

平成26年4月期（平成26年1月24日～平成26年4月7日）決算短信

平成26年5月19日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS 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6月26日
 分配金支払開始日 平成26年5月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年4月期の運用状況（平成26年1月24日～平成26年4月7日）

(1)資産内訳 (百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
平成26年4月期	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)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	236,943,923
株式	22,357,273,050
派生商品評価勘定	15,128,244
未収入金	197,936,000
未収配当金	210,684,404
未収利息	471
流動資産合計	23,017,966,092
資産合計	23,017,966,092
負債の部	
流動負債	
前受金	4,790,000
未払収益分配金	199,398,540
未払受託者報酬	1,790,676
未払委託者報酬	5,372,002
その他未払費用	1,714,683
流動負債合計	213,065,901
負債合計	213,065,901
純資産の部	
元本等	
元本	24,402,183,432
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,597,283,241
(分配準備積立金)	1,484,880
元本等合計	22,804,900,191
純資産合計	22,804,900,191
負債純資産合計	23,017,966,092

(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

営業収益	
受取配当金	210,684,404
受取利息	7,673
有価証券売買等損益	42,255,856
派生商品取引等損益	15,128,244
営業収益合計	268,076,177
営業費用	
受託者報酬	1,790,676

委託者報酬	5,372,002
その他費用	2,645,979
営業費用合計	9,808,657
営業利益又は営業損失(△)	258,267,520
経常利益又は経常損失(△)	258,267,520
当期純利益又は当期純損失(△)	258,267,520
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△)	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,656,152,221
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
分配金	199,398,540
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,597,283,241

(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 1 月 24 日から平成 26 年 4 月 7 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 1 期 平成 26 年 4 月 7 日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,098,932 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	
1 口当たり純資産額	10,865 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	
1. 分配金の計算過程	

項目		
当期配当等収益額	A	210,692,077 円
分配準備積立金	B	0 円
配当等収益合計額	C=A+B	210,692,077 円
経費	D	9,808,657 円
収益分配可能額	E=C-D	200,883,420 円
収益分配金	F	199,398,540 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,484,880 円
口数	H	2,098,932 口
1 口当たり分配金	I=F/H	95 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、1,141,863 円は上場に係る費用であります。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第 1 期 自 平成 26 年 1 月 24 日 至 平成 26 年 4 月 7 日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>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。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 1 期 平成 26 年 4 月 7 日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>株式</p> <p>(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。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第 1 期 自 平成 26 年 1 月 24 日 至 平成 26 年 4 月 7 日
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。</p>

(その他の注記)

1 元本の移動

第 1 期 自 平成 26 年 1 月 24 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	
期首元本額	— 円
期中追加設定元本額	24,402,183,432 円
期中一部交換元本額	0 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 1 期 自 平成 26 年 1 月 24 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	
	損益に含まれた評価差額 (円)	
株式	58,128,893	
合計	58,128,893	

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第 1 期(平成 26 年 4 月 7 日現在)			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1 年超		
市場取引 先物取引 株価指数先物取引 買建	427,925,000	—	443,075,000	15,128,244
合計	427,925,000	—	443,075,000	15,128,244

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式(平成 26 年 4 月 7 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	国際石油開発帝石	102,200	1,386.00	141,649,200	
		ミライト・ホールディングス	6,000	903.00	5,418,000	
		コムシスホールディングス	10,200	1,702.00	17,360,400	
		ミサワホーム	2,300	1,322.00	3,040,600	
		大成建設	106,000	473.00	50,138,000	
		長谷工コーポレーション	28,000	669.00	18,732,000	

鹿島建設	92,000	377.00	34,684,000
大東建託	8,000	9,978.00	79,824,000
住友林業	14,500	1,034.00	14,993,000
大和ハウス工業	58,000	1,770.00	102,660,000
積水ハウス	56,000	1,296.00	72,576,000
協和エクシオ	8,200	1,380.00	11,316,000
日揮	21,000	3,659.00	76,839,000
東芝プラントシステム	3,400	1,530.00	5,202,000
千代田化工建設	17,000	1,400.00	23,800,000
日清製粉グループ本社	20,900	1,117.00	23,345,300
山崎製パン	15,000	1,228.00	18,420,000
ヤクルト本社	12,300	5,060.00	62,238,000
明治ホールディングス	6,200	6,080.00	37,696,000
雪印メグミルク	4,500	1,332.00	5,994,000
日本ハム	15,000	1,587.00	23,805,000
アサヒグループホールディングス	42,200	2,902.00	122,464,400
キリンホールディングス	89,900	1,382.00	124,241,800
伊藤園	5,700	2,289.00	13,047,300
不二製油	5,100	1,324.00	6,752,400
キッコーマン	17,000	1,941.00	32,997,000
味の素	50,000	1,483.00	74,150,000
キューピー	10,700	1,463.00	15,654,100
ニチレイ	22,000	436.00	9,592,000
東洋水産	10,000	3,310.00	33,100,000
日清食品ホールディングス	8,200	4,630.00	37,966,000
日本たばこ産業	89,100	3,274.00	291,713,400
東レ	143,000	688.00	98,384,000
王子ホールディングス	87,000	454.00	39,498,000
レンゴー	16,000	532.00	8,512,000
クラレ	31,200	1,179.00	36,784,800
旭化成	123,000	691.00	84,993,000
昭和電工	131,000	145.00	18,995,000
日産化学工業	13,500	1,582.00	21,357,000
東ソー	53,000	394.00	20,882,000
東亜合成	23,000	434.00	9,982,000

電気化学工業	39,000	364.00	14,196,000
信越化学工業	35,200	5,813.00	204,617,600
エア・ウォーター	16,000	1,443.00	23,088,000
大陽日酸	25,000	809.00	20,225,000
日本パーカライジング	4,600	2,416.00	11,113,600
日本触媒	17,000	1,211.00	20,587,000
J S R	18,000	1,879.00	33,822,000
三菱ケミカルホールディングス	122,800	428.00	52,558,400
日本合成化学工業	4,000	739.00	2,956,000
ダイセル	26,000	847.00	22,022,000
積水化学工業	40,000	1,085.00	43,400,000
日本ゼオン	16,000	955.00	15,280,000
アイカ工業	5,500	2,239.00	12,314,500
宇部興産	99,000	186.00	18,414,000
日立化成	8,500	1,452.00	12,342,000
日本化薬	14,000	1,158.00	16,212,000
花王	51,100	3,609.00	184,419,900
日本ペイント	17,000	1,594.00	27,098,000
関西ペイント	24,000	1,460.00	35,040,000
D I C	70,000	267.00	18,690,000
東洋インキSCホールディングス	18,000	436.00	7,848,000
富士フイルムホールディングス	45,000	2,816.00	126,720,000
資生堂	34,900	1,793.00	62,575,700
ドクターシーラボ	1,300	3,190.00	4,147,000
小林製薬	3,200	5,960.00	19,072,000
日東電工	16,200	4,950.00	80,190,000
エフピコ	2,600	3,120.00	8,112,000
ニフコ	4,400	2,986.00	13,138,400
ユニ・チャーム	12,100	5,607.00	67,844,700
協和発酵キリン	24,000	1,087.00	26,088,000
武田薬品工業	69,900	4,821.00	336,987,900
アステラス製薬	226,200	1,194.00	270,082,800
塩野義製薬	30,700	1,855.00	56,948,500
田辺三菱製薬	16,300	1,469.00	23,944,700
中外製薬	19,600	2,651.00	51,959,600

科研製薬	7,000	1,611.00	11,277,000
エーザイ	24,200	3,925.00	94,985,000
ロート製薬	8,200	1,762.00	14,448,400
小野薬品工業	8,900	8,620.00	76,718,000
久光製薬	6,100	4,605.00	28,090,500
持田製薬	1,400	7,280.00	10,192,000
参天製薬	7,200	4,780.00	34,416,000
ツムラ	5,800	2,470.00	14,326,000
日医工	4,600	1,577.00	7,254,200
東和薬品	1,000	4,285.00	4,285,000
沢井製薬	3,100	6,190.00	19,189,000
第一三共	61,900	1,813.00	112,224,700
キョーリン製薬ホールディングス	5,200	1,931.00	10,041,200
大正製薬ホールディングス	4,700	7,700.00	36,190,000
日本コークス工業	15,800	123.00	1,943,400
昭和シェル石油	17,600	923.00	16,244,800
東燃ゼネラル石油	30,000	909.00	27,270,000
出光興産	9,300	2,123.00	19,743,900
J Xホールディングス	218,000	502.00	109,436,000
横浜ゴム	22,000	948.00	20,856,000
東洋ゴム工業	16,000	765.00	12,240,000
ブリヂストン	61,600	3,745.00	230,692,000
住友ゴム工業	15,300	1,377.00	21,068,100
旭硝子	97,000	590.00	57,230,000
日本電気硝子	41,000	525.00	21,525,000
太平洋セメント	115,000	380.00	43,700,000
TOTO	29,000	1,497.00	43,413,000
日本特殊陶業	17,000	2,381.00	40,477,000
ニチアス	9,000	666.00	5,994,000
新日鐵住金	830,000	281.00	233,230,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	50,100	1,954.00	97,895,400
大同特殊鋼	33,000	499.00	16,467,000
日立金属	17,000	1,428.00	24,276,000
三井金属鉱業	50,000	241.00	12,050,000
三菱マテリアル	123,000	301.00	37,023,000

住友金属鉱山	51,000	1,313.00	66,963,000
DOWAホールディングス	22,000	858.00	18,876,000
住友電気工業	74,000	1,522.00	112,628,000
アサヒホールディングス	3,000	1,654.00	4,962,000
LIXILグループ	27,300	2,774.00	75,730,200
リンナイ	3,000	8,660.00	25,980,000
ジーテクト	1,500	1,337.00	2,005,500
日本発條	15,600	971.00	15,147,600
日本製鋼所	28,000	466.00	13,048,000
オーエスジー	8,100	1,797.00	14,555,700
ディスコ	2,200	6,630.00	14,586,000
ニューフレアテクノロジー	300	7,710.00	2,313,000
ナブテスコ	9,000	2,347.00	21,123,000
SMC	5,600	26,695.00	149,492,000
小松製作所	91,600	2,207.00	202,161,200
住友重機械工業	54,000	438.00	23,652,000
日立建機	10,000	1,992.00	19,920,000
クボタ	102,000	1,387.00	141,474,000
荏原製作所	43,000	646.00	27,778,000
ダイキン工業	25,600	6,018.00	154,060,800
栗田工業	11,800	2,184.00	25,771,200
椿本チエイン	10,000	775.00	7,750,000
平和	4,100	1,720.00	7,052,000
SANKYO	5,700	4,265.00	24,310,500
ユニバーサルエンターテインメント	1,400	1,865.00	2,611,000
セガサミーホールディングス	20,200	2,272.00	45,894,400
T P R	2,100	1,617.00	3,395,700
ホンザキ電機	5,500	3,980.00	21,890,000
日本精工	42,000	1,105.00	46,410,000
ジェイテクト	19,900	1,617.00	32,178,300
不二越	17,000	666.00	11,322,000
T H K	11,700	2,249.00	26,313,300
マキタ	12,200	5,530.00	67,466,000
日立造船	13,900	497.00	6,908,300
三菱重工業	334,000	598.00	199,732,000

I H I	132,000	424.00	55,968,000
コニカミノルタ	49,500	955.00	47,272,500
ブラザー工業	24,200	1,448.00	35,041,600
日立製作所	450,000	755.00	339,750,000
東芝	370,000	435.00	160,950,000
三菱電機	188,000	1,191.00	223,908,000
富士電機	52,000	452.00	23,504,000
安川電機	20,600	1,404.00	28,922,400
日本電産	20,300	6,130.00	124,439,000
オムロン	21,200	4,105.00	87,026,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,000	571.00	20,556,000
富士通	181,000	610.00	110,410,000
ワコム	14,800	692.00	10,241,600
アンリツ	10,900	1,154.00	12,578,600
富士通ゼネラル	4,000	1,072.00	4,288,000
ソニー	102,800	1,988.00	204,366,400
TDK	11,300	4,435.00	50,115,500
ヒロセ電機	3,300	14,610.00	48,213,000
アズビル	5,700	2,487.00	14,175,900
日本光電工業	4,000	4,235.00	16,940,000
堀場製作所	3,500	3,650.00	12,775,000
キーエンス	4,200	42,240.00	177,408,000
シスメックス	15,700	3,240.00	50,868,000
スタンレー電気	13,500	2,311.00	31,198,500
ファナック	20,900	18,145.00	379,230,500
浜松ホトニクス	7,300	4,730.00	34,529,000
京セラ	33,000	4,643.00	153,219,000
村田製作所	19,700	9,627.00	189,651,900
小糸製作所	10,300	1,911.00	19,683,300
ミツバ	3,500	1,670.00	5,845,000
キヤノン電子	1,700	1,802.00	3,063,400
キヤノン	90,300	3,200.00	288,960,000
東京エレクトロン	16,800	6,454.00	108,427,200
トヨタ紡織	6,600	1,042.00	6,877,200
鬼怒川ゴム工業	4,000	429.00	1,716,000

ユニプレス	3,000	1,868.00	5,604,000
豊田自動織機	17,100	4,855.00	83,020,500
デンソー	46,300	5,024.00	232,611,200
川崎重工業	146,000	394.00	57,524,000
日産自動車	263,300	939.00	247,238,700
いすゞ自動車	109,000	598.00	65,182,000
トヨタ自動車	56,600	5,758.00	325,902,800
日野自動車	23,400	1,519.00	35,544,600
三菱自動車工業	58,800	1,110.00	65,268,000
NOK	9,100	1,717.00	15,624,700
カヤバ工業	18,000	434.00	7,812,000
大同メタル工業	3,000	1,175.00	3,525,000
プレス工業	7,000	377.00	2,639,000
カルソニックカンセイ	13,000	503.00	6,539,000
アイシン精機	17,200	3,685.00	63,382,000
ダイハツ工業	19,900	1,767.00	35,163,300
本田技研工業	90,600	3,571.00	323,532,600
スズキ	39,200	2,767.00	108,466,400
富士重工業	63,800	2,856.00	182,212,800
ヤマハ発動機	28,500	1,634.00	46,569,000
エクセディ	2,300	2,845.00	6,543,500
豊田合成	6,100	1,977.00	12,059,700
エフ・シー・シー	3,100	1,780.00	5,518,000
シマノ	8,100	10,110.00	81,891,000
テイ・エス テック	4,000	3,045.00	12,180,000
テルモ	28,800	2,207.00	63,561,600
東京精密	3,400	1,913.00	6,504,200
ニコン	35,000	1,665.00	58,275,000
HOYA	45,600	3,121.00	142,317,600
バンダイナムコホールディングス	20,700	2,338.00	48,396,600
アシックス	18,600	1,938.00	36,046,800
ビジョン	3,100	4,700.00	14,570,000
リンテック	4,500	1,926.00	8,667,000
電源開発	11,600	2,879.00	33,396,400
東京瓦斯	220,000	511.00	112,420,000

大阪瓦斯	194,000	390.00	75,660,000
東武鉄道	106,000	499.00	52,894,000
相鉄ホールディングス	43,000	372.00	15,996,000
東京急行電鉄	110,000	632.00	69,520,000
小田急電鉄	60,000	885.00	53,100,000
京王電鉄	52,000	713.00	37,076,000
京成電鉄	28,000	877.00	24,556,000
東日本旅客鉄道	34,500	7,646.00	263,787,000
西日本旅客鉄道	16,900	4,135.00	69,881,500
東海旅客鉄道	16,800	11,925.00	200,340,000
西日本鉄道	32,000	392.00	12,544,000
近畿日本鉄道	189,000	362.00	68,418,000
阪急阪神ホールディングス	126,000	558.00	70,308,000
京阪電気鉄道	53,000	417.00	22,101,000
名古屋鉄道	87,000	302.00	26,274,000
日本通運	74,000	509.00	37,666,000
ヤマトホールディングス	34,400	2,184.00	75,129,600
山九	23,000	393.00	9,039,000
日立物流	3,900	1,645.00	6,415,500
ANAホールディングス	369,000	227.00	83,763,000
スカイマーク	5,300	297.00	1,574,100
上組	22,000	987.00	21,714,000
近鉄エクスプレス	1,700	4,460.00	7,582,000
グリーン	11,100	1,077.00	11,954,700
ティーガイア	1,800	894.00	1,609,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	47,000	563.00	26,461,000
インターネットイニシアティブ	2,700	2,203.00	5,948,100
野村総合研究所	10,500	3,215.00	33,757,500
フジ・メディア・ホールディングス	17,900	1,770.00	31,683,000
オービック	6,400	3,135.00	20,064,000
ヤフー	134,000	485.00	64,990,000
トレンドマイクロ	8,200	3,155.00	25,871,000
日本オラクル	3,000	4,565.00	13,695,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,100	4,290.00	9,009,000
大塚商会	1,700	12,850.00	21,845,000

USEN	10,950	399.00	4,369,050
エイベックス・グループ・ホールディングス	3,400	1,879.00	6,388,600
日本テレビホールディングス	18,400	1,599.00	29,421,600
日本電信電話	56,900	5,408.00	307,715,200
KDDI	57,500	5,588.00	321,310,000
光通信	1,700	8,620.00	14,654,000
NTTドコモ	152,500	1,584.00	241,560,000
GMOインターネット	6,200	995.00	6,169,000
東宝	13,200	2,055.00	27,126,000
エス・ティ・ティ・データ	13,100	3,860.00	50,566,000
カプコン	4,700	1,728.00	8,121,600
SCSK	4,400	2,737.00	12,042,800
コナミ	8,400	2,351.00	19,748,400
ソフトバンク	54,800	7,556.00	414,068,800
フィールズ	1,400	1,398.00	1,957,200
双日	123,900	173.00	21,434,700
TOKAIホールディングス	9,000	359.00	3,231,000
シップヘルスケアホールディングス	2,600	3,890.00	10,114,000
三菱食品	2,000	2,234.00	4,468,000
第一興商	4,200	3,095.00	12,999,000
ガリバーインターナショナル	6,200	832.00	5,158,400
伊藤忠商事	147,700	1,166.00	172,218,200
丸紅	162,000	689.00	111,618,000
長瀬産業	10,500	1,251.00	13,135,500
豊田通商	20,600	2,579.00	53,127,400
兼松	39,000	160.00	6,240,000
三井物産	170,400	1,468.00	250,147,200
日立ハイテクノロジーズ	5,600	2,425.00	13,580,000
山善	7,100	662.00	4,700,200
住友商事	109,300	1,325.00	144,822,500
三菱商事	144,500	1,881.00	271,804,500
岩谷産業	20,000	650.00	13,000,000
東邦ホールディングス	5,900	2,110.00	12,449,000
サンリオ	4,700	3,635.00	17,084,500
ミスミグループ本社	7,400	2,718.00	20,113,200

ローソン	7,600	7,100.00	53,960,000
エービーシー・マート	2,600	4,525.00	11,765,000
ゲオホールディングス	3,200	912.00	2,918,400
アダストリアホールディングス	1,400	2,380.00	3,332,000
日本マクドナルドホールディングス	7,700	2,772.00	21,344,400
パル	1,100	1,952.00	2,147,200
セリア	2,200	3,820.00	8,404,000
ビックカメラ	7,000	611.00	4,277,000
MonotaRO	2,900	2,616.00	7,586,400
J. フロント リテイリング	44,000	702.00	30,888,000
マツモトキヨシホールディングス	3,800	3,275.00	12,445,000
スタートトゥデイ	5,800	2,472.00	14,337,600
ココカラファイン	1,900	2,929.00	5,565,100
三越伊勢丹ホールディングス	36,800	1,318.00	48,502,400
ウエルシアホールディングス	900	5,910.00	5,319,000
コスモス薬品	1,000	11,920.00	11,920,000
セブン&アイ・ホールディングス	77,400	3,910.00	302,634,000
ツルハホールディングス	1,800	10,150.00	18,270,000
良品計画	2,000	10,080.00	20,160,000
コーナン商事	2,400	1,052.00	2,524,800
ワタミ	2,200	1,480.00	3,256,000
ドンキホーテホールディングス	6,400	5,460.00	34,944,000
ゼンショーホールディングス	8,500	1,019.00	8,661,500
サイゼリヤ	2,700	1,249.00	3,372,300
VTホールディングス	7,000	619.00	4,333,000
ユナイテッドアローズ	2,400	3,825.00	9,180,000
スギホールディングス	3,300	4,605.00	15,196,500
ファミリーマート	6,300	4,455.00	28,066,500
AOKIホールディングス	3,200	1,339.00	4,284,800
コメリ	2,900	2,734.00	7,928,600
しまむら	2,100	8,750.00	18,375,000
高島屋	25,000	949.00	23,725,000
イオン	73,900	1,161.00	85,797,900
ユニグループ・ホールディングス	17,700	595.00	10,531,500
イズミ	4,100	3,045.00	12,484,500

ケーズホールディングス	3,900	2,747.00	10,713,300
アインファーマシーズ	1,000	4,710.00	4,710,000
ヤマダ電機	73,200	356.00	26,059,200
ニトリホールディングス	7,300	4,555.00	33,251,500
王将フードサービス	1,200	3,450.00	4,140,000
アークス	4,200	2,014.00	8,458,800
バロー	4,000	1,298.00	5,192,000
ファーストリテイリング	4,300	37,975.00	163,292,500
サンドラッグ	3,900	4,465.00	17,413,500
新生銀行	160,000	203.00	32,480,000
あおぞら銀行	96,000	299.00	28,704,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	511,800	569.00	291,214,200
りそなホールディングス	176,000	500.00	88,000,000
三井住友トラスト・ホールディングス	364,000	457.00	166,348,000
三井住友フィナンシャルグループ	68,800	4,403.00	302,926,400
西日本シティ銀行	65,000	241.00	15,665,000
千葉銀行	71,000	641.00	45,511,000
横浜銀行	120,000	515.00	61,800,000
常陽銀行	69,000	504.00	34,776,000
群馬銀行	41,000	554.00	22,714,000
ふくおかフィナンシャルグループ	75,000	427.00	32,025,000
静岡銀行	54,000	1,010.00	54,540,000
十六銀行	31,000	365.00	11,315,000
スルガ銀行	18,000	1,790.00	32,220,000
八十二銀行	46,000	578.00	26,588,000
京都銀行	35,000	842.00	29,470,000
ほくほくフィナンシャルグループ	126,000	196.00	24,696,000
広島銀行	55,000	429.00	23,595,000
伊予銀行	26,400	964.00	25,449,600
セブン銀行	69,400	397.00	27,551,800
みずほフィナンシャルグループ	1,523,700	205.00	312,358,500
山口フィナンシャルグループ	25,000	910.00	22,750,000
北洋銀行	27,900	429.00	11,969,100
京葉銀行	20,000	448.00	8,960,000

トモニホールディングス	14,200	444.00	6,304,800
野村ホールディングス	378,500	660.00	249,810,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	17,700	1,696.00	30,019,200
第一生命保険	93,200	1,485.00	138,402,000
東京海上ホールディングス	71,700	3,093.00	221,768,100
T&Dホールディングス	63,500	1,245.00	79,057,500
クレディセゾン	15,100	2,140.00	32,314,000
芙蓉総合リース	1,900	3,605.00	6,849,500
興銀リース	3,200	2,485.00	7,952,000
東京センチュリーリース	4,300	2,913.00	12,525,900
Jトラスト	4,800	1,257.00	6,033,600
リコーリース	1,300	2,524.00	3,281,200
イオンフィナンシャルサービス	10,800	2,374.00	25,639,200
オリックス	114,900	1,486.00	170,741,400
三菱UFJリース	47,000	515.00	24,205,000
日本取引所グループ	27,200	2,459.00	66,884,800
野村不動産ホールディングス	12,200	2,074.00	25,302,800
東急不動産ホールディングス	35,300	807.00	28,487,100
飯田グループホールディングス	2,100	1,524.00	3,200,400
パーク24	9,700	1,924.00	18,662,800
三井不動産	87,000	3,239.00	281,793,000
三菱地所	119,000	2,509.00	298,571,000
住友不動産	44,000	4,277.00	188,188,000
大京	31,000	212.00	6,572,000
住友不動産販売	1,300	3,325.00	4,322,500
タカラレーベン	6,200	320.00	1,984,000
イオンモール	11,900	2,706.00	32,201,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	11,500	994.00	11,431,000
アコーディア・ゴルフ	8,000	1,168.00	9,344,000
カカクコム	11,900	1,692.00	20,134,800
エムスリー	13,000	1,621.00	21,073,000
ディー・エヌ・エー	10,500	1,833.00	19,246,500
電通	18,500	4,030.00	74,555,000
みらかホールディングス	5,100	4,395.00	22,414,500
オリエンタルランド	5,300	15,675.00	83,077,500

	リゾートトラスト	6,600	1,657.00	10,936,200	
	もしもしホットライン	3,600	944.00	3,398,400	
	ユー・エス・エス	23,700	1,463.00	34,673,100	
	サイバーエージェント	4,800	3,885.00	18,648,000	
	楽天	84,900	1,349.00	114,530,100	
	リロ・ホールディング	1,000	5,420.00	5,420,000	
	エイチ・アイ・エス	1,600	5,670.00	9,072,000	
	セコム	20,400	5,847.00	119,278,800	
	ベネッセホールディングス	6,600	4,015.00	26,499,000	
	イオンディライト	1,900	1,964.00	3,731,600	
	小計 銘柄数 : 400			22,357,273,050	
	組入時価比率 : 98.0%			100.0%	
	合計			22,357,273,050	

(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 26 年 4 月 7 日現在)

該当事項はありません。

第 2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。