



平成 29 年 7 月期 (平成 28 年 7 月 9 日～平成 29 年 7 月 8 日) 決算短信
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2017 (July 9, 2016 – July 8, 2017)

平成 29 年 8 月 17 日
August 17, 2017

上場取引所 東証
Listed Exchange TSE

ファンド名 日経225連動型上場投資信託
コード番号 (1321)
連動対象指標 日経平均株価
主要投資資産 株式
売買単位 1 口
管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>
代表者名 CEO 兼執行役社長 渡邊 国夫
問合せ先責任者 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL(03)-3241-9511

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

有価証券報告書提出予定日 平成 29 年 9 月 28 日
分配金支払開始日 平成 29 年 8 月 16 日
Scheduled date of submission of securities report: September 28, 2017
Date of commencing dividend payment: August 16, 2017

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 平成 29 年 7 月期の運用状況 (平成 28 年 7 月 9 日～平成 29 年 7 月 8 日)

Management Status for Year ended July 2017 (from July 9, 2016 to July 8, 2017)

(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.	%
平成 29 年 7 月期 FY ended Jul. 2017	4,538,134	(98.8)	56,447	(1.2)	4,594,582	(100.0)
平成 28 年 7 月期 FY ended Jul. 2016	2,857,060	(98.8)	33,564	(1.2)	2,890,625	(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
平成29年7月期 FY ended Jul. 2017	188,121	88,236	50,282	226,075
平成28年7月期 FY ended Jul. 2016	150,930	87,193	50,002	188,121

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	10口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×10) Net Asset Value per 10 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×10)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
平成29年7月期 FY ended Jul. 2017	4,953,846	359,263	4,594,582	203,232
平成28年7月期 FY ended Jul. 2016	3,601,348	710,723	2,890,625	153,657

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
平成29年7月期 FY ended Jul. 2017	2,860
平成28年7月期 FY ended Jul. 2016	2,690

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 15 期 (平成 28 年 7 月 8 日現在) 15th Fiscal Year As of July 8, 2016	第 16 期 (平成 29 年 7 月 8 日現在) 16th Fiscal Year As of July 8, 2017
	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	728,898,758,053	404,771,745,254
株式 Stocks	2,857,060,280,660	4,538,134,596,060
未収配当金 Accrued dividend receivable	4,223,648,000	6,039,999,950
未収利息 Accrued interest	14,743,514	37,430,657
その他未収収益 Other accrued revenue	18,610,476	80,247,476
差入委託証拠金 Customers' margin	11,132,605,999	4,782,130,000
流動資産合計 Total current assets	3,601,348,646,702	4,953,846,149,397
資産合計 Total assets	3,601,348,646,702	4,953,846,149,397
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	2,934,999,573	424,490,520
未払金 Accounts payable - other	4,922,251,237	615,058,695
未払収益分配金 Unpaid dividends	50,604,709,055	64,657,668,504
未払受託者報酬 Trustee fee payable	864,681,043	1,139,311,787
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	2,783,400,669	4,022,307,066
未払利息 Accrued interest expenses	1,111,520	1,124,044
有価証券貸借取引受入金 Cash received on debt credit transaction of securities	648,579,296,588	288,356,983,056
その他未払費用 Other accrued expenses	33,164,312	46,923,745
流動負債合計	710,723,613,997	359,263,867,417

Total current liabilities		
負債合計 Total liabilities	710, 723, 613, 997	359, 263, 867, 417
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	2, 315, 212, 469, 665	2, 782, 314, 427, 548
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	575, 412, 563, 040	1, 812, 267, 854, 432
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	143, 055, 722	164, 844, 577
元本等合計 Total principal and other	2, 890, 625, 032, 705	4, 594, 582, 281, 980
純資産合計 Total net assets	2, 890, 625, 032, 705	4, 594, 582, 281, 980
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	3, 601, 348, 646, 702	4, 953, 846, 149, 397

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	第 15 期 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 7 月 8 日 15th Fiscal Year From July 9, 2015 to July 8, 2016	第 16 期 自 平成 28 年 7 月 9 日 至 平成 29 年 7 月 8 日 16th Fiscal Year From July 9, 2016 to July 8, 2017
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	57, 659, 664, 456	71, 218, 340, 342
受取利息 Interest income	75, 807, 992	-
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△790, 430, 670, 625	987, 359, 736, 649
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△14, 878, 027, 350	18, 102, 771, 818
その他収益 Other revenue	377, 084, 282	2, 724, 228, 545
営業収益合計 Total operating revenue	△747, 196, 141, 245	1, 079, 405, 077, 354
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	7, 936, 159	△259, 274, 325
受託者報酬 Trustee fee	1, 748, 497, 497	2, 119, 505, 974
委託者報酬 Investment trust management fee	5, 640, 738, 588	7, 310, 276, 739

その他費用 Other expenses	70,400,049	92,603,140
営業費用合計 Total operating expenses	7,467,572,293	9,263,111,528
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△754,663,713,538	1,070,141,965,826
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△754,663,713,538	1,070,141,965,826
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△754,663,713,538	1,070,141,965,826
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△) Distribution of profit loss from partial exchange	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△) Surplus (deficit) at beginning of period	1,174,561,139,588	575,412,563,040
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	493,835,021,985	570,262,954,393
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	493,835,021,985	570,262,954,393
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	287,715,175,940	338,891,960,323
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	287,715,175,940	338,891,960,323
分配金 Dividends	50,604,709,055	64,657,668,504
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	575,412,563,040	1,812,267,854,432

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成 28 年 7 月 9 日から平成 29

年 7 月 8 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 15 期 平成 28 年 7 月 8 日現在	第 16 期 平成 29 年 7 月 8 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 188, 121, 595 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 226, 075, 764 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, 365.7 円 (10 口当たり純資産額) (153, 657 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 20, 323.2 円 (10 口当たり純資産額) (203, 232 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 605, 740, 465, 940 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 272, 675, 553, 520 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 15 期 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 7 月 8 日	第 16 期 自 平成 28 年 7 月 9 日 至 平成 29 年 7 月 8 日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">58, 104, 620, 571 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;">102, 780, 340 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;">58, 207, 400, 911 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">7, 459, 636, 134 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;">50, 747, 764, 777 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">50, 604, 709, 055 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;">143, 055, 722 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">188, 121, 595 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H×10</td> <td style="text-align: right;">2, 690 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	58, 104, 620, 571 円	分配準備積立金	B	102, 780, 340 円	配当等収益合計額	C=A+B	58, 207, 400, 911 円	経費	D	7, 459, 636, 134 円	収益分配可能額	E=C-D	50, 747, 764, 777 円	収益分配金	F	50, 604, 709, 055 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	143, 055, 722 円	口数	H	188, 121, 595 口	10 口当たり分配金	I=F/H×10	2, 690 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 style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">74, 201, 843, 212 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;">143, 055, 722 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;">74, 344, 898, 934 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">9, 522, 385, 853 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;">64, 822, 513, 081 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">64, 657, 668, 504 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;">164, 844, 577 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">226, 075, 764 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H×10</td> <td style="text-align: right;">2, 860 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	74, 201, 843, 212 円	分配準備積立金	B	143, 055, 722 円	配当等収益合計額	C=A+B	74, 344, 898, 934 円	経費	D	9, 522, 385, 853 円	収益分配可能額	E=C-D	64, 822, 513, 081 円	収益分配金	F	64, 657, 668, 504 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	164, 844, 577 円	口数	H	226, 075, 764 口	10 口当たり分配金	I=F/H×10	2, 860 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	58, 104, 620, 571 円																																																											
分配準備積立金	B	102, 780, 340 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	58, 207, 400, 911 円																																																											
経費	D	7, 459, 636, 134 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	50, 747, 764, 777 円																																																											
収益分配金	F	50, 604, 709, 055 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	143, 055, 722 円																																																											
口数	H	188, 121, 595 口																																																											
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2, 690 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	74, 201, 843, 212 円																																																											
分配準備積立金	B	143, 055, 722 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	74, 344, 898, 934 円																																																											
経費	D	9, 522, 385, 853 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	64, 822, 513, 081 円																																																											
収益分配金	F	64, 657, 668, 504 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	164, 844, 577 円																																																											
口数	H	226, 075, 764 口																																																											
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2, 860 円																																																											
2. 追加情報 平成 28 年 1 月 29 日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。																																																													

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第 15 期 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 7 月 8 日	第 16 期 自 平成 28 年 7 月 9 日 至 平成 29 年 7 月 8 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効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>
---	---------------------------------

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第15期 平成28年7月8日現在	第16期 平成29年7月8日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 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 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15期 自平成27年7月9日 至平成28年7月8日	第16期 自平成28年7月9日 至平成29年7月8日
<p>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。</p>	<p>同左</p>

(その他の注記)

1 元本の移動

第15期 自平成27年7月9日 至平成28年7月8日	第16期 自平成28年7月9日 至平成29年7月8日
期首元本額 1,857,500,125,125円	期首元本額 2,315,212,469,665円
期中追加設定元本額 1,073,087,081,610円	期中追加設定元本額 1,085,924,021,030円
期中一部交換元本額 615,374,737,070円	期中一部交換元本額 618,822,063,147円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第15期 自平成27年7月9日 至平成28年7月8日	第16期 自平成28年7月9日 至平成29年7月8日
	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
株式	△695,248,672,640	824,019,838,317
合計	△695,248,672,640	824,019,838,317

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 15 期(平成 28 年 7 月 8 日現在)				第 16 期(平成 29 年 7 月 8 日現在)			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1 年超				うち 1 年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	36,334,005,999	—	33,400,080,000	△2,934,999,573	56,682,120,000	—	56,259,000,000	△424,490,520
合計	36,334,005,999	—	33,400,080,000	△2,934,999,573	56,682,120,000	—	56,259,000,000	△424,490,520

(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ありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式(平成 29 年 7 月 8 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	日本水産	8,658,000	633.00	5,480,514,000	
		マルハニチロ	865,800	2,925.00	2,532,465,000	貸付有価証券 3,100 株
		国際石油開発帝石	3,463,200	1,069.00	3,702,160,800	貸付有価証券 107,100 株
		コムシスホールディングス	8,658,000	2,300.00	19,913,400,000	
		大成建設	8,658,000	1,034.00	8,952,372,000	
		大林組	8,658,000	1,310.00	11,341,980,000	貸付有価証券 306,600 株 (306,600 株)
		清水建設	8,658,000	1,196.00	10,354,968,000	貸付有価証券 614,000 株
		長谷工コーポレーション	1,731,600	1,375.00	2,380,950,000	貸付有価証券 19,400 株
		鹿島建設	8,658,000	960.00	8,311,680,000	
		大和ハウス工業	8,658,000	3,780.00	32,727,240,000	
		積水ハウス	8,658,000	1,965.50	17,017,299,000	貸付有価証券 1,260,000 株 (1,260,000 株)
		日揮	8,658,000	1,849.00	16,008,642,000	貸付有価証券 519,600 株 (126,300 株)

千代田化工建設	8,658,000	654.00	5,662,332,000	貸付有価証券 6,462,000株 (190,000株)
日清製粉グループ本社	8,658,000	1,786.00	15,463,188,000	貸付有価証券 230,600株(230,600 株)
明治ホールディングス	1,731,600	8,940.00	15,480,504,000	
日本ハム	8,658,000	3,330.00	28,831,140,000	
サッポロホールディングス	1,731,600	3,095.00	5,359,302,000	
アサヒグループホールディングス	8,658,000	4,352.00	37,679,616,000	
キリンホールディングス	8,658,000	2,325.00	20,129,850,000	貸付有価証券 433,200株(431,300 株)
宝ホールディングス	8,658,000	1,163.00	10,069,254,000	貸付有価証券 30,100株
キッコーマン	8,658,000	3,510.00	30,389,580,000	貸付有価証券 112,300株
味の素	8,658,000	2,365.50	20,480,499,000	
ニチレイ	4,329,000	3,125.00	13,528,125,000	
日本たばこ産業	8,658,000	3,862.00	33,437,196,000	
東洋紡	8,658,000	210.00	1,818,180,000	貸付有価証券 342,000株
ユニチカ	8,658,000	83.00	718,614,000	貸付有価証券 232,000株
帝人	1,731,600	2,178.00	3,771,424,800	貸付有価証券 111,200株(56,300 株)
東レ	8,658,000	956.90	8,284,840,200	貸付有価証券 79,300株
王子ホールディングス	8,658,000	570.00	4,935,060,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
日本製紙	865,800	2,197.00	1,902,162,600	貸付有価証券 11,800株(11,800 株)
北越紀州製紙	8,658,000	844.00	7,307,352,000	貸付有価証券 1,586,600株 (264,100株)
クラレ	8,658,000	2,119.00	18,346,302,000	貸付有価証券 124,200株(124,200 株)
旭化成	8,658,000	1,201.00	10,398,258,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
昭和電工	865,800	2,647.00	2,291,772,600	
住友化学	8,658,000	642.00	5,558,436,000	
日産化学工業	8,658,000	3,790.00	32,813,820,000	

東ソー	8,658,000	1,178.00	10,199,124,000	貸付有価証券 194,000株(194,000 株)
トクヤマ	8,658,000	550.00	4,761,900,000	
デンカ	8,658,000	588.00	5,090,904,000	貸付有価証券 1,000株
信越化学工業	8,658,000	9,944.00	86,095,152,000	貸付有価証券 1,674,400株
三井化学	8,658,000	598.00	5,177,484,000	貸付有価証券 2,391,000株 (2,391,000株)
三菱ケミカルホールディ ングス	4,329,000	950.50	4,114,714,500	
宇部興産	8,658,000	295.00	2,554,110,000	
日本化薬	8,658,000	1,588.00	13,748,904,000	貸付有価証券 85,000株
花王	8,658,000	6,652.00	57,593,016,000	
富士フイルムホールディ ングス	8,658,000	4,013.00	34,744,554,000	
資生堂	8,658,000	3,862.00	33,437,196,000	
日東電工	8,658,000	9,653.00	83,575,674,000	
協和発酵キリン	8,658,000	1,971.00	17,064,918,000	貸付有価証券 400株(400株)
武田薬品工業	8,658,000	5,637.00	48,805,146,000	
アステラス製薬	43,290,000	1,379.50	59,718,555,000	貸付有価証券 6,472,000株
大日本住友製薬	8,658,000	1,519.00	13,151,502,000	貸付有価証券 7,231,100株
塩野義製薬	8,658,000	6,028.00	52,190,424,000	
中外製薬	8,658,000	4,085.00	35,367,930,000	
エーザイ	8,658,000	6,033.00	52,233,714,000	貸付有価証券 104,900株(104,900 株)
第一三共	8,658,000	2,525.50	21,865,779,000	
大塚ホールディングス	8,658,000	4,736.00	41,004,288,000	
昭和シェル石油	8,658,000	1,115.00	9,653,670,000	
JXTGホールディング ス	8,658,000	491.30	4,253,675,400	
横浜ゴム	4,329,000	2,291.00	9,917,739,000	
ブリヂストン	8,658,000	4,794.00	41,506,452,000	
旭硝子	1,731,600	4,780.00	8,277,048,000	
日本板硝子	865,800	962.00	832,899,600	貸付有価証券 237,400株(199,400 株)

日本電気硝子	2,597,400	3,915.00	10,168,821,000	
住友大阪セメント	8,658,000	537.00	4,649,346,000	貸付有価証券 365,000 株
太平洋セメント	8,658,000	418.00	3,619,044,000	
東海カーボン	8,658,000	646.00	5,593,068,000	
TOTO	4,329,000	4,185.00	18,116,865,000	
日本碍子	8,658,000	2,252.00	19,497,816,000	
新日鐵住金	865,800	2,630.00	2,277,054,000	
神戸製鋼所	865,800	1,212.00	1,049,349,600	貸付有価証券 703,200 株 (72,600 株)
ジェイ エフ イー ホールディングス	865,800	2,020.00	1,748,916,000	
日新製鋼	865,800	1,257.00	1,088,310,600	
大太平洋金属	8,658,000	294.00	2,545,452,000	貸付有価証券 7,271,000 株
日本軽金属ホールディングス	8,658,000	278.00	2,406,924,000	
三井金属鉱業	8,658,000	465.00	4,025,970,000	貸付有価証券 135,000 株
東邦亜鉛	8,658,000	477.00	4,129,866,000	貸付有価証券 400,000 株
三菱マテリアル	865,800	3,400.00	2,943,720,000	
住友金属鉱山	8,658,000	1,508.00	13,056,264,000	貸付有価証券 233,000 株
DOWAホールディングス	8,658,000	874.00	7,567,092,000	貸付有価証券 627,000 株
古河機械金属	8,658,000	203.00	1,757,574,000	貸付有価証券 125,000 株
古河電気工業	865,800	4,860.00	4,207,788,000	貸付有価証券 55,600 株
住友電気工業	8,658,000	1,781.00	15,419,898,000	
フジクラ	8,658,000	945.00	8,181,810,000	
SUMCO	865,800	1,730.00	1,497,834,000	
東洋製罐グループホールディングス	8,658,000	1,833.00	15,870,114,000	貸付有価証券 40,700 株
日本製鋼所	1,731,600	1,869.00	3,236,360,400	貸付有価証券 466,200 株
オークマ	8,658,000	1,056.00	9,142,848,000	貸付有価証券 1,558,000 株 (25,000 株)
アマダホールディングス	8,658,000	1,286.00	11,134,188,000	貸付有価証券 36,600 株
小松製作所	8,658,000	2,855.50	24,722,919,000	
住友重機械工業	8,658,000	771.00	6,675,318,000	

日立建機	8,658,000	2,818.00	24,398,244,000	貸付有価証券 1,312,800株 (642,500株)
クボタ	8,658,000	1,925.00	16,666,650,000	貸付有価証券 411,000株
荏原製作所	1,731,600	3,235.00	5,601,726,000	貸付有価証券 30,700株
ダイキン工業	8,658,000	11,725.00	101,515,050,000	
日本精工	8,658,000	1,443.00	12,493,494,000	貸付有価証券 738,900株
N T N	8,658,000	522.00	4,519,476,000	貸付有価証券 332,000株 (50,000 株)
ジェイテクト	8,658,000	1,691.00	14,640,678,000	
日立造船	1,731,600	559.00	967,964,400	
三菱重工業	8,658,000	463.10	4,009,519,800	貸付有価証券 6,000株 (6,000株)
I H I	8,658,000	374.00	3,238,092,000	貸付有価証券 59,000株
日清紡ホールディングス	8,658,000	1,147.00	9,930,726,000	貸付有価証券 162,000株
コニカミノルタ	8,658,000	935.00	8,095,230,000	
ミネベアミツミ	8,658,000	1,754.00	15,186,132,000	
日立製作所	8,658,000	698.30	6,045,881,400	
東芝	8,658,000	261.90	2,267,530,200	貸付有価証券 416,000株
三菱電機	8,658,000	1,659.50	14,367,951,000	
富士電機	8,658,000	603.00	5,220,774,000	貸付有価証券 634,000株 (274,000 株)
安川電機	8,658,000	2,352.00	20,363,616,000	貸付有価証券 1,986,000株 (186,300株)
明電舎	8,658,000	387.00	3,350,646,000	貸付有価証券 187,000株 (187,000 株)
ジーエス・ユアサコー ポレーション	8,658,000	485.00	4,199,130,000	貸付有価証券 420,000株 (334,000 株)
日本電気	8,658,000	295.00	2,554,110,000	
富士通	8,658,000	813.80	7,045,880,400	
沖電気工業	865,800	1,606.00	1,390,474,800	貸付有価証券 11,300株 (6,600株)
パナソニック	8,658,000	1,464.50	12,679,641,000	
ソニー	8,658,000	4,245.00	36,753,210,000	
T D K	8,658,000	7,490.00	64,848,420,000	

アルプス電気	8,658,000	3,180.00	27,532,440,000	貸付有価証券 368,800株
パイオニア	8,658,000	217.00	1,878,786,000	貸付有価証券 3,327,300株 (41,900 株)
横河電機	8,658,000	1,775.00	15,367,950,000	
アドバンテスト	17,316,000	1,930.00	33,419,880,000	貸付有価証券 4,305,600株 (1,106,100株)
カシオ計算機	8,658,000	1,699.00	14,709,942,000	貸付有価証券 5,481,300株 (205,700株)
ファナック	8,658,000	21,725.00	188,095,050,000	貸付有価証券 953,200株
京セラ	17,316,000	6,437.00	111,463,092,000	貸付有価証券 2,100株
太陽誘電	8,658,000	1,755.00	15,194,790,000	貸付有価証券 233,400株 (173,100 株)
S C R E E Nホールディ ングス	1,731,600	7,660.00	13,264,056,000	
キヤノン	12,987,000	3,652.00	47,428,524,000	
リコー	8,658,000	953.00	8,251,074,000	貸付有価証券 5,910,400株 (56,500 株)
東京エレクトロン	8,658,000	15,230.00	131,861,340,000	
デンソー	8,658,000	4,766.00	41,264,028,000	
三井造船	8,658,000	160.00	1,385,280,000	貸付有価証券 969,000株 (273,000 株)
川崎重工業	8,658,000	339.00	2,935,062,000	貸付有価証券 474,000株
日産自動車	8,658,000	1,146.50	9,926,397,000	貸付有価証券 637,800株
いすゞ自動車	4,329,000	1,413.50	6,119,041,500	
トヨタ自動車	8,658,000	6,157.00	53,307,306,000	貸付有価証券 886,700株
日野自動車	8,658,000	1,265.00	10,952,370,000	貸付有価証券 72,100株 (71,400 株)
三菱自動車工業	865,800	746.00	645,886,800	貸付有価証券 725,200株
マツダ	1,731,600	1,629.00	2,820,776,400	
本田技研工業	17,316,000	3,087.00	53,454,492,000	
スズキ	8,658,000	5,291.00	45,809,478,000	貸付有価証券 3,350,000株 (1,696,000株)
S U B A R U	8,658,000	4,086.00	35,376,588,000	

ヤマハ発動機	8,658,000	2,910.00	25,194,780,000	
テルモ	17,316,000	4,330.00	74,978,280,000	貸付有価証券 261,200株(261,200株)
ニコン	8,658,000	1,879.00	16,268,382,000	貸付有価証券 5,590,200株
オリンパス	8,658,000	4,080.00	35,324,640,000	貸付有価証券 1,639,800株(32,100株)
シチズン時計	8,658,000	804.00	6,961,032,000	貸付有価証券 100,000株
凸版印刷	8,658,000	1,201.00	10,398,258,000	貸付有価証券 50,000株
大日本印刷	8,658,000	1,234.00	10,683,972,000	貸付有価証券 125,000株(125,000株)
ヤマハ	8,658,000	3,945.00	34,155,810,000	
東京電力ホールディングス	865,800	460.00	398,268,000	貸付有価証券 50,300株
中部電力	865,800	1,451.00	1,256,275,800	
関西電力	865,800	1,484.50	1,285,280,100	
東京瓦斯	8,658,000	571.30	4,946,315,400	
大阪瓦斯	8,658,000	441.40	3,821,641,200	
東武鉄道	8,658,000	602.00	5,212,116,000	貸付有価証券 176,000株(176,000株)
東京急行電鉄	8,658,000	848.00	7,341,984,000	
小田急電鉄	4,329,000	2,213.00	9,580,077,000	貸付有価証券 2,097,900株
京王電鉄	8,658,000	925.00	8,008,650,000	貸付有価証券 688,000株
京成電鉄	4,329,000	2,944.00	12,744,576,000	貸付有価証券 58,800株(58,800株)
東日本旅客鉄道	865,800	10,650.00	9,220,770,000	貸付有価証券 164,400株(86,000株)
西日本旅客鉄道	865,800	7,916.00	6,853,672,800	貸付有価証券 44,600株
東海旅客鉄道	865,800	17,885.00	15,484,833,000	貸付有価証券 433,000株
日本通運	8,658,000	697.00	6,034,626,000	貸付有価証券 214,000株(214,000株)
ヤマトホールディングス	8,658,000	2,244.00	19,428,552,000	貸付有価証券 465,100株(113,200株)
日本郵船	8,658,000	217.00	1,878,786,000	貸付有価証券

				1,560,000株
商船三井	8,658,000	339.00	2,935,062,000	貸付有価証券 325,000株
川崎汽船	8,658,000	273.00	2,363,634,000	貸付有価証券 7,221,000株 (291,000株)
ANAホールディングス	8,658,000	378.60	3,277,918,800	
三菱倉庫	8,658,000	1,471.00	12,735,918,000	貸付有価証券 2,045,000株
ヤフー	3,463,200	487.00	1,686,578,400	貸付有価証券 2,842,500株
トレンドマイクロ	8,658,000	5,690.00	49,264,020,000	貸付有価証券 150,200株
スカパーJ SATホールディングス	865,800	475.00	411,255,000	貸付有価証券 313,200株 (148,800株)
日本電信電話	1,731,600	5,294.00	9,167,090,400	
KDDI	51,948,000	2,989.50	155,298,546,000	貸付有価証券 4,968,700株
NTTドコモ	865,800	2,650.00	2,294,370,000	
東宝	865,800	3,385.00	2,930,733,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	43,290,000	1,226.00	53,073,540,000	貸付有価証券 4,500株
コナミホールディングス	8,658,000	5,960.00	51,601,680,000	貸付有価証券 341,400株
ソフトバンクグループ	25,974,000	8,934.00	232,051,716,000	貸付有価証券 1,282,700株
双日	865,800	281.00	243,289,800	
伊藤忠商事	8,658,000	1,713.00	14,831,154,000	
丸紅	8,658,000	739.50	6,402,591,000	貸付有価証券 152,800株 (152,800株)
豊田通商	8,658,000	3,355.00	29,047,590,000	
三井物産	8,658,000	1,608.00	13,922,064,000	
住友商事	8,658,000	1,482.50	12,835,485,000	
三菱商事	8,658,000	2,396.00	20,744,568,000	
J.フロントリテイリング	4,329,000	1,630.00	7,056,270,000	
三越伊勢丹ホールディングス	8,658,000	1,108.00	9,593,064,000	貸付有価証券 259,200株
セブン&アイ・ホールディングス	8,658,000	4,560.00	39,480,480,000	貸付有価証券 268,200株 (268,200株)
ユニー・ファミリーマートホールディングス	8,658,000	6,230.00	53,939,340,000	貸付有価証券 1,966,500株 (472,600株)

高島屋	8,658,000	1,026.00	8,883,108,000	貸付有価証券 906,000株(745,000 株)
丸井グループ	8,658,000	1,571.00	13,601,718,000	貸付有価証券 867,900株
イオン	8,658,000	1,734.00	15,012,972,000	貸付有価証券 1,001,900株 (578,900株)
ファーストリテイリング	8,658,000	36,820.00	318,787,560,000	貸付有価証券 988,900株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	8,658,000	572.60	4,957,570,800	
新生銀行	8,658,000	193.00	1,670,994,000	貸付有価証券 4,284,000株
あおぞら銀行	8,658,000	433.00	3,748,914,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,658,000	754.00	6,528,132,000	
りそなホールディングス	865,800	609.70	527,878,260	
三井住友トラスト・ホールディングス	865,800	4,030.00	3,489,174,000	
三井住友フィナンシャルグループ	865,800	4,372.00	3,785,277,600	貸付有価証券 71,800株
千葉銀行	8,658,000	809.00	7,004,322,000	貸付有価証券 27,000株(27,000 株)
ふくおかフィナンシャルグループ	8,658,000	547.00	4,735,926,000	
静岡銀行	8,658,000	1,020.00	8,831,160,000	貸付有価証券 501,000株(70,000 株)
みずほフィナンシャルグループ	8,658,000	205.90	1,782,682,200	
大和証券グループ本社	8,658,000	667.40	5,778,349,200	
野村ホールディングス	8,658,000	657.10	5,689,171,800	
松井証券	8,658,000	919.00	7,956,702,000	貸付有価証券 858,900株(295,800 株)
SOMPOホールディングス	2,164,500	4,364.00	9,445,878,000	
MS&ADインシュアランスグループホール	2,597,400	3,869.00	10,049,340,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,731,600	2,037.00	3,527,269,200	貸付有価証券 60,200株
第一生命ホールディングス	865,800	2,072.50	1,794,370,500	
東京海上ホールディングス	4,329,000	4,752.00	20,571,408,000	
T&Dホールディングス	1,731,600	1,740.00	3,012,984,000	

	クレディセゾン	8,658,000	2,214.00	19,168,812,000	貸付有価証券 84,300株(84,300 株)
	東急不動産ホールディングス	8,658,000	654.00	5,662,332,000	貸付有価証券 8,900株
	三井不動産	8,658,000	2,578.50	22,324,653,000	
	三菱地所	8,658,000	2,011.50	17,415,567,000	
	東京建物	4,329,000	1,441.00	6,238,089,000	貸付有価証券 29,100株
	住友不動産	8,658,000	3,367.00	29,151,486,000	
	ディー・エヌ・エー	2,597,400	2,596.00	6,742,850,400	貸付有価証券 277,900株
	電通	8,658,000	5,240.00	45,367,920,000	
	楽天	8,658,000	1,316.00	11,393,928,000	貸付有価証券 1,084,800株
	東京ドーム	4,329,000	1,022.00	4,424,238,000	
	セコム	8,658,000	8,427.00	72,960,966,000	
小計	銘柄数：225 組入時価比率：98.8%			4,538,134,596,060 100.0%	
合計				4,538,134,596,060	

(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証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(平成 29 年 7 月 8 日現在)

該当事項はありません。

第 2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。