



2021年4月期 (2020年10月21日～2021年4月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2021 (October 21, 2020 - April 20, 2021)

2021年6月1日
 June 1, 2021

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 小池 広靖
 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: Hiroyasu Koike, 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7月14日
 分配金支払開始日 2021年5月28日
 Scheduled date of submission of securities report: July 14, 2021
 Date of commencing dividend payment: May 28, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021年4月期の運用状況 (2020年10月21日～2021年4月20日)

Management Status for Year ended April 2021 (from October 21, 2020 to April 20, 2021)

(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.	%
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	8,408	(98.1)	161	(1.9)	8,569	(100.0)
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	7,754	(98.3)	136	(1.7)	7,890	(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
2021 年 4 月期 FY ended Apr. 2021	485	39	78	446
2020 年 10 月期 FY ended Oct. 2020	444	79	39	485

(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
2021 年 4 月期 FY ended Apr. 2021	8,654	84	8,569	19,173
2020 年 10 月期 FY ended Oct. 2020	7,956	65	7,890	16,256

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2021 年 4 月期 FY ended Apr. 2021	152
2020 年 10 月期 FY ended Oct. 2020	110

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 9 期 (2020 年 10 月 20 日現在) 9th Fiscal Year As of October 20, 2020	第 10 期 (2021 年 4 月 20 日現在) 10th Fiscal Year As of April 20, 2021
	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	137,554,572	171,865,212
株式 Stocks	7,754,367,050	8,408,339,030
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	2,034,390	1,249,500
未収入金 Accounts receivable - other	1,338,239	774,900
未収配当金 Accrued dividends receivable	55,977,436	66,389,480
差入委託証拠金 Margin deposits	5,109,251	6,060,540
流動資産合計 Total current assets	7,956,380,938	8,654,678,662
資産合計 Total assets	7,956,380,938	8,654,678,662
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	990,771	1,395,520
未払収益分配金 Unpaid dividends	53,395,980	67,940,504
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,818,879	2,229,951
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	6,547,896	8,027,772
未払利息 Accrued interest expenses	109	86
その他未払費用 Other accrued expenses	2,648,487	5,377,682
流動負債合計 Total current liabilities	65,402,122	84,971,515
負債合計 Total liabilities	65,402,122	84,971,515
純資産の部 Net assets		

元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,238,106,718	5,744,101,427
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,652,872,098	2,825,605,720
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	404,696	198,671
元本等合計 Total principal and other	7,890,978,816	8,569,707,147
純資産合計 Total net assets	7,890,978,816	8,569,707,147
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	7,956,380,938	8,654,678,662

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	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	第10期 自 2020年10月21日 至 2021年4月20日 10th Fiscal Year From October 21, 2020 to April 20, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	64,528,508	81,099,032
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	884,836,978	1,291,290,694
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	24,131,867	26,119,078
その他収益 Other revenue	80,112	20,211
営業収益合計 Total operating revenue	973,577,465	1,398,529,015
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	31,692	16,662
受託者報酬 Trustee fees	1,818,879	2,229,951
委託者報酬 Investment trust management fees	6,547,896	8,027,772
その他費用 Other expenses	2,566,495	3,110,379
営業費用合計 Total operating expenses	10,964,962	13,384,764
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	962,612,503	1,385,144,251
経常利益又は経常損失 (△)	962,612,503	1,385,144,251

Ordinary profit (loss)		
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	962,612,503	1,385,144,251
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	575,416,691	1,652,872,098
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	290,541,138	262,437,021
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	262,437,021
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	122,302,254	406,907,146
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	406,907,146
分配金 Dividends	53,395,980	67,940,504
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,652,872,098	2,825,605,720

(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10月21日から2021年4月20日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第 9 期 2020 年 10 月 20 日現在	第 10 期 2021 年 4 月 20 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 485,418 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 446,977 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 16,256 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 19,173 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 9 期 自 2020 年 4 月 21 日 至 2020 年 10 月 20 日	第 10 期 自 2020 年 10 月 21 日 至 2021 年 4 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>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	<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>81,102,581 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>404,696 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>81,507,277 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>13,368,102 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>68,139,175 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>67,940,504 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>198,671 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>446,977 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>152 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	81,102,581 円	分配準備積立金	B	404,696 円	配当等収益合計額	C=A+B	81,507,277 円	経費	D	13,368,102 円	収益分配可能額	E=C-D	68,139,175 円	収益分配金	F	67,940,504 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	198,671 円	口数	H	446,977 口	1 口当たり分配金	I=F/H	152 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																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	81,102,581 円																																																											
分配準備積立金	B	404,696 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	81,507,277 円																																																											
経費	D	13,368,102 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	68,139,175 円																																																											
収益分配金	F	67,940,504 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	198,671 円																																																											
口数	H	446,977 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	152 円																																																											
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。	2. その他費用 その他費用のうち 2,675,885 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 9 期 自 2020 年 4 月 21 日 至 2020 年 10 月 20 日	第 10 期 自 2020 年 10 月 21 日 至 2021 年 4 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9期 2020年10月20日現在	第10期 2021年4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ん。	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 株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2. 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2020年4月21日 至2020年10月20日	第10期 自2020年10月21日 至2021年4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9期 自2020年4月21日 至2020年10月20日	第10期 自2020年10月21日 至2021年4月20日
期首元本額 5,713,824,471円	期首元本額 6,238,106,718円
期中追加設定元本額 1,027,604,513円	期中追加設定元本額 513,564,513円
期中一部交換元本額 503,322,266円	期中一部交換元本額 1,007,569,804円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第9期 自2020年4月21日 至2020年10月20日	第10期 自2020年10月21日 至2021年4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	708,720,964	1,144,787,751
合計	708,720,964	1,144,787,751

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9期(2020年10月20日現在)			第10期(2021年4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	133,780,751	—	134,833,500	1,043,619	160,077,890	—	159,941,000	△146,020
合計	133,780,751	—	134,833,500	1,043,619	160,077,890	—	159,941,000	△146,020

(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(2021年4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	5,400	4,175.00	22,545,000	
		清水建設	14,900	899.00	13,395,100	
		長谷工コーポレーション	7,200	1,565.00	11,268,000	
		鹿島建設	12,200	1,535.00	18,727,000	
		大東建託	1,900	12,010.00	22,819,000	
		大和ハウス工業	14,300	3,260.00	46,618,000	
		積水ハウス	15,400	2,308.50	35,550,900	
		協和エクシオ	2,300	2,902.00	6,674,600	
		日清製粉グループ本社	4,900	1,753.00	8,589,700	
		寿スピリッツ	500	6,340.00	3,170,000	
		森永乳業	900	5,830.00	5,247,000	
		ヤクルト本社	3,100	5,270.00	16,337,000	
		明治ホールディングス	3,200	6,800.00	21,760,000	
		アサヒグループホールディングス	9,700	4,549.00	44,125,300	
		キリンホールディングス	22,200	2,053.50	45,587,700	
		サントリー食品インターナショナル	3,500	3,760.00	13,160,000	
		キッコーマン	3,900	6,320.00	24,648,000	
		味の素	12,200	2,170.50	26,480,100	
		キューピー	2,600	2,565.00	6,669,000	
		ニチレイ	2,600	2,743.00	7,131,800	
日本たばこ産業	30,700	2,077.00	63,763,900			
帝人	4,900	1,830.00	8,967,000			
東レ	37,400	689.60	25,791,040			

ゴールドウイン	600	6,840.00	4,104,000
クラレ	8,600	1,216.00	10,457,600
旭化成	31,400	1,220.00	38,308,000
昭和電工	3,700	3,345.00	12,376,500
住友化学	38,400	576.00	22,118,400
日産化学	3,100	5,940.00	18,414,000
東ソー	6,700	2,102.00	14,083,400
トクヤマ	1,600	2,818.00	4,508,800
デンカ	2,100	4,445.00	9,334,500
信越化学工業	9,900	19,035.00	188,446,500
エア・ウォーター	3,900	1,834.00	7,152,600
カネカ	1,300	4,470.00	5,811,000
三菱瓦斯化学	4,400	2,647.00	11,646,800
三井化学	4,800	3,590.00	17,232,000
J S R	5,100	3,455.00	17,620,500
ダイセル	7,100	866.00	6,148,600
積水化学工業	9,900	2,104.00	20,829,600
日本ゼオン	3,300	1,675.00	5,527,500
アイカ工業	1,300	3,945.00	5,128,500
トリケミカル研究所	700	3,780.00	2,646,000
花王	13,100	7,115.00	93,206,500
日本ペイントホールディングス	17,800	1,609.00	28,640,200
D I C	1,900	2,882.00	5,475,800
資生堂	10,500	7,754.00	81,417,000
ライオン	5,900	2,105.00	12,419,500
マンダム	1,100	2,099.00	2,308,900
ファンケル	2,100	3,580.00	7,518,000
コーセー	900	15,960.00	14,364,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,400	2,509.00	6,021,600
小林製薬	1,400	9,860.00	13,804,000
日東電工	4,500	9,510.00	42,795,000
ニフコ	2,300	3,905.00	8,981,500
ユニ・チャーム	9,900	4,400.00	43,560,000
武田薬品工業	36,300	3,674.00	133,366,200
アステラス製薬	49,400	1,653.50	81,682,900

大日本住友製薬	3,700	1,846.00	6,830,200
塩野義製薬	7,400	5,646.00	41,780,400
日本新薬	1,200	7,770.00	9,324,000
中外製薬	17,000	4,255.00	72,335,000
エーザイ	6,900	7,345.00	50,680,500
小野薬品工業	10,300	2,880.00	29,664,000
参天製薬	10,000	1,462.00	14,620,000
JCRファーマ	1,700	2,982.00	5,069,400
第一三共	46,600	2,921.50	136,141,900
大塚ホールディングス	11,300	4,277.00	48,330,100
出光興産	5,200	2,665.00	13,858,000
Eneosホールディングス	90,200	477.00	43,025,400
横浜ゴム	2,700	2,079.00	5,613,300
TOYO TIRE	3,000	2,063.00	6,189,000
ブリヂストン	15,900	4,406.00	70,055,400
住友ゴム工業	4,300	1,348.00	5,796,400
AGC	5,000	4,955.00	24,775,000
太平洋セメント	3,400	2,848.00	9,683,200
東海カーボン	4,800	1,758.00	8,438,400
TOTO	3,800	6,200.00	23,560,000
日本碍子	6,900	1,979.00	13,655,100
日本特殊陶業	4,100	1,886.00	7,732,600
ニチアス	1,300	2,824.00	3,671,200
神戸製鋼所	8,600	760.00	6,536,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	13,100	1,410.00	18,471,000
日本軽金属ホールディングス	1,500	2,151.00	3,226,500
古河電気工業	1,700	2,946.00	5,008,200
住友電気工業	20,000	1,672.50	33,450,000
SUMCO	6,800	2,844.00	19,339,200
三和ホールディングス	5,000	1,399.00	6,995,000
日本発條	4,500	814.00	3,663,000
三浦工業	2,200	5,810.00	12,782,000
オークマ	600	6,190.00	3,714,000
アマダ	9,100	1,177.00	10,710,700
FUJI	1,700	2,925.00	4,972,500

オーエスジー	2,200	1,911.00	4,204,200
DMG 森精機	3,100	1,785.00	5,533,500
ディスコ	800	37,400.00	29,920,000
ナブテスコ	3,100	5,130.00	15,903,000
SMC	1,700	65,900.00	112,030,000
小松製作所	24,100	3,245.00	78,204,500
住友重機械工業	3,000	3,165.00	9,495,000
日立建機	3,000	3,345.00	10,035,000
ローツェ	200	9,150.00	1,830,000
クボタ	27,900	2,551.50	71,186,850
ダイキン工業	6,400	22,010.00	140,864,000
栗田工業	2,700	5,030.00	13,581,000
ダイフク	2,600	10,880.00	28,288,000
タダノ	2,000	1,177.00	2,354,000
アマノ	1,500	2,726.00	4,089,000
グローリー	1,300	2,384.00	3,099,200
セガサミーホールディングス	4,900	1,609.00	7,884,100
ジェイテクト	5,200	1,067.00	5,548,400
THK	3,200	3,810.00	12,192,000
マキタ	6,200	5,220.00	32,364,000
コニカミノルタ	11,800	605.00	7,139,000
ブラザー工業	6,200	2,402.00	14,892,400
ミネベアミツミ	9,800	2,791.00	27,351,800
三菱電機	49,500	1,661.00	82,219,500
富士電機	3,500	4,855.00	16,992,500
安川電機	6,100	5,240.00	31,964,000
マブチモーター	1,200	4,635.00	5,562,000
日本電産	11,600	13,630.00	158,108,000
オムロン	5,400	8,710.00	47,034,000
セイコーエプソン	7,600	1,911.00	14,523,600
アルバック	1,000	5,100.00	5,100,000
エレコム	900	2,407.00	2,166,300
パナソニック	60,100	1,366.00	82,096,600
シャープ	4,600	1,865.00	8,579,000
アンリツ	3,700	2,432.00	8,998,400

富士通ゼネラル	1,500	2,949.00	4,423,500
TDK	3,500	15,440.00	54,040,000
ヒロセ電機	800	17,290.00	13,832,000
日本航空電子工業	1,300	1,727.00	2,245,100
アズビル	3,000	4,425.00	13,275,000
日本光電工業	2,000	3,240.00	6,480,000
堀場製作所	900	7,450.00	6,705,000
アドバンテスト	5,400	10,300.00	55,620,000
キーエンス	4,500	50,590.00	227,655,000
シスメックス	3,400	11,295.00	38,403,000
レーザーテック	2,000	18,780.00	37,560,000
スタンレー電気	3,500	3,270.00	11,445,000
ファナック	5,600	26,740.00	149,744,000
浜松ホトニクス	3,900	6,490.00	25,311,000
京セラ	8,600	7,055.00	60,673,000
太陽誘電	3,100	5,100.00	15,810,000
村田製作所	15,300	8,945.00	136,858,500
小糸製作所	2,500	7,110.00	17,775,000
キヤノン	27,900	2,555.00	71,284,500
東京エレクトロン	4,500	48,900.00	220,050,000
トヨタ紡織	1,300	1,860.00	2,418,000
豊田自動織機	4,100	9,430.00	38,663,000
デンソー	12,200	7,130.00	86,986,000
日産自動車	63,400	557.20	35,326,480
いすゞ自動車	14,200	1,136.00	16,131,200
トヨタ自動車	32,100	8,418.00	270,217,800
日野自動車	7,100	897.00	6,368,700
三菱自動車工業	18,600	297.00	5,524,200
アイシン	4,200	3,965.00	16,653,000
マツダ	15,600	860.00	13,416,000
本田技研工業	42,700	3,274.00	139,799,800
スズキ	9,100	4,566.00	41,550,600
SUBARU	16,000	2,089.50	33,432,000
ヤマハ発動機	7,400	2,777.00	20,549,800
デルモ	15,600	4,083.00	63,694,800

島津製作所	5,800	4,045.00	23,461,000
ブイ・テクノロジー	200	5,700.00	1,140,000
東京精密	1,100	5,440.00	5,984,000
トプコン	2,700	1,480.00	3,996,000
オリンパス	30,100	2,261.00	68,056,100
HOYA	10,500	13,370.00	140,385,000
朝日インテック	5,900	3,035.00	17,906,500
バンダイナムコホールディングス	5,400	8,140.00	43,956,000
ヤマハ	3,700	6,130.00	22,681,000
ピジョン	3,100	3,945.00	12,229,500
任天堂	3,100	63,070.00	195,517,000
関西電力	19,000	1,069.00	20,311,000
東北電力	12,000	1,004.00	12,048,000
九州電力	10,300	990.00	10,197,000
東武鉄道	5,400	2,787.00	15,049,800
東急	12,200	1,354.00	16,518,800
小田急電鉄	7,800	2,850.00	22,230,000
東日本旅客鉄道	8,200	7,314.00	59,974,800
西日本旅客鉄道	4,500	5,592.00	25,164,000
東海旅客鉄道	3,600	15,410.00	55,476,000
日本通運	2,000	7,930.00	15,860,000
九州旅客鉄道	4,200	2,312.00	9,710,400
S Gホールディングス	8,100	2,565.00	20,776,500
日本航空	9,400	2,136.00	20,078,400
ANAホールディングス	8,300	2,315.50	19,218,650
日鉄ソリューションズ	900	3,600.00	3,240,000
コーエーテクモホールディングス	1,500	5,110.00	7,665,000
ネクソン	13,500	3,570.00	48,195,000
ブロードリーフ	2,400	548.00	1,315,200
ラクス	1,400	2,368.00	3,315,200
野村総合研究所	9,100	3,350.00	30,485,000
アルテリア・ネットワークス	700	1,575.00	1,102,500
オービック	1,400	20,070.00	28,098,000
Zホールディングス	59,500	561.90	33,433,050
トレンドマイクロ	3,500	5,330.00	18,655,000

日本オラクル	900	10,340.00	9,306,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,500	3,660.00	9,150,000
大塚商会	2,900	5,210.00	15,109,000
サイボウズ	600	2,540.00	1,524,000
日本電信電話	72,500	2,803.00	203,217,500
KDDI	44,100	3,367.00	148,484,700
エヌ・ティ・ティ・データ	18,100	1,683.00	30,462,300
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,500	6,460.00	16,150,000
SCSK	1,400	6,660.00	9,324,000
コナミホールディングス	2,700	6,520.00	17,604,000
双日	24,700	306.00	7,558,200
神戸物産	2,900	3,060.00	8,874,000
第一興商	1,000	4,325.00	4,325,000
日本ライフライン	1,500	1,500.00	2,250,000
伊藤忠商事	35,800	3,434.00	122,937,200
丸紅	42,700	900.60	38,455,620
豊田通商	5,500	4,730.00	26,015,000
住友商事	29,400	1,518.50	44,643,900
三菱商事	35,300	3,012.00	106,323,600
ミスミグループ本社	5,700	3,100.00	17,670,000
ローソン	1,300	5,270.00	6,851,000
エービーシー・マート	800	5,850.00	4,680,000
くら寿司	300	7,580.00	2,274,000
セリア	1,000	4,070.00	4,070,000
ジズホールディングス	300	8,010.00	2,403,000
MonotaRO	6,900	2,847.00	19,644,300
マツモトキヨシホールディングス	2,000	4,480.00	8,960,000
ZOZO	4,700	3,500.00	16,450,000
物語コーポレーション	300	7,270.00	2,181,000
ウエルシアホールディングス	2,500	3,585.00	8,962,500
すかいらーくホールディングス	5,400	1,635.00	8,829,000
コスモス薬品	500	16,090.00	8,045,000
セブン&アイ・ホールディングス	19,700	4,556.00	89,753,200
ツルハホールディングス	1,000	13,130.00	13,130,000
トリドールホールディングス	1,200	1,677.00	2,012,400

クスリのアオキホールディングス	400	8,310.00	3,324,000
FOOD & LIFE COMP ANIE	2,400	5,030.00	12,072,000
良品計画	6,900	2,324.00	16,035,600
パン・パシフィック・インターナシ ョナルホ	12,700	2,420.00	30,734,000
ゼンショーホールディングス	2,500	2,828.00	7,070,000
スギホールディングス	1,000	8,510.00	8,510,000
日本瓦斯	2,500	1,875.00	4,687,500
しまむら	600	10,880.00	6,528,000
イオン	16,500	3,091.00	51,001,500
イズミ	800	4,495.00	3,596,000
ヤオコー	400	7,140.00	2,856,000
ニトリホールディングス	2,000	20,115.00	40,230,000
ファーストリテイリング	600	87,400.00	52,440,000
サンドラッグ	1,900	3,825.00	7,267,500
りそなホールディングス	58,100	452.40	26,284,440
SBIホールディングス	6,500	3,075.00	19,987,500
東京センチュリー	1,100	6,990.00	7,689,000
イオンフィナンシャルサービス	2,900	1,228.00	3,561,200
オリックス	36,800	1,781.00	65,540,800
三菱HCキャピタル	17,200	625.00	10,750,000
ヒューリック	7,700	1,295.00	9,971,500
サムティ	600	1,962.00	1,177,200
オープンハウス	1,800	4,870.00	8,766,000
飯田グループホールディングス	3,900	2,749.00	10,721,100
パーク24	3,000	1,910.00	5,730,000
三井不動産	24,700	2,389.00	59,008,300
イオンモール	2,700	1,733.00	4,679,100
日本空港ビルデング	1,000	4,740.00	4,740,000
ミクシィ	1,200	2,778.00	3,333,600
パーソルホールディングス	4,900	2,070.00	10,143,000
カカクコム	3,800	3,020.00	11,476,000
ディップ	900	3,150.00	2,835,000
エムスリー	8,800	8,186.00	72,036,800
博報堂DYホールディングス	6,100	1,836.00	11,199,600

	エスプール	1,400	927.00	1,297,800	
	電通グループ	6,200	3,320.00	20,584,000	
	オリエンタルランド	5,200	15,430.00	80,236,000	
	リゾートトラスト	2,100	1,721.00	3,614,100	
	サイバーエージェント	11,300	1,999.00	22,588,700	
	楽天グループ	23,100	1,333.00	30,792,300	
	エン・ジャパン	800	3,320.00	2,656,000	
	テクノプロ・ホールディングス	1,000	8,630.00	8,630,000	
	リクルートホールディングス	33,300	5,008.00	166,766,400	
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,000	2,250.00	2,250,000	
	リログループ	3,200	2,244.00	7,180,800	
	エイチ・アイ・エス	900	2,102.00	1,891,800	
	カナモト	800	2,804.00	2,243,200	
	セコム	5,900	9,006.00	53,135,400	
	小計 銘柄数：281			8,408,339,030	
	組入時価比率：98.1%			100.0%	
	合計			8,408,339,030	

(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(2021年4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。