

# 2018年7月期 (2017年7月11日 ~ 2018年7月10日) 決算短信

2018年8月21日

上場取引所 東京・名古屋・福岡・札幌

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300指数  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 1000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

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17日

## ファンドの運用状況

### 1. 2018年7月期の運用状況 (2017年7月11日 ~ 2018年7月10日)

(1)資産内訳 (百万円未満切捨て)

	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)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2018年7月期	10,105	(99.8)	18	(0.2)	10,123	(100)
2017年7月期	10,918	(99.7)	31	(0.3)	10,949	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前計算期間末 発行済口数( )	設定口数( )	交換口数( )	当計算期間末 発行済口数 ( + - )
	千口	千口	千口	千口
2018年7月期	34,632	3,600	7,937	30,294
2017年7月期	34,632	0	0	34,632

(3)基準価額

	総資産 ( )	負債 ( )	純資産 ( ( - ) )	100口当り基準価額 ( ( / 当計算期間末発行済口数 ) × 100 )
	百万円	百万円	百万円	円
2018年7月期	10,333	209	10,123	33,418
2017年7月期	11,150	200	10,949	31,618

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
2018年7月期	625.10
2017年7月期	511.20

### 2. 会計方針の変更

会計基準等の改正に伴う変更  
 以外の変更

有  無   
 有  無

## Ⅱ 財務諸表等

日経 300 株価指数連動型上場投資信託

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 23 期 (2017 年 7 月 10 日現在)	第 24 期 (2018 年 7 月 10 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	217,549,353	214,201,880
株式	10,918,163,150	10,105,108,200
未収配当金	14,614,900	14,503,150
流動資産合計	11,150,327,403	10,333,813,230
資産合計	11,150,327,403	10,333,813,230
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	177,039,699	189,372,751
未払受託者報酬	4,488,590	3,926,406
未払委託者報酬	18,851,750	16,490,782
未払利息	312	435
その他未払費用	89,651	78,430
流動負債合計	200,470,002	209,868,804
負債合計	200,470,002	209,868,804
純資産の部		
元本等		
元本	8,380,987,318	7,331,339,906
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,568,870,083	2,792,604,520
(分配準備積立金)	22,716	27,258
元本等合計	10,949,857,401	10,123,944,426
純資産合計	10,949,857,401	10,123,944,426
負債純資産合計	11,150,327,403	10,333,813,230

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 23 期 自 2016 年 7 月 11 日 至 2017 年 7 月 10 日	第 24 期 自 2017 年 7 月 11 日 至 2018 年 7 月 10 日
営業収益		
受取配当金	224,236,788	232,121,511
有価証券売買等損益	2,632,369,834	613,934,370
その他収益	126,970	145,412
営業収益合計	2,856,733,592	846,201,293
営業費用		
支払利息	57,135	66,140
受託者報酬	9,051,570	8,203,811
委託者報酬	38,015,974	34,455,753
その他費用	204,427	163,926
営業費用合計	47,329,106	42,889,630

営業利益又は営業損失 (△)	2,809,404,486	803,311,663
経常利益又は経常損失 (△)	2,809,404,486	803,311,663
当期純利益又は当期純損失 (△)	2,809,404,486	803,311,663
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 (△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△63,494,704	2,568,870,083
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	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	-	295,704,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	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	-	685,908,475
分配金	177,039,699	189,372,751
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	2,568,870,083	2,792,604,520

## (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、2017年7月11日から2018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23期 2017年7月10日現在	第24期 2018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 34,632,179 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 316.18 円 (100口当たり純資産額) (31,618 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 334.18 円 (100口当たり純資産額) (33,418 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第23期 自2016年7月11日 至2017年7月10日	第24期 自2017年7月11日 至2018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>224,306,623 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>27,763 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>224,334,386 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>47,271,971 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>177,062,415 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>177,039,699 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	224,306,623 円	分配準備積立金	B	27,763 円	配当等収益合計額	C=A+B	224,334,386 円	経費	D	47,271,971 円	収益分配可能額	E=C-D	177,062,415 円	収益分配金	F	177,039,699 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>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> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>189,400,009 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>189,372,751 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	収益分配可能額	E=C-D	189,400,009 円	収益分配金	F	189,372,751 円
項目																																											
当期配当等収益額	A	224,306,623 円																																									
分配準備積立金	B	27,763 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	224,334,386 円																																									
経費	D	47,271,971 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	177,062,415 円																																									
収益分配金	F	177,039,699 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																																									
収益分配可能額	E=C-D	189,400,009 円																																									
収益分配金	F	189,372,751 円																																									

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	22,716 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,258 円
口数	H	34,632,179 口	口数	H	30,294,793 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	511 円 20 銭	100 口当たり分配金	I=F/H×100	625 円 10 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 23 期 自 2016 年 7 月 11 日 至 2017 年 7 月 10 日	第 24 期 自 2017 年 7 月 11 日 至 2018 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 23 期 2017 年 7 月 10 日現在	第 24 期 2018 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 23 期 自 2016 年 7 月 11 日 至 2017 年 7 月 10 日	第 24 期 自 2017 年 7 月 11 日 至 2018 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 23 期 自 2016 年 7 月 11 日 至 2017 年 7 月 10 日		第 24 期 自 2017 年 7 月 11 日 至 2018 年 7 月 10 日	
期首元本額	8,380,987,318 円	期首元本額	8,380,987,318 円
期中追加設定元本額	0 円	期中追加設定元本額	871,200,000 円
期中一部交換元本額	0 円	期中一部交換元本額	1,920,847,412 円

## 2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 23 期 自 2016 年 7 月 11 日 至 2017 年 7 月 10 日	第 24 期 自 2017 年 7 月 11 日 至 2018 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	2,602,070,748	524,280,888
合計	2,602,070,748	524,280,888

## 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(2018 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	7,400	531.00	3,929,400	
		マルハニチロ	1,200	4,045.00	4,854,000	
		サカタのタネ	1,100	4,080.00	4,488,000	
		ホクト	800	1,952.00	1,561,600	
		国際石油開発帝石	34,700	1,180.50	40,963,350	
		コムシスホールディングス	3,300	2,817.00	9,296,100	
		大成建設	5,300	6,150.00	32,595,000	
		大林組	17,100	1,132.00	19,357,200	
		清水建設	18,700	1,175.00	21,972,500	
		鹿島建設	25,000	862.00	21,550,000	
		西松建設	1,300	3,115.00	4,049,500	
		前田建設工業	4,700	1,279.00	6,011,300	
		奥村組	1,100	3,660.00	4,026,000	
		戸田建設	7,700	953.00	7,338,100	
		大東建託	1,800	18,240.00	32,832,000	
		N I P P O	2,800	2,036.00	5,700,800	
前田道路	2,200	2,097.00	4,613,400			

住友林業	4,300	1,694.00	7,284,200
大和ハウス工業	15,800	3,859.00	60,972,200
積水ハウス	16,400	1,923.50	31,545,400
中電工	1,400	2,814.00	3,939,600
関電工	4,900	1,203.00	5,894,700
九電工	1,700	5,190.00	8,823,000
日揮	6,100	2,037.00	12,425,700
高砂熱学工業	2,000	1,943.00	3,886,000
日清製粉グループ本社	7,200	2,174.00	15,652,800
山崎製パン	5,200	2,743.00	14,263,600
ヤクルト本社	4,100	7,110.00	29,151,000
明治ホールディングス	3,600	8,890.00	32,004,000
雪印メグミルク	1,700	2,738.00	4,654,600
日本ハム	2,500	4,260.00	10,650,000
伊藤ハム米久ホールディングス	7,100	893.00	6,340,300
サッポロホールディングス	1,900	2,685.00	5,101,500
アサヒグループホールディングス	11,500	5,505.00	63,307,500
キリンホールディングス	21,700	2,883.50	62,571,950
宝ホールディングス	4,800	1,359.00	6,523,200
伊藤園	2,100	4,980.00	10,458,000
キッコーマン	4,600	5,140.00	23,644,000
味の素	13,600	2,052.50	27,914,000
キューピー	3,600	2,920.00	10,512,000
ハウス食品グループ本社	2,400	3,650.00	8,760,000
ニチレイ	3,300	2,595.00	8,563,500
日清食品ホールディングス	2,500	7,480.00	18,700,000
日本たばこ産業	31,600	3,003.00	94,894,800
東洋紡	2,100	1,820.00	3,822,000
帝人	4,700	2,042.00	9,597,400
東レ	38,700	871.60	33,730,920
ワコールホールディングス	1,700	3,105.00	5,278,500
オンワードホールディングス	3,900	710.00	2,769,000
王子ホールディングス	24,000	669.00	16,056,000
日本製紙	2,800	1,775.00	4,970,000
レンゴー	6,400	1,000.00	6,400,000
クラレ	8,400	1,513.00	12,709,200

旭化成	33,300	1,415.50	47,136,150
住友化学	39,000	629.00	24,531,000
デンカ	2,100	3,660.00	7,686,000
信越化学工業	10,100	10,385.00	104,888,500
大陽日酸	10,300	1,839.00	18,941,700
日本触媒	1,000	8,260.00	8,260,000
カネカ	8,000	968.00	7,744,000
三菱瓦斯化学	5,500	2,487.00	13,678,500
三井化学	4,800	2,942.00	14,121,600
東京応化工業	1,100	4,190.00	4,609,000
三菱ケミカルホールディングス	35,700	948.50	33,861,450
ダイセル	8,300	1,192.00	9,893,600
積水化学工業	11,700	1,912.00	22,370,400
宇部興産	2,500	2,921.00	7,302,500
日立化成	4,900	2,181.00	10,686,900
花王	11,700	8,058.00	94,278,600
日本ペイントホールディングス	7,700	4,515.00	34,765,500
D I C	2,300	3,485.00	8,015,500
東洋インキ S C ホールディングス	1,400	2,887.00	4,041,800
富士フイルムホールディングス	12,200	4,356.00	53,143,200
資生堂	9,500	8,325.00	79,087,500
ライオン	7,100	1,931.00	13,710,100
日東電工	4,100	8,086.00	33,152,600
ユニ・チャーム	14,700	3,362.00	49,421,400
協和発酵キリン	13,700	2,149.00	29,441,300
武田薬品工業	18,800	4,630.00	87,044,000
アステラス製薬	46,900	1,758.50	82,473,650
塩野義製薬	7,700	5,605.00	43,158,500
田辺三菱製薬	13,300	1,890.00	25,137,000
中外製薬	13,300	5,600.00	74,480,000
エーザイ	7,000	10,550.00	73,850,000
第一三共	16,800	4,369.00	73,399,200
大塚ホールディングス	13,200	4,798.00	63,333,600
大正製薬ホールディングス	2,100	12,810.00	26,901,000
昭和シェル石油	8,900	1,682.00	14,969,800
J X T G ホールディングス	81,300	798.10	64,885,530

横浜ゴム	4,000	2,274.00	9,096,000
ブリヂストン	18,100	4,165.00	75,386,500
住友ゴム工業	6,200	1,741.00	10,794,200
A G C	5,500	4,335.00	23,842,500
日本板硝子	2,100	1,081.00	2,270,100
日本電気硝子	2,400	3,205.00	7,692,000
太平洋セメント	3,000	3,570.00	10,710,000
TOTO	4,200	5,140.00	21,588,000
日本碍子	7,800	1,944.00	15,163,200
新日鐵住金	22,500	2,125.00	47,812,500
神戸製鋼所	8,600	1,016.00	8,737,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	14,600	2,092.00	30,543,200
日新製鋼	2,600	1,499.00	3,897,400
日立金属	10,200	1,148.00	11,709,600
日本軽金属ホールディングス	14,700	246.00	3,616,200
三井金属鉱業	1,400	4,315.00	6,041,000
三菱マテリアル	3,100	2,903.00	8,999,300
住友金属鉱山	6,900	4,178.00	28,828,200
DOWAホールディングス	1,500	3,370.00	5,055,000
古河機械金属	1,000	1,658.00	1,658,000
古河電気工業	1,700	3,790.00	6,443,000
住友電気工業	18,800	1,660.00	31,208,000
フジクラ	7,000	692.00	4,844,000
SUMCO	7,000	2,320.00	16,240,000
東洋製罐グループホールディングス	4,800	1,968.00	9,446,400
三和ホールディングス	5,600	1,185.00	6,636,000
L I X I Lグループ	7,400	2,332.00	17,256,800
オクマ	800	5,950.00	4,760,000
アマダホールディングス	9,000	1,078.00	9,702,000
SMC	1,600	38,710.00	61,936,000
小松製作所	23,000	3,178.00	73,094,000
住友重機械工業	2,900	3,805.00	11,034,500
日立建機	5,100	3,560.00	18,156,000
クボタ	29,300	1,804.50	52,871,850
荏原製作所	2,400	3,495.00	8,388,000



ダイキン工業	7,000	13,015.00	91,105,000
栗田工業	2,800	3,050.00	8,540,000
椿本チエイン	5,000	912.00	4,560,000
ダイフク	3,000	4,850.00	14,550,000
平和	2,400	2,593.00	6,223,200
アマノ	1,800	2,573.00	4,631,400
セガサミーホールディングス	6,300	1,815.00	11,434,500
日本精工	13,100	1,178.00	15,431,800
NTN	12,600	462.00	5,821,200
ジェイテクト	8,100	1,564.00	12,668,400
不二越	600	5,090.00	3,054,000
三菱重工業	8,000	4,069.00	32,552,000
IHI	3,700	3,835.00	14,189,500
日清紡ホールディングス	4,200	1,205.00	5,061,000
コニカミノルタ	11,900	997.00	11,864,300
ブラザー工業	6,200	2,179.00	13,509,800
ミネベアミツミ	10,100	1,908.00	19,270,800
日立製作所	115,000	790.20	90,873,000
三菱電機	50,900	1,476.00	75,128,400
富士電機	18,000	840.00	15,120,000
日本電気	6,200	2,997.00	18,581,400
富士通	49,000	728.70	35,706,300
パナソニック	58,200	1,404.00	81,712,800
ソニー	30,100	5,705.00	171,720,500
TDK	3,100	11,900.00	36,890,000
ファナック	4,800	21,735.00	104,328,000
京セラ	9,000	6,258.00	56,322,000
村田製作所	5,300	19,965.00	105,814,500
キヤノン	31,600	3,543.00	111,958,800
リコー	17,700	1,004.00	17,770,800
東京エレクトロン	3,900	18,810.00	73,359,000
豊田自動織機	7,700	6,020.00	46,354,000
デンソー	18,800	5,378.00	101,106,400
三井E&Sホールディングス	2,000	1,432.00	2,864,000
川崎重工業	4,000	3,220.00	12,880,000
日本車輛製造	3,000	268.00	804,000

日産自動車	100,100	1,041.50	104,254,150
トヨタ自動車	77,400	7,151.00	553,487,400
新明和工業	2,400	1,283.00	3,079,200
本田技研工業	43,000	3,273.00	140,739,000
シマノ	2,200	16,030.00	35,266,000
テルモ	9,000	6,050.00	54,450,000
島津製作所	7,000	3,330.00	23,310,000
ニコン	9,500	1,784.00	16,948,000
オリンパス	8,100	4,330.00	35,073,000
HOYA	9,000	6,183.00	55,647,000
シチズン時計	7,600	697.00	5,297,200
バンダイナムコホールディングス	5,300	4,380.00	23,214,000
トッパン・フォームズ	2,700	1,125.00	3,037,500
凸版印刷	17,000	836.00	14,212,000
大日本印刷	7,700	2,395.00	18,441,500
N I S S H A	1,200	2,226.00	2,671,200
アシックス	4,700	1,776.00	8,347,200
ヤマハ	4,500	5,420.00	24,390,000
ビジョン	2,900	5,490.00	15,921,000
リンテック	1,800	3,150.00	5,670,000
任天堂	3,400	35,510.00	120,734,000
タカラスタンダード	1,800	1,827.00	3,288,600
コクヨ	3,100	1,920.00	5,952,000
オカムラ	2,700	1,573.00	4,247,100
東京電力ホールディングス	38,100	523.00	19,926,300
中部電力	18,000	1,677.00	30,186,000
関西電力	22,300	1,568.50	34,977,550
東北電力	11,900	1,331.00	15,838,900
九州電力	11,200	1,252.00	14,022,400
東京瓦斯	10,900	2,898.50	31,593,650
大阪瓦斯	9,900	2,262.50	22,398,750
東武鉄道	5,000	3,215.00	16,075,000
東京急行電鉄	14,800	1,812.00	26,817,600
小田急電鉄	8,700	2,244.00	19,522,800
東日本旅客鉄道	9,100	10,205.00	92,865,500
西日本旅客鉄道	4,600	7,886.00	36,275,600

東海旅客鉄道	4,900	21,830.00	106,967,000
近鉄グループホールディングス	4,500	4,285.00	19,282,500
阪急阪神ホールディングス	6,000	4,255.00	25,530,000
日本通運	2,400	7,270.00	17,448,000
ヤマトホールディングス	9,800	2,980.00	29,204,000
福山通運	1,300	5,570.00	7,241,000
セイノーホールディングス	4,900	1,902.00	9,319,800
日本郵船	4,000	2,143.00	8,572,000
商船三井	2,900	2,676.00	7,760,400
日本航空	8,300	3,900.00	32,370,000
ANAホールディングス	8,300	4,006.00	33,249,800
三菱倉庫	2,100	2,463.00	5,172,300
三井倉庫ホールディングス	3,000	331.00	993,000
住友倉庫	4,000	678.00	2,712,000
上組	3,200	2,232.00	7,142,400
T I S	2,100	5,230.00	10,983,000
ネクソン	21,100	1,675.00	35,342,500
野村総合研究所	6,000	5,400.00	32,400,000
オービック	2,400	9,020.00	21,648,000
ヤフー	135,100	401.00	54,175,100
トレンドマイクロ	3,300	6,230.00	20,559,000
日本オラクル	3,000	9,390.00	28,170,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,700	1,979.00	11,280,300
大塚商会	4,500	4,185.00	18,832,500
日本ユニシス	2,600	2,786.00	7,243,600
日本電信電話	33,600	5,028.00	168,940,800
KDD I	60,000	3,105.00	186,300,000
NTTドコモ	89,700	2,812.00	252,236,400
東宝	4,500	3,435.00	15,457,500
エヌ・ティ・ティ・データ	33,300	1,258.00	41,891,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,900	5,110.00	14,819,000
コナミホールディングス	3,400	5,450.00	18,530,000
ソフトバンクグループ	26,100	8,758.00	228,583,800
双日	29,700	405.00	12,028,500
伊藤忠商事	39,400	1,995.50	78,622,700

丸紅	41,200	847.90	34,933,480
豊田通商	8,400	3,710.00	31,164,000
三井物産	41,300	1,867.50	77,127,750
住友商事	29,700	1,841.00	54,677,700
三菱商事	37,700	3,132.00	118,076,400
キヤノンマーケティングジャパン	3,600	2,249.00	8,096,400
岩谷産業	1,200	3,810.00	4,572,000
サンリオ	2,100	2,112.00	4,435,200
スズケン	2,500	4,635.00	11,587,500
ローソン	2,400	6,660.00	15,984,000
エービーシー・マート	2,000	6,160.00	12,320,000
J. フロント リテイリング	6,400	1,599.00	10,233,600
三越伊勢丹ホールディングス	9,400	1,358.00	12,765,200
セブン&アイ・ホールディングス	21,000	4,504.00	94,584,000
良品計画	700	32,500.00	22,750,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3,000	11,150.00	33,450,000
しまむら	900	10,100.00	9,090,000
高島屋	8,000	924.00	7,392,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	3,000	1,733.00	5,199,000
丸井グループ	5,300	2,159.00	11,442,700
イオン	20,700	2,222.50	46,005,750
イズミ	1,700	6,480.00	11,016,000
ヤマダ電機	22,900	551.00	12,617,900
ニトリホールディングス	2,700	16,435.00	44,374,500
ファーストリテイリング	2,500	48,560.00	121,400,000
サンドラッグ	2,800	4,370.00	12,236,000
めぶきフィナンシャルグループ	28,000	369.00	10,332,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	30,000	551.00	16,530,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	329,600	636.50	209,790,400
りそなホールディングス	41,600	593.00	24,668,800
三井住友トラスト・ホールディングス	9,300	4,406.00	40,975,800
三井住友フィナンシャルグループ	33,500	4,293.00	143,815,500
千葉銀行	20,500	755.00	15,477,500
ふくおかフィナンシャルグループ	20,000	551.00	11,020,000

静岡銀行	14,600	978.00	14,278,800
みずほフィナンシャルグループ	602,100	188.70	113,616,270
大和証券グループ本社	40,300	654.00	26,356,200
野村ホールディングス	86,400	541.00	46,742,400
SOMPOホールディングス	9,800	4,399.00	43,110,200
MS&ADインシュアランスグループホール	14,100	3,407.00	48,038,700
第一生命ホールディングス	28,400	1,991.50	56,558,600
東京海上ホールディングス	17,700	5,313.00	94,040,100
クレディセゾン	4,400	1,681.00	7,396,400
イオンフィナンシャルサービス	5,300	2,225.00	11,792,500
アコム	37,900	411.00	15,576,900
日立キャピタル	3,000	2,826.00	8,478,000
オリックス	31,400	1,826.00	57,336,400
三菱UFJリース	21,200	666.00	14,119,200
日本取引所グループ	12,700	1,977.00	25,107,900
ヒューリック	15,700	1,163.00	18,259,100
三井不動産	23,500	2,694.00	63,309,000
三菱地所	33,000	1,911.00	63,063,000
住友不動産	11,000	4,071.00	44,781,000
イオンモール	5,400	1,848.00	9,979,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,800	1,130.00	8,814,000
総合警備保障	2,400	4,825.00	11,580,000
エムスリー	7,700	4,370.00	33,649,000
ディー・エヌ・エー	3,600	2,071.00	7,455,600
博報堂DYホールディングス	9,200	1,717.00	15,796,400
電通	6,800	5,090.00	34,612,000
みらかホールディングス	1,400	3,070.00	4,298,000
オリエンタルランド	8,600	11,355.00	97,653,000
ユー・エス・エス	7,400	2,049.00	15,162,600
楽天	34,000	797.20	27,104,800
リクルートホールディングス	40,200	3,093.00	124,338,600
東京ドーム	2,300	943.00	2,168,900
トランス・コスモス	1,200	2,596.00	3,115,200
セコム	5,500	8,364.00	46,002,000
ベネッセホールディングス	2,400	3,985.00	9,564,000

	小計	銘柄数 : 300 組入時価比率 : 99.8%			10,105,108,200	
					100.0%	
	合計				10,105,108,200	

(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(2018 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。