



2019年10月期 (2019年4月8日～2019年10月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2019 (April 8, 2019 – October 7, 2019)

2019年11月18日
 November 18, 2019

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信
 コード番号 (1598)
 連動対象指標 Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックス(配当除く)
 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 商品企画部長 増田 真一 TEL(03)-3241-9511

Fund name: NEXT FUNDS Russell/Nomura Fundamental Index Exchange Traded Fund
 Code: 1598
 Underlying index: Russell/Nomura Fundamental Prime Index (exclusive of dividends)
 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: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 2019年12月26日
 分配金支払開始日 2019年11月15日
 Scheduled date of submission of securities report: December 26, 2019
 Date of commencing dividend payment: November 15, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年10月期の運用状況 (2019年4月8日～2019年10月7日)

Management Status for Year ended October 2019 (from April 8, 2019 to October 7, 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10月期 FY ended Oct. 2019	2,534	(97.6)	61	(2.4)	2,595	(100.0)
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	2,688	(97.8)	61	(2.2)	2,749	(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10月期 FY ended Oct. 2019	154	0	0	154
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	154	0	0	154

(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))	1口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×1 Net Asset Value per 1 unit (③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×1)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	2,635	39	2,595	16,853
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	2,793	43	2,749	17,851

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	217
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	235

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11期 (2019年4月7日現在) 11th Fiscal Year As of April 7, 2019	第12期 (2019年10月7日現在) 12th Fiscal Year As of October 7, 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	64,176,016	63,257,056
株式 Stocks	2,688,252,265	2,534,880,820
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	1,279,755	681,564
未収入金 Accounts receivable - other	657,998	824,604
未収配当金 Accrued dividends receivable	37,667,702	33,833,852
差入委託証拠金 Customers' margin	1,122,249	2,206,020
流動資産合計 Total current assets	2,793,155,985	2,635,683,916
資産合計 Total assets	2,793,155,985	2,635,683,916
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	-	746,088
未払収益分配金 Unpaid dividends	36,196,580	33,424,076
未払受託者報酬 Trustee fee payable	737,345	702,852
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	3,686,641	3,514,164
未払利息 Accrued interest expenses	411	34
その他未払費用 Other accrued expenses	2,919,418	1,401,248
流動負債合計 Total current liabilities	43,540,395	39,788,462
負債合計 Total liabilities	43,540,395	39,788,462
純資産の部 Net assets		

元本等 Principal and other		
元本 Principal	2,053,039,212	2,053,039,212
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	696,576,378	542,856,242
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	130,241	61,950
元本等合計 Total principal and other	2,749,615,590	2,595,895,454
純資産合計 Total net assets	2,749,615,590	2,595,895,454
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	2,793,155,985	2,635,683,916

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第11期 自 2018年10月8日 至 2019年4月7日 11th Fiscal Year From October 8, 2018 to April 7, 2019	第12期 自 2019年4月8日 至 2019年10月7日 12th Fiscal Year From April 8, 2019 to October 7, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	42,112,051	38,948,412
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△325,068,827	△151,843,005
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△3,841,719	△1,808,840
その他収益 Other revenue	34,442	33,617
営業収益合計 Total operating revenue	△286,764,053	△114,669,816
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	18,228	14,496
受託者報酬 Trustee fee	737,345	702,852
委託者報酬 Investment trust management fee	3,686,641	3,514,164
その他費用 Other expenses	1,452,969	1,394,732
営業費用合計 Total operating expenses	5,895,183	5,626,244
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△292,659,236	△120,296,060
経常利益又は経常損失 (△)	△292,659,236	△120,296,060

Ordinary profit (loss)		
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△292,659,236	△120,296,060
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	1,025,432,194	696,576,378
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	-	-
分配金 Dividends	36,196,580	33,424,076
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	696,576,378	542,856,242

(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る場合、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、2019 年 4 月 8 日から 2019 年 10 月 7 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 11 期 2019 年 4 月 7 日現在	第 12 期 2019 年 10 月 7 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 154,028 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 154,028 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 17,851 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 16,853 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 11 期 自 2018 年 10 月 8 日 至 2019 年 4 月 7 日	第 12 期 自 2019 年 4 月 8 日 至 2019 年 10 月 7 日
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程

項目			項目		
当期配当等収益額	A	42,128,265 円	当期配当等収益額	A	38,967,533 円
分配準備積立金	B	75,511 円	分配準備積立金	B	130,241 円
配当等収益合計額	C=A+B	42,203,776 円	配当等収益合計額	C=A+B	39,097,774 円
経費	D	5,876,955 円	経費	D	5,611,748 円
収益分配可能額	E=C-D	36,326,821 円	収益分配可能額	E=C-D	33,486,026 円
収益分配金	F	36,196,580 円	収益分配金	F	33,424,076 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	130,241 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	61,950 円
口数	H	154,028 口	口数	H	154,028 口
1口当たり分配金	I=F/H	235 円	1口当たり分配金	I=F/H	217 円

<p>2. その他費用</p> <p>その他費用のうち 1,327,151 円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>	<p>2. その他費用</p> <p>その他費用のうち 1,264,496 円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>
---	---

(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 11 期 自 2018 年 10 月 8 日 至 2019 年 4 月 7 日	第 12 期 自 2019 年 4 月 8 日 至 2019 年 10 月 7 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価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</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 11 期 2019 年 4 月 7 日現在	第 12 期 2019 年 10 月 7 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>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>

<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>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>	
--	--

(関連当事者との取引に関する注記)

<p>第11期 自2018年10月8日 至2019年4月7日</p>	<p>第12期 自2019年4月8日 至2019年10月7日</p>
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

<p>第11期 自2018年10月8日 至2019年4月7日</p>	<p>第12期 自2019年4月8日 至2019年10月7日</p>		
期首元本額	2,053,039,212円	期首元本額	2,053,039,212円
期中追加設定元本額	0円	期中追加設定元本額	0円
期中一部交換元本額	0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11期 自2018年10月8日 至2019年4月7日	第12期 自2019年4月8日 至2019年10月7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	△296,188,289	△151,424,140
合計	△296,188,289	△151,424,140

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11期(2019年4月7日現在)				第12期(2019年10月7日現在)			
	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	58,767,249	—	60,051,000	1,279,755	59,796,420	—	59,736,000	△64,524
合計	58,767,249	—	60,051,000	1,279,755	59,796,420	—	59,736,000	△64,524

(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(2019年10月7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	586.00	1,113,400	
		マルハニチロ	200	2,774.00	554,800	
		国際石油開発帝石	5,200	931.70	4,844,840	
		石油資源開発	500	2,615.00	1,307,500	
		ミライト・ホールディングス	500	1,605.00	802,500	
		安藤・間	1,000	773.00	773,000	
		コムシスホールディングス	600	2,992.00	1,795,200	
		大成建設	1,300	3,970.00	5,161,000	
		大林組	5,200	1,031.00	5,361,200	
		清水建設	3,600	974.00	3,506,400	
		長谷工コーポレーション	2,300	1,266.00	2,911,800	
		鹿島建設	2,800	1,372.00	3,841,600	
		西松建設	400	1,951.00	780,400	
		三井住友建設	900	551.00	495,900	
		前田建設工業	600	934.00	560,400	
		奥村組	200	2,872.00	574,400	
		戸田建設	1,300	611.00	794,300	
		熊谷組	300	2,990.00	897,000	
		大東建託	500	13,770.00	6,885,000	
		N I P P O	500	2,077.00	1,038,500	
		前田道路	500	2,316.00	1,158,000	
		五洋建設	1,400	579.00	810,600	
		住友林業	1,100	1,430.00	1,573,000	
		大和ハウス工業	3,300	3,529.00	11,645,700	
		積水ハウス	5,200	2,149.00	11,174,800	
		関電工	700	957.00	669,900	
		きんでん	1,000	1,580.00	1,580,000	
協和エクシオ	400	2,545.00	1,018,000			
九電工	200	3,405.00	681,000			
日揮ホールディングス	1,100	1,374.00	1,511,400			
千代田化工建設	1,000	272.00	272,000			

日本製粉	400	1,679.00	671,600
日清製粉グループ本社	800	1,967.00	1,573,600
江崎グリコ	200	4,480.00	896,000
山崎製パン	800	1,943.00	1,554,400
カルビー	300	3,355.00	1,006,500
森永乳業	400	4,145.00	1,658,000
ヤクルト本社	200	5,830.00	1,166,000
明治ホールディングス	600	7,680.00	4,608,000
雪印メグミルク	400	2,589.00	1,035,600
プリマハム	300	2,338.00	701,400
日本ハム	1,000	4,495.00	4,495,000
丸大食品	300	2,224.00	667,200
伊藤ハム米久ホールディングス	1,600	673.00	1,076,800
サッポロホールディングス	500	2,742.00	1,371,000
アサヒグループホールディングス	1,400	5,349.00	7,488,600
キリンホールディングス	3,900	2,282.50	8,901,750
宝ホールディングス	500	1,054.00	527,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	700	2,440.00	1,708,000
サントリー食品インターナショナル	700	4,605.00	3,223,500
伊藤園	300	5,160.00	1,548,000
日清オイリオグループ	300	3,480.00	1,044,000
不二製油グループ本社	200	3,195.00	639,000
キッコーマン	300	5,070.00	1,521,000
味の素	3,300	2,011.50	6,637,950
キューピー	700	2,379.00	1,665,300
ハウス食品グループ本社	300	4,075.00	1,222,500
カゴメ	300	2,763.00	828,900
ニチレイ	600	2,438.00	1,462,800
東洋水産	500	4,275.00	2,137,500
日清食品ホールディングス	300	7,960.00	2,388,000
日本たばこ産業	6,300	2,346.00	14,779,800
東洋紡	700	1,354.00	947,800
帝人	1,500	2,024.00	3,036,000
東レ	10,100	788.50	7,963,850
ワコールホールディングス	300	2,733.00	819,900

T S I ホールディングス	1,000	582.00	582,000
オンワードホールディングス	1,300	578.00	751,400
王子ホールディングス	5,300	508.00	2,692,400
日本製紙	1,200	1,804.00	2,164,800
北越コーポレーション	1,300	537.00	698,100
大王製紙	500	1,407.00	703,500
レンゴー	1,300	750.00	975,000
クラレ	2,500	1,294.00	3,235,000
旭化成	6,100	1,073.00	6,545,300
昭和電工	500	2,747.00	1,373,500
住友化学	14,900	483.00	7,196,700
日産化学	300	4,255.00	1,276,500
クレハ	100	6,440.00	644,000
日本曹達	200	2,642.00	528,400
東ソー	2,200	1,408.00	3,097,600
トクヤマ	500	2,495.00	1,247,500
セントラル硝子	400	2,291.00	916,400
東亜合成	800	1,173.00	938,400
デンカ	500	2,888.00	1,444,000
信越化学工業	1,400	11,215.00	15,701,000
エア・ウォーター	1,000	1,918.00	1,918,000
大陽日酸	600	2,081.00	1,248,600
日本触媒	200	6,110.00	1,222,000
カネカ	400	3,385.00	1,354,000
三菱瓦斯化学	1,300	1,402.00	1,822,600
三井化学	1,600	2,392.00	3,827,200
J S R	1,400	1,731.00	2,423,400
東京応化工業	200	4,165.00	833,000
三菱ケミカルホールディングス	14,100	760.80	10,727,280
ダイセル	2,300	907.00	2,086,100
住友ベークライト	200	4,185.00	837,000
積水化学工業	2,800	1,676.00	4,692,800
日本ゼオン	900	1,283.00	1,154,700
アイカ工業	200	3,175.00	635,000
宇部興産	1,100	2,130.00	2,343,000

日立化成	900	3,545.00	3,190,500
日本化薬	900	1,272.00	1,144,800
ADEKA	500	1,352.00	676,000
日油	300	3,545.00	1,063,500
花王	1,400	7,880.00	11,032,000
日本ペイントホールディングス	400	5,890.00	2,356,000
関西ペイント	800	2,500.00	2,000,000
DIC	700	2,958.00	2,070,600
東洋インキSCホールディングス	300	2,452.00	735,600
富士フイルムホールディングス	2,800	4,573.00	12,804,400
資生堂	500	8,552.00	4,276,000
ライオン	600	2,095.00	1,257,000
ポーラ・オルビスホールディングス	200	2,383.00	476,600
小林製薬	100	8,410.00	841,000
日東電工	900	5,188.00	4,669,200
ニフコ	500	2,510.00	1,255,000
ユニ・チャーム	900	3,341.00	3,006,900
協和キリン	800	1,987.00	1,589,600
武田薬品工業	4,000	3,621.00	14,484,000
アステラス製薬	10,400	1,505.50	15,657,200
大日本住友製薬	300	1,699.00	509,700
塩野義製薬	700	6,036.00	4,225,200
田辺三菱製薬	1,100	1,166.00	1,282,600
中外製薬	300	8,170.00	2,451,000
科研製薬	100	4,925.00	492,500
エーザイ	500	5,405.00	2,702,500
ロート製薬	200	2,889.00	577,800
小野薬品工業	800	1,873.50	1,498,800
久光製薬	100	4,550.00	455,000
参天製薬	1,000	1,845.00	1,845,000
ツムラ	200	2,844.00	568,800
沢井製薬	200	5,340.00	1,068,000
第一三共	1,900	6,626.00	12,589,400
大塚ホールディングス	1,700	4,084.00	6,942,800
大正製薬ホールディングス	100	7,760.00	776,000

出光興産	1,200	3,030.00	3,636,000
JXTGホールディングス	33,600	482.20	16,201,920
コスモエネルギーホールディングス	500	2,211.00	1,105,500
横浜ゴム	800	2,121.00	1,696,800
TOYO TIRE	700	1,319.00	923,300
ブリヂストン	5,400	4,131.00	22,307,400
住友ゴム工業	2,000	1,264.00	2,528,000
AGC	1,700	3,320.00	5,644,000
日本板硝子	900	627.00	564,300
日本電気硝子	600	2,340.00	1,404,000
住友大阪セメント	300	4,510.00	1,353,000
太平洋セメント	1,200	2,802.00	3,362,400
TOTO	600	3,960.00	2,376,000
日本碍子	1,400	1,518.00	2,125,200
日本特殊陶業	800	1,987.00	1,589,600
ニチアス	300	1,824.00	547,200
日本製鉄	10,000	1,481.00	14,810,000
神戸製鋼所	5,600	564.00	3,158,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	4,700	1,286.00	6,044,200
大和工業	200	2,667.00	533,400
丸一鋼管	200	2,780.00	556,000
大同特殊鋼	300	4,330.00	1,299,000
日立金属	1,700	1,174.00	1,995,800
日本軽金属ホールディングス	6,100	197.00	1,201,700
三井金属鉱業	600	2,513.00	1,507,800
三菱マテリアル	1,400	2,873.00	4,022,200
住友金属鉱山	1,300	3,320.00	4,316,000
DOWAホールディングス	500	3,645.00	1,822,500
UACJ	300	1,753.00	525,900
古河電気工業	600	2,650.00	1,590,000
住友電気工業	8,300	1,341.50	11,134,450
フジクラ	3,900	411.00	1,602,900
リョービ	200	1,746.00	349,200
SUMCO	1,000	1,439.00	1,439,000
東洋製罐グループホールディングス	1,100	1,682.00	1,850,200

三和ホールディングス	1,100	1,205.00	1,325,500
三協立山	500	1,119.00	559,500
LIXILグループ	2,600	1,909.00	4,963,400
リンナイ	200	7,290.00	1,458,000
日本発條	1,900	807.00	1,533,300
日本製鋼所	300	2,053.00	615,900
オークマ	100	5,800.00	580,000
アマダホールディングス	2,300	1,120.00	2,576,000
牧野フライス製作所	200	4,545.00	909,000
オーエスジー	400	2,190.00	876,000
DMG 森精機	1,200	1,493.00	1,791,600
ディスコ	100	20,750.00	2,075,000
ナブテスコ	600	3,240.00	1,944,000
SMC	200	46,070.00	9,214,000
小松製作所	4,200	2,375.00	9,975,000
住友重機械工業	800	3,100.00	2,480,000
日立建機	600	2,438.00	1,462,800
クボタ	4,600	1,557.00	7,162,200
荏原製作所	600	2,829.00	1,697,400
ダイキン工業	700	14,080.00	9,856,000
栗田工業	600	2,738.00	1,642,800
椿本チエイン	200	3,400.00	680,000
ダイフク	200	5,600.00	1,120,000
タダノ	500	993.00	496,500
フジテック	500	1,374.00	687,000
平和	300	2,164.00	649,200
SANKYO	300	3,685.00	1,105,500
アマノ	300	3,200.00	960,000
グローリー	500	3,005.00	1,502,500
セガサミーホールディングス	1,300	1,547.00	2,011,100
ホシザキ	100	8,370.00	837,000
日本精工	3,000	910.00	2,730,000
NTN	3,900	309.00	1,205,100
ジェイテクト	2,000	1,214.00	2,428,000
THK	600	2,747.00	1,648,200

マキタ	600	3,045.00	1,827,000
日立造船	1,800	346.00	622,800
三菱重工業	2,900	4,211.00	12,211,900
I H I	700	2,286.00	1,600,200
日清紡ホールディングス	1,400	817.00	1,143,800
イビデン	1,300	2,255.00	2,931,500
コニカミノルタ	4,000	739.00	2,956,000
ブラザー工業	1,600	1,897.00	3,035,200
ミネベアミツミ	1,500	1,793.00	2,689,500
日立製作所	9,700	4,006.00	38,858,200
東芝	1,600	3,540.00	5,664,000
三菱電機	13,300	1,426.50	18,972,450
富士電機	600	3,255.00	1,953,000
安川電機	600	3,920.00	2,352,000
マブチモーター	300	3,960.00	1,188,000
日本電産	300	14,210.00	4,263,000
JVCケンウッド	2,200	315.00	693,000
オムロン	1,200	5,810.00	6,972,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	600	1,844.00	1,106,400
日本電気	2,500	4,625.00	11,562,500
富士通	1,600	8,626.00	13,801,600
沖電気工業	1,000	1,409.00	1,409,000
ルネサスエレクトロニクス	2,500	689.00	1,722,500
セイコーエプソン	2,200	1,420.00	3,124,000
アルバック	300	4,460.00	1,338,000
ジャパンディスプレイ	13,500	56.00	756,000
パナソニック	18,500	875.70	16,200,450
シャープ	700	1,191.00	833,700
アンリツ	400	2,047.00	818,800
富士通ゼネラル	400	1,736.00	694,400
ソニー	4,200	6,207.00	26,069,400
TDK	700	9,920.00	6,944,000
アルプスアルパイン	1,400	2,043.00	2,860,200
フォスター電機	600	1,878.00	1,126,800
ヒロセ電機	100	13,300.00	1,330,000

日本航空電子工業	400	1,630.00	652,000
マクセルホールディングス	500	1,550.00	775,000
横河電機	800	1,827.00	1,461,600
アズビル	600	2,848.00	1,708,800
日本光電工業	300	3,085.00	925,500
堀場製作所	200	6,380.00	1,276,000
アドバンテスト	400	4,845.00	1,938,000
キーエンス	100	64,590.00	6,459,000
シスメックス	200	6,986.00	1,397,200
スタンレー電気	600	2,780.00	1,668,000
ウシオ電機	600	1,486.00	891,600
カシオ計算機	1,200	1,653.00	1,983,600
ファナック	600	19,250.00	11,550,000
ローム	500	8,350.00	4,175,000
浜松ホトニクス	300	3,915.00	1,174,500
京セラ	1,500	6,598.00	9,897,000
太陽誘電	500	2,671.00	1,335,500
村田製作所	1,900	5,528.00	10,503,200
小糸製作所	400	5,260.00	2,104,000
S C R E E Nホールディングス	200	6,480.00	1,296,000
キヤノン	7,800	2,825.50	22,038,900
リコー	5,700	952.00	5,426,400
東京エレクトロン	600	20,845.00	12,507,000
トヨタ紡織	600	1,469.00	881,400
ユニプレス	600	1,670.00	1,002,000
豊田自動織機	900	6,150.00	5,535,000
デンソー	3,400	4,578.00	15,565,200
東海理化電機製作所	500	1,812.00	906,000
三井E&Sホールディングス	500	939.00	469,500
川崎重工業	1,300	2,360.00	3,068,000
日産自動車	27,900	657.10	18,333,090
いすゞ自動車	4,300	1,161.00	4,992,300
トヨタ自動車	16,000	6,986.00	111,776,000
日野自動車	2,700	875.00	2,362,500
三菱自動車工業	7,300	469.00	3,423,700

日産車体	1,200	852.00	1,022,400
新明和工業	600	1,237.00	742,200
日信工業	500	1,475.00	737,500
タチエス	500	1,308.00	654,000
NOK	1,100	1,589.00	1,747,900
KYB	200	2,999.00	599,800
プレス工業	1,300	440.00	572,000
ケーヒン	500	1,636.00	818,000
アイシン精機	1,900	3,385.00	6,431,500
マツダ	8,600	945.70	8,133,020
本田技研工業	18,800	2,730.00	51,324,000
スズキ	2,300	4,395.00	10,108,500
SUBARU	5,100	2,895.50	14,767,050
ヤマハ発動機	1,800	1,938.00	3,488,400
ショーワ	600	1,570.00	942,000
エクセディ	200	2,080.00	416,000
豊田合成	700	2,082.00	1,457,400
日本精機	400	1,612.00	644,800
エフ・シー・シー	200	2,052.00	410,400
シマノ	200	15,700.00	3,140,000
テイ・エス テック	500	3,200.00	1,600,000
テルモ	1,200	3,315.00	3,978,000
島津製作所	400	2,625.00	1,050,000
ニコン	2,000	1,315.00	2,630,000
オリンパス	2,700	1,445.00	3,901,500
HOYA	1,600	8,524.00	13,638,400
シチズン時計	2,200	535.00	1,177,000
ニプロ	900	1,203.00	1,082,700
バンダイナムコホールディングス	900	6,580.00	5,922,000
パイロットコーポレーション	100	3,900.00	390,000
タカラトミー	600	1,196.00	717,600
凸版印刷	2,900	1,900.00	5,510,000
大日本印刷	2,400	2,777.00	6,664,800
アシックス	1,000	1,742.00	1,742,000
ヤマハ	400	4,755.00	1,902,000

ビジョン	100	4,300.00	430,000
リンテック	300	2,141.00	642,300
任天堂	100	40,410.00	4,041,000
コクヨ	400	1,480.00	592,000
東京電力ホールディングス	36,900	535.00	19,741,500
中部電力	7,100	1,626.00	11,544,600
関西電力	6,200	1,217.00	7,545,400
中国電力	2,800	1,417.00	3,967,600
北陸電力	2,000	716.00	1,432,000
東北電力	5,300	1,101.00	5,835,300
四国電力	1,500	1,052.00	1,578,000
九州電力	3,200	1,065.00	3,408,000
北海道電力	2,500	578.00	1,445,000
沖縄電力	400	1,763.00	705,200
電源開発	1,200	2,543.00	3,051,600
東京瓦斯	4,200	2,769.50	11,631,900
大阪瓦斯	3,600	2,074.00	7,466,400
東邦瓦斯	600	4,285.00	2,571,000
東武鉄道	900	3,560.00	3,204,000
相鉄ホールディングス	300	2,905.00	871,500
東急	2,200	2,030.00	4,466,000
京浜急行電鉄	700	2,119.00	1,483,300
小田急電鉄	800	2,595.00	2,076,000
京王電鉄	300	6,710.00	2,013,000
京成電鉄	300	4,385.00	1,315,500
東日本旅客鉄道	1,900	10,420.00	19,798,000
西日本旅客鉄道	1,000	9,185.00	9,185,000
東海旅客鉄道	500	22,570.00	11,285,000
西武ホールディングス	800	1,930.00	1,544,000
西日本鉄道	300	2,374.00	712,200
近鉄グループホールディングス	800	5,790.00	4,632,000
阪急阪神ホールディングス	1,100	4,230.00	4,653,000
南海電気鉄道	500	2,774.00	1,387,000
京阪ホールディングス	300	4,870.00	1,461,000
名古屋鉄道	900	3,335.00	3,001,500

日本通運	700	5,380.00	3,766,000
ヤマトホールディングス	1,600	1,642.50	2,628,000
山九	200	5,660.00	1,132,000
センコーグループホールディングス	800	837.00	669,600
ニッコンホールディングス	400	2,420.00	968,000
セイノーホールディングス	1,100	1,339.00	1,472,900
日立物流	400	3,220.00	1,288,000
九州旅客鉄道	700	3,435.00	2,404,500
S Gホールディングス	600	2,651.00	1,590,600
日本郵船	2,600	1,822.00	4,737,200
商船三井	1,300	2,742.00	3,564,600
川崎汽船	1,000	1,289.00	1,289,000
日本航空	3,200	3,271.00	10,467,200
ANAホールディングス	2,500	3,665.00	9,162,500
三菱倉庫	300	2,686.00	805,800
住友倉庫	400	1,428.00	571,200
上組	700	2,422.00	1,695,400
T I S	300	6,250.00	1,875,000
ネクソン	1,000	1,311.00	1,311,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	800	2,353.00	1,882,400
野村総合研究所	1,200	2,197.00	2,636,400
フジ・メディア・ホールディングス	1,200	1,392.00	1,670,400
Zホールディングス	4,400	319.00	1,403,600
トレンドマイクロ	300	5,200.00	1,560,000
日本オラクル	100	9,170.00	917,000
伊藤忠テクノソリューションズ	400	2,938.00	1,175,200
大塚商会	400	4,045.00	1,618,000
ネットワンシステムズ	300	2,871.00	861,300
エイベックス	400	1,284.00	513,600
日本ユニシス	300	3,575.00	1,072,500
東京放送ホールディングス	500	1,750.00	875,000
日本テレビホールディングス	900	1,380.00	1,242,000
テレビ朝日ホールディングス	400	1,695.00	678,000
日本電信電話	16,700	5,284.00	88,242,800
KDD I	11,900	2,939.00	34,974,100

光通信	100	23,610.00	2,361,000
NTTドコモ	8,700	2,819.00	24,525,300
KADOKAWA	600	1,549.00	929,400
東宝	300	4,740.00	1,422,000
エヌ・ティ・ティ・データ	2,800	1,395.00	3,906,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	300	5,100.00	1,530,000
SCSK	200	5,080.00	1,016,000
コナミホールディングス	300	5,010.00	1,503,000
ソフトバンクグループ	8,600	4,157.00	35,750,200
あらた	200	3,925.00	785,000
双日	13,300	325.00	4,322,500
アルフレッサ ホールディングス	1,400	2,356.00	3,298,400
ダイワボウホールディングス	100	4,415.00	441,500
マクニカ・富士エレホールディングス	500	1,385.00	692,500
シップヘルスケアホールディングス	200	4,450.00	890,000
三菱食品	300	2,710.00	813,000
第一興商	200	4,930.00	986,000
メディopalホールディングス	1,800	2,358.00	4,244,400
伊藤忠商事	11,300	2,209.00	24,961,700
丸紅	22,500	694.60	15,628,500
長瀬産業	1,200	1,490.00	1,788,000
豊田通商	2,300	3,365.00	7,739,500
兼松	900	1,208.00	1,087,200
三井物産	15,700	1,730.00	27,161,000
日立ハイテクノロジーズ	400	6,390.00	2,556,000
住友商事	10,700	1,665.50	17,820,850
三菱商事	8,700	2,638.50	22,954,950
キヤノンマーケティングジャパン	400	2,242.00	896,800
阪和興業	500	2,896.00	1,448,000
岩谷産業	300	3,610.00	1,083,000
三愛石油	800	1,018.00	814,400
稲畑産業	600	1,290.00	774,000
東邦ホールディングス	500	2,483.00	1,241,500
サンゲツ	400	2,022.00	808,800

伊藤忠エネクス	900	809.00	728,100
リョーサン	300	2,699.00	809,700
PAL TAC	200	5,280.00	1,056,000
日鉄物産	300	4,265.00	1,279,500
オートバックスセブン	600	1,775.00	1,065,000
加藤産業	300	3,210.00	963,000
因幡電機産業	200	4,720.00	944,000
ミスミグループ本社	400	2,395.00	958,000
スズケン	700	5,680.00	3,976,000
ローソン	300	5,680.00	1,704,000
エービーシー・マート	100	6,720.00	672,000
ゲオホールディングス	500	1,308.00	654,000
アダストリア	400	2,675.00	1,070,000
エディオン	1,200	1,039.00	1,246,800
ビックカメラ	600	1,122.00	673,200
DCMホールディングス	1,000	1,033.00	1,033,000
J. フロント リテイリング	2,000	1,240.00	2,480,000
マツモトキヨシホールディングス	400	3,945.00	1,578,000
ZOZO	200	2,501.00	500,200
ココカラファイン	100	5,840.00	584,000
三越伊勢丹ホールディングス	3,000	865.00	2,595,000
ウエルシアホールディングス	100	5,500.00	550,000
すかいらーくホールディングス	1,000	1,959.00	1,959,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	700	963.00	674,100
セブン&アイ・ホールディングス	4,800	4,119.00	19,771,200
ツルハホールディングス	100	11,830.00	1,183,000
良品計画	600	2,033.00	1,219,800
コーナン商事	200	2,408.00	481,600
パン・パシフィック・インターナシ ョナルホ	1,400	1,740.00	2,436,000
ゼンショーホールディングス	400	2,509.00	1,003,600
スギホールディングス	200	5,920.00	1,184,000
ファミリーマート	600	2,572.00	1,543,200
日本瓦斯	200	3,155.00	631,000
島忠	300	2,647.00	794,100

コメリ	300	2,128.00	638,400
青山商事	400	1,867.00	746,800
しまむら	200	9,210.00	1,842,000
高島屋	1,500	1,205.00	1,807,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,100	1,199.00	1,318,900
丸井グループ	800	2,283.00	1,826,400
イオン	4,400	2,007.50	8,833,000
イズミ	200	4,165.00	833,000
平和堂	200	2,062.00	412,400
ケーズホールディングス	1,700	1,158.00	1,968,600
アインホールディングス	100	5,940.00	594,000
ヤマダ電機	7,800	513.00	4,001,400
ニトリホールディングス	200	15,925.00	3,185,000
吉野家ホールディングス	400	2,786.00	1,114,400
アークス	500	2,224.00	1,112,000
バローホールディングス	400	1,825.00	730,000
サンドラッグ	400	3,425.00	1,370,000
めぶきフィナンシャルグループ	12,800	261.00	3,340,800
九州フィナンシャルグループ	1,700	424.00	720,800
ゆうちょ銀行	5,100	1,026.00	5,232,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	7,200	409.00	2,944,800
西日本フィナンシャルホールディングス	1,800	739.00	1,330,200
第四北越フィナンシャルグループ	300	2,601.00	780,300
新生銀行	1,300	1,522.00	1,978,600
あおぞら銀行	1,500	2,578.00	3,867,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	131,000	532.80	69,796,800
りそなホールディングス	67,000	444.60	29,788,200
三井住友トラスト・ホールディングス	19,100	3,739.00	71,414,900
三井住友フィナンシャルグループ	32,100	3,617.00	116,105,700
千葉銀行	6,000	544.00	3,264,000
群馬銀行	1,400	347.00	485,800
武蔵野銀行	200	1,805.00	361,000
千葉興業銀行	2,400	296.00	710,400

筑波銀行	2,500	187.00	467,500
東邦銀行	5,900	244.00	1,439,600
ふくおかフィナンシャルグループ	5,300	1,978.00	10,483,400
静岡銀行	1,400	792.00	1,108,800
スルガ銀行	4,300	430.00	1,849,000
八十二銀行	7,100	435.00	3,088,500
大垣共立銀行	500	2,379.00	1,189,500
北國銀行	800	2,902.00	2,321,600
滋賀銀行	500	2,425.00	1,212,500
南都銀行	400	2,497.00	998,800
百五銀行	2,700	333.00	899,100
京都銀行	200	4,035.00	807,000
紀陽銀行	1,700	1,658.00	2,818,600
ほくほくフィナンシャルグループ	3,600	1,017.00	3,661,200
広島銀行	4,300	533.00	2,291,900
山陰合同銀行	2,500	644.00	1,610,000
中国銀行	1,200	997.00	1,196,400
伊予銀行	1,600	560.00	896,000
百十四銀行	300	2,139.00	641,700
阿波銀行	200	2,453.00	490,600
大分銀行	200	2,758.00	551,600
宮崎銀行	300	2,444.00	733,200
琉球銀行	500	1,119.00	559,500
セブン銀行	3,300	296.00	976,800
みずほフィナンシャルグループ	474,700	161.90	76,853,930
山口フィナンシャルグループ	900	723.00	650,700
北洋銀行	11,900	226.00	2,689,400
東和銀行	1,300	791.00	1,028,300
トモニホールディングス	2,400	346.00	830,400
池田泉州ホールディングス	4,100	187.00	766,700
SBIホールディングス	800	2,158.00	1,726,400
ジャフコ	300	4,045.00	1,213,500
大和証券グループ本社	11,000	482.60	5,308,600
野村ホールディングス	34,100	463.90	15,818,990
岡三証券グループ	1,300	375.00	487,500

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,100	291.00	320,100
SOMPOホールディングス	2,100	4,478.00	9,403,800
MS&ADインシュアランスグループホール	5,600	3,401.00	19,045,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,200	2,232.00	4,910,400
第一生命ホールディングス	13,900	1,624.00	22,573,600
東京海上ホールディングス	4,600	5,727.00	26,344,200
T&Dホールディングス	4,700	1,145.00	5,381,500
クレディセゾン	800	1,413.00	1,130,400
日本証券金融	4,000	502.00	2,008,000
イオンフィナンシャルサービス	600	1,566.00	939,600
オリックス	9,300	1,609.00	14,963,700
日本取引所グループ	1,300	1,710.00	2,223,000
ヒューリック	800	1,130.00	904,000
野村不動産ホールディングス	700	2,393.00	1,675,100
東急不動産ホールディングス	2,100	701.00	1,472,100
飯田グループホールディングス	1,100	1,730.00	1,903,000
パーク24	300	2,516.00	754,800
三井不動産	2,600	2,667.50	6,935,500
三菱地所	3,800	2,066.00	7,850,800
東京建物	1,500	1,502.00	2,253,000
住友不動産	700	4,005.00	2,803,500
レオパレス21	3,300	267.00	881,100
イオンモール	500	1,675.00	837,500
ミクシィ	500	2,046.00	1,023,000
パーソルホールディングス	600	2,030.00	1,218,000
総合警備保障	200	5,680.00	1,136,000
カカコム	300	2,636.00	790,800
ディー・エヌ・エー	600	1,975.00	1,185,000
博報堂DYホールディングス	1,200	1,528.00	1,833,600
電通	900	3,775.00	3,397,500
みらかホールディングス	500	2,424.00	1,212,000
オリエンタルランド	300	16,555.00	4,966,500
ダスキン	400	2,801.00	1,120,400
ユー・エス・エス	600	2,019.00	1,211,400

	サイバーエージェント	200	4,150.00	830,000	
	楽天	2,700	1,036.00	2,797,200	
	テクノプロ・ホールディングス	100	6,480.00	648,000	
	リクルートホールディングス	1,900	3,417.00	6,492,300	
	日本郵政	6,700	981.00	6,572,700	
	ベルシステム24ホールディングス	500	1,747.00	873,500	
	エイチ・アイ・エス	200	2,705.00	541,000	
	カナモト	200	2,669.00	533,800	
	セコム	700	9,717.00	6,801,900	
	メイテック	100	5,200.00	520,000	
	ベネッセホールディングス	500	2,829.00	1,414,500	
	小計 銘柄数：562			2,534,880,820	
	組入時価比率：97.6%			100.0%	
	合計			2,534,880,820	

(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10月7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。