

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 | |
| F P G | 68,700 | 915.00 | 62,860,500 | 貸付有価証券 44,500 株 (6,400 株) |
| S B I 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D Y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證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。