



2020年7月期 (2019年7月16日～2020年7月15日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2020 (July 16, 2019 - July 15, 2020)

2020年8月26日  
 August 26, 2020

上場取引所 東証  
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 小売(TOPIX-17)上場投信  
 コード番号 (1630)  
 連動対象指標 TOPIX-17 小売  
 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 TOPIX-17 RETAIL TRADE ETF  
 Code: 1630  
 Underlying index: TOPIX-17 RETAIL TRADE  
 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9月29日  
 分配金支払開始日 2020年8月21日  
 Scheduled date of submission of securities report: September 29, 2020  
 Date of commencing dividend payment: August 21, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年7月期の運用状況 (2019年7月16日～2020年7月15日)

Management Status for Year ended July 2020 (from July 16, 2019 to July 15, 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<br>(負債控除後)                               |              | 合計 (純資産)           |              |
|--------------------------------|-------------------------|--------------|---|--------------|--------------------|--------------|
|                                | Primary Invested Assets |              | Cash/Deposits/Other Assets<br>(excluding liabilities) |              | Total (Net Assets) |              |
|                                | 金額<br>Amount            | 構成比<br>ratio | 金額<br>Amount  | 構成比<br>ratio | 金額<br>Amount       | 構成比<br>ratio |
|                                | 百万円<br>JPY mil.         | %            | 百万円<br>JPY mil.                                       | %            | 百万円<br>JPY mil.    | %            |
| 2020年7月期<br>FY ended Jul. 2020 | 620                     | (99.9)       | 0   | (0.1)        | 621                | (100.0)      |
| 2019年7月期<br>FY ended Jul. 2019 | 576                     | (99.8)       | 0   | (0.2)        | 577                | (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<br>発行済口数<br>No. of Issued Units<br>at End of Previous<br>Fiscal Period<br>(①) | 設定口数<br>No. of Units Created<br>(②) | 交換口数<br>No. of Units<br>Exchanged<br>(③) | 当計算期間末<br>発行済口数<br>No. of Issued Units<br>at End of Fiscal<br>Period<br>(①+②-③) |
|--------------------------------|--|-------------------------------------|--|---|
|                                | 千口<br>'000 units   | 千口<br>'000 units                    | 千口<br>'000 units                         | 千口<br>'000 units  |
| 2020年7月期<br>FY ended Jul. 2020 | 30   | 0                                   | 0  | 30  |
| 2019年7月期<br>FY ended Jul. 2019 | 50   | 0                                   | 19                                       | 30  |

(3) 基準価額

Net Asset Value

|                                | 総資産<br>Total Assets<br>(①) | 負債<br>Liabilities<br>(②) | 純資産<br>Net Assets<br>(③(①-②)) | 10口当り基準価額<br>((③/当計算期間末発行済口数)×10)<br>Net Asset Value per 10 units<br>((③/No. of Issued Units at End of Fiscal<br>Period)×10) |
|--------------------------------|----------------------------|--------------------------|-------------------------------|--|
|                                | 百万円<br>JPY mil.            | 百万円<br>JPY mil.          | 百万円<br>JPY mil.               | 円<br>JPY   |
| 2020年7月期<br>FY ended Jul. 2020 | 629                        | 8                        | 621                           | 204,414  |
| 2019年7月期<br>FY ended Jul. 2019 | 585                        | 8                        | 577                           | 189,808  |

(4) 分配金

Dividend Payment

|                                | 10口当り分配金<br>Dividend per 10 units |
|--------------------------------|-----------------------------------|
|                                | 円<br>JPY                          |
| 2020年7月期<br>FY ended Jul. 2020 | 2,380                             |
| 2019年7月期<br>FY ended Jul. 2019 | 2,400                             |

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<br>(2019年7月15日現在)<br>12th Fiscal Year<br>As of July 15, 2019 | 第13期<br>(2020年7月15日現在)<br>13th Fiscal Year<br>As of July 15, 2020 |
|--|---|---|
|  | 金額 Amount   | 金額 Amount   |
| 資産の部<br>Assets                                     |   |   |
| 流動資産<br>Current assets                             |   |   |
| コール・ローン<br>Call loans                              | 1,378,388   | 2,355,207   |
| 株式<br>Stocks                                       | 576,106,100   | 620,558,350   |
| 未収入金<br>Accounts receivable - other                | 7,547,400   | 6,483,156   |
| 未収配当金<br>Accrued dividends receivable              | 425,630   | 415,250   |
| 流動資産合計<br>Total current assets                     | 585,457,518   | 629,811,963   |
| 資産合計<br>Total assets                               | 585,457,518   | 629,811,963   |
| 負債の部<br>Liabilities                                |   |   |
| 流動負債<br>Current liabilities                        |   |   |
| 未払収益分配金<br>Unpaid dividends                        | 7,296,720   | 7,235,914   |
| 未払受託者報酬<br>Trustee fee payable                     | 157,558   | 158,840   |
| 未払委託者報酬<br>Investment trust management fee payable | 850,766   | 857,686   |
| 未払利息<br>Accrued interest expenses                  | 10  | 1   |
| その他未払費用<br>Other accrued expenses                  | 77,736  | 78,963  |
| 流動負債合計<br>Total current liabilities                | 8,382,790   | 8,331,404   |
| 負債合計<br>Total liabilities                          | 8,382,790   | 8,331,404   |
| 純資産の部<br>Net assets                                |   |   |
| 元本等<br>Principal and other                         |   |   |
| 元本<br>Principal                                    | 298,983,102   | 298,983,102   |
| 剰余金<br>Surplus                                     |   |   |

|   |             |             |
|---|-------------|-------------|
| 期末剰余金又は期末欠損金(△)<br>Surplus (deficit) at end of period | 278,091,626 | 322,497,457 |
| (分配準備積立金)<br>(Reserve for distribution)               | 2,159       | 19,526      |
| 元本等合計<br>Total principal and other                    | 577,074,728 | 621,480,559 |
| 純資産合計<br>Total net assets                             | 577,074,728 | 621,480,559 |
| 負債純資産合計<br>Total liabilities and net assets           | 585,457,518 | 629,811,963 |

(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<br>自 2018年7月16日<br>至 2019年7月15日<br>12th Fiscal Year<br>From July 16, 2018<br>to July 15, 2019 | 第13期<br>自 2019年7月16日<br>至 2020年7月15日<br>13th Fiscal Year<br>From July 16, 2019<br>to July 15, 2020 |
|--|--|--|
|  | 金額 Amount  | 金額 Amount  |
| 営業収益<br>Operating revenue  |  |  |
| 受取配当金<br>Dividend income   | 9,628,830  | 9,516,130  |
| 有価証券売買等損益<br>Profit and loss on buying and selling of securities and other                     | △81,373,017  | 44,388,464   |
| その他収益<br>Other revenue   | 25,473   | 30,037   |
| 営業収益合計<br>Total operating revenue  | △71,718,714  | 53,934,631   |
| 営業費用<br>Operating expenses   |  |  |
| 支払利息<br>Interest expenses  | 1,766  | 903  |
| 受託者報酬<br>Trustee fee   | 339,976  | 324,801  |
| 委託者報酬<br>Investment trust management fee   | 1,835,737  | 1,753,812  |
| その他費用<br>Other expenses  | 216,415  | 213,370  |
| 営業費用合計<br>Total operating expenses   | 2,393,894  | 2,292,886  |
| 営業利益又は営業損失(△)<br>Operating profit (loss)   | △74,112,608  | 51,641,745   |
| 経常利益又は経常損失(△)<br>Ordinary profit (loss)  | △74,112,608  | 51,641,745   |
| 当期純利益又は当期純損失(△)<br>Profit (loss)   | △74,112,608  | 51,641,745   |
| 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(△)<br>Distribution of profit loss from partial exchange | -  | -  |
| 期首剰余金又は期首欠損金(△)  | 603,929,070  | 278,091,626  |

|   |             |             |
|---|-------------|-------------|
| Surplus (deficit) at beginning of period  |             |             |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額<br>Increase in surplus or decrease in deficit                                |             | -           |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額<br>Decrease in surplus or increase in deficit                                | 244,428,116 | -           |
| 当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額<br>Decrease in surplus or increase in deficit from partial exchange | 244,428,116 | -           |
| 分配金<br>Dividends  | 7,296,720   | 7,235,914   |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△)<br>Surplus (deficit) at end of period                                       | 278,091,626 | 322,497,457 |

(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<br>原則として時価で評価しております。<br>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<br>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。<br>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。<br>有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。                   |
| 4. その他                 | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年7月16日から2020年7月15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<br>2019年7月15日現在   | 第13期<br>2020年7月15日現在   |
|--|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>30,403口  | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>30,403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<br>1口当たり純資産額 18,980.8円<br>(10口当たり純資産額) (189,808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<br>1口当たり純資産額 20,441.4円<br>(10口当たり純資産額) (204,414円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第12期<br>自2018年7月16日<br>至2019年7月15日  | 第13期<br>自2019年7月16日<br>至2020年7月15日 |            |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
|---|------------------------------------|------------|--|----------|---|------------|---------|---|---------|----------|-------|------------|----|---|------------|---------|-------|------------|-------|---|------------|----------------|-------|--------|---|----|--|--|----------|---|------------|---------|---|--------|----------|-------|------------|----|---|------------|---------|-------|------------|-------|---|------------|----------------|-------|---------|
| 1. 分配金の計算過程   | 1. 分配金の計算過程                        |            |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| <table border="1" style="width: 100%;"> <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>9,652,537円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>38,470円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>9,691,007円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,392,128円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>7,298,879円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>7,296,720円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>2,159円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目                                 |            |  | 当期配当等収益額 | A | 9,652,537円 | 分配準備積立金 | B | 38,470円 | 配当等収益合計額 | C=A+B | 9,691,007円 | 経費 | D | 2,392,128円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 7,298,879円 | 収益分配金 | F | 7,296,720円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 2,159円 | <table border="1" style="width: 100%;"> <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>9,545,264円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,159円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>9,547,423円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,291,983円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>7,255,440円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>7,235,914円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>19,526円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 |  |  | 当期配当等収益額 | A | 9,545,264円 | 分配準備積立金 | B | 2,159円 | 配当等収益合計額 | C=A+B | 9,547,423円 | 経費 | D | 2,291,983円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 7,255,440円 | 収益分配金 | F | 7,235,914円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 19,526円 |
| 項目  |                                    |            |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 当期配当等収益額  | A                                  | 9,652,537円 |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 分配準備積立金   | B                                  | 38,470円    |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 配当等収益合計額  | C=A+B                              | 9,691,007円 |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 経費  | D                                  | 2,392,128円 |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 収益分配可能額   | E=C-D                              | 7,298,879円 |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 収益分配金   | F                                  | 7,296,720円 |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 次期繰越金(分配準備積立金)  | G=E-F                              | 2,159円     |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 項目  |                                    |            |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 当期配当等収益額  | A                                  | 9,545,264円 |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 分配準備積立金   | B                                  | 2,159円     |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 配当等収益合計額  | C=A+B                              | 9,547,423円 |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 経費  | D                                  | 2,291,983円 |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 収益分配可能額   | E=C-D                              | 7,255,440円 |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 収益分配金   | F                                  | 7,235,914円 |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |
| 次期繰越金(分配準備積立金)  | G=E-F                              | 19,526円    |  |          |   |            |         |   |         |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |        |   |    |  |  |          |   |            |         |   |        |          |       |            |    |   |            |         |       |            |       |   |            |                |       |         |

|           |          |          |           |          |          |
|-----------|----------|----------|-----------|----------|----------|
| 口数        | H        | 30,403 口 | 口数        | H        | 30,403 口 |
| 10口当たり分配金 | I=F/H×10 | 2,400 円  | 10口当たり分配金 | I=F/H×10 | 2,380 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12期<br>自 2018年 7月 16日<br>至 2019年 7月 15日  | 第13期<br>自 2019年 7月 16日<br>至 2020年 7月 15日   |
|---|--|
| <p>1. 金融商品に対する取組方針<br/>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<br/>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。<br/>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。<br/>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<br/>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。<br/>○市場リスクの管理<br/>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。<br/>○信用リスクの管理<br/>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。<br/>○流動性リスクの管理<br/>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<br/>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<br/>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制<br/>同左</p> |

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| 第12期<br>2019年 7月 15日現在   | 第13期<br>2020年 7月 15日現在                                    |
|--|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>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<br/>株式<br/>(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。<br/>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>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<br/>同左</p> <p>2. 時価の算定方法<br/>同左</p> |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 第12期<br>自 2018年 7月 16日<br>至 2019年 7月 15日                              | 第13期<br>自 2019年 7月 16日<br>至 2020年 7月 15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<br>自 2018年 7月 16日<br>至 2019年 7月 15日 |              | 第13期<br>自 2019年 7月 16日<br>至 2020年 7月 15日 |              |
|--|--------------|--|--------------|
| 期首元本額                                    | 493,951,986円 | 期首元本額                                    | 298,983,102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                                | 194,968,884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<br>自 2018年 7月 16日<br>至 2019年 7月 15日 | 第13期<br>自 2019年 7月 16日<br>至 2020年 7月 15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 | △86,494,454                              | 41,711,927                               |
| 合計 | △86,494,454                              | 41,711,927                               |

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年7月15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 | ローソン           | 1,400   | 5,760.00 | 8,064,000 |    |
|      |     | サンエー           | 500     | 4,105.00 | 2,052,500 |    |
|      |     | カワチ薬品          | 400     | 2,987.00 | 1,194,800 |    |
|      |     | エービーシー・マート     | 900     | 6,120.00 | 5,508,000 |    |
|      |     | ハードオフコーポレーション  | 200     | 699.00   | 139,800   |    |
|      |     | アスクル           | 600     | 3,540.00 | 2,124,000 |    |
|      |     | ゲオホールディングス     | 1,000   | 1,464.00 | 1,464,000 |    |
|      |     | アダストリア         | 800     | 1,574.00 | 1,259,200 |    |
|      |     | ジーフット          | 300     | 503.00   | 150,900   |    |
|      |     | シー・ヴィ・エス・ベイエリア | 100     | 461.00   | 46,100    |    |
|      |     | くら寿司           | 300     | 4,915.00 | 1,474,500 |    |
|      |     | キャンドウ          | 300     | 2,476.00 | 742,800   |    |
|      |     | パルグループホールディングス | 600     | 1,130.00 | 678,000   |    |
|      |     | エディオン          | 2,500   | 1,065.00 | 2,662,500 |    |
|      |     | サーラコーポレーション    | 1,100   | 580.00   | 638,000   |    |
|      |     | ワッツ            | 200     | 1,054.00 | 210,800   |    |
| ハローズ | 200 | 3,600.00       | 720,000 |          |           |    |

|                    |       |          |            |
|--------------------|-------|----------|------------|
| フジオフードグループ本社       | 500   | 1,281.00 | 640,500    |
| あみやき亭              | 100   | 2,864.00 | 286,400    |
| ひらまつ               | 1,000 | 174.00   | 174,000    |
| 大黒天物産              | 100   | 5,920.00 | 592,000    |
| ハニーズホールディングス       | 500   | 1,149.00 | 574,500    |
| ファーマライズホールディングス    | 100   | 780.00   | 78,000     |
| アルペン               | 400   | 1,671.00 | 668,400    |
| ハブ                 | 200   | 590.00   | 118,000    |
| クオールホールディングス       | 800   | 1,153.00 | 922,400    |
| ジンスホールディングス        | 300   | 7,330.00 | 2,199,000  |
| ビックカメラ             | 3,300 | 1,181.00 | 3,897,300  |
| DCMホールディングス        | 3,100 | 1,314.00 | 4,073,400  |
| ペッパーフードサービス        | 500   | 511.00   | 255,500    |
| Monotaro           | 3,900 | 4,550.00 | 17,745,000 |
| 東京一番フーズ            | 100   | 508.00   | 50,800     |
| DDホールディングス         | 200   | 762.00   | 152,400    |
| きちりホールディングス        | 100   | 571.00   | 57,100     |
| アークランドサービスホールディングス | 400   | 1,901.00 | 760,400    |
| J. フロント リテイリング     | 6,600 | 679.00   | 4,481,400  |
| ドトール・日レスホールディングス   | 800   | 1,554.00 | 1,243,200  |
| マツモトキヨシホールディングス    | 2,300 | 3,965.00 | 9,119,500  |
| ブロンコビリー            | 300   | 2,253.00 | 675,900    |
| ZOZO               | 3,800 | 2,653.00 | 10,081,400 |
| トレジャー・ファクトリー       | 200   | 719.00   | 143,800    |
| 物語コーポレーション         | 100   | 7,930.00 | 793,000    |
| ココカラファイン           | 600   | 6,240.00 | 3,744,000  |
| 三越伊勢丹ホールディングス      | 9,700 | 599.00   | 5,810,300  |
| Hamee              | 200   | 1,880.00 | 376,000    |
| ウエルシアホールディングス      | 1,600 | 9,420.00 | 15,072,000 |
| クリエイトSDホールディングス    | 900   | 3,745.00 | 3,370,500  |
| 丸善CHIホールディングス      | 600   | 399.00   | 239,400    |
| ミサワ                | 100   | 669.00   | 66,900     |
| ティーライフ             | 100   | 1,099.00 | 109,900    |
| エー・ピーカンパニー         | 100   | 429.00   | 42,900     |
| チムニー               | 200   | 1,288.00 | 257,600    |

|                      |        |           |            |
|----------------------|--------|-----------|------------|
| シュッピン                | 400    | 739.00    | 295,600    |
| オイシックス・ラ・大地          | 500    | 2,062.00  | 1,031,000  |
| ネクステージ               | 800    | 977.00    | 781,600    |
| ジョイフル本田              | 1,600  | 1,489.00  | 2,382,400  |
| 鳥貴族                  | 200    | 1,485.00  | 297,000    |
| キリン堂ホールディングス         | 200    | 2,924.00  | 584,800    |
| ホットランド               | 400    | 1,075.00  | 430,000    |
| すかいらーくホールディングス       | 6,200  | 1,616.00  | 10,019,200 |
| SFPホールディングス          | 300    | 1,447.00  | 434,100    |
| 綿半ホールディングス           | 200    | 1,977.00  | 395,400    |
| ヨシックス                | 100    | 1,847.00  | 184,700    |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 1,600  | 1,250.00  | 2,000,000  |
| ゴルフダイジェスト・オンライン      | 300    | 523.00    | 156,900    |
| B E E N O S          | 300    | 1,189.00  | 356,700    |
| あさひ                  | 400    | 1,608.00  | 643,200    |
| 日本調剤                 | 300    | 1,700.00  | 510,000    |
| コスモス薬品               | 500    | 18,700.00 | 9,350,000  |
| トーエル                 | 300    | 684.00    | 205,200    |
| オンリー                 | 100    | 580.00    | 58,000     |
| セブン&アイ・ホールディングス      | 21,700 | 3,550.00  | 77,035,000 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 3,000  | 540.00    | 1,620,000  |
| ツルハホールディングス          | 1,200  | 14,980.00 | 17,976,000 |
| サンマルクホールディングス        | 400    | 1,597.00  | 638,800    |
| フェリシモ                | 100    | 1,072.00  | 107,200    |
| トリドールホールディングス        | 1,400  | 1,192.00  | 1,668,800  |
| TOKYO BASE           | 500    | 328.00    | 164,000    |
| ウイルプラスホールディングス       | 100    | 608.00    | 60,800     |
| JMホールディングス           | 400    | 3,620.00  | 1,448,000  |
| サツドラホールディングス         | 100    | 1,976.00  | 197,600    |
| アレンザホールディングス         | 300    | 1,109.00  | 332,700    |
| 串カツ田中ホールディングス        | 100    | 1,623.00  | 162,300    |
| パロックジャパンリミテッド        | 400    | 646.00    | 258,400    |
| クスリのアオキホールディングス      | 500    | 10,050.00 | 5,025,000  |
| 力の源ホールディングス          | 300    | 664.00    | 199,200    |

|                      |        |          |            |
|----------------------|--------|----------|------------|
| スシログローバルホールディングス     | 3,000  | 2,469.00 | 7,407,000  |
| LIXILビバ              | 500    | 2,596.00 | 1,298,000  |
| メディカルシステムネットワーク      | 500    | 506.00   | 253,000    |
| はるやまホールディングス         | 300    | 730.00   | 219,000    |
| ノジマ                  | 1,000  | 2,730.00 | 2,730,000  |
| カップ・クリエイト            | 800    | 1,385.00 | 1,108,000  |
| ライトオン                | 400    | 569.00   | 227,600    |
| ジーンズメイト              | 200    | 219.00   | 43,800     |
| 良品計画                 | 7,400  | 1,385.00 | 10,249,000 |
| 三城ホールディングス           | 600    | 265.00   | 159,000    |
| アドヴァン                | 800    | 1,346.00 | 1,076,800  |
| アルビス                 | 200    | 2,438.00 | 487,600    |
| コナカ                  | 700    | 311.00   | 217,700    |
| ハウス オブ ローゼ           | 100    | 1,596.00 | 159,600    |
| G-7ホールディングス          | 300    | 2,441.00 | 732,300    |
| イオン北海道               | 700    | 785.00   | 549,500    |
| コジマ                  | 1,000  | 568.00   | 568,000    |
| ヒマラヤ                 | 200    | 819.00   | 163,800    |
| コーナン商事               | 800    | 3,860.00 | 3,088,000  |
| エコス                  | 200    | 2,176.00 | 435,200    |
| ワタミ                  | 700    | 898.00   | 628,600    |
| マルシェ                 | 100    | 503.00   | 50,300     |
| パン・パシフィック・インターナショナルホ | 12,200 | 2,406.00 | 29,353,200 |
| 西松屋チェーン              | 1,200  | 1,137.00 | 1,364,400  |
| ゼンショーホールディングス        | 2,700  | 2,096.00 | 5,659,200  |
| 幸楽苑ホールディングス          | 400    | 1,550.00 | 620,000    |
| ハークスレイ               | 100    | 1,006.00 | 100,600    |
| サイゼリヤ                | 800    | 1,849.00 | 1,479,200  |
| V Tホールディングス          | 2,300  | 348.00   | 800,400    |
| 魚力                   | 200    | 1,608.00 | 321,600    |
| ポプラ                  | 100    | 407.00   | 40,700     |
| フジ・コーポレーション          | 100    | 2,000.00 | 200,000    |
| ユナイテッドアローズ           | 600    | 1,645.00 | 987,000    |
| ハイデイ日高               | 800    | 1,607.00 | 1,285,600  |

|                 |       |          |            |
|-----------------|-------|----------|------------|
| 京都きもの友禅         | 400   | 258.00   | 103,200    |
| コロナイド           | 1,800 | 1,371.00 | 2,467,800  |
| ピーシーデポコーポレーション  | 700   | 672.00   | 470,400    |
| 壱番屋             | 400   | 4,960.00 | 1,984,000  |
| トップカルチャー        | 200   | 349.00   | 69,800     |
| P L A N T       | 100   | 661.00   | 66,100     |
| スギホールディングス      | 1,100 | 7,850.00 | 8,635,000  |
| 薬王堂ホールディングス     | 200   | 2,706.00 | 541,200    |
| ヴィア・ホールディングス    | 700   | 366.00   | 256,200    |
| スクロール           | 900   | 500.00   | 450,000    |
| ヨンドシーホールディングス   | 600   | 1,903.00 | 1,141,800  |
| ファミリーマート        | 4,400 | 2,397.00 | 10,546,800 |
| 木曽路             | 700   | 2,350.00 | 1,645,000  |
| S R Sホールディングス   | 700   | 889.00   | 622,300    |
| 千趣会             | 1,000 | 346.00   | 346,000    |
| タカキュー           | 400   | 130.00   | 52,000     |
| リテールパートナーズ      | 700   | 2,237.00 | 1,565,900  |
| ケーヨー            | 1,100 | 803.00   | 883,300    |
| 上新電機            | 700   | 2,243.00 | 1,570,100  |
| 日本瓦斯            | 900   | 4,750.00 | 4,275,000  |
| ロイヤルホールディングス    | 1,000 | 1,743.00 | 1,743,000  |
| いなげや            | 700   | 1,752.00 | 1,226,400  |
| 島忠              | 1,000 | 2,950.00 | 2,950,000  |
| チヨダ             | 600   | 1,090.00 | 654,000    |
| ライフコーポレーション     | 400   | 4,435.00 | 1,774,000  |
| リンガーハット         | 700   | 2,210.00 | 1,547,000  |
| M r M a x H D   | 800   | 730.00   | 584,000    |
| テンアライド          | 500   | 366.00   | 183,000    |
| A O K Iホールディングス | 1,100 | 611.00   | 672,100    |
| オークワ            | 900   | 1,563.00 | 1,406,700  |
| コメリ             | 900   | 2,880.00 | 2,592,000  |
| 青山商事            | 1,100 | 652.00   | 717,200    |
| しまむら            | 600   | 7,540.00 | 4,524,000  |
| はせがわ            | 300   | 300.00   | 90,000     |
| 高島屋             | 4,000 | 817.00   | 3,268,000  |

|                    |        |           |            |
|--------------------|--------|-----------|------------|
| 松屋                 | 1,100  | 634.00    | 697,400    |
| エイチ・ツー・オー リテイリング   | 2,600  | 699.00    | 1,817,400  |
| 近鉄百貨店              | 200    | 2,850.00  | 570,000    |
| 丸井グループ             | 5,100  | 1,731.00  | 8,828,100  |
| アクシアル リテイリング       | 500    | 4,650.00  | 2,325,000  |
| 井筒屋                | 300    | 183.00    | 54,900     |
| イオン                | 21,300 | 2,485.50  | 52,941,150 |
| イズミ                | 1,100  | 4,055.00  | 4,460,500  |
| 平和堂                | 1,100  | 1,955.00  | 2,150,500  |
| フジ                 | 700    | 1,886.00  | 1,320,200  |
| ヤオコー               | 600    | 8,430.00  | 5,058,000  |
| ゼビオホールディングス        | 700    | 816.00    | 571,200    |
| ケーズホールディングス        | 5,300  | 1,403.00  | 7,435,900  |
| O l y m p i c グループ | 300    | 926.00    | 277,800    |
| 日産東京販売ホールディングス     | 800    | 257.00    | 205,600    |
| シルバーライフ            | 100    | 1,964.00  | 196,400    |
| 一家ダイニングプロジェクト      | 100    | 573.00    | 57,300     |
| Genky Drug Stores  | 200    | 3,665.00  | 733,000    |
| ナルミヤ・インターナショナル     | 100    | 565.00    | 56,500     |
| ブックオフグループホールディングス  | 300    | 782.00    | 234,600    |
| アインホールディングス        | 700    | 7,160.00  | 5,012,000  |
| 元気寿司               | 100    | 2,278.00  | 227,800    |
| ヤマダ電機              | 16,900 | 505.00    | 8,534,500  |
| アークランドサカモト         | 900    | 1,906.00  | 1,715,400  |
| ニトリホールディングス        | 2,400  | 22,600.00 | 54,240,000 |
| グルメ杵屋              | 400    | 943.00    | 377,200    |
| 愛眼                 | 400    | 224.00    | 89,600     |
| ケーユーホールディングス       | 300    | 840.00    | 252,000    |
| 吉野家ホールディングス        | 1,800  | 2,061.00  | 3,709,800  |
| 松屋フーズホールディングス      | 300    | 3,575.00  | 1,072,500  |
| サガミホールディングス        | 700    | 1,194.00  | 835,800    |
| 関西スーパーマーケット        | 500    | 1,226.00  | 613,000    |
| 王将フードサービス          | 400    | 5,800.00  | 2,320,000  |
| プレナス               | 600    | 1,724.00  | 1,034,400  |
| ミニストップ             | 400    | 1,546.00  | 618,400    |

|  |                 |       |           |             |  |
|--|-----------------|-------|-----------|-------------|--|
|  | アークス            | 1,100 | 2,649.00  | 2,913,900   |  |
|  | バローホールディングス     | 1,200 | 2,262.00  | 2,714,400   |  |
|  | 藤久              | 100   | 1,114.00  | 111,400     |  |
|  | ベルク             | 300   | 7,810.00  | 2,343,000   |  |
|  | 大庄              | 300   | 1,143.00  | 342,900     |  |
|  | ファーストリテイリング     | 700   | 59,730.00 | 41,811,000  |  |
|  | サンドラッグ          | 2,100 | 3,575.00  | 7,507,500   |  |
|  | サックスパー ホールディングス | 500   | 545.00    | 272,500     |  |
|  | ヤマザワ            | 100   | 1,694.00  | 169,400     |  |
|  | やまや             | 100   | 2,060.00  | 206,000     |  |
|  | ベルーナ            | 1,200 | 686.00    | 823,200     |  |
|  | 小計 銘柄数：201      |       |           | 620,558,350 |  |
|  | 組入時価比率：99.9%    |       |           | 100.0%      |  |
|  | 合計              |       |           | 620,558,350 |  |

(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(2020年7月15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。