

平成26年7月期（平成25年7月9日～平成26年7月8日）決算短信

平成26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 投信ディスプレイ部長 村山 治子 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成26年9月25日  
 分配金支払開始日 平成26年8月15日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年7月期の運用状況（平成25年7月9日～平成26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26年7月期	1,892,525	(98.7)	24,050	(1.3)	1,916,575	(100)
平成25年7月期	1,441,236	(98.4)	22,802	(1.6)	1,464,038	(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26年7月期	102,380	46,249	25,355	123,274
平成25年7月期	88,694	33,596	19,911	102,380

(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26年7月期	2,027,959	111,383	1,916,575	155,473
平成25年7月期	1,572,493	108,454	1,464,038	143,000

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成26年7月期	1,990.00
平成25年7月期	1,870.00

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 225 連動型上場投資信託

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 12 期 (平成 25 年 7 月 8 日現在)	第 13 期 (平成 26 年 7 月 8 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	126,639,258,036	132,404,033,805
株式	1,441,236,290,500	1,892,525,209,000
派生商品評価勘定	1,631,927,904	273,050,966
未収入金	1,717,952,400	295,907,380
未収配当金	1,253,161,000	1,731,530,000
未収利息	85,917	86,610
その他未収収益	14,376,981	11,205,629
差入委託証拠金	-	718,637,000
流動資産合計	1,572,493,052,738	2,027,959,660,390
資産合計	1,572,493,052,738	2,027,959,660,390
負債の部		
流動負債		
前受金	1,530,674,000	-
未払収益分配金	19,145,081,505	24,531,576,546
未払受託者報酬	419,008,211	585,532,784
未払委託者報酬	1,023,721,813	1,583,702,736
未払利息	3,686,742	3,941,218
有価証券貸借取引受入金	86,319,049,950	84,659,489,775
その他未払費用	13,115,662	19,720,263
流動負債合計	108,454,337,883	111,383,963,322
負債合計	108,454,337,883	111,383,963,322
純資産の部		
元本等		
元本	1,259,992,075,305	1,517,136,243,978
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	204,046,639,550	399,439,453,090
(分配準備積立金)	64,632,971	42,022,437
元本等合計	1,464,038,714,855	1,916,575,697,068
純資産合計	1,464,038,714,855	1,916,575,697,068
負債純資産合計	1,572,493,052,738	2,027,959,660,390

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 12 期		第 13 期	
	自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日		自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日	
営業収益				
受取配当金		20,550,694,628		28,437,742,184
受取利息		83,393,267		75,209,364
有価証券売買等損益		503,505,227,349		142,881,963,643
派生商品取引等損益		12,149,067,872		3,545,299,846
その他収益		175,683,973		124,635,492
営業収益合計		536,464,067,089		175,064,850,529
営業費用				
支払利息		35,038,136		35,381,370
受託者報酬		733,748,497		1,106,100,419
委託者報酬		1,717,629,882		2,946,060,033
その他費用		26,788,862		41,079,206
営業費用合計		2,513,205,377		4,128,621,028
営業利益又は営業損失(△)		533,950,861,712		170,936,229,501
経常利益又は経常損失(△)		533,950,861,712		170,936,229,501
当期純利益又は当期純損失(△)		533,950,861,712		170,936,229,501
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(△)		△284,273,152,964		204,046,639,550
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		128,938,358,628
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
剰余金減少額又は欠損金増加額		26,485,987,693		79,950,198,043
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,606,968,640		79,950,198,043
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		20,879,019,053		-
分配金		19,145,081,505		24,531,576,546
期末剰余金又は期末欠損金(△)		204,046,639,550		399,439,453,090

## (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った場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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 25 年 7 月 9 日から平成 26 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 12 期 平成 25 年 7 月 8 日現在	第 13 期 平成 26 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 102,380,115 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 123,274,254 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 14,300.0 円 (10 口当たり純資産額) (143,000 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 15,547.3 円 (10 口当たり純資産額) (155,473 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 82,631,909,300 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 80,101,690,300 円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 12 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日	第 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 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>20,774,733,732 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>913,147,985 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>21,687,881,717 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,478,167,241 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>19,209,714,476 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>19,145,081,505 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>64,632,971 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>102,380,115 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>1,870 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	20,774,733,732 円	分配準備積立金	B	913,147,985 円	配当等収益合計額	C=A+B	21,687,881,717 円	経費	D	2,478,167,241 円	収益分配可能額	E=C-D	19,209,714,476 円	収益分配金	F	19,145,081,505 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	64,632,971 円	口数	H	102,380,115 口	10 口当たり分配金	I=F/H×10	1,870 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>28,602,205,670 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>64,632,971 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>28,666,838,641 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>4,093,239,658 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>24,573,598,983 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>24,531,576,546 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>42,022,437 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>123,274,254 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>1,990 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	28,602,205,670 円	分配準備積立金	B	64,632,971 円	配当等収益合計額	C=A+B	28,666,838,641 円	経費	D	4,093,239,658 円	収益分配可能額	E=C-D	24,573,598,983 円	収益分配金	F	24,531,576,546 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	42,022,437 円	口数	H	123,274,254 口	10 口当たり分配金	I=F/H×10	1,990 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	20,774,733,732 円																																																											
分配準備積立金	B	913,147,985 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	21,687,881,717 円																																																											
経費	D	2,478,167,241 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	19,209,714,476 円																																																											
収益分配金	F	19,145,081,505 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	64,632,971 円																																																											
口数	H	102,380,115 口																																																											
10 口当たり分配金	I=F/H×10	1,870 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	28,602,205,670 円																																																											
分配準備積立金	B	64,632,971 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	28,666,838,641 円																																																											
経費	D	4,093,239,658 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	24,573,598,983 円																																																											
収益分配金	F	24,531,576,546 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	42,022,437 円																																																											
口数	H	123,274,254 口																																																											
10 口当たり分配金	I=F/H×10	1,990 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 12 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日	第 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 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。 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。</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>	<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 12 期 平成 25 年 7 月 8 日現在	第 13 期 平成 26 年 7 月 8 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。 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>	<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 12 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日	第 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 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 12 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日	第 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日
期首元本額 1,091,563,642,245 円	期首元本額 1,259,992,075,305 円
期中追加設定元本額 413,473,110,060 円	期中追加設定元本額 569,191,242,730 円
期中一部交換元本額 245,044,677,000 円	期中一部交換元本額 312,047,074,057 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第 12 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日	第 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 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	440,847,476,980	119,636,967,289
合計	440,847,476,980	119,636,967,289

## 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 12 期(平成 25 年 7 月 8 日現在)				第 13 期(平成 26 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	20,814,336,000	—	22,447,200,000	1,631,927,904	23,564,344,000	—	23,838,360,000	273,050,966
合計	20,814,336,000	—	22,447,200,000	1,631,927,904	23,564,344,000	—	23,838,360,000	273,050,966

(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 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	4,850,000	328.00	1,590,800,000	貸付有価証券 299,300 株
		マルハニチロ	485,000	1,635.00	792,975,000	
		国際石油開発帝石	1,940,000	1,522.00	2,952,680,000	
		コムシスホールディングス	4,850,000	1,849.00	8,967,650,000	
		大成建設	4,850,000	554.00	2,686,900,000	貸付有価証券 2,903,000 株 (2,903,000 株)
		大林組	4,850,000	707.00	3,428,950,000	
		清水建設	4,850,000	703.00	3,409,550,000	
		鹿島建設	4,850,000	439.00	2,129,150,000	
		大和ハウス工業	4,850,000	2,167.00	10,509,950,000	貸付有価証券 514,000 株 (514,000 株)
		積水ハウス	4,850,000	1,419.00	6,882,150,000	
		日揮	4,850,000	3,078.00	14,928,300,000	
		千代田化工建設	4,850,000	1,200.00	5,820,000,000	貸付有価証券 1,423,000 株
		日清製粉グループ本社	4,850,000	1,199.00	5,815,150,000	貸付有価証券 148,500 株 (148,500 株)
		明治ホールディングス	485,000	6,890.00	3,341,650,000	
		日本ハム	4,850,000	2,018.00	9,787,300,000	
		サッポロホールディングス	4,850,000	434.00	2,104,900,000	
		アサヒグループホールディングス	4,850,000	3,275.00	15,883,750,000	貸付有価証券 56,500 株 (56,500 株)
		キリンホールディングス	4,850,000	1,470.00	7,129,500,000	
		宝ホールディングス	4,850,000	895.00	4,340,750,000	
		キッコーマン	4,850,000	2,108.00	10,223,800,000	貸付有価証券 25,000 株
		味の素	4,850,000	1,607.00	7,793,950,000	
ニチレイ	4,850,000	478.00	2,318,300,000			
日本たばこ産業	4,850,000	3,676.00	17,828,600,000			

東洋紡	4,850,000	175.00	848,750,000	
ユニチカ	4,850,000	48.00	232,800,000	貸付有価証券 3,314,000 株
日清紡ホールディングス	4,850,000	1,021.00	4,951,850,000	
帝人	4,850,000	246.00	1,193,100,000	貸付有価証券 983,000 株
東レ	4,850,000	680.00	3,298,000,000	
王子ホールディングス	4,850,000	420.00	2,037,000,000	貸付有価証券 375,000 株
日本製紙	485,000	1,902.00	922,470,000	貸付有価証券 249,400 株 (139,900 株)
北越紀州製紙	4,850,000	450.00	2,182,500,000	貸付有価証券 294,700 株 (267,700 株)
クラレ	4,850,000	1,324.00	6,421,400,000	
旭化成	4,850,000	785.00	3,807,250,000	
昭和電工	4,850,000	145.00	703,250,000	貸付有価証券 2,634,000 株 (268,000 株)
住友化学	4,850,000	386.00	1,872,100,000	
日産化学工業	4,850,000	1,650.00	8,002,500,000	
日本曹達	4,850,000	543.00	2,633,550,000	
東ソー	4,850,000	485.00	2,352,250,000	
トクヤマ	4,850,000	328.00	1,590,800,000	貸付有価証券 79,000 株
電気化学工業	4,850,000	388.00	1,881,800,000	
信越化学工業	4,850,000	6,146.00	29,808,100,000	
三井化学	4,850,000	274.00	1,328,900,000	貸付有価証券 3,249,000 株 (382,000 株)
三菱ケミカルホールディングス	2,425,000	451.00	1,093,675,000	
宇部興産	4,850,000	178.00	863,300,000	
日本化薬	4,850,000	1,292.00	6,266,200,000	
花王	4,850,000	4,083.00	19,802,550,000	
富士フイルムホールディングス	4,850,000	2,867.00	13,904,950,000	
資生堂	4,850,000	1,847.00	8,957,950,000	
日東電工	4,850,000	4,760.00	23,086,000,000	
協和発酵キリン	4,850,000	1,387.00	6,726,950,000	貸付有価証券 58,000 株
武田薬品工業	4,850,000	4,684.00	22,717,400,000	



アステラス製薬	24,250,100	1,353.00	32,810,385,300	貸付有価証券 318,200株(318,200株)
大日本住友製薬	4,850,000	1,168.00	5,664,800,000	貸付有価証券 836,400株
塩野義製薬	4,850,000	2,119.00	10,277,150,000	
中外製薬	4,850,000	2,847.00	13,807,950,000	
エーザイ	4,850,000	4,227.00	20,500,950,000	貸付有価証券 727,600株(40,400株)
第一三共	4,850,000	1,876.00	9,098,600,000	
昭和シェル石油	4,850,000	1,120.00	5,432,000,000	貸付有価証券 153,500株
JXホールディングス	4,850,000	532.00	2,580,200,000	
横浜ゴム	4,850,000	872.00	4,229,200,000	
ブリヂストン	4,850,000	3,661.00	17,755,850,000	貸付有価証券 447,400株
日東紡績	4,850,000	414.00	2,007,900,000	
旭硝子	4,850,000	604.00	2,929,400,000	貸付有価証券 121,000株
日本板硝子	4,850,000	143.00	693,550,000	貸付有価証券 225,000株(225,000株)
日本電気硝子	7,275,000	592.00	4,306,800,000	貸付有価証券 2,539,000株
住友大阪セメント	4,850,000	375.00	1,818,750,000	
太平洋セメント	4,850,000	402.00	1,949,700,000	
東海カーボン	4,850,000	301.00	1,459,850,000	
TOTO	4,850,000	1,370.00	6,644,500,000	
日本碍子	4,850,000	2,371.00	11,499,350,000	
新日鐵住金	4,850,000	317.00	1,537,450,000	
神戸製鋼所	4,850,000	159.00	771,150,000	貸付有価証券 283,000株(283,000株)
ジェイ エフ イー ホールディングス	485,000	2,108.00	1,022,380,000	
日新製鋼	485,000	1,331.00	645,535,000	
大平洋金属	4,850,000	528.00	2,560,800,000	貸付有価証券 1,714,000株(3,000株)
日本軽金属ホールディングス	4,850,000	158.00	766,300,000	
三井金属鉱業	4,850,000	302.00	1,464,700,000	
東邦亜鉛	4,850,000	433.00	2,100,050,000	

三菱マテリアル	4,850,000	374.00	1,813,900,000	
住友金属鉱山	4,850,000	1,747.00	8,472,950,000	貸付有価証券 63,000株(63,000 株)
DOWAホールディング ス	4,850,000	985.00	4,777,250,000	
古河機械金属	4,850,000	211.00	1,023,350,000	貸付有価証券 136,000株
古河電気工業	4,850,000	219.00	1,062,150,000	
住友電気工業	4,850,000	1,488.00	7,216,800,000	
フジクラ	4,850,000	517.00	2,507,450,000	
SUMCO	485,000	935.00	453,475,000	貸付有価証券 326,000株
東洋製罐グループホール ディングス	4,850,000	1,567.00	7,599,950,000	
日本製鋼所	4,850,000	461.00	2,235,850,000	貸付有価証券 2,509,000株 (440,000株)
オークマ	4,850,000	961.00	4,660,850,000	
アマダ	4,850,000	1,031.00	5,000,350,000	貸付有価証券 102,000株(102,000 株)
小松製作所	4,850,000	2,333.00	11,315,050,000	貸付有価証券 3,120,800株
住友重機械工業	4,850,000	483.00	2,342,550,000	
日立建機	4,850,000	2,033.00	9,860,050,000	貸付有価証券 1,372,100株(58,800 株)
クボタ	4,850,000	1,423.00	6,901,550,000	
荏原製作所	4,850,000	658.00	3,191,300,000	貸付有価証券 1,012,000株
ダイキン工業	4,850,000	6,772.00	32,844,200,000	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
日本精工	4,850,000	1,369.00	6,639,650,000	
NTN	4,850,000	466.00	2,260,100,000	
ジェイテクト	4,850,000	1,786.00	8,662,100,000	貸付有価証券 87,900株(87,900 株)
日立造船	970,000	558.00	541,260,000	貸付有価証券 143,900株
三菱重工業	4,850,000	658.00	3,191,300,000	
IHI	4,850,000	468.00	2,269,800,000	
コニカミノルタ	4,850,000	1,020.00	4,947,000,000	
ミネベア	4,850,000	1,207.00	5,853,950,000	貸付有価証券 56,000株
日立製作所	4,850,000	767.00	3,719,950,000	

東芝	4,850,000	481.00	2,332,850,000	
三菱電機	4,850,000	1,286.00	6,237,100,000	
富士電機	4,850,000	513.00	2,488,050,000	
安川電機	4,850,000	1,295.00	6,280,750,000	貸付有価証券 737,600 株 (43,500 株)
明電舎	4,850,000	436.00	2,114,600,000	
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	4,850,000	681.00	3,302,850,000	貸付有価証券 830,000 株 (437,000 株)
日本電気	4,850,000	357.00	1,731,450,000	
富士通	4,850,000	774.00	3,753,900,000	
沖電気工業	4,850,000	225.00	1,091,250,000	
パナソニック	4,850,000	1,240.00	6,014,000,000	
シャープ	4,850,000	335.00	1,624,750,000	貸付有価証券 3,307,000 株
ソニー	4,850,000	1,718.00	8,332,300,000	貸付有価証券 3,249,500 株 (206,300 株)
TDK	4,850,000	4,915.00	23,837,750,000	
ミツミ電機	4,850,000	768.00	3,724,800,000	
アルプス電気	4,850,000	1,440.00	6,984,000,000	貸付有価証券 95,600 株 (95,600 株)
パイオニア	4,850,000	254.00	1,231,900,000	貸付有価証券 767,100 株
横河電機	4,850,000	1,297.00	6,290,450,000	
アドバンテスト	9,700,000	1,226.00	11,892,200,000	貸付有価証券 5,351,700 株 (1,142,100 株)
カシオ計算機	4,850,000	1,571.00	7,619,350,000	貸付有価証券 3,346,600 株
ファナック	4,850,000	17,635.00	85,529,750,000	
京セラ	9,700,000	4,872.00	47,258,400,000	
太陽誘電	4,850,000	1,113.00	5,398,050,000	貸付有価証券 2,279,000 株
大日本スクリーン製造	4,850,000	493.00	2,391,050,000	貸付有価証券 78,000 株
キヤノン	7,275,000	3,304.00	24,036,600,000	
リコー	4,850,000	1,189.00	5,766,650,000	貸付有価証券 100 株
東京エレクトロン	4,850,000	7,200.00	34,920,000,000	
デンソー	4,850,000	4,727.00	22,925,950,000	
三井造船	4,850,000	217.00	1,052,450,000	

川崎重工業	4,850,000	407.00	1,973,950,000	
日産自動車	4,850,000	989.00	4,796,650,000	貸付有価証券 75,400 株
いすゞ自動車	4,850,000	686.00	3,327,100,000	
トヨタ自動車	4,850,000	6,131.00	29,735,350,000	貸付有価証券 19,800 株 (19,800 株)
日野自動車	4,850,000	1,443.00	6,998,550,000	
三菱自動車工業	485,000	1,126.00	546,110,000	
マツダ	4,850,000	507.00	2,458,950,000	
本田技研工業	9,700,000	3,575.00	34,677,500,000	
スズキ	4,850,000	3,360.00	16,296,000,000	
富士重工業	4,850,000	2,906.00	14,094,100,000	
テルモ	9,700,000	2,291.00	22,222,700,000	
ニコン	4,850,000	1,585.00	7,687,250,000	貸付有価証券 3,302,500 株 (128,100 株)
オリンパス	4,850,000	3,655.00	17,726,750,000	
シチズンホールディング ス	4,850,000	792.00	3,841,200,000	
凸版印刷	4,850,000	789.00	3,826,650,000	貸付有価証券 168,000 株 (168,000 株)
大日本印刷	4,850,000	1,071.00	5,194,350,000	貸付有価証券 1,383,000 株 (1,383,000 株)
ヤマハ	4,850,000	1,606.00	7,789,100,000	
東京電力	485,000	425.00	206,125,000	
中部電力	485,000	1,265.00	613,525,000	
関西電力	485,000	1,002.00	485,970,000	貸付有価証券 18,900 株
東京瓦斯	4,850,000	594.00	2,880,900,000	貸付有価証券 57,000 株 (57,000 株)
大阪瓦斯	4,850,000	428.00	2,075,800,000	
東武鉄道	4,850,000	529.00	2,565,650,000	貸付有価証券 97,000 株
東京急行電鉄	4,850,000	730.00	3,540,500,000	
小田急電鉄	4,850,000	975.00	4,728,750,000	貸付有価証券 186,000 株
京王電鉄	4,850,000	803.00	3,894,550,000	貸付有価証券 142,000 株 (142,000 株)
京成電鉄	4,850,000	1,009.00	4,893,650,000	貸付有価証券 191,000 株 (191,000 株)

				株)
東日本旅客鉄道	485,000	8,140.00	3,947,900,000	
西日本旅客鉄道	485,000	4,548.00	2,205,780,000	
東海旅客鉄道	485,000	14,800.00	7,178,000,000	
日本通運	4,850,000	495.00	2,400,750,000	
ヤマトホールディングス	4,850,000	2,082.00	10,097,700,000	貸付有価証券 832,200 株
日本郵船	4,850,000	297.00	1,440,450,000	
商船三井	4,850,000	383.00	1,857,550,000	
川崎汽船	4,850,000	221.00	1,071,850,000	貸付有価証券 3,249,000 株
ANAホールディングス	4,850,000	240.00	1,164,000,000	貸付有価証券 609,000 株 (280,000 株)
三菱倉庫	4,850,000	1,518.00	7,362,300,000	貸付有価証券 106,000 株
ヤフー	1,940,000	469.00	909,860,000	貸付有価証券 65,100 株
トレンドマイクロ	4,850,000	3,400.00	16,490,000,000	貸付有価証券 689,900 株
スカパー J S A Tホール ディングス	485,000	601.00	291,485,000	
日本電信電話	485,000	6,512.00	3,158,320,000	
K D D I	9,700,000	6,224.00	60,372,800,000	貸付有価証券 100 株
N T T ドコモ	485,000	1,765.00	856,025,000	
東宝	485,000	2,421.00	1,174,185,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	4,850,000	3,855.00	18,696,750,000	貸付有価証券 36,200 株 (36,200 株)
コナミ	4,850,000	2,252.00	10,922,200,000	貸付有価証券 2,819,300 株 (15,100 株)
ソフトバンク	14,550,100	7,537.00	109,664,103,700	貸付有価証券 26,700 株 (26,700 株)
双日	485,000	179.00	86,815,000	
伊藤忠商事	4,850,000	1,310.00	6,353,500,000	
丸紅	4,850,000	743.00	3,603,550,000	
豊田通商	4,850,000	2,887.00	14,001,950,000	
三井物産	4,850,000	1,651.00	8,007,350,000	
住友商事	4,850,000	1,373.00	6,659,050,000	
三菱商事	4,850,000	2,139.00	10,374,150,000	
J. フロント リテイリ	4,850,000	695.00	3,370,750,000	

ング				
三越伊勢丹ホールディングス	4,850,000	1,272.00	6,169,200,000	
セブン&アイ・ホールディングス	4,850,000	4,433.00	21,500,050,000	
高島屋	4,850,000	964.00	4,675,400,000	貸付有価証券 797,000株(619,000株)
丸井グループ	4,850,000	957.00	4,641,450,000	
イオン	4,850,000	1,180.00	5,723,000,000	貸付有価証券 445,200株
ユニーグループ・ホールディングス	4,850,000	636.00	3,084,600,000	貸付有価証券 327,700株(327,700株)
ファーストリテイリング	4,850,000	33,220.00	161,117,000,000	貸付有価証券 124,300株
新生銀行	4,850,000	227.00	1,100,950,000	
あおぞら銀行	4,850,000	337.00	1,634,450,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,850,000	625.00	3,031,250,000	
りそなホールディングス	485,000	609.00	295,365,000	貸付有価証券 26,000株(26,000株)
三井住友トラスト・ホールディングス	4,850,000	468.00	2,269,800,000	
三井住友フィナンシャルグループ	485,000	4,275.00	2,073,375,000	貸付有価証券 6,200株(6,200株)
千葉銀行	4,850,000	730.00	3,540,500,000	
横浜銀行	4,850,000	597.00	2,895,450,000	貸付有価証券 217,000株
ふくおかフィナンシャルグループ	4,850,000	498.00	2,415,300,000	
静岡銀行	4,850,000	1,134.00	5,499,900,000	
みずほフィナンシャルグループ	4,850,000	204.00	989,400,000	
大和証券グループ本社	4,850,000	882.00	4,277,700,000	
野村ホールディングス	4,850,000	716.00	3,472,600,000	
松井証券	4,850,000	1,006.00	4,879,100,000	貸付有価証券 1,388,600株(13,200株)
NKS Jホールディングス	1,212,500	2,666.00	3,232,525,000	貸付有価証券 19,000株
MS&ADインシュアランスグループホール	1,455,000	2,347.00	3,414,885,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	970,000	1,706.00	1,654,820,000	貸付有価証券 83,300株
第一生命保険	485,000	1,469.00	712,465,000	貸付有価証券 194,400株

	東京海上ホールディングス	2,425,000	3,237.00	7,849,725,000	
	T&Dホールディングス	970,000	1,370.00	1,328,900,000	
	クレディセゾン	4,850,000	2,118.00	10,272,300,000	
	東急不動産ホールディングス	4,850,000	783.00	3,797,550,000	
	三井不動産	4,850,000	3,390.00	16,441,500,000	貸付有価証券 136,000株(74,000株)
	三菱地所	4,850,000	2,498.00	12,115,300,000	
	平和不動産	970,000	1,588.00	1,540,360,000	
	東京建物	4,850,000	927.00	4,495,950,000	
	住友不動産	4,850,000	4,330.00	21,000,500,000	
	電通	4,850,000	4,140.00	20,079,000,000	貸付有価証券 100,000株
	東京ドーム	4,850,000	477.00	2,313,450,000	
	セコム	4,850,000	6,222.00	30,176,700,000	
	小計 銘柄数：225			1,892,525,209,000	
	組入時価比率：98.7%			100.0%	
	合計			1,892,525,209,000	

(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。

(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 26 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。