

平成28年4月期（平成27年10月8日～平成28年4月7日）決算短信

平成28年5月18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6月30日  
 分配金支払開始日 平成28年5月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年4月期の運用状況（平成27年10月8日～平成28年4月7日）

(1)資産内訳 (百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
平成28年4月期	6,099	(97.3)	170	(2.7)	6,270	(100)
平成27年10月期	7,615	(98.3)	134	(1.7)	7,749	(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4月期	449	0	0	449
平成27年10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4月期	6,378	108	6,270	13,946
平成27年10月期	7,833	83	7,749	17,236

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成28年4月期	168.00
平成27年10月期	145.00

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 4 期 (平成 27 年 10 月 7 日現在)	第 5 期 (平成 28 年 4 月 7 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	-	113,170,202
コール・ローン	75,107,257	8,790,277
株式	7,615,604,670	6,099,559,800
派生商品評価勘定	3,935,211	-
未収入金	65,642,100	54,944,600
未収配当金	69,702,813	81,151,536
未収利息	144	-
差入委託証拠金	3,322,501	20,998,850
流動資産合計	7,833,314,696	6,378,615,265
資産合計	7,833,314,696	6,378,615,265
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	11,224,698
未払金	459,245	1,378,755
未払収益分配金	65,196,205	75,537,672
未払受託者報酬	2,218,144	1,994,111
未払委託者報酬	11,090,681	9,970,511
その他未払費用	4,405,351	7,957,166
流動負債合計	83,369,626	108,062,913
負債合計	83,369,626	108,062,913
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,993,104,941	5,993,104,941
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,756,840,129	277,447,411
(分配準備積立金)	247,490	14,708
元本等合計	7,749,945,070	6,270,552,352
純資産合計	7,749,945,070	6,270,552,352
負債純資産合計	7,833,314,696	6,378,615,265

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	82,992,876	91,220,228
受取利息	27,329	28,170

有価証券売買等損益	△174,527,926	△1,453,926,823
派生商品取引等損益	5,596,033	△25,233,113
その他収益	45,457	45,372
営業収益合計	△85,866,231	△1,387,866,166
営業費用		
受託者報酬	2,218,144	1,994,111
委託者報酬	11,090,681	9,970,511
その他費用	4,407,646	4,024,258
営業費用合計	17,716,471	15,988,880
営業利益又は営業損失(△)	△103,582,702	△1,403,855,046
経常利益又は経常損失(△)	△103,582,702	△1,403,855,046
当期純利益又は当期純損失(△)	△103,582,702	△1,403,855,046
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(△)	1,925,619,036	1,756,840,129
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	-	-
分配金	65,196,205	75,537,672
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,756,840,129	277,447,411

## (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 27 年 10 月 8 日から平成 28 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 4 期 平成 27 年 10 月 7 日現在	第 5 期 平成 28 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 449,629 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 449,629 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 17,236 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 13,946 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日
----------------------------	-----------------------------

至 平成 27 年 10 月 7 日			至 平成 28 年 4 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	83,065,662 円	当期配当等収益額	A	91,293,770 円
分配準備積立金	B	94,504 円	分配準備積立金	B	247,490 円
配当等収益合計額	C=A+B	83,160,166 円	配当等収益合計額	C=A+B	91,541,260 円
経費	D	17,716,471 円	経費	D	15,988,880 円
収益分配可能額	E=C-D	65,443,695 円	収益分配可能額	E=C-D	75,552,380 円
収益分配金	F	65,196,205 円	収益分配金	F	75,537,672 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	247,490 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	14,708 円
口数	H	449,629 口	口数	H	449,629 口
1口当たり分配金	I=F/H	145 円	1口当たり分配金	I=F/H	168 円
2. その他費用 その他費用のうち 4,013,375 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 3,589,344 円は、対象指数についての商標使用料であります。		

(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 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 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価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○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っております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 4 期 平成 27 年 10 月 7 日現在	第 5 期 平成 28 年 4 月 7 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</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p>

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。	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 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 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。	同左

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 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 0 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 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	△170,663,782	△1,460,373,403
合計	△170,663,782	△1,460,373,403

## 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 4 期(平成 27 年 10 月 7 日現在)				第 5 期(平成 28 年 4 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	124,840,501	—	128,785,000	3,935,211	178,170,050	—	166,959,500	△11,224,698
合計	124,840,501	—	128,785,000	3,935,211	178,170,050	—	166,959,500	△11,224,698

## (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 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	6,700	579.00	3,879,300	
		国際石油開発帝石	20,400	794.00	16,197,600	
		石油資源開発	900	2,320.00	2,088,000	
		ミライト・ホールディングス	1,900	868.00	1,649,200	
		コムシスホールディングス	3,000	1,644.00	4,932,000	
		ミサワホーム	2,700	703.00	1,898,100	
		大成建設	14,000	721.00	10,094,000	
		大林組	7,600	1,061.00	8,063,600	
		清水建設	7,000	949.00	6,643,000	
		長谷工コーポレーション	5,000	989.00	4,945,000	
		鹿島建設	12,000	672.00	8,064,000	
		西松建設	4,000	472.00	1,888,000	
		前田建設工業	2,000	788.00	1,576,000	
		奥村組	3,000	545.00	1,635,000	
		戸田建設	4,000	511.00	2,044,000	
		大東建託	2,200	16,460.00	36,212,000	
		N I P P O	1,000	1,745.00	1,745,000	
		前田道路	1,000	1,864.00	1,864,000	
		住友林業	3,800	1,254.00	4,765,200	
		パナホーム	2,000	801.00	1,602,000	
		大和ハウス工業	6,800	3,021.00	20,542,800	
		積水ハウス	9,900	1,853.50	18,349,650	
		関電工	2,000	783.00	1,566,000	
		きんでん	3,100	1,300.00	4,030,000	
		協和エクシオ	2,600	1,189.00	3,091,400	
		日揮	5,000	1,610.00	8,050,000	
		千代田化工建設	2,000	782.00	1,564,000	
		日本製粉	3,000	847.00	2,541,000	
		日清製粉グループ本社	3,100	1,728.00	5,356,800	
		江崎グリコ	400	5,510.00	2,204,000	
山崎製パン	2,000	2,278.00	4,556,000			

カルビー	500	4,125.00	2,062,500
森永乳業	7,000	596.00	4,172,000
ヤクルト本社	700	4,750.00	3,325,000
明治ホールディングス	1,100	8,820.00	9,702,000
雪印メグミルク	1,100	2,726.00	2,998,600
日本ハム	4,000	2,349.00	9,396,000
丸大食品	4,000	422.00	1,688,000
伊藤ハム米久ホールディングス	3,200	775.00	2,480,000
サッポロホールディングス	6,000	547.00	3,282,000
アサヒグループホールディングス	5,500	3,339.00	18,364,500
キリンホールディングス	19,800	1,524.00	30,175,200
宝ホールディングス	2,600	888.00	2,308,800
コカ・コーラウエスト	2,000	2,742.00	5,484,000
コカ・コーライーストジャパン	1,300	1,731.00	2,250,300
サントリー食品インターナショナル	1,400	4,785.00	6,699,000
伊藤園	1,500	3,495.00	5,242,500
日清オイリオグループ	5,000	436.00	2,180,000
不二製油グループ本社	1,400	2,009.00	2,812,600
キッコーマン	1,000	3,520.00	3,520,000
味の素	8,400	2,500.00	21,000,000
キューピー	1,700	2,791.00	4,744,700
ハウス食品グループ本社	1,200	2,015.00	2,418,000
カゴメ	1,000	2,200.00	2,200,000
ニチレイ	5,000	938.00	4,690,000
東洋水産	1,400	3,895.00	5,453,000
日清食品ホールディングス	900	5,100.00	4,590,000
日本たばこ産業	15,500	4,561.00	70,695,500
グンゼ	4,000	304.00	1,216,000
東洋紡	21,000	184.00	3,864,000
帝人	22,000	366.00	8,052,000
東レ	20,000	906.50	18,130,000
ワコールホールディングス	2,000	1,315.00	2,630,000
T S I ホールディングス	2,100	687.00	1,442,700
オンワードホールディングス	3,000	724.00	2,172,000
王子ホールディングス	17,000	418.00	7,106,000
日本製紙	3,500	1,921.00	6,723,500

北越紀州製紙	3,200	644.00	2,060,800
大王製紙	1,800	907.00	1,632,600
レンゴー	7,000	565.00	3,955,000
クラレ	7,000	1,275.00	8,925,000
旭化成	29,000	709.60	20,578,400
昭和電工	57,000	106.00	6,042,000
住友化学	32,000	456.00	14,592,000
日産化学工業	1,400	2,798.00	3,917,200
クレハ	4,000	336.00	1,344,000
日本曹達	2,000	497.00	994,000
東ソー	9,000	438.00	3,942,000
トクヤマ	15,000	157.00	2,355,000
セントラル硝子	4,000	574.00	2,296,000
東亜合成	3,100	878.00	2,721,800
デンカ	11,000	450.00	4,950,000
信越化学工業	5,100	5,707.00	29,105,700
エア・ウォーター	3,000	1,538.00	4,614,000
大陽日酸	1,800	963.00	1,733,400
日本触媒	400	5,330.00	2,132,000
カネカ	5,000	932.00	4,660,000
三菱瓦斯化学	9,000	559.00	5,031,000
三井化学	20,000	326.00	6,520,000
J S R	4,200	1,493.00	6,270,600
東京応化工業	500	2,657.00	1,328,500
三菱ケミカルホールディングス	42,300	523.70	22,152,510
ダイセル	4,000	1,434.00	5,736,000
住友ベークライト	5,000	423.00	2,115,000
積水化学工業	9,500	1,327.00	12,606,500
日本ゼオン	3,000	665.00	1,995,000
アイカ工業	700	2,198.00	1,538,600
宇部興産	33,000	185.00	6,105,000
日立化成	2,400	1,788.00	4,291,200
日本化薬	3,000	1,072.00	3,216,000
ADEKA	1,400	1,514.00	2,119,600
日油	3,000	773.00	2,319,000
花王	6,300	5,650.00	35,595,000



日本ペイントホールディングス	1,000	2,311.00	2,311,000
関西ペイント	2,000	1,793.00	3,586,000
D I C	18,000	240.00	4,320,000
東洋インキ S C ホールディングス	5,000	418.00	2,090,000
富士フイルムホールディングス	7,900	4,074.00	32,184,600
資生堂	4,300	2,394.50	10,296,350
ライオン	2,000	1,351.00	2,702,000
コーセー	200	10,720.00	2,144,000
小林製薬	200	9,240.00	1,848,000
日東電工	2,100	5,728.00	12,028,800
ニフコ	500	5,090.00	2,545,000
ユニ・チャーム	3,500	2,346.50	8,212,750
協和発酵キリン	2,600	1,768.00	4,596,800
武田薬品工業	11,600	5,155.00	59,798,000
アステラス製薬	27,800	1,420.50	39,489,900
大日本住友製薬	2,100	1,330.00	2,793,000
塩野義製薬	2,400	5,230.00	12,552,000
田辺三菱製薬	2,600	1,909.00	4,963,400
中外製薬	1,300	3,365.00	4,374,500
科研製薬	300	6,770.00	2,031,000
エーザイ	2,800	6,850.00	19,180,000
ロート製薬	1,200	1,960.00	2,352,000
小野薬品工業	2,100	4,892.00	10,273,200
久光製薬	700	4,940.00	3,458,000
持田製薬	200	8,010.00	1,602,000
参天製薬	3,000	1,630.00	4,890,000
ツムラ	900	2,681.00	2,412,900
沢井製薬	300	6,820.00	2,046,000
第一三共	10,700	2,514.50	26,905,150
キョーリン製薬ホールディングス	1,000	2,099.00	2,099,000
大塚ホールディングス	6,700	3,986.00	26,706,200
大正製薬ホールディングス	400	8,640.00	3,456,000
昭和シェル石油	8,200	937.00	7,683,400
東燃ゼネラル石油	7,000	936.00	6,552,000
出光興産	5,500	1,863.00	10,246,500
J Xホールディングス	155,700	420.60	65,487,420

コスモエネルギーホールディングス	2,700	1,249.00	3,372,300
横浜ゴム	2,200	1,708.00	3,757,600
東洋ゴム工業	1,200	1,475.00	1,770,000
ブリヂストン	9,700	3,916.00	37,985,200
住友ゴム工業	3,900	1,588.00	6,193,200
旭硝子	30,000	561.00	16,830,000
日本板硝子	46,000	79.00	3,634,000
日本電気硝子	14,000	539.00	7,546,000
住友大阪セメント	8,000	449.00	3,592,000
太平洋セメント	21,000	252.00	5,292,000
東海カーボン	6,000	242.00	1,452,000
TOTO	1,600	3,325.00	5,320,000
日本碍子	2,000	1,831.00	3,662,000
日本特殊陶業	1,700	1,889.00	3,211,300
新日鐵住金	20,000	2,041.00	40,820,000
神戸製鋼所	99,000	96.00	9,504,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	16,900	1,458.00	24,640,200
日新製鋼	2,600	1,266.00	3,291,600
大和工業	700	2,366.00	1,656,200
丸一鋼管	700	2,942.00	2,059,400
大同特殊鋼	9,000	364.00	3,276,000
愛知製鋼	3,000	400.00	1,200,000
日立金属	2,500	1,094.00	2,735,000
日本軽金属ホールディングス	11,900	169.00	2,011,100
三井金属鉱業	20,000	166.00	3,320,000
三菱マテリアル	30,000	296.00	8,880,000
住友金属鉱山	12,000	1,048.50	12,582,000
DOWAホールディングス	4,000	616.00	2,464,000
古河電気工業	29,000	235.00	6,815,000
住友電気工業	17,500	1,245.00	21,787,500
フジクラ	9,000	506.00	4,554,000
東洋製罐グループホールディングス	3,400	1,941.00	6,599,400
三和ホールディングス	3,100	812.00	2,517,200
三協立山	1,000	1,433.00	1,433,000
LIXILグループ	5,400	2,206.00	11,912,400

リンナイ	400	9,630.00	3,852,000
日本発條	4,000	963.00	3,852,000
日本製鋼所	6,000	331.00	1,986,000
オークマ	2,000	746.00	1,492,000
アマダホールディングス	4,700	1,026.00	4,822,200
オーエスジー	900	1,888.00	1,699,200
DMG 森精機	1,300	1,005.00	1,306,500
ディスコ	200	9,190.00	1,838,000
ナブテスコ	1,700	2,316.00	3,937,200
S M C	400	24,175.00	9,670,000
小松製作所	21,400	1,742.50	37,289,500
住友重機械工業	13,000	415.00	5,395,000
日立建機	3,100	1,655.00	5,130,500
クボタ	10,000	1,350.50	13,505,000
荏原製作所	10,000	464.00	4,640,000
ダイキン工業	2,200	8,015.00	17,633,000
栗田工業	2,000	2,423.00	4,846,000
椿本チエイン	2,000	635.00	1,270,000
ダイフク	1,000	1,865.00	1,865,000
フジテック	1,500	1,093.00	1,639,500
平和	1,200	2,270.00	2,724,000
SANKYO	1,300	4,035.00	5,245,500
グローリー	900	3,660.00	3,294,000
セガサミーホールディングス	7,100	1,152.00	8,179,200
ホシザキ電機	200	9,250.00	1,850,000
日本精工	5,800	875.00	5,075,000
N T N	7,000	300.00	2,100,000
ジェイテクト	3,700	1,298.00	4,802,600
T H K	1,800	2,004.00	3,607,200
マキタ	1,100	6,570.00	7,227,000
日立造船	3,300	494.00	1,630,200
三菱重工業	54,000	377.60	20,390,400
I H I	24,000	199.00	4,776,000
日清紡ホールディングス	2,800	1,072.00	3,001,600
イビデン	3,800	1,297.00	4,928,600
コニカミノルタ	10,200	883.00	9,006,600

ブラザー工業	5,600	1,215.00	6,804,000
ミネベア	3,000	769.00	2,307,000
日立製作所	127,000	468.50	59,499,500
東芝	112,000	202.30	22,657,600
三菱電機	35,000	1,090.50	38,167,500
富士電機	12,000	356.00	4,272,000
安川電機	2,600	1,250.00	3,250,000
東芝テック	5,000	420.00	2,100,000
マブチモーター	400	4,715.00	1,886,000
日本電産	1,500	7,262.00	10,893,000
JVCケンウッド	5,400	265.00	1,431,000
オムロン	3,200	3,115.00	9,968,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	6,000	465.00	2,790,000
日本電気	54,000	266.00	14,364,000
富士通	49,000	369.50	18,105,500
沖電気工業	16,000	141.00	2,256,000
セイコーエプソン	4,600	1,680.00	7,728,000
ジャパニディスプレイ	6,700	203.00	1,360,100
パナソニック	68,300	879.20	60,049,360
シャープ	37,000	126.00	4,662,000
アンリツ	2,800	563.00	1,576,400
ソニー	19,100	2,820.00	53,862,000
TDK	2,700	5,720.00	15,444,000
ミツミ電機	3,800	453.00	1,721,400
アルプス電気	1,600	1,673.00	2,676,800
パイオニア	8,400	306.00	2,570,400
ホンデン	3,500	656.00	2,296,000
ヒロセ電機	300	12,090.00	3,627,000
日本航空電子工業	1,000	1,130.00	1,130,000
日立マクセル	1,500	1,619.00	2,428,500
アルパイン	1,400	1,129.00	1,580,600
横河電機	2,900	1,076.00	3,120,400
アズビル	1,100	2,835.00	3,118,500
日本光電工業	1,000	2,655.00	2,655,000
堀場製作所	400	3,950.00	1,580,000

アドバンテスト	2,200	953.00	2,096,600
キーエンス	100	59,990.00	5,999,000
シスメックス	400	6,690.00	2,676,000
スタンレー電気	2,100	2,226.00	4,674,600
ウシオ電機	1,600	1,390.00	2,224,000
カシオ計算機	2,300	2,081.00	4,786,300
ファナック	1,200	16,500.00	19,800,000
ローム	1,500	4,310.00	6,465,000
浜松ホトニクス	1,000	3,025.00	3,025,000
新光電気工業	2,300	586.00	1,347,800
京セラ	4,400	4,630.00	20,372,000
太陽誘電	1,800	1,017.00	1,830,600
村田製作所	1,300	12,690.00	16,497,000
小糸製作所	1,000	4,670.00	4,670,000
S C R E E Nホールディングス	3,000	836.00	2,508,000
キヤノン	28,900	3,131.00	90,485,900
リコー	15,800	1,057.00	16,700,600
東京エレクトロン	2,200	6,778.00	14,911,600
トヨタ紡織	1,200	1,753.00	2,103,600
ユニプレス	1,300	1,747.00	2,271,100
豊田自動織機	2,200	4,545.00	9,999,000
デンソー	7,000	4,006.00	28,042,000
東海理化電機製作所	1,200	1,847.00	2,216,400
三井造船	21,000	148.00	3,108,000
川崎重工業	23,000	281.00	6,463,000
日産自動車	49,100	946.20	46,458,420
いすゞ自動車	11,900	1,046.50	12,453,350
トヨタ自動車	31,400	5,424.00	170,313,600
日野自動車	5,300	1,084.00	5,745,200
三菱自動車工業	23,000	787.00	18,101,000
日産車体	2,400	989.00	2,373,600
新明和工業	1,000	702.00	702,000
日信工業	1,200	1,359.00	1,630,800
タチエス	1,300	1,472.00	1,913,600
NOK	1,400	1,673.00	2,342,200
フタバ産業	3,900	411.00	1,602,900

K Y B	8,000	310.00	2,480,000
プレス工業	3,700	356.00	1,317,200
カルソニックカンセイ	4,000	710.00	2,840,000
ケーヒン	1,500	1,464.00	2,196,000
アイシン精機	5,100	4,000.00	20,400,000
マツダ	7,100	1,463.50	10,390,850
ダイハツ工業	7,400	1,428.00	10,567,200
本田技研工業	36,200	2,852.00	103,242,400
スズキ	5,500	2,910.00	16,005,000
富士重工業	4,900	3,398.00	16,650,200
ヤマハ発動機	3,600	1,634.00	5,882,400
ショーワ	2,700	879.00	2,373,300
エクセディ	600	2,191.00	1,314,600
豊田合成	1,900	1,927.00	3,661,300
日本精機	1,000	1,874.00	1,874,000
エフ・シー・シー	800	1,680.00	1,344,000
シマノ	400	17,040.00	6,816,000
テイ・エス テック	1,200	2,376.00	2,851,200
テルモ	2,200	3,985.00	8,767,000
島津製作所	2,000	1,622.00	3,244,000
ニコン	8,500	1,638.00	13,923,000
オリンパス	1,500	4,120.00	6,180,000
HOYA	4,700	4,132.00	19,420,400
シチズンホールディングス	4,200	590.00	2,478,000
ニプロ	2,400	1,014.00	2,433,600
バンダイナムコホールディングス	2,900	2,338.00	6,780,200
トッパン・フォームズ	1,100	1,154.00	1,269,400
凸版印刷	14,000	899.00	12,586,000
大日本印刷	17,000	945.00	16,065,000
アシックス	1,000	1,895.00	1,895,000
ヤマハ	1,600	3,280.00	5,248,000
リンテック	1,000	1,901.00	1,901,000
任天堂	1,000	15,530.00	15,530,000
コクヨ	1,600	1,300.00	2,080,000
東京電力ホールディングス	53,600	582.00	31,195,200
中部電力	16,800	1,473.50	24,754,800

関西電力	16,900	975.20	16,480,880
中国電力	7,200	1,412.00	10,166,400
北陸電力	5,100	1,502.00	7,660,200
東北電力	9,000	1,365.00	12,285,000
四国電力	3,500	1,459.00	5,106,500
九州電力	5,400	1,086.00	5,864,400
北海道電力	4,100	927.00	3,800,700
沖縄電力	800	2,790.00	2,232,000
電源開発	2,400	3,275.00	7,860,000
東京瓦斯	54,000	480.60	25,952,400
大阪瓦斯	44,000	397.60	17,494,400
東邦瓦斯	8,000	748.00	5,984,000
東武鉄道	23,000	546.00	12,558,000
相鉄ホールディングス	4,000	689.00	2,756,000
東京急行電鉄	12,000	943.00	11,316,000
京浜急行電鉄	3,000	962.00	2,886,000
小田急電鉄	5,000	1,186.00	5,930,000
京王電鉄	5,000	957.00	4,785,000
京成電鉄	2,000	1,527.00	3,054,000
東日本旅客鉄道	4,300	9,407.00	40,450,100
西日本旅客鉄道	2,600	6,400.00	16,640,000
東海旅客鉄道	1,500	18,895.00	28,342,500
西日本鉄道	4,000	706.00	2,824,000
近鉄グループホールディングス	20,000	446.00	8,920,000
阪急阪神ホールディングス	15,000	688.00	10,320,000
南海電気鉄道	5,000	587.00	2,935,000
京阪ホールディングス	4,000	799.00	3,196,000
名古屋鉄道	14,000	546.00	7,644,000
日本通運	24,000	470.00	11,280,000
ヤマトホールディングス	6,800	2,087.50	14,195,000
山九	6,000	470.00	2,820,000
ニッコンホールディングス	800	1,921.00	1,536,800
セイノーホールディングス	3,500	1,122.00	3,927,000
日立物流	1,100	1,875.00	2,062,500
日本郵船	57,000	203.00	11,571,000
商船三井	30,000	221.00	6,630,000

川崎汽船	36,000	208.00	7,488,000
日本航空	5,800	4,004.00	23,223,200
ANAホールディングス	59,000	305.10	18,000,900
三菱倉庫	1,000	1,357.00	1,357,000
上組	4,000	996.00	3,984,000
近鉄エクスプレス	900	1,330.00	1,197,000
ITホールディングス	1,500	2,459.00	3,688,500
グリー	3,500	578.00	2,023,000
ネクソン	1,100	1,802.00	1,982,200
野村総合研究所	1,000	3,750.00	3,750,000
フジ・メディア・ホールディングス	5,000	1,179.00	5,895,000
オービック	300	5,710.00	1,713,000
ヤフー	9,000	455.00	4,095,000
トレンドマイクロ	1,200	3,845.00	4,614,000
日本オラクル	500	5,890.00	2,945,000
伊藤忠テクノソリューションズ	900	1,974.00	1,776,600
大塚商会	700	5,390.00	3,773,000
ネットワンシステムズ	3,600	548.00	1,972,800
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,300	1,419.00	1,844,700
東京放送ホールディングス	1,500	1,611.00	2,416,500
日本テレビホールディングス	2,300	1,770.00	4,071,000
テレビ朝日ホールディングス	1,100	1,914.00	2,105,400
スカパーJ SATホールディングス	3,300	619.00	2,042,700
日本電信電話	51,600	4,739.00	244,532,400
KDDI	31,200	2,991.50	93,334,800
光通信	300	8,200.00	2,460,000
NTTドコモ	32,400	2,547.50	82,539,000
カドカワ	1,000	1,556.00	1,556,000
東宝	1,000	2,842.00	2,842,000
エヌ・ティ・ティ・データ	2,000	5,320.00	10,640,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	600	2,798.00	1,678,800
SCSK	600	4,210.00	2,526,000
コナミホールディングス	1,400	3,395.00	4,753,000
ソフトバンクグループ	10,000	5,604.00	56,040,000
あらた	700	2,337.00	1,635,900



双日	78,700	209.00	16,448,300
アルフレッサ ホールディングス	4,700	2,085.00	9,799,500
ダイワボウホールディングス	9,000	201.00	1,809,000
シップヘルスケアホールディングス	700	2,761.00	1,932,700
三菱食品	600	2,728.00	1,636,800
第一興商	700	4,635.00	3,244,500
メディパルホールディングス	5,100	1,709.00	8,715,900
黒田電気	800	1,608.00	1,286,400
伊藤忠商事	55,600	1,317.50	73,253,000
丸紅	73,200	533.90	39,081,480
長瀬産業	3,600	1,153.00	4,150,800
豊田通商	8,000	2,331.00	18,648,000
兼松	16,000	152.00	2,432,000
三井物産	67,500	1,234.00	83,295,000
日立ハイテクノロジーズ	1,400	3,015.00	4,221,000
カメイ	1,600	1,020.00	1,632,000
住友商事	42,400	1,073.50	45,516,400
三菱商事	57,800	1,775.50	102,623,900
キヤノンマーケティングジャパン	1,500	1,829.00	2,743,500
阪和興業	10,000	449.00	4,490,000
岩谷産業	5,000	607.00	3,035,000
三愛石油	3,700	776.00	2,871,200
稲畑産業	1,800	1,025.00	1,845,000
東邦ホールディングス	1,600	2,262.00	3,619,200
サンゲツ	1,200	1,952.00	2,342,400
伊藤忠エネクス	2,700	858.00	2,316,600
サンリオ	600	2,021.00	1,212,600
リョーサン	1,100	2,592.00	2,851,200
三信電気	1,400	850.00	1,190,000
PAL TAC	1,300	1,942.00	2,524,600
日鉄住金物産	7,000	345.00	2,415,000
オートバックスセブン	2,000	1,817.00	3,634,000
加藤産業	900	2,657.00	2,391,300
因幡電機産業	600	3,385.00	2,031,000
ミスミグループ本社	1,600	1,497.00	2,395,200
スズケン	2,100	3,720.00	7,812,000

ローソン	900	9,010.00	8,109,000
ゲオホールディングス	1,100	1,918.00	2,109,800
アダストリア	500	3,965.00	1,982,500
日本マクドナルドホールディングス	1,000	2,671.00	2,671,000
エディオン	4,900	837.00	4,101,300
ビックカメラ	1,600	973.00	1,556,800
DCMホールディングス	3,700	757.00	2,800,900
J. フロント リテイリング	4,000	1,351.00	5,404,000
マツモトキヨシホールディングス	800	5,690.00	4,552,000
ココカラファイン	400	4,865.00	1,946,000
三越伊勢丹ホールディングス	5,300	1,157.00	6,132,100
すかいらーく	1,600	1,372.00	2,195,200
セブン&アイ・ホールディングス	12,400	4,489.00	55,663,600
ツルハホールディングス	400	10,940.00	4,376,000
良品計画	100	23,460.00	2,346,000
コーナン商事	1,100	1,553.00	1,708,300
ドンキホーテホールディングス	1,100	3,630.00	3,993,000
ゼンショーホールディングス	1,800	1,326.00	2,386,800
スギホールディングス	500	5,650.00	2,825,000
ファミリーマート	1,000	5,640.00	5,640,000
島忠	1,100	2,570.00	2,827,000
コメリ	800	2,172.00	1,737,600
青山商事	1,100	4,025.00	4,427,500
しまむら	400	14,220.00	5,688,000
高島屋	7,000	842.00	5,894,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,800	1,806.00	3,250,800
丸井グループ	3,200	1,475.00	4,720,000
イオン	17,300	1,499.50	25,941,350
ユニグループ・ホールディングス	11,200	768.00	8,601,600
イズミ	600	4,685.00	2,811,000
平和堂	700	2,238.00	1,566,600
ケーズホールディングス	1,400	3,575.00	5,005,000
ヤマダ電機	27,300	557.00	15,206,100
ニトリホールディングス	600	10,220.00	6,132,000
吉野家ホールディングス	1,600	1,318.00	2,108,800
アークス	1,100	2,528.00	2,780,800

バローホールディングス	900	2,687.00	2,418,300
ファーストリテイリング	200	30,490.00	6,098,000
サンドラッグ	500	8,030.00	4,015,000
じもとホールディングス	18,800	135.00	2,538,000
足利ホールディングス	5,500	300.00	1,650,000
東京T Yフィナンシャルグループ	1,700	2,469.00	4,197,300
九州フィナンシャルグループ	12,200	569.00	6,941,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	46,705	470.10	21,956,020
新生銀行	15,000	134.00	2,010,000
あおぞら銀行	30,000	359.00	10,770,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	326,500	482.80	157,634,200
りそなホールディングス	315,300	372.60	117,480,780
三井住友トラスト・ホールディングス	126,000	304.30	38,341,800
三井住友フィナンシャルグループ	100,400	3,121.00	313,348,400
第四銀行	8,000	359.00	2,872,000
北越銀行	11,000	171.00	1,881,000
西日本シティ銀行	19,000	184.00	3,496,000
千葉銀行	14,000	513.00	7,182,000
常陽銀行	15,000	358.00	5,370,000
群馬銀行	6,000	427.00	2,562,000
武蔵野銀行	800	2,660.00	2,128,000
千葉興業銀行	4,800	445.00	2,136,000
筑波銀行	5,700	277.00	1,578,900
七十七銀行	25,000	364.00	9,100,000
青森銀行	8,000	306.00	2,448,000
秋田銀行	7,000	275.00	1,925,000
山形銀行	4,000	394.00	1,576,000
岩手銀行	1,100	3,765.00	4,141,500
東邦銀行	41,000	330.00	13,530,000
みちのく銀行	12,000	170.00	2,040,000
ふくおかフィナンシャルグループ	42,000	337.00	14,154,000
静岡銀行	7,000	745.00	5,215,000
十六銀行	14,000	307.00	4,298,000
スルガ銀行	2,400	1,807.00	4,336,800

八十二銀行	13,300	449.00	5,971,700
山梨中央銀行	8,000	385.00	3,080,000
大垣共立銀行	9,000	319.00	2,871,000
福井銀行	10,000	196.00	1,960,000
北國銀行	14,000	272.00	3,808,000
滋賀銀行	6,000	448.00	2,688,000
南都銀行	11,000	288.00	3,168,000
百五銀行	13,000	384.00	4,992,000
京都銀行	6,000	662.00	3,972,000
紀陽銀行	4,000	1,199.00	4,796,000
ほくほくフィナンシャルグループ	56,000	136.00	7,616,000
広島銀行	16,000	371.00	5,936,000
山陰合同銀行	5,600	656.00	3,673,600
中国銀行	7,000	1,051.00	7,357,000
伊予銀行	4,600	660.00	3,036,000
百十四銀行	7,000	297.00	2,079,000
四国銀行	15,000	203.00	3,045,000
阿波銀行	5,000	503.00	2,515,000
大分銀行	8,000	329.00	2,632,000
宮崎銀行	6,000	263.00	1,578,000
佐賀銀行	9,000	203.00	1,827,000
十八銀行	8,000	222.00	1,776,000
沖縄銀行	600	3,340.00	2,004,000
琉球銀行	3,000	1,172.00	3,516,000
セブン銀行	6,900	452.00	3,118,800
みずほフィナンシャルグループ	1,344,300	152.90	205,543,470
山口フィナンシャルグループ	8,000	949.00	7,592,000
名古屋銀行	5,000	346.00	1,730,000
北洋銀行	25,200	257.00	6,476,400
愛知銀行	300	4,280.00	1,284,000
愛媛銀行	21,000	223.00	4,683,000
みなの銀行	8,000	145.00	1,160,000
京葉銀行	6,000	370.00	2,220,000
関西アーバン銀行	1,400	1,012.00	1,416,800
東和銀行	22,000	78.00	1,716,000
トモニホールディングス	8,200	300.00	2,460,000

フィデアホールディングス	20,700	161.00	3,332,700
池田泉州ホールディングス	10,100	384.00	3,878,400
SBIホールディングス	2,100	1,060.00	2,226,000
大和証券グループ本社	111,000	643.70	71,450,700
野村ホールディングス	43,800	447.00	19,578,600
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	4,700	2,927.50	13,759,250
MS&ADインシュアランスグループホール	7,700	2,869.50	22,095,150
ソニーフィナンシャルホールディングス	6,900	1,324.00	9,135,600
第一生命保険	31,400	1,225.00	38,465,000
東京海上ホールディングス	9,000	3,473.00	31,257,000
T&Dホールディングス	15,300	982.70	15,035,310
クレディセゾン	1,200	1,835.00	2,202,000
アイフル	5,100	366.00	1,866,600
イオンフィナンシャルサービス	1,300	2,422.00	3,148,600
オリックス	17,100	1,530.00	26,163,000
三菱UFJリース	3,600	465.00	1,674,000
日本取引所グループ	1,600	1,627.00	2,603,200
野村不動産ホールディングス	1,900	1,989.00	3,779,100
東急不動産ホールディングス	2,900	746.00	2,163,400
飯田グループホールディングス	2,500	2,109.00	5,272,500
パーク24	1,000	3,125.00	3,125,000
三井不動産	6,000	2,552.00	15,312,000
三菱地所	8,000	2,006.50	16,052,000
東京建物	4,200	1,350.00	5,670,000
住友不動産	2,000	3,043.00	6,086,000
大京	8,000	173.00	1,384,000
レオパレス21	4,800	651.00	3,124,800
イオンモール	1,300	1,545.00	2,008,500
アコーディア・ゴルフ	3,200	1,036.00	3,315,200
GCAサヴィアン	1,800	1,087.00	1,956,600
テンブホールディングス	1,000	1,654.00	1,654,000
総合警備保障	400	6,010.00	2,404,000
ディー・エヌ・エー	2,400	1,876.00	4,502,400
博報堂DYホールディングス	4,800	1,213.00	5,822,400

	電通	2,000	5,270.00	10,540,000	
	みらかホールディングス	900	4,545.00	4,090,500	
	オリエンタルランド	1,200	7,766.00	9,319,200	
	ダスキン	1,400	1,998.00	2,797,200	
	ラウンドワン	3,400	622.00	2,114,800	
	ユー・エス・エス	2,000	1,691.00	3,382,000	
	サイバーエージェント	400	5,030.00	2,012,000	
	楽天	1,400	1,183.00	1,656,200	
	リクルートホールディングス	2,500	3,285.00	8,212,500	
	エイチ・アイ・エス	400	3,035.00	1,214,000	
	セコム	2,400	7,906.00	18,974,400	
	メイテック	400	3,770.00	1,508,000	
	アサツー ディ・ケイ	1,100	2,703.00	2,973,300	
	ベネッセホールディングス	1,700	3,170.00	5,389,000	
	小計	銘柄数 : 578		6,099,559,800	
		組入時価比率 : 97.3%		100.0%	
	合計			6,099,559,800	

(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 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。