

平成28年10月期（平成28年5月18日～平成28年10月20日）決算短信

平成28年11月30日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信  
 コード番号 ( 1480 )  
 連動対象指標 野村企業価値分配指数  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 1口  
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>  
 代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫  
 問合せ先責任者 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成29年1月12日  
 分配金支払開始日 平成28年11月28日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年10月期の運用状況（平成28年5月18日～平成28年10月20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28年10月期	9,216	(98.3)	159	(1.7)	9,376	(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28年10月期	-	717	0	717
-	-	-	-	-

(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28年10月期	9,458	82	9,376	13,060
-	-	-	-	-

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成28年10月期	102.00
-	-

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 野村企業価値分配指数連動型上場投信

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

第 1 期  
(平成 28 年 10 月 20 日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	89,223,031
株式	9,216,546,520
派生商品評価勘定	4,165,580
未収入金	74,845,330
未収配当金	70,233,044
差入委託証拠金	3,412,000
流動資産合計	9,458,425,505
資産合計	9,458,425,505
負債の部	
流動負債	
未払収益分配金	73,228,146
未払受託者報酬	1,539,490
未払委託者報酬	5,542,127
未払利息	107
その他未払費用	2,099,174
流動負債合計	82,409,044
負債合計	82,409,044
純資産の部	
元本等	
元本	9,226,028,473
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	149,987,988
(分配準備積立金)	87,730
元本等合計	9,376,016,461
純資産合計	9,376,016,461
負債純資産合計	9,458,425,505

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第 1 期  
自 平成 28 年 5 月 18 日  
至 平成 28 年 10 月 20 日

営業収益	
受取配当金	83,482,469
有価証券売買等損益	334,039,132
派生商品取引等損益	4,575,852
その他収益	14
営業収益合計	422,097,467
営業費用	

支払利息	3,697
受託者報酬	1,539,490
委託者報酬	5,542,127
その他費用	3,081,293
営業費用合計	10,166,607
営業利益又は営業損失(△)	411,930,860
経常利益又は経常損失(△)	411,930,860
当期純利益又は当期純損失(△)	411,930,860
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	188,714,726
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	188,714,726
分配金	73,228,146
期末剰余金又は期末欠損金(△)	149,987,988

## (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28年5月18日から平成28年10月20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28年10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	717,923 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	13,060 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自平成28年5月18日 至平成28年10月20日	
1. 分配金の計算過程	

項目		
当期配当等収益額	A	83,478,786円
分配準備積立金	B	0円
配当等収益合計額	C=A+B	83,478,786円
経費	D	10,162,910円
収益分配可能額	E=C-D	73,315,876円
収益分配金	F	73,228,146円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	87,730円
口数	H	717,923口
1口当たり分配金	I=F/H	102円

## 2. その他費用

その他費用のうち2,387,334円は、対象指数についての商標使用料であります。

## 3. 追加情報

平成28年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

## (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28年 5月18日 至 平成28年 10月20日
<p>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。</p> <p>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効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>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。</p>

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成28年 10月20日現在
<p>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。</p> <p>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。</p>

## (関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 平成28年5月18日 至 平成28年10月20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28年5月18日 至 平成28年10月20日	
期首元本額	－円
期中追加設定元本額	9,226,028,473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28年5月18日 至 平成28年10月20日 損益に含まれた評価差額(円)
株式	307,399,800
合計	307,399,800

## 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28年10月20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				
株価指数先物取引				
買建	152,912,000	－	157,090,000	4,165,580
合計	152,912,000	－	157,090,000	4,165,580

(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28年10月20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	45,400	1,009.50	45,831,300	
		長谷工コーポレーション	12,900	1,015.00	13,093,500	
		大東建託	3,400	17,435.00	59,279,000	

大和ハウス工業	22,800	2,804.50	63,942,600
積水ハウス	25,900	1,662.00	43,045,800
カルビー	3,600	3,790.00	13,644,000
ヤクルト本社	3,800	4,765.00	18,107,000
明治ホールディングス	5,300	10,480.00	55,544,000
日本ハム	7,000	2,491.00	17,437,000
アサヒグループホールディングス	16,000	3,672.00	58,752,000
キリンホールディングス	35,800	1,728.00	61,862,400
コカ・コーライーストジャパン	2,800	2,200.00	6,160,000
サントリー食品インターナショナル	5,900	4,520.00	26,668,000
伊藤園	2,700	3,845.00	10,381,500
不二製油グループ本社	2,300	2,129.00	4,896,700
キッコーマン	7,000	3,315.00	23,205,000
味の素	22,400	2,297.50	51,464,000
キューピー	4,300	2,944.00	12,659,200
日清食品ホールディングス	3,000	6,050.00	18,150,000
日本たばこ産業	52,400	3,931.00	205,984,400
東レ	64,000	953.50	61,024,000
クラレ	15,100	1,501.00	22,665,100
旭化成	51,000	860.10	43,865,100
住友化学	64,000	495.00	31,680,000
日産化学工業	5,300	3,395.00	17,993,500
東ソー	21,000	663.00	13,923,000
セントラル硝子	8,000	425.00	3,400,000
信越化学工業	17,400	7,431.00	129,299,400
エア・ウォーター	6,200	1,913.00	11,860,600
大陽日酸	5,300	1,086.00	5,755,800
カネカ	11,000	835.00	9,185,000
三菱瓦斯化学	8,000	1,521.00	12,168,000
J S R	8,400	1,689.00	14,187,600
三菱ケミカルホールディングス	56,100	655.20	36,756,720
ダイセル	12,400	1,300.00	16,120,000
積水化学工業	17,700	1,503.00	26,603,100
日本ゼオン	6,000	1,000.00	6,000,000
日立化成	4,500	2,477.00	11,146,500
日本化薬	6,000	1,159.00	6,954,000

花王	23,200	5,585.00	129,572,000
日本ペイントホールディングス	6,500	3,440.00	22,360,000
D I C	3,400	3,130.00	10,642,000
資生堂	16,300	2,677.00	43,635,100
コーセー	1,400	9,710.00	13,594,000
小林製薬	2,400	5,300.00	12,720,000
日東電工	7,500	7,213.00	54,097,500
ニフコ	1,900	5,720.00	10,868,000
ユニ・チャーム	17,000	2,450.50	41,658,500
協和発酵キリン	11,000	1,600.00	17,600,000
武田薬品工業	34,300	4,809.00	164,948,700
アステラス製薬	97,500	1,554.50	151,563,750
大日本住友製薬	6,000	1,874.00	11,244,000
塩野義製薬	13,000	5,193.00	67,509,000
田辺三菱製薬	9,600	2,126.00	20,409,600
中外製薬	8,800	3,590.00	31,592,000
エーザイ	11,500	6,835.00	78,602,500
小野薬品工業	17,800	2,709.50	48,229,100
久光製薬	2,400	5,160.00	12,384,000
参天製薬	16,000	1,523.00	24,368,000
ツムラ	2,800	2,987.00	8,363,600
東和薬品	400	4,145.00	1,658,000
沢井製薬	1,500	6,930.00	10,395,000
第一三共	28,500	2,380.50	67,844,250
大塚ホールディングス	19,000	4,583.00	87,077,000
横浜ゴム	4,700	1,750.00	8,225,000
東洋ゴム工業	4,200	1,647.00	6,917,400
ブリヂストン	28,200	3,907.00	110,177,400
住友ゴム工業	7,200	1,657.00	11,930,400
太平洋セメント	56,000	278.00	15,568,000
TOTO	6,200	4,085.00	25,327,000
日本碍子	12,000	2,153.00	25,836,000
日本特殊陶業	7,500	1,981.00	14,857,500
新日鐵住金	32,300	2,092.50	67,587,750
ジェイ エフ イー ホールディングス	20,900	1,487.00	31,078,300

日立金属	7,700	1,347.00	10,371,900
三菱マテリアル	5,000	2,748.00	13,740,000
DOWAホールディングス	11,000	765.00	8,415,000
住友電気工業	33,900	1,537.00	52,104,300
三和ホールディングス	8,800	1,017.00	8,949,600
リンナイ	1,700	9,820.00	16,694,000
日本発條	7,000	958.00	6,706,000
オーエスジー	3,500	2,174.00	7,609,000
DMG 森精機	5,200	1,119.00	5,818,800
ディスコ	1,300	12,000.00	15,600,000
ナブテスコ	5,600	3,065.00	17,164,000
SMC	2,700	30,120.00	81,324,000
小松製作所	40,800	2,373.00	96,818,400
ハーモニック・ドライブ・システムズ	1,100	2,940.00	3,234,000
クボタ	44,700	1,664.00	74,380,800
荏原製作所	4,200	3,175.00	13,335,000
ダイキン工業	10,700	9,820.00	105,074,000
栗田工業	4,700	2,452.00	11,524,400
椿本チエイン	5,000	831.00	4,155,000
タダノ	3,500	1,179.00	4,126,500
セガサミーホールディングス	8,600	1,548.00	13,312,800
ホシザキ	1,800	9,130.00	16,434,000
日本精工	17,700	1,131.00	20,018,700
NTN	18,000	385.00	6,930,000
ジェイテクト	8,500	1,604.00	13,634,000
不二越	6,000	383.00	2,298,000
THK	5,600	2,076.00	11,625,600
マキタ	5,300	7,420.00	39,326,000
三菱重工業	131,000	452.30	59,251,300
I H I	59,000	295.00	17,405,000
コニカミノルタ	20,500	924.00	18,942,000
ブラザー工業	10,200	1,843.00	18,798,600
ミネベア	13,400	1,042.00	13,962,800
日立製作所	217,000	523.00	113,491,000
三菱電機	84,500	1,348.50	113,948,250



富士電機	26,000	518.00	13,468,000
安川電機	10,300	1,599.00	16,469,700
マブチモーター	2,300	6,220.00	14,306,000
日本電産	9,400	9,293.00	87,354,200
オムロン	9,000	3,770.00	33,930,000
富士通	81,000	561.80	45,505,800
沖電気工業	3,800	1,511.00	5,741,800
セイコーエプソン	12,300	2,040.00	25,092,000
ワコム	6,700	316.00	2,117,200
パナソニック	97,200	1,080.50	105,024,600
アンリツ	6,100	613.00	3,739,300
富士通ゼネラル	2,000	2,285.00	4,570,000
日立国際電気	2,300	1,902.00	4,374,600
TDK	5,800	7,010.00	40,658,000
アルプス電気	8,300	2,621.00	21,754,300
ヒロセ電機	1,300	13,480.00	17,524,000
日本航空電子工業	3,000	1,710.00	5,130,000
横河電機	9,500	1,492.00	14,174,000
日本光電工業	3,200	2,551.00	8,163,200
堀場製作所	1,600	4,975.00	7,960,000
キーエンス	2,100	76,930.00	161,553,000
シスメックス	5,700	7,560.00	43,092,000
スタンレー電気	5,900	2,949.00	17,399,100
ウシオ電機	4,600	1,202.00	5,529,200
カシオ計算機	9,800	1,518.00	14,876,400
ファナック	8,600	19,670.00	169,162,000
ローム	4,300	5,340.00	22,962,000
浜松ホトニクス	6,700	3,125.00	20,937,500
太陽誘電	4,700	1,081.00	5,080,700
村田製作所	8,700	14,465.00	125,845,500
小糸製作所	4,000	5,300.00	21,200,000
SCREENホールディングス	1,700	6,630.00	11,271,000
キヤノン	46,700	3,034.00	141,687,800
リコー	28,200	929.00	26,197,800
東京エレクトロン	7,300	8,857.00	64,656,100
トヨタ紡織	2,400	2,460.00	5,904,000

豊田自動織機	7,100	4,900.00	34,790,000
デンソー	20,900	4,363.00	91,186,700
東海理化電機製作所	2,200	2,026.00	4,457,200
川崎重工業	61,000	297.00	18,117,000
日産自動車	110,900	1,012.00	112,230,800
いすゞ自動車	24,700	1,233.00	30,455,100
トヨタ自動車	45,600	6,038.00	275,332,800
日野自動車	11,100	1,127.00	12,509,700
三菱自動車工業	30,000	536.00	16,080,000
NOK	3,400	2,311.00	7,857,400
カルソニックカンセイ	6,000	1,020.00	6,120,000
アイシン精機	7,900	4,740.00	37,446,000
マツダ	25,300	1,662.00	42,048,600
スズキ	14,700	3,577.00	52,581,900
富士重工業	25,700	4,011.00	103,082,700
ヤマハ発動機	11,800	2,211.00	26,089,800
豊田合成	2,900	2,466.00	7,151,400
シマノ	3,500	17,730.00	62,055,000
テイ・エス テック	1,800	2,803.00	5,045,400
テルモ	12,600	4,090.00	51,534,000
島津製作所	10,000	1,544.00	15,440,000
東京精密	1,700	2,727.00	4,635,900
ニコン	14,900	1,566.00	23,333,400
トプコン	3,100	1,516.00	4,699,600
オリンパス	11,000	3,830.00	42,130,000
HOYA	18,900	4,157.00	78,567,300
朝日インテック	2,200	4,760.00	10,472,000
シチズン時計	11,200	577.00	6,462,400
ニプロ	5,500	1,290.00	7,095,000
バンダイナムコホールディングス	8,600	3,100.00	26,660,000
アシックス	7,200	2,170.00	15,624,000
ヤマハ	6,500	3,550.00	23,075,000
ビジョン	5,000	2,925.00	14,625,000
中部電力	28,800	1,491.50	42,955,200
北陸電力	7,600	1,213.00	9,218,800
東北電力	20,200	1,282.00	25,896,400

東京瓦斯	89,000	475.90	42,355,100
大阪瓦斯	81,000	440.40	35,672,400
東京急行電鉄	42,000	763.00	32,046,000
東日本旅客鉄道	14,300	9,284.00	132,761,200
西日本旅客鉄道	7,500	6,362.00	47,715,000
東海旅客鉄道	6,300	17,265.00	108,769,500
日本通運	36,000	495.00	17,820,000
日本航空	16,200	3,019.00	48,907,800
ANAホールディングス	145,000	276.10	40,034,500
ネクソン	6,800	1,675.00	11,390,000
野村総合研究所	5,300	3,780.00	20,034,000
ヤフー	58,700	408.00	23,949,600
トレンドマイクロ	5,300	3,615.00	19,159,500
伊藤忠テクノソリューションズ	2,100	2,688.00	5,644,800
大塚商会	2,400	5,090.00	12,216,000
日本電信電話	55,100	4,705.00	259,245,500
KDDI	85,500	3,093.00	264,451,500
光通信	800	9,400.00	7,520,000
NTTドコモ	62,800	2,577.00	161,835,600
エヌ・ティ・ティ・データ	6,000	5,380.00	32,280,000
カプコン	2,100	2,515.00	5,281,500
SCSK	2,300	4,160.00	9,568,000
第一興商	1,600	4,300.00	6,880,000
IDOM	2,700	511.00	1,379,700
豊田通商	9,100	2,433.00	22,140,300
ミスミグループ本社	9,100	1,978.00	17,999,800
ローソン	2,900	7,920.00	22,968,000
エービーシー・マート	1,200	6,500.00	7,800,000
ゲオホールディングス	1,500	1,312.00	1,968,000
アダストリア	1,400	2,589.00	3,624,600
セリア	700	8,350.00	5,845,000
ジェイアイエヌ	500	5,270.00	2,635,000
マツモトキヨシホールディングス	1,700	5,480.00	9,316,000
ウエルシアホールディングス	700	7,450.00	5,215,000
すかいらーく	4,700	1,444.00	6,786,800
コスモス薬品	400	23,580.00	9,432,000

セブン&アイ・ホールディングス	34,200	4,539.00	155,233,800
クリエイト・レストランツ・ホールディング	2,000	1,003.00	2,006,000
ツルハホールディングス	1,600	11,770.00	18,832,000
クスリのアオキ	700	5,410.00	3,787,000
良品計画	1,100	22,690.00	24,959,000
ドンキホーテホールディングス	5,400	4,050.00	21,870,000
ユナイテッドアローズ	1,000	2,769.00	2,769,000
スギホールディングス	1,700	5,830.00	9,911,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2,600	6,450.00	16,770,000
青山商事	2,000	3,600.00	7,200,000
しまむら	1,000	12,700.00	12,700,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	3,900	1,584.00	6,177,600
イオン	27,600	1,463.00	40,378,800
イズミ	1,400	4,795.00	6,713,000
ニトリホールディングス	3,200	12,450.00	39,840,000
吉野家ホールディングス	2,500	1,533.00	3,832,500
バローホールディングス	1,500	2,975.00	4,462,500
ファーストリテイリング	1,500	36,330.00	54,495,000
サンドラッグ	1,600	8,070.00	12,912,000
三井住友フィナンシャルグループ	59,100	3,461.00	204,545,100
大和証券グループ本社	76,000	581.40	44,186,400
東京センチュリー	1,900	3,620.00	6,878,000
日立キャピタル	2,100	2,262.00	4,750,200
オリックス	62,300	1,459.00	90,895,700
三菱UFJリース	18,600	496.00	9,225,600
ヒューリック	10,800	1,020.00	11,016,000
野村不動産ホールディングス	5,900	1,769.00	10,437,100
飯田グループホールディングス	6,300	1,985.00	12,505,500
パーク 24	4,100	3,305.00	13,550,500
タカラレーベン	3,900	775.00	3,022,500
イオンモール	5,100	1,514.00	7,721,400
テンブホールディングス	6,300	1,782.00	11,226,600
総合警備保障	2,200	5,350.00	11,770,000
カクコム	6,700	1,811.00	12,133,700
エムスリー	6,700	3,420.00	22,914,000

	ディー・エヌ・エー	4,900	3,385.00	16,586,500	
	博報堂DYホールディングス	10,400	1,244.00	12,937,600	
	ぐるなび	1,100	2,988.00	3,286,800	
	ケネディクス	11,100	438.00	4,861,800	
	電通	10,500	5,240.00	55,020,000	
	みらかホールディングス	2,400	5,010.00	12,024,000	
	オリエンタルランド	9,000	6,007.00	54,063,000	
	リゾートトラスト	3,200	2,078.00	6,649,600	
	サイバーエージェント	4,600	3,025.00	13,915,000	
	楽天	38,000	1,318.00	50,084,000	
	リクルートホールディングス	10,700	4,265.00	45,635,500	
	リログループ	500	17,800.00	8,900,000	
	エイチ・アイ・エス	1,600	2,637.00	4,219,200	
	カナモト	1,100	2,516.00	2,767,600	
	セコム	9,500	7,599.00	72,190,500	
	小計 銘柄数：267			9,216,546,520	
	組入時価比率：98.3%			100.0%	
	合計			9,216,546,520	

(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 28 年 10 月 20 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。