

平成27年10月期（平成27年4月8日～平成27年10月7日）決算短信

平成27年11月18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12月24日
 分配金支払開始日 平成27年11月13日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年10月期の運用状況（平成27年4月8日～平成27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27年10月期	224,563	(98.3)	3,844	(1.7)	228,408	(100)
平成27年4月期	209,990	(98.2)	3,875	(1.8)	213,866	(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10月期	14,887	5,893	3,727	17,053
平成27年4月期	8,595	12,092	5,801	14,887

(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/当特定期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
平成27年10月期	245,707	17,298	228,408	13,393
平成27年4月期	219,244	5,377	213,866	14,366

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成27年10月期	109.00
平成27年4月期	111.00

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3期 (平成27年4月7日現在)	第4期 (平成27年10月7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,761,593,169	17,307,250,100
株式	209,990,844,100	224,563,483,780
派生商品評価勘定	105,727,036	70,499,484
未収入金	1,667,979,777	1,881,967,700
未収配当金	1,638,878,877	1,742,359,133
未収利息	3,467	14,023
その他未収収益	2,250,634	1,976,576
差入委託証拠金	76,872,100	139,705,200
流動資産合計	219,244,149,160	245,707,255,996
資産合計	219,244,149,160	245,707,255,996
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,652,499,624	1,858,871,503
未払受託者報酬	45,281,776	63,758,757
未払委託者報酬	136,517,105	192,262,912
未払利息	111,895	270,585
有価証券貸借取引受入金	3,520,050,565	15,108,913,575
その他未払費用	22,922,498	74,727,402
流動負債合計	5,377,383,463	17,298,804,734
負債合計	5,377,383,463	17,298,804,734
純資産の部		
元本等		
元本	173,080,726,384	198,268,257,742
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	40,786,039,313	30,140,193,520
(分配準備積立金)	6,625,444	5,728,750
元本等合計	213,866,765,697	228,408,451,262
純資産合計	213,866,765,697	228,408,451,262
負債純資産合計	219,244,149,160	245,707,255,996

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 自 平成26年10月8日 至 平成27年4月7日	第4期 自 平成27年4月8日 至 平成27年10月7日
営業収益		
受取配当金	1,887,330,040	2,160,694,552
受取利息	1,081,511	2,468,785
有価証券売買等損益	33,341,756,560	△16,074,707,636

派生商品取引等損益	428,891,583	△244,376,044
その他収益	8,311,754	12,550,123
営業収益合計	35,667,371,448	△14,143,370,220
営業費用		
支払利息	358,920	1,099,651
受託者報酬	45,281,776	63,758,757
委託者報酬	136,517,105	192,262,912
その他費用	60,019,145	60,617,331
営業費用合計	242,176,946	317,738,651
営業利益又は営業損失(△)	35,425,194,502	△14,461,108,871
経常利益又は経常損失(△)	35,425,194,502	△14,461,108,871
当期純利益又は当期純損失(△)	35,425,194,502	△14,461,108,871
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(△)	1,005,074,093	40,786,039,313
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,972,000,168	16,480,809,543
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	16,480,809,543
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,963,729,826	10,806,674,962
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,963,729,826	10,806,674,962
分配金	1,652,499,624	1,858,871,503
期末剰余金又は期末欠損金(△)	40,786,039,313	30,140,193,520

(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 27 年 4 月 8 日から平成 27 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 3 期 平成 27 年 4 月 7 日現在	第 4 期 平成 27 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 14,887,384 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 17,053,867 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	14,366 円	1 口当たり純資産額	13,393 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	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	14,665,551,450 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日			第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 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	1,896,364,385 円	当期配当等収益額	A	2,174,613,809 円
分配準備積立金	B	4,578,709 円	分配準備積立金	B	6,625,444 円
配当等収益合計額	C=A+B	1,900,943,094 円	配当等収益合計額	C=A+B	2,181,239,253 円
経費	D	241,818,026 円	経費	D	316,639,000 円
収益分配可能額	E=C-D	1,659,125,068 円	収益分配可能額	E=C-D	1,864,600,253 円
収益分配金	F	1,652,499,624 円	収益分配金	F	1,858,871,503 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,625,444 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,728,750 円
口数	H	14,887,384 口	口数	H	17,053,867 口
1 口当たり分配金	I=F/H	111 円	1 口当たり分配金	I=F/H	109 円
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。			2. その他費用 その他費用のうち 50,217,571 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 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日		第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 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 3 期 平成 27 年 4 月 7 日現在	第 4 期 平成 27 年 10 月 7 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 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日	第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 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 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日	第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日
期首元本額 99,933,445,436 円	期首元本額 173,080,726,384 円
期中追加設定元本額 140,592,427,432 円	期中追加設定元本額 68,517,726,366 円
期中一部交換元本額 67,445,146,484 円	期中一部交換元本額 43,330,195,008 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日	第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 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	29,494,265,829	△15,709,835,095
合計	29,494,265,829	△15,709,835,095

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 3 期(平成 27 年 4 月 7 日現在)			第 4 期(平成 27 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)
市場取引						
株価指数先物取引						
買建	3,736,176,100	—	3,842,336,000	3,573,898,200	—	3,644,838,000
合計	3,736,176,100	—	3,842,336,000	3,573,898,200	—	3,644,838,000

(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	国際石油開発帝石	819,600	1,217.50	997,863,000	
		安藤・間	103,800	755.00	78,369,000	
		コムシスホールディングス	69,200	1,478.00	102,277,600	
		ミサワホーム	18,400	753.00	13,855,200	貸付有価証券 4,500株
		大成建設	808,000	749.00	605,192,000	
		大林組	467,000	984.00	459,528,000	貸付有価証券 91,000株(91,000 株)
		清水建設	476,000	995.00	473,620,000	貸付有価証券 7,000株
		長谷工コーポレーション	194,500	1,363.00	265,103,500	
		鹿島建設	684,000	629.00	430,236,000	
		三井住友建設	631,200	155.00	97,836,000	貸付有価証券 318,200株
		大東建託	58,100	12,655.00	735,255,500	
		NIPPO	36,000	2,076.00	74,736,000	
		住友林業	114,700	1,377.00	157,941,900	貸付有価証券 600株
		大和ハウス工業	459,000	3,033.00	1,392,147,000	貸付有価証券 158,800株(158,100 株)
		積水ハウス	489,600	1,985.50	972,100,800	貸付有価証券 224,600株
		協和エクシオ	66,000	1,205.00	79,530,000	
		日揮	156,000	1,786.00	278,616,000	
		千代田化工建設	112,000	901.00	100,912,000	貸付有価証券 13,000株
		カルビー	57,600	3,915.00	225,504,000	貸付有価証券 17,900株
		ヤクルト本社	83,400	6,060.00	505,404,000	貸付有価証券 41,900株(40,900 株)
明治ホールディングス	92,200	9,300.00	857,460,000			

日本ハム	114,000	2,428.00	276,792,000	貸付有価証券 12,000株(11,000株)
アサヒグループホールディングス	291,900	3,720.00	1,085,868,000	貸付有価証券 145,900株
麒麟ホールディングス	630,500	1,597.50	1,007,223,750	貸付有価証券 315,200株
伊藤園	46,200	2,581.00	119,242,200	貸付有価証券 23,200株
キッコーマン	127,000	3,500.00	444,500,000	
味の素	359,000	2,574.50	924,245,500	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
キューピー	79,200	2,620.00	207,504,000	
ニチレイ	166,000	793.00	131,638,000	
東洋水産	81,300	4,470.00	363,411,000	
日清食品ホールディングス	65,800	5,560.00	365,848,000	
日本たばこ産業	904,200	3,994.00	3,611,374,800	貸付有価証券 452,100株
東レ	1,125,000	1,032.00	1,161,000,000	貸付有価証券 11,000株(11,000株)
王子ホールディングス	597,000	558.00	333,126,000	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
大王製紙	64,400	1,007.00	64,850,800	貸付有価証券 32,000株(15,000株)
クラレ	229,500	1,510.00	346,545,000	
旭化成	907,000	904.60	820,472,200	
住友化学	1,071,000	690.00	738,990,000	
日産化学工業	94,200	2,745.00	258,579,000	
東ソー	389,000	619.00	240,791,000	
デンカ	301,000	537.00	161,637,000	
信越化学工業	260,800	6,560.00	1,710,848,000	
エア・ウォーター	129,000	1,890.00	243,810,000	
大陽日酸	186,700	1,201.00	224,226,700	貸付有価証券 93,900株(500株)
日本パーカライズニング	68,600	961.00	65,924,600	
J S R	143,600	1,854.00	266,234,400	
三菱ケミカルホールディングス	909,200	692.20	629,348,240	
日本合成化学工業	34,000	796.00	27,064,000	
ダイセル	204,600	1,540.00	315,084,000	

積水化学工業	336,600	1,316.00	442,965,600	
日本ゼオン	125,000	1,006.00	125,750,000	
アイカ工業	43,700	2,424.00	105,928,800	
宇部興産	733,000	226.00	165,658,000	
日立化成	71,900	1,842.00	132,439,800	
日本化薬	94,000	1,222.00	114,868,000	
日油	119,000	847.00	100,793,000	
花王	391,100	5,515.00	2,156,916,500	
日本ペイントホールディングス	125,900	2,330.00	293,347,000	貸付有価証券 63,400株
関西ペイント	176,300	1,724.00	303,941,200	貸付有価証券 900株
D I C	583,000	305.00	177,815,000	
富士フイルムホールディングス	332,800	4,594.00	1,528,883,200	
資生堂	258,700	2,710.50	701,206,350	貸付有価証券 16,700株
コーセー	23,500	11,550.00	271,425,000	
ドクターシーラボ	19,700	2,348.00	46,255,600	貸付有価証券 10,000株
小林製薬	23,800	9,090.00	216,342,000	
日東電工	112,400	8,040.00	903,696,000	
ニフコ	32,400	4,490.00	145,476,000	
ユニ・チャーム	294,400	2,226.00	655,334,400	貸付有価証券 148,400株
協和発酵キリン	174,000	1,762.00	306,588,000	
武田薬品工業	545,100	5,486.00	2,990,418,600	
アステラス製薬	1,628,500	1,554.50	2,531,503,250	
塩野義製薬	227,100	4,275.00	970,852,500	
田辺三菱製薬	169,400	2,086.00	353,368,400	
中外製薬	144,800	3,625.00	524,900,000	貸付有価証券 72,300株
科研製薬	25,100	9,040.00	226,904,000	
エーザイ	191,800	6,887.00	1,320,926,600	
ロート製薬	66,100	1,877.00	124,069,700	
小野薬品工業	66,100	14,450.00	955,145,000	
久光製薬	41,000	4,080.00	167,280,000	貸付有価証券 8,200株(8,200株)
持田製薬	10,000	6,970.00	69,700,000	
参天製薬	267,600	1,605.00	429,498,000	

ツムラ	45,800	2,638.00	120,820,400	貸付有価証券 23,100 株
沢井製薬	23,000	7,250.00	166,750,000	
第一三共	489,100	2,156.50	1,054,744,150	
キョーリン製薬ホールディングス	38,800	1,880.00	72,944,000	
大塚ホールディングス	312,700	3,832.00	1,198,266,400	
大正製薬ホールディングス	35,000	6,990.00	244,650,000	
昭和シェル石油	146,200	1,031.00	150,732,200	
横浜ゴム	87,700	2,218.00	194,518,600	貸付有価証券 5,200 株
東洋ゴム工業	65,800	2,710.00	178,318,000	
ブリヂストン	490,800	4,257.00	2,089,335,600	貸付有価証券 7,000 株
住友ゴム工業	136,100	1,715.00	233,411,500	貸付有価証券 68,600 株
旭硝子	767,000	733.00	562,211,000	貸付有価証券 79,000 株
太平洋セメント	907,000	369.00	334,683,000	
TOTO	106,800	3,975.00	424,530,000	貸付有価証券 500 株 (500 株)
日本碍子	184,000	2,418.00	444,912,000	貸付有価証券 1,000 株 (1,000 株)
日本特殊陶業	125,300	3,025.00	379,032,500	
新日鐵住金	620,800	2,415.50	1,499,542,400	貸付有価証券 63,400 株 (7,900 株)
神戸製鋼所	2,514,000	148.00	372,072,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	370,900	1,800.00	667,620,000	
日立金属	147,900	1,546.00	228,653,400	
三井金属鉱業	395,000	236.00	93,220,000	
三菱マテリアル	907,000	404.00	366,428,000	
住友金属鉱山	401,000	1,523.00	610,723,000	
DOWAホールディングス	174,000	999.00	173,826,000	
住友電気工業	547,700	1,630.50	893,024,850	
アサヒホールディングス	21,900	1,921.00	42,069,900	
三和ホールディングス	136,700	868.00	118,655,600	
三協立山	19,000	1,692.00	32,148,000	
リンナイ	27,000	9,600.00	259,200,000	
日本発條	126,300	1,218.00	153,833,400	貸付有価証券 27,900 株 (19,800 株)

オーエスジー	66,200	2,246.00	148,685,200	貸付有価証券 33,300株(33,300株)
ディスコ	17,000	9,420.00	160,140,000	
ニューフレアテクノロジー	2,100	4,710.00	9,891,000	貸付有価証券 600株
ナブテスコ	88,500	2,407.00	213,019,500	
SMC	43,600	29,385.00	1,281,186,000	貸付有価証券 900株(900株)
小松製作所	712,400	1,898.00	1,352,135,200	
住友重機械工業	397,000	535.00	212,395,000	
日立建機	64,900	1,798.00	116,690,200	貸付有価証券 1,300株
クボタ	699,000	1,813.00	1,267,287,000	貸付有価証券 158,000株(141,000株)
荏原製作所	301,000	485.00	145,985,000	貸付有価証券 77,000株(77,000株)
ダイキン工業	202,200	7,403.00	1,496,886,600	
椿本チエイン	74,000	820.00	60,680,000	
タダノ	67,000	1,444.00	96,748,000	
平和	41,200	2,080.00	85,696,000	
ユニバーサルエンターテインメント	13,800	2,126.00	29,338,800	貸付有価証券 6,500株
セガサミーホールディングス	149,200	1,248.00	186,201,600	
T P R	15,500	2,936.00	45,508,000	
ホシザキ電機	40,600	8,530.00	346,318,000	
日本精工	285,200	1,291.00	368,193,200	貸付有価証券 5,100株
ジェイテクト	148,000	1,900.00	281,200,000	
不二越	129,000	533.00	68,757,000	貸付有価証券 63,000株
T H K	92,300	2,111.00	194,845,300	
イーグル工業	19,300	2,245.00	43,328,500	
マキタ	90,500	6,800.00	615,400,000	
三菱重工業	2,327,000	594.10	1,382,470,700	
I H I	1,000,000	343.00	343,000,000	
コニカミノルタ	325,100	1,326.00	431,082,600	
ブラザー工業	179,500	1,503.00	269,788,500	
ミネベア	207,000	1,286.00	266,202,000	
日立製作所	3,334,000	660.00	2,200,440,000	

三菱電機	1,389,000	1,192.50	1,656,382,500	
富士電機	386,000	484.00	186,824,000	
安川電機	170,100	1,301.00	221,300,100	貸付有価証券 20,300株
日本電産	153,800	8,437.00	1,297,610,600	
オムロン	150,000	3,880.00	582,000,000	
日本電気	1,797,000	389.00	699,033,000	
富士通	1,339,000	555.70	744,082,300	
沖電気工業	489,000	192.00	93,888,000	貸付有価証券 68,000株
セイコーエプソン	189,500	1,852.00	350,954,000	
ワコム	109,300	463.00	50,605,900	貸付有価証券 55,000株
パナソニック	1,700,300	1,296.00	2,203,588,800	
アンリツ	83,400	789.00	65,802,600	貸付有価証券 42,000株
富士通ゼネラル	42,000	1,496.00	62,832,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
日立国際電気	36,000	1,393.00	50,148,000	
TDK	83,800	7,150.00	599,170,000	
アルプス電気	114,500	3,380.00	387,010,000	
ヒロセ電機	23,600	14,240.00	336,064,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
日本航空電子工業	40,000	2,043.00	81,720,000	
横河電機	139,000	1,288.00	179,032,000	貸付有価証券 7,100株(7,100株)
日本光電工業	58,000	2,047.00	118,726,000	
堀場製作所	25,700	4,535.00	116,549,500	貸付有価証券 700株
キーエンス	31,500	59,240.00	1,866,060,000	
シスメックス	107,700	6,140.00	661,278,000	
スタンレー電気	99,700	2,597.00	258,920,900	
カシオ計算機	139,200	2,315.00	322,248,000	貸付有価証券 70,400株
ファナック	144,600	19,875.00	2,873,925,000	
エンプラス	6,300	4,395.00	27,688,500	
浜松ホトニクス	108,300	2,929.00	317,210,700	
京セラ	227,900	5,603.00	1,276,923,700	
村田製作所	145,700	15,680.00	2,284,576,000	
小糸製作所	83,200	4,170.00	346,944,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)

ミツバ	25,500	1,770.00	45,135,000	
キヤノン	747,600	3,586.00	2,680,893,600	貸付有価証券 373,800 株
リコー	417,500	1,286.00	536,905,000	
東京エレクトロン	116,800	6,303.00	736,190,400	
トヨタ紡織	48,500	2,342.00	113,587,000	
ユニプレス	26,700	2,505.00	66,883,500	
豊田自動織機	126,400	6,190.00	782,416,000	
デンソー	343,100	5,397.00	1,851,710,700	
東海理化電機製作所	36,600	2,635.00	96,441,000	
三井造船	537,000	187.00	100,419,000	
川崎重工業	1,009,000	458.00	462,122,000	
名村造船所	38,700	985.00	38,119,500	貸付有価証券 19,600 株 (200 株)
日産自動車	1,949,200	1,173.00	2,286,411,600	
いすゞ自動車	439,000	1,344.50	590,235,500	
トヨタ自動車	450,600	7,351.00	3,312,360,600	貸付有価証券 3,800 株 (3,800 株)
日野自動車	198,200	1,315.00	260,633,000	
三菱自動車工業	508,900	976.00	496,686,400	
NOK	67,200	2,705.00	181,776,000	
カルソニックカンセイ	106,000	946.00	100,276,000	
アイシン精機	127,100	4,425.00	562,417,500	
マツダ	413,800	2,108.00	872,290,400	
ダイハツ工業	165,700	1,555.00	257,663,500	貸付有価証券 83,500 株 (13,700 株)
本田技研工業	933,100	3,862.00	3,603,632,200	貸付有価証券 26,700 株 (26,700 株)
スズキ	290,300	3,855.00	1,119,106,500	
富士重工業	472,600	4,498.00	2,125,754,800	
ヤマハ発動機	196,100	2,701.00	529,666,100	
エクセディ	18,900	2,750.00	51,975,000	貸付有価証券 400 株
豊田合成	44,800	2,567.00	115,001,600	貸付有価証券 700 株
日本精機	37,000	2,541.00	94,017,000	
シマノ	56,000	18,180.00	1,018,080,000	
テイ・エス テック	29,300	3,465.00	101,524,500	
テルモ	212,900	3,420.00	728,118,000	貸付有価証券

				5,900株(5,900株)
ニコン	259,300	1,547.00	401,137,100	貸付有価証券 130,700株(35,300株)
トプコン	41,900	1,600.00	67,040,000	貸付有価証券 21,100株
オリンパス	206,800	3,895.00	805,486,000	
HOYA	323,100	4,499.00	1,453,626,900	
セイコーホールディングス	98,000	741.00	72,618,000	貸付有価証券 15,000株
バンダイナムコホールディングス	153,100	2,887.00	441,999,700	
パイロットコーポレーション	24,200	4,880.00	118,096,000	
アシックス	129,300	2,968.00	383,762,400	貸付有価証券 49,600株(9,800株)
ヤマハ	102,100	2,857.00	291,699,700	
ピジョン	78,700	3,025.00	238,067,500	
電源開発	100,700	3,850.00	387,695,000	
東京瓦斯	1,653,000	574.90	950,309,700	
大阪瓦斯	1,437,000	465.80	669,354,600	
東武鉄道	742,000	540.00	400,680,000	
相鉄ホールディングス	317,000	673.00	213,341,000	
東京急行電鉄	754,000	918.00	692,172,000	
小田急電鉄	445,000	1,121.00	498,845,000	貸付有価証券 3,000株
京王電鉄	388,000	879.00	341,052,000	
京成電鉄	208,000	1,378.00	286,624,000	
東日本旅客鉄道	253,800	10,875.00	2,760,075,000	貸付有価証券 79,200株(79,200株)
西日本旅客鉄道	133,600	8,056.00	1,076,281,600	
東海旅客鉄道	124,300	20,830.00	2,589,169,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
西日本鉄道	240,000	617.00	148,080,000	
近鉄グループホールディングス	1,398,000	453.00	633,294,000	貸付有価証券 520,000株
阪急阪神ホールディングス	932,000	750.00	699,000,000	
南海電気鉄道	415,000	640.00	265,600,000	
京阪電気鉄道	415,000	820.00	340,300,000	
名古屋鉄道	674,000	486.00	327,564,000	貸付有価証券 115,000株(3,000株)

日本通運	537,000	586.00	314,682,000	
ヤマトホールディングス	238,300	2,338.00	557,145,400	貸付有価証券 400 株
山九	169,000	598.00	101,062,000	
日本郵船	1,173,000	307.00	360,111,000	
A N A ホールディングス	2,729,000	344.80	940,959,200	
近鉄エクスプレス	24,800	2,036.00	50,492,800	貸付有価証券 2,100 株 (2,100 株)
グリーン	83,100	568.00	47,200,800	
ネクソン	130,600	1,631.00	213,008,600	
ティーガイア	13,600	1,812.00	24,643,200	貸付有価証券 1,800 株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	319,300	369.00	117,821,700	
野村総合研究所	85,370	4,650.00	396,970,500	貸付有価証券 3,040 株
フジ・メディア・ホール ディングス	142,700	1,474.00	210,339,800	貸付有価証券 54,400 株
オービック	47,200	5,500.00	259,600,000	
ヤフー	982,200	477.00	468,509,400	貸付有価証券 495,200 株
トレンドマイクロ	66,500	4,190.00	278,635,000	
日本オラクル	22,000	5,260.00	115,720,000	
伊藤忠テクノソリューシ ョンズ	31,000	2,688.00	83,328,000	貸付有価証券 15,700 株 (100 株)
大塚商会	36,900	6,110.00	225,459,000	
U S E N	62,500	320.00	20,000,000	
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	27,200	1,424.00	38,732,800	貸付有価証券 13,700 株 (200 株)
日本テレビホールディン グス	125,100	1,988.00	248,698,800	
日本電信電話	833,700	4,337.00	3,615,756,900	
K D D I	1,251,300	2,768.00	3,463,598,400	
光通信	12,400	9,150.00	113,460,000	
N T T ドコモ	1,057,000	2,130.50	2,251,938,500	
GMOインターネット	50,800	1,652.00	83,921,600	貸付有価証券 25,900 株 (25,900 株)
東宝	97,800	2,902.00	283,815,600	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	84,700	6,130.00	519,211,000	
S C S K	32,600	4,340.00	141,484,000	
ソフトバンクグループ	512,800	6,188.00	3,173,206,400	

双日	917,300	253.00	232,076,900	
アルフレッサ ホールディングス	162,100	2,051.00	332,467,100	
シップヘルスケアホールディングス	25,100	2,806.00	70,430,600	貸付有価証券 600株
第一興商	32,500	4,220.00	137,150,000	
メディパルホールディングス	137,100	1,903.00	260,901,300	
伊藤忠商事	1,147,200	1,418.00	1,626,729,600	
丸紅	1,198,900	643.50	771,492,150	
豊田通商	152,700	2,700.00	412,290,000	
兼松	273,000	192.00	52,416,000	
三井物産	1,161,900	1,483.50	1,723,678,650	
日立ハイテクノロジーズ	47,500	2,835.00	134,662,500	
住友商事	808,800	1,235.50	999,272,400	
三菱商事	1,028,400	2,219.00	2,282,019,600	
岩谷産業	152,000	642.00	97,584,000	貸付有価証券 12,000株 (1,000株)
東邦ホールディングス	47,200	2,518.00	118,849,600	貸付有価証券 21,300株 (21,300株)
サンリオ	38,400	3,270.00	125,568,000	貸付有価証券 8,200株
日鉄住金物産	120,000	399.00	47,880,000	貸付有価証券 9,000株
ミスミグループ本社	153,800	1,442.00	221,779,600	
ローソン	51,900	8,980.00	466,062,000	
エービーシー・マート	20,900	7,580.00	158,422,000	貸付有価証券 10,500株 (5,400株)
ゲオホールディングス	25,900	1,856.00	48,070,400	貸付有価証券 12,900株 (400株)
セリア	16,300	5,870.00	95,681,000	貸付有価証券 8,200株
Monotaro	48,200	2,825.00	136,165,000	貸付有価証券 4,700株
J.フロント リテイリング	173,400	2,058.00	356,857,200	
マツモトキヨシホールディングス	30,600	5,430.00	166,158,000	
スタートトゥデイ	42,600	4,065.00	173,169,000	
三越伊勢丹ホールディングス	272,500	1,928.00	525,380,000	
ウエルシアホールディングス	18,100	6,100.00	110,410,000	貸付有価証券 9,100株 (9,100株)
コスモス薬品	6,900	15,900.00	109,710,000	貸付有価証券

				3,500 株 (2,300 株)
セブン&アイ・ホールディングス	573,300	5,543.00	3,177,801,900	貸付有価証券 286,600 株
ツルハホールディングス	29,300	10,500.00	307,650,000	
良品計画	16,900	24,200.00	408,980,000	貸付有価証券 1,300 株
ドンキホーテホールディングス	88,600	4,850.00	429,710,000	貸付有価証券 300 株
V Tホールディングス	56,600	767.00	43,412,200	貸付有価証券 5,800 株
ユナイテッドアローズ	17,900	5,620.00	100,598,000	
スギホールディングス	24,600	5,740.00	141,204,000	
ファミリーマート	46,300	5,430.00	251,409,000	
日本瓦斯	29,300	3,240.00	94,932,000	貸付有価証券 14,800 株
AOKIホールディングス	31,500	1,487.00	46,840,500	
しまむら	15,900	13,780.00	219,102,000	
高島屋	199,000	1,057.00	210,343,000	
イオン	565,200	1,974.00	1,115,704,800	貸付有価証券 138,400 株
イズミ	30,600	4,950.00	151,470,000	
ヤオコー	15,500	5,310.00	82,305,000	
ケーズホールディングス	31,600	4,155.00	131,298,000	貸付有価証券 9,200 株
アインファーマシーズ	16,500	6,300.00	103,950,000	
ニトリホールディングス	59,200	9,540.00	564,768,000	
バローホールディングス	29,500	2,994.00	88,323,000	
ファーストリテイリング	27,400	49,800.00	1,364,520,000	貸付有価証券 13,700 株 (500 株)
サンドラッグ	29,000	6,640.00	192,560,000	
新生銀行	1,304,000	259.00	337,736,000	
あおぞら銀行	925,000	415.00	383,875,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,201,300	773.20	3,248,445,160	
りそなホールディングス	1,603,300	642.00	1,029,318,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	3,029,000	459.70	1,392,431,300	
三井住友フィナンシャルグループ	677,100	4,820.00	3,263,622,000	
西日本シティ銀行	481,000	346.00	166,426,000	
千葉銀行	528,000	859.00	453,552,000	
横浜銀行	919,000	734.30	674,821,700	

常陽銀行	496,000	631.00	312,976,000	貸付有価証券 249,000 株 (249,000 株)
群馬銀行	325,000	775.00	251,875,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	556,000	593.00	329,708,000	
静岡銀行	401,000	1,197.00	479,997,000	貸付有価証券 2,000 株 (2,000 株)
十六銀行	229,000	533.00	122,057,000	
スルガ銀行	144,700	2,260.00	327,022,000	
八十二銀行	331,000	845.00	279,695,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	932,000	271.00	252,572,000	
広島銀行	404,000	683.00	275,932,000	
中国銀行	129,500	1,734.00	224,553,000	
伊予銀行	195,400	1,384.00	270,433,600	
セブン銀行	462,200	513.00	237,108,600	
みずほフィナンシャルグループ	14,051,100	236.60	3,324,490,260	
山口フィナンシャルグループ	182,000	1,473.00	268,086,000	貸付有価証券 86,000 株 (86,000 株)
北洋銀行	206,500	488.00	100,772,000	
京葉銀行	150,000	625.00	93,750,000	
SBIホールディングス	164,600	1,455.00	239,493,000	貸付有価証券 82,900 株 (82,900 株)
ジャフコ	18,700	5,160.00	96,492,000	
大和証券グループ本社	1,282,000	825.50	1,058,291,000	
野村ホールディングス	2,801,800	730.90	2,047,835,620	
岡三証券グループ	117,000	735.00	85,995,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	157,300	692.00	108,851,600	
松井証券	69,700	1,078.00	75,136,600	貸付有価証券 600 株
カブドットコム証券	121,500	394.00	47,871,000	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	304,400	3,717.00	1,131,454,800	
MS&ADインシュアランスグループホール	436,900	3,385.00	1,478,906,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	131,300	2,073.00	272,184,900	
第一生命保険	878,100	1,999.50	1,755,760,950	
東京海上ホールディング	555,200	4,617.00	2,563,358,400	

ス				
T & D ホールディングス	499,500	1,481.50	740,009,250	
クレディセゾン	111,900	2,342.00	262,069,800	
芙蓉総合リース	14,400	5,000.00	72,000,000	
興銀リース	25,700	2,414.00	62,039,800	貸付有価証券 1,000 株
東京センチュリーリース	32,200	3,865.00	124,453,000	貸付有価証券 500 株
イオンフィナンシャルサービス	89,900	2,566.00	230,683,400	貸付有価証券 1,700 株
アコム	275,300	651.00	179,220,300	貸付有価証券 138,800 株 (5,400 株)
日立キャピタル	26,900	3,180.00	85,542,000	貸付有価証券 5,000 株 (5,000 株)
オリックス	970,500	1,735.00	1,683,817,500	
三菱UFJリース	347,600	572.00	198,827,200	
日本取引所グループ	402,500	1,916.00	771,190,000	
ビューリック	285,600	1,141.00	325,869,600	貸付有価証券 12,400 株
野村不動産ホールディングス	82,600	2,439.00	201,461,400	
プレサンスコーポレーション	4,600	4,870.00	22,402,000	
東急不動産ホールディングス	359,200	822.00	295,262,400	
飯田グループホールディングス	88,900	1,986.00	176,555,400	
パーク 24	69,000	2,291.00	158,079,000	
三井不動産	727,000	3,486.00	2,534,322,000	
三菱地所	1,019,000	2,537.00	2,585,203,000	
東京建物	149,700	1,527.00	228,591,900	
住友不動産	328,000	4,066.00	1,333,648,000	
大京	218,000	205.00	44,690,000	
レオパレス 21	149,900	586.00	87,841,400	貸付有価証券 74,200 株
スターツコーポレーション	21,000	1,924.00	40,404,000	
住友不動産販売	9,900	3,220.00	31,878,000	
タカラレーベン	60,700	614.00	37,269,800	貸付有価証券 23,200 株 (23,200 株)
イオンモール	88,400	1,896.00	167,606,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	85,100	1,188.00	101,098,800	

ミクシィ	32,700	4,325.00	141,427,500	
日本M&Aセンター	22,400	5,190.00	116,256,000	
テンプホールディングス	29,900	5,700.00	170,430,000	貸付有価証券 100株
クックパッド	32,200	2,499.00	80,467,800	
総合警備保障	48,400	5,590.00	270,556,000	
カカクコム	95,600	1,978.00	189,096,800	貸付有価証券 48,200株(35,100 株)
エムスリー	125,600	2,389.00	300,058,400	貸付有価証券 46,000株
ディー・エヌ・エー	71,500	2,235.00	159,802,500	貸付有価証券 33,300株
博報堂DYホールディングス	201,000	1,204.00	242,004,000	
電通	161,700	6,460.00	1,044,582,000	
みらかホールディングス	37,000	5,010.00	185,370,000	
オリエンタルランド	156,800	7,009.00	1,099,011,200	貸付有価証券 41,700株
リゾートトラスト	56,100	3,185.00	178,678,500	
ユー・エス・エス	175,600	2,085.00	366,126,000	
サイバーエージェント	35,400	4,990.00	176,646,000	貸付有価証券 18,100株(18,100 株)
楽天	678,300	1,640.50	1,112,751,150	
リロ・ホールディング	6,600	12,580.00	83,028,000	
エイチ・アイ・エス	23,600	4,020.00	94,872,000	
カナモト	20,200	2,314.00	46,742,800	貸付有価証券 10,200株
セコム	140,800	7,282.00	1,025,305,600	
ベネッセホールディングス	53,000	3,160.00	167,480,000	貸付有価証券 5,800株(5,700株)
イオンディライト	14,000	3,385.00	47,390,000	
小計	銘柄数：400		224,563,483,780	
	組入時価比率：98.3%		100.0%	
合計			224,563,483,780	

(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 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。