

平成26年4月期（平成26年3月19日～平成26年4月7日）決算短信

平成26年5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6月26日
 分配金支払開始日 平成26年5月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年4月期の運用状況（平成26年3月19日～平成26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)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	26,229,272
株式	1,988,806,100
派生商品評価勘定	1,707,648
未収入金	21,315,000
未収配当金	22,438,383
未収利息	52
流動資産合計	2,060,496,455
資産合計	2,060,496,455
負債の部	
流動負債	
前受金	590,000
未払収益分配金	21,426,691
未払受託者報酬	56,051
未払委託者報酬	280,246
その他未払費用	111,521
流動負債合計	22,464,509
負債合計	22,464,509
純資産の部	
元本等	
元本	1,997,177,373
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	40,854,573
(分配準備積立金)	39,574
元本等合計	2,038,031,946
純資産合計	2,038,031,946
負債純資産合計	2,060,496,455

(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

営業収益	
受取配当金	22,438,383
受取利息	700
有価証券売買等損益	39,101,662
派生商品取引等損益	1,707,648
営業収益合計	63,248,393
営業費用	
受託者報酬	56,051

委託者報酬	280,246
その他費用	636,521
営業費用合計	972,818
営業利益又は営業損失(△)	62,275,575
経常利益又は経常損失(△)	62,275,575
当期純利益又は当期純損失(△)	62,275,575
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(△)	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,689
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
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	21,426,691
期末剰余金又は期末欠損金(△)	40,854,573

(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 3 月 19 日から平成 26 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 1 期 平成 26 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	149,837 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

(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		
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、533,401 円は上場に係る費用であります。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

<p>第 1 期 自 平成 26 年 3 月 19 日 至 平成 26 年 4 月 7 日</p>
<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。 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。</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。 ○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。</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

<p>第 1 期 平成 26 年 4 月 7 日現在</p>
<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。 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。</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>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。</p>

(その他の注記)

1 元本の移動

第 1 期 自 平成 26 年 3 月 19 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	
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

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	
	損益に含まれた評価差額 (円)	
株式		38,721,123
合計		38,721,123

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)			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1 年超		
市場取引 先物取引 株価指数先物取引 買建	46,190,000	—	47,900,000	1,707,648
合計	46,190,000	—	47,900,000	1,707,648

(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 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	日本水産	3,000	214.00	642,000	
		マルハニチロ	500	1,687.00	843,500	
		国際石油開発帝石	5,500	1,386.00	7,623,000	
		石油資源開発	200	3,565.00	713,000	
		ミライト・ホールディングス	600	903.00	541,800	
		コムシスホールディングス	900	1,702.00	1,531,800	
		ミサワホーム	300	1,322.00	396,600	

大成建設	5,000	473.00	2,365,000
大林組	3,000	627.00	1,881,000
清水建設	4,000	538.00	2,152,000
長谷工コーポレーション	1,800	669.00	1,204,200
鹿島建設	5,000	377.00	1,885,000
西松建設	2,000	335.00	670,000
前田建設工業	1,000	714.00	714,000
奥村組	1,000	453.00	453,000
戸田建設	2,000	322.00	644,000
大東建託	800	9,978.00	7,982,400
五洋建設	2,200	350.00	770,000
住友林業	1,300	1,034.00	1,344,200
パナホーム	1,000	700.00	700,000
大和ハウス工業	2,000	1,770.00	3,540,000
積水ハウス	3,500	1,296.00	4,536,000
関電工	1,000	515.00	515,000
きんでん	1,000	998.00	998,000
協和エクシオ	700	1,380.00	966,000
日揮	1,000	3,659.00	3,659,000
千代田化工建設	1,000	1,400.00	1,400,000
日本製粉	1,000	564.00	564,000
日清製粉グループ本社	1,500	1,117.00	1,675,500
山崎製パン	1,000	1,228.00	1,228,000
カルビー	200	2,472.00	494,400
森永乳業	3,000	327.00	981,000
ヤクルト本社	200	5,060.00	1,012,000
明治ホールディングス	500	6,080.00	3,040,000
雪印メグミルク	500	1,332.00	666,000
日本ハム	2,000	1,587.00	3,174,000
伊藤ハム	2,000	459.00	918,000
丸大食品	2,000	303.00	606,000
サッポロホールディングス	2,000	423.00	846,000
アサヒグループホールディングス	1,500	2,902.00	4,353,000
キリンホールディングス	5,400	1,382.00	7,462,800
宝ホールディングス	1,000	776.00	776,000

コカ・コーラウエスト	700	1,777.00	1,243,900
サントリー食品インターナショナル	200	3,585.00	717,000
伊藤園	400	2,289.00	915,600
日清オイリオグループ	2,000	336.00	672,000
不二製油	400	1,324.00	529,600
キッコーマン	1,000	1,941.00	1,941,000
味の素	4,000	1,483.00	5,932,000
キューピー	900	1,463.00	1,316,700
ハウス食品グループ本社	500	1,677.00	838,500
カゴメ	400	1,709.00	683,600
ニチレイ	2,000	436.00	872,000
東洋水産	1,000	3,310.00	3,310,000
日清食品ホールディングス	400	4,630.00	1,852,000
日本たばこ産業	4,000	3,274.00	13,096,000
グンゼ	2,000	276.00	552,000
東洋紡	5,000	163.00	815,000
日清紡ホールディングス	1,000	856.00	856,000
帝人	12,000	250.00	3,000,000
東レ	8,000	688.00	5,504,000
ワコールホールディングス	1,000	1,028.00	1,028,000
オンワードホールディングス	1,000	675.00	675,000
王子ホールディングス	6,000	454.00	2,724,000
日本製紙	700	2,040.00	1,428,000
北越紀州製紙	1,500	497.00	745,500
大王製紙	1,000	1,178.00	1,178,000
レンゴー	2,000	532.00	1,064,000
クラレ	2,200	1,179.00	2,593,800
旭化成	8,000	691.00	5,528,000
昭和電工	16,000	145.00	2,320,000
住友化学	14,000	386.00	5,404,000
日産化学工業	800	1,582.00	1,265,600
クレハ	1,000	497.00	497,000
日本曹達	1,000	566.00	566,000
東ソー	4,000	394.00	1,576,000
トクヤマ	3,000	326.00	978,000

セントラル硝子	2,000	326.00	652,000
東亜合成	2,000	434.00	868,000
電気化学工業	4,000	364.00	1,456,000
信越化学工業	1,700	5,813.00	9,882,100
エア・ウォーター	1,000	1,443.00	1,443,000
大陽日酸	2,000	809.00	1,618,000
日本触媒	1,000	1,211.00	1,211,000
カネカ	2,000	611.00	1,222,000
三菱瓦斯化学	2,000	644.00	1,288,000
三井化学	11,000	252.00	2,772,000
J S R	1,200	1,879.00	2,254,800
東京応化工業	200	2,250.00	450,000
三菱ケミカルホールディングス	15,300	428.00	6,548,400
ダイセル	2,000	847.00	1,694,000
住友ベークライト	2,000	394.00	788,000
積水化学工業	3,000	1,085.00	3,255,000
日本ゼオン	1,000	955.00	955,000
アイカ工業	200	2,239.00	447,800
宇部興産	10,000	186.00	1,860,000
日立化成	900	1,452.00	1,306,800
日本化薬	1,000	1,158.00	1,158,000
ADEKA	500	1,144.00	572,000
日油	1,000	728.00	728,000
花王	2,800	3,609.00	10,105,200
関西ペイント	1,000	1,460.00	1,460,000
D I C	4,000	267.00	1,068,000
東洋インキSCホールディングス	1,000	436.00	436,000
富士フイルムホールディングス	4,500	2,816.00	12,672,000
資生堂	2,100	1,793.00	3,765,300
ライオン	1,000	604.00	604,000
コーセー	200	3,325.00	665,000
小林製薬	100	5,960.00	596,000
日東電工	700	4,950.00	3,465,000
エフピコ	100	3,120.00	312,000
ニフコ	200	2,986.00	597,200

ユニ・チャーム	200	5,607.00	1,121,400
協和発酵キリン	1,000	1,087.00	1,087,000
武田薬品工業	5,300	4,821.00	25,551,300
アステラス製薬	13,200	1,194.00	15,760,800
大日本住友製薬	500	1,706.00	853,000
塩野義製薬	1,000	1,855.00	1,855,000
田辺三菱製薬	600	1,469.00	881,400
中外製薬	700	2,651.00	1,855,700
エーザイ	1,400	3,925.00	5,495,000
ロート製薬	300	1,762.00	528,600
小野薬品工業	400	8,620.00	3,448,000
久光製薬	200	4,605.00	921,000
持田製薬	100	7,280.00	728,000
参天製薬	300	4,780.00	1,434,000
ツムラ	200	2,470.00	494,000
沢井製薬	100	6,190.00	619,000
第一三共	4,400	1,813.00	7,977,200
キョーリン製薬ホールディングス	200	1,931.00	386,200
大塚ホールディングス	2,000	2,957.00	5,914,000
大正製薬ホールディングス	100	7,700.00	770,000
昭和シェル石油	2,000	923.00	1,846,000
コスモ石油	12,000	190.00	2,280,000
東燃ゼネラル石油	3,000	909.00	2,727,000
出光興産	1,400	2,123.00	2,972,200
J Xホールディングス	37,300	502.00	18,724,600
横浜ゴム	1,000	948.00	948,000
東洋ゴム工業	1,000	765.00	765,000
ブリヂストン	2,600	3,745.00	9,737,000
住友ゴム工業	1,000	1,377.00	1,377,000
旭硝子	10,000	590.00	5,900,000
日本板硝子	14,000	145.00	2,030,000
日本電気硝子	5,000	525.00	2,625,000
住友大阪セメント	2,000	419.00	838,000
太平洋セメント	4,000	380.00	1,520,000
東海カーボン	2,000	337.00	674,000

TOTO	1,000	1,497.00	1,497,000
日本碍子	1,000	2,117.00	2,117,000
日本特殊陶業	1,000	2,381.00	2,381,000
新日鐵住金	28,000	281.00	7,868,000
神戸製鋼所	19,000	137.00	2,603,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	4,400	1,954.00	8,597,600
日新製鋼	400	956.00	382,400
東京製鐵	900	569.00	512,100
大和工業	200	3,225.00	645,000
淀川製鋼所	1,000	426.00	426,000
丸一鋼管	200	2,583.00	516,600
大同特殊鋼	2,000	499.00	998,000
愛知製鋼	1,000	408.00	408,000
日立金属	1,000	1,428.00	1,428,000
大平洋金属	1,000	391.00	391,000
日本軽金属ホールディングス	4,000	139.00	556,000
三井金属鉱業	5,000	241.00	1,205,000
三菱マテリアル	8,000	301.00	2,408,000
住友金属鉱山	4,000	1,313.00	5,252,000
DOWAホールディングス	1,000	858.00	858,000
古河電気工業	8,000	249.00	1,992,000
住友電気工業	5,200	1,522.00	7,914,400
フジクラ	4,000	477.00	1,908,000
SUMCO	1,000	790.00	790,000
東洋製罐グループホールディングス	1,000	1,619.00	1,619,000
三和ホールディングス	1,000	653.00	653,000
LIXILグループ	1,600	2,774.00	4,438,400
リンナイ	100	8,660.00	866,000
日本発條	1,100	971.00	1,068,100
日本製鋼所	2,000	466.00	932,000
アマダ	1,000	726.00	726,000
DMG 森精機	400	1,325.00	530,000
ディスコ	100	6,630.00	663,000
ナブテスコ	300	2,347.00	704,100
SMC	100	26,695.00	2,669,500

小松製作所	4,000	2,207.00	8,828,000
住友重機械工業	4,000	438.00	1,752,000
日立建機	500	1,992.00	996,000
クボタ	3,000	1,387.00	4,161,000
荏原製作所	2,000	646.00	1,292,000
ダイキン工業	700	6,018.00	4,212,600
栗田工業	800	2,184.00	1,747,200
ダイフク	400	1,244.00	497,600
平和	400	1,720.00	688,000
SANKYO	300	4,265.00	1,279,500
アマノ	400	1,031.00	412,400
グローリー	300	2,789.00	836,700
セガサミーホールディングス	900	2,272.00	2,044,800
ホンザキ電機	100	3,980.00	398,000
日本精工	2,000	1,105.00	2,210,000
NTN	3,000	380.00	1,140,000
ジェイテクト	1,100	1,617.00	1,778,700
THK	400	2,249.00	899,600
マキタ	400	5,530.00	2,212,000
日立造船	700	497.00	347,900
三菱重工業	14,000	598.00	8,372,000
IHI	5,000	424.00	2,120,000
イビデン	1,300	2,037.00	2,648,100
コニカミノルタ	4,500	955.00	4,297,500
ブラザー工業	2,000	1,448.00	2,896,000
ミネベア	2,000	933.00	1,866,000
日立製作所	36,000	755.00	27,180,000
東芝	24,000	435.00	10,440,000
三菱電機	9,000	1,191.00	10,719,000
富士電機	3,000	452.00	1,356,000
安川電機	500	1,404.00	702,000
東芝テック	1,000	598.00	598,000
マブチモーター	100	6,810.00	681,000
日本電産	800	6,130.00	4,904,000
JVCケンウッド	3,400	241.00	819,400

オムロン	700	4,105.00	2,873,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,000	571.00	571,000
日本電気	27,000	315.00	8,505,000
富士通	26,000	610.00	15,860,000
沖電気工業	3,000	218.00	654,000
セイコーエプソン	1,000	3,200.00	3,200,000
パナソニック	26,600	1,162.00	30,909,200
シャープ	11,000	326.00	3,586,000
ソニー	9,100	1,988.00	18,090,800
TDK	1,100	4,435.00	4,878,500
ミツミ電機	1,600	702.00	1,123,200
アルプス電気	1,500	1,195.00	1,792,500
ホシデン	2,000	496.00	992,000
ヒロセ電機	100	14,610.00	1,461,000
アルパイン	400	1,302.00	520,800
船井電機	500	1,028.00	514,000
横河電機	600	1,557.00	934,200
アズビル	400	2,487.00	994,800
日本光電工業	100	4,235.00	423,500
堀場製作所	100	3,650.00	365,000
アドバンテスト	600	1,149.00	689,400
シスメックス	200	3,240.00	648,000
スタンレー電気	800	2,311.00	1,848,800
ウシオ電機	600	1,383.00	829,800
カシオ計算機	1,300	1,228.00	1,596,400
ファナック	400	18,145.00	7,258,000
ローム	800	4,750.00	3,800,000
浜松ホトニクス	200	4,730.00	946,000
新光電気工業	500	738.00	369,000
京セラ	1,400	4,643.00	6,500,200
太陽誘電	600	1,252.00	751,200
村田製作所	700	9,627.00	6,738,900
小糸製作所	500	1,911.00	955,500
キヤノン	10,500	3,200.00	33,600,000
リコー	5,300	1,159.00	6,142,700

東京エレクトロン	700	6,454.00	4,517,800
トヨタ紡織	700	1,042.00	729,400
ユニプレス	400	1,868.00	747,200
豊田自動織機	700	4,855.00	3,398,500
デンソー	1,900	5,024.00	9,545,600
東海理化電機製作所	400	1,802.00	720,800
三井造船	6,000	231.00	1,386,000
川崎重工業	5,000	394.00	1,970,000
日産自動車	16,000	939.00	15,024,000
いすゞ自動車	5,000	598.00	2,990,000
トヨタ自動車	7,800	5,758.00	44,912,400
日野自動車	800	1,519.00	1,215,200
三菱自動車工業	2,000	1,110.00	2,220,000
武蔵精密工業	200	2,189.00	437,800
日産車体	500	1,694.00	847,000
日信工業	300	2,039.00	611,700
タチエス	300	1,642.00	492,600
NOK	600	1,717.00	1,030,200
フタバ産業	1,300	471.00	612,300
カヤバ工業	1,000	434.00	434,000
プレス工業	1,000	377.00	377,000
カルソニックカンセイ	2,000	503.00	1,006,000
ケーヒン	400	1,478.00	591,200
アイシン精機	1,200	3,685.00	4,422,000
マツダ	7,000	473.00	3,311,000
ダイハツ工業	1,400	1,767.00	2,473,800
本田技研工業	9,000	3,571.00	32,139,000
スズキ	2,400	2,767.00	6,640,800
富士重工業	1,200	2,856.00	3,427,200
ヤマハ発動機	1,800	1,634.00	2,941,200
ショーワ	400	1,073.00	429,200
豊田合成	500	1,977.00	988,500
エフ・シー・シー	200	1,780.00	356,000
シマノ	200	10,110.00	2,022,000
タカタ	200	2,633.00	526,600

テイ・エス テック	200	3,045.00	609,000
テルモ	700	2,207.00	1,544,900
島津製作所	1,000	893.00	893,000
ニコン	1,900	1,665.00	3,163,500
オリンパス	300	3,175.00	952,500
HOYA	2,300	3,121.00	7,178,300
シチズンホールディングス	1,800	793.00	1,427,400
ニプロ	500	898.00	449,000
バンダイナムコホールディングス	1,300	2,338.00	3,039,400
トッパン・フォームズ	500	937.00	468,500
タカラトミー	900	465.00	418,500
凸版印刷	6,000	721.00	4,326,000
大日本印刷	6,000	970.00	5,820,000
アシックス	500	1,938.00	969,000
ヤマハ	1,000	1,383.00	1,383,000
リンテック	300	1,926.00	577,800
任天堂	1,000	11,835.00	11,835,000
コクヨ	800	741.00	592,800
東京電力	25,600	400.00	10,240,000
中部電力	7,800	1,178.00	9,188,400
関西電力	7,400	994.00	7,355,600
中国電力	2,600	1,345.00	3,497,000
北陸電力	1,900	1,268.00	2,409,200
東北電力	3,800	1,006.00	3,822,800
四国電力	1,800	1,297.00	2,334,600
九州電力	3,200	1,163.00	3,721,600
北海道電力	1,500	718.00	1,077,000
沖縄電力	200	3,445.00	689,000
電源開発	1,000	2,879.00	2,879,000
東京瓦斯	15,000	511.00	7,665,000
大阪瓦斯	14,000	390.00	5,460,000
東邦瓦斯	3,000	538.00	1,614,000
東武鉄道	7,000	499.00	3,493,000
相鉄ホールディングス	2,000	372.00	744,000
東京急行電鉄	4,000	632.00	2,528,000

京浜急行電鉄	1,000	846.00	846,000
小田急電鉄	2,000	885.00	1,770,000
京王電鉄	2,000	713.00	1,426,000
京成電鉄	1,000	877.00	877,000
東日本旅客鉄道	1,500	7,646.00	11,469,000
西日本旅客鉄道	1,300	4,135.00	5,375,500
東海旅客鉄道	600	11,925.00	7,155,000
西日本鉄道	2,000	392.00	784,000
近畿日本鉄道	6,000	362.00	2,172,000
阪急阪神ホールディングス	5,000	558.00	2,790,000
南海電気鉄道	2,000	398.00	796,000
京阪電気鉄道	2,000	417.00	834,000
名古屋鉄道	5,000	302.00	1,510,000
日本通運	8,000	509.00	4,072,000
ヤマトホールディングス	2,000	2,184.00	4,368,000
山九	3,000	393.00	1,179,000
日本梱包運輸倉庫	300	1,758.00	527,400
セイノーホールディングス	1,000	969.00	969,000
日立物流	400	1,645.00	658,000
日本郵船	15,000	309.00	4,635,000
商船三井	8,000	406.00	3,248,000
川崎汽船	9,000	225.00	2,025,000
日本航空	500	5,120.00	2,560,000
ANAホールディングス	19,000	227.00	4,313,000
住友倉庫	1,000	495.00	495,000
上組	2,000	987.00	1,974,000
近鉄エクスプレス	100	4,460.00	446,000
I Tホールディングス	1,000	1,674.00	1,674,000
野村総合研究所	400	3,215.00	1,286,000
フジ・メディア・ホールディングス	1,000	1,770.00	1,770,000
オービック	200	3,135.00	627,000
ヤフー	2,800	485.00	1,358,000
トレンドマイクロ	400	3,155.00	1,262,000
日本オラクル	200	4,565.00	913,000
伊藤忠テクノソリューションズ	200	4,290.00	858,000

大塚商会	100	12,850.00	1,285,000
ネットワンシステムズ	1,200	729.00	874,800
日本ユニシス	500	1,066.00	533,000
東京放送ホールディングス	800	1,125.00	900,000
日本テレビホールディングス	700	1,599.00	1,119,300
テレビ朝日ホールディングス	300	1,836.00	550,800
スカパーJ S A Tホールディングス	1,100	536.00	589,600
日本電信電話	9,900	5,408.00	53,539,200
K D D I	3,500	5,588.00	19,558,000
光通信	100	8,620.00	862,000
N T T ドコモ	11,600	1,584.00	18,374,400
東宝	400	2,055.00	822,000
エヌ・ティ・ティ・データ	1,000	3,860.00	3,860,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	300	1,952.00	585,600
カプコン	200	1,728.00	345,600
S C S K	200	2,737.00	547,400
コナミ	500	2,351.00	1,175,500
ソフトバンク	1,700	7,556.00	12,845,200
双日	26,200	173.00	4,532,600
アルフレッサ ホールディングス	500	6,280.00	3,140,000
ダイワボウホールディングス	3,000	178.00	534,000
第一興商	300	3,095.00	928,500
メディパルホールディングス	2,200	1,470.00	3,234,000
黒田電気	400	1,686.00	674,400
伊藤忠商事	15,300	1,166.00	17,839,800
丸紅	16,000	689.00	11,024,000
長瀬産業	1,200	1,251.00	1,501,200
豊田通商	1,900	2,579.00	4,900,100
兼松	5,000	160.00	800,000
三井物産	19,000	1,468.00	27,892,000
日立ハイテクノロジーズ	600	2,425.00	1,455,000
カメイ	800	771.00	616,800
住友商事	12,000	1,325.00	15,900,000
三菱商事	17,600	1,881.00	33,105,600
キヤノンマーケティングジャパン	800	1,409.00	1,127,200

三谷商事	200	2,254.00	450,800
阪和興業	3,000	401.00	1,203,000
岩谷産業	2,000	650.00	1,300,000
三愛石油	2,000	643.00	1,286,000
稲畑産業	600	1,026.00	615,600
東邦ホールディングス	500	2,110.00	1,055,000
サンゲツ	200	2,653.00	530,600
伊藤忠エネクス	1,300	567.00	737,100
リョーサン	500	2,153.00	1,076,500
三信電気	1,000	681.00	681,000
P a l t a c	600	1,251.00	750,600
日鉄住金物産	2,000	351.00	702,000
オートバックスセブン	800	1,562.00	1,249,600
加藤産業	300	2,080.00	624,000
因幡電機産業	200	3,200.00	640,000
ミスミグループ本社	200	2,718.00	543,600
スズケン	800	3,835.00	3,068,000
ローソン	300	7,100.00	2,130,000
カワチ薬品	200	1,947.00	389,400
ゲオホールディングス	600	912.00	547,200
アダストリアホールディングス	100	2,380.00	238,000
日本マクドナルドホールディングス	400	2,772.00	1,108,800
エディオン	2,700	565.00	1,525,500
DCMホールディングス	1,200	674.00	808,800
J. フロント リテイリング	3,000	702.00	2,106,000
マツモトキヨシホールディングス	300	3,275.00	982,500
三越伊勢丹ホールディングス	1,800	1,318.00	2,372,400
セブン&アイ・ホールディングス	5,700	3,910.00	22,287,000
ツルハホールディングス	100	10,150.00	1,015,000
良品計画	100	10,080.00	1,008,000
コーナン商事	500	1,052.00	526,000
ドンキホーテホールディングス	200	5,460.00	1,092,000
ゼンショーホールディングス	400	1,019.00	407,600
スギホールディングス	200	4,605.00	921,000
ファミリーマート	300	4,455.00	1,336,500

上新電機	1,000	820.00	820,000
島忠	400	2,195.00	878,000
コメリ	200	2,734.00	546,800
青山商事	400	2,681.00	1,072,400
しまむら	100	8,750.00	875,000
高島屋	2,000	949.00	1,898,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,000	775.00	775,000
丸井グループ	1,400	874.00	1,223,600
ダイエー	4,050	340.00	1,377,000
イズミヤ	1,000	490.00	490,000
イオン	5,600	1,161.00	6,501,600
ユニーグループ・ホールディングス	3,800	595.00	2,261,000
イズミ	300	3,045.00	913,500
平和堂	300	1,449.00	434,700
ケーズホールディングス	600	2,747.00	1,648,200
ヤマダ電機	20,200	356.00	7,191,200
ニトリホールディングス	300	4,555.00	1,366,500
吉野家ホールディングス	500	1,332.00	666,000
アークス	300	2,014.00	604,200
バロー	400	1,298.00	519,200
ファーストリテイリング	100	37,975.00	3,797,500
サンドラッグ	100	4,465.00	446,500
じもとホールディングス	5,100	210.00	1,071,000
新生銀行	12,000	203.00	2,436,000
あおぞら銀行	6,000	299.00	1,794,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	221,800	569.00	126,204,200
りそなホールディングス	94,200	500.00	47,100,000
三井住友トラスト・ホールディングス	17,000	457.00	7,769,000
三井住友フィナンシャルグループ	18,900	4,403.00	83,216,700
第四銀行	6,000	373.00	2,238,000
北越銀行	4,000	216.00	864,000
西日本シティ銀行	7,000	241.00	1,687,000
千葉銀行	3,000	641.00	1,923,000
横浜銀行	9,000	515.00	4,635,000

常陽銀行	4,000	504.00	2,016,000
群馬銀行	1,000	554.00	554,000
武蔵野銀行	300	3,400.00	1,020,000
筑波銀行	1,500	384.00	576,000
七十七銀行	9,000	471.00	4,239,000
青森銀行	4,000	288.00	1,152,000
秋田銀行	3,000	285.00	855,000
山形銀行	1,000	433.00	433,000
岩手銀行	400	5,010.00	2,004,000
東邦銀行	7,000	340.00	2,380,000
ふくおかフィナンシャルグループ	7,000	427.00	2,989,000
静岡銀行	2,000	1,010.00	2,020,000
十六銀行	4,000	365.00	1,460,000
八十二銀行	4,000	578.00	2,312,000
山梨中央銀行	4,000	462.00	1,848,000
大垣共立銀行	3,000	279.00	837,000
福井銀行	2,000	258.00	516,000
北國銀行	2,000	353.00	706,000
滋賀銀行	1,000	560.00	560,000
南都銀行	3,000	388.00	1,164,000
百五銀行	5,000	407.00	2,035,000
京都銀行	2,000	842.00	1,684,000
紀陽銀行	700	1,289.00	902,300
ほくほくフィナンシャルグループ	27,000	196.00	5,292,000
広島銀行	6,000	429.00	2,574,000
山陰合同銀行	2,000	689.00	1,378,000
中国銀行	2,000	1,364.00	2,728,000
伊予銀行	1,500	964.00	1,446,000
百十四銀行	3,000	357.00	1,071,000
四国銀行	4,000	210.00	840,000
阿波銀行	2,000	543.00	1,086,000
鹿児島銀行	1,000	661.00	661,000
大分銀行	3,000	395.00	1,185,000
肥後銀行	2,000	545.00	1,090,000
佐賀銀行	2,000	225.00	450,000

十八銀行	4,000	228.00	912,000
沖縄銀行	300	4,310.00	1,293,000
琉球銀行	800	1,356.00	1,084,800
八千代銀行	200	2,759.00	551,800
セブン銀行	2,300	397.00	913,100
みずほフィナンシャルグループ	599,700	205.00	122,938,500
山口フィナンシャルグループ	2,000	910.00	1,820,000
東日本銀行	2,000	253.00	506,000
愛媛銀行	5,000	225.00	1,125,000
みなと銀行	3,000	176.00	528,000
京葉銀行	1,000	448.00	448,000
栃木銀行	1,000	414.00	414,000
トモニホールディングス	2,400	444.00	1,065,600
フィデアホールディングス	5,600	191.00	1,069,600
池田泉州ホールディングス	1,900	455.00	864,500
SBIホールディングス	900	1,263.00	1,136,700
大和証券グループ本社	15,000	894.00	13,410,000
野村ホールディングス	5,700	660.00	3,762,000
NKSJホールディングス	1,300	2,650.00	3,445,000
MS&ADインシュアランスグループホール	1,800	2,380.00	4,284,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,400	1,696.00	4,070,400
第一生命保険	9,100	1,485.00	13,513,500
東京海上ホールディングス	3,300	3,093.00	10,206,900
T&Dホールディングス	3,000	1,245.00	3,735,000
クレディセゾン	500	2,140.00	1,070,000
日本証券金融	700	590.00	413,000
アイフル	3,200	324.00	1,036,800
イオンフィナンシャルサービス	200	2,374.00	474,800
ジャックス	2,000	431.00	862,000
オリックス	4,500	1,486.00	6,687,000
三菱UFJリース	1,200	515.00	618,000
野村不動産ホールディングス	300	2,074.00	622,200
東急不動産ホールディングス	1,700	807.00	1,371,900
飯田グループホールディングス	300	1,524.00	457,200

パーク 2 4	200	1,924.00	384,800
三井不動産	1,000	3,239.00	3,239,000
三菱地所	2,000	2,509.00	5,018,000
東京建物	1,000	869.00	869,000
大京	3,000	212.00	636,000
レオパレス 2 1	1,000	524.00	524,000
イオンモール	200	2,706.00	541,200
日本空港ビルディング	200	2,619.00	523,800
総合警備保障	300	2,256.00	676,800
ディー・エヌ・エー	600	1,833.00	1,099,800
博報堂DYホールディングス	1,900	718.00	1,364,200
ケネディクス	800	365.00	292,000
電通	1,100	4,030.00	4,433,000
みらかホールディングス	300	4,395.00	1,318,500
オリエンタルランド	100	15,675.00	1,567,500
ダスキン	500	1,939.00	969,500
ラウンドワン	800	881.00	704,800
ユー・エス・エス	900	1,463.00	1,316,700
エイチ・アイ・エス	100	5,670.00	567,000
セコム	900	5,847.00	5,262,300
メイテック	200	2,815.00	563,000
アサツー ディ・ケイ	400	2,142.00	856,800
ベネッセホールディングス	500	4,015.00	2,007,500
小計 銘柄数 : 553			1,988,806,100
組入時価比率 : 97.6%			100.0%
合計			1,988,806,100

(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。

(2) 株式以外の有価証券(平成 26 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。