

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年6月26日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼執行役社長 渡邊 国夫
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	N E X T F U N D S J P X日経インデックス400連動型上場投信
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	(1)当初自己設定日(平成26年1月24日) 200億円に相当する有価証券等を上限とします。 (2)継続申込期間(平成26年1月28日から平成27年3月26日まで) 15兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 (東京都中央区日本橋兜町2番1号)

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、平成26年1月8日付をもって提出した有価証券届出書（平成26年1月24日提出の有価証券届出書の訂正届出書にて訂正済み。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

また、それ以外の訂正事項につきましては、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部__は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(1) ファンドの目的及び基本的性格

< 訂正前 >

JPX日経インデックス400（「対象株価指数」といいます。）に連動する投資成果（基準価額の変動率が対象株価指数の変動率に一致することをいいます。）を目指します。

JPX日経インデックス400は、東京証券取引所（市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQ）に上場する全ての普通株式のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社日本取引所グループ、株式会社東京証券取引所および株式会社日本経済新聞社が選定した、原則400銘柄で構成される株価指数です。平成25年8月30日を起算日とし、その日の指数値を10,000ポイントとして計算されています。

ファンドの受益権は、金融商品取引所において時価により株式と同様に売買することができます。

信託金の限度額

ファンドの信託の限度額は、5兆円相当です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託の限度額を変更することができます。

ファンドは契約型の追加型株式投資信託ですが、以下の点で通常の投資信託とは異なる商品設計となっております。

受益権を上場します。

株式の組入比率を高位に維持するために、現金による解約は行なえないこととしていることからこれに代わる換金手段として、金融商品取引所により流通市場を提供するものです。

金融商品取引所での売買

上場(予定)日である平成26年1月28日以降、いつでも下記の金融商品取引所で売買することができます。

東京証券取引所

売買単位は1口以上1口単位です。

手数料は申込みの取り扱いの第一種金融商品取引業者等が独自に定める金額とします。

取引方法は原則として株式と同様です。詳しくは取り扱いの第一種金融商品取引業者等へお問い合わせください。

ファンドの設定は株式によって行ないます。

ファンドの設定は原則として株式^()によって行ないます。

受益権の取得（追加設定）については、原則として、委託者が事前に提示する現物株式のポートフォリオ（以下「指定株式ポートフォリオ」といいます。）による設定に限定します。

投資家は指定株式ポートフォリオをもって受益権を取得します。なお、指定株式ポートフォリオの時価評価額が、取得する受益権の評価額に満たない場合は、その差額に相当する金銭にて設定する

ものとしします。

また、投資家が指定株式ポートフォリオに含まれる株式の発行会社またはその子会社（会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社またはその子会社を以下「発行会社等」といいます。）である場合には、原則として、指定株式ポートフォリオの時価総額のうち当該発行会社の株式の時価総額に相当する金額および、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額(当該時価総額の0.15%の額)を当該株式に代えて金銭にて設定するものとしします。

()ファンドの設定は、以下に示す要件をすべて満たす、委託者の指定する有価証券等(これを「信託適格有価証券等」といいます。)によって行なわれます。

- 1.原則として対象株価指数に採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式であること
- 2.原則として有価証券の株数の比率が、運用の基本方針に沿ったものであること
- 3.投資信託及び投資法人に関する法律施行令ならびに同法律施行規則に定めるものであること

追加設定は一定口数以上の申込みでないと行なうことはできません。

対象株価指数に連動する投資成果という目的の支障とならないようにするために、追加設定をポートフォリオを組成するために必要な金額以上の場合に限定するものです。

受益権と株式を交換することができます。

一定口数以上の受益権を有する投資家は、それに相当する信託財産中の有価証券ポートフォリオと交換することができます。

基準価額と金融商品取引所での時価との間に乖離が生じたときに、合理的な裁定が入り、そうした乖離が収斂することにより、金融商品取引所での円滑な価格形成が行なわれることを期待するものです。

なお、投資家が、対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合には、原則として、委託者は、交換必要口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる株式（当該発行会社の株式を除きます。）を交換するよう指図するものとしします。

収益分配金の支払いは、名義登録によって受益者を確定する方法で行なわれます。

（以下 略）

< 訂正後 >

JPX日経インデックス400（「対象株価指数」といいます。）に連動する投資成果（基準価額の変動率が対象株価指数の変動率に一致することをいいます。）を目指します。

JPX日経インデックス400は、東京証券取引所（市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQ）に上場する全ての普通株式のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社日本取引所グループ、株式会社東京証券取引所および株式会社日本経済新聞社が選定した、原則400銘柄で構成される株価指数です。平成25年8月30日を起算日とし、その日の指数値を10,000ポイントとして計算されています。

ファンドの受益権は、金融商品取引所において時価により株式と同様に売買することができます。

信託金の限度額

ファンドの信託の限度額は、5兆円相当です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託の限度額を変更することができます。

ファンドは契約型の追加型株式投資信託ですが、以下の点で通常の投資信託とは異なる商品設計となっております。

受益権を上場します。

株式の組入比率を高位に維持するために、現金による解約は行なえないこととしていることからこれに代わる換金手段として、金融商品取引所により流通市場を提供するものです。

金融商品取引所での売買

いつでも下記の金融商品取引所で売買することができます。

東京証券取引所

売買単位は1口以上1口単位です。

手数料は申込みの取り扱いの第一種金融商品取引業者等が独自に定める金額とします。

取引方法は原則として株式と同様です。詳しくは取り扱いの第一種金融商品取引業者等へお問い合わせください。

ファンドの設定は株式によって行ないます。

ファンドの設定は原則として株式^()によって行ないます。

受益権の取得(追加設定)については、原則として、委託者が事前に提示する現物株式のポートフォリオ(以下「指定株式ポートフォリオ」といいます。)による設定に限定します。

投資家は指定株式ポートフォリオをもって受益権を取得します。なお、指定株式ポートフォリオの時価評価額が、取得する受益権の評価額に満たない場合は、その差額に相当する金銭にて設定するものとします。

また、投資家が指定株式ポートフォリオに含まれる株式の発行会社またはその子会社(会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社またはその子会社を以下「発行会社等」といいます。)である場合には、原則として、指定株式ポートフォリオの時価総額のうち当該発行会社の株式の時価総額に相当する金額および、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額(当該時価総額の0.15%の額)を当該株式に代えて金銭にて設定するものとします。

()ファンドの設定は、以下に示す要件をすべて満たす、委託者の指定する有価証券等(これを「信託適格有価証券等」といいます。)によって行なわれます。

- 1.原則として対象株価指数に採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式であること
- 2.原則として有価証券の株数の比率が、運用の基本方針に沿ったものであること
- 3.投資信託及び投資法人に関する法律施行令ならびに同法律施行規則に定めるものであること

追加設定は一定口数以上の申込みでないと行なうことはできません。

対象株価指数に連動する投資成果という目的の支障とならないようにするために、追加設定をポートフォリオを組成するために必要な金額以上の場合に限定するものです。

受益権と株式を交換することができます。

一定口数以上の受益権を有する投資家は、それに相当する信託財産中の有価証券ポートフォリオと交換することができます。

基準価額と金融商品取引所での時価との間に乖離が生じたときに、合理的な裁定が入り、そうした乖離が収斂することにより、金融商品取引所での円滑な価格形成が行なわれることを期待するものです。

なお、投資家が、対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合には、原則として、委託者は、交換必要口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる株式(当該発行会社の株式を除きます。)を交換するよう指図するものとします。

収益分配金の支払いは、名義登録によって受益者を確定する方法で行なわれます。

（以下 略）

（２）ファンドの沿革

<訂正前>

平成26年1月24日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
平成26年1月28日 受益権を東京証券取引所に上場（予定）

<訂正後>

平成26年1月24日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
平成26年1月28日 受益権を東京証券取引所に上場

（３）ファンドの仕組み

<更新後>

委託会社の概況(平成26年5月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

昭和34年(1959年)12月1日 野村証券投資信託委託株式会社として設立
平成9年(1997年)10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更
平成12年(2000年)11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更
平成15年(2003年)6月27日 委員会等設置会社へ移行

・大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋一丁目9番1号	5,150,693株	100%

4 手数料等及び税金

（３）信託報酬等

<更新後>

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、次の第1号により計算した額に、第2号により計算した額を加算して得た額とします。

1. 信託財産の純資産総額に年0.216% (税抜年0.20%) 以内で委託会社が定める率（「信託報酬率」といいます。）を乗じて得た額とし、平成26年6月26日現在の信託報酬率およびその配分については純資産総額の残高に応じて次の通りとします。

純資産総額	5,000億円以下の部分	5,000億円超 1兆5,000億円以下の部分	1兆5,000億円超の部分
信託報酬率	年0.216% (税抜年0.20%)	年0.1728% (税抜年0.16%)	年0.1296% (税抜年0.12%)
委託会社(税抜)	年0.15%	年0.12%	年0.09%
受託会社(税抜)	年0.05%	年0.04%	年0.03%

2. 株式の貸付を行なった場合は、その品貸料の43.2% (税抜40%) 以内の額とし、その配分については、委託会社は80%、受託会社は20%とします。

上記の信託報酬の総額は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払われます。

(4) その他の手数料等

<更新後>

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。なお、受益権の上場に係る費用および対象株価指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(以下、「商標使用料」といいます。)ならびに当該上場に係る費用および当該商標使用料に係る消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支払うことができます。なお、ファンドから支払わない金額については、委託会社の負担となり、委託会社が受領する信託報酬中から支払います。

<商標使用料>

平成26年6月26日現在、商標使用料は信託財産の純資産総額に、最大年0.0432% (税抜年0.04%) を乗じて得た額

純資産総額	商標使用料(税抜)
5,000億円以下の部分	年0.04%
5,000億円超1兆円以下の部分	年0.035%
1兆円超の部分	年0.03%

<上場に係る費用>

平成26年6月26日現在、受益権の上場に係る費用は以下の通りです。

- ・ 追加上場料：追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して、0.0081%（税抜0.0075%）。
- ・ 年間上場料：毎年末の純資産総額に対して、最大0.0081% (税抜0.0075%)。

ファンドに関する組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用は信託財産中から支払

われます。

ファンドに係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときに信託財産中から支払われます。

これらの費用等の中には、運用状況等により変動するものがあり、事前に料率、上限額等を表示することができないものがあります。

5 運用状況

以下は平成26年 4月30日現在の運用状況であります。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	21,794,239,400	98.05
現金・預金・その他資産(負債控除後)		433,182,778	1.94
合計(純資産総額)		22,227,422,178	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	427,535,000	1.92

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	54,800	7,556.00	414,068,800	7,590.00	415,932,000	1.87
2	日本	株式	ファナック	電気機器	20,900	18,145.00	379,230,500	18,400.00	384,560,000	1.73
3	日本	株式	日立製作所	電気機器	450,000	755.00	339,750,000	727.00	327,150,000	1.47
4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	56,900	5,408.00	307,715,200	5,661.00	322,110,900	1.44
5	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	69,900	4,821.00	336,987,900	4,588.00	320,701,200	1.44
6	日本	株式	KDDI	情報・通信業	57,500	5,588.00	321,310,000	5,442.00	312,915,000	1.40
7	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	56,600	5,758.00	325,902,800	5,516.00	312,205,600	1.40
8	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	77,400	3,910.00	302,634,000	4,031.00	311,999,400	1.40
9	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	90,600	3,571.00	323,532,600	3,380.00	306,228,000	1.37
10	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,524,900	204.99	312,598,500	200.00	304,980,000	1.37

11	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	89,100	3,274.00	291,713,400	3,356.00	299,019,600	1.34
12	日本	株式	キヤノン	電気機器	90,300	3,200.00	288,960,000	3,215.00	290,314,500	1.30
13	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	68,800	4,403.00	302,926,400	4,033.00	277,470,400	1.24
14	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	511,800	569.00	291,214,200	542.00	277,395,600	1.24
15	日本	株式	三菱地所	不動産業	119,000	2,509.00	298,571,000	2,314.00	275,366,000	1.23
16	日本	株式	三菱商事	卸売業	144,500	1,881.00	271,804,500	1,828.00	264,146,000	1.18
17	日本	株式	三井不動産	不動産業	87,000	3,239.00	281,793,000	3,021.00	262,827,000	1.18
18	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	226,200	1,194.00	270,082,800	1,137.00	257,189,400	1.15
19	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	34,500	7,646.00	263,787,000	7,453.00	257,128,500	1.15
20	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	152,500	1,584.00	241,560,000	1,622.00	247,355,000	1.11
21	日本	株式	三井物産	卸売業	170,500	1,467.99	250,293,100	1,449.00	247,054,500	1.11
22	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	263,300	939.00	247,238,700	877.00	230,914,100	1.03
23	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	61,600	3,745.00	230,692,000	3,660.00	225,456,000	1.01
24	日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	378,500	660.00	249,810,000	588.00	222,558,000	1.00
25	日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	830,000	281.00	233,230,000	268.00	222,440,000	1.00
26	日本	株式	三菱電機	電気機器	188,000	1,191.00	223,908,000	1,163.00	218,644,000	0.98
27	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	71,700	3,093.00	221,768,100	3,011.00	215,888,700	0.97
28	日本	株式	デンソー	輸送用機器	46,300	5,024.00	232,611,200	4,652.00	215,387,600	0.96
29	日本	株式	信越化学工業	化学	35,200	5,813.00	204,617,600	5,998.00	211,129,600	0.94
30	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	16,800	11,925.00	200,340,000	12,540.00	210,672,000	0.94

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	鉱業	0.68
		建設業	2.27
		食料品	4.30
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.11
		医薬品	5.37
		石油・石炭製品	0.83
		ゴム製品	1.25
		ガラス・土石製品	0.92
		鉄鋼	1.60
		非鉄金属	1.15
		金属製品	0.52
		機械	5.88
		電気機器	13.09
		輸送用機器	8.78
精密機器	1.15		
その他製品	0.47		

	電気・ガス業	1.00
	陸運業	5.03
	空運業	0.37
	倉庫・運輸関連業	0.12
	情報・通信業	7.79
	卸売業	5.13
	小売業	4.94
	銀行業	7.53
	証券、商品先物取引業	1.00
	保険業	2.04
	その他金融業	1.55
	不動産業	3.75
	サービス業	2.66
合 計		98.05

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2014年06月限)	買建	37	日本円	443,075,000	427,535,000	1.92

(3) 運用実績

純資産の推移

平成26年4月末日及び同日前1年以内における各月末（設定来）並びに下記決算期末の純資産及び金融商品取引所の取引価格の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）		東京証券取引所 取引価格（円）
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）	
第1計算期間	(2014年 4月 7日)	22,804	23,004	10,865.0000	10,960.0000	10,910
	2014年 1月末日	4,411		11,034.0000		11,090
	2月末日	19,740		10,973.0000		10,960
	3月末日	23,075		10,994.0000		10,970
	4月末日	22,227		10,590.0000		10,630

決算日が休日の場合は、前営業日の取引価格を記載しております。

分配の推移

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2014年 1月24日～2014年 4月 7日	95.0000円

収益率の推移

	計算期間	収益率
第1計算期間	2014年 1月24日～2014年 4月 7日	5.7%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（４）設定及び解約の実績

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2014年 1月24日～2014年 4月 7日	2,098,932		2,098,932

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

解約口数は交換口数を表示しております。

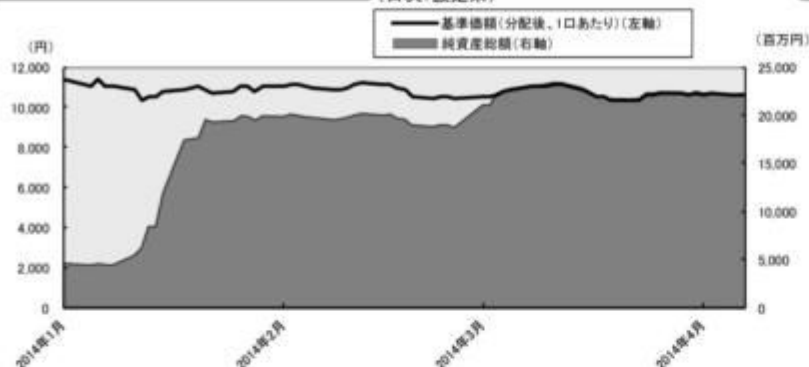
参考情報

< 更新後 >

運用実績 (2014年4月30日現在)

基準価額・純資産の推移

(日次・設定来)



分配の推移

(1口あたり、課税前)

2014年4月	95 円
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来累計	95 円

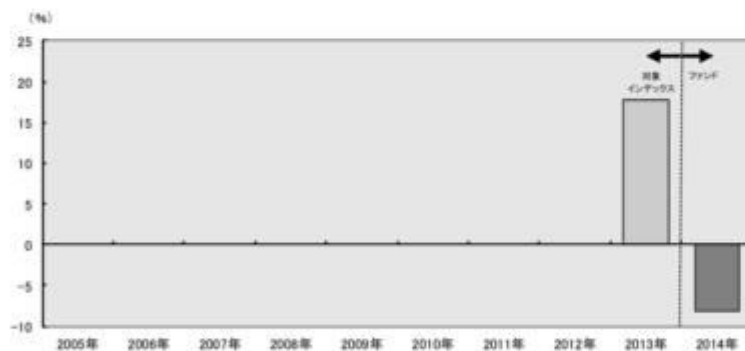
主要な資産の状況

銘柄別投資比率(上位)

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	ソフトバンク	情報・通信業	1.9
2	ファナック	電気機器	1.7
3	日立製作所	電気機器	1.5
4	日本電信電話	情報・通信業	1.4
5	武田薬品工業	医薬品	1.4
6	KDDI	情報・通信業	1.4
7	トヨタ自動車	輸送用機器	1.4
8	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1.4
9	本田技研工業	輸送用機器	1.4
10	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.4

年間収益率の推移

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・対象インデックスは、2013年8月30日を起算日として計算されているため、2005年から2012年の期間は対象インデックスが存在しないことから、記載を行なっておりません。
- ・2013年は8月30日から年末までの対象インデックスの収益率。
- ・2014年は設定日(2014年1月24日)から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●対象インデックスの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

3 資産管理等の概要

(4) 計算期間

<訂正前>

毎年4月8日から10月7日までおよび10月8日から翌年4月7日までとします。

ただし、第1計算期間は平成26年1月24日から平成26年4月7日までとします。

最終計算期間の終了日は、信託約款の規定によりこの信託が終了する場合における信託期間の終了日とします。

<訂正後>

毎年4月8日から10月7日までおよび10月8日から翌年4月7日までとします。

最終計算期間の終了日は、信託約款の規定によりこの信託が終了する場合における信託期間の終了日とします。

第3【ファンドの経理状況】

NEXT FUNDS J P X日経インデックス400連動型上場投信

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(平成26年1月24日から平成26年4月7日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

(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

	第1期 自 平成26年 1月24日 至 平成26年 4月 7日
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	
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。	
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。	
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なっております。

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なっております。

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なっております。

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なっております。

(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 （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 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 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 S C 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
T O T O	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
D O W A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
L I X I L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
S M C	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
TPR	2,100	1,617.00	3,395,700
ホシザキ電機	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
THK	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
IHI	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
A N A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
U S E N	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
K D D I	57,500	5,588.00	321,310,000
光通信	1,700	8,620.00	14,654,000
N T T ドコモ	152,500	1,584.00	241,560,000
G M Oインターネット	6,200	995.00	6,169,000
東宝	13,200	2,055.00	27,126,000
エヌ・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
S C S K	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
T O K A I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
M o n o t a R O	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
V T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
A O K I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
パロー	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。

2 ファンドの現況

純資産額計算書

平成26年 4月30日現在

資産総額	22,879,410,832円
負債総額	651,988,654円
純資産総額(-)	22,227,422,178円
発行済口数	2,098,932口
1口当たり純資産額(/)	10,590円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

< 更新後 >

(1) 資本金の額

平成26年5月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

当社は委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表執行役ならびに執行役、指名委員会、監査委員会および報酬委員会をおきますが、代表取締役および監査役会は設けません。各機関の権限は以下のとおりであります。

株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また執行役・代表執行役、各委員会の委員等を選任し、取締役および執行役の職務の執行を監督します。

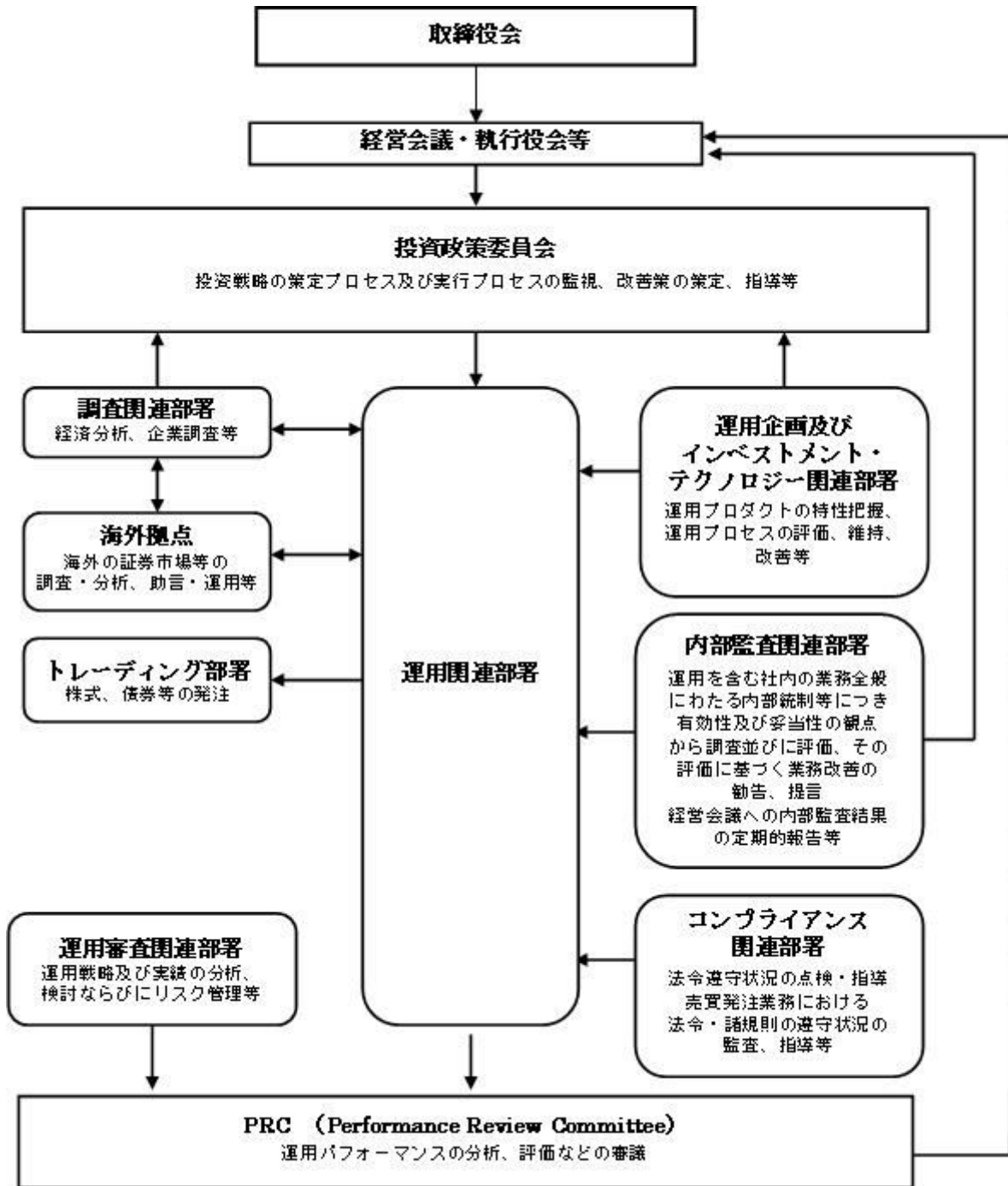
代表執行役・執行役

各執行役は、当社の業務の執行を行います。代表執行役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表執行役および執行役で構成される経営会議および執行役会が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役会で選定された執行役員が含まれます。

委員会

取締役3名以上（但し、各委員につき過半数は社外取締役であって執行役でない者）で構成され、イ）指名委員会は、株主総会に提出する取締役の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定し、ロ）報酬委員会は取締役・執行役が受ける個人別の報酬の決定に関する方針を定め、かつそれに従って各報酬の内容を決定し、ハ）監査委員会は取締役・執行役の職務執行の適法性ならびに妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定します。

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

< 更新後 >

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は平成26年4月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	806	13,534,000
単位型株式投資信託	45	236,082
追加型公社債投資信託	18	6,186,017
単位型公社債投資信託	32	381,973
合計	901	20,338,072

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

< 更新後 >

(1) 受託者

(a)名称	(b)資本の額 [*]	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

* 平成26年4月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	3,000百万円	
S M B C日興証券株式会社	10,000百万円	
シティグループ証券株式会社	96,307百万円	
ソシエテジェネラル証券会社 東京支店	31,703百万円	
大和証券株式会社	100,000百万円	
ドイツ証券株式会社	72,728百万円	
パークレイズ証券株式会社	32,945百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
メリルリンチ日本証券株式会社	119,440百万円	
モルガン・スタンレーMUFG証券株式会社	62,149百万円	

* 平成26年4月末現在

独立監査人の監査報告書

平成26年5月27日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	三 昇	浦
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯 尚	原

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているNEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信の平成26年1月24日から平成26年4月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信の平成26年4月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。