

平成28年10月期（平成28年4月8日～平成28年10月7日）決算短信

平成28年11月16日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信
 コード番号 (1598)
 連動対象指標 Russell/Nomuraファンダメンタル・プライム・インデックス(配当除く)
 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28年12月15日
 分配金支払開始日 平成28年11月15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4月8日～平成28年10月7日）

(1)資産内訳 (百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
平成28年10月期	2,271	(98.3)	38	(1.7)	2,309	(100)
平成28年4月期	6,099	(97.3)	170	(2.7)	6,270	(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	449	0	295	154
平成28年4月期	449	0	0	449

(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	2,344	34	2,309	14,997
平成28年4月期	6,378	108	6,270	13,946

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成28年10月期	153.00
平成28年4月期	168.00

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 R/N ファンダメンタル・インデックス上場投信

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 5 期 (平成 28 年 4 月 7 日現在)	第 6 期 (平成 28 年 10 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	113,170,202	-
コール・ローン	8,790,277	46,041,307
株式	6,099,559,800	2,271,311,450
派生商品評価勘定	-	351,684
未収入金	54,944,600	102,812
未収配当金	81,151,536	24,786,708
差入委託証拠金	20,998,850	2,104,200
流動資産合計	6,378,615,265	2,344,698,161
資産合計	6,378,615,265	2,344,698,161
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,224,698	-
未払金	1,378,755	-
未払収益分配金	75,537,672	23,566,284
未払受託者報酬	1,994,111	1,405,091
未払委託者報酬	9,970,511	7,025,407
未払利息	-	38
その他未払費用	7,957,166	2,795,047
流動負債合計	108,062,913	34,791,867
負債合計	108,062,913	34,791,867
純資産の部		
元本等		
元本	5,993,104,941	2,053,039,212
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	277,447,411	256,867,082
(分配準備積立金)	14,708	145,920
元本等合計	6,270,552,352	2,309,906,294
純資産合計	6,270,552,352	2,309,906,294
負債純資産合計	6,378,615,265	2,344,698,161

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日
営業収益		
受取配当金	91,220,228	34,930,986
受取利息	28,170	7

有価証券売買等損益	△1,453,926,823	332,413,482
派生商品取引等損益	△25,233,113	5,420,738
その他収益	45,372	59,828
営業収益合計	△1,387,866,166	372,825,041
営業費用		
支払利息	-	20,631
受託者報酬	1,994,111	1,405,091
委託者報酬	9,970,511	7,025,407
その他費用	4,024,258	2,842,196
営業費用合計	15,988,880	11,293,325
営業利益又は営業損失(△)	△1,403,855,046	361,531,716
経常利益又は経常損失(△)	△1,403,855,046	361,531,716
当期純利益又は当期純損失(△)	△1,403,855,046	361,531,716
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	1,756,840,129	277,447,411
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	-	358,545,761
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	358,545,761
分配金	75,537,672	23,566,284
期末剰余金又は期末欠損金(△)	277,447,411	256,867,082

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成 28 年 4 月 8 日から平成 28 年 10 月 7 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 5 期 平成 28 年 4 月 7 日現在	第 6 期 平成 28 年 10 月 7 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 449,629 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 154,028 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 13,946 円	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 14,997 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日			第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	91,293,770 円	当期配当等収益額	A	34,970,190 円
分配準備積立金	B	247,490 円	分配準備積立金	B	14,708 円
配当等収益合計額	C=A+B	91,541,260 円	配当等収益合計額	C=A+B	34,984,898 円
経費	D	15,988,880 円	経費	D	11,272,694 円
収益分配可能額	E=C-D	75,552,380 円	収益分配可能額	E=C-D	23,712,204 円
収益分配金	F	75,537,672 円	収益分配金	F	23,566,284 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	14,708 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	145,920 円
口数	H	449,629 口	口数	H	154,028 口
1 口当たり分配金	I=F/H	168 円	1 口当たり分配金	I=F/H	153 円
2. その他費用 その他費用のうち 3,589,344 円は、対象指数についての商標 使用料であります。			2. その他費用 その他費用のうち 2,525,928 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 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日		第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用 の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資とし て運用することを目的としております。		1. 金融商品に対する取組方針 同左	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバ ティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であ ります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及 び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低 減を目的として、株価指数先物取引を行っております。		2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左	
3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員 会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行 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		3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左	

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 5 期 平成 28 年 4 月 7 日現在	第 6 期 平成 28 年 10 月 7 日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 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。	2. 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日
期首元本額 5,993,104,941 円	期首元本額 5,993,104,941 円
期中追加設定元本額 0 円	期中追加設定元本額 0 円
期中一部交換元本額 0 円	期中一部交換元本額 3,940,065,729 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日
	損益に含まれた評価差額 (円)	損益に含まれた評価差額 (円)
株式	△1,460,373,403	156,227,982
合計	△1,460,373,403	156,227,982

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 5 期(平成 28 年 4 月 7 日現在)				第 6 期(平成 28 年 10 月 7 日現在)			
	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	178,170,050	—	166,959,500	△11,224,698	36,122,400	—	36,477,000	351,684
合計	178,170,050	—	166,959,500	△11,224,698	36,122,400	—	36,477,000	351,684

(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 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	2,300	444.00	1,021,200	
		国際石油開発帝石	7,100	965.80	6,857,180	
		石油資源開発	300	2,422.00	726,600	
		ミライト・ホールディングス	700	874.00	611,800	
		コムシスホールディングス	1,000	1,766.00	1,766,000	
		ミサワホーム	900	775.00	697,500	
		大成建設	5,000	745.00	3,725,000	
		大林組	2,600	961.00	2,498,600	
		清水建設	2,000	883.00	1,766,000	
		長谷工コーポレーション	1,700	938.00	1,594,600	
		鹿島建設	4,000	694.00	2,776,000	
		西松建設	1,000	465.00	465,000	
		前田建設工業	1,000	873.00	873,000	
		奥村組	1,000	573.00	573,000	
		戸田建設	1,000	541.00	541,000	
		大東建託	800	15,605.00	12,484,000	
		住友林業	1,300	1,380.00	1,794,000	
		パナホーム	1,000	793.00	793,000	
		大和ハウス工業	2,300	2,666.00	6,131,800	
		積水ハウス	3,400	1,649.50	5,608,300	
		関電工	1,000	941.00	941,000	
		きんでん	1,100	1,196.00	1,315,600	
		協和エクシオ	900	1,441.00	1,296,900	
日揮	1,700	1,800.00	3,060,000			
千代田化工建設	1,000	875.00	875,000			

日本製粉	500	1,565.00	782,500
日清製粉グループ本社	1,100	1,564.00	1,720,400
江崎グリコ	100	5,840.00	584,000
山崎製パン	800	2,483.00	1,986,400
カルビー	200	3,740.00	748,000
森永乳業	2,000	799.00	1,598,000
ヤクルト本社	200	4,600.00	920,000
明治ホールディングス	400	10,130.00	4,052,000
雪印メグミルク	400	3,535.00	1,414,000
日本ハム	2,000	2,419.00	4,838,000
丸大食品	1,000	497.00	497,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,100	1,003.00	1,103,300
サッポロホールディングス	400	2,863.00	1,145,200
アサヒグループホールディングス	1,900	3,706.00	7,041,400
キリンホールディングス	6,800	1,667.00	11,335,600
宝ホールディングス	900	981.00	882,900
コカ・コーラウエスト	700	2,946.00	2,062,200
コカ・コーライーストジャパン	500	2,200.00	1,100,000
サントリー食品インターナショナル	500	4,430.00	2,215,000
伊藤園	500	3,635.00	1,817,500
日清オイリオグループ	2,000	481.00	962,000
不二製油グループ本社	500	2,071.00	1,035,500
味の素	2,900	2,296.50	6,659,850
キューピー	600	2,953.00	1,771,800
ハウス食品グループ本社	400	2,324.00	929,600
カゴメ	400	2,639.00	1,055,600
ニチレイ	900	2,209.00	1,988,100
東洋水産	500	4,350.00	2,175,000
日清食品ホールディングス	300	6,140.00	1,842,000
日本たばこ産業	5,400	4,118.00	22,237,200
ゲンゼ	2,000	325.00	650,000
東洋紡	7,000	171.00	1,197,000
帝人	1,500	1,962.00	2,943,000
東レ	7,000	943.80	6,606,600
ワコールホールディングス	1,000	1,150.00	1,150,000
T S I ホールディングス	700	594.00	415,800

オンワードホールディングス	1,000	719.00	719,000
王子ホールディングス	6,000	409.00	2,454,000
日本製紙	1,200	1,841.00	2,209,200
北越紀州製紙	1,100	624.00	686,400
大王製紙	600	1,235.00	741,000
レンゴー	2,300	645.00	1,483,500
クラレ	2,400	1,507.00	3,616,800
旭化成	10,000	822.60	8,226,000
昭和電工	2,000	1,369.00	2,738,000
住友化学	11,000	472.00	5,192,000
日産化学工業	500	3,175.00	1,587,500
クレハ	100	3,855.00	385,500
日本曹達	1,000	440.00	440,000
東ソー	3,000	649.00	1,947,000
トクヤマ	5,000	485.00	2,425,000
セントラル硝子	2,000	405.00	810,000
東亜合成	1,100	1,118.00	1,229,800
デンカ	4,000	432.00	1,728,000
信越化学工業	1,800	7,504.00	13,507,200
エア・ウォーター	900	1,882.00	1,693,800
大陽日酸	600	1,056.00	633,600
日本触媒	100	6,580.00	658,000
カネカ	2,000	809.00	1,618,000
三菱瓦斯化学	1,500	1,493.00	2,239,500
三井化学	7,000	505.00	3,535,000
J S R	1,400	1,654.00	2,315,600
東京応化工業	200	3,215.00	643,000
三菱ケミカルホールディングス	14,600	664.90	9,707,540
ダイセル	1,400	1,259.00	1,762,600
住友ベークライト	2,000	549.00	1,098,000
積水化学工業	3,300	1,488.00	4,910,400
日本ゼオン	1,000	935.00	935,000
アイカ工業	300	2,703.00	810,900
宇部興産	12,000	199.00	2,388,000
日立化成	800	2,428.00	1,942,400
日本化薬	1,000	1,135.00	1,135,000

ADEKA	500	1,429.00	714,500
日油	1,000	1,068.00	1,068,000
花王	2,200	5,724.00	12,592,800
日本ペイントホールディングス	300	3,565.00	1,069,500
関西ペイント	700	2,221.00	1,554,700
DIC	600	3,230.00	1,938,000
東洋インキSCホールディングス	2,000	474.00	948,000
富士フイルムホールディングス	2,700	3,798.00	10,254,600
資生堂	1,500	2,670.00	4,005,000
ライオン	1,000	1,629.00	1,629,000
コーセー	100	10,030.00	1,003,000
小林製薬	200	5,280.00	1,056,000
日東電工	700	6,805.00	4,763,500
ニフコ	200	5,470.00	1,094,000
ユニ・チャーム	1,200	2,611.00	3,133,200
協和発酵キリン	900	1,566.00	1,409,400
武田薬品工業	4,000	4,867.00	19,468,000
アステラス製薬	9,600	1,567.00	15,043,200
大日本住友製薬	700	1,873.00	1,311,100
塩野義製薬	800	5,242.00	4,193,600
田辺三菱製薬	900	2,151.00	1,935,900
中外製薬	500	3,650.00	1,825,000
科研製薬	100	6,340.00	634,000
エーザイ	1,000	6,469.00	6,469,000
ロート製薬	400	1,731.00	692,400
小野薬品工業	700	3,140.00	2,198,000
久光製薬	200	5,360.00	1,072,000
持田製薬	100	8,080.00	808,000
参天製薬	1,000	1,516.00	1,516,000
ツムラ	300	2,910.00	873,000
沢井製薬	100	7,090.00	709,000
第一三共	3,700	2,454.50	9,081,650
キョーリン製薬ホールディングス	300	2,294.00	688,200
大塚ホールディングス	2,300	4,549.00	10,462,700
大正製薬ホールディングス	100	10,140.00	1,014,000
昭和シェル石油	2,800	977.00	2,735,600

東燃ゼネラル石油	2,000	1,023.00	2,046,000
出光興産	1,900	2,292.00	4,354,800
J Xホールディングス	53,900	409.80	22,088,220
コスモエネルギーホールディングス	900	1,279.00	1,151,100
横浜ゴム	800	1,700.00	1,360,000
東洋ゴム工業	400	1,519.00	607,600
ブリヂストン	3,400	3,948.00	13,423,200
住友ゴム工業	1,400	1,619.00	2,266,600
旭硝子	10,000	664.00	6,640,000
日本板硝子	1,600	825.00	1,320,000
日本電気硝子	5,000	544.00	2,720,000
住友大阪セメント	3,000	441.00	1,323,000
太平洋セメント	7,000	285.00	1,995,000
東海カーボン	2,000	290.00	580,000
TOTO	600	3,870.00	2,322,000
日本碍子	700	2,114.00	1,479,800
日本特殊陶業	600	1,927.00	1,156,200
新日鐵住金	6,900	2,135.50	14,734,950
神戸製鋼所	3,400	914.00	3,107,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	5,800	1,531.00	8,879,800
日新製鋼	900	1,392.00	1,252,800
大和工業	200	3,010.00	602,000
丸一鋼管	200	3,345.00	669,000
大同特殊鋼	3,000	468.00	1,404,000
愛知製鋼	100	5,280.00	528,000
日立金属	900	1,282.00	1,153,800
日本軽金属ホールディングス	4,100	220.00	902,000
三井金属鉱業	7,000	229.00	1,603,000
三菱マテリアル	1,000	2,754.00	2,754,000
住友金属鉱山	4,000	1,318.00	5,272,000
DOWAホールディングス	2,000	767.00	1,534,000
古河電気工業	1,000	2,945.00	2,945,000
住友電気工業	6,100	1,482.00	9,040,200
フジクラ	3,000	596.00	1,788,000
東洋製罐グループホールディングス	1,200	1,795.00	2,154,000

三和ホールディングス	1,100	972.00	1,069,200
三協立山	300	1,545.00	463,500
LIXILグループ	1,900	2,251.00	4,276,900
リンナイ	100	9,330.00	933,000
日本発條	1,400	993.00	1,390,200
日本製鋼所	400	2,332.00	932,800
オークマ	1,000	798.00	798,000
アマダホールディングス	1,600	1,085.00	1,736,000
オーエスジー	300	2,090.00	627,000
DMG森精機	500	1,098.00	549,000
ディスコ	100	12,500.00	1,250,000
ナブテスコ	600	2,920.00	1,752,000
SMC	100	29,760.00	2,976,000
小松製作所	7,400	2,367.50	17,519,500
住友重機械工業	5,000	512.00	2,560,000
日立建機	1,100	2,067.00	2,273,700
クボタ	3,500	1,562.00	5,467,000
荏原製作所	700	3,145.00	2,201,500
ダイキン工業	800	9,699.00	7,759,200
栗田工業	700	2,435.00	1,704,500
椿本チエイン	1,000	808.00	808,000
ダイフク	300	1,874.00	562,200
フジテック	500	1,184.00	592,000
平和	400	2,255.00	902,000
SANKYO	500	3,470.00	1,735,000
グローリー	300	3,510.00	1,053,000
セガサミーホールディングス	2,500	1,466.00	3,665,000
ホンザキ	100	9,060.00	906,000
日本精工	2,000	1,101.00	2,202,000
NTN	2,000	376.00	752,000
ジェイテクト	1,300	1,566.00	2,035,800
THK	600	2,056.00	1,233,600
マキタ	400	7,240.00	2,896,000
日立造船	1,100	516.00	567,600
三菱重工業	19,000	438.50	8,331,500
IHI	8,000	296.00	2,368,000

日清紡ホールディングス	1,000	996.00	996,000
イビデン	1,300	1,462.00	1,900,600
コニカミノルタ	3,500	897.00	3,139,500
ブラザー工業	1,900	1,840.00	3,496,000
ミネベア	1,000	1,005.00	1,005,000
日立製作所	44,000	524.50	23,078,000
東芝	39,000	350.10	13,653,900
三菱電機	12,000	1,337.50	16,050,000
富士電機	4,000	500.00	2,000,000
安川電機	900	1,560.00	1,404,000
東芝テック	2,000	438.00	876,000
マブチモーター	100	5,790.00	579,000
日本電産	500	9,296.00	4,648,000
JVCケンウッド	1,900	266.00	505,400
オムロン	1,100	3,760.00	4,136,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	2,000	439.00	878,000
日本電気	19,000	268.00	5,092,000
富士通	17,000	570.10	9,691,700
沖電気工業	600	1,400.00	840,000
セイコーエプソン	1,600	1,962.00	3,139,200
ジャパンディスプレイ	2,300	170.00	391,000
パナソニック	23,700	1,047.50	24,825,750
シャープ	13,000	137.00	1,781,000
アンリツ	1,000	596.00	596,000
ソニー	6,600	3,350.00	22,110,000
TDK	900	7,110.00	6,399,000
ミツミ電機	1,300	603.00	783,900
アルプス電気	600	2,615.00	1,569,000
パイオニア	2,900	226.00	655,400
ホシデン	1,200	743.00	891,600
ヒロセ電機	100	13,790.00	1,379,000
日立マクセル	500	1,562.00	781,000
アルパイン	500	1,384.00	692,000
横河電機	1,000	1,408.00	1,408,000
アズビル	400	3,075.00	1,230,000

日本光電工業	300	2,539.00	761,700
堀場製作所	200	4,845.00	969,000
アドバンテスト	700	1,436.00	1,005,200
シスメックス	100	7,560.00	756,000
スタンレー電気	700	2,799.00	1,959,300
ウシオ電機	600	1,199.00	719,400
カシオ計算機	800	1,440.00	1,152,000
ファナック	400	18,410.00	7,364,000
ローム	500	5,570.00	2,785,000
浜松ホトニクス	400	3,145.00	1,258,000
新光電気工業	800	617.00	493,600
京セラ	1,500	4,965.00	7,447,500
太陽誘電	600	1,055.00	633,000
村田製作所	500	13,795.00	6,897,500
小糸製作所	400	5,270.00	2,108,000
S C R E E Nホールディングス	200	6,810.00	1,362,000
キヤノン	10,000	2,991.50	29,915,000
リコー	5,500	933.00	5,131,500
東京エレクトロン	800	9,217.00	7,373,600
トヨタ紡織	400	2,404.00	961,600
ユニプレス	400	1,897.00	758,800
豊田自動織機	800	4,985.00	3,988,000
デンソー	2,400	4,198.00	10,075,200
東海理化電機製作所	400	2,096.00	838,400
三井造船	7,000	147.00	1,029,000
川崎重工業	8,000	294.00	2,352,000
日産自動車	17,000	1,013.00	17,221,000
いすゞ自動車	4,100	1,253.50	5,139,350
トヨタ自動車	11,500	6,006.00	69,069,000
日野自動車	1,900	1,121.00	2,129,900
三菱自動車工業	8,000	489.00	3,912,000
日産車体	800	986.00	788,800
日信工業	400	1,612.00	644,800
タチエス	400	1,693.00	677,200
NOK	500	2,316.00	1,158,000
フタバ産業	1,400	502.00	702,800

K Y B	3,000	466.00	1,398,000
プレス工業	1,300	482.00	626,600
カルソニックカンセイ	1,000	974.00	974,000
ケーヒン	500	1,683.00	841,500
アイシン精機	1,800	4,815.00	8,667,000
マツダ	2,500	1,668.00	4,170,000
本田技研工業	12,500	3,069.00	38,362,500
スズキ	1,900	3,521.00	6,689,900
富士重工業	1,700	3,950.00	6,715,000
ヤマハ発動機	1,300	2,183.00	2,837,900
ショーワ	900	571.00	513,900
エクセディ	200	2,720.00	544,000
豊田合成	600	2,494.00	1,496,400
エフ・シー・シー	300	2,352.00	705,600
シマノ	100	16,330.00	1,633,000
テイ・エス テック	400	2,734.00	1,093,600
テルモ	800	3,965.00	3,172,000
島津製作所	1,000	1,573.00	1,573,000
ニコン	2,900	1,567.00	4,544,300
オリンパス	500	3,745.00	1,872,500
HOYA	1,600	4,199.00	6,718,400
シチズン時計	1,500	573.00	859,500
ニプロ	800	1,294.00	1,035,200
バンダイナムコホールディングス	1,000	3,135.00	3,135,000
トッパン・フォームズ	400	1,065.00	426,000
凸版印刷	5,000	938.00	4,690,000
大日本印刷	6,000	1,010.00	6,060,000
アシックス	300	2,143.00	642,900
ヤマハ	600	3,460.00	2,076,000
リンテック	300	2,086.00	625,800
任天堂	300	26,690.00	8,007,000
コクヨ	600	1,470.00	882,000
東京電力ホールディングス	18,600	416.00	7,737,600
中部電力	5,800	1,449.00	8,404,200
関西電力	5,800	910.60	5,281,480
中国電力	2,500	1,230.00	3,075,000

北陸電力	1,800	1,197.00	2,154,600
東北電力	3,100	1,279.00	3,964,900
四国電力	1,200	945.00	1,134,000
九州電力	1,900	902.00	1,713,800
北海道電力	1,400	831.00	1,163,400
沖縄電力	400	2,233.00	893,200
電源開発	800	2,390.00	1,912,000
東京瓦斯	19,000	453.90	8,624,100
大阪瓦斯	15,000	418.70	6,280,500
東邦瓦斯	3,000	928.00	2,784,000
東武鉄道	8,000	502.00	4,016,000
相鉄ホールディングス	1,000	501.00	501,000
東京急行電鉄	4,000	755.00	3,020,000
京浜急行電鉄	1,000	1,039.00	1,039,000
小田急電鉄	900	2,198.00	1,978,200
京王電鉄	2,000	863.00	1,726,000
京成電鉄	400	2,452.00	980,800
東日本旅客鉄道	1,500	9,064.00	13,596,000
西日本旅客鉄道	900	6,275.00	5,647,500
東海旅客鉄道	500	17,340.00	8,670,000
西日本鉄道	1,000	479.00	479,000
近鉄グループホールディングス	7,000	419.00	2,933,000
阪急阪神ホールディングス	1,100	3,410.00	3,751,000
南海電気鉄道	2,000	493.00	986,000
京阪ホールディングス	1,000	694.00	694,000
名古屋鉄道	5,000	539.00	2,695,000
日本通運	8,000	487.00	3,896,000
ヤマトホールディングス	2,400	2,348.50	5,636,400
山九	2,000	590.00	1,180,000
ニッコンホールディングス	300	2,240.00	672,000
セイノーホールディングス	1,200	1,091.00	1,309,200
日立物流	400	2,030.00	812,000
日本郵船	20,000	206.00	4,120,000
商船三井	10,000	252.00	2,520,000
川崎汽船	13,000	270.00	3,510,000
日本航空	2,000	3,028.00	6,056,000

ANAホールディングス	20,000	276.20	5,524,000
三菱倉庫	1,000	1,463.00	1,463,000
上組	2,000	888.00	1,776,000
近鉄エクスプレス	300	1,334.00	400,200
T I S	500	2,689.00	1,344,500
グリーン	1,200	572.00	686,400
ネクソン	400	1,635.00	654,000
野村総合研究所	300	3,555.00	1,066,500
フジ・メディア・ホールディングス	1,700	1,431.00	2,432,700
オービック	100	5,240.00	524,000
ヤフー	3,100	407.00	1,261,700
トレンドマイクロ	400	3,605.00	1,442,000
日本オラクル	200	5,600.00	1,120,000
伊藤忠テクノソリューションズ	300	2,686.00	805,800
大塚商会	200	4,900.00	980,000
ネットワンシステムズ	1,200	695.00	834,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	400	1,418.00	567,200
東京放送ホールディングス	500	1,611.00	805,500
日本テレビホールディングス	800	1,770.00	1,416,000
テレビ朝日ホールディングス	400	1,877.00	750,800
スカパーJ S A Tホールディングス	1,100	506.00	556,600
日本電信電話	17,900	4,606.00	82,447,400
K D D I	10,800	3,067.00	33,123,600
光通信	100	9,190.00	919,000
N T T ドコモ	11,200	2,459.00	27,540,800
カドカワ	400	1,498.00	599,200
東宝	300	3,210.00	963,000
エヌ・ティ・ティ・データ	700	5,060.00	3,542,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	3,445.00	689,000
S C S K	200	3,915.00	783,000
コナミホールディングス	500	4,040.00	2,020,000
ソフトバンクグループ	3,400	6,547.00	22,259,800
あらた	200	2,355.00	471,000
双日	27,200	270.00	7,344,000
アルフレッサ ホールディングス	1,600	2,096.00	3,353,600

ダイワボウホールディングス	3,000	243.00	729,000
シップヘルスケアホールディングス	200	3,025.00	605,000
三菱食品	200	3,340.00	668,000
第一興商	200	4,105.00	821,000
メディopalホールディングス	1,700	1,753.00	2,980,100
黒田電気	300	1,980.00	594,000
伊藤忠商事	19,300	1,285.00	24,800,500
丸紅	25,400	531.70	13,505,180
長瀬産業	1,300	1,257.00	1,634,100
豊田通商	2,800	2,397.00	6,711,600
兼松	6,000	159.00	954,000
三井物産	23,400	1,402.50	32,818,500
日立ハイテクノロジーズ	500	4,175.00	2,087,500
カメイ	600	911.00	546,600
住友商事	14,700	1,175.50	17,279,850
三菱商事	20,000	2,317.50	46,350,000
キヤノンマーケティングジャパン	500	1,839.00	919,500
阪和興業	4,000	632.00	2,528,000
岩谷産業	2,000	621.00	1,242,000
三愛石油	1,300	693.00	900,900
稲畑産業	600	1,074.00	644,400
東邦ホールディングス	500	2,137.00	1,068,500
サンゲツ	400	1,965.00	786,000
伊藤忠エネクス	900	825.00	742,500
サンリオ	200	1,891.00	378,200
リョーサン	400	3,195.00	1,278,000
三信電気	500	894.00	447,000
PAL TAC	500	2,354.00	1,177,000
日鉄住金物産	200	3,715.00	743,000
オートバックスセブン	700	1,471.00	1,029,700
加藤産業	300	2,477.00	743,100
因幡電機産業	200	3,675.00	735,000
ミスミグループ本社	500	1,949.00	974,500
スズケン	700	3,275.00	2,292,500
ローソン	300	7,890.00	2,367,000
ゲオホールディングス	400	1,298.00	519,200

アダストリア	200	2,481.00	496,200
日本マクドナルドホールディングス	400	2,935.00	1,174,000
エディオン	1,700	886.00	1,506,200
ビックカメラ	600	868.00	520,800
DCMホールディングス	1,300	884.00	1,149,200
J. フロント リテイリング	1,400	1,397.00	1,955,800
マツモトキヨシホールディングス	300	5,200.00	1,560,000
ココカラファイン	100	3,870.00	387,000
三越伊勢丹ホールディングス	1,800	1,046.00	1,882,800
すかいらーく	600	1,385.00	831,000
セブン&アイ・ホールディングス	4,300	4,581.00	19,698,300
ツルハホールディングス	100	11,170.00	1,117,000
良品計画	100	21,410.00	2,141,000
コーナン商事	400	2,005.00	802,000
ドンキホーテホールディングス	400	3,855.00	1,542,000
ゼンショーホールディングス	600	1,855.00	1,113,000
スギホールディングス	200	5,540.00	1,108,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	900	6,490.00	5,841,000
島忠	400	2,520.00	1,008,000
コメリ	300	2,489.00	746,700
青山商事	400	3,485.00	1,394,000
しまむら	100	12,580.00	1,258,000
高島屋	2,000	856.00	1,712,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	600	1,564.00	938,400
丸井グループ	1,100	1,389.00	1,527,900
イオン	6,000	1,444.00	8,664,000
イズミ	200	4,315.00	863,000
平和堂	200	2,028.00	405,600
ケーズホールディングス	1,000	1,685.00	1,685,000
ヤマダ電機	9,500	501.00	4,759,500
ニトリホールディングス	200	11,890.00	2,378,000
吉野家ホールディングス	600	1,441.00	864,600
アークス	400	2,472.00	988,800
バローホールディングス	300	2,886.00	865,800
ファーストリテイリング	100	33,500.00	3,350,000

サンドラッグ	200	8,030.00	1,606,000
じもとホールディングス	6,500	150.00	975,000
めぶきフィナンシャルグループ	8,750	361.00	3,158,750
東京T Yフィナンシャルグループ	600	2,919.00	1,751,400
九州フィナンシャルグループ	4,200	686.00	2,881,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	16,200	454.70	7,366,140
西日本フィナンシャルホールディングス	1,300	1,052.00	1,367,600
新生銀行	5,000	157.00	785,000
あおぞら銀行	10,000	349.00	3,490,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	113,000	526.60	59,505,800
りそなホールディングス	109,100	434.90	47,447,590
三井住友トラスト・ホールディングス	4,300	3,385.00	14,555,500
三井住友フィナンシャルグループ	34,700	3,478.00	120,686,600
第四銀行	3,000	412.00	1,236,000
北越銀行	400	2,347.00	938,800
千葉銀行	5,000	591.00	2,955,000
群馬銀行	2,100	474.00	995,400
武蔵野銀行	300	2,677.00	803,100
千葉興業銀行	1,600	428.00	684,800
筑波銀行	2,000	301.00	602,000
七十七銀行	9,000	432.00	3,888,000
青森銀行	3,000	334.00	1,002,000
秋田銀行	2,000	323.00	646,000
山形銀行	1,000	434.00	434,000
岩手銀行	400	4,045.00	1,618,000
東邦銀行	14,000	370.00	5,180,000
みちのく銀行	4,000	205.00	820,000
ふくおかフィナンシャルグループ	15,000	440.00	6,600,000
静岡銀行	3,000	836.00	2,508,000
十六銀行	5,000	300.00	1,500,000
スルガ銀行	800	2,435.00	1,948,000
八十二銀行	4,600	539.00	2,479,400
山梨中央銀行	3,000	479.00	1,437,000
大垣共立銀行	3,000	349.00	1,047,000

福井銀行	4,000	270.00	1,080,000
北國銀行	5,000	325.00	1,625,000
滋賀銀行	2,000	509.00	1,018,000
南都銀行	400	3,825.00	1,530,000
百五銀行	4,000	386.00	1,544,000
京都銀行	2,000	762.00	1,524,000
紀陽銀行	1,400	1,646.00	2,304,400
ほくほくフィナンシャルグループ	2,000	1,410.00	2,820,000
広島銀行	5,000	428.00	2,140,000
山陰合同銀行	1,900	712.00	1,352,800
中国銀行	2,400	1,259.00	3,021,600
伊予銀行	1,600	611.00	977,600
百十四銀行	3,000	328.00	984,000
四国銀行	5,000	233.00	1,165,000
阿波銀行	2,000	656.00	1,312,000
大分銀行	3,000	376.00	1,128,000
宮崎銀行	2,000	284.00	568,000
佐賀銀行	3,000	270.00	810,000
十八銀行	3,000	315.00	945,000
沖縄銀行	300	3,330.00	999,000
琉球銀行	1,000	1,280.00	1,280,000
セブン銀行	2,400	321.00	770,400
みずほフィナンシャルグループ	465,400	173.20	80,607,280
山口フィナンシャルグループ	3,000	1,082.00	3,246,000
名古屋銀行	200	3,635.00	727,000
北洋銀行	8,700	367.00	3,192,900
愛知銀行	100	5,170.00	517,000
愛媛銀行	1,400	1,329.00	1,860,600
みなと銀行	300	1,755.00	526,500
京葉銀行	2,000	440.00	880,000
関西アーバン銀行	500	1,099.00	549,500
東和銀行	8,000	95.00	760,000
トモニホールディングス	2,800	496.00	1,388,800
フィデアホールディングス	7,200	168.00	1,209,600
池田泉州ホールディングス	3,500	463.00	1,620,500
SBIホールディングス	700	1,214.00	849,800

大和証券グループ本社	39,000	590.80	23,041,200
野村ホールディングス	15,200	469.20	7,131,840
SOMPOホールディングス	1,600	3,312.00	5,299,200
MS&ADインシュアランスグループホール	2,700	2,909.00	7,854,300
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,400	1,415.00	3,396,000
第一生命ホールディングス	10,900	1,473.50	16,061,150
東京海上ホールディングス	3,100	4,053.00	12,564,300
T&Dホールディングス	5,300	1,204.50	6,383,850
クレディセゾン	400	1,740.00	696,000
アイフル	1,800	305.00	549,000
イオンフィナンシャルサービス	400	1,836.00	734,400
オリックス	5,900	1,460.00	8,614,000
三菱UFJリース	1,300	479.00	622,700
日本取引所グループ	600	1,621.00	972,600
野村不動産ホールディングス	700	1,606.00	1,124,200
東急不動産ホールディングス	1,000	533.00	533,000
飯田グループホールディングス	900	1,975.00	1,777,500
パーク24	300	3,215.00	964,500
三井不動産	2,000	2,089.00	4,178,000
三菱地所	3,000	1,877.00	5,631,000
東京建物	1,500	1,204.00	1,806,000
住友不動産	1,000	2,476.50	2,476,500
大京	3,000	188.00	564,000
レオパレス21	1,600	652.00	1,043,200
イオンモール	400	1,456.00	582,400
アコーディア・ゴルフ	1,100	1,026.00	1,128,600
GCA	600	776.00	465,600
テンプホールディングス	400	1,785.00	714,000
総合警備保障	100	5,270.00	527,000
ディー・エヌ・エー	800	3,465.00	2,772,000
博報堂DYホールディングス	1,700	1,189.00	2,021,300
電通	700	5,100.00	3,570,000
みらかホールディングス	300	5,040.00	1,512,000
オリエンタルランド	400	6,045.00	2,418,000
ダスキン	500	1,929.00	964,500

	ラウンドワン	1,200	686.00	823,200	
	ユー・エス・エス	700	1,716.00	1,201,200	
	サイバーエージェント	300	3,035.00	910,500	
	楽天	500	1,288.50	644,250	
	リクルートホールディングス	900	4,165.00	3,748,500	
	エイチ・アイ・エス	200	2,568.00	513,600	
	セコム	800	7,527.00	6,021,600	
	メイテック	100	3,510.00	351,000	
	アサツー ディ・ケイ	400	2,767.00	1,106,800	
	ベネッセホールディングス	600	2,686.00	1,611,600	
	小計	銘柄数 : 568		2,271,311,450	
		組入時価比率 : 98.3%		100.0%	
	合計			2,271,311,450	

(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 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。