



2020年7月期 (2019年7月11日～2020年7月10日) 決算短信
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2020 (July 11, 2019 – July 10, 2020)

2020年8月19日
August 19, 2020

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 サポートダイヤル 山中 淳 TEL 0120-753104

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: 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18日
Scheduled date of submission of securities report: September 30, 2020
Date of commencing dividend payment: August 18, 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11日～2020年7月10日)

Management Status for Year ended July 2020 (from July 11, 2019 to July 10, 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	2,506	(98.9)	27	(1.1)	2,534	(100.0)
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	9,527	(99.9)	8	(0.1)	9,536	(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	30,294	1,900	23,709	8,485
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	30,294	0	0	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
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,742	207	2,534	29,872
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	9,759	223	9,536	31,478

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,212.9
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	671.3

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25期 (2019年7月10日現在) 25th Fiscal Year As of July 10, 2019	第26期 (2020年7月10日現在) 26th Fiscal Year As of July 10, 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	216,606,008	199,852,504
株式 Stocks	9,527,515,210	2,506,895,050
未収入金 Accounts receivable - other	681,240	20,074,860
未収配当金 Accrued dividends receivable	15,143,850	15,302,650
流動資産合計 Total current assets	9,759,946,308	2,742,125,064
資産合計 Total assets	9,759,946,308	2,742,125,064
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払金 Accounts payable - other	-	556,182
未払収益分配金 Unpaid dividends	203,368,945	187,779,081
未払受託者報酬 Trustee fee payable	3,926,405	3,631,355
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	16,490,783	15,251,556
未払利息 Accrued interest expenses	484	114
その他未払費用 Other accrued expenses	78,433	72,588
流動負債合計 Total current liabilities	223,865,050	207,290,876
負債合計 Total liabilities	223,865,050	207,290,876
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	7,331,339,906	2,053,528,752

剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,204,741,352	481,305,436
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	28,252	1,375
元本等合計 Total principal and other	9,536,081,258	2,534,834,188
純資産合計 Total net assets	9,536,081,258	2,534,834,188
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	9,759,946,308	2,742,125,064

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	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	第26期 自 2019年7月11日 至 2020年7月10日 26th Fiscal Year From July 11, 2019 to July 10, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	244,590,098	226,829,651
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△587,864,162	14,741,016
その他収益 Other revenue	177,462	85,181
営業収益合計 Total operating revenue	△343,096,602	241,655,848
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	66,642	39,644
受託者報酬 Trustee fee	7,917,890	7,494,857
委託者報酬 Investment trust management fee	33,254,892	31,478,292
その他費用 Other expenses	158,197	149,835
営業費用合計 Total operating expenses	41,397,621	39,162,628
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△384,494,223	202,493,220
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△384,494,223	202,493,220
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△384,494,223	202,493,220
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	2,792,604,520	2,204,741,352
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	-	157,225,000
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	-	157,225,000
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	-	1,895,375,055
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	-	1,895,375,055
分配金 Dividends	203,368,945	187,779,081
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,204,741,352	481,305,436

(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、2019年7月11日から2020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25期 2019年7月10日現在	第26期 2020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 8,485,656 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 314.78 円 (100口当たり純資産額) (31,478 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 298.72 円 (100口当たり純資産額) (29,872 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第25期 自2018年7月11日 至2019年7月10日	第26期 自2019年7月11日 至2020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>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> </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	<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>226,875,188 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>28,252 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	226,875,188 円	分配準備積立金	B	28,252 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																	
項目																			
当期配当等収益額	A	226,875,188 円																	
分配準備積立金	B	28,252 円																	

配当等収益合計額	C=A+B	244,728,176円	配当等収益合計額	C=A+B	226,903,440円
経費	D	41,330,979円	経費	D	39,122,984円
収益分配可能額	E=C-D	203,397,197円	収益分配可能額	E=C-D	187,780,456円
収益分配金	F	203,368,945円	収益分配金	F	187,779,081円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	28,252円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,375円
口数	H	30,294,793口	口数	H	8,485,656口
100口当たり分配金	I=F/H×100	671円30銭	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,212円90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25期 自2018年7月11日 至2019年7月10日	第26期 自2019年7月11日 至2020年7月10日
<p>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。</p> <p>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、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。</p> <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。 ○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っております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 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 同左</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25期 2019年7月10日現在	第26期 2020年7月10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。 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25期	第26期
------	------

自 2018年 7月 11日 至 2019年 7月 10日	自 2019年 7月 11日 至 2020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25期 自 2018年 7月 11日 至 2019年 7月 10日	第26期 自 2019年 7月 11日 至 2020年 7月 10日
期首元本額 7,331,339,906円	期首元本額 7,331,339,906円
期中追加設定元本額 0円	期中追加設定元本額 459,800,000円
期中一部交換元本額 0円	期中一部交換元本額 5,737,611,154円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第25期 自 2018年 7月 11日 至 2019年 7月 10日	第26期 自 2019年 7月 11日 至 2020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	△584,667,083	△13,917,082
合計	△584,667,083	△13,917,082

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(2020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	1,900	449.00	853,100	
		マルハニチロ	300	2,064.00	619,200	
		サカタのタネ	300	3,275.00	982,500	
		ホクト	200	1,981.00	396,200	
		国際石油開発帝石	8,900	598.20	5,323,980	
		コムシスホールディングス	900	3,115.00	2,803,500	
		大成建設	1,400	3,780.00	5,292,000	
		大林組	4,400	977.00	4,298,800	
		清水建設	4,800	836.00	4,012,800	
		鹿島建設	3,200	1,232.00	3,942,400	
		西松建設	300	2,015.00	604,500	
		前田建設工業	1,200	764.00	916,800	
		奥村組	200	2,441.00	488,200	

戸田建設	2,000	681.00	1,362,000
大東建託	400	9,708.00	3,883,200
N I P P O	700	2,640.00	1,848,000
前田道路	500	1,943.00	971,500
住友林業	1,100	1,293.00	1,422,300
大和ハウス工業	4,100	2,416.00	9,905,600
積水ハウス	4,200	2,022.50	8,494,500
中電工	400	2,173.00	869,200
関電工	1,300	877.00	1,140,100
九電工	400	3,120.00	1,248,000
日揮ホールディングス	1,600	1,094.00	1,750,400
高砂熱学工業	500	1,525.00	762,500
日清製粉グループ本社	1,900	1,522.00	2,891,800
山崎製パン	1,300	1,782.00	2,316,600
ヤクルト本社	1,000	6,270.00	6,270,000
明治ホールディングス	900	8,340.00	7,506,000
雪印メグミルク	400	2,435.00	974,000
日本ハム	600	4,255.00	2,553,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,800	618.00	1,112,400
サッポロホールディングス	500	1,896.00	948,000
アサヒグループホールディングス	3,000	3,587.00	10,761,000
キリンホールディングス	5,600	2,086.50	11,684,400
宝ホールディングス	1,200	948.00	1,137,600
伊藤園	500	6,180.00	3,090,000
キッコーマン	1,200	4,850.00	5,820,000
味の素	3,400	1,721.50	5,853,100
キューピー	900	1,882.00	1,693,800
ハウス食品グループ本社	600	3,280.00	1,968,000
ニチレイ	900	3,040.00	2,736,000
日清食品ホールディングス	600	9,510.00	5,706,000
日本たばこ産業	8,200	1,930.00	15,826,000
東洋紡	500	1,433.00	716,500
帝人	1,200	1,650.00	1,980,000
東レ	10,000	484.20	4,842,000
ワコールホールディングス	400	1,882.00	752,800

オンワードホールディングス	1,000	284.00	284,000
王子ホールディングス	6,200	465.00	2,883,000
日本製紙	700	1,407.00	984,900
レンゴー	1,700	816.00	1,387,200
クラレ	2,200	1,080.00	2,376,000
旭化成	8,500	823.60	7,000,600
住友化学	10,100	312.00	3,151,200
デンカ	500	2,551.00	1,275,500
信越化学工業	2,500	12,410.00	31,025,000
大陽日酸	2,600	1,774.00	4,612,400
日本触媒	200	5,390.00	1,078,000
カネカ	400	2,574.00	1,029,600
三菱瓦斯化学	1,400	1,603.00	2,244,200
三井化学	1,300	2,167.00	2,817,100
東京応化工業	300	5,650.00	1,695,000
三菱ケミカルホールディングス	9,200	607.30	5,587,160
ダイセル	1,900	764.00	1,451,600
積水化学工業	2,900	1,466.00	4,251,400
宇部興産	600	1,757.00	1,054,200
花王	2,900	8,409.00	24,386,100
日本ペイントホールディングス	2,000	7,740.00	15,480,000
D I C	600	2,644.00	1,586,400
東洋インキSCホールディングス	400	1,997.00	798,800
富士フイルムホールディングス	3,100	4,639.00	14,380,900
資生堂	2,400	6,712.00	16,108,800
ライオン	1,800	2,645.00	4,761,000
日東電工	1,000	5,850.00	5,850,000
ユニ・チャーム	3,800	4,873.00	18,517,400
協和キリン	3,300	2,680.00	8,844,000
武田薬品工業	9,600	3,670.00	35,232,000
アステラス製薬	11,400	1,713.50	19,533,900
塩野義製薬	1,900	6,134.00	11,654,600
中外製薬	10,300	5,398.00	55,599,400
エーザイ	1,800	8,723.00	15,701,400
第一三共	4,300	8,459.00	36,373,700

大塚ホールディングス	3,400	4,446.00	15,116,400
大正製薬ホールディングス	500	6,150.00	3,075,000
出光興産	1,800	2,248.00	4,046,400
E N E O Sホールディングス	19,800	374.80	7,421,040
横浜ゴム	1,000	1,452.00	1,452,000
ブリヂストン	4,400	3,390.00	14,916,000
住友ゴム工業	1,600	964.00	1,542,400
A G C	1,400	2,976.00	4,166,400
日本板硝子	600	360.00	216,000
日本電気硝子	600	1,629.00	977,400
太平洋セメント	800	2,283.00	1,826,400
T O T O	1,100	4,155.00	4,570,500
日本碍子	2,000	1,382.00	2,764,000
日本製鉄	5,800	980.30	5,685,740
神戸製鋼所	2,200	353.00	776,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	3,800	750.00	2,850,000
日立金属	2,600	1,275.00	3,315,000
日本軽金属ホールディングス	3,800	182.00	691,600
三井金属鉱業	400	2,245.00	898,000
三菱マテリアル	800	2,228.00	1,782,400
住友金属鉱山	1,800	3,157.00	5,682,600
D O W Aホールディングス	400	3,245.00	1,298,000
古河機械金属	200	1,051.00	210,200
古河電気工業	400	2,550.00	1,020,000
住友電気工業	4,900	1,215.00	5,953,500
フジクラ	1,800	304.00	547,200
S U M C O	1,800	1,620.00	2,916,000
東洋製罐グループホールディングス	1,200	1,134.00	1,360,800
三和ホールディングス	1,400	890.00	1,246,000
L I X I Lグループ	1,900	1,471.00	2,794,900
オークマ	200	4,445.00	889,000
アマダ	2,200	790.00	1,738,000
S M C	400	55,700.00	22,280,000
小松製作所	5,900	2,160.00	12,744,000
住友重機械工業	800	2,178.00	1,742,400

日立建機	1,300	3,000.00	3,900,000
クボタ	7,500	1,518.00	11,385,000
荏原製作所	600	2,493.00	1,495,800
ダイキン工業	1,800	18,415.00	33,147,000
栗田工業	700	2,943.00	2,060,100
椿本チエイン	200	2,493.00	498,600
ダイフク	800	10,030.00	8,024,000
平和	600	1,762.00	1,057,200
アマノ	500	2,212.00	1,106,000
セガサミーホールディングス	1,600	1,281.00	2,049,600
日本精工	3,400	744.00	2,529,600
NTN	3,300	198.00	653,400
ジェイテクト	2,100	761.00	1,598,100
不二越	200	3,245.00	649,000
三菱重工業	2,100	2,538.00	5,329,800
IHI	900	1,492.00	1,342,800
コニカミノルタ	3,100	360.00	1,116,000
ブラザー工業	1,600	1,833.00	2,932,800
ミネベアミツミ	2,600	1,836.00	4,773,600
日立製作所	5,900	3,342.00	19,717,800
三菱電機	13,100	1,376.50	18,032,150
富士電機	900	2,781.00	2,502,900
日本電産	3,600	6,985.00	25,146,000
日本電気	1,700	5,550.00	9,435,000
富士通	1,300	12,960.00	16,848,000
パナソニック	15,000	954.90	14,323,500
ソニー	7,700	7,780.00	59,906,000
TDK	800	10,480.00	8,384,000
キーエンス	1,500	44,840.00	67,260,000
ファナック	1,200	19,725.00	23,670,000
京セラ	2,300	5,637.00	12,965,100
村田製作所	4,100	6,480.00	26,568,000
キヤノン	8,200	2,007.00	16,457,400
リコー	4,600	766.00	3,523,600
東京エレクトロン	1,000	29,610.00	29,610,000

豊田自動織機	2,000	5,460.00	10,920,000
デンソー	4,800	4,071.00	19,540,800
三井E&Sホールディングス	500	409.00	204,500
川崎重工業	1,000	1,487.00	1,487,000
日産自動車	25,800	374.80	9,669,840
トヨタ自動車	20,000	6,568.00	131,360,000
新明和工業	400	992.00	396,800
本田技研工業	11,100	2,636.50	29,265,150
シマノ	600	20,980.00	12,588,000
テルモ	4,600	3,899.00	17,935,400
島津製作所	1,800	2,876.00	5,176,800
ニコン	2,300	834.00	1,918,200
オリンパス	8,400	1,978.00	16,615,200
HOYA	2,300	10,735.00	24,690,500
シチズン時計	1,900	317.00	602,300
バンダイナムコホールディングス	1,400	5,762.00	8,066,800
トッパン・フォームズ	700	1,034.00	723,800
凸版印刷	2,100	1,693.00	3,555,300
大日本印刷	2,000	2,417.00	4,834,000
NISSHA	300	953.00	285,900
アシックス	1,200	1,195.00	1,434,000
ヤマハ	1,200	4,710.00	5,652,000
ピジョン	700	4,395.00	3,076,500
リンテック	500	2,534.00	1,267,000
任天堂	800	48,680.00	38,944,000
タカラスタンダード	500	1,492.00	746,000
コクヨ	800	1,200.00	960,000
オカムラ	700	719.00	503,300
東京電力ホールディングス	9,800	305.00	2,989,000
中部電力	4,600	1,334.50	6,138,700
関西電力	5,700	1,060.00	6,042,000
東北電力	3,100	1,009.00	3,127,900
九州電力	2,900	893.00	2,589,700
東京瓦斯	2,700	2,568.50	6,934,950
大阪瓦斯	2,500	2,112.00	5,280,000

東武鉄道	1,300	3,380.00	4,394,000
東急	3,800	1,382.00	5,251,600
小田急電鉄	2,300	2,570.00	5,911,000
東日本旅客鉄道	2,300	7,116.00	16,366,800
西日本旅客鉄道	1,200	5,389.00	6,466,800
東海旅客鉄道	1,300	15,055.00	19,571,500
近鉄グループホールディングス	1,200	4,555.00	5,466,000
阪急阪神ホールディングス	1,600	3,415.00	5,464,000
日本通運	600	5,600.00	3,360,000
ヤマトホールディングス	2,500	2,679.00	6,697,500
福山通運	300	3,645.00	1,093,500
セイノーホールディングス	1,300	1,374.00	1,786,200
S Gホールディングス	2,000	3,705.00	7,410,000
日本郵船	1,000	1,466.00	1,466,000
商船三井	700	1,911.00	1,337,700
日本航空	2,100	1,907.00	4,004,700
ANAホールディングス	2,100	2,347.50	4,929,750
三菱倉庫	500	2,694.00	1,347,000
三井倉庫ホールディングス	200	1,479.00	295,800
住友倉庫	500	1,221.00	610,500
上組	800	2,016.00	1,612,800
T I S	1,600	2,250.00	3,600,000
ネクソン	5,400	2,593.00	14,002,200
野村総合研究所	3,900	2,897.00	11,298,300
オービック	600	19,090.00	11,454,000
Zホールディングス	29,500	532.00	15,694,000
トレンドマイクロ	900	6,180.00	5,562,000
日本オラクル	800	13,370.00	10,696,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,500	4,175.00	6,262,500
大塚商会	1,200	5,640.00	6,768,000
日本ユニシス	700	3,255.00	2,278,500
日本電信電話	16,100	2,515.00	40,491,500
KDD I	14,100	3,265.00	46,036,500
N T T ドコモ	19,700	2,935.50	57,829,350
東宝	1,100	3,540.00	3,894,000

エヌ・ティ・ティ・データ	8,600	1,191.00	10,242,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	700	5,520.00	3,864,000
コナミホールディングス	900	3,270.00	2,943,000
ソフトバンクグループ	12,800	6,267.00	80,217,600
双日	7,700	229.00	1,763,300
伊藤忠商事	9,700	2,296.00	22,271,200
丸紅	10,600	469.30	4,974,580
豊田通商	2,200	2,663.00	5,858,600
三井物産	10,500	1,560.00	16,380,000
住友商事	7,600	1,205.00	9,158,000
三菱商事	9,100	2,241.50	20,397,650
キヤノンマーケティングジャパン	800	2,123.00	1,698,400
岩谷産業	300	3,710.00	1,113,000
サンリオ	500	1,562.00	781,000
スズケン	600	3,810.00	2,286,000
ローソン	600	5,500.00	3,300,000
エービーシー・マート	500	5,890.00	2,945,000
J. フロント リテイリング	1,700	658.00	1,118,600
三越伊勢丹ホールディングス	2,400	574.00	1,377,600
セブン&アイ・ホールディングス	5,400	3,304.00	17,841,600
良品計画	1,700	1,371.00	2,330,700
パン・パシフィック・インターナショナルホ	3,900	2,420.00	9,438,000
ファミリーマート	3,100	2,306.00	7,148,600
しまむら	200	7,230.00	1,446,000
高島屋	1,100	801.00	881,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	800	661.00	528,800
丸井グループ	1,400	1,693.00	2,370,200
イオン	5,300	2,386.50	12,648,450
イズミ	400	3,205.00	1,282,000
ヤマダ電機	5,900	492.00	2,902,800
ニトリホールディングス	700	21,920.00	15,344,000
ファーストリテイリング	600	60,280.00	36,168,000
サンドラッグ	700	3,465.00	2,425,500
めぶきフィナンシャルグループ	7,200	245.00	1,764,000

コンコルディア・フィナンシャルグループ	7,400	335.00	2,479,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	83,000	410.00	34,030,000
りそなホールディングス	10,600	360.30	3,819,180
三井住友トラスト・ホールディングス	2,300	2,907.50	6,687,250
三井住友フィナンシャルグループ	8,400	2,980.00	25,032,000
千葉銀行	5,000	504.00	2,520,000
ふくおかフィナンシャルグループ	1,200	1,629.00	1,954,800
静岡銀行	3,600	682.00	2,455,200
みずほフィナンシャルグループ	155,300	130.00	20,189,000
大和証券グループ本社	10,400	464.20	4,827,680
野村ホールディングス	21,400	483.70	10,351,180
SOMPOホールディングス	2,300	3,641.00	8,374,300
MS&ADインシュアランスグループホール	3,600	2,859.50	10,294,200
第一生命ホールディングス	7,300	1,278.50	9,333,050
東京海上ホールディングス	4,300	4,663.00	20,050,900
クレディセゾン	1,100	1,071.00	1,178,100
イオンフィナンシャルサービス	1,300	889.00	1,155,700
アコム	9,800	374.00	3,665,200
日立キャピタル	800	2,331.00	1,864,800
オリックス	8,000	1,278.00	10,224,000
三菱UFJリース	5,500	477.00	2,623,500
日本取引所グループ	3,300	2,540.00	8,382,000
ヒューリック	4,100	940.00	3,854,000
三井不動産	6,000	1,710.00	10,260,000
三菱地所	8,500	1,503.50	12,779,750
住友不動産	2,900	2,580.50	7,483,450
イオンモール	1,400	1,238.00	1,733,200
総合警備保障	600	4,900.00	2,940,000
エムスリー	4,100	4,895.00	20,069,500
ディー・エヌ・エー	800	1,290.00	1,032,000
博報堂DYホールディングス	2,400	1,133.00	2,719,200
電通グループ	1,800	2,393.00	4,307,400
H. U. グループホールディングス	400	2,503.00	1,001,200

	オリエンタルランド	2,200	13,865.00	30,503,000	
	ユー・エス・エス	1,900	1,646.00	3,127,400	
	サイバーエージェント	800	5,980.00	4,784,000	
	楽天	8,800	988.00	8,694,400	
	リクルートホールディングス	10,400	3,570.00	37,128,000	
	日本郵政	11,900	750.80	8,934,520	
	東京ドーム	600	705.00	423,000	
	トランス・コスモス	300	2,513.00	753,900	
	セコム	1,400	9,242.00	12,938,800	
	ベネッセホールディングス	600	2,766.00	1,659,600	
	小計 銘柄数：300			2,506,895,050	
	組入時価比率：98.9%			100.0%	
	合計			2,506,895,050	

(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(2020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。