

平成29年7月期（平成28年7月11日～平成29年7月10日）決算短信

平成29年8月21日

上場取引所 東京・名古屋・
福岡・札幌

ファンド名 日経300株価指数連動型上場投資信託
 コード番号 (1319)
 連動対象指標 日経300指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 1000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9月28日
 分配金支払開始日 平成29年8月18日

I ファンドの運用状況

1. 平成29年7月期の運用状況（平成28年7月11日～平成29年7月10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29年7月期	10,918	(99.7)	31	(0.3)	10,949	(100)
平成28年7月期	8,298	(99.8)	18	(0.2)	8,317	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成29年7月期	34,632	0	0	34,632
平成28年7月期	46,534	0	11,902	34,632

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	100口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数) × 100
	百万円	百万円	百万円	円
平成29年7月期	11,150	200	10,949	31,618
平成28年7月期	8,532	215	8,317	24,017

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成29年7月期	511.20
平成28年7月期	553.40

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

日経 300 株価指数連動型上場投資信託

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 22 期 (平成 28 年 7 月 10 日現在)	第 23 期 (平成 29 年 7 月 10 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	219,194,863	217,549,353
株式	8,298,765,370	10,918,163,150
未収配当金	14,683,800	14,614,900
流動資産合計	8,532,644,033	11,150,327,403
資産合計	8,532,644,033	11,150,327,403
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	191,654,478	177,039,699
未払受託者報酬	4,501,016	4,488,590
未払委託者報酬	18,904,184	18,851,750
未払利息	1,801	312
その他未払費用	89,940	89,651
流動負債合計	215,151,419	200,470,002
負債合計	215,151,419	200,470,002
純資産の部		
元本等		
元本	8,380,987,318	8,380,987,318
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△63,494,704	2,568,870,083
(分配準備積立金)	27,763	22,716
元本等合計	8,317,492,614	10,949,857,401
純資産合計	8,317,492,614	10,949,857,401
負債純資産合計	8,532,644,033	11,150,327,403

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	第 23 期 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 7 月 10 日
営業収益		
受取配当金	242,979,215	224,236,788
受取利息	28,174	-
有価証券売買等損益	△2,835,359,711	2,632,369,834
その他収益	134,016	126,970
営業収益合計	△2,592,218,306	2,856,733,592
営業費用		
支払利息	33,275	57,135
受託者報酬	9,858,990	9,051,570
委託者報酬	41,407,515	38,015,974

その他費用	197,037	204,427
営業費用合計	51,496,817	47,329,106
営業利益又は営業損失(△)	△2,643,715,123	2,809,404,486
経常利益又は経常損失(△)	△2,643,715,123	2,809,404,486
当期純利益又は当期純損失(△)	△2,643,715,123	2,809,404,486
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(△)	3,522,108,953	△63,494,704
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	750,234,056	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	750,234,056	-
分配金	191,654,478	177,039,699
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△63,494,704	2,568,870,083

(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。
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。
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。
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 7 月 11 日から平成 29 年 7 月 10 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 22 期 平成 28 年 7 月 10 日現在	第 23 期 平成 29 年 7 月 10 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 34,632,179 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 34,632,179 口
2. 投資信託財産計算規則第 55 条の 6 第 1 項第 10 号に規定する額 元本の欠損 63,494,704 円	
3. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 240.17 円 (100 口当たり純資産額) (24,017 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 316.18 円 (100 口当たり純資産額) (31,618 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	第 23 期 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 7 月 10 日																															
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																															
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>243,108,130 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>37,653 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>243,145,783 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>51,463,542 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	243,108,130 円	分配準備積立金	B	37,653 円	配当等収益合計額	C=A+B	243,145,783 円	経費	D	51,463,542 円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>224,306,623 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>27,763 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>224,334,386 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>47,271,971 円</td> </tr> </tbody> </table>		項目			当期配当等収益額	A	224,306,623 円	分配準備積立金	B	27,763 円	配当等収益合計額	C=A+B	224,334,386 円	経費	D	47,271,971 円
項目																																
当期配当等収益額	A	243,108,130 円																														
分配準備積立金	B	37,653 円																														
配当等収益合計額	C=A+B	243,145,783 円																														
経費	D	51,463,542 円																														
項目																																
当期配当等収益額	A	224,306,623 円																														
分配準備積立金	B	27,763 円																														
配当等収益合計額	C=A+B	224,334,386 円																														
経費	D	47,271,971 円																														

収益分配可能額	E=C-D	191,682,241 円
収益分配金	F	191,654,478 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,763 円
口数	H	34,632,179 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	553 円 40 銭

収益分配可能額	E=C-D	177,062,415 円
収益分配金	F	177,039,699 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	22,716 円
口数	H	34,632,179 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	511 円 20 銭

2. 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 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	第 23 期 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 7 月 10 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、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。</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 22 期 平成 28 年 7 月 10 日現在	第 23 期 平成 29 年 7 月 10 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。 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</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

ります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	第 23 期 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 7 月 10 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 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	第 23 期 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 7 月 10 日
期首元本額 11,261,469,274 円	期首元本額 8,380,987,318 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 2,880,481,956 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 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	第 23 期 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 7 月 10 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	△2,636,563,609	2,602,070,748
合計	△2,636,563,609	2,602,070,748

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式(平成 29 年 7 月 10 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	8,500	638.00	5,423,000	
		マルハニチロ	1,400	2,915.00	4,081,000	
		サカタのタネ	1,300	3,495.00	4,543,500	
		ホクト	900	1,969.00	1,772,100	
		国際石油開発帝石	39,600	1,067.50	42,273,000	
		コムシスホールディングス	3,800	2,315.00	8,797,000	
		大成建設	31,000	1,038.00	32,178,000	
		大林組	19,500	1,322.00	25,779,000	
		清水建設	21,300	1,198.00	25,517,400	
		鹿島建設	29,000	967.00	28,043,000	
		西松建設	8,000	624.00	4,992,000	
		前田建設工業	5,000	1,333.00	6,665,000	

奥村組	6,000	754.00	4,524,000
戸田建設	9,000	711.00	6,399,000
大東建託	2,100	18,110.00	38,031,000
N I P P O	3,000	2,257.00	6,771,000
前田道路	3,000	2,310.00	6,930,000
住友林業	4,800	1,732.00	8,313,600
パナホーム	5,000	1,199.00	5,995,000
大和ハウス工業	18,000	3,850.00	69,300,000
積水ハウス	18,700	1,977.00	36,969,900
中電工	1,600	2,959.00	4,734,400
関電工	6,000	1,121.00	6,726,000
九電工	1,900	4,245.00	8,065,500
日揮	7,000	1,849.00	12,943,000
高砂熱学工業	2,200	1,820.00	4,004,000
日清製粉グループ本社		1,797.00	14,735,400
山崎製パン	6,000	2,206.00	13,236,000
ヤクルト本社	4,800	7,580.00	36,384,000
明治ホールディングス	4,100	8,940.00	36,654,000
雪印メグミルク	1,900	3,170.00	6,023,000
日本ハム	6,000	3,365.00	20,190,000
伊藤ハム米久ホールディングス	8,000	1,007.00	8,056,000
サッポロホールディングス	2,100	3,105.00	6,520,500
アサヒグループホールディングス	13,100	4,378.00	57,351,800
キリンホールディングス	24,700	2,344.00	57,896,800
宝ホールディングス	5,900	1,168.00	6,891,200
伊藤園	2,400	4,130.00	9,912,000
キッコーマン	5,700	3,565.00	20,320,500
味の素	15,500	2,368.50	36,711,750
キューピー	4,100	2,810.00	11,521,000
ハウス食品グループ本社	2,800	2,790.00	7,812,000
ニチレイ	3,800	3,230.00	12,274,000
日清食品ホールディングス	3,200	6,950.00	22,240,000
日本たばこ産業	36,100	3,857.00	139,237,700
東洋紡	24,000	212.00	5,088,000
帝人	5,300	2,199.00	11,654,700
東レ	44,100	956.10	42,164,010

ワコールホールディングス	4,000	1,515.00	6,060,000
オンワードホールディングス	5,000	785.00	3,925,000
王子ホールディングス	27,000	579.00	15,633,000
日本製紙	3,100	2,220.00	6,882,000
レンゴー	7,300	648.00	4,730,400
クラレ	9,600	2,135.00	20,496,000
旭化成	38,000	1,210.50	45,999,000
住友化学	45,000	647.00	29,115,000
デンカ	12,000	594.00	7,128,000
信越化学工業	11,700	9,965.00	116,590,500
大陽日酸	11,700	1,245.00	14,566,500
日本触媒	1,100	7,230.00	7,953,000
カネカ	9,000	871.00	7,839,000
三菱瓦斯化学	6,500	2,457.00	15,970,500
三井化学	28,000	605.00	16,940,000
東京応化工業	1,200	3,730.00	4,476,000
三菱ケミカルホールディングス	40,700	954.90	38,864,430
ダイセル	9,500	1,422.00	13,509,000
積水化学工業	13,500	2,000.00	27,000,000
宇部興産	29,000	293.00	8,497,000
日立化成	5,600	3,310.00	18,536,000
花王	13,400	6,702.00	89,806,800
日本ペイントホールディングス	8,800	4,160.00	36,608,000
D I C	2,600	4,235.00	11,011,000
東洋インキ S Cホールディングス	8,000	581.00	4,648,000
富士フイルムホールディングス	13,900	4,086.00	56,795,400
資生堂	10,800	3,887.00	41,979,600
ライオン	8,100	2,289.00	18,540,900
日東電工	4,700	9,712.00	45,646,400
ユニ・チャーム	16,800	2,828.50	47,518,800
協和発酵キリン	15,600	1,980.00	30,888,000
武田薬品工業	21,400	5,694.00	121,851,600
アステラス製薬	56,000	1,385.50	77,588,000
塩野義製薬	8,900	6,004.00	53,435,600
田辺三菱製薬	15,200	2,610.00	39,672,000
中外製薬	15,100	4,085.00	61,683,500

エーザイ	8,000	6,088.00	48,704,000
第一三共	19,200	2,512.00	48,230,400
大塚ホールディングス	15,100	4,745.00	71,649,500
大正製薬ホールディングス	2,400	8,450.00	20,280,000
昭和シェル石油	10,200	1,108.00	11,301,600
JXTGホールディングス	92,700	486.50	45,098,550
横浜ゴム	4,600	2,314.00	10,644,400
ブリヂストン	22,000	4,858.00	106,876,000
住友ゴム工業	7,100	2,012.00	14,285,200
旭硝子	6,400	4,845.00	31,008,000
日本板硝子	2,400	978.00	2,347,200
日本電気硝子	2,700	4,040.00	10,908,000
太平洋セメント	34,000	419.00	14,246,000
TOTO	4,800	4,210.00	20,208,000
日本碍子	8,900	2,252.00	20,042,800
新日鐵住金	25,700	2,649.00	68,079,300
神戸製鋼所	9,900	1,232.00	12,196,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	16,600	2,034.00	33,764,400
日新製鋼	3,000	1,257.00	3,771,000
日立金属	11,600	1,630.00	18,908,000
日本軽金属ホールディングス	16,800	277.00	4,653,600
三井金属鉱業	15,000	475.00	7,125,000
三菱マテリアル	3,600	3,425.00	12,330,000
住友金属鉱山	16,000	1,507.00	24,112,000
DOWAホールディングス	8,000	876.00	7,008,000
古河機械金属	11,000	204.00	2,244,000
古河電気工業	1,900	4,980.00	9,462,000
住友電気工業	21,500	1,793.50	38,560,250
フジクラ	8,000	976.00	7,808,000
SUMCO	7,900	1,748.00	13,809,200
東洋製罐グループホールディングス	5,900	1,867.00	11,015,300
三和ホールディングス	6,500	1,175.00	7,637,500
LIXILグループ	8,500	2,808.00	23,868,000
オークマ	5,000	1,052.00	5,260,000
アマダホールディングス	10,200	1,292.00	13,178,400

SMC	1,800	35,070.00	63,126,000
小松製作所	26,300	2,894.00	76,112,200
住友重機械工業	17,000	776.00	13,192,000
日立建機	5,800	2,872.00	16,657,600
クボタ	33,600	1,939.00	65,150,400
荏原製作所	2,800	3,260.00	9,128,000
ダイキン工業	7,900	11,735.00	92,706,500
栗田工業	3,100	3,015.00	9,346,500
椿本チエイン	5,000	1,004.00	5,020,000
ダイフク	3,300	3,310.00	10,923,000
平和	2,700	2,499.00	6,747,300
アマノ	2,100	2,364.00	4,964,400
セガサミーホールディングス	7,200	1,516.00	10,915,200
日本精工	14,900	1,472.00	21,932,800
NTN	14,000	530.00	7,420,000
ジェイテクト	9,300	1,703.00	15,837,900
不二越	7,000	624.00	4,368,000
三菱重工業	91,000	460.00	41,860,000
IHI	42,000	381.00	16,002,000
日清紡ホールディングス	4,800	1,148.00	5,510,400
コニカミノルタ	13,600	946.00	12,865,600
ブラザー工業	7,100	2,691.00	19,106,100
ミネベアミツミ	11,600	1,789.00	20,752,400
日立製作所	131,000	701.00	91,831,000
東芝	115,000	255.60	29,394,000
三菱電機	58,100	1,669.50	96,997,950
富士電機	20,000	608.00	12,160,000
日本電気	70,000	295.00	20,650,000
富士通	56,000	820.90	45,970,400
パナソニック	66,400	1,491.50	99,035,600
ソニー	34,200	4,318.00	147,675,600
TDK	3,500	7,520.00	26,320,000
ファナック	5,500	22,060.00	121,330,000
京セラ	10,200	6,508.00	66,381,600
村田製作所	6,100	16,915.00	103,181,500
キヤノン	36,100	3,748.00	135,302,800

リコー	20,100	969.00	19,476,900
東京エレクトロン	4,500	15,580.00	70,110,000
豊田自動織機	8,800	6,230.00	54,824,000
デンソー	21,500	4,817.00	103,565,500
三井造船	22,000	161.00	3,542,000
川崎重工業	45,000	339.00	15,255,000
日本車輛製造	4,000	285.00	1,140,000
日産自動車	114,200	1,152.00	131,558,400
トヨタ自動車	88,300	6,187.00	546,312,100
新明和工業	2,700	951.00	2,567,700
本田技研工業	49,000	3,104.00	152,096,000
シマノ	2,500	17,910.00	44,775,000
テルモ	10,300	4,345.00	44,753,500
島津製作所	8,000	2,209.00	17,672,000
ニコン	10,800	1,876.00	20,260,800
オリンパス	9,300	4,140.00	38,502,000
HOYA	10,500	5,708.00	59,934,000
シチズン時計	8,700	826.00	7,186,200
バンダイナムコホールディングス	6,000	4,080.00	24,480,000
トッパン・フォームズ	3,100	1,219.00	3,778,900
凸版印刷	19,000	1,209.00	22,971,000
大日本印刷	18,000	1,253.00	22,554,000
日本写真印刷	1,300	2,980.00	3,874,000
アシックス	5,400	2,017.00	10,891,800
ヤマハ	5,300	3,985.00	21,120,500
リンテック	2,100	2,722.00	5,716,200
任天堂	3,800	36,470.00	138,586,000
タカラスタンダード	2,000	1,833.00	3,666,000
コクヨ	3,500	1,496.00	5,236,000
岡村製作所	3,000	1,027.00	3,081,000
東京電力ホールディングス	43,500	460.00	20,010,000
中部電力	20,500	1,451.00	29,745,500
関西電力	25,400	1,487.50	37,782,500
東北電力	13,600	1,510.00	20,536,000
九州電力	12,800	1,321.00	16,908,800
東京瓦斯	62,000	576.30	35,730,600

大阪瓦斯	56,000	444.10	24,869,600
東武鉄道	29,000	604.00	17,516,000
東京急行電鉄	34,000	844.00	28,696,000
小田急電鉄	10,000	2,210.00	22,100,000
東日本旅客鉄道	10,500	10,785.00	113,242,500
西日本旅客鉄道	5,200	7,960.00	41,392,000
東海旅客鉄道	5,600	17,920.00	100,352,000
近鉄グループホールディングス	52,000	426.00	22,152,000
阪急阪神ホールディングス	6,900	4,015.00	27,703,500
日本通運	27,000	711.00	19,197,000
ヤマトホールディングス	11,100	2,265.50	25,147,050
福山通運	8,000	717.00	5,736,000
セイノーホールディングス	5,600	1,502.00	8,411,200
日本郵船	46,000	221.00	10,166,000
商船三井	33,000	356.00	11,748,000
日本航空	9,600	3,508.00	33,676,800
ANAホールディングス	95,000	384.80	36,556,000
三菱倉庫	5,000	1,468.00	7,340,000
三井倉庫ホールディングス	3,000	309.00	927,000
住友倉庫	5,000	710.00	3,550,000
上組	7,000	1,182.00	8,274,000
郵船ロジスティクス	1,100	1,007.00	1,107,700
T I S	2,400	3,055.00	7,332,000
野村総合研究所	7,100	4,295.00	30,494,500
オービック	2,700	6,860.00	18,522,000
ヤフー	154,100	491.00	75,663,100
トレンドマイクロ	3,800	5,770.00	21,926,000
日本オラクル	3,500	7,300.00	25,550,000
伊藤忠テクノソリューションズ	3,200	3,935.00	12,592,000
大塚商会	2,600	6,920.00	17,992,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,200	1,469.00	1,762,800
日本ユニシス	3,000	1,857.00	5,571,000
日本電信電話	38,300	5,230.00	200,309,000
KDD I	70,000	2,909.00	203,630,000
NTTドコモ	105,500	2,622.50	276,673,750

東宝	5,100	3,390.00	17,289,000
エヌ・ティ・ティ・データ	37,900	1,239.00	46,958,100
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3,300	3,595.00	11,863,500
コナミホールディングス	3,900	6,160.00	24,024,000
ソフトバンクグループ	29,800	8,928.00	266,054,400
双日	33,900	280.00	9,492,000
伊藤忠商事	45,000	1,726.50	77,692,500
丸紅	47,000	739.70	34,765,900
豊田通商	9,600	3,390.00	32,544,000
三井物産	48,600	1,603.00	77,905,800
住友商事	33,800	1,489.00	50,328,200
三菱商事	43,000	2,390.50	102,791,500
キヤノンマーケティングジャパン	4,100	2,524.00	10,348,400
岩谷産業	7,000	704.00	4,928,000
サンリオ	2,400	2,181.00	5,234,400
スズケン	2,800	3,670.00	10,276,000
ローソン	2,700	7,330.00	19,791,000
エービーシー・マート	2,200	6,330.00	13,926,000
J. フロント リテイリング	7,300	1,642.00	11,986,600
三越伊勢丹ホールディングス	10,700	1,116.00	11,941,200
セブン&アイ・ホールディングス	24,000	4,535.00	108,840,000
良品計画	800	27,350.00	21,880,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3,400	6,300.00	21,420,000
しまむら	1,000	13,650.00	13,650,000
高島屋	10,000	1,029.00	10,290,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	3,400	1,933.00	6,572,200
丸井グループ	6,300	1,589.00	10,010,700
イオン	23,600	1,718.00	40,544,800
イズミ	1,900	6,130.00	11,647,000
ヤマダ電機	26,100	562.00	14,668,200
ニトリホールディングス	3,100	15,000.00	46,500,000
ファーストリテイリング	2,900	37,180.00	107,822,000
サンドラッグ	3,600	4,045.00	14,562,000
めぶきフィナンシャルグループ	31,900	434.00	13,844,600
コンコルディア・フィナンシャルグ	34,800	575.50	20,027,400

ループ			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	383,300	749.30	287,206,690
りそなホールディングス	47,400	605.30	28,691,220
三井住友トラスト・ホールディングス	10,600	4,039.00	42,813,400
三井住友フィナンシャルグループ	38,300	4,373.00	167,485,900
千葉銀行	24,000	825.00	19,800,000
ふくおかフィナンシャルグループ	23,000	547.00	12,581,000
静岡銀行	17,000	1,031.00	17,527,000
みずほフィナンシャルグループ	686,800	204.60	140,519,280
大和証券グループ本社	46,000	675.90	31,091,400
野村ホールディングス	103,400	664.30	68,688,620
SOMPOホールディングス	11,200	4,412.00	49,414,400
MS&ADインシュアランスグループホール	16,000	3,859.00	61,744,000
第一生命ホールディングス	32,400	2,075.00	67,230,000
東京海上ホールディングス	20,400	4,774.00	97,389,600
クレディセゾン	5,000	2,214.00	11,070,000
イオンフィナンシャルサービス	6,100	2,391.00	14,585,100
アコム	43,200	508.00	21,945,600
日立キャピタル	3,400	2,761.00	9,387,400
オリックス	35,800	1,784.00	63,867,200
三菱UFJリース	24,200	622.00	15,052,400
日本取引所グループ	14,900	2,010.00	29,949,000
ビューリック	17,900	1,131.00	20,244,900
三井不動産	26,800	2,608.50	69,907,800
三菱地所	37,600	2,038.00	76,628,800
住友不動産	13,000	3,426.00	44,538,000
イオンモール	6,200	2,088.00	12,945,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	8,900	1,078.00	9,594,200
エムスリー	8,800	3,040.00	26,752,000
ディー・エヌ・エー	4,100	2,643.00	10,836,300
電通	7,800	5,130.00	40,014,000
みらかホールディングス	1,500	4,930.00	7,395,000
オリエンタルランド	9,800	7,511.00	73,607,800
ユー・エス・エス	8,500	2,205.00	18,742,500
楽天	38,800	1,317.50	51,119,000

	リクルートホールディングス	45,900	1,904.00	87,393,600	
	東京ドーム	2,600	1,032.00	2,683,200	
	トランス・コスモス	1,300	2,612.00	3,395,600	
	セコム	6,300	8,580.00	54,054,000	
	ベネッセホールディングス	2,800	4,375.00	12,250,000	
	小計 銘柄数 : 300			10,918,163,150	
	組入時価比率 : 99.7%			100.0%	
	合計			10,918,163,150	

(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 29 年 7 月 10 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

該当事項はありません。