



2020年10月期 (2020年4月8日～2020年10月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2020 (April 8, 2020 – October 7, 2020)

2020年11月18日
 November 18, 2020

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 サポートダイヤル 山中 淳 TEL 0120-753104

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: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2020年12月16日
 分配金支払開始日 2020年11月13日
 Scheduled date of submission of securities report: December 16, 2020
 Date of commencing dividend payment: November 13, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年10月期の運用状況 (2020年4月8日～2020年10月7日)

Management Status for Year ended October 2020 (from April 8, 2020 to October 7, 2020)

(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.	%
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	930,087	(98.0)	18,660	(2.0)	948,747	(100.0)
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	715,983	(96.6)	24,964	(3.4)	740,948	(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
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	58,621	6,094	872	63,843
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	56,540	5,195	3,113	58,621

(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
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	1,008,620	59,872	948,747	14,861
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	813,408	72,460	740,948	12,639

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	125
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	168

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13期 (2020年4月7日現在) 13th Fiscal Year As of April 7, 2020	第14期 (2020年10月7日現在) 14th Fiscal Year As of October 7, 2020
	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	75,869,274,144	69,246,177,380
株式 Stocks	715,983,637,960	930,087,181,580
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	1,167,296,142	383,866,450
未収入金 Accounts receivable - other	9,989,996,620	269,211,600
未収配当金 Accrued dividends receivable	9,178,670,157	7,929,272,671
未収利息 Accrued interest	8,540,431	6,057,680
その他未収収益 Other accrued revenue	74,210,990	82,183,745
差入委託証拠金 Customers' margin	1,137,336,918	616,470,500
流動資産合計 Total current assets	813,408,963,362	1,008,620,421,606
資産合計 Total assets	813,408,963,362	1,008,620,421,606
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	1,457,000	24,709,500
未払収益分配金 Unpaid dividends	9,848,495,496	7,980,413,750
未払受託者報酬 Trustee fee payable	213,861,028	221,319,076
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	646,179,689	667,298,523
未払利息 Accrued interest expenses	68,386	28,855
有価証券貸借取引受入金 Cash received on debt credit transaction of securities	61,659,746,016	50,704,650,401
その他未払費用	91,084,492	274,253,881

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	72,460,892,107	59,872,673,986
負債合計 Total liabilities	72,460,892,107	59,872,673,986
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	681,539,337,122	742,242,322,060
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	59,408,734,133	206,505,425,560
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	65,456,419	52,907,267
元本等合計 Total principal and other	740,948,071,255	948,747,747,620
純資産合計 Total net assets	740,948,071,255	948,747,747,620
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	813,408,963,362	1,008,620,421,606

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第13期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日 13th Fiscal Year From October 8, 2019 to April 7, 2020	第14期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日 14th Fiscal Year From April 8, 2020 to October 7, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	10,770,371,640	8,873,804,882
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△84,167,373,237	131,160,106,078
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△1,198,965,468	4,042,308,151
その他収益 Other revenue	176,553,991	199,688,249
営業収益合計 Total operating revenue	△74,419,413,074	144,275,907,360
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△11,687,114	△10,608,776
受託者報酬 Trustee fee	213,861,028	221,319,076
委託者報酬 Investment trust management fee	646,179,689	667,298,523

その他費用 Other expenses	237,094,368	227,619,710
営業費用合計 Total operating expenses	1,085,447,971	1,105,628,533
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△75,504,861,045	143,170,278,827
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△75,504,861,045	143,170,278,827
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△75,504,861,045	143,170,278,827
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	140,054,813,438	59,408,734,133
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	15,144,402,670	14,080,544,858
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	15,144,402,670	14,080,544,858
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	10,437,125,434	2,173,718,508
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	10,437,125,434	2,173,718,508
分配金 Dividends	9,848,495,496	7,980,413,750
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	59,408,734,133	206,505,425,560

(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。 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

4. その他	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、2020年4月8日から2020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13期 2020年4月7日現在	第14期 2020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 58,621,997口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 63,843,310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 12,639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 14,861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 61,322,373,310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 48,714,357,960円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自2019年10月8日 至2020年4月7日	第14期 自2020年4月8日 至2020年10月7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>10,958,612,745円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>52,474,255円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>11,011,087,000円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,097,135,085円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>9,913,951,915円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>9,848,495,496円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>65,456,419円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>58,621,997口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>168円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	10,958,612,745円	分配準備積立金	B	52,474,255円	配当等収益合計額	C=A+B	11,011,087,000円	経費	D	1,097,135,085円	収益分配可能額	E=C-D	9,913,951,915円	収益分配金	F	9,848,495,496円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	65,456,419円	口数	H	58,621,997口	1口当たり分配金	I=F/H	168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>9,084,101,907円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>65,456,419円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>9,149,558,326円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,116,237,309円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>8,033,321,017円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>7,980,413,750円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>52,907,267円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>63,843,310口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>125円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	9,084,101,907円	分配準備積立金	B	65,456,419円	配当等収益合計額	C=A+B	9,149,558,326円	経費	D	1,116,237,309円	収益分配可能額	E=C-D	8,033,321,017円	収益分配金	F	7,980,413,750円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	52,907,267円	口数	H	63,843,310口	1口当たり分配金	I=F/H	125円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	10,958,612,745円																																																											
分配準備積立金	B	52,474,255円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	11,011,087,000円																																																											
経費	D	1,097,135,085円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	9,913,951,915円																																																											
収益分配金	F	9,848,495,496円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	65,456,419円																																																											
口数	H	58,621,997口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	168円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	9,084,101,907円																																																											
分配準備積立金	B	65,456,419円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	9,149,558,326円																																																											
経費	D	1,116,237,309円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	8,033,321,017円																																																											
収益分配金	F	7,980,413,750円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	52,907,267円																																																											
口数	H	63,843,310口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	125円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち173,256,388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180,389,616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13期 自2019年10月8日 至2020年4月7日	第14期 自2020年4月8日 至2020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。 ○市場リスクの管理	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

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13期 2020年4月7日現在	第14期 2020年10月7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2. 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第13期 自2019年10月8日 至2020年4月7日	第14期 自2020年4月8日 至2020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13期 自2019年10月8日 至2020年4月7日	第14期 自2020年4月8日 至2020年10月7日
期首元本額 657,339,666,984円	期首元本額 681,539,337,122円
期中追加設定元本額 60,401,359,994円	期中追加設定元本額 70,852,331,800円
期中一部交換元本額 36,201,689,856円	期中一部交換元本額 10,149,346,862円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第13期 自2019年10月8日 至2020年4月7日	第14期 自2020年4月8日 至2020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	△86,737,466,485	129,460,874,270
合計	△86,737,466,485	129,460,874,270

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13期(2020年4月7日現在)			第14期(2020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	23,486,736,918	—	24,655,750,000	1,165,839,142	18,131,795,500	—	18,493,010,000	359,156,950
合計	23,486,736,918	—	24,655,750,000	1,165,839,142	18,131,795,500	—	18,493,010,000	359,156,950

(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(2020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	705,400	446.00	314,608,400	貸付有価証券 300株
		マルハニチロ	101,900	2,345.00	238,955,500	貸付有価証券 1,000株
		国際石油開発帝石	2,594,200	580.00	1,504,636,000	貸付有価証券 1,664,700株
		安藤・間	420,000	743.00	312,060,000	貸付有価証券 800株
		東急建設	206,600	473.00	97,721,800	貸付有価証券 1,600株
		コムシスホールディングス	250,100	2,886.00	721,788,600	貸付有価証券 6,700株
		大成建設	543,200	3,640.00	1,977,248,000	貸付有価証券 200株
		大林組	1,629,000	956.00	1,557,324,000	
		清水建設	1,653,200	791.00	1,307,681,200	貸付有価証券 11,500株
		長谷工コーポレーション	630,600	1,397.00	880,948,200	貸付有価証券 33,800株
		鹿島建設	1,278,900	1,261.00	1,612,692,900	
		西松建設	125,500	2,100.00	263,550,000	貸付有価証券 4,400株
		三井住友建設	393,500	449.00	176,681,500	貸付有価証券 3,000株
		前田建設工業	408,000	779.00	317,832,000	貸付有価証券 700株
戸田建設	676,500	715.00	483,697,500	貸付有価証券		

				48,100株
熊谷組	75,500	2,664.00	201,132,000	
大東建託	177,800	9,357.00	1,663,674,600	貸付有価証券 3,000株
N I P P O	134,800	2,898.00	390,650,400	貸付有価証券 100株
五洋建設	645,800	674.00	435,269,200	貸付有価証券 5,600株
住友林業	412,600	1,715.00	707,609,000	貸付有価証券 18,100株
大和ハウス工業	1,611,700	2,925.50	4,715,028,350	貸付有価証券 200株
積水ハウス	1,766,700	1,859.50	3,285,178,650	貸付有価証券 103,400株
協和エクシオ	247,000	2,727.00	673,569,000	貸付有価証券 1,200株
九電工	114,300	3,030.00	346,329,000	貸付有価証券 100株
森永製菓	122,400	4,200.00	514,080,000	貸付有価証券 100株
江崎グリコ	143,500	4,710.00	675,885,000	貸付有価証券 13,700株
カルビー	237,600	3,435.00	816,156,000	貸付有価証券 1,200株
ヤクルト本社	358,600	5,480.00	1,965,128,000	貸付有価証券 11,900株
明治ホールディングス	344,700	7,860.00	2,709,342,000	
日本ハム	199,300	4,510.00	898,843,000	貸付有価証券 2,800株
アサヒグループホールディングス	1,139,000	3,740.00	4,259,860,000	貸付有価証券 451,800株 (35,200株)
キリンホールディングス	2,211,100	1,980.00	4,377,978,000	貸付有価証券 781,600株
サントリー食品インターナショナル	348,800	3,935.00	1,372,528,000	貸付有価証券 53,700株
キッコーマン	375,200	5,490.00	2,059,848,000	貸付有価証券 36,500株
味の素	1,151,400	2,142.00	2,466,298,800	貸付有価証券 500株
キューピー	290,300	2,299.00	667,399,700	貸付有価証券 900株
アリアケジャパン	47,600	7,100.00	337,960,000	
ニチレイ	248,300	2,744.00	681,335,200	
東洋水産	268,200	5,500.00	1,475,100,000	貸付有価証券 3,200株
日清食品ホールディングス	221,600	9,660.00	2,140,656,000	貸付有価証券 500株

日本たばこ産業	2,795,400	1,991.50	5,567,039,100	貸付有価証券 1,503,000株
帝人	415,000	1,700.00	705,500,000	
東レ	3,683,600	498.80	1,837,379,680	貸付有価証券 100株
ゴールドウイン	92,200	8,160.00	752,352,000	貸付有価証券 200株
王子ホールディングス	2,126,700	491.00	1,044,209,700	貸付有価証券 300株
クラレ	801,200	1,061.00	850,073,200	貸付有価証券 359,200株
旭化成	3,372,100	939.40	3,167,750,740	
昭和電工	386,300	2,018.00	779,553,400	貸付有価証券 100,300株
住友化学	3,737,700	364.00	1,360,522,800	貸付有価証券 100株
日産化学	280,600	5,500.00	1,543,300,000	貸付有価証券 4,800株
東ソー	786,400	1,746.00	1,373,054,400	
トクヤマ	146,600	2,577.00	377,788,200	
デンカ	185,700	3,220.00	597,954,000	
信越化学工業	873,600	13,840.00	12,090,624,000	貸付有価証券 400株
エア・ウォーター	473,200	1,506.00	712,639,200	
日本酸素ホールディングス	488,900	1,674.00	818,418,600	貸付有価証券 24,600株
三菱瓦斯化学	473,300	2,007.00	949,913,100	貸付有価証券 400株
三井化学	461,900	2,616.00	1,208,330,400	貸付有価証券 4,800株
J S R	474,100	2,513.00	1,191,413,300	貸付有価証券 1,100株
三菱ケミカルホールディングス	3,400,900	627.20	2,133,044,480	貸付有価証券 239,600株
ダイセル	662,400	806.00	533,894,400	貸付有価証券 28,000株
積水化学工業	1,075,900	1,759.00	1,892,508,100	貸付有価証券 1,500株
アイカ工業	152,600	3,700.00	564,620,000	貸付有価証券 100株
宇部興産	256,900	1,835.00	471,411,500	貸付有価証券 1,600株
ダイキョーニシカラ	107,300	609.00	65,345,700	貸付有価証券 2,100株
日油	191,600	4,080.00	781,728,000	
花王	1,243,700	7,772.00	9,666,036,400	貸付有価証券 27,100株

日本ペイントホールディングス	419,800	10,650.00	4,470,870,000	貸付有価証券 17,000株
関西ペイント	571,600	2,585.00	1,477,586,000	貸付有価証券 26,600株
D I C	214,800	2,654.00	570,079,200	貸付有価証券 7,800株
資生堂	1,032,200	6,455.00	6,662,851,000	貸付有価証券 237,300株
ライオン	675,400	2,095.00	1,414,963,000	貸付有価証券 600株
コーセー	97,700	13,730.00	1,341,421,000	貸付有価証券 6,300株
ポーラ・オルビスホールディングス	221,700	2,000.00	443,400,000	貸付有価証券 19,700株
小林製薬	145,600	10,320.00	1,502,592,000	貸付有価証券 300株
日東電工	358,400	7,050.00	2,526,720,000	貸付有価証券 200株
ニフコ	190,700	2,995.00	571,146,500	貸付有価証券 800株
ユニ・チャーム	1,101,400	4,665.00	5,138,031,000	貸付有価証券 81,600株 (24,000株)
協和キリン	522,500	2,788.00	1,456,730,000	貸付有価証券 7,200株
武田薬品工業	3,319,500	3,667.00	12,172,606,500	
アステラス製薬	4,503,900	1,505.00	6,778,369,500	貸付有価証券 9,000株
大日本住友製薬	385,000	1,348.00	518,980,000	貸付有価証券 600株
塩野義製薬	653,300	5,424.00	3,543,499,200	貸付有価証券 2,100株
日本新薬	136,000	8,190.00	1,113,840,000	
中外製薬	1,624,700	4,613.00	7,494,741,100	貸付有価証券 44,300株 (300株)
科研製薬	88,900	4,670.00	415,163,000	貸付有価証券 1,700株
エーザイ	621,800	9,450.00	5,876,010,000	貸付有価証券 200株
小野薬品工業	1,192,900	3,197.00	3,813,701,300	貸付有価証券 9,700株
久光製薬	137,300	5,300.00	727,690,000	貸付有価証券 14,100株
参天製薬	968,000	2,099.00	2,031,832,000	貸付有価証券 400株
沢井製薬	106,700	5,150.00	549,505,000	貸付有価証券 500株
第一三共	4,459,400	2,985.00	13,311,309,000	貸付有価証券 11,700株

大塚ホールディングス	1,079,600	4,307.00	4,649,837,200	貸付有価証券 1,400株
ペプチドリーム	264,000	4,850.00	1,280,400,000	貸付有価証券 101,300株
出光興産	576,500	2,258.00	1,301,737,000	貸付有価証券 7,700株
ENEOSホールディングス	7,814,400	385.00	3,008,544,000	貸付有価証券 300株
コスモエネルギーホールディングス	150,400	1,593.00	239,587,200	貸付有価証券 2,600株
横浜ゴム	300,800	1,550.00	466,240,000	貸付有価証券 39,700株
ブリヂストン	1,381,200	3,477.00	4,802,432,400	貸付有価証券 774,200株
住友ゴム工業	466,600	1,018.00	474,998,800	貸付有価証券 308,600株
AGC	476,800	3,195.00	1,523,376,000	貸付有価証券 224,900株
太平洋セメント	328,100	2,793.00	916,383,300	
東海カーボン	507,900	1,184.00	601,353,600	貸付有価証券 129,900株 (70,100株)
TOTO	371,100	4,860.00	1,803,546,000	貸付有価証券 2,200株
日本碍子	623,600	1,523.00	949,742,800	貸付有価証券 200株
日本特殊陶業	395,100	1,931.00	762,938,100	貸付有価証券 500株
ニチアス	142,200	2,476.00	352,087,200	
日本製鉄	2,298,900	1,072.00	2,464,420,800	貸付有価証券 36,300株
ジェイエフイーホールディングス	1,387,300	782.00	1,084,868,600	貸付有価証券 136,300株
日立金属	553,400	1,652.00	914,216,800	貸付有価証券 11,500株
日本軽金属ホールディングス	129,970	1,700.00	220,949,000	貸付有価証券 2,800株
住友金属鉱山	656,600	3,270.00	2,147,082,000	貸付有価証券 16,600株
DOWAホールディングス	130,000	3,125.00	406,250,000	貸付有価証券 1,200株
古河電気工業	159,600	2,547.00	406,501,200	貸付有価証券 4,700株
住友電気工業	1,920,600	1,230.50	2,363,298,300	貸付有価証券 2,400株
SUMCO	657,400	1,509.00	992,016,600	貸付有価証券 432,100株
三和ホールディングス	484,300	1,165.00	564,209,500	貸付有価証券 300株

リンナイ	99,900	10,360.00	1,034,964,000	貸付有価証券 1,600株
東プレ	95,800	1,178.00	112,852,400	貸付有価証券 800株
アマダ	637,100	1,023.00	651,753,300	
オーエスジー	253,300	1,764.00	446,821,200	貸付有価証券 24,400株
DMG森精機	325,000	1,514.00	492,050,000	貸付有価証券 47,900株 (2,600株)
ディスコ	69,700	26,880.00	1,873,536,000	貸付有価証券 100株
ナブテスコ	302,700	3,955.00	1,197,178,500	貸付有価証券 7,800株
三井海洋開発	54,600	1,650.00	90,090,000	貸付有価証券 1,600株
SMC	163,000	57,900.00	9,437,700,000	貸付有価証券 500株
小松製作所	2,352,900	2,450.50	5,765,781,450	
住友重機械工業	297,300	2,521.00	749,493,300	貸付有価証券 800株
日立建機	208,200	3,790.00	789,078,000	貸付有価証券 8,100株
ハーモニック・ドライ ブ・システムズ	108,700	6,730.00	731,551,000	貸付有価証券 72,800株
クボタ	2,755,900	1,976.50	5,447,036,350	貸付有価証券 672,000株
ダイキン工業	661,800	18,620.00	12,322,716,000	貸付有価証券 3,100株
ダイフク	265,400	10,740.00	2,850,396,000	貸付有価証券 200株
竹内製作所	86,900	2,379.00	206,735,100	貸付有価証券 100株
T P R	69,900	1,338.00	93,526,200	貸付有価証券 800株
日本精工	978,000	859.00	840,102,000	貸付有価証券 8,800株
ジェイテクト	498,300	881.00	439,002,300	貸付有価証券 8,400株
THK	323,800	2,712.00	878,145,600	貸付有価証券 147,400株
マキタ	677,400	5,040.00	3,414,096,000	貸付有価証券 10,300株
三菱重工業	870,500	2,342.00	2,038,711,000	貸付有価証券 1,900株
I H I	374,200	1,467.00	548,951,400	貸付有価証券 6,700株
コニカミノルタ	1,134,900	301.00	341,604,900	貸付有価証券 152,400株

ブラザー工業	634,300	1,722.00	1,092,264,600	貸付有価証券 3,600株
ミネベアミツミ	964,300	2,017.00	1,944,993,100	貸付有価証券 400株
日立製作所	2,495,900	3,676.00	9,174,928,400	貸付有価証券 18,400株
三菱電機	5,194,300	1,442.00	7,490,180,600	貸付有価証券 1,600株
富士電機	313,000	3,315.00	1,037,595,000	貸付有価証券 100株
安川電機	559,100	4,220.00	2,359,402,000	貸付有価証券 10,200株
東芝テック	65,100	4,455.00	290,020,500	貸付有価証券 3,600株
日本電産	1,250,100	10,290.00	12,863,529,000	貸付有価証券 14,700株
日新電機	121,700	1,106.00	134,600,200	
オムロン	465,700	8,080.00	3,762,856,000	貸付有価証券 300株
日本電気	630,100	6,020.00	3,793,202,000	貸付有価証券 100株
富士通	500,800	14,045.00	7,033,736,000	貸付有価証券 200株
ルネサスエレクトロニクス	2,222,000	834.00	1,853,148,000	貸付有価証券 87,300株
セイコーエプソン	644,500	1,202.00	774,689,000	貸付有価証券 16,300株
アルバック	95,500	3,895.00	371,972,500	貸付有価証券 29,600株
エレコム	59,000	4,895.00	288,805,000	
パナソニック	5,934,600	912.70	5,416,509,420	貸付有価証券 100株
富士通ゼネラル	141,000	2,950.00	415,950,000	貸付有価証券 13,600株
ソニー	2,200,900	7,770.00	17,100,993,000	貸付有価証券 15,300株
TDK	250,800	11,710.00	2,936,868,000	
アルプスアルパイン	459,700	1,527.00	701,961,900	貸付有価証券 100株
ヒロセ電機	80,000	14,680.00	1,174,400,000	貸付有価証券 3,400株
横河電機	476,500	1,703.00	811,479,500	貸付有価証券 100株
アズビル	327,800	4,125.00	1,352,175,000	貸付有価証券 400株
日本光電工業	214,600	3,510.00	753,246,000	貸付有価証券 1,300株
堀場製作所	102,900	5,520.00	568,008,000	貸付有価証券

				3,700株
アドバンテスト	386,200	5,210.00	2,012,102,000	貸付有価証券 1,700株
キーエンス	371,700	49,190.00	18,283,923,000	貸付有価証券 800株
シスメックス	371,400	10,010.00	3,717,714,000	貸付有価証券 2,500株
OBARA GROUP	30,300	3,605.00	109,231,500	貸付有価証券 20,300株 (18,900 株)
レーザーテック	228,100	8,870.00	2,023,247,000	貸付有価証券 6,300株
スタンレー電気	364,200	3,110.00	1,132,662,000	
カシオ計算機	459,500	1,687.00	775,176,500	貸付有価証券 74,100株
ファナック	488,500	20,655.00	10,089,967,500	
浜松ホトニクス	372,600	5,260.00	1,959,876,000	
京セラ	730,800	6,036.00	4,411,108,800	貸付有価証券 500株
太陽誘電	231,000	3,430.00	792,330,000	貸付有価証券 41,500株
村田製作所	1,525,900	6,878.00	10,495,140,200	貸付有価証券 500株
小糸製作所	311,200	5,280.00	1,643,136,000	貸付有価証券 300株
SCREENホールディングス	90,100	5,880.00	529,788,000	貸付有価証券 500株
キヤノン	2,581,200	1,749.00	4,514,518,800	貸付有価証券 1,400,700株
東京エレクトロン	329,600	27,560.00	9,083,776,000	貸付有価証券 1,200株
トヨタ紡織	151,300	1,564.00	236,633,200	貸付有価証券 100株
豊田自動織機	420,400	6,930.00	2,913,372,000	貸付有価証券 14,500株
デンソー	1,143,700	4,840.00	5,535,508,000	貸付有価証券 400株
川崎重工業	404,200	1,461.00	590,536,200	貸付有価証券 51,600株
いすゞ自動車	1,505,100	997.10	1,500,735,210	
トヨタ自動車	1,991,000	7,003.00	13,942,973,000	
日野自動車	648,700	801.00	519,608,700	貸付有価証券 300株
アイシン精機	427,700	3,475.00	1,486,257,500	貸付有価証券 200株
マツダ	1,528,400	629.00	961,363,600	貸付有価証券 119,500株

本田技研工業	4,089,900	2,618.50	10,709,403,150	貸付有価証券 55,600株
スズキ	1,029,600	4,811.00	4,953,405,600	貸付有価証券 500株
S U B A R U	1,612,600	2,130.00	3,434,838,000	貸付有価証券 4,600株
ヤマハ発動機	734,100	1,649.00	1,210,530,900	貸付有価証券 206,700株
豊田合成	167,700	2,529.00	424,113,300	貸付有価証券 500株
シマノ	194,400	21,390.00	4,158,216,000	貸付有価証券 73,000株
テイ・エス テック	120,600	3,045.00	367,227,000	
テルモ	1,469,900	4,106.00	6,035,409,400	貸付有価証券 51,400株
島津製作所	620,700	3,160.00	1,961,412,000	貸付有価証券 25,700株
ブイ・テクノロジー	24,300	4,590.00	111,537,000	貸付有価証券 7,900株
東京精密	94,200	3,450.00	324,990,000	貸付有価証券 1,300株
ニコン	793,200	716.00	567,931,200	貸付有価証券 52,800株
オリンパス	2,874,200	2,169.00	6,234,139,800	貸付有価証券 3,100株
HOYA	1,030,500	12,190.00	12,561,795,000	貸付有価証券 800株
朝日インテック	588,400	3,400.00	2,000,560,000	貸付有価証券 14,700株
バンダイナムコホールディングス	537,000	7,780.00	4,177,860,000	貸付有価証券 2,900株
パイロットコーポレーション	91,900	3,040.00	279,376,000	
タカラトミー	232,900	989.00	230,338,100	貸付有価証券 3,100株
ヤマハ	308,900	5,110.00	1,578,479,000	貸付有価証券 400株
ピジョン	333,500	4,860.00	1,620,810,000	貸付有価証券 62,400株 (8,100株)
任天堂	318,500	57,860.00	18,428,410,000	貸付有価証券 200株
中部電力	1,589,200	1,301.50	2,068,343,800	
関西電力	1,968,100	1,030.50	2,028,127,050	貸付有価証券 9,600株
東北電力	1,297,600	1,007.00	1,306,683,200	貸付有価証券 14,100株
九州電力	1,070,600	966.00	1,034,199,600	貸付有価証券 64,200株

電源開発	413,300	1,603.00	662,519,900	貸付有価証券 16,700株
東京瓦斯	998,900	2,390.00	2,387,371,000	
大阪瓦斯	1,008,000	2,032.00	2,048,256,000	
東武鉄道	541,400	3,265.00	1,767,671,000	貸付有価証券 700株
相鉄ホールディングス	221,600	2,844.00	630,230,400	貸付有価証券 2,500株
東急	1,310,100	1,381.00	1,809,248,100	貸付有価証券 1,800株
小田急電鉄	772,600	2,674.00	2,065,932,400	貸付有価証券 11,300株
京王電鉄	269,500	6,520.00	1,757,140,000	貸付有価証券 100株
京成電鉄	361,500	3,000.00	1,084,500,000	貸付有価証券 9,100株
東日本旅客鉄道	914,300	6,555.00	5,993,236,500	貸付有価証券 11,300株
西日本旅客鉄道	462,900	5,299.00	2,452,907,100	
東海旅客鉄道	431,900	15,420.00	6,659,898,000	貸付有価証券 1,700株
西武ホールディングス	678,200	1,181.00	800,954,200	貸付有価証券 6,600株
近鉄グループホールディングス	492,000	4,580.00	2,253,360,000	貸付有価証券 38,700株
阪急阪神ホールディングス	656,100	3,460.00	2,270,106,000	貸付有価証券 500株
京阪ホールディングス	292,100	4,370.00	1,276,477,000	
名古屋鉄道	539,300	2,902.00	1,565,048,600	貸付有価証券 116,100株
日本通運	170,300	6,160.00	1,049,048,000	貸付有価証券 100株
ヤマトホールディングス	862,400	2,692.00	2,321,580,800	貸付有価証券 13,800株
山九	136,700	4,215.00	576,190,500	貸付有価証券 900株
日立物流	90,100	3,395.00	305,889,500	貸付有価証券 60,300株
日本航空	870,000	2,020.00	1,757,400,000	貸付有価証券 2,400株
ANAホールディングス	899,300	2,480.00	2,230,264,000	貸付有価証券 602,500株 (215,700株)
日鉄ソリューションズ	76,400	3,230.00	246,772,000	貸付有価証券 900株
T I S	509,700	2,224.00	1,133,572,800	
ネクソン	1,285,700	2,585.00	3,323,534,500	貸付有価証券 44,200株

コロプラ	167,200	925.00	154,660,000	貸付有価証券 109,000株(27,500 株)
ティーガイア	45,200	1,959.00	88,546,800	貸付有価証券 300株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	122,800	2,179.00	267,581,200	貸付有価証券 40,900株
GMOペイメントゲート ウェイ	107,800	11,390.00	1,227,842,000	貸付有価証券 4,000株
アカツキ	18,000	4,845.00	87,210,000	貸付有価証券 2,400株(1,800株)
野村総合研究所	722,600	3,115.00	2,250,899,000	
オービック	176,700	18,350.00	3,242,445,000	
Zホールディングス	7,000,000	745.00	5,215,000,000	貸付有価証券 12,900株
トレンドマイクロ	272,000	6,310.00	1,716,320,000	貸付有価証券 38,100株
日本オラクル	103,400	11,000.00	1,137,400,000	貸付有価証券 2,200株
伊藤忠テクノソリューシ ョンズ	232,200	3,850.00	893,970,000	貸付有価証券 1,200株
大塚商会	275,800	5,330.00	1,470,014,000	貸付有価証券 21,600株
デジタルガレージ	91,800	3,700.00	339,660,000	貸付有価証券 34,600株
日本ユニシス	159,200	3,420.00	544,464,000	貸付有価証券 900株
日本テレビホールディン グス	425,500	1,167.00	496,558,500	貸付有価証券 22,200株
日本電信電話	5,187,200	2,295.50	11,907,217,600	貸付有価証券 3,100株
KDDI	3,716,000	2,738.50	10,176,266,000	貸付有価証券 10,200株
光通信	52,600	25,050.00	1,317,630,000	貸付有価証券 200株
NTTドコモ	3,644,700	3,877.00	14,130,501,900	貸付有価証券 26,600株
東宝	300,800	4,465.00	1,343,072,000	貸付有価証券 14,400株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	1,357,100	1,329.00	1,803,585,900	貸付有価証券 4,000株
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	217,400	6,720.00	1,460,928,000	貸付有価証券 200株
カブコン	240,300	5,920.00	1,422,576,000	貸付有価証券 3,100株
SCSK	117,600	5,790.00	680,904,000	貸付有価証券 6,800株
コナミホールディングス	185,100	4,595.00	850,534,500	貸付有価証券 1,000株

ソフトバンクグループ	2,447,500	6,955.00	17,022,362,500	貸付有価証券 64,600株
双日	2,825,700	243.00	686,645,100	貸付有価証券 110,400株
アルフレッサホールディングス	568,500	2,302.00	1,308,687,000	貸付有価証券 400株
神戸物産	176,500	5,710.00	1,007,815,000	貸付有価証券 118,200株
ダイワボウホールディングス	43,500	6,550.00	284,925,000	
TOKAIホールディングス	270,300	1,034.00	279,490,200	貸付有価証券 1,700株
シップヘルスケアホールディングス	82,000	5,180.00	424,760,000	貸付有価証券 13,200株
コメダホールディングス	111,500	1,934.00	215,641,000	貸付有価証券 20,600株
第一興商	101,500	3,600.00	365,400,000	貸付有価証券 4,800株
メディカルホールディングス	552,100	2,085.00	1,151,128,500	貸付有価証券 4,000株
日本ライフライン	151,500	1,400.00	212,100,000	貸付有価証券 1,900株
伊藤忠商事	3,578,400	2,701.50	9,667,047,600	貸付有価証券 2,900株
丸紅	5,325,400	618.90	3,295,890,060	貸付有価証券 25,000株
豊田通商	571,000	3,095.00	1,767,245,000	
兼松	190,800	1,306.00	249,184,800	貸付有価証券 2,700株
三井物産	4,429,700	1,849.00	8,190,515,300	
住友商事	3,227,900	1,280.00	4,131,712,000	
三菱商事	3,354,500	2,561.00	8,590,874,500	
岩谷産業	115,500	3,950.00	456,225,000	貸付有価証券 49,200株
PALTAC	82,000	5,390.00	441,980,000	
日鉄物産	36,500	3,110.00	113,515,000	
ミスミグループ本社	641,300	2,994.00	1,920,052,200	貸付有価証券 600株
ローソン	129,400	5,070.00	656,058,000	貸付有価証券 86,600株
エービーシー・マート	79,900	5,490.00	438,651,000	貸付有価証券 53,100株
日本マクドナルドホールディングス	214,400	5,140.00	1,102,016,000	貸付有価証券 139,200株 (79,100株)
セリア	122,300	4,160.00	508,768,000	貸付有価証券 900株

ビックカメラ	303,400	1,208.00	366,507,200	貸付有価証券 137,100株
MonotaRO	363,800	5,240.00	1,906,312,000	貸付有価証券 113,300株
J.フロントリテイ リング	610,900	824.00	503,381,600	貸付有価証券 120,900株
マツモトキヨシホールデ ィングス	211,500	4,060.00	858,690,000	貸付有価証券 4,400株
ZOZO	351,800	2,973.00	1,045,901,400	貸付有価証券 26,500株
ウエルシアホールディ ィングス	304,300	4,410.00	1,341,963,000	貸付有価証券 38,400株 (18,800 株)
クリエイトSDホールデ ィングス	86,200	3,535.00	304,717,000	貸付有価証券 500株 (500株)
すかいらくホールディ ィングス	573,300	1,538.00	881,735,400	貸付有価証券 384,100株
コスモス薬品	45,200	17,480.00	790,096,000	貸付有価証券 200株
セブン&アイ・ホールデ ィングス	2,001,400	3,431.00	6,866,803,400	貸付有価証券 982,400株
ツルハホールディ ィングス	111,400	15,040.00	1,675,456,000	貸付有価証券 1,800株
クスリのアオキホールデ ィングス	45,800	8,380.00	383,804,000	貸付有価証券 16,300株
ノジマ	91,000	2,850.00	259,350,000	
良品計画	679,200	1,800.00	1,222,560,000	貸付有価証券 69,500株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	1,124,700	2,405.00	2,704,903,500	貸付有価証券 428,500株
ゼンショーホールディ ィングス	245,100	2,547.00	624,269,700	貸付有価証券 18,500株
ワークマン	52,800	8,690.00	458,832,000	貸付有価証券 35,300株
ユナイテッドアローズ	53,600	1,547.00	82,919,200	貸付有価証券 4,200株
スギホールディ ィングス	102,100	7,400.00	755,540,000	貸付有価証券 3,600株
ファミリーマート	408,700	2,325.00	950,227,500	貸付有価証券 44,000株 (5,200株)
しまむら	59,500	10,590.00	630,105,000	貸付有価証券 1,400株
丸井グループ	468,900	2,097.00	983,283,300	貸付有価証券 8,300株
イオン	1,968,700	2,939.50	5,786,993,650	貸付有価証券 332,100株
イズミ	104,000	3,730.00	387,920,000	貸付有価証券 3,000株
ヤオコー	58,100	7,540.00	438,074,000	貸付有価証券

				36,400株
ケーズホールディングス	493,700	1,395.00	688,711,500	
アインホールディングス	62,800	7,540.00	473,512,000	貸付有価証券 8,200株
ニトリホールディングス	221,500	21,630.00	4,791,045,000	貸付有価証券 14,100株
ファーストリテイリング	68,400	66,490.00	4,547,916,000	貸付有価証券 8,600株
サンドラッグ	192,400	3,940.00	758,056,000	貸付有価証券 300株
めぶきフィナンシャルグループ	2,662,100	237.00	630,917,700	貸付有価証券 96,900株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,926,200	382.00	1,117,808,400	貸付有価証券 89,100株
新生銀行	376,000	1,332.00	500,832,000	貸付有価証券 8,400株
あおぞら銀行	305,200	1,789.00	546,002,800	貸付有価証券 67,300株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	25,844,300	433.90	11,213,841,770	
りそなホールディングス	5,570,000	368.20	2,050,874,000	貸付有価証券 454,000株
三井住友トラスト・ホールディングス	968,400	2,892.00	2,800,612,800	貸付有価証券 6,600株
三井住友フィナンシャルグループ	3,433,100	3,020.00	10,367,962,000	貸付有価証券 800株
千葉銀行	1,709,800	594.00	1,015,621,200	貸付有価証券 35,600株
セブン銀行	1,711,700	259.00	443,330,300	貸付有価証券 57,200株
みずほフィナンシャルグループ	6,961,680	1,342.50	9,346,055,400	貸付有価証券 871,600株
F P G	158,000	565.00	89,270,000	貸付有価証券 101,400株 (4,500株)
S B I ホールディングス	579,000	2,660.00	1,540,140,000	
大和証券グループ本社	4,111,000	450.00	1,849,950,000	貸付有価証券 5,900株
野村ホールディングス	9,014,700	494.10	4,454,163,270	貸付有価証券 10,400株
松井証券	292,700	932.00	272,796,400	貸付有価証券 25,700株
S O M P O ホールディングス	963,300	3,812.00	3,672,099,600	
MS & ADインシュアランスグループホール	1,339,600	2,894.00	3,876,802,400	貸付有価証券 300株
第一生命ホールディングス	2,899,100	1,586.00	4,597,972,600	貸付有価証券 1,400株

東京海上ホールディングス	1,811,400	4,774.00	8,647,623,600	
T&Dホールディングス	1,531,300	1,098.00	1,681,367,400	貸付有価証券 82,900株
全国保証	144,400	4,275.00	617,310,000	貸付有価証券 60,700株 (13,100 株)
芙蓉総合リース	53,700	6,510.00	349,587,000	貸付有価証券 100株
東京センチュリー	103,200	5,940.00	613,008,000	貸付有価証券 9,500株
イオンフィナンシャルサービス	313,500	1,059.00	331,996,500	貸付有価証券 156,000株
オリエントコーポレーション	1,385,900	118.00	163,536,200	貸付有価証券 5,900株
オリックス	3,178,600	1,380.50	4,388,057,300	
三菱UFJリース	1,300,300	494.00	642,348,200	貸付有価証券 4,100株
日本取引所グループ	1,470,500	2,800.00	4,117,400,000	貸付有価証券 14,400株
いちご	652,000	333.00	217,116,000	貸付有価証券 5,200株
ヒューリック	1,062,400	1,033.00	1,097,459,200	貸付有価証券 270,000株
野村不動産ホールディングス	311,200	2,038.00	634,225,600	貸付有価証券 1,600株
プレサンスコーポレーション	84,300	1,452.00	122,403,600	貸付有価証券 3,000株 (2,600株)
オープンハウス	161,400	3,790.00	611,706,000	貸付有価証券 400株
東急不動産ホールディングス	1,393,100	490.00	682,619,000	
飯田グループホールディングス	427,400	2,095.00	895,403,000	貸付有価証券 4,200株
パーク24	275,000	1,785.00	490,875,000	貸付有価証券 28,500株
三井不動産	2,490,500	1,909.00	4,754,364,500	
三菱地所	3,589,700	1,632.00	5,858,390,400	
東京建物	506,000	1,286.00	650,716,000	貸付有価証券 300株
住友不動産	1,151,700	3,062.00	3,526,505,400	貸付有価証券 27,600株
スターツコーポレーション	69,700	2,436.00	169,789,200	
イオンモール	256,900	1,617.00	415,407,300	貸付有価証券 1,500株
日本空港ビルデング	163,500	4,710.00	770,085,000	貸付有価証券 94,500株

ミクシィ	126,200	3,080.00	388,696,000	貸付有価証券 7,700株
ジェイエイシーリクルー トメント	33,300	1,339.00	44,588,700	貸付有価証券 7,800株 (7,800株)
日本M&Aセンター	379,800	6,210.00	2,358,558,000	
UTグループ	78,100	3,670.00	286,627,000	貸付有価証券 48,900株 (19,600 株)
エス・エム・エス	154,500	3,135.00	484,357,500	貸付有価証券 1,400株
パーソルホールディング ス	496,300	1,693.00	840,235,900	貸付有価証券 10,600株
総合警備保障	197,500	5,030.00	993,425,000	貸付有価証券 1,500株
カカクコム	366,700	2,979.00	1,092,399,300	貸付有価証券 59,500株
ディップ	67,900	2,351.00	159,632,900	貸付有価証券 16,500株 (500株)
ベネフィット・ワン	180,600	2,677.00	483,466,200	貸付有価証券 10,900株
エムスリー	1,094,600	6,480.00	7,093,008,000	貸付有価証券 9,900株
アウトソーシング	284,300	1,091.00	310,171,300	貸付有価証券 55,000株
ディー・エヌ・エー	210,000	1,924.00	404,040,000	貸付有価証券 3,300株
博報堂DYホールディン グス	690,300	1,438.00	992,651,400	
電通グループ	558,200	3,055.00	1,705,301,000	貸付有価証券 62,000株
オリエンタルランド	527,900	15,065.00	7,952,813,500	貸付有価証券 6,900株
リゾートトラスト	227,500	1,695.00	385,612,500	貸付有価証券 3,300株
ユー・エス・エス	555,700	1,936.00	1,075,835,200	貸付有価証券 1,600株
サイバーエージェント	305,800	6,290.00	1,923,482,000	貸付有価証券 3,900株
楽天	2,313,600	1,193.00	2,760,124,800	貸付有価証券 1,549,800株
エン・ジャパン	88,200	2,750.00	242,550,000	貸付有価証券 100株
テクノプロ・ホールディ ングス	99,100	6,820.00	675,862,000	貸付有価証券 2,400株
リクルートホールディン グス	3,555,700	4,272.00	15,189,950,400	貸付有価証券 11,700株
リログループ	271,300	2,562.00	695,070,600	貸付有価証券 2,100株
カナモト	87,500	2,401.00	210,087,500	貸付有価証券

					26,100株
	セコム	526,700	9,387.00	4,944,132,900	貸付有価証券 2,000株
	メイテック	60,800	5,320.00	323,456,000	貸付有価証券 200株
	小計 銘柄数：396 組入時価比率：98.0%			930,087,181,580 100.0%	
	合計			930,087,181,580	

(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(2020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。