

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<br>(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<br>発行済口数(①) | 設定口数(②) | 交換口数(③) | 当計算期間末<br>発行済口数<br>(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<br>(①) | 負債<br>(②) | 純資産<br>(③(①-②)) | 100口当り基準価額<br>(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<br>(平成 27 年 7 月 10 日現在) | 第 22 期<br>(平成 28 年 7 月 10 日現在) |
|------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| <b>資産の部</b>      |                                |                                |
| 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                  |
| <b>負債の部</b>      |                                |                                |
| 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                    |
| <b>純資産の部</b>     |                                |                                |
| 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<br>自 平成 26 年 7 月 11 日<br>至 平成 27 年 7 月 10 日 | 第 22 期<br>自 平成 27 年 7 月 11 日<br>至 平成 28 年 7 月 10 日 |
|-------------|----------------------------------------------------|----------------------------------------------------|
| <b>営業収益</b> |                                                    |                                                    |
| 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                                     |
| <b>営業費用</b> |                                                    |                                                    |
| 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<br>原則として時価で評価しております。<br>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<br>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。<br>有価証券売買等損益<br>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<br>平成 27 年 7 月 10 日現在                                                     | 第 22 期<br>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<br>46,534,997 口                                             | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>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<br>1 口当たり純資産額 317.69 円<br>(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<br>元本の欠損 63,494,704 円<br>3. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額<br>1 口当たり純資産額 240.17 円<br>(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<br>自平成 26 年 7 月 11 日<br>至平成 27 年 7 月 10 日                                                                                                                                                                                 | 第 22 期<br>自平成 27 年 7 月 11 日<br>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<br>自 平成 26 年 7 月 11 日<br>至 平成 27 年 7 月 10 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 第 22 期<br>自 平成 27 年 7 月 11 日<br>至 平成 28 年 7 月 10 日                                                   |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1. 金融商品に対する取組方針<br/>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<br/>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。<br/>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。<br/>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<br/>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。<br/>○市場リスクの管理<br/>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。<br/>○信用リスクの管理<br/>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。<br/>○流動性リスクの管理<br/>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<br/>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<br/>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制<br/>同左</p> |

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

| 第 21 期<br>平成 27 年 7 月 10 日現在                                                                                                                                             | 第 22 期<br>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<br/>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<br/>株式<br/>(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。<br/>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<br/>同左</p> <p>2. 時価の算定方法<br/>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<br>自 平成 26 年 7 月 11 日<br>至 平成 27 年 7 月 10 日                    | 第 22 期<br>自 平成 27 年 7 月 11 日<br>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<br>自 平成 26 年 7 月 11 日<br>至 平成 27 年 7 月 10 日 | 第 22 期<br>自 平成 27 年 7 月 11 日<br>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<br>自 平成 26 年 7 月 11 日<br>至 平成 27 年 7 月 10 日 | 第 22 期<br>自 平成 27 年 7 月 11 日<br>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  |
| I H I         | 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。