

平成27年7月期（平成26年7月9日～平成27年7月8日）決算短信

平成27年8月19日

上場取引所 東証

ファンド名 日経225連動型上場投資信託
 コード番号 (1321)
 連動対象指標 日経平均株価
 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9月30日
 分配金支払開始日 平成27年8月14日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年7月期の運用状況（平成26年7月9日～平成27年7月8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7月期	2,996,550	(98.8)	35,510	(1.2)	3,032,061	(100)
平成26年7月期	1,892,525	(98.7)	24,050	(1.3)	1,916,575	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成27年7月期	123,274	64,654	36,998	150,930
平成26年7月期	102,380	46,249	25,355	123,274

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数) × 10
	百万円	百万円	百万円	円
平成27年7月期	3,175,011	142,950	3,032,061	200,891
平成26年7月期	2,027,959	111,383	1,916,575	155,473

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成27年7月期	2,300.00
平成26年7月期	1,990.00

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

日経 2 2 5 連動型上場投資信託

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 13 期	第 14 期
	(平成 26 年 7 月 8 日現在)	(平成 27 年 7 月 8 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	132,404,033,805	173,368,705,935
株式	1,892,525,209,000	2,996,550,949,800
派生商品評価勘定	273,050,966	-
未収入金	295,907,380	-
未収配当金	1,731,530,000	2,799,624,000
未収利息	86,610	139,762
その他未収収益	11,205,629	11,110,681
差入委託証拠金	718,637,000	2,281,060,000
流動資産合計	2,027,959,660,390	3,175,011,590,178
資産合計	2,027,959,660,390	3,175,011,590,178
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,404,259,454
未払金	-	1,002,945,580
未払収益分配金	24,531,576,546	34,713,986,250
未払受託者報酬	585,532,784	798,291,238
未払委託者報酬	1,583,702,736	2,487,714,614
未払利息	3,941,218	2,853,334
有価証券貸借取引受入金	84,659,489,775	102,510,402,277
その他未払費用	19,720,263	29,872,718
流動負債合計	111,383,963,322	142,950,325,465
負債合計	111,383,963,322	142,950,325,465
純資産の部		
元本等		
元本	1,517,136,243,978	1,857,500,125,125
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	399,439,453,090	1,174,561,139,588
(分配準備積立金)	42,022,437	102,780,340
元本等合計	1,916,575,697,068	3,032,061,264,713
純資産合計	1,916,575,697,068	3,032,061,264,713
負債純資産合計	2,027,959,660,390	3,175,011,590,178

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 13 期	第 14 期
	自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日	自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 日
営業収益		
受取配当金	28,437,742,184	40,481,328,760
受取利息	75,209,364	59,951,090
有価証券売買等損益	142,881,963,643	595,988,984,980

派生商品取引等損益	3,545,299,846	10,431,701,745
その他収益	124,635,492	102,762,433
営業収益合計	175,064,850,529	647,064,729,008
営業費用		
支払利息	35,381,370	27,744,884
受託者報酬	1,106,100,419	1,455,629,983
委託者報酬	2,946,060,033	4,329,386,306
その他費用	41,079,206	56,536,957
営業費用合計	4,128,621,028	5,869,298,130
営業利益又は営業損失(△)	170,936,229,501	641,195,430,878
経常利益又は経常損失(△)	170,936,229,501	641,195,430,878
当期純利益又は当期純損失(△)	170,936,229,501	641,195,430,878
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(△)	204,046,639,550	399,439,453,090
剰余金増加額又は欠損金減少額	128,938,358,628	362,483,189,397
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	128,938,358,628	362,483,189,397
剰余金減少額又は欠損金増加額	79,950,198,043	193,842,947,527
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	79,950,198,043	193,842,947,527
分配金	24,531,576,546	34,713,986,250
期末剰余金又は期末欠損金(△)	399,439,453,090	1,174,561,139,588

(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 7 月 9 日から平成 27 年 7 月 8 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 13 期 平成 26 年 7 月 8 日現在	第 14 期 平成 27 年 7 月 8 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 123,274,254 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 150,930,375 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	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	15,547.3 円	1 口当たり純資産額	20,089.1 円
(10 口当たり純資産額)	(155,473 円)	(10 口当たり純資産額)	(200,891 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	80,101,690,300 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	95,367,448,310 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日			第 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	28,602,205,670 円	当期配当等収益額	A	40,616,297,399 円
分配準備積立金	B	64,632,971 円	分配準備積立金	B	42,022,437 円
配当等収益合計額	C=A+B	28,666,838,641 円	配当等収益合計額	C=A+B	40,658,319,836 円
経費	D	4,093,239,658 円	経費	D	5,841,553,246 円
収益分配可能額	E=C-D	24,573,598,983 円	収益分配可能額	E=C-D	34,816,766,590 円
収益分配金	F	24,531,576,546 円	収益分配金	F	34,713,986,250 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	42,022,437 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	102,780,340 円
口数	H	123,274,254 口	口数	H	150,930,375 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	1,990 円	10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,300 円

(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 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日		第 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 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効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。	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組入制限等の管理を行っております。 ○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っております。	3. 金融商品に係るリスク管理体制	同左

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 13 期 平成 26 年 7 月 8 日現在	第 14 期 平成 27 年 7 月 8 日現在
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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。 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。 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。	2. 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日	第 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 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 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日	第 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 日
期首元本額 1,259,992,075,305 円	期首元本額 1,517,136,243,978 円
期中追加設定元本額 569,191,242,730 円	期中追加設定元本額 795,701,454,660 円
期中一部交換元本額 312,047,074,057 円	期中一部交換元本額 455,337,573,513 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日	第 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 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	119,636,967,289	531,929,330,620
合計	119,636,967,289	531,929,330,620

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 13 期(平成 26 年 7 月 8 日現在)				第 14 期(平成 27 年 7 月 8 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	23,564,344,000	—	23,838,360,000	273,050,966	36,575,130,000	—	35,171,740,000	△1,404,259,454
合計	23,564,344,000	—	23,838,360,000	273,050,966	36,575,130,000	—	35,171,740,000	△1,404,259,454

(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 7 月 8 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	5,960,000	346.00	2,062,160,000	
		マルハニチロ	596,000	2,067.00	1,231,932,000	貸付有価証券 15,000株
		国際石油開発帝石	2,384,000	1,322.50	3,152,840,000	
		コムシスホールディングス	5,960,000	1,781.00	10,614,760,000	
		大成建設	5,960,000	711.00	4,237,560,000	
		大林組	5,960,000	943.00	5,620,280,000	
		清水建設	5,960,000	1,029.00	6,132,840,000	
		鹿島建設	5,960,000	589.00	3,510,440,000	
		大和ハウス工業	5,960,000	2,842.50	16,941,300,000	貸付有価証券 47,400株(47,400 株)
		積水ハウス	5,960,000	1,834.50	10,933,620,000	
		日揮	5,960,000	2,305.50	13,740,780,000	貸付有価証券 219,000株(197,000 株)
		千代田化工建設	5,960,000	1,079.00	6,430,840,000	貸付有価証券 1,163,000株
		日清製粉グループ本社	5,960,000	1,630.00	9,714,800,000	貸付有価証券 100株(100株)
		明治ホールディングス	596,000	16,020.00	9,547,920,000	
		日本ハム	5,960,000	2,813.00	16,765,480,000	貸付有価証券 442,000株(353,000 株)
		サッポロホールディングス	5,960,000	446.00	2,658,160,000	貸付有価証券 223,000株(171,000 株)
		アサヒグループホールディングス	5,960,000	3,730.50	22,233,780,000	
		キリンホールディングス	5,960,000	1,664.50	9,920,420,000	
宝ホールディングス	5,960,000	960.00	5,721,600,000			
キッコーマン	5,960,000	3,850.00	22,946,000,000			
味の素	5,960,000	2,602.00	15,507,920,000			

ニチレイ	5,960,000	862.00	5,137,520,000	
日本たばこ産業	5,960,000	4,237.00	25,252,520,000	
東洋紡	5,960,000	184.00	1,096,640,000	
ユニチカ	5,960,000	57.00	339,720,000	貸付有価証券 441,000 株
日清紡ホールディングス	5,960,000	1,330.00	7,926,800,000	
帝人	5,960,000	444.00	2,646,240,000	貸付有価証券 405,000 株 (405,000 株)
東レ	5,960,000	980.00	5,840,800,000	
王子ホールディングス	5,960,000	519.00	3,093,240,000	貸付有価証券 6,000 株 (6,000 株)
日本製紙	596,000	2,073.00	1,235,508,000	貸付有価証券 388,700 株
北越紀州製紙	5,960,000	676.00	4,028,960,000	貸付有価証券 1,339,100 株 (926,200 株)
クラレ	5,960,000	1,401.00	8,349,960,000	貸付有価証券 101,300 株 (101,300 株)
旭化成	5,960,000	941.10	5,608,956,000	
昭和電工	5,960,000	155.00	923,800,000	貸付有価証券 828,000 株
住友化学	5,960,000	690.00	4,112,400,000	
日産化学工業	5,960,000	2,735.00	16,300,600,000	貸付有価証券 1,800 株
日本曹達	5,960,000	751.00	4,475,960,000	貸付有価証券 91,000 株
東ソー	5,960,000	665.00	3,963,400,000	
トクヤマ	5,960,000	225.00	1,341,000,000	貸付有価証券 3,993,000 株
電気化学工業	5,960,000	507.00	3,021,720,000	
信越化学工業	5,960,000	7,311.00	43,573,560,000	
三井化学	5,960,000	432.00	2,574,720,000	貸付有価証券 159,000 株 (159,000 株)
三菱ケミカルホールディングス	2,980,000	740.40	2,206,392,000	貸付有価証券 151,200 株 (151,200 株)
宇部興産	5,960,000	217.00	1,293,320,000	
日本化薬	5,960,000	1,245.00	7,420,200,000	
花王	5,960,000	5,747.00	34,252,120,000	
富士フイルムホールディングス	5,960,000	4,286.00	25,544,560,000	
資生堂	5,960,000	2,723.00	16,229,080,000	貸付有価証券 447,900 株

日東電工	5,960,000	9,509.00	56,673,640,000	貸付有価証券 61,300株(61,300 株)
協和発酵キリン	5,960,000	1,558.00	9,285,680,000	
武田薬品工業	5,960,000	5,929.00	35,336,840,000	
アステラス製薬	29,800,000	1,771.00	52,775,800,000	
大日本住友製薬	5,960,000	1,373.00	8,183,080,000	貸付有価証券 3,993,200株
塩野義製薬	5,960,000	4,820.00	28,727,200,000	
中外製薬	5,960,000	4,365.00	26,015,400,000	
エーザイ	5,960,000	8,172.00	48,705,120,000	貸付有価証券 59,500株(59,500 株)
第一三共	5,960,000	2,385.00	14,214,600,000	貸付有価証券 3,729,200株
昭和シェル石油	5,960,000	1,062.00	6,329,520,000	
JXホールディングス	5,960,000	502.10	2,992,516,000	貸付有価証券 92,300株(92,300 株)
横浜ゴム	2,980,000	2,394.00	7,134,120,000	貸付有価証券 1,201,100株
ブリヂストン	5,960,000	4,492.00	26,772,320,000	
日東紡績	5,960,000	592.00	3,528,320,000	貸付有価証券 13,000株
旭硝子	5,960,000	688.00	4,100,480,000	
日本板硝子	5,960,000	120.00	715,200,000	貸付有価証券 3,425,000株
日本電気硝子	8,940,000	582.00	5,203,080,000	
住友大阪セメント	5,960,000	448.00	2,670,080,000	
太平洋セメント	5,960,000	356.00	2,121,760,000	貸付有価証券 227,000株
東海カーボン	5,960,000	362.00	2,157,520,000	
TOTO	5,960,000	1,942.00	11,574,320,000	
日本碍子	5,960,000	3,045.00	18,148,200,000	
新日鐵住金	5,960,000	290.10	1,728,996,000	
神戸製鋼所	5,960,000	188.00	1,120,480,000	貸付有価証券 380,000株(380,000 株)
ジェイ エフ イー ホールディングス	596,000	2,419.50	1,442,022,000	
日新製鋼	596,000	1,398.00	833,208,000	
大平洋金属	5,960,000	350.00	2,086,000,000	貸付有価証券 3,993,000株 (227,000株)
日本軽金属ホールディング	5,960,000	199.00	1,186,040,000	貸付有価証券

グス				1,285,500 株 (1,117,300 株)
三井金属鉱業	5,960,000	298.00	1,776,080,000	貸付有価証券 2,396,000 株
東邦亜鉛	5,960,000	355.00	2,115,800,000	貸付有価証券 75,000 株
三菱マテリアル	5,960,000	437.00	2,604,520,000	貸付有価証券 322,000 株 (322,000 株)
住友金属鉱山	5,960,000	1,706.50	10,170,740,000	貸付有価証券 38,000 株 (38,000 株)
DOWAホールディング ス	5,960,000	1,096.00	6,532,160,000	
古河機械金属	5,960,000	216.00	1,287,360,000	貸付有価証券 65,000 株
古河電気工業	5,960,000	206.00	1,227,760,000	貸付有価証券 38,000 株 (38,000 株)
住友電気工業	5,960,000	1,849.00	11,020,040,000	
フジクラ	5,960,000	654.00	3,897,840,000	
SUMCO	596,000	1,364.00	812,944,000	貸付有価証券 399,300 株 (7,900 株)
東洋製罐グループホール ディングス	5,960,000	1,818.00	10,835,280,000	貸付有価証券 183,000 株 (155,400 株)
日本製鋼所	5,960,000	477.00	2,842,920,000	貸付有価証券 698,000 株 (623,000 株)
オークマ	5,960,000	1,315.00	7,837,400,000	
アマダホールディングス	5,960,000	1,224.00	7,295,040,000	
小松製作所	5,960,000	2,231.50	13,299,740,000	貸付有価証券 1,992,800 株 (37,700 株)
住友重機械工業	5,960,000	659.00	3,927,640,000	貸付有価証券 122,000 株 (122,000 株)
日立建機	5,960,000	2,009.00	11,973,640,000	貸付有価証券 2,253,200 株
クボタ	5,960,000	1,983.00	11,818,680,000	貸付有価証券 147,000 株 (147,000 株)
荏原製作所	5,960,000	559.00	3,331,640,000	貸付有価証券 1,268,000 株 (1,008,000 株)
ダイキン工業	5,960,000	8,523.00	50,797,080,000	貸付有価証券 40,200 株
日本精工	5,960,000	1,700.00	10,132,000,000	
NTN	5,960,000	713.00	4,249,480,000	貸付有価証券

				222,000 株 (222,000 株)
ジェイテクト	5,960,000	2,185.00	13,022,600,000	
日立造船	1,192,000	688.00	820,096,000	貸付有価証券 100 株
三菱重工業	5,960,000	697.40	4,156,504,000	
I H I	5,960,000	534.00	3,182,640,000	
コニカミノルタ	5,960,000	1,435.00	8,552,600,000	貸付有価証券 133,400 株 (133,400 株)
ミネベア	5,960,000	1,891.00	11,270,360,000	
日立製作所	5,960,000	775.00	4,619,000,000	貸付有価証券 51,000 株 (51,000 株)
東芝	5,960,000	394.70	2,352,412,000	
三菱電機	5,960,000	1,500.50	8,942,980,000	
富士電機	5,960,000	514.00	3,063,440,000	
安川電機	5,960,000	1,501.00	8,945,960,000	貸付有価証券 3,741,100 株 (399,200 株)
明電舎	5,960,000	428.00	2,550,880,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,960,000	468.00	2,789,280,000	貸付有価証券 285,000 株 (67,000 株)
日本電気	5,960,000	362.00	2,157,520,000	
富士通	5,960,000	649.20	3,869,232,000	
沖電気工業	5,960,000	251.00	1,495,960,000	
パナソニック	5,960,000	1,568.00	9,345,280,000	
シャープ	5,960,000	161.00	959,560,000	貸付有価証券 3,988,000 株 (122,000 株)
ソニー	5,960,000	3,322.00	19,799,120,000	
TDK	5,960,000	8,720.00	51,971,200,000	貸付有価証券 8,200 株
ミツミ電機	5,960,000	776.00	4,624,960,000	貸付有価証券 907,000 株 (71,400 株)
アルプス電気	5,960,000	3,575.00	21,307,000,000	貸付有価証券 2,131,900 株
パイオニア	5,960,000	221.00	1,317,160,000	貸付有価証券 21,200 株
横河電機	5,960,000	1,430.00	8,522,800,000	貸付有価証券 3,993,200 株 (433,700 株)
アドバンテスト	11,920,000	1,231.00	14,673,520,000	貸付有価証券 2,688,900 株 (418,100 株)

カシオ計算機	5,960,000	2,271.00	13,535,160,000	貸付有価証券 3,979,500 株
ファナック	5,960,000	23,930.00	142,622,800,000	
京セラ	11,920,000	6,186.00	73,737,120,000	貸付有価証券 26,500 株 (26,500 株)
太陽誘電	5,960,000	1,568.00	9,345,280,000	貸付有価証券 33,900 株 (14,400 株)
S C R E E Nホールディ ングス	5,960,000	750.00	4,470,000,000	貸付有価証券 96,000 株 (65,000 株)
キヤノン	8,940,000	3,882.00	34,705,080,000	
リコー	5,960,000	1,206.50	7,190,740,000	貸付有価証券 4,700 株
東京エレクトロン	5,960,000	7,750.00	46,190,000,000	
デンソー	5,960,000	5,778.00	34,436,880,000	
三井造船	5,960,000	205.00	1,221,800,000	
川崎重工業	5,960,000	540.00	3,218,400,000	貸付有価証券 1,093,000 株 (397,000 株)
日産自動車	5,960,000	1,191.00	7,098,360,000	
いすゞ自動車	2,980,000	1,555.00	4,633,900,000	
トヨタ自動車	5,960,000	7,931.00	47,268,760,000	
日野自動車	5,960,000	1,410.00	8,403,600,000	
三菱自動車工業	596,000	1,011.00	602,556,000	貸付有価証券 336,200 株 (336,200 株)
マツダ	1,192,000	2,360.50	2,813,716,000	
本田技研工業	11,920,000	3,835.00	45,713,200,000	貸付有価証券 32,000 株 (32,000 株)
スズキ	5,960,000	3,852.00	22,957,920,000	貸付有価証券 225,300 株 (225,300 株)
富士重工業	5,960,000	4,318.50	25,738,260,000	貸付有価証券 39,700 株 (39,700 株)
テルモ	11,920,000	2,990.00	35,640,800,000	
ニコン	5,960,000	1,431.00	8,528,760,000	貸付有価証券 3,987,800 株
オリンパス	5,960,000	4,410.00	26,283,600,000	
シチズンホールディ ングス	5,960,000	828.00	4,934,880,000	貸付有価証券 75,400 株 (75,400 株)
凸版印刷	5,960,000	1,004.00	5,983,840,000	貸付有価証券 290,000 株 (290,000 株)

大日本印刷	5,960,000	1,263.50	7,530,460,000	
ヤマハ	5,960,000	2,495.00	14,870,200,000	
東京電力	596,000	679.00	404,684,000	
中部電力	596,000	1,798.00	1,071,608,000	貸付有価証券 37,800 株 (37,800 株)
関西電力	596,000	1,351.00	805,196,000	貸付有価証券 4,800 株
東京瓦斯	5,960,000	643.00	3,832,280,000	
大阪瓦斯	5,960,000	477.40	2,845,304,000	貸付有価証券 534,000 株 (534,000 株)
東武鉄道	5,960,000	559.00	3,331,640,000	
東京急行電鉄	5,960,000	847.00	5,048,120,000	
小田急電鉄	5,960,000	1,168.00	6,961,280,000	
京王電鉄	5,960,000	939.00	5,596,440,000	
京成電鉄	5,960,000	1,478.00	8,808,880,000	貸付有価証券 192,000 株 (192,000 株)
東日本旅客鉄道	596,000	11,045.00	6,582,820,000	
西日本旅客鉄道	596,000	7,890.00	4,702,440,000	
東海旅客鉄道	596,000	21,070.00	12,557,720,000	
日本通運	5,960,000	591.00	3,522,360,000	貸付有価証券 147,000 株 (147,000 株)
ヤマトホールディングス	5,960,000	2,360.00	14,065,600,000	
日本郵船	5,960,000	339.00	2,020,440,000	
商船三井	5,960,000	380.00	2,264,800,000	貸付有価証券 3,407,000 株
川崎汽船	5,960,000	284.00	1,692,640,000	貸付有価証券 1,413,000 株
A N A ホールディングス	5,960,000	341.20	2,033,552,000	
三菱倉庫	5,960,000	1,591.00	9,482,360,000	貸付有価証券 10,000 株
ヤフー	2,384,000	478.00	1,139,552,000	貸付有価証券 1,035,400 株
トレンドマイクロ	5,960,000	3,985.00	23,750,600,000	
スカパー J S A T ホール ディングス	596,000	636.00	379,056,000	
日本電信電話	1,192,000	4,350.00	5,185,200,000	
K D D I	35,760,000	2,942.50	105,223,800,000	
N T T ドコモ	596,000	2,328.00	1,387,488,000	
東宝	596,000	2,962.00	1,765,352,000	

エヌ・ティ・ティ・データ	5,960,000	5,150.00	30,694,000,000	貸付有価証券 49,500株(49,500株)
コナミ	5,960,000	2,319.00	13,821,240,000	貸付有価証券 55,400株
ソフトバンクグループ	17,880,000	6,934.00	123,979,920,000	
双日	596,000	280.00	166,880,000	
伊藤忠商事	5,960,000	1,404.00	8,367,840,000	
丸紅	5,960,000	677.20	4,036,112,000	
豊田通商	5,960,000	3,150.00	18,774,000,000	
三井物産	5,960,000	1,570.00	9,357,200,000	
住友商事	5,960,000	1,350.00	8,046,000,000	
三菱商事	5,960,000	2,579.00	15,370,840,000	
J.フロントリテイリング	2,980,000	2,274.00	6,776,520,000	
三越伊勢丹ホールディングス	5,960,000	2,156.00	12,849,760,000	
セブン&アイ・ホールディングス	5,960,000	5,291.00	31,534,360,000	
高島屋	5,960,000	1,095.00	6,526,200,000	貸付有価証券 138,000株(138,000株)
丸井グループ	5,960,000	1,673.00	9,971,080,000	
イオン	5,960,000	1,735.00	10,340,600,000	貸付有価証券 2,637,600株 (176,700株)
ユニグループ・ホールディングス	5,960,000	795.00	4,738,200,000	貸付有価証券 554,700株
ファーストリテイリング	5,960,000	55,180.00	328,872,800,000	貸付有価証券 58,200株(57,200株)
新生銀行	5,960,000	253.00	1,507,880,000	
あおぞら銀行	5,960,000	462.00	2,753,520,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,960,000	840.50	5,009,380,000	
りそなホールディングス	596,000	642.30	382,810,800	
三井住友トラスト・ホールディングス	5,960,000	536.30	3,196,348,000	
三井住友フィナンシャルグループ	596,000	5,230.00	3,117,080,000	
千葉銀行	5,960,000	921.00	5,489,160,000	
横浜銀行	5,960,000	745.40	4,442,584,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	5,960,000	613.00	3,653,480,000	貸付有価証券 216,000株(216,000株)

静岡銀行	5,960,000	1,251.00	7,455,960,000	
みずほフィナンシャルグループ	5,960,000	253.30	1,509,668,000	
大和証券グループ本社	5,960,000	883.80	5,267,448,000	
野村ホールディングス	5,960,000	843.00	5,024,280,000	
松井証券	5,960,000	1,056.00	6,293,760,000	貸付有価証券 187,300 株
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1,490,000	4,114.50	6,130,605,000	
MS & ADインシュアランスグループホール	1,788,000	3,584.00	6,408,192,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,192,000	2,134.00	2,543,728,000	
第一生命保険	596,000	2,236.00	1,332,656,000	貸付有価証券 11,800 株 (11,800 株)
東京海上ホールディングス	2,980,000	4,850.00	14,453,000,000	
T & Dホールディングス	1,192,000	1,716.50	2,046,068,000	
クレディセゾン	5,960,000	2,665.00	15,883,400,000	
東急不動産ホールディングス	5,960,000	956.00	5,697,760,000	
三井不動産	5,960,000	3,295.00	19,638,200,000	貸付有価証券 54,000 株 (54,000 株)
三菱地所	5,960,000	2,531.00	15,084,760,000	貸付有価証券 174,000 株 (174,000 株)
平和不動産	1,192,000	1,679.00	2,001,368,000	
東京建物	2,980,000	1,611.00	4,800,780,000	貸付有価証券 21,600 株
住友不動産	5,960,000	4,118.00	24,543,280,000	貸付有価証券 1,000 株 (1,000 株)
電通	5,960,000	6,230.00	37,130,800,000	
東京ドーム	5,960,000	501.00	2,985,960,000	
セコム	5,960,000	7,908.00	47,131,680,000	
小計	銘柄数 : 225 組入時価比率 : 98.8%		2,996,550,949,800	100.0%
合計			2,996,550,949,800	

(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證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 7 月 8 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。