

平成27年10月期（平成27年4月8日～平成27年10月7日）決算短信

平成27年11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27年12月24日
 分配金支払開始日 平成27年11月13日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年10月期の運用状況（平成27年4月8日～平成27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27年10月期	7,615	(98.3)	134	(1.7)	7,749	(100)
平成27年4月期	7,739	(97.7)	179	(2.3)	7,918	(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27年10月期	449	0	0	449
平成27年4月期	349	99	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27年10月期	7,833	83	7,749	17,236
平成27年4月期	8,006	88	7,918	17,612

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成27年10月期	145.00
平成27年4月期	156.00

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 3 期 (平成 27 年 4 月 7 日現在)	第 4 期 (平成 27 年 10 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	111,289,583	75,107,257
株式	7,739,467,050	7,615,604,670
派生商品評価勘定	4,750,169	3,935,211
未収入金	71,738,190	65,642,100
未収配当金	75,978,760	69,702,813
未収利息	170	144
差入委託証拠金	3,603,000	3,322,501
流動資産合計	8,006,826,922	7,833,314,696
資産合計	8,006,826,922	7,833,314,696
負債の部		
流動負債		
未払金	1,142,914	459,245
未払収益分配金	70,142,124	65,196,205
未払受託者報酬	1,924,425	2,218,144
未払委託者報酬	9,622,055	11,090,681
その他未払費用	5,271,427	4,405,351
流動負債合計	88,102,945	83,369,626
負債合計	88,102,945	83,369,626
純資産の部		
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 (△)	1,925,619,036	1,756,840,129
(分配準備積立金)	94,504	247,490
元本等合計	7,918,723,977	7,749,945,070
純資産合計	7,918,723,977	7,749,945,070
負債純資産合計	8,006,826,922	7,833,314,696

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日	第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日
営業収益		
受取配当金	85,949,981	82,992,876
受取利息	31,870	27,329
有価証券売買等損益	1,327,121,376	△174,527,926
派生商品取引等損益	21,104,822	5,596,033
その他収益	20,005	45,457

営業収益合計	1,434,228,054	△85,866,231
営業費用		
受託者報酬	1,924,425	2,218,144
委託者報酬	9,622,055	11,090,681
その他費用	4,320,279	4,407,646
営業費用合計	15,866,759	17,716,471
営業利益又は営業損失(△)	1,418,361,295	△103,582,702
経常利益又は経常損失(△)	1,418,361,295	△103,582,702
当期純利益又は当期純損失(△)	1,418,361,295	△103,582,702
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(△)	462,153,172	1,925,619,036
剰余金増加額又は欠損金減少額	115,246,693	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	115,246,693	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	70,142,124	65,196,205
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,925,619,036	1,756,840,129

(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 4 月 8 日から平成 27 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 3 期 平成 27 年 4 月 7 日現在	第 4 期 平成 27 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 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 17,612 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 17,236 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 3 期 自平成 26 年 10 月 8 日 至平成 27 年 4 月 7 日	第 4 期 自平成 27 年 4 月 8 日 至平成 27 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		
当期配当等収益額	A	86,001,856 円
分配準備積立金	B	101,531 円
配当等収益合計額	C=A+B	86,103,387 円
経費	D	15,866,759 円
収益分配可能額	E=C-D	70,236,628 円
収益分配金	F	70,142,124 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	94,504 円
口数	H	449,629 口
1 口当たり分配金	I=F/H	156 円

2. その他費用

その他費用のうち 3,463,895 円は、対象指数についての商標使用料であります。

項目		
当期配当等収益額	A	83,065,662 円
分配準備積立金	B	94,504 円
配当等収益合計額	C=A+B	83,160,166 円
経費	D	17,716,471 円
収益分配可能額	E=C-D	65,443,695 円
収益分配金	F	65,196,205 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	247,490 円
口数	H	449,629 口
1 口当たり分配金	I=F/H	145 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。

(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 3 期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日	第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 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。</p> <p>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。</p> <p>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>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。</p> <p>○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。</p> <p>○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。</p> <p>○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 3 期 平成 27 年 4 月 7 日現在	第 4 期 平成 27 年 10 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ん。</p> <p>2. 時価の算定方法 株式</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>

(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3期 自平成26年10月8日 至平成27年4月7日	第4期 自平成27年4月8日 至平成27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3期 自平成26年10月8日 至平成27年4月7日	第4期 自平成27年4月8日 至平成27年10月7日
期首元本額 4,662,017,685円	期首元本額 5,993,104,941円
期中追加設定元本額 1,331,087,256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3期 自平成26年10月8日 至平成27年4月7日	第4期 自平成27年4月8日 至平成27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	1,263,700,206	△170,663,782
合計	1,263,700,206	△170,663,782

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3期(平成27年4月7日現在)			第4期(平成27年10月7日現在)		
	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引						
株価指数先物取引						
買建	169,263,000	174,020,000	4,750,169	124,840,501	128,785,000	3,935,211
合計	169,263,000	174,020,000	4,750,169	124,840,501	128,785,000	3,935,211

(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 27 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	7,100	358.00	2,541,800	
		国際石油開発帝石	15,500	1,217.50	18,871,250	
		石油資源開発	700	3,630.00	2,541,000	
		ミライト・ホールディングス	1,400	1,026.00	1,436,400	
		コムシスホールディングス	2,300	1,478.00	3,399,400	
		ミサワホーム	1,900	753.00	1,430,700	
		大成建設	16,000	749.00	11,984,000	
		大林組	10,000	984.00	9,840,000	
		清水建設	8,000	995.00	7,960,000	
		長谷工コーポレーション	6,500	1,363.00	8,859,500	
		鹿島建設	12,000	629.00	7,548,000	
		西松建設	4,000	479.00	1,916,000	
		前田建設工業	2,000	853.00	1,706,000	
		奥村組	3,000	640.00	1,920,000	
		戸田建設	4,000	535.00	2,140,000	
		大東建託	2,000	12,655.00	25,310,000	
		N I P P O	1,000	2,076.00	2,076,000	
		前田道路	1,000	2,184.00	2,184,000	
		五洋建設	4,800	542.00	2,601,600	
		住友林業	4,100	1,377.00	5,645,700	
		パナホーム	2,000	795.00	1,590,000	
		大和ハウス工業	8,300	3,033.00	25,173,900	
		積水ハウス	11,600	1,985.50	23,031,800	
		関電工	4,000	803.00	3,212,000	
		きんでん	4,300	1,514.00	6,510,200	
		協和エクシオ	2,100	1,205.00	2,530,500	
		日揮	3,000	1,786.00	5,358,000	
		千代田化工建設	2,000	901.00	1,802,000	
		日本製粉	4,000	736.00	2,944,000	
		日清製粉グループ本社	4,500	1,746.00	7,857,000	
江崎グリコ	400	5,440.00	2,176,000			
山崎製パン	2,000	2,031.00	4,062,000			

カルビー	500	3,915.00	1,957,500
森永乳業	8,000	484.00	3,872,000
ヤクルト本社	700	6,060.00	4,242,000
明治ホールディングス	1,800	9,300.00	16,740,000
雪印メグミルク	1,600	2,249.00	3,598,400
日本ハム	4,000	2,428.00	9,712,000
伊藤ハム	4,000	630.00	2,520,000
丸大食品	4,000	474.00	1,896,000
サッポロホールディングス	6,000	473.00	2,838,000
アサヒグループホールディングス	4,500	3,720.00	16,740,000
キリンホールディングス	19,300	1,597.50	30,831,750
宝ホールディングス	2,400	751.00	1,802,400
コカ・コーラウエスト	2,600	2,326.00	6,047,600
コカ・コーライーストジャパン	900	1,939.00	1,745,100
サントリー食品インターナショナル	1,000	4,585.00	4,585,000
伊藤園	1,500	2,581.00	3,871,500
日清オイリオグループ	4,000	441.00	1,764,000
不二製油グループ本社	1,100	1,598.00	1,757,800
キッコーマン	1,000	3,500.00	3,500,000
味の素	10,000	2,574.50	25,745,000
キューピー	2,100	2,620.00	5,502,000
ハウス食品グループ本社	1,100	2,026.00	2,228,600
カゴメ	1,100	1,962.00	2,158,200
ニチレイ	8,000	793.00	6,344,000
東洋水産	1,400	4,470.00	6,258,000
日清食品ホールディングス	900	5,560.00	5,004,000
日本たばこ産業	15,000	3,994.00	59,910,000
グンゼ	5,000	377.00	1,885,000
東洋紡	21,000	168.00	3,528,000
帝人	30,000	401.00	12,030,000
東レ	24,000	1,032.00	24,768,000
ワコールホールディングス	2,000	1,421.00	2,842,000
T S I ホールディングス	2,400	871.00	2,090,400
オンワードホールディングス	4,000	719.00	2,876,000
王子ホールディングス	25,000	558.00	13,950,000
日本製紙	3,200	1,966.00	6,291,200

北越紀州製紙	6,100	696.00	4,245,600
大王製紙	2,000	1,007.00	2,014,000
レンゴー	7,000	515.00	3,605,000
クラレ	6,300	1,510.00	9,513,000
旭化成	22,000	904.60	19,901,200
昭和電工	50,000	143.00	7,150,000
住友化学	47,000	690.00	32,430,000
日産化学工業	1,900	2,745.00	5,215,500
クレハ	3,000	454.00	1,362,000
日本曹達	3,000	736.00	2,208,000
東ソー	11,000	619.00	6,809,000
トクヤマ	10,000	213.00	2,130,000
セントラル硝子	7,000	544.00	3,808,000
東亜合成	3,100	935.00	2,898,500
デンカ	14,000	537.00	7,518,000
信越化学工業	4,300	6,560.00	28,208,000
エア・ウォーター	3,000	1,890.00	5,670,000
大陽日酸	3,300	1,201.00	3,963,300
日本触媒	600	8,570.00	5,142,000
カネカ	8,000	965.00	7,720,000
三菱瓦斯化学	7,000	616.00	4,312,000
三井化学	27,000	434.00	11,718,000
J S R	3,400	1,854.00	6,303,600
東京応化工業	500	3,405.00	1,702,500
三菱ケミカルホールディングス	44,200	692.20	30,595,240
ダイセル	4,600	1,540.00	7,084,000
住友ベークライト	5,000	461.00	2,305,000
積水化学工業	7,900	1,316.00	10,396,400
日本ゼオン	3,000	1,006.00	3,018,000
アイカ工業	700	2,424.00	1,696,800
宇部興産	39,000	226.00	8,814,000
日立化成	2,200	1,842.00	4,052,400
日本化薬	2,000	1,222.00	2,444,000
ADEKA	1,500	1,599.00	2,398,500
日油	3,000	847.00	2,541,000
花王	7,100	5,515.00	39,156,500

日本ペイントホールディングス	1,000	2,330.00	2,330,000
関西ペイント	1,800	1,724.00	3,103,200
D I C	20,000	305.00	6,100,000
東洋インキ S C ホールディングス	4,000	475.00	1,900,000
富士フイルムホールディングス	9,000	4,594.00	41,346,000
資生堂	6,500	2,710.50	17,618,250
ライオン	4,000	1,075.00	4,300,000
コーセー	300	11,550.00	3,465,000
小林製薬	300	9,090.00	2,727,000
日東電工	2,400	8,040.00	19,296,000
エフピコ	500	4,660.00	2,330,000
ニフコ	600	4,490.00	2,694,000
ユニ・チャーム	2,400	2,226.00	5,342,400
協和発酵キリン	4,000	1,762.00	7,048,000
武田薬品工業	13,400	5,486.00	73,512,400
アステラス製薬	24,200	1,554.50	37,618,900
大日本住友製薬	1,800	1,198.00	2,156,400
塩野義製薬	3,100	4,275.00	13,252,500
田辺三菱製薬	2,300	2,086.00	4,797,800
中外製薬	1,500	3,625.00	5,437,500
科研製薬	400	9,040.00	3,616,000
エーザイ	4,100	6,887.00	28,236,700
ロート製薬	1,300	1,877.00	2,440,100
小野薬品工業	600	14,450.00	8,670,000
久光製薬	800	4,080.00	3,264,000
持田製薬	200	6,970.00	1,394,000
参天製薬	3,800	1,605.00	6,099,000
ツムラ	900	2,638.00	2,374,200
沢井製薬	300	7,250.00	2,175,000
第一三共	13,000	2,156.50	28,034,500
キョーリン製薬ホールディングス	800	1,880.00	1,504,000
大塚ホールディングス	5,400	3,832.00	20,692,800
大正製薬ホールディングス	300	6,990.00	2,097,000
昭和シェル石油	6,900	1,031.00	7,113,900
東燃ゼネラル石油	8,000	1,261.00	10,088,000
出光興産	4,000	1,976.00	7,904,000

J Xホールディングス	127,500	477.60	60,894,000
コスモエネルギーホールディングス	2,700	1,586.00	4,282,200
横浜ゴム	2,200	2,218.00	4,879,600
東洋ゴム工業	1,300	2,710.00	3,523,000
ブリヂストン	9,100	4,257.00	38,738,700
住友ゴム工業	3,400	1,715.00	5,831,000
旭硝子	34,000	733.00	24,922,000
日本板硝子	46,000	107.00	4,922,000
日本電気硝子	16,000	589.00	9,424,000
住友大阪セメント	9,000	438.00	3,942,000
太平洋セメント	15,000	369.00	5,535,000
東海カーボン	6,000	306.00	1,836,000
TOTO	2,300	3,975.00	9,142,500
日本碍子	2,000	2,418.00	4,836,000
日本特殊陶業	1,400	3,025.00	4,235,000
新日鐵住金	13,300	2,415.50	32,126,150
神戸製鋼所	65,000	148.00	9,620,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	13,100	1,800.00	23,580,000
日新製鋼	2,400	1,195.00	2,868,000
大和工業	500	2,626.00	1,313,000
淀川製鋼所	700	2,368.00	1,657,600
丸一鋼管	700	2,889.00	2,022,300
大同特殊鋼	8,000	411.00	3,288,000
日立金属	1,500	1,546.00	2,319,000
日本軽金属ホールディングス	13,000	199.00	2,587,000
三井金属鉱業	14,000	236.00	3,304,000
三菱マテリアル	29,000	404.00	11,716,000
住友金属鉱山	10,000	1,523.00	15,230,000
DOWAホールディングス	4,000	999.00	3,996,000
古河電気工業	26,000	205.00	5,330,000
住友電気工業	16,100	1,630.50	26,251,050
フジクラ	9,000	551.00	4,959,000
東洋製罐グループホールディングス	5,300	2,041.00	10,817,300
三和ホールディングス	2,800	868.00	2,430,400
L I X I Lグループ	4,900	2,554.00	12,514,600

リンナイ	400	9,600.00	3,840,000
日本発條	4,100	1,218.00	4,993,800
日本製鋼所	8,000	429.00	3,432,000
アマダホールディングス	3,600	1,044.00	3,758,400
DMG 森精機	1,300	1,651.00	2,146,300
ディスコ	200	9,420.00	1,884,000
ナブテスコ	1,200	2,407.00	2,888,400
SMC	300	29,385.00	8,815,500
小松製作所	13,000	1,898.00	24,674,000
住友重機械工業	11,000	535.00	5,885,000
日立建機	2,200	1,798.00	3,955,600
クボタ	9,000	1,813.00	16,317,000
荏原製作所	7,000	485.00	3,395,000
ダイキン工業	2,000	7,403.00	14,806,000
栗田工業	2,200	2,763.00	6,078,600
ダイフク	1,300	1,762.00	2,290,600
平和	800	2,080.00	1,664,000
SANKYO	1,100	4,405.00	4,845,500
グローリー	900	3,025.00	2,722,500
セガサミーホールディングス	4,900	1,248.00	6,115,200
ホシザキ電機	300	8,530.00	2,559,000
日本精工	4,400	1,291.00	5,680,400
NTN	8,000	550.00	4,400,000
ジェイテクト	3,200	1,900.00	6,080,000
THK	1,100	2,111.00	2,322,100
マキタ	1,100	6,800.00	7,480,000
日立造船	3,100	636.00	1,971,600
三菱重工業	42,000	594.10	24,952,200
IHI	13,000	343.00	4,459,000
日清紡ホールディングス	3,800	1,464.00	5,563,200
イビデン	3,500	1,669.00	5,841,500
コニカミノルタ	10,500	1,326.00	13,923,000
ブラザー工業	3,800	1,503.00	5,711,400
ミネベア	2,000	1,286.00	2,572,000
日立製作所	94,000	660.00	62,040,000
東芝	75,000	321.60	24,120,000

三菱電機	26,000	1,192.50	31,005,000
富士電機	9,000	484.00	4,356,000
安川電機	1,800	1,301.00	2,341,800
東芝テック	3,000	401.00	1,203,000
マブチモーター	400	5,870.00	2,348,000
日本電産	1,500	8,437.00	12,655,500
JVCケンウッド	6,600	304.00	2,006,400
オムロン	1,900	3,880.00	7,372,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	5,000	504.00	2,520,000
日本電気	54,000	389.00	21,006,000
富士通	37,000	555.70	20,560,900
沖電気工業	9,000	192.00	1,728,000
セイコーエプソン	2,600	1,852.00	4,815,200
パナソニック	64,400	1,296.00	83,462,400
シャープ	28,000	137.00	3,836,000
アンリツ	2,100	789.00	1,656,900
ソニー	29,200	3,205.00	93,586,000
TDK	2,700	7,150.00	19,305,000
ミツミ電機	4,000	671.00	2,684,000
アルプス電気	2,200	3,380.00	7,436,000
パイオニア	6,200	291.00	1,804,200
ホシデン	5,100	711.00	3,626,100
ヒロセ電機	300	14,240.00	4,272,000
日立マクセル	1,700	1,934.00	3,287,800
アルパイン	1,000	1,494.00	1,494,000
船井電機	1,200	1,139.00	1,366,800
横河電機	2,200	1,288.00	2,833,600
アズビル	1,100	2,921.00	3,213,100
日本光電工業	600	2,047.00	1,228,200
堀場製作所	400	4,535.00	1,814,000
アドバンテスト	1,400	937.00	1,311,800
キーエンス	100	59,240.00	5,924,000
シスメックス	500	6,140.00	3,070,000
スタンレー電気	2,300	2,597.00	5,973,100
ウシオ電機	2,100	1,536.00	3,225,600

カシオ計算機	2,300	2,315.00	5,324,500
ファナック	1,100	19,875.00	21,862,500
ローム	1,400	5,860.00	8,204,000
浜松ホトニクス	1,000	2,929.00	2,929,000
新光電気工業	2,200	757.00	1,665,400
京セラ	4,600	5,603.00	25,773,800
太陽誘電	2,200	1,655.00	3,641,000
村田製作所	1,400	15,680.00	21,952,000
小糸製作所	1,300	4,170.00	5,421,000
S C R E E Nホールディングス	3,000	626.00	1,878,000
キヤノン	28,300	3,586.00	101,483,800
リコー	16,800	1,286.00	21,604,800
トヨタ紡織	2,500	2,342.00	5,855,000
ユニプレス	1,400	2,505.00	3,507,000
豊田自動織機	2,200	6,190.00	13,618,000
デンソー	6,400	5,397.00	34,540,800
東海理化電機製作所	1,200	2,635.00	3,162,000
三井造船	15,000	187.00	2,805,000
川崎重工業	19,000	458.00	8,702,000
日産自動車	50,500	1,173.00	59,236,500
いすゞ自動車	8,500	1,344.50	11,428,250
トヨタ自動車	27,600	7,351.00	202,887,600
日野自動車	3,400	1,315.00	4,471,000
三菱自動車工業	13,100	976.00	12,785,600
日産車体	2,000	1,395.00	2,790,000
新明和工業	2,000	1,250.00	2,500,000
日信工業	1,100	1,847.00	2,031,700
タチエス	1,200	1,622.00	1,946,400
NOK	1,300	2,705.00	3,516,500
フタバ産業	3,000	487.00	1,461,000
K Y B	4,000	326.00	1,304,000
プレス工業	3,200	478.00	1,529,600
カルソニックカンセイ	5,000	946.00	4,730,000
ケーヒン	1,800	1,788.00	3,218,400
アイシン精機	5,000	4,425.00	22,125,000
マツダ	4,700	2,108.00	9,907,600

ダイハツ工業	5,500	1,555.00	8,552,500
本田技研工業	34,500	3,862.00	133,239,000
スズキ	5,800	3,855.00	22,359,000
富士重工業	4,400	4,498.00	19,791,200
ヤマハ発動機	4,200	2,701.00	11,344,200
ショーワ	2,100	1,028.00	2,158,800
エクセディ	500	2,750.00	1,375,000
豊田合成	2,000	2,567.00	5,134,000
日本精機	1,000	2,541.00	2,541,000
エフ・シー・シー	1,000	2,158.00	2,158,000
シマノ	500	18,180.00	9,090,000
タカタ	700	1,374.00	961,800
テイ・エス テック	1,300	3,465.00	4,504,500
テルモ	2,300	3,420.00	7,866,000
島津製作所	3,000	1,716.00	5,148,000
ニコン	7,400	1,547.00	11,447,800
オリンパス	1,200	3,895.00	4,674,000
HOYA	5,000	4,499.00	22,495,000
シチズンホールディングス	4,400	873.00	3,841,200
ニプロ	2,500	1,245.00	3,112,500
バンダイナムコホールディングス	2,700	2,887.00	7,794,900
トッパン・フォームズ	1,400	1,447.00	2,025,800
凸版印刷	18,000	998.00	17,964,000
大日本印刷	18,000	1,185.00	21,330,000
アシックス	1,000	2,968.00	2,968,000
ヤマハ	2,900	2,857.00	8,285,300
リンテック	1,000	2,726.00	2,726,000
任天堂	2,500	21,085.00	52,712,500
コクヨ	2,200	1,292.00	2,842,400
東京電力	116,900	841.00	98,312,900
中部電力	25,900	1,878.00	48,640,200
関西電力	28,900	1,455.50	42,063,950
中国電力	9,200	1,741.00	16,017,200
北陸電力	5,900	1,712.00	10,100,800
東北電力	11,800	1,734.00	20,461,200
四国電力	6,200	2,023.00	12,542,600

九州電力	10,100	1,384.00	13,978,400
北海道電力	6,400	1,242.00	7,948,800
沖縄電力	900	2,886.00	2,597,400
電源開発	2,100	3,850.00	8,085,000
東京瓦斯	47,000	574.90	27,020,300
大阪瓦斯	44,000	465.80	20,495,200
東邦瓦斯	8,000	714.00	5,712,000
東武鉄道	21,000	540.00	11,340,000
相鉄ホールディングス	6,000	673.00	4,038,000
東京急行電鉄	15,000	918.00	13,770,000
京浜急行電鉄	3,000	969.00	2,907,000
小田急電鉄	5,000	1,121.00	5,605,000
京王電鉄	6,000	879.00	5,274,000
京成電鉄	2,000	1,378.00	2,756,000
東日本旅客鉄道	5,100	10,875.00	55,462,500
西日本旅客鉄道	3,500	8,056.00	28,196,000
東海旅客鉄道	1,700	20,830.00	35,411,000
西日本鉄道	5,000	617.00	3,085,000
近鉄グループホールディングス	20,000	453.00	9,060,000
阪急阪神ホールディングス	16,000	750.00	12,000,000
南海電気鉄道	5,000	640.00	3,200,000
京阪電気鉄道	6,000	820.00	4,920,000
名古屋鉄道	12,000	486.00	5,832,000
日本通運	28,000	586.00	16,408,000
ヤマトホールディングス	6,600	2,338.00	15,430,800
山九	6,000	598.00	3,588,000
ニッコンホールディングス	800	2,178.00	1,742,400
セイノーホールディングス	5,000	1,275.00	6,375,000
日立物流	1,300	1,975.00	2,567,500
日本郵船	51,000	307.00	15,657,000
商船三井	25,000	308.00	7,700,000
川崎汽船	29,000	274.00	7,946,000
日本航空	3,700	4,325.00	16,002,500
A N Aホールディングス	64,000	344.80	22,067,200
三菱倉庫	1,000	1,478.00	1,478,000
上組	4,000	991.00	3,964,000

近鉄エクスプレス	700	2,036.00	1,425,200
I Tホールディングス	2,100	2,611.00	5,483,100
グリー	1,900	568.00	1,079,200
野村総合研究所	1,320	4,650.00	6,138,000
フジ・メディア・ホールディングス	4,200	1,474.00	6,190,800
オービック	400	5,500.00	2,200,000
ヤフー	9,400	477.00	4,483,800
トレンドマイクロ	1,200	4,190.00	5,028,000
日本オラクル	600	5,260.00	3,156,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,100	2,688.00	2,956,800
大塚商会	700	6,110.00	4,277,000
ネットワンシステムズ	3,800	686.00	2,606,800
エイベックス・グループ・ホールディングス	900	1,424.00	1,281,600
東京放送ホールディングス	2,800	1,656.00	4,636,800
日本テレビホールディングス	2,600	1,988.00	5,168,800
テレビ朝日ホールディングス	1,000	1,933.00	1,933,000
スカパー J S A Tホールディングス	3,100	599.00	1,856,900
日本電信電話	60,200	4,337.00	261,087,400
KDD I	30,100	2,768.00	83,316,800
光通信	400	9,150.00	3,660,000
N T T ドコモ	30,900	2,130.50	65,832,450
東宝	1,100	2,902.00	3,192,200
エス・ティ・ティ・データ	2,700	6,130.00	16,551,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	700	3,045.00	2,131,500
カプコン	1,000	2,362.00	2,362,000
S C S K	700	4,340.00	3,038,000
コナミホールディングス	1,700	2,652.00	4,508,400
ソフトバンクグループ	6,100	6,188.00	37,746,800
双日	100,800	253.00	25,502,400
アルフレッサ ホールディングス	5,400	2,051.00	11,075,400
ダイワボウホールディングス	7,000	223.00	1,561,000
シップヘルスケアホールディングス	500	2,806.00	1,403,000
第一興商	900	4,220.00	3,798,000
メディパルホールディングス	6,700	1,903.00	12,750,100
黒田電気	1,100	2,323.00	2,555,300

伊藤忠商事	51,800	1,418.00	73,452,400
丸紅	58,300	643.50	37,516,050
長瀬産業	3,200	1,476.00	4,723,200
豊田通商	6,500	2,700.00	17,550,000
兼松	15,000	192.00	2,880,000
三井物産	51,500	1,483.50	76,400,250
日立ハイテクノロジーズ	1,200	2,835.00	3,402,000
住友商事	44,300	1,235.50	54,732,650
三菱商事	53,600	2,219.00	118,938,400
キヤノンマーケティングジャパン	1,300	1,818.00	2,363,400
三谷商事	500	3,005.00	1,502,500
阪和興業	11,000	466.00	5,126,000
岩谷産業	4,000	642.00	2,568,000
三愛石油	3,000	841.00	2,523,000
稲畑産業	1,900	1,333.00	2,532,700
東邦ホールディングス	1,500	2,518.00	3,777,000
サンゲツ	1,400	1,939.00	2,714,600
伊藤忠エネクス	3,100	950.00	2,945,000
リョーサン	1,300	2,832.00	3,681,600
三信電気	2,200	1,240.00	2,728,000
PALTAC	1,900	2,162.00	4,107,800
日鉄住金物産	6,000	399.00	2,394,000
オートバックスセブン	2,100	2,027.00	4,256,700
加藤産業	900	2,681.00	2,412,900
因幡電機産業	500	3,805.00	1,902,500
ミスミグループ本社	1,800	1,442.00	2,595,600
スズケン	2,800	4,005.00	11,214,000
ローソン	1,000	8,980.00	8,980,000
ゲオホールディングス	2,000	1,856.00	3,712,000
アダストリア	700	7,550.00	5,285,000
日本マクドナルドホールディングス	1,100	2,744.00	3,018,400
エディオン	5,200	878.00	4,565,600
DCMホールディングス	3,400	832.00	2,828,800
J. フロント リテイリング	4,700	2,058.00	9,672,600
マツモトキヨシホールディングス	1,200	5,430.00	6,516,000
ココカラファイン	500	4,960.00	2,480,000

三越伊勢丹ホールディングス	6,000	1,928.00	11,568,000
セブン&アイ・ホールディングス	14,200	5,543.00	78,710,600
ツルハホールディングス	500	10,500.00	5,250,000
良品計画	200	24,200.00	4,840,000
コーナン商事	1,300	1,497.00	1,946,100
ドンキホーテホールディングス	1,300	4,850.00	6,305,000
ゼンショーホールディングス	1,700	1,151.00	1,956,700
スギホールディングス	500	5,740.00	2,870,000
ファミリーマート	1,000	5,430.00	5,430,000
島忠	1,000	2,659.00	2,659,000
コメリ	800	2,645.00	2,116,000
青山商事	1,500	4,230.00	6,345,000
しまむら	500	13,780.00	6,890,000
高島屋	6,000	1,057.00	6,342,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,100	2,377.00	4,991,700
丸井グループ	4,100	1,512.00	6,199,200
イオン	25,300	1,974.00	49,942,200
ユニグループ・ホールディングス	12,700	733.00	9,309,100
イズミ	700	4,950.00	3,465,000
平和堂	800	2,858.00	2,286,400
ケーズホールディングス	1,700	4,155.00	7,063,500
ヤマダ電機	43,500	533.00	23,185,500
ニトリホールディングス	700	9,540.00	6,678,000
吉野家ホールディングス	1,700	1,575.00	2,677,500
アークス	900	2,318.00	2,086,200
パローホールディングス	1,100	2,994.00	3,293,400
ファーストリテイリング	200	49,800.00	9,960,000
サンドラッグ	500	6,640.00	3,320,000
じもとホールディングス	19,900	214.00	4,258,600
足利ホールディングス	5,200	512.00	2,662,400
東京T Yフィナンシャルグループ	500	3,890.00	1,945,000
九州フィナンシャルグループ	12,340	918.00	11,328,120
新生銀行	19,000	259.00	4,921,000
あおぞら銀行	22,000	415.00	9,130,000
三菱UF J フィナンシャル・グループ	559,000	773.20	432,218,800

りそなホールディングス	296,800	642.00	190,545,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	75,000	459.70	34,477,500	
三井住友フィナンシャルグループ	76,900	4,820.00	370,658,000	
第四銀行	10,000	561.00	5,610,000	
北越銀行	10,000	246.00	2,460,000	
西日本シティ銀行	15,000	346.00	5,190,000	
千葉銀行	11,000	859.00	9,449,000	
横浜銀行	34,000	734.30	24,966,200	
常陽銀行	14,000	631.00	8,834,000	
群馬銀行	7,000	775.00	5,425,000	
武蔵野銀行	1,100	4,420.00	4,862,000	
千葉興業銀行	4,400	697.00	3,066,800	
筑波銀行	6,400	441.00	2,822,400	
七十七銀行	28,000	685.00	19,180,000	
青森銀行	7,000	383.00	2,681,000	
秋田銀行	8,000	385.00	3,080,000	
山形銀行	4,000	481.00	1,924,000	
岩手銀行	1,200	5,390.00	6,468,000	
東邦銀行	32,000	438.00	14,016,000	
みちのく銀行	12,000	210.00	2,520,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	30,000	593.00	17,790,000	
静岡銀行	6,000	1,197.00	7,182,000	
十六銀行	13,000	533.00	6,929,000	
スルガ銀行	2,200	2,260.00	4,972,000	
八十二銀行	16,000	845.00	13,520,000	
山梨中央銀行	10,000	602.00	6,020,000	
大垣共立銀行	13,000	481.00	6,253,000	
福井銀行	10,000	246.00	2,460,000	
北國銀行	6,000	491.00	2,946,000	
滋賀銀行	6,000	615.00	3,690,000	
南都銀行	10,000	379.00	3,790,000	
百五銀行	16,000	583.00	9,328,000	
京都銀行	6,000	1,236.00	7,416,000	
紀陽銀行	4,600	1,908.00	8,776,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	79,000	271.00	21,409,000	

広島銀行	15,000	683.00	10,245,000
山陰合同銀行	4,700	1,159.00	5,447,300
中国銀行	6,300	1,734.00	10,924,200
伊予銀行	3,800	1,384.00	5,259,200
百十四銀行	11,000	447.00	4,917,000
四国銀行	16,000	252.00	4,032,000
阿波銀行	5,000	696.00	3,480,000
大分銀行	9,000	490.00	4,410,000
佐賀銀行	10,000	275.00	2,750,000
十八銀行	7,000	362.00	2,534,000
沖縄銀行	700	4,990.00	3,493,000
琉球銀行	2,300	1,745.00	4,013,500
セブン銀行	6,600	513.00	3,385,800
みずほフィナンシャルグループ	1,755,500	236.60	415,351,300
山口フィナンシャルグループ	11,000	1,473.00	16,203,000
北洋銀行	19,800	488.00	9,662,400
愛知銀行	300	6,730.00	2,019,000
東日本銀行	6,000	398.00	2,388,000
愛媛銀行	20,000	251.00	5,020,000
みなと銀行	9,000	210.00	1,890,000
京葉銀行	4,000	625.00	2,500,000
関西アーバン銀行	1,600	1,394.00	2,230,400
栃木銀行	4,000	685.00	2,740,000
トモニホールディングス	9,900	480.00	4,752,000
フィデアホールディングス	15,000	244.00	3,660,000
池田泉州ホールディングス	10,700	515.00	5,510,500
SBIホールディングス	2,300	1,455.00	3,346,500
大和証券グループ本社	49,000	825.50	40,449,500
野村ホールディングス	24,400	730.90	17,833,960
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	5,400	3,717.00	20,071,800
MS&ADインシュアランスグループホール	7,200	3,385.00	24,372,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	7,500	2,073.00	15,547,500
第一生命保険	27,500	1,999.50	54,986,250
東京海上ホールディングス	8,700	4,617.00	40,167,900

T&Dホールディングス	11,700	1,481.50	17,333,550
クレディセゾン	2,100	2,342.00	4,918,200
アイフル	9,300	468.00	4,352,400
イオンフィナンシャルサービス	1,000	2,566.00	2,566,000
ジャックス	2,000	487.00	974,000
オリックス	16,700	1,735.00	28,974,500
三菱UFJリース	4,200	572.00	2,402,400
日本取引所グループ	1,800	1,916.00	3,448,800
野村不動産ホールディングス	2,200	2,439.00	5,365,800
東急不動産ホールディングス	2,600	822.00	2,137,200
飯田グループホールディングス	1,900	1,986.00	3,773,400
パーク24	1,000	2,291.00	2,291,000
三井不動産	5,000	3,486.00	17,430,000
三菱地所	8,000	2,537.00	20,296,000
東京建物	2,000	1,527.00	3,054,000
住友不動産	2,000	4,066.00	8,132,000
大京	7,000	205.00	1,435,000
レオパレス21	3,200	586.00	1,875,200
イオンモール	1,000	1,896.00	1,896,000
日本空港ビルデング	300	5,780.00	1,734,000
GCAサヴィアン	2,000	1,625.00	3,250,000
テンプホールディングス	500	5,700.00	2,850,000
総合警備保障	700	5,590.00	3,913,000
ディー・エヌ・エー	3,400	2,235.00	7,599,000
博報堂DYホールディングス	4,800	1,204.00	5,779,200
ケネディクス	4,300	426.00	1,831,800
電通	2,900	6,460.00	18,734,000
みらかホールディングス	800	5,010.00	4,008,000
オリエンタルランド	1,400	7,009.00	9,812,600
ダスキン	1,600	2,155.00	3,448,000
ラウンドワン	2,200	519.00	1,141,800
ユー・エス・エス	2,500	2,085.00	5,212,500
サイバーエージェント	400	4,990.00	1,996,000
エイチ・アイ・エス	500	4,020.00	2,010,000
セコム	2,500	7,282.00	18,205,000
アサツー ディ・ケイ	1,100	2,864.00	3,150,400

	ベネッセホールディングス	1,500	3,160.00	4,740,000	
小計	銘柄数：566 組入時価比率：98.3%			7,615,604,670	100.0%
合計				7,615,604,670	

(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 27 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。