

平成28年10月期（平成28年4月8日～平成28年10月7日）決算短信

平成28年11月16日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信  
 コード番号 ( 1591 )  
 連動対象指標 JPX日経インデックス400  
 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12月15日  
 分配金支払開始日 平成28年11月15日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年10月期の運用状況（平成28年4月8日～平成28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28年10月期	289,301	(98.1)	5,719	(1.9)	295,021	(100)
平成28年4月期	226,826	(97.7)	5,280	(2.3)	232,106	(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10月期	20,201	7,691	3,524	24,368
平成28年4月期	17,053	5,893	2,746	20,201

(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/当特定期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
平成28年10月期	340,519	45,497	295,021	12,107
平成28年4月期	252,126	20,019	232,106	11,490

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成28年10月期	109.00
平成28年4月期	119.00

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 JPX日経インデックス400連動型上場投信

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 5 期 (平成 28 年 4 月 7 日現在)	第 6 期 (平成 28 年 10 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	18,694,373,424	-
コール・ローン	1,452,049,395	45,709,787,283
株式	226,826,185,830	289,301,867,960
派生商品評価勘定	-	50,650,002
未収入金	2,295,281,083	2,699,145,350
未収配当金	2,346,282,871	2,481,673,957
未収利息	110	800,259
その他未収収益	5,768,358	80,983,657
差入委託証拠金	506,539,602	194,239,501
流動資産合計	252,126,480,673	340,519,147,969
資産合計	252,126,480,673	340,519,147,969
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	267,817,518	-
未払収益分配金	2,403,973,978	2,656,116,251
未払受託者報酬	69,274,101	73,468,726
未払委託者報酬	209,839,528	223,175,433
未払利息	-	37,920
有価証券貸借取引受入金	17,040,187,499	42,459,480,261
その他未払費用	28,408,020	85,601,463
流動負債合計	20,019,500,644	45,497,880,054
負債合計	20,019,500,644	45,497,880,054
純資産の部		
元本等		
元本	234,862,197,212	283,302,821,414
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△2,755,217,183	11,718,446,501
(分配準備積立金)	11,864,702	89,781,401
元本等合計	232,106,980,029	295,021,267,915
純資産合計	232,106,980,029	295,021,267,915
負債純資産合計	252,126,480,673	340,519,147,969

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日
営業収益		

受取配当金	2,735,943,663	2,979,154,095
受取利息	4,768,818	1,588
有価証券売買等損益	△36,129,351,754	12,798,418,139
派生商品取引等損益	△649,522,566	227,650,574
その他収益	24,646,215	113,944,197
営業収益合計	△34,013,515,624	16,119,168,593
営業費用		
支払利息	2,350,203	△7,812,451
受託者報酬	69,274,101	73,468,726
委託者報酬	209,839,528	223,175,433
その他費用	73,784,934	70,235,222
営業費用合計	355,248,766	359,066,930
営業利益又は営業損失(△)	△34,368,764,390	15,760,101,663
経常利益又は経常損失(△)	△34,368,764,390	15,760,101,663
当期純利益又は当期純損失(△)	△34,368,764,390	15,760,101,663
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(△)	30,140,193,520	△2,755,217,183
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,522,135,011	1,500,754,332
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,522,135,011	1,500,754,332
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,644,807,346	131,076,060
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,644,807,346	131,076,060
分配金	2,403,973,978	2,656,116,251
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△2,755,217,183	11,718,446,501

## (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 28 年 4 月 8 日から平成 28 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 5 期 平成 28 年 4 月 7 日現在	第 6 期 平成 28 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 20,201,462 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 24,368,039 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 2,755,217,183 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 11,490 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 12,107 円
4. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 16,275,485,960 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 40,332,581,050 円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日			第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 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			項目		
当期配当等収益額	A	2,763,008,493 円	当期配当等収益額	A	3,100,912,331 円
分配準備積立金	B	5,728,750 円	分配準備積立金	B	11,864,702 円
配当等収益合計額	C=A+B	2,768,737,243 円	配当等収益合計額	C=A+B	3,112,777,033 円
経費	D	352,898,563 円	経費	D	366,879,381 円
収益分配可能額	E=C-D	2,415,838,680 円	収益分配可能額	E=C-D	2,745,897,652 円
収益分配金	F	2,403,973,978 円	収益分配金	F	2,656,116,251 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,864,702 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	89,781,401 円
口数	H	20,201,462 口	口数	H	24,368,039 口
1 口当たり分配金	I=F/H	119 円	1 口当たり分配金	I=F/H	109 円
2. その他費用 その他費用のうち 53,935,926 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 56,559,457 円は、対象指数についての商標使用料であります。		
			3. 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 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日		第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 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。		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		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。

同左

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

第 5 期 平成 28 年 4 月 7 日現在	第 6 期 平成 28 年 10 月 7 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 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 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 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日
期首元本額 198,268,257,742 円	期首元本額 234,862,197,212 円
期中追加設定元本額 68,522,527,904 円	期中追加設定元本額 89,418,088,842 円
期中一部交換元本額 31,928,588,434 円	期中一部交換元本額 40,977,464,640 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 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	△34,645,600,612	12,409,597,945
合計	△34,645,600,612	12,409,597,945

## 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 5 期(平成 28 年 4 月 7 日現在)				第 6 期(平成 28 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)
		うち 1 年超				うち 1 年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	5,467,303,602	—	5,200,218,000	△267,817,518	5,612,521,500	—	5,663,929,500	50,650,002
合計	5,467,303,602	—	5,200,218,000	△267,817,518	5,612,521,500	—	5,663,929,500	50,650,002

(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 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	279,600	444.00	124,142,400	
		国際石油開発帝石	1,152,900	965.80	1,113,470,820	
		安藤・間	146,000	597.00	87,162,000	
		東急建設	71,200	989.00	70,416,800	
		コムシスホールディングス	94,100	1,766.00	166,180,600	貸付有価証券 800 株
		大成建設	1,137,000	745.00	847,065,000	貸付有価証券 47,000 株
		大林組	656,300	961.00	630,704,300	
		清水建設	669,000	883.00	590,727,000	貸付有価証券 60,000 株
		長谷工コーポレーション	255,400	938.00	239,565,200	貸付有価証券 156,200 株
		鹿島建設	1,026,000	694.00	712,044,000	
		三井住友建設	838,500	95.00	79,657,500	
		熊谷組	321,000	260.00	83,460,000	
		大東建託	80,500	15,605.00	1,256,202,500	
		NIPPO	51,000	1,929.00	98,379,000	貸付有価証券 4,000 株
		前田道路	69,000	1,786.00	123,234,000	
住友林業	150,600	1,380.00	207,828,000	貸付有価証券 19,400 株		

大和ハウス工業	646,500	2,666.00	1,723,569,000	貸付有価証券 5,000株
積水ハウス	731,700	1,649.50	1,206,939,150	
協和エクシオ	85,700	1,441.00	123,493,700	
九電工	40,700	3,610.00	146,927,000	貸付有価証券 25,900株 (1,000株)
日揮	219,900	1,800.00	395,820,000	貸付有価証券 58,300株
江崎グリコ	50,500	5,840.00	294,920,000	
カルビー	81,100	3,740.00	303,314,000	貸付有価証券 52,600株
ヤクルト本社	117,300	4,600.00	539,580,000	貸付有価証券 60,400株 (52,700 株)
明治ホールディングス	129,600	10,130.00	1,312,848,000	
日本ハム	161,000	2,419.00	389,459,000	貸付有価証券 46,000株 (9,000株)
アサヒグループホールディングス	410,600	3,706.00	1,521,683,600	貸付有価証券 116,000株
キリンホールディングス	942,300	1,667.00	1,570,814,100	貸付有価証券 586,200株
伊藤園	64,900	3,635.00	235,911,500	貸付有価証券 300株
キッコーマン	166,000	3,310.00	549,460,000	
味の素	450,800	2,296.50	1,035,262,200	貸付有価証券 39,700株
キューピー	111,300	2,953.00	328,668,900	
ニチレイ	116,600	2,209.00	257,569,400	
東洋水産	107,600	4,350.00	468,060,000	
日清食品ホールディングス	92,600	6,140.00	568,564,000	貸付有価証券 45,500株
日本たばこ産業	922,300	4,118.00	3,798,031,400	貸付有価証券 399,200株
東レ	1,484,000	943.80	1,400,599,200	貸付有価証券 238,000株
王子ホールディングス	800,000	409.00	327,200,000	貸付有価証券 3,000株
大王製紙	90,600	1,235.00	111,891,000	貸付有価証券 57,200株 (17,500 株)
クラレ	344,300	1,507.00	518,860,100	貸付有価証券 203,600株
旭化成	1,276,000	822.60	1,049,637,600	貸付有価証券 110,000株
住友化学	1,506,000	472.00	710,832,000	
日産化学工業	121,400	3,175.00	385,445,000	貸付有価証券 900株 (500株)

東ソー	552,000	649.00	358,248,000	
デンカ	424,000	432.00	183,168,000	貸付有価証券 11,000株
信越化学工業	366,900	7,504.00	2,753,217,600	
エア・ウォーター	168,700	1,882.00	317,493,400	
大陽日酸	157,600	1,056.00	166,425,600	貸付有価証券 500株 (500株)
日本パーカライジング	104,500	1,430.00	149,435,000	
三菱瓦斯化学	175,900	1,493.00	262,618,700	
J S R	191,900	1,654.00	317,402,600	貸付有価証券 102,200株 (8,400 株)
三菱ケミカルホールディ ングス	1,370,200	664.90	911,045,980	
ダイセル	275,900	1,259.00	347,358,100	
積水化学工業	464,400	1,488.00	691,027,200	
日本ゼオン	173,000	935.00	161,755,000	
アイカ工業	61,500	2,703.00	166,234,500	
宇部興産	1,095,000	199.00	217,905,000	
日立化成	101,100	2,428.00	245,470,800	
日本化薬	133,000	1,135.00	150,955,000	貸付有価証券 16,000株
日油	153,000	1,068.00	163,404,000	
花王	519,600	5,724.00	2,974,190,400	貸付有価証券 289,500株
日本ペイントホールディ ングス	157,900	3,565.00	562,913,500	
関西ペイント	231,500	2,221.00	514,161,500	貸付有価証券 14,000株 (8,500株)
D I C	80,800	3,230.00	260,984,000	貸付有価証券 5,400株
富士フイルムホールディ ングス	468,100	3,798.00	1,777,843,800	
資生堂	388,100	2,670.00	1,036,227,000	貸付有価証券 241,700株
コーセー	33,100	10,030.00	331,993,000	
シーズ・ホールディン グス	26,500	2,943.00	77,989,500	
小林製薬	61,900	5,280.00	326,832,000	
日東電工	158,100	6,805.00	1,075,870,500	貸付有価証券 400株 (400株)
ニフコ	39,100	5,470.00	213,877,000	貸付有価証券 7,800株
ユニ・チャーム	414,200	2,611.00	1,081,476,200	貸付有価証券 268,700株 (100,500 株)

				株)
協和発酵キリン	244,700	1,566.00	383,200,200	貸付有価証券 126,700株
武田薬品工業	814,900	4,867.00	3,966,118,300	貸付有価証券 11,500株
アステラス製薬	2,220,500	1,567.00	3,479,523,500	貸付有価証券 382,500株
塩野義製薬	298,100	5,242.00	1,562,640,200	
田辺三菱製薬	238,300	2,151.00	512,583,300	
中外製薬	203,700	3,650.00	743,505,000	貸付有価証券 126,100株
科研製薬	35,300	6,340.00	223,802,000	
エーザイ	251,800	6,469.00	1,628,894,200	
小野薬品工業	464,500	3,140.00	1,458,530,000	
久光製薬	63,500	5,360.00	340,360,000	貸付有価証券 9,100株
参天製薬	376,800	1,516.00	571,228,800	貸付有価証券 15,800株 (15,800 株)
ツムラ	64,400	2,910.00	187,404,000	貸付有価証券 4,300株
沢井製薬	34,700	7,090.00	246,023,000	
第一三共	688,000	2,454.50	1,688,696,000	貸付有価証券 55,700株
キョーリン製薬ホールディングス	54,500	2,294.00	125,023,000	
大塚ホールディングス	439,800	4,549.00	2,000,650,200	貸付有価証券 275,500株
大正製薬ホールディングス	49,200	10,140.00	498,888,000	
横浜ゴム	123,400	1,700.00	209,780,000	貸付有価証券 80,000株 (4,300株)
東洋ゴム工業	108,000	1,519.00	164,052,000	
ブリヂストン	690,300	3,948.00	2,725,304,400	貸付有価証券 18,000株
住友ゴム工業	191,400	1,619.00	309,876,600	
旭硝子	1,008,000	664.00	669,312,000	貸付有価証券 630,000株
住友大阪セメント	405,000	441.00	178,605,000	
太平洋セメント	1,302,000	285.00	371,070,000	貸付有価証券 4,000株
TOTO	150,300	3,870.00	581,661,000	貸付有価証券 45,000株 (1,500株)
日本碍子	258,200	2,114.00	545,834,800	貸付有価証券 700株
日本特殊陶業	176,200	1,927.00	339,537,400	貸付有価証券 56,300株

新日鐵住金	922,100	2,135.50	1,969,144,550	
神戸製鋼所	375,600	914.00	343,298,400	貸付有価証券 204,900株 (19,300 株)
ジェイ エフ イー ホールディングス	558,900	1,531.00	855,675,900	貸付有価証券 111,200株
日立金属	234,100	1,282.00	300,116,200	
三菱マテリアル	127,600	2,754.00	351,410,400	
住友金属鉱山	564,000	1,318.00	743,352,000	
DOWAホールディングス	263,000	767.00	201,721,000	貸付有価証券 83,000株
住友電気工業	818,500	1,482.00	1,213,017,000	
三和ホールディングス	202,900	972.00	197,218,800	
三協立山	26,800	1,545.00	41,406,000	貸付有価証券 6,400株
リンナイ	38,000	9,330.00	354,540,000	貸付有価証券 700株 (700株)
日本発條	192,400	993.00	191,053,200	
オーエスジー	93,100	2,090.00	194,579,000	貸付有価証券 60,400株 (46,600 株)
DMG森精機	120,900	1,098.00	132,748,200	貸付有価証券 75,200株
ディスコ	26,000	12,500.00	325,000,000	
ニューフレアテクノロジー	3,600	5,670.00	20,412,000	貸付有価証券 2,300株 (1,700株)
ナブテスコ	106,200	2,920.00	310,104,000	貸付有価証券 6,700株 (6,700株)
SMC	61,300	29,760.00	1,824,288,000	
小松製作所	1,002,100	2,367.50	2,372,471,750	
住友重機械工業	596,000	512.00	305,152,000	
日立建機	91,300	2,067.00	188,717,100	貸付有価証券 10,400株 (3,000株)
クボタ	981,500	1,562.00	1,533,103,000	貸付有価証券 610,600株 (182,700 株)
荏原製作所	90,500	3,145.00	284,622,500	貸付有価証券 900株 (300株)
ダイキン工業	284,400	9,699.00	2,758,395,600	貸付有価証券 71,300株
椿本チエイン	116,000	808.00	93,728,000	
ダイフク	104,900	1,874.00	196,582,600	
タダノ	94,200	1,096.00	103,243,200	
平和	60,500	2,255.00	136,427,500	

竹内製作所	38,600	1,891.00	72,992,600	
T P R	24,000	2,960.00	71,040,000	貸付有価証券 1,700株
ホシザキ	57,100	9,060.00	517,326,000	貸付有価証券 14,300株
日本精工	401,200	1,101.00	441,721,200	貸付有価証券 17,000株
ジェイテクト	208,200	1,566.00	326,041,200	
不二越	196,000	375.00	73,500,000	貸付有価証券 127,000株 (10,000 株)
T H K	129,900	2,056.00	267,074,400	貸付有価証券 26,000株
イーグル工業	24,100	1,382.00	33,306,200	
マキタ	127,400	7,240.00	922,376,000	貸付有価証券 14,100株
三菱重工業	3,478,000	438.50	1,525,103,000	
I H I	1,501,000	296.00	444,296,000	貸付有価証券 195,000株
コニカミノルタ	487,700	897.00	437,466,900	貸付有価証券 69,600株 (3,900株)
ブラザー工業	252,500	1,840.00	464,600,000	貸付有価証券 5,100株
ミネベア	314,700	1,005.00	316,273,500	
日立製作所	4,983,000	524.50	2,613,583,500	
三菱電機	2,083,500	1,337.50	2,786,681,250	貸付有価証券 87,000株
富士電機	589,000	500.00	294,500,000	
安川電機	242,600	1,560.00	378,456,000	貸付有価証券 30,600株 (20,000 株)
日本電産	235,000	9,296.00	2,184,560,000	貸付有価証券 121,700株
オムロン	220,600	3,760.00	829,456,000	貸付有価証券 11,400株 (11,400 株)
日本電気	2,685,000	268.00	719,580,000	貸付有価証券 680,000株
富士通	1,883,000	570.10	1,073,498,300	
沖電気工業	84,600	1,400.00	118,440,000	貸付有価証券 47,000株
ルネサスエレクトロニクス	101,100	640.00	64,704,000	貸付有価証券 65,500株
セイコーエプソン	290,800	1,962.00	570,549,600	
エレコム	16,900	2,184.00	36,909,600	
パナソニック	2,231,500	1,047.50	2,337,496,250	貸付有価証券 237,300株

富士通ゼネラル	60,000	2,169.00	130,140,000	
日立国際電気	44,700	1,928.00	86,181,600	
TDK	117,900	7,110.00	838,269,000	
アルプス電気	168,300	2,615.00	440,104,500	
ヒロセ電機	31,600	13,790.00	435,764,000	
日本航空電子工業	56,000	1,693.00	94,808,000	貸付有価証券 36,000株(36,000 株)
横河電機	195,500	1,408.00	275,264,000	貸付有価証券 12,400株
日本光電工業	81,600	2,539.00	207,182,400	貸付有価証券 3,300株
堀場製作所	38,700	4,845.00	187,501,500	貸付有価証券 10,800株(200株)
キーエンス	44,200	76,800.00	3,394,560,000	貸付有価証券 27,400株
シスメックス	151,700	7,560.00	1,146,852,000	
スタンレー電気	139,600	2,799.00	390,740,400	
カシオ計算機	195,800	1,440.00	281,952,000	貸付有価証券 2,900株
ファナック	198,000	18,410.00	3,645,180,000	貸付有価証券 18,700株
エンプラス	10,000	3,225.00	32,250,000	貸付有価証券 500株(500株)
浜松ホトニクス	152,400	3,145.00	479,298,000	貸付有価証券 89,100株
京セラ	320,600	4,965.00	1,591,779,000	貸付有価証券 11,600株
村田製作所	206,000	13,795.00	2,841,770,000	
小糸製作所	117,000	5,270.00	616,590,000	貸付有価証券 72,600株
ミツバ	33,200	1,461.00	48,505,200	
SCREENホールディングス	40,000	6,810.00	272,400,000	貸付有価証券 2,100株
キヤノン	1,051,500	2,991.50	3,145,562,250	貸付有価証券 650,900株
リコー	632,500	933.00	590,122,500	貸付有価証券 92,700株
東京エレクトロン	160,300	9,217.00	1,477,485,100	貸付有価証券 30,400株
豊田自動織機	177,800	4,985.00	886,333,000	
デンソー	433,400	4,198.00	1,819,413,200	
川崎重工業	1,520,000	294.00	446,880,000	
名村造船所	58,600	713.00	41,781,800	貸付有価証券 200株(200株)

日産自動車	2,662,700	1,013.00	2,697,315,100	貸付有価証券 49,200株
いすゞ自動車	566,000	1,253.50	709,481,000	貸付有価証券 94,900株
トヨタ自動車	818,900	6,006.00	4,918,313,400	貸付有価証券 79,400株
日野自動車	278,800	1,121.00	312,534,800	貸付有価証券 27,600株
日信工業	43,700	1,612.00	70,444,400	貸付有価証券 26,600株 (4,400株)
NOK	94,500	2,316.00	218,862,000	貸付有価証券 200株 (200株)
カルソニックカンセイ	149,000	974.00	145,126,000	貸付有価証券 3,000株
アイシン精機	200,200	4,815.00	963,963,000	
マツダ	618,400	1,668.00	1,031,491,200	
本田技研工業	1,569,000	3,069.00	4,815,261,000	貸付有価証券 97,300株
スズキ	357,300	3,521.00	1,258,053,300	貸付有価証券 206,500株 (900株)
富士重工業	606,400	3,950.00	2,395,280,000	
ヤマハ発動機	275,900	2,183.00	602,289,700	貸付有価証券 170,900株 (100株)
豊田合成	71,000	2,494.00	177,074,000	
シマノ	78,700	16,330.00	1,285,171,000	貸付有価証券 48,700株
テイ・エス テック	45,400	2,734.00	124,123,600	
テルモ	299,400	3,965.00	1,187,121,000	貸付有価証券 23,300株
島津製作所	251,000	1,573.00	394,823,000	
ニコン	364,700	1,567.00	571,484,900	貸付有価証券 236,600株 (37,500株)
トプコン	65,500	1,490.00	97,595,000	貸付有価証券 31,500株 (3,600株)
オリンパス	290,900	3,745.00	1,089,420,500	貸付有価証券 157,400株
HOYA	433,900	4,199.00	1,821,946,100	
朝日インテック	46,700	4,435.00	207,114,500	貸付有価証券 1,300株
セイコーホールディングス	126,000	328.00	41,328,000	貸付有価証券 77,000株 (24,000株)
バンダイナムコホールディングス	201,900	3,135.00	632,956,500	
パイロットコーポレーション	34,100	4,280.00	145,948,000	

アシックス	194,000	2,143.00	415,742,000	貸付有価証券 39,000株(35,200 株)
ヤマハ	143,500	3,460.00	496,510,000	貸付有価証券 12,900株(2,500株)
ピジョン	110,700	3,005.00	332,653,500	貸付有価証券 62,800株
中部電力	597,600	1,449.00	865,922,400	
東北電力	488,000	1,279.00	624,152,000	
電源開発	166,500	2,390.00	397,935,000	貸付有価証券 100,900株
東京瓦斯	2,095,000	453.90	950,920,500	貸付有価証券 74,000株
大阪瓦斯	2,022,000	418.70	846,611,400	
東邦瓦斯	492,000	928.00	456,576,000	貸付有価証券 59,000株(24,000 株)
東武鉄道	1,044,000	502.00	524,088,000	貸付有価証券 66,000株(66,000 株)
相鉄ホールディングス	446,000	501.00	223,446,000	
東京急行電鉄	1,137,000	755.00	858,435,000	
小田急電鉄	312,900	2,198.00	687,754,200	貸付有価証券 146,600株
京王電鉄	546,000	863.00	471,198,000	
京成電鉄	146,400	2,452.00	358,972,800	
東日本旅客鉄道	354,200	9,064.00	3,210,468,800	貸付有価証券 119,500株(79,200 株)
西日本旅客鉄道	188,000	6,275.00	1,179,700,000	貸付有価証券 29,600株
東海旅客鉄道	174,900	17,340.00	3,032,766,000	貸付有価証券 31,600株
西日本鉄道	337,000	479.00	161,423,000	
近鉄グループホールディングス	1,966,000	419.00	823,754,000	貸付有価証券 216,000株
阪急阪神ホールディングス	262,200	3,410.00	894,102,000	貸付有価証券 4,500株
南海電気鉄道	585,000	493.00	288,405,000	
京阪ホールディングス	583,000	694.00	404,602,000	
名古屋鉄道	948,000	539.00	510,972,000	貸付有価証券 615,000株
日本通運	755,000	487.00	367,685,000	
ヤマトホールディングス	349,200	2,348.50	820,096,200	貸付有価証券 2,600株
山九	257,000	590.00	151,630,000	貸付有価証券 41,000株

日本郵船	1,753,000	206.00	361,118,000	
日本航空	373,900	3,028.00	1,132,169,200	
A N A ホールディングス	3,625,000	276.20	1,001,225,000	貸付有価証券 577,000株
グリーン	117,100	572.00	66,981,200	
ネクソン	211,900	1,635.00	346,456,500	
コロプラ	53,600	1,574.00	84,366,400	貸付有価証券 33,200株
ティーガイア	19,200	1,500.00	28,800,000	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	449,100	248.00	111,376,800	貸付有価証券 279,600株(800株)
野村総合研究所	131,000	3,555.00	465,705,000	
オービック	66,400	5,240.00	347,936,000	貸付有価証券 600株
ヤフー	1,381,600	407.00	562,311,200	貸付有価証券 368,600株(41,100 株)
トレンドマイクロ	102,100	3,605.00	368,070,500	貸付有価証券 63,500株
日本オラクル	30,900	5,600.00	173,040,000	
伊藤忠テクノソリューシ ョンズ	43,700	2,686.00	117,378,200	
大塚商会	51,900	4,900.00	254,310,000	貸付有価証券 31,200株
U S E N	87,900	333.00	29,270,700	貸付有価証券 53,200株
日本テレビホールディン グス	176,000	1,770.00	311,520,000	貸付有価証券 12,800株
日本電信電話	840,900	4,606.00	3,873,185,400	
K D D I	1,296,600	3,067.00	3,976,672,200	貸付有価証券 100,100株
光通信	23,200	9,190.00	213,208,000	
N T T ドコモ	1,440,400	2,459.00	3,541,943,600	
G M O インターネット	70,300	1,322.00	92,936,600	貸付有価証券 45,600株(14,100 株)
東宝	137,500	3,210.00	441,375,000	貸付有価証券 89,200株(85,500 株)
エヌ・ティ・ティ・デー タ	119,100	5,060.00	602,646,000	
S C S K	45,800	3,915.00	179,307,000	
ソフトバンクグループ	697,200	6,547.00	4,564,568,400	貸付有価証券 49,900株
双日	1,214,400	270.00	327,888,000	
アルフレッサ ホールデ	242,300	2,096.00	507,860,800	

インクス				
シップヘルスケアホールディングス	39,100	3,025.00	118,277,500	
第一興商	45,400	4,105.00	186,367,000	
メディパルホールディングス	192,800	1,753.00	337,978,400	
伊藤忠商事	1,512,700	1,285.00	1,943,819,500	
丸紅	1,897,100	531.70	1,008,688,070	
豊田通商	214,700	2,397.00	514,635,900	
兼松	410,000	159.00	65,190,000	
三井物産	1,743,200	1,402.50	2,444,838,000	貸付有価証券 13,200 株 (13,200 株)
日立ハイテクノロジーズ	66,800	4,175.00	278,890,000	
住友商事	1,213,500	1,175.50	1,426,469,250	
三菱商事	1,446,400	2,317.50	3,352,032,000	
阪和興業	193,000	632.00	121,976,000	
岩谷産業	229,000	621.00	142,209,000	貸付有価証券 141,000 株 (14,000 株)
東邦ホールディングス	61,700	2,137.00	131,852,900	貸付有価証券 1,000 株
サンリオ	59,400	1,891.00	112,325,400	貸付有価証券 36,700 株
日鉄住金物産	16,900	3,715.00	62,783,500	
ミスミグループ本社	216,500	1,949.00	421,958,500	貸付有価証券 57,000 株 (37,000 株)
ローソン	73,000	7,890.00	575,970,000	貸付有価証券 47,300 株
エービーシー・マート	25,000	6,250.00	156,250,000	貸付有価証券 800 株
ゲオホールディングス	32,200	1,298.00	41,795,600	貸付有価証券 20,800 株 (700 株)
セリア	20,700	7,670.00	158,769,000	
Monotaro	68,200	2,838.00	193,551,600	貸付有価証券 42,600 株 (19,800 株)
J. フロント リテイリング	243,900	1,397.00	340,728,300	
マツモトキヨシホールディングス	39,800	5,200.00	206,960,000	
スタートトゥデイ	175,900	1,809.00	318,203,100	
ウエルシアホールディングス	22,200	6,940.00	154,068,000	
クリエイトSDホールディングス	28,400	2,219.00	63,019,600	

インクス				
コスモス薬品	9,700	21,270.00	206,319,000	貸付有価証券 5,600株(4,100株)
セブン&アイ・ホールディングス	806,400	4,581.00	3,694,118,400	
ツルハホールディングス	44,400	11,170.00	495,948,000	
クスリのアオキ	17,200	4,755.00	81,786,000	
ノジマ	29,700	1,293.00	38,402,100	
良品計画	22,100	21,410.00	473,161,000	
ドンキホーテホールディングス	124,700	3,855.00	480,718,500	貸付有価証券 6,700株
V Tホールディングス	86,900	551.00	47,881,900	貸付有価証券 49,500株
ユナイテッドアローズ	27,500	2,607.00	71,692,500	
スギホールディングス	34,600	5,540.00	191,684,000	貸付有価証券 6,400株(6,200株)
ユニー・ファミリーマートホールディングス	59,200	6,490.00	384,208,000	貸付有価証券 33,900株(33,600株)
日本瓦斯	29,500	3,225.00	95,137,500	貸付有価証券 5,400株
しまむら	22,400	12,580.00	281,792,000	
高島屋	280,000	856.00	239,680,000	貸付有価証券 177,000株(107,000株)
イオン	793,200	1,444.00	1,145,380,800	貸付有価証券 514,700株(17,900株)
イズミ	38,300	4,315.00	165,264,500	貸付有価証券 2,200株
ヤオコー	21,800	4,070.00	88,726,000	貸付有価証券 12,200株
ケーズホールディングス	81,400	1,685.00	137,159,000	
アインホールディングス	23,200	6,550.00	151,960,000	貸付有価証券 1,000株
ニトリホールディングス	83,300	11,890.00	990,437,000	貸付有価証券 51,600株
パローホールディングス	41,500	2,886.00	119,769,000	
ファーストリテイリング	32,200	33,500.00	1,078,700,000	貸付有価証券 20,800株(900株)
サンドラッグ	40,700	8,030.00	326,821,000	貸付有価証券 1,900株
東京TYフィナンシャルグループ	26,600	2,919.00	77,645,400	貸付有価証券 3,400株
九州フィナンシャルグループ	393,400	686.00	269,872,400	
コンコルディア・フィナ	1,343,300	454.70	610,798,510	

ンシャルグループ				
新生銀行	1,668,000	157.00	261,876,000	貸付有価証券 1,082,000株
あおぞら銀行	1,220,000	349.00	425,780,000	貸付有価証券 15,000株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,853,700	526.60	4,662,358,420	
りそなホールディングス	2,255,100	434.90	980,742,990	貸付有価証券 382,500株(382,500株)
三井住友トラスト・ホールディングス	402,400	3,385.00	1,362,124,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,379,500	3,478.00	4,797,901,000	
千葉銀行	743,000	591.00	439,113,000	貸付有価証券 152,000株
群馬銀行	428,400	474.00	203,061,600	貸付有価証券 11,000株(11,000株)
ふくおかフィナンシャルグループ	834,000	440.00	366,960,000	貸付有価証券 51,000株(51,000株)
静岡銀行	565,000	836.00	472,340,000	貸付有価証券 85,000株
スルガ銀行	183,000	2,435.00	445,605,000	貸付有価証券 45,500株(2,100株)
八十二銀行	464,900	539.00	250,581,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	131,200	1,410.00	184,992,000	
広島銀行	569,000	428.00	243,532,000	
中国銀行	182,200	1,259.00	229,389,800	
セブン銀行	722,600	321.00	231,954,600	貸付有価証券 462,200株
みずほフィナンシャルグループ	27,589,000	173.20	4,778,414,800	
山口フィナンシャルグループ	240,000	1,082.00	259,680,000	貸付有価証券 84,000株(84,000株)
北洋銀行	290,400	367.00	106,576,800	
FPG	68,700	915.00	62,860,500	貸付有価証券 44,500株(6,400株)
SBIホールディングス	231,500	1,214.00	281,041,000	貸付有価証券 10,900株(10,900株)
ジャフコ	32,200	3,045.00	98,049,000	貸付有価証券 6,000株
大和証券グループ本社	1,804,000	590.80	1,065,803,200	貸付有価証券 711,000株
野村ホールディングス	3,709,100	469.20	1,740,309,720	

岡三証券グループ	164,000	534.00	87,576,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	221,200	505.00	111,706,000	貸付有価証券 52,600株 (1,300株)
松井証券	94,300	829.00	78,174,700	貸付有価証券 16,900株
カブドットコム証券	164,300	338.00	55,533,400	貸付有価証券 100株 (100株)
SOMPOホールディングス	428,200	3,312.00	1,418,198,400	
MS&ADインシュアランスグループホール	576,100	2,909.00	1,675,874,900	
ソニーフィナンシャルホールディングス	184,700	1,415.00	261,350,500	貸付有価証券 2,100株
第一生命ホールディングス	1,235,100	1,473.50	1,819,919,850	
東京海上ホールディングス	781,000	4,053.00	3,165,393,000	
T&Dホールディングス	702,600	1,204.50	846,281,700	
全国保証	50,100	4,065.00	203,656,500	
芙蓉総合リース	22,000	4,960.00	109,120,000	
興銀リース	36,200	2,076.00	75,151,200	
東京センチュリー	45,300	3,665.00	166,024,500	
イオンフィナンシャルサービス	131,200	1,836.00	240,883,200	
オリエントコーポレーション	833,600	192.00	160,051,200	貸付有価証券 540,900株 (125,800株)
日立キャピタル	45,400	2,155.00	97,837,000	貸付有価証券 29,400株
オリックス	1,365,100	1,460.00	1,993,046,000	
三菱UFJリース	488,900	479.00	234,183,100	
日本取引所グループ	566,100	1,621.00	917,648,100	
いちご	213,400	450.00	96,030,000	貸付有価証券 5,600株
ヒューリック	401,900	988.00	397,077,200	貸付有価証券 1,100株
野村不動産ホールディングス	128,000	1,606.00	205,568,000	
プレサンスコーポレーション	26,200	1,110.00	29,082,000	
東急不動産ホールディングス	466,400	533.00	248,591,200	貸付有価証券 2,800株
飯田グループホールディングス	178,600	1,975.00	352,735,000	
パーク24	97,400	3,215.00	313,141,000	貸付有価証券 63,200株 (5,600株)

三井不動産	1,022,000	2,089.00	2,134,958,000	
三菱地所	1,433,000	1,877.00	2,689,741,000	
東京建物	223,700	1,204.00	269,334,800	貸付有価証券 139,100株(139,100株)
住友不動産	462,000	2,476.50	1,144,143,000	
大京	358,000	188.00	67,304,000	貸付有価証券 109,000株(25,000株)
レオパレス21	227,100	652.00	148,069,200	
スターツコーポレーション	29,500	1,860.00	54,870,000	
住友不動産販売	13,900	2,053.00	28,536,700	
タカラレーベン	84,100	719.00	60,467,900	貸付有価証券 21,300株(3,600株)
イオンモール	124,400	1,456.00	181,126,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	119,800	928.00	111,174,400	貸付有価証券 3,200株
ミクシィ	39,700	3,640.00	144,508,000	貸付有価証券 25,700株
日本M&Aセンター	63,800	3,100.00	197,780,000	
テンプホールディングス	143,000	1,785.00	255,255,000	
クックパッド	45,500	994.00	45,227,000	貸付有価証券 29,500株(26,800株)
総合警備保障	68,100	5,270.00	358,887,000	
カカクコム	145,500	1,766.00	256,953,000	貸付有価証券 35,100株(35,100株)
ディップ	22,600	2,980.00	67,348,000	貸付有価証券 14,600株(1,300株)
エムスリー	176,700	3,475.00	614,032,500	貸付有価証券 20,000株
ディー・エヌ・エー	91,500	3,465.00	317,047,500	貸付有価証券 15,700株
博報堂DYホールディングス	282,800	1,189.00	336,249,200	
ぐるなび	23,600	2,800.00	66,080,000	
電通	227,400	5,100.00	1,159,740,000	貸付有価証券 141,400株(1,900株)
オリエンタルランド	220,600	6,045.00	1,333,527,000	貸付有価証券 143,100株(2,700株)
リゾートトラスト	85,600	2,016.00	172,569,600	貸付有価証券 34,900株(100株)
ユー・エス・エス	247,000	1,716.00	423,852,000	

	サイバーエージェント	107,300	3,035.00	325,655,500	貸付有価証券 47,400株(47,400株)
	楽天	1,042,100	1,288.50	1,342,745,850	貸付有価証券 676,300株
	リログループ	10,200	16,360.00	166,872,000	
	エイチ・アイ・エス	33,200	2,568.00	85,257,600	貸付有価証券 20,800株(14,200株)
	カナモト	28,500	2,515.00	71,677,500	
	セコム	212,200	7,527.00	1,597,229,400	
	イオンディライト	19,700	3,070.00	60,479,000	
	小計	銘柄数：400 組入時価比率：98.1%		289,301,867,960 100.0%	
	合計			289,301,867,960	

(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。