



2019年10月期 (2019年4月21日～2019年10月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2019 (April 21, 2019 – October 20, 2019)

2019年11月29日
 November 29, 2019

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信
 コード番号 (1480)
 連動対象指標 野村企業価値分配指数
 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 Nomura Enterprise Value Allocation Index Exchange Traded Fund
 Code: 1480
 Underlying index: Nomura Enterprise Value Allocation Index
 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 2020年1月14日
 分配金支払開始日 2019年11月28日
 Scheduled date of submission of securities report: January 14, 2020
 Date of commencing dividend payment: November 28, 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21日～2019年10月20日)

Management Status for Year ended October 2019 (from April 21, 2019 to October 20, 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	7,410	(97.7)	170	(2.3)	7,581	(100.0)
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	7,329	(97.8)	163	(2.2)	7,492	(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	483	0	0	483
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	483	0	0	483

(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	7,667	85	7,581	15,679
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	7,590	97	7,492	15,494

(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	149
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	172

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 6 期 (2019 年 4 月 20 日現在) 6th Fiscal Year As of April 20, 2019	第 7 期 (2019 年 10 月 20 日現在) 7th Fiscal Year As of October 20, 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	139,054,132	181,900,483
株式 Stocks	7,329,005,980	7,410,677,350
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	1,479,874	4,875,968
未収入金 Accounts receivable - other	40,674,518	3,055,189
未収配当金 Accrued dividends receivable	76,540,532	66,494,475
差入委託証拠金 Customers' margin	3,442,950	-
流動資産合計 Total current assets	7,590,197,986	7,667,003,465
資産合計 Total assets	7,590,197,986	7,667,003,465
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	8,574	-
前受金 Advances received	-	1,436,950
未払収益分配金 Unpaid dividends	83,172,664	72,050,738
未払受託者報酬 Trustee fee payable	1,960,493	1,969,583
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	7,057,719	7,090,438
未払利息 Accrued interest expenses	612	544
その他未払費用 Other accrued expenses	5,571,344	2,891,563
流動負債合計 Total current liabilities	97,771,406	85,439,816
負債合計 Total liabilities	97,771,406	85,439,816

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,214,255,262	6,214,255,262
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,278,171,318	1,367,308,387
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	190,687	251,470
元本等合計 Total principal and other	7,492,426,580	7,581,563,649
純資産合計 Total net assets	7,492,426,580	7,581,563,649
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	7,590,197,986	7,667,003,465

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第 6 期 自 2018 年 10 月 21 日 至 2019 年 4 月 20 日 6th Fiscal Year From October 21, 2018 to April 20, 2019	第 7 期 自 2019 年 4 月 21 日 至 2019 年 10 月 20 日 7th Fiscal Year From April 21, 2019 to October 20, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	94,975,442	83,826,567
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△161,879,646	84,730,690
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△1,533,336	4,345,596
その他収益 Other revenue	120,882	106,569
営業収益合計 Total operating revenue	△68,316,658	173,009,422
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	39,580	41,335
受託者報酬 Trustee fee	1,960,493	1,969,583
委託者報酬 Investment trust management fee	7,057,719	7,090,438
その他費用 Other expenses	2,687,084	2,720,259
営業費用合計 Total operating expenses	11,744,876	11,821,615
営業利益又は営業損失 (△)	△80,061,534	161,187,807

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△80,061,534	161,187,807
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△80,061,534	161,187,807
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	1,441,405,516	1,278,171,318
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	83,172,664	72,050,738
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,278,171,318	1,367,308,387

(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21日から2019年10月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第6期 2019年4月20日現在	第7期 2019年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 483,562 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 483,562 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 15,494 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 15,679 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自 2018年10月21日	第7期 自 2019年4月21日
----------------------	---------------------

至 2019 年 4 月 20 日	至 2019 年 10 月 20 日																																																												
<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 20%;"></th> <th style="width: 50%;"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">95,056,744 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">11,903 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C=A+B</td> <td style="text-align: right;">95,068,647 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">11,705,296 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E=C-D</td> <td style="text-align: right;">83,363,351 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">83,172,664 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G=E-F</td> <td style="text-align: right;">190,687 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">483,562 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H</td> <td style="text-align: right;">172 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち 2,352,528 円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>	項目			当期配当等収益額	A	95,056,744 円	分配準備積立金	B	11,903 円	配当等収益合計額	C=A+B	95,068,647 円	経費	D	11,705,296 円	収益分配可能額	E=C-D	83,363,351 円	収益分配金	F	83,172,664 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	190,687 円	口数	H	483,562 口	1 口当たり分配金	I=F/H	172 円	<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 20%;"></th> <th style="width: 50%;"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">83,891,801 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">190,687 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C=A+B</td> <td style="text-align: right;">84,082,488 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">11,780,280 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E=C-D</td> <td style="text-align: right;">72,302,208 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">72,050,738 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G=E-F</td> <td style="text-align: right;">251,470 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">483,562 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H</td> <td style="text-align: right;">149 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち 2,361,433 円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>	項目			当期配当等収益額	A	83,891,801 円	分配準備積立金	B	190,687 円	配当等収益合計額	C=A+B	84,082,488 円	経費	D	11,780,280 円	収益分配可能額	E=C-D	72,302,208 円	収益分配金	F	72,050,738 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	251,470 円	口数	H	483,562 口	1 口当たり分配金	I=F/H	149 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	95,056,744 円																																																											
分配準備積立金	B	11,903 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	95,068,647 円																																																											
経費	D	11,705,296 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	83,363,351 円																																																											
収益分配金	F	83,172,664 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	190,687 円																																																											
口数	H	483,562 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	172 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	83,891,801 円																																																											
分配準備積立金	B	190,687 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	84,082,488 円																																																											
経費	D	11,780,280 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	72,302,208 円																																																											
収益分配金	F	72,050,738 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	251,470 円																																																											
口数	H	483,562 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	149 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 6 期 自 2018 年 10 月 21 日 至 2019 年 4 月 20 日	第 7 期 自 2019 年 4 月 21 日 至 2019 年 10 月 20 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、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。 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。 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。 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 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 6 期 2019 年 4 月 20 日現在	第 7 期 2019 年 10 月 20 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</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p>

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 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。	2. 時価の算定方法 同左
--	------------------

(関連当事者との取引に関する注記)

第6期 自 2018年10月21日 至 2019年4月20日	第7期 自 2019年4月21日 至 2019年10月20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6期 自 2018年10月21日 至 2019年4月20日	第7期 自 2019年4月21日 至 2019年10月20日
期首元本額 6,214,255,262円	期首元本額 6,214,255,262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6期 自 2018年10月21日 至 2019年4月20日	第7期 自 2019年4月21日 至 2019年10月20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	△162,353,976	136,268,729
合計	△162,353,976	136,268,729

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6期(2019年4月20日現在)				第7期(2019年10月20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	159,917,900	—	161,400,000	1,471,300	163,332,800	—	168,220,000	4,875,968
合計	159,917,900	—	161,400,000	1,471,300	163,332,800	—	168,220,000	4,875,968

(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 20 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	ミライト・ホールディングス	1,900	1,662.00	3,157,800	
		大成建設	5,700	4,185.00	23,854,500	
		清水建設	15,500	1,002.00	15,531,000	
		長谷工コーポレーション	7,800	1,320.00	10,296,000	
		鹿島建設	12,400	1,453.00	18,017,200	
		大東建託	2,000	13,945.00	27,890,000	
		大和ハウス工業	14,800	3,587.00	53,087,600	
		積水ハウス	15,800	2,290.00	36,182,000	
		山崎製パン	2,800	1,927.00	5,395,600	
		寿スピリッツ	500	7,240.00	3,620,000	
		森永乳業	900	4,280.00	3,852,000	
		ヤクルト本社	2,700	6,060.00	16,362,000	
		明治ホールディングス	3,300	7,770.00	25,641,000	
		アサヒグループホールディングス	9,800	5,290.00	51,842,000	
		キリンホールディングス	22,900	2,238.00	51,250,200	
		サントリー食品インターナショナル	3,600	4,590.00	16,524,000	
		キッコーマン	3,800	5,240.00	19,912,000	
		味の素	12,600	2,012.50	25,357,500	
		キューピー	2,600	2,449.00	6,367,400	
		ニチレイ	2,700	2,461.00	6,644,700	
		日清食品ホールディングス	1,700	8,110.00	13,787,000	
		日本たばこ産業	31,700	2,391.50	75,810,550	
		帝人	5,100	2,147.00	10,949,700	
		東レ	38,900	843.30	32,804,370	
		クラレ	9,000	1,355.00	12,195,000	
		旭化成	31,800	1,168.50	37,158,300	
昭和電工	3,700	2,975.00	11,007,500			
住友化学	39,800	511.00	20,337,800			
日産化学	3,200	4,360.00	13,952,000			

東ソー	6,800	1,502.00	10,213,600
デンカ	2,200	3,105.00	6,831,000
信越化学工業	10,500	12,165.00	127,732,500
エア・ウォーター	3,600	2,007.00	7,225,200
カネカ	1,300	3,535.00	4,595,500
三菱瓦斯化学	4,600	1,510.00	6,946,000
三井化学	4,600	2,582.00	11,877,200
J S R	5,300	1,831.00	9,704,300
三菱ケミカルホールディングス	35,800	825.70	29,560,060
ダイセル	7,600	937.00	7,121,200
積水化学工業	10,100	1,718.00	17,351,800
アイカ工業	1,300	3,410.00	4,433,000
日立化成	2,800	3,520.00	9,856,000
日本化薬	3,900	1,322.00	5,155,800
花王	13,800	8,260.00	113,988,000
日本ペイントホールディングス	3,600	6,160.00	22,176,000
関西ペイント	4,900	2,620.00	12,838,000
D I C	2,000	3,115.00	6,230,000
資生堂	10,600	8,590.00	91,054,000
ライオン	6,100	2,184.00	13,322,400
ファンケル	1,900	2,812.00	5,342,800
コーセー	900	18,920.00	17,028,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,400	2,556.00	6,134,400
小林製薬	1,300	8,640.00	11,232,000
日東電工	4,600	5,543.00	25,497,800
ニフコ	2,300	2,665.00	6,129,500
ユニ・チャーム	9,900	3,480.00	34,452,000
武田薬品工業	21,100	3,780.00	79,758,000
アステラス製薬	53,800	1,715.50	92,293,900
大日本住友製薬	3,700	1,785.00	6,604,500
塩野義製薬	7,700	6,078.00	46,800,600
田辺三菱製薬	6,300	1,232.00	7,761,600
日本新薬	1,300	9,360.00	12,168,000
中外製薬	5,700	8,320.00	47,424,000
エーザイ	7,100	5,550.00	39,405,000

小野薬品工業	10,800	1,939.50	20,946,600
参天製薬	10,000	1,865.00	18,650,000
沢井製薬	1,100	5,660.00	6,226,000
第一三共	15,900	6,814.00	108,342,600
大塚ホールディングス	11,600	4,350.00	50,460,000
JXTGホールディングス	90,500	505.90	45,783,950
ブリヂストン	17,000	4,343.00	73,831,000
住友ゴム工業	4,600	1,355.00	6,233,000
AGC	5,100	3,540.00	18,054,000
太平洋セメント	3,500	3,140.00	10,990,000
東海カーボン	4,900	1,145.00	5,610,500
TOTO	3,900	4,200.00	16,380,000
日本碍子	7,100	1,555.00	11,040,500
日本特殊陶業	4,200	2,091.00	8,782,200
ニチアス	1,400	2,113.00	2,958,200
日本製鉄	22,000	1,525.50	33,561,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	13,400	1,307.00	17,513,800
日立金属	5,400	1,236.00	6,674,400
日本軽金属ホールディングス	15,300	202.00	3,090,600
古河電気工業	1,800	2,816.00	5,068,800
住友電気工業	20,500	1,406.50	28,833,250
SUMCO	6,500	1,788.00	11,622,000
三和ホールディングス	5,200	1,246.00	6,479,200
日本発條	4,500	857.00	3,856,500
アマダホールディングス	9,400	1,189.00	11,176,600
FUJ I	1,700	1,687.00	2,867,900
オーエスジー	2,100	2,129.00	4,470,900
DMG 森精機	3,200	1,616.00	5,171,200
ディスコ	800	21,610.00	17,288,000
ナブテスコ	3,200	3,365.00	10,768,000
SMC	1,700	46,550.00	79,135,000
小松製作所	24,500	2,488.00	60,956,000
住友重機械工業	3,100	3,240.00	10,044,000
日立建機	3,000	2,590.00	7,770,000
ハーモニック・ドライブ・システム	700	5,060.00	3,542,000

ズ				
クボタ	28,300	1,716.00	48,562,800	
ダイキン工業	6,700	14,570.00	97,619,000	
栗田工業	2,800	2,903.00	8,128,400	
椿本チエイン	600	3,525.00	2,115,000	
ダイフク	2,600	5,880.00	15,288,000	
CKD	1,200	1,484.00	1,780,800	
ユニバーサルエンターテインメント	600	3,685.00	2,211,000	
セガサミーホールディングス	5,000	1,549.00	7,745,000	
日本精工	10,500	983.00	10,321,500	
ジェイテクト	5,300	1,289.00	6,831,700	
THK	3,400	2,893.00	9,836,200	
マキタ	6,400	3,420.00	21,888,000	
コニカミノルタ	12,300	781.00	9,606,300	
ブラザー工業	6,300	2,006.00	12,637,800	
ミネベアミツミ	9,800	1,904.00	18,659,200	
日立製作所	26,600	4,135.00	109,991,000	
三菱電機	51,600	1,509.00	77,864,400	
富士電機	3,300	3,395.00	11,203,500	
安川電機	6,300	4,035.00	25,420,500	
マブチモーター	1,300	4,030.00	5,239,000	
日本電産	5,900	15,075.00	88,942,500	
オムロン	5,500	6,320.00	34,760,000	
ルネサスエレクトロニクス	17,800	734.00	13,065,200	
セイコーエプソン	7,600	1,499.00	11,392,400	
アルバック	1,100	4,750.00	5,225,000	
パナソニック	61,100	888.20	54,269,020	
シャープ	4,300	1,262.00	5,426,600	
富士通ゼネラル	1,500	1,809.00	2,713,500	
TDK	3,600	10,610.00	38,196,000	
アルプスアルパイン	6,100	2,115.00	12,901,500	
ヒロセ電機	800	13,570.00	10,856,000	
日本航空電子工業	1,300	1,718.00	2,233,400	
アズビル	3,200	2,960.00	9,472,000	
日本光電工業	2,000	3,155.00	6,310,000	

掘場製作所	1,000	6,850.00	6,850,000
アドバンテスト	4,900	5,290.00	25,921,000
キーエンス	2,700	67,070.00	181,089,000
シスメックス	3,400	7,024.00	23,881,600
オプテックスグループ	800	1,674.00	1,339,200
レーザーテック	1,000	7,680.00	7,680,000
スタンレー電気	3,700	2,964.00	10,966,800
ファナック	5,600	21,075.00	118,020,000
ローム	2,600	8,830.00	22,958,000
浜松ホトニクス	4,000	4,035.00	16,140,000
京セラ	8,900	6,922.00	61,605,800
太陽誘電	3,100	2,948.00	9,138,800
村田製作所	16,000	5,893.00	94,288,000
小糸製作所	2,500	5,510.00	13,775,000
SCREENホールディングス	1,100	7,660.00	8,426,000
キヤノン	28,700	2,859.00	82,053,300
東京エレクトロン	4,500	21,750.00	97,875,000
トヨタ紡織	1,400	1,530.00	2,142,000
豊田自動織機	4,100	6,250.00	25,625,000
デンソー	12,300	4,858.00	59,753,400
東海理化電機製作所	1,300	1,904.00	2,475,200
日産自動車	63,300	689.30	43,632,690
いすゞ自動車	14,600	1,236.50	18,052,900
トヨタ自動車	30,400	7,368.00	223,987,200
日野自動車	7,200	940.00	6,768,000
三菱自動車工業	19,000	490.00	9,310,000
ケーヒン	1,200	1,705.00	2,046,000
アイシン精機	4,400	3,665.00	16,126,000
マツダ	16,600	991.00	16,450,600
スズキ	8,900	4,914.00	43,734,600
SUBARU	16,200	3,046.00	49,345,200
ヤマハ発動機	7,500	2,098.00	15,735,000
シマノ	2,100	15,620.00	32,802,000
テイ・エス テック	1,100	3,355.00	3,690,500
テルモ	15,200	3,489.00	53,032,800

島津製作所	6,000	2,705.00	16,230,000
ブイ・テクノロジー	200	6,520.00	1,304,000
東京精密	1,100	3,385.00	3,723,500
トプコン	2,800	1,407.00	3,939,600
オリンパス	30,300	1,451.00	43,965,300
HOYA	10,800	9,201.00	99,370,800
朝日インテック	5,700	2,824.00	16,096,800
バンダイナムコホールディングス	5,500	6,870.00	37,785,000
ヤマハ	3,700	5,030.00	18,611,000
ピジョン	3,100	4,630.00	14,353,000
任天堂	3,100	38,610.00	119,691,000
関西電力	19,700	1,259.50	24,812,150
東北電力	12,500	1,088.00	13,600,000
九州電力	10,600	1,077.00	11,416,200
イーレックス	900	1,363.00	1,226,700
東急	12,500	2,047.00	25,587,500
小田急電鉄	8,000	2,637.00	21,096,000
東日本旅客鉄道	8,600	10,100.00	86,860,000
西日本旅客鉄道	4,600	9,208.00	42,356,800
近鉄グループホールディングス	5,000	5,740.00	28,700,000
日本通運	2,100	5,650.00	11,865,000
九州旅客鉄道	4,400	3,425.00	15,070,000
S Gホールディングス	3,800	2,612.00	9,925,600
日本航空	9,600	3,375.00	32,400,000
ANAホールディングス	8,600	3,729.00	32,069,400
ネクソン	12,400	1,240.00	15,376,000
ブロードリーフ	2,400	586.00	1,406,400
野村総合研究所	9,700	2,265.00	21,970,500
Zホールディングス	37,700	332.00	12,516,400
トレンドマイクロ	3,500	5,250.00	18,375,000
日本オラクル	900	8,960.00	8,064,000
大塚商会	3,000	4,025.00	12,075,000
日本電信電話	39,600	5,277.00	208,969,200
KDDI	49,900	2,934.00	146,406,600
NTTドコモ	34,500	2,822.00	97,359,000

エヌ・ティ・ティ・データ	18,400	1,424.00	26,201,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,500	4,955.00	12,387,500
S C S K	1,400	5,060.00	7,084,000
富士ソフト	600	4,495.00	2,697,000
コナミホールディングス	2,700	4,880.00	13,176,000
ソフトバンクグループ	37,900	4,299.00	162,932,100
双日	25,900	333.00	8,624,700
第一興商	1,000	5,040.00	5,040,000
伊藤忠商事	36,500	2,259.00	82,453,500
日立ハイテクノロジーズ	1,900	6,520.00	12,388,000
三菱商事	35,700	2,677.00	95,568,900
ミスミグループ本社	5,700	2,494.00	14,215,800
ローソン	1,300	6,000.00	7,800,000
エービーシー・マート	800	7,470.00	5,976,000
アスクル	600	2,877.00	1,726,200
アダストリア	800	2,572.00	2,057,600
くら寿司	300	4,450.00	1,335,000
セリア	1,000	2,843.00	2,843,000
ジーンズホールディングス	300	6,290.00	1,887,000
Monotaro	3,500	2,881.00	10,083,500
マツモトキヨシホールディングス	2,000	3,915.00	7,830,000
ZOZO	5,600	2,525.00	14,140,000
物語コーポレーション	100	9,560.00	956,000
ウエルシアホールディングス	1,200	6,220.00	7,464,000
すかいらーくホールディングス	4,900	1,910.00	9,359,000
コスモス薬品	300	21,820.00	6,546,000
セブン&アイ・ホールディングス	20,600	4,264.00	87,838,400
ツルハホールディングス	1,000	12,220.00	12,220,000
トリドールホールディングス	600	2,280.00	1,368,000
クスリのアオキホールディングス	400	7,540.00	3,016,000
スシローグローバルホールディングス	500	7,460.00	3,730,000
良品計画	7,000	2,297.00	16,079,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	15,200	1,695.00	25,764,000
ゼンショーホールディングス	2,400	2,287.00	5,488,800

ユナイテッドアローズ	600	3,335.00	2,001,000
スギホールディングス	1,000	6,190.00	6,190,000
日本瓦斯	900	3,235.00	2,911,500
しまむら	600	9,390.00	5,634,000
イオン	17,600	2,175.00	38,280,000
イズミ	900	4,230.00	3,807,000
ニトリホールディングス	2,000	16,160.00	32,320,000
ファーストリテイリング	600	69,500.00	41,700,000
サンドラッグ	1,900	3,460.00	6,574,000
りそなホールディングス	59,500	455.70	27,114,150
SBIホールディングス	6,400	2,289.00	14,649,600
大和証券グループ本社	45,400	483.40	21,946,360
東京海上ホールディングス	18,900	5,700.00	107,730,000
クレディセゾン	4,300	1,500.00	6,450,000
東京センチュリー	1,100	4,970.00	5,467,000
イオンフィナンシャルサービス	3,100	1,612.00	4,997,200
オリックス	37,500	1,631.00	61,162,500
三菱UFJリース	10,700	655.00	7,008,500
ヒューリック	7,600	1,136.00	8,633,600
オープンハウス	1,800	2,757.00	4,962,600
飯田グループホールディングス	3,900	1,754.00	6,840,600
パーク24	3,000	2,621.00	7,863,000
三井不動産	25,400	2,706.50	68,745,100
イオンモール	2,800	1,731.00	4,846,800
日本空港ビルデング	1,000	5,190.00	5,190,000
ミクシィ	1,200	2,107.00	2,528,400
パーソルホールディングス	4,900	2,006.00	9,829,400
総合警備保障	1,500	5,530.00	8,295,000
カクコム	3,900	2,420.00	9,438,000
ディップ	900	2,825.00	2,542,500
エムスリー	9,100	2,681.00	24,397,100
博報堂DYホールディングス	6,300	1,569.00	9,884,700
電通	6,300	3,725.00	23,467,500
オリエンタルランド	5,300	16,485.00	87,370,500
リゾートトラスト	2,100	1,742.00	3,658,200

	サイバーエージェント	2,900	4,125.00	11,962,500	
	楽天	23,700	1,055.00	25,003,500	
	テクノプロ・ホールディングス	1,000	6,550.00	6,550,000	
	ジャパンマテリアル	1,600	1,502.00	2,403,200	
	リクルートホールディングス	32,200	3,459.00	111,379,800	
	リログループ	3,200	2,504.00	8,012,800	
	エイチ・アイ・エス	900	2,736.00	2,462,400	
	カナモト	800	2,868.00	2,294,400	
	セコム	6,000	9,781.00	58,686,000	
	小計 銘柄数：281			7,410,677,350	
	組入時価比率：97.7%			100.0%	
	合計			7,410,677,350	

(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20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。