

平成26年10月期（平成26年4月8日～平成26年10月7日）決算短信

平成26年11月19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 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12月18日
 分配金支払開始日 平成26年11月14日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年10月期の運用状況（平成26年4月8日～平成26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26年10月期	99,148	(98.2)	1,789	(1.8)	100,938	(100)
平成26年4月期	22,357	(98.0)	447	(2.0)	22,804	(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10月期	2,098	6,693	196	8,595
平成26年4月期	-	2,098	0	2,098

(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10月期	101,794	855	100,938	11,743
平成26年4月期	23,017	213	22,804	10,865

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成26年10月期	87.00
平成26年4月期	95.00

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 1 期 (平成 26 年 4 月 7 日現在)	第 2 期 (平成 26 年 10 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	236,943,923	1,026,717,296
株式	22,357,273,050	99,148,842,090
派生商品評価勘定	15,128,244	1,184,781
未収入金	197,936,000	763,993,678
未収配当金	210,684,404	788,277,657
未収利息	471	1,614
差入委託証拠金	-	65,431,000
流動資産合計	23,017,966,092	101,794,448,116
資産合計	23,017,966,092	101,794,448,116
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	23,499,616
前受金	4,790,000	-
未払収益分配金	199,398,540	747,824,682
未払受託者報酬	1,790,676	16,759,759
未払委託者報酬	5,372,002	50,279,237
その他未払費用	1,714,683	17,565,293
流動負債合計	213,065,901	855,928,587
負債合計	213,065,901	855,928,587
純資産の部		
元本等		
元本	24,402,183,432	99,933,445,436
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△1,597,283,241	1,005,074,093
(分配準備積立金)	1,484,880	4,578,709
元本等合計	22,804,900,191	100,938,519,529
純資産合計	22,804,900,191	100,938,519,529
負債純資産合計	23,017,966,092	101,794,448,116

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 1 期 自 平成 26 年 1 月 24 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日
営業収益		
受取配当金	210,684,404	833,689,809
受取利息	7,673	162,131
有価証券売買等損益	42,255,856	3,415,851,174

派生商品取引等損益	15,128,244	16,053,946
その他収益	-	207,003
営業収益合計	268,076,177	4,265,964,063
営業費用		
受託者報酬	1,790,676	16,759,759
委託者報酬	5,372,002	50,279,237
その他費用	2,645,979	16,101,436
営業費用合計	9,808,657	83,140,432
営業利益又は営業損失(△)	258,267,520	4,182,823,631
経常利益又は経常損失(△)	258,267,520	4,182,823,631
当期純利益又は当期純損失(△)	258,267,520	4,182,823,631
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(△)	-	△1,597,283,241
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,656,152,221	832,641,615
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	67,154,038
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,656,152,221	765,487,577
分配金	199,398,540	747,824,682
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,597,283,241	1,005,074,093

(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 4 月 8 日から平成 26 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 1 期 平成 26 年 4 月 7 日現在	第 2 期 平成 26 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 2,098,932 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 8,595,686 口
2. 投資信託財産計算規則第 55 条の 6 第 1 項第 10 号に規定する額	

元本の欠損	1,597,283,241 円		
3. 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	10,865 円	1 口当たり純資産額	11,743 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 1 月 24 日 至 平成 26 年 4 月 7 日			第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 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	210,692,077 円	当期配当等収益額	A	834,058,943 円
分配準備積立金	B	0 円	分配準備積立金	B	1,484,880 円
配当等収益合計額	C=A+B	210,692,077 円	配当等収益合計額	C=A+B	835,543,823 円
経費	D	9,808,657 円	経費	D	83,140,432 円
収益分配可能額	E=C-D	200,883,420 円	収益分配可能額	E=C-D	752,403,391 円
収益分配金	F	199,398,540 円	収益分配金	F	747,824,682 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,484,880 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,578,709 円
口数	H	2,098,932 口	口数	H	8,595,686 口
1 口当たり分配金	I=F/H	95 円	1 口当たり分配金	I=F/H	87 円
2. その他費用 その他費用のうち 1,432,513 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 13,407,751 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 1 期 自 平成 26 年 1 月 24 日 至 平成 26 年 4 月 7 日		第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 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 1 期 平成 26 年 4 月 7 日現在	第 2 期 平成 26 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 せん。 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。	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 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 1 期 自 平成 26 年 1 月 24 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 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 1 期 自 平成 26 年 1 月 24 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日
期首元本額	— 円
期中追加設定元本額	24,402,183,432 円
期中一部交換元本額	0 円
	期首元本額 24,402,183,432 円
	期中追加設定元本額 77,820,154,006 円
	期中一部交換元本額 2,288,892,002 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 1 月 24 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	第 2 期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 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	58,128,893	2,962,793,891
合計	58,128,893	2,962,793,891

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)				第 2 期(平成 26 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)
	うち 1 年 超				うち 1 年 超			
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	427,925,000	—	443,075,000	15,128,244	1,769,806,000	—	1,747,575,000	△22,314,835
合計	427,925,000	—	443,075,000	15,128,244	1,769,806,000	—	1,747,575,000	△22,314,835

(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 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	399,100	1,464.00	584,282,400	
		安藤・間	54,800	669.00	36,661,200	
		コムシスホールディングス	39,800	1,799.00	71,600,200	
		ミサワホーム	8,800	1,094.00	9,627,200	
		大成建設	415,000	590.00	244,850,000	
		長谷工コーポレーション	109,500	817.00	89,461,500	
		鹿島建設	361,000	504.00	181,944,000	
		大東建託	31,200	12,700.00	396,240,000	
		N I P P O	19,000	1,985.00	37,715,000	
		住友林業	56,500	1,153.00	65,144,500	
		大和ハウス工業	225,300	1,963.00	442,263,900	
		積水ハウス	220,900	1,277.50	282,199,750	
		協和エクシオ	32,200	1,359.00	43,759,800	
		日揮	82,000	2,841.00	232,962,000	
		東芝プラントシステム	13,300	1,804.00	23,993,200	
		千代田化工建設	65,000	1,149.00	74,685,000	
		日清製粉グループ本社	90,040	1,054.00	94,902,160	
		カルビー	30,400	3,500.00	106,400,000	
		ヤクルト本社	48,000	5,550.00	266,400,000	
		明治ホールディングス	24,300	8,700.00	211,410,000	
		日本ハム	51,000	2,379.00	121,329,000	
		アサヒグループホールディングス	165,000	3,210.50	529,732,500	
		キリンホールディングス	351,200	1,434.00	503,620,800	
		伊藤園	22,300	2,288.00	51,022,400	
キッコーマン	67,000	2,244.00	150,348,000			
味の素	189,000	1,895.50	358,249,500			

キューピー	41,800	1,821.00	76,117,800
ニチレイ	87,000	439.00	38,193,000
東洋水産	40,300	3,690.00	148,707,000
日清食品ホールディングス	32,100	5,890.00	189,069,000
日本たばこ産業	393,200	3,602.50	1,416,503,000
東レ	557,000	701.70	390,846,900
王子ホールディングス	339,000	394.00	133,566,000
クラレ	121,900	1,301.00	158,591,900
旭化成	479,000	910.90	436,321,100
昭和電工	511,000	141.00	72,051,000
日産化学工業	51,300	1,891.00	97,008,300
東ソー	205,000	442.00	90,610,000
東亜合成	96,000	442.00	42,432,000
電気化学工業	148,000	349.00	51,652,000
信越化学工業	137,600	6,970.00	959,072,000
エア・ウォーター	63,000	1,631.00	102,753,000
大陽日酸	99,000	962.00	95,238,000
日本パーカライジング	18,100	2,477.00	44,833,700
日本触媒	65,000	1,187.00	77,155,000
J S R	70,400	1,954.00	137,561,600
三菱ケミカルホールディングス	479,600	530.50	254,427,800
日本合成化学工業	16,000	770.00	12,320,000
ダイセル	100,000	1,193.00	119,300,000
積水化学工業	157,000	1,245.00	195,465,000
日本ゼオン	61,000	1,103.00	67,283,000
アイカ工業	21,500	2,282.00	49,063,000
宇部興産	386,000	169.00	65,234,000
日立化成	33,200	1,903.00	63,179,600
日本化薬	54,000	1,342.00	72,468,000
花王	211,200	4,252.50	898,128,000
日本ペイントホールディングス	66,000	2,332.00	153,912,000
関西ペイント	93,000	1,538.00	143,034,000
D I C	307,000	240.00	73,680,000
東洋インキSCホールディングス	69,000	502.00	34,638,000
富士フイルムホールディングス	175,600	3,595.00	631,282,000

資生堂	136,500	1,772.50	241,946,250
ドクターシーラボ	5,200	3,690.00	19,188,000
小林製薬	12,600	6,670.00	84,042,000
日東電工	63,200	5,924.00	374,396,800
エフピコ	10,100	3,015.00	30,451,500
ニフコ	17,100	3,330.00	56,943,000
ユニ・チャーム	141,200	2,560.00	361,472,000
協和発酵キリン	92,000	1,319.00	121,348,000
武田薬品工業	287,400	4,678.00	1,344,457,200
アステラス製薬	873,700	1,660.50	1,450,778,850
塩野義製薬	119,800	2,526.00	302,614,800
田辺三菱製薬	63,800	1,637.00	104,440,600
中外製薬	76,400	3,235.00	247,154,000
科研製薬	26,000	2,523.00	65,598,000
エーザイ	94,400	4,358.50	411,442,400
ロート製薬	32,200	1,484.00	47,784,800
小野薬品工業	34,800	9,400.00	327,120,000
久光製薬	23,800	3,765.00	89,607,000
持田製薬	5,500	7,340.00	40,370,000
参天製薬	28,200	6,130.00	172,866,000
ツムラ	22,500	2,393.00	53,842,500
沢井製薬	12,100	6,280.00	75,988,000
第一三共	241,900	1,670.00	403,973,000
キョーリン製薬ホールディングス	20,500	2,243.00	45,981,500
大塚ホールディングス	152,200	3,875.50	589,851,100
大正製薬ホールディングス	18,500	7,360.00	136,160,000
昭和シェル石油	68,600	1,014.00	69,560,400
東燃ゼネラル石油	116,000	952.00	110,432,000
出光興産	36,400	2,266.00	82,482,400
J Xホールディングス	851,300	493.70	420,286,810
横浜ゴム	86,000	940.00	80,840,000
東洋ゴム工業	34,700	1,767.00	61,314,900
ブリヂストン	240,400	3,595.50	864,358,200
住友ゴム工業	59,800	1,544.00	92,331,200
旭硝子	378,000	572.20	216,291,600

日本電気硝子	158,000	500.00	79,000,000
太平洋セメント	450,000	395.00	177,750,000
TOTO	113,000	1,187.00	134,131,000
日本特殊陶業	66,100	2,973.00	196,515,300
ニチアス	37,000	674.00	24,938,000
新日鐵住金	3,242,000	272.70	884,093,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	195,600	2,065.00	403,914,000
大同特殊鋼	128,000	416.00	53,248,000
日立金属	68,000	1,899.00	129,132,000
三井金属鉱業	195,000	292.00	56,940,000
三菱マテリアル	478,000	349.00	166,822,000
住友金属鉱山	198,000	1,480.50	293,139,000
DOWAホールディングス	85,000	893.00	75,905,000
住友電気工業	288,900	1,557.50	449,961,750
アサヒホールディングス	11,500	1,869.00	21,493,500
LIXILグループ	106,800	2,261.00	241,474,800
リンナイ	11,900	8,900.00	105,910,000
ジーテクト	6,000	1,012.00	6,072,000
日本発條	61,100	1,017.00	62,138,700
日本製鋼所	110,000	407.00	44,770,000
オーエスジー	34,900	1,831.00	63,901,900
ディスコ	8,500	7,320.00	62,220,000
ニューフレアテクノロジー	1,100	4,975.00	5,472,500
ナブテスコ	35,000	2,600.00	91,000,000
SMC	21,900	29,955.00	656,014,500
小松製作所	357,800	2,445.00	874,821,000
住友重機械工業	210,000	577.00	121,170,000
日立建機	39,100	2,089.00	81,679,900
クボタ	398,000	1,601.50	637,397,000
荏原製作所	169,000	638.00	107,822,000
ダイキン工業	100,000	6,471.00	647,100,000
栗田工業	46,100	2,349.00	108,288,900
椿本チエイン	39,000	848.00	33,072,000
タダノ	32,000	1,860.00	59,520,000
平和	15,900	2,142.00	34,057,800

SANKYO	22,200	3,830.00	85,026,000
ユニバーサルエンターテインメント	5,500	1,760.00	9,680,000
セガサミーホールディングス	78,700	1,655.00	130,248,500
T P R	8,200	2,462.00	20,188,400
ホンザキ電機	21,400	5,040.00	107,856,000
日本精工	163,000	1,482.00	241,566,000
ジェイテクト	77,800	1,755.00	136,539,000
不二越	68,000	722.00	49,096,000
THK	45,700	2,690.00	122,933,000
マキタ	47,800	5,920.00	282,976,000
三菱重工業	1,304,000	669.90	873,549,600
I H I	528,000	556.00	293,568,000
コニカミノルタ	186,200	1,167.00	217,295,400
ブラザー工業	94,700	1,948.00	184,475,600
ミネベア	100,000	1,413.00	141,300,000
日立製作所	1,763,000	828.20	1,460,116,600
東芝	1,446,000	475.60	687,717,600
三菱電機	733,000	1,393.50	1,021,435,500
富士電機	204,000	485.00	98,940,000
安川電機	80,300	1,402.00	112,580,600
日本電産	79,200	7,110.00	563,112,000
オムロン	82,600	4,925.00	406,805,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	141,000	593.00	83,613,000
富士通	706,000	693.00	489,258,000
沖電気工業	327,000	263.00	86,001,000
セイコーエプソン	50,000	5,200.00	260,000,000
ワコム	57,700	454.00	26,195,800
パナソニック	836,900	1,276.00	1,067,884,400
アンリツ	42,600	785.00	33,441,000
富士通ゼネラル	17,000	1,285.00	21,845,000
T D K	44,200	5,930.00	262,106,000
ヒロセ電機	12,700	13,540.00	171,958,000
横河電機	79,400	1,377.00	109,333,800
日本光電工業	15,600	5,510.00	85,956,000
堀場製作所	13,500	3,910.00	52,785,000

キーエンス	16,600	47,680.00	791,488,000
シスメックス	61,400	4,285.00	263,099,000
スタンレー電気	52,700	2,234.00	117,731,800
カシオ計算機	73,400	1,684.00	123,605,600
ファナック	81,700	19,230.00	1,571,091,000
浜松ホトニクス	30,500	4,930.00	150,365,000
京セラ	128,800	4,924.50	634,275,600
村田製作所	76,800	11,935.00	916,608,000
小糸製作所	40,200	2,911.00	117,022,200
ミツバ	13,500	1,755.00	23,692,500
キヤノン	424,700	3,503.00	1,487,724,100
リコー	220,200	1,150.00	253,230,000
トヨタ紡織	25,600	1,104.00	28,262,400
鬼怒川ゴム工業	14,000	458.00	6,412,000
ユニプレス	11,900	2,085.00	24,811,500
豊田自動織機	66,700	5,130.00	342,171,000
デンソー	181,000	4,962.50	898,212,500
三井造船	283,000	250.00	70,750,000
川崎重工業	570,000	428.00	243,960,000
名村造船所	14,300	1,059.00	15,143,700
日産自動車	1,028,200	1,021.00	1,049,792,200
いすゞ自動車	212,300	1,466.00	311,231,800
トヨタ自動車	236,600	6,366.00	1,506,195,600
日野自動車	91,500	1,518.00	138,897,000
三菱自動車工業	262,100	1,256.00	329,197,600
NOK	35,400	2,568.00	90,907,200
カヤバ工業	69,000	478.00	32,982,000
大同メタル工業	10,000	1,391.00	13,910,000
カルソニックカンセイ	50,000	575.00	28,750,000
アイシン精機	67,000	3,910.00	261,970,000
マツダ	218,300	2,601.00	567,798,300
ダイハツ工業	77,700	1,624.00	126,184,800
本田技研工業	410,600	3,591.00	1,474,464,600
スズキ	153,100	3,331.50	510,052,650
富士重工業	249,300	3,476.00	866,566,800

ヤマハ発動機	111,400	2,087.00	232,491,800
エクセディ	8,800	2,667.00	23,469,600
豊田合成	23,700	2,041.00	48,371,700
エフ・シー・シー	12,000	1,702.00	20,424,000
シマノ	31,600	13,090.00	413,644,000
テイ・エス テック	15,500	2,454.00	38,037,000
テルモ	112,300	2,595.00	291,418,500
ニコン	136,800	1,529.00	209,167,200
HOYA	174,300	3,618.50	630,704,550
バンダイナムコホールディングス	80,800	2,771.00	223,896,800
アシックス	72,800	2,458.00	178,942,400
ピジョン	12,000	6,400.00	76,800,000
電源開発	45,500	3,455.00	157,202,500
東京瓦斯	835,000	594.30	496,240,500
大阪瓦斯	758,000	429.90	325,864,200
東武鉄道	416,000	544.00	226,304,000
相鉄ホールディングス	167,000	393.00	65,631,000
東京急行電鉄	431,000	689.00	296,959,000
小田急電鉄	235,000	971.00	228,185,000
京王電鉄	205,000	791.00	162,155,000
京成電鉄	110,000	1,126.00	123,860,000
東日本旅客鉄道	134,200	8,151.00	1,093,864,200
西日本旅客鉄道	66,100	4,951.00	327,261,100
東海旅客鉄道	65,600	14,590.00	957,104,000
西日本鉄道	126,000	419.00	52,794,000
近畿日本鉄道	737,000	360.00	265,320,000
阪急阪神ホールディングス	492,000	625.00	307,500,000
京阪電気鉄道	206,000	465.00	95,790,000
名古屋鉄道	348,000	440.00	153,120,000
日本通運	290,000	448.00	129,920,000
ヤマトホールディングス	134,400	2,049.50	275,452,800
山九	89,000	555.00	49,395,000
日立物流	15,300	1,426.00	21,817,800
A N Aホールディングス	1,440,000	246.40	354,816,000
上組	87,000	1,028.00	89,436,000

近鉄エクスプレス	6,600	4,165.00	27,489,000
グリーン	43,600	771.00	33,615,600
ティーガイア	7,200	1,084.00	7,804,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	183,400	503.00	92,250,200
インターネットイニシアティブ	10,600	1,976.00	20,945,600
野村総合研究所	40,900	3,415.00	139,673,500
フジ・メディア・ホールディングス	69,900	1,518.00	106,108,200
オービック	24,900	3,820.00	95,118,000
ヤフー	518,100	416.00	215,529,600
トレンドマイクロ	38,300	3,560.00	136,348,000
日本オラクル	11,600	4,245.00	49,242,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,200	4,440.00	36,408,000
大塚商会	19,400	4,340.00	84,196,000
USEN	42,400	328.00	13,907,200
エイベックス・グループ・ホールディングス	13,300	1,611.00	21,426,300
日本テレビホールディングス	72,000	1,621.00	116,712,000
日本電信電話	229,800	6,538.00	1,502,432,400
KDDI	224,400	6,609.00	1,483,059,600
光通信	6,500	7,390.00	48,035,000
NTTドコモ	595,700	1,752.00	1,043,666,400
GMOインターネット	24,100	895.00	21,569,500
東宝	51,600	2,417.00	124,717,200
エヌ・ティ・ティ・データ	51,000	3,945.00	201,195,000
SCSK	17,200	2,921.00	50,241,200
コナミ	32,600	2,163.00	70,513,800
ソフトバンク	192,500	7,467.00	1,437,397,500
双日	483,900	166.00	80,327,400
アルフレッサホールディングス	85,500	1,534.00	131,157,000
シップヘルスケアホールディングス	10,400	2,853.00	29,671,200
三菱食品	7,900	2,384.00	18,833,600
第一興商	15,800	3,000.00	47,400,000
メディカルホールディングス	72,300	1,331.00	96,231,300
伊藤忠商事	576,800	1,266.50	730,517,200
丸紅	632,400	719.50	455,011,800

豊田通商	80,500	2,564.00	206,402,000
兼松	154,000	171.00	26,334,000
三井物産	653,700	1,662.00	1,086,449,400
日立ハイテクノロジーズ	21,900	3,085.00	67,561,500
山善	27,700	847.00	23,461,900
住友商事	426,600	1,157.50	493,789,500
三菱商事	554,000	2,148.00	1,189,992,000
岩谷産業	80,000	734.00	58,720,000
東邦ホールディングス	23,100	1,988.00	45,922,800
サンリオ	18,200	3,210.00	58,422,000
日鉄住金物産	63,000	401.00	25,263,000
ミスミグループ本社	29,000	3,165.00	91,785,000
ローソン	29,700	7,410.00	220,077,000
エービーシー・マート	10,300	5,500.00	56,650,000
ゲオホールディングス	12,400	959.00	11,891,600
日本マクドナルドホールディングス	30,200	2,638.00	79,667,600
スターバックス コーヒー ジャパン	16,400	1,463.00	23,993,200
パル	4,200	2,980.00	12,516,000
セリア	8,600	4,040.00	34,744,000
Monotaro	14,000	2,593.00	36,302,000
J. フロント リテイリング	85,400	1,375.00	117,425,000
マツモトキヨシホールディングス	14,900	3,220.00	47,978,000
スタートトゥデイ	22,500	2,378.00	53,505,000
三越伊勢丹ホールディングス	143,700	1,401.00	201,323,700
ウエルシアホールディングス	8,700	3,335.00	29,014,500
コスモス薬品	4,100	13,840.00	56,744,000
セブン&アイ・ホールディングス	302,400	4,136.00	1,250,726,400
ツルハホールディングス	14,300	6,120.00	87,516,000
良品計画	7,700	13,580.00	104,566,000
ドンキホーテホールディングス	25,000	6,260.00	156,500,000
VTホールディングス	27,200	371.00	10,091,200
ユナイテッドアローズ	9,500	3,915.00	37,192,500
スギホールディングス	13,000	4,630.00	60,190,000
ファミリーマート	24,400	4,200.00	102,480,000
AOKIホールディングス	12,500	1,263.00	15,787,500

コメリ	11,100	2,350.00	26,085,000
しまむら	8,400	9,880.00	82,992,000
高島屋	100,000	914.00	91,400,000
イオン	288,800	1,110.00	320,568,000
ユニーグループ・ホールディングス	69,200	573.00	39,651,600
イズミ	16,100	3,560.00	57,316,000
ケーズホールディングス	15,300	3,305.00	50,566,500
アインファーマシーズ	8,000	2,594.00	20,752,000
ヤマダ電機	285,800	332.00	94,885,600
ニトリホールディングス	28,600	6,880.00	196,768,000
王将フードサービス	4,800	4,185.00	20,088,000
アークス	16,400	2,288.00	37,523,200
パロー	15,600	1,786.00	27,861,600
ファーストリテイリング	14,500	36,965.00	535,992,500
サンドラッグ	15,300	4,815.00	73,669,500
新生銀行	626,000	234.00	146,484,000
あおぞら銀行	375,000	364.00	136,500,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,339,000	610.00	1,426,790,000
りそなホールディングス	687,200	603.10	414,450,320
三井住友トラスト・ホールディングス	1,420,000	443.70	630,054,000
三井住友フィナンシャルグループ	342,200	4,391.00	1,502,600,200
西日本シティ銀行	254,000	283.00	71,882,000
千葉銀行	279,000	737.00	205,623,000
横浜銀行	470,000	584.60	274,762,000
常陽銀行	262,000	524.00	137,288,000
群馬銀行	161,000	616.00	99,176,000
ふくおかフィナンシャルグループ	293,000	502.00	147,086,000
静岡銀行	212,000	1,067.00	226,204,000
十六銀行	121,000	395.00	47,795,000
スルガ銀行	70,500	2,097.00	147,838,500
八十二銀行	174,000	632.00	109,968,000
ほくほくフィナンシャルグループ	492,000	207.00	101,844,000
広島銀行	213,000	522.00	111,186,000
中国銀行	69,300	1,539.00	106,652,700

伊予銀行	103,100	1,071.00	110,420,100
セブン銀行	270,900	437.00	118,383,300
みずほフィナンシャルグループ	6,993,000	195.70	1,368,530,100
山口フィナンシャルグループ	96,000	1,011.00	97,056,000
北洋銀行	108,900	418.00	45,520,200
京葉銀行	79,000	539.00	42,581,000
大和証券グループ本社	716,000	824.00	589,984,000
野村ホールディングス	1,478,000	620.90	917,690,200
岡三証券グループ	57,000	759.00	43,263,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	76,600	705.00	54,003,000
松井証券	36,700	973.00	35,709,100
ソニーフィナンシャルホールディングス	69,300	1,710.00	118,503,000
第一生命保険	431,200	1,569.00	676,552,800
東京海上ホールディングス	280,000	3,364.00	941,920,000
T&Dホールディングス	248,000	1,363.00	338,024,000
クレディセゾン	59,000	2,048.00	120,832,000
芙蓉総合リース	7,600	4,225.00	32,110,000
興銀リース	12,600	2,431.00	30,630,600
東京センチュリーリース	17,000	2,808.00	47,736,000
Jトラスト	18,900	1,060.00	20,034,000
アイフル	131,800	411.00	54,169,800
リコーリース	5,000	3,025.00	15,125,000
イオンフィナンシャルサービス	42,600	2,150.00	91,590,000
アコム	145,200	329.00	47,770,800
日立キャピタル	14,200	2,555.00	36,281,000
オリックス	451,600	1,428.00	644,884,800
三菱UFJリース	183,400	545.00	99,953,000
日本取引所グループ	106,100	2,491.00	264,295,100
ヒューリック	122,000	1,046.00	127,612,000
野村不動産ホールディングス	47,800	1,828.00	87,378,400
東急不動産ホールディングス	160,300	716.00	114,774,800
飯田グループホールディングス	31,700	1,346.00	42,668,200
パーク24	38,000	1,742.00	66,196,000
三井不動産	379,000	3,118.50	1,181,911,500

三菱地所	506,000	2,302.00	1,164,812,000
住友不動産	173,000	3,587.00	620,551,000
大京	122,000	195.00	23,790,000
レオパレス21	83,100	569.00	47,283,900
住友不動産販売	5,200	2,418.00	12,573,600
タカラレーベン	23,700	396.00	9,385,200
イオンモール	46,600	1,959.00	91,289,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	44,900	1,086.00	48,761,400
アコーディア・ゴルフ	31,200	1,120.00	34,944,000
テンプホールディングス	16,700	3,355.00	56,028,500
カクコム	45,800	1,435.00	65,723,000
エムスリー	51,500	1,717.00	88,425,500
ディー・エヌ・エー	41,200	1,308.00	53,889,600
博報堂DYホールディングス	106,000	1,069.00	113,314,000
電通	72,200	3,980.00	287,356,000
みらかホールディングス	20,100	4,485.00	90,148,500
オリエンタルランド	20,700	21,330.00	441,531,000
リゾートトラスト	25,900	2,442.00	63,247,800
もしもしホットライン	14,200	1,022.00	14,512,400
ユー・エス・エス	92,600	1,609.00	148,993,400
サイバーエージェント	18,700	3,975.00	74,332,500
楽天	332,100	1,218.00	404,497,800
リロ・ホールディング	3,800	7,420.00	28,196,000
エイチ・アイ・エス	12,500	2,738.00	34,225,000
セコム	79,600	6,355.00	505,858,000
ベネッセホールディングス	25,600	3,525.00	90,240,000
イオンディライト	7,400	2,757.00	20,401,800
小計	銘柄数：400		99,148,842,090
	組入時価比率：98.2%		100.0%
合計			99,148,842,090

(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。