



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

2020年11月18日
 November 18, 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12月16日
 分配金支払開始日 2020年11月13日
 Scheduled date of submission of securities report: December 16, 2020
 Date of commencing dividend payment: November 13, 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8日～2020年10月7日)

Management Status for Year ended October 2020 (from April 8, 2020 to October 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10月期 FY ended Oct. 2020	2,389	(96.6)	83	(3.4)	2,472	(100.0)
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	2,136	(96.8)	70	(3.2)	2,206	(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	154	0	0	154
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	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10月期 FY ended Oct. 2020	2,505	32	2,472	16,053
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	2,251	44	2,206	14,327

(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	175
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	240

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13期 (2020年4月7日現在) 13th Fiscal Year As of April 7, 2020	第14期 (2020年10月7日現在) 14th Fiscal Year As of October 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	45,722,130	79,681,091
株式 Stocks	2,136,386,770	2,389,527,290
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	1,405,320	1,526,080
未収入金 Accounts receivable - other	22,578,721	758,780
未収配当金 Accrued dividends receivable	38,637,280	30,514,364
差入委託証拠金 Customers' margin	6,645,750	3,048,099
流動資産合計 Total current assets	2,251,375,971	2,505,055,704
資産合計 Total assets	2,251,375,971	2,505,055,704
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	499,950	262,479
未払収益分配金 Unpaid dividends	36,966,720	26,954,900
未払受託者報酬 Trustee fee payable	731,898	655,002
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	3,659,404	3,274,924
未払利息 Accrued interest expenses	41	33
その他未払費用 Other accrued expenses	2,719,699	1,300,130
流動負債合計 Total current liabilities	44,577,712	32,447,468
負債合計 Total liabilities	44,577,712	32,447,468
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	153,759,047	419,569,024
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	124,542	136,742
元本等合計 Total principal and other	2,206,798,259	2,472,608,236
純資産合計 Total net assets	2,206,798,259	2,472,608,236
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	2,251,375,971	2,505,055,704

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	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	第14期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日 14th Fiscal Year From April 8, 2020 to October 7, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	42,869,752	32,203,134
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△382,938,736	254,059,226
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△6,221,051	11,738,551
その他収益 Other revenue	24,036	24,800
営業収益合計 Total operating revenue	△346,265,999	298,025,711
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	9,930	12,686
受託者報酬 Trustee fee	731,898	655,002
委託者報酬 Investment trust management fee	3,659,404	3,274,924
その他費用 Other expenses	1,463,244	1,318,222
営業費用合計 Total operating expenses	5,864,476	5,260,834
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△352,130,475	292,764,877
経常利益又は経常損失 (△)	△352,130,475	292,764,877

Ordinary profit (loss)		
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△352,130,475	292,764,877
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	542,856,242	153,759,047
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	36,966,720	26,954,900
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	153,759,047	419,569,024

(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 8 日から 2020 年 10 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 13 期 2020 年 4 月 7 日現在	第 14 期 2020 年 10 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 14,327 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 16,053 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 13 期 自 2019 年 10 月 8 日 至 2020 年 4 月 7 日	第 14 期 自 2020 年 4 月 8 日 至 2020 年 10 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	42,883,858円	当期配当等収益額	A	32,215,248円
分配準備積立金	B	61,950円	分配準備積立金	B	124,542円
配当等収益合計額	C=A+B	42,945,808円	配当等収益合計額	C=A+B	32,339,790円
経費	D	5,854,546円	経費	D	5,248,148円
収益分配可能額	E=C-D	37,091,262円	収益分配可能額	E=C-D	27,091,642円
収益分配金	F	36,966,720円	収益分配金	F	26,954,900円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	124,542円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	136,742円
口数	H	154,028口	口数	H	154,028口
1口当たり分配金	I=F/H	240円	1口当たり分配金	I=F/H	175円

<p>2. その他費用</p> <p>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。</p>	<p>2. その他費用</p> <p>その他費用のうち1,177,661円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>
---	---

(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13期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日	第14期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第13期 2020年4月7日現在	第14期 2020年10月7日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>株式</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

<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。</p> <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	
--	--

(関連当事者との取引に関する注記)

<p>第13期 自2019年10月8日 至2020年4月7日</p>	<p>第14期 自2020年4月8日 至2020年10月7日</p>
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

<p>第13期 自2019年10月8日 至2020年4月7日</p>	<p>第14期 自2020年4月8日 至2020年10月7日</p>
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13期 自2019年10月8日 至2020年4月7日	第14期 自2020年4月8日 至2020年10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	△396,497,148	251,972,271
合計	△396,497,148	251,972,271

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13期(2020年4月7日現在)				第14期(2020年10月7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)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	67,225,350	—	68,136,000	905,370	81,080,899	—	82,350,000	1,263,601
合計	67,225,350	—	68,136,000	905,370	81,080,899	—	82,350,000	1,263,601

(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	446.00	981,200	
		マルハニチロ	400	2,345.00	938,000	
		国際石油開発帝石	6,600	580.00	3,828,000	
		石油資源開発	400	1,743.00	697,200	
		ミライト・ホールディングス	500	1,600.00	800,000	
		安藤・間	1,000	743.00	743,000	
		コムシスホールディングス	500	2,886.00	1,443,000	
		大成建設	1,300	3,640.00	4,732,000	
		大林組	4,800	956.00	4,588,800	
		清水建設	3,200	791.00	2,531,200	
		長谷工コーポレーション	2,200	1,397.00	3,073,400	
		鹿島建設	3,100	1,261.00	3,909,100	
		西松建設	400	2,100.00	840,000	
		三井住友建設	1,300	449.00	583,700	
		前田建設工業	800	779.00	623,200	
		奥村組	200	2,652.00	530,400	
		戸田建設	1,300	715.00	929,500	
		熊谷組	200	2,664.00	532,800	
		大東建託	500	9,357.00	4,678,500	
		N I P P O	400	2,898.00	1,159,200	
		前田道路	400	1,872.00	748,800	
		五洋建設	1,700	674.00	1,145,800	
		住友林業	1,200	1,715.00	2,058,000	
		大和ハウス工業	3,200	2,925.50	9,361,600	
		積水ハウス	3,400	1,859.50	6,322,300	
		関電工	700	856.00	599,200	
		きんでん	900	1,809.00	1,628,100	
		協和エクシオ	400	2,727.00	1,090,800	
九電工	200	3,030.00	606,000			
日揮ホールディングス	1,500	1,034.00	1,551,000			
日本製粉	400	1,735.00	694,000			

日清製粉グループ本社	800	1,701.00	1,360,800
森永製菓	100	4,200.00	420,000
江崎グリコ	200	4,710.00	942,000
山崎製パン	800	1,834.00	1,467,200
カルビー	300	3,435.00	1,030,500
森永乳業	300	5,430.00	1,629,000
ヤクルト本社	300	5,480.00	1,644,000
明治ホールディングス	600	7,860.00	4,716,000
雪印メグミルク	400	2,525.00	1,010,000
プリマハム	200	3,105.00	621,000
日本ハム	800	4,510.00	3,608,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,600	747.00	1,195,200
サッポロホールディングス	400	1,900.00	760,000
アサヒグループホールディングス	1,100	3,740.00	4,114,000
キリンホールディングス	4,200	1,980.00	8,316,000
宝ホールディングス	600	1,115.00	669,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	900	1,744.00	1,569,600
サントリー食品インターナショナル	600	3,935.00	2,361,000
伊藤園	200	7,370.00	1,474,000
日清オイリオグループ	200	3,180.00	636,000
不二製油グループ本社	200	3,465.00	693,000
キッコーマン	400	5,490.00	2,196,000
味の素	2,600	2,142.00	5,569,200
キューピー	700	2,299.00	1,609,300
ハウス食品グループ本社	200	3,640.00	728,000
カゴメ	300	3,595.00	1,078,500
ニチレイ	600	2,744.00	1,646,400
東洋水産	400	5,500.00	2,200,000
日清食品ホールディングス	200	9,660.00	1,932,000
日本たばこ産業	6,500	1,991.50	12,944,750
東洋紡	700	1,492.00	1,044,400
帝人	1,500	1,700.00	2,550,000
東レ	8,600	498.80	4,289,680
ワコールホールディングス	300	1,987.00	596,100
オンワードホールディングス	1,200	266.00	319,200

王子ホールディングス	7,200	491.00	3,535,200
日本製紙	1,100	1,313.00	1,444,300
北越コーポレーション	1,100	379.00	416,900
大王製紙	500	1,534.00	767,000
レンゴー	1,400	817.00	1,143,800
クラレ	2,600	1,061.00	2,758,600
旭化成	7,500	939.40	7,045,500
昭和電工	1,100	2,018.00	2,219,800
住友化学	16,200	364.00	5,896,800
日産化学	400	5,500.00	2,200,000
クレハ	100	4,745.00	474,500
日本曹達	200	3,000.00	600,000
東ソー	2,300	1,746.00	4,015,800
トクヤマ	500	2,577.00	1,288,500
セントラル硝子	300	2,260.00	678,000
東亜合成	600	1,117.00	670,200
デンカ	600	3,220.00	1,932,000
信越化学工業	1,000	13,840.00	13,840,000
エア・ウォーター	800	1,506.00	1,204,800
日本酸素ホールディングス	400	1,674.00	669,600
日本触媒	200	6,040.00	1,208,000
カネカ	500	3,200.00	1,600,000
三菱瓦斯化学	1,800	2,007.00	3,612,600
三井化学	1,700	2,616.00	4,447,200
J S R	1,300	2,513.00	3,266,900
東京応化工業	200	5,470.00	1,094,000
三菱ケミカルホールディングス	16,100	627.20	10,097,920
ダイセル	3,000	806.00	2,418,000
住友ベークライト	200	2,912.00	582,400
積水化学工業	2,600	1,759.00	4,573,400
日本ゼオン	700	1,138.00	796,600
アイカ工業	200	3,700.00	740,000
宇部興産	1,200	1,835.00	2,202,000
日本化薬	800	923.00	738,400
ADEKA	600	1,500.00	900,000

日油	300	4,080.00	1,224,000
花王	1,300	7,772.00	10,103,600
日本ペイントホールディングス	300	10,650.00	3,195,000
関西ペイント	500	2,585.00	1,292,500
D I C	700	2,654.00	1,857,800
東洋インキS Cホールディングス	300	2,020.00	606,000
富士フイルムホールディングス	2,500	5,106.00	12,765,000
資生堂	400	6,455.00	2,582,000
ライオン	600	2,095.00	1,257,000
ポーラ・オルビスホールディングス	300	2,000.00	600,000
小林製薬	100	10,320.00	1,032,000
日東電工	1,300	7,050.00	9,165,000
ニフコ	500	2,995.00	1,497,500
ユニ・チャーム	800	4,665.00	3,732,000
協和キリン	700	2,788.00	1,951,600
武田薬品工業	3,500	3,667.00	12,834,500
アステラス製薬	10,400	1,505.00	15,652,000
大日本住友製薬	500	1,348.00	674,000
塩野義製薬	800	5,424.00	4,339,200
中外製薬	700	4,613.00	3,229,100
科研製薬	100	4,670.00	467,000
エーザイ	900	9,450.00	8,505,000
ロート製薬	200	3,460.00	692,000
小野薬品工業	1,100	3,197.00	3,516,700
久光製薬	200	5,300.00	1,060,000
参天製薬	1,000	2,099.00	2,099,000
ツムラ	200	3,335.00	667,000
沢井製薬	200	5,150.00	1,030,000
第一三共	3,000	2,985.00	8,955,000
キョーリン製薬ホールディングス	400	2,160.00	864,000
大塚ホールディングス	1,700	4,307.00	7,321,900
大正製薬ホールディングス	100	6,870.00	687,000
出光興産	1,900	2,258.00	4,290,200
E N E O Sホールディングス	55,000	385.00	21,175,000
コスモエネルギーホールディングス	1,100	1,593.00	1,752,300

横浜ゴム	800	1,550.00	1,240,000
TOYO TIRE	800	1,766.00	1,412,800
ブリヂストン	4,500	3,477.00	15,646,500
住友ゴム工業	2,000	1,018.00	2,036,000
AGC	1,900	3,195.00	6,070,500
日本板硝子	1,700	402.00	683,400
日本電気硝子	800	1,990.00	1,592,000
住友大阪セメント	300	3,470.00	1,041,000
太平洋セメント	1,300	2,793.00	3,630,900
東海カーボン	600	1,184.00	710,400
TOTO	600	4,860.00	2,916,000
日本碍子	1,500	1,523.00	2,284,500
日本特殊陶業	1,000	1,931.00	1,931,000
ニチアス	400	2,476.00	990,400
日本製鉄	13,300	1,072.00	14,257,600
神戸製鋼所	8,600	426.00	3,663,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	8,000	782.00	6,256,000
東京製鐵	700	725.00	507,500
大和工業	200	2,593.00	518,600
丸一鋼管	200	2,657.00	531,400
大同特殊鋼	200	3,440.00	688,000
日立金属	1,800	1,652.00	2,973,600
日本軽金属ホールディングス	700	1,700.00	1,190,000
三井金属鉱業	600	2,528.00	1,516,800
三菱マテリアル	1,400	2,054.00	2,875,600
住友金属鉱山	1,300	3,270.00	4,251,000
DOWAホールディングス	400	3,125.00	1,250,000
UACJ	400	1,710.00	684,000
古河電気工業	700	2,547.00	1,782,900
住友電気工業	8,400	1,230.50	10,336,200
フジクラ	3,900	300.00	1,170,000
リョービ	300	1,193.00	357,900
SUMCO	1,200	1,509.00	1,810,800
東洋製罐グループホールディングス	1,500	1,040.00	1,560,000
三和ホールディングス	1,000	1,165.00	1,165,000

L I X I Lグループ	2,500	2,190.00	5,475,000
リンナイ	200	10,360.00	2,072,000
東プレ	400	1,178.00	471,200
日本発條	2,200	705.00	1,551,000
日本製鋼所	300	2,005.00	601,500
オークマ	100	5,190.00	519,000
アマダ	2,100	1,023.00	2,148,300
牧野フライス製作所	200	3,800.00	760,000
オーエスジー	400	1,764.00	705,600
DMG森精機	1,200	1,514.00	1,816,800
ディスコ	100	26,880.00	2,688,000
ナブテスコ	400	3,955.00	1,582,000
SMC	100	57,900.00	5,790,000
小松製作所	4,800	2,450.50	11,762,400
住友重機械工業	800	2,521.00	2,016,800
日立建機	800	3,790.00	3,032,000
クボタ	4,700	1,976.50	9,289,550
荏原製作所	600	2,981.00	1,788,600
ダイキン工業	600	18,620.00	11,172,000
栗田工業	500	3,350.00	1,675,000
椿本チエイン	200	2,466.00	493,200
ダイフク	200	10,740.00	2,148,000
フジテック	500	2,433.00	1,216,500
平和	300	1,766.00	529,800
SANKYO	300	2,760.00	828,000
アマノ	200	2,599.00	519,800
グローリー	400	2,365.00	946,000
セガサミーホールディングス	1,000	1,279.00	1,279,000
T P R	300	1,338.00	401,400
ホシザキ	100	8,860.00	886,000
日本精工	3,500	859.00	3,006,500
N T N	4,700	211.00	991,700
ジェイテクト	2,300	881.00	2,026,300
THK	600	2,712.00	1,627,200
マキタ	800	5,040.00	4,032,000

日立造船	1,900	431.00	818,900
三菱重工業	2,600	2,342.00	6,089,200
I H I	1,100	1,467.00	1,613,700
日清紡ホールディングス	1,900	722.00	1,371,800
イビデン	700	3,650.00	2,555,000
コニカミノルタ	4,900	301.00	1,474,900
ブラザー工業	1,700	1,722.00	2,927,400
ミネベアミツミ	1,700	2,017.00	3,428,900
日立製作所	8,200	3,676.00	30,143,200
東芝	2,900	2,793.00	8,099,700
三菱電機	11,500	1,442.00	16,583,000
富士電機	700	3,315.00	2,320,500
安川電機	500	4,220.00	2,110,000
マブチモーター	300	4,185.00	1,255,500
日本電産	700	10,290.00	7,203,000
JVCケンウッド	2,000	152.00	304,000
オムロン	900	8,080.00	7,272,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	700	1,877.00	1,313,900
日本電気	1,400	6,020.00	8,428,000
富士通	1,300	14,045.00	18,258,500
沖電気工業	800	1,164.00	931,200
ルネサスエレクトロニクス	2,800	834.00	2,335,200
セイコーエプソン	2,600	1,202.00	3,125,200
アルバック	200	3,895.00	779,000
ジャパンディスプレイ	15,300	52.00	795,600
パナソニック	22,800	912.70	20,809,560
シャープ	1,200	1,321.00	1,585,200
アンリツ	300	2,464.00	739,200
ソニー	4,600	7,770.00	35,742,000
TDK	600	11,710.00	7,026,000
アルプスアルパイン	1,700	1,527.00	2,595,900
フォスター電機	400	1,218.00	487,200
ホシデン	600	944.00	566,400
ヒロセ電機	100	14,680.00	1,468,000
日本航空電子工業	400	1,588.00	635,200

横河電機	900	1,703.00	1,532,700
アズビル	400	4,125.00	1,650,000
日本光電工業	300	3,510.00	1,053,000
堀場製作所	100	5,520.00	552,000
アドバンテスト	200	5,210.00	1,042,000
キーエンス	100	49,190.00	4,919,000
シスメックス	200	10,010.00	2,002,000
スタンレー電気	800	3,110.00	2,488,000
ウシオ電機	500	1,359.00	679,500
カシオ計算機	1,000	1,687.00	1,687,000
ファナック	600	20,655.00	12,393,000
ローム	400	8,480.00	3,392,000
浜松ホトニクス	300	5,260.00	1,578,000
京セラ	1,400	6,036.00	8,450,400
太陽誘電	500	3,430.00	1,715,000
村田製作所	1,700	6,878.00	11,692,600
小糸製作所	500	5,280.00	2,640,000
S C R E E Nホールディングス	100	5,880.00	588,000
キヤノン	7,900	1,749.00	13,817,100
リコー	5,600	712.00	3,987,200
東京エレクトロン	400	27,560.00	11,024,000
トヨタ紡織	700	1,564.00	1,094,800
ユニプレス	700	895.00	626,500
豊田自動織機	800	6,930.00	5,544,000
デンソー	3,500	4,840.00	16,940,000
東海理化電機製作所	600	1,624.00	974,400
三井E&Sホールディングス	1,000	401.00	401,000
川崎重工業	1,500	1,461.00	2,191,500
日産自動車	40,100	392.10	15,723,210
いすゞ自動車	5,300	997.10	5,284,630
トヨタ自動車	11,500	7,003.00	80,534,500
日野自動車	2,900	801.00	2,322,900
三菱自動車工業	7,700	243.00	1,871,100
武蔵精密工業	400	1,197.00	478,800
日産車体	900	929.00	836,100

新明和工業	700	889.00	622,300
日信工業	400	2,244.00	897,600
タチエス	500	1,045.00	522,500
NOK	1,100	1,156.00	1,271,600
フタバ産業	800	557.00	445,600
KYB	300	2,322.00	696,600
プレス工業	1,300	306.00	397,800
ケーヒン	600	2,593.00	1,555,800
アイシン精機	2,200	3,475.00	7,645,000
マツダ	10,300	629.00	6,478,700
本田技研工業	17,500	2,618.50	45,823,750
スズキ	2,700	4,811.00	12,989,700
SUBARU	5,000	2,130.00	10,650,000
ヤマハ発動機	2,400	1,649.00	3,957,600
ショーワ	500	2,294.00	1,147,000
エクセディ	300	1,386.00	415,800
豊田合成	800	2,529.00	2,023,200
日本精機	400	1,166.00	466,400
エフ・シー・シー	300	2,043.00	612,900
シマノ	200	21,390.00	4,278,000
テイ・エス テック	500	3,045.00	1,522,500
テルモ	1,100	4,106.00	4,516,600
島津製作所	500	3,160.00	1,580,000
東京精密	200	3,450.00	690,000
ニコン	2,500	716.00	1,790,000
トプコン	400	1,055.00	422,000
オリンパス	1,800	2,169.00	3,904,200
HOYA	900	12,190.00	10,971,000
シチズン時計	2,500	294.00	735,000
セイコーホールディングス	200	1,447.00	289,400
ニプロ	900	1,188.00	1,069,200
バンダイナムコホールディングス	500	7,780.00	3,890,000
タカラトミー	600	989.00	593,400
凸版印刷	2,200	1,469.00	3,231,800
大日本印刷	1,800	2,099.00	3,778,200

アシックス	900	1,490.00	1,341,000
ヤマハ	400	5,110.00	2,044,000
ビジョン	200	4,860.00	972,000
リンテック	300	2,447.00	734,100
任天堂	100	57,860.00	5,786,000
コクヨ	500	1,322.00	661,000
東京電力ホールディングス	36,500	300.00	10,950,000
中部電力	6,700	1,301.50	8,720,050
関西電力	8,000	1,030.50	8,244,000
中国電力	2,300	1,329.00	3,056,700
北陸電力	2,500	766.00	1,915,000
東北電力	6,800	1,007.00	6,847,600
四国電力	1,900	808.00	1,535,200
九州電力	4,600	966.00	4,443,600
北海道電力	4,100	461.00	1,890,100
沖縄電力	500	1,645.00	822,500
電源開発	1,300	1,603.00	2,083,900
東京瓦斯	3,300	2,390.00	7,887,000
大阪瓦斯	3,000	2,032.00	6,096,000
東邦瓦斯	400	5,160.00	2,064,000
東武鉄道	700	3,265.00	2,285,500
相鉄ホールディングス	300	2,844.00	853,200
東急	1,800	1,381.00	2,485,800
京浜急行電鉄	600	1,643.00	985,800
小田急電鉄	700	2,674.00	1,871,800
京王電鉄	200	6,520.00	1,304,000
京成電鉄	200	3,000.00	600,000
東日本旅客鉄道	1,600	6,555.00	10,488,000
西日本旅客鉄道	800	5,299.00	4,239,200
東海旅客鉄道	400	15,420.00	6,168,000
西武ホールディングス	800	1,181.00	944,800
西日本鉄道	300	3,040.00	912,000
近鉄グループホールディングス	500	4,580.00	2,290,000
阪急阪神ホールディングス	900	3,460.00	3,114,000
南海電気鉄道	400	2,331.00	932,400

京阪ホールディングス	300	4,370.00	1,311,000
名古屋鉄道	700	2,902.00	2,031,400
日本通運	800	6,160.00	4,928,000
ヤマトホールディングス	2,700	2,692.00	7,268,400
山九	200	4,215.00	843,000
センコーグループホールディングス	1,000	977.00	977,000
ニッコンホールディングス	400	2,291.00	916,400
セイノーホールディングス	1,200	1,481.00	1,777,200
日立物流	300	3,395.00	1,018,500
九州旅客鉄道	600	2,277.00	1,366,200
S Gホールディングス	700	5,340.00	3,738,000
日本郵船	2,300	1,881.00	4,326,300
商船三井	1,200	2,228.00	2,673,600
川崎汽船	800	1,265.00	1,012,000
日本航空	3,400	2,020.00	6,868,000
ANAホールディングス	2,300	2,480.00	5,704,000
三菱倉庫	300	3,005.00	901,500
住友倉庫	400	1,344.00	537,600
上組	600	2,047.00	1,228,200
T I S	600	2,224.00	1,334,400
ネクソン	1,200	2,585.00	3,102,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	600	2,179.00	1,307,400
野村総合研究所	900	3,115.00	2,803,500
フジ・メディア・ホールディングス	1,600	1,051.00	1,681,600
Zホールディングス	8,000	745.00	5,960,000
トレンドマイクロ	300	6,310.00	1,893,000
日本オラクル	100	11,000.00	1,100,000
伊藤忠テクノソリューションズ	300	3,850.00	1,155,000
大塚商会	400	5,330.00	2,132,000
ネットワンシステムズ	200	4,840.00	968,000
日本ユニシス	300	3,420.00	1,026,000
T B Sホールディングス	600	1,815.00	1,089,000
日本テレビホールディングス	1,200	1,167.00	1,400,400
テレビ朝日ホールディングス	400	1,680.00	672,000
日本電信電話	25,900	2,295.50	59,453,450

KDD I	10,900	2,738.50	29,849,650
ソフトバンク	11,400	1,212.00	13,816,800
NTTドコモ	8,800	3,877.00	34,117,600
東宝	300	4,465.00	1,339,500
エヌ・ティ・ティ・データ	2,800	1,329.00	3,721,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	6,720.00	1,344,000
SCSK	200	5,790.00	1,158,000
コナミホールディングス	300	4,595.00	1,378,500
ソフトバンクグループ	11,000	6,955.00	76,505,000
あらた	300	5,020.00	1,506,000
双日	13,500	243.00	3,280,500
アルフレッサ ホールディングス	1,700	2,302.00	3,913,400
ダイワボウホールディングス	200	6,550.00	1,310,000
マクニカ・富士エレホールディングス	600	1,926.00	1,155,600
シップヘルスケアホールディングス	200	5,180.00	1,036,000
三菱食品	200	2,798.00	559,600
第一興商	200	3,600.00	720,000
メディopalホールディングス	1,700	2,085.00	3,544,500
伊藤忠商事	10,000	2,701.50	27,015,000
丸紅	26,100	618.90	16,153,290
長瀬産業	1,200	1,439.00	1,726,800
豊田通商	2,500	3,095.00	7,737,500
兼松	1,100	1,306.00	1,436,600
三井物産	15,500	1,849.00	28,659,500
山善	600	1,071.00	642,600
住友商事	10,400	1,280.00	13,312,000
三菱商事	11,300	2,561.00	28,939,300
キヤノンマーケティングジャパン	400	2,047.00	818,800
阪和興業	600	2,169.00	1,301,400
岩谷産業	400	3,950.00	1,580,000
三愛石油	900	997.00	897,300
稲畑産業	700	1,320.00	924,000
東邦ホールディングス	600	2,222.00	1,333,200
サンゲツ	400	1,592.00	636,800

伊藤忠エネクス	1,100	961.00	1,057,100
リョーサン	400	2,068.00	827,200
PAL TAC	200	5,390.00	1,078,000
日鉄物産	300	3,110.00	933,000
オートバックスセブン	500	1,434.00	717,000
加藤産業	300	3,695.00	1,108,500
因幡電機産業	400	2,627.00	1,050,800
ミスミグループ本社	500	2,994.00	1,497,000
スズケン	600	3,980.00	2,388,000
ローソン	300	5,070.00	1,521,000
エービーシー・マート	100	5,490.00	549,000
ゲオホールディングス	600	1,633.00	979,800
日本マクドナルドホールディングス	100	5,140.00	514,000
エディオン	1,400	1,110.00	1,554,000
ビックカメラ	800	1,208.00	966,400
DCMホールディングス	900	1,472.00	1,324,800
J. フロント リテイリング	1,900	824.00	1,565,600
マツモトキヨシホールディングス	400	4,060.00	1,624,000
ZOZO	300	2,973.00	891,900
ココカラファイン	100	7,020.00	702,000
三越伊勢丹ホールディングス	3,800	600.00	2,280,000
ウエルシアホールディングス	300	4,410.00	1,323,000
すかいらーくホールディングス	800	1,538.00	1,230,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	900	1,216.00	1,094,400
コスモス薬品	100	17,480.00	1,748,000
セブン&アイ・ホールディングス	4,800	3,431.00	16,468,800
ツルハホールディングス	100	15,040.00	1,504,000
良品計画	800	1,800.00	1,440,000
コーナン商事	300	3,910.00	1,173,000
パン・パシフィック・インターナシ ョナルホ	1,100	2,405.00	2,645,500
ゼンショーホールディングス	300	2,547.00	764,100
スギホールディングス	200	7,400.00	1,480,000
ファミリーマート	700	2,325.00	1,627,500
日本瓦斯	200	5,280.00	1,056,000

島忠	300	4,190.00	1,257,000
コメリ	300	3,100.00	930,000
青山商事	700	574.00	401,800
しまむら	200	10,590.00	2,118,000
高島屋	2,000	879.00	1,758,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,400	751.00	1,051,400
丸井グループ	700	2,097.00	1,467,900
イオン	4,200	2,939.50	12,345,900
イズミ	200	3,730.00	746,000
平和堂	300	2,300.00	690,000
ケーズホールディングス	1,900	1,395.00	2,650,500
アインホールディングス	100	7,540.00	754,000
ヤマダホールディングス	7,200	519.00	3,736,800
ニトリホールディングス	100	21,630.00	2,163,000
アークス	500	2,565.00	1,282,500
バローホールディングス	500	2,728.00	1,364,000
サンドラッグ	400	3,940.00	1,576,000
めぶきフィナンシャルグループ	12,400	237.00	2,938,800
ゆうちょ銀行	3,900	820.00	3,198,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	9,700	382.00	3,705,400
西日本フィナンシャルホールディングス	3,300	736.00	2,428,800
ひろぎんホールディングス	3,200	599.00	1,916,800
新生銀行	600	1,332.00	799,200
あおぞら銀行	1,800	1,789.00	3,220,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	203,200	433.90	88,168,480
りそなホールディングス	53,500	368.20	19,698,700
三井住友トラスト・ホールディングス	19,500	2,892.00	56,394,000
三井住友フィナンシャルグループ	30,600	3,020.00	92,412,000
千葉銀行	7,100	594.00	4,217,400
群馬銀行	2,100	352.00	739,200
武蔵野銀行	300	1,576.00	472,800
青森銀行	400	2,430.00	972,000
ふくおかフィナンシャルグループ	4,800	1,804.00	8,659,200

静岡銀行	1,200	728.00	873,600
八十二銀行	11,100	420.00	4,662,000
大垣共立銀行	300	2,353.00	705,900
北國銀行	1,100	3,065.00	3,371,500
滋賀銀行	500	2,436.00	1,218,000
南都銀行	200	1,976.00	395,200
百五銀行	4,000	327.00	1,308,000
京都銀行	200	5,130.00	1,026,000
紀陽銀行	500	1,588.00	794,000
ほくほくフィナンシャルグループ	4,100	1,055.00	4,325,500
山陰合同銀行	2,400	559.00	1,341,600
伊予銀行	1,300	691.00	898,300
百十四銀行	400	1,810.00	724,000
大分銀行	300	2,460.00	738,000
セブン銀行	3,500	259.00	906,500
みずほフィナンシャルグループ	49,620	1,342.50	66,614,850
北洋銀行	10,100	236.00	2,383,600
東和銀行	1,500	726.00	1,089,000
池田泉州ホールディングス	4,900	174.00	852,600
SBIホールディングス	1,100	2,660.00	2,926,000
ジャフコグループ	300	4,450.00	1,335,000
大和証券グループ本社	10,800	450.00	4,860,000
野村ホールディングス	26,600	494.10	13,143,060
岡三証券グループ	1,600	355.00	568,000
かんぽ生命保険	400	1,731.00	692,400
SOMPOホールディングス	2,100	3,812.00	8,005,200
MS&ADインシュアランスグループホール	5,700	2,894.00	16,495,800
第一生命ホールディングス	18,700	1,586.00	29,658,200
東京海上ホールディングス	4,400	4,774.00	21,005,600
T&Dホールディングス	7,900	1,098.00	8,674,200
全国保証	100	4,275.00	427,500
クレディセゾン	700	1,155.00	808,500
日本証券金融	6,400	510.00	3,264,000
イオンフィナンシャルサービス	1,000	1,059.00	1,059,000
オリックス	10,400	1,380.50	14,357,200

日本取引所グループ	1,300	2,800.00	3,640,000
ヒューリック	900	1,033.00	929,700
野村不動産ホールディングス	500	2,038.00	1,019,000
東急不動産ホールディングス	2,100	490.00	1,029,000
飯田グループホールディングス	1,300	2,095.00	2,723,500
パーク24	400	1,785.00	714,000
三井不動産	2,200	1,909.00	4,199,800
三菱地所	3,000	1,632.00	4,896,000
東京建物	1,000	1,286.00	1,286,000
住友不動産	700	3,062.00	2,143,400
レオパレス21	5,200	177.00	920,400
イオンモール	500	1,617.00	808,500
ミクシィ	600	3,080.00	1,848,000
パーソルホールディングス	700	1,693.00	1,185,100
総合警備保障	200	5,030.00	1,006,000
カカコム	300	2,979.00	893,700
ディー・エヌ・エー	500	1,924.00	962,000
博報堂DYホールディングス	1,200	1,438.00	1,725,600
電通グループ	1,200	3,055.00	3,666,000
H. U. グループホールディングス	500	2,877.00	1,438,500
オリエンタルランド	200	15,065.00	3,013,000
ダスキン	300	2,888.00	866,400
ユー・エス・エス	500	1,936.00	968,000
サイバーエージェント	300	6,290.00	1,887,000
楽天	2,200	1,193.00	2,624,600
テクノプロ・ホールディングス	100	6,820.00	682,000
リクルートホールディングス	2,100	4,272.00	8,971,200
日本郵政	8,300	740.70	6,147,810
ベルシステム24ホールディングス	400	1,778.00	711,200
カナモト	300	2,401.00	720,300
セコム	600	9,387.00	5,632,200
メイテック	100	5,320.00	532,000
ベネッセホールディングス	400	2,681.00	1,072,400
小計 銘柄数：550			2,389,527,290
組入時価比率：96.6%			100.0%

合計			2,389,527,290
----	--	--	---------------

(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。