

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 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 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25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	7,739	(97.7)	179	(2.3)	7,918	(100)
平成26年10月期	5,030	(98.2)	93	(1.8)	5,124	(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	349	99	0	449
平成26年10月期	149	199	0	349

(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	8,006	88	7,918	17,612
平成26年10月期	5,173	49	5,124	14,650

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成27年4月期	156.00
平成26年10月期	120.00

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 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	50,897,270	111,289,583
株式	5,030,831,000	7,739,467,050
派生商品評価勘定	121,516	4,750,169
未収入金	43,107,020	71,738,190
未収配当金	45,658,166	75,978,760
未収利息	80	170
差入委託証拠金	3,301,000	3,603,000
流動資産合計	5,173,916,052	8,006,826,922
資産合計	5,173,916,052	8,006,826,922
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,186,863	-
未払金	-	1,142,914
未払収益分配金	41,971,800	70,142,124
未払受託者報酬	816,517	1,924,425
未払委託者報酬	4,082,533	9,622,055
その他未払費用	1,687,482	5,271,427
流動負債合計	49,745,195	88,102,945
負債合計	49,745,195	88,102,945
純資産の部		
元本等		
元本	4,662,017,685	5,993,104,941
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	462,153,172	1,925,619,036
(分配準備積立金)	101,531	94,504
元本等合計	5,124,170,857	7,918,723,977
純資産合計	5,124,170,857	7,918,723,977
負債純資産合計	5,173,916,052	8,006,826,922

## (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	48,718,542	85,949,981
受取利息	14,981	31,870
有価証券売買等損益	220,492,831	1,327,121,376

派生商品取引等損益	3,008,169	21,104,822
その他収益	13,507	20,005
営業収益合計	272,248,030	1,434,228,054
営業費用		
受託者報酬	816,517	1,924,425
委託者報酬	4,082,533	9,622,055
その他費用	1,814,223	4,320,279
営業費用合計	6,713,273	15,866,759
営業利益又は営業損失(△)	265,534,757	1,418,361,295
経常利益又は経常損失(△)	265,534,757	1,418,361,295
当期純利益又は当期純損失(△)	265,534,757	1,418,361,295
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(△)	40,854,573	462,153,172
剰余金増加額又は欠損金減少額	197,735,642	115,246,693
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	197,735,642	115,246,693
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	41,971,800	70,142,124
期末剰余金又は期末欠損金(△)	462,153,172	1,925,619,036

## (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 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 平成 26 年 10 月 7 日現在	第 3 期 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 349,765 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 449,629 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 14,650 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 17,612 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 2 期	第 3 期
-------	-------

自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日			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		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	48,747,030 円	当期配当等収益額	A	86,001,856 円
分配準備積立金	B	39,574 円	分配準備積立金	B	101,531 円
配当等収益合計額	C=A+B	48,786,604 円	配当等収益合計額	C=A+B	86,103,387 円
経費	D	6,713,273 円	経費	D	15,866,759 円
収益分配可能額	E=C-D	42,073,331 円	収益分配可能額	E=C-D	70,236,628 円
収益分配金	F	41,971,800 円	収益分配金	F	70,142,124 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	101,531 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	94,504 円
口数	H	349,765 口	口数	H	449,629 口
1 口当たり分配金	I=F/H	120 円	1 口当たり分配金	I=F/H	156 円
2. その他費用 その他費用のうち 1,469,680 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 3,463,895 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 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
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	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左

ん。 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 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 1,997,177,373 円 期中追加設定元本額 2,664,840,312 円 期中一部交換元本額 0 円	期首元本額 4,662,017,685 円 期中追加設定元本額 1,331,087,256 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 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	215,970,563	1,263,700,206
合計	215,970,563	1,263,700,206

## 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)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	91,676,000	—	90,615,000	△1,065,347	169,263,000	—	174,020,000	4,750,169
合計	91,676,000	—	90,615,000	△1,065,347	169,263,000	—	174,020,000	4,750,169

## (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	日本水産	7,000	370.00	2,590,000	
		国際石油開発帝石	15,400	1,386.50	21,352,100	
		石油資源開発	700	4,245.00	2,971,500	
		ミライト・ホールディングス	1,400	1,401.00	1,961,400	
		コムシスホールディングス	2,200	1,534.00	3,374,800	
		ミサワホーム	1,900	1,084.00	2,059,600	
		大成建設	16,000	674.00	10,784,000	
		大林組	10,000	795.00	7,950,000	
		清水建設	8,000	821.00	6,568,000	
		長谷工コーポレーション	6,500	1,243.00	8,079,500	
		鹿島建設	12,000	567.00	6,804,000	
		西松建設	4,000	418.00	1,672,000	
		前田建設工業	2,000	822.00	1,644,000	
		奥村組	3,000	573.00	1,719,000	
		戸田建設	4,000	519.00	2,076,000	
		大東建託	2,000	13,995.00	27,990,000	
		N I P P O	1,000	1,926.00	1,926,000	
		前田道路	1,000	1,904.00	1,904,000	
		五洋建設	4,800	443.00	2,126,400	
		住友林業	4,100	1,338.00	5,485,800	
		パナホーム	2,000	852.00	1,704,000	
		大和ハウス工業	8,200	2,475.00	20,295,000	
		積水ハウス	11,500	1,769.00	20,343,500	
		関電工	4,000	698.00	2,792,000	
		きんでん	4,000	1,555.00	6,220,000	
		協和エクシオ	2,100	1,321.00	2,774,100	
		日揮	3,000	2,401.00	7,203,000	
		千代田化工建設	2,000	1,035.00	2,070,000	
		日本製粉	4,000	601.00	2,404,000	
		日清製粉グループ本社	4,400	1,460.00	6,424,000	
江崎グリコ	400	5,750.00	2,300,000			

山崎製パン	2,000	2,287.00	4,574,000
カルビー	500	5,430.00	2,715,000
森永乳業	8,000	474.00	3,792,000
ヤクルト本社	700	8,790.00	6,153,000
明治ホールディングス	900	15,820.00	14,238,000
雪印メグミルク	1,600	1,473.00	2,356,800
日本ハム	4,000	2,813.00	11,252,000
伊藤ハム	4,000	695.00	2,780,000
丸大食品	4,000	412.00	1,648,000
サッポロホールディングス	6,000	473.00	2,838,000
アサヒグループホールディングス	4,500	3,951.00	17,779,500
キリンホールディングス	19,200	1,615.00	31,008,000
宝ホールディングス	2,400	931.00	2,234,400
コカ・コーラウエスト	2,600	2,073.00	5,389,800
コカ・コーライーストジャパン	800	2,555.00	2,044,000
サントリー食品インターナショナル	1,000	5,160.00	5,160,000
伊藤園	1,500	2,648.00	3,972,000
日清オイリオグループ	4,000	434.00	1,736,000
不二製油	1,100	1,954.00	2,149,400
キッコーマン	1,000	4,115.00	4,115,000
味の素	10,000	2,744.50	27,445,000
キューピー	2,100	3,415.00	7,171,500
ハウス食品グループ本社	1,100	2,615.00	2,876,500
カゴメ	1,100	1,898.00	2,087,800
ニチレイ	8,000	686.00	5,488,000
東洋水産	1,400	4,240.00	5,936,000
日清食品ホールディングス	900	5,860.00	5,274,000
日本たばこ産業	14,900	3,893.50	58,013,150
ゲンゼ	5,000	324.00	1,620,000
東洋紡	21,000	165.00	3,465,000
日清紡ホールディングス	4,000	1,163.00	4,652,000
帝人	30,000	423.00	12,690,000
東レ	24,000	1,008.00	24,192,000
ワコールホールディングス	2,000	1,357.00	2,714,000
T S I ホールディングス	2,400	849.00	2,037,600
オンワードホールディングス	4,000	804.00	3,216,000

王子ホールディングス	25,000	524.00	13,100,000
日本製紙	3,200	1,867.00	5,974,400
北越紀州製紙	6,000	617.00	3,702,000
大王製紙	2,000	1,100.00	2,200,000
レンゴー	7,000	506.00	3,542,000
クラレ	6,300	1,659.00	10,451,700
旭化成	22,000	1,146.00	25,212,000
昭和電工	50,000	153.00	7,650,000
住友化学	46,000	633.00	29,118,000
日産化学工業	1,900	2,433.00	4,622,700
クレハ	3,000	518.00	1,554,000
日本曹達	3,000	714.00	2,142,000
東ソー	11,000	648.00	7,128,000
トクヤマ	10,000	284.00	2,840,000
セントラル硝子	7,000	566.00	3,962,000
東亜合成	6,000	546.00	3,276,000
電気化学工業	14,000	481.00	6,734,000
信越化学工業	4,300	7,836.00	33,694,800
エア・ウォーター	3,000	2,218.00	6,654,000
大陽日酸	3,300	1,664.00	5,491,200
日本触媒	3,000	1,712.00	5,136,000
カネカ	8,000	864.00	6,912,000
三菱瓦斯化学	7,000	588.00	4,116,000
三井化学	26,000	401.00	10,426,000
J S R	3,400	2,209.00	7,510,600
東京応化工業	500	3,880.00	1,940,000
三菱ケミカルホールディングス	44,000	729.00	32,076,000
ダイセル	4,600	1,436.00	6,605,600
住友ベークライト	5,000	525.00	2,625,000
積水化学工業	8,000	1,669.00	13,352,000
日本ゼオン	3,000	1,167.00	3,501,000
アイカ工業	700	2,750.00	1,925,000
宇部興産	39,000	187.00	7,293,000
日立化成	2,200	2,562.00	5,636,400
日本化薬	2,000	1,538.00	3,076,000
ADEKA	1,500	1,596.00	2,394,000



日油	3,000	925.00	2,775,000
花王	7,100	6,207.00	44,069,700
日本ペイントホールディングス	900	4,290.00	3,861,000
関西ペイント	2,000	2,226.00	4,452,000
D I C	19,000	371.00	7,049,000
東洋インキ S C ホールディングス	4,000	556.00	2,224,000
富士フイルムホールディングス	8,900	4,443.00	39,542,700
資生堂	6,500	2,303.50	14,972,750
ライオン	4,000	767.00	3,068,000
コーセー	300	7,370.00	2,211,000
小林製薬	300	8,680.00	2,604,000
日東電工	2,400	8,100.00	19,440,000
エフピコ	500	4,650.00	2,325,000
ニフコ	600	4,385.00	2,631,000
ユニ・チャーム	2,400	3,232.00	7,756,800
協和発酵キリン	4,000	1,661.00	6,644,000
武田薬品工業	13,300	5,949.00	79,121,700
アステラス製薬	24,100	1,961.00	47,260,100
大日本住友製薬	1,800	1,433.00	2,579,400
塩野義製薬	3,000	4,175.00	12,525,000
田辺三菱製薬	2,300	2,024.00	4,655,200
中外製薬	1,400	3,905.00	5,467,000
科研製薬	1,000	3,820.00	3,820,000
エーザイ	4,100	8,438.00	34,595,800
ロート製薬	1,300	1,698.00	2,207,400
小野薬品工業	600	13,420.00	8,052,000
久光製薬	800	4,860.00	3,888,000
持田製薬	200	7,970.00	1,594,000
参天製薬	3,700	1,680.00	6,216,000
ツムラ	900	2,962.00	2,665,800
沢井製薬	300	6,970.00	2,091,000
第一三共	13,000	1,887.00	24,531,000
キョーリン製薬ホールディングス	800	2,874.00	2,299,200
大塚ホールディングス	5,400	3,807.00	20,557,800
大正製薬ホールディングス	300	8,860.00	2,658,000
昭和シェル石油	6,900	1,096.00	7,562,400

コスモ石油	27,000	173.00	4,671,000
東燃ゼネラル石油	8,000	1,065.00	8,520,000
出光興産	3,900	2,140.00	8,346,000
J Xホールディングス	126,800	482.50	61,181,000
横浜ゴム	4,000	1,232.00	4,928,000
東洋ゴム工業	1,300	2,337.00	3,038,100
ブリヂストン	9,000	5,060.00	45,540,000
住友ゴム工業	3,400	2,220.00	7,548,000
旭硝子	34,000	779.00	26,486,000
日本板硝子	46,000	122.00	5,612,000
日本電気硝子	16,000	575.00	9,200,000
住友大阪セメント	8,000	391.00	3,128,000
太平洋セメント	15,000	368.00	5,520,000
東海カーボン	6,000	350.00	2,100,000
TOTO	5,000	1,664.00	8,320,000
日本碍子	2,000	2,621.00	5,242,000
日本特殊陶業	1,400	3,155.00	4,417,000
新日鐵住金	132,000	301.80	39,837,600
神戸製鋼所	64,000	224.00	14,336,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	13,000	2,726.50	35,444,500
日新製鋼	2,400	1,620.00	3,888,000
大和工業	500	2,993.00	1,496,500
淀川製鋼所	3,000	488.00	1,464,000
丸一鋼管	700	2,899.00	2,029,300
大同特殊鋼	8,000	544.00	4,352,000
日立金属	2,000	1,801.00	3,602,000
日本軽金属ホールディングス	13,000	187.00	2,431,000
三井金属鉱業	14,000	275.00	3,850,000
三菱マテリアル	29,000	410.00	11,890,000
住友金属鉱山	10,000	1,787.50	17,875,000
DOWAホールディングス	4,000	1,044.00	4,176,000
古河電気工業	26,000	205.00	5,330,000
住友電気工業	16,000	1,578.00	25,248,000
フジクラ	9,000	551.00	4,959,000
東洋製罐グループホールディングス	5,300	1,821.00	9,651,300

三和ホールディングス	2,800	880.00	2,464,000
LIXILグループ	4,900	2,725.00	13,352,500
リンナイ	400	8,770.00	3,508,000
日本発條	4,100	1,290.00	5,289,000
日本製鋼所	8,000	516.00	4,128,000
アマダホールディングス	3,600	1,189.00	4,280,400
DMG 森精機	1,300	1,904.00	2,475,200
ディスコ	200	12,330.00	2,466,000
ナブテスコ	1,200	3,310.00	3,972,000
SMC	300	37,265.00	11,179,500
小松製作所	12,900	2,504.00	32,301,600
住友重機械工業	11,000	822.00	9,042,000
日立建機	2,200	2,140.00	4,708,000
クボタ	9,000	1,992.50	17,932,500
荏原製作所	7,000	510.00	3,570,000
ダイキン工業	2,000	8,078.00	16,156,000
栗田工業	2,200	3,040.00	6,688,000
ダイフク	1,300	1,590.00	2,067,000
平和	700	2,444.00	1,710,800
SANKYO	1,100	4,410.00	4,851,000
グローリー	900	3,260.00	2,934,000
セガサミーホールディングス	4,900	1,802.00	8,829,800
ホシザキ電機	300	8,120.00	2,436,000
日本精工	4,300	1,800.00	7,740,000
NTN	8,000	659.00	5,272,000
ジェイテクト	3,200	1,812.00	5,798,400
THK	1,100	3,135.00	3,448,500
マキタ	1,100	6,270.00	6,897,000
日立造船	3,100	627.00	1,943,700
三菱重工業	41,000	666.40	27,322,400
IHI	13,000	524.00	6,812,000
イビデン	3,500	2,012.00	7,042,000
コニカミノルタ	10,400	1,265.00	13,156,000
ブラザー工業	3,800	1,969.00	7,482,200
ミネベア	2,000	1,872.00	3,744,000
日立製作所	93,000	827.30	76,938,900

東芝	75,000	492.70	36,952,500
三菱電機	26,000	1,494.50	38,857,000
富士電機	9,000	574.00	5,166,000
安川電機	1,800	1,748.00	3,146,400
東芝テック	3,000	744.00	2,232,000
マブチモーター	400	6,670.00	2,668,000
日本電産	1,500	8,102.00	12,153,000
JVCケンウッド	6,500	368.00	2,392,000
オムロン	1,900	5,350.00	10,165,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	5,000	543.00	2,715,000
日本電気	53,000	362.00	19,186,000
富士通	37,000	854.30	31,609,100
沖電気工業	9,000	252.00	2,268,000
セイコーエプソン	2,600	2,181.00	5,670,600
パナソニック	64,000	1,593.00	101,952,000
シャープ	28,000	251.00	7,028,000
アンリツ	2,100	810.00	1,701,000
ソニー	29,100	3,490.00	101,559,000
TDK	2,700	8,640.00	23,328,000
ミツミ電機	4,000	940.00	3,760,000
アルプス電気	2,200	2,980.00	6,556,000
パイオニア	6,200	221.00	1,370,200
ホンデン	5,000	705.00	3,525,000
ヒロセ電機	315	15,810.00	4,980,150
日立マクセル	1,600	1,988.00	3,180,800
アルパイン	1,000	2,069.00	2,069,000
船井電機	1,200	1,441.00	1,729,200
横河電機	2,200	1,402.00	3,084,400
アズビル	1,100	3,250.00	3,575,000
日本光電工業	600	3,310.00	1,986,000
堀場製作所	400	4,690.00	1,876,000
アドバンテスト	1,400	1,487.00	2,081,800
キーエンス	100	65,930.00	6,593,000
シスメックス	500	6,920.00	3,460,000
スタンレー電気	2,300	2,761.00	6,350,300

ウシオ電機	2,000	1,507.00	3,014,000
カシオ計算機	2,300	2,326.00	5,349,800
ファナック	1,100	27,225.00	29,947,500
ローム	1,300	8,240.00	10,712,000
浜松ホトニクス	1,000	3,725.00	3,725,000
新光電気工業	2,200	858.00	1,887,600
京セラ	4,600	6,673.00	30,695,800
太陽誘電	2,200	1,820.00	4,004,000
村田製作所	1,400	17,430.00	24,402,000
小糸製作所	1,300	3,565.00	4,634,500
S C R E E Nホールディングス	3,000	881.00	2,643,000
キヤノン	28,100	4,460.00	125,326,000
リコー	16,700	1,322.50	22,085,750
トヨタ紡織	2,500	1,544.00	3,860,000
ユニプレス	1,400	2,464.00	3,449,600
豊田自動織機	2,100	7,130.00	14,973,000
デンソー	6,400	5,467.00	34,988,800
東海理化電機製作所	1,200	2,806.00	3,367,200
三井造船	15,000	204.00	3,060,000
川崎重工業	19,000	608.00	11,552,000
日産自動車	50,200	1,223.50	61,419,700
いすゞ自動車	8,400	1,585.50	13,318,200
トヨタ自動車	27,400	8,410.00	230,434,000
日野自動車	3,400	1,659.00	5,640,600
三菱自動車工業	13,000	1,096.00	14,248,000
日産車体	2,000	1,549.00	3,098,000
新明和工業	1,000	1,241.00	1,241,000
日信工業	1,100	1,826.00	2,008,600
タチエス	1,200	1,839.00	2,206,800
NOK	1,300	3,695.00	4,803,500
フタバ産業	3,000	553.00	1,659,000
カヤバ工業	4,000	441.00	1,764,000
プレス工業	3,200	489.00	1,564,800
カルソニックカンセイ	5,000	830.00	4,150,000
ケーヒン	1,800	1,877.00	3,378,600
アイシン精機	5,000	4,455.00	22,275,000

マツダ	4,700	2,321.50	10,911,050
ダイハツ工業	5,500	1,827.00	10,048,500
本田技研工業	34,300	4,046.50	138,794,950
スズキ	5,700	3,644.50	20,773,650
富士重工業	4,400	4,130.50	18,174,200
ヤマハ発動機	4,200	2,976.00	12,499,200
ショーワ	2,100	1,183.00	2,484,300
エクセディ	500	2,857.00	1,428,500
豊田合成	2,000	2,717.00	5,434,000
日本精機	1,000	2,391.00	2,391,000
エフ・シー・シー	1,000	1,912.00	1,912,000
シマノ	500	18,400.00	9,200,000
タカタ	700	1,326.00	928,200
テイ・エス テック	1,300	3,305.00	4,296,500
テルモ	2,300	3,185.00	7,325,500
島津製作所	2,000	1,391.00	2,782,000
ニコン	7,300	1,677.00	12,242,100
オリンパス	1,200	4,325.00	5,190,000
HOYA	5,000	4,947.00	24,735,000
シチズンホールディングス	4,400	940.00	4,136,000
ニプロ	2,500	1,170.00	2,925,000
バンダイナムコホールディングス	2,700	2,485.00	6,709,500
トッパン・フォームズ	1,400	1,442.00	2,018,800
凸版印刷	18,000	952.00	17,136,000
大日本印刷	17,000	1,201.00	20,417,000
アシックス	1,000	3,215.00	3,215,000
ヤマハ	2,900	2,396.00	6,948,400
リンテック	1,000	2,884.00	2,884,000
任天堂	2,500	19,085.00	47,712,500
コクヨ	2,200	1,172.00	2,578,400
東京電力	116,300	458.00	53,265,400
中部電力	25,800	1,420.00	36,636,000
関西電力	28,700	1,140.00	32,718,000
中国電力	9,100	1,563.00	14,223,300
北陸電力	5,900	1,591.00	9,386,900
東北電力	11,800	1,336.00	15,764,800

四国電力	6,200	1,507.00	9,343,400
九州電力	10,000	1,120.00	11,200,000
北海道電力	6,400	957.00	6,124,800
沖縄電力	600	4,215.00	2,529,000
電源開発	2,100	4,030.00	8,463,000
東京瓦斯	47,000	781.60	36,735,200
大阪瓦斯	44,000	507.40	22,325,600
東邦瓦斯	8,000	689.00	5,512,000
東武鉄道	21,000	586.00	12,306,000
相鉄ホールディングス	6,000	581.00	3,486,000
東京急行電鉄	15,000	776.00	11,640,000
京浜急行電鉄	3,000	984.00	2,952,000
小田急電鉄	5,000	1,258.00	6,290,000
京王電鉄	6,000	975.00	5,850,000
京成電鉄	2,000	1,535.00	3,070,000
東日本旅客鉄道	5,100	10,300.00	52,530,000
西日本旅客鉄道	3,500	6,569.00	22,991,500
東海旅客鉄道	1,700	22,670.00	38,539,000
西日本鉄道	5,000	547.00	2,735,000
近鉄グループホールディングス	20,000	443.00	8,860,000
阪急阪神ホールディングス	16,000	758.00	12,128,000
南海電気鉄道	5,000	543.00	2,715,000
京阪電気鉄道	6,000	734.00	4,404,000
名古屋鉄道	12,000	494.00	5,928,000
日本通運	28,000	703.00	19,684,000
ヤマトホールディングス	6,500	2,838.50	18,450,250
山九	6,000	539.00	3,234,000
日本梱包運輸倉庫	800	2,132.00	1,705,600
セイノーホールディングス	5,000	1,337.00	6,685,000
日立物流	1,300	1,930.00	2,509,000
日本郵船	51,000	344.00	17,544,000
商船三井	25,000	408.00	10,200,000
川崎汽船	29,000	318.00	9,222,000
日本航空	3,700	3,665.00	13,560,500
ANAホールディングス	64,000	328.00	20,992,000
三菱倉庫	1,000	1,919.00	1,919,000

上組	4,000	1,198.00	4,792,000
近鉄エクスプレス	400	5,650.00	2,260,000
I Tホールディングス	2,100	2,323.00	4,878,300
グリーン	1,800	819.00	1,474,200
野村総合研究所	1,200	4,615.00	5,538,000
フジ・メディア・ホールディングス	4,200	1,740.00	7,308,000
オービック	400	5,440.00	2,176,000
ヤフー	9,300	505.00	4,696,500
トレンドマイクロ	1,200	4,075.00	4,890,000
日本オラクル	600	5,330.00	3,198,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,100	2,499.00	2,748,900
大塚商会	700	5,230.00	3,661,000
ネットワンシステムズ	3,800	828.00	3,146,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	900	1,894.00	1,704,600
東京放送ホールディングス	2,800	1,581.00	4,426,800
日本テレビホールディングス	2,600	2,101.00	5,462,600
テレビ朝日ホールディングス	1,000	2,185.00	2,185,000
スカパーJ S A Tホールディングス	3,100	778.00	2,411,800
日本電信電話	29,900	7,643.00	228,525,700
K D D I	30,000	2,840.50	85,215,000
光通信	400	8,310.00	3,324,000
N T T ドコモ	30,700	2,165.50	66,480,850
東宝	1,100	3,110.00	3,421,000
エヌ・ティ・ティ・データ	2,700	5,340.00	14,418,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	700	2,590.00	1,813,000
カプコン	1,000	2,447.00	2,447,000
S C S K	700	3,540.00	2,478,000
コナミ	1,600	2,240.00	3,584,000
ソフトバンク	6,100	7,090.00	43,249,000
双日	100,300	204.00	20,461,200
アルフレッサ ホールディングス	5,400	1,741.00	9,401,400
ダイワボウホールディングス	7,000	195.00	1,365,000
シップヘルスケアホールディングス	500	2,814.00	1,407,000
第一興商	900	3,960.00	3,564,000
メディパルホールディングス	6,700	1,597.00	10,699,900



黒田電気	1,000	1,953.00	1,953,000
伊藤忠商事	51,600	1,325.00	68,370,000
丸紅	58,000	703.10	40,779,800
長瀬産業	3,200	1,594.00	5,100,800
豊田通商	6,400	3,310.00	21,184,000
兼松	15,000	177.00	2,655,000
三井物産	51,200	1,603.50	82,099,200
日立ハイテクノロジーズ	1,200	3,530.00	4,236,000
住友商事	44,100	1,317.50	58,101,750
三菱商事	53,300	2,453.50	130,771,550
キヤノンマーケティングジャパン	1,300	2,463.00	3,201,900
三谷商事	500	2,557.00	1,278,500
阪和興業	11,000	483.00	5,313,000
岩谷産業	4,000	811.00	3,244,000
三愛石油	3,000	794.00	2,382,000
稲畑産業	1,900	1,206.00	2,291,400
東邦ホールディングス	1,500	2,201.00	3,301,500
サンゲツ	1,400	1,890.00	2,646,000
伊藤忠エネクス	3,100	989.00	3,065,900
リョーサン	1,300	2,985.00	3,880,500
三信電気	2,200	1,006.00	2,213,200
P a l t a c	1,900	1,685.00	3,201,500
日鉄住金物産	6,000	411.00	2,466,000
オートバックスセブン	2,100	1,919.00	4,029,900
加藤産業	900	2,526.00	2,273,400
因幡電機産業	500	4,315.00	2,157,500
ミスミグループ本社	600	4,705.00	2,823,000
スズケン	2,860	3,770.00	10,782,200
ローソン	1,000	8,280.00	8,280,000
ゲオホールディングス	1,900	1,300.00	2,470,000
アダストリアホールディングス	700	3,155.00	2,208,500
日本マクドナルドホールディングス	1,100	2,664.00	2,930,400
エディオン	5,200	907.00	4,716,400
DCMホールディングス	3,400	938.00	3,189,200
J. フロント リテイリング	4,600	1,910.00	8,786,000
マツモトキヨシホールディングス	1,100	4,515.00	4,966,500

ココカラファイン	500	3,485.00	1,742,500	
三越伊勢丹ホールディングス	6,000	2,116.00	12,696,000	
セブン&アイ・ホールディングス	14,100	5,217.00	73,559,700	
ツルハホールディングス	500	9,330.00	4,665,000	
良品計画	200	17,730.00	3,546,000	
コーナン商事	1,300	1,338.00	1,739,400	
ドンキホーテホールディングス	600	9,930.00	5,958,000	
ゼンショーホールディングス	1,700	1,170.00	1,989,000	
スギホールディングス	500	6,050.00	3,025,000	
ファミリーマート	1,000	5,120.00	5,120,000	
島忠	1,000	3,250.00	3,250,000	
コメリ	800	2,830.00	2,264,000	
青山商事	1,500	4,070.00	6,105,000	
しまむら	500	11,530.00	5,765,000	
高島屋	6,000	1,216.00	7,296,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,100	2,333.00	4,899,300	
丸井グループ	4,100	1,405.00	5,760,500	
イオン	25,200	1,356.50	34,183,800	
ユニグループ・ホールディングス	12,600	674.00	8,492,400	
イズミ	700	4,340.00	3,038,000	
平和堂	800	2,899.00	2,319,200	
ケーズホールディングス	1,700	3,900.00	6,630,000	
ヤマダ電機	43,300	489.00	21,173,700	
ニトリホールディングス	700	8,960.00	6,272,000	
吉野家ホールディングス	1,700	1,329.00	2,259,300	
アークス	900	2,754.00	2,478,600	
バロー	1,100	2,598.00	2,857,800	
ファーストリテイリング	200	47,540.00	9,508,000	
サンドラッグ	500	6,340.00	3,170,000	
じもとホールディングス	19,800	224.00	4,435,200	
足利ホールディングス	5,100	482.00	2,458,200	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	500	3,365.00	1,682,500	
新生銀行	19,000	238.00	4,522,000	
あおぞら銀行	22,000	423.00	9,306,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	556,300	788.00	438,364,400	

りそなホールディングス	295,400	610.00	180,194,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	75,000	502.00	37,650,000	
三井住友フィナンシャルグループ	76,600	4,676.50	358,219,900	
第四銀行	10,000	425.00	4,250,000	
北越銀行	10,000	237.00	2,370,000	
西日本シティ銀行	15,000	357.00	5,355,000	
千葉銀行	11,000	905.00	9,955,000	
横浜銀行	33,000	736.90	24,317,700	
常陽銀行	14,000	627.00	8,778,000	
群馬銀行	7,000	822.00	5,754,000	
武蔵野銀行	1,100	4,170.00	4,587,000	
千葉興業銀行	4,400	815.00	3,586,000	
筑波銀行	6,400	393.00	2,515,200	
七十七銀行	27,000	685.00	18,495,000	
青森銀行	7,000	384.00	2,688,000	
秋田銀行	8,000	363.00	2,904,000	
山形銀行	4,000	518.00	2,072,000	
岩手銀行	1,200	5,240.00	6,288,000	
東邦銀行	32,000	493.00	15,776,000	
みちのく銀行	12,000	206.00	2,472,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	30,000	637.00	19,110,000	
静岡銀行	6,000	1,221.00	7,326,000	
十六銀行	13,000	450.00	5,850,000	
スルガ銀行	2,200	2,619.00	5,761,800	
八十二銀行	16,000	873.00	13,968,000	
山梨中央銀行	10,000	532.00	5,320,000	
大垣共立銀行	13,000	395.00	5,135,000	
福井銀行	10,000	265.00	2,650,000	
北國銀行	6,000	419.00	2,514,000	
滋賀銀行	6,000	590.00	3,540,000	
南都銀行	10,000	415.00	4,150,000	
百五銀行	16,000	564.00	9,024,000	
京都銀行	6,000	1,288.00	7,728,000	
紀陽銀行	4,600	1,681.00	7,732,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	79,000	276.00	21,804,000	

広島銀行	15,000	671.00	10,065,000
山陰合同銀行	5,000	991.00	4,955,000
中国銀行	6,300	1,832.00	11,541,600
伊予銀行	3,800	1,447.00	5,498,600
百十四銀行	11,000	404.00	4,444,000
四国銀行	16,000	246.00	3,936,000
阿波銀行	5,000	690.00	3,450,000
鹿児島銀行	4,000	826.00	3,304,000
大分銀行	9,000	463.00	4,167,000
肥後銀行	8,000	741.00	5,928,000
佐賀銀行	10,000	304.00	3,040,000
十八銀行	7,000	367.00	2,569,000
沖縄銀行	700	5,040.00	3,528,000
琉球銀行	2,200	1,759.00	3,869,800
セブン銀行	6,600	608.00	4,012,800
みずほフィナンシャルグループ	1,746,900	215.00	375,583,500
山口フィナンシャルグループ	11,000	1,425.00	15,675,000
北洋銀行	19,700	457.00	9,002,900
愛知銀行	300	6,070.00	1,821,000
東日本銀行	6,000	391.00	2,346,000
愛媛銀行	19,000	240.00	4,560,000
みなと銀行	9,000	279.00	2,511,000
京葉銀行	4,000	702.00	2,808,000
関西アーバン銀行	1,600	1,276.00	2,041,600
栃木銀行	4,000	622.00	2,488,000
トモニホールディングス	9,800	557.00	5,458,600
フィデアホールディングス	14,900	222.00	3,307,800
池田泉州ホールディングス	10,700	581.00	6,216,700
SBIホールディングス	2,300	1,513.00	3,479,900
大和証券グループ本社	49,000	966.70	47,368,300
野村ホールディングス	24,300	714.50	17,362,350
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	5,300	3,874.00	20,532,200
MS&ADインシュアランスグループホール	7,200	3,490.00	25,128,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	7,400	2,075.00	15,355,000

第一生命保険	27,400	1,826.00	50,032,400
東京海上ホールディングス	8,700	4,770.00	41,499,000
T&Dホールディングス	11,600	1,738.00	20,160,800
クレディセゾン	2,100	2,222.00	4,666,200
アイフル	9,200	408.00	3,753,600
イオンフィナンシャルサービス	1,000	3,055.00	3,055,000
ジャックス	2,000	620.00	1,240,000
オリックス	16,700	1,767.50	29,517,250
三菱UFJリース	4,200	625.00	2,625,000
日本取引所グループ	900	3,655.00	3,289,500
野村不動産ホールディングス	2,200	2,338.00	5,143,600
東急不動産ホールディングス	2,500	893.00	2,232,500
飯田グループホールディングス	1,800	1,616.00	2,908,800
パーク24	1,000	2,511.00	2,511,000
三井不動産	5,000	3,678.50	18,392,500
三菱地所	8,000	2,871.50	22,972,000
東京建物	4,000	894.00	3,576,000
住友不動産	2,000	4,585.00	9,170,000
大京	7,000	185.00	1,295,000
レオパレス21	3,200	652.00	2,086,400
イオンモール	1,000	2,500.00	2,500,000
日本空港ビルデング	300	8,030.00	2,409,000
GCAサヴィアン	2,000	1,511.00	3,022,000
テンブホールディングス	500	3,910.00	1,955,000
総合警備保障	700	4,390.00	3,073,000
ディー・エヌ・エー	3,400	2,488.00	8,459,200
博報堂DYホールディングス	4,700	1,359.00	6,387,300
ケネディクス	4,300	487.00	2,094,100
電通	2,900	5,450.00	15,805,000
みらかホールディングス	800	5,690.00	4,552,000
オリエンタルランド	1,400	9,371.00	13,119,400
ダスキン	1,600	2,086.00	3,337,600
ラウンドワン	2,200	654.00	1,438,800
ユー・エス・エス	2,500	2,163.00	5,407,500
サイバーエージェント	400	6,840.00	2,736,000
エイチ・アイ・エス	500	4,325.00	2,162,500

	セコム	2,400	8,197.00	19,672,800	
	アサツー ディ・ケイ	1,100	3,395.00	3,734,500	
	ベネッセホールディングス	1,500	3,775.00	5,662,500	
	小計			7,739,467,050	
	銘柄数：567				
	組入時価比率：97.7%			100.0%	
	合計			7,739,467,050	

(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 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。