



2019年7月期 (2018年7月9日～2019年7月8日) 決算短信
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2019 (July 9, 2018 - July 8, 2019)

2019年8月19日
August 19, 2019

上場取引所 東証
Listed Exchange TSE

ファンド名 日経225連動型上場投資信託
コード番号 (1321)
連動対象指標 日経平均株価(日経225)
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 兼代表取締役社長 中川 順子
問合せ先責任者 商品企画部長 増田 真一 TEL(03)-3241-9511

Fund name: Nikkei 225 Exchange Traded Fund
Code: 1321
Underlying index: Nikkei Stock Average(Nikkei 225)
Primary invested assets: Stocks
Trading unit: 1 unit
Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
Representative: Junko Nakagawa, President & CEO
Contact person: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 2019年9月26日
分配金支払開始日 2019年8月16日
Scheduled date of submission of securities report: September 26, 2019
Date of commencing dividend payment: August 16, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年7月期の運用状況 (2018年7月9日～2019年7月8日)

Management Status for Year ended July 2019 (from July 9, 2018 to July 8, 2019)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

Assets (fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

	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)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	6,028,366	(99.6)	25,847	(0.4)	6,054,214	(100.0)
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	5,514,892	(99.1)	48,335	(0.9)	5,563,227	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	250,082	68,313	43,205	275,190
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	226,075	94,207	70,200	250,082

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	10口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×10) Net Asset Value per 10 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×10)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	6,414,827	360,613	6,054,214	220,001
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	6,023,380	460,153	5,563,227	222,456

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	4,090
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	3,500

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無
Changes other than those in ① No

II 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位:円) (Unit:JPY)

	第17期 (2018年7月8日現在) 17th Fiscal Year As of July 8, 2018	第18期 (2019年7月8日現在) 18th Fiscal Year As of July 8, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
コール・ローン Call loans	490,627,011,771	374,299,828,679
株式 Stocks	5,514,892,048,960	6,028,366,234,680
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	-	502,566,406
未収入金 Accounts receivable - other	-	2,298,634,500
未収配当金 Accrued dividends receivable	7,296,945,800	8,733,409,200
未収利息 Accrued interest	41,743,608	26,433,576
その他未収収益 Other accrued revenue	136,836,661	254,479,390
差入委託証拠金 Customers' margin	10,386,360,000	345,543,100
流動資産合計 Total current assets	6,023,380,946,800	6,414,827,129,531
資産合計 Total assets	6,023,380,946,800	6,414,827,129,531
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	1,358,469,200	-
未払金 Accounts payable - other	2,930,546,720	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	87,528,809,550	112,552,973,396
未払受託者報酬 Trustee fee payable	1,409,012,182	1,479,522,517
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	5,235,958,914	5,553,255,406
未払利息 Accrued interest expenses	3,005,056	794,643
有価証券貸借取引受入金 Cash received on debt credit transaction	361,627,337,945	240,962,633,802

of securities		
その他未払費用 Other accrued expenses	60,408,767	63,934,282
流動負債合計 Total current liabilities	460,153,548,334	360,613,114,046
負債合計 Total liabilities	460,153,548,334	360,613,114,046
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	3,077,763,026,091	3,386,771,255,708
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,485,464,372,375	2,667,442,759,777
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	111,093,496	200,662,014
元本等合計 Total principal and other	5,563,227,398,466	6,054,214,015,485
純資産合計 Total net assets	5,563,227,398,466	6,054,214,015,485
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	6,023,380,946,800	6,414,827,129,531

(2) 【損益及び剰余金計算書】 Statement of Income and Retained Earnings

(単位：円) (Unit: JPY)

	第17期 自 2017年7月9日 至 2018年7月8日 17th Fiscal Year From July 9, 2017 to July 8, 2018	第18期 自 2018年7月9日 至 2019年7月8日 18th Fiscal Year From July 9, 2018 to July 8, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	97,787,904,022	123,730,169,690
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	453,148,362,913	△84,990,965,776
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	8,024,762,020	△584,957,793
その他収益 Other revenue	2,327,096,424	2,882,323,582
営業収益合計 Total operating revenue	561,288,125,379	41,036,569,703
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△129,831,137	△177,296,516
受託者報酬 Trustee fee	2,705,306,545	2,953,489,256

委託者報酬 Investment trust management fee	9,946,379,381	11,063,201,567
その他費用 Other expenses	118,087,188	130,557,051
営業費用合計 Total operating expenses	12,639,941,977	13,969,951,358
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	548,648,183,402	27,066,618,345
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	548,648,183,402	27,066,618,345
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	548,648,183,402	27,066,618,345
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(△) Distribution of profit loss from partial exchange	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△) Surplus (deficit) at beginning of period	1,812,267,854,432	2,485,464,372,375
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	937,094,187,264	714,266,505,170
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from additional subscriptions for period	937,094,187,264	714,266,505,170
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	725,017,043,173	446,801,762,717
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from partial exchange	725,017,043,173	446,801,762,717
分配金 Dividends	87,528,809,550	112,552,973,396
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	2,485,464,372,375	2,667,442,759,777

(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 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。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配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。

4. その他	<p>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。</p> <p>当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年7月9日から2019年7月8日までとなっております。</p>
--------	---

(貸借対照表に関する注記)

第17期 2018年7月8日現在	第18期 2019年7月8日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 250,082,313口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 275,190,644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 22,245.6円 (10口当たり純資産額) (222,456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 22,000.1円 (10口当たり純資産額) (220,001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 344,979,569,450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 229,768,281,100円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自2017年7月9日 至2018年7月8日	第18期 自2018年7月9日 至2019年7月8日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1" style="width: 100%;"> <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>100,244,831,583円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>164,844,577円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>100,409,676,160円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>12,769,773,114円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>87,639,903,046円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>87,528,809,550円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>111,093,496円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>250,082,313口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>3,500円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	100,244,831,583円	分配準備積立金	B	164,844,577円	配当等収益合計額	C=A+B	100,409,676,160円	経費	D	12,769,773,114円	収益分配可能額	E=C-D	87,639,903,046円	収益分配金	F	87,528,809,550円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	111,093,496円	口数	H	250,082,313口	10口当たり分配金	I=F/H×10	3,500円	<table border="1" style="width: 100%;"> <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>126,789,789,788円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>111,093,496円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>126,900,883,284円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>14,147,247,874円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>112,753,635,410円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>112,552,973,396円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>200,662,014円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>275,190,644口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>4,090円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	126,789,789,788円	分配準備積立金	B	111,093,496円	配当等収益合計額	C=A+B	126,900,883,284円	経費	D	14,147,247,874円	収益分配可能額	E=C-D	112,753,635,410円	収益分配金	F	112,552,973,396円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	200,662,014円	口数	H	275,190,644口	10口当たり分配金	I=F/H×10	4,090円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	100,244,831,583円																																																											
分配準備積立金	B	164,844,577円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	100,409,676,160円																																																											
経費	D	12,769,773,114円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	87,639,903,046円																																																											
収益分配金	F	87,528,809,550円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	111,093,496円																																																											
口数	H	250,082,313口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	3,500円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	126,789,789,788円																																																											
分配準備積立金	B	111,093,496円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	126,900,883,284円																																																											
経費	D	14,147,247,874円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	112,753,635,410円																																																											
収益分配金	F	112,552,973,396円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	200,662,014円																																																											
口数	H	275,190,644口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	4,090円																																																											

(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17期 自2017年7月9日 至2018年7月8日	第18期 自2018年7月9日 至2019年7月8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、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。</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>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</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</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>

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。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第17期 2018年7月8日現在	第18期 2019年7月8日現在
<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第17期 自2017年7月9日 至2018年7月8日	第18期 自2018年7月9日 至2019年7月8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17期 自2017年7月9日 至2018年7月8日	第18期 自2018年7月9日 至2019年7月8日
期首元本額 2,782,314,427,548円	期首元本額 3,077,763,026,091円
期中追加設定元本額 1,159,410,594,870円	期中追加設定元本額 840,737,198,180円
期中一部交換元本額 863,961,996,327円	期中一部交換元本額 531,728,968,563円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第17期 自2017年7月9日 至2018年7月8日	第18期 自2018年7月9日 至2019年7月8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	322,424,213,042	△86,851,574,319
合計	322,424,213,042	△86,851,574,319

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17期(2018年7月8日現在)	第18期(2019年7月8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	49,317,400,000	—	47,960,000,000	△1,358,469,200	24,880,730,600	—	25,383,870,000	502,566,406
合計	49,317,400,000	—	47,960,000,000	△1,358,469,200	24,880,730,600	—	25,383,870,000	502,566,406

(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(2019年7月8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	10,278,000	681.00	6,999,318,000	貸付有価証券 31,100株
		マルハニチロ	1,027,800	3,205.00	3,294,099,000	貸付有価証券 5,700株
		国際石油開発帝石	4,111,200	957.70	3,937,296,240	貸付有価証券 3,300株
		コムシスホールディングス	10,278,000	2,746.00	28,223,388,000	貸付有価証券 100,400株
		大成建設	2,055,600	4,080.00	8,386,848,000	貸付有価証券 400株
		大林組	10,278,000	1,076.00	11,059,128,000	貸付有価証券 700株
		清水建設	10,278,000	920.00	9,455,760,000	貸付有価証券 48,800株
		長谷工コーポレーション	2,055,600	1,151.00	2,365,995,600	貸付有価証券 3,300株
		鹿島建設	5,139,000	1,505.00	7,734,195,000	貸付有価証券 5,600株
		大和ハウス工業	10,278,000	3,198.00	32,869,044,000	貸付有価証券 3,200株
		積水ハウス	10,278,000	1,865.50	19,173,609,000	貸付有価証券 101,800株
		日揮	10,278,000	1,482.00	15,231,996,000	貸付有価証券 922,900株
		千代田化工建設	10,278,000	306.00	3,145,068,000	貸付有価証券 6,494,700株 (93,000株)

日清製粉グループ本社	10,278,000	2,467.00	25,355,826,000	貸付有価証券 10,900株
明治ホールディングス	2,055,600	7,570.00	15,560,892,000	
日本ハム	5,139,000	4,540.00	23,331,060,000	貸付有価証券 2,300株
サッポロホールディングス	2,055,600	2,383.00	4,898,494,800	貸付有価証券 655,200株 (4,500 株)
アサヒグループホールディングス	10,278,000	4,834.00	49,683,852,000	貸付有価証券 310,200株
麒麟ホールディングス	10,278,000	2,337.00	24,019,686,000	貸付有価証券 998,800株
宝ホールディングス	10,278,000	1,161.00	11,932,758,000	貸付有価証券 42,600株
キッコーマン	10,278,000	4,720.00	48,512,160,000	貸付有価証券 230,700株
味の素	10,278,000	1,867.50	19,194,165,000	貸付有価証券 102,800株
ニチレイ	5,139,000	2,656.00	13,649,184,000	貸付有価証券 18,100株
日本たばこ産業	10,278,000	2,465.00	25,335,270,000	貸付有価証券 1,502,900株
東洋紡	1,027,800	1,349.00	1,386,502,200	貸付有価証券 34,000株
ユニチカ	1,027,800	407.00	418,314,600	貸付有価証券 13,200株
帝人	2,055,600	1,867.00	3,837,805,200	貸付有価証券 6,700株
東レ	10,278,000	789.30	8,112,425,400	貸付有価証券 25,300株
王子ホールディングス	10,278,000	604.00	6,207,912,000	貸付有価証券 36,600株
日本製紙	1,027,800	1,931.00	1,984,681,800	貸付有価証券 286,300株 (129,900 株)
クラレ	10,278,000	1,300.00	13,361,400,000	貸付有価証券 1,379,100株
旭化成	10,278,000	1,133.00	11,644,974,000	貸付有価証券 7,600株
昭和電工	1,027,800	3,075.00	3,160,485,000	貸付有価証券 763,900株
住友化学	10,278,000	509.00	5,231,502,000	貸付有価証券 28,900株
日産化学	10,278,000	4,710.00	48,409,380,000	貸付有価証券 40,700株
東ソー	5,139,000	1,544.00	7,934,616,000	貸付有価証券 10,600株
トクヤマ	2,055,600	2,833.00	5,823,514,800	貸付有価証券 300株

デンカ	2,055,600	3,245.00	6,670,422,000	貸付有価証券 6,900株
信越化学工業	10,278,000	10,005.00	102,831,390,000	貸付有価証券 33,700株
三井化学	2,055,600	2,634.00	5,414,450,400	貸付有価証券 1,000株
三菱ケミカルホールディングス	5,139,000	765.20	3,932,362,800	
宇部興産	1,027,800	2,236.00	2,298,160,800	貸付有価証券 1,900株
日本化薬	10,278,000	1,336.00	13,731,408,000	貸付有価証券 17,500株
花王	10,278,000	8,302.00	85,327,956,000	貸付有価証券 524,500株
D I C	1,027,800	2,882.00	2,962,119,600	貸付有価証券 145,400株
富士フイルムホールディングス	10,278,000	5,410.00	55,603,980,000	貸付有価証券 1,200株
資生堂	10,278,000	8,095.00	83,200,410,000	貸付有価証券 158,900株
日東電工	10,278,000	5,295.00	54,422,010,000	貸付有価証券 14,300株
協和キリン	10,278,000	1,896.00	19,487,088,000	貸付有価証券 532,100株
武田薬品工業	10,278,000	3,879.00	39,868,362,000	貸付有価証券 121,800株
アステラス製薬	51,390,000	1,554.50	79,885,755,000	貸付有価証券 5,900株
大日本住友製薬	10,278,000	1,994.00	20,494,332,000	貸付有価証券 5,500株
塩野義製薬	10,278,000	6,189.00	63,610,542,000	貸付有価証券 1,300株
中外製薬	10,278,000	7,220.00	74,207,160,000	貸付有価証券 162,300株
エーザイ	10,278,000	6,146.00	63,168,588,000	貸付有価証券 20,700株
第一三共	10,278,000	5,829.00	59,910,462,000	貸付有価証券 48,500株
大塚ホールディングス	10,278,000	3,816.00	39,220,848,000	貸付有価証券 134,900株
出光興産	4,111,200	3,120.00	12,826,944,000	貸付有価証券 9,400株
J X T Gホールディングス	10,278,000	524.00	5,385,672,000	
横浜ゴム	5,139,000	2,047.00	10,519,533,000	貸付有価証券 438,000株
ブリヂストン	10,278,000	4,212.00	43,290,936,000	貸付有価証券 2,326,900株
A G C	2,055,600	3,780.00	7,770,168,000	貸付有価証券

				354,800株
日本板硝子	1,027,800	744.00	764,683,200	貸付有価証券 119,500株
日本電気硝子	3,083,400	2,762.00	8,516,350,800	貸付有価証券 642,500株
住友大阪セメント	1,027,800	4,150.00	4,265,370,000	貸付有価証券 4,200株
太平洋セメント	1,027,800	3,170.00	3,258,126,000	
東海カーボン	10,278,000	1,088.00	11,182,464,000	貸付有価証券 8,269,900株 (18,500株)
TOTO	5,139,000	4,335.00	22,277,565,000	貸付有価証券 69,300株 (12,500株)
日本碍子	10,278,000	1,597.00	16,413,966,000	貸付有価証券 51,900株
日本製鉄	1,027,800	1,849.00	1,900,402,200	貸付有価証券 103,400株
神戸製鋼所	1,027,800	713.00	732,821,400	貸付有価証券 3,300株
ジェイ エフ イー ホールディングス	1,027,800	1,576.00	1,619,812,800	貸付有価証券 2,000株
大太平洋金属	1,027,800	2,257.00	2,319,744,600	貸付有価証券 521,100株
日本軽金属ホールディングス	10,278,000	228.00	2,343,384,000	貸付有価証券 26,000株
三井金属鉱業	1,027,800	2,534.00	2,604,445,200	貸付有価証券 2,500株
東邦亜鉛	1,027,800	2,530.00	2,600,334,000	貸付有価証券 85,300株
三菱マテリアル	1,027,800	3,050.00	3,134,790,000	貸付有価証券 19,300株
住友金属鉱山	5,139,000	3,137.00	16,121,043,000	貸付有価証券 11,100株
DOWAホールディングス	2,055,600	3,455.00	7,102,098,000	貸付有価証券 38,000株
古河電気工業	1,027,800	3,225.00	3,314,655,000	
住友電気工業	10,278,000	1,427.50	14,671,845,000	貸付有価証券 400株
フジクラ	10,278,000	422.00	4,337,316,000	貸付有価証券 233,900株 (21,800株)
SUMCO	1,027,800	1,322.00	1,358,751,600	貸付有価証券 842,700株
東洋製罐グループホールディングス	10,278,000	2,073.00	21,306,294,000	貸付有価証券 341,900株
日本製鋼所	2,055,600	1,835.00	3,772,026,000	貸付有価証券 8,600株
オークマ	2,055,600	5,800.00	11,922,480,000	貸付有価証券

				50,700株
アマダホールディングス	10,278,000	1,227.00	12,611,106,000	
小松製作所	10,278,000	2,568.00	26,393,904,000	貸付有価証券 7,500株
住友重機械工業	2,055,600	3,705.00	7,615,998,000	貸付有価証券 3,400株
日立建機	10,278,000	2,810.00	28,881,180,000	貸付有価証券 214,500株
クボタ	10,278,000	1,747.00	17,955,666,000	貸付有価証券 252,600株
荏原製作所	2,055,600	2,951.00	6,066,075,600	貸付有価証券 112,800株
ダイキン工業	10,278,000	14,465.00	148,671,270,000	貸付有価証券 12,900株
日本精工	10,278,000	962.00	9,887,436,000	
NTN	10,278,000	321.00	3,299,238,000	貸付有価証券 3,826,100株
ジェイテクト	10,278,000	1,333.00	13,700,574,000	貸付有価証券 16,700株
日立造船	2,055,600	403.00	828,406,800	貸付有価証券 251,900株
三菱重工業	1,027,800	4,761.00	4,893,355,800	貸付有価証券 2,400株
IHI	1,027,800	2,485.00	2,554,083,000	
日清紡ホールディングス	10,278,000	824.00	8,469,072,000	貸付有価証券 277,400株
コニカミノルタ	10,278,000	1,087.00	11,172,186,000	
ミネベアミツミ	10,278,000	1,853.00	19,045,134,000	貸付有価証券 83,500株
日立製作所	2,055,600	4,108.00	8,444,404,800	
三菱電機	10,278,000	1,465.50	15,062,409,000	貸付有価証券 327,900株
富士電機	2,055,600	3,765.00	7,739,334,000	貸付有価証券 8,200株
安川電機	10,278,000	3,725.00	38,285,550,000	貸付有価証券 3,893,600株
オムロン	10,278,000	5,580.00	57,351,240,000	貸付有価証券 738,600株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,055,600	2,147.00	4,413,373,200	貸付有価証券 29,100株
日本電気	1,027,800	4,275.00	4,393,845,000	
富士通	1,027,800	7,712.00	7,926,393,600	貸付有価証券 9,400株
沖電気工業	1,027,800	1,338.00	1,375,196,400	貸付有価証券 11,200株
セイコーエプソン	20,556,000	1,738.00	35,726,328,000	貸付有価証券 40,800株

パナソニック	10,278,000	943.00	9,692,154,000	貸付有価証券 314,900株
ソニー	10,278,000	5,939.00	61,041,042,000	
TDK	10,278,000	8,630.00	88,699,140,000	貸付有価証券 40,900株
アルプスアルパイン	10,278,000	1,870.00	19,219,860,000	貸付有価証券 49,500株
横河電機	10,278,000	2,136.00	21,953,808,000	貸付有価証券 62,300株
アドバンテスト	20,556,000	3,085.00	63,415,260,000	貸付有価証券 789,200株 (62,400 株)
カシオ計算機	10,278,000	1,308.00	13,443,624,000	貸付有価証券 2,245,500株 (103,900株)
ファナック	10,278,000	19,990.00	205,457,220,000	貸付有価証券 44,400株
京セラ	20,556,000	7,133.00	146,625,948,000	貸付有価証券 84,700株
太陽誘電	10,278,000	2,173.00	22,334,094,000	貸付有価証券 8,427,900株
SCREENホールディングス	2,055,600	5,000.00	10,278,000,000	貸付有価証券 359,300株 (82,900 株)
キヤノン	15,417,000	3,184.00	49,087,728,000	貸付有価証券 4,416,900株
リコー	10,278,000	1,068.00	10,976,904,000	貸付有価証券 562,900株
東京エレクトロン	10,278,000	16,795.00	172,619,010,000	貸付有価証券 64,500株
デンソー	10,278,000	4,566.00	46,929,348,000	貸付有価証券 25,900株
三井E&Sホールディングス	1,027,800	958.00	984,632,400	貸付有価証券 64,600株
川崎重工業	1,027,800	2,551.00	2,621,917,800	
日産自動車	10,278,000	770.50	7,919,199,000	貸付有価証券 186,600株
いすゞ自動車	5,139,000	1,233.50	6,338,956,500	貸付有価証券 7,000株
トヨタ自動車	10,278,000	6,888.00	70,794,864,000	貸付有価証券 47,400株
日野自動車	10,278,000	855.00	8,787,690,000	貸付有価証券 18,900株
三菱自動車工業	1,027,800	522.00	536,511,600	貸付有価証券 6,600株
マツダ	2,055,600	1,118.50	2,299,188,600	貸付有価証券 36,800株
本田技研工業	20,556,000	2,837.00	58,317,372,000	貸付有価証券 850,100株

スズキ	10,278,000	4,947.00	50,845,266,000	貸付有価証券 199,800株
S U B A R U	10,278,000	2,816.00	28,942,848,000	貸付有価証券 69,600株
ヤマハ発動機	10,278,000	1,926.00	19,795,428,000	貸付有価証券 2,829,500株
テルモ	41,112,000	3,187.00	131,023,944,000	貸付有価証券 663,500株
ニコン	10,278,000	1,557.00	16,002,846,000	貸付有価証券 161,400株
オリンパス	41,112,000	1,182.00	48,594,384,000	貸付有価証券 122,400株
シチズン時計	10,278,000	561.00	5,765,958,000	貸付有価証券 312,700株 (15,000 株)
凸版印刷	5,139,000	1,728.00	8,880,192,000	貸付有価証券 17,300株
大日本印刷	5,139,000	2,326.00	11,953,314,000	
ヤマハ	10,278,000	5,090.00	52,315,020,000	貸付有価証券 46,000株
東京電力ホールディング ス	1,027,800	544.00	559,123,200	貸付有価証券 148,900株
中部電力	1,027,800	1,507.50	1,549,408,500	貸付有価証券 27,300株
関西電力	1,027,800	1,283.00	1,318,667,400	貸付有価証券 3,500株
東京瓦斯	2,055,600	2,674.00	5,496,674,400	貸付有価証券 1,400株
大阪瓦斯	2,055,600	1,928.00	3,963,196,800	貸付有価証券 100株
東武鉄道	2,055,600	3,155.00	6,485,418,000	貸付有価証券 9,100株
東京急行電鉄	5,139,000	1,946.00	10,000,494,000	貸付有価証券 600株
小田急電鉄	5,139,000	2,587.00	13,294,593,000	貸付有価証券 74,000株
京王電鉄	2,055,600	7,150.00	14,697,540,000	貸付有価証券 135,800株
京成電鉄	5,139,000	3,975.00	20,427,525,000	貸付有価証券 18,700株
東日本旅客鉄道	1,027,800	10,135.00	10,416,753,000	貸付有価証券 6,900株
西日本旅客鉄道	1,027,800	8,753.00	8,996,333,400	貸付有価証券 62,800株
東海旅客鉄道	1,027,800	21,675.00	22,277,565,000	貸付有価証券 17,200株
日本通運	1,027,800	5,800.00	5,961,240,000	貸付有価証券 1,900株
ヤマトホールディングス	10,278,000	2,238.50	23,007,303,000	貸付有価証券

				280,800株
日本郵船	1,027,800	1,853.00	1,904,513,400	貸付有価証券 32,600株
商船三井	1,027,800	2,748.00	2,824,394,400	貸付有価証券 123,700株 (86,100 株)
川崎汽船	1,027,800	1,477.00	1,518,060,600	貸付有価証券 787,300株 (64,500 株)
A N Aホールディングス	1,027,800	3,647.00	3,748,386,600	貸付有価証券 111,400株
三菱倉庫	5,139,000	2,904.00	14,923,656,000	貸付有価証券 489,600株
ヤフー	4,111,200	320.00	1,315,584,000	
トレンドマイクロ	10,278,000	4,955.00	50,927,490,000	貸付有価証券 159,800株
スカパー J S A Tホール ディングス	1,027,800	431.00	442,981,800	貸付有価証券 19,200株
日本電信電話	2,055,600	5,124.00	10,532,894,400	
K D D I	61,668,000	2,730.00	168,353,640,000	
N T T ドコモ	1,027,800	2,540.00	2,610,612,000	貸付有価証券 5,100株
東宝	1,027,800	4,765.00	4,897,467,000	貸付有価証券 500株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	51,390,000	1,483.00	76,211,370,000	貸付有価証券 179,600株
コナミホールディングス	10,278,000	4,815.00	49,488,570,000	貸付有価証券 179,800株
ソフトバンクグループ	61,668,000	5,187.00	319,871,916,000	貸付有価証券 364,300株
双日	1,027,800	351.00	360,757,800	貸付有価証券 1,600株
伊藤忠商事	10,278,000	2,090.00	21,481,020,000	
丸紅	10,278,000	734.90	7,553,302,200	貸付有価証券 200株
豊田通商	10,278,000	3,305.00	33,968,790,000	貸付有価証券 102,600株
三井物産	10,278,000	1,789.00	18,387,342,000	
住友商事	10,278,000	1,638.50	16,840,503,000	貸付有価証券 13,000株
三菱商事	10,278,000	2,941.00	30,227,598,000	貸付有価証券 1,800株
J. フロント リテイリ ング	5,139,000	1,278.00	6,567,642,000	貸付有価証券 815,000株
三越伊勢丹ホールディン グス	10,278,000	910.00	9,352,980,000	貸付有価証券 293,300株
セブン&アイ・ホールデ ィングス	10,278,000	3,853.00	39,601,134,000	貸付有価証券 1,905,400株

ユニー・ファミリーマートホールディングス	41,112,000	2,611.00	107,343,432,000	貸付有価証券 3,084,300株
高島屋	5,139,000	1,240.00	6,372,360,000	貸付有価証券 1,701,400株
丸井グループ	10,278,000	2,358.00	24,235,524,000	貸付有価証券 127,300株
イオン	10,278,000	1,881.00	19,332,918,000	貸付有価証券 328,700株 (39,000株)
ファーストリテイリング	10,278,000	65,410.00	672,283,980,000	貸付有価証券 760,100株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	10,278,000	417.00	4,285,926,000	貸付有価証券 105,600株
新生銀行	1,027,800	1,732.00	1,780,149,600	貸付有価証券 842,700株
あおぞら銀行	1,027,800	2,646.00	2,719,558,800	貸付有価証券 8,100株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,278,000	526.70	5,413,422,600	
りそなホールディングス	1,027,800	454.30	466,929,540	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,027,800	3,943.00	4,052,615,400	貸付有価証券 12,200株
三井住友フィナンシャルグループ	1,027,800	3,840.00	3,946,752,000	
千葉銀行	10,278,000	551.00	5,663,178,000	貸付有価証券 11,400株
ふくおかフィナンシャルグループ	2,055,600	2,033.00	4,179,034,800	貸付有価証券 200株
静岡銀行	10,278,000	818.00	8,407,404,000	貸付有価証券 817,800株
みずほフィナンシャルグループ	10,278,000	158.70	1,631,118,600	貸付有価証券 164,800株
大和証券グループ本社	10,278,000	479.90	4,932,412,200	貸付有価証券 464,600株
野村ホールディングス	10,278,000	382.30	3,929,279,400	貸付有価証券 1,071,900株
松井証券	10,278,000	1,003.00	10,308,834,000	貸付有価証券 2,828,700株
SOMPOホールディングス	2,569,500	4,375.00	11,241,562,500	貸付有価証券 2,600株
MS&ADインシュアランスグループホール	3,083,400	3,609.00	11,127,990,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,055,600	2,601.00	5,346,615,600	貸付有価証券 119,700株
第一生命ホールディングス	1,027,800	1,634.00	1,679,425,200	
東京海上ホールディングス	5,139,000	5,593.00	28,742,427,000	貸付有価証券 10,000株
T&Dホールディングス	2,055,600	1,205.50	2,478,025,800	貸付有価証券

				19,600株
クレディセゾン	10,278,000	1,284.00	13,196,952,000	貸付有価証券 251,600株
東急不動産ホールディングス	10,278,000	638.00	6,557,364,000	貸付有価証券 9,600株
三井不動産	10,278,000	2,618.50	26,912,943,000	
三菱地所	10,278,000	2,040.00	20,967,120,000	貸付有価証券 500株
東京建物	5,139,000	1,269.00	6,521,391,000	貸付有価証券 90,500株
住友不動産	10,278,000	3,991.00	41,019,498,000	貸付有価証券 11,700株
ディー・エヌ・エー	3,083,400	2,095.00	6,459,723,000	貸付有価証券 2,600株
電通	10,278,000	3,850.00	39,570,300,000	貸付有価証券 235,900株
サイバーエージェント	2,055,600	4,115.00	8,458,794,000	貸付有価証券 368,300株(24,300株)
楽天	10,278,000	1,187.00	12,199,986,000	貸付有価証券 1,544,800株
リクルートホールディングス	30,834,000	3,562.00	109,830,708,000	
日本郵政	10,278,000	1,219.00	12,528,882,000	貸付有価証券 18,400株
東京ドーム	5,139,000	998.00	5,128,722,000	貸付有価証券 2,196,700株
セコム	10,278,000	9,024.00	92,748,672,000	貸付有価証券 62,000株
小計	銘柄数：225 組入時価比率：99.6%		6,028,366,234,680 100.0%	
合計			6,028,366,234,680	

(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(2019年7月8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。