

【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29年2月20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 赤林 富二
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【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29年2月21日（火）～平成30年2月20日（火）

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

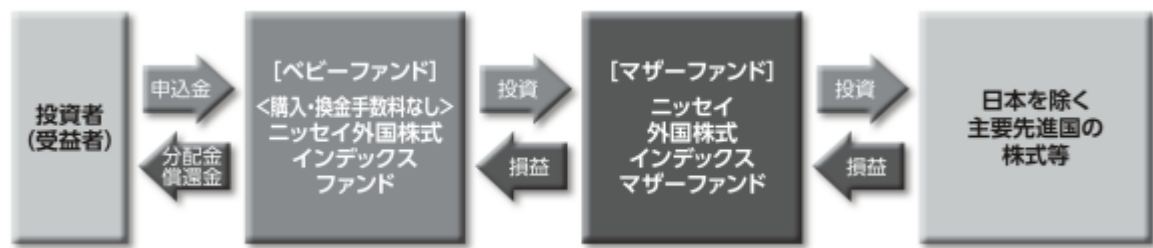
ファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

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独創性、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 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

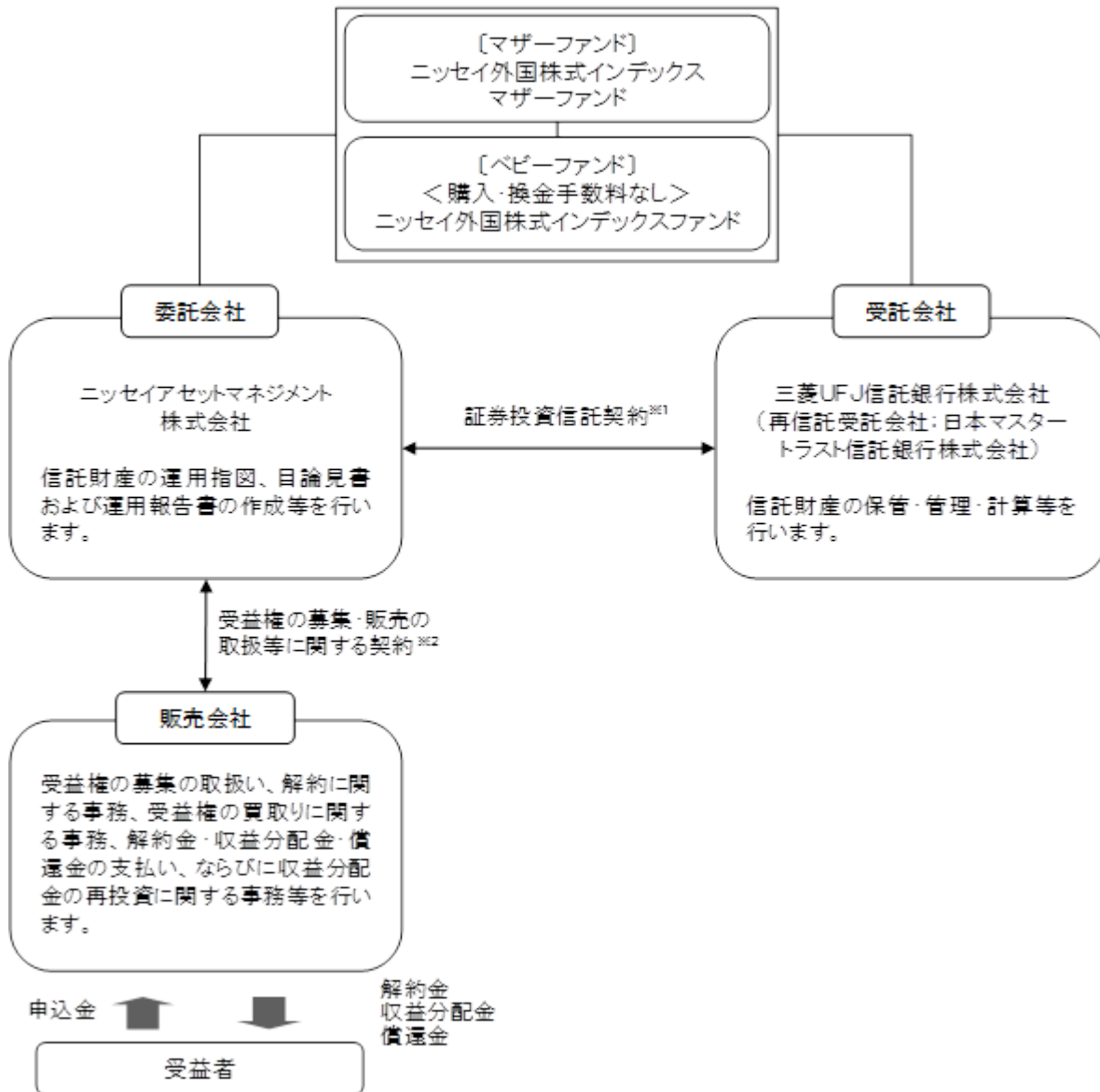
その他資産 (投資信託証券 (株式(一般)))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本除く)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)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28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 赤林 富二
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 平成7年4月4日
7. 沿革

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

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

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

8. 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます）の新株引受権証券を除きます）
- 6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます）
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます）
- 9．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券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．預託証券（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券
- 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。

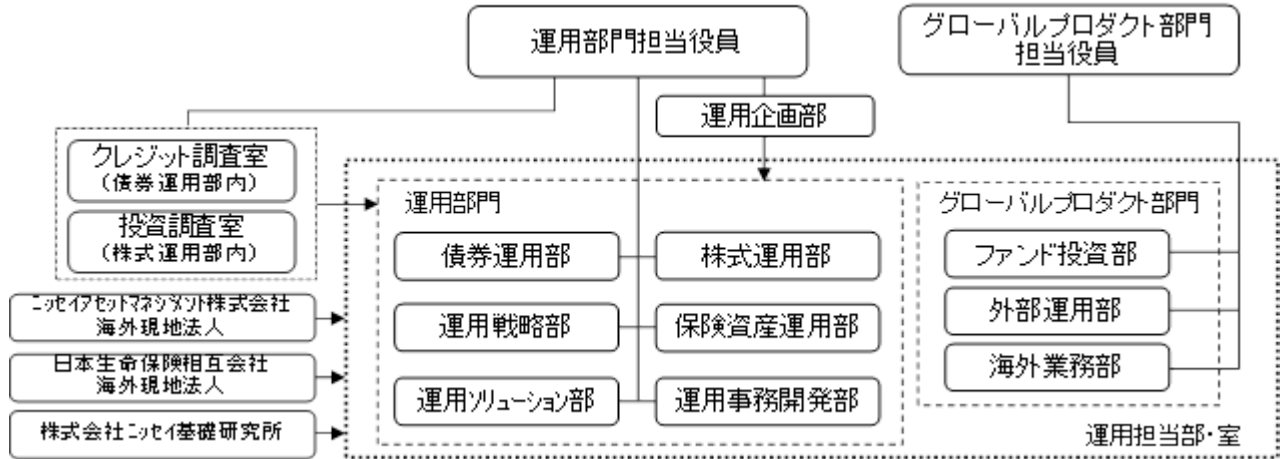
- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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。

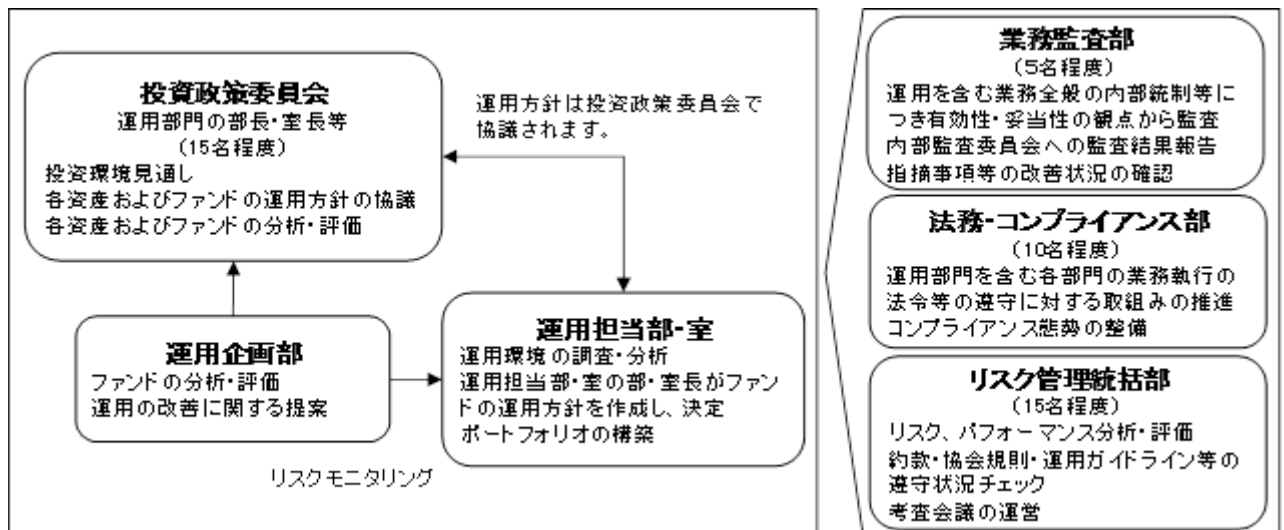
(3) 【運用体制】

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

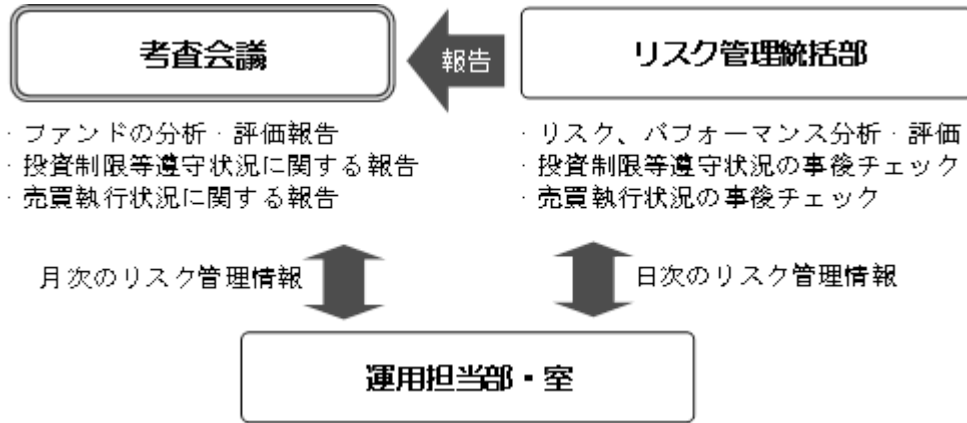
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・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28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20.0%保有しています。

当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

(2) 投資リスク管理体制

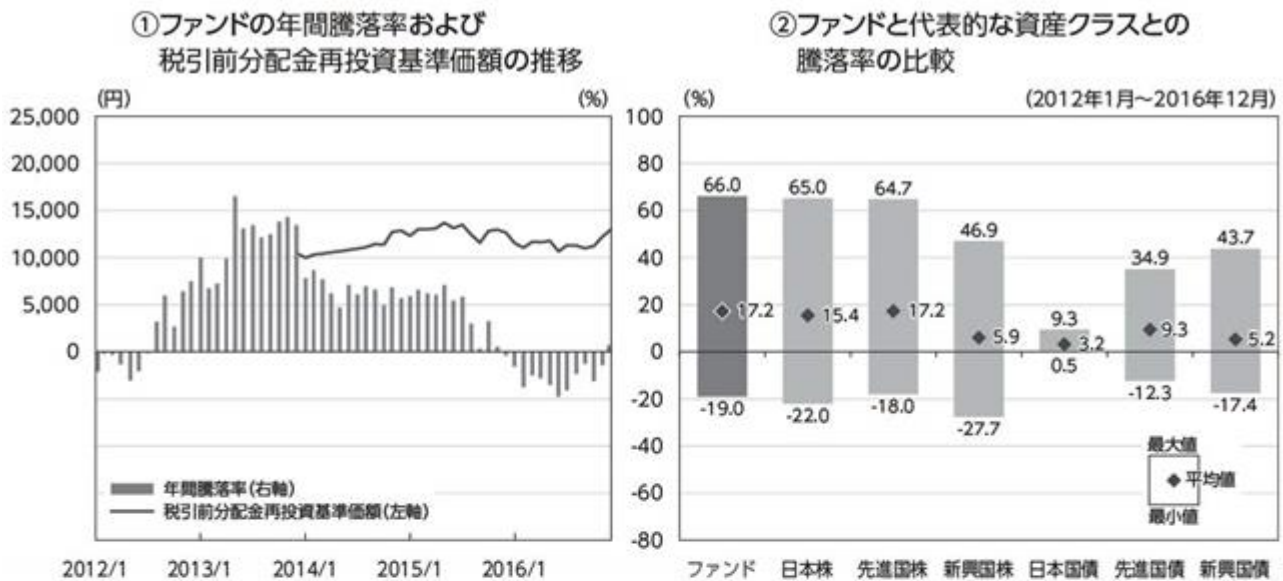


1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。
 - ・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
 - ・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

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

（参考情報）

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



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、不足する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0.216%（税抜0.2%）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29年2月20日現在の信託報酬率は年0.216%（税抜0.2%）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
0.10%	0.08%	0.02%

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

組入る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）」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。

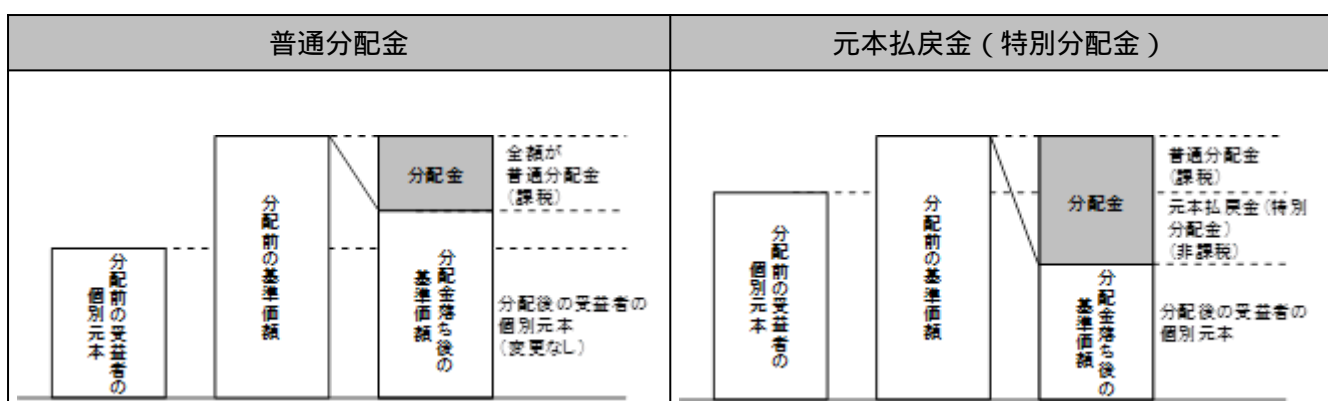
個別元本

- 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。



収益分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本と同額以上の場合、収益分配金の全額が普通分配金となります。

収益分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本を下回っている場合、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、収益分配金から元本払戻金（特別分配金）を差引いた額が普通分配金となります。

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28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	38,974,673,539	100.00
内 日本	38,974,673,539	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	229,655	0.00
純資産総額	38,974,443,884	100.00

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

(参考情報)

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」

(平成28年12月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	64,048,104,405	94.19
内 アメリカ	40,058,124,780	58.91
内 イギリス	4,371,187,733	6.43
内 カナダ	2,640,700,805	3.88
内 スイス	2,487,402,459	3.66
内 フランス	2,416,618,020	3.55
内 ドイツ	2,353,445,936	3.46
内 オーストラリア	1,730,372,287	2.54
内 オランダ	1,428,324,982	2.10
内 アイルランド	1,047,802,829	1.54
内 スペイン	814,018,672	1.20
内 スウェーデン	760,830,423	1.12
内 香港	684,896,746	1.01
内 イタリア	460,478,195	0.68
内 シンガポール	454,769,544	0.67
内 デンマーク	431,071,307	0.63
内 ベルギー	306,680,781	0.45
内 フィンランド	250,619,733	0.37
内 オランダ領キュラソー	249,742,957	0.37
内 ジャージー	242,897,792	0.36
内 バミューダ	214,932,580	0.32
内 ノルウェー	174,574,242	0.26
内 イスラエル	138,548,193	0.20
内 ケイマン諸島	92,039,230	0.14

内	ルクセンブルグ	53,431,069	0.08
内	オーストリア	52,714,074	0.08
内	ニュージーランド	48,504,886	0.07
内	ポルトガル	39,559,673	0.06
内	パプアニューギニア	15,724,576	0.02
内	イギリス領バージン諸島	15,445,385	0.02
内	マン島	8,196,563	0.01
内	モーリシャス	4,447,953	0.01
投資証券		1,644,329,351	2.42
内	アメリカ	1,240,042,215	1.82
内	オーストラリア	172,532,821	0.25
内	フランス	93,384,927	0.14
内	イギリス	66,495,885	0.10
内	香港	30,945,342	0.05
内	シンガポール	25,476,256	0.04
内	カナダ	15,451,905	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,304,547,609	3.39
純資産総額		67,996,981,365	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）	2,090,275,737	3.07
内 アメリカ	1,386,056,265	2.04
内 ドイツ	704,219,472	1.04

（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28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	26,693,153,578	1.3502 36,041,795,260	1.4601 38,974,673,539	- -	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28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	98,727	12,820.88 1,265,767,947	13,597.87 1,342,477,671	- -	1.97%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	135,611	7,030.17 953,368,587	7,327.22 993,651,767	- -	1.46%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	75,968	9,934.26 754,686,410	10,524.87 799,553,438	- -	1.18%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	50,119	13,438.28 673,513,476	13,453.43 674,272,463	- -	0.99%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	66,143	9,052.43 598,755,400	10,005.32 661,782,284	- -	0.97%
6	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	7,383	88,552.91 653,786,159	89,132.32 658,063,944	- -	0.97%
7	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 資本財	164,218	3,572.74 586,709,580	3,693.89 606,604,525	- -	0.89%
8	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	42,577	13,632.95 580,450,279	13,553.61 577,072,116	- -	0.85%
9	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	87,797	6,153.00 540,215,099	6,388.31 560,874,593	- -	0.82%
10	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	112,858	4,375.36 493,794,875	4,969.46 560,843,700	- -	0.82%

11	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	5,665	88,595.30 501,892,400	91,187.20 516,575,528	- -	0.76%
12	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	5,404	90,395.32 488,496,344	93,527.49 505,422,562	- -	0.74%
13	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	186,876	2,329.79 435,383,704	2,562.77 478,922,075	- -	0.70%
14	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	57,007	7,817.67 445,662,170	8,365.88 476,913,863	- -	0.70%
15	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	34,558	12,720.70 439,602,227	13,724.85 474,303,428	- -	0.70%
16	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	74,851	5,599.67 419,141,221	6,260.17 468,580,179	- -	0.69%
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	46,819	9,552.17 447,223,515	9,825.93 460,040,286	- -	0.68%
18	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	22,312	18,376.17 410,009,219	18,993.69 423,787,311	- -	0.62%
19	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	111,100	3,667.10 407,415,387	3,784.76 420,486,847	- -	0.62%
20	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	86,478	4,071.32 352,080,086	4,270.52 369,306,322	- -	0.54%
21	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	53,176	6,460.53 343,545,430	6,917.17 367,827,761	- -	0.54%
22	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	75,107	4,765.60 357,930,362	4,845.98 363,967,320	- -	0.54%
23	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア	44,092	7,960.92 351,013,175	8,164.78 360,001,660	- -	0.53%
24	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	22,646	14,949.16 338,538,715	15,737.79 356,398,196	- -	0.52%
25	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	50,640	7,207.23 364,974,446	6,877.56 348,280,124	- -	0.51%
26	NOVARTIS AG スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	40,912	8,177.43 334,555,261	8,502.93 347,872,056	- -	0.51%

27	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	12,881	26,496.71 341,304,250	26,725.13 344,246,528	- -	0.51%
28	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	28,014	11,443.97 320,591,588	12,180.19 341,215,965	- -	0.50%
29	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	363,987	906.33 329,894,233	929.78 338,430,016	- -	0.50%
30	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	17,441	17,409.43 303,637,877	18,759.54 327,185,304	- -	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	銀行	9.33
		ソフトウェア・サービス	8.67
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.35
		エネルギー	7.63
		資本財	7.16
		食品・飲料・タバコ	5.66
		素材	4.77
		各種金融	4.22
		保険	4.09
		小売	3.77
		ヘルスケア機器・サービス	3.71
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.51
		公益事業	3.19
		電気通信サービス	3.01
		メディア	2.58
		半導体・半導体製造装置	2.41
		家庭用品・パーソナル用品	2.04
		食品・生活必需品小売り	1.93
		運輸	1.87
		消費者サービス	1.73
耐久消費財・アパレル	1.62		
自動車・自動車部品	1.44		
商業・専門サービス	0.95		
不動産	0.56		
	小計		94.19
投資証券	外国	投資証券	2.42

	小計		2.42
合計(対純資産総額比)			96.61

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先 物取引	シカゴ商品取 引所	S & P 500 EMIN I FUTURE 2017 03	買建	106	1,385,452,264	1,386,056,265	2.04%
	EUREX取 引所	DJ EURO STOXX 50 201703	買建	176	686,591,408	704,219,472	1.04%

(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28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
第3計算期間末 (平成28年11月21日)	35,666,779,975	35,666,779,975	1.1931	1.1931
平成27年12月末日	20,829,391,490	-	1.2648	-
平成28年1月末日	21,109,631,083	-	1.1530	-
2月末日	22,040,845,910	-	1.1046	-
3月末日	24,722,358,960	-	1.1682	-
4月末日	25,634,389,994	-	1.1630	-
5月末日	27,104,551,013	-	1.1756	-
6月末日	25,829,539,257	-	1.0632	-
7月末日	28,739,093,161	-	1.1301	-
8月末日	29,961,257,251	-	1.1263	-
9月末日	30,632,271,746	-	1.0989	-

10月末日	32,611,404,670	-	1.1218	-
11月末日	36,553,215,222	-	1.2219	-
12月末日	38,974,443,884	-	1.2987	-

【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
第3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
第3計算期間	8.0

(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
第3計算期間	20,482,172,909	5,266,671,510	29,894,160,896

(注)本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2016年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。

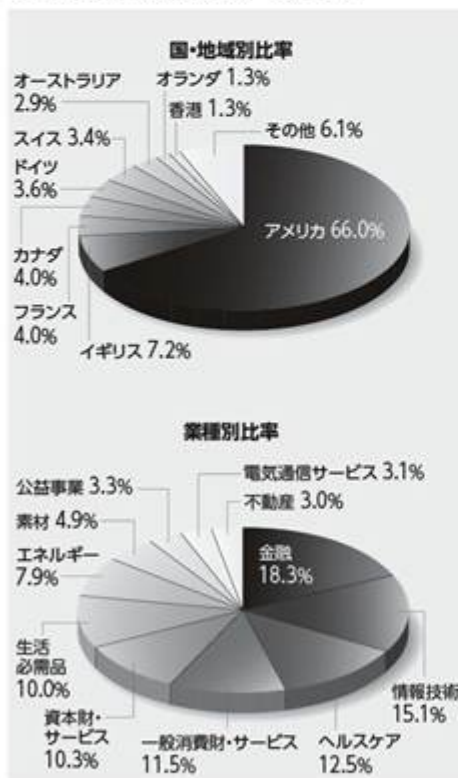
● 基準価額および純資産総額

基準価額	12,967円
純資産総額	389億円

● 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
第3期	2016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)



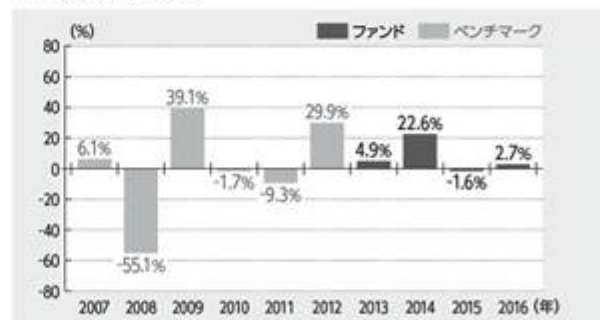
- ・上記グラフはすべて対組入株式等評価額比です。
- ・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
- ・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。

● 組入上位銘柄(マザーファンド)

順位	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	2.0%
2	マイクロソフト	情報技術	1.5%
3	エクソンモービル	エネルギー	1.2%
4	ジョンソン・エンド・ジョンソン	ヘルスケア	1.0%
5	JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	金融	1.0%
6	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	1.0%
7	GE(ゼネラル・エレクトリック)	資本財・サービス	0.9%
8	フェイスブック	情報技術	0.9%
9	ウェルズ・ファーゴ・アンド・カンパニー	金融	0.9%
10	AT&T	電気通信サービス	0.9%

- ・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、2016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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。
2. 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
2. 換金請求の受付が中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記の規定に準じて算出した価額とします。
3. 詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

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、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、
2. 委託会社は、前記1.の事項(前記1.の変更事項にあつ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、併合の事項にあつ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つても、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カ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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成27年11月21日から平成28年11月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【＜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2期 (平成27年11月20日現在)	第3期 (平成28年11月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,172,583
コール・ローン	30,483,366	36,426,846
親投資信託受益証券	19,030,162,875	35,667,542,867
未収入金	61,001,371	288,431,403
流動資産合計	19,121,647,612	35,993,573,699
資産合計	19,121,647,612	35,993,573,699
負債の部		
流動負債		
未払解約金	60,351,008	287,675,552
未払受託者報酬	3,941,923	4,794,145
未払委託者報酬	26,805,341	33,559,271
その他未払費用	603,814	764,756
流動負債合計	91,702,086	326,793,724
負債合計	91,702,086	326,793,724
純資産の部		
元本等		
元本	14,678,659,497	29,894,160,896
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,351,286,029	5,772,619,079
純資産合計	19,029,945,526	35,666,779,975
負債純資産合計	19,121,647,612	35,993,573,699

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（単位：円）

	第2期 （自平成26年11月21日 至平成27年11月20日）	第3期 （自平成27年11月21日 至平成28年11月21日）
営業収益		
受取利息	5,625	1,038
有価証券売買等損益	421,115,798	562,904,978
営業収益合計	421,121,423	562,903,940
営業費用		
支払利息	-	7,620
受託者報酬	6,090,123	8,341,165
委託者報酬	41,413,349	58,388,633
その他費用	1,048,702	1,361,625
営業費用合計	48,552,174	68,099,043
営業利益又は営業損失（ ）	372,569,249	631,002,983
経常利益又は経常損失（ ）	372,569,249	631,002,983
当期純利益又は当期純損失（ ）	372,569,249	631,002,983
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	19,434,362	506,620,736
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,160,598,122	4,351,286,029
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,978,877,477	2,824,659,226
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	3,978,877,477	2,824,659,226
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,141,324,457	1,278,943,929
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,141,324,457	1,278,943,929
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,351,286,029	5,772,619,079

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年11月20日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、平成27年11月21日から平成28年11月21日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第2期 (平成27年11月20日現在)	第3期 (平成28年11月21日現在)
1. 受益権総口数	14,678,659,497口	29,894,160,896口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2964円 (12,964円)	1.1931円 (11,931円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期 (自平成26年11月21日 至平成27年11月20日)	第3期 (自平成27年11月21日 至平成28年11月21日)
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(540,694,373円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(5,435,451,458円)及び分配準備積立金(654,762,874円)より分配対象収益は6,630,908,705円(1口当たり0.221813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2期 (自平成26年11月21日 至平成27年11月20日)	第3期 (自平成27年11月21日 至平成28年11月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (平成27年11月20日現在)	第3期 (平成28年11月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期 (平成27年11月20日現在)	第3期 (平成28年11月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	393,322,138	59,169,562

合計	393,322,138	59,169,562
----	-------------	------------

（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2期 （平成27年11月20日現在）	第3期 （平成28年11月21日現在）
期首元本額	4,595,224,980円	14,678,659,497円
期中追加設定元本額	14,317,781,361円	20,482,172,909円
期中一部解約元本額	4,234,346,844円	5,266,671,510円

（４）【附属明細表】（平成28年11月21日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	26,595,736,983	35,667,542,867	
親投資信託受益証券	合計	26,595,736,983	35,667,542,867	
合計		26,595,736,983	35,667,542,867	

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27年11月20日現在）	（平成28年11月21日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	571,026,544	853,567,774
金銭信託	-	26,910,558
コール・ローン	517,375,725	835,988,994
株式	47,696,457,467	58,708,562,978
投資証券	1,205,171,823	1,474,902,228
派生商品評価勘定	42,032,891	29,044,433
未収入金	1,242,993	7,356
未収配当金	89,473,109	105,372,858
差入委託証拠金	1,011,545,971	876,971,482
流動資産合計	51,134,326,523	62,911,328,661
資産合計	51,134,326,523	62,911,328,661
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,180,811	7,898,350
未払解約金	251,957,534	488,374,428
その他未払費用	-	2,376
流動負債合計	254,138,345	496,275,154
負債合計	254,138,345	496,275,154
純資産の部		
元本等		
元本	35,008,790,381	46,538,854,861
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,871,397,797	15,876,198,646
純資産合計	50,880,188,178	62,415,053,507

負債純資産合計	51,134,326,523	62,911,328,661
---------	----------------	----------------

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成27年11月20日現在）	（平成28年11月21日現在）
1. 受益権総口数	35,008,790,381口	46,538,854,861口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4534円 (14,534円)	1.3411円 (13,411円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成26年11月21日 至 平成27年11月20日）	（自 平成27年11月21日 至 平成28年11月21日）

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成27年11月20日現在)	(平成28年11月21日現在)
----	-----------------	-----------------

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	（平成27年11月20日現在）	（平成28年11月21日現在）
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	1,865,846,743	2,924,910,929
投資証券	5,258,479	98,393,580
合計	1,871,105,222	2,826,517,349

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成27年11月20日 現在）				（平成28年11月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1 年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1 年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	1,242,151	-	1,236,509	5,642	-	-	-	-
アメリカ・ドル	1,242,151	-	1,236,509	5,642	-	-	-	-
合計	1,242,151	-	1,236,509	5,642	-	-	-	-

（注） 1．時価の算定方法

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

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

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

2．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	（平成27年11月20日 現在）				（平成28年11月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1 年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1 年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	1,779,316,317	-	1,819,162,755	39,846,438	2,172,900,935	-	2,194,047,017	21,146,082
合計	1,779,316,317	-	1,819,162,755	39,846,438	2,172,900,935	-	2,194,047,017	21,146,082

（注） 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

4．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成27年11月20日現在）	（平成28年11月21日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	31,417,345,029円	35,008,790,381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	18,394,745,440円	28,592,294,715円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	14,803,300,088円	17,062,230,235円
元本の内訳		
ファンド名		
D Cニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	278,615,081円	316,268,146円
D Cニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	1,896,276,758円	2,098,426,713円

D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,651,202,428円	1,780,160,998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)	11,034,706,520円	12,274,209,247円
ニッセイ厚生年金型バランス運用D B(適格機関投資家限定)	6,967,231,514円	1,891,324,584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	13,093,548,146円	26,595,736,983円
D Cニッセイ外国株式インデックス	2,911,000円	1,336,069,884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)	239,362円	- 円
ニッセイターゲットデートファンド(適格機関投資家限定)	196,060円	- 円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	83,863,512円	246,387,525円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	- 円	270,781円
計	35,008,790,381円	46,538,854,861円

附属明細表(平成28年11月21日現在)

第1 有価証券明細表
株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	11,141	172.96	1,926,947.36	
	ABBOTT LABORATORIES	26,962	39.84	1,074,166.08	
	ABBVIE INC	29,718	60.52	1,798,533.36	
	ACCENTURE PLC	11,516	118.43	1,363,839.88	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	10,833	38.39	415,878.87	
	ACUITY BRANDS INC	779	248.96	193,939.84	
	ADOBE SYSTEMS INC	9,190	105.02	965,133.80	
	ADVANCE AUTO PARTS	1,310	162.57	212,966.70	
	AERCAP HOLDINGS NV	2,959	44.34	131,202.06	
	AES CORP	11,969	11.40	136,446.60	
	AETNA INC	6,431	124.88	803,103.28	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	948	140.63	133,317.24	
	AFLAC INC	7,569	72.50	548,752.50	
	AGCO CORP	1,171	52.71	61,723.41	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,035	45.04	271,816.40	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,770	137.96	520,109.20	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,130	66.44	207,957.20	
	ALBEMARLE CORP	1,992	82.46	164,260.32	

ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,115	119.85	493,182.75	
ALKERMES PLC	2,697	58.44	157,612.68	
ALLEGHANY CORP	271	566.39	153,491.69	
ALLERGAN PLC	7,268	191.78	1,393,857.04	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,057	217.60	230,003.20	
ALLIANT ENERGY CORP	4,131	35.64	147,228.84	
ALLSTATE CORP	6,874	72.02	495,065.48	
ALLY FINANCIAL INC	7,754	19.41	150,505.14	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,376	45.97	63,261.60	
ALPHABET INC-CL A	5,396	775.97	4,187,134.12	
ALPHABET INC-CL C	5,677	760.54	4,317,585.58	
ALTRIA GROUP INC	35,955	62.77	2,256,895.35	
AMAZON.COM INC	7,366	760.16	5,599,338.56	
AMERCO	148	343.73	50,872.04	
AMEREN CORPORATION	4,391	48.48	212,875.68	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,619	46.26	121,154.94	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	9,103	58.44	531,979.32	
AMERICAN EXPRESS CO	14,852	71.00	1,054,492.00	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	20,511	63.91	1,310,858.01	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,214	71.83	230,861.62	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,037	113.14	343,606.18	
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,387	79.21	268,284.27	
AMERITRADE HOLDING CORP	4,653	39.61	184,305.33	
AMETEK INC	4,161	47.65	198,271.65	
AMGEN INC	13,793	145.23	2,003,157.39	
AMPHENOL CORP-CL A	5,693	68.04	387,351.72	
ANADARKO PETROLEUM CORP	9,380	61.51	576,963.80	
ANALOG DEVICES INC	5,647	68.47	386,650.09	
ANSYS INC	1,563	93.36	145,921.68	
ANTERO RESOURCES CORP	2,709	24.95	67,589.55	
ANTHEM INC	4,827	135.35	653,334.45	
AON PLC	4,877	111.96	546,028.92	
APACHE CORP	6,952	62.08	431,580.16	
APPLE INC	100,615	110.06	11,073,686.90	
APPLIED MATERIALS INC	19,978	30.74	614,123.72	

ARAMARK	4,110	34.08	140,068.80	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,171	80.85	175,525.35	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	10,763	43.49	468,082.87	
ARCONIC INC	7,800	19.91	155,298.00	
ARROW ELECTRONICS INC	1,621	65.90	106,823.90	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,133	51.52	161,412.16	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	1,109	111.12	123,232.08	
ASSURANT INC	1,087	85.79	93,253.73	
AT&T INC	113,246	37.56	4,253,519.76	
ATMOS ENERGY CORP	1,861	71.63	133,303.43	
AUTODESK INC	3,610	76.90	277,609.00	
AUTOLIV INC	1,573	97.77	153,792.21	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	8,361	94.39	789,194.79	
AUTONATION INC	1,282	43.96	56,356.72	
AUTOZONE INC	547	755.24	413,116.28	
AVERY DENNISON CORP	1,580	70.58	111,516.40	
AVNET INC	2,267	45.14	102,332.38	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	3,884	26.14	101,527.76	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,619	61.20	99,082.80	
BAKER HUGHES INC	7,641	60.86	465,031.26	
BALL CORP	2,972	76.39	227,031.08	
BANK OF AMERICA CORP	188,595	20.00	3,771,900.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	19,728	47.44	935,896.32	
BARD (C.R.) INC	1,353	215.73	291,882.69	
BAXTER INTERNATIONAL INC	9,035	46.98	424,464.30	
BB&T CORPORATION	15,072	44.49	670,553.28	
BE AEROSPACE INC	1,850	59.13	109,390.50	
BECTON DICKINSON & CO	3,903	171.86	670,769.58	
BED BATH & BEYOND INC	2,762	44.42	122,688.04	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	21,892	157.75	3,453,463.00	
BEST BUY CO INC	5,177	44.79	231,877.83	
BIOGEN INC	4,023	317.00	1,275,291.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,981	89.00	265,309.00	
BLACKROCK INC	2,239	372.78	834,654.42	

BOEING CO	11,114	146.35	1,626,533.90	
BORGWARNER INC	3,875	35.68	138,260.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	24,910	21.34	531,579.40	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	30,666	56.76	1,740,602.16	
BROADCOM LTD	7,167	168.16	1,205,202.72	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,098	65.16	136,705.68	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	3,894	45.83	178,462.02	
BUNGE LIMITED	2,485	67.35	167,364.75	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,698	74.40	200,731.20	
CA Inc	5,501	31.01	170,586.01	
CABOT OIL & GAS CORP	8,299	21.95	182,163.05	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	5,335	26.40	140,844.00	
CALPINE CORP	6,211	11.63	72,233.93	
CAMPBELL SOUP CO	3,568	54.23	193,492.64	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9,389	82.01	769,991.89	
CARDINAL HEALTH INC	5,980	70.77	423,204.60	
CARMAX INC	3,474	55.23	191,869.02	
CARNIVAL CORP	6,664	51.50	343,196.00	
CATERPILLAR INC	10,734	92.34	991,177.56	
CBRE GROUP INC	5,349	28.69	153,462.81	
CBS CORP-CL B	7,680	60.00	460,800.00	
CDK GLOBAL INC	2,348	57.80	135,714.40	
CDW CORP/DE	2,679	51.43	137,780.97	
CELANESE CORP-SERIES A	2,615	78.11	204,257.65	
CELGENE CORP	14,232	121.97	1,735,877.04	
CENTENE CORP	3,023	56.90	172,008.70	
CENTERPOINT ENERGY INC	7,494	23.34	174,909.96	
CENTURYLINK INC	10,144	24.79	251,469.76	
CERNER CORP	5,588	49.53	276,773.64	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,157	28.96	120,386.72	
CHARLES SCHWAB CORP	21,808	37.48	817,363.84	
CHARTER COMMUNICATIONS- CL A	3,942	262.70	1,035,563.40	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	2,291	83.41	191,092.31	
CHENIERE ENERGY INC	3,594	38.45	138,189.30	
CHEVRON CORP	34,596	109.20	3,777,883.20	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	520	411.80	214,136.00	
CHUBB LTD	8,513	126.30	1,075,191.90	
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,571	44.79	204,735.09	
CIGNA CORP	4,709	138.70	653,138.30	
CIMAREX ENERGY CO	1,687	125.66	211,988.42	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,748	74.47	204,643.56	
CINTAS CORP	1,519	111.71	169,687.49	
CISCO SYSTEMS INC	92,435	30.18	2,789,688.30	
CIT GROUP INC	3,577	40.93	146,406.61	
CITIGROUP INC	53,860	55.46	2,987,075.60	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	9,370	31.97	299,558.90	
CITRIX SYSTEMS INC	2,756	86.82	239,275.92	
CLOROX CO	2,411	114.80	276,782.80	
CME GROUP INC	6,202	113.93	706,593.86	
CMS ENERGY CORP	5,116	39.72	203,207.52	
COACH INC	4,949	38.00	188,062.00	
COCA-COLA CO	75,483	40.91	3,088,009.53	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	11,121	55.57	617,993.97	
COLGATE-PALMOLIVE CO	15,616	65.86	1,028,469.76	
COMCAST CORP	44,483	68.34	3,039,968.22	
COMERICA INC	3,085	61.04	188,308.40	
CONAGRA BRANDS INC	7,660	36.80	281,888.00	
CONCHO RESOURCES INC	2,577	130.05	335,138.85	
CONOCOPHILLIPS	22,741	44.76	1,017,887.16	
CONSOLIDATED EDISON INC	5,594	69.53	388,950.82	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,242	155.16	503,028.72	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,660	51.07	84,776.20	
COOPER COS INC/THE	859	172.00	147,748.00	
CORE LABORATORIES N.V.	792	106.05	83,991.60	
CORNING INC	19,756	23.83	470,785.48	
COSTCO WHOLESALE CORP	8,047	150.36	1,209,946.92	
CROWN HOLDINGS INC	2,526	53.29	134,610.54	
CSX CORP	17,821	34.00	605,914.00	
CUMMINS INC	2,967	135.03	400,634.01	
CVS HEALTH CORP	19,717	74.04	1,459,846.68	
D&B CORP	657	121.87	80,068.59	

DANAHER CORP	11,374	78.99	898,432.26	
DARDEN RESTAURANTS INC	2,115	72.84	154,056.60	
DAVITA INC	2,981	61.52	183,391.12	
DEERE & CO	4,943	91.96	454,558.28	
DELL TECHNOLOGIES INC- CL V	3,891	51.99	202,293.09	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	5,020	68.19	342,313.80	
DELTA AIR LINES INC	3,485	48.90	170,416.50	
DENTSPLY SIRONA INC	4,295	60.16	258,387.20	
DEVON ENERGY CORPORATION	8,649	43.82	378,999.18	
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,574	58.02	91,323.48	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7,589	66.24	502,695.36	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	2,682	27.50	73,755.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,293	26.75	114,837.75	
DISH NETWORK CORP	4,085	55.85	228,147.25	
DOLLAR GENERAL CORP	5,215	76.87	400,877.05	
DOLLAR TREE INC	4,334	81.91	354,997.94	
DOMINION RESOURCES INC/VA	11,363	71.15	808,477.45	
DOMINO'S PIZZA INC	897	164.31	147,386.07	
DOVER CORP	2,760	70.16	193,641.60	
DOW CHEMICAL CO	20,616	53.23	1,097,389.68	
DR HORTON INC	6,278	28.54	179,174.12	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	3,431	83.48	286,419.88	
DTE ENERGY COMPANY	3,361	91.22	306,590.42	
DUKE ENERGY CORP	12,717	73.60	935,971.20	
E*TRADE FINANCIAL	4,905	34.06	167,064.30	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,642	74.18	195,983.56	
EATON CORP PLC	8,401	64.15	538,924.15	
EATON VANCE CORP	2,002	40.14	80,360.28	
EBAY INC	20,075	28.69	575,951.75	
ECOLAB INC	4,862	114.28	555,629.36	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,055	80.81	85,254.55	
EDISON INTERNATIONAL	6,062	68.45	414,943.90	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,887	89.03	346,059.61	

EI DU PONT DE NEMOURS & CO	16,044	68.84	1,104,468.96	
ELECTRONIC ARTS INC	5,536	78.99	437,288.64	
ELI LILLY & CO	18,258	76.67	1,399,840.86	
EMERSON ELECTRIC CO	11,812	54.20	640,210.40	
ENDO INTERNATIONAL PLC	3,773	17.14	64,669.22	
ENTERGY CORP	3,324	67.83	225,466.92	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	3,339	22.46	74,993.94	
EOG RESOURCES INC	10,106	93.15	941,373.90	
EQT CORP	3,079	67.14	206,724.06	
EQUIFAX INC	2,191	121.56	266,337.96	
ESTEE LAUDER COS INC	4,081	77.41	315,910.21	
EVEREST RE GROUP LTD	736	211.48	155,649.28	
EVERSOURCE ENERGY	5,933	51.82	307,448.06	
EXELON CORP	17,013	31.73	539,822.49	
EXPEDIA INC	2,246	125.67	282,254.82	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	3,483	51.50	179,374.50	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	11,613	75.77	879,917.01	
EXXON MOBIL CORP	76,146	85.28	6,493,730.88	
F5 NETWORKS INC	1,205	142.01	171,122.05	
FACEBOOK INC-A	42,467	117.02	4,969,488.34	
FASTENAL CO	5,141	44.80	230,316.80	
FEDEX CORP	4,739	187.29	887,567.31	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	5,714	77.12	440,663.68	
FIFTH THIRD BANCORP	14,070	25.68	361,317.60	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,600	82.89	215,514.00	
FIRSTENERGY CORP	7,890	31.40	247,746.00	
FISERV INC	4,108	104.29	428,423.32	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,702	150.20	255,640.40	
FLEX LTD	9,661	14.03	135,543.83	
FLIR SYSTEMS INC	2,460	35.08	86,296.80	
FLOWSERVE CORP	2,322	45.98	106,765.56	
FLUOR CORP	2,463	51.34	126,450.42	
FMC CORP	2,382	54.02	128,675.64	
FMC TECHNOLOGIES INC	4,023	34.26	137,827.98	
FNF GROUP	4,379	33.25	145,601.75	

FOOT LOCKER INC	2,417	71.78	173,492.26	
FORD MOTOR CO	68,139	11.76	801,314.64	
FORTINET INC	2,596	30.96	80,372.16	
FORTIVE CORP	5,685	54.63	310,571.55	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	2,731	57.59	157,278.29	
FRANKLIN RESOURCES INC	6,691	38.89	260,212.99	
FREEMPORT-MCMORAN INC	21,234	13.73	291,542.82	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	21,425	3.42	73,273.50	
GAP INC	4,235	25.61	108,458.35	
GARMIN LTD	2,011	51.71	103,988.81	
GARTNER INC	1,496	103.26	154,476.96	
GENERAL DYNAMICS CORP	4,771	166.62	794,944.02	
GENERAL ELECTRIC CO	168,934	30.67	5,181,205.78	
GENERAL MILLS INC	10,927	61.26	669,388.02	
GENERAL MOTORS CO	25,409	33.00	838,497.00	
GENUINE PARTS CO	2,747	94.55	259,728.85	
GILEAD SCIENCES INC	24,449	74.62	1,824,384.38	
GLOBAL PAYMENTS INC	2,746	70.71	194,169.66	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	6,866	210.35	1,444,263.10	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	4,734	30.14	142,682.76	
H&R BLOCK INC	4,001	23.15	92,623.15	
HALLIBURTON CO	15,784	49.31	778,309.04	
HANESBRANDS INC	6,762	24.61	166,412.82	
HARLEY-DAVIDSON INC	3,237	58.14	188,199.18	
HARMAN INTERNATIONAL	1,256	109.35	137,343.60	
HARRIS CORP	2,252	103.57	233,239.64	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	7,182	47.25	339,349.50	
HASBRO INC	2,006	84.28	169,065.68	
HCA HOLDINGS INC	5,781	72.39	418,486.59	
HELMERICH & PAYNE	1,907	68.25	130,152.75	
HENRY SCHEIN INC	1,449	156.96	227,435.04	
HERSHEY CO/THE	2,667	98.56	262,859.52	
HESS CORP	5,237	50.97	266,929.89	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	31,594	23.31	736,456.14	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	9,650	24.42	235,653.00	
HOLLYFRONTIER CORP	2,962	27.35	81,010.70	

HOLOGIC INC	4,481	38.37	171,935.97	
HOME DEPOT INC	22,860	128.33	2,933,623.80	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	13,288	112.09	1,489,451.92	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	21,200	6.25	132,500.00	
HORMEL FOODS CORP	5,153	35.58	183,343.74	
HP INC	31,877	15.87	505,887.99	
HUMANA INC	2,736	200.16	547,637.76	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	19,271	12.50	240,887.50	
IDEXX LABORATORIES INC	1,605	116.13	186,388.65	
IHS MARKIT LTD	6,358	34.94	222,148.52	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	5,949	123.96	737,438.04	
ILLUMINA INC	2,708	131.87	357,103.96	
INCYTE CORP	3,103	103.63	321,563.89	
INGERSOLL-RAND PLC	4,737	74.46	352,717.02	
INGREDION INC	1,271	120.88	153,638.48	
INTEL CORP	86,692	34.95	3,029,885.40	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	10,916	54.82	598,415.12	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	16,748	160.39	2,686,211.72	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	1,420	119.78	170,087.60	
INTERNATIONAL PAPER CO	7,186	48.45	348,161.70	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	7,265	23.61	171,526.65	
INTUIT INC	4,466	115.98	517,966.68	
INTUITIVE SURGICAL INC	696	654.89	455,803.44	
INVESCO LTD	7,389	31.52	232,901.28	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,150	58.15	125,022.50	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,600	56.97	262,062.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,077	109.25	117,662.25	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	1,740	91.47	159,157.80	
JM SMUCKER CO	2,199	124.85	274,545.15	
JOHNSON & JOHNSON	50,520	115.36	5,827,987.20	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	17,405	44.71	778,177.55	
JONES LANG LASALLE INC	795	100.00	79,500.00	

JPMORGAN CHASE & CO	67,136	77.71	5,217,138.56	
JUNIPER NETWORKS INC	6,198	26.35	163,317.30	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,983	87.57	173,651.31	
KELLOGG CO	4,847	73.07	354,170.29	
KEYCORP	19,221	17.01	326,949.21	
KIMBERLY-CLARK CORP	6,634	113.11	750,371.74	
KINDER MORGAN INC	34,845	21.67	755,091.15	
KLA-TENCOR CORP	2,798	80.04	223,951.92	
KOHL'S CORP	3,293	54.57	179,699.01	
KRAFT HEINZ CO/THE	11,160	82.53	921,034.80	
KROGER CO	16,650	33.45	556,942.50	
L BRANDS INC	4,498	70.17	315,624.66	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,369	152.20	208,361.80	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	1,873	126.00	235,998.00	
LAM RESEARCH CORP	2,912	104.71	304,915.52	
LAMB WESTON HOLDING INC	2,553	32.68	83,432.04	
LAS VEGAS SANDS CORP	8,005	60.59	485,022.95	
LEAR CORP	1,308	126.87	165,945.96	
LEGGETT & PLATT INC	2,406	48.86	117,557.16	
LENNAR CORP-CL A	3,281	43.47	142,625.07	
LEUCADIA NATIONAL CORP	5,795	20.99	121,637.05	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	5,666	55.71	315,652.86	
LIBERTY BROADBAND-C	1,951	68.72	134,072.72	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,979	32.77	163,161.83	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11,642	31.76	369,749.92	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP A	7,661	21.07	161,417.27	
LIBERTY LILAC GROUP-C	1,993	20.47	40,796.71	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	1,683	36.43	61,311.69	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	3,621	36.02	130,428.42	
LINCOLN NATIONAL CORP	4,210	62.24	262,030.40	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	4,372	61.00	266,692.00	
LINKEDIN CORP - A	2,166	193.64	419,424.24	
LKQ CORP	5,453	32.25	175,859.25	
LOCKHEED MARTIN CORP	4,867	263.09	1,280,459.03	
LOEWS CORP	5,108	43.86	224,036.88	

LOWE'S COS INC	16,280	69.31	1,128,366.80	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,960	54.61	107,035.60	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,650	83.12	552,748.00	
M&T BANK CORP	2,624	141.26	370,666.24	
MACY'S INC	5,499	43.03	236,621.97	
MALLINCKRODT PLC	1,951	54.59	106,505.09	
MANPOWER GROUP	1,258	85.43	107,470.94	
MARATHON OIL CORP	15,114	15.62	236,080.68	
MARATHON PETROLEUM CORP	9,718	43.31	420,886.58	
MARKEL CORP	257	882.92	226,910.44	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	6,120	77.14	472,096.80	
MARSH & MCLENNAN COS INC	9,581	69.23	663,292.63	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,071	219.67	235,266.57	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	7,818	14.80	115,706.40	
MASCO CORP	5,967	32.46	193,688.82	
MASTERCARD INC-CLASS A	17,823	104.78	1,867,493.94	
MATTEL INC	6,077	30.52	185,470.04	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,070	40.09	203,256.30	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,042	91.20	186,230.40	
MCDONALD'S CORP	16,118	120.00	1,934,160.00	
MCKESSON CORP	4,129	140.05	578,266.45	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,454	71.00	245,234.00	
MEDNAX INC	1,647	63.88	105,210.36	
MEDTRONIC PLC	25,708	80.93	2,080,548.44	
MELCO PBL ENTERTAINMENT-ADR	3,431	18.78	64,434.18	
MERCK & CO INC	50,839	61.87	3,145,408.93	
METLIFE INC	17,074	54.81	935,825.94	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	478	414.97	198,355.66	
MGM MIRAGE	8,055	28.43	229,003.65	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,145	47.57	149,607.65	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,825	64.57	246,980.25	
MICRON TECHNOLOGY INC	19,043	19.21	365,816.03	

MICROSOFT CORP	137,146	60.35	8,276,761.10	
MOBILEYE NV	3,121	38.59	120,439.39	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,122	199.97	224,366.34	
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,456	96.83	334,644.48	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	28,485	42.92	1,222,576.20	
MONSANTO CO	8,029	101.21	812,615.09	
MONSTER BEVERAGE CORP	7,344	41.68	306,097.92	
MOODY'S CORP	3,227	100.56	324,507.12	
MORGAN STANLEY	26,669	40.43	1,078,227.67	
MOSAIC CO/THE	5,895	28.26	166,592.70	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,856	79.98	228,422.88	
MSCI INC	1,629	79.69	129,815.01	
MURPHY OIL CORP	2,904	30.73	89,239.92	
MYLAN NV	8,365	36.47	305,071.55	
NASDAQ INC	2,012	65.85	132,490.20	
NATIONAL-OILWELL INC	6,720	35.21	236,611.20	
NAVIENT CORP	5,885	17.62	103,693.70	
NETAPP INC	5,150	37.00	190,550.00	
NETFLIX INC	7,867	115.21	906,357.07	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	8,763	15.87	139,068.81	
NEWELL BRANDS INC	8,150	46.74	380,931.00	
NEWFIELD EXPLORATION CO	3,536	40.17	142,041.12	
NEWMONT MINING CORP	9,715	32.69	317,583.35	
NEWS CORP - CLASS A	6,816	11.87	80,905.92	
NEXTERA ENERGY INC	8,513	114.09	971,248.17	
NIELSEN HOLDINGS PLC	6,670	42.64	284,408.80	
NIKE INC	24,464	51.10	1,250,110.40	
NISOURCE INC	5,895	21.71	127,980.45	
NOBLE ENERGY INC	7,907	35.00	276,745.00	
NORDSTROM INC	2,328	58.94	137,212.32	
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,506	103.45	569,595.70	
NORTHERN TRUST CORP	3,963	81.50	322,984.50	
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,153	245.46	773,935.38	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,809	39.68	111,461.12	
NRG ENERGY INC	5,705	11.21	63,953.05	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	4,493	16.91	75,976.63	

NUCOR CORP	5,861	58.84	344,861.24	
NVIDIA CORP	9,793	93.36	914,274.48	
NXP SEMICONDUCTORS NV	5,406	98.88	534,545.28	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,774	265.74	471,422.76	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	14,030	68.22	957,126.60	
OGE ENERGY CORP	3,633	30.85	112,078.05	
OMNICOM GROUP	4,441	84.85	376,818.85	
ONEOK INC	3,752	50.42	189,175.84	
ORACLE CORP	57,132	39.86	2,277,281.52	
PACCAR INC	6,452	59.78	385,700.56	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,673	87.51	146,404.23	
PALO ALTO NETWORKS INC	1,651	161.35	266,388.85	
PARKER HANNIFIN CORP	2,475	136.08	336,798.00	
PATTERSON COS INC	1,487	46.49	69,130.63	
PAYCHEX INC	5,949	55.93	332,727.57	
PAYPAL HOLDINGS INC	20,023	40.08	802,521.84	
PENTAIR PLC	3,059	57.80	176,810.20	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	5,395	18.29	98,674.55	
PEPSICO INC	26,540	101.31	2,688,767.40	
PERRIGO CO PLC	2,630	88.14	231,808.20	
PFIZER INC	111,390	31.48	3,506,557.20	
PG&E CORP	9,191	58.38	536,570.58	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	28,509	89.09	2,539,866.81	
PHILLIPS 66	8,673	83.64	725,409.72	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,015	73.26	147,618.90	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,003	178.19	535,104.57	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	1,699	33.62	57,120.38	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,169	111.24	1,019,959.56	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,096	83.93	91,987.28	
PPG INDUSTRIES INC	4,888	95.19	465,288.72	
PPL CORPORATION	12,627	32.84	414,670.68	
PRAXAIR INC	5,261	115.78	609,118.58	
PRICELINE GROUP INC/THE	911	1,507.35	1,373,195.85	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5,248	57.66	302,599.68	
PROCTER & GAMBLE CO	48,865	82.00	4,006,930.00	

PROGRESSIVE CORP	10,725	32.94	353,281.50	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,075	99.15	800,636.25	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	9,388	40.34	378,711.92	
PULTE GROUP INC	5,532	18.84	104,222.88	
PVH CORP	1,445	106.37	153,704.65	
QORVO INC	2,274	55.28	125,706.72	
QUALCOMM INC	26,972	67.31	1,815,485.32	
QUEST DIAGNOSTICS	2,500	85.54	213,850.00	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	2,761	79.88	220,548.68	
RALPH LAUREN CORP	1,017	110.28	112,154.76	
RANGE RESOURCES CORP	3,028	34.02	103,012.56	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,238	73.28	164,000.64	
RAYTHEON CO	5,458	146.04	797,086.32	
REALOGY HOLDINGS CORP	2,604	24.44	63,641.76	
RED HAT INC	3,326	79.03	262,853.78	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,421	397.48	564,819.08	
REGIONS FINANCIAL CORP	22,373	13.26	296,665.98	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	764	131.78	100,679.92	
REPUBLIC SERVICES INC	4,287	54.61	234,113.07	
RESMED INC	2,488	58.53	145,622.64	
REYNOLDS AMERICAN INC	15,712	53.84	845,934.08	
RITE AID CORP	18,859	7.67	144,648.53	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	2,312	44.76	103,485.12	
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,401	131.20	315,011.20	
ROCKWELL COLLINS INC.	2,321	87.79	203,760.59	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,870	180.12	336,824.40	
ROSS STORES INC	7,379	68.00	501,772.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,053	82.95	253,246.35	
S&P GLOBAL INC	4,871	121.80	593,287.80	
SABRE CORP	3,768	25.70	96,837.60	
SALESFORCE.COM INC	11,803	77.77	917,919.31	
SBA COMMUNICATIONS CORP	2,363	100.75	238,072.25	
SCANA CORP	2,468	69.65	171,896.20	
SCHLUMBERGER LTD	25,558	80.00	2,044,640.00	

SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,471	69.65	102,455.15	
SEAGATE TECHNOLOGY	5,321	39.29	209,062.09	
SEALED AIR CORP	3,545	47.19	167,288.55	
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,422	47.68	115,480.96	
SEMPRA ENERGY	4,408	99.82	440,006.56	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,050	36.68	111,874.00	
SERVICENOW INC	2,908	85.75	249,361.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,450	260.29	377,420.50	
SIGNATURE BANK	944	149.35	140,986.40	
SIGNET JEWELERS LTD	1,324	88.96	117,783.04	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	36,950	4.56	168,492.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,476	78.21	271,857.96	
SMITH (A.O.) CORP	2,632	47.07	123,888.24	
SNAP-ON INC	1,033	167.77	173,306.41	
SOUTHERN CO	17,280	47.13	814,406.40	
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,896	47.06	136,285.76	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	8,555	10.54	90,169.70	
SPECTRA ENERGY CORP	12,815	41.16	527,465.40	
SPLUNK INC	2,359	59.88	141,256.92	
SPRINT CORP	14,295	7.35	105,068.25	
ST JUDE MEDICAL INC	5,227	80.02	418,264.54	
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,769	121.56	336,599.64	
STAPLES INC	11,429	9.60	109,718.40	
STARBUCKS CORP	26,860	55.77	1,497,982.20	
STATE STREET CORP	7,256	78.50	569,596.00	
STERICYCLE INC	1,519	76.09	115,580.71	
STRYKER CORP	6,171	111.44	687,696.24	
SUNTRUST BANKS INC	9,146	51.78	473,579.88	
SYMANTEC CORP	11,276	23.75	267,805.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	15,317	33.62	514,957.54	
SYNOPSIS INC	2,673	61.11	163,347.03	
SYSCO CORP	9,829	53.14	522,313.06	
T ROWE PRICE GROUP INC	4,524	73.47	332,378.28	
T-MOBILE US INC	5,349	53.59	286,652.91	
TARGET CORP	10,284	76.19	783,537.96	
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	264	102.57	27,078.48	
TE CONNECTIVITY LTD	6,575	66.67	438,355.25	

TEGNA INC	3,763	22.94	86,323.22	
TESLA MOTORS INC	2,144	185.02	396,682.88	
TESORO CORP	2,131	83.22	177,341.82	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	16,773	38.56	646,766.88	
TEXAS INSTRUMENTS INC	18,434	72.60	1,338,308.40	
TEXTRON INC	4,788	44.24	211,821.12	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7,234	145.81	1,054,789.54	
TIFFANY & CO	2,244	76.35	171,329.40	
TIME WARNER INC	14,477	91.35	1,322,473.95	
TJX COS INC	12,145	77.73	944,030.85	
TOLL BROTHERS INC	2,871	29.14	83,660.94	
TORCHMARK CORP	2,007	70.06	140,610.42	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	2,930	50.32	147,437.60	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,373	72.91	173,015.43	
TRANSDIGM GROUP INC	986	250.03	246,529.58	
TRAVELERS COS INC/THE	5,356	111.82	598,907.92	
TRIMBLE INC	4,484	27.51	123,354.84	
TRIPADVISOR INC	2,134	50.79	108,385.86	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	7,684	27.69	212,769.96	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	20,419	27.82	568,056.58	
TWITTER INC	10,032	18.73	187,899.36	
TYSON FOODS INC-CL A	5,492	67.36	369,941.12	
UGI CORP	3,152	44.25	139,476.00	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,093	250.09	273,348.37	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,235	30.95	100,123.25	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	3,364	23.75	79,895.00	
UNION PACIFIC CORP	15,541	99.83	1,551,458.03	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,540	68.29	105,166.60	
UNITED PARCEL SERVICE INC	12,871	114.09	1,468,452.39	
UNITED RENTALS INC	1,582	90.95	143,882.90	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	14,600	106.50	1,554,900.00	
UNITED THERAPEUTICS CORP	788	130.94	103,180.72	

UNITEDHEALTH GROUP INC	17,446	149.45	2,607,304.70	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	1,595	122.66	195,642.70	
UNUM GROUP	4,161	42.55	177,050.55	
US BANCORP	31,676	49.23	1,559,409.48	
VALERO ENERGY CORP	8,609	63.39	545,724.51	
VALSPAR CORP	1,350	101.38	136,863.00	
VANTIV INC - CL A	2,808	59.32	166,570.56	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,688	88.25	148,966.00	
VERISIGN INC	1,777	80.04	142,231.08	
VERISK ANALYTICS INC	2,858	83.16	237,671.28	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	75,067	48.07	3,608,470.69	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4,545	89.44	406,504.80	
VF CORP	6,139	54.52	334,698.28	
VIACOM INC-CLASS B	6,218	37.77	234,853.86	
VISA INC-CLASS A SHARES	34,964	80.82	2,825,790.48	
VMWARE INC-CLASS A	1,322	80.14	105,945.08	
VOYA FINANCIAL INC	3,567	37.36	133,263.12	
VULCAN MATERIALS CO	2,449	128.20	313,961.80	
WABCO HOLDINGS INC	951	100.00	95,100.00	
WABTEC CORP	1,602	85.63	137,179.26	
WAL-MART STORES INC	28,800	68.54	1,973,952.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	16,855	83.27	1,403,515.85	
WALT DISNEY CO	28,345	98.24	2,784,612.80	
WASTE CONNECTIONS INC	3,200	75.55	241,760.00	
WASTE MANAGEMENT INC	8,194	68.90	564,566.60	
WATERS CORP	1,447	135.18	195,605.46	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	16,056	4.83	77,550.48	
WEC ENERGY GROUP INC	5,898	55.53	327,515.94	
WELLS FARGO & CO	88,573	52.82	4,678,425.86	
WESTAR ENERGY INC	2,572	57.01	146,629.72	
WESTERN DIGITAL CORP	5,136	60.93	312,936.48	
WESTERN UNION CO	8,721	20.48	178,606.08	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	4,502	50.27	226,315.54	
WEYERHAEUSER CO	13,705	31.13	426,636.65	
WHIRLPOOL CORP	1,352	161.05	217,739.60	

	WHITEWAVE FOODS CO - CL A	3,152	54.94	173,170.88	
	WHOLE FOODS MARKET INC	5,711	30.96	176,812.56	
	WILLIAMS COS INC	13,103	30.15	395,055.45	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,414	124.82	301,315.48	
	WORKDAY INC-CLASS A	2,103	82.75	174,023.25	
	WR BERKLEY CORP	1,737	60.76	105,540.12	
	WR GRACE & CO	1,291	67.11	86,639.01	
	WW GRAINGER INC	1,038	217.62	225,889.56	
	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	1,995	72.26	144,158.70	
	WYNN RESORTS LTD	1,451	92.35	133,999.85	
	XCEL ENERGY INC	9,478	38.87	368,409.86	
	XEROX CORP	15,254	9.44	143,997.76	
	XILINX INC	4,651	52.98	246,409.98	
	XL GROUP LTD	4,992	37.43	186,850.56	
	XYLEM INC	3,176	53.29	169,249.04	
	YAHOO! INC	16,580	41.19	682,930.20	
	YUM! BRANDS INC	7,479	62.36	466,390.44	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	2,012	36.29	73,015.48	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,655	100.64	367,839.20	
	ZOETIS INC	8,722	49.89	435,140.58	
アメリカ・ドル	小計	5,700,732		353,202,523.84 (39,187,820,020)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	16,857	6.46	108,896.22	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	16,098	2.86	46,040.28	
	ADMIRAL GROUP PLC	3,753	19.17	71,945.01	
	AGGREKO PLC	4,533	8.02	36,354.66	
	ANGLO AMERICAN PLC	25,725	10.89	280,273.87	
	ANTOFAGASTA PLC	6,912	6.66	46,033.92	
	ASHTED GROUP PLC	8,993	14.07	126,531.51	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	6,335	25.50	161,542.50	
	ASTRAZENECA PLC	23,235	43.23	1,004,565.22	
	AUTO TRADER GROUP PLC- WI	18,168	3.91	71,200.39	
	AVIVA PLC	74,339	4.54	337,573.39	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	4,470	9.79	43,783.65	
	BAE SYSTEMS PLC	58,483	5.93	347,096.60	

BARCLAYS PLC	310,100	2.12	658,032.20	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	17,762	4.88	86,838.41	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	2,318	25.37	58,807.66	
BHP BILLITON PLC	38,758	12.63	489,707.33	
BP PLC	342,342	4.47	1,532,322.79	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	34,265	43.59	1,493,782.67	
BT GROUP PLC	155,719	3.62	565,104.25	
BUNZL PLC	6,028	19.89	119,896.92	
BURBERRY GROUP PLC	7,939	14.01	111,225.39	
CAPITA PLC	11,978	5.78	69,232.84	
CARNIVAL PLC	3,379	40.84	137,998.36	
CENTRICA PLC	100,370	1.99	200,338.52	
COBHAM PLC	30,697	1.61	49,422.17	
COCA-COLA HBC AG-CDI	3,197	16.74	53,517.78	
COMPASS GROUP PLC	30,163	13.81	416,551.03	
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,354	31.41	73,939.14	
DCC PLC	1,596	61.65	98,393.40	
DIAGEO PLC	46,262	20.29	938,655.98	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	24,320	3.55	86,408.96	
DIXONS CARPHONE PLC	17,341	3.40	58,994.08	
EASYJET PLC	2,927	10.71	31,348.17	
EXPERIAN PLC	17,705	14.30	253,181.50	
FRESNILLO PLC	3,925	12.89	50,593.25	
G4S PLC	28,132	2.44	68,782.74	
GKN PLC	30,519	3.04	92,869.31	
GLAXOSMITHKLINE PLC	89,596	15.22	1,364,099.10	
GLENCORE PLC	224,560	2.61	588,122.64	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	4,584	12.24	56,108.16	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,575	16.62	42,796.50	
HSBC HOLDINGS PLC	363,470	6.33	2,303,672.86	
ICAP PLC	9,825	4.73	46,521.37	
IMI PLC	4,872	9.38	45,699.36	
IMPERIAL BRANDS PLC	17,646	34.61	610,728.06	
INMARSAT PLC	8,289	7.20	59,680.80	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,342	32.50	108,615.00	
INTERTEK GROUP PLC	2,904	32.28	93,741.12	

INVESTEC PLC	10,956	5.06	55,437.36	
ITV PLC	65,015	1.70	110,525.50	
JOHNSON MATTHEY PLC	3,441	32.47	111,729.27	
KINGFISHER PLC	40,433	3.68	148,833.87	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	108,986	2.32	253,610.42	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,179,983	0.59	700,909.90	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,571	28.76	160,221.96	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	28,883	3.36	97,162.41	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	6,599	7.54	49,789.45	
MEGGITT PLC	13,861	4.48	62,180.44	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	12,592	4.37	55,052.22	
MONDI PLC/WI	6,507	15.68	102,029.76	
MORRISON WM SUPERMARKETS	39,399	2.18	86,008.01	
NATIONAL GRID PLC	69,376	9.28	644,433.66	
NEXT PLC	2,530	50.90	128,777.00	
OLD MUTUAL PLC	87,454	1.88	165,200.60	
PEARSON PLC	14,709	7.66	112,670.94	
PERSIMMON PLC	5,460	17.74	96,860.40	
PETROFAC LTD	4,607	7.90	36,395.30	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	2,642	29.46	77,833.32	
PRUDENTIAL PLC	47,195	15.15	715,004.25	
RANGOLD RESOURCES LTD	1,660	57.90	96,114.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	11,644	69.16	805,299.04	
RELX PLC	20,484	13.54	277,353.36	
RIO TINTO PLC	22,680	29.34	665,431.20	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,386,440	0.00	1,386.44	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	33,798	6.57	222,221.85	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	62,769	2.05	128,739.21	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	77,867	19.85	1,545,659.95	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	69,311	20.69	1,434,391.14	
ROYAL MAIL PLC	16,958	4.70	79,821.30	

	RSA INSURANCE GROUP PLC	18,129	5.21	94,452.09	
	SAGE GROUP PLC	19,274	6.85	132,026.90	
	SAINSBURY (J) PLC	28,932	2.38	69,118.54	
	SCHRODERS PLC	2,351	28.72	67,520.72	
	SEVERN TRENT PLC	4,441	22.20	98,590.20	
	SHIRE PLC	16,487	47.99	791,211.13	
	SKY PLC	18,748	7.67	143,797.16	
	SMITH & NEPHEW PLC	16,454	11.08	182,310.32	
	SMITHS GROUP PLC	7,057	13.70	96,680.90	
	SSE PLC	18,723	14.42	269,985.66	
	ST JAMES'S PLACE PLC	9,347	9.52	88,983.44	
	STANDARD CHARTERED PLC	60,336	6.25	377,220.67	
	STANDARD LIFE PLC	34,999	3.42	119,976.57	
	TATE & LYLE PLC	8,322	6.86	57,130.53	
	TAYLOR WIMPEY PLC	57,971	1.52	88,637.65	
	TESCO PLC	150,421	2.12	319,644.62	
	TRAVIS PERKINS PLC	4,436	14.16	62,813.76	
	TUI AG-DI	8,854	10.34	91,550.36	
	UNILEVER PLC	23,563	31.20	735,165.60	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	12,648	8.93	113,009.88	
	VODAFONE GROUP PLC	489,402	2.04	1,002,784.69	
	WEIR GROUP PLC/THE	3,812	17.46	66,557.52	
	WHITBREAD PLC	3,235	36.04	116,589.40	
	WILLIAM HILL PLC	15,323	2.93	44,942.35	
	WOLSELEY PLC	4,641	45.56	211,443.96	
	WORLDPAY GROUP PLC-W/I	25,645	2.75	70,703.26	
	WPP PLC	23,922	16.99	406,434.78	
	イギリス・ポンド 小計	6,816,943		30,943,933.23 (4,244,269,882)	
イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	734	155.50	114,137.00	
	BANK HAPOLIM BM	18,692	22.87	427,486.04	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	25,557	15.33	391,788.81	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	38,104	6.63	252,896.24	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	9,156	14.50	132,762.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,638	54.01	142,478.38	
	NICE LTD	1,063	256.20	272,340.60	
	イスラエル・シュケル 小計	95,944		1,733,889.07	

				(49,485,194)	
オーストラリア・ドル	AGL ENERGY LTD	13,562	20.07	272,189.34	
	ALUMINA LTD	46,762	1.70	79,495.40	
	AMCOR LTD	22,200	14.27	316,794.00	
	AMP LTD	56,152	4.73	265,598.96	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	10,211	14.65	149,591.15	
	ASX LTD	3,866	47.45	183,441.70	
	AURIZON HOLDINGS LTD	40,940	4.88	199,787.20	
	AUSNET SERVICES	45,368	1.47	66,917.80	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	54,268	27.98	1,518,418.64	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	7,789	11.02	85,834.78	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	9,064	11.72	106,230.08	
	BHP BILLITON LTD	59,421	24.10	1,432,046.10	
	BORAL LTD	15,145	6.15	93,141.75	
	BRAMBLES LTD	31,102	11.88	369,491.76	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,949	29.45	145,748.05	
	CHALLENGER LTD	11,511	10.66	122,707.26	
	CIMIC GROUP LIMITED	1,970	30.70	60,479.00	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	11,826	9.38	110,927.88	
	COCHLEAR LTD	1,122	119.27	133,820.94	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	31,883	76.86	2,450,527.38	
	COMPUTERSHARE LIMITED	9,470	11.69	110,704.30	
	CROWN RESORTS LTD	7,005	11.18	78,315.90	
	CSL LIMITED	8,553	100.25	857,438.25	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,170	69.60	81,432.00	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,116	30.01	33,491.16	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	28,551	5.79	165,310.29	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	11,927	4.55	54,267.85		
HEALTHSCOPE LTD	34,931	2.23	77,896.13		
INCITEC PIVOT LTD	32,209	3.15	101,458.35		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	46,904	5.43	254,688.72		
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	8,580	19.83	170,141.40		

	MACQUARIE GROUP LTD	5,809	83.71	486,271.39	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	52,941	2.49	131,823.09	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	49,319	28.47	1,404,111.93	
	NEWCREST MINING LIMITED	13,927	20.76	289,124.52	
	OIL SEARCH LTD	25,413	6.87	174,587.31	
	ORICA LTD	7,135	17.15	122,365.25	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	32,000	5.68	181,760.00	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	5,755	5.20	29,926.00	
	QANTAS AIRWAYS LTD	12,062	3.12	37,633.44	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	25,661	11.12	285,350.32	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	2,762	70.74	195,383.88	
	REA GROUP LTD	1,216	49.90	60,678.40	
	RIO TINTO LTD	8,050	57.37	461,828.50	
	SANTOS LTD	29,125	3.89	113,296.25	
	SEEK LTD	6,498	14.54	94,480.92	
	SONIC HEALTHCARE LTD	7,717	22.18	171,163.06	
	SOUTH32 LTD	96,515	2.58	249,008.70	
	SUNCORP GROUP LTD	24,408	12.08	294,848.64	
	TABCORP HOLDINGS LTD	15,548	4.59	71,365.32	
	TATTS GROUP LTD	27,372	3.87	105,929.64	
	TELSTRA CORP LTD	85,134	4.93	419,710.62	
	TPG TELECOM LTD	7,186	7.02	50,445.72	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	13,968	10.52	146,943.36	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	10,392	5.33	55,389.36	
	WESFARMERS LIMITED	21,144	41.16	870,287.04	
	WESTPAC BANKING CORP	62,046	30.93	1,919,082.78	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	14,205	29.40	417,627.00	
	WOOLWORTHS LTD	23,960	23.21	556,111.60	
	オーストラリア・ドル 小計	1,356,795		19,544,867.56	(1,589,779,527)
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	3,926	57.04	223,939.04	
	AGRIUM INC	2,354	132.93	312,917.22	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	7,732	62.37	482,244.84	
	ALTAGAS LTD	2,954	32.69	96,566.26	
	ARC RESOURCES LTD	6,265	23.46	146,976.90	
	ATCO LTD -CL 'I'	1,489	43.11	64,190.79	

BANK OF MONTREAL	11,820	87.84	1,038,268.80	
BANK OF NOVA SCOTIA	22,061	72.00	1,588,392.00	
BARRICK GOLD CORP	21,410	20.66	442,330.60	
BCE INC	2,855	58.50	167,017.50	
BLACKBERRY LTD	9,009	10.25	92,342.25	
BOMBARDIER INC	35,141	1.94	68,173.54	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	15,984	45.56	728,231.04	
CAE INC	4,997	19.54	97,641.38	
CAMECO CORP	7,056	12.27	86,577.12	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	7,251	104.08	754,684.08	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	14,480	87.00	1,259,760.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	20,162	43.09	868,780.58	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,722	196.79	535,662.38	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,250	140.94	176,175.00	
CANADIAN UTILITIES LTD- A	2,384	36.50	87,016.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	501	226.88	113,666.88	
CENOVUS ENERGY INC	14,924	19.63	292,958.12	
CGI GROUP INC	3,866	63.57	245,780.95	
CI FINANCIAL CORP	4,428	25.80	114,242.40	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	345	623.14	214,983.30	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,039	15.49	140,014.11	
DOLLARAMA INC	2,077	97.93	203,400.61	
ELDORADO GOLD CORP	12,755	3.69	47,065.95	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	7,029	11.50	80,833.50	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,982	17.59	52,453.38	
ENBRIDGE INC	17,098	57.10	976,295.80	
ENCANA CORP	15,192	15.78	239,729.76	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	426	589.00	250,914.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	3,059	25.94	79,350.46	
FIRST CAPITAL REALTY INC	2,507	19.96	50,039.72	

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,298	13.81	169,835.38	
FORTIS INC	5,220	40.46	211,201.20	
FRANCO-NEVADA CORP	3,169	77.70	246,231.30	
GEORGE WESTON LTD	940	108.31	101,811.40	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,053	35.55	144,084.15	
GOLDCORP INC	14,884	17.98	267,614.32	
GREAT-WEST LIFECO INC	5,276	35.00	184,660.00	
HUSKY ENERGY INC	6,268	14.41	90,321.88	
HYDRO ONE LTD	3,549	23.20	82,336.80	
IGM FINANCIAL INC	1,784	37.02	66,043.68	
IMPERIAL OIL LTD	5,305	44.73	237,292.65	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,831	55.87	102,297.97	
INTACT FINANCIAL CORP	2,374	93.57	222,135.18	
INTER PIPELINE LTD	6,033	27.35	165,002.55	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	1,476	20.08	29,638.08	
KEYERA CORP	3,282	38.55	126,521.10	
KINROSS GOLD CORP	22,196	4.58	101,657.68	
LINAMAR CORP	869	49.26	42,806.94	
LOBLAW COS LTD	4,018	68.48	275,152.64	
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,294	54.83	399,930.02	
MANULIFE FINANCIAL CORP	36,185	22.95	830,445.75	
METHANEX CORP	1,619	51.15	82,811.85	
METRO INC	4,242	41.11	174,388.62	
NATIONAL BANK OF CANADA	5,989	49.28	295,137.92	
ONEX CORPORATION	1,613	91.74	147,976.62	
OPEN TEXT CORP	2,188	83.13	181,888.44	
PEMBINA PIPELINE CORP	6,947	38.44	267,042.68	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	2,953	34.15	100,844.95	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	15,413	24.05	370,682.65	
POWER CORP OF CANADA	6,703	29.46	197,470.38	
POWER FINANCIAL CORP	4,465	33.00	147,345.00	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	3,687	29.44	108,545.28	
RESTAURANT BRANDS INTERN	3,979	62.42	248,369.18	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	6,863	51.61	354,199.43	
ROYAL BANK OF CANADA	27,322	87.27	2,384,390.94	

	SAPUTO INC	4,576	46.25	211,640.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	3,871	30.07	116,400.97	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	7,607	26.20	199,303.40	
	SILVER WHEATON CORP	7,830	25.30	198,099.00	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	2,691	55.04	148,112.64	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	11,293	51.99	587,123.07	
	SUNCOR ENERGY INC	30,555	41.81	1,277,504.55	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	10,099	30.80	311,049.20	
	THOMSON REUTERS CORP	6,440	56.97	366,886.80	
	TORONTO-DOMINION BANK	34,080	63.27	2,156,241.60	
	TOURMALINE OIL CORP	3,734	35.25	131,623.50	
	TRANSCANADA CORP	14,714	60.38	888,431.32	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	17,830	4.55	81,126.50	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	5,797	24.40	141,446.80	
	VERESEN INC	5,500	12.49	68,695.00	
	VERMILION ENERGY INC	2,044	53.66	109,681.04	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,205	46.64	56,201.20	
	YAMANA GOLD INC	16,841	4.10	69,048.10	
カナダ・ドル 小計		728,524		28,696,345.56 (2,361,422,276)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND LTD	46,100	3.01	138,761.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	7,300	8.40	61,320.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	42,600	2.42	103,092.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	32,200	16.50	531,300.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	108,300	0.93	101,260.50	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	48,300	2.01	97,083.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	126,500	0.39	49,967.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	1,800	39.67	71,406.00	
	KEPPEL CORP LTD	25,900	5.38	139,342.00	
	NOBLE GROUP LTD	156,300	0.17	27,821.40	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	56,900	8.87	504,703.00	
	SEBCCORP INDUSTRIES LTD	17,800	2.63	46,814.00	
	SEBCCORP MARINE LTD	15,800	1.35	21,330.00	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	10,400	9.71	100,984.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	14,400	7.14	102,816.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	30,300	3.68	111,504.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	28,500	3.28	93,480.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	149,000	3.71	552,790.00	
	STARHUB LTD	13,700	2.90	39,730.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	23,900	19.56	467,484.00	
	UOL Group Limited	8,300	5.66	46,978.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	34,000	3.37	114,580.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	32,600	0.77	25,265.00	
	シンガポール・ドル 小計	1,030,900		3,549,811.40 (276,246,323)	
スイス・フラン	ABB LTD	36,199	20.89	756,197.11	
	ACTELION LTD-REG	1,889	157.50	297,517.50	
	ADECCO GROUP AG-REG	2,939	61.10	179,572.90	
	ARYZTA AG	1,552	43.02	66,767.04	
	BALOISE HOLDING AG	875	122.50	107,187.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	40	1,236.00	49,440.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	16	5,065.00	81,040.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	59,790.00	119,580.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	9,595	66.05	633,749.75	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	34,185	14.13	483,034.05	
	DUFREY AG-REG	826	123.80	102,258.80	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	146	498.25	72,744.50	
	GALENICA AG-REG	70	1,032.00	72,240.00	
	GEBERIT AG-REG	704	406.60	286,246.40	
	GIVAUDAN-REG	170	1,797.00	305,490.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,992	45.05	179,839.60	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,077	129.20	139,148.40	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	8,371	53.85	450,778.35	
	LONZA GROUP AG	949	182.50	173,192.50	
	NESTLE SA	58,562	68.45	4,008,568.90	
	NOVARTIS AG	41,024	71.60	2,937,318.40	

	PARGESA HOLDING SA-BR	629	63.70	40,067.30	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	305	495.25	151,051.25	
	ROCHE HOLDING AG	12,916	232.00	2,996,512.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	367	178.50	65,509.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	786	180.10	141,558.60	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	98	2,000.00	196,000.00	
	SIKA AG-BEARER	39	4,891.00	190,749.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	948	126.50	119,922.00	
	SWATCH GROUP AG	554	298.30	165,258.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	562	275.50	154,831.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,278	82.35	105,243.30	
	SWISS RE AG	6,099	92.75	565,682.25	
	SWISSCOM AG	478	436.40	208,599.20	
	SYNGENTA AG	1,711	389.80	666,947.80	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	850	58.25	49,512.50	
	UBS GROUP AG	67,212	16.07	1,080,096.84	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,757	266.60	735,016.20	
スイス・フラン	小計	300,772		19,134,468.64 (2,103,452,138)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	5,332	134.60	717,687.20	
	ASSA ABLOY AB	18,604	170.90	3,179,423.60	
	ATLAS COPCO AB	6,585	250.60	1,650,201.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	12,720	280.80	3,571,776.00	
	BOLIDEN AB	4,834	229.30	1,108,436.20	
	ELECTROLUX AB	4,326	214.90	929,657.40	
	GETINGE AB-B SHS	3,649	146.10	533,118.90	
	HENNES & MAURITZ AB	17,521	270.40	4,737,678.40	
	HEXAGON AB-B SHS	4,687	314.00	1,471,718.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	7,602	67.75	515,035.50	
	ICA GRUPPEN AB	1,451	275.00	399,025.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,904	159.70	463,768.80	
	INVESTOR AB	8,425	310.50	2,615,962.50	
	KINNEVIK AB - B	4,223	220.40	930,749.20	
	LUNDIN PETROLEUM AB	3,455	157.80	545,199.00	
	NORDEA BANK AB	56,043	96.80	5,424,962.40	

	SANDVIK AB	19,164	108.20	2,073,544.80	
	SECURITAS AB	5,685	134.50	764,632.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	28,056	92.90	2,606,402.40	
	SKANSKA AB-B SHS	6,097	207.40	1,264,517.80	
	SKF AB	7,169	160.60	1,151,341.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB	11,216	246.00	2,759,136.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	28,206	126.70	3,573,700.20	
	SWEDBANK AB - A SHARES	16,830	212.30	3,573,009.00	
	SWEDISH MATCH AB	3,486	288.60	1,006,059.60	
	TELE2 AB	6,193	70.65	437,535.45	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	56,769	47.70	2,707,881.30	
	TELIA CO AB	47,599	34.82	1,657,397.18	
	VOLVO AB	28,452	97.35	2,769,802.20	
スウェーデン・クローナ 小計		427,283		55,139,358.93 (662,223,701)	
デンマーク・ク ローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	117	9,030.00	1,056,510.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	67	8,540.00	572,180.00	
	CARLSBERG AS-B	1,910	587.50	1,122,125.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,796	387.60	696,129.60	
	COLOPLAST-B	2,103	439.30	923,847.90	
	DANSKE BANK A/S	12,727	205.90	2,620,489.30	
	DSV A/S	3,582	309.50	1,108,629.00	
	GENMAB A/S	1,010	1,246.00	1,258,460.00	
	ISS A/S	2,995	240.90	721,495.50	
	NOVO-NORDISK A/S	35,077	229.20	8,039,648.40	
	NOVOZYMES A/S	4,109	242.20	995,199.80	
	PANDORA A/S	2,046	830.00	1,698,180.00	
	TDC A/S	14,898	35.24	525,005.52	
	TRYGVESTA AS	2,055	128.00	263,040.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	4,068	440.30	1,791,140.40	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,132	116.20	247,738.40		
デンマーク・クローネ 小計		90,692		23,639,818.82 (373,745,536)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	18,421	6.25	115,131.25	
	CONTACT ENERGY LTD	13,528	4.67	63,175.76	
	FLETCHER BUILDING LTD	12,297	10.64	130,840.08	
	MERCURY NZ LTD	13,475	3.03	40,896.62	

	MERIDIAN ENERGY LTD	23,192	2.59	60,183.24	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	6,751	8.59	57,991.09	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	33,452	3.35	112,064.20	
ニュージーランド・ドル 小計		121,116		580,282.24	(45,174,972)
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	17,515	123.20	2,157,848.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	3,622	140.50	508,891.00	
	MARINE HARVEST	6,799	149.60	1,017,130.40	
	NORSK HYDRO ASA	23,768	38.77	921,485.36	
	ORKLA ASA	14,517	75.80	1,100,388.60	
	SCHIBSTED ASA	1,336	187.80	250,900.80	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,681	180.40	303,252.40	
	STATOIL ASA	20,529	139.10	2,855,583.90	
	TELENOR ASA	13,557	125.50	1,701,403.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,190	320.80	1,023,352.00	
ノルウェー・クローネ 小計		106,514		11,840,235.96	(152,857,446)
ユーロ	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	12,149	12.38	150,465.36	
	ABN AMRO GROUP NV-CVA	4,207	20.30	85,402.10	
	ACCOR	3,043	33.76	102,731.68	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,420	26.77	91,570.50	
	ADIDAS AG	3,457	138.85	480,004.45	
	ADP	664	90.30	59,959.20	
	AEGON NV	32,122	4.77	153,254.06	
	AENA SA	1,264	125.10	158,126.40	
	AGEAS	3,462	35.08	121,446.96	
	AIR LIQUIDE	6,355	93.85	596,416.75	
	AIRBUS GROUP SE	10,783	55.24	595,652.92	
	AKZO NOBEL NV	4,547	57.77	262,680.19	
	ALLIANZ SE	8,361	150.77	1,260,604.69	
	ALSTOM RGPT	2,826	26.55	75,044.43	
	ALTICE NV - A-W/I	6,594	15.84	104,481.93	
	ALTICE NV - B -W/I	2,036	15.94	32,453.84	
	AMADEUS IT GROUP SA	8,070	41.80	337,326.00	
	ANDRITZ AG	1,302	47.78	62,216.07	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	14,778	95.43	1,410,264.54	
	ARCELORMITTAL	32,946	6.57	216,521.11	

ARKEMA	1,216	87.93	106,922.88	
ASML HOLDING NV	6,772	98.53	667,245.16	
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	21,401	11.25	240,761.25	
ATLANTIA SPA	7,823	19.93	155,912.39	
ATOS SE	1,574	96.30	151,576.20	
AXA	35,562	21.90	778,807.80	
AXEL SPRINGER SE	829	42.33	35,095.71	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	118,727	5.85	695,621.49	
BANCO DE SABADELL SA	93,853	1.27	119,193.31	
BANCO POPULAR ESPANOL	60,135	0.85	51,655.96	
BANCO SANTANDER SA	264,872	4.26	1,129,943.95	
BANK OF IRELAND	501,769	0.21	109,385.64	
BANKIA SA	80,678	0.86	70,109.18	
BANKINTER SA	12,000	7.03	84,456.00	
BASF SE	16,845	80.23	1,351,524.88	
BAYER AG	15,189	91.44	1,388,912.53	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,117	80.81	494,351.47	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	915	68.03	62,247.45	
BEIERSDORF AG	1,757	77.51	136,197.36	
BNP PARIBAS	19,466	54.39	1,058,755.74	
BOLLORE	17,294	2.82	48,769.08	
BOSKALIS WESTMINSTER	1,554	28.64	44,506.56	
BOUYGUES	3,736	31.61	118,113.64	
BRENNTAG AG	2,760	47.95	132,342.00	
BUREAU VERITAS SA	4,946	17.26	85,392.69	
CAIXABANK	46,802	2.83	132,636.86	
CAP GEMINI SA	3,033	76.59	232,297.47	
CARREFOUR SA	10,165	22.23	225,967.95	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,024	44.00	45,056.00	
CHRISTIAN DIOR SE	980	178.40	174,832.00	
CIE DE SAINT-GOBAIN	9,087	41.34	375,656.58	
CNH INDUSTRIAL NV	18,333	7.40	135,755.86	
CNP ASSURANCES	3,037	16.34	49,639.76	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	3,878	31.95	123,902.10	
COLRUYT NV	1,173	47.16	55,318.68	
COMMERZBANK AG	18,761	7.05	132,302.57	

CONTINENTAL AG	2,016	169.75	342,216.00
COVESTRO AG	1,228	58.08	71,332.06
CREDIT AGRICOLE SA	18,793	10.81	203,152.33
CRH PLC	15,437	31.84	491,514.08
DAIMLER AG	17,678	65.20	1,152,640.95
DANONE	10,887	58.82	640,373.34
DASSAULT SYSTEMES SA	2,320	71.35	165,532.00
DEUTSCHE BANK AG	25,315	15.01	379,978.15
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	2,745	76.28	209,388.60
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	4,324	12.84	55,541.78
DEUTSCHE POST AG	18,098	29.05	525,837.39
DEUTSCHE TELEKOM AG	59,524	14.40	857,145.60
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	5,999	27.92	167,492.08
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,011	4.60	50,672.62
E.ON SE	36,831	6.08	224,006.14
EDENRED	3,746	18.93	70,930.51
EDF	4,502	9.79	44,115.09
EIFFAGE	1,100	63.05	69,355.00
ELISA OYJ	2,689	29.11	78,276.79
ENAGAS SA	4,130	23.11	95,444.30
ENDESA SA	5,637	17.94	101,155.96
ENEL SPA	140,678	3.61	508,691.64
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	42,068	2.69	113,162.92
ENGIE	27,048	11.25	304,425.24
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	46,718	12.38	578,368.84
ERSTE GROUP BANK AG	5,378	26.66	143,404.37
ESSILOR INTERNATIONA	3,799	101.95	387,308.05
EURAZEO	729	52.64	38,374.56
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,206	16.28	52,193.68
EVONIK INDUSTRIES AG	2,859	26.11	74,648.49
EXOR SPA	1,989	37.52	74,627.28
FERRARI NV	2,219	49.89	110,705.91
FERROVIAL S.A.	8,613	16.64	143,320.32
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	16,010	7.04	112,790.45
FORTUM OYJ	7,966	13.53	107,779.98
FRAPORT AG	904	52.91	47,830.64
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	4,032	72.85	293,767.48

FRESENIUS SE & CO KGAA	7,539	66.92	504,577.73	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	1,218	37.81	46,052.58	
GALP ENERGIA SGPS SA	8,240	12.33	101,599.20	
GAS NATURAL SDG SA	6,215	16.14	100,341.17	
GEA GROUP AG	3,236	33.70	109,069.38	
GEMALTO	1,431	48.69	69,675.39	
GRIFOLS SA	5,309	18.46	98,030.68	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,401	76.33	106,938.33	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,996	8.24	74,181.01	
HANNOVER RUECK SE	1,027	99.81	102,504.87	
HEIDELBERGCEMENT AG	2,487	84.00	208,920.43	
HEINEKEN HOLDING NV	1,787	66.40	118,656.80	
HEINEKEN NV	4,238	71.10	301,321.80	
HENKEL AG & CO KGAA	1,759	93.68	164,783.12	
HENKEL KGAA-VORZUG	3,321	109.06	362,194.90	
HERMES INTERNATIONAL	474	376.65	178,532.10	
HOCHTIEF AG	367	132.24	48,534.28	
HUGO BOSS AG	1,190	53.57	63,757.82	
IBERDROLA SA	99,767	5.63	562,286.81	
ILIAD SA	491	177.60	87,201.60	
IMERYS SA	664	64.91	43,100.24	
INDITEX SA	19,975	31.49	629,012.75	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	20,775	15.95	331,485.90	
ING GROEP NV-CVA	71,178	12.78	909,654.84	
INGENICO GROUP	989	74.13	73,314.57	
INTESA SANPAOLO	247,080	2.03	503,054.88	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	14,551	5.18	75,505.13	
JC DECAUX SA	1,397	25.24	35,267.26	
JERONIMO MARTINS	4,476	14.88	66,625.26	
K+S AG	3,385	18.85	63,807.25	
KBC GROEP NV	4,608	55.96	257,863.68	
KERING	1,396	199.15	278,013.40	
KERRY GROUP PLC-A	3,000	65.31	195,930.00	
KONE OYJ	6,179	41.31	255,254.49	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	23,412	19.38	453,724.56	
KONINKLIJKE DSM NV	3,225	56.96	183,696.00	

KONINKLIJKE PHILIPS NV	17,110	27.17	464,964.25	
L'OREAL SA	4,658	159.40	742,485.20	
LAGARDERE S.C.A.	2,234	23.02	51,426.68	
LANXESS	1,624	56.99	92,563.12	
LEGRAND SA	4,958	51.88	257,221.04	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	7,215	11.80	85,137.00	
LINDE AG	3,415	152.12	519,496.63	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,039	48.52	147,452.28	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,134	165.25	848,393.50	
MAN SE	649	93.34	60,577.66	
MAPFRE SA	18,139	2.73	49,628.30	
MEDIOBANCA SPA	10,068	6.53	65,744.04	
MERCK KGAA	2,365	94.82	224,258.76	
METRO AG	3,122	27.89	87,088.19	
METSO OYJ	2,016	25.99	52,395.84	
MICHELIN (C.G.D.E.)	3,367	98.63	332,087.21	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	2,938	173.31	509,205.34	
NATIXIS	16,749	4.63	77,598.11	
NESTE OYJ	2,252	36.74	82,738.48	
NN GROUP NV	5,544	29.97	166,181.40	
NOKIA OYJ	107,442	3.91	420,098.22	
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,038	33.67	68,619.46	
OCI NV	1,706	13.11	22,374.19	
OMV AG	2,594	29.08	75,433.52	
ORANGE S.A.	36,791	13.66	502,565.06	
ORION OYJ-CLASS B	1,849	39.38	72,813.62	
OSRAM LICHT AG	1,565	47.87	74,929.07	
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,447	102.40	148,172.80	
PERNOD-RICARD	3,929	102.70	403,508.30	
PEUGEOT SA	8,606	13.97	120,268.85	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	2,696	46.14	124,401.52	
POSTE ITALIANE SPA	9,310	5.71	53,160.10	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	3,981	33.50	133,391.36	
PROXIMUS	2,845	26.18	74,482.10	
PRYSMIAN SPA	3,487	22.28	77,690.36	
PUBLICIS GROUPE	3,520	60.47	212,854.40	
QIAGEN NV	3,960	26.20	103,752.00	

RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	2,076	16.59	34,451.22	
RANDSTAD HOLDINGS NV	2,090	47.76	99,828.85	
RED ELECTRICA DE ESPANA	7,816	16.49	128,885.84	
RELX NV	18,758	14.90	279,587.99	
REMY COINTREAU	399	73.95	29,506.05	
RENAULT SA	3,519	74.35	261,637.65	
REPSOL SA	20,186	12.16	245,562.69	
REXEL SA	5,414	14.16	76,689.31	
ROYAL KPN NV	62,297	2.56	159,854.10	
RTL GROUP	710	65.86	46,760.60	
RWE AG	8,763	11.75	103,035.35	
SAFRAN SA	5,776	62.46	360,768.96	
SAIPEM SPA	108,360	0.38	42,152.04	
SAMPO OYJ	8,178	41.98	343,312.44	
SANOFI	21,289	76.05	1,619,028.45	
SAP SE	18,044	78.43	1,415,299.18	
SCHAEFFLER AG	2,982	12.34	36,809.80	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	10,291	62.01	638,144.91	
SCOR REGROUPE	2,898	29.87	86,563.26	
SFR GROUP SA	2,026	22.95	46,496.70	
SIEMENS AG	14,044	106.51	1,495,826.44	
SNAM SPA	45,423	3.51	159,616.42	
SOCIETE BIC SA	521	122.25	63,692.25	
SOCIETE GENERALE	14,075	40.22	566,096.50	
SODEXO	1,679	100.60	168,907.40	
SOLVAY SA	1,328	99.79	132,521.12	
STMICROELECTRONICS NV	11,426	8.88	101,497.15	
STORA ENSO OYJ	9,663	8.88	85,807.44	
SUEZ	6,159	13.21	81,360.39	
SYMRISE AG	2,212	56.13	124,161.77	
TECHNIP SA	1,961	65.30	128,053.30	
TELECOM ITALIA SPA	253,776	0.68	174,090.33	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	13,861	3.52	48,832.30	
TELEFONICA SA	82,513	7.98	658,866.30	
TELEFONICA SA-RTS	82,513	0.31	26,321.64	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,065	47.26	50,337.22	
TENARIS SA	8,374	14.33	119,999.42	
TERNA SPA	27,809	3.94	109,567.46	

	THALES SA	1,894	89.25	169,039.50	
	THYSSENKRUPP AG	6,588	21.11	139,085.85	
	TOTAL SA	40,970	43.12	1,766,626.40	
	UCB SA	2,267	61.87	140,259.29	
	UMICORE	1,687	54.28	91,570.36	
	UNICREDIT SPA	93,561	1.98	185,625.02	
	UNILEVER NV	29,894	36.66	1,095,914.04	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA	16,218	2.12	34,382.16	
	UNIPOLSAI SPA	19,334	1.76	34,027.84	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,237	36.36	81,341.79	
	UPM-KYMMENE OYJ	9,414	21.35	200,988.90	
	VALEO SA	4,258	51.43	218,988.94	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,292	16.40	135,988.80	
	VINCI SA	9,339	61.09	570,519.51	
	VIVENDI SA	21,621	18.35	396,853.45	
	VOESTALPINE AG	2,039	34.78	70,926.61	
	VOLKSWAGEN AG	566	128.22	72,572.52	
	VOLKSWAGEN AG	3,415	117.30	400,579.50	
	VONOVIA SE	8,617	30.33	261,396.69	
	VOPAK	1,247	43.72	54,525.07	
	WARTSILA OYJ	2,611	39.41	102,899.51	
	WENDEL	555	106.05	58,857.75	
	WOLTERS KLUWER NV	5,480	32.84	179,963.20	
	ZALANDO SE	1,540	35.76	55,084.26	
	ZARDOYA OTIS SA	3,300	7.52	24,816.00	
	ZODIAC SA	3,632	21.54	78,251.44	
	ユーロ 小計	4,236,670		58,785,932.76 (6,915,577,130)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	222,075	46.85	10,404,213.75	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,600	74.55	342,930.00	
	BANK OF EAST ASIA	21,800	31.55	687,790.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	68,039	28.05	1,908,493.95	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD	25,000	10.52	263,000.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	12,000	64.30	771,600.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	49,409	50.75	2,507,506.75	

CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	49,409	94.90	4,688,914.10	
CLP HOLDINGS LTD	29,643	73.70	2,184,689.10	
FIRST PACIFIC CO	40,000	5.26	210,400.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	42,810	35.95	1,539,019.50	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	40,157	17.00	682,669.00	
HANG SENG BANK LTD	13,712	145.00	1,988,240.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	18,743	41.90	785,331.70	
HONG KONG & CHINA GAS	144,406	14.54	2,099,663.24	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	21,311	203.00	4,326,133.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	11,000	33.65	370,150.00	
KERRY PROPERTIES LTD	12,500	20.75	259,375.00	
LI & FUNG LTD	109,278	3.49	381,380.22	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	17,600	15.54	273,504.00	
MTR CORP	29,255	39.15	1,145,333.25	
NEW WORLD DEVELOPMENT	101,669	8.80	894,687.20	
NWS HOLDINGS LTD	29,000	14.52	421,080.00	
PCCW LTD	86,000	4.41	379,260.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	25,087	72.70	1,823,824.90	
SANDS CHINA LTD	43,380	36.95	1,602,891.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	24,000	8.70	208,800.00	
SINO LAND CO	56,000	11.24	629,440.00	
SJM HOLDINGS LTD	35,000	5.80	203,000.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	27,023	100.30	2,710,406.90	
SWIRE PACIFIC LTD	9,866	77.50	764,615.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	21,400	22.00	470,800.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	25,000	28.70	717,500.00	
WH GROUP LTD	106,000	6.38	676,280.00	
WHARF HOLDINGS LTD	26,733	55.30	1,478,334.90	
WHELOCK & CO LTD	15,000	43.45	651,750.00	
WYNN MACAU LTD	28,503	12.82	365,408.46	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,000	27.50	385,000.00	
香港・ドル 小計	1,656,408		52,203,414.92 (746,508,833)	
合計	22,669,293		58,708,562,978	

(58,708,562,978)

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	5,718.00	109,442.52	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,314.00	141,123.60	
		AMERICAN TOWER REIT INC	7,818.00	821,593.62	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	17,853.00	178,530.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,525.00	409,858.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,839.00	343,973.24	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5,454.00	128,987.10	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,545.00	117,497.25	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	6,222.00	528,870.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,914.00	259,171.16	
		DUKE REALTY CORP	6,113.00	148,362.51	
		EQUINIX INC	1,278.00	425,880.72	
		EQUITY RESIDENTIAL	6,706.00	395,519.88	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,210.00	257,669.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,234.00	157,742.74	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,266.00	174,467.46	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	10,601.00	267,039.19	
		HCP INC	8,586.00	246,246.48	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	13,252.00	217,465.32	
		IRON MOUNTAIN INC	4,467.00	140,933.85	
		KIMCO REALTY CORP	7,426.00	190,476.90	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	2,584.00	98,553.76	
		MACERICH CO/THE	2,245.00	154,905.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,340.00	119,327.00	
		PROLOGIS INC	9,640.00	472,070.80	
		PUBLIC STORAGE	2,704.00	551,534.88	
REALTY INCOME CORP	4,698.00	259,094.70			
REGENCY CENTERS CORP	1,735.00	114,492.65			
SIMON PROPERTY GROUP INC	5,699.00	1,030,550.17			

	SL GREEN REALTY CORP	1,794.00	185,535.48	
	UDR INC	4,781.00	158,490.15	
	VENTAS INC	6,219.00	372,518.10	
	VEREIT	17,225.00	142,278.50	
	VORNADO REALTY TRUST	3,153.00	301,300.68	
	WELLTOWER INC	6,566.00	410,309.34	
アメリカ・ドル 小計		187,724.00	10,031,812.25 (1,113,029,569)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	17,352.00	104,719.32	
	HAMMERSON PLC	14,109.00	78,304.95	
	INTU PROPERTIES PLC	16,970.00	45,496.57	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	14,007.00	139,299.61	
	SEGRO PLC	13,461.00	55,392.01	
イギリス・ポンド 小計		75,899.00	423,212.46 (58,047,821)	
オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	19,520.00	172,166.40	
	GOODMAN GROUP	34,597.00	224,188.56	
	GPT GROUP	36,895.00	168,979.10	
	MIRVAC GROUP	75,020.00	148,539.60	
	SCENTRE GROUP	103,911.00	427,074.21	
	STOCKLAND	47,595.00	197,519.25	
	VICINITY CENTRES	66,531.00	186,952.11	
	WESTFIELD CORP	38,860.00	347,408.40	
オーストラリア・ドル 小計		422,929.00	1,872,827.63 (152,335,799)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	2,551.00	54,336.30	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,900.00	75,893.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,220.00	36,880.60	
カナダ・ドル 小計		6,671.00	167,109.90 (13,751,474)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	40,800.00	94,248.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	37,000.00	55,500.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	44,700.00	86,941.50	
	SUNTEC REIT	43,800.00	72,489.00	
シンガポール・ドル 小計		166,300.00	309,178.50	

				(24,060,271)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS		647.00	48,525.00	
	GECINA SA		740.00	89,503.00	
	ICADE		692.00	43,222.32	
	KLEPIERRE		3,972.00	137,470.92	
	UNIBAIL-RODAMCO SE		1,833.00	381,813.90	
ユーロ 小計		7,884.00	700,535.14	(82,410,954)	
香港・ドル	LINK REIT		41,371.00	2,186,457.35	
香港・ドル 小計			41,371.00	2,186,457.35	(31,266,340)
投資証券 合計				1,474,902,228	(1,474,902,228)
合計				1,474,902,228	(1,474,902,228)

(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 590銘柄	62.79%	-%	66.96%
	投資証券 35銘柄	-%	1.78%	
イギリス・ポンド	株式 107銘柄	6.80%	-%	7.15%
	投資証券 5銘柄	-%	0.09%	
イスラエル・シェケル	株式 7銘柄	0.08%	-%	0.08%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.55%	-%	2.89%
	投資証券 8銘柄	-%	0.24%	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.78%	-%	3.95%
	投資証券 3銘柄	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 23銘柄	0.44%	-%	0.50%
	投資証券 4銘柄	-%	0.04%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.37%	-%	3.50%
スウェーデン・クローナ	株式 29銘柄	1.06%	-%	1.10%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.60%	-%	0.62%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.07%	-%	0.08%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.24%	-%	0.25%
ユーロ	株式 230銘柄	11.08%	-%	11.63%
	投資証券 5銘柄	-%	0.13%	

香港・ドル	株式	38銘柄	1.20%	-%	1.29%
	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28年12月30日現在）

資産総額	39,347,358,198円
負債総額	372,914,314円
純資産総額（ - ）	38,974,443,884円
発行済数量	30,011,194,290口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2987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28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28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	318	52,114
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	54	9,537
単位型公社債投資信託	3	114
合計	375	61,766

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して記載しておりますので、表中の個々の金額の合計と合計欄の金額とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第21期事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、第22期事業年度に係る中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,488,730	9,619,679
有価証券	5,209,385	7,602,477
前払費用	499,710	390,202
未収委託者報酬	2,778,650	3,426,935
未収運用受託報酬	1,519,030	1,649,081
未収投資助言報酬	216,814	208,775
繰延税金資産	417,418	480,820
その他	52,788	19,980
流動資産合計	14,182,529	23,397,951
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 88,529	1 80,574
車両	1 588	1 294

器具備品	1	90,111	1	114,079
有形固定資産合計		179,229		194,948
無形固定資産				
ソフトウェア		854,449		742,019
ソフトウェア仮勘定		17,421		88,417
その他		8,075		8,043
無形固定資産合計		879,946		838,479
投資その他の資産				
投資有価証券		35,677,217		35,476,609
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		175,262		-
差入保証金		284,888		285,819
繰延税金資産		-		170,956
その他		17		793
投資その他の資産合計		36,203,608		36,000,401
固定資産合計		37,262,784		37,033,830
資産合計		51,445,314		60,431,781

負債の部

流動負債

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

固定負債

退職給付引当金	1,253,790	1,404,058
役員退職慰労引当金	25,400	26,800
繰延税金負債	13,483	-
固定負債合計	1,292,673	1,430,858
負債合計	6,788,467	8,882,374
純資産の部		
株主資本		
資本金	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金	120,000	120,000
研究開発積立金	70,000	70,000
別途積立金	350,000	350,000
繰越利益剰余金	23,998,814	31,277,901
利益剰余金合計	24,678,621	31,957,708
株主資本合計	42,960,461	50,239,548
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,696,385	1,309,858
評価・換算差額等合計	1,696,385	1,309,858
純資産合計	44,656,846	51,549,407
負債・純資産合計	51,445,314	60,431,781

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	15,670,934	23,796,732
運用受託報酬	7,825,480	10,253,108

投資助言報酬		872,448		887,392
業務受託料		47,100		-
営業収益計		24,415,963		34,937,233
営業費用				
支払手数料		6,834,391		10,915,789
広告宣伝費		28,551		59,346
調査費		4,581,959		5,358,400
支払運用委託報酬		1,811,448		2,043,036
支払投資助言報酬		1,722,179		2,189,966
委託調査費		80,518		90,937
調査費		967,812		1,034,460
委託計算費		148,832		189,969
営業雑経費		581,870		712,706
通信費		53,825		47,397
印刷費		170,610		207,694
協会費		21,379		22,682
その他営業雑経費		336,053		434,931
営業費用計		12,175,604		17,236,212
一般管理費				
役員報酬	1	62,272	1	69,958
給料・手当		2,905,979		2,984,319
賞与引当金繰入額		782,365		864,968
賞与		237,611		245,495
福利厚生費		532,618		581,952
退職給付費用		283,064		298,054
役員退職慰労引当金繰入額		7,250		7,450
役員退職慰労金		-		100
その他人件費		101,498		134,593
不動産賃借料		544,587		544,913
その他不動産経費		25,737		25,766
交際費		20,059		24,568
旅費交通費		100,791		114,715
固定資産減価償却費		440,227		401,740
租税公課		104,874		183,280
業務委託費		194,856		225,301
器具備品費		156,991		173,657
保険料		56,700		57,047
諸経費		135,187		146,268

一般管理費計		6,692,676		7,084,153
営業利益		5,547,682		10,616,866
営業外収益				
受取利息		274		747
有価証券利息		70,792		66,047
受取配当金	4	177,354	4	214,632
為替差益		31,164		-
その他営業外収益		6,906		32,180
営業外収益計		286,492		313,608
営業外費用				
為替差損		-		18,136
控除対象外消費税		19,444		10,447
その他営業外費用		6,244		499
営業外費用計		25,689		29,083
経常利益		5,808,485		10,901,391
特別利益				
投資有価証券売却益		366,068		100,523
投資有価証券償還益		15,343		17,323
事故受取保険金		-	5	5,609
特別利益計		381,411		123,456
特別損失				
投資有価証券売却損		-		726
固定資産除却損	3	8,042	3	6,419
事故損失賠償金	2	25,550		-
特別損失計		33,593		7,145
税引前当期純利益		6,156,304		11,017,702
法人税、住民税及び事業税		2,284,237		3,740,258
法人税等調整額		14,162		137,203
法人税等合計		2,298,400		3,603,055
当期純利益		3,857,904		7,414,647

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金					
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,116
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,857,904	3,857,904	3,857,904
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,722,344	3,722,344	3,722,344
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金					
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	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

当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,414,647	7,414,647	7,414,647
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	7,279,087	7,279,087	7,279,087
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,548

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	7,414,647
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	386,526	386,526	386,526
当期変動額合計	386,526	386,526	6,892,580
当期末残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407

注記事項

(重要な会計方針)

項目	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法(定額法)によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)によっております。</p>

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

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。		
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	272,378千円	287,659千円
車両	6,425	6,720
器具備品	481,704	453,566
計	760,508	747,946

(損益計算書関係)

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。	
取締役	180,000千円
監査役	40,000千円

2. 事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。	
3. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。	
前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
器具備品	4,128千円
その他	3,914
計	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26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
関係会社からの受取配当金	41,126千円
	51,062千円
5. 事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。	

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成26年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成26年3月31日

効力発生日 平成26年6月26日

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

平成27年6月25日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成27年3月31日

効力発生日 平成27年6月25日

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成27年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成27年3月31日

効力発生日 平成27年6月25日

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

平成28年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成28年3月31日

効力発生日 平成28年6月24日

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

該当するものではありません。

未経過リース料期末残高相当額等

該当するものではありません。

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
支払リース料	108	-
減価償却費相当額	100	-
支払利息相当額	1	-

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	3,488,730	3,488,730	-
有価証券			
満期保有目的の債券	5,209,385	5,215,010	5,624
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,414,879	22,498,520	83,640
その他有価証券	13,194,837	13,194,837	-

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	9,619,679	9,619,679	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,602,477	7,619,170	16,692
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,118,488	22,356,870	238,381
その他有価証券	13,290,620	13,290,620	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

預金はすべて短期であるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	66,222

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(平成27年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	3,488,730	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券				
国債・地方債等	5,200,000	22,400,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの 其他(注)	990,647	9,384,052	1,683,297	3,372
合計	9,679,377	31,784,052	1,683,297	3,372

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(平成28年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	9,619,679	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券				
国債・地方債等	7,600,000	22,100,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの 其他(注)	995,984	11,352,737	851,097	1,017
合計	18,215,663	33,452,737	851,097	1,017

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(平成27年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)

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

当事業年度（平成28年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	29,720,965	29,976,040	255,074
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,720,965	29,976,040	255,074
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		29,720,965	29,976,040	255,074

2. その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,882,680	5,808,946	73,733
	国債・地方債等	5,882,680	5,808,946	73,733
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,418,711	4,470,989	1,947,721
	小計	12,301,391	10,279,936	2,021,454
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	989,229	1,118,670	129,440
	小計	989,229	1,118,670	129,440
	合計	13,290,620	11,398,606	1,892,014

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

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

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

2．簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

（2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 215,268 千円

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、44,254千円であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

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

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

2．簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用

220,314 千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、46,819千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金負債合計	442,659	340,929
繰延税金資産(は負債)の純額	13,483	170,956

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率 (調整)	35.64 %	法定実効税率 (調整)	33.06 %
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.09	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.07
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.26	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.15
住民税均等割	0.09	住民税均等割	0.05
税率変更に伴う影響	1.63	税率変更に伴う影響	0.71
特定外国子会社留保金課税	0.44	特定外国子会社留保金課税	0.16
所得拡大促進税制による特別控除額	0.37	所得拡大促進税制による特別控除額	0.35
評価性引当額の増加	0.03	評価性引当額の増減	0.76
その他	0.03	外国税額控除	0.08
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.33	その他	0.00
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.70

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.34%から平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.63%に、それぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が33,334千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が63,097千円、その他有価証券評価差額金が29,763千円、それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	4,553,051

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	4,199,085

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等
前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	200,000	生命保険業	(被所有)直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,566,369	未収運用受託報酬	600,637
								投資助言報酬の受取	632,716	未収投資助言報酬	143,284

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

(1株当たり情報)

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

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。
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26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第22期中間会計期間末
(平成28年9月30日現在)

資産の部

流動資産

現金・預金		15,063,257
有価証券		6,100,434
前払費用		332,057
未収委託者報酬		3,387,820
未収運用受託報酬		1,987,018
未収投資助言報酬		77,619
繰延税金資産		235,224
その他		12,300
流動資産合計		27,195,731

固定資産

有形固定資産	1	177,912
無形固定資産		939,013
投資その他の資産		
投資有価証券		32,061,699
関係会社株式		66,222
差入保証金		285,884
繰延税金資産		358,138
その他		56
投資その他の資産合計		32,772,001

固定資産合計 33,888,927

資産合計 61,084,658

負債の部

流動負債

預り金		34,656
未払収益分配金		2,498
未払償還金		83,820
未払手数料		1,148,447

未払運用委託報酬		732,230
未払投資助言報酬		460,615
その他未払金		205,555
未払費用		162,124
未払法人税等		1,392,159
前受投資助言報酬		46,905
賞与引当金		412,947
その他	2	203,375
流動負債合計		<u>4,885,336</u>
固定負債		
退職給付引当金		1,473,953
役員退職慰労引当金		20,525
固定負債合計		<u>1,494,478</u>
負債合計		<u>6,379,815</u>
純資産の部		
株主資本		
資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		<u>8,281,840</u>
利益剰余金		
利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		34,819,634
利益剰余金合計		<u>35,499,441</u>
株主資本合計		<u>53,781,281</u>
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		923,561
評価・換算差額等合計		<u>923,561</u>
純資産合計		<u>54,704,843</u>
負債・純資産合計		<u>61,084,658</u>

(2)中間損益計算書

（単位：千円）

第22期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）	
営業収益	
委託者報酬	12,190,330
運用受託報酬	4,378,762
投資助言報酬	282,418
営業収益計	16,851,511
営業費用	8,389,290
一般管理費	1 3,636,282
営業利益	4,825,938
営業外収益	2 156,270
営業外費用	3 17,987
経常利益	4,964,221
特別利益	4 277,431
特別損失	5 7,077
税引前中間純利益	5,234,575
法人税、住民税及び事業税	1,327,094
法人税等調整額	238,395
法人税等合計	1,565,490
中間純利益	3,669,085

(3)中間株主資本等変動計算書

第22期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

（単位：千円）

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				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					利益剰余金合計
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,548
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-	-	8,207	8,207	8,207
遡及処理後当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,286,108	31,965,915	50,247,755
当中間期変動額										

剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,669,085	3,669,085	3,669,085
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,533,525	3,533,525	3,533,525
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	34,819,634	35,499,441	53,781,281

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	8,207
遡及処理後当期首残高	1,309,858	1,309,858	51,557,614
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
中間純利益	-	-	3,669,085
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	386,296	386,296	386,296
当中間期変動額合計	386,296	386,296	3,147,228
当中間期末残高	923,561	923,561	54,704,843

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第22期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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>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（ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 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。 なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5. 消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

（会計方針の変更）

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

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

回収可能性適用指針の適用については、回収可能性適用指針第49項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点において回収可能性適用指針第49項(3) から に該当する定めを適用し

た場合の繰延税金資産の額と、前事業年度末の繰延税金資産の額との差額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に加算しております。

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

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

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

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

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

(中間貸借対照表関係)

第22期中間会計期末 (平成28年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	767,987千円
2.消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

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

事故損失賠償金	4,746千円
投資有価証券売却損	2,080千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第22期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）					
1．発行済株式の種類及び総数					
	当事業年度期首 株式数（千株）	当中間会計期間増加 株式数（千株）	当中間会計期間減少 株式数（千株）	当中間会計期間末 株式数（千株）	
発行済株式					
普通株式	108	-	-	108	
合計	108	-	-	108	
2．配当に関する事項 配当金支払額					
（決議）	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成28年6月24日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成28年3月31日	平成28年6月24日

（金融商品関係）

第22期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日（中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金 有価証券	15,063,257	15,063,257	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

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

有価証券

中間決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

中間決算日の市場価格等によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

(有価証券関係)

第22期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	25,116,403	25,339,500	223,096
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	25,116,403	25,339,500	223,096
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		25,116,403	25,339,500	223,096

2. その他有価証券

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

中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,807,626	5,876,090	68,463
	国債・地方債等	5,807,626	5,876,090	68,463
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	2,505,459	4,016,701	1,511,241
	小計	8,313,086	9,892,791	1,579,705
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	3,331,200	3,085,438	245,761
	小計	3,331,200	3,085,438	245,761
	合計	11,644,286	12,978,229	1,333,943

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

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

（デリバティブ取引関係）

第22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1．サービスごとの情報

当社のサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	3,669,085千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	3,669,085千円
期中平均株式数	108千株

(重要な後発事象)

第22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成28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28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28年9月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
岡三オンライン証券株式会社	1,000百万円	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。
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
フィデリティ証券株式会社	7,657百万円	
松井証券株式会社	11,944百万円	
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28年6月3日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成29年1月12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27年1月21日から平成28年1月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、<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28年1月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成28年11月29日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第22期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日を

もって終了する中間会計期間(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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