

平成28年7月期（平成27年7月9日～平成28年7月8日）決算短信

平成28年8月17日

上場取引所

東証

ファンド名 日経225連動型上場投資信託
 コード番号 (1321)
 連動対象指標 日経平均株価
 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9月29日
 分配金支払開始日 平成28年8月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年7月期の運用状況（平成27年7月9日～平成28年7月8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7月期	2,857,060	(98.8)	33,564	(1.2)	2,890,625	(100)
平成27年7月期	2,996,550	(98.8)	35,510	(1.2)	3,032,061	(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28年7月期	150,930	87,193	50,002	188,121
平成27年7月期	123,274	64,654	36,998	150,930

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数) × 10
	百万円	百万円	百万円	円
平成28年7月期	3,601,348	710,723	2,890,625	153,657
平成27年7月期	3,175,011	142,950	3,032,061	200,891

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成28年7月期	2,690.00
平成27年7月期	2,300.00

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

日経 225 連動型上場投資信託

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 14 期 (平成 27 年 7 月 8 日現在)	第 15 期 (平成 28 年 7 月 8 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	173,368,705,935	728,898,758,053
株式	2,996,550,949,800	2,857,060,280,660
未収配当金	2,799,624,000	4,223,648,000
未収利息	139,762	14,743,514
その他未収収益	11,110,681	18,610,476
差入委託証拠金	2,281,060,000	11,132,605,999
流動資産合計	3,175,011,590,178	3,601,348,646,702
資産合計	3,175,011,590,178	3,601,348,646,702
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,404,259,454	2,934,999,573
未払金	1,002,945,580	4,922,251,237
未払収益分配金	34,713,986,250	50,604,709,055
未払受託者報酬	798,291,238	864,681,043
未払委託者報酬	2,487,714,614	2,783,400,669
未払利息	2,853,334	1,111,520
有価証券貸借取引受入金	102,510,402,277	648,579,296,588
その他未払費用	29,872,718	33,164,312
流動負債合計	142,950,325,465	710,723,613,997
負債合計	142,950,325,465	710,723,613,997
純資産の部		
元本等		
元本	1,857,500,125,125	2,315,212,469,665
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1,174,561,139,588	575,412,563,040
(分配準備積立金)	102,780,340	143,055,722
元本等合計	3,032,061,264,713	2,890,625,032,705
純資産合計	3,032,061,264,713	2,890,625,032,705
負債純資産合計	3,175,011,590,178	3,601,348,646,702

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 日	第 15 期 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 7 月 8 日
営業収益		
受取配当金	40,481,328,760	57,659,664,456
受取利息	59,951,090	75,807,992
有価証券売買等損益	595,988,984,980	△790,430,670,625
派生商品取引等損益	10,431,701,745	△14,878,027,350
その他収益	102,762,433	377,084,282

営業収益合計	647,064,729,008	△747,196,141,245
営業費用		
支払利息	27,744,884	7,936,159
受託者報酬	1,455,629,983	1,748,497,497
委託者報酬	4,329,386,306	5,640,738,588
その他費用	56,536,957	70,400,049
営業費用合計	5,869,298,130	7,467,572,293
営業利益又は営業損失(△)	641,195,430,878	△754,663,713,538
経常利益又は経常損失(△)	641,195,430,878	△754,663,713,538
当期純利益又は当期純損失(△)	641,195,430,878	△754,663,713,538
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(△)	399,439,453,090	1,174,561,139,588
剰余金増加額又は欠損金減少額	362,483,189,397	493,835,021,985
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	362,483,189,397	493,835,021,985
剰余金減少額又は欠損金増加額	193,842,947,527	287,715,175,940
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	193,842,947,527	287,715,175,940
分配金	34,713,986,250	50,604,709,055
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,174,561,139,588	575,412,563,040

(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 7 月 9 日から平成 28 年 7 月 8 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 14 期 平成 27 年 7 月 8 日現在	第 15 期 平成 28 年 7 月 8 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 150,930,375 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 188,121,595 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 20,089.1 円 (10 口当たり純資産額) (200,891 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 15,365.7 円 (10 口当たり純資産額) (153,657 円)

3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 95,367,448,310 円	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 605,740,465,940 円
--	---

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 日			第 15 期 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 7 月 8 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	40,616,297,399 円	当期配当等収益額	A	58,104,620,571 円
分配準備積立金	B	42,022,437 円	分配準備積立金	B	102,780,340 円
配当等収益合計額	C=A+B	40,658,319,836 円	配当等収益合計額	C=A+B	58,207,400,911 円
経費	D	5,841,553,246 円	経費	D	7,459,636,134 円
収益分配可能額	E=C-D	34,816,766,590 円	収益分配可能額	E=C-D	50,747,764,777 円
収益分配金	F	34,713,986,250 円	収益分配金	F	50,604,709,055 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	102,780,340 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	143,055,722 円
口数	H	150,930,375 口	口数	H	188,121,595 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,300 円	10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,690 円
			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 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 日		第 15 期 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 7 月 8 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効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。		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		3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左	

組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。	
---	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 14 期 平成 27 年 7 月 8 日現在	第 15 期 平成 28 年 7 月 8 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 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 日	第 15 期 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 7 月 8 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 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 日	第 15 期 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 7 月 8 日
期首元本額 1,517,136,243,978 円	期首元本額 1,857,500,125,125 円
期中追加設定元本額 795,701,454,660 円	期中追加設定元本額 1,073,087,081,610 円
期中一部交換元本額 455,337,573,513 円	期中一部交換元本額 615,374,737,070 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 日	第 15 期 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 7 月 8 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	531,929,330,620	△695,248,672,640
合計	531,929,330,620	△695,248,672,640

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 14 期(平成 27 年 7 月 8 日現在)			第 15 期(平成 28 年 7 月 8 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	36,575,130,000	—	35,171,740,000	△1,404,259,454	36,334,005,999	—
					33,400,080,000	△2,934,999,573

合計	36,575,130,000	—	35,171,740,000	△1,404,259,454	36,334,005,999	—	33,400,080,000	△2,934,999,573
----	----------------	---	----------------	----------------	----------------	---	----------------	----------------

(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 7 月 8 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	7,418,000	500.00	3,709,000,000	貸付有価証券 7,800 株
		マルハニチロ	741,800	2,698.00	2,001,376,400	
		国際石油開発帝石	2,967,200	741.50	2,200,178,800	貸付有価証券 26,100 株
		コムシスホールディングス	7,418,000	1,636.00	12,135,848,000	貸付有価証券 33,700 株
		大成建設	7,418,000	811.00	6,015,998,000	
		大林組	7,418,000	1,045.00	7,751,810,000	
		清水建設	7,418,000	931.00	6,906,158,000	貸付有価証券 740,000 株
		長谷工コーポレーション	1,483,600	928.00	1,376,780,800	貸付有価証券 953,400 株
		鹿島建設	7,418,000	694.00	5,148,092,000	
		大和ハウス工業	7,418,000	2,757.50	20,455,135,000	
		積水ハウス	7,418,000	1,653.00	12,261,954,000	
		日揮	7,418,000	1,439.00	10,674,502,000	貸付有価証券 1,366,000 株
		千代田化工建設	7,418,000	665.00	4,932,970,000	貸付有価証券 997,000 株
		日清製粉グループ本社	7,418,000	1,645.00	12,202,610,000	貸付有価証券 147,000 株 (147,000 株)
		明治ホールディングス	1,483,600	10,560.00	15,666,816,000	
		日本ハム	7,418,000	2,517.00	18,671,106,000	貸付有価証券 2,070,000 株 (156,000 株)
		サッポロホールディングス	1,483,600	2,964.00	4,397,390,400	貸付有価証券 277,700 株
アサヒグループホールディングス	7,418,000	3,366.00	24,968,988,000			

麒麟ホールディングス	7,418,000	1,778.50	13,192,913,000	貸付有価証券 177,400 株
宝ホールディングス	7,418,000	929.00	6,891,322,000	
キッコーマン	7,418,000	3,800.00	28,188,400,000	貸付有価証券 1,066,000 株
味の素	7,418,000	2,479.50	18,392,931,000	貸付有価証券 756,100 株
ニチレイ	7,418,000	952.00	7,061,936,000	
日本たばこ産業	7,418,000	4,289.00	31,815,802,000	貸付有価証券 1,042,900 株
東洋紡	7,418,000	196.00	1,453,928,000	貸付有価証券 4,925,000 株
ユニチカ	7,418,000	57.00	422,826,000	貸付有価証券 1,282,000 株
帝人	7,418,000	355.00	2,633,390,000	貸付有価証券 961,000 株 (961,000 株)
東レ	7,418,000	882.00	6,542,676,000	貸付有価証券 3,304,000 株
王子ホールディングス	7,418,000	384.00	2,848,512,000	
日本製紙	741,800	1,801.00	1,335,981,800	貸付有価証券 496,300 株 (18,600 株)
北越紀州製紙	7,418,000	738.00	5,474,484,000	貸付有価証券 2,204,600 株 (988,300 株)
クラレ	7,418,000	1,201.00	8,909,018,000	
旭化成	7,418,000	698.50	5,181,473,000	貸付有価証券 4,925,000 株 (147,000 株)
昭和電工	741,800	909.00	674,296,200	貸付有価証券 439,500 株
住友化学	7,418,000	396.00	2,937,528,000	
日産化学工業	7,418,000	3,070.00	22,773,260,000	貸付有価証券 148,700 株
日本曹達	7,418,000	385.00	2,855,930,000	貸付有価証券 143,000 株
東ソー	7,418,000	438.00	3,249,084,000	
トクヤマ	7,418,000	286.00	2,121,548,000	貸付有価証券 2,622,000 株
デンカ	7,418,000	400.00	2,967,200,000	
信越化学工業	7,418,000	5,901.00	43,773,618,000	貸付有価証券 1,290,200 株
三井化学	7,418,000	351.00	2,603,718,000	
三菱ケミカルホールディ ングス	3,709,000	445.70	1,653,101,300	
宇部興産	7,418,000	163.00	1,209,134,000	

日本化薬	7,418,000	916.00	6,794,888,000	貸付有価証券 151,000株
花王	7,418,000	5,827.00	43,224,686,000	貸付有価証券 276,200株
富士フイルムホールディングス	7,418,000	3,724.00	27,624,632,000	貸付有価証券 1,778,900株
資生堂	7,418,000	2,885.50	21,404,639,000	貸付有価証券 90,300株
日東電工	7,418,000	6,173.00	45,791,314,000	貸付有価証券 2,071,200株
協和発酵キリン	7,418,000	1,769.00	13,122,442,000	
武田薬品工業	7,418,000	4,253.00	31,548,754,000	貸付有価証券 2,063,500株
アステラス製薬	37,090,000	1,603.50	59,473,815,000	貸付有価証券 14,508,700株
大日本住友製薬	7,418,000	1,874.00	13,901,332,000	貸付有価証券 4,925,100株
塩野義製薬	7,418,000	5,539.00	41,088,302,000	貸付有価証券 819,000株 (46,600株)
中外製薬	7,418,000	3,680.00	27,298,240,000	貸付有価証券 242,000株
エーザイ	7,418,000	5,509.00	40,865,762,000	貸付有価証券 17,200株
第一三共	7,418,000	2,547.50	18,897,355,000	貸付有価証券 170,500株
昭和シェル石油	7,418,000	889.00	6,594,602,000	貸付有価証券 34,100株
J Xホールディングス	7,418,000	381.00	2,826,258,000	貸付有価証券 406,200株
横浜ゴム	3,709,000	1,237.00	4,588,033,000	貸付有価証券 336,800株 (26,500株)
ブリヂストン	7,418,000	3,140.00	23,292,520,000	貸付有価証券 271,700株
旭硝子	7,418,000	490.00	3,634,820,000	
日本板硝子	7,418,000	60.00	445,080,000	貸付有価証券 4,970,000株 (16,000株)
日本電気硝子	11,127,000	418.00	4,651,086,000	貸付有価証券 430,000株 (430,000株)
住友大阪セメント	7,418,000	448.00	3,323,264,000	貸付有価証券 33,000株
太平洋セメント	7,418,000	248.00	1,839,664,000	貸付有価証券 322,000株 (322,000株)
東海カーボン	7,418,000	251.00	1,861,918,000	
TOTO	3,709,000	3,900.00	14,465,100,000	貸付有価証券 1,215,100株

日本碍子	7,418,000	1,918.00	14,227,724,000	貸付有価証券 35,000株
新日鐵住金	741,800	1,864.00	1,382,715,200	
神戸製鋼所	7,418,000	82.00	608,276,000	貸付有価証券 2,486,000株 (1,759,000株)
ジェイ エフ イー ホールディングス	741,800	1,242.50	921,686,500	
日新製鋼	741,800	1,242.00	921,315,600	貸付有価証券 1,500株
大太平洋金属	7,418,000	278.00	2,062,204,000	貸付有価証券 4,970,000株 (267,000株)
日本軽金属ホールディングス	7,418,000	216.00	1,602,288,000	貸付有価証券 4,866,000株 (794,000株)
三井金属鉱業	7,418,000	173.00	1,283,314,000	
東邦亜鉛	7,418,000	333.00	2,470,194,000	貸付有価証券 2,466,000株 (175,000株)
三菱マテリアル	7,418,000	241.00	1,787,738,000	
住友金属鉱山	7,418,000	1,031.00	7,647,958,000	
DOWAホールディングス	7,418,000	526.00	3,901,868,000	貸付有価証券 2,376,000株
古河機械金属	7,418,000	123.00	912,414,000	貸付有価証券 873,000株
古河電気工業	7,418,000	243.00	1,802,574,000	
住友電気工業	7,418,000	1,244.00	9,227,992,000	
フジクラ	7,418,000	435.00	3,226,830,000	
SUMCO	741,800	597.00	442,854,600	貸付有価証券 480,100株
東洋製罐グループホールディングス	7,418,000	1,921.00	14,249,978,000	貸付有価証券 35,200株
日本製鋼所	7,418,000	436.00	3,234,248,000	貸付有価証券 1,619,000株
オークマ	7,418,000	640.00	4,747,520,000	貸付有価証券 2,275,000株 (319,000株)
アマダホールディングス	7,418,000	967.00	7,173,206,000	貸付有価証券 164,500株
小松製作所	7,418,000	1,759.00	13,048,262,000	
住友重機械工業	7,418,000	426.00	3,160,068,000	
日立建機	7,418,000	1,378.00	10,222,004,000	貸付有価証券 2,689,800株 (289,900株)
クボタ	7,418,000	1,276.00	9,465,368,000	貸付有価証券 2,622,000株

荏原製作所	7,418,000	559.00	4,146,662,000	
ダイキン工業	7,418,000	8,029.00	59,559,122,000	貸付有価証券 3,299,200 株
日本精工	7,418,000	702.00	5,207,436,000	貸付有価証券 184,200 株
N T N	7,418,000	243.00	1,802,574,000	貸付有価証券 266,000 株 (266,000 株)
ジェイテクト	7,418,000	1,041.00	7,722,138,000	
日立造船	1,483,600	464.00	688,390,400	
三菱重工業	7,418,000	413.60	3,068,084,800	
I H I	7,418,000	274.00	2,032,532,000	貸付有価証券 4,970,000 株 (77,000 株)
日清紡ホールディングス	7,418,000	893.00	6,624,274,000	
コニカミノルタ	7,418,000	715.00	5,303,870,000	
ミネベア	7,418,000	617.00	4,576,906,000	貸付有価証券 338,000 株
日立製作所	7,418,000	403.30	2,991,679,400	
東芝	7,418,000	269.50	1,999,151,000	貸付有価証券 4,640,000 株 (31,000 株)
三菱電機	7,418,000	1,108.00	8,219,144,000	貸付有価証券 508,000 株
富士電機	7,418,000	398.00	2,952,364,000	
安川電機	7,418,000	1,204.00	8,931,272,000	貸付有価証券 4,826,200 株
明電舎	7,418,000	313.00	2,321,834,000	
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	7,418,000	386.00	2,863,348,000	貸付有価証券 1,169,000 株 (732,000 株)
日本電気	7,418,000	247.00	1,832,246,000	貸付有価証券 2,038,000 株
富士通	7,418,000	343.70	2,549,566,600	
沖電気工業	7,418,000	126.00	934,668,000	貸付有価証券 378,000 株 (173,000 株)
パナソニック	7,418,000	863.00	6,401,734,000	貸付有価証券 582,000 株
シャープ	7,418,000	103.00	764,054,000	貸付有価証券 2,686,000 株 (176,000 株)
ソニー	7,418,000	3,013.00	22,350,434,000	貸付有価証券 142,300 株 (60,900 株)
T D K	7,418,000	5,250.00	38,944,500,000	貸付有価証券 2,107,500 株

ミツミ電機	7,418,000	381.00	2,826,258,000	貸付有価証券 1,427,000株(72,800株)
アルプス電気	7,418,000	1,664.00	12,343,552,000	
パイオニア	7,418,000	164.00	1,216,552,000	貸付有価証券 4,970,000株
横河電機	7,418,000	1,151.00	8,538,118,000	貸付有価証券 1,175,200株 (513,700株)
アドバンテスト	14,836,000	1,029.00	15,266,244,000	貸付有価証券 8,132,800株 (1,573,000株)
カシオ計算機	7,418,000	1,422.00	10,548,396,000	貸付有価証券 4,658,300株
ファナック	7,418,000	15,500.00	114,979,000,000	貸付有価証券 3,066,200株
京セラ	14,836,000	4,613.00	68,438,468,000	貸付有価証券 7,151,500株
太陽誘電	7,418,000	781.00	5,793,458,000	貸付有価証券 294,100株
S C R E E Nホールディングス	7,418,000	1,045.00	7,751,810,000	貸付有価証券 1,036,000株 (197,000株)
キヤノン	11,127,000	2,802.50	31,183,417,500	貸付有価証券 1,215,500株
リコー	7,418,000	823.00	6,105,014,000	貸付有価証券 3,850,400株 (209,300株)
東京エレクトロン	7,418,000	8,490.00	62,978,820,000	貸付有価証券 1,370,000株
デンソー	7,418,000	3,399.00	25,213,782,000	
三井造船	7,418,000	133.00	986,594,000	
川崎重工業	7,418,000	260.00	1,928,680,000	
日産自動車	7,418,000	918.90	6,816,400,200	貸付有価証券 196,100株
いすゞ自動車	3,709,000	1,232.00	4,569,488,000	貸付有価証券 851,700株
トヨタ自動車	7,418,000	5,055.00	37,497,990,000	貸付有価証券 2,699,500株(12,500株)
日野自動車	7,418,000	916.00	6,794,888,000	
三菱自動車工業	741,800	442.00	327,875,600	貸付有価証券 46,600株
マツダ	1,483,600	1,211.50	1,797,381,400	
本田技研工業	14,836,000	2,476.50	36,741,354,000	貸付有価証券 494,200株
スズキ	7,418,000	2,691.00	19,961,838,000	
富士重工業	7,418,000	3,288.00	24,390,384,000	

テルモ	14,836,000	4,495.00	66,687,820,000	貸付有価証券 6,908,300株(18,600株)
ニコン	7,418,000	1,366.00	10,132,988,000	貸付有価証券 4,942,200株 (2,119,100株)
オリンパス	7,418,000	3,425.00	25,406,650,000	貸付有価証券 3,240,200株
シチズンホールディングス	7,418,000	482.00	3,575,476,000	貸付有価証券 2,832,700株 (155,300株)
凸版印刷	7,418,000	854.00	6,334,972,000	
大日本印刷	7,418,000	1,165.00	8,641,970,000	
ヤマハ	7,418,000	2,589.00	19,205,202,000	貸付有価証券 110,000株(18,400株)
東京電力ホールディングス	741,800	403.00	298,945,400	貸付有価証券 472,400株
中部電力	741,800	1,422.00	1,054,839,600	貸付有価証券 74,600株(74,600株)
関西電力	741,800	956.70	709,680,060	貸付有価証券 445,100株
東京瓦斯	7,418,000	414.60	3,075,502,800	貸付有価証券 1,015,000株
大阪瓦斯	7,418,000	390.50	2,896,729,000	貸付有価証券 2,454,000株
東武鉄道	7,418,000	563.00	4,176,334,000	貸付有価証券 409,000株(409,000株)
東京急行電鉄	7,418,000	861.00	6,386,898,000	
小田急電鉄	7,418,000	1,197.00	8,879,346,000	貸付有価証券 2,043,000株
京王電鉄	7,418,000	956.00	7,091,608,000	貸付有価証券 419,000株
京成電鉄	7,418,000	1,294.00	9,598,892,000	貸付有価証券 508,000株
東日本旅客鉄道	741,800	9,339.00	6,927,670,200	貸付有価証券 286,100株(206,700株)
西日本旅客鉄道	741,800	6,486.00	4,811,314,800	貸付有価証券 6,200株
東海旅客鉄道	741,800	18,065.00	13,400,617,000	
日本通運	7,418,000	469.00	3,479,042,000	
ヤマトホールディングス	7,418,000	2,546.00	18,886,228,000	貸付有価証券 1,071,600株
日本郵船	7,418,000	169.00	1,253,642,000	
商船三井	7,418,000	202.00	1,498,436,000	貸付有価証券 4,947,000株

川崎汽船	7,418,000	244.00	1,809,992,000	貸付有価証券 4,934,000株(28,000株)
ANAホールディングス	7,418,000	276.70	2,052,560,600	
三菱倉庫	7,418,000	1,360.00	10,088,480,000	貸付有価証券 1,831,000株
ヤフー	2,967,200	452.00	1,341,174,400	貸付有価証券 234,400株
トレンドマイクロ	7,418,000	3,630.00	26,927,340,000	貸付有価証券 2,216,500株
スカパーJ SATホールディングス	741,800	443.00	328,617,400	
日本電信電話	1,483,600	4,829.00	7,164,304,400	
KDDI	44,508,000	3,134.00	139,488,072,000	貸付有価証券 18,147,100株
NTTドコモ	741,800	2,795.00	2,073,331,000	
東宝	741,800	2,696.00	1,999,892,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	7,418,000	4,725.00	35,050,050,000	貸付有価証券 2,711,100株
コナミホールディングス	7,418,000	4,050.00	30,042,900,000	貸付有価証券 1,551,500株
ソフトバンクグループ	22,254,000	5,399.00	120,149,346,000	貸付有価証券 7,079,900株
双日	741,800	238.00	176,548,400	
伊藤忠商事	7,418,000	1,226.00	9,094,468,000	貸付有価証券 78,200株(78,200株)
丸紅	7,418,000	459.00	3,404,862,000	貸付有価証券 1,407,800株
豊田通商	7,418,000	2,177.00	16,148,986,000	貸付有価証券 21,500株
三井物産	7,418,000	1,188.00	8,812,584,000	貸付有価証券 239,900株
住友商事	7,418,000	1,015.00	7,529,270,000	貸付有価証券 284,200株
三菱商事	7,418,000	1,748.00	12,966,664,000	
J.フロントリテイリング	3,709,000	1,010.00	3,746,090,000	
三越伊勢丹ホールディングス	7,418,000	891.00	6,609,438,000	貸付有価証券 2,834,300株 (179,900株)
セブン&アイ・ホールディングス	7,418,000	4,078.00	30,250,604,000	貸付有価証券 4,368,200株 (129,000株)
高島屋	7,418,000	697.00	5,170,346,000	貸付有価証券 592,000株(424,000株)
丸井グループ	7,418,000	1,399.00	10,377,782,000	貸付有価証券 498,000株

イオン	7,418,000	1,444.50	10,715,301,000	貸付有価証券 4,288,400 株
ユニーグループ・ホールディングス	7,418,000	856.00	6,349,808,000	
ファーストリテイリング	7,418,000	25,445.00	188,751,010,000	貸付有価証券 2,281,100 株 (205,400 株)
コンコルディア・フィナンシャルグループ	7,418,000	379.00	2,811,422,000	貸付有価証券 369,400 株 (369,400 株)
新生銀行	7,418,000	134.00	994,012,000	貸付有価証券 4,832,000 株
あおぞら銀行	7,418,000	339.00	2,514,702,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,418,000	428.70	3,180,096,600	貸付有価証券 36,400 株
りそなホールディングス	741,800	358.00	265,564,400	貸付有価証券 220,700 株 (220,700 株)
三井住友トラスト・ホールディングス	7,418,000	289.80	2,149,736,400	
三井住友フィナンシャルグループ	741,800	2,775.00	2,058,495,000	貸付有価証券 25,800 株
千葉銀行	7,418,000	445.00	3,301,010,000	貸付有価証券 1,000 株
ふくおかフィナンシャルグループ	7,418,000	319.00	2,366,342,000	貸付有価証券 613,000 株 (339,000 株)
静岡銀行	7,418,000	657.00	4,873,626,000	貸付有価証券 101,000 株
みずほフィナンシャルグループ	7,418,000	142.00	1,053,356,000	
大和証券グループ本社	7,418,000	513.90	3,812,110,200	
野村ホールディングス	7,418,000	352.60	2,615,586,800	
松井証券	7,418,000	829.00	6,149,522,000	貸付有価証券 96,800 株
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1,854,500	2,600.00	4,821,700,000	
MS&ADインシュアランスグループホール	2,225,400	2,429.00	5,405,496,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,483,600	1,050.00	1,557,780,000	
第一生命保険	741,800	1,011.50	750,330,700	
東京海上ホールディングス	3,709,000	3,252.00	12,061,668,000	
T&Dホールディングス	1,483,600	813.00	1,206,166,800	
クレディセゾン	7,418,000	1,598.00	11,853,964,000	貸付有価証券 78,200 株
東急不動産ホールディングス	7,418,000	570.00	4,228,260,000	

	三井不動産	7,418,000	2,039.00	15,125,302,000	
	三菱地所	7,418,000	1,727.50	12,814,595,000	貸付有価証券 1,819,000 株
	東京建物	3,709,000	1,143.00	4,239,387,000	
	住友不動産	7,418,000	2,453.50	18,200,063,000	
	ディー・エヌ・エー	2,225,400	2,442.00	5,434,426,800	貸付有価証券 1,440,900 株
	電通	7,418,000	4,435.00	32,898,830,000	貸付有価証券 394,700 株
	東京ドーム	7,418,000	453.00	3,360,354,000	
	セコム	7,418,000	7,443.00	55,212,174,000	貸付有価証券 828,200 株
	小計	銘柄数：225		2,857,060,280,660	
		組入時価比率：98.8%		100.0%	
	合計			2,857,060,280,660	

(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。

(注 2) 備考欄の貸付有価証券の（ ）内は、委託者の利害関係人である野村証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(平成 28 年 7 月 8 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。