



2020年7月期 (2019年7月9日～2020年7月8日) 決算短信  
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2020 (July 9, 2019 - July 8, 2020)

2020年8月19日  
August 19, 2020

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(日経225)  
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: Nikkei 225 Exchange Traded Fund  
Code: 1321  
Underlying index: Nikkei Stock Average(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: 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9月30日  
分配金支払開始日 2020年8月14日  
Scheduled date of submission of securities report: September 30, 2020  
Date of commencing dividend payment: August 14, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年7月期の運用状況 (2019年7月9日～2020年7月8日)

Management Status for Year ended July 2020 (from July 9, 2019 to July 8, 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7月期 FY ended Jul. 2020	6,152,975	(98.4)	96,887	(1.6)	6,249,863	(100.0)
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	6,028,366	(99.6)	25,847	(0.4)	6,054,214	(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7月期 FY ended Jul. 2020	275,190	39,783	42,969	272,004
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	250,082	68,313	43,205	275,190

(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
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	6,701,745	451,882	6,249,863	229,771
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	6,414,827	360,613	6,054,214	220,001

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	3,890
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	4,090

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18期 (2019年7月8日現在) 18th Fiscal Year As of July 8, 2019	第19期 (2020年7月8日現在) 19th Fiscal Year As of July 8, 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	374,299,828,679	528,459,572,501
株式 Stocks	6,028,366,234,680	6,152,975,676,980
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	502,566,406	55,156,662
未収入金 Accounts receivable - other	2,298,634,500	-
未収配当金 Accrued dividends receivable	8,733,409,200	8,172,313,350
未収利息 Accrued interest	26,433,576	53,197,248
その他未収収益 Other accrued revenue	254,479,390	868,299,729
差入委託証拠金 Customers' margin	345,543,100	11,161,300,988
流動資産合計 Total current assets	6,414,827,129,531	6,701,745,517,458
資産合計 Total assets	6,414,827,129,531	6,701,745,517,458
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	-	2,253,238,130
未払金 Accounts payable - other	-	2,194,726,100
未払収益分配金 Unpaid dividends	112,552,973,396	105,809,715,879
未払受託者報酬 Trustee fee payable	1,479,522,517	1,493,351,170
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	5,553,255,406	5,591,903,972
未払利息 Accrued interest expenses	794,643	379,766
有価証券貸借取引受入金 Cash received on debt credit transaction	240,962,633,802	334,474,734,538

of securities		
その他未払費用 Other accrued expenses	63,934,282	64,411,351
流動負債合計 Total current liabilities	360,613,114,046	451,882,460,906
負債合計 Total liabilities	360,613,114,046	451,882,460,906
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	3,386,771,255,708	3,347,558,286,177
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,667,442,759,777	2,902,304,770,375
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	200,662,014	186,704,631
元本等合計 Total principal and other	6,054,214,015,485	6,249,863,056,552
純資産合計 Total net assets	6,054,214,015,485	6,249,863,056,552
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	6,414,827,129,531	6,701,745,517,458

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第18期 自 2018年7月9日 至 2019年7月8日 18th Fiscal Year From July 9, 2018 to July 8, 2019	第19期 自 2019年7月9日 至 2020年7月8日 19th Fiscal Year From July 9, 2019 to July 8, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	123,730,169,690	117,840,964,945
受取利息 Interest income	-	1,098,348
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△84,990,965,776	262,776,709,323
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△584,957,793	14,548,299,855
その他収益 Other revenue	2,882,323,582	2,249,904,566
営業収益合計 Total operating revenue	41,036,569,703	397,416,977,037
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△177,296,516	△282,769,010

受託者報酬 Trustee fee	2,953,489,256	3,037,058,346
委託者報酬 Investment trust management fee	11,063,201,567	11,407,479,618
その他費用 Other expenses	130,557,051	134,440,409
営業費用合計 Total operating expenses	13,969,951,358	14,296,209,363
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	27,066,618,345	383,120,767,674
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	27,066,618,345	383,120,767,674
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	27,066,618,345	383,120,767,674
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	2,485,464,372,375	2,667,442,759,777
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	714,266,505,170	372,769,151,422
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	714,266,505,170	372,769,151,422
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	446,801,762,717	415,218,192,619
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	446,801,762,717	415,218,192,619
分配金 Dividends	112,552,973,396	105,809,715,879
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	2,667,442,759,777	2,902,304,770,375

(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

4. その他	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年7月9日から2020年7月8日までとなっております。</p>
--------	--

(貸借対照表に関する注記)

第18期 2019年7月8日現在	第19期 2020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 275,190,644 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 272,004,411 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 22,000.1 円 (10口当たり純資産額) (220,001 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 22,977.1 円 (10口当たり純資産額) (229,771 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 229,768,281,100 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 313,430,542,470 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自2018年7月9日 至2019年7月8日	第19期 自2019年7月9日 至2020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>A</td> <td>126,789,789,788 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>111,093,496 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>126,900,883,284 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>14,147,247,874 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>112,753,635,410 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>112,552,973,396 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>200,662,014 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>275,190,644 口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>4,090 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	126,789,789,788 円	分配準備積立金	B	111,093,496 円	配当等収益合計額	C=A+B	126,900,883,284 円	経費	D	14,147,247,874 円	収益分配可能額	E=C-D	112,753,635,410 円	収益分配金	F	112,552,973,396 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	200,662,014 円	口数	H	275,190,644 口	10口当たり分配金	I=F/H×10	4,090 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>120,374,736,869 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>200,662,014 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>120,575,398,883 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>14,578,978,373 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>105,996,420,510 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>105,809,715,879 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>186,704,631 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>272,004,411 口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>3,890 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	120,374,736,869 円	分配準備積立金	B	200,662,014 円	配当等収益合計額	C=A+B	120,575,398,883 円	経費	D	14,578,978,373 円	収益分配可能額	E=C-D	105,996,420,510 円	収益分配金	F	105,809,715,879 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	186,704,631 円	口数	H	272,004,411 口	10口当たり分配金	I=F/H×10	3,890 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	126,789,789,788 円																																																											
分配準備積立金	B	111,093,496 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	126,900,883,284 円																																																											
経費	D	14,147,247,874 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	112,753,635,410 円																																																											
収益分配金	F	112,552,973,396 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	200,662,014 円																																																											
口数	H	275,190,644 口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	4,090 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	120,374,736,869 円																																																											
分配準備積立金	B	200,662,014 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	120,575,398,883 円																																																											
経費	D	14,578,978,373 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	105,996,420,510 円																																																											
収益分配金	F	105,809,715,879 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	186,704,631 円																																																											
口数	H	272,004,411 口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	3,890 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18期 自2018年7月9日 至2019年7月8日	第19期 自2019年7月9日 至2020年7月8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、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。</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>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。</p> <p>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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</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>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。</p> <p>○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。</p> <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>	同左
--	----

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第18期 2019年7月8日現在	第19期 2020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。 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</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18期 自2018年7月9日 至2019年7月8日	第19期 自2019年7月9日 至2020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18期 自2018年7月9日 至2019年7月8日	第19期 自2019年7月9日 至2020年7月8日
期首元本額 3,077,763,026,091円	期首元本額 3,386,771,255,708円
期中追加設定元本額 840,737,198,180円	期中追加設定元本額 489,617,257,480円
期中一部交換元本額 531,728,968,563円	期中一部交換元本額 528,830,227,011円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第18期 自2018年7月9日 至2019年7月8日	第19期 自2019年7月9日 至2020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	△86,851,574,319	268,311,805,208
合計	△86,851,574,319	268,311,805,208

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18期(2019年7月8日現在)				第19期(2020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	24,880,730,600	—	25,383,870,000	502,566,406	98,476,430,988	—	96,280,480,000	△2,198,081,468
合計	24,880,730,600	—	25,383,870,000	502,566,406	98,476,430,988	—	96,280,480,000	△2,198,081,468

(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	9,878,000	467.00	4,613,026,000	貸付有価証券 202,700株
		マルハニチロ	987,800	2,138.00	2,111,916,400	貸付有価証券 14,900株
		国際石油開発帝石	3,951,200	634.00	2,505,060,800	貸付有価証券 163,500株
		コムシスホールディングス	9,878,000	3,115.00	30,769,970,000	貸付有価証券 643,900株
		大成建設	1,975,600	3,840.00	7,586,304,000	貸付有価証券 22,600株
		大林組	9,878,000	990.00	9,779,220,000	貸付有価証券 3,100株
		清水建設	9,878,000	847.00	8,366,666,000	貸付有価証券 46,300株
		長谷工コーポレーション	1,975,600	1,336.00	2,639,401,600	貸付有価証券 14,300株
		鹿島建設	4,939,000	1,248.00	6,163,872,000	貸付有価証券 22,800株
		大和ハウス工業	9,878,000	2,454.00	24,240,612,000	貸付有価証券 11,900株
		積水ハウス	9,878,000	2,053.50	20,284,473,000	貸付有価証券 1,188,300株
		日揮ホールディングス	9,878,000	1,119.00	11,053,482,000	貸付有価証券 325,800株



日清製粉グループ本社	9,878,000	1,556.00	15,370,168,000	貸付有価証券 49,500株
明治ホールディングス	1,975,600	8,450.00	16,693,820,000	貸付有価証券 9,200株
日本ハム	4,939,000	4,285.00	21,163,615,000	貸付有価証券 733,000株
サッポロホールディングス	1,975,600	1,960.00	3,872,176,000	貸付有価証券 76,300株
アサヒグループホールディングス	9,878,000	3,682.00	36,370,796,000	貸付有価証券 1,200株
キリンホールディングス	9,878,000	2,165.50	21,390,809,000	貸付有価証券 522,100株
宝ホールディングス	9,878,000	952.00	9,403,856,000	貸付有価証券 246,900株
キッコーマン	9,878,000	5,000.00	49,390,000,000	貸付有価証券 1,963,000株
味の素	9,878,000	1,747.50	17,261,805,000	貸付有価証券 6,400株
ニチレイ	4,939,000	3,115.00	15,384,985,000	貸付有価証券 72,500株
日本たばこ産業	9,878,000	1,969.50	19,454,721,000	貸付有価証券 5,882,100株
東洋紡	987,800	1,471.00	1,453,053,800	
ユニチカ	987,800	346.00	341,778,800	貸付有価証券 653,100株(140,400株)
帝人	1,975,600	1,663.00	3,285,422,800	貸付有価証券 32,300株
東レ	9,878,000	497.70	4,916,280,600	貸付有価証券 359,500株
王子ホールディングス	9,878,000	480.00	4,741,440,000	貸付有価証券 177,900株
日本製紙	987,800	1,442.00	1,424,407,600	貸付有価証券 189,500株(86,100株)
クラレ	9,878,000	1,087.00	10,737,386,000	貸付有価証券 91,200株
旭化成	9,878,000	835.90	8,257,020,200	貸付有価証券 71,500株
昭和電工	987,800	2,346.00	2,317,378,800	貸付有価証券 214,300株
住友化学	9,878,000	327.00	3,230,106,000	貸付有価証券 606,900株
日産化学	9,878,000	5,460.00	53,933,880,000	貸付有価証券 208,300株
東ソー	4,939,000	1,443.00	7,126,977,000	貸付有価証券 7,600株
トクヤマ	1,975,600	2,425.00	4,790,830,000	貸付有価証券 28,600株

デンカ	1,975,600	2,568.00	5,073,340,800	貸付有価証券 12,200株
信越化学工業	9,878,000	12,375.00	122,240,250,000	貸付有価証券 18,100株
三井化学	1,975,600	2,243.00	4,431,270,800	貸付有価証券 9,600株
三菱ケミカルホールディングス	4,939,000	620.90	3,066,625,100	貸付有価証券 284,000株
宇部興産	987,800	1,802.00	1,780,015,600	貸付有価証券 1,200株
日本化薬	9,878,000	1,084.00	10,707,752,000	貸付有価証券 321,100株
花王	9,878,000	8,529.00	84,249,462,000	貸付有価証券 588,700株
D I C	987,800	2,655.00	2,622,609,000	貸付有価証券 29,500株
富士フイルムホールディングス	9,878,000	4,665.00	46,080,870,000	貸付有価証券 47,800株
資生堂	9,878,000	6,845.00	67,614,910,000	貸付有価証券 2,400株
日東電工	9,878,000	5,850.00	57,786,300,000	貸付有価証券 33,800株
協和キリン	9,878,000	2,717.00	26,838,526,000	貸付有価証券 161,500株
武田薬品工業	9,878,000	3,766.00	37,200,548,000	貸付有価証券 300株
アステラス製薬	49,390,000	1,732.50	85,568,175,000	貸付有価証券 272,200株
大日本住友製薬	9,878,000	1,384.00	13,671,152,000	貸付有価証券 255,700株
塩野義製薬	9,878,000	6,286.00	62,093,108,000	貸付有価証券 16,900株
中外製薬	29,634,000	5,533.00	163,964,922,000	貸付有価証券 269,800株
エーザイ	9,878,000	8,535.00	84,308,730,000	貸付有価証券 139,200株
第一三共	9,878,000	8,516.00	84,121,048,000	貸付有価証券 92,000株
大塚ホールディングス	9,878,000	4,579.00	45,231,362,000	貸付有価証券 99,300株
出光興産	3,951,200	2,327.00	9,194,442,400	貸付有価証券 66,000株
E N E O S ホールディングス	9,878,000	383.10	3,784,261,800	貸付有価証券 1,914,300株
横浜ゴム	4,939,000	1,504.00	7,428,256,000	貸付有価証券 74,500株
ブリヂストン	9,878,000	3,398.00	33,565,444,000	貸付有価証券 2,693,000株
A G C	1,975,600	3,130.00	6,183,628,000	貸付有価証券

				198,800株
日本板硝子	987,800	382.00	377,339,600	貸付有価証券 778,900株(157,300株)
日本電気硝子	2,963,400	1,687.00	4,999,255,800	貸付有価証券 1,316,900株
住友大阪セメント	987,800	3,675.00	3,630,165,000	貸付有価証券 24,000株
太平洋セメント	987,800	2,378.00	2,348,988,400	
東海カーボン	9,878,000	992.00	9,798,976,000	貸付有価証券 6,326,000株 (363,400株)
TOTO	4,939,000	4,175.00	20,620,325,000	貸付有価証券 102,200株
日本碍子	9,878,000	1,435.00	14,174,930,000	貸付有価証券 11,000株
日本製鉄	987,800	1,018.00	1,005,580,400	貸付有価証券 19,100株
神戸製鋼所	987,800	377.00	372,400,600	貸付有価証券 225,800株
ジェイ エフ イー ホールディングス	987,800	792.00	782,337,600	貸付有価証券 5,000株
大平洋金属	987,800	1,550.00	1,531,090,000	貸付有価証券 199,100株
日本軽金属ホールディングス	9,878,000	184.00	1,817,552,000	貸付有価証券 120,300株
三井金属鉱業	987,800	2,208.00	2,181,062,400	貸付有価証券 73,700株
東邦亜鉛	987,800	1,522.00	1,503,431,600	貸付有価証券 60,500株
三菱マテリアル	987,800	2,265.00	2,237,367,000	貸付有価証券 100株
住友金属鉱山	4,939,000	3,130.00	15,459,070,000	貸付有価証券 108,700株
DOWAホールディングス	1,975,600	3,235.00	6,391,066,000	貸付有価証券 16,200株
古河電気工業	987,800	2,622.00	2,590,011,600	貸付有価証券 40,200株
住友電気工業	9,878,000	1,249.50	12,342,561,000	貸付有価証券 421,600株
フジクラ	9,878,000	322.00	3,180,716,000	貸付有価証券 1,137,800株 (144,800株)
SUMCO	987,800	1,655.00	1,634,809,000	貸付有価証券 198,900株(3,600株)
東洋製罐グループホールディングス	9,878,000	1,169.00	11,547,382,000	貸付有価証券 204,100株
日本製鋼所	1,975,600	1,525.00	3,012,790,000	貸付有価証券 17,100株

オークマ	1,975,600	4,475.00	8,840,810,000	貸付有価証券 46,100株
アマダ	9,878,000	833.00	8,228,374,000	貸付有価証券 7,500株
小松製作所	9,878,000	2,180.00	21,534,040,000	貸付有価証券 774,100株
住友重機械工業	1,975,600	2,249.00	4,443,124,400	貸付有価証券 6,500株
日立建機	9,878,000	3,000.00	29,634,000,000	貸付有価証券 534,400株
クボタ	9,878,000	1,549.50	15,305,961,000	貸付有価証券 606,200株
荏原製作所	1,975,600	2,570.00	5,077,292,000	貸付有価証券 13,800株
ダイキン工業	9,878,000	18,365.00	181,409,470,000	貸付有価証券 389,700株
日本精工	9,878,000	786.00	7,764,108,000	貸付有価証券 121,100株
NTN	9,878,000	212.00	2,094,136,000	貸付有価証券 2,192,000株 (385,500株)
ジェイテクト	9,878,000	802.00	7,922,156,000	貸付有価証券 105,100株
日立造船	1,975,600	375.00	740,850,000	貸付有価証券 6,200株
三菱重工業	987,800	2,571.00	2,539,633,800	貸付有価証券 145,700株
IHI	987,800	1,572.00	1,552,821,600	貸付有価証券 27,300株
日清紡ホールディングス	9,878,000	770.00	7,606,060,000	貸付有価証券 22,800株
コニカミノルタ	9,878,000	375.00	3,704,250,000	貸付有価証券 170,100株
ミネベアミツミ	9,878,000	1,917.00	18,936,126,000	貸付有価証券 155,500株
日立製作所	1,975,600	3,391.00	6,699,259,600	貸付有価証券 5,400株
三菱電機	9,878,000	1,405.00	13,878,590,000	貸付有価証券 5,300株
富士電機	1,975,600	2,885.00	5,699,606,000	貸付有価証券 8,400株
安川電機	9,878,000	4,040.00	39,907,120,000	貸付有価証券 1,206,000株
オムロン	9,878,000	7,330.00	72,405,740,000	貸付有価証券 71,200株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,975,600	1,838.00	3,631,152,800	貸付有価証券 89,500株
日本電気	987,800	5,570.00	5,502,046,000	貸付有価証券 100株

富士通	987,800	12,980.00	12,821,644,000	貸付有価証券 1,700株
沖電気工業	987,800	1,065.00	1,052,007,000	貸付有価証券 332,000株
セイコーエプソン	19,756,000	1,207.00	23,845,492,000	貸付有価証券 1,011,500株
パナソニック	9,878,000	956.30	9,446,331,400	貸付有価証券 33,100株
ソニー	9,878,000	7,430.00	73,393,540,000	貸付有価証券 109,800株
TDK	9,878,000	10,490.00	103,620,220,000	貸付有価証券 35,300株
アルプスアルパイン	9,878,000	1,393.00	13,760,054,000	貸付有価証券 188,900株
横河電機	9,878,000	1,652.00	16,318,456,000	貸付有価証券 121,000株
アドバンテスト	19,756,000	6,820.00	134,735,920,000	貸付有価証券 404,100株
カシオ計算機	9,878,000	1,850.00	18,274,300,000	貸付有価証券 1,177,900株
ファナック	9,878,000	19,320.00	190,842,960,000	貸付有価証券 113,200株
京セラ	19,756,000	5,755.00	113,695,780,000	貸付有価証券 68,000株
太陽誘電	9,878,000	3,395.00	33,535,810,000	貸付有価証券 4,669,300株
S C R E E Nホールディングス	1,975,600	5,290.00	10,450,924,000	貸付有価証券 188,900株
キヤノン	14,817,000	2,085.00	30,893,445,000	貸付有価証券 12,149,900株
リコー	9,878,000	780.00	7,704,840,000	貸付有価証券 116,500株
東京エレクトロン	9,878,000	29,810.00	294,463,180,000	貸付有価証券 54,000株
デンソー	9,878,000	4,168.00	41,171,504,000	貸付有価証券 269,800株
三井E&Sホールディングス	987,800	432.00	426,729,600	貸付有価証券 32,400株
川崎重工業	987,800	1,559.00	1,539,980,200	貸付有価証券 149,900株
日産自動車	9,878,000	391.20	3,864,273,600	貸付有価証券 1,920,700株
いすゞ自動車	4,939,000	949.70	4,690,568,300	貸付有価証券 202,200株
トヨタ自動車	9,878,000	6,728.00	66,459,184,000	貸付有価証券 1,200株
日野自動車	9,878,000	706.00	6,973,868,000	貸付有価証券 116,800株
三菱自動車工業	987,800	271.00	267,693,800	貸付有価証券

				171,200株
マツダ	1,975,600	653.00	1,290,066,800	貸付有価証券 50,200株
本田技研工業	19,756,000	2,726.00	53,854,856,000	
スズキ	9,878,000	3,794.00	37,477,132,000	貸付有価証券 1,284,400株
S U B A R U	9,878,000	2,222.00	21,948,916,000	貸付有価証券 101,800株
ヤマハ発動機	9,878,000	1,642.00	16,219,676,000	貸付有価証券 276,300株
テルモ	39,512,000	4,022.00	158,917,264,000	貸付有価証券 773,800株
ニコン	9,878,000	870.00	8,593,860,000	貸付有価証券 2,098,900株
オリンパス	39,512,000	1,990.50	78,648,636,000	貸付有価証券 1,249,200株
シチズン時計	9,878,000	339.00	3,348,642,000	貸付有価証券 441,800株
バンダイナムコホールディングス	9,878,000	5,777.00	57,065,206,000	貸付有価証券 152,100株
凸版印刷	4,939,000	1,710.00	8,445,690,000	貸付有価証券 6,100株
大日本印刷	4,939,000	2,421.00	11,957,319,000	貸付有価証券 9,900株
ヤマハ	9,878,000	4,820.00	47,611,960,000	貸付有価証券 167,700株
東京電力ホールディングス	987,800	315.00	311,157,000	貸付有価証券 771,500株
中部電力	987,800	1,334.50	1,318,219,100	貸付有価証券 89,800株
関西電力	987,800	1,060.50	1,047,561,900	貸付有価証券 4,800株
東京瓦斯	1,975,600	2,575.50	5,088,157,800	貸付有価証券 63,700株
大阪瓦斯	1,975,600	2,132.00	4,211,979,200	貸付有価証券 14,700株
東武鉄道	1,975,600	3,490.00	6,894,844,000	貸付有価証券 59,300株
東急	4,939,000	1,439.00	7,107,221,000	貸付有価証券 76,600株
小田急電鉄	4,939,000	2,606.00	12,871,034,000	貸付有価証券 403,700株
京王電鉄	1,975,600	5,960.00	11,774,576,000	貸付有価証券 314,300株
京成電鉄	4,939,000	3,210.00	15,854,190,000	貸付有価証券 49,100株
東日本旅客鉄道	987,800	7,235.00	7,146,733,000	貸付有価証券 14,200株

西日本旅客鉄道	987,800	5,677.00	5,607,740,600	貸付有価証券 142,600株
東海旅客鉄道	987,800	15,620.00	15,429,436,000	貸付有価証券 177,100株
日本通運	987,800	5,540.00	5,472,412,000	貸付有価証券 23,400株
ヤマトホールディングス	9,878,000	2,771.00	27,371,938,000	貸付有価証券 741,500株
日本郵船	987,800	1,490.00	1,471,822,000	
商船三井	987,800	1,996.00	1,971,648,800	貸付有価証券 1,700株
川崎汽船	987,800	1,065.00	1,052,007,000	貸付有価証券 436,400株 (16,000 株)
A N Aホールディングス	987,800	2,448.00	2,418,134,400	貸付有価証券 809,900株 (271,800 株)
三菱倉庫	4,939,000	2,736.00	13,513,104,000	貸付有価証券 698,700株 (356,700 株)
Zホールディングス	3,951,200	540.00	2,133,648,000	貸付有価証券 3,200株
トレンドマイクロ	9,878,000	6,140.00	60,650,920,000	貸付有価証券 242,600株
スカパーJ S A Tホール ディングス	987,800	415.00	409,937,000	貸付有価証券 4,400株
日本電信電話	3,951,200	2,486.00	9,822,683,200	貸付有価証券 3,000株
K D D I	59,268,000	3,259.00	193,154,412,000	貸付有価証券 29,700株
N T T ドコモ	987,800	2,925.00	2,889,315,000	貸付有価証券 7,400株
東宝	987,800	3,685.00	3,640,043,000	貸付有価証券 4,900株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	49,390,000	1,171.00	57,835,690,000	貸付有価証券 1,592,600株
コナミホールディングス	9,878,000	3,365.00	33,239,470,000	貸付有価証券 395,400株
ソフトバンクグループ	59,268,000	6,019.00	356,734,092,000	貸付有価証券 448,600株
双日	987,800	233.00	230,157,400	貸付有価証券 59,200株
伊藤忠商事	9,878,000	2,307.50	22,793,485,000	貸付有価証券 165,400株
丸紅	9,878,000	482.90	4,770,086,200	貸付有価証券 83,500株
豊田通商	9,878,000	2,696.00	26,631,088,000	貸付有価証券 45,900株
三井物産	9,878,000	1,574.00	15,547,972,000	貸付有価証券 3,500株

住友商事	9,878,000	1,233.50	12,184,513,000	貸付有価証券 98,800株
三菱商事	9,878,000	2,276.50	22,487,267,000	貸付有価証券 293,100株
J. フロント リテイ リング	4,939,000	685.00	3,383,215,000	貸付有価証券 10,300株
三越伊勢丹ホールディ ングス	9,878,000	613.00	6,055,214,000	貸付有価証券 912,100株
セブン&アイ・ホール ディングス	9,878,000	3,425.00	33,832,150,000	貸付有価証券 3,287,800株
ファミリーマート	39,512,000	1,754.00	69,304,048,000	貸付有価証券 6,790,000株
高島屋	4,939,000	822.00	4,059,858,000	貸付有価証券 1,074,700株 (394,800株)
丸井グループ	9,878,000	1,802.00	17,800,156,000	貸付有価証券 322,000株
イオン	9,878,000	2,533.50	25,025,913,000	貸付有価証券 482,100株
ファーストリテイリン グ	9,878,000	62,130.00	613,720,140,000	貸付有価証券 1,491,500株
コンコルディア・フィ ナンシャルグループ	9,878,000	342.00	3,378,276,000	貸付有価証券 91,600株
新生銀行	987,800	1,281.00	1,265,371,800	貸付有価証券 23,200株
あおぞら銀行	987,800	1,865.00	1,842,247,000	貸付有価証券 352,200株
三菱UFJフィナンシャ ル・グループ	9,878,000	420.20	4,150,735,600	貸付有価証券 2,379,600株
りそなホールディング ス	987,800	368.60	364,103,080	貸付有価証券 2,000株
三井住友トラスト・ホ ールディングス	987,800	2,976.00	2,939,692,800	貸付有価証券 3,700株
三井住友フィナンシャ ルグループ	987,800	3,036.00	2,998,960,800	貸付有価証券 36,500株
千葉銀行	9,878,000	506.00	4,998,268,000	貸付有価証券 706,700株
ふくおかフィナンシャ ルグループ	1,975,600	1,667.00	3,293,325,200	貸付有価証券 8,300株
静岡銀行	9,878,000	689.00	6,805,942,000	
みずほフィナンシャ ルグループ	9,878,000	132.10	1,304,883,800	貸付有価証券 122,700株
大和証券グループ本 社	9,878,000	473.00	4,672,294,000	貸付有価証券 185,300株
野村ホールディング ス	9,878,000	497.30	4,912,329,400	貸付有価証券 10,400株
松井証券	9,878,000	838.00	8,277,764,000	貸付有価証券 135,800株
S O M P Oホールディ ング	2,469,500	3,683.00	9,095,168,500	貸付有価証券



グス				9,500株
MS&ADインシュアランスグループホール	2,963,400	2,930.50	8,684,243,700	貸付有価証券 2,000株
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,975,600	2,596.00	5,128,657,600	貸付有価証券 213,500株(21,500株)
第一生命ホールディングス	987,800	1,334.50	1,318,219,100	
東京海上ホールディングス	4,939,000	4,656.00	22,995,984,000	貸付有価証券 1,600株
T&Dホールディングス	1,975,600	940.00	1,857,064,000	貸付有価証券 73,000株
クレディセゾン	9,878,000	1,139.00	11,251,042,000	貸付有価証券 674,800株
東急不動産ホールディングス	9,878,000	464.00	4,583,392,000	貸付有価証券 35,500株
三井不動産	9,878,000	1,857.00	18,343,446,000	貸付有価証券 29,600株
三菱地所	9,878,000	1,576.50	15,572,667,000	貸付有価証券 298,800株
東京建物	4,939,000	1,203.00	5,941,617,000	貸付有価証券 43,500株
住友不動産	9,878,000	2,781.00	27,470,718,000	貸付有価証券 373,400株
エムスリー	23,707,200	4,860.00	115,216,992,000	貸付有価証券 257,900株
ディー・エヌ・エー	2,963,400	1,320.00	3,911,688,000	貸付有価証券 295,400株
電通グループ	9,878,000	2,548.00	25,169,144,000	貸付有価証券 9,400株
サイバーエージェント	1,975,600	5,970.00	11,794,332,000	貸付有価証券 494,100株(31,100株)
楽天	9,878,000	992.00	9,798,976,000	貸付有価証券 318,200株
リクルートホールディングス	29,634,000	3,630.00	107,571,420,000	貸付有価証券 100,200株
日本郵政	9,878,000	761.90	7,526,048,200	貸付有価証券 49,300株
セコム	9,878,000	9,396.00	92,813,688,000	貸付有価証券 75,800株
小計	銘柄数：225 組入時価比率：98.4%		6,152,975,676,980 100.0%	
合計			6,152,975,676,980	

(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。