

平成27年4月期（平成26年10月8日～平成27年4月7日）決算短信

平成27年5月19日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信
 コード番号 (1591)
 連動対象指標 JPX日経インデックス400
 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 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成27年6月30日
 分配金支払開始日 平成27年5月15日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年4月期の運用状況（平成26年10月8日～平成27年4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27年4月期	209,990	(98.2)	3,875	(1.8)	213,866	(100)
平成26年10月期	99,148	(98.2)	1,789	(1.8)	100,938	(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27年4月期	8,595	12,092	5,801	14,887
平成26年10月期	2,098	6,693	196	8,595

(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27年4月期	219,244	5,377	213,866	14,366
平成26年10月期	101,794	855	100,938	11,743

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成27年4月期	111.00
平成26年10月期	87.00

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 JPX日経インデックス400連動型上場投信

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (平成26年10月7日現在)	第3期 (平成27年4月7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,026,717,296	5,761,593,169
株式	99,148,842,090	209,990,844,100
派生商品評価勘定	1,184,781	105,727,036
未収入金	763,993,678	1,667,979,777
未収配当金	788,277,657	1,638,878,877
未収利息	1,614	3,467
その他未収収益	-	2,250,634
差入委託証拠金	65,431,000	76,872,100
流動資産合計	101,794,448,116	219,244,149,160
資産合計	101,794,448,116	219,244,149,160
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,499,616	-
未払収益分配金	747,824,682	1,652,499,624
未払受託者報酬	16,759,759	45,281,776
未払委託者報酬	50,279,237	136,517,105
未払利息	-	111,895
有価証券貸借取引受入金	-	3,520,050,565
その他未払費用	17,565,293	22,922,498
流動負債合計	855,928,587	5,377,383,463
負債合計	855,928,587	5,377,383,463
純資産の部		
元本等		
元本	99,933,445,436	173,080,726,384
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,005,074,093	40,786,039,313
(分配準備積立金)	4,578,709	6,625,444
元本等合計	100,938,519,529	213,866,765,697
純資産合計	100,938,519,529	213,866,765,697
負債純資産合計	101,794,448,116	219,244,149,160

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 自 平成26年4月8日 至 平成26年10月7日	第3期 自 平成26年10月8日 至 平成27年4月7日
営業収益		
受取配当金	833,689,809	1,887,330,040

受取利息	162,131	1,081,511
有価証券売買等損益	3,415,851,174	33,341,756,560
派生商品取引等損益	16,053,946	428,891,583
その他収益	207,003	8,311,754
営業収益合計	4,265,964,063	35,667,371,448
営業費用		
支払利息	-	358,920
受託者報酬	16,759,759	45,281,776
委託者報酬	50,279,237	136,517,105
その他費用	16,101,436	60,019,145
営業費用合計	83,140,432	242,176,946
営業利益又は営業損失(△)	4,182,823,631	35,425,194,502
経常利益又は経常損失(△)	4,182,823,631	35,425,194,502
当期純利益又は当期純損失(△)	4,182,823,631	35,425,194,502
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(△)	△1,597,283,241	1,005,074,093
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	10,972,000,168
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	10,972,000,168
剰余金減少額又は欠損金増加額	832,641,615	4,963,729,826
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	67,154,038	4,963,729,826
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	765,487,577	-
分配金	747,824,682	1,652,499,624
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,005,074,093	40,786,039,313

(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 10 月 8 日から平成 27 年 4 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 2 期	第 3 期
-------	-------

平成 26 年 10 月 7 日現在	平成 27 年 4 月 7 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 8,595,686 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 14,887,384 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 11,743 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 14,366 円
	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 3,375,020,450 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日	第 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>834,058,943 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>1,484,880 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>835,543,823 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>83,140,432 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>752,403,391 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>747,824,682 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>4,578,709 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>8,595,686 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>87 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	834,058,943 円	分配準備積立金	B	1,484,880 円	配当等収益合計額	C=A+B	835,543,823 円	経費	D	83,140,432 円	収益分配可能額	E=C-D	752,403,391 円	収益分配金	F	747,824,682 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,578,709 円	口数	H	8,595,686 口	1 口当たり分配金	I=F/H	87 円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,896,364,385 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>4,578,709 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>1,900,943,094 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>241,818,026 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>1,659,125,068 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>1,652,499,624 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>6,625,444 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>14,887,384 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>111 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1,896,364,385 円	分配準備積立金	B	4,578,709 円	配当等収益合計額	C=A+B	1,900,943,094 円	経費	D	241,818,026 円	収益分配可能額	E=C-D	1,659,125,068 円	収益分配金	F	1,652,499,624 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,625,444 円	口数	H	14,887,384 口	1 口当たり分配金	I=F/H	111 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	834,058,943 円																																																											
分配準備積立金	B	1,484,880 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	835,543,823 円																																																											
経費	D	83,140,432 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	752,403,391 円																																																											
収益分配金	F	747,824,682 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,578,709 円																																																											
口数	H	8,595,686 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	87 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	1,896,364,385 円																																																											
分配準備積立金	B	4,578,709 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	1,900,943,094 円																																																											
経費	D	241,818,026 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	1,659,125,068 円																																																											
収益分配金	F	1,652,499,624 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,625,444 円																																																											
口数	H	14,887,384 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	111 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち 13,407,751 円は対象指数についての商標 使用料であります。	2. その他費用 その他費用のうち 35,309,187 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 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日	第 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 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。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
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。 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。 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。 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。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
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。 ○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。 ○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	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

組入制限等の管理を行なっております。

○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なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 2 期 平成 26 年 10 月 7 日現在	第 3 期 平成 27 年 4 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>2. 時価の算定方法 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>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 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日	第 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日
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

第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日	第 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日
期首元本額 24,402,183,432 円	期首元本額 99,933,445,436 円
期中追加設定元本額 77,820,154,006 円	期中追加設定元本額 140,592,427,432 円
期中一部交換元本額 2,288,892,002 円	期中一部交換元本額 67,445,146,484 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日	第 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 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	2,962,793,891	29,494,265,829
合計	2,962,793,891	29,494,265,829

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 2 期(平成 26 年 10 月 7 日現在)			第 3 期(平成 27 年 4 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	1,769,806,000	—	1,747,575,000	△22,314,835	3,736,176,100	—
				3,842,336,000	105,727,036	

合計	1,769,806,000	—	1,747,575,000	△22,314,835	3,736,176,100	—	3,842,336,000	105,727,036
----	---------------	---	---------------	-------------	---------------	---	---------------	-------------

(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27年4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	国際石油開発帝石	737,300	1,386.50	1,022,266,450	
		安藤・間	93,400	653.00	60,990,200	
		コムシスホールディングス	62,300	1,534.00	95,568,200	
		ミサワホーム	16,500	1,084.00	17,886,000	
		大成建設	727,000	674.00	489,998,000	貸付有価証券 20,000株(20,000株)
		長谷工コーポレーション	175,000	1,243.00	217,525,000	
		鹿島建設	615,000	567.00	348,705,000	貸付有価証券 16,000株
		大東建託	53,100	13,995.00	743,134,500	
		N I P P O	32,000	1,926.00	61,632,000	
		住友林業	103,200	1,338.00	138,081,600	
		大和ハウス工業	409,800	2,475.00	1,014,255,000	
		積水ハウス	434,900	1,769.00	769,338,100	
		協和エクシオ	59,400	1,321.00	78,467,400	
		日揮	141,000	2,401.00	338,541,000	貸付有価証券 9,000株(4,000株)
		東芝プラントシステム	22,700	1,637.00	37,159,900	
		千代田化工建設	101,000	1,035.00	104,535,000	
		日清製粉グループ本社	153,500	1,460.00	224,110,000	
		カルビー	51,800	5,430.00	281,274,000	
		ヤクルト本社	75,000	8,790.00	659,250,000	
		明治ホールディングス	41,500	15,820.00	656,530,000	
日本ハム	103,000	2,813.00	289,739,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)		

アサヒグループホールディングス	281,300	3,951.00	1,111,416,300	
麒麟ホールディングス	567,200	1,615.00	916,028,000	
伊藤園	41,500	2,648.00	109,892,000	貸付有価証券 10,600株(100株)
キッコーマン	114,000	4,115.00	469,110,000	
味の素	323,000	2,744.50	886,473,500	
キューピー	71,200	3,415.00	243,148,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
ニチレイ	149,000	686.00	102,214,000	
東洋水産	73,100	4,240.00	309,944,000	
日清食品ホールディングス	59,200	5,860.00	346,912,000	
日本たばこ産業	670,600	3,893.50	2,610,981,100	貸付有価証券 8,500株(8,500株)
東レ	1,012,000	1,008.00	1,020,096,000	
王子ホールディングス	537,000	524.00	281,388,000	
クラレ	222,700	1,659.00	369,459,300	
旭化成	816,000	1,146.00	935,136,000	
昭和電工	871,000	153.00	133,263,000	
日産化学工業	85,800	2,433.00	208,751,400	
東ソー	326,000	648.00	211,248,000	
東亜合成	164,000	546.00	89,544,000	
電気化学工業	271,000	481.00	130,351,000	
信越化学工業	234,600	7,836.00	1,838,325,600	
エア・ウォーター	116,000	2,218.00	257,288,000	
大陽日酸	168,000	1,664.00	279,552,000	貸付有価証券 62,000株
日本パーカライジング	61,700	1,443.00	89,033,100	
日本触媒	103,000	1,712.00	176,336,000	
J S R	129,200	2,209.00	285,402,800	
三菱ケミカルホールディングス	817,900	729.00	596,249,100	
日本合成化学工業	31,000	833.00	25,823,000	貸付有価証券 3,000株
ダイセル	184,000	1,436.00	264,224,000	
積水化学工業	303,000	1,669.00	505,707,000	
日本ゼオン	113,000	1,167.00	131,871,000	
アイカ工業	39,300	2,750.00	108,075,000	
宇部興産	659,000	187.00	123,233,000	

日立化成	64,700	2,562.00	165,761,400	
日本化薬	85,000	1,538.00	130,730,000	
花王	351,900	6,207.00	2,184,243,300	
日本ペイントホールディングス	113,200	4,290.00	485,628,000	
関西ペイント	159,000	2,226.00	353,934,000	
D I C	524,000	371.00	194,404,000	
東洋インキ S C ホールディングス	129,000	556.00	71,724,000	
富士フイルムホールディングス	299,400	4,443.00	1,330,234,200	
資生堂	232,700	2,303.50	536,024,450	貸付有価証券 4,200 株 (4,200 株)
ドクターシーラボ	8,900	4,460.00	39,694,000	貸付有価証券 1,300 株 (1,300 株)
小林製薬	21,400	8,680.00	185,752,000	
日東電工	101,100	8,100.00	818,910,000	
エフピコ	15,500	4,650.00	72,075,000	貸付有価証券 5,300 株
ニフコ	29,200	4,385.00	128,042,000	貸付有価証券 11,700 株
ユニ・チャーム	264,900	3,232.00	856,156,800	
協和発酵キリン	157,000	1,661.00	260,777,000	
武田薬品工業	490,200	5,949.00	2,916,199,800	貸付有価証券 1,800 株 (1,800 株)
アステラス製薬	1,490,000	1,961.00	2,921,890,000	
塩野義製薬	204,300	4,175.00	852,952,500	貸付有価証券 1,400 株 (1,400 株)
田辺三菱製薬	152,400	2,024.00	308,457,600	
中外製薬	130,200	3,905.00	508,431,000	
科研製薬	45,000	3,820.00	171,900,000	
エーザイ	172,500	8,438.00	1,455,555,000	貸付有価証券 1,200 株 (1,200 株)
ロート製薬	59,500	1,698.00	101,031,000	
小野薬品工業	59,400	13,420.00	797,148,000	
久光製薬	36,900	4,860.00	179,334,000	
持田製薬	9,300	7,970.00	74,121,000	
参天製薬	240,400	1,680.00	403,872,000	
ツムラ	41,200	2,962.00	122,034,400	貸付有価証券 10,700 株
沢井製薬	20,700	6,970.00	144,279,000	
第一三共	440,000	1,887.00	830,280,000	貸付有価証券 60,300 株

キョーリン製薬ホールディングス	34,900	2,874.00	100,302,600	
大塚ホールディングス	259,600	3,807.00	988,297,200	
大正製薬ホールディングス	31,500	8,860.00	279,090,000	
昭和シェル石油	116,900	1,096.00	128,122,400	
東燃ゼネラル石油	197,000	1,065.00	209,805,000	貸付有価証券 48,000株
出光興産	62,100	2,140.00	132,894,000	
JXホールディングス	1,451,800	482.50	700,493,500	
横浜ゴム	146,000	1,232.00	179,872,000	
東洋ゴム工業	59,200	2,337.00	138,350,400	
ブリヂストン	410,000	5,060.00	2,074,600,000	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
住友ゴム工業	102,000	2,220.00	226,440,000	貸付有価証券 13,600株(13,600株)
旭硝子	644,000	779.00	501,676,000	
日本電気硝子	251,000	575.00	144,325,000	貸付有価証券 58,000株
太平洋セメント	816,000	368.00	300,288,000	
TOTO	192,000	1,664.00	319,488,000	
日本特殊陶業	112,700	3,155.00	355,568,500	
ニチアス	58,000	695.00	40,310,000	貸付有価証券 23,000株(20,000株)
新日鐵住金	5,529,000	301.80	1,668,652,200	
ジェイ エフ イー ホールディングス	333,600	2,726.50	909,560,400	
大同特殊鋼	219,000	544.00	119,136,000	
日立金属	133,000	1,801.00	239,533,000	
三井金属鉱業	356,000	275.00	97,900,000	
三菱マテリアル	816,000	410.00	334,560,000	
住友金属鉱山	361,000	1,787.50	645,287,500	
DOWAホールディングス	156,000	1,044.00	162,864,000	
住友電気工業	492,700	1,578.00	777,480,600	
アサヒホールディングス	19,700	2,110.00	41,567,000	
LIXILグループ	194,300	2,725.00	529,467,500	貸付有価証券 3,800株
リンナイ	24,300	8,770.00	213,111,000	
ジーテクト	11,900	1,139.00	13,554,100	

日本発條	113,600	1,290.00	146,544,000	貸付有価証券 8,100株
日本製鋼所	187,000	516.00	96,492,000	
オーエスジー	59,500	2,394.00	142,443,000	貸付有価証券 20,500株 (20,500 株)
ディスコ	15,200	12,330.00	187,416,000	
ニューフレアテクノロジー	1,900	5,300.00	10,070,000	貸付有価証券 600株 (100株)
ナブテスコ	79,600	3,310.00	263,476,000	
S M C	39,200	37,265.00	1,460,788,000	
小松製作所	648,200	2,504.00	1,623,092,800	貸付有価証券 14,700株 (14,700 株)
住友重機械工業	358,000	822.00	294,276,000	
日立建機	58,400	2,140.00	124,976,000	貸付有価証券 13,800株
クボタ	630,000	1,992.50	1,255,275,000	
荏原製作所	271,000	510.00	138,210,000	貸付有価証券 6,000株 (6,000株)
ダイキン工業	181,900	8,078.00	1,469,388,200	
栗田工業	73,900	3,040.00	224,656,000	
椿本チエイン	67,000	1,030.00	69,010,000	
タダノ	60,000	1,599.00	95,940,000	
平和	27,100	2,444.00	66,232,400	
SANKYO	37,900	4,410.00	167,139,000	
ユニバーサルエンターテインメント	12,400	1,933.00	23,969,200	貸付有価証券 2,600株
セガサミーホールディングス	134,200	1,802.00	241,828,400	
T P R	13,900	3,120.00	43,368,000	
ホシザキ電機	36,500	8,120.00	296,380,000	
日本精工	256,600	1,800.00	461,880,000	
ジェイテクト	133,100	1,812.00	241,177,200	貸付有価証券 700株 (700株)
不二越	116,000	700.00	81,200,000	
T H K	83,100	3,135.00	260,518,500	
マキタ	81,500	6,270.00	511,005,000	
三菱重工業	2,094,000	666.40	1,395,441,600	
I H I	900,000	524.00	471,600,000	
コニカミノルタ	297,700	1,265.00	376,590,500	
ブラザー工業	161,500	1,969.00	317,993,500	

ミネベア	186,000	1,872.00	348,192,000	
日立製作所	2,999,000	827.30	2,481,072,700	貸付有価証券 14,000株(14,000 株)
東芝	2,630,000	492.70	1,295,801,000	貸付有価証券 65,000株(65,000 株)
三菱電機	1,249,000	1,494.50	1,866,630,500	
富士電機	347,000	574.00	199,178,000	
安川電機	149,100	1,748.00	260,626,800	貸付有価証券 36,400株
日本電産	133,300	8,102.00	1,079,996,600	貸付有価証券 600株
オムロン	134,900	5,350.00	721,715,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	241,000	543.00	130,863,000	貸付有価証券 1,000株
富士通	1,204,000	854.30	1,028,577,200	貸付有価証券 33,000株(33,000 株)
沖電気工業	432,000	252.00	108,864,000	
セイコーエプソン	170,500	2,181.00	371,860,500	
ワコム	98,300	592.00	58,193,600	貸付有価証券 8,300株
パナソニック	1,522,200	1,593.00	2,424,864,600	
アンリツ	75,000	810.00	60,750,000	
富士通ゼネラル	38,000	1,551.00	58,938,000	貸付有価証券 15,000株(10,000 株)
TDK	75,400	8,640.00	651,456,000	
ヒロセ電機	21,215	15,810.00	335,409,150	貸付有価証券 2,500株
横河電機	125,000	1,402.00	175,250,000	
日本光電工業	53,200	3,310.00	176,092,000	
堀場製作所	23,100	4,690.00	108,339,000	
キーエンス	28,300	65,930.00	1,865,819,000	貸付有価証券 600株(600株)
シスメックス	96,700	6,920.00	669,164,000	
スタンレー電気	89,600	2,761.00	247,385,600	
カシオ計算機	125,200	2,326.00	291,215,200	貸付有価証券 50,400株(6,300株)
ファナック	130,000	27,225.00	3,539,250,000	
浜松ホトニクス	104,000	3,725.00	387,400,000	
京セラ	205,000	6,673.00	1,367,965,000	
村田製作所	131,100	17,430.00	2,285,073,000	

小糸製作所	74,800	3,565.00	266,662,000	
ミツバ	23,000	2,613.00	60,099,000	
キヤノン	724,200	4,460.00	3,229,932,000	
リコー	375,600	1,322.50	496,731,000	
トヨタ紡織	43,700	1,544.00	67,472,800	
鬼怒川ゴム工業	29,000	534.00	15,486,000	
ユニプレス	24,000	2,464.00	59,136,000	
豊田自動織機	113,700	7,130.00	810,681,000	
デンソー	308,600	5,467.00	1,687,116,200	貸付有価証券 900株(900株)
三井造船	483,000	204.00	98,532,000	
川崎重工業	908,000	608.00	552,064,000	
名村造船所	23,800	1,164.00	27,703,200	
日産自動車	1,753,300	1,223.50	2,145,162,550	
いすゞ自動車	394,900	1,585.50	626,113,950	
トヨタ自動車	403,500	8,410.00	3,393,435,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
日野自動車	178,300	1,659.00	295,799,700	
三菱自動車工業	457,800	1,096.00	501,748,800	貸付有価証券 6,900株(6,900株)
NOK	60,400	3,695.00	223,178,000	
カヤバ工業	140,000	441.00	61,740,000	
大同メタル工業	17,400	1,339.00	23,298,600	
カルソニックカンセイ	95,000	830.00	78,850,000	
アイシン精機	114,300	4,455.00	509,206,500	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
マツダ	372,300	2,321.50	864,294,450	
ダイハツ工業	149,100	1,827.00	272,405,700	貸付有価証券 32,300株(900株)
本田技研工業	700,100	4,046.50	2,832,954,650	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
スズキ	261,100	3,644.50	951,578,950	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
富士重工業	425,100	4,130.50	1,755,875,550	
ヤマハ発動機	190,000	2,976.00	565,440,000	
エクセディ	17,000	2,857.00	48,569,000	
豊田合成	40,300	2,717.00	109,495,100	貸付有価証券 12,500株(12,500株)
エフ・シー・シー	18,400	1,912.00	35,180,800	
シマノ	53,900	18,400.00	991,760,000	

テイ・エス テック	26,400	3,305.00	87,252,000	
テルモ	191,500	3,185.00	609,927,500	
ニコン	233,200	1,677.00	391,076,400	貸付有価証券 85,700株(600株)
HOYA	297,200	4,947.00	1,470,248,400	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
バンダイナムコホールディングス	137,800	2,485.00	342,433,000	
アシックス	124,100	3,215.00	398,981,500	貸付有価証券 44,000株(3,700株)
ピジョン	23,600	10,590.00	249,924,000	
電源開発	90,500	4,030.00	364,715,000	貸付有価証券 10,000株
東京瓦斯	1,518,000	781.60	1,186,468,800	
大阪瓦斯	1,293,000	507.40	656,068,200	
東武鉄道	667,000	586.00	390,862,000	
相鉄ホールディングス	285,000	581.00	165,585,000	
東京急行電鉄	679,000	776.00	526,904,000	
小田急電鉄	400,000	1,258.00	503,200,000	
京王電鉄	349,000	975.00	340,275,000	
京成電鉄	187,000	1,535.00	287,045,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
東日本旅客鉄道	228,900	10,300.00	2,357,670,000	
西日本旅客鉄道	120,200	6,569.00	789,593,800	
東海旅客鉄道	111,900	22,670.00	2,536,773,000	
西日本鉄道	215,000	547.00	117,605,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
近鉄グループホールディングス	1,257,000	443.00	556,851,000	
阪急阪神ホールディングス	838,000	758.00	635,204,000	貸付有価証券 82,000株(82,000株)
京阪電気鉄道	373,000	734.00	273,782,000	貸付有価証券 81,000株
名古屋鉄道	606,000	494.00	299,364,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
日本通運	494,000	703.00	347,282,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
ヤマトホールディングス	219,600	2,838.50	623,334,600	
山九	152,000	539.00	81,928,000	
日立物流	26,000	1,930.00	50,180,000	
ANAホールディングス	2,455,000	328.00	805,240,000	
上組	149,000	1,198.00	178,502,000	

近鉄エクスプレス	11,200	5,650.00	63,280,000	
グリーン	74,700	819.00	61,179,300	貸付有価証券 27,100株(13,300 株)
ティーガイア	12,300	1,630.00	20,049,000	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	312,800	440.00	137,632,000	貸付有価証券 122,300株(122,300 株)
インターネットイニシア ティブ	19,900	1,969.00	39,183,100	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
野村総合研究所	69,800	4,615.00	322,127,000	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
フジ・メディア・ホール ディングス	128,400	1,740.00	223,416,000	
オービック	42,500	5,440.00	231,200,000	
ヤフー	883,500	505.00	446,167,500	貸付有価証券 83,400株
トレンドマイクロ	65,300	4,075.00	266,097,500	貸付有価証券 600株
日本オラクル	19,700	5,330.00	105,001,000	
伊藤忠テクノソリューシ ョンズ	27,900	2,499.00	69,722,100	
大塚商会	33,200	5,230.00	173,636,000	
U S E N	72,300	382.00	27,618,600	貸付有価証券 18,300株
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	24,400	1,894.00	46,213,600	貸付有価証券 3,100株
日本テレビホールディン グス	112,600	2,101.00	236,572,600	
日本電信電話	390,400	7,643.00	2,983,827,200	
K D D I	1,252,400	2,840.50	3,557,442,200	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
光通信	11,100	8,310.00	92,241,000	
N T T ドコモ	1,015,800	2,165.50	2,199,714,900	
GMOインターネット	41,100	1,504.00	61,814,400	貸付有価証券 1,800株
東宝	88,000	3,110.00	273,680,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	76,200	5,340.00	406,908,000	
S C S K	29,300	3,540.00	103,722,000	
コナミ	50,100	2,240.00	112,224,000	
ソフトバンク	353,600	7,090.00	2,507,024,000	
双日	825,200	204.00	168,340,800	
アルフレッサ ホールデ ィングス	145,800	1,741.00	253,837,800	

シップヘルスケアホールディングス	22,500	2,814.00	63,315,000	
三菱食品	13,500	2,493.00	33,655,500	
第一興商	29,300	3,960.00	116,028,000	
メディパルホールディングス	123,300	1,597.00	196,910,100	
伊藤忠商事	1,031,900	1,325.00	1,367,267,500	貸付有価証券 11,900株(11,900株)
丸紅	1,078,500	703.10	758,293,350	
豊田通商	137,300	3,310.00	454,463,000	
兼松	246,000	177.00	43,542,000	
三井物産	1,045,200	1,603.50	1,675,978,200	
日立ハイテクノロジーズ	42,700	3,530.00	150,731,000	
山善	47,300	986.00	46,637,800	
住友商事	727,600	1,317.50	958,613,000	
三菱商事	944,800	2,453.50	2,318,066,800	
岩谷産業	136,000	811.00	110,296,000	貸付有価証券 32,000株(1,000株)
東邦ホールディングス	42,500	2,201.00	93,542,500	貸付有価証券 5,900株(5,900株)
サンリオ	34,500	3,290.00	113,505,000	貸付有価証券 12,600株(3,600株)
日鉄住金物産	108,000	411.00	44,388,000	
ミスミグループ本社	46,100	4,705.00	216,900,500	
ローソン	46,700	8,280.00	386,676,000	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
エービーシー・マート	17,500	7,350.00	128,625,000	貸付有価証券 700株
ゲオホールディングス	23,200	1,300.00	30,160,000	
日本マクドナルドホールディングス	51,600	2,664.00	137,462,400	貸付有価証券 19,000株(1,700株)
パル	7,200	3,455.00	24,876,000	
セリア	14,700	4,335.00	63,724,500	貸付有価証券 5,200株
MonotaRO	24,100	4,330.00	104,353,000	
J.フロントリテイリング	156,000	1,910.00	297,960,000	
マツモトキヨシホールディングス	27,500	4,515.00	124,162,500	
スタートトゥデイ	38,400	3,090.00	118,656,000	
三越伊勢丹ホールディングス	245,100	2,116.00	518,631,600	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
ウエルシアホールディング	14,800	4,770.00	70,596,000	

グス				
コスモス薬品	6,200	18,290.00	113,398,000	貸付有価証券 100株
セブン&アイ・ホールディングス	515,700	5,217.00	2,690,406,900	
ツルハホールディングス	26,300	9,330.00	245,379,000	
良品計画	15,200	17,730.00	269,496,000	
ドンキホーテホールディングス	39,800	9,930.00	395,214,000	
VTホールディングス	50,900	556.00	28,300,400	
ユナイテッドアローズ	16,100	3,715.00	59,811,500	貸付有価証券 5,700株 (1,200株)
スギホールディングス	22,100	6,050.00	133,705,000	
ファミリーマート	41,700	5,120.00	213,504,000	貸付有価証券 12,900株 (2,900株)
AOKIホールディングス	28,300	1,718.00	48,619,400	
コメリ	21,100	2,830.00	59,713,000	
しまむら	14,300	11,530.00	164,879,000	
高島屋	179,000	1,216.00	217,664,000	
イオン	492,400	1,356.50	667,940,600	貸付有価証券 193,800株 (11,700株)
ユニグループ・ホールディングス	118,000	674.00	79,532,000	貸付有価証券 22,700株 (5,700株)
イズミ	27,500	4,340.00	119,350,000	
ケーズホールディングス	28,400	3,900.00	110,760,000	貸付有価証券 4,000株
アインファーマシーズ	14,800	4,825.00	71,410,000	
ヤマダ電機	487,300	489.00	238,289,700	貸付有価証券 164,000株 (98,300株)
ニトリホールディングス	53,300	8,960.00	477,568,000	
王将フードサービス	9,000	4,275.00	38,475,000	
アークス	28,600	2,754.00	78,764,400	
バロー	26,600	2,598.00	69,106,800	
ファーストリテイリング	24,700	47,540.00	1,174,238,000	貸付有価証券 100株 (100株)
サンドラッグ	26,000	6,340.00	164,840,000	
新生銀行	1,173,000	238.00	279,174,000	
あおぞら銀行	832,000	423.00	351,936,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,223,500	788.00	3,328,118,000	貸付有価証券 25,400株 (25,400株)

りそなホールディングス	1,442,200	610.00	879,742,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,725,000	502.00	1,367,950,000	
三井住友フィナンシャルグループ	583,500	4,676.50	2,728,737,750	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
西日本シティ銀行	433,000	357.00	154,581,000	
千葉銀行	475,000	905.00	429,875,000	
横浜銀行	827,000	736.90	609,416,300	
常陽銀行	446,000	627.00	279,642,000	
群馬銀行	292,000	822.00	240,024,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	500,000	637.00	318,500,000	
静岡銀行	361,000	1,221.00	440,781,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
十六銀行	206,000	450.00	92,700,000	
スルガ銀行	130,200	2,619.00	340,993,800	
八十二銀行	297,000	873.00	259,281,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	839,000	276.00	231,564,000	
広島銀行	364,000	671.00	244,244,000	
中国銀行	118,300	1,832.00	216,725,600	貸付有価証券 200株(200株)
伊予銀行	175,800	1,447.00	254,382,600	
セブン銀行	415,700	608.00	252,745,600	
みずほフィナンシャルグループ	12,732,900	215.00	2,737,573,500	
山口フィナンシャルグループ	164,000	1,425.00	233,700,000	貸付有価証券 57,000株(57,000株)
北洋銀行	185,700	457.00	84,864,900	
京葉銀行	135,000	702.00	94,770,000	
大和証券グループ本社	1,153,000	966.70	1,114,605,100	
野村ホールディングス	2,520,300	714.50	1,800,754,350	
岡三証券グループ	105,000	961.00	100,905,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	141,500	939.00	132,868,500	
松井証券	62,700	1,110.00	69,597,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	118,100	2,075.00	245,057,500	
第一生命保険	789,800	1,826.00	1,442,174,800	
東京海上ホールディングス	507,400	4,770.00	2,420,298,000	

T&Dホールディングス	449,300	1,738.00	780,883,400	
クレディセゾン	100,700	2,222.00	223,755,400	
芙蓉総合リース	12,900	5,120.00	66,048,000	
興銀リース	23,200	2,590.00	60,088,000	
東京センチュリーリース	28,900	3,890.00	112,421,000	
Jトラスト	36,800	1,048.00	38,566,400	
アイフル	206,300	408.00	84,170,400	貸付有価証券 83,100株(8,500株)
リコーリース	9,700	3,650.00	35,405,000	貸付有価証券 900株
イオンフィナンシャルサービス	80,900	3,055.00	247,149,500	貸付有価証券 32,600株
アコム	247,600	396.00	98,049,600	貸付有価証券 99,800株(29,600株)
日立キャピタル	24,200	2,597.00	62,847,400	
オリックス	872,700	1,767.50	1,542,497,250	
三菱UFJリース	312,700	625.00	195,437,500	
日本取引所グループ	181,000	3,655.00	661,555,000	
ヒューリック	208,100	1,425.00	296,542,500	貸付有価証券 38,600株
野村不動産ホールディングス	74,100	2,338.00	173,245,800	
東急不動産ホールディングス	323,100	893.00	288,528,300	
飯田グループホールディングス	79,900	1,616.00	129,118,400	
パーク24	62,000	2,511.00	155,682,000	
三井不動産	654,000	3,678.50	2,405,739,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
三菱地所	917,000	2,871.50	2,633,165,500	
住友不動産	295,000	4,585.00	1,352,575,000	
大京	196,000	185.00	36,260,000	
レオパレス21	134,800	652.00	87,889,600	
住友不動産販売	8,900	3,355.00	29,859,500	
タカラレーベン	54,600	804.00	43,898,400	
イオンモール	79,500	2,500.00	198,750,000	貸付有価証券 10,700株(10,700株)
エス・ティ・ティ都市開発	76,600	1,307.00	100,116,200	
アコーディア・ゴルフ	49,100	1,168.00	57,348,800	
テンブホールディングス	25,700	3,910.00	100,487,000	貸付有価証券

				400 株
カカクコム	86,000	1,964.00	168,904,000	貸付有価証券 30,300 株 (30,300 株)
エムスリー	112,900	2,468.00	278,637,200	
ディー・エヌ・エー	64,300	2,488.00	159,978,400	貸付有価証券 22,600 株
博報堂DYホールディングス	180,800	1,359.00	245,707,200	
電通	145,400	5,450.00	792,430,000	
みらかホールディングス	34,300	5,690.00	195,167,000	
オリエンタルランド	141,100	9,371.00	1,322,248,100	貸付有価証券 15,500 株
リゾートトラスト	48,100	3,340.00	160,654,000	貸付有価証券 11,900 株
もしもしホットライン	24,300	1,392.00	33,825,600	
ユー・エス・エス	157,900	2,163.00	341,537,700	
サイバーエージェント	31,900	6,840.00	218,196,000	
楽天	567,300	2,235.50	1,268,199,150	
リロ・ホールディング	5,900	11,300.00	66,670,000	
エイチ・アイ・エス	21,300	4,325.00	92,122,500	貸付有価証券 1,500 株
セコム	126,700	8,197.00	1,038,559,900	
ベネッセホールディングス	47,700	3,775.00	180,067,500	
イオンディライト	12,600	2,968.00	37,396,800	
小計	銘柄数：399		209,990,844,100	
	組入時価比率：98.2%		100.0%	
合計			209,990,844,100	

(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。

(注 2) 備考欄の貸付有価証券の () 内は、委託者の利害関係人である野村証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(平成 27 年 4 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。