



2019年7月期 (2018年7月11日～2019年7月10日) 決算短信
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2019 (July 11, 2018 - July 10, 2019)

2019年8月21日
August 21, 2019

上場取引所 東京・名古屋・福岡・札幌
Listed Exchange TSE,NSE,FSE,SSE

ファンド名 日経300株価指数連動型上場投資信託
コード番号 (1319)
連動対象指標 日経株価指数 300
主要投資資産 株式
売買単位 1,000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: Nikkei 300 Index Exchange Traded Fund
Code: 1319
Underlying index: Nikkei Stock Index 300
Primary invested assets: Stocks
Trading unit: 1,000 units
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9月26日
分配金支払開始日 2019年8月16日
Scheduled date of submission of securities report: September 26, 2019
Date of commencing dividend payment: August 16, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年7月期の運用状況 (2018年7月11日～2019年7月10日)

Management Status for Year ended July 2019 (from July 11, 2018 to July 10, 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7月期 FY ended Jul. 2019	9,527	(99.9)	8	(0.1)	9,536	(100.0)
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	10,105	(99.8)	18	(0.2)	10,123	(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7月期 FY ended Jul. 2019	30,294	0	0	30,294
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	34,632	3,600	7,937	30,294

(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))	100口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	9,759	223	9,536	31,478
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	10,333	209	10,123	33,418

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	671.3
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	625.1

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24期 (2018年7月10日現在) 24th Fiscal Year As of July 10, 2018	第25期 (2019年7月10日現在) 25th Fiscal Year As of July 10, 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	214,201,880	216,606,008
株式 Stocks	10,105,108,200	9,527,515,210
未収入金 Accounts receivable - other	-	681,240
未収配当金 Accrued dividends receivable	14,503,150	15,143,850
流動資産合計 Total current assets	10,333,813,230	9,759,946,308
資産合計 Total assets	10,333,813,230	9,759,946,308
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	189,372,751	203,368,945
未払受託者報酬 Trustee fee payable	3,926,406	3,926,405
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	16,490,782	16,490,783
未払利息 Accrued interest expenses	435	484
その他未払費用 Other accrued expenses	78,430	78,433
流動負債合計 Total current liabilities	209,868,804	223,865,050
負債合計 Total liabilities	209,868,804	223,865,050
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	7,331,339,906	7,331,339,906
剰余金 Surplus		

期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,792,604,520	2,204,741,352
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	27,258	28,252
元本等合計 Total principal and other	10,123,944,426	9,536,081,258
純資産合計 Total net assets	10,123,944,426	9,536,081,258
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	10,333,813,230	9,759,946,308

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第24期 自 2017年7月11日 至 2018年7月10日 24th Fiscal Year From July 11, 2017 to July 10, 2018	第25期 自 2018年7月11日 至 2019年7月10日 25th Fiscal Year From July 11, 2018 to July 10, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	232,121,511	244,590,098
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	613,934,370	△587,864,162
その他収益 Other revenue	145,412	177,462
営業収益合計 Total operating revenue	846,201,293	△343,096,602
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	66,140	66,642
受託者報酬 Trustee fee	8,203,811	7,917,890
委託者報酬 Investment trust management fee	34,455,753	33,254,892
その他費用 Other expenses	163,926	158,197
営業費用合計 Total operating expenses	42,889,630	41,397,621
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	803,311,663	△384,494,223
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	803,311,663	△384,494,223
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	803,311,663	△384,494,223
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 (△)	2,568,870,083	2,792,604,520

Surplus (deficit) at beginning of period		
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	295,704,000	-
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	295,704,000	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	685,908,475	-
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	685,908,475	-
分配金 Dividends	189,372,751	203,368,945
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,792,604,520	2,204,741,352

(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。
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。
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	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年7月11日から2019年7月10日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第24期 2018年7月10日現在	第25期 2019年7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 30,294,793 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 30,294,793 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 334.18 円 (100口当たり純資産額) (33,418 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 314.78 円 (100口当たり純資産額) (31,478 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第24期 自2017年7月11日 至2018年7月10日	第25期 自2018年7月11日 至2019年7月10日																														
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																														
<table border="1"> <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>232,200,783 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>22,716 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>232,223,499 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>42,823,490 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	232,200,783 円	分配準備積立金	B	22,716 円	配当等収益合計額	C=A+B	232,223,499 円	経費	D	42,823,490 円	<table border="1"> <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>244,700,918 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>27,258 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>244,728,176 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>41,330,979 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	244,700,918 円	分配準備積立金	B	27,258 円	配当等収益合計額	C=A+B	244,728,176 円	経費	D	41,330,979 円
項目																															
当期配当等収益額	A	232,200,783 円																													
分配準備積立金	B	22,716 円																													
配当等収益合計額	C=A+B	232,223,499 円																													
経費	D	42,823,490 円																													
項目																															
当期配当等収益額	A	244,700,918 円																													
分配準備積立金	B	27,258 円																													
配当等収益合計額	C=A+B	244,728,176 円																													
経費	D	41,330,979 円																													

収益分配可能額	E=C-D	189,400,009円	収益分配可能額	E=C-D	203,397,197円
収益分配金	F	189,372,751円	収益分配金	F	203,368,945円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,258円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	28,252円
口数	H	30,294,793口	口数	H	30,294,793口
100口当たり分配金	I=F/H×100	625円10銭	100口当たり分配金	I=F/H×100	671円30銭

(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24期 自2017年7月11日 至2018年7月10日	第25期 自2018年7月11日 至2019年7月10日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>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。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>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っております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>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っております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第24期 2018年7月10日現在	第25期 2019年7月10日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>株式</p> <p>(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>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第24期 自2017年7月11日 至2018年7月10日	第25期 自2018年7月11日 至2019年7月10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	同左

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。

(その他の注記)

1 元本の移動

第24期 自 2017年7月11日 至 2018年7月10日		第25期 自 2018年7月11日 至 2019年7月10日	
期首元本額	8,380,987,318円	期首元本額	7,331,339,906円
期中追加設定元本額	871,200,000円	期中追加設定元本額	0円
期中一部交換元本額	1,920,847,412円	期中一部交換元本額	0円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第24期 自 2017年7月11日 至 2018年7月10日	第25期 自 2018年7月11日 至 2019年7月10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	524,280,888	△584,667,083
合計	524,280,888	△584,667,083

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式(2019年7月10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	7,200	698.00	5,025,600	
		マルハニチロ	1,200	3,285.00	3,942,000	
		サカタのタネ	1,100	3,190.00	3,509,000	
		ホクト	800	1,852.00	1,481,600	
		国際石油開発帝石	33,900	973.80	33,011,820	
		コムシスホールディングス	3,300	2,741.00	9,045,300	
		大成建設	5,200	3,935.00	20,462,000	
		大林組	16,700	1,063.00	17,752,100	
		清水建設	18,300	893.00	16,341,900	
		鹿島建設	12,300	1,470.00	18,081,000	
		西松建設	1,300	2,135.00	2,775,500	
		前田建設工業	4,600	880.00	4,048,000	
		奥村組	1,100	3,300.00	3,630,000	
		戸田建設	7,500	612.00	4,590,000	
		大東建託	1,800	14,015.00	25,227,000	

N I P P O	2,800	2,103.00	5,888,400
前田道路	2,200	2,321.00	5,106,200
住友林業	4,200	1,300.00	5,460,000
大和ハウス工業	15,400	3,187.00	49,079,800
積水ハウス	16,000	1,848.50	29,576,000
中電工	1,300	2,336.00	3,036,800
関電工	4,800	929.00	4,459,200
九電工	1,600	3,445.00	5,512,000
日揮	6,000	1,503.00	9,018,000
高砂熱学工業	1,800	1,783.00	3,209,400
日清製粉グループ本社	7,100	2,477.00	17,586,700
山崎製パン	5,100	1,712.00	8,731,200
ヤクルト本社	4,000	6,370.00	25,480,000
明治ホールディングス	3,500	7,690.00	26,915,000
雪印メグミルク	1,600	2,379.00	3,806,400
日本ハム	2,400	4,605.00	11,052,000
伊藤ハム米久ホールディングス	6,900	724.00	4,995,600
サッポロホールディングス	1,800	2,404.00	4,327,200
アサヒグループホールディングス	11,200	5,024.00	56,268,800
麒麟ホールディングス	21,200	2,367.00	50,180,400
宝ホールディングス	4,700	1,158.00	5,442,600
伊藤園	2,100	5,100.00	10,710,000
キッコーマン	4,500	4,830.00	21,735,000
味の素	12,700	1,872.00	23,774,400
キューピー	3,500	2,530.00	8,855,000
ハウス食品グループ本社	2,300	4,190.00	9,637,000
ニチレイ	3,200	2,670.00	8,544,000
日清食品ホールディングス	2,400	6,900.00	16,560,000
日本たばこ産業	30,900	2,447.50	75,627,750
東洋紡	2,100	1,319.00	2,769,900
帝人	4,600	1,819.00	8,367,400
東レ	37,800	770.00	29,106,000
ワコールホールディングス	1,600	2,806.00	4,489,600
オンワードホールディングス	3,700	585.00	2,164,500
王子ホールディングス	23,500	588.00	13,818,000

日本製紙	2,700	1,901.00	5,132,700
レンゴー	6,300	830.00	5,229,000
クラレ	8,200	1,254.00	10,282,800
旭化成	32,500	1,103.00	35,847,500
住友化学	38,400	483.00	18,547,200
デンカ	2,100	3,130.00	6,573,000
信越化学工業	9,900	9,691.00	95,940,900
大陽日酸	10,000	2,139.00	21,390,000
日本触媒	900	7,100.00	6,390,000
カネカ	1,600	3,995.00	6,392,000
三菱瓦斯化学	5,300	1,411.00	7,478,300
三井化学	4,700	2,524.00	11,862,800
東京応化工業	1,000	3,370.00	3,370,000
三菱ケミカルホールディングス	34,900	743.40	25,944,660
ダイセル	7,700	934.00	7,191,800
積水化学工業	11,200	1,604.00	17,964,800
宇部興産	2,500	2,185.00	5,462,500
日立化成	4,800	2,945.00	14,136,000
花王	11,300	8,275.00	93,507,500
日本ペイントホールディングス	7,500	4,400.00	33,000,000
D I C	2,200	2,811.00	6,184,200
東洋インキS Cホールディングス	1,400	2,315.00	3,241,000
富士フイルムホールディングス	11,900	5,415.00	64,438,500
資生堂	9,300	8,124.00	75,553,200
ライオン	6,900	2,103.00	14,510,700
日東電工	3,700	5,084.00	18,810,800
ユニ・チャーム	14,400	3,187.00	45,892,800
協和キリン	12,500	1,913.00	23,912,500
武田薬品工業	36,500	3,862.00	140,963,000
アステラス製薬	43,800	1,572.50	68,875,500
塩野義製薬	7,300	6,238.00	45,537,400
田辺三菱製薬	13,000	1,237.00	16,081,000
中外製薬	13,000	7,250.00	94,250,000
エーザイ	6,900	6,156.00	42,476,400
第一三共	16,400	5,955.00	97,662,000

大塚ホールディングス	12,900	3,886.00	50,129,400
大正製薬ホールディングス	2,000	8,480.00	16,960,000
出光興産	7,000	3,190.00	22,330,000
J X T Gホールディングス	77,200	535.10	41,309,720
横浜ゴム	3,900	2,042.00	7,963,800
ブリヂストン	17,600	4,204.00	73,990,400
住友ゴム工業	6,100	1,232.00	7,515,200
A G C	5,300	3,680.00	19,504,000
日本板硝子	2,100	719.00	1,509,900
日本電気硝子	2,300	2,738.00	6,297,400
太平洋セメント	2,900	3,175.00	9,207,500
T O T O	4,100	4,330.00	17,753,000
日本碍子	7,600	1,564.00	11,886,400
日本製鉄	22,000	1,813.00	39,886,000
神戸製鋼所	8,400	692.00	5,812,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	14,200	1,523.50	21,633,700
日立金属	9,900	1,186.00	11,741,400
日本軽金属ホールディングス	14,400	228.00	3,283,200
三井金属鉱業	1,300	2,428.00	3,156,400
三菱マテリアル	3,000	2,999.00	8,997,000
住友金属鉱山	6,700	3,135.00	21,004,500
D O W Aホールディングス	1,400	3,370.00	4,718,000
古河機械金属	900	1,388.00	1,249,200
古河電気工業	1,600	3,175.00	5,080,000
住友電気工業	18,400	1,415.50	26,045,200
フジクラ	6,900	413.00	2,849,700
S U M C O	6,800	1,300.00	8,840,000
東洋製罐グループホールディングス	4,700	2,059.00	9,677,300
三和ホールディングス	5,400	1,138.00	6,145,200
L I X I Lグループ	7,300	1,802.00	13,154,600
オークマ	800	5,540.00	4,432,000
アマダホールディングス	8,500	1,199.00	10,191,500
S M C	1,600	39,620.00	63,392,000
小松製作所	22,500	2,523.50	56,778,750
住友重機械工業	2,800	3,615.00	10,122,000

日立建機	5,000	2,731.00	13,655,000
クボタ	28,600	1,747.00	49,964,200
荏原製作所	2,400	2,889.00	6,933,600
ダイキン工業	6,800	14,160.00	96,288,000
栗田工業	2,700	2,740.00	7,398,000
椿本チエイン	900	3,520.00	3,168,000
ダイフク	2,900	5,950.00	17,255,000
平和	2,300	2,177.00	5,007,100
アマノ	1,800	3,040.00	5,472,000
セガサミーホールディングス	6,200	1,349.00	8,363,800
日本精工	12,800	940.00	12,032,000
NTN	12,300	314.00	3,862,200
ジェイテクト	8,000	1,315.00	10,520,000
不二越	600	4,475.00	2,685,000
三菱重工業	7,800	4,789.00	37,354,200
I H I	3,600	2,466.00	8,877,600
日清紡ホールディングス	4,100	816.00	3,345,600
コニカミノルタ	11,600	1,081.00	12,539,600
ブラザー工業	6,100	2,098.00	12,797,800
ミネベアミツミ	9,900	1,785.00	17,671,500
日立製作所	22,400	4,057.00	90,876,800
三菱電機	49,800	1,450.00	72,210,000
富士電機	3,500	3,695.00	12,932,500
日本電気	6,000	4,385.00	26,310,000
富士通	4,800	7,778.00	37,334,400
パナソニック	56,900	927.50	52,774,750
ソニー	29,500	5,955.00	175,672,500
TDK	3,000	8,460.00	25,380,000
キーエンス	2,800	65,170.00	182,476,000
ファナック	4,700	19,595.00	92,096,500
京セラ	8,800	7,098.00	62,462,400
村田製作所	15,700	4,849.00	76,129,300
キヤノン	30,900	3,193.00	98,663,700
リコー	17,300	1,052.00	18,199,600
東京エレクトロン	3,800	16,405.00	62,339,000

豊田自動織機	7,600	5,890.00	44,764,000
デンソー	18,300	4,564.00	83,521,200
三井E&Sホールディングス	1,900	938.00	1,782,200
川崎重工業	3,900	2,528.00	9,859,200
日産自動車	97,800	773.70	75,667,860
トヨタ自動車	75,600	6,908.00	522,244,800
新明和工業	2,200	1,342.00	2,952,400
本田技研工業	42,000	2,859.50	120,099,000
シマノ	2,100	15,860.00	33,306,000
テルモ	17,600	3,291.00	57,921,600
島津製作所	6,900	2,755.00	19,009,500
ニコン	9,300	1,568.00	14,582,400
オリンパス	31,800	1,216.00	38,668,800
HOYA	8,800	7,998.00	70,382,400
シチズン時計	7,400	565.00	4,181,000
バンダイナムコホールディングス	5,100	5,190.00	26,469,000
トッパン・フォームズ	2,700	931.00	2,513,700
凸版印刷	8,100	1,744.00	14,126,400
大日本印刷	7,500	2,341.00	17,557,500
N I S S H A	1,200	1,151.00	1,381,200
アシックス	4,400	1,170.00	5,148,000
ヤマハ	4,400	5,020.00	22,088,000
ビジョン	2,800	4,035.00	11,298,000
リンテック	1,800	2,221.00	3,997,800
任天堂	3,100	40,000.00	124,000,000
タカラスタンダード	1,700	1,727.00	2,935,900
コクヨ	3,000	1,498.00	4,494,000
オカムラ	2,600	1,059.00	2,753,400
東京電力ホールディングス	37,200	545.00	20,274,000
中部電力	17,600	1,517.50	26,708,000
関西電力	21,800	1,267.50	27,631,500
東北電力	11,700	1,085.00	12,694,500
九州電力	11,000	1,068.00	11,748,000
東京瓦斯	10,500	2,686.00	28,203,000
大阪瓦斯	9,700	1,922.00	18,643,400

東武鉄道	4,900	3,145.00	15,410,500
東京急行電鉄	14,500	1,949.00	28,260,500
小田急電鉄	8,500	2,584.00	21,964,000
東日本旅客鉄道	8,800	10,250.00	90,200,000
西日本旅客鉄道	4,500	8,845.00	39,802,500
東海旅客鉄道	4,800	21,770.00	104,496,000
近鉄グループホールディングス	4,400	5,190.00	22,836,000
阪急阪神ホールディングス	5,900	3,860.00	22,774,000
日本通運	2,300	5,810.00	13,363,000
ヤマトホールディングス	9,500	2,190.00	20,805,000
福山通運	1,300	4,040.00	5,252,000
セイノーホールディングス	4,800	1,403.00	6,734,400
日本郵船	3,900	1,795.00	7,000,500
商船三井	2,800	2,663.00	7,456,400
日本航空	8,100	3,441.00	27,872,100
ANAホールディングス	8,100	3,639.00	29,475,900
三菱倉庫	2,000	2,963.00	5,926,000
三井倉庫ホールディングス	600	1,526.00	915,600
住友倉庫	2,000	1,383.00	2,766,000
上組	3,100	2,517.00	7,802,700
T I S	2,000	5,790.00	11,580,000
ネクソン	20,800	1,697.00	35,297,600
野村総合研究所	17,500	1,761.00	30,817,500
オービック	2,300	11,860.00	27,278,000
ヤフー	154,400	332.00	51,260,800
トレンドマイクロ	3,300	4,935.00	16,285,500
日本オラクル	3,000	8,810.00	26,430,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,600	2,837.00	15,887,200
大塚商会	4,400	4,330.00	19,052,000
日本ユニシス	2,500	3,675.00	9,187,500
日本電信電話	29,500	5,170.00	152,515,000
KDD I	54,600	2,857.50	156,019,500
NTTドコモ	77,300	2,573.50	198,931,550
東宝	4,400	4,750.00	20,900,000
エヌ・ティ・ティ・データ	32,500	1,474.00	47,905,000

スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,800	3,750.00	10,500,000
コナミホールディングス	3,300	4,895.00	16,153,500
ソフトバンクグループ	48,400	5,182.00	250,808,800
双日	29,000	348.00	10,092,000
伊藤忠商事	36,700	2,075.00	76,152,500
丸紅	40,300	725.80	29,249,740
豊田通商	8,200	3,340.00	27,388,000
三井物産	40,400	1,807.00	73,002,800
住友商事	29,000	1,638.50	47,516,500
三菱商事	36,900	2,931.50	108,172,350
キヤノンマーケティングジャパン	3,500	2,330.00	8,155,000
岩谷産業	1,200	3,730.00	4,476,000
サンリオ	2,100	2,380.00	4,998,000
スズケン	2,400	6,260.00	15,024,000
ローソン	2,300	5,450.00	12,535,000
エービーシー・マート	1,900	6,640.00	12,616,000
J. フロント リテイリング	6,300	1,290.00	8,127,000
三越伊勢丹ホールディングス	9,200	901.00	8,289,200
セブン&アイ・ホールディングス	20,500	3,773.00	77,346,500
良品計画	700	20,020.00	14,014,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	3,700	6,830.00	25,271,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	11,700	2,678.00	31,332,600
しまむら	900	8,250.00	7,425,000
高島屋	4,100	1,234.00	5,059,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,900	1,269.00	3,680,100
丸井グループ	5,200	2,410.00	12,532,000
イオン	20,200	1,865.00	37,673,000
イズミ	1,700	4,210.00	7,157,000
ヤマダ電機	22,400	499.00	11,177,600
ニトリホールディングス	2,700	14,645.00	39,541,500
ファーストリテイリング	2,500	66,880.00	167,200,000
サンドラッグ	2,800	3,050.00	8,540,000
めぶきフィナンシャルグループ	27,300	284.00	7,753,200
コンコルディア・フィナンシャルグ	28,900	422.00	12,195,800

ループ			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	316,800	526.40	166,763,520
りそなホールディングス	40,700	459.60	18,705,720
三井住友トラスト・ホールディングス	9,000	3,946.00	35,514,000
三井住友フィナンシャルグループ	32,400	3,839.00	124,383,600
千葉銀行	19,500	569.00	11,095,500
ふくおかフィナンシャルグループ	4,400	2,037.00	8,962,800
静岡銀行	14,000	819.00	11,466,000
みずほフィナンシャルグループ	588,500	158.50	93,277,250
大和証券グループ本社	39,400	474.80	18,707,120
野村ホールディングス	81,000	380.40	30,812,400
SOMPOホールディングス	8,700	4,370.00	38,019,000
MS&ADインシュアランスグループホール	13,800	3,590.00	49,542,000
第一生命ホールディングス	27,800	1,634.00	45,425,200
東京海上ホールディングス	16,500	5,656.00	93,324,000
クレディセゾン	4,300	1,295.00	5,568,500
イオンフィナンシャルサービス	5,200	1,759.00	9,146,800
アコム	37,000	385.00	14,245,000
日立キャピタル	2,900	2,336.00	6,774,400
オリックス	30,700	1,636.50	50,240,550
三菱UFJリース	20,800	583.00	12,126,400
日本取引所グループ	12,400	1,710.00	21,204,000
ヒューリック	15,400	918.00	14,137,200
三井不動産	23,000	2,604.00	59,892,000
三菱地所	32,200	2,027.50	65,285,500
住友不動産	11,000	3,983.00	43,813,000
イオンモール	5,300	1,729.00	9,163,700
総合警備保障	2,400	4,965.00	11,916,000
エムスリー	15,700	2,024.00	31,776,800
ディー・エヌ・エー	3,500	2,142.00	7,497,000
博報堂DYホールディングス	9,000	1,806.00	16,254,000
電通	6,700	3,875.00	25,962,500
みらかホールディングス	1,300	2,508.00	3,260,400
オリエンタルランド	8,400	13,830.00	116,172,000

	ユー・エス・エス	7,300	2,155.00	15,731,500	
	楽天	33,200	1,169.00	38,810,800	
	リクルートホールディングス	39,300	3,495.00	137,353,500	
	日本郵政	45,000	1,205.00	54,225,000	
	東京ドーム	2,200	1,015.00	2,233,000	
	トランス・コスモス	1,100	2,466.00	2,712,600	
	セコム	5,400	9,042.00	48,826,800	
	ベネッセホールディングス	2,400	2,552.00	6,124,800	
	小計 銘柄数：300			9,527,515,210	
	組入時価比率：99.9%			100.0%	
	合計			9,527,515,210	

(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。

(2) 株式以外の有価証券(2019年7月10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

該当事項はありません。