

平成27年7月期（平成26年7月11日～平成27年7月10日）決算短信

平成27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27年9月30日
 分配金支払開始日 平成27年8月18日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年7月期の運用状況（平成26年7月11日～平成27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27年7月期	14,766	(99.9)	17	(0.1)	14,783	(100)
平成26年7月期	11,715	(99.9)	6	(0.1)	11,722	(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27年7月期	46,534	0	0	46,534
平成26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27年7月期	15,018	234	14,783	31,769
平成26年7月期	11,920	197	11,722	25,190

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成27年7月期	437.00
平成26年7月期	358.00

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 20 期 (平成 26 年 7 月 10 日現在)	第 21 期 (平成 27 年 7 月 10 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	193,329,111	221,495,237
株式	11,715,967,600	14,766,206,740
未収入金	-	15,228,730
未収配当金	10,781,250	15,487,940
未収利息	349	350
流動資産合計	11,920,078,310	15,018,418,997
資産合計	11,920,078,310	15,018,418,997
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	166,595,289	203,357,936
未払受託者報酬	5,957,186	6,031,253
未払委託者報酬	25,020,034	25,331,008
その他未払費用	119,068	120,573
流動負債合計	197,691,577	234,840,770
負債合計	197,691,577	234,840,770
純資産の部		
元本等		
元本	11,261,469,274	11,261,469,274
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	460,917,459	3,522,108,953
(分配準備積立金)	37,198	37,653
元本等合計	11,722,386,733	14,783,578,227
純資産合計	11,722,386,733	14,783,578,227
負債純資産合計	11,920,078,310	15,018,418,997

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 20 期 自 平成 25 年 7 月 11 日 至 平成 26 年 7 月 10 日	第 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 7 月 10 日
営業収益		
受取配当金	228,670,503	266,719,674
受取利息	47,941	48,511
有価証券売買等損益	523,708,821	3,061,191,039
その他収益	111,836	77,698
営業収益合計	752,539,101	3,328,036,922
営業費用		
受託者報酬	11,918,050	12,162,467
委託者報酬	50,055,653	51,081,871

その他費用	238,189	243,154
営業費用合計	62,211,892	63,487,492
営業利益又は営業損失(△)	690,327,209	3,264,549,430
経常利益又は経常損失(△)	690,327,209	3,264,549,430
当期純利益又は当期純損失(△)	690,327,209	3,264,549,430
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(△)	△62,814,461	460,917,459
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	-	-
分配金	166,595,289	203,357,936
期末剰余金又は期末欠損金(△)	460,917,459	3,522,108,953

(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った場合、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 26 年 7 月 11 日から平成 27 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 20 期 平成 26 年 7 月 10 日現在	第 21 期 平成 27 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 46,534,997 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 251.90 円 (100 口当たり純資産額) (25,190 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 317.69 円 (100 口当たり純資産額) (31,769 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 20 期 自 平成 25 年 7 月 11 日 至 平成 26 年 7 月 10 日			第 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 7 月 10 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	228,830,280 円	当期配当等収益額	A	266,845,883 円
分配準備積立金	B	14,099 円	分配準備積立金	B	37,198 円
配当等収益合計額	C=A+B	228,844,379 円	配当等収益合計額	C=A+B	266,883,081 円
経費	D	62,211,892 円	経費	D	63,487,492 円
収益分配可能額	E=C-D	166,632,487 円	収益分配可能額	E=C-D	203,395,589 円
収益分配金	F	166,595,289 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	37,198 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	口数	H	46,534,997 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	358 円 00 銭	100 口当たり分配金	I=F/H×100	437 円 00 銭

(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 20 期 自 平成 25 年 7 月 11 日 至 平成 26 年 7 月 10 日	第 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 7 月 10 日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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。</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>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 20 期 平成 26 年 7 月 10 日現在	第 21 期 平成 27 年 7 月 10 日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>株式</p> <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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <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。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第 20 期 自 平成 25 年 7 月 11 日 至 平成 26 年 7 月 10 日	第 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 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 20 期 自 平成 25 年 7 月 11 日	第 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日

至 平成 26 年 7 月 10 日		至 平成 27 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	0 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 20 期 自 平成 25 年 7 月 11 日 至 平成 26 年 7 月 10 日	第 21 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 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	521,145,516	3,036,726,398
合計	521,145,516	3,036,726,398

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 27 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	10,300	359.00	3,697,700	
		マルハニチロ	2,000	2,076.00	4,152,000	
		サカタのタネ	1,800	2,196.00	3,952,800	
		ホクト	1,200	2,384.00	2,860,800	
		国際石油開発帝石	54,400	1,349.00	73,385,600	
		コムシスホールディングス	5,400	1,808.00	9,763,200	
		大成建設	44,000	715.00	31,460,000	
		大林組	27,000	942.00	25,434,000	
		清水建設	29,000	1,034.00	29,986,000	
		鹿島建設	39,000	591.00	23,049,000	
		西松建設	10,000	469.00	4,690,000	
		前田建設工業	7,000	821.00	5,747,000	
		奥村組	8,000	612.00	4,896,000	
		戸田建設	12,000	539.00	6,468,000	
		大東建託	3,000	12,290.00	36,870,000	
		N I P P O	4,000	2,030.00	8,120,000	
		前田道路	4,000	2,144.00	8,576,000	
		住友林業	6,600	1,460.00	9,636,000	
		パナホーム	6,000	821.00	4,926,000	

大和ハウス工業	24,600	2,848.50	70,073,100
積水ハウス	26,400	1,840.50	48,589,200
中電工	2,400	2,264.00	5,433,600
関電工	8,000	753.00	6,024,000
九電工	2,000	2,070.00	4,140,000
日揮	10,000	2,278.00	22,780,000
高砂熱学工業	3,100	1,487.00	4,609,700
日清製粉グループ本社	11,300	1,624.00	18,351,200
山崎製パン	8,000	1,879.00	15,032,000
森永乳業	9,000	444.00	3,996,000
ヤクルト本社	6,500	7,010.00	45,565,000
明治ホールディングス	2,800	16,080.00	45,024,000
雪印メグミルク	2,600	1,527.00	3,970,200
日本ハム	8,000	2,916.00	23,328,000
伊藤ハム	9,000	652.00	5,868,000
サッポロホールディングス	15,000	451.00	6,765,000
アサヒグループホールディングス	18,000	3,734.50	67,221,000
キリンホールディングス	34,000	1,694.00	57,596,000
宝ホールディングス	8,100	986.00	7,986,600
伊藤園	3,300	2,504.00	8,263,200
キッコーマン	8,000	4,040.00	32,320,000
味の素	22,000	2,653.00	58,366,000
キューピー	5,700	2,463.00	14,039,100
ハウス食品グループ本社	3,800	2,243.00	8,523,400
ニチレイ	11,000	879.00	9,669,000
日清食品ホールディングス	4,400	5,290.00	23,276,000
日本たばこ産業	49,600	4,327.50	214,644,000
東洋紡	33,000	180.00	5,940,000
日清紡ホールディングス	7,000	1,353.00	9,471,000
帝人	37,000	453.00	16,761,000
東レ	61,000	968.30	59,066,300
ワコールホールディングス	5,000	1,390.00	6,950,000
オンワードホールディングス	6,000	763.00	4,578,000
王子ホールディングス	40,000	515.00	20,600,000
日本製紙	4,300	2,048.00	8,806,400
レンゴー	10,000	471.00	4,710,000

クラレ	13,200	1,417.00	18,704,400
旭化成	52,000	921.40	47,912,800
住友化学	62,000	677.00	41,974,000
電気化学工業	17,000	507.00	8,619,000
信越化学工業	16,100	7,271.00	117,063,100
大陽日酸	16,100	1,368.00	22,024,800
日本触媒	8,000	1,593.00	12,744,000
カネカ	13,000	829.00	10,777,000
三菱瓦斯化学	18,000	637.00	11,466,000
三井化学	38,000	434.00	16,492,000
東京応化工業	1,700	3,365.00	5,720,500
三菱ケミカルホールディングス	56,000	737.30	41,288,800
ダイセル	13,600	1,510.00	20,536,000
積水化学工業	19,000	1,451.00	27,569,000
宇部興産	40,000	214.00	8,560,000
日立化成	7,800	2,092.00	16,317,600
花王	18,700	5,749.00	107,506,300
日本ペイントホールディングス	12,100	3,525.00	42,652,500
D I C	36,000	282.00	10,152,000
東洋インキ S Cホールディングス	11,000	472.00	5,192,000
富士フイルムホールディングス	19,100	4,293.00	81,996,300
資生堂	14,900	2,696.00	40,170,400
ライオン	11,000	1,004.00	11,044,000
日東電工	6,500	9,373.00	60,924,500
ユニ・チャーム	23,100	2,777.00	64,148,700
協和発酵キリン	21,000	1,659.00	34,839,000
武田薬品工業	29,400	5,934.00	174,459,600
アステラス製薬	82,600	1,780.00	147,028,000
塩野義製薬	13,100	4,870.00	63,797,000
田辺三菱製薬	20,900	1,929.00	40,316,100
中外製薬	20,800	4,325.00	89,960,000
エーザイ	11,000	8,323.00	91,553,000
第一三共	26,400	2,420.50	63,901,200
大正製薬ホールディングス	3,400	8,110.00	27,574,000
昭和シェル石油	14,000	1,078.00	15,092,000
東燃ゼネラル石油	21,000	1,147.00	24,087,000

J Xホールディングス	92,800	505.40	46,901,120
横浜ゴム	6,300	2,314.00	14,578,200
ブリヂストン	30,200	4,407.00	133,091,400
住友ゴム工業	9,800	1,779.00	17,434,200
旭硝子	44,000	687.00	30,228,000
日本板硝子	34,000	120.00	4,080,000
日本電気硝子	19,000	585.00	11,115,000
太平洋セメント	46,000	360.00	16,560,000
TOTO	13,000	1,982.00	25,766,000
日本碍子	12,000	3,060.00	36,720,000
新日鐵住金	353,000	288.50	101,840,500
神戸製鋼所	136,000	185.00	25,160,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	22,900	2,429.00	55,624,100
日新製鋼	4,100	1,404.00	5,756,400
日立金属	16,000	1,721.00	27,536,000
日本軽金属ホールディングス	20,300	197.00	3,999,100
三井金属鉱業	21,000	297.00	6,237,000
三菱マテリアル	49,000	435.00	21,315,000
住友金属鉱山	22,000	1,728.00	38,016,000
DOWAホールディングス	12,000	1,122.00	13,464,000
古河機械金属	15,000	218.00	3,270,000
古河電気工業	26,000	203.00	5,278,000
住友電気工業	29,500	1,831.00	54,014,500
フジクラ	13,000	649.00	8,437,000
SUMCO	10,900	1,344.00	14,649,600
東洋製罐グループホールディングス	8,100	1,879.00	15,219,900
三和ホールディングス	9,100	992.00	9,027,200
LIXILグループ	11,600	2,461.00	28,547,600
オークマ	6,000	1,276.00	7,656,000
アマダホールディングス	14,400	1,220.00	17,568,000
SMC	2,500	34,380.00	85,950,000
小松製作所	36,200	2,269.00	82,137,800
住友重機械工業	23,000	652.00	14,996,000
日立建機	8,000	2,007.00	16,056,000
クボタ	46,000	1,977.00	90,942,000

小森コーポレーション	2,500	1,478.00	3,695,000
荅原製作所	17,000	557.00	9,469,000
ダイキン工業	10,900	8,489.00	92,530,100
栗田工業	4,400	2,798.00	12,311,200
椿本チエイン	7,000	1,088.00	7,616,000
ダイフク	4,200	1,819.00	7,639,800
平和	3,700	2,413.00	8,928,100
アマノ	2,900	1,637.00	4,747,300
セガサミーホールディングス	9,900	1,491.00	14,760,900
日本精工	20,500	1,720.00	35,260,000
NTN	20,000	712.00	14,240,000
ジェイテクト	12,800	2,155.00	27,584,000
不二越	9,000	664.00	5,976,000
三菱重工業	125,000	695.90	86,987,500
I H I	58,000	533.00	30,914,000
コニカミノルタ	18,700	1,448.00	27,077,600
ブラザー工業	10,300	1,655.00	17,046,500
ミネベア	15,000	1,879.00	28,185,000
日立製作所	180,000	756.50	136,170,000
東芝	158,000	377.20	59,597,600
三菱電機	80,000	1,470.50	117,640,000
富士電機	28,000	506.00	14,168,000
日本電気	97,000	366.00	35,502,000
富士通	77,000	669.40	51,543,800
パナソニック	91,200	1,574.00	143,548,800
シャープ	63,000	172.00	10,836,000
ソニー	43,500	3,420.00	148,770,000
TDK	4,800	8,660.00	41,568,000
ファナック	7,700	23,765.00	182,990,500
京セラ	14,000	6,240.00	87,360,000
村田製作所	8,400	19,180.00	161,112,000
キヤノン	49,600	3,864.00	191,654,400
リコー	27,700	1,209.50	33,503,150
東京エレクトロン	6,700	7,727.00	51,770,900
豊田自動織機	12,100	6,460.00	78,166,000
デンソー	32,900	5,775.00	189,997,500

三井造船	31,000	206.00	6,386,000
川崎重工業	62,000	543.00	33,666,000
日本車輛製造	5,000	328.00	1,640,000
日産自動車	168,100	1,188.00	199,702,800
トヨタ自動車	127,100	7,925.00	1,007,267,500
新明和工業	4,000	1,093.00	4,372,000
トピー工業	9,000	290.00	2,610,000
本田技研工業	67,400	3,831.50	258,243,100
シマノ	3,400	16,550.00	56,270,000
テルモ	14,100	3,025.00	42,652,500
島津製作所	11,000	1,787.00	19,657,000
ニコン	14,900	1,426.00	21,247,400
オリンパス	12,700	4,450.00	56,515,000
HOYA	15,800	4,794.00	75,745,200
シチズンホールディングス	12,300	828.00	10,184,400
バンダイナムコホールディングス	8,300	2,352.00	19,521,600
トッパン・フォームズ	4,300	1,600.00	6,880,000
凸版印刷	26,000	1,006.00	26,156,000
大日本印刷	25,000	1,267.50	31,687,500
日本写真印刷	1,700	2,002.00	3,403,400
アシックス	7,400	3,140.00	23,236,000
ヤマハ	7,300	2,517.00	18,374,100
リンテック	2,800	2,608.00	7,302,400
任天堂	5,300	19,515.00	103,429,500
タカラスタンダード	6,000	802.00	4,812,000
コクヨ	4,800	1,013.00	4,862,400
岡村製作所	4,200	1,033.00	4,338,600
東京電力	59,800	682.00	40,783,600
中部電力	28,200	1,823.50	51,422,700
関西電力	34,900	1,371.00	47,847,900
東北電力	18,700	1,622.00	30,331,400
九州電力	17,600	1,515.00	26,664,000
東京瓦斯	91,000	642.80	58,494,800
大阪瓦斯	77,000	473.50	36,459,500
東武鉄道	40,000	548.00	21,920,000
東京急行電鉄	46,000	847.00	38,962,000

小田急電鉄	27,000	1,165.00	31,455,000
東日本旅客鉄道	14,600	11,165.00	163,009,000
西日本旅客鉄道	7,200	8,047.00	57,938,400
東海旅客鉄道	7,700	20,730.00	159,621,000
近鉄グループホールディングス	71,000	424.00	30,104,000
阪急阪神ホールディングス	47,000	729.00	34,263,000
日本通運	39,000	582.00	22,698,000
ヤマトホールディングス	16,200	2,386.00	38,653,200
福山通運	10,000	639.00	6,390,000
セイノーホールディングス	7,700	1,296.00	9,979,200
日本郵船	63,000	330.00	20,790,000
商船三井	45,000	374.00	16,830,000
ANAホールディングス	131,000	339.90	44,526,900
三菱倉庫	7,000	1,679.00	11,753,000
三井倉庫ホールディングス	5,000	396.00	1,980,000
住友倉庫	7,000	662.00	4,634,000
上組	10,000	1,084.00	10,840,000
郵船ロジスティクス	1,600	1,319.00	2,110,400
I Tホールディングス	3,300	2,711.00	8,946,300
野村総合研究所	8,400	4,640.00	38,976,000
オービック	3,700	5,650.00	20,905,000
ヤフー	211,800	470.00	99,546,000
トレンドマイクロ	5,200	4,070.00	21,164,000
日本オラクル	4,700	4,885.00	22,959,500
伊藤忠テクノソリューションズ	4,500	2,896.00	13,032,000
大塚商会	3,500	6,060.00	21,210,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,700	2,006.00	3,410,200
日本ユニシス	4,100	1,245.00	5,104,500
日本電信電話	57,100	4,465.50	254,980,050
KDD I	100,100	3,001.00	300,400,100
NTTドコモ	152,000	2,332.00	354,464,000
東宝	7,000	2,883.00	20,181,000
エヌ・ティ・ティ・データ	10,400	5,220.00	54,288,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,500	2,863.00	12,883,500
富士ソフト	1,300	2,422.00	3,148,600

コナミ	5,300	2,317.00	12,280,100
ソフトバンクグループ	44,700	6,924.00	309,502,800
双日	46,500	285.00	13,252,500
伊藤忠商事	61,900	1,466.00	90,745,400
丸紅	64,600	674.50	43,572,700
豊田通商	13,200	3,155.00	41,646,000
三井物産	66,800	1,588.50	106,111,800
住友商事	46,500	1,380.50	64,193,250
三菱商事	60,400	2,616.00	158,006,400
キヤノンマーケティングジャパン	5,600	2,020.00	11,312,000
岩谷産業	9,000	756.00	6,804,000
サンリオ	3,300	3,265.00	10,774,500
スズケン	3,800	3,790.00	14,402,000
ローソン	3,700	8,130.00	30,081,000
エービーシー・マート	2,800	6,740.00	18,872,000
J. フロント リテイリング	10,000	2,235.00	22,350,000
三越伊勢丹ホールディングス	14,700	2,082.00	30,605,400
セブン&アイ・ホールディングス	33,000	5,170.00	170,610,000
良品計画	1,000	25,240.00	25,240,000
ファミリーマート	3,600	5,690.00	20,484,000
しまむら	1,400	11,600.00	16,240,000
高島屋	13,000	1,080.00	14,040,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,700	2,521.00	11,848,700
丸井グループ	10,400	1,695.00	17,628,000
イオン	32,400	1,753.00	56,797,200
ユニグループ・ホールディングス	8,700	781.00	6,794,700
イズミ	2,900	5,350.00	15,515,000
ヤマダ電機	35,900	460.00	16,514,000
ニトリホールディングス	4,300	9,820.00	42,226,000
ファーストリテイリング	3,900	54,010.00	210,639,000
サンドラッグ	2,500	6,780.00	16,950,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	527,000	857.30	451,797,100
りそなホールディングス	65,200	654.70	42,686,440
三井住友トラスト・ホールディングス	145,000	540.40	78,358,000
三井住友フィナンシャルグループ	52,600	5,268.00	277,096,800

千葉銀行	33,000	919.00	30,327,000	
横浜銀行	47,000	759.90	35,715,300	
常陽銀行	28,000	683.00	19,124,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	32,000	616.00	19,712,000	
静岡銀行	25,000	1,274.00	31,850,000	
みずほフィナンシャルグループ	916,500	258.30	236,731,950	
大和証券グループ本社	65,000	885.90	57,583,500	
野村ホールディングス	142,200	847.90	120,571,380	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	15,400	4,118.00	63,417,200	
MS & ADインシュアランスグループホール	23,600	3,651.00	86,163,600	
第一生命保険	44,600	2,261.00	100,840,600	
東京海上ホールディングス	28,200	4,886.50	137,799,300	
クレディセゾン	6,900	2,765.00	19,078,500	
イオンフィナンシャルサービス	7,800	3,405.00	26,559,000	
アコム	59,400	482.00	28,630,800	
日立キャピタル	4,600	3,145.00	14,467,000	
オリックス	49,200	1,745.50	85,878,600	
三菱UFJリース	33,300	633.00	21,078,900	
三井不動産	37,000	3,354.00	124,098,000	
三菱地所	52,000	2,617.00	136,084,000	
住友不動産	18,000	4,219.50	75,951,000	
イオンモール	8,500	2,230.00	18,955,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	12,200	1,176.00	14,347,200	
ディー・エヌ・エー	5,600	2,293.00	12,840,800	
電通	10,700	6,500.00	69,550,000	
みらかホールディングス	2,100	5,920.00	12,432,000	
オリエンタルランド	13,500	7,371.00	99,508,500	
ユー・エス・エス	11,700	2,089.00	24,441,300	
東京ドーム	7,000	499.00	3,493,000	
トランス・コスモス	1,800	3,030.00	5,454,000	
セコム	8,700	7,972.00	69,356,400	
ベネッセホールディングス	3,800	3,095.00	11,761,000	
小計 銘柄数：300			14,766,206,740	
組入時価比率：99.9%			100.0%	
合計			14,766,206,740	

(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 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。