



2018年10月期 (2018年4月8日～2018年10月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2018 (April 8, 2018 – October 7, 2018)

2018年11月16日
 November 16, 2018

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

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 増田 真一 TEL(03)-3241-9511

Fund name: NEXT FUNDS JPX-Nikkei Index 400 Exchange Traded Fund
 Code: 1591
 Underlying index: JPX-Nikkei Index 400
 Primary invested assets: Stocks
 Trading unit: 1 unit
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Kunio Watanabe, 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 2018年12月27日
 分配金支払開始日 2018年11月15日
 Scheduled date of submission of securities report: December 27, 2018
 Date of commencing dividend payment: November 15, 2018

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2018年10月期の運用状況 (2018年4月8日～2018年10月7日)

Management Status for Year ended October 2018 (from April 8, 2018 to October 7, 2018)

(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.	%
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	703,144	(97.4)	18,490	(2.6)	721,635	(100.0)
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	584,547	(97.9)	12,560	(2.1)	597,108	(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
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	39,189	9,592	3,425	45,356
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	35,133	11,692	7,636	39,189

(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))	1口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×1) Net Asset Value per 1 unit ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×1)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	777,438	55,803	721,635	15,910
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	638,766	41,658	597,108	15,236

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	145
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	148

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9期 (2018年4月7日現在) 9th Fiscal Year As of April 7, 2018	第10期 (2018年10月7日現在) 10th Fiscal Year As of October 7, 2018
	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	42,431,776,764	60,828,936,617
株式 Stocks	584,547,267,200	703,144,954,720
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	182,561,157	831,919,592
未収入金 Accounts receivable - other	5,822,298,200	6,570,497,110
未収配当金 Accrued dividend receivable	5,441,699,757	6,008,875,038
未収利息 Accrued interest	4,104,969	5,177,379
その他未収収益 Other accrued revenue	119,420,901	48,529,568
差入委託証拠金 Customers' margin	217,129,036	-
流動資産合計 Total current assets	638,766,257,984	777,438,890,024
資産合計 Total assets	638,766,257,984	777,438,890,024
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	-	49,314,708
前受金 Advances received	-	285,941,112
未払収益分配金 Unpaid dividends	5,800,034,900	6,576,667,270
未払受託者報酬 Trustee fee payable	155,081,586	174,502,468
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	467,362,816	525,935,942
未払利息 Accrued interest expenses	140,174	315,876
有価証券貸借取引受入金 Cash received on debt credit transaction	35,167,305,599	47,978,405,905

of securities		
その他未払費用 Other accrued expenses	68,251,832	211,963,282
流動負債合計 Total current liabilities	41,658,176,907	55,803,046,563
負債合計 Total liabilities	41,658,176,907	55,803,046,563
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	455,616,255,050	527,312,646,076
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	141,491,826,027	194,323,197,385
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	11,720,631	25,337,168
元本等合計 Total principal and other	597,108,081,077	721,635,843,461
純資産合計 Total net assets	597,108,081,077	721,635,843,461
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	638,766,257,984	777,438,890,024

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第9期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7日 9th Fiscal Year From October 8, 2017 to April 7, 2018	第10期 自 2018年4月8日 至 2018年10月7日 10th Fiscal Year From April 8, 2018 to October 7, 2018
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	6,403,315,137	7,372,065,441
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	6,813,300,340	29,354,108,177
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	375,423,509	603,961,959
その他収益 Other revenue	164,527,397	90,034,518
営業収益合計 Total operating revenue	13,756,566,383	37,420,170,095
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△4,901,670	△2,133,878
受託者報酬 Trustee fee	155,081,586	174,502,468

委託者報酬 Investment trust management fee	467,362,816	525,935,942
その他費用 Other expenses	175,114,792	173,511,620
営業費用合計 Total operating expenses	792,657,524	871,816,152
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	12,963,908,859	36,548,353,943
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	12,963,908,859	36,548,353,943
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	12,963,908,859	36,548,353,943
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	115,351,934,151	141,491,826,027
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	50,299,012,043	36,376,567,445
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	50,299,012,043	36,376,567,445
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	31,322,994,126	13,516,882,760
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	31,322,994,126	13,516,882,760
分配金 Dividends	5,800,034,900	6,576,667,270
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	141,491,826,027	194,323,197,385

(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	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。 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年4月8日から2018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9期 2018年4月7日現在	第10期 2018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 39,189,425 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 45,356,326 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 15,236 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 15,910 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 33,796,203,260 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 44,887,286,750 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7日	第10期 自 2018年4月8日 至 2018年10月7日																																																												
1. 分配金の計算過程 <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 10%;"></th> <th style="width: 60%;"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">6,572,744,204 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">36,570,521 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C=A+B</td> <td style="text-align: right;">6,609,314,725 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">797,559,194 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E=C-D</td> <td style="text-align: right;">5,811,755,531 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">5,800,034,900 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G=E-F</td> <td style="text-align: right;">11,720,631 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">39,189,425 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H</td> <td style="text-align: right;">148 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	6,572,744,204 円	分配準備積立金	B	36,570,521 円	配当等収益合計額	C=A+B	6,609,314,725 円	経費	D	797,559,194 円	収益分配可能額	E=C-D	5,811,755,531 円	収益分配金	F	5,800,034,900 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,720,631 円	口数	H	39,189,425 口	1口当たり分配金	I=F/H	148 円	1. 分配金の計算過程 <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 10%;"></th> <th style="width: 60%;"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">7,464,233,837 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">11,720,631 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C=A+B</td> <td style="text-align: right;">7,475,954,468 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">873,950,030 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E=C-D</td> <td style="text-align: right;">6,602,004,438 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">6,576,667,270 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G=E-F</td> <td style="text-align: right;">25,337,168 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">45,356,326 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H</td> <td style="text-align: right;">145 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	7,464,233,837 円	分配準備積立金	B	11,720,631 円	配当等収益合計額	C=A+B	7,475,954,468 円	経費	D	873,950,030 円	収益分配可能額	E=C-D	6,602,004,438 円	収益分配金	F	6,576,667,270 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	25,337,168 円	口数	H	45,356,326 口	1口当たり分配金	I=F/H	145 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	6,572,744,204 円																																																											
分配準備積立金	B	36,570,521 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	6,609,314,725 円																																																											
経費	D	797,559,194 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	5,811,755,531 円																																																											
収益分配金	F	5,800,034,900 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,720,631 円																																																											
口数	H	39,189,425 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	148 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	7,464,233,837 円																																																											
分配準備積立金	B	11,720,631 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	7,475,954,468 円																																																											
経費	D	873,950,030 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	6,602,004,438 円																																																											
収益分配金	F	6,576,667,270 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	25,337,168 円																																																											
口数	H	45,356,326 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	145 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち124,978,974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140,411,830円は、対象指数についての商標使用料であります。																																																												

(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9期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7日	第10期 自 2018年4月8日 至 2018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 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。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

<p>○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。</p> <p>○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。</p> <p>○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。</p>	
---	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第9期 2018年4月7日現在	第10期 2018年10月7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9期 自2017年10月8日 至2018年4月7日	第10期 自2018年4月8日 至2018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9期 自2017年10月8日 至2018年4月7日	第10期 自2018年4月8日 至2018年10月7日
期首元本額 408,458,780,842円	期首元本額 455,616,255,050円
期中追加設定元本額 135,938,481,502円	期中追加設定元本額 111,525,206,866円
期中一部交換元本額 88,781,007,294円	期中一部交換元本額 39,828,815,840円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第9期 自2017年10月8日 至2018年4月7日	第10期 自2018年4月8日 至2018年10月7日
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	952,571,824	27,899,718,833
合計	952,571,824	27,899,718,833

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9期(2018年4月7日現在)	第10期(2018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	12,308,989,035	—	12,492,876,000	182,561,157	17,673,164,888	—	18,457,648,000	782,604,884
合計	12,308,989,035	—	12,492,876,000	182,561,157	17,673,164,888	—	18,457,648,000	782,604,884

(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(2018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	444,000	713.00	316,572,000	貸付有価証券 100株
		マルハニチロ	74,800	4,175.00	312,290,000	貸付有価証券 26,200株
		国際石油開発帝石	1,918,400	1,426.00	2,735,638,400	
		安藤・間	322,000	848.00	273,056,000	貸付有価証券 1,800株
		東急建設	151,700	1,106.00	167,780,200	貸付有価証券 800株
		コムシスホールディングス	138,700	3,255.00	451,468,500	
		大成建設	392,800	5,120.00	2,011,136,000	
		大林組	1,183,200	1,069.00	1,264,840,800	
		清水建設	1,206,800	1,014.00	1,223,695,200	
		長谷工コーポレーション	460,400	1,471.00	677,248,400	
		鹿島建設	866,900	1,616.00	1,400,910,400	
		西松建設	91,200	2,879.00	262,564,800	貸付有価証券 300株
		三井住友建設	284,500	777.00	221,056,500	
		前田建設工業	281,300	1,472.00	414,073,600	
		戸田建設	458,600	821.00	376,510,600	貸付有価証券 16,000株
熊谷組	61,900	3,160.00	195,604,000	貸付有価証券 9,000株		

大東建託	140,600	14,885.00	2,092,831,000	
N I P P O	91,400	2,045.00	186,913,000	
前田道路	123,500	2,300.00	284,050,000	
五洋建設	469,000	752.00	352,688,000	
住友林業	252,200	1,979.00	499,103,800	
大和ハウス工業	1,165,400	3,336.00	3,887,774,400	
積水ハウス	1,283,600	1,691.00	2,170,567,600	貸付有価証券 73,300株
協和エクシオ	141,700	3,260.00	461,942,000	貸付有価証券 400株
九電工	77,800	4,460.00	346,988,000	
森永製菓	82,900	4,410.00	365,589,000	
江崎グリコ	98,700	5,670.00	559,629,000	
カルビー	161,000	3,735.00	601,335,000	貸付有価証券 42,900株
ヤクルト本社	205,700	9,230.00	1,898,611,000	
明治ホールディングス	233,700	7,740.00	1,808,838,000	
日本ハム	152,800	4,165.00	636,412,000	貸付有価証券 20,900株
アサヒグループホールディングス	740,100	4,907.00	3,631,670,700	貸付有価証券 150,600株
麒麟ホールディングス	1,598,700	2,820.00	4,508,334,000	貸付有価証券 365,100株
サントリー食品インターナショナル	236,500	4,670.00	1,104,455,000	貸付有価証券 95,000株
キッコーマン	254,300	6,480.00	1,647,864,000	貸付有価証券 4,900株
味の素	812,700	1,902.50	1,546,161,750	
キューピー	196,800	2,618.00	515,222,400	貸付有価証券 40,300株
ニチレイ	168,300	2,895.00	487,228,500	
東洋水産	193,900	4,370.00	847,343,000	
日清食品ホールディングス	138,700	7,710.00	1,069,377,000	
日本たばこ産業	2,040,700	2,941.00	6,001,698,700	貸付有価証券 302,300株
帝人	303,000	2,158.00	653,874,000	貸付有価証券 14,000株
東レ	2,675,400	852.10	2,279,708,340	
王子ホールディングス	1,552,500	849.00	1,318,072,500	
クラレ	581,900	1,677.00	975,846,300	貸付有価証券 393,500株
旭化成	2,300,100	1,708.50	3,929,720,850	貸付有価証券

				161,500株
昭和電工	229,100	5,800.00	1,328,780,000	貸付有価証券 157,100株
住友化学	2,714,700	640.00	1,737,408,000	
日産化学	211,800	6,150.00	1,302,570,000	貸付有価証券 5,900株
東ソー	533,100	1,654.00	881,747,400	
デンカ	135,500	3,885.00	526,417,500	
信越化学工業	607,700	9,924.00	6,030,814,800	
エア・ウォーター	304,100	2,052.00	624,013,200	貸付有価証券 1,000株
大陽日酸	284,100	1,806.00	513,084,600	
日本パーカラライジング	188,500	1,486.00	280,111,000	貸付有価証券 900株
三菱瓦斯化学	304,000	2,312.00	702,848,000	
三井化学	335,300	2,811.00	942,528,300	
J S R	370,800	2,066.00	766,072,800	貸付有価証券 1,600株
三菱ケミカルホールディングス	2,470,100	1,065.50	2,631,891,550	
ダイセル	497,300	1,366.00	679,311,800	
積水化学工業	753,800	2,052.00	1,546,797,600	貸付有価証券 900株
日本ゼオン	311,000	1,230.00	382,530,000	
アイカ工業	103,400	4,550.00	470,470,000	
宇部興産	185,800	2,952.00	548,481,600	
日立化成	182,200	2,185.00	398,107,000	貸付有価証券 1,700株
ダイキョーニシカワ	72,700	1,269.00	92,256,300	貸付有価証券 400株
日油	142,400	3,660.00	521,184,000	貸付有価証券 600株
花王	865,800	8,871.00	7,680,511,800	貸付有価証券 182,100株
日本ペイントホールディングス	284,600	4,135.00	1,176,821,000	貸付有価証券 134,900株 (1,900株)
関西ペイント	387,500	2,004.00	776,550,000	貸付有価証券 60,900株
D I C	156,000	3,845.00	599,820,000	貸付有価証券 30,100株
資生堂	699,700	8,084.00	5,656,374,800	貸付有価証券 131,300株
ライオン	490,500	2,320.00	1,137,960,000	貸付有価証券 180,500株

コーセー	59,600	20,500.00	1,221,800,000	
シーブズ・ホールディングス	42,500	4,030.00	171,275,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	150,300	3,985.00	598,945,500	貸付有価証券 7,700株
小林製薬	98,700	7,890.00	778,743,000	貸付有価証券 57,100株
日東電工	265,900	8,652.00	2,300,566,800	
ニフコ	129,300	3,050.00	394,365,000	
ユニ・チャーム	746,600	3,498.00	2,611,606,800	貸付有価証券 273,800株
協和発酵キリン	441,200	2,072.00	914,166,400	
武田薬品工業	1,297,300	4,556.00	5,910,498,800	貸付有価証券 877,200株
アステラス製薬	3,463,000	1,975.50	6,841,156,500	
大日本住友製薬	261,000	2,739.00	714,879,000	貸付有価証券 39,000株
塩野義製薬	496,100	7,498.00	3,719,757,800	
田辺三菱製薬	429,600	1,885.00	809,796,000	貸付有価証券 3,900株
中外製薬	367,100	7,040.00	2,584,384,000	貸付有価証券 63,300株
科研製薬	63,500	5,950.00	377,825,000	
エーザイ	421,500	10,910.00	4,598,565,000	
小野薬品工業	831,600	3,209.00	2,668,604,400	
久光製薬	104,000	8,690.00	903,760,000	貸付有価証券 36,900株
参天製薬	667,500	1,785.00	1,191,487,500	
ツムラ	125,900	3,945.00	496,675,500	貸付有価証券 900株
沢井製薬	70,800	6,180.00	437,544,000	
第一三共	1,007,600	4,858.00	4,894,920,800	
大塚ホールディングス	670,800	5,717.00	3,834,963,600	貸付有価証券 130,100株
出光興産	295,600	6,310.00	1,865,236,000	
JXTGホールディングス	5,619,600	860.30	4,834,541,880	
コスモエネルギーホールディングス	101,900	4,760.00	485,044,000	
横浜ゴム	203,900	2,410.00	491,399,000	貸付有価証券 29,500株
ブリヂストン	1,082,300	4,315.00	4,670,124,500	貸付有価証券 264,000株
住友ゴム工業	316,300	1,674.00	529,486,200	貸付有価証券

				1,600株
AGC	355,000	4,620.00	1,640,100,000	貸付有価証券 111,000株
太平洋セメント	222,400	3,585.00	797,304,000	
TOTO	270,900	4,865.00	1,317,928,500	
日本碍子	429,700	1,831.00	786,780,700	
日本特殊陶業	296,900	3,305.00	981,254,500	貸付有価証券 200株
ニチアス	96,400	2,929.00	282,355,600	
新日鐵住金	1,558,400	2,367.00	3,688,732,800	
ジェイ エフ イー ホールディングス	940,400	2,582.00	2,428,112,800	
東京製鐵	186,500	827.00	154,235,500	貸付有価証券 5,100株
日立金属	375,100	1,404.00	526,640,400	貸付有価証券 1,100株
日本軽金属ホールディングス	1,016,600	244.00	248,050,400	
三菱マテリアル	230,000	3,435.00	790,050,000	
住友金属鉱山	445,100	3,923.00	1,746,127,300	
DOWAホールディングス	88,100	3,630.00	319,803,000	貸付有価証券 36,400株
古河電気工業	115,900	3,665.00	424,773,500	貸付有価証券 400株
住友電気工業	1,301,900	1,722.00	2,241,871,800	
SUMCO	384,800	1,627.00	626,069,600	貸付有価証券 109,300株 (83,900株)
三和ホールディングス	334,000	1,347.00	449,898,000	
リンナイ	62,100	8,390.00	521,019,000	
東プレ	65,000	2,780.00	180,700,000	
日本発條	346,900	1,149.00	398,588,100	貸付有価証券 300株
アマダホールディングス	537,400	1,164.00	625,533,600	
オーエスジー	171,400	2,563.00	439,298,200	
DMG森精機	220,300	1,888.00	415,926,400	貸付有価証券 152,200株 (7,200株)
ディスコ	47,100	18,230.00	858,633,000	
ナブテスコ	191,500	3,000.00	574,500,000	貸付有価証券 77,600株
三井海洋開発	37,000	3,615.00	133,755,000	
SMC	110,500	36,320.00	4,013,360,000	

小松製作所	1,700,200	3,400.00	5,780,680,000	
住友重機械工業	201,500	4,040.00	814,060,000	
日立建機	164,600	3,770.00	620,542,000	
ハーモニック・ドライブ・システムズ	52,600	4,255.00	223,813,000	貸付有価証券 35,500株(23,200株)
クボタ	1,888,700	1,967.00	3,715,072,900	貸付有価証券 366,300株(101,500株)
荏原製作所	156,000	3,855.00	601,380,000	貸付有価証券 80,700株
ダイキン工業	480,700	14,910.00	7,167,237,000	
椿本チエイン	41,900	5,340.00	223,746,000	
ダイフク	179,200	5,560.00	996,352,000	
タダノ	169,900	1,347.00	228,855,300	貸付有価証券 200株
平和	109,100	2,457.00	268,058,700	貸付有価証券 2,500株
竹内製作所	58,900	2,991.00	176,169,900	貸付有価証券 100株
T P R	39,500	3,010.00	118,895,000	
ホシザキ	102,900	11,660.00	1,199,814,000	貸付有価証券 39,400株
日本精工	723,200	1,308.00	945,945,600	
ジェイテクト	375,300	1,705.00	639,886,500	
T H K	219,500	2,827.00	620,526,500	
マキタ	459,200	5,380.00	2,470,496,000	
三菱重工業	590,100	4,458.00	2,630,665,800	
コニカミノルタ	824,300	1,222.00	1,007,294,600	
ブラザー工業	430,000	2,308.00	992,440,000	貸付有価証券 10,700株
ミネベアミツミ	653,700	1,980.00	1,294,326,000	
日立製作所	1,690,900	3,797.00	6,420,347,300	
三菱電機	3,521,100	1,532.50	5,396,085,750	貸付有価証券 2,600株
富士電機	212,200	4,465.00	947,473,000	貸付有価証券 17,500株
安川電機	408,200	3,360.00	1,371,552,000	貸付有価証券 214,800株(2,000株)
日本電産	423,700	15,640.00	6,626,668,000	
オムロン	374,200	4,895.00	1,831,709,000	
日本電気	455,600	3,150.00	1,435,140,000	

富士通	362,100	7,678.00	2,780,203,800	
ルネサスエレクトロニクス	364,700	733.00	267,325,100	貸付有価証券 186,400株
セイコーエプソン	524,300	1,943.00	1,018,714,900	
アルバック	80,900	4,155.00	336,139,500	貸付有価証券 11,200株
エレコム	31,600	2,925.00	92,430,000	貸付有価証券 2,600株
パナソニック	4,022,600	1,334.50	5,368,159,700	
富士通ゼネラル	107,500	1,893.00	203,497,500	貸付有価証券 13,600株
ソニー	1,794,100	6,596.00	11,833,883,600	
TDK	184,200	11,320.00	2,085,144,000	
アルプス電気	303,400	2,942.00	892,602,800	
クラリオン	37,100	1,750.00	64,925,000	貸付有価証券 25,000株
ヒロセ電機	57,500	11,990.00	689,425,000	貸付有価証券 13,200株
横河電機	352,400	2,495.00	879,238,000	
日本光電工業	145,500	3,805.00	553,627,500	
堀場製作所	69,700	5,790.00	403,563,000	貸付有価証券 26,000株
アドバンテスト	196,400	2,263.00	444,453,200	
キーエンス	162,300	65,200.00	10,581,960,000	
シスメックス	274,300	9,460.00	2,594,878,000	
OBARA GROUP	20,500	5,420.00	111,110,000	
スタンレー電気	268,800	3,885.00	1,044,288,000	
カシオ計算機	283,200	1,866.00	528,451,200	貸付有価証券 36,700株
ファナック	334,600	21,345.00	7,142,037,000	貸付有価証券 5,900株
浜松ホトニクス	252,600	4,280.00	1,081,128,000	
京セラ	578,000	6,627.00	3,830,406,000	
村田製作所	369,400	17,110.00	6,320,434,000	貸付有価証券 1,200株
小糸製作所	210,900	7,190.00	1,516,371,000	
SCREENホールディングス	66,600	6,400.00	426,240,000	貸付有価証券 24,500株
キヤノン	1,895,500	3,617.00	6,856,023,500	貸付有価証券 679,800株
東京エレクトロン	234,800	15,200.00	3,568,960,000	貸付有価証券 6,100株
トヨタ紡織	102,600	2,110.00	216,486,000	

豊田自動織機	285,000	6,440.00	1,835,400,000	
デンソー	781,300	5,679.00	4,437,002,700	
川崎重工業	274,000	3,260.00	893,240,000	
日産自動車	4,152,800	1,037.00	4,306,453,600	貸付有価証券 134,600株
いすゞ自動車	1,020,300	1,731.50	1,766,649,450	
トヨタ自動車	1,415,700	7,002.00	9,912,731,400	
日野自動車	502,500	1,234.00	620,085,000	
NOK	189,300	1,897.00	359,102,100	貸付有価証券 51,300株
アイシン精機	289,900	5,190.00	1,504,581,000	
マツダ	1,105,100	1,341.50	1,482,491,650	
本田技研工業	3,120,600	3,326.00	10,379,115,600	貸付有価証券 1,800株
スズキ	697,900	6,200.00	4,326,980,000	貸付有価証券 600株
S U B A R U	1,093,100	3,454.00	3,775,567,400	貸付有価証券 6,300株
ヤマハ発動機	497,300	3,120.00	1,551,576,000	貸付有価証券 172,200株 (28,700 株)
豊田合成	127,900	2,683.00	343,155,700	
シマノ	141,900	17,270.00	2,450,613,000	貸付有価証券 24,500株
テイ・エス テック	81,800	3,790.00	310,022,000	
テルモ	539,700	6,920.00	3,734,724,000	貸付有価証券 3,700株
島津製作所	420,800	3,410.00	1,434,928,000	
オリンパス	524,500	4,435.00	2,326,157,500	貸付有価証券 100株
HOYA	708,900	6,841.00	4,849,584,900	
朝日インテック	169,600	5,290.00	897,184,000	貸付有価証券 32,600株 (32,600 株)
バンダイナムコホールデ ィングス	364,000	4,160.00	1,514,240,000	
パイロットコーポレーシ ョン	61,400	6,730.00	413,222,000	
アシックス	349,600	1,713.00	598,864,800	貸付有価証券 228,500株
ヤマハ	230,400	5,530.00	1,274,112,000	
ピジョン	212,800	6,100.00	1,298,080,000	貸付有価証券 79,600株
任天堂	216,800	41,180.00	8,927,824,000	

中部電力	1,077,300	1,751.00	1,886,352,300	貸付有価証券 16,700株
関西電力	1,436,700	1,726.00	2,479,744,200	
東北電力	824,600	1,552.00	1,279,779,200	貸付有価証券 600株
九州電力	777,600	1,387.00	1,078,531,200	貸付有価証券 2,700株
電源開発	280,200	3,190.00	893,838,000	
東京瓦斯	740,100	2,799.50	2,071,909,950	
大阪瓦斯	683,300	2,192.00	1,497,793,600	
東邦瓦斯	174,400	4,350.00	758,640,000	
東武鉄道	371,400	3,280.00	1,218,192,000	
相鉄ホールディングス	150,200	3,730.00	560,246,000	
東京急行電鉄	956,400	1,953.00	1,867,849,200	
小田急電鉄	523,700	2,651.00	1,388,328,700	
京王電鉄	196,700	6,170.00	1,213,639,000	
京成電鉄	245,000	3,905.00	956,725,000	
東日本旅客鉄道	626,100	10,235.00	6,408,133,500	貸付有価証券 1,800株
西日本旅客鉄道	315,600	7,757.00	2,448,109,200	貸付有価証券 1,000株
東海旅客鉄道	315,300	23,540.00	7,422,162,000	貸付有価証券 8,400株
西武ホールディングス	448,800	2,132.00	956,841,600	
近鉄グループホールディングス	333,500	4,505.00	1,502,417,500	
阪急阪神ホールディングス	444,800	3,970.00	1,765,856,000	
京阪ホールディングス	198,000	4,370.00	865,260,000	貸付有価証券 100株
名古屋鉄道	356,100	2,810.00	1,000,641,000	貸付有価証券 12,800株
日本通運	130,900	7,090.00	928,081,000	
ヤマトホールディングス	584,600	3,436.00	2,008,685,600	
山九	85,600	6,360.00	544,416,000	貸付有価証券 100株
日立物流	73,300	3,075.00	225,397,500	
日本航空	610,500	4,000.00	2,442,000,000	貸付有価証券 6,600株
A N Aホールディングス	647,700	3,777.00	2,446,362,900	貸付有価証券 2,700株
新日鉄住金ソリューションズ	51,800	3,650.00	189,070,000	

T I S	115,200	5,450.00	627,840,000	
ネクソン	879,400	1,449.00	1,274,250,600	貸付有価証券 163,200株
コロプラ	98,600	713.00	70,301,800	貸付有価証券 34,800株 (15,900 株)
ティーガイア	34,600	2,842.00	98,333,200	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	832,700	224.00	186,524,800	貸付有価証券 563,200株 (4,500 株)
野村総合研究所	219,500	5,580.00	1,224,810,000	
オービック	108,900	10,690.00	1,164,141,000	
ヤフー	2,491,600	400.00	996,640,000	貸付有価証券 234,100株
トレンドマイクロ	184,000	6,980.00	1,284,320,000	貸付有価証券 60,400株
日本オラクル	56,000	8,870.00	496,720,000	貸付有価証券 11,900株
伊藤忠テクノソリューションズ	157,400	2,356.00	370,834,400	
大塚商会	186,900	4,055.00	757,879,500	貸付有価証券 107,600株
日本ユニシス	95,900	2,840.00	272,356,000	
日本テレビホールディングス	317,300	1,986.00	630,157,800	貸付有価証券 7,200株
日本電信電話	2,015,700	5,062.00	10,203,473,400	
KDDI	3,044,900	2,978.50	9,069,234,650	
光通信	40,700	21,400.00	870,980,000	
NTTドコモ	2,480,900	2,970.00	7,368,273,000	
GMOインターネット	125,800	1,812.00	227,949,600	貸付有価証券 37,900株 (2,600株)
東宝	227,300	3,580.00	813,734,000	貸付有価証券 88,800株
エヌ・ティ・ティ・データ	1,073,300	1,543.00	1,656,101,900	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	160,700	4,360.00	700,652,000	
カプコン	148,100	2,807.00	415,716,700	
S C S K	79,700	5,180.00	412,846,000	
コナミホールディングス	141,200	4,425.00	624,810,000	
ソフトバンクグループ	1,273,200	11,075.00	14,100,690,000	
双日	2,052,300	417.00	855,809,100	
アルフレッサ ホールディングス	385,400	3,050.00	1,175,470,000	

神戸物産	26,200	6,250.00	163,750,000	貸付有価証券 17,900株
シップヘルスケアホールディングス	72,200	4,355.00	314,431,000	貸付有価証券 300株
第一興商	68,800	5,480.00	377,024,000	
メディopalホールディングス	347,500	2,413.00	838,517,500	
伊藤忠商事	2,545,100	2,272.50	5,783,739,750	
丸紅	2,849,900	1,043.00	2,972,445,700	
豊田通商	387,100	4,400.00	1,703,240,000	
兼松	147,800	1,680.00	248,304,000	貸付有価証券 500株
三井物産	2,857,200	2,098.00	5,994,405,600	
日立ハイテクノロジーズ	120,500	3,755.00	452,477,500	貸付有価証券 2,200株
住友商事	2,187,600	1,916.00	4,191,441,600	
三菱商事	2,433,600	3,617.00	8,802,331,200	
阪和興業	64,800	3,805.00	246,564,000	貸付有価証券 3,700株
岩谷産業	76,900	4,015.00	308,753,500	貸付有価証券 40,000株 (35,900株)
東邦ホールディングス	102,700	2,946.00	302,554,200	貸付有価証券 67,400株 (59,600株)
PAL TAC	48,600	5,430.00	263,898,000	
日鉄住金物産	27,100	5,360.00	145,256,000	貸付有価証券 100株
ミスミグループ本社	402,900	2,937.00	1,183,317,300	
ローソン	87,700	7,170.00	628,809,000	貸付有価証券 59,200株 (37,500株)
エービーシー・マート	63,200	6,200.00	391,840,000	貸付有価証券 44,000株
アダストリア	53,300	1,736.00	92,528,800	貸付有価証券 36,000株
セリア	82,900	3,855.00	319,579,500	貸付有価証券 700株
ビックカメラ	185,100	1,508.00	279,130,800	
Monotaro	219,100	3,290.00	720,839,000	貸付有価証券 149,600株 (1,600株)
J. フロント リテイリング	414,100	1,735.00	718,463,500	貸付有価証券 71,600株
マツモトキヨシホールディングス	143,400	4,460.00	639,564,000	

ZOZO	340,700	3,215.00	1,095,350,500	
ウエルシアホールディングス	91,700	6,020.00	552,034,000	貸付有価証券 18,600株
クリエイティブSDホールディングス	51,100	2,985.00	152,533,500	
すかいらーくホールディングス	323,200	1,672.00	540,390,400	貸付有価証券 64,200株 (64,100株)
コスモス薬品	17,500	24,890.00	435,575,000	貸付有価証券 1,700株
セブン&アイ・ホールディングス	1,453,600	5,114.00	7,433,710,400	貸付有価証券 507,500株
ツルハホールディングス	75,300	13,070.00	984,171,000	貸付有価証券 31,400株
クスリのアオキホールディングス	27,600	8,780.00	242,328,000	貸付有価証券 18,600株
ノジマ	61,500	2,358.00	145,017,000	
良品計画	46,000	32,150.00	1,478,900,000	貸付有価証券 18,300株
ドンキホーテホールディングス	224,800	5,630.00	1,265,624,000	貸付有価証券 78,900株
ゼンショーホールディングス	179,900	2,163.00	389,123,700	
ユナイテッドアローズ	42,900	4,700.00	201,630,000	
スギホールディングス	76,200	5,590.00	425,958,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	110,800	12,770.00	1,414,916,000	貸付有価証券 27,000株 (700株)
日本瓦斯	63,700	5,450.00	347,165,000	
しまむら	40,400	9,430.00	380,972,000	貸付有価証券 2,700株
丸井グループ	317,900	2,463.00	782,987,700	貸付有価証券 7,500株
イオン	1,334,500	2,692.00	3,592,474,000	貸付有価証券 933,900株 (111,400株)
イズミ	62,700	7,040.00	441,408,000	
ヤオコー	39,400	6,770.00	266,738,000	
ケーズホールディングス	308,900	1,393.00	430,297,700	
アインホールディングス	46,500	8,730.00	405,945,000	貸付有価証券 32,300株 (32,300株)
ニトリホールディングス	137,600	15,815.00	2,176,144,000	貸付有価証券 61,500株
ファーストリテイリング	46,400	57,750.00	2,679,600,000	貸付有価証券 24,800株
サンドラッグ	130,500	4,040.00	527,220,000	

めぶきフィナンシャルグループ	1,804,600	399.00	720,035,400	貸付有価証券 100株
九州フィナンシャルグループ	759,900	557.00	423,264,300	貸付有価証券 900株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,073,800	578.00	1,198,656,400	
新生銀行	283,200	1,870.00	529,584,000	貸付有価証券 180,400株
あおぞら銀行	206,900	4,020.00	831,738,000	貸付有価証券 2,900株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	16,001,000	732.70	11,723,932,700	
りそなホールディングス	3,811,200	652.90	2,488,332,480	
三井住友トラスト・ホールディングス	682,800	4,729.00	3,228,961,200	
三井住友フィナンシャルグループ	2,331,800	4,722.00	11,010,759,600	貸付有価証券 14,700株
千葉銀行	1,230,100	803.00	987,770,300	貸付有価証券 1,300株
静岡銀行	874,200	1,057.00	924,029,400	
広島銀行	512,700	765.00	392,215,500	貸付有価証券 500株
セブン銀行	1,303,600	340.00	443,224,000	貸付有価証券 83,900株
みずほフィナンシャルグループ	47,191,500	199.80	9,428,861,700	
FPG	111,100	1,096.00	121,765,600	貸付有価証券 13,100株
SBIホールディングス	392,800	3,375.00	1,325,700,000	貸付有価証券 28,100株
大和証券グループ本社	2,972,500	693.30	2,060,834,250	
野村ホールディングス	5,974,800	562.40	3,360,227,520	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	384,500	673.00	258,768,500	貸付有価証券 79,700株
松井証券	170,100	1,195.00	203,269,500	
SOMPOホールディングス	681,100	4,785.00	3,259,063,500	
MS&ADインシュアランスグループホール	908,000	3,819.00	3,467,652,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	285,400	2,605.00	743,467,000	貸付有価証券 2,000株
第一生命ホールディングス	1,964,600	2,447.00	4,807,376,200	
東京海上ホールディングス	1,308,400	5,618.00	7,350,591,200	貸付有価証券 25,700株
T&Dホールディングス	1,074,100	1,995.50	2,143,366,550	
全国保証	97,900	4,400.00	430,760,000	貸付有価証券

				28,400株
芙蓉総合リース	39,700	6,760.00	268,372,000	
東京センチュリー	69,900	6,770.00	473,223,000	
イオンフィナンシャルサー ビス	246,500	2,298.00	566,457,000	貸付有価証券 4,800株
オリエントコーポレーシ ョン	751,400	172.00	129,240,800	貸付有価証券 520,200株
日立キャピタル	95,500	3,110.00	297,005,000	
オリックス	2,317,000	1,836.50	4,255,170,500	
三菱UFJリース	881,400	673.00	593,182,200	
日本取引所グループ	996,800	1,996.00	1,989,612,800	貸付有価証券 3,800株
いちご	496,700	399.00	198,183,300	
ヒューリック	724,900	1,029.00	745,922,100	貸付有価証券 412,900株
野村不動産ホールディン グス	231,200	2,246.00	519,275,200	
プレサンスコーポレーシ ョン	48,100	1,416.00	68,109,600	
オープンハウス	56,600	5,540.00	313,564,000	
東急不動産ホールディン グス	840,700	675.00	567,472,500	
飯田グループホールディ ングス	289,700	2,008.00	581,717,600	貸付有価証券 200株
パーク24	202,700	3,445.00	698,301,500	貸付有価証券 29,200株 (400株)
三井不動産	1,734,200	2,629.50	4,560,078,900	
三菱地所	2,584,900	1,841.50	4,760,093,350	
東京建物	379,500	1,275.00	483,862,500	貸付有価証券 149,500株
住友不動産	832,800	3,935.00	3,277,068,000	
レオパレス21	414,400	622.00	257,756,800	
スターツコーポレーショ ン	47,200	2,395.00	113,044,000	
イオンモール	223,800	1,848.00	413,582,400	貸付有価証券 76,900株
エヌ・ティ・ティ都市開 発	215,900	1,301.00	280,885,900	貸付有価証券 2,300株
ミクシィ	85,500	2,687.00	229,738,500	貸付有価証券 14,100株 (14,000 株)
日本M&Aセンター	232,900	3,445.00	802,340,500	貸付有価証券 400株
パーソルホールディン グス	310,500	2,672.00	829,656,000	

総合警備保障	133,900	4,935.00	660,796,500	
カカクコム	253,300	2,135.00	540,795,500	貸付有価証券 33,100株
ディップ	47,400	2,684.00	127,221,600	貸付有価証券 33,000株
エムスリー	708,200	2,380.00	1,685,516,000	貸付有価証券 64,600株
ディー・エヌ・エー	181,400	1,985.00	360,079,000	
博報堂D Yホールディングス	467,500	2,020.00	944,350,000	
電通	409,900	5,580.00	2,287,242,000	貸付有価証券 80,100株
オリエンタルランド	397,600	11,365.00	4,518,724,000	
リゾートトラスト	142,400	1,826.00	260,022,400	貸付有価証券 100株
ユー・エス・エス	410,900	2,102.00	863,711,800	
サイバーエージェント	207,300	5,480.00	1,136,004,000	貸付有価証券 1,600株
楽天	1,568,300	852.00	1,336,191,600	貸付有価証券 739,800株
エン・ジャパン	38,000	5,500.00	209,000,000	
テクノプロ・ホールディングス	63,400	6,780.00	429,852,000	
リクルートホールディングス	2,595,700	3,694.00	9,588,515,800	
リログループ	183,900	3,075.00	565,492,500	貸付有価証券 600株
カナモト	47,300	4,055.00	191,801,500	
セコム	357,100	9,524.00	3,401,020,400	
メイテック	39,400	5,340.00	210,396,000	
イオンディライト	41,500	4,085.00	169,527,500	
小計	銘柄数：400		703,144,954,720	
	組入時価比率：97.4%		100.0%	
合計			703,144,954,720	

(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(2018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。