



2019年10月期 (2019年4月8日～2019年10月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2019 (April 8, 2019 – October 7, 2019)

2019年11月18日
 November 18, 2019

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: 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: 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12月26日
 分配金支払開始日 2019年11月15日
 Scheduled date of submission of securities report: December 26, 2019
 Date of commencing dividend payment: November 15, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年10月期の運用状況 (2019年4月8日～2019年10月7日)

Management Status for Year ended October 2019 (from April 8, 2019 to October 7, 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10月期 FY ended Oct. 2019	779,694	(97.8)	17,700	(2.2)	797,394	(100.0)
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	709,491	(97.6)	17,559	(2.4)	727,050	(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10月期 FY ended Oct. 2019	50,178	8,386	2,024	56,540
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	45,356	5,695	873	50,178

(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
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	887,708	90,313	797,394	14,103
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	802,749	75,698	727,050	14,489

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	150
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	166

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11期 (2019年4月7日現在) 11th Fiscal Year As of April 7, 2019	第12期 (2019年10月7日現在) 12th Fiscal Year As of October 7, 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	76,598,988,480	91,179,166,479
株式 Stocks	709,491,209,420	779,694,388,060
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	232,990,499	185,465,292
未収入金 Accounts receivable - other	8,376,070,150	8,397,796,140
未収配当金 Accrued dividends receivable	7,635,949,119	7,734,101,953
未収利息 Accrued interest	10,252,528	9,887,534
その他未収収益 Other accrued revenue	112,318,337	52,467,706
差入委託証拠金 Customers' margin	291,615,992	455,116,286
流動資産合計 Total current assets	802,749,394,525	887,708,389,450
資産合計 Total assets	802,749,394,525	887,708,389,450
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	-	103,650,086
未払金 Accounts payable - other	-	8,378,596,208
未払収益分配金 Unpaid dividends	8,329,557,296	8,481,072,600
未払受託者報酬 Trustee fee payable	177,209,426	194,667,653
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	535,067,762	587,869,220
未払利息 Accrued interest expenses	491,134	50,410
有価証券貸借取引受入金 Cash received on debt credit transaction	66,577,657,562	72,329,839,463

of securities		
その他未払費用 Other accrued expenses	78,463,585	238,163,388
流動負債合計 Total current liabilities	75,698,446,765	90,313,909,028
負債合計 Total liabilities	75,698,446,765	90,313,909,028
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	583,370,079,056	657,339,666,984
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	143,680,868,704	140,054,813,438
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	22,341,152	52,474,255
元本等合計 Total principal and other	727,050,947,760	797,394,480,422
純資産合計 Total net assets	727,050,947,760	797,394,480,422
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	802,749,394,525	887,708,389,450

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第11期 自 2018年10月8日 至 2019年4月7日 11th Fiscal Year From October 8, 2018 to April 7, 2019	第12期 自 2019年4月8日 至 2019年10月7日 12th Fiscal Year From April 8, 2019 to October 7, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	9,038,276,045	9,362,654,597
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△62,357,879,760	△19,271,848,497
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△1,307,788,325	△308,719,232
その他収益 Other revenue	174,634,847	115,604,755
営業収益合計 Total operating revenue	△54,452,757,193	△10,102,308,377
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△4,898,775	△8,205,755
受託者報酬 Trustee fee	177,209,426	194,667,653

委託者報酬 Investment trust management fee	535,067,762	587,869,220
その他費用 Other expenses	178,971,199	192,722,531
営業費用合計 Total operating expenses	886,349,612	967,053,649
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△55,339,106,805	△11,069,362,026
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△55,339,106,805	△11,069,362,026
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△55,339,106,805	△11,069,362,026
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	194,323,197,385	143,680,868,704
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	15,295,451,460	20,489,806,004
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	15,295,451,460	20,489,806,004
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	2,269,116,040	4,565,426,644
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	2,269,116,040	4,565,426,644
分配金 Dividends	8,329,557,296	8,481,072,600
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	143,680,868,704	140,054,813,438

(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、2019年4月8日から2019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11期 2019年4月7日現在	第12期 2019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 50,178,056 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 56,540,484 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 14,489 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 14,103 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 63,452,416,470 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 69,036,766,310 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 2018年10月8日 至 2019年4月7日	第12期 自 2019年4月8日 至 2019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;">9,217,809,667 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;">25,337,168 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;">9,243,146,835 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">891,248,387 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;">8,351,898,448 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">8,329,557,296 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;">22,341,152 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">50,178,056 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;">166 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	9,217,809,667 円	分配準備積立金	B	25,337,168 円	配当等収益合計額	C=A+B	9,243,146,835 円	経費	D	891,248,387 円	収益分配可能額	E=C-D	8,351,898,448 円	収益分配金	F	8,329,557,296 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	22,341,152 円	口数	H	50,178,056 口	1口当たり分配金	I=F/H	166 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;">9,486,465,107 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;">22,341,152 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;">9,508,806,259 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">975,259,404 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;">8,533,546,855 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">8,481,072,600 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;">52,474,255 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">56,540,484 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;">150 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	9,486,465,107 円	分配準備積立金	B	22,341,152 円	配当等収益合計額	C=A+B	9,508,806,259 円	経費	D	975,259,404 円	収益分配可能額	E=C-D	8,533,546,855 円	収益分配金	F	8,481,072,600 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	52,474,255 円	口数	H	56,540,484 口	1口当たり分配金	I=F/H	150 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	9,217,809,667 円																																																											
分配準備積立金	B	25,337,168 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	9,243,146,835 円																																																											
経費	D	891,248,387 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	8,351,898,448 円																																																											
収益分配金	F	8,329,557,296 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	22,341,152 円																																																											
口数	H	50,178,056 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	166 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	9,486,465,107 円																																																											
分配準備積立金	B	22,341,152 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	9,508,806,259 円																																																											
経費	D	975,259,404 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	8,533,546,855 円																																																											
収益分配金	F	8,481,072,600 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	52,474,255 円																																																											
口数	H	56,540,484 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	150 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち142,109,314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156,818,882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11期 自 2018年10月8日 至 2019年4月7日	第12期 自 2019年4月8日 至 2019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	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

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11期 2019年4月7日現在	第12期 2019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。 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。	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 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第11期 自2018年10月8日 至2019年4月7日	第12期 自2019年4月8日 至2019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11期 自2018年10月8日 至2019年4月7日	第12期 自2019年4月8日 至2019年10月7日
期首元本額 527,312,646,076円	期首元本額 583,370,079,056円
期中追加設定元本額 66,212,453,330円	期中追加設定元本額 97,505,273,954円
期中一部交換元本額 10,155,020,350円	期中一部交換元本額 23,535,686,026円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第11期 自2018年10月8日 至2019年4月7日	第12期 自2019年4月8日 至2019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	△57,826,214,732	△13,302,133,201
合計	△57,826,214,732	△13,302,133,201

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11期(2019年4月7日現在)	第12期(2019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	17,226,510,991	—	17,461,462,500	232,990,499	17,538,958,286	—	17,622,804,000	81,815,206
合計	17,226,510,991	—	17,461,462,500	232,990,499	17,538,958,286	—	17,622,804,000	81,815,206

(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	608,700	586.00	356,698,200	
		マルハニチロ	87,900	2,774.00	243,834,600	貸付有価証券 12,000株
		国際石油開発帝石	2,442,200	931.70	2,275,397,740	
		安藤・間	390,400	773.00	301,779,200	
		東急建設	178,300	810.00	144,423,000	
		コムシスホールディングス	215,900	2,992.00	645,972,800	貸付有価証券 1,800株
		大成建設	500,000	3,970.00	1,985,000,000	
		大林組	1,506,200	1,031.00	1,552,892,200	貸付有価証券 1,800株
		清水建設	1,536,300	974.00	1,496,356,200	貸付有価証券 13,700株
		長谷工コーポレーション	627,900	1,266.00	794,921,400	貸付有価証券 1,200株
		鹿島建設	1,177,200	1,372.00	1,615,118,400	貸付有価証券 1,600株
		西松建設	108,300	1,951.00	211,293,300	
		三井住友建設	362,200	551.00	199,572,200	貸付有価証券 2,300株
		前田建設工業	352,100	934.00	328,861,400	貸付有価証券 2,400株
		戸田建設	583,800	611.00	356,701,800	貸付有価証券 3,500株

熊谷組	71,700	2,990.00	214,383,000	
大東建託	178,900	13,770.00	2,463,453,000	貸付有価証券 1,900株
N I P P O	132,900	2,077.00	276,033,300	貸付有価証券 400株
五洋建設	597,100	579.00	345,720,900	貸付有価証券 3,900株
住友林業	356,000	1,430.00	509,080,000	貸付有価証券 4,900株
大和ハウス工業	1,390,800	3,529.00	4,908,133,200	
積水ハウス	1,538,000	2,149.00	3,305,162,000	貸付有価証券 1,001,800株 (175,700株)
協和エクシオ	196,800	2,545.00	500,856,000	
九電工	98,600	3,405.00	335,733,000	
森永製菓	113,100	5,160.00	583,596,000	貸付有価証券 600株
江崎グリコ	133,400	4,480.00	597,632,000	貸付有価証券 4,300株
カルビー	205,000	3,355.00	687,775,000	貸付有価証券 6,200株
ヤクルト本社	333,300	5,830.00	1,943,139,000	
明治ホールディングス	318,700	7,680.00	2,447,616,000	貸付有価証券 6,000株
日本ハム	186,300	4,495.00	837,418,500	貸付有価証券 9,600株
アサヒグループホールディングス	942,200	5,349.00	5,039,827,800	貸付有価証券 233,500株
キリンホールディングス	1,908,100	2,282.50	4,355,238,250	貸付有価証券 864,200株 (116,600株)
サントリー食品インターナショナル	301,000	4,605.00	1,386,105,000	貸付有価証券 28,800株
キッコーマン	296,800	5,070.00	1,504,776,000	貸付有価証券 500株
味の素	993,600	2,011.50	1,998,626,400	貸付有価証券 17,600株
キューピー	250,500	2,379.00	595,939,500	貸付有価証券 86,200株
アリアケジャパン	41,100	8,330.00	342,363,000	
ニチレイ	233,700	2,438.00	569,760,600	貸付有価証券 1,200株
東洋水産	231,500	4,275.00	989,662,500	
日清食品ホールディングス	191,200	7,960.00	1,521,952,000	
日本たばこ産業	2,597,900	2,346.00	6,094,673,400	貸付有価証券 1,313,400株

帝人	358,100	2,024.00	724,794,400	
東レ	3,405,900	788.50	2,685,552,150	
ゴールドウイン	79,600	8,470.00	674,212,000	貸付有価証券 53,300株 (53,300 株)
王子ホールディングス	1,976,400	508.00	1,004,011,200	貸付有価証券 3,700株
クラレ	691,400	1,294.00	894,671,600	貸付有価証券 282,000株 (133,500 株)
旭化成	3,123,300	1,073.00	3,351,300,900	貸付有価証券 2,600株
昭和電工	312,500	2,747.00	858,437,500	貸付有価証券 193,400株
住友化学	3,455,900	483.00	1,669,199,700	貸付有価証券 11,000株
日産化学	266,000	4,255.00	1,131,830,000	貸付有価証券 700株
東ソー	678,600	1,408.00	955,468,800	
トクヤマ	126,500	2,495.00	315,617,500	
デンカ	172,500	2,888.00	498,180,000	貸付有価証券 200株
信越化学工業	773,600	11,215.00	8,675,924,000	
エア・ウォーター	359,500	1,918.00	689,521,000	
大陽日酸	361,600	2,081.00	752,489,600	
三菱瓦斯化学	446,300	1,402.00	625,712,600	
三井化学	398,500	2,392.00	953,212,000	貸付有価証券 1,400株
J S R	440,600	1,731.00	762,678,600	
三菱ケミカルホールディングス	2,934,900	760.80	2,232,871,920	貸付有価証券 2,700株
ダイセル	646,800	907.00	586,647,600	
積水化学工業	944,000	1,676.00	1,582,144,000	
アイカ工業	131,700	3,175.00	418,147,500	
宇部興産	221,700	2,130.00	472,221,000	
日立化成	203,000	3,545.00	719,635,000	貸付有価証券 82,400株
ダイキョーニシカワ	92,600	781.00	72,320,600	貸付有価証券 200株
日油	165,300	3,545.00	585,988,500	
花王	1,073,300	7,880.00	8,457,604,000	貸付有価証券 649,800株 (118,400 株)
日本ペイントホールディングス	362,300	5,890.00	2,133,947,000	貸付有価証券 73,800株

関西ペイント	493,200	2,500.00	1,233,000,000	貸付有価証券 10,400株
D I C	185,400	2,958.00	548,413,200	貸付有価証券 94,400株 (54,500 株)
資生堂	890,700	8,552.00	7,617,266,400	貸付有価証券 349,100株 (96,000 株)
ライオン	582,800	2,095.00	1,220,966,000	貸付有価証券 385,500株 (6,500 株)
コーセー	75,900	18,110.00	1,374,549,000	
ポーラ・オルビスホール ディングス	191,300	2,383.00	455,867,900	
小林製薬	125,600	8,410.00	1,056,296,000	貸付有価証券 600株
日東電工	309,300	5,188.00	1,604,648,400	
ニフコ	179,500	2,510.00	450,545,000	
ユニ・チャーム	864,000	3,341.00	2,886,624,000	貸付有価証券 390,900株
協和キリン	450,900	1,987.00	895,938,300	貸付有価証券 121,900株
武田薬品工業	3,005,700	3,621.00	10,883,639,700	貸付有価証券 102,000株
アステラス製薬	3,943,100	1,505.50	5,936,337,050	
大日本住友製薬	332,300	1,699.00	564,577,700	
塩野義製薬	573,100	6,036.00	3,459,231,600	貸付有価証券 7,400株
田辺三菱製薬	468,800	1,166.00	546,620,800	
日本新薬	117,300	9,140.00	1,072,122,000	
中外製薬	467,400	8,170.00	3,818,658,000	貸付有価証券 283,500株 (58,300 株)
科研製薬	76,700	4,925.00	377,747,500	
エーザイ	536,600	5,405.00	2,900,323,000	
小野薬品工業	1,058,700	1,873.50	1,983,474,450	
久光製薬	132,400	4,550.00	602,420,000	貸付有価証券 14,700株
参天製薬	834,700	1,845.00	1,540,021,500	
沢井製薬	92,000	5,340.00	491,280,000	貸付有価証券 400株
第一三共	1,282,800	6,626.00	8,499,832,800	
大塚ホールディングス	854,000	4,084.00	3,487,736,000	貸付有価証券 311,000株 (133,900 株)

ペプチドリーム	226,700	5,030.00	1,140,301,000	貸付有価証券 151,400株 (63,100 株)
出光興産	517,400	3,030.00	1,567,722,000	貸付有価証券 10,400株
JXTGホールディング ス	7,415,700	482.20	3,575,850,540	
コスモエネルギーホール ディングス	129,800	2,211.00	286,987,800	貸付有価証券 82,200株
横浜ゴム	259,600	2,121.00	550,611,600	貸付有価証券 121,200株 (62,200 株)
ブリヂストン	1,377,800	4,131.00	5,691,691,800	貸付有価証券 503,100株 (5,000 株)
住友ゴム工業	402,700	1,264.00	509,012,800	貸付有価証券 7,400株
A G C	443,100	3,320.00	1,471,092,000	貸付有価証券 263,500株 (89,600 株)
太平洋セメント	283,100	2,802.00	793,246,200	
東海カーボン	469,600	1,061.00	498,245,600	貸付有価証券 314,600株 (167,200 株)
T O T O	344,800	3,960.00	1,365,408,000	貸付有価証券 30,500株
日本碍子	547,000	1,518.00	830,346,000	
日本特殊陶業	378,000	1,987.00	751,086,000	貸付有価証券 3,000株
ニチアス	122,700	1,824.00	223,804,800	貸付有価証券 700株
日本製鉄	2,059,800	1,481.00	3,050,563,800	
ジェイ エフ イー ホ ールディングス	1,197,200	1,286.00	1,539,599,200	貸付有価証券 1,800株
日立金属	477,500	1,174.00	560,585,000	貸付有価証券 6,100株
日本軽金属ホールディン グス	1,207,900	197.00	237,956,300	貸付有価証券 92,500株
住友金属鉱山	607,100	3,320.00	2,015,572,000	
D O W Aホールディング ス	103,500	3,645.00	377,257,500	
古河電気工業	127,900	2,650.00	338,935,000	貸付有価証券 1,000株
住友電気工業	1,657,400	1,341.50	2,223,402,100	
S U M C O	530,600	1,439.00	763,533,400	貸付有価証券 295,200株
三和ホールディングス	457,900	1,205.00	551,769,500	貸付有価証券 1,200株

リンナイ	79,000	7,290.00	575,910,000	
東プレ	82,700	1,671.00	138,191,700	
アマダホールディングス	666,000	1,120.00	745,920,000	
オーエスジー	204,700	2,190.00	448,293,000	貸付有価証券 55,300株 (21,400 株)
DMG 森精機	280,500	1,493.00	418,786,500	貸付有価証券 183,200株
ディスコ	60,000	20,750.00	1,245,000,000	
ナブテスコ	261,200	3,240.00	846,288,000	貸付有価証券 113,800株 (3,300 株)
三井海洋開発	47,100	2,517.00	118,550,700	貸付有価証券 1,700株
SMC	131,300	46,070.00	6,048,991,000	
小松製作所	2,029,500	2,375.00	4,820,062,500	貸付有価証券 1,200株
住友重機械工業	256,600	3,100.00	795,460,000	
日立建機	179,600	2,438.00	437,864,800	貸付有価証券 4,900株
ハーモニック・ドライ ブ・システムズ	80,400	4,620.00	371,448,000	貸付有価証券 53,000株 (22,400 株)
クボタ	2,401,500	1,557.00	3,739,135,500	貸付有価証券 1,140,900株 (224,400株)
ダイキン工業	611,900	14,080.00	8,615,552,000	
ダイフク	246,700	5,600.00	1,381,520,000	貸付有価証券 13,200株
竹内製作所	75,000	1,649.00	123,675,000	貸付有価証券 6,700株
T P R	60,300	1,664.00	100,339,200	貸付有価証券 100株
日本精工	920,700	910.00	837,837,000	貸付有価証券 800株
ジェイテクト	430,000	1,214.00	522,020,000	貸付有価証券 300株
THK	260,800	2,747.00	716,417,600	貸付有価証券 14,900株
マキタ	545,600	3,045.00	1,661,352,000	
三菱重工業	751,200	4,211.00	3,163,303,200	
I H I	344,400	2,286.00	787,298,400	貸付有価証券 4,300株
コニカミノルタ	979,400	739.00	723,776,600	
ブラザー工業	583,900	1,897.00	1,107,658,300	
ミネベアミツミ	832,100	1,793.00	1,491,955,300	貸付有価証券

				61,600株
日立製作所	2,017,900	4,006.00	8,083,707,400	
三菱電機	4,482,500	1,426.50	6,394,286,250	
富士電機	290,900	3,255.00	946,879,500	
安川電機	519,600	3,920.00	2,036,832,000	貸付有価証券 91,800株(9,100株)
東芝テック	56,100	3,465.00	194,386,500	
日本電産	539,400	14,210.00	7,664,874,000	貸付有価証券 11,900株
日新電機	105,100	1,306.00	137,260,600	貸付有価証券 11,700株
オムロン	476,400	5,810.00	2,767,884,000	
日本電気	580,000	4,625.00	2,682,500,000	
富士通	432,100	8,626.00	3,727,294,600	貸付有価証券 2,100株
ルネサスエレクトロニクス	2,135,200	689.00	1,471,152,800	貸付有価証券 32,100株
セイコーエプソン	556,200	1,420.00	789,804,000	貸付有価証券 9,700株
アルバック	89,300	4,460.00	398,278,000	貸付有価証券 11,400株
エレコム	42,500	4,225.00	179,562,500	
パナソニック	5,120,800	875.70	4,484,284,560	貸付有価証券 2,200株
富士通ゼネラル	136,900	1,736.00	237,658,400	貸付有価証券 17,100株(13,900株)
ソニー	2,035,300	6,207.00	12,633,107,100	貸付有価証券 13,200株
TDK	234,500	9,920.00	2,326,240,000	貸付有価証券 800株
アルプスアルパイン	466,600	2,043.00	953,263,800	
ヒロセ電機	64,100	13,300.00	852,530,000	貸付有価証券 300株
横河電機	448,600	1,827.00	819,592,200	
アズビル	282,900	2,848.00	805,699,200	
日本光電工業	197,600	3,085.00	609,596,000	
堀場製作所	88,800	6,380.00	566,544,000	貸付有価証券 9,200株
アドバンテスト	305,500	4,845.00	1,480,147,500	
キーエンス	173,800	64,590.00	11,225,742,000	貸付有価証券 67,400株
シスメックス	349,400	6,986.00	2,440,908,400	
OBARA GROUP	23,200	3,560.00	82,592,000	貸付有価証券

				100株
レーザーテック	91,900	7,250.00	666,275,000	貸付有価証券 60,000株
スタンレー電気	316,300	2,780.00	879,314,000	
カシオ計算機	396,500	1,653.00	655,414,500	貸付有価証券 106,800株 (4,100 株)
ファナック	425,900	19,250.00	8,198,575,000	貸付有価証券 4,600株
浜松ホトニクス	321,500	3,915.00	1,258,672,500	
京セラ	683,200	6,598.00	4,507,753,600	
太陽誘電	199,400	2,671.00	532,597,400	貸付有価証券 133,500株
村田製作所	1,410,800	5,528.00	7,798,902,400	
小糸製作所	268,500	5,260.00	1,412,310,000	貸付有価証券 600株
S C R E E Nホールディ ングス	77,800	6,480.00	504,144,000	貸付有価証券 3,800株
キヤノン	2,413,100	2,825.50	6,818,214,050	貸付有価証券 1,121,600株 (148,600株)
東京エレクトロン	298,900	20,845.00	6,230,570,500	貸付有価証券 500株
トヨタ紡織	156,700	1,469.00	230,192,300	
豊田自動織機	362,800	6,150.00	2,231,220,000	貸付有価証券 1,200株
デンソー	986,900	4,578.00	4,518,028,200	
川崎重工業	348,800	2,360.00	823,168,000	貸付有価証券 8,600株
いすゞ自動車	1,416,900	1,161.00	1,645,020,900	貸付有価証券 1,400株
トヨタ自動車	1,718,100	6,986.00	12,002,646,600	貸付有価証券 24,700株
日野自動車	559,800	875.00	489,825,000	
アイシン精機	369,100	3,385.00	1,249,403,500	
マツダ	1,406,900	945.70	1,330,505,330	
本田技研工業	3,781,500	2,730.00	10,323,495,000	貸付有価証券 1,000株
スズキ	820,100	4,395.00	3,604,339,500	
S U B A R U	1,391,600	2,895.50	4,029,377,800	
ヤマハ発動機	584,500	1,938.00	1,132,761,000	貸付有価証券 255,000株 (64,200 株)
豊田合成	144,800	2,082.00	301,473,600	
シマノ	167,800	15,700.00	2,634,460,000	貸付有価証券

				95,000株
テイ・エス テック	104,100	3,200.00	333,120,000	
テルモ	1,268,500	3,315.00	4,205,077,500	
島津製作所	576,900	2,625.00	1,514,362,500	貸付有価証券 3,800株
ブイ・テクノロジー	21,000	5,530.00	116,130,000	貸付有価証券 1,400株
東京精密	81,200	3,160.00	256,592,000	貸付有価証券 1,700株
ニコン	781,100	1,315.00	1,027,146,500	貸付有価証券 3,700株
オリンパス	2,671,100	1,445.00	3,859,739,500	貸付有価証券 18,000株
HOYA	902,500	8,524.00	7,692,910,000	
朝日インテック	507,200	2,807.00	1,423,710,400	貸付有価証券 27,200株
バンダイナムコホールディングス	463,400	6,580.00	3,049,172,000	
パイロットコーポレーション	78,200	3,900.00	304,980,000	貸付有価証券 1,400株
タカラトミー	187,600	1,196.00	224,369,600	
ヤマハ	266,600	4,755.00	1,267,683,000	貸付有価証券 500株
ピジョン	270,900	4,300.00	1,164,870,000	貸付有価証券 168,500株 (50,500株)
任天堂	256,500	40,410.00	10,365,165,000	
中部電力	1,371,400	1,626.00	2,229,896,400	貸付有価証券 26,700株
関西電力	1,829,000	1,217.00	2,225,893,000	貸付有価証券 200株
東北電力	1,049,800	1,101.00	1,155,829,800	
九州電力	923,900	1,065.00	983,953,500	
電源開発	356,700	2,543.00	907,088,100	
東京瓦斯	862,000	2,769.50	2,387,309,000	
大阪瓦斯	869,900	2,074.00	1,804,172,600	貸付有価証券 100株
東武鉄道	472,800	3,560.00	1,683,168,000	貸付有価証券 400株
相鉄ホールディングス	204,900	2,905.00	595,234,500	貸付有価証券 2,400株
東急	1,217,500	2,030.00	2,471,525,000	貸付有価証券 29,100株
小田急電鉄	718,000	2,595.00	1,863,210,000	貸付有価証券 400株

京王電鉄	250,500	6,710.00	1,680,855,000	貸付有価証券 12,600株
京成電鉄	335,900	4,385.00	1,472,921,500	貸付有価証券 900株
東日本旅客鉄道	789,000	10,420.00	8,221,380,000	
西日本旅客鉄道	399,400	9,185.00	3,668,489,000	
東海旅客鉄道	401,400	22,570.00	9,059,598,000	
西武ホールディングス	555,200	1,930.00	1,071,536,000	
近鉄グループホールディングス	424,600	5,790.00	2,458,434,000	貸付有価証券 800株
阪急阪神ホールディングス	566,200	4,230.00	2,395,026,000	貸付有価証券 200株
京阪ホールディングス	252,000	4,870.00	1,227,240,000	貸付有価証券 200株
名古屋鉄道	465,400	3,335.00	1,552,109,000	貸付有価証券 2,500株
日本通運	163,700	5,380.00	880,706,000	
ヤマトホールディングス	744,200	1,642.50	1,222,348,500	貸付有価証券 100株
山九	118,000	5,660.00	667,880,000	貸付有価証券 200株
日立物流	93,300	3,220.00	300,426,000	
日本航空	777,200	3,271.00	2,542,221,200	
ANAホールディングス	776,000	3,665.00	2,844,040,000	貸付有価証券 211,100株
日鉄ソリューションズ	65,900	3,595.00	236,910,500	貸付有価証券 600株
T I S	146,600	6,250.00	916,250,000	
ネクソン	1,248,800	1,311.00	1,637,176,800	
コロプラ	143,900	1,623.00	233,549,700	貸付有価証券 96,400株 (5,700株)
ティーガイア	31,200	2,160.00	67,392,000	貸付有価証券 100株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	106,000	2,353.00	249,418,000	貸付有価証券 64,000株
GMOペイメントゲートウェイ	72,400	7,970.00	577,028,000	貸付有価証券 48,500株
アカツキ	15,500	6,950.00	107,725,000	貸付有価証券 3,900株
野村総合研究所	839,300	2,197.00	1,843,942,100	貸付有価証券 1,900株
オービック	152,500	12,190.00	1,858,975,000	
Zホールディングス	2,868,000	319.00	914,892,000	貸付有価証券 1,907,600株
トレンドマイクロ	195,500	5,200.00	1,016,600,000	貸付有価証券

				64,900株
日本オラクル	89,200	9,170.00	817,964,000	貸付有価証券 28,300株
伊藤忠テクノソリューションズ	200,400	2,938.00	588,775,200	
大塚商会	238,000	4,045.00	962,710,000	貸付有価証券 24,300株
デジタルガレージ	85,700	3,435.00	294,379,500	
日本ユニシス	137,400	3,575.00	491,205,000	
日本テレビホールディングス	403,900	1,380.00	557,382,000	貸付有価証券 3,300株
日本電信電話	2,290,500	5,284.00	12,103,002,000	
KDDI	3,605,800	2,939.00	10,597,446,200	
光通信	51,800	23,610.00	1,222,998,000	
NTTドコモ	2,785,000	2,819.00	7,850,915,000	貸付有価証券 8,600株
東宝	289,300	4,740.00	1,371,282,000	貸付有価証券 100,500株
エヌ・ティ・ティ・データ	1,171,100	1,395.00	1,633,684,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	204,600	5,100.00	1,043,460,000	貸付有価証券 2,100株
カプコン	188,500	2,818.00	531,193,000	
SCSK	116,000	5,080.00	589,280,000	
コナミホールディングス	179,700	5,010.00	900,297,000	貸付有価証券 200株
ソフトバンクグループ	2,112,100	4,157.00	8,779,999,700	
双日	2,438,400	325.00	792,480,000	
アルフレッサホールディングス	490,600	2,356.00	1,155,853,600	貸付有価証券 1,400株
神戸物産	76,200	5,800.00	441,960,000	貸付有価証券 51,000株 (1,900株)
ダイワボウホールディングス	40,200	4,415.00	177,483,000	
TOKAIホールディングス	233,300	1,034.00	241,232,200	
シップヘルスケアホールディングス	92,000	4,450.00	409,400,000	貸付有価証券 100株
コメダホールディングス	102,500	2,048.00	209,920,000	
第一興商	87,600	4,930.00	431,868,000	
メディパルホールディングス	476,400	2,358.00	1,123,351,200	貸付有価証券 600株
日本ライフライン	130,800	1,670.00	218,436,000	貸付有価証券 25,900株

伊藤忠商事	3,088,000	2,209.00	6,821,392,000	貸付有価証券 16,600株
丸紅	4,353,700	694.60	3,024,080,020	
豊田通商	492,700	3,365.00	1,657,935,500	
兼松	176,400	1,208.00	213,091,200	貸付有価証券 500株
三井物産	3,637,500	1,730.00	6,292,875,000	
日立ハイテクノロジーズ	134,200	6,390.00	857,538,000	
住友商事	2,611,200	1,665.50	4,348,953,600	
三菱商事	3,098,100	2,638.50	8,174,336,850	
岩谷産業	98,000	3,610.00	353,780,000	貸付有価証券 13,300株 (11,600株)
PALTA C	79,600	5,280.00	420,288,000	貸付有価証券 200株
日鉄物産	31,500	4,265.00	134,347,500	
ミスミグループ本社	552,900	2,395.00	1,324,195,500	貸付有価証券 8,000株
ローソン	111,700	5,680.00	634,456,000	貸付有価証券 46,400株 (9,400株)
エービーシー・マート	68,900	6,720.00	463,008,000	貸付有価証券 5,000株
日本マクドナルドホールディングス	185,000	5,450.00	1,008,250,000	貸付有価証券 123,900株
セリア	116,100	2,784.00	323,222,400	貸付有価証券 500株
ビックカメラ	261,800	1,122.00	293,739,600	貸付有価証券 12,500株
Monotaro	313,800	2,869.00	900,292,200	貸付有価証券 129,900株 (35,300株)
J.フロント リテイリング	564,800	1,240.00	700,352,000	貸付有価証券 217,100株 (47,200株)
マツモトキヨシホールディングス	182,500	3,945.00	719,962,500	貸付有価証券 44,500株
ZOZO	477,100	2,501.00	1,193,227,100	貸付有価証券 319,600株 (45,200株)
ウエルシアホールディングス	116,700	5,500.00	641,850,000	貸付有価証券 58,800株
クリエイティブSDホールディングス	65,100	2,514.00	163,661,400	貸付有価証券 300株
すかいらーくホールディングス	494,800	1,959.00	969,313,200	貸付有価証券 331,500株
コスモス薬品	19,500	21,690.00	422,955,000	貸付有価証券 10,500株

セブン&アイ・ホールディングス	1,850,500	4,119.00	7,622,209,500	貸付有価証券 917,200株 (282,800株)
ツルハホールディングス	95,900	11,830.00	1,134,497,000	貸付有価証券 11,000株
クスリのアオキホールディングス	43,900	7,790.00	341,981,000	貸付有価証券 17,300株
ノジマ	78,500	1,801.00	141,378,500	貸付有価証券 1,200株
良品計画	625,200	2,033.00	1,271,031,600	貸付有価証券 227,500株
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,057,700	1,740.00	1,840,398,000	貸付有価証券 671,200株
ゼンショーホールディングス	214,600	2,509.00	538,431,400	貸付有価証券 6,600株
ワークマン	45,600	8,020.00	365,712,000	貸付有価証券 30,500株 (16,000株)
ユナイテッドアローズ	50,500	3,275.00	165,387,500	貸付有価証券 1,400株
スギホールディングス	97,000	5,920.00	574,240,000	
ファミリーマート	493,800	2,572.00	1,270,053,600	貸付有価証券 207,600株 (46,300株)
しまむら	51,400	9,210.00	473,394,000	貸付有価証券 12,200株 (600株)
丸井グループ	373,500	2,283.00	852,700,500	貸付有価証券 41,200株
イオン	1,698,900	2,007.50	3,410,541,750	貸付有価証券 398,500株 (352,500株)
イズミ	89,800	4,165.00	374,017,000	貸付有価証券 19,200株
ヤオコー	50,100	4,895.00	245,239,500	貸付有価証券 8,300株
ケーズホールディングス	458,800	1,158.00	531,290,400	
アインホールディングス	59,200	5,940.00	351,648,000	貸付有価証券 3,200株
ニトリホールディングス	191,100	15,925.00	3,043,267,500	貸付有価証券 42,900株
ファーストリテイリング	59,100	60,450.00	3,572,595,000	貸付有価証券 21,000株 (5,100株)
サンドラッグ	166,100	3,425.00	568,892,500	
めぶきフィナンシャルグループ	2,297,300	261.00	599,595,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,773,700	409.00	1,134,443,300	
新生銀行	324,500	1,522.00	493,889,000	

あおぞら銀行	246,900	2,578.00	636,508,200	貸付有価証券 700株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	22,443,400	532.80	11,957,843,520	
りそなホールディングス	4,851,800	444.60	2,157,110,280	
三井住友トラスト・ホールディングス	869,200	3,739.00	3,249,938,800	
三井住友フィナンシャルグループ	3,019,000	3,617.00	10,919,723,000	
千葉銀行	1,520,700	544.00	827,260,800	貸付有価証券 69,400株
セブン銀行	1,476,900	296.00	437,162,400	
みずほフィナンシャルグループ	60,076,800	161.90	9,726,433,920	貸付有価証券 16,100株
FPG	138,800	1,047.00	145,323,600	貸付有価証券 24,900株
SBIホールディングス	526,800	2,158.00	1,136,834,400	貸付有価証券 28,200株
大和証券グループ本社	3,547,600	482.60	1,712,071,760	貸付有価証券 25,200株
野村ホールディングス	7,779,300	463.90	3,608,817,270	
松井証券	216,500	873.00	189,004,500	貸付有価証券 38,000株
SOMPOホールディングス	779,400	4,478.00	3,490,153,200	貸付有価証券 3,300株
MS&ADインシュアランスグループホール	1,156,000	3,401.00	3,931,556,000	貸付有価証券 19,800株
ソニーフィナンシャルホールディングス	363,300	2,232.00	810,885,600	貸付有価証券 61,500株
第一生命ホールディングス	2,501,500	1,624.00	4,062,436,000	
東京海上ホールディングス	1,581,000	5,727.00	9,054,387,000	貸付有価証券 300株
T&Dホールディングス	1,367,400	1,145.00	1,565,673,000	
全国保証	124,600	4,045.00	504,007,000	貸付有価証券 11,900株
芙蓉総合リース	50,600	6,590.00	333,454,000	
東京センチュリー	89,000	4,955.00	440,995,000	貸付有価証券 100株
イオンフィナンシャルサービス	282,500	1,566.00	442,395,000	貸付有価証券 4,000株
オリエン特コーポレーション	1,195,800	141.00	168,607,800	貸付有価証券 462,500株
オリックス	2,949,600	1,609.00	4,745,906,400	
三菱UFJリース	997,400	621.00	619,385,400	
日本取引所グループ	1,194,300	1,710.00	2,042,253,000	貸付有価証券 100株

いちご	562,400	433.00	243,519,200	貸付有価証券 6,100株
ヒューリック	922,800	1,130.00	1,042,764,000	貸付有価証券 499,600株 (5,100 株)
野村不動産ホールディングス	294,800	2,393.00	705,456,400	貸付有価証券 2,000株
プレサンスコーポレーション	70,200	1,762.00	123,692,400	貸付有価証券 12,900株
オープンハウス	128,300	2,692.00	345,383,600	貸付有価証券 84,300株
東急不動産ホールディングス	1,189,100	701.00	833,559,100	
飯田グループホールディングス	368,800	1,730.00	638,024,000	貸付有価証券 2,400株
パーク24	237,200	2,516.00	596,795,200	貸付有価証券 123,100株
三井不動産	2,345,600	2,667.50	6,256,888,000	
三菱地所	3,097,400	2,066.00	6,399,228,400	
東京建物	483,100	1,502.00	725,616,200	貸付有価証券 136,800株 (64,700 株)
住友不動産	993,900	4,005.00	3,980,569,500	貸付有価証券 300株
スターツコーポレーション	60,100	2,690.00	161,669,000	貸付有価証券 100株
イオンモール	221,600	1,675.00	371,180,000	
日本空港ビルデング	141,100	4,845.00	683,629,500	貸付有価証券 12,300株
ミクシィ	119,800	2,046.00	245,110,800	
ジェイエイシーリクルートメント	28,700	2,034.00	58,375,800	貸付有価証券 100株
日本M&Aセンター	323,500	3,075.00	994,762,500	貸付有価証券 300株
UTグループ	67,400	2,301.00	155,087,400	貸付有価証券 44,700株 (44,700 株)
エス・エム・エス	157,500	2,646.00	416,745,000	貸付有価証券 1,100株
パーソルホールディングス	428,300	2,030.00	869,449,000	
総合警備保障	170,400	5,680.00	967,872,000	
カカコム	320,700	2,636.00	845,365,200	貸付有価証券 100株
ディップ	69,000	2,603.00	179,607,000	貸付有価証券 40,800株 (5,000株)
ベネフィット・ワン	156,500	2,086.00	326,459,000	貸付有価証券 19,400株

エムスリー	901,800	2,658.00	2,396,984,400	貸付有価証券 286,100株(68,400株)
アウトソーシング	244,900	1,040.00	254,696,000	貸付有価証券 7,300株
ディー・エヌ・エー	230,900	1,975.00	456,027,500	貸付有価証券 3,600株
博報堂DYホールディングス	595,400	1,528.00	909,771,200	貸付有価証券 2,100株
電通	441,500	3,775.00	1,666,662,500	貸付有価証券 195,400株(59,300株)
オリエンタルランド	506,200	16,555.00	8,380,141,000	貸付有価証券 1,900株
リゾートトラスト	181,200	1,740.00	315,288,000	
ユー・エス・エス	523,100	2,019.00	1,056,138,900	
サイバーエージェント	246,300	4,150.00	1,022,145,000	貸付有価証券 8,900株
楽天	1,996,500	1,036.00	2,068,374,000	貸付有価証券 1,085,300株
エン・ジャパン	62,300	4,025.00	250,757,500	貸付有価証券 9,900株(1,900株)
テクノプロ・ホールディングス	85,900	6,480.00	556,632,000	貸付有価証券 700株
リクルートホールディングス	3,068,400	3,417.00	10,484,722,800	貸付有価証券 7,100株
リログループ	234,200	2,602.00	609,388,400	貸付有価証券 7,000株
カナモト	70,100	2,669.00	187,096,900	貸付有価証券 12,300株
セコム	454,600	9,717.00	4,417,348,200	
メイテック	53,000	5,200.00	275,600,000	
小計	銘柄数：400 組入時価比率：97.8%		779,694,388,060 100.0%	
合計			779,694,388,060	

(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。