

平成29年4月期（平成28年10月8日～平成29年4月7日）決算短信

平成29年5月17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29年6月29日
 分配金支払開始日 平成29年5月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成29年4月期の運用状況（平成28年10月8日～平成29年4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29年4月期	406,742	(97.5)	10,457	(2.5)	417,199	(100)
平成28年10月期	289,301	(98.1)	5,719	(1.9)	295,021	(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4月期	24,368	9,983	3,120	31,230
平成28年10月期	20,201	7,691	3,524	24,368

(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/当計算期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
平成29年4月期	449,942	32,742	417,199	13,359
平成28年10月期	340,519	45,497	295,021	12,107

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成29年4月期	132.00
平成28年10月期	109.00

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6期 (平成28年10月7日現在)	第7期 (平成29年4月7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	45,709,787,283	34,372,331,066
株式	289,301,867,960	406,742,789,100
派生商品評価勘定	50,650,002	-
未収入金	2,699,145,350	4,148,579,960
未収配当金	2,481,673,957	3,783,693,896
未収利息	800,259	3,961,993
その他未収収益	80,983,657	97,351,299
差入委託証拠金	194,239,501	793,721,603
流動資産合計	340,519,147,969	449,942,428,917
資産合計		
	340,519,147,969	449,942,428,917
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	306,978,455
未払収益分配金	2,656,116,251	4,122,467,052
未払受託者報酬	73,468,726	101,444,212
未払委託者報酬	223,175,433	307,440,152
未払利息	37,920	37,950
有価証券貸借取引受入金	42,459,480,261	27,858,219,845
その他未払費用	85,601,463	45,923,307
流動負債合計	45,497,880,054	32,742,510,973
負債合計		
	45,497,880,054	32,742,510,973
純資産の部		
元本等		
元本	283,302,821,414	363,089,408,686
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	11,718,446,501	54,110,509,258
(分配準備積立金)	89,781,401	27,386,758
元本等合計	295,021,267,915	417,199,917,944
純資産合計		
	295,021,267,915	417,199,917,944
負債純資産合計		
	340,519,147,969	449,942,428,917

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期 自 平成28年4月8日 至 平成28年10月7日	第7期 自 平成28年10月8日 至 平成29年4月7日
営業収益		
受取配当金	2,979,154,095	4,410,681,752

受取利息	1,588	-
有価証券売買等損益	12,798,418,139	29,722,155,053
派生商品取引等損益	227,650,574	558,866,892
その他収益	113,944,197	158,239,944
営業収益合計	16,119,168,593	34,849,943,641
営業費用		
支払利息	△7,812,451	△9,645,708
受託者報酬	73,468,726	101,444,212
委託者報酬	223,175,433	307,440,152
その他費用	70,235,222	109,610,631
営業費用合計	359,066,930	508,849,287
営業利益又は営業損失(△)	15,760,101,663	34,341,094,354
経常利益又は経常損失(△)	15,760,101,663	34,341,094,354
当期純利益又は当期純損失(△)	15,760,101,663	34,341,094,354
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(△)	△2,755,217,183	11,718,446,501
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,500,754,332	18,090,142,987
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,500,754,332	18,090,142,987
剰余金減少額又は欠損金増加額	131,076,060	5,916,707,532
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	131,076,060	5,916,707,532
分配金	2,656,116,251	4,122,467,052
期末剰余金又は期末欠損金(△)	11,718,446,501	54,110,509,258

(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る場合、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 10 月 8 日から平成 29 年 4 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 6 期 平成 28 年 10 月 7 日現在	第 7 期 平成 29 年 4 月 7 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1. 計算期間の末日における受益権の総数

	24,368,039 口		31,230,811 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		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	1 口当たり純資産額	13,359 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		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		26,448,555,100 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日			第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 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	3,100,912,331 円	当期配当等収益額	A	4,578,567,404 円
分配準備積立金	B	11,864,702 円	分配準備積立金	B	89,781,401 円
配当等収益合計額	C=A+B	3,112,777,033 円	配当等収益合計額	C=A+B	4,668,348,805 円
経費	D	366,879,381 円	経費	D	518,494,995 円
収益分配可能額	E=C-D	2,745,897,652 円	収益分配可能額	E=C-D	4,149,853,810 円
収益分配金	F	2,656,116,251 円	収益分配金	F	4,122,467,052 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	89,781,401 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,386,758 円
口数	H	24,368,039 口	口数	H	31,230,811 口
1 口当たり分配金	I=F/H	109 円	1 口当たり分配金	I=F/H	132 円
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。			2. その他費用 その他費用のうち 78,515,838 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 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日		第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 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 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		3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左	

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。	
--	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 6 期 平成 28 年 10 月 7 日現在	第 7 期 平成 29 年 4 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。 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。	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 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 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 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日
期首元本額 234,862,197,212 円	期首元本額 283,302,821,414 円
期中追加設定元本額 89,418,088,842 円	期中追加設定元本額 116,069,101,080 円
期中一部交換元本額 40,977,464,640 円	期中一部交換元本額 36,282,513,808 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 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	12,409,597,945	25,068,479,708
合計	12,409,597,945	25,068,479,708

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 6 期(平成 28 年 10 月 7 日現在)			第 7 期(平成 29 年 4 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	5,612,521,500	—	5,663,929,500	50,650,002	10,685,363,603	—	10,379,640,000	△306,978,455
合計	5,612,521,500	—	5,663,929,500	50,650,002	10,685,363,603	—	10,379,640,000	△306,978,455

(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29年4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	368,300	526.00	193,725,800	
		国際石油開発帝石	1,493,900	1,126.50	1,682,878,350	
		安藤・間	203,800	746.00	152,034,800	貸付有価証券 79,400株
		東急建設	100,700	849.00	85,494,300	貸付有価証券 59,200株
		コムシスホールディングス	110,800	2,017.00	223,483,600	貸付有価証券 1,100株
		大成建設	1,442,000	823.00	1,186,766,000	
		大林組	850,500	1,040.00	884,520,000	
		清水建設	868,000	1,014.00	880,152,000	貸付有価証券 50,000株
		長谷工コーポレーション	330,900	1,151.00	380,865,900	
		鹿島建設	1,246,000	734.00	914,564,000	
		三井住友建設	1,086,600	115.00	124,959,000	貸付有価証券 48,200株
		熊谷組	445,000	282.00	125,490,000	貸付有価証券 8,000株
		大東建託	104,300	15,405.00	1,606,741,500	
		N I P P O	66,000	2,091.00	138,006,000	
		前田道路	89,000	1,935.00	172,215,000	
		住友林業	195,200	1,603.00	312,905,600	
大和ハウス工業	837,700	3,175.00	2,659,697,500			
積水ハウス	892,300	1,789.00	1,596,324,700	貸付有価証券 205,200株 (138,100株)		

協和エクシオ	111,100	1,586.00	176,204,600	貸付有価証券 700株
九電工	55,100	3,075.00	169,432,500	
日揮	264,600	1,933.00	511,471,800	
江崎グリコ	70,900	5,690.00	403,421,000	
カルビー	115,700	3,870.00	447,759,000	貸付有価証券 75,300株(10,700株)
ヤクルト本社	152,100	6,400.00	973,440,000	貸付有価証券 33,500株(32,500株)
明治ホールディングス	168,000	9,530.00	1,601,040,000	
日本ハム	192,000	3,025.00	580,800,000	
アサヒグループホールディングス	532,000	4,305.00	2,290,260,000	貸付有価証券 105,500株(67,600株)
キリンホールディングス	1,221,000	2,110.00	2,576,310,000	貸付有価証券 271,900株
伊藤園	84,100	4,060.00	341,446,000	貸付有価証券 56,800株
キッコーマン	198,400	3,325.00	659,680,000	
味の素	584,200	2,152.50	1,257,490,500	貸付有価証券 39,200株
キューピー	144,300	2,852.00	411,543,600	
ニチレイ	139,500	2,735.00	381,532,500	
東洋水産	139,400	4,175.00	581,995,000	
日清食品ホールディングス	110,800	6,330.00	701,364,000	貸付有価証券 1,000株
日本たばこ産業	1,195,100	3,689.00	4,408,723,900	貸付有価証券 275,700株
東レ	1,923,100	982.50	1,889,445,750	貸付有価証券 100株
王子ホールディングス	1,036,000	513.00	531,468,000	
大王製紙	105,600	1,425.00	150,480,000	貸付有価証券 71,400株(3,700株)
クラレ	446,200	1,673.00	746,492,600	貸付有価証券 247,100株
旭化成	1,653,000	1,041.00	1,720,773,000	
住友化学	1,951,000	595.00	1,160,845,000	
日産化学工業	145,200	3,210.00	466,092,000	貸付有価証券 15,100株
東ソー	766,000	962.00	736,892,000	
デンカ	549,000	552.00	303,048,000	
信越化学工業	475,400	9,415.00	4,475,891,000	

エア・ウォーター	218,600	2,056.00	449,441,600	貸付有価証券 10,500株
大陽日酸	204,200	1,286.00	262,601,200	貸付有価証券 67,500株
日本パーカラライジング	135,500	1,361.00	184,415,500	
三菱瓦斯化学	247,000	2,247.00	555,009,000	
J S R	266,500	1,871.00	498,621,500	
三菱ケミカルホールディングス	1,775,500	836.60	1,485,383,300	
ダイセル	357,500	1,269.00	453,667,500	
積水化学工業	601,800	1,805.00	1,086,249,000	
日本ゼオン	224,000	1,190.00	266,560,000	
アイカ工業	85,000	2,942.00	250,070,000	
宇部興産	1,335,000	251.00	335,085,000	貸付有価証券 15,000株
日立化成	147,400	3,035.00	447,359,000	
日本化薬	172,000	1,464.00	251,808,000	
日油	205,000	1,212.00	248,460,000	
花王	673,300	6,254.00	4,210,818,200	貸付有価証券 145,300株
日本ペイントホールディングス	204,600	3,990.00	816,354,000	貸付有価証券 110,300株 (19,900株)
関西ペイント	278,500	2,375.00	661,437,500	貸付有価証券 37,000株
D I C	104,700	3,915.00	409,900,500	
富士フイルムホールディングス	525,700	4,217.00	2,216,876,900	
資生堂	502,900	2,923.50	1,470,228,150	貸付有価証券 48,000株
コーセー	42,900	10,070.00	432,003,000	
シーズ・ホールディングス	34,400	3,260.00	112,144,000	
小林製薬	70,900	5,600.00	397,040,000	
日東電工	191,200	8,309.00	1,588,680,800	
ニフコ	46,500	5,540.00	257,610,000	貸付有価証券 3,900株 (600株)
ユニ・チャーム	536,700	2,666.50	1,431,110,550	貸付有価証券 173,300株 (149,200株)
協和発酵キリン	317,100	1,715.00	543,826,500	貸付有価証券 9,600株
武田薬品工業	993,800	5,230.00	5,197,574,000	
アステラス製薬	2,708,100	1,494.00	4,045,901,400	

塩野義製薬	336,200	5,869.00	1,973,157,800	
田辺三菱製薬	308,800	2,350.00	725,680,000	
中外製薬	263,900	3,855.00	1,017,334,500	貸付有価証券 15,100株
科研製薬	49,500	6,480.00	320,760,000	
エーザイ	326,300	5,776.00	1,884,708,800	
小野薬品工業	602,000	2,317.00	1,394,834,000	
久光製薬	74,800	6,520.00	487,696,000	貸付有価証券 27,200株
参天製薬	478,800	1,517.00	726,339,600	
ツムラ	89,000	3,470.00	308,830,000	
沢井製薬	45,000	5,950.00	267,750,000	貸付有価証券 27,300株
第一三共	780,000	2,469.00	1,925,820,000	
キョーリン製薬ホールディングス	64,800	2,330.00	150,984,000	
大塚ホールディングス	569,900	5,120.00	2,917,888,000	貸付有価証券 40,200株 (4,100株)
大正製薬ホールディングス	56,700	9,010.00	510,867,000	
横浜ゴム	159,900	2,108.00	337,069,200	貸付有価証券 15,600株
東洋ゴム工業	139,900	1,901.00	265,949,900	
ブリヂストン	894,600	4,488.00	4,014,964,800	貸付有価証券 302,700株 (172,000株)
住友ゴム工業	248,100	1,889.00	468,660,900	貸付有価証券 149,600株
旭硝子	1,306,000	883.00	1,153,198,000	貸付有価証券 114,000株 (71,000株)
住友大阪セメント	492,000	452.00	222,384,000	
太平洋セメント	1,599,000	363.00	580,437,000	
TOTO	194,700	4,195.00	816,766,500	
日本碍子	334,600	2,417.00	808,728,200	
日本特殊陶業	228,400	2,372.00	541,764,800	
新日鐵住金	1,194,900	2,454.00	2,932,284,600	
神戸製鋼所	458,100	964.00	441,608,400	貸付有価証券 246,600株 (3,800株)
ジェイ エフ イー ホールディングス	724,300	1,809.00	1,310,258,700	
日立金属	269,600	1,461.00	393,885,600	
三菱マテリアル	165,300	3,210.00	530,613,000	

住友金属鉱山	686,000	1,537.50	1,054,725,000	
DOWAホールディングス	292,000	764.00	223,088,000	貸付有価証券 10,000株
住友電気工業	998,300	1,738.50	1,735,544,550	
三和ホールディングス	262,900	1,036.00	272,364,400	
三協立山	34,700	1,583.00	54,930,100	貸付有価証券 21,000株(2,800株)
リンナイ	45,100	8,880.00	400,488,000	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
日本発條	249,300	1,190.00	296,667,000	
オーエスジー	120,600	2,251.00	271,470,600	貸付有価証券 70,300株(62,800株)
DMG森精機	156,700	1,698.00	266,076,600	貸付有価証券 81,200株(15,600株)
ディスコ	31,000	16,870.00	522,970,000	
ニューフレアテクノロジー	5,700	6,570.00	37,449,000	貸付有価証券 3,000株
ナブテスコ	137,700	3,050.00	419,985,000	
SMC	79,400	31,520.00	2,502,688,000	貸付有価証券 2,600株(2,300株)
小松製作所	1,222,100	2,852.50	3,486,040,250	貸付有価証券 390,800株
住友重機械工業	773,000	755.00	583,615,000	
日立建機	118,300	2,676.00	316,570,800	貸付有価証券 5,900株(5,900株)
クボタ	1,267,900	1,652.00	2,094,570,800	貸付有価証券 235,400株(235,400株)
荏原製作所	119,900	3,380.00	405,262,000	
ダイキン工業	345,500	10,765.00	3,719,307,500	
椿本チエイン	150,000	931.00	139,650,000	
ダイフク	126,300	2,745.00	346,693,500	貸付有価証券 54,400株
タダノ	132,300	1,294.00	171,196,200	貸付有価証券 18,600株
平和	78,400	2,707.00	212,228,800	
竹内製作所	46,200	2,081.00	96,142,200	
T P R	28,300	3,455.00	97,776,500	
ホシザキ	74,000	8,780.00	649,720,000	貸付有価証券 37,600株
日本精工	519,800	1,486.00	772,422,800	
ジェイテクト	269,800	1,700.00	458,660,000	

不二越	255,000	612.00	156,060,000	貸付有価証券 61,000株(24,000株)
THK	178,800	2,739.00	489,733,200	貸付有価証券 400株
イーグル工業	27,400	1,430.00	39,182,000	
マキタ	330,100	3,885.00	1,282,438,500	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
三菱重工業	4,242,000	440.80	1,869,873,600	貸付有価証券 120,000株
IHI	1,945,000	367.00	713,815,000	貸付有価証券 344,000株
コニカミノルタ	592,500	953.00	564,652,500	
ブラザー工業	327,100	2,211.00	723,218,100	
ミネベアミツミ	407,800	1,483.00	604,767,400	
日立製作所	6,077,000	586.10	3,561,729,700	
三菱電機	2,699,800	1,541.00	4,160,391,800	
富士電機	763,000	621.00	473,823,000	
安川電機	293,400	2,116.00	620,834,400	貸付有価証券 29,400株(1,500株)
日本電産	328,000	10,435.00	3,422,680,000	
オムロン	269,000	4,840.00	1,301,960,000	
日本電気	3,480,000	264.00	918,720,000	
富士通	2,440,000	667.90	1,629,676,000	
沖電気工業	109,700	1,604.00	175,958,800	貸付有価証券 500株
ルネサスエレクトロニクス	131,000	1,092.00	143,052,000	貸付有価証券 88,600株(3,500株)
セイコーエプソン	376,900	2,304.00	868,377,600	
エレコム	21,900	2,100.00	45,990,000	貸付有価証券 8,100株
パナソニック	2,891,500	1,255.00	3,628,832,500	
富士通ゼネラル	85,900	2,235.00	191,986,500	貸付有価証券 3,000株
日立国際電気	66,100	2,405.00	158,970,500	貸付有価証券 1,400株
TDK	142,600	6,750.00	962,550,000	
アルプス電気	233,600	2,988.00	697,996,800	
ヒロセ電機	40,900	15,080.00	616,772,000	
日本航空電子工業	73,000	1,378.00	100,594,000	
横河電機	274,400	1,726.00	473,614,400	
日本光電工業	105,800	2,440.00	258,152,000	貸付有価証券 4,700株

堀場製作所	50,100	5,990.00	300,099,000	貸付有価証券 18,200株
キーエンス	114,700	44,140.00	5,062,858,000	
シスメックス	196,700	6,840.00	1,345,428,000	
スタンレー電気	180,500	3,070.00	554,135,000	貸付有価証券 30,600株
カシオ計算機	203,500	1,525.00	310,337,500	貸付有価証券 45,700株
ファナック	256,600	22,650.00	5,811,990,000	
エンプラス	11,500	3,025.00	34,787,500	
浜松ホトニクス	197,500	3,105.00	613,237,500	貸付有価証券 11,600株
京セラ	415,400	6,002.00	2,493,230,800	
村田製作所	265,500	14,855.00	3,944,002,500	
小糸製作所	151,600	5,550.00	841,380,000	貸付有価証券 74,400株
ミツバ	46,600	2,051.00	95,576,600	
S C R E E Nホールディングス	51,900	7,750.00	402,225,000	貸付有価証券 100株
キヤノン	1,362,600	3,465.00	4,721,409,000	貸付有価証券 452,600株
リコー	761,000	889.00	676,529,000	貸付有価証券 32,400株
東京エレクトロン	168,800	12,100.00	2,042,480,000	
豊田自動織機	230,500	5,230.00	1,205,515,000	
デンソー	624,000	4,702.00	2,934,048,000	
川崎重工業	1,969,000	328.00	645,832,000	
名村造船所	76,000	695.00	52,820,000	貸付有価証券 200株 (200株)
日産自動車	2,985,100	1,010.50	3,016,443,550	
いすゞ自動車	733,400	1,433.00	1,050,962,200	貸付有価証券 45,000株
トヨタ自動車	1,012,000	5,832.00	5,901,984,000	
日野自動車	361,200	1,290.00	465,948,000	
日信工業	56,600	1,897.00	107,370,200	貸付有価証券 1,800株 (1,800株)
NOK	122,500	2,462.00	301,595,000	
アイシン精機	231,600	5,150.00	1,192,740,000	
マツダ	801,400	1,502.00	1,203,702,800	
本田技研工業	2,033,200	3,157.00	6,418,812,400	
スズキ	501,600	4,515.00	2,264,724,000	貸付有価証券 83,400株 (6,200株)
S U B A R U	785,800	3,941.00	3,096,837,800	

ヤマハ発動機	357,500	2,524.00	902,330,000	貸付有価証券 238,100株
豊田合成	81,700	2,720.00	222,224,000	
シマノ	102,000	16,290.00	1,661,580,000	貸付有価証券 28,300株
テイ・エス テック	58,800	2,843.00	167,168,400	
テルモ	388,000	3,875.00	1,503,500,000	貸付有価証券 13,800株
島津製作所	325,700	1,786.00	581,700,200	
ニコン	441,000	1,570.00	692,370,000	貸付有価証券 149,900株
トプコン	127,400	1,918.00	244,353,200	貸付有価証券 700株
オリンパス	403,900	4,145.00	1,674,165,500	貸付有価証券 54,800株 (6,900株)
HOYA	520,700	5,266.00	2,742,006,200	
朝日インテック	60,800	4,705.00	286,064,000	
セイコーホールディングス	179,000	450.00	80,550,000	貸付有価証券 50,000株 (41,000株)
バンダイナムコホールディングス	279,100	3,265.00	911,261,500	
パイロットコーポレーション	44,100	4,530.00	199,773,000	
アシックス	251,400	1,828.00	459,559,200	貸付有価証券 158,300株 (900株)
ヤマハ	170,500	3,015.00	514,057,500	貸付有価証券 7,700株
ピジョン	153,000	3,550.00	543,150,000	
中部電力	833,900	1,464.00	1,220,829,600	貸付有価証券 50,300株
東北電力	632,300	1,500.00	948,450,000	貸付有価証券 67,800株
電源開発	201,400	2,520.00	507,528,000	貸付有価証券 22,600株
東京瓦斯	2,714,000	509.80	1,383,597,200	
大阪瓦斯	2,456,000	423.20	1,039,379,200	
東邦瓦斯	634,000	780.00	494,520,000	
東武鉄道	1,352,000	556.00	751,712,000	貸付有価証券 50,000株 (50,000株)
相鉄ホールディングス	540,000	519.00	280,260,000	
東京急行電鉄	1,375,000	804.00	1,105,500,000	
小田急電鉄	405,400	2,137.00	866,339,800	貸付有価証券 14,600株
京王電鉄	707,000	878.00	620,746,000	貸付有価証券

				9,000 株
京成電鉄	189,700	2,612.00	495,496,400	
東日本旅客鉄道	489,600	9,750.00	4,773,600,000	
西日本旅客鉄道	243,600	7,300.00	1,778,280,000	貸付有価証券 19,300 株
東海旅客鉄道	210,400	18,350.00	3,860,840,000	
西日本鉄道	405,000	466.00	188,730,000	貸付有価証券 4,000 株
近鉄グループホールディングス	2,547,000	404.00	1,028,988,000	貸付有価証券 332,000 株
阪急阪神ホールディングス	319,700	3,635.00	1,162,109,500	
南海電気鉄道	713,000	547.00	390,011,000	
京阪ホールディングス	756,000	687.00	519,372,000	貸付有価証券 8,000 株
名古屋鉄道	1,229,000	516.00	634,164,000	貸付有価証券 163,000 株 (71,000 株)
日本通運	979,000	570.00	558,030,000	
ヤマトホールディングス	452,500	2,343.50	1,060,433,750	貸付有価証券 14,400 株
山九	333,000	672.00	223,776,000	貸付有価証券 3,000 株
日本郵船	2,138,000	227.00	485,326,000	貸付有価証券 295,000 株
日本航空	456,000	3,380.00	1,541,280,000	
ANAホールディングス	4,698,000	330.60	1,553,158,800	
グリー	152,100	729.00	110,880,900	
ネクソン	274,000	1,772.00	485,528,000	
コロプラ	70,000	1,033.00	72,310,000	貸付有価証券 47,300 株 (2,400 株)
ティーガイア	24,900	1,905.00	47,434,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	523,700	251.00	131,448,700	貸付有価証券 354,200 株
野村総合研究所	186,700	4,020.00	750,534,000	
オービック	86,100	5,310.00	457,191,000	貸付有価証券 600 株
ヤフー	1,790,300	518.00	927,375,400	貸付有価証券 496,100 株
トレンドマイクロ	132,300	4,875.00	644,962,500	貸付有価証券 6,000 株
日本オラクル	40,100	6,470.00	259,447,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	56,600	3,265.00	184,799,000	
大塚商会	67,200	5,980.00	401,856,000	

USEN	113,900	460.00	52,394,000	貸付有価証券 68,700株
日本テレビホールディングス	228,100	1,903.00	434,074,300	貸付有価証券 200株
日本電信電話	1,131,600	4,890.00	5,533,524,000	
KDDI	1,680,200	2,898.00	4,869,219,600	
光通信	30,000	10,570.00	317,100,000	
NTTドコモ	1,866,500	2,634.00	4,916,361,000	
GMOインターネット	91,100	1,264.00	115,150,400	貸付有価証券 37,200株 (7,200株)
東宝	163,400	3,020.00	493,468,000	貸付有価証券 500株
エヌ・ティ・ティ・データ	154,300	5,120.00	790,016,000	
SCSK	67,900	4,410.00	299,439,000	
ソフトバンクグループ	717,800	7,996.00	5,739,528,800	
双日	1,475,200	272.00	401,254,400	
アルフレッサホールディングス	295,500	1,971.00	582,430,500	
シップヘルスケアホールディングス	47,900	2,945.00	141,065,500	
第一興商	54,200	4,450.00	241,190,000	
メディカルホールディングス	249,800	1,798.00	449,140,400	
伊藤忠商事	1,829,500	1,572.00	2,875,974,000	
丸紅	2,458,300	682.30	1,677,298,090	
豊田通商	278,200	3,330.00	926,406,000	
兼松	531,000	196.00	104,076,000	
三井物産	2,258,800	1,616.50	3,651,350,200	
日立ハイテクノロジーズ	86,600	4,455.00	385,803,000	
住友商事	1,572,400	1,487.50	2,338,945,000	
三菱商事	1,874,300	2,447.00	4,586,412,100	
阪和興業	249,000	770.00	191,730,000	
岩谷産業	277,000	637.00	176,449,000	貸付有価証券 15,000株 (15,000株)
東邦ホールディングス	80,000	2,323.00	185,840,000	貸付有価証券 17,400株 (800株)
サンリオ	77,000	2,000.00	154,000,000	貸付有価証券 52,000株 (7,100株)
日鉄住金物産	21,900	4,550.00	99,645,000	貸付有価証券 500株
ミスミグループ本社	281,000	2,000.00	562,000,000	

ローソン	78,800	7,700.00	606,760,000	貸付有価証券 53,300株(51,200株)
エービーシー・マート	45,400	6,450.00	292,830,000	貸付有価証券 12,900株
ゲオホールディングス	41,700	1,179.00	49,164,300	貸付有価証券 28,200株(4,300株)
セリア	59,600	4,780.00	284,888,000	
Monotaro	88,500	3,520.00	311,520,000	貸付有価証券 41,600株(7,200株)
J.フロントリテイリング	316,000	1,581.00	499,596,000	貸付有価証券 2,300株
マツモトキヨシホールディングス	47,200	5,540.00	261,488,000	
スタートトゥデイ	228,000	2,456.00	559,968,000	
ウエルシアホールディングス	65,900	3,240.00	213,516,000	
クリエイトSDホールディングス	36,800	2,487.00	91,521,600	
コスモス薬品	12,600	22,650.00	285,390,000	貸付有価証券 1,200株(100株)
セブン&アイ・ホールディングス	1,044,900	4,637.00	4,845,201,300	貸付有価証券 61,100株(61,100株)
ツルハホールディングス	50,000	10,820.00	541,000,000	
クスリのアオキホールディングス	19,800	4,855.00	96,129,000	貸付有価証券 12,700株
ノジマ	38,700	1,446.00	55,960,200	
良品計画	33,100	24,900.00	824,190,000	貸付有価証券 21,700株(1,000株)
ドンキホーテホールディングス	161,600	3,900.00	630,240,000	貸付有価証券 2,900株
VTホールディングス	112,600	556.00	62,605,600	貸付有価証券 10,600株
ユナイテッドアローズ	33,200	3,345.00	111,054,000	貸付有価証券 11,800株
スギホールディングス	54,700	5,210.00	284,987,000	貸付有価証券 17,300株
ユニー・ファミリーマートホールディングス	76,600	6,560.00	502,496,000	貸付有価証券 32,100株(2,300株)
日本瓦斯	45,800	3,305.00	151,369,000	
しまむら	29,000	15,460.00	448,340,000	
高島屋	419,000	966.00	404,754,000	貸付有価証券 209,000株(18,000株)
イオン	1,027,800	1,640.00	1,685,592,000	貸付有価証券 543,500株(219,300株)

イズミ	49,600	4,920.00	244,032,000	貸付有価証券 9,900株
ヤオコー	28,300	4,140.00	117,162,000	貸付有価証券 12,200株
ケーズホールディングス	115,100	2,031.00	233,768,100	貸付有価証券 73,500株 (73,500 株)
アインホールディングス	32,600	7,490.00	244,174,000	貸付有価証券 22,000株 (1,500株)
ニトリホールディングス	107,900	15,100.00	1,629,290,000	
バローホールディングス	53,800	2,560.00	137,728,000	
ファーストリテイリング	41,700	34,500.00	1,438,650,000	貸付有価証券 1,900株 (1,800株)
サンドラッグ	95,000	3,825.00	363,375,000	
東京T Yフィナンシャル グループ	36,100	3,100.00	111,910,000	
九州フィナンシャルグル ープ	546,200	661.00	361,038,200	
コンコルディア・フィナ ンシャルグループ	1,635,300	499.40	816,668,820	
新生銀行	2,377,000	194.00	461,138,000	貸付有価証券 689,000株
あおぞら銀行	1,580,000	388.00	613,040,000	
三菱UF J フィナンシャ ル・グループ	10,835,300	667.70	7,234,729,810	
りそなホールディングス	2,922,200	557.30	1,628,542,060	
三井住友トラスト・ホー ルディングス	521,500	3,713.00	1,936,329,500	
三井住友フィナンシャル グループ	1,787,500	3,893.00	6,958,737,500	
千葉銀行	963,000	698.00	672,174,000	貸付有価証券 48,000株
群馬銀行	555,100	555.00	308,080,500	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	1,013,000	471.00	477,123,000	貸付有価証券 34,000株
静岡銀行	679,000	875.00	594,125,000	貸付有価証券 8,000株 (8,000株)
スルガ銀行	255,400	2,313.00	590,740,200	貸付有価証券 41,000株
八十二銀行	642,600	602.00	386,845,200	
ほくほくフィナンシャル グループ	166,200	1,655.00	275,061,000	
広島銀行	737,000	455.00	335,335,000	貸付有価証券 31,000株
中国銀行	236,100	1,544.00	364,538,400	貸付有価証券 3,300株

セブン銀行	936,300	383.00	358,602,900	貸付有価証券 620,400株(3,100株)
みずほフィナンシャルグループ	33,763,700	193.90	6,546,781,430	
山口フィナンシャルグループ	312,000	1,185.00	369,720,000	貸付有価証券 132,000株(81,000株)
北洋銀行	407,700	402.00	163,895,400	貸付有価証券 19,300株
F P G	89,100	938.00	83,575,800	貸付有価証券 27,900株
S B I ホールディングス	282,300	1,503.00	424,296,900	貸付有価証券 58,900株(58,900株)
ジャフコ	41,700	3,600.00	150,120,000	貸付有価証券 2,300株
大和証券グループ本社	2,337,000	663.40	1,550,365,800	貸付有価証券 397,000株
野村ホールディングス	5,106,600	658.90	3,364,738,740	
岡三証券グループ	213,000	644.00	137,172,000	貸付有価証券 5,000株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	286,600	565.00	161,929,000	貸付有価証券 63,800株
松井証券	142,600	873.00	124,489,800	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
カブドットコム証券	186,300	360.00	67,068,000	貸付有価証券 900株
S O M P Oホールディングス	522,200	3,940.00	2,057,468,000	
MS&ADインシュアランスグループホール	746,500	3,500.00	2,612,750,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	239,300	1,723.00	412,313,900	
第一生命ホールディングス	1,506,300	1,857.00	2,797,199,100	
東京海上ホールディングス	1,012,000	4,539.00	4,593,468,000	
T & Dホールディングス	910,400	1,541.00	1,402,926,400	
全国保証	70,300	4,040.00	284,012,000	貸付有価証券 45,500株
芙蓉総合リース	28,600	4,855.00	138,853,000	
興銀リース	46,900	2,278.00	106,838,200	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
東京センチュリー	50,300	3,715.00	186,864,500	
イオンフィナンシャルサービス	159,500	2,138.00	341,011,000	貸付有価証券 107,400株(300株)
オリエントコーポレーション	540,100	196.00	105,859,600	貸付有価証券 145,300株(3,200株)

				株)
日立キャピタル	58,900	2,631.00	154,965,900	貸付有価証券 8,000株
オリックス	1,768,900	1,670.00	2,954,063,000	
三菱UFJリース	633,600	541.00	342,777,600	
日本取引所グループ	776,700	1,571.00	1,220,195,700	
いちご	237,500	313.00	74,337,500	貸付有価証券 150,600株
ヒューリック	521,000	1,057.00	550,697,000	貸付有価証券 82,800株
野村不動産ホールディングス	165,800	1,748.00	289,818,400	貸付有価証券 24,800株
プレサンスコーポレーション	38,700	1,284.00	49,690,800	
東急不動産ホールディングス	604,300	605.00	365,601,500	
飯田グループホールディングス	208,200	1,654.00	344,362,800	
パーク24	126,800	2,900.00	367,720,000	貸付有価証券 56,000株 (900株)
三井不動産	1,324,500	2,362.00	3,128,469,000	
三菱地所	1,857,800	2,029.50	3,770,405,100	
東京建物	289,800	1,465.00	424,557,000	
住友不動産	599,000	2,866.50	1,717,033,500	
大京	464,000	223.00	103,472,000	
レオパレス21	315,300	575.00	181,297,500	貸付有価証券 126,700株
スターツコーポレーション	33,900	2,309.00	78,275,100	
住友不動産販売	22,500	3,595.00	80,887,500	
タカラレーベン	108,900	489.00	53,252,100	貸付有価証券 66,600株 (13,700株)
イオンモール	160,800	1,793.00	288,314,400	貸付有価証券 100,500株
エヌ・ティ・ティ都市開発	155,200	941.00	146,043,200	
ミクシィ	70,800	5,620.00	397,896,000	貸付有価証券 21,400株 (21,400株)
日本M&Aセンター	76,300	3,730.00	284,599,000	
テンブホールディングス	204,600	2,035.00	416,361,000	貸付有価証券 21,800株
クックパッド	59,000	918.00	54,162,000	貸付有価証券 15,000株 (2,100株)
総合警備保障	96,200	4,620.00	444,444,000	

カカクコム	188,600	1,585.00	298,931,000	貸付有価証券 7,800 株
ディップ	34,100	2,391.00	81,533,100	貸付有価証券 22,700 株 (300 株)
エムスリー	229,000	2,878.00	659,062,000	貸付有価証券 28,800 株
ディー・エヌ・エー	118,500	2,258.00	267,573,000	貸付有価証券 300 株
博報堂DYホールディングス	366,400	1,315.00	481,816,000	
ぐるなび	38,300	2,291.00	87,745,300	貸付有価証券 400 株
電通	294,600	6,010.00	1,770,546,000	貸付有価証券 123,000 株
オリエンタルランド	285,800	6,508.00	1,859,986,400	貸付有価証券 20,200 株 (18,000 株)
リゾートトラスト	102,300	1,878.00	192,119,400	貸付有価証券 21,200 株
ユー・エス・エス	320,000	1,870.00	598,400,000	
サイバーエージェント	139,100	3,285.00	456,943,500	貸付有価証券 82,600 株 (39,900 株)
楽天	1,350,900	1,180.50	1,594,737,450	貸付有価証券 891,600 株 (180,800 株)
リロググループ	132,200	1,828.00	241,661,600	貸付有価証券 89,400 株
エイチ・アイ・エス	43,100	2,654.00	114,387,400	貸付有価証券 18,500 株
カナモト	36,900	2,991.00	110,367,900	
セコム	275,000	7,967.00	2,190,925,000	
イオンディライト	29,800	3,505.00	104,449,000	
小計	銘柄数 : 399		406,742,789,100	
	組入時価比率 : 97.5%		100.0%	
合計			406,742,789,100	

(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 29 年 4 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。