



2020 年 10 月期 (2020 年 4 月 21 日～2020 年 10 月 20 日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2020 (April 21, 2020 – October 20, 2020)

2020 年 12 月 1 日
 December 1, 2020

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 サポートダイヤル 山中 淳 TEL 0120-753104

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: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2021 年 1 月 18 日
 分配金支払開始日 2020 年 11 月 27 日
 Scheduled date of submission of securities report: January 18, 2021
 Date of commencing dividend payment: November 27, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020 年 10 月期の運用状況 (2020 年 4 月 21 日～2020 年 10 月 20 日)

Management Status for Year ended October 2020 (from April 21, 2020 to October 20, 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 10 月期 FY ended Oct. 2020	7,754	(98.3)	136	(1.7)	7,890	(100.0)
2020 年 4 月期 FY ended Apr. 2020	6,125	(97.4)	163	(2.6)	6,289	(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 10 月期 FY ended Oct. 2020	444	79	39	485
2020 年 4 月期 FY ended Apr. 2020	483	0	38	444

(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 10 月期 FY ended Oct. 2020	7,956	65	7,890	16,256
2020 年 4 月期 FY ended Apr. 2020	6,375	86	6,289	14,145

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2020 年 10 月期 FY ended Oct. 2020	110
2020 年 4 月期 FY ended Apr. 2020	161

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 8 期 (2020 年 4 月 20 日現在) 8th Fiscal Year As of April 20, 2020	第 9 期 (2020 年 10 月 20 日現在) 9th Fiscal Year As of October 20, 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	168,454,094	137,554,572
株式 Stocks	6,125,689,670	7,754,367,050
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	6,585,780	2,034,390
未収入金 Accounts receivable - other	3,977,500	1,338,239
未収配当金 Accrued dividends receivable	67,505,910	55,977,436
差入委託証拠金 Customers' margin	3,477,181	5,109,251
流動資産合計 Total current assets	6,375,690,135	7,956,380,938
資産合計 Total assets	6,375,690,135	7,956,380,938
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	-	990,771
未払収益分配金 Unpaid dividends	71,583,981	53,395,980
未払受託者報酬 Trustee fee payable	2,063,851	1,818,879
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	7,429,802	6,547,896
未払利息 Accrued interest expenses	186	109
その他未払費用 Other accrued expenses	5,371,153	2,648,487
流動負債合計 Total current liabilities	86,448,973	65,402,122
負債合計 Total liabilities	86,448,973	65,402,122
純資産の部 Net assets		

元本等 Principal and other		
元本 Principal	5,713,824,471	6,238,106,718
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	575,416,691	1,652,872,098
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	157,018	404,696
元本等合計 Total principal and other	6,289,241,162	7,890,978,816
純資産合計 Total net assets	6,289,241,162	7,890,978,816
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	6,375,690,135	7,956,380,938

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第 8 期 自 2019 年 10 月 21 日 至 2020 年 4 月 20 日 8th Fiscal Year From October 21, 2019 to April 20, 2020	第 9 期 自 2020 年 4 月 21 日 至 2020 年 10 月 20 日 9th Fiscal Year From April 21, 2020 to October 20, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	83,830,802	64,528,508
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△787,892,395	884,836,978
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△19,757,640	24,131,867
その他収益 Other revenue	72,931	80,112
営業収益合計 Total operating revenue	△723,746,302	973,577,465
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	30,292	31,692
受託者報酬 Trustee fee	2,063,851	1,818,879
委託者報酬 Investment trust management fee	7,429,802	6,547,896
その他費用 Other expenses	2,890,259	2,566,495
営業費用合計 Total operating expenses	12,414,204	10,964,962
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△736,160,506	962,612,503
経常利益又は経常損失 (△)	△736,160,506	962,612,503

Ordinary profit (loss)		
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△736,160,506	962,612,503
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	1,367,308,387	575,416,691
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	15,852,791	290,541,138
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from partial exchange	15,852,791	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from additional subscriptions for period	-	290,541,138
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	-	122,302,254
当期一部交換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 partial exchange	-	122,302,254
分配金 Dividends	71,583,981	53,395,980
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	575,416,691	1,652,872,098

(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、2020年4月21日から2020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 8 期 2020 年 4 月 20 日現在	第 9 期 2020 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 444,621 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 485,418 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 14,145 円	2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 16,256 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 8 期 自 2019 年 10 月 21 日 至 2020 年 4 月 20 日	第 9 期 自 2020 年 4 月 21 日 至 2020 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>83,873,441 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>251,470 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>84,124,911 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>12,383,912 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>71,740,999 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>71,583,981 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>157,018 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>444,621 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>161 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	83,873,441 円	分配準備積立金	B	251,470 円	配当等収益合計額	C=A+B	84,124,911 円	経費	D	12,383,912 円	収益分配可能額	E=C-D	71,740,999 円	収益分配金	F	71,583,981 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	157,018 円	口数	H	444,621 口	1 口当たり分配金	I=F/H	161 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>64,576,928 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>157,018 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>64,733,946 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>10,933,270 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>53,800,676 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>53,395,980 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>404,696 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>485,418 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>110 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	64,576,928 円	分配準備積立金	B	157,018 円	配当等収益合計額	C=A+B	64,733,946 円	経費	D	10,933,270 円	収益分配可能額	E=C-D	53,800,676 円	収益分配金	F	53,395,980 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	404,696 円	口数	H	485,418 口	1 口当たり分配金	I=F/H	110 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	83,873,441 円																																																											
分配準備積立金	B	251,470 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	84,124,911 円																																																											
経費	D	12,383,912 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	71,740,999 円																																																											
収益分配金	F	71,583,981 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	157,018 円																																																											
口数	H	444,621 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	161 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	64,576,928 円																																																											
分配準備積立金	B	157,018 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	64,733,946 円																																																											
経費	D	10,933,270 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	53,800,676 円																																																											
収益分配金	F	53,395,980 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	404,696 円																																																											
口数	H	485,418 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	110 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち 2,476,556 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 2,173,469 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 8 期 自 2019 年 10 月 21 日 至 2020 年 4 月 20 日	第 9 期 自 2020 年 4 月 21 日 至 2020 年 10 月 20 日
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。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
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。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
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	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

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なっております。

○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なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 8 期 2020 年 4 月 20 日現在	第 9 期 2020 年 10 月 20 日現在
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 せん。 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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 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 8 期 自 2019 年 10 月 21 日 至 2020 年 4 月 20 日	第 9 期 自 2020 年 4 月 21 日 至 2020 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 8 期 自 2019 年 10 月 21 日 至 2020 年 4 月 20 日	第 9 期 自 2020 年 4 月 21 日 至 2020 年 10 月 20 日
期首元本額 6,214,255,262 円	期首元本額 5,713,824,471 円
期中追加設定元本額 0 円	期中追加設定元本額 1,027,604,513 円
期中一部交換元本額 500,430,791 円	期中一部交換元本額 503,322,266 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 8 期 自 2019 年 10 月 21 日 至 2020 年 4 月 20 日	第 9 期 自 2020 年 4 月 21 日 至 2020 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	△663,784,050	708,720,964
合計	△663,784,050	708,720,964

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 8 期(2020 年 4 月 20 日現在)			第 9 期(2020 年 10 月 20 日現在)		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引						
株価指数先物取引						

買建	156,592,680	—	163,191,000	6,585,780	133,780,751	—	134,833,500	1,043,619
合計	156,592,680	—	163,191,000	6,585,780	133,780,751	—	134,833,500	1,043,619

(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	大成建設	5,800	3,410.00	19,778,000	
		清水建設	16,000	743.00	11,888,000	
		長谷工コーポレーション	7,700	1,297.00	9,986,900	
		鹿島建設	13,100	1,167.00	15,287,700	
		大東建託	2,100	9,656.00	20,277,600	
		大和ハウス工業	15,300	2,839.50	43,444,350	
		積水ハウス	16,500	1,777.00	29,320,500	
		協和エクシオ	2,500	2,518.00	6,295,000	
		日清製粉グループ本社	5,300	1,606.00	8,511,800	
		寿スピリッツ	500	5,080.00	2,540,000	
		森永乳業	1,000	5,120.00	5,120,000	
		ヤクルト本社	3,400	5,160.00	17,544,000	
		明治ホールディングス	3,400	7,530.00	25,602,000	
		アサヒグループホールディングス	10,400	3,587.00	37,304,800	
		キリンホールディングス	23,800	1,927.00	45,862,600	
		サントリー食品インターナショナル	3,800	3,850.00	14,630,000	
		キッコーマン	4,100	5,250.00	21,525,000	
		味の素	13,000	2,111.50	27,449,500	
		キューピー	2,800	2,160.00	6,048,000	
		ニチレイ	2,800	2,644.00	7,403,200	
日本たばこ産業	32,900	1,984.50	65,290,050			
帝人	5,300	1,654.00	8,766,200			
東レ	40,100	491.60	19,713,160			

ゴールドウイン	700	8,280.00	5,796,000
クラレ	9,200	1,028.00	9,457,600
旭化成	33,700	924.30	31,148,910
昭和電工	4,000	1,856.00	7,424,000
住友化学	41,100	355.00	14,590,500
日産化学	3,300	5,510.00	18,183,000
東ソー	7,200	1,737.00	12,506,400
トクヤマ	1,800	2,540.00	4,572,000
デンカ	2,300	3,230.00	7,429,000
信越化学工業	10,600	14,290.00	151,474,000
エア・ウォーター	4,200	1,455.00	6,111,000
カネカ	1,300	3,000.00	3,900,000
三菱瓦斯化学	4,700	2,003.00	9,414,100
三井化学	5,100	2,693.00	13,734,300
J S R	5,400	2,517.00	13,591,800
ダイセル	7,600	779.00	5,920,400
積水化学工業	10,600	1,725.00	18,285,000
日本ゼオン	3,500	1,247.00	4,364,500
アイカ工業	1,400	3,640.00	5,096,000
トリケミカル研究所	200	13,120.00	2,624,000
花王	14,100	7,754.00	109,331,400
日本ペイントホールディングス	3,800	10,130.00	38,494,000
D I C	2,100	2,635.00	5,533,500
資生堂	11,300	6,865.00	77,574,500
ライオン	6,400	2,149.00	13,753,600
マンダム	1,100	1,796.00	1,975,600
ファンケル	2,200	3,470.00	7,634,000
コーセー	900	14,710.00	13,239,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	2,085.00	5,421,000
小林製薬	1,500	10,350.00	15,525,000
日東電工	4,800	7,270.00	34,896,000
ニフコ	2,400	3,120.00	7,488,000
ユニ・チャーム	10,600	5,079.00	53,837,400
武田薬品工業	39,000	3,541.00	138,099,000
アステラス製薬	52,900	1,486.50	78,635,850

大日本住友製薬	3,900	1,218.00	4,750,200
塩野義製薬	7,900	5,217.00	41,214,300
日本新薬	1,300	8,330.00	10,829,000
中外製薬	18,200	4,353.00	79,224,600
エーザイ	7,400	8,638.00	63,921,200
小野薬品工業	11,000	3,320.00	36,520,000
参天製薬	10,700	2,084.00	22,298,800
JCRファーマ	1,900	2,718.00	5,164,200
第一三共	50,000	2,745.00	137,250,000
大塚ホールディングス	12,100	4,109.00	49,718,900
出光興産	5,600	2,171.00	12,157,600
Eneosホールディングス	96,600	367.70	35,519,820
横浜ゴム	2,900	1,449.00	4,202,100
TOYO TIRE	3,200	1,673.00	5,353,600
ブリヂストン	17,000	3,363.00	57,171,000
住友ゴム工業	4,600	925.00	4,255,000
AGC	5,300	3,285.00	17,410,500
太平洋セメント	3,600	2,639.00	9,500,400
東海カーボン	5,200	1,226.00	6,375,200
TOTO	4,100	4,645.00	19,044,500
日本碍子	7,400	1,501.00	11,107,400
日本特殊陶業	4,400	1,941.00	8,540,400
ニチアス	1,400	2,400.00	3,360,000
神戸製鋼所	9,200	417.00	3,836,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	14,000	763.00	10,682,000
日本軽金属ホールディングス	1,580	1,679.00	2,652,820
古河電気工業	1,900	2,497.00	4,744,300
住友電気工業	21,400	1,136.50	24,321,100
SUMCO	7,300	1,601.00	11,687,300
三和ホールディングス	5,400	1,212.00	6,544,800
日本発條	4,800	647.00	3,105,600
三浦工業	2,300	4,900.00	11,270,000
オークマ	700	5,090.00	3,563,000
アマダ	9,700	948.00	9,195,600
FUJI	1,800	2,128.00	3,830,400

オーエスジー	2,400	1,655.00	3,972,000
DMG 森精機	3,300	1,479.00	4,880,700
ディスコ	900	28,990.00	26,091,000
ナブテスコ	3,300	3,900.00	12,870,000
SMC	1,800	57,870.00	104,166,000
小松製作所	25,800	2,415.50	62,319,900
住友重機械工業	3,200	2,349.00	7,516,800
日立建機	3,200	3,630.00	11,616,000
ローツェ	300	5,200.00	1,560,000
クボタ	29,800	1,929.50	57,499,100
ダイキン工業	6,900	19,615.00	135,343,500
栗田工業	2,900	3,320.00	9,628,000
ダイフク	2,800	11,230.00	31,444,000
タダノ	2,200	863.00	1,898,600
アマノ	1,600	2,448.00	3,916,800
グローリー	1,400	2,241.00	3,137,400
セガサミーホールディングス	5,200	1,307.00	6,796,400
ジェイテクト	5,600	824.00	4,614,400
THK	3,400	2,658.00	9,037,200
マキタ	6,700	4,890.00	32,763,000
コニカミノルタ	12,600	250.00	3,150,000
ブラザー工業	6,600	1,552.00	10,243,200
ミネベアミツミ	10,500	1,958.00	20,559,000
三菱電機	53,100	1,361.50	72,295,650
富士電機	3,700	3,220.00	11,914,000
安川電機	6,500	4,090.00	26,585,000
マブチモーター	1,300	4,255.00	5,531,500
日本電産	12,400	10,240.00	126,976,000
オムロン	5,800	7,840.00	45,472,000
セイコーエプソン	8,200	1,037.00	8,503,400
アルバック	1,100	3,960.00	4,356,000
エレコム	500	4,855.00	2,427,500
パナソニック	64,500	877.00	56,566,500
シャープ	4,900	1,253.00	6,139,700
アンリツ	4,000	2,492.00	9,968,000

富士通ゼネラル	1,600	2,969.00	4,750,400
TDK	3,700	12,290.00	45,473,000
ヒロセ電機	800	14,910.00	11,928,000
日本航空電子工業	1,400	1,516.00	2,122,400
アズビル	3,300	4,385.00	14,470,500
日本光電工業	2,100	3,380.00	7,098,000
堀場製作所	1,000	5,300.00	5,300,000
アドバンテスト	5,800	5,610.00	32,538,000
キーエンス	4,800	49,860.00	239,328,000
シスメックス	3,600	10,235.00	36,846,000
レーザーテック	2,200	9,430.00	20,746,000
スタンレー電気	3,800	3,000.00	11,400,000
ファナック	5,900	20,835.00	122,926,500
浜松ホトニクス	4,200	5,200.00	21,840,000
京セラ	9,300	6,024.00	56,023,200
太陽誘電	3,400	3,860.00	13,124,000
村田製作所	16,400	7,268.00	119,195,200
小糸製作所	2,600	5,130.00	13,338,000
キヤノン	29,900	1,632.00	48,796,800
東京エレクトロン	4,800	29,315.00	140,712,000
トヨタ紡織	1,400	1,512.00	2,116,800
豊田自動織機	4,400	6,700.00	29,480,000
デンソー	13,100	4,836.00	63,351,600
日産自動車	67,900	368.00	24,987,200
いすゞ自動車	15,200	899.10	13,666,320
トヨタ自動車	34,400	6,897.00	237,256,800
日野自動車	7,700	745.00	5,736,500
三菱自動車工業	20,000	212.00	4,240,000
アイシン精機	4,500	3,370.00	15,165,000
マツダ	16,700	603.00	10,070,100
本田技研工業	45,700	2,565.00	117,220,500
スズキ	9,800	4,635.00	45,423,000
SUBARU	17,100	2,027.50	34,670,250
ヤマハ発動機	7,900	1,519.00	12,000,100
デルモ	16,700	4,005.00	66,883,500

島津製作所	6,200	2,989.00	18,531,800
ブイ・テクノロジー	300	4,755.00	1,426,500
東京精密	1,100	3,645.00	4,009,500
トプコン	2,900	1,073.00	3,111,700
オリンパス	32,200	2,064.00	66,460,800
HOYA	11,300	12,370.00	139,781,000
朝日インテック	6,300	3,395.00	21,388,500
バンダイナムコホールディングス	5,700	7,860.00	44,802,000
ヤマハ	3,900	4,845.00	18,895,500
ピジョン	3,300	4,925.00	16,252,500
任天堂	3,300	57,220.00	188,826,000
関西電力	20,400	1,000.50	20,410,200
東北電力	12,900	962.00	12,409,800
九州電力	11,000	929.00	10,219,000
東武鉄道	5,800	2,980.00	17,284,000
東急	13,000	1,238.00	16,094,000
小田急電鉄	8,300	2,484.00	20,617,200
東日本旅客鉄道	8,800	5,887.00	51,805,600
西日本旅客鉄道	4,800	4,697.00	22,545,600
東海旅客鉄道	3,800	13,900.00	52,820,000
日本通運	2,200	5,930.00	13,046,000
九州旅客鉄道	4,500	2,139.00	9,625,500
S Gホールディングス	4,300	5,600.00	24,080,000
日本航空	10,100	1,980.00	19,998,000
ANAホールディングス	8,800	2,373.00	20,882,400
日鉄ソリューションズ	1,000	3,145.00	3,145,000
コーエーテクモホールディングス	1,200	5,210.00	6,252,000
ネクソン	14,400	2,546.00	36,662,400
ブロードリーフ	2,600	548.00	1,424,800
ラクス	1,500	2,432.00	3,648,000
野村総合研究所	9,800	3,135.00	30,723,000
アルテリア・ネットワークス	800	1,797.00	1,437,600
オービック	1,500	18,020.00	27,030,000
Zホールディングス	63,800	770.00	49,126,000
トレンドマイクロ	3,800	6,220.00	23,636,000

日本オラクル	1,000	10,620.00	10,620,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,700	3,850.00	10,395,000
大塚商会	3,100	5,040.00	15,624,000
サイボウズ	600	3,515.00	2,109,000
日本電信電話	77,700	2,204.50	171,289,650
KDDI	47,300	2,725.00	128,892,500
NTTドコモ	34,300	3,885.00	133,255,500
エヌ・ティ・ティ・データ	19,400	1,312.00	25,452,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,600	6,470.00	16,822,000
SCSK	1,500	5,760.00	8,640,000
コナミホールディングス	2,900	4,275.00	12,397,500
双日	26,500	233.00	6,174,500
神戸物産	1,500	5,790.00	8,685,000
第一興商	1,100	3,710.00	4,081,000
日本ライフライン	1,600	1,353.00	2,164,800
伊藤忠商事	38,400	2,602.50	99,936,000
丸紅	45,800	587.40	26,902,920
豊田通商	5,900	2,939.00	17,340,100
住友商事	31,500	1,211.50	38,162,250
三菱商事	37,900	2,471.00	93,650,900
ミスミグループ本社	6,100	2,918.00	17,799,800
ローソン	1,400	5,090.00	7,126,000
エービーシー・マート	900	5,280.00	4,752,000
くら寿司	300	6,410.00	1,923,000
セリア	1,100	4,395.00	4,834,500
ジズホールディングス	300	8,220.00	2,466,000
MonotaRO	3,700	5,900.00	21,830,000
マツモトキョシホールディングス	2,200	4,135.00	9,097,000
ZOZO	5,100	3,115.00	15,886,500
物語コーポレーション	100	11,370.00	1,137,000
ウエルシアホールディングス	2,600	4,435.00	11,531,000
すかいらーくホールディングス	5,800	1,534.00	8,897,200
コスモス薬品	600	18,450.00	11,070,000
セブン&アイ・ホールディングス	21,100	3,540.00	74,694,000
ツルハホールディングス	1,100	14,970.00	16,467,000

トリドールホールディングス	1,300	1,392.00	1,809,600
クスリのアオキホールディングス	500	8,300.00	4,150,000
スシローグローバルホールディングス	2,500	2,850.00	7,125,000
良品計画	7,400	2,219.00	16,420,600
パン・パシフィック・インターナショナルホ	13,600	2,381.00	32,381,600
ゼンショーホールディングス	2,600	2,429.00	6,315,400
スギホールディングス	1,100	7,040.00	7,744,000
日本瓦斯	900	5,060.00	4,554,000
しまむら	600	10,910.00	6,546,000
イオン	17,700	2,830.50	50,099,850
イズミ	900	3,740.00	3,366,000
ヤオコー	400	7,480.00	2,992,000
ニトリホールディングス	2,200	22,415.00	49,313,000
ファーストリテイリング	600	73,150.00	43,890,000
サンドラッグ	2,100	4,120.00	8,652,000
りそなホールディングス	62,300	351.50	21,898,450
SBIホールディングス	7,000	2,563.00	17,941,000
東京センチュリー	1,100	5,570.00	6,127,000
イオンフィナンシャルサービス	3,100	1,086.00	3,366,600
日立キャピタル	1,400	2,327.00	3,257,800
オリックス	39,400	1,320.50	52,027,700
三菱UFJリース	11,300	465.00	5,254,500
ヒューリック	8,300	1,013.00	8,407,900
サムティ	700	1,729.00	1,210,300
オープンハウス	2,000	3,810.00	7,620,000
飯田グループホールディングス	4,200	2,026.00	8,509,200
パーク24	3,200	1,567.00	5,014,400
三井不動産	26,500	1,887.50	50,018,750
イオンモール	2,800	1,655.00	4,634,000
日本空港ビルデング	1,100	4,650.00	5,115,000
ミクシィ	1,300	2,930.00	3,809,000
パーソルホールディングス	5,300	1,815.00	9,619,500
カカクコム	4,000	2,980.00	11,920,000
ディップ	900	2,169.00	1,952,100

	エムスリー	9,400	7,240.00	68,056,000	
	博報堂D Yホールディングス	6,500	1,421.00	9,236,500	
	エスプール	1,500	769.00	1,153,500	
	電通グループ	6,600	3,070.00	20,262,000	
	オリエンタルランド	5,600	14,900.00	83,440,000	
	リゾートトラスト	2,300	1,728.00	3,974,400	
	サイバーエージェント	3,000	6,790.00	20,370,000	
	楽天	24,700	1,122.00	27,713,400	
	エン・ジャパン	900	2,756.00	2,480,400	
	テクノプロ・ホールディングス	1,100	7,170.00	7,887,000	
	リクルートホールディングス	35,700	4,345.00	155,116,500	
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	500	4,295.00	2,147,500	
	リログループ	3,400	2,689.00	9,142,600	
	エイチ・アイ・エス	900	1,651.00	1,485,900	
	カナモト	900	2,318.00	2,086,200	
	セコム	6,300	9,093.00	57,285,900	
	小計 銘柄数：283			7,754,367,050	
	組入時価比率：98.3%			100.0%	
	合計			7,754,367,050	

(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。