

平成26年10月期（平成26年4月8日～平成26年10月7日）決算短信

平成26年11月19日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信  
 コード番号 ( 1598 )  
 連動対象指標 Russell/Nomuraファンダメンタル・プライム・インデックス(配当除く)  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 1口  
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>  
 代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫  
 問合せ先責任者 投信ディスクロージャー部長 村山 治子 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成26年12月18日  
 分配金支払開始日 平成26年11月14日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年10月期の運用状況（平成26年4月8日～平成26年10月7日）

(1)資産内訳 (百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
平成26年10月期	5,030	(98.2)	93	(1.8)	5,124	(100)
平成26年4月期	1,988	(97.6)	49	(2.4)	2,038	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前特定期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当特定期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成26年10月期	149	199	0	349
平成26年4月期	-	149	0	149

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当り基準価額 (③/①)
	百万円	百万円	百万円	円
平成26年10月期	5,173	49	5,124	14,650
平成26年4月期	2,060	22	2,038	13,602

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成26年10月期	120.00
平成26年4月期	143.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有  無   
 ② ①以外の変更 有  無

## II 財務諸表等

## NEXT FUNDS R/N ファンダメンタル・インデックス上場投信

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 1 期 (平成 26 年 4 月 7 日現在)	第 2 期 (平成 26 年 10 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	26,229,272	50,897,270
株式	1,988,806,100	5,030,831,000
派生商品評価勘定	1,707,648	121,516
未収入金	21,315,000	43,107,020
未収配当金	22,438,383	45,658,166
未収利息	52	80
差入委託証拠金	-	3,301,000
流動資産合計	2,060,496,455	5,173,916,052
資産合計	2,060,496,455	5,173,916,052
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,186,863
前受金	590,000	-
未払収益分配金	21,426,691	41,971,800
未払受託者報酬	56,051	816,517
未払委託者報酬	280,246	4,082,533
その他未払費用	111,521	1,687,482
流動負債合計	22,464,509	49,745,195
負債合計	22,464,509	49,745,195
純資産の部		
元本等		
元本	1,997,177,373	4,662,017,685
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	40,854,573	462,153,172
(分配準備積立金)	39,574	101,531
元本等合計	2,038,031,946	5,124,170,857
純資産合計	2,038,031,946	5,124,170,857
負債純資産合計	2,060,496,455	5,173,916,052

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 1 期 自 平成 26 年 3 月 19 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日
営業収益		
受取配当金	22,438,383	48,718,542
受取利息	700	14,981
有価証券売買等損益	39,101,662	220,492,831
派生商品取引等損益	1,707,648	3,008,169

その他収益	-	13,507
営業収益合計	63,248,393	272,248,030
営業費用		
受託者報酬	56,051	816,517
委託者報酬	280,246	4,082,533
その他費用	636,521	1,814,223
営業費用合計	972,818	6,713,273
営業利益又は営業損失(△)	62,275,575	265,534,757
経常利益又は経常損失(△)	62,275,575	265,534,757
当期純利益又は当期純損失(△)	62,275,575	265,534,757
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	-	40,854,573
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,689	197,735,642
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,689	197,735,642
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	21,426,691	41,971,800
期末剰余金又は期末欠損金(△)	40,854,573	462,153,172

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 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、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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ております。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る場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における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市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成26年4月8日から平成26年10月7日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 平成26年4月7日現在	第2期 平成26年10月7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 149,837口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 349,765口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 13,602円	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 14,650円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自平成26年3月19日 至平成26年4月7日	第2期 自平成26年4月8日 至平成26年10月7日
----------------------------------	----------------------------------

## 1. 分配金の計算過程

項目		
当期配当等収益額	A	22,439,083 円
分配準備積立金	B	0 円
配当等収益合計額	C=A+B	22,439,083 円
経費	D	972,818 円
収益分配可能額	E=C-D	21,466,265 円
収益分配金	F	21,426,691 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	39,574 円
口数	H	149,837 口
1口当たり分配金	I=F/H	143 円

## 2. その他費用

その他費用のうち 100,885 円は、対象指数についての商標使用料であります。

## 1. 分配金の計算過程

項目		
当期配当等収益額	A	48,747,030 円
分配準備積立金	B	39,574 円
配当等収益合計額	C=A+B	48,786,604 円
経費	D	6,713,273 円
収益分配可能額	E=C-D	42,073,331 円
収益分配金	F	41,971,800 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	101,531 円
口数	H	349,765 口
1口当たり分配金	I=F/H	120 円

## 2. その他費用

その他費用のうち 1,469,680 円は、対象指数についての商標使用料であります。

## (金融商品に関する注記)

## (1) 金融商品の状況に関する事項

第 1 期 自 平成 26 年 3 月 19 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日
<p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 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。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

第 1 期 平成 26 年 4 月 7 日現在	第 2 期 平成 26 年 10 月 7 日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p>

<p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>
---	-----------------------------

## (関連当事者との取引に関する注記)

<p>第1期 自 平成 26 年 3 月 19 日 至 平成 26 年 4 月 7 日</p>	<p>第2期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日</p>
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

<p>第1期 自 平成 26 年 3 月 19 日 至 平成 26 年 4 月 7 日</p>	<p>第2期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日</p>
期首元本額	-円
期中追加設定元本額	1,997,177,373円
期中一部交換元本額	0円

<p>第1期 自 平成 26 年 3 月 19 日 至 平成 26 年 4 月 7 日</p>	<p>第2期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日</p>
期首元本額	1,997,177,373円
期中追加設定元本額	2,664,840,312円
期中一部交換元本額	0円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成 26 年 3 月 19 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	第2期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日
	損益に含まれた評価差額 (円)	損益に含まれた評価差額 (円)
株式	38,721,123	215,970,563
合計	38,721,123	215,970,563

## 3 デリバティブ取引関係

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第1期(平成 26 年 4 月 7 日現在)			第2期(平成 26 年 10 月 7 日現在)				
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	46,190,000	-	47,900,000	1,707,648	91,676,000	-	90,615,000	△1,065,347
合計	46,190,000	-	47,900,000	1,707,648	91,676,000	-	90,615,000	△1,065,347

(注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

(1) 株式(平成 26 年 10 月 7 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	日本水産	7,200	296.00	2,131,200	
		マルハニチロ	1,200	1,611.00	1,933,200	
		国際石油開発帝石	13,000	1,464.00	19,032,000	
		石油資源開発	500	3,995.00	1,997,500	
		ミライト・ホールディングス	1,400	1,219.00	1,706,600	
		コムシスホールディングス	2,200	1,799.00	3,957,800	
		ミサワホーム	800	1,094.00	875,200	
		大成建設	12,000	590.00	7,080,000	
		大林組	8,000	717.00	5,736,000	
		清水建設	9,000	820.00	7,380,000	
		長谷工コーポレーション	4,300	817.00	3,513,100	
		鹿島建設	11,000	504.00	5,544,000	
		西松建設	5,000	477.00	2,385,000	
		前田建設工業	2,000	875.00	1,750,000	
		奥村組	3,000	620.00	1,860,000	
		戸田建設	4,000	508.00	2,032,000	
		大東建託	1,800	12,700.00	22,860,000	
		NIPPO	1,000	1,985.00	1,985,000	
		前田道路	1,000	1,664.00	1,664,000	
		五洋建設	5,200	355.00	1,846,000	
		住友林業	3,100	1,153.00	3,574,300	
		パナホーム	2,000	741.00	1,482,000	
		大和ハウス工業	5,800	1,963.00	11,385,400	
		積水ハウス	8,300	1,277.50	10,603,250	
		関電工	3,000	521.00	1,563,000	
		きんでん	3,000	1,090.00	3,270,000	
		協和エクシオ	1,700	1,359.00	2,310,300	
		日揮	1,000	2,841.00	2,841,000	
千代田化工建設	1,000	1,149.00	1,149,000			
日本製粉	3,000	529.00	1,587,000			

日清製粉グループ本社	3,850	1,054.00	4,057,900
山崎製パン	3,000	1,442.00	4,326,000
カルビー	400	3,500.00	1,400,000
森永乳業	7,000	358.00	2,506,000
ヤクルト本社	500	5,550.00	2,775,000
明治ホールディングス	1,100	8,700.00	9,570,000
雪印メグミルク	1,200	1,419.00	1,702,800
日本ハム	4,000	2,379.00	9,516,000
伊藤ハム	4,000	529.00	2,116,000
丸大食品	4,000	435.00	1,740,000
サッポロホールディングス	4,000	427.00	1,708,000
アサヒグループホールディングス	3,600	3,210.50	11,557,800
キリンホールディングス	12,800	1,434.00	18,355,200
宝ホールディングス	1,700	812.00	1,380,400
コカ・コーラウエスト	1,600	1,590.00	2,544,000
サントリー食品インターナショナル	500	3,875.00	1,937,500
伊藤園	1,000	2,288.00	2,288,000
日清オイリオグループ	4,000	382.00	1,528,000
不二製油	800	1,688.00	1,350,400
キッコーマン	1,000	2,244.00	2,244,000
味の素	10,000	1,895.50	18,955,000
キューピー	2,100	1,821.00	3,824,100
ハウス食品グループ本社	1,100	1,874.00	2,061,400
カゴメ	800	1,721.00	1,376,800
ニチレイ	5,000	439.00	2,195,000
東洋水産	1,300	3,690.00	4,797,000
日清食品ホールディングス	900	5,890.00	5,301,000
日本たばこ産業	9,500	3,602.50	34,223,750
ゲンゼ	5,000	305.00	1,525,000
東洋紡	13,000	154.00	2,002,000
日清紡ホールディングス	3,000	882.00	2,646,000
帝人	27,000	260.00	7,020,000
東レ	19,000	701.70	13,332,300
ワコールホールディングス	2,000	1,084.00	2,168,000
オンワードホールディングス	2,000	643.00	1,286,000

王子ホールディングス	14,000	394.00	5,516,000
日本製紙	1,700	1,603.00	2,725,100
北越紀州製紙	3,600	432.00	1,555,200
大王製紙	3,000	928.00	2,784,000
レンゴー	5,000	492.00	2,460,000
クラレ	5,200	1,301.00	6,765,200
旭化成	18,000	910.90	16,396,200
昭和電工	39,000	141.00	5,499,000
住友化学	33,000	375.00	12,375,000
日産化学工業	1,800	1,891.00	3,403,800
クレハ	3,000	537.00	1,611,000
日本曹達	2,000	573.00	1,146,000
東ソー	8,000	442.00	3,536,000
トクヤマ	7,000	332.00	2,324,000
セントラル硝子	5,000	368.00	1,840,000
東亜合成	4,000	442.00	1,768,000
電気化学工業	9,000	349.00	3,141,000
信越化学工業	4,000	6,970.00	27,880,000
エア・ウォーター	2,000	1,631.00	3,262,000
大陽日酸	4,000	962.00	3,848,000
日本触媒	2,000	1,187.00	2,374,000
カネカ	6,000	612.00	3,672,000
三菱瓦斯化学	4,000	687.00	2,748,000
三井化学	26,000	311.00	8,086,000
J S R	2,900	1,954.00	5,666,600
東京応化工業	600	2,883.00	1,729,800
三菱ケミカルホールディングス	36,100	530.50	19,151,050
ダイセル	5,000	1,193.00	5,965,000
住友ベークライト	5,000	432.00	2,160,000
積水化学工業	6,000	1,245.00	7,470,000
日本ゼオン	1,000	1,103.00	1,103,000
アイカ工業	500	2,282.00	1,141,000
宇部興産	24,000	169.00	4,056,000
日立化成	2,100	1,903.00	3,996,300
日本化薬	1,000	1,342.00	1,342,000

ADEKA	1,300	1,397.00	1,816,100
日油	2,000	679.00	1,358,000
花王	6,700	4,252.50	28,491,750
日本ペイントホールディングス	1,000	2,332.00	2,332,000
関西ペイント	2,000	1,538.00	3,076,000
DIC	10,000	240.00	2,400,000
東洋インキSCホールディングス	3,000	502.00	1,506,000
富士フイルムホールディングス	10,600	3,595.00	38,107,000
資生堂	5,000	1,772.50	8,862,500
ライオン	3,000	586.00	1,758,000
コーセー	400	4,445.00	1,778,000
小林製薬	200	6,670.00	1,334,000
日東電工	1,700	5,924.00	10,070,800
エフピコ	300	3,015.00	904,500
ニフコ	500	3,330.00	1,665,000
ユニ・チャーム	1,700	2,560.00	4,352,000
協和発酵キリン	3,000	1,319.00	3,957,000
武田薬品工業	12,400	4,678.00	58,007,200
アステラス製薬	31,200	1,660.50	51,807,600
大日本住友製薬	1,200	1,332.00	1,598,400
塩野義製薬	2,400	2,526.00	6,062,400
田辺三菱製薬	1,500	1,637.00	2,455,500
中外製薬	1,700	3,235.00	5,499,500
科研製薬	1,000	2,523.00	2,523,000
エーザイ	3,300	4,358.50	14,383,050
ロート製薬	800	1,484.00	1,187,200
小野薬品工業	900	9,400.00	8,460,000
久光製薬	400	3,765.00	1,506,000
持田製薬	200	7,340.00	1,468,000
参天製薬	700	6,130.00	4,291,000
ツムラ	500	2,393.00	1,196,500
沢井製薬	100	6,280.00	628,000
第一三共	10,500	1,670.00	17,535,000
キョーリン製薬ホールディングス	600	2,243.00	1,345,800
大塚ホールディングス	4,600	3,875.50	17,827,300

大正製薬ホールディングス	300	7,360.00	2,208,000
昭和シェル石油	4,600	1,014.00	4,664,400
コスモ石油	27,000	181.00	4,887,000
東燃ゼネラル石油	8,000	952.00	7,616,000
出光興産	3,200	2,266.00	7,251,200
J Xホールディングス	87,900	493.70	43,396,230
横浜ゴム	3,000	940.00	2,820,000
東洋ゴム工業	900	1,767.00	1,590,300
ブリヂストン	6,000	3,595.50	21,573,000
住友ゴム工業	2,300	1,544.00	3,551,200
旭硝子	24,000	572.20	13,732,800
日本板硝子	32,000	112.00	3,584,000
日本電気硝子	12,000	500.00	6,000,000
住友大阪セメント	5,000	351.00	1,755,000
太平洋セメント	9,000	395.00	3,555,000
東海カーボン	4,000	296.00	1,184,000
TOTO	3,000	1,187.00	3,561,000
日本碍子	2,000	2,499.00	4,998,000
日本特殊陶業	1,400	2,973.00	4,162,200
新日鐵住金	67,000	272.70	18,270,900
神戸製鋼所	45,000	169.00	7,605,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	10,300	2,065.00	21,269,500
日新製鋼	1,000	931.00	931,000
東京製鐵	2,100	554.00	1,163,400
大和工業	400	3,460.00	1,384,000
淀川製鋼所	3,000	425.00	1,275,000
丸一鋼管	600	2,565.00	1,539,000
大同特殊鋼	4,000	416.00	1,664,000
愛知製鋼	2,000	391.00	782,000
日立金属	1,000	1,899.00	1,899,000
大平洋金属	3,000	365.00	1,095,000
日本軽金属ホールディングス	9,400	154.00	1,447,600
三井金属鉱業	13,000	292.00	3,796,000
三菱マテリアル	20,000	349.00	6,980,000
住友金属鉱山	9,000	1,480.50	13,324,500

DOWAホールディングス	3,000	893.00	2,679,000
古河電気工業	20,000	201.00	4,020,000
住友電気工業	12,200	1,557.50	19,001,500
フジクラ	8,000	502.00	4,016,000
SUMCO	2,300	1,210.00	2,783,000
東洋製罐グループホールディングス	2,400	1,292.00	3,100,800
三和ホールディングス	2,300	760.00	1,748,000
LIXILグループ	3,800	2,261.00	8,591,800
リンナイ	300	8,900.00	2,670,000
日本発條	2,700	1,017.00	2,745,900
日本製鋼所	5,000	407.00	2,035,000
アマダ	3,100	994.00	3,081,400
DMG森精機	800	1,335.00	1,068,000
ディスコ	200	7,320.00	1,464,000
ナブテスコ	700	2,600.00	1,820,000
SMC	200	29,955.00	5,991,000
小松製作所	9,400	2,445.00	22,983,000
住友重機械工業	10,000	577.00	5,770,000
日立建機	1,200	2,089.00	2,506,800
クボタ	7,000	1,601.50	11,210,500
荏原製作所	6,000	638.00	3,828,000
ダイキン工業	1,500	6,471.00	9,706,500
栗田工業	1,900	2,349.00	4,463,100
ダイフク	900	1,292.00	1,162,800
平和	1,000	2,142.00	2,142,000
SANKYO	700	3,830.00	2,681,000
アマノ	1,000	1,131.00	1,131,000
グローリー	800	2,902.00	2,321,600
セガサミーホールディングス	2,100	1,655.00	3,475,500
ホンザキ電機	300	5,040.00	1,512,000
日本精工	4,000	1,482.00	5,928,000
NTN	6,000	502.00	3,012,000
ジェイテクト	2,700	1,755.00	4,738,500
THK	1,000	2,690.00	2,690,000
マキタ	1,000	5,920.00	5,920,000

日立造船	1,700	634.00	1,077,800
三菱重工業	32,000	669.90	21,436,800
I H I	11,000	556.00	6,116,000
イビデン	3,100	1,703.00	5,279,300
コニカミノルタ	10,700	1,167.00	12,486,900
ブラザー工業	4,600	1,948.00	8,960,800
ミネベア	4,000	1,413.00	5,652,000
日立製作所	86,000	828.20	71,225,200
東芝	56,000	475.60	26,633,600
三菱電機	20,000	1,393.50	27,870,000
富士電機	7,000	485.00	3,395,000
安川電機	1,200	1,402.00	1,682,400
東芝テック	2,000	677.00	1,354,000
マブチモーター	300	9,460.00	2,838,000
日本電産	1,900	7,110.00	13,509,000
JVCケンウッド	8,100	262.00	2,122,200
オムロン	1,600	4,925.00	7,880,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,000	593.00	1,779,000
日本電気	63,000	373.00	23,499,000
富士通	61,000	693.00	42,273,000
沖電気工業	6,000	263.00	1,578,000
セイコーエプソン	2,400	5,200.00	12,480,000
パナソニック	62,800	1,276.00	80,132,800
シャープ	26,000	295.00	7,670,000
ソニー	21,500	1,913.00	41,129,500
TDK	2,500	5,930.00	14,825,000
ミツミ電機	3,800	763.00	2,899,400
アルプス電気	3,500	1,857.00	6,499,500
ホンデン	4,700	580.00	2,726,000
ヒロセ電機	200	13,540.00	2,708,000
アルパイン	1,000	1,783.00	1,783,000
船井電機	1,100	1,108.00	1,218,800
横河電機	1,500	1,377.00	2,065,500
アズビル	1,000	2,588.00	2,588,000
日本光電工業	300	5,510.00	1,653,000

堀場製作所	400	3,910.00	1,564,000
アドバンテスト	1,400	1,368.00	1,915,200
キーエンス	100	47,680.00	4,768,000
シスメックス	400	4,285.00	1,714,000
スタンレー電気	1,900	2,234.00	4,244,600
ウシオ電機	1,500	1,118.00	1,677,000
カンオ計算機	3,100	1,684.00	5,220,400
ファナック	900	19,230.00	17,307,000
ローム	1,800	6,690.00	12,042,000
浜松ホトニクス	500	4,930.00	2,465,000
新光電気工業	1,300	754.00	980,200
京セラ	3,400	4,924.50	16,743,300
太陽誘電	1,500	1,171.00	1,756,500
村田製作所	1,600	11,935.00	19,096,000
小糸製作所	1,200	2,911.00	3,493,200
キヤノン	24,800	3,503.00	86,874,400
リコー	12,400	1,150.00	14,260,000
トヨタ紡織	1,500	1,104.00	1,656,000
ユニプレス	900	2,085.00	1,876,500
豊田自動織機	1,800	5,130.00	9,234,000
デンソー	4,400	4,962.50	21,835,000
東海理化電機製作所	900	2,295.00	2,065,500
三井造船	14,000	250.00	3,500,000
川崎重工業	12,000	428.00	5,136,000
日産自動車	37,700	1,021.00	38,491,700
いすゞ自動車	5,800	1,466.00	8,502,800
トヨタ自動車	18,500	6,366.00	117,771,000
日野自動車	1,900	1,518.00	2,884,200
三菱自動車工業	4,800	1,256.00	6,028,800
武蔵精密工業	400	2,069.00	827,600
日産車体	1,200	1,652.00	1,982,400
日信工業	700	1,685.00	1,179,500
タチエス	700	1,470.00	1,029,000
NOK	1,500	2,568.00	3,852,000
フタバ産業	3,200	602.00	1,926,400

カヤバ工業	2,000	478.00	956,000
プレス工業	2,000	441.00	882,000
カルソニックカンセイ	4,000	575.00	2,300,000
ケーヒン	1,000	1,390.00	1,390,000
アイシン精機	2,900	3,910.00	11,339,000
マツダ	3,400	2,601.00	8,843,400
ダイハツ工業	3,300	1,624.00	5,359,200
本田技研工業	21,200	3,591.00	76,129,200
スズキ	5,700	3,331.50	18,989,550
富士重工業	2,700	3,476.00	9,385,200
ヤマハ発動機	4,200	2,087.00	8,765,400
ショーワ	1,100	1,043.00	1,147,300
豊田合成	1,200	2,041.00	2,449,200
日本精機	1,000	2,285.00	2,285,000
エフ・シー・シー	600	1,702.00	1,021,200
シマノ	500	13,090.00	6,545,000
タカタ	500	2,344.00	1,172,000
テイ・エス テック	500	2,454.00	1,227,000
テルモ	1,800	2,595.00	4,671,000
島津製作所	2,000	980.00	1,960,000
ニコン	4,500	1,529.00	6,880,500
オリンパス	800	3,795.00	3,036,000
HOYA	5,400	3,618.50	19,539,900
シチズンホールディングス	4,200	692.00	2,906,400
ニプロ	1,100	888.00	976,800
バンダイナムコホールディングス	3,000	2,771.00	8,313,000
トッパン・フォームズ	1,100	1,083.00	1,191,300
タカラトミー	2,100	621.00	1,304,100
凸版印刷	14,000	767.00	10,738,000
大日本印刷	14,000	1,080.00	15,120,000
アシックス	1,200	2,458.00	2,949,600
ヤマハ	2,400	1,414.00	3,393,600
リンテック	800	2,304.00	1,843,200
任天堂	2,400	11,525.00	27,660,000
コクヨ	1,900	855.00	1,624,500

東京電力	60,300	370.00	22,311,000
中部電力	18,400	1,214.50	22,346,800
関西電力	17,500	978.90	17,130,750
中国電力	6,200	1,376.00	8,531,200
北陸電力	4,600	1,383.00	6,361,800
東北電力	8,900	1,187.00	10,564,300
四国電力	4,200	1,338.00	5,619,600
九州電力	7,700	1,087.00	8,369,900
北海道電力	3,500	804.00	2,814,000
沖縄電力	400	3,300.00	1,320,000
電源開発	2,300	3,455.00	7,946,500
東京瓦斯	35,000	594.30	20,800,500
大阪瓦斯	32,000	429.90	13,756,800
東邦瓦斯	7,000	588.00	4,116,000
東武鉄道	15,000	544.00	8,160,000
相鉄ホールディングス	5,000	393.00	1,965,000
東京急行電鉄	11,000	689.00	7,579,000
京浜急行電鉄	2,000	888.00	1,776,000
小田急電鉄	4,000	971.00	3,884,000
京王電鉄	5,000	791.00	3,955,000
京成電鉄	2,000	1,126.00	2,252,000
東日本旅客鉄道	3,700	8,151.00	30,158,700
西日本旅客鉄道	3,000	4,951.00	14,853,000
東海旅客鉄道	1,400	14,590.00	20,426,000
西日本鉄道	4,000	419.00	1,676,000
近畿日本鉄道	13,000	360.00	4,680,000
阪急阪神ホールディングス	13,000	625.00	8,125,000
南海電気鉄道	5,000	506.00	2,530,000
京阪電気鉄道	5,000	465.00	2,325,000
名古屋鉄道	13,000	440.00	5,720,000
日本通運	20,000	448.00	8,960,000
ヤマトホールディングス	4,800	2,049.50	9,837,600
山九	7,000	555.00	3,885,000
日本梱包運輸倉庫	600	1,832.00	1,099,200
セイノーホールディングス	3,000	844.00	2,532,000

日立物流	900	1,426.00	1,283,400
日本郵船	35,000	283.00	9,905,000
商船三井	18,000	344.00	6,192,000
川崎汽船	22,000	229.00	5,038,000
日本航空	2,200	2,925.00	6,435,000
ANAホールディングス	45,000	246.40	11,088,000
三菱倉庫	1,000	1,535.00	1,535,000
住友倉庫	2,000	575.00	1,150,000
上組	4,000	1,028.00	4,112,000
近鉄エクスプレス	300	4,165.00	1,249,500
I Tホールディングス	2,300	1,773.00	4,077,900
野村総合研究所	900	3,415.00	3,073,500
フジ・メディア・ホールディングス	2,400	1,518.00	3,643,200
オービック	400	3,820.00	1,528,000
ヤフー	6,700	416.00	2,787,200
トレンドマイクロ	900	3,560.00	3,204,000
日本オラクル	500	4,245.00	2,122,500
伊藤忠テクノソリューションズ	500	4,440.00	2,220,000
大塚商会	500	4,340.00	2,170,000
ネットワンシステムズ	2,900	625.00	1,812,500
日本ユニシス	1,200	947.00	1,136,400
東京放送ホールディングス	1,900	1,176.00	2,234,400
日本テレビホールディングス	1,700	1,621.00	2,755,700
テレビ朝日ホールディングス	600	1,712.00	1,027,200
スカパーJ S A Tホールディングス	2,500	643.00	1,607,500
日本電信電話	23,400	6,538.00	152,989,200
K D D I	8,200	6,609.00	54,193,800
光通信	200	7,390.00	1,478,000
N T T ドコモ	27,400	1,752.00	48,004,800
東宝	900	2,417.00	2,175,300
エヌ・ティ・ティ・データ	2,400	3,945.00	9,468,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	700	2,219.00	1,553,300
カプコン	600	1,660.00	996,000
S C S K	500	2,921.00	1,460,500
コナミ	1,300	2,163.00	2,811,900

ソフトバンク	4,000	7,467.00	29,868,000
双日	61,700	166.00	10,242,200
アルフレッサ ホールディングス	4,300	1,534.00	6,596,200
ダイワボウホールディングス	7,000	212.00	1,484,000
第一興商	700	3,000.00	2,100,000
メディパルホールディングス	5,200	1,331.00	6,921,200
黒田電気	800	1,602.00	1,281,600
伊藤忠商事	36,200	1,266.50	45,847,300
丸紅	38,300	719.50	27,556,850
長瀬産業	2,900	1,321.00	3,830,900
豊田通商	4,400	2,564.00	11,281,600
兼松	12,000	171.00	2,052,000
三井物産	44,700	1,662.00	74,291,400
日立ハイテクノロジーズ	1,300	3,085.00	4,010,500
カメイ	1,800	788.00	1,418,400
住友商事	28,200	1,157.50	32,641,500
三菱商事	41,400	2,148.00	88,927,200
キャノンマーケティングジャパン	1,800	2,099.00	3,778,200
三谷商事	600	2,696.00	1,617,600
阪和興業	7,000	387.00	2,709,000
岩谷産業	5,000	734.00	3,670,000
三愛石油	4,000	760.00	3,040,000
稲畑産業	1,400	1,047.00	1,465,800
東邦ホールディングス	1,100	1,988.00	2,186,800
サンゲツ	600	2,787.00	1,672,200
伊藤忠エネクス	3,100	698.00	2,163,800
リョーサン	1,200	2,349.00	2,818,800
三信電気	2,300	797.00	1,833,100
P a l t a c	1,300	1,361.00	1,769,300
日鉄住金物産	5,000	401.00	2,005,000
オートバックスセブン	1,800	1,679.00	3,022,200
加藤産業	700	2,278.00	1,594,600
因幡電機産業	400	3,620.00	1,448,000
ミスミグループ本社	400	3,165.00	1,266,000
スズケン	1,800	3,115.00	5,607,000

ローソン	700	7,410.00	5,187,000
カワチ薬品	500	1,883.00	941,500
ゲオホールディングス	1,400	959.00	1,342,600
アダストリアホールディングス	300	2,293.00	687,900
日本マクドナルドホールディングス	900	2,638.00	2,374,200
エディオン	6,500	768.00	4,992,000
DCMホールディングス	2,800	757.00	2,119,600
J. フロント リテイリング	3,200	1,375.00	4,400,000
マツモトキヨシホールディングス	700	3,220.00	2,254,000
三越伊勢丹ホールディングス	4,400	1,401.00	6,164,400
セブン&アイ・ホールディングス	13,400	4,136.00	55,422,400
ツルハホールディングス	500	6,120.00	3,060,000
良品計画	200	13,580.00	2,716,000
コーナン商事	1,200	1,244.00	1,492,800
ドンキホーテホールディングス	400	6,260.00	2,504,000
ゼンショーホールディングス	900	973.00	875,700
スギホールディングス	400	4,630.00	1,852,000
ファミリーマート	800	4,200.00	3,360,000
上新電機	1,000	953.00	953,000
島忠	900	2,543.00	2,288,700
コメリ	600	2,350.00	1,410,000
青山商事	1,000	2,516.00	2,516,000
しまむら	300	9,880.00	2,964,000
高島屋	5,000	914.00	4,570,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,500	1,776.00	4,440,000
丸井グループ	3,400	894.00	3,039,600
ダイエー	19,100	127.00	2,425,700
イオン	13,100	1,110.00	14,541,000
ユニグループ・ホールディングス	9,100	573.00	5,214,300
イズミ	600	3,560.00	2,136,000
平和堂	700	1,858.00	1,300,600
ケーズホールディングス	1,400	3,305.00	4,627,000
ヤマダ電機	47,600	332.00	15,803,200
ニトリホールディングス	700	6,880.00	4,816,000
吉野家ホールディングス	1,300	1,320.00	1,716,000

アークス	800	2,288.00	1,830,400
バロー	1,000	1,786.00	1,786,000
ファーストリテイリング	100	36,965.00	3,696,500
サンドラッグ	300	4,815.00	1,444,500
じもとホールディングス	11,900	220.00	2,618,000
東京TYフィナンシャルグループ	400	3,210.00	1,284,000
新生銀行	28,000	234.00	6,552,000
あおぞら銀行	14,000	364.00	5,096,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	522,900	610.00	318,969,000
りそなホールディングス	222,100	603.10	133,948,510
三井住友トラスト・ホールディングス	41,000	443.70	18,191,700
三井住友フィナンシャルグループ	44,500	4,391.00	195,399,500
第四銀行	13,000	378.00	4,914,000
北越銀行	9,000	209.00	1,881,000
西日本シティ銀行	16,000	283.00	4,528,000
千葉銀行	7,000	737.00	5,159,000
横浜銀行	22,000	584.60	12,861,200
常陽銀行	9,000	524.00	4,716,000
群馬銀行	3,000	616.00	1,848,000
武蔵野銀行	700	3,540.00	2,478,000
筑波銀行	3,600	363.00	1,306,800
七十七銀行	22,000	571.00	12,562,000
青森銀行	9,000	329.00	2,961,000
秋田銀行	6,000	301.00	1,806,000
山形銀行	3,000	515.00	1,545,000
岩手銀行	900	4,725.00	4,252,500
東邦銀行	18,000	399.00	7,182,000
ふくおかフィナンシャルグループ	15,000	502.00	7,530,000
静岡銀行	5,000	1,067.00	5,335,000
十六銀行	9,000	395.00	3,555,000
スルガ銀行	700	2,097.00	1,467,900
八十二銀行	10,000	632.00	6,320,000
山梨中央銀行	9,000	457.00	4,113,000
大垣共立銀行	8,000	291.00	2,328,000

福井銀行	5,000	261.00	1,305,000
北國銀行	4,000	366.00	1,464,000
滋賀銀行	3,000	584.00	1,752,000
南都銀行	7,000	431.00	3,017,000
百五銀行	11,000	438.00	4,818,000
京都銀行	6,000	864.00	5,184,000
紀陽銀行	1,700	1,534.00	2,607,800
ほくほくフィナンシャルグループ	64,000	207.00	13,248,000
広島銀行	13,000	522.00	6,786,000
山陰合同銀行	4,000	768.00	3,072,000
中国銀行	4,700	1,539.00	7,233,300
伊予銀行	3,500	1,071.00	3,748,500
百十四銀行	7,000	344.00	2,408,000
四国銀行	9,000	229.00	2,061,000
阿波銀行	5,000	648.00	3,240,000
鹿児島銀行	2,000	672.00	1,344,000
大分銀行	6,000	407.00	2,442,000
肥後銀行	5,000	603.00	3,015,000
佐賀銀行	5,000	246.00	1,230,000
十八銀行	9,000	291.00	2,619,000
沖縄銀行	600	4,600.00	2,760,000
琉球銀行	1,900	1,678.00	3,188,200
セブン銀行	5,400	437.00	2,359,800
みずほフィナンシャルグループ	1,414,000	195.70	276,719,800
山口フィナンシャルグループ	5,000	1,011.00	5,055,000
東日本銀行	5,000	267.00	1,335,000
愛媛銀行	11,000	241.00	2,651,000
みなと銀行	7,000	215.00	1,505,000
京葉銀行	2,000	539.00	1,078,000
栃木銀行	3,000	422.00	1,266,000
トモニホールディングス	5,700	448.00	2,553,600
フィデアホールディングス	13,100	228.00	2,986,800
池田泉州ホールディングス	4,600	560.00	2,576,000
SBIホールディングス	2,000	1,166.00	2,332,000
大和証券グループ本社	36,000	824.00	29,664,000

野村ホールディングス	13,400	620.90	8,320,060
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	3,200	2,587.00	8,278,400
MS & AD インシュアランスグループホール	4,200	2,317.00	9,731,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	5,600	1,710.00	9,576,000
第一生命保険	21,500	1,569.00	33,733,500
東京海上ホールディングス	7,900	3,364.00	26,575,600
T & D ホールディングス	7,100	1,363.00	9,677,300
クレディセゾン	1,300	2,048.00	2,662,400
日本証券金融	1,700	605.00	1,028,500
アイフル	7,600	411.00	3,123,600
イオンフィナンシャルサービス	500	2,150.00	1,075,000
ジャックス	4,000	547.00	2,188,000
オリックス	10,600	1,428.00	15,136,800
三菱UFJリース	2,800	545.00	1,526,000
野村不動産ホールディングス	700	1,828.00	1,279,600
東急不動産ホールディングス	4,000	716.00	2,864,000
飯田グループホールディングス	700	1,346.00	942,200
パーク 2 4	600	1,742.00	1,045,200
三井不動産	3,000	3,118.50	9,355,500
三菱地所	4,000	2,302.00	9,208,000
東京建物	2,000	838.00	1,676,000
住友不動産	1,000	3,587.00	3,587,000
大京	8,000	195.00	1,560,000
レオパレス 2 1	2,400	569.00	1,365,600
イオンモール	500	1,959.00	979,500
日本空港ビルデング	500	4,205.00	2,102,500
総合警備保障	700	2,468.00	1,727,600
ディー・エヌ・エー	1,400	1,308.00	1,831,200
博報堂DYホールディングス	4,400	1,069.00	4,703,600
ケネディクス	2,000	449.00	898,000
電通	2,600	3,980.00	10,348,000
みらかホールディングス	600	4,485.00	2,691,000
オリエンタルランド	300	21,330.00	6,399,000
ダスキン	1,100	1,779.00	1,956,900

	ラウンドワン	1,900	657.00	1,248,300	
	ユー・エス・エス	2,100	1,609.00	3,378,900	
	エイチ・アイ・エス	400	2,738.00	1,095,200	
	セコム	2,000	6,355.00	12,710,000	
	メイテック	400	3,050.00	1,220,000	
	アサツー ディ・ケイ	800	2,706.00	2,164,800	
	ベネッセホールディングス	1,200	3,525.00	4,230,000	
	小計 銘柄数：560			5,030,831,000	
	組入時価比率：98.2%			100.0%	
	合計			5,030,831,000	

(注 1) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2) 株式以外の有価証券(平成 26 年 10 月 7 日現在)

該当事項はありません。

## 第 2 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

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。