【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】	ＣＥＯ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】	ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　Ｒ／Ｎファンダメンタル・インデックス上場投信
【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3月19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3月24日から平成27年6月25日まで) 2兆円を上限とします。
【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3月3日付をもって提出した有価証券届出書（平成26年3月19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＞

「Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックス[※1]（配当除く）」(「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。

※1　Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックスは、日本国内の金融商品取引所に上場する全銘柄のうち、浮動株調整時価総額上位98%を母集団とし、各銘柄のファンダメンタル指標（調整済み売上高、調整済み営業キャッシュフロー、調整済み配当金）を用いて計算される指数ウェイト[※2]に基づいて算出されるRussell/Nomuraファンダメンタル・インデックスの構成銘柄から、流動性が著しく低い銘柄や指数ウェイトが極端に低い銘柄を除外して算出される、投資可能性を追求した指数です。平成12年12月29日を起算日とし、その日の指数値を100ポイントとして計算されています。

※2　リサーチ・アフィリエイツ社のファンダメンタル・インデックス[(R)]の手法を用います。

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、1兆円相当です。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。

①　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3月24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。

②　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

③　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。

④　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。

⑤　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。

＜訂正後＞

「Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックス[※1]（配当除く）」(「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。

※1　Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックスは、日本国内の金融商品取引所に上場する全銘柄のうち、浮動株調整時価総額上位98%を母集団とし、各銘柄のファンダメンタル指標（調整済み売上高、調整済み営業キャッシュフロー、調整済み配当金）を用いて計算される指数ウェイト[※2]に基づいて算出されるRussell/Nomuraファンダメンタル・インデックスの構成銘柄から、流動性が著しく低い銘柄や指数ウェイトが極端に低い銘柄を除外して算出される、投資可能性を追求した指数です。平成12年12月29日を起算日とし、その日の指数値を100ポイントとして計算されています。

※2　リサーチ・アフィリエイツ社のファンダメンタル・インデックス(R)の手法を用います。

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、1兆円相当です。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。

① 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。

② 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

③ 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。

④ 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。

⑤　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。

（２）ファンドの沿革

＜訂正前＞

平成26年3月19日　　信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
平成26年3月24日　　受益権を東京証券取引所に上場（予定）

＜訂正後＞

平成26年3月19日　　信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
平成26年3月24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　　野村證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0.324%(税抜年0.3%)以内で委託会社が定める率（平成26年6月26日現在、年0.324%(税抜年0.3%)）（「信託報酬率」といいます。）を乗じて得た額とし、その配分については次の通り（税抜）とします。

＜委託会社＞	＜受託会社＞
年0.25%	年0.05%

＊上記配分は、平成26年6月26日現在の信託報酬率における配分です。

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＞

① 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、年0.0972%(税抜年0.09%)を乗じて得た額

＜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%)。

② ファンドに関する組入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。

③ 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	1,940,631,050	97.63
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	47,033,598	2.36
合計（純資産総額）		1,987,664,648	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	46,220,000	2.32

（２）投資資産

①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	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	221,800	569.00	126,204,200	542.00	120,215,600	6.04
2	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	599,700	205.00	122,938,500	200.00	119,940,000	6.03
3	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	18,900	4,403.00	83,216,700	4,033.00	76,223,700	3.83
4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	9,900	5,408.00	53,539,200	5,661.00	56,043,900	2.81
5	日本	株式	りそなホールディングス	銀行業	94,200	500.00	47,100,000	522.00	49,172,400	2.47
6	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	7,800	5,758.00	44,912,400	5,516.00	43,024,800	2.16
7	日本	株式	キヤノン	電気機器	10,500	3,200.00	33,600,000	3,215.00	33,757,500	1.69
8	日本	株式	三菱商事	卸売業	17,600	1,881.00	33,105,600	1,828.00	32,172,800	1.61
9	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	9,000	3,571.00	32,139,000	3,380.00	30,420,000	1.53
10	日本	株式	パナソニック	電気機器	26,600	1,162.00	30,909,200	1,119.00	29,765,400	1.49
11	日本	株式	三井物産	卸売業	19,000	1,468.00	27,892,000	1,449.00	27,531,000	1.38
12	日本	株式	日立製作所	電気機器	36,000	755.00	27,180,000	727.00	26,172,000	1.31
13	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	5,300	4,821.00	25,551,300	4,588.00	24,316,400	1.22
14	日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	5,700	3,910.00	22,287,000	4,031.00	22,976,700	1.15

15	日本	株式	ＪＸホールディングス	石油・石炭製品	37,300	502.00	18,724,600	530.00	19,769,000	0.99
16	日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	3,500	5,588.00	19,558,000	5,442.00	19,047,000	0.95
17	日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	11,600	1,584.00	18,374,400	1,622.00	18,815,200	0.94
18	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	15,300	1,166.00	17,839,800	1,144.00	17,503,200	0.88
19	日本	株式	ソニー	電気機器	9,100	1,988.00	18,090,800	1,792.00	16,307,200	0.82
20	日本	株式	住友商事	卸売業	12,000	1,325.00	15,900,000	1,327.00	15,924,000	0.80
21	日本	株式	富士通	電気機器	26,000	610.00	15,860,000	600.00	15,600,000	0.78
22	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	13,200	1,194.00	15,760,800	1,137.00	15,008,400	0.75
23	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	16,000	939.00	15,024,000	877.00	14,032,000	0.70
24	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	4,000	3,274.00	13,096,000	3,356.00	13,424,000	0.67
25	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,700	7,556.00	12,845,200	7,590.00	12,903,000	0.64
26	日本	株式	第一生命保険	保険業	9,100	1,485.00	13,513,500	1,414.00	12,867,400	0.64
27	日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	4,500	2,816.00	12,672,000	2,640.00	11,880,000	0.59
28	日本	株式	大和証券グループ本社	証券、商品先物取引業	15,000	894.00	13,410,000	765.00	11,475,000	0.57
29	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	1,500	7,646.00	11,469,000	7,453.00	11,179,500	0.56
30	日本	株式	丸紅	卸売業	16,000	689.00	11,024,000	682.00	10,912,000	0.54

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	水産・農林業	0.07
		鉱業	0.44
		建設業	2.05
		食料品	3.19
		繊維製品	0.61
		パルプ・紙	0.33
		化学	5.05
		医薬品	3.70
		石油・石炭製品	1.51
		ゴム製品	0.63
		ガラス・土石製品	0.94
		鉄鋼	1.20
		非鉄金属	1.11
		金属製品	0.45
		機械	2.62
		電気機器	11.81
		輸送用機器	7.27
		精密機器	0.75
		その他製品	1.39
		電気・ガス業	2.99
		陸運業	2.82

		海運業	0.43
		空運業	0.34
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	6.55
		卸売業	7.22
		小売業	3.91
		銀行業	22.86
		証券、商品先物取引業	0.79
		保険業	1.90
		その他金融業	0.56
		不動産業	0.66
		サービス業	1.16
合　　計			97.63

②投資不動産物件

該当事項はありません。

③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	4	日本円	47,900,000	46,220,000	2.32

（３）運用実績

①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)	2,038	2,059	13,602.0000	13,745.0000	13,690
2014年 3月末日	2,070	―	13,821.0000	―	13,820
4月末日	1,987	―	13,266.0000	―	―

※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。

②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 3月19日～2014年 4月 7日	143.0000円

③収益率の推移

	計算期間	収益率
第1計算期間	2014年 3月19日～2014年 4月 7日	3.1%

※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 3月19日～2014年 4月 7日	149,837	―	149,837

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

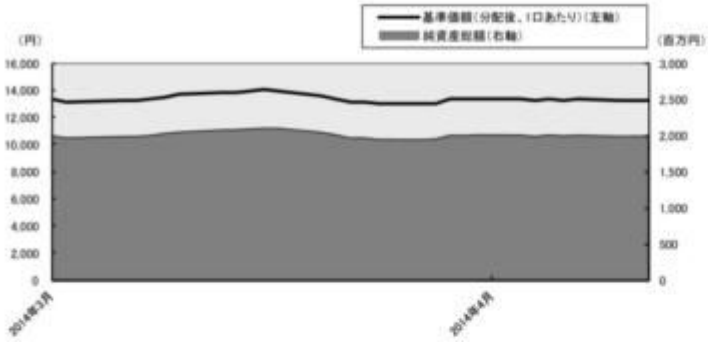
※解約口数は交換口数を表示しております。

≪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）

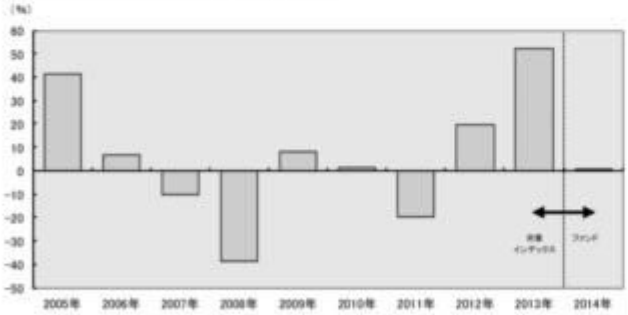
2014年4月	143 円
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来累計	143 円

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	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6.0
2	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	6.0
3	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3.8
4	日本電信電話	情報・通信業	2.8
5	りそなホールディングス	銀行業	2.5
6	トヨタ自動車	輸送用機器	2.2
7	キヤノン	電気機器	1.7
8	三菱商事	卸売業	1.6
9	本田技研工業	輸送用機器	1.5
10	パナソニック	電気機器	1.5

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。
・2005年から2013年は対象インデックスの年間収益率。
・2014年は設定日（2014年3月19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3月19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 R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信

(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3月19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	26,229,272
株式	1,988,806,100
派生商品評価勘定	1,707,648
未収入金	21,315,000
未収配当金	22,438,383
未収利息	52
流動資産合計	2,060,496,455
資産合計	2,060,496,455
負債の部	
流動負債	
前受金	590,000
未払収益分配金	21,426,691
未払受託者報酬	56,051
未払委託者報酬	280,246
その他未払費用	111,521
流動負債合計	22,464,509
負債合計	22,464,509
純資産の部	
元本等	
元本	1,997,177,373
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	40,854,573
（分配準備積立金）	39,574
元本等合計	2,038,031,946
純資産合計	2,038,031,946
負債純資産合計	2,060,496,455

（２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第1期 自　平成26年 3月19日 至　平成26年 4月 7日
営業収益	
受取配当金	22,438,383
受取利息	700
有価証券売買等損益	39,101,662

	第1期 自　平成26年 3月19日 至　平成26年 4月 7日
派生商品取引等損益	1,707,648
営業収益合計	63,248,393
営業費用	
受託者報酬	56,051
委託者報酬	280,246
その他費用	636,521
営業費用合計	972,818
営業利益又は営業損失（△）	62,275,575
経常利益又は経常損失（△）	62,275,575
当期純利益又は当期純損失（△）	62,275,575
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	5,689
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,689
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	21,426,691
期末剰余金又は期末欠損金（△）	40,854,573

（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 3月19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	149,837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	13,602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 3月19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	22,439,083円
分配準備積立金	B	0円
配当等収益合計額	C=A+B	22,439,083円
経費	D	972,818円
収益分配可能額	E=C-D	21,466,265円
収益分配金	F	21,426,691円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	39,574円
口数	H	149,837口
1口当たり分配金	I=F/H	143円

2.その他費用

その他費用のうち100,885円は対象指数についての商標使用料、533,401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 3月19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
1．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成26年 3月19日 至 平成26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。

（その他の注記）
1 元本の移動

第1期 自 平成26年 3月19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	1,997,177,373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 3月19日 至 平成26年 4月 7日
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	38,721,123
合計	38,721,123

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	46,190,000	－	47,900,000	1,707,648
合計	46,190,000	－	47,900,000	1,707,648

（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	日本水産	3,000	214.00	642,000	
		マルハニチロ	500	1,687.00	843,500	
		国際石油開発帝石	5,500	1,386.00	7,623,000	
		石油資源開発	200	3,565.00	713,000	
		ミライト・ホールディングス	600	903.00	541,800	
		コムシスホールディングス	900	1,702.00	1,531,800	

ミサワホーム	300	1,322.00	396,600	
大成建設	5,000	473.00	2,365,000	
大林組	3,000	627.00	1,881,000	
清水建設	4,000	538.00	2,152,000	
長谷工コーポレーション	1,800	669.00	1,204,200	
鹿島建設	5,000	377.00	1,885,000	
西松建設	2,000	335.00	670,000	
前田建設工業	1,000	714.00	714,000	
奥村組	1,000	453.00	453,000	
戸田建設	2,000	322.00	644,000	
大東建託	800	9,978.00	7,982,400	
五洋建設	2,200	350.00	770,000	
住友林業	1,300	1,034.00	1,344,200	
パナホーム	1,000	700.00	700,000	
大和ハウス工業	2,000	1,770.00	3,540,000	
積水ハウス	3,500	1,296.00	4,536,000	
関電工	1,000	515.00	515,000	
きんでん	1,000	998.00	998,000	
協和エクシオ	700	1,380.00	966,000	
日揮	1,000	3,659.00	3,659,000	
千代田化工建設	1,000	1,400.00	1,400,000	
日本製粉	1,000	564.00	564,000	
日清製粉グループ本社	1,500	1,117.00	1,675,500	
山崎製パン	1,000	1,228.00	1,228,000	
カルビー	200	2,472.00	494,400	
森永乳業	3,000	327.00	981,000	
ヤクルト本社	200	5,060.00	1,012,000	
明治ホールディングス	500	6,080.00	3,040,000	
雪印メグミルク	500	1,332.00	666,000	
日本ハム	2,000	1,587.00	3,174,000	
伊藤ハム	2,000	459.00	918,000	
丸大食品	2,000	303.00	606,000	
サッポロホールディングス	2,000	423.00	846,000	
アサヒグループホールディングス	1,500	2,902.00	4,353,000	
キリンホールディングス	5,400	1,382.00	7,462,800	
宝ホールディングス	1,000	776.00	776,000	
コカ・コーラウエスト	700	1,777.00	1,243,900	
サントリー食品インターナショナル	200	3,585.00	717,000	
伊藤園	400	2,289.00	915,600	
日清オイリオグループ	2,000	336.00	672,000	
不二製油	400	1,324.00	529,600	
キッコーマン	1,000	1,941.00	1,941,000	
味の素	4,000	1,483.00	5,932,000	

キユーピー	900	1,463.00	1,316,700	
ハウス食品グループ本社	500	1,677.00	838,500	
カゴメ	400	1,709.00	683,600	
ニチレイ	2,000	436.00	872,000	
東洋水産	1,000	3,310.00	3,310,000	
日清食品ホールディングス	400	4,630.00	1,852,000	
日本たばこ産業	4,000	3,274.00	13,096,000	
グンゼ	2,000	276.00	552,000	
東洋紡	5,000	163.00	815,000	
日清紡ホールディングス	1,000	856.00	856,000	
帝人	12,000	250.00	3,000,000	
東レ	8,000	688.00	5,504,000	
ワコールホールディングス	1,000	1,028.00	1,028,000	
オンワードホールディングス	1,000	675.00	675,000	
王子ホールディングス	6,000	454.00	2,724,000	
日本製紙	700	2,040.00	1,428,000	
北越紀州製紙	1,500	497.00	745,500	
大王製紙	1,000	1,178.00	1,178,000	
レンゴー	2,000	532.00	1,064,000	
クラレ	2,200	1,179.00	2,593,800	
旭化成	8,000	691.00	5,528,000	
昭和電工	16,000	145.00	2,320,000	
住友化学	14,000	386.00	5,404,000	
日産化学工業	800	1,582.00	1,265,600	
クレハ	1,000	497.00	497,000	
日本曹達	1,000	566.00	566,000	
東ソー	4,000	394.00	1,576,000	
トクヤマ	3,000	326.00	978,000	
セントラル硝子	2,000	326.00	652,000	
東亜合成	2,000	434.00	868,000	
電気化学工業	4,000	364.00	1,456,000	
信越化学工業	1,700	5,813.00	9,882,100	
エア・ウォーター	1,000	1,443.00	1,443,000	
大陽日酸	2,000	809.00	1,618,000	
日本触媒	1,000	1,211.00	1,211,000	
カネカ	2,000	611.00	1,222,000	
三菱瓦斯化学	2,000	644.00	1,288,000	
三井化学	11,000	252.00	2,772,000	
ＪＳＲ	1,200	1,879.00	2,254,800	
東京応化工業	200	2,250.00	450,000	
三菱ケミカルホールディングス	15,300	428.00	6,548,400	
ダイセル	2,000	847.00	1,694,000	
住友ベークライト	2,000	394.00	788,000	

積水化学工業	3,000	1,085.00	3,255,000	
日本ゼオン	1,000	955.00	955,000	
アイカ工業	200	2,239.00	447,800	
宇部興産	10,000	186.00	1,860,000	
日立化成	900	1,452.00	1,306,800	
日本化薬	1,000	1,158.00	1,158,000	
ＡＤＥＫＡ	500	1,144.00	572,000	
日油	1,000	728.00	728,000	
花王	2,800	3,609.00	10,105,200	
関西ペイント	1,000	1,460.00	1,460,000	
ＤＩＣ	4,000	267.00	1,068,000	
東洋インキＳＣホールディングス	1,000	436.00	436,000	
富士フイルムホールディングス	4,500	2,816.00	12,672,000	
資生堂	2,100	1,793.00	3,765,300	
ライオン	1,000	604.00	604,000	
コーセー	200	3,325.00	665,000	
小林製薬	100	5,960.00	596,000	
日東電工	700	4,950.00	3,465,000	
エフピコ	100	3,120.00	312,000	
ニフコ	200	2,986.00	597,200	
ユニ・チャーム	200	5,607.00	1,121,400	
協和発酵キリン	1,000	1,087.00	1,087,000	
武田薬品工業	5,300	4,821.00	25,551,300	
アステラス製薬	13,200	1,194.00	15,760,800	
大日本住友製薬	500	1,706.00	853,000	
塩野義製薬	1,000	1,855.00	1,855,000	
田辺三菱製薬	600	1,469.00	881,400	
中外製薬	700	2,651.00	1,855,700	
エーザイ	1,400	3,925.00	5,495,000	
ロート製薬	300	1,762.00	528,600	
小野薬品工業	400	8,620.00	3,448,000	
久光製薬	200	4,605.00	921,000	
持田製薬	100	7,280.00	728,000	
参天製薬	300	4,780.00	1,434,000	
ツムラ	200	2,470.00	494,000	
沢井製薬	100	6,190.00	619,000	
第一三共	4,400	1,813.00	7,977,200	
キョーリン製薬ホールディングス	200	1,931.00	386,200	
大塚ホールディングス	2,000	2,957.00	5,914,000	
大正製薬ホールディングス	100	7,700.00	770,000	
昭和シェル石油	2,000	923.00	1,846,000	
コスモ石油	12,000	190.00	2,280,000	
東燃ゼネラル石油	3,000	909.00	2,727,000	

出光興産	1,400	2,123.00	2,972,200	
ＪＸホールディングス	37,300	502.00	18,724,600	
横浜ゴム	1,000	948.00	948,000	
東洋ゴム工業	1,000	765.00	765,000	
ブリヂストン	2,600	3,745.00	9,737,000	
住友ゴム工業	1,000	1,377.00	1,377,000	
旭硝子	10,000	590.00	5,900,000	
日本板硝子	14,000	145.00	2,030,000	
日本電気硝子	5,000	525.00	2,625,000	
住友大阪セメント	2,000	419.00	838,000	
太平洋セメント	4,000	380.00	1,520,000	
東海カーボン	2,000	337.00	674,000	
ＴＯＴＯ	1,000	1,497.00	1,497,000	
日本碍子	1,000	2,117.00	2,117,000	
日本特殊陶業	1,000	2,381.00	2,381,000	
新日鐵住金	28,000	281.00	7,868,000	
神戸製鋼所	19,000	137.00	2,603,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	4,400	1,954.00	8,597,600	
日新製鋼	400	956.00	382,400	
東京製鐵	900	569.00	512,100	
大和工業	200	3,225.00	645,000	
淀川製鋼所	1,000	426.00	426,000	
丸一鋼管	200	2,583.00	516,600	
大同特殊鋼	2,000	499.00	998,000	
愛知製鋼	1,000	408.00	408,000	
日立金属	1,000	1,428.00	1,428,000	
大平洋金属	1,000	391.00	391,000	
日本軽金属ホールディングス	4,000	139.00	556,000	
三井金属鉱業	5,000	241.00	1,205,000	
三菱マテリアル	8,000	301.00	2,408,000	
住友金属鉱山	4,000	1,313.00	5,252,000	
ＤＯＷＡホールディングス	1,000	858.00	858,000	
古河電気工業	8,000	249.00	1,992,000	
住友電気工業	5,200	1,522.00	7,914,400	
フジクラ	4,000	477.00	1,908,000	
ＳＵＭＣＯ	1,000	790.00	790,000	
東洋製罐グループホールディングス	1,000	1,619.00	1,619,000	
三和ホールディングス	1,000	653.00	653,000	
ＬＩＸＩＬグループ	1,600	2,774.00	4,438,400	
リンナイ	100	8,660.00	866,000	
日本発條	1,100	971.00	1,068,100	
日本製鋼所	2,000	466.00	932,000	

アマダ	1,000	726.00	726,000	
ＤＭＧ森精機	400	1,325.00	530,000	
ディスコ	100	6,630.00	663,000	
ナブテスコ	300	2,347.00	704,100	
ＳＭＣ	100	26,695.00	2,669,500	
小松製作所	4,000	2,207.00	8,828,000	
住友重機械工業	4,000	438.00	1,752,000	
日立建機	500	1,992.00	996,000	
クボタ	3,000	1,387.00	4,161,000	
荏原製作所	2,000	646.00	1,292,000	
ダイキン工業	700	6,018.00	4,212,600	
栗田工業	800	2,184.00	1,747,200	
ダイフク	400	1,244.00	497,600	
平和	400	1,720.00	688,000	
ＳＡＮＫＹＯ	300	4,265.00	1,279,500	
アマノ	400	1,031.00	412,400	
グローリー	300	2,789.00	836,700	
セガサミーホールディングス	900	2,272.00	2,044,800	
ホシザキ電機	100	3,980.00	398,000	
日本精工	2,000	1,105.00	2,210,000	
ＮＴＮ	3,000	380.00	1,140,000	
ジェイテクト	1,100	1,617.00	1,778,700	
ＴＨＫ	400	2,249.00	899,600	
マキタ	400	5,530.00	2,212,000	
日立造船	700	497.00	347,900	
三菱重工業	14,000	598.00	8,372,000	
ＩＨＩ	5,000	424.00	2,120,000	
イビデン	1,300	2,037.00	2,648,100	
コニカミノルタ	4,500	955.00	4,297,500	
ブラザー工業	2,000	1,448.00	2,896,000	
ミネベア	2,000	933.00	1,866,000	
日立製作所	36,000	755.00	27,180,000	
東芝	24,000	435.00	10,440,000	
三菱電機	9,000	1,191.00	10,719,000	
富士電機	3,000	452.00	1,356,000	
安川電機	500	1,404.00	702,000	
東芝テック	1,000	598.00	598,000	
マブチモーター	100	6,810.00	681,000	
日本電産	800	6,130.00	4,904,000	
ＪＶＣケンウッド	3,400	241.00	819,400	
オムロン	700	4,105.00	2,873,500	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	1,000	571.00	571,000	

日本電気	27,000	315.00	8,505,000	
富士通	26,000	610.00	15,860,000	
沖電気工業	3,000	218.00	654,000	
セイコーエプソン	1,000	3,200.00	3,200,000	
パナソニック	26,600	1,162.00	30,909,200	
シャープ	11,000	326.00	3,586,000	
ソニー	9,100	1,988.00	18,090,800	
ＴＤＫ	1,100	4,435.00	4,878,500	
ミツミ電機	1,600	702.00	1,123,200	
アルプス電気	1,500	1,195.00	1,792,500	
ホシデン	2,000	496.00	992,000	
ヒロセ電機	100	14,610.00	1,461,000	
アルパイン	400	1,302.00	520,800	
船井電機	500	1,028.00	514,000	
横河電機	600	1,557.00	934,200	
アズビル	400	2,487.00	994,800	
日本光電工業	100	4,235.00	423,500	
堀場製作所	100	3,650.00	365,000	
アドバンテスト	600	1,149.00	689,400	
シスメックス	200	3,240.00	648,000	
スタンレー電気	800	2,311.00	1,848,800	
ウシオ電機	600	1,383.00	829,800	
カシオ計算機	1,300	1,228.00	1,596,400	
ファナック	400	18,145.00	7,258,000	
ローム	800	4,750.00	3,800,000	
浜松ホトニクス	200	4,730.00	946,000	
新光電気工業	500	738.00	369,000	
京セラ	1,400	4,643.00	6,500,200	
太陽誘電	600	1,252.00	751,200	
村田製作所	700	9,627.00	6,738,900	
小糸製作所	500	1,911.00	955,500	
キヤノン	10,500	3,200.00	33,600,000	
リコー	5,300	1,159.00	6,142,700	
東京エレクトロン	700	6,454.00	4,517,800	
トヨタ紡織	700	1,042.00	729,400	
ユニプレス	400	1,868.00	747,200	
豊田自動織機	700	4,855.00	3,398,500	
デンソー	1,900	5,024.00	9,545,600	
東海理化電機製作所	400	1,802.00	720,800	
三井造船	6,000	231.00	1,386,000	
川崎重工業	5,000	394.00	1,970,000	
日産自動車	16,000	939.00	15,024,000	
いすゞ自動車	5,000	598.00	2,990,000	

トヨタ自動車	7,800	5,758.00	44,912,400	
日野自動車	800	1,519.00	1,215,200	
三菱自動車工業	2,000	1,110.00	2,220,000	
武蔵精密工業	200	2,189.00	437,800	
日産車体	500	1,694.00	847,000	
日信工業	300	2,039.00	611,700	
タチエス	300	1,642.00	492,600	
ＮＯＫ	600	1,717.00	1,030,200	
フタバ産業	1,300	471.00	612,300	
カヤバ工業	1,000	434.00	434,000	
プレス工業	1,000	377.00	377,000	
カルソニックカンセイ	2,000	503.00	1,006,000	
ケーヒン	400	1,478.00	591,200	
アイシン精機	1,200	3,685.00	4,422,000	
マツダ	7,000	473.00	3,311,000	
ダイハツ工業	1,400	1,767.00	2,473,800	
本田技研工業	9,000	3,571.00	32,139,000	
スズキ	2,400	2,767.00	6,640,800	
富士重工業	1,200	2,856.00	3,427,200	
ヤマハ発動機	1,800	1,634.00	2,941,200	
ショーワ	400	1,073.00	429,200	
豊田合成	500	1,977.00	988,500	
エフ・シー・シー	200	1,780.00	356,000	
シマノ	200	10,110.00	2,022,000	
タカタ	200	2,633.00	526,600	
テイ・エス　テック	200	3,045.00	609,000	
テルモ	700	2,207.00	1,544,900	
島津製作所	1,000	893.00	893,000	
ニコン	1,900	1,665.00	3,163,500	
オリンパス	300	3,175.00	952,500	
ＨＯＹＡ	2,300	3,121.00	7,178,300	
シチズンホールディングス	1,800	793.00	1,427,400	
ニプロ	500	898.00	449,000	
バンダイナムコホールディングス	1,300	2,338.00	3,039,400	
トッパン・フォームズ	500	937.00	468,500	
タカラトミー	900	465.00	418,500	
凸版印刷	6,000	721.00	4,326,000	
大日本印刷	6,000	970.00	5,820,000	
アシックス	500	1,938.00	969,000	
ヤマハ	1,000	1,383.00	1,383,000	
リンテック	300	1,926.00	577,800	
任天堂	1,000	11,835.00	11,835,000	
コクヨ	800	741.00	592,800	

東京電力	25,600	400.00	10,240,000	
中部電力	7,800	1,178.00	9,188,400	
関西電力	7,400	994.00	7,355,600	
中国電力	2,600	1,345.00	3,497,000	
北陸電力	1,900	1,268.00	2,409,200	
東北電力	3,800	1,006.00	3,822,800	
四国電力	1,800	1,297.00	2,334,600	
九州電力	3,200	1,163.00	3,721,600	
北海道電力	1,500	718.00	1,077,000	
沖縄電力	200	3,445.00	689,000	
電源開発	1,000	2,879.00	2,879,000	
東京瓦斯	15,000	511.00	7,665,000	
大阪瓦斯	14,000	390.00	5,460,000	
東邦瓦斯	3,000	538.00	1,614,000	
東武鉄道	7,000	499.00	3,493,000	
相鉄ホールディングス	2,000	372.00	744,000	
東京急行電鉄	4,000	632.00	2,528,000	
京浜急行電鉄	1,000	846.00	846,000	
小田急電鉄	2,000	885.00	1,770,000	
京王電鉄	2,000	713.00	1,426,000	
京成電鉄	1,000	877.00	877,000	
東日本旅客鉄道	1,500	7,646.00	11,469,000	
西日本旅客鉄道	1,300	4,135.00	5,375,500	
東海旅客鉄道	600	11,925.00	7,155,000	
西日本鉄道	2,000	392.00	784,000	
近畿日本鉄道	6,000	362.00	2,172,000	
阪急阪神ホールディングス	5,000	558.00	2,790,000	
南海電気鉄道	2,000	398.00	796,000	
京阪電気鉄道	2,000	417.00	834,000	
名古屋鉄道	5,000	302.00	1,510,000	
日本通運	8,000	509.00	4,072,000	
ヤマトホールディングス	2,000	2,184.00	4,368,000	
山九	3,000	393.00	1,179,000	
日本梱包運輸倉庫	300	1,758.00	527,400	
セイノーホールディングス	1,000	969.00	969,000	
日立物流	400	1,645.00	658,000	
日本郵船	15,000	309.00	4,635,000	
商船三井	8,000	406.00	3,248,000	
川崎汽船	9,000	225.00	2,025,000	
日本航空	500	5,120.00	2,560,000	
ＡＮＡホールディングス	19,000	227.00	4,313,000	
住友倉庫	1,000	495.00	495,000	
上組	2,000	987.00	1,974,000	

近鉄エクスプレス	100	4,460.00	446,000	
ＩＴホールディングス	1,000	1,674.00	1,674,000	
野村総合研究所	400	3,215.00	1,286,000	
フジ・メディア・ホールディングス	1,000	1,770.00	1,770,000	
オービック	200	3,135.00	627,000	
ヤフー	2,800	485.00	1,358,000	
トレンドマイクロ	400	3,155.00	1,262,000	
日本オラクル	200	4,565.00	913,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	200	4,290.00	858,000	
大塚商会	100	12,850.00	1,285,000	
ネットワンシステムズ	1,200	729.00	874,800	
日本ユニシス	500	1,066.00	533,000	
東京放送ホールディングス	800	1,125.00	900,000	
日本テレビホールディングス	700	1,599.00	1,119,300	
テレビ朝日ホールディングス	300	1,836.00	550,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	1,100	536.00	589,600	
日本電信電話	9,900	5,408.00	53,539,200	
ＫＤＤＩ	3,500	5,588.00	19,558,000	
光通信	100	8,620.00	862,000	
ＮＴＴドコモ	11,600	1,584.00	18,374,400	
東宝	400	2,055.00	822,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,000	3,860.00	3,860,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	300	1,952.00	585,600	
カプコン	200	1,728.00	345,600	
ＳＣＳＫ	200	2,737.00	547,400	
コナミ	500	2,351.00	1,175,500	
ソフトバンク	1,700	7,556.00	12,845,200	
双日	26,200	173.00	4,532,600	
アルフレッサ　ホールディングス	500	6,280.00	3,140,000	
ダイワボウホールディングス	3,000	178.00	534,000	
第一興商	300	3,095.00	928,500	
メディパルホールディングス	2,200	1,470.00	3,234,000	
黒田電気	400	1,686.00	674,400	
伊藤忠商事	15,300	1,166.00	17,839,800	
丸紅	16,000	689.00	11,024,000	
長瀬産業	1,200	1,251.00	1,501,200	
豊田通商	1,900	2,579.00	4,900,100	
兼松	5,000	160.00	800,000	
三井物産	19,000	1,468.00	27,892,000	
日立ハイテクノロジーズ	600	2,425.00	1,455,000	
カメイ	800	771.00	616,800	
住友商事	12,000	1,325.00	15,900,000	

三菱商事	17,600	1,881.00	33,105,600	
キヤノンマーケティングジャパン	800	1,409.00	1,127,200	
三谷商事	200	2,254.00	450,800	
阪和興業	3,000	401.00	1,203,000	
岩谷産業	2,000	650.00	1,300,000	
三愛石油	2,000	643.00	1,286,000	
稲畑産業	600	1,026.00	615,600	
東邦ホールディングス	500	2,110.00	1,055,000	
サンゲツ	200	2,653.00	530,600	
伊藤忠エネクス	1,300	567.00	737,100	
リョーサン	500	2,153.00	1,076,500	
三信電気	1,000	681.00	681,000	
Ｐａｌｔａｃ	600	1,251.00	750,600	
日鉄住金物産	2,000	351.00	702,000	
オートバックスセブン	800	1,562.00	1,249,600	
加藤産業	300	2,080.00	624,000	
因幡電機産業	200	3,200.00	640,000	
ミスミグループ本社	200	2,718.00	543,600	
スズケン	800	3,835.00	3,068,000	
ローソン	300	7,100.00	2,130,000	
カワチ薬品	200	1,947.00	389,400	
ゲオホールディングス	600	912.00	547,200	
アダストリアホールディングス	100	2,380.00	238,000	
日本マクドナルドホールディングス	400	2,772.00	1,108,800	
エディオン	2,700	565.00	1,525,500	
ＤＣＭホールディングス	1,200	674.00	808,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	3,000	702.00	2,106,000	
マツモトキヨシホールディングス	300	3,275.00	982,500	
三越伊勢丹ホールディングス	1,800	1,318.00	2,372,400	
セブン＆アイ・ホールディングス	5,700	3,910.00	22,287,000	
ツルハホールディングス	100	10,150.00	1,015,000	
良品計画	100	10,080.00	1,008,000	
コーナン商事	500	1,052.00	526,000	
ドンキホーテホールディングス	200	5,460.00	1,092,000	
ゼンショーホールディングス	400	1,019.00	407,600	
スギホールディングス	200	4,605.00	921,000	
ファミリーマート	300	4,455.00	1,336,500	
上新電機	1,000	820.00	820,000	
島忠	400	2,195.00	878,000	
コメリ	200	2,734.00	546,800	
青山商事	400	2,681.00	1,072,400	
しまむら	100	8,750.00	875,000	
高島屋	2,000	949.00	1,898,000	

エイチ・ツー・オー　リテイリング	1,000	775.00	775,000	
丸井グループ	1,400	874.00	1,223,600	
ダイエー	4,050	340.00	1,377,000	
イズミヤ	1,000	490.00	490,000	
イオン	5,600	1,161.00	6,501,600	
ユニーグループ・ホールディングス	3,800	595.00	2,261,000	
イズミ	300	3,045.00	913,500	
平和堂	300	1,449.00	434,700	
ケーズホールディングス	600	2,747.00	1,648,200	
ヤマダ電機	20,200	356.00	7,191,200	
ニトリホールディングス	300	4,555.00	1,366,500	
吉野家ホールディングス	500	1,332.00	666,000	
アークス	300	2,014.00	604,200	
バロー	400	1,298.00	519,200	
ファーストリテイリング	100	37,975.00	3,797,500	
サンドラッグ	100	4,465.00	446,500	
じもとホールディングス	5,100	210.00	1,071,000	
新生銀行	12,000	203.00	2,436,000	
あおぞら銀行	6,000	299.00	1,794,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	221,800	569.00	126,204,200	
りそなホールディングス	94,200	500.00	47,100,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	17,000	457.00	7,769,000	
三井住友フィナンシャルグループ	18,900	4,403.00	83,216,700	
第四銀行	6,000	373.00	2,238,000	
北越銀行	4,000	216.00	864,000	
西日本シティ銀行	7,000	241.00	1,687,000	
千葉銀行	3,000	641.00	1,923,000	
横浜銀行	9,000	515.00	4,635,000	
常陽銀行	4,000	504.00	2,016,000	
群馬銀行	1,000	554.00	554,000	
武蔵野銀行	300	3,400.00	1,020,000	
筑波銀行	1,500	384.00	576,000	
七十七銀行	9,000	471.00	4,239,000	
青森銀行	4,000	288.00	1,152,000	
秋田銀行	3,000	285.00	855,000	
山形銀行	1,000	433.00	433,000	
岩手銀行	400	5,010.00	2,004,000	
東邦銀行	7,000	340.00	2,380,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	7,000	427.00	2,989,000	
静岡銀行	2,000	1,010.00	2,020,000	
十六銀行	4,000	365.00	1,460,000	
八十二銀行	4,000	578.00	2,312,000	

山梨中央銀行	4,000	462.00	1,848,000	
大垣共立銀行	3,000	279.00	837,000	
福井銀行	2,000	258.00	516,000	
北國銀行	2,000	353.00	706,000	
滋賀銀行	1,000	560.00	560,000	
南都銀行	3,000	388.00	1,164,000	
百五銀行	5,000	407.00	2,035,000	
京都銀行	2,000	842.00	1,684,000	
紀陽銀行	700	1,289.00	902,300	
ほくほくフィナンシャルグループ	27,000	196.00	5,292,000	
広島銀行	6,000	429.00	2,574,000	
山陰合同銀行	2,000	689.00	1,378,000	
中国銀行	2,000	1,364.00	2,728,000	
伊予銀行	1,500	964.00	1,446,000	
百十四銀行	3,000	357.00	1,071,000	
四国銀行	4,000	210.00	840,000	
阿波銀行	2,000	543.00	1,086,000	
鹿児島銀行	1,000	661.00	661,000	
大分銀行	3,000	395.00	1,185,000	
肥後銀行	2,000	545.00	1,090,000	
佐賀銀行	2,000	225.00	450,000	
十八銀行	4,000	228.00	912,000	
沖縄銀行	300	4,310.00	1,293,000	
琉球銀行	800	1,356.00	1,084,800	
八千代銀行	200	2,759.00	551,800	
セブン銀行	2,300	397.00	913,100	
みずほフィナンシャルグループ	599,700	205.00	122,938,500	
山口フィナンシャルグループ	2,000	910.00	1,820,000	
東日本銀行	2,000	253.00	506,000	
愛媛銀行	5,000	225.00	1,125,000	
みなと銀行	3,000	176.00	528,000	
京葉銀行	1,000	448.00	448,000	
栃木銀行	1,000	414.00	414,000	
トモニホールディングス	2,400	444.00	1,065,600	
フィデアホールディングス	5,600	191.00	1,069,600	
池田泉州ホールディングス	1,900	455.00	864,500	
ＳＢＩホールディングス	900	1,263.00	1,136,700	
大和証券グループ本社	15,000	894.00	13,410,000	
野村ホールディングス	5,700	660.00	3,762,000	
ＮＫＳＪホールディングス	1,300	2,650.00	3,445,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	1,800	2,380.00	4,284,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,400	1,696.00	4,070,400	

		第一生命保険	9,100	1,485.00	13,513,500	
		東京海上ホールディングス	3,300	3,093.00	10,206,900	
		Ｔ＆Ｄホールディングス	3,000	1,245.00	3,735,000	
		クレディセゾン	500	2,140.00	1,070,000	
		日本証券金融	700	590.00	413,000	
		アイフル	3,200	324.00	1,036,800	
		イオンフィナンシャルサービス	200	2,374.00	474,800	
		ジャックス	2,000	431.00	862,000	
		オリックス	4,500	1,486.00	6,687,000	
		三菱ＵＦＪリース	1,200	515.00	618,000	
		野村不動産ホールディングス	300	2,074.00	622,200	
		東急不動産ホールディングス	1,700	807.00	1,371,900	
		飯田グループホールディングス	300	1,524.00	457,200	
		パーク２４	200	1,924.00	384,800	
		三井不動産	1,000	3,239.00	3,239,000	
		三菱地所	2,000	2,509.00	5,018,000	
		東京建物	1,000	869.00	869,000	
		大京	3,000	212.00	636,000	
		レオパレス２１	1,000	524.00	524,000	
		イオンモール	200	2,706.00	541,200	
		日本空港ビルデング	200	2,619.00	523,800	
		綜合警備保障	300	2,256.00	676,800	
		ディー・エヌ・エー	600	1,833.00	1,099,800	
		博報堂ＤＹホールディングス	1,900	718.00	1,364,200	
		ケネディクス	800	365.00	292,000	
		電通	1,100	4,030.00	4,433,000	
		みらかホールディングス	300	4,395.00	1,318,500	
		オリエンタルランド	100	15,675.00	1,567,500	
		ダスキン	500	1,939.00	969,500	
		ラウンドワン	800	881.00	704,800	
		ユー・エス・エス	900	1,463.00	1,316,700	
		エイチ・アイ・エス	100	5,670.00	567,000	
		セコム	900	5,847.00	5,262,300	
		メイテック	200	2,815.00	563,000	
		アサツー　ディ・ケイ	400	2,142.00	856,800	
		ベネッセホールディングス	500	4,015.00	2,007,500	
	小計	銘柄数：553 組入時価比率：97.6%			1,988,806,100 100.0%	
合計					1,988,806,100	

(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

Ⅰ　資産総額	2,055,931,857円
Ⅱ　負債総額	68,267,209円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,987,664,648円
Ⅳ　発行済口数	149,837口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	13,266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。

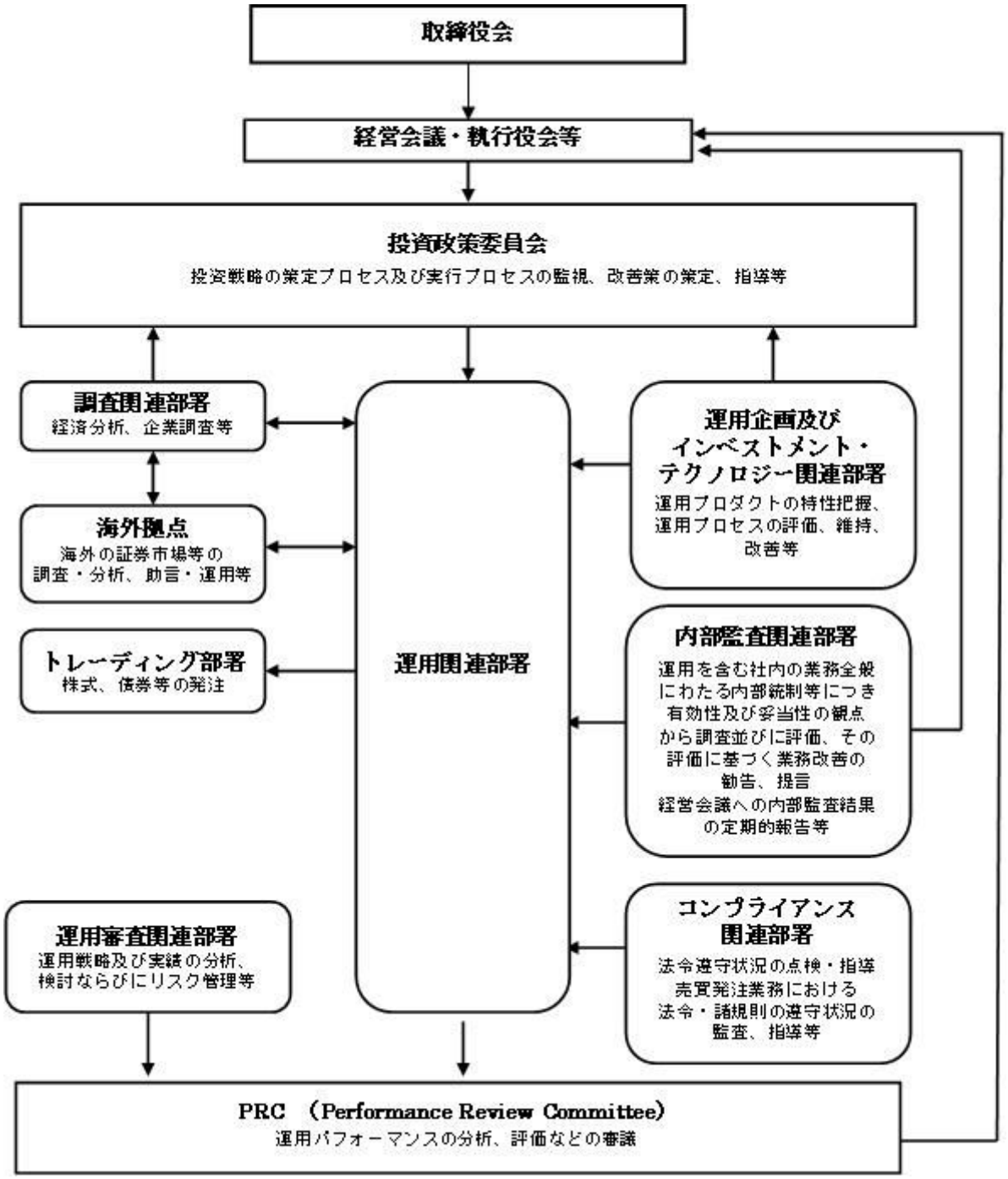
代表執行役・執行役

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 ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円 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。

＊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	三浦 昇	
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯原 尚	

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 R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信の平成26年3月19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 R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信の平成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。