



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 MSCI日本株女性活躍指数(セレクト)連動型上場投信
 コード番号 (2518)
 連動対象指標 MSCI日本株女性活躍指数(セレクト)
 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 MSCI Japan Empowering Women Select Index Exchange Traded Fund
 Code: 2518
 Underlying index: MSCI Japan Empowering Women (WIN) Select 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	4,210	(100.0)	1	(0.0)	4,211	(100.0)
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	3,628	(99.8)	6	(0.2)	3,634	(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	4,031	499	0	4,530
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	3,031	1,000	0	4,031

(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
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	4,259	48	4,211	92,948
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	3,682	47	3,634	90,166

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	1,000
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	1,100

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2期 (2019年4月20日現在) 2nd Fiscal Year As of April 20, 2019	第3期 (2019年10月20日現在) 3rd 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	12,541,073	8,508,691
株式 Stocks	3,628,594,260	4,210,218,230
未収入金 Accounts receivable - other	-	2,270,600
未収配当金 Accrued dividends receivable	41,085,140	38,986,450
流動資産合計 Total current assets	3,682,220,473	4,259,983,971
資産合計 Total assets	3,682,220,473	4,259,983,971
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	44,343,299	45,309,090
未払受託者報酬 Trustee fee payable	562,755	596,041
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	2,250,981	2,384,082
未払利息 Accrued interest expenses	54	24
その他未払費用 Other accrued expenses	286,852	303,132
流動負債合計 Total current liabilities	47,443,941	48,592,369
負債合計 Total liabilities	47,443,941	48,592,369
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	4,031,209,000	4,530,909,000
剰余金 Surplus		

期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△396,432,468	△319,517,398
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	2,995,944	2,183,933
元本等合計 Total principal and other	3,634,776,532	4,211,391,602
純資産合計 Total net assets	3,634,776,532	4,211,391,602
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	3,682,220,473	4,259,983,971

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第2期 自 2018年10月21日 至 2019年4月20日 2nd Fiscal Year From October 21, 2018 to April 20, 2019	第3期 自 2019年4月21日 至 2019年10月20日 3rd 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	48,251,990	47,931,150
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△199,443,710	115,607,330
その他収益 Other revenue	53,622	31,211
営業収益合計 Total operating revenue	△151,138,098	163,569,691
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	2,720	3,595
受託者報酬 Trustee fee	562,755	596,041
委託者報酬 Investment trust management fee	2,250,981	2,384,082
その他費用 Other expenses	650,052	481,564
営業費用合計 Total operating expenses	3,466,508	3,465,282
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△154,604,606	160,104,409
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△154,604,606	160,104,409
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△154,604,606	160,104,409
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 (△)	△130,715,505	△396,432,468

Surplus (deficit) at beginning of period		
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	66,769,058	37,880,249
当期追加信託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 additional subscriptions for period	66,769,058	37,880,249
分配金 Dividends	44,343,299	45,309,090
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△396,432,468	△319,517,398

(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2期 2019年4月20日現在	第3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 4,031,209 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 4,530,909 口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 396,432,468 円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 319,517,398 円
3. 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 901.66 円 (100口当たり純資産額) (90,166 円)	3. 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 929.48 円 (100口当たり純資産額) (92,948 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自2018年10月21日 至2019年4月20日	第3期 自2019年4月21日 至2019年10月20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>48,302,892 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,500,139 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>50,803,031 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,463,788 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	48,302,892 円	分配準備積立金	B	2,500,139 円	配当等収益合計額	C=A+B	50,803,031 円	経費	D	3,463,788 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>47,958,766 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,995,944 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>50,954,710 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,461,687 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	47,958,766 円	分配準備積立金	B	2,995,944 円	配当等収益合計額	C=A+B	50,954,710 円	経費	D	3,461,687 円
項目																															
当期配当等収益額	A	48,302,892 円																													
分配準備積立金	B	2,500,139 円																													
配当等収益合計額	C=A+B	50,803,031 円																													
経費	D	3,463,788 円																													
項目																															
当期配当等収益額	A	47,958,766 円																													
分配準備積立金	B	2,995,944 円																													
配当等収益合計額	C=A+B	50,954,710 円																													
経費	D	3,461,687 円																													

収益分配可能額	E=C-D	47,339,243円
収益分配金	F	44,343,299円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,995,944円
口数	H	4,031,209口
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,100円

2. その他費用
 その他費用のうち 338,526円は、上場に係る費用であります。

収益分配可能額	E=C-D	47,493,023円
収益分配金	F	45,309,090円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,183,933円
口数	H	4,530,909口
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,000円

2. その他費用
 その他費用のうち 142,439円は、上場に係る費用であります。

(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2期 自 2018年10月21日 至 2019年4月20日	第3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、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2期 2019年4月20日現在	第3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2期	第3期
-----	-----

自 2018年10月21日 至 2019年4月20日	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2期 自 2018年10月21日 至 2019年4月20日	第3期 自 2019年4月21日 至 2019年10月20日
期首元本額 3,031,209,000円	期首元本額 4,031,209,000円
期中追加設定元本額 1,000,000,000円	期中追加設定元本額 499,700,000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2期 自 2018年10月21日 至 2019年4月20日	第3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	△171,892,891	154,692,304
合計	△171,892,891	154,692,304

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(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	国際石油開発帝石	38,100	955.20	36,393,120	
		大成建設	6,300	4,185.00	26,365,500	
		大林組	13,400	1,089.00	14,592,600	
		清水建設	10,600	1,002.00	10,621,200	
		鹿島建設	4,900	1,453.00	7,119,700	
		大東建託	3,000	13,945.00	41,835,000	
		住友林業	1,300	1,516.00	1,970,800	
		大和ハウス工業	22,300	3,587.00	79,990,100	
		積水ハウス	11,200	2,290.00	25,648,000	
		森永製菓	1,000	5,350.00	5,350,000	
		江崎グリコ	400	4,820.00	1,928,000	
		カルビー	3,000	3,340.00	10,020,000	
		森永乳業	300	4,280.00	1,284,000	

アサヒグループホールディングス	6,000	5,290.00	31,740,000
キリンホールディングス	10,900	2,238.00	24,394,200
サントリー食品インターナショナル	2,800	4,590.00	12,852,000
不二製油グループ本社	800	3,185.00	2,548,000
味の素	4,800	2,012.50	9,660,000
キューピー	2,000	2,449.00	4,898,000
カゴメ	1,200	2,761.00	3,313,200
ニチレイ	2,200	2,461.00	5,414,200
東洋水産	1,300	4,365.00	5,674,500
日清食品ホールディングス	1,200	8,110.00	9,732,000
東洋紡	700	1,446.00	1,012,200
帝人	3,500	2,147.00	7,514,500
東レ	22,200	843.30	18,721,260
王子ホールディングス	9,500	543.00	5,158,500
日本製紙	500	1,815.00	907,500
クラレ	6,100	1,355.00	8,265,500
旭化成	43,300	1,168.50	50,596,050
住友化学	31,400	511.00	16,045,400
日産化学	4,700	4,360.00	20,492,000
エア・ウォーター	2,600	2,007.00	5,218,200
三井化学	1,200	2,582.00	3,098,400
J S R	4,600	1,831.00	8,422,600
東京応化工業	600	4,265.00	2,559,000
三菱ケミカルホールディングス	32,300	825.70	26,670,110
日本ゼオン	3,900	1,369.00	5,339,100
日立化成	2,400	3,520.00	8,448,000
日油	2,300	3,585.00	8,245,500
花王	20,600	8,260.00	170,156,000
関西ペイント	2,400	2,620.00	6,288,000
D I C	1,900	3,115.00	5,918,500
富士フイルムホールディングス	4,000	4,618.00	18,472,000
資生堂	13,800	8,590.00	118,542,000
ライオン	7,600	2,184.00	16,598,400
ファンケル	500	2,812.00	1,406,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,600	2,556.00	4,089,600

小林製薬	1,200	8,640.00	10,368,000
日東電工	3,900	5,543.00	21,617,700
エフピコ	400	6,610.00	2,644,000
ニフコ	2,000	2,665.00	5,330,000
ユニ・チャーム	13,500	3,480.00	46,980,000
協和キリン	4,700	2,025.00	9,517,500
アステラス製薬	70,500	1,715.50	120,942,750
大日本住友製薬	3,000	1,785.00	5,355,000
塩野義製薬	13,300	6,078.00	80,837,400
田辺三菱製薬	2,600	1,232.00	3,203,200
日本新薬	1,000	9,360.00	9,360,000
中外製薬	5,800	8,320.00	48,256,000
エーザイ	4,900	5,550.00	27,195,000
ロート製薬	1,800	3,135.00	5,643,000
参天製薬	6,100	1,865.00	11,376,500
沢井製薬	500	5,660.00	2,830,000
第一三共	5,300	6,814.00	36,114,200
大塚ホールディングス	4,700	4,350.00	20,445,000
JXTGホールディングス	112,000	505.90	56,660,800
ブリヂストン	17,700	4,343.00	76,871,100
日本電気硝子	400	2,379.00	951,600
住友大阪セメント	600	4,890.00	2,934,000
TOTO	3,300	4,200.00	13,860,000
日本碍子	5,000	1,555.00	7,775,000
日本特殊陶業	3,100	2,091.00	6,482,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	4,900	1,307.00	6,404,300
日立金属	3,800	1,236.00	4,696,800
三井金属鉱業	200	2,766.00	553,200
古河電気工業	700	2,816.00	1,971,200
住友電気工業	12,400	1,406.50	17,440,600
LIXILグループ	1,300	1,972.00	2,563,600
日本発條	3,900	857.00	3,342,300
三浦工業	2,500	3,225.00	8,062,500
オーエスジー	2,100	2,129.00	4,470,900
ディスコ	800	21,610.00	17,288,000

小松製作所	22,500	2,488.00	55,980,000
クボタ	19,100	1,716.00	32,775,600
荏原製作所	1,700	3,105.00	5,278,500
ダイキン工業	7,000	14,570.00	101,990,000
栗田工業	1,800	2,903.00	5,225,400
セガサミーホールディングス	700	1,549.00	1,084,300
NTN	1,500	327.00	490,500
三菱重工業	1,900	4,398.00	8,356,200
IHI	1,300	2,579.00	3,352,700
日清紡ホールディングス	600	877.00	526,200
コニカミノルタ	6,000	781.00	4,686,000
ミネベアミツミ	13,400	1,904.00	25,513,600
三菱電機	41,800	1,509.00	63,076,200
富士電機	2,600	3,395.00	8,827,000
日本電産	6,000	15,075.00	90,450,000
オムロン	3,000	6,320.00	18,960,000
日本電気	1,600	4,530.00	7,248,000
セイコーエプソン	5,000	1,499.00	7,495,000
ソニー	17,900	6,449.00	115,437,100
アルプスアルパイン	2,100	2,115.00	4,441,500
横河電機	4,200	1,932.00	8,114,400
アズビル	2,500	2,960.00	7,400,000
堀場製作所	1,000	6,850.00	6,850,000
シスメックス	6,100	7,024.00	42,846,400
カシオ計算機	3,400	1,703.00	5,790,200
キヤノン	12,800	2,859.00	36,595,200
リコー	2,800	962.00	2,693,600
三菱自動車工業	8,300	490.00	4,067,000
島津製作所	1,300	2,705.00	3,516,500
トプコン	900	1,407.00	1,266,300
バンダイナムコホールディングス	7,700	6,870.00	52,899,000
凸版印刷	2,400	1,956.00	4,694,400
大日本印刷	3,600	2,794.00	10,058,400
ヤマハ	3,900	5,030.00	19,617,000
ビジョン	4,900	4,630.00	22,687,000

中部電力	4,700	1,614.00	7,585,800
四国電力	1,100	1,039.00	1,142,900
九州電力	4,700	1,077.00	5,061,900
東京瓦斯	19,100	2,681.00	51,207,100
大阪瓦斯	13,400	2,055.00	27,537,000
東邦瓦斯	2,100	4,200.00	8,820,000
相鉄ホールディングス	1,000	2,851.00	2,851,000
東急	4,000	2,047.00	8,188,000
小田急電鉄	2,800	2,637.00	7,383,600
西武ホールディングス	2,000	1,898.00	3,796,000
近鉄グループホールディングス	1,000	5,740.00	5,740,000
セイノーホールディングス	2,200	1,360.00	2,992,000
九州旅客鉄道	1,300	3,425.00	4,452,500
S Gホールディングス	4,500	2,612.00	11,754,000
日本郵船	600	1,929.00	1,157,400
商船三井	700	3,010.00	2,107,000
川崎汽船	300	1,512.00	453,600
日本航空	3,900	3,375.00	13,162,500
ANAホールディングス	2,300	3,729.00	8,576,700
三菱倉庫	800	2,717.00	2,173,600
T I S	2,000	6,540.00	13,080,000
野村総合研究所	10,000	2,265.00	22,650,000
Zホールディングス	76,600	332.00	25,431,200
日本オラクル	2,200	8,960.00	19,712,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,600	2,864.00	7,446,400
日本ユニシス	2,300	3,485.00	8,015,500
K D D I	49,200	2,934.00	144,352,800
N T T ドコモ	39,700	2,822.00	112,033,400
東宝	2,400	4,590.00	11,016,000
エヌ・ティ・ティ・データ	7,300	1,424.00	10,395,200
カプコン	2,800	2,789.00	7,809,200
S C S K	1,200	5,060.00	6,072,000
コナミホールディングス	1,800	4,880.00	8,784,000
双日	19,500	333.00	6,493,500
アルフレッサ ホールディングス	4,100	2,399.00	9,835,900

メディアパルホールディングス	2,700	2,404.00	6,490,800
丸紅	31,400	733.70	23,038,180
豊田通商	1,400	3,570.00	4,998,000
三井物産	12,200	1,775.50	21,661,100
日立ハイテクノロジーズ	1,900	6,520.00	12,388,000
三菱商事	9,500	2,677.00	25,431,500
PAL TAC	600	5,210.00	3,126,000
ローソン	400	6,000.00	2,400,000
日本マクドナルドホールディングス	1,000	5,280.00	5,280,000
セリア	1,400	2,843.00	3,980,200
Monotaro	4,600	2,881.00	13,252,600
J. フロント リテイリング	3,800	1,373.00	5,217,400
ZOZO	9,200	2,525.00	23,230,000
三越伊勢丹ホールディングス	4,000	872.00	3,488,000
すかいらーくホールディングス	2,100	1,910.00	4,011,000
ゼンショーホールディングス	400	2,287.00	914,800
スギホールディングス	700	6,190.00	4,333,000
青山商事	500	1,902.00	951,000
しまむら	200	9,390.00	1,878,000
高島屋	2,000	1,232.00	2,464,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	400	1,240.00	496,000
丸井グループ	2,000	2,371.00	4,742,000
イオン	2,700	2,175.00	5,872,500
イズミ	600	4,230.00	2,538,000
アインホールディングス	600	6,140.00	3,684,000
ゆうちょ銀行	6,400	1,046.00	6,694,400
新生銀行	2,200	1,635.00	3,597,000
あおぞら銀行	1,600	2,655.00	4,248,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	123,300	547.00	67,445,100
りそなホールディングス	44,000	455.70	20,050,800
千葉銀行	16,000	560.00	8,960,000
静岡銀行	10,100	806.00	8,140,600
八十二銀行	4,300	453.00	1,947,900
京都銀行	1,300	4,120.00	5,356,000
広島銀行	2,600	536.00	1,393,600

	みずほフィナンシャルグループ	239,000	164.60	39,339,400
	大和証券グループ本社	14,400	483.40	6,960,960
	野村ホールディングス	25,300	483.50	12,232,550
	SOMPOホールディングス	13,500	4,202.00	56,727,000
	MS & ADインシュアランスグループホール	25,100	3,425.00	85,967,500
	第一生命ホールディングス	42,200	1,737.00	73,301,400
	T&Dホールディングス	24,800	1,190.00	29,512,000
	クレディセゾン	1,200	1,500.00	1,800,000
	東京センチュリー	600	4,970.00	2,982,000
	日立キャピタル	400	2,401.00	960,400
	オリックス	30,400	1,631.00	49,582,400
	三菱UFJリース	3,800	655.00	2,489,000
	日本取引所グループ	32,200	1,764.00	56,800,800
	ビューリック	3,400	1,136.00	3,862,400
	東急不動産ホールディングス	3,300	721.00	2,379,300
	三井不動産	15,300	2,706.50	41,409,450
	三菱地所	12,800	2,083.00	26,662,400
	イオンモール	2,800	1,731.00	4,846,800
	カカクコム	6,500	2,420.00	15,730,000
	エムスリー	18,800	2,681.00	50,402,800
	ディー・エヌ・エー	1,200	1,912.00	2,294,400
	ケネディクス	4,800	576.00	2,764,800
	みらかホールディングス	500	2,519.00	1,259,500
	オリエンタルランド	5,800	16,485.00	95,613,000
	リゾートトラスト	1,300	1,742.00	2,264,600
	サイバーエージェント	1,200	4,125.00	4,950,000
	楽天	19,300	1,055.00	20,361,500
	テクノプロ・ホールディングス	1,300	6,550.00	8,515,000
	リクルートホールディングス	45,300	3,459.00	156,692,700
	セコム	4,600	9,781.00	44,992,600
	ベネッセホールディングス	500	2,863.00	1,431,500
小計	銘柄数：219			4,210,218,230
	組入時価比率：100.0%			100.0%
合計				4,210,218,230

(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

該当事項はありません。