

平成28年7月期（平成27年7月11日～平成28年7月10日）決算短信

平成28年8月19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28年9月29日
 分配金支払開始日 平成28年8月18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11日～平成28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28年7月期	8,298	(99.8)	18	(0.2)	8,317	(100)
平成27年7月期	14,766	(99.9)	17	(0.1)	14,783	(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	46,534	0	11,902	34,632
平成27年7月期	46,534	0	0	46,534

(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28年7月期	8,532	215	8,317	24,017
平成27年7月期	15,018	234	14,783	31,769

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成28年7月期	553.40
平成27年7月期	437.00

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 300 株価指数連動型上場投資信託

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 21 期 (平成 27 年 7 月 10 日現在)	第 22 期 (平成 28 年 7 月 10 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	221,495,237	219,194,863
株式	14,766,206,740	8,298,765,370
未収入金	15,228,730	-
未収配当金	15,487,940	14,683,800
未収利息	350	-
流動資産合計	15,018,418,997	8,532,644,033
資産合計	15,018,418,997	8,532,644,033
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	203,357,936	191,654,478
未払受託者報酬	6,031,253	4,501,016
未払委託者報酬	25,331,008	18,904,184
未払利息	-	1,801
その他未払費用	120,573	89,940
流動負債合計	234,840,770	215,151,419
負債合計	234,840,770	215,151,419
純資産の部		
元本等		
元本	11,261,469,274	8,380,987,318
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	3,522,108,953	△63,494,704
(分配準備積立金)	37,653	27,763
元本等合計	14,783,578,227	8,317,492,614
純資産合計	14,783,578,227	8,317,492,614
負債純資産合計	15,018,418,997	8,532,644,033

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 7 月 10 日	第 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日
営業収益		
受取配当金	266,719,674	242,979,215
受取利息	48,511	28,174
有価証券売買等損益	3,061,191,039	△2,835,359,711
その他収益	77,698	134,016
営業収益合計	3,328,036,922	△2,592,218,306
営業費用		
支払利息	-	33,275

受託者報酬	12,162,467	9,858,990
委託者報酬	51,081,871	41,407,515
その他費用	243,154	197,037
営業費用合計	63,487,492	51,496,817
営業利益又は営業損失(△)	3,264,549,430	△2,643,715,123
経常利益又は経常損失(△)	3,264,549,430	△2,643,715,123
当期純利益又は当期純損失(△)	3,264,549,430	△2,643,715,123
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(△)	460,917,459	3,522,108,953
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	203,357,936	191,654,478
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,522,108,953	△63,494,704

(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る場合、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 27 年 7 月 11 日から平成 28 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 21 期 平成 27 年 7 月 10 日現在	第 22 期 平成 28 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 46,534,997 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 34,632,179 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 317.69 円 (100 口当たり純資産額) (31,769 円)	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)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 21 期 自平成 26 年 7 月 11 日 至平成 27 年 7 月 10 日	第 22 期 自平成 27 年 7 月 11 日 至平成 28 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>266,845,883 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>37,198 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	266,845,883 円	分配準備積立金	B	37,198 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>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> </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
項目																			
当期配当等収益額	A	266,845,883 円																	
分配準備積立金	B	37,198 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	266,883,081 円
経費	D	63,487,492 円
収益分配可能額	E=C-D	203,395,589 円
収益分配金	F	203,357,936 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	37,653 円
口数	H	46,534,997 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	437 円 00 銭

配当等収益合計額	C=A+B	243,145,783 円
経費	D	51,463,542 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

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 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 7 月 10 日	第 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 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 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。</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 21 期 平成 27 年 7 月 10 日現在	第 22 期 平成 28 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</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>

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 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 7 月 10 日	第 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 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 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 7 月 10 日	第 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日
期首元本額 11,261,469,274 円	期首元本額 11,261,469,274 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 2,880,481,956 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 7 月 10 日	第 22 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 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	3,036,726,398	△2,636,563,609
合計	3,036,726,398	△2,636,563,609

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 28 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	7,600	500.00	3,800,000	
		マルハニチロ	1,400	2,698.00	3,777,200	
		サカタのタネ	1,300	2,142.00	2,784,600	
		ホクト	900	1,845.00	1,660,500	
		国際石油開発帝石	40,100	741.50	29,734,150	
		コムシスホールディングス	3,900	1,636.00	6,380,400	
		大成建設	32,000	811.00	25,952,000	
		大林組	19,800	1,045.00	20,691,000	
		清水建設	22,000	931.00	20,482,000	
		鹿島建設	29,000	694.00	20,126,000	

西松建設	8,000	480.00	3,840,000
前田建設工業	5,000	785.00	3,925,000
奥村組	6,000	546.00	3,276,000
戸田建設	9,000	436.00	3,924,000
大東建託	2,100	16,255.00	34,135,500
N I P P O	3,000	1,694.00	5,082,000
前田道路	3,000	1,748.00	5,244,000
住友林業	4,900	1,420.00	6,958,000
パナホーム	5,000	796.00	3,980,000
大和ハウス工業	18,300	2,757.50	50,462,250
積水ハウス	19,500	1,653.00	32,233,500
中電工	1,800	1,968.00	3,542,400
関電工	6,000	855.00	5,130,000
九電工	1,800	3,050.00	5,490,000
日揮	7,000	1,439.00	10,073,000
高砂熱学工業	2,300	1,180.00	2,714,000
日清製粉グループ本社	8,300	1,645.00	13,653,500
山崎製パン	6,000	2,927.00	17,562,000
ヤクルト本社	4,800	4,875.00	23,400,000
明治ホールディングス	4,200	10,560.00	44,352,000
雪印メグミルク	1,900	3,660.00	6,954,000
日本ハム	6,000	2,517.00	15,102,000
伊藤ハム米久ホールディングス	8,200	1,052.00	8,626,400
サッポロホールディングス	2,200	2,964.00	6,520,800
アサヒグループホールディングス	13,300	3,366.00	44,767,800
キリンホールディングス	25,100	1,778.50	44,640,350
宝ホールディングス	6,000	929.00	5,574,000
伊藤園	2,400	3,930.00	9,432,000
キッコーマン	6,000	3,800.00	22,800,000
味の素	16,000	2,479.50	39,672,000
キューピー	4,200	3,350.00	14,070,000
ハウス食品グループ本社	2,800	2,416.00	6,764,800
ニチレイ	8,000	952.00	7,616,000
日清食品ホールディングス	3,200	5,520.00	17,664,000
日本たばこ産業	36,600	4,289.00	156,977,400
東洋紡	24,000	196.00	4,704,000

帝人	27,000	355.00	9,585,000
東レ	45,000	882.00	39,690,000
ワコールホールディングス	4,000	1,010.00	4,040,000
オンワードホールディングス	5,000	604.00	3,020,000
王子ホールディングス	28,000	384.00	10,752,000
日本製紙	3,200	1,801.00	5,763,200
レンゴー	7,000	693.00	4,851,000
クラレ	9,700	1,201.00	11,649,700
旭化成	38,000	698.50	26,543,000
住友化学	45,000	396.00	17,820,000
デンカ	13,000	400.00	5,200,000
信越化学工業	11,800	5,901.00	69,631,800
大陽日酸	11,900	863.00	10,269,700
日本触媒	1,100	5,740.00	6,314,000
カネカ	10,000	654.00	6,540,000
三菱瓦斯化学	13,000	506.00	6,578,000
三井化学	28,000	351.00	9,828,000
東京応化工業	1,200	2,464.00	2,956,800
三菱ケミカルホールディングス	41,300	445.70	18,407,410
ダイセル	9,600	983.00	9,436,800
積水化学工業	14,000	1,274.00	17,836,000
宇部興産	29,000	163.00	4,727,000
日立化成	5,700	1,812.00	10,328,400
花王	13,800	5,827.00	80,412,600
日本ペイントホールディングス	8,900	2,320.00	20,648,000
D I C	2,600	2,078.00	5,402,800
東洋インキ S Cホールディングス	8,000	413.00	3,304,000
富士フイルムホールディングス	14,100	3,724.00	52,508,400
資生堂	11,000	2,885.50	31,740,500
ライオン	8,000	1,689.00	13,512,000
日東電工	4,800	6,173.00	29,630,400
ユニ・チャーム	17,000	2,060.50	35,028,500
協和発酵キリン	15,800	1,769.00	27,950,200
武田薬品工業	21,700	4,253.00	92,290,100
アステラス製薬	59,000	1,603.50	94,606,500
塩野義製薬	9,600	5,539.00	53,174,400

田辺三菱製薬	15,400	1,834.00	28,243,600
中外製薬	15,300	3,680.00	56,304,000
エーザイ	8,100	5,509.00	44,622,900
第一三共	19,400	2,547.50	49,421,500
大正製薬ホールディングス	2,500	10,730.00	26,825,000
昭和シェル石油	10,300	889.00	9,156,700
東燃ゼネラル石油	10,000	917.00	9,170,000
J Xホールディングス	68,400	381.00	26,060,400
横浜ゴム	4,600	1,237.00	5,690,200
ブリヂストン	22,300	3,140.00	70,022,000
住友ゴム工業	7,200	1,300.00	9,360,000
旭硝子	33,000	490.00	16,170,000
日本板硝子	25,000	60.00	1,500,000
日本電気硝子	14,000	418.00	5,852,000
太平洋セメント	34,000	248.00	8,432,000
TOTO	4,900	3,900.00	19,110,000
日本碍子	9,000	1,918.00	17,262,000
新日鐵住金	26,100	1,864.00	48,650,400
神戸製鋼所	100,000	82.00	8,200,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	16,800	1,242.50	20,874,000
日新製鋼	3,000	1,242.00	3,726,000
日立金属	11,800	954.00	11,257,200
日本軽金属ホールディングス	14,900	216.00	3,218,400
三井金属鉱業	16,000	173.00	2,768,000
三菱マテリアル	36,000	241.00	8,676,000
住友金属鉱山	16,000	1,031.00	16,496,000
DOWAホールディングス	8,000	526.00	4,208,000
古河機械金属	11,000	123.00	1,353,000
古河電気工業	19,000	243.00	4,617,000
住友電気工業	21,800	1,244.00	27,119,200
フジクラ	8,000	435.00	3,480,000
SUMCO	8,000	597.00	4,776,000
東洋製罐グループホールディングス	6,000	1,921.00	11,526,000
三和ホールディングス	6,600	908.00	5,992,800
LIXILグループ	8,600	1,640.00	14,104,000

オークマ	5,000	640.00	3,200,000
アマダホールディングス	10,400	967.00	10,056,800
SMC	1,800	23,200.00	41,760,000
小松製作所	26,600	1,759.00	46,789,400
住友重機械工業	17,000	426.00	7,242,000
日立建機	5,900	1,378.00	8,130,200
クボタ	34,100	1,276.00	43,511,600
荏原製作所	13,000	559.00	7,267,000
ダイキン工業	8,000	8,029.00	64,232,000
栗田工業	3,300	2,148.00	7,088,400
椿本チエイン	5,000	601.00	3,005,000
ダイフク	3,400	1,782.00	6,058,800
平和	2,700	2,017.00	5,445,900
アマノ	2,100	1,708.00	3,586,800
セガサミーホールディングス	7,300	1,105.00	8,066,500
日本精工	15,100	702.00	10,600,200
NTN	15,000	243.00	3,645,000
ジェイテクト	9,400	1,041.00	9,785,400
不二越	7,000	259.00	1,813,000
三菱重工業	92,000	413.60	38,051,200
IHI	42,000	274.00	11,508,000
日清紡ホールディングス	4,900	893.00	4,375,700
ユニカミノルタ	13,800	715.00	9,867,000
ブラザー工業	7,600	1,000.00	7,600,000
ミネベア	10,900	617.00	6,725,300
日立製作所	133,000	403.30	53,638,900
東芝	116,000	269.50	31,262,000
三菱電機	59,000	1,108.00	65,372,000
富士電機	20,000	398.00	7,960,000
日本電気	71,000	247.00	17,537,000
富士通	57,000	343.70	19,590,900
パナソニック	67,200	863.00	57,993,600
シャープ	47,000	103.00	4,841,000
ソニー	34,600	3,013.00	104,249,800
TDK	3,600	5,250.00	18,900,000
ファナック	5,600	15,500.00	86,800,000

京セラ	10,400	4,613.00	47,975,200
村田製作所	6,200	10,475.00	64,945,000
キヤノン	36,600	2,802.50	102,571,500
リコー	20,400	823.00	16,789,200
東京エレクトロン	4,500	8,490.00	38,205,000
豊田自動織機	8,900	3,750.00	33,375,000
デンソー	24,200	3,399.00	82,255,800
三井造船	23,000	133.00	3,059,000
川崎重工業	46,000	260.00	11,960,000
日本車輛製造	4,000	270.00	1,080,000
日産自動車	120,400	918.90	110,635,560
トヨタ自動車	91,500	5,055.00	462,532,500
新明和工業	3,000	584.00	1,752,000
トピー工業	7,000	200.00	1,400,000
本田技研工業	49,700	2,476.50	123,082,050
シマノ	2,500	13,740.00	34,350,000
テルモ	10,400	4,495.00	46,748,000
島津製作所	8,000	1,348.00	10,784,000
ニコン	11,000	1,366.00	15,026,000
オリンパス	9,400	3,425.00	32,195,000
HOYA	11,100	3,527.00	39,149,700
シチズンホールディングス	9,100	482.00	4,386,200
バンダイナムコホールディングス	6,100	2,639.00	16,097,900
トッパン・フォームズ	3,200	1,042.00	3,334,400
凸版印刷	19,000	854.00	16,226,000
大日本印刷	18,000	1,165.00	20,970,000
日本写真印刷	1,200	1,781.00	2,137,200
アシックス	5,500	1,584.00	8,712,000
ヤマハ	5,400	2,589.00	13,980,600
リンテック	2,100	1,956.00	4,107,600
任天堂	3,900	16,270.00	63,453,000
タカラスタンダード	4,000	935.00	3,740,000
コクヨ	3,500	1,387.00	4,854,500
岡村製作所	3,100	962.00	2,982,200
東京電力ホールディングス	44,100	403.00	17,772,300
中部電力	20,800	1,422.00	29,577,600

関西電力	25,700	956.70	24,587,190	
東北電力	13,800	1,266.00	17,470,800	
九州電力	13,000	994.00	12,922,000	
東京瓦斯	66,000	414.60	27,363,600	
大阪瓦斯	57,000	390.50	22,258,500	
東武鉄道	29,000	563.00	16,327,000	
東京急行電鉄	34,000	861.00	29,274,000	
小田急電鉄	20,000	1,197.00	23,940,000	
東日本旅客鉄道	10,800	9,339.00	100,861,200	
西日本旅客鉄道	5,300	6,486.00	34,375,800	
東海旅客鉄道	5,600	18,065.00	101,164,000	
近鉄グループホールディングス	52,000	432.00	22,464,000	
阪急阪神ホールディングス	35,000	756.00	26,460,000	
日本通運	28,000	469.00	13,132,000	
ヤマトホールディングス	11,300	2,546.00	28,769,800	
福山通運	8,000	559.00	4,472,000	
セイノーホールディングス	5,700	973.00	5,546,100	
日本郵船	47,000	169.00	7,943,000	
商船三井	33,000	202.00	6,666,000	
日本航空	9,900	3,022.00	29,917,800	
ANAホールディングス	96,000	276.70	26,563,200	
三菱倉庫	5,000	1,360.00	6,800,000	
三井倉庫ホールディングス	3,000	253.00	759,000	
住友倉庫	5,000	480.00	2,400,000	
上組	8,000	893.00	7,144,000	
郵船ロジスティクス	1,200	947.00	1,136,400	
T I S	2,400	2,230.00	5,352,000	
野村総合研究所	6,600	3,475.00	22,935,000	
オービック	2,700	5,550.00	14,985,000	
ヤフー	156,100	452.00	70,557,200	
トレンドマイクロ	3,800	3,630.00	13,794,000	
日本オラクル	3,500	5,580.00	19,530,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	3,300	2,188.00	7,220,400	
大塚商会	2,600	4,765.00	12,389,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,200	1,115.00	1,338,000	

日本ユニシス	3,000	1,291.00	3,873,000
日本電信電話	38,900	4,829.00	187,848,100
KDD I	71,800	3,134.00	225,021,200
NTT ドコモ	108,500	2,795.00	303,257,500
東宝	5,200	2,696.00	14,019,200
エヌ・ティ・ティ・データ	7,700	4,725.00	36,382,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3,400	3,290.00	11,186,000
コナミホールディングス	3,900	4,050.00	15,795,000
ソフトバンクグループ	32,900	5,399.00	177,627,100
双日	34,300	238.00	8,163,400
伊藤忠商事	45,600	1,226.00	55,905,600
丸紅	47,600	459.00	21,848,400
豊田通商	9,700	2,177.00	21,116,900
三井物産	49,300	1,188.00	58,568,400
住友商事	34,300	1,015.00	34,814,500
三菱商事	43,600	1,748.00	76,212,800
キヤノンマーケティングジャパン	4,100	1,870.00	7,667,000
岩谷産業	7,000	573.00	4,011,000
サンリオ	2,400	1,720.00	4,128,000
スズケン	2,800	3,095.00	8,666,000
ローソン	2,700	8,040.00	21,708,000
エービーシー・マート	2,300	6,610.00	15,203,000
J. フロント リテイリング	7,400	1,010.00	7,474,000
三越伊勢丹ホールディングス	10,800	891.00	9,622,800
セブン&アイ・ホールディングス	24,300	4,078.00	99,095,400
良品計画	800	22,070.00	17,656,000
ファミリーマート	2,700	6,200.00	16,740,000
しまむら	1,000	15,140.00	15,140,000
高島屋	10,000	697.00	6,970,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	3,400	1,287.00	4,375,800
丸井グループ	7,600	1,399.00	10,632,400
イオン	23,900	1,444.50	34,523,550
ユニーグループ・ホールディングス	6,400	856.00	5,478,400
イズミ	2,200	3,810.00	8,382,000
ヤマダ電機	26,500	536.00	14,204,000

ニトリホールディングス	3,100	13,120.00	40,672,000
ファーストリテイリング	2,900	25,445.00	73,790,500
サンドラッグ	1,800	9,060.00	16,308,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	35,600	379.00	13,492,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	388,400	428.70	166,507,080
りそなホールディングス	48,100	358.00	17,219,800
三井住友トラスト・ホールディングス	107,000	289.80	31,008,600
三井住友フィナンシャルグループ	38,800	2,775.00	107,670,000
千葉銀行	24,000	445.00	10,680,000
常陽銀行	21,000	353.00	7,413,000
ふくおかフィナンシャルグループ	24,000	319.00	7,656,000
静岡銀行	18,000	657.00	11,826,000
みずほフィナンシャルグループ	686,600	142.00	97,497,200
大和証券グループ本社	48,000	513.90	24,667,200
野村ホールディングス	104,800	352.60	36,952,480
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	11,400	2,600.00	29,640,000
MS & ADインシュアランスグループホール	17,400	2,429.00	42,264,600
第一生命保険	32,800	1,011.50	33,177,200
東京海上ホールディングス	20,800	3,252.00	67,641,600
クレディセゾン	5,100	1,598.00	8,149,800
イオンフィナンシャルサービス	5,700	2,140.00	12,198,000
アコム	43,800	467.00	20,454,600
日立キャピタル	3,400	1,731.00	5,885,400
オリックス	36,300	1,251.00	45,411,300
三菱UFJリース	24,600	351.00	8,634,600
日本取引所グループ	15,100	1,155.00	17,440,500
三井不動産	27,000	2,039.00	55,053,000
三菱地所	38,000	1,727.50	65,645,000
住友不動産	13,000	2,453.50	31,895,500
イオンモール	6,200	1,212.00	7,514,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	9,000	1,014.00	9,126,000
ディー・エヌ・エー	4,100	2,442.00	10,012,200
電通	7,900	4,435.00	35,036,500
みらかホールディングス	1,600	4,470.00	7,152,000

	オリエンタルランド	10,000	6,359.00	63,590,000	
	ユー・エス・エス	8,600	1,589.00	13,665,400	
	楽天	39,200	1,050.00	41,160,000	
	東京ドーム	5,000	453.00	2,265,000	
	トランス・コスモス	1,300	2,877.00	3,740,100	
	セコム	6,400	7,443.00	47,635,200	
	ベネッセホールディングス	2,800	2,376.00	6,652,800	
	小計 銘柄数 : 300			8,298,765,370	
	組入時価比率 : 99.8%			100.0%	
	合計			8,298,765,370	

(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 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。