



2018年7月期 (2017年7月9日～2018年7月8日) 決算短信
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2018 (July 9, 2017 - July 8, 2018)

2018年8月17日
August 17, 2018

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 増田 真一 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: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 2018年9月27日
分配金支払開始日 2018年8月16日
Scheduled date of submission of securities report: September 27, 2018
Date of commencing dividend payment: August 16, 2018

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2018年7月期の運用状況 (2017年7月9日～2018年7月8日)

Management Status for Year ended July 2018 (from July 9, 2017 to July 8, 2018)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

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

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計 (純資産)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	5,514,892	(99.1)	48,335	(0.9)	5,563,227	(100.0)
2017年7月期 FY ended Jul. 2017	4,538,134	(98.8)	56,447	(1.2)	4,594,582	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

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

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	226,075	94,207	70,200	250,082
2017年7月期 FY ended Jul. 2017	188,121	88,236	50,282	226,075

(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
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	6,023,380	460,153	5,563,227	222,456
2017年7月期 FY ended Jul. 2017	4,953,846	359,263	4,594,582	203,232

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	3,500
2017年7月期 FY ended Jul. 2017	2,860

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16期 (2017年7月8日現在) 16th Fiscal Year As of July 8, 2017	第17期 (2018年7月8日現在) 17th Fiscal Year As of July 8, 2018
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
コール・ローン Call loans	404,771,745,254	490,627,011,771
株式 Stocks	4,538,134,596,060	5,514,892,048,960
未収配当金 Accrued dividend receivable	6,039,999,950	7,296,945,800
未収利息 Accrued interest	37,430,657	41,743,608
その他未収収益 Other accrued revenue	80,247,476	136,836,661
差入委託証拠金 Customers' margin	4,782,130,000	10,386,360,000
流動資産合計 Total current assets	4,953,846,149,397	6,023,380,946,800
資産合計 Total assets	4,953,846,149,397	6,023,380,946,800
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	424,490,520	1,358,469,200
未払金 Accounts payable - other	615,058,695	2,930,546,720
未払収益分配金 Unpaid dividends	64,657,668,504	87,528,809,550
未払受託者報酬 Trustee fee payable	1,139,311,787	1,409,012,182
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	4,022,307,066	5,235,958,914
未払利息 Accrued interest expenses	1,124,044	3,005,056
有価証券貸借取引受入金 Cash received on debt credit transaction of securities	288,356,983,056	361,627,337,945
その他未払費用 Other accrued expenses	46,923,745	60,408,767
流動負債合計	359,263,867,417	460,153,548,334

Total current liabilities		
負債合計 Total liabilities	359,263,867,417	460,153,548,334
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	2,782,314,427,548	3,077,763,026,091
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,812,267,854,432	2,485,464,372,375
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	164,844,577	111,093,496
元本等合計 Total principal and other	4,594,582,281,980	5,563,227,398,466
純資産合計 Total net assets	4,594,582,281,980	5,563,227,398,466
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	4,953,846,149,397	6,023,380,946,800

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第16期 自 2016年7月9日 至 2017年7月8日 16th Fiscal Year From July 9, 2016 to July 8, 2017	第17期 自 2017年7月9日 至 2018年7月8日 17th Fiscal Year From July 9, 2017 to July 8, 2018
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	71,218,340,342	97,787,904,022
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	987,359,736,649	453,148,362,913
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	18,102,771,818	8,024,762,020
その他収益 Other revenue	2,724,228,545	2,327,096,424
営業収益合計 Total operating revenue	1,079,405,077,354	561,288,125,379
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△259,274,325	△129,831,137
受託者報酬 Trustee fee	2,119,505,974	2,705,306,545
委託者報酬 Investment trust management fee	7,310,276,739	9,946,379,381
その他費用 Other expenses	92,603,140	118,087,188

営業費用合計 Total operating expenses	9,263,111,528	12,639,941,977
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	1,070,141,965,826	548,648,183,402
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	1,070,141,965,826	548,648,183,402
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	1,070,141,965,826	548,648,183,402
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	575,412,563,040	1,812,267,854,432
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	570,262,954,393	937,094,187,264
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	570,262,954,393	937,094,187,264
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	338,891,960,323	725,017,043,173
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	338,891,960,323	725,017,043,173
分配金 Dividends	64,657,668,504	87,528,809,550
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	1,812,267,854,432	2,485,464,372,375

(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った場合、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、2017年7月9日から2018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16期 2017年7月8日現在	第17期 2018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 226,075,764口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 250,082,313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 20,323.2円 (10口当たり純資産額) (203,232円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 22,245.6円 (10口当たり純資産額) (222,456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	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 344,979,569,450円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自2016年7月9日 至2017年7月8日	第17期 自2017年7月9日 至2018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;">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	<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;">100,244,831,583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;">164,844,577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;">100,409,676,160円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">12,769,773,114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;">87,639,903,046円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">87,528,809,550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;">111,093,496円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">250,082,313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;">3,500円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	100,244,831,583円	分配準備積立金	B	164,844,577円	配当等収益合計額	C=A+B	100,409,676,160円	経費	D	12,769,773,114円	収益分配可能額	E=C-D	87,639,903,046円	収益分配金	F	87,528,809,550円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	111,093,496円	口数	H	250,082,313口	10口当たり分配金	I=F/H×10	3,500円
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	100,244,831,583円																																																											
分配準備積立金	B	164,844,577円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	100,409,676,160円																																																											
経費	D	12,769,773,114円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	87,639,903,046円																																																											
収益分配金	F	87,528,809,550円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	111,093,496円																																																											
口数	H	250,082,313口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	3,500円																																																											

(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16期 自2016年7月9日 至2017年7月8日	第17期 自2017年7月9日 至2018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
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 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っております。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

<p>○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	
---	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第16期 2017年7月8日現在	第17期 2018年7月8日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第16期 自2016年7月9日 至2017年7月8日	第17期 自2017年7月9日 至2018年7月8日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第16期 自2016年7月9日 至2017年7月8日	第17期 自2017年7月9日 至2018年7月8日
期首元本額 2,315,212,469,665円	期首元本額 2,782,314,427,548円
期中追加設定元本額 1,085,924,021,030円	期中追加設定元本額 1,159,410,594,870円
期中一部交換元本額 618,822,063,147円	期中一部交換元本額 863,961,996,327円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第16期 自2016年7月9日 至2017年7月8日	第17期 自2017年7月9日 至2018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	824,019,838,317	322,424,213,042
合計	824,019,838,317	322,424,213,042

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16期(2017年7月8日現在)			第17期(2018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	56,682,120,000	-	56,259,000,000	△424,490,520	49,317,400,000	-	47,960,000,000	△1,358,469,200
合計	56,682,120,000	-	56,259,000,000	△424,490,520	49,317,400,000	-	47,960,000,000	△1,358,469,200

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年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	9,392,000	537.00	5,043,504,000	貸付有価証券 141,500株
		マルハニチロ	939,200	4,210.00	3,954,032,000	貸付有価証券 92,400株
		国際石油開発帝石	3,756,800	1,153.50	4,333,468,800	
		コムシスホールディングス	9,392,000	2,783.00	26,137,936,000	貸付有価証券 375,500株
		大成建設	1,878,400	6,000.00	11,270,400,000	
		大林組	9,392,000	1,081.00	10,152,752,000	
		清水建設	9,392,000	1,122.00	10,537,824,000	
		長谷工コーポレーション	1,878,400	1,466.00	2,753,734,400	
		鹿島建設	9,392,000	806.00	7,569,952,000	
		大和ハウス工業	9,392,000	3,845.00	36,112,240,000	
		積水ハウス	9,392,000	1,892.50	17,774,360,000	
		日揮	9,392,000	1,989.00	18,680,688,000	貸付有価証券 729,000株
		千代田化工建設	9,392,000	884.00	8,302,528,000	貸付有価証券 1,963,900株
		日清製粉グループ本社	9,392,000	2,206.00	20,718,752,000	
		明治ホールディングス	1,878,400	9,030.00	16,961,952,000	貸付有価証券 9,200株
		日本ハム	4,696,000	4,285.00	20,122,360,000	貸付有価証券 20,400株
サッポロホールディングス	1,878,400	2,668.00	5,011,571,200	貸付有価証券 689,100株		
アサヒグループホールデ	9,392,000	5,566.00	52,275,872,000			

インダストリアル				
麒麟ホールディングス	9,392,000	2,895.50	27,194,536,000	貸付有価証券 77,300株
宝ホールディングス	9,392,000	1,374.00	12,904,608,000	貸付有価証券 33,500株
キッコーマン	9,392,000	5,270.00	49,495,840,000	
味の素	9,392,000	2,071.50	19,455,528,000	貸付有価証券 172,600株
ニチレイ	4,696,000	2,635.00	12,373,960,000	貸付有価証券 700株
日本たばこ産業	9,392,000	3,039.00	28,542,288,000	貸付有価証券 131,600株
東洋紡	939,200	1,786.00	1,677,411,200	貸付有価証券 14,600株
ユニチカ	939,200	615.00	577,608,000	貸付有価証券 117,500株
帝人	1,878,400	2,013.00	3,781,219,200	貸付有価証券 42,900株
東レ	9,392,000	865.80	8,131,593,600	貸付有価証券 729,400株
王子ホールディングス	9,392,000	675.00	6,339,600,000	
日本製紙	939,200	1,756.00	1,649,235,200	貸付有価証券 770,100株
クラレ	9,392,000	1,483.00	13,928,336,000	貸付有価証券 46,900株
旭化成	9,392,000	1,401.50	13,162,888,000	
昭和電工	939,200	4,880.00	4,583,296,000	貸付有価証券 152,000株
住友化学	9,392,000	616.00	5,785,472,000	貸付有価証券 25,000株
日産化学	9,392,000	5,030.00	47,241,760,000	
東ソー	4,696,000	1,711.00	8,034,856,000	
トクヤマ	1,878,400	3,345.00	6,283,248,000	
デンカ	1,878,400	3,550.00	6,668,320,000	貸付有価証券 200株
信越化学工業	9,392,000	10,070.00	94,577,440,000	貸付有価証券 446,300株
三井化学	1,878,400	2,903.00	5,452,995,200	
三菱ケミカルホールディングス	4,696,000	918.20	4,311,867,200	
宇部興産	939,200	2,856.00	2,682,355,200	
日本化薬	9,392,000	1,158.00	10,875,936,000	貸付有価証券 4,700株
花王	9,392,000	8,102.00	76,093,984,000	貸付有価証券 207,400株
富士フイルムホールディングス	9,392,000	4,229.00	39,718,768,000	

ングス				
資生堂	9,392,000	8,180.00	76,826,560,000	
日東電工	9,392,000	8,058.00	75,680,736,000	貸付有価証券 631,600株
協和発酵キリン	9,392,000	2,175.00	20,427,600,000	
武田薬品工業	9,392,000	4,623.00	43,419,216,000	貸付有価証券 2,691,700株
アステラス製薬	46,960,000	1,721.00	80,818,160,000	貸付有価証券 1,992,500株
大日本住友製薬	9,392,000	2,354.00	22,108,768,000	貸付有価証券 1,800,000株
塩野義製薬	9,392,000	5,559.00	52,210,128,000	
中外製薬	9,392,000	5,650.00	53,064,800,000	貸付有価証券 200株
エーザイ	9,392,000	9,206.00	86,462,752,000	貸付有価証券 578,300株
第一三共	9,392,000	4,194.00	39,390,048,000	
大塚ホールディングス	9,392,000	5,035.00	47,288,720,000	
昭和シェル石油	9,392,000	1,546.00	14,520,032,000	貸付有価証券 54,600株
J X T Gホールディングス	9,392,000	770.10	7,232,779,200	
横浜ゴム	4,696,000	2,217.00	10,411,032,000	貸付有価証券 122,500株
ブリヂストン	9,392,000	4,092.00	38,432,064,000	貸付有価証券 191,800株
A G C	1,878,400	4,260.00	8,001,984,000	
日本板硝子	939,200	1,042.00	978,646,400	貸付有価証券 770,100株 (30,800株)
日本電気硝子	2,817,600	3,060.00	8,621,856,000	貸付有価証券 26,400株
住友大阪セメント	9,392,000	511.00	4,799,312,000	貸付有価証券 3,347,000株 (206,000株)
太平洋セメント	939,200	3,505.00	3,291,896,000	
東海カーボン	9,392,000	2,008.00	18,859,136,000	貸付有価証券 7,701,400株
T O T O	4,696,000	5,090.00	23,902,640,000	貸付有価証券 175,800株
日本碍子	9,392,000	1,907.00	17,910,544,000	貸付有価証券 17,000株
新日鐵住金	939,200	2,102.50	1,974,668,000	貸付有価証券 23,100株
神戸製鋼所	939,200	1,004.00	942,956,800	
ジェイ エフ イー ホ	939,200	2,030.00	1,906,576,000	

ールディングス				
日新製鋼	939,200	1,476.00	1,386,259,200	貸付有価証券 6,500株
大太平洋金属	939,200	3,620.00	3,399,904,000	貸付有価証券 586,100株 (21,800 株)
日本軽金属ホールディングス	9,392,000	243.00	2,282,256,000	
三井金属鉱業	939,200	4,135.00	3,883,592,000	貸付有価証券 11,900株
東邦亜鉛	939,200	3,840.00	3,606,528,000	貸付有価証券 39,500株
三菱マテリアル	939,200	2,861.00	2,687,051,200	
住友金属鉱山	4,696,000	3,954.00	18,567,984,000	貸付有価証券 100株
DOWAホールディングス	1,878,400	3,275.00	6,151,760,000	貸付有価証券 334,500株
古河機械金属	939,200	1,583.00	1,486,753,600	貸付有価証券 27,100株
古河電気工業	939,200	3,680.00	3,456,256,000	貸付有価証券 37,600株
住友電気工業	9,392,000	1,626.00	15,271,392,000	
フジクラ	9,392,000	663.00	6,226,896,000	
SUMCO	939,200	2,233.00	2,097,233,600	貸付有価証券 770,100株
東洋製罐グループホールディングス	9,392,000	1,952.00	18,333,184,000	貸付有価証券 23,600株
日本製鋼所	1,878,400	2,729.00	5,126,153,600	貸付有価証券 700株
オークマ	1,878,400	5,660.00	10,631,744,000	貸付有価証券 34,300株
アマダホールディングス	9,392,000	1,060.00	9,955,520,000	
小松製作所	9,392,000	3,215.00	30,195,280,000	
住友重機械工業	1,878,400	3,740.00	7,025,216,000	
日立建機	9,392,000	3,545.00	33,294,640,000	貸付有価証券 649,000株
クボタ	9,392,000	1,778.00	16,698,976,000	貸付有価証券 259,300株
荏原製作所	1,878,400	3,365.00	6,320,816,000	貸付有価証券 209,600株
ダイキン工業	9,392,000	12,610.00	118,433,120,000	
日本精工	9,392,000	1,137.00	10,678,704,000	貸付有価証券 524,500株
NTN	9,392,000	452.00	4,245,184,000	貸付有価証券 986,300株
ジェイテクト	9,392,000	1,492.00	14,012,864,000	

日立造船	1,878,400	513.00	963,619,200	貸付有価証券 80,500株
三菱重工業	939,200	4,041.00	3,795,307,200	貸付有価証券 42,900株
I H I	939,200	3,795.00	3,564,264,000	
日清紡ホールディングス	9,392,000	1,168.00	10,969,856,000	貸付有価証券 354,400株
コニカミノルタ	9,392,000	981.00	9,213,552,000	貸付有価証券 134,000株
ミネベアミツミ	9,392,000	1,832.00	17,206,144,000	貸付有価証券 326,200株
日立製作所	9,392,000	758.80	7,126,649,600	
三菱電機	9,392,000	1,411.50	13,256,808,000	
富士電機	9,392,000	814.00	7,645,088,000	貸付有価証券 527,000株
安川電機	9,392,000	3,790.00	35,595,680,000	貸付有価証券 4,854,000株
ジーエス・ユアサコーポレーション	9,392,000	492.00	4,620,864,000	貸付有価証券 125,000株
日本電気	939,200	2,999.00	2,816,660,800	
富士通	9,392,000	697.80	6,553,737,600	
沖電気工業	939,200	1,260.00	1,183,392,000	貸付有価証券 496,700株
セイコーエプソン	18,784,000	1,894.00	35,576,896,000	
パナソニック	9,392,000	1,410.00	13,242,720,000	
ソニー	9,392,000	5,450.00	51,186,400,000	貸付有価証券 328,400株
T D K	9,392,000	11,220.00	105,378,240,000	貸付有価証券 398,500株
アルプス電気	9,392,000	2,934.00	27,556,128,000	貸付有価証券 280,700株
パイオニア	9,392,000	145.00	1,361,840,000	貸付有価証券 7,623,100株 (979,700株)
横河電機	9,392,000	1,941.00	18,229,872,000	
アドバンテスト	18,784,000	2,285.00	42,921,440,000	貸付有価証券 1,756,200株
カシオ計算機	9,392,000	1,829.00	17,177,968,000	貸付有価証券 4,003,300株
ファナック	9,392,000	21,300.00	200,049,600,000	貸付有価証券 192,900株
京セラ	18,784,000	6,124.00	115,033,216,000	
太陽誘電	9,392,000	3,160.00	29,678,720,000	貸付有価証券 2,170,000株 (476,000株)
S C R E E Nホールディ	1,878,400	7,790.00	14,632,736,000	

ングス				
キヤノン	14,088,000	3,480.00	49,026,240,000	貸付有価証券 4,400,900株
リコー	9,392,000	1,008.00	9,467,136,000	貸付有価証券 4,552,300株
東京エレクトロン	9,392,000	18,115.00	170,136,080,000	貸付有価証券 414,600株
デンソー	9,392,000	5,206.00	48,894,752,000	貸付有価証券 691,200株
三井E&Sホールディングス	939,200	1,399.00	1,313,940,800	貸付有価証券 589,000株(109,800株)
川崎重工業	939,200	3,150.00	2,958,480,000	貸付有価証券 12,200株
日産自動車	9,392,000	1,051.50	9,875,688,000	
いすゞ自動車	4,696,000	1,381.50	6,487,524,000	
トヨタ自動車	9,392,000	7,162.00	67,265,504,000	貸付有価証券 1,148,600株
日野自動車	9,392,000	1,157.00	10,866,544,000	貸付有価証券 85,400株
三菱自動車工業	939,200	866.00	813,347,200	貸付有価証券 281,100株
マツダ	1,878,400	1,326.00	2,490,758,400	貸付有価証券 42,900株(28,200株)
本田技研工業	18,784,000	3,228.00	60,634,752,000	
スズキ	9,392,000	6,134.00	57,610,528,000	貸付有価証券 566,200株
S U B A R U	9,392,000	3,173.00	29,800,816,000	
ヤマハ発動機	9,392,000	2,781.00	26,119,152,000	貸付有価証券 160,200株
テルモ	18,784,000	6,020.00	113,079,680,000	貸付有価証券 28,700株
ニコン	9,392,000	1,715.00	16,107,280,000	
オリンパス	9,392,000	4,150.00	38,976,800,000	貸付有価証券 84,000株
シチズン時計	9,392,000	686.00	6,442,912,000	貸付有価証券 422,600株
凸版印刷	9,392,000	819.00	7,692,048,000	貸付有価証券 4,000株
大日本印刷	4,696,000	2,345.00	11,012,120,000	貸付有価証券 270,600株
ヤマハ	9,392,000	5,420.00	50,904,640,000	貸付有価証券 32,900株
東京電力ホールディングス	939,200	524.00	492,140,800	貸付有価証券 147,000株
中部電力	939,200	1,692.00	1,589,126,400	貸付有価証券 63,000株

関西電力	939,200	1,607.00	1,509,294,400	貸付有価証券 400株
東京瓦斯	1,878,400	2,868.00	5,387,251,200	貸付有価証券 22,800株
大阪瓦斯	1,878,400	2,259.50	4,244,244,800	貸付有価証券 37,300株
東武鉄道	1,878,400	3,260.00	6,123,584,000	貸付有価証券 8,600株
東京急行電鉄	4,696,000	1,818.00	8,537,328,000	
小田急電鉄	4,696,000	2,289.00	10,749,144,000	貸付有価証券 45,100株
京王電鉄	1,878,400	5,300.00	9,955,520,000	貸付有価証券 23,500株
京成電鉄	4,696,000	3,665.00	17,210,840,000	貸付有価証券 102,300株
東日本旅客鉄道	939,200	10,285.00	9,659,672,000	貸付有価証券 1,600株
西日本旅客鉄道	939,200	7,964.00	7,479,788,800	貸付有価証券 7,500株
東海旅客鉄道	939,200	22,215.00	20,864,328,000	
日本通運	939,200	7,490.00	7,034,608,000	
ヤマトホールディングス	9,392,000	3,057.00	28,711,344,000	貸付有価証券 477,000株
日本郵船	939,200	2,103.00	1,975,137,600	貸付有価証券 123,200株
商船三井	939,200	2,632.00	2,471,974,400	貸付有価証券 202,100株
川崎汽船	939,200	1,904.00	1,788,236,800	貸付有価証券 764,200株 (64,500株)
A N Aホールディングス	939,200	3,974.00	3,732,380,800	貸付有価証券 2,700株
三菱倉庫	4,696,000	2,445.00	11,481,720,000	貸付有価証券 702,200株
ヤフー	3,756,800	354.00	1,329,907,200	貸付有価証券 3,055,600株 (86,600株)
トレンドマイクロ	9,392,000	6,270.00	58,887,840,000	貸付有価証券 12,100株
スカパー J S A Tホールディングス	939,200	545.00	511,864,000	貸付有価証券 3,200株
日本電信電話	1,878,400	4,966.00	9,328,134,400	貸付有価証券 99,900株
K D D I	56,352,000	3,082.00	173,676,864,000	貸付有価証券 1,761,200株
N T T ドコモ	939,200	2,808.50	2,637,743,200	
東宝	939,200	3,465.00	3,254,328,000	

エヌ・ティ・ティ・データ	46,960,000	1,248.00	58,606,080,000	
コナミホールディングス	9,392,000	5,410.00	50,810,720,000	貸付有価証券 183,900株
ソフトバンクグループ	28,176,000	8,293.00	233,663,568,000	貸付有価証券 772,900株
双日	939,200	402.00	377,558,400	
伊藤忠商事	9,392,000	1,967.50	18,478,760,000	
丸紅	9,392,000	835.80	7,849,833,600	
豊田通商	9,392,000	3,650.00	34,280,800,000	
三井物産	9,392,000	1,847.00	17,347,024,000	
住友商事	9,392,000	1,815.50	17,051,176,000	
三菱商事	9,392,000	3,109.00	29,199,728,000	貸付有価証券 638,200株
J. フロント リテイリング	4,696,000	1,602.00	7,522,992,000	貸付有価証券 1,800株
三越伊勢丹ホールディングス	9,392,000	1,380.00	12,960,960,000	貸付有価証券 951,400株
セブン&アイ・ホールディングス	9,392,000	4,566.00	42,883,872,000	貸付有価証券 1,029,800株
ユニー・ファミリーマートホールディングス	9,392,000	11,210.00	105,284,320,000	貸付有価証券 5,290,600株 (480,500株)
高島屋	9,392,000	908.00	8,527,936,000	貸付有価証券 287,000株 (36,000株)
丸井グループ	9,392,000	2,201.00	20,671,792,000	貸付有価証券 663,700株
イオン	9,392,000	2,230.00	20,944,160,000	貸付有価証券 1,722,400株 (17,000株)
ファーストリテイリング	9,392,000	47,760.00	448,561,920,000	貸付有価証券 1,242,100株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	9,392,000	542.00	5,090,464,000	
新生銀行	939,200	1,662.00	1,560,950,400	貸付有価証券 749,000株
あおぞら銀行	939,200	4,155.00	3,902,376,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,392,000	618.60	5,809,891,200	貸付有価証券 1,902,300株
りそなホールディングス	939,200	580.30	545,017,760	
三井住友トラスト・ホールディングス	939,200	4,353.00	4,088,337,600	
三井住友フィナンシャルグループ	939,200	4,208.00	3,952,153,600	
千葉銀行	9,392,000	749.00	7,034,608,000	貸付有価証券 207,000株

ふくおかフィナンシャルグループ	9,392,000	545.00	5,118,640,000	貸付有価証券 803,000株
静岡銀行	9,392,000	956.00	8,978,752,000	
みずほフィナンシャルグループ	9,392,000	185.30	1,740,337,600	
大和証券グループ本社	9,392,000	633.30	5,947,953,600	
野村ホールディングス	9,392,000	528.90	4,967,428,800	
松井証券	9,392,000	1,048.00	9,842,816,000	貸付有価証券 24,500株
S O M P Oホールディングス	2,348,000	4,355.00	10,225,540,000	
MS&ADインシュアランスグループホール	2,817,600	3,421.00	9,639,009,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,878,400	2,035.00	3,822,544,000	貸付有価証券 218,900株
第一生命ホールディングス	939,200	1,937.50	1,819,700,000	
東京海上ホールディングス	4,696,000	5,245.00	24,630,520,000	貸付有価証券 348,600株
T&Dホールディングス	1,878,400	1,586.00	2,979,142,400	貸付有価証券 7,400株
クレディセゾン	9,392,000	1,633.00	15,337,136,000	貸付有価証券 20,700株
東急不動産ホールディングス	9,392,000	738.00	6,931,296,000	貸付有価証券 156,800株
三井不動産	9,392,000	2,657.00	24,954,544,000	貸付有価証券 5,900株
三菱地所	9,392,000	1,909.50	17,934,024,000	
東京建物	4,696,000	1,481.00	6,954,776,000	貸付有価証券 59,700株
住友不動産	9,392,000	4,062.00	38,150,304,000	貸付有価証券 13,000株
ディー・エヌ・エー	2,817,600	2,055.00	5,790,168,000	
電通	9,392,000	5,030.00	47,241,760,000	貸付有価証券 94,000株
楽天	9,392,000	736.00	6,912,512,000	貸付有価証券 1,736,900株
リクルートホールディングス	28,176,000	2,996.50	84,429,384,000	貸付有価証券 1,464,000株
日本郵政	9,392,000	1,206.00	11,326,752,000	
東京ドーム	4,696,000	950.00	4,461,200,000	貸付有価証券 30,200株
セコム	9,392,000	8,351.00	78,432,592,000	貸付有価証券 590,100株
小計	銘柄数：225 組入時価比率：99.1%		5,514,892,048,960	100.0%

合計			5,514,892,048,960	
----	--	--	-------------------	--

(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(2018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。