



2020年4月期 (2019年10月8日～2020年4月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2020 (October 8, 2019 - April 7, 2020)

2020年5月19日
 May 19, 2020

		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	サポートダイヤル	山中 淳	TEL 0120-753104

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:	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6月30日
 分配金支払開始日 2020年5月15日
 Scheduled date of submission of securities report: June 30, 2020
 Date of commencing dividend payment: May 15, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年4月期の運用状況 (2019年10月8日～2020年4月7日)

Management Status for Year ended April 2020 (from October 8, 2019 to April 7, 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4月期 FY ended Apr. 2020	2,136	(96.8)	70	(3.2)	2,206	(100.0)
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	2,534	(97.6)	61	(2.4)	2,595	(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4月期 FY ended Apr. 2020	154	0	0	154
2019年10月期 FY ended Oct. 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
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	2,251	44	2,206	14,327
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	2,635	39	2,595	16,853

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	240
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	217

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12期 (2019年10月7日現在) 12th Fiscal Year As of October 7, 2019	第13期 (2020年4月7日現在) 13th Fiscal Year As of April 7, 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	63,257,056	45,722,130
株式 Stocks	2,534,880,820	2,136,386,770
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	681,564	1,405,320
未収入金 Accounts receivable - other	824,604	22,578,721
未収配当金 Accrued dividends receivable	33,833,852	38,637,280
差入委託証拠金 Customers' margin	2,206,020	6,645,750
流動資産合計 Total current assets	2,635,683,916	2,251,375,971
資産合計 Total assets	2,635,683,916	2,251,375,971
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	746,088	499,950
未払収益分配金 Unpaid dividends	33,424,076	36,966,720
未払受託者報酬 Trustee fee payable	702,852	731,898
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	3,514,164	3,659,404
未払利息 Accrued interest expenses	34	41
その他未払費用 Other accrued expenses	1,401,248	2,719,699
流動負債合計 Total current liabilities	39,788,462	44,577,712
負債合計 Total liabilities	39,788,462	44,577,712
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	542,856,242	153,759,047
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	61,950	124,542
元本等合計 Total principal and other	2,595,895,454	2,206,798,259
純資産合計 Total net assets	2,595,895,454	2,206,798,259
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	2,635,683,916	2,251,375,971

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	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	第13期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日 13th Fiscal Year From October 8, 2019 to April 7, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	38,948,412	42,869,752
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△151,843,005	△382,938,736
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△1,808,840	△6,221,051
その他収益 Other revenue	33,617	24,036
営業収益合計 Total operating revenue	△114,669,816	△346,265,999
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	14,496	9,930
受託者報酬 Trustee fee	702,852	731,898
委託者報酬 Investment trust management fee	3,514,164	3,659,404
その他費用 Other expenses	1,394,732	1,463,244
営業費用合計 Total operating expenses	5,626,244	5,864,476
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△120,296,060	△352,130,475
経常利益又は経常損失 (△)	△120,296,060	△352,130,475

Ordinary profit (loss)		
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△120,296,060	△352,130,475
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	696,576,378	542,856,242
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	33,424,076	36,966,720
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	542,856,242	153,759,047

(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10月8日から2020年4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12期 2019年10月7日現在	第13期 2020年4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 16,853 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 14,327 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自2019年4月8日 至2019年10月7日	第13期 自2019年10月8日 至2020年4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	38,967,533円	当期配当等収益額	A	42,883,858円
分配準備積立金	B	130,241円	分配準備積立金	B	61,950円
配当等収益合計額	C=A+B	39,097,774円	配当等収益合計額	C=A+B	42,945,808円
経費	D	5,611,748円	経費	D	5,854,546円
収益分配可能額	E=C-D	33,486,026円	収益分配可能額	E=C-D	37,091,262円
収益分配金	F	33,424,076円	収益分配金	F	36,966,720円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	61,950円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	124,542円
口数	H	154,028口	口数	H	154,028口
1口当たり分配金	I=F/H	217円	1口当たり分配金	I=F/H	240円

2. その他費用
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。

2. その他費用
その他費用のうち1,317,355円は、対象指数についての商標使用料であります。

(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12期 自 2019年4月8日 至 2019年10月7日	第13期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7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。</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 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 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 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 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12期 2019年10月7日現在	第13期 2020年4月7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</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>

(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。	
--	--

(関連当事者との取引に関する注記)

第12期 自 2019年4月8日 至 2019年10月7日	第13期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7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12期 自 2019年4月8日 至 2019年10月7日	第13期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日
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12期 自 2019年4月8日 至 2019年10月7日	第13期 自 2019年10月8日 至 2020年4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	△151,424,140	△396,497,148
合計	△151,424,140	△396,497,148

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12期(2019年10月7日現在)				第13期(2020年4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	59,796,420	—	59,736,000	△64,524	67,225,350	—	68,136,000	905,370
合計	59,796,420	—	59,736,000	△64,524	67,225,350	—	68,136,000	905,370

(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(2020年4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	2,200	456.00	1,003,200	
		マルハニチロ	400	2,256.00	902,400	
		国際石油開発帝石	6,500	678.40	4,409,600	
		石油資源開発	400	1,930.00	772,000	
		ミライト・ホールディングス	500	1,249.00	624,500	
		安藤・間	1,000	666.00	666,000	
		コムシスホールディングス	500	2,604.00	1,302,000	
		大成建設	1,300	3,305.00	4,296,500	
		大林組	4,800	954.00	4,579,200	
		清水建設	3,200	831.00	2,659,200	
		長谷工コーポレーション	2,200	1,100.00	2,420,000	
		鹿島建設	3,100	1,088.00	3,372,800	
		西松建設	400	2,077.00	830,800	
		三井住友建設	1,300	443.00	575,900	
		前田建設工業	800	834.00	667,200	
		奥村組	200	2,267.00	453,400	
		戸田建設	1,300	622.00	808,600	
		熊谷組	200	2,381.00	476,200	
		大東建託	500	10,170.00	5,085,000	
		N I P P O	400	2,288.00	915,200	
		前田道路	400	1,927.00	770,800	
		五洋建設	1,700	549.00	933,300	
		住友林業	1,200	1,272.00	1,526,400	
		大和ハウス工業	3,200	2,654.50	8,494,400	
		積水ハウス	3,400	1,798.00	6,113,200	
		関電工	700	847.00	592,900	
		きんでん	900	1,643.00	1,478,700	
協和エクシオ	400	2,305.00	922,000			
九電工	200	2,827.00	565,400			
日揮ホールディングス	1,500	989.00	1,483,500			
日本製粉	400	1,689.00	675,600			

日清製粉グループ本社	800	1,654.00	1,323,200
森永製菓	100	4,310.00	431,000
江崎グリコ	200	4,555.00	911,000
山崎製パン	800	2,246.00	1,796,800
カルビー	300	3,020.00	906,000
森永乳業	300	4,115.00	1,234,500
ヤクルト本社	300	6,410.00	1,923,000
明治ホールディングス	600	7,600.00	4,560,000
雪印メグミルク	400	2,358.00	943,200
プリマハム	200	2,396.00	479,200
日本ハム	800	3,505.00	2,804,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,600	617.00	987,200
サッポロホールディングス	300	1,935.00	580,500
アサヒグループホールディングス	1,100	3,458.00	3,803,800
キリンホールディングス	4,200	2,096.50	8,805,300
宝ホールディングス	600	743.00	445,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	900	2,041.00	1,836,900
サントリー食品インターナショナル	600	4,195.00	2,517,000
伊藤園	200	5,890.00	1,178,000
日清オイリオグループ	200	3,330.00	666,000
不二製油グループ本社	200	2,552.00	510,400
キッコーマン	400	4,725.00	1,890,000
味の素	2,600	1,905.50	4,954,300
キューピー	700	1,971.00	1,379,700
ハウス食品グループ本社	200	3,385.00	677,000
カゴメ	300	2,711.00	813,300
ニチレイ	600	2,904.00	1,742,400
東洋水産	400	5,220.00	2,088,000
日清食品ホールディングス	200	8,970.00	1,794,000
日本たばこ産業	6,500	1,990.50	12,938,250
東洋紡	700	1,125.00	787,500
帝人	1,500	1,727.00	2,590,500
東レ	8,600	459.20	3,949,120
ワコールホールディングス	300	2,206.00	661,800
オンワードホールディングス	1,100	424.00	466,400

王子ホールディングス	7,200	564.00	4,060,800
日本製紙	1,100	1,543.00	1,697,300
北越コーポレーション	1,100	407.00	447,700
大王製紙	500	1,470.00	735,000
レンゴー	1,400	830.00	1,162,000
クラレ	2,500	1,071.00	2,677,500
旭化成	7,500	751.20	5,634,000
昭和電工	1,100	2,282.00	2,510,200
住友化学	16,200	318.00	5,151,600
日産化学	400	3,690.00	1,476,000
クレハ	100	4,380.00	438,000
日本曹達	200	2,761.00	552,200
東ソー	2,300	1,260.00	2,898,000
トクヤマ	500	2,157.00	1,078,500
セントラル硝子	300	1,843.00	552,900
東亜合成	600	928.00	556,800
デンカ	600	2,852.00	1,711,200
信越化学工業	1,000	11,165.00	11,165,000
エア・ウォーター	800	1,421.00	1,136,800
大陽日酸	400	1,562.00	624,800
日本触媒	200	4,995.00	999,000
カネカ	500	2,549.00	1,274,500
三菱瓦斯化学	1,800	1,262.00	2,271,600
三井化学	1,700	1,895.00	3,221,500
J S R	1,300	1,973.00	2,564,900
東京応化工業	200	4,060.00	812,000
三菱ケミカルホールディングス	16,100	638.10	10,273,410
ダイセル	2,900	780.00	2,262,000
住友ベークライト	200	2,425.00	485,000
積水化学工業	2,600	1,380.00	3,588,000
日本ゼオン	700	855.00	598,500
アイカ工業	200	3,035.00	607,000
宇部興産	1,200	1,631.00	1,957,200
日立化成	500	4,610.00	2,305,000
日本化薬	800	947.00	757,600

ADEKA	500	1,317.00	658,500
日油	300	3,485.00	1,045,500
花王	1,300	8,830.00	11,479,000
日本ペイントホールディングス	300	5,630.00	1,689,000
関西ペイント	500	2,027.00	1,013,500
DIC	700	2,303.00	1,612,100
東洋インキSCホールディングス	300	2,011.00	603,300
富士フイルムホールディングス	2,500	5,829.00	14,572,500
資生堂	400	6,432.00	2,572,800
ライオン	600	2,314.00	1,388,400
ポーラ・オルビスホールディングス	300	2,084.00	625,200
小林製薬	100	10,350.00	1,035,000
日東電工	1,300	4,945.00	6,428,500
ニフコ	500	1,890.00	945,000
ユニ・チャーム	800	4,139.00	3,311,200
協和キリン	700	2,375.00	1,662,500
武田薬品工業	3,500	3,471.00	12,148,500
アステラス製薬	10,400	1,657.00	17,232,800
大日本住友製薬	500	1,342.00	671,000
塩野義製薬	800	5,393.00	4,314,400
中外製薬	200	13,020.00	2,604,000
科研製薬	100	5,500.00	550,000
エーザイ	900	7,476.00	6,728,400
ロート製薬	200	3,190.00	638,000
小野薬品工業	1,100	2,518.50	2,770,350
久光製薬	200	4,825.00	965,000
参天製薬	900	1,838.00	1,654,200
ツムラ	200	2,782.00	556,400
沢井製薬	200	5,860.00	1,172,000
第一三共	1,000	7,072.00	7,072,000
キョーリン製薬ホールディングス	400	2,197.00	878,800
大塚ホールディングス	1,700	4,168.00	7,085,600
大正製薬ホールディングス	100	6,500.00	650,000
出光興産	1,900	2,565.00	4,873,500
JXTGホールディングス	54,800	393.50	21,563,800

コスモエネルギーホールディングス	1,100	1,643.00	1,807,300
横浜ゴム	800	1,280.00	1,024,000
TOYO TIRE	800	1,114.00	891,200
ブリヂストン	4,500	3,286.00	14,787,000
住友ゴム工業	2,000	963.00	1,926,000
AGC	1,900	2,520.00	4,788,000
日本板硝子	1,700	306.00	520,200
日本電気硝子	800	1,434.00	1,147,200
住友大阪セメント	300	3,210.00	963,000
太平洋セメント	1,300	1,981.00	2,575,300
東海カーボン	600	907.00	544,200
TOTO	600	3,600.00	2,160,000
日本碍子	1,500	1,333.00	1,999,500
日本特殊陶業	1,000	1,470.00	1,470,000
ニチアス	400	2,066.00	826,400
日本製鉄	13,200	901.00	11,893,200
神戸製鋼所	8,600	330.00	2,838,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	7,900	702.00	5,545,800
東京製鐵	700	667.00	466,900
大和工業	200	1,959.00	391,800
丸一鋼管	200	2,348.00	469,600
大同特殊鋼	200	3,465.00	693,000
日立金属	1,800	1,092.00	1,965,600
日本軽金属ホールディングス	7,000	165.00	1,155,000
三井金属鉱業	600	1,853.00	1,111,800
三菱マテリアル	1,400	2,166.00	3,032,400
住友金属鉱山	1,300	2,333.00	3,032,900
DOWAホールディングス	400	2,830.00	1,132,000
UACJ	400	1,535.00	614,000
古河電気工業	700	1,887.00	1,320,900
住友電気工業	8,400	1,064.00	8,937,600
フジクラ	3,900	291.00	1,134,900
リョービ	300	1,201.00	360,300
SUMCO	1,200	1,460.00	1,752,000
東洋製罐グループホールディングス	1,500	1,143.00	1,714,500

三和ホールディングス	1,000	849.00	849,000
LIXILグループ	2,500	1,288.00	3,220,000
リンナイ	200	7,760.00	1,552,000
東プレ	400	1,100.00	440,000
日本発條	2,200	670.00	1,474,000
日本製鋼所	300	1,272.00	381,600
オークマ	100	3,315.00	331,500
アマダ	2,100	853.00	1,791,300
牧野フライス製作所	200	2,733.00	546,600
オーエスジー	400	1,359.00	543,600
DMG 森精機	1,200	882.00	1,058,400
ディスコ	100	22,890.00	2,289,000
ナブテスコ	400	2,538.00	1,015,200
SMC	100	47,310.00	4,731,000
小松製作所	4,800	1,793.50	8,608,800
住友重機械工業	800	2,061.00	1,648,800
日立建機	800	2,299.00	1,839,200
クボタ	4,600	1,284.00	5,906,400
荏原製作所	600	2,135.00	1,281,000
ダイキン工業	600	13,720.00	8,232,000
栗田工業	500	2,623.00	1,311,500
椿本チエイン	200	2,338.00	467,600
ダイフク	200	6,980.00	1,396,000
フジテック	500	1,421.00	710,500
平和	300	1,815.00	544,500
SANKYO	300	3,005.00	901,500
アマノ	200	2,268.00	453,600
グローリー	400	2,403.00	961,200
セガサミーホールディングス	1,000	1,295.00	1,295,000
TPR	300	1,102.00	330,600
ホシザキ	100	7,670.00	767,000
日本精工	3,500	645.00	2,257,500
NTN	4,700	182.00	855,400
ジェイテクト	2,300	705.00	1,621,500
THK	600	2,157.00	1,294,200

マキタ	800	3,390.00	2,712,000
日立造船	1,900	334.00	634,600
三菱重工業	2,600	2,638.00	6,858,800
I H I	1,100	1,198.00	1,317,800
日清紡ホールディングス	1,900	671.00	1,274,900
イビデン	700	2,205.00	1,543,500
コニカミノルタ	4,800	407.00	1,953,600
ブラザー工業	1,700	1,734.00	2,947,800
ミネベアミツミ	1,700	1,596.00	2,713,200
日立製作所	8,100	3,138.00	25,417,800
東芝	2,900	2,640.00	7,656,000
三菱電機	11,500	1,307.00	15,030,500
富士電機	700	2,432.00	1,702,400
安川電機	500	2,898.00	1,449,000
マブチモーター	300	3,210.00	963,000
日本電産	700	5,468.00	3,827,600
JVCケンウッド	2,000	174.00	348,000
オムロン	900	5,690.00	5,121,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	700	1,435.00	1,004,500
日本電気	1,400	3,920.00	5,488,000
富士通	1,300	9,943.00	12,925,900
沖電気工業	800	966.00	772,800
ルネサスエレクトロニクス	2,800	408.00	1,142,400
セイコーエプソン	2,600	1,075.00	2,795,000
アルバック	200	2,625.00	525,000
ジャパンディスプレイ	15,300	46.00	703,800
パナソニック	22,800	832.80	18,987,840
シャープ	1,200	1,127.00	1,352,400
アンリツ	300	2,019.00	605,700
ソニー	4,600	6,690.00	30,774,000
TDK	600	8,140.00	4,884,000
アルプスアルパイン	1,700	1,000.00	1,700,000
フォスター電機	400	1,112.00	444,800
ホシデン	600	785.00	471,000
ヒロセ電機	100	11,100.00	1,110,000

日本航空電子工業	400	1,264.00	505,600
横河電機	900	1,357.00	1,221,300
アズビル	400	2,806.00	1,122,400
日本光電工業	300	3,600.00	1,080,000
堀場製作所	100	5,370.00	537,000
アドバンテスト	200	4,645.00	929,000
キーエンス	100	35,800.00	3,580,000
シスメックス	200	7,841.00	1,568,200
スタンレー電気	800	2,187.00	1,749,600
ウシオ電機	500	1,012.00	506,000
カシオ計算機	1,000	1,598.00	1,598,000
ファナック	600	14,365.00	8,619,000
ローム	400	6,350.00	2,540,000
浜松ホトニクス	300	4,535.00	1,360,500
京セラ	1,400	6,152.00	8,612,800
太陽誘電	500	2,808.00	1,404,000
村田製作所	1,700	5,622.00	9,557,400
小糸製作所	500	3,680.00	1,840,000
SCREENホールディングス	100	4,065.00	406,500
キヤノン	7,800	2,282.00	17,799,600
リコー	5,600	697.00	3,903,200
東京エレクトロン	400	22,105.00	8,842,000
トヨタ紡織	700	1,206.00	844,200
ユニプレス	700	899.00	629,300
豊田自動織機	800	5,060.00	4,048,000
デンソー	3,500	3,643.00	12,750,500
東海理化電機製作所	600	1,322.00	793,200
三井E&Sホールディングス	1,000	541.00	541,000
川崎重工業	1,500	1,477.00	2,215,500
日産自動車	39,900	346.70	13,833,330
いすゞ自動車	5,300	701.70	3,719,010
トヨタ自動車	11,500	6,618.00	76,107,000
日野自動車	2,800	582.00	1,629,600
三菱自動車工業	7,700	308.00	2,371,600
武蔵精密工業	400	778.00	311,200

日産車体	900	865.00	778,500
新明和工業	700	1,080.00	756,000
日信工業	400	2,212.00	884,800
タチエス	500	899.00	449,500
NOK	1,100	1,110.00	1,221,000
フタバ産業	800	437.00	349,600
KYB	300	1,998.00	599,400
プレス工業	1,300	228.00	296,400
ケーヒン	600	2,542.00	1,525,200
アイシン精機	2,200	2,621.00	5,766,200
マツダ	10,300	559.00	5,757,700
本田技研工業	17,400	2,355.50	40,985,700
スズキ	2,700	2,756.00	7,441,200
SUBARU	4,900	1,874.00	9,182,600
ヤマハ発動機	2,400	1,302.00	3,124,800
ショーワ	500	2,239.00	1,119,500
エクセディ	300	1,515.00	454,500
豊田合成	700	1,753.00	1,227,100
日本精機	400	1,148.00	459,200
エフ・シー・シー	300	1,502.00	450,600
シマノ	200	15,460.00	3,092,000
テイ・エス テック	500	2,519.00	1,259,500
テルモ	1,100	3,687.00	4,055,700
島津製作所	500	2,868.00	1,434,000
東京精密	200	3,170.00	634,000
ニコン	2,400	995.00	2,388,000
トプコン	400	796.00	318,400
オリンパス	1,800	1,557.50	2,803,500
HOYA	900	9,659.00	8,693,100
シチズン時計	2,500	372.00	930,000
セイコーホールディングス	200	1,682.00	336,400
ニプロ	900	1,161.00	1,044,900
バンダイナムコホールディングス	500	5,408.00	2,704,000
タカラトミー	600	783.00	469,800
凸版印刷	2,200	1,547.00	3,403,400

大日本印刷	1,800	2,288.00	4,118,400
アシックス	900	943.00	848,700
ヤマハ	400	4,310.00	1,724,000
ピジョン	200	4,185.00	837,000
リンテック	300	2,242.00	672,600
任天堂	100	43,190.00	4,319,000
コクヨ	500	1,417.00	708,500
東京電力ホールディングス	36,400	368.00	13,395,200
中部電力	6,700	1,461.00	9,788,700
関西電力	8,000	1,129.00	9,032,000
中国電力	2,300	1,481.00	3,406,300
北陸電力	2,500	751.00	1,877,500
東北電力	6,800	1,006.00	6,840,800
四国電力	1,800	834.00	1,501,200
九州電力	4,600	876.00	4,029,600
北海道電力	4,000	443.00	1,772,000
沖縄電力	400	1,871.00	748,400
電源開発	1,300	2,110.00	2,743,000
東京瓦斯	3,300	2,564.50	8,462,850
大阪瓦斯	3,000	2,012.00	6,036,000
東邦瓦斯	400	4,990.00	1,996,000
東武鉄道	700	3,480.00	2,436,000
相鉄ホールディングス	300	2,688.00	806,400
東急	1,800	1,698.00	3,056,400
京浜急行電鉄	600	1,783.00	1,069,800
小田急電鉄	700	2,330.00	1,631,000
京王電鉄	200	6,140.00	1,228,000
京成電鉄	200	2,997.00	599,400
東日本旅客鉄道	1,600	8,062.00	12,899,200
西日本旅客鉄道	800	7,420.00	5,936,000
東海旅客鉄道	400	17,545.00	7,018,000
西武ホールディングス	800	1,229.00	983,200
西日本鉄道	300	2,563.00	768,900
近鉄グループホールディングス	500	5,050.00	2,525,000
阪急阪神ホールディングス	900	3,575.00	3,217,500

南海電気鉄道	400	2,386.00	954,400
京阪ホールディングス	300	4,700.00	1,410,000
名古屋鉄道	700	3,080.00	2,156,000
日本通運	800	5,070.00	4,056,000
ヤマトホールディングス	2,700	1,907.00	5,148,900
山九	200	4,135.00	827,000
センコーグループホールディングス	1,000	846.00	846,000
ニッコンホールディングス	400	2,002.00	800,800
セイノーホールディングス	1,200	1,214.00	1,456,800
日立物流	300	2,444.00	733,200
九州旅客鉄道	600	3,010.00	1,806,000
S Gホールディングス	700	2,682.00	1,877,400
日本郵船	2,300	1,346.00	3,095,800
商船三井	1,100	1,789.00	1,967,900
川崎汽船	800	899.00	719,200
日本航空	3,400	1,855.50	6,308,700
ANAホールディングス	2,300	2,352.50	5,410,750
三菱倉庫	300	2,203.00	660,900
住友倉庫	400	1,211.00	484,400
上組	600	1,890.00	1,134,000
T I S	600	1,915.00	1,149,000
ネクソン	1,200	1,784.00	2,140,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	600	1,545.00	927,000
野村総合研究所	900	2,357.00	2,121,300
フジ・メディア・ホールディングス	1,600	1,073.00	1,716,800
Zホールディングス	7,900	355.00	2,804,500
トレンドマイクロ	300	4,855.00	1,456,500
日本オラクル	100	9,510.00	951,000
伊藤忠テクノソリューションズ	300	3,150.00	945,000
大塚商会	400	4,550.00	1,820,000
ネットワンシステムズ	200	2,331.00	466,200
日本ユニシス	200	2,927.00	585,400
東京放送ホールディングス	600	1,555.00	933,000
日本テレビホールディングス	1,200	1,229.00	1,474,800
テレビ朝日ホールディングス	400	1,605.00	642,000

日本電信電話	25,800	2,594.50	66,938,100
KDDI	10,900	3,251.00	35,435,900
ソフトバンク	11,300	1,396.50	15,780,450
NTTドコモ	8,800	3,382.00	29,761,600
東宝	300	3,280.00	984,000
エヌ・ティ・ティ・データ	2,800	1,031.00	2,886,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	5,000.00	1,000,000
SCSK	200	5,000.00	1,000,000
コナミホールディングス	300	3,365.00	1,009,500
ソフトバンクグループ	11,000	4,129.00	45,419,000
あらた	300	4,335.00	1,300,500
双日	13,500	244.00	3,294,000
アルフレッサ ホールディングス	1,700	2,094.00	3,559,800
ダイワボウホールディングス	200	5,620.00	1,124,000
マクニカ・富士エレホールディングス	600	1,386.00	831,600
シップヘルスケアホールディングス	200	4,500.00	900,000
三菱食品	200	2,618.00	523,600
第一興商	200	2,761.00	552,200
メディパルホールディングス	1,700	2,093.00	3,558,100
伊藤忠商事	9,900	2,139.00	21,176,100
丸紅	26,000	519.00	13,494,000
長瀬産業	1,200	1,256.00	1,507,200
豊田通商	2,500	2,331.00	5,827,500
兼松	1,100	1,036.00	1,139,600
三井物産	15,400	1,504.00	23,161,600
日立ハイテク	200	7,980.00	1,596,000
山善	600	879.00	527,400
住友商事	10,300	1,190.50	12,262,150
三菱商事	11,300	2,235.00	25,255,500
キャノンマーケティングジャパン	300	2,109.00	632,700
阪和興業	600	1,562.00	937,200
岩谷産業	400	3,665.00	1,466,000
三愛石油	900	1,112.00	1,000,800
稲畑産業	700	1,128.00	789,600

東邦ホールディングス	600	2,238.00	1,342,800
サンゲツ	400	1,544.00	617,600
伊藤忠エネクス	1,100	844.00	928,400
リョーサン	400	2,365.00	946,000
PAL TAC	200	5,420.00	1,084,000
日鉄物産	300	3,420.00	1,026,000
オートバックスセブン	500	1,203.00	601,500
加藤産業	300	3,350.00	1,005,000
因幡電機産業	400	2,234.00	893,600
ミスミグループ本社	500	2,281.00	1,140,500
スズケン	600	3,965.00	2,379,000
ローソン	300	5,690.00	1,707,000
エービーシー・マート	100	5,070.00	507,000
ゲオホールディングス	600	1,290.00	774,000
日本マクドナルドホールディングス	100	4,970.00	497,000
エディオン	1,400	889.00	1,244,600
ビックカメラ	800	853.00	682,400
DCMホールディングス	900	1,001.00	900,900
J. フロント リテイリング	1,900	754.00	1,432,600
マツモトキヨシホールディングス	400	3,920.00	1,568,000
ZOZO	300	1,551.00	465,300
ココカラファイン	100	5,490.00	549,000
三越伊勢丹ホールディングス	3,800	573.00	2,177,400
ウエルシアホールディングス	100	7,310.00	731,000
すかいらーくホールディングス	800	1,480.00	1,184,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	900	966.00	869,400
セブン&アイ・ホールディングス	4,800	3,581.00	17,188,800
ツルハホールディングス	100	14,020.00	1,402,000
良品計画	800	1,089.00	871,200
コーナン商事	300	2,157.00	647,100
パン・パシフィック・インターナシ ョナルホ	1,100	2,008.00	2,208,800
ゼンショーホールディングス	300	1,941.00	582,300
スギホールディングス	200	5,740.00	1,148,000
ファミリーマート	700	1,955.00	1,368,500

日本瓦斯	200	3,210.00	642,000
島忠	300	2,691.00	807,300
コメリ	300	1,914.00	574,200
青山商事	700	810.00	567,000
しまむら	200	5,920.00	1,184,000
高島屋	2,000	886.00	1,772,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,400	769.00	1,076,600
丸井グループ	700	1,628.00	1,139,600
イオン	4,200	2,150.50	9,032,100
イズミ	200	2,882.00	576,400
平和堂	300	1,752.00	525,600
ケーズホールディングス	1,900	1,053.00	2,000,700
アインホールディングス	100	6,120.00	612,000
ヤマダ電機	7,200	485.00	3,492,000
ニトリホールディングス	100	15,400.00	1,540,000
アークス	500	1,870.00	935,000
バローホールディングス	500	1,881.00	940,500
サンドラッグ	400	3,550.00	1,420,000
めぶきフィナンシャルグループ	12,400	213.00	2,641,200
ゆうちょ銀行	3,900	975.00	3,802,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	9,600	308.00	2,956,800
西日本フィナンシャルホールディングス	3,300	587.00	1,937,100
新生銀行	600	1,499.00	899,400
あおぞら銀行	1,800	1,923.00	3,461,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	202,500	415.60	84,159,000
りそなホールディングス	53,400	334.30	17,851,620
三井住友トラスト・ホールディングス	19,500	3,121.00	60,859,500
三井住友フィナンシャルグループ	30,500	2,724.00	83,082,000
千葉銀行	7,100	469.00	3,329,900
群馬銀行	2,100	320.00	672,000
武蔵野銀行	300	1,322.00	396,600
青森銀行	400	2,307.00	922,800
ふくおかフィナンシャルグループ	4,800	1,423.00	6,830,400

静岡銀行	1,200	645.00	774,000
八十二銀行	11,000	370.00	4,070,000
大垣共立銀行	300	2,065.00	619,500
北國銀行	1,100	3,035.00	3,338,500
滋賀銀行	500	2,579.00	1,289,500
南都銀行	200	2,109.00	421,800
百五銀行	4,000	286.00	1,144,000
京都銀行	200	3,365.00	673,000
紀陽銀行	500	1,497.00	748,500
ほくほくフィナンシャルグループ	4,100	866.00	3,550,600
広島銀行	3,200	436.00	1,395,200
山陰合同銀行	2,400	541.00	1,298,400
伊予銀行	1,300	526.00	683,800
百十四銀行	400	1,909.00	763,600
大分銀行	300	1,900.00	570,000
セブン銀行	3,400	285.00	969,000
みずほフィナンシャルグループ	494,500	124.00	61,318,000
北洋銀行	10,100	187.00	1,888,700
東和銀行	1,500	593.00	889,500
池田泉州ホールディングス	4,900	148.00	725,200
SBIホールディングス	1,100	1,611.00	1,772,100
ジャフコ	300	2,987.00	896,100
大和証券グループ本社	10,800	438.10	4,731,480
野村ホールディングス	26,500	444.00	11,766,000
岡三証券グループ	1,600	344.00	550,400
かんぽ生命保険	400	1,338.00	535,200
SOMPOホールディングス	2,100	3,550.00	7,455,000
MS&ADインシュアランスグループホール	5,600	3,060.00	17,136,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,300	1,793.00	4,123,900
第一生命ホールディングス	18,700	1,364.50	25,516,150
東京海上ホールディングス	4,400	5,007.00	22,030,800
T&Dホールディングス	7,900	913.00	7,212,700
全国保証	100	2,936.00	293,600
クレディセゾン	700	1,077.00	753,900

日本証券金融	6,400	475.00	3,040,000
イオンフィナンシャルサービス	1,000	1,055.00	1,055,000
オリックス	10,400	1,235.00	12,844,000
日本取引所グループ	1,300	2,062.00	2,680,600
ヒューリック	900	1,039.00	935,100
野村不動産ホールディングス	500	1,714.00	857,000
東急不動産ホールディングス	2,100	481.00	1,010,100
飯田グループホールディングス	1,300	1,387.00	1,803,100
パーク24	400	1,414.00	565,600
三井不動産	2,200	1,984.50	4,365,900
三菱地所	3,000	1,690.00	5,070,000
東京建物	900	1,122.00	1,009,800
住友不動産	700	2,555.00	1,788,500
レオパレス21	5,200	259.00	1,346,800
イオンモール	500	1,263.00	631,500
ミクシィ	600	1,650.00	990,000
パーソルホールディングス	700	1,017.00	711,900
総合警備保障	200	5,080.00	1,016,000
カカクコム	300	1,952.00	585,600
ディー・エヌ・エー	500	1,166.00	583,000
博報堂DYホールディングス	1,200	1,129.00	1,354,800
電通グループ	1,200	2,011.00	2,413,200
みらかホールディングス	500	2,282.00	1,141,000
オリエンタルランド	200	14,195.00	2,839,000
ダスキン	300	2,797.00	839,100
ユー・エス・エス	500	1,577.00	788,500
サイバーエージェント	300	4,120.00	1,236,000
楽天	2,100	856.00	1,797,600
テクノプロ・ホールディングス	100	4,575.00	457,500
リクルートホールディングス	2,100	2,645.00	5,554,500
日本郵政	8,300	848.70	7,044,210
ベルシステム24ホールディングス	400	1,105.00	442,000
カナモト	300	2,087.00	626,100
セコム	600	8,847.00	5,308,200
メイテック	100	4,005.00	400,500

	ベネッセホールディングス	400	2,736.00	1,094,400	
小計	銘柄数：552 組入時価比率：96.8%			2,136,386,770	100.0%
合計				2,136,386,770	

(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4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。