



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 MSCI日本株女性活躍指数(セレクト)連動型上場投信		
コード番号	(2518)		
連動対象指標	MSCI 日本株女性活躍指数(セレクト)		
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 MSCI Japan Empowering Women Select Index Exchange Traded Fund		
Code:	2518		
Underlying index:	MSCI Japan Empowering Women (WIN) Select 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	4,805	(99.9)	3	(0.1)	4,809	(100.0)
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	3,853	(99.9)	2	(0.1)	3,856	(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	4,535	1,492	991	5,036
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	4,530	500	495	4,535

(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))	100口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	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	4,848	38	4,809	95,486
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	3,910	53	3,856	85,025

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	700
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	1,100

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4期 (2020年4月20日現在) 4th Fiscal Year As of April 20, 2020	第5期 (2020年10月20日現在) 5th 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	9,295,895	6,600,659
株式 Stocks	3,853,695,950	4,805,149,905
未収配当金 Accrued dividends receivable	47,048,953	36,379,820
流動資産合計 Total current assets	3,910,040,798	4,848,130,384
資産合計 Total assets	3,910,040,798	4,848,130,384
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	49,892,821	35,255,367
未払受託者報酬 Trustee fee payable	671,360	677,718
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	2,685,383	2,710,810
未払利息 Accrued interest expenses	10	5
その他未払費用 Other accrued expenses	324,820	340,176
流動負債合計 Total current liabilities	53,574,394	38,984,076
負債合計 Total liabilities	53,574,394	38,984,076
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	4,535,711,000	5,036,481,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△679,244,596	△227,334,692

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	1, 680, 428	4, 774, 902
元本等合計 Total principal and other	3, 856, 466, 404	4, 809, 146, 308
純資産合計 Total net assets	3, 856, 466, 404	4, 809, 146, 308
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	3, 910, 040, 798	4, 848, 130, 384

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	第4期 自 2019年10月21日 至 2020年4月20日 4th Fiscal Year From October 21, 2019 to April 20, 2020	第5期 自 2020年4月21日 至 2020年10月20日 5th 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	53, 316, 851	42, 272, 725
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△362, 603, 333	444, 939, 630
その他収益 Other revenue	25, 219	17, 676
営業収益合計 Total operating revenue	△309, 261, 263	487, 230, 031
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	1, 177	3, 062
受託者報酬 Trustee fee	671, 360	677, 718
委託者報酬 Investment trust management fee	2, 685, 383	2, 710, 810
その他費用 Other expenses	594, 834	548, 970
営業費用合計 Total operating expenses	3, 952, 754	3, 940, 560
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△313, 214, 017	483, 289, 471
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△313, 214, 017	483, 289, 471
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△313, 214, 017	483, 289, 471
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	△319, 517, 398	△679, 244, 596
剰余金増加額又は欠損金減少額	10, 764, 240	61, 558, 460

Increase in surplus or decrease in deficit		
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	10,764,240	61,558,460
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	7,384,600	57,682,660
当期追加信託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 additional subscriptions for period	7,384,600	57,682,660
分配金 Dividends	49,892,821	35,255,367
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△679,244,596	△227,334,692

(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。
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。
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、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4期 2020年4月20日現在	第5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 4,535,711口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 5,036,481口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 679,244,596円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 227,334,692円
3. 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 850.25円 (100口当たり純資産額) (85,025円)	3. 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 954.86円 (100口当たり純資産額) (95,486円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自2019年10月21日 至2020年4月20日	第5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>53,340,893円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,183,933円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	53,340,893円	分配準備積立金	B	2,183,933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>42,287,339円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>1,680,428円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	42,287,339円	分配準備積立金	B	1,680,428円
項目																			
当期配当等収益額	A	53,340,893円																	
分配準備積立金	B	2,183,933円																	
項目																			
当期配当等収益額	A	42,287,339円																	
分配準備積立金	B	1,680,428円																	

配当等収益合計額	C=A+B	55,524,826円	配当等収益合計額	C=A+B	43,967,767円
経費	D	3,951,577円	経費	D	3,937,498円
収益分配可能額	E=C-D	51,573,249円	収益分配可能額	E=C-D	40,030,269円
収益分配金	F	49,892,821円	収益分配金	F	35,255,367円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,680,428円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,774,902円
口数	H	4,535,711口	口数	H	5,036,481口
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,100円	100口当たり分配金	I=F/H×100	700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4期 自 2019年10月21日 至 2020年4月20日	第5期 自 2020年4月21日 至 2020年10月20日
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○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。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年4月20日現在	第5期 2020年10月20日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 株式 (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。 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>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第4期	第5期
-----	-----

自 2019年10月21日 至 2020年4月20日	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4期 自 2019年10月21日 至 2020年4月20日	第5期 自 2020年4月21日 至 2020年10月20日
期首元本額 4,530,909,000円	期首元本額 4,535,711,000円
期中追加設定元本額 500,100,000円	期中追加設定元本額 1,492,200,000円
期中一部交換元本額 495,298,000円	期中一部交換元本額 991,430,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第4期 自 2019年10月21日 至 2020年4月20日	第5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	△420,519,522	347,050,298
合計	△420,519,522	347,050,298

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	マルハニチロ	200	2,193.00	438,600	
		国際石油開発帝石	35,900	522.90	18,772,110	
		大成建設	4,900	3,410.00	16,709,000	
		大林組	12,600	887.00	11,176,200	
		清水建設	13,100	743.00	9,733,300	
		鹿島建設	3,400	1,167.00	3,967,800	
		熊谷組	700	2,458.00	1,720,600	
		住友林業	1,600	1,731.00	2,769,600	
		積水ハウス	14,500	1,777.00	25,766,500	
		日清製粉グループ本社	3,100	1,606.00	4,978,600	
		森永製菓	1,100	4,055.00	4,460,500	
		カルビー	2,900	3,355.00	9,729,500	
		アサヒグループホールディングス	5,800	3,587.00	20,804,600	

キリンホールディングス	7,400	1,927.00	14,259,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	700	1,641.00	1,148,700
サントリー食品インターナショナル	2,600	3,850.00	10,010,000
不二製油グループ本社	600	3,295.00	1,977,000
キッコーマン	3,500	5,250.00	18,375,000
味の素	6,700	2,111.50	14,147,050
カゴメ	1,000	3,585.00	3,585,000
ニチレイ	2,400	2,644.00	6,345,600
東洋紡	900	1,480.00	1,332,000
帝人	3,300	1,654.00	5,458,200
東レ	17,100	491.60	8,406,360
ゴールドウイン	600	8,280.00	4,968,000
王子ホールディングス	18,500	451.00	8,343,500
日本製紙	500	1,217.00	608,500
クラレ	5,400	1,028.00	5,551,200
旭化成	40,300	924.30	37,249,290
昭和電工	1,100	1,856.00	2,041,600
住友化学	26,900	355.00	9,549,500
三井化学	2,800	2,693.00	7,540,400
J S R	4,100	2,517.00	10,319,700
東京応化工業	600	6,250.00	3,750,000
三菱ケミカルホールディングス	12,700	606.70	7,705,090
KHネオケム	1,100	2,636.00	2,899,600
ダイセル	5,400	779.00	4,206,600
積水化学工業	9,200	1,725.00	15,870,000
日本ゼオン	3,200	1,247.00	3,990,400
花王	16,900	7,754.00	131,042,600
日本ペイントホールディングス	2,500	10,130.00	25,325,000
D I C	1,800	2,635.00	4,743,000
富士フイルムホールディングス	4,900	5,323.00	26,082,700
資生堂	13,800	6,865.00	94,737,000
ライオン	5,300	2,149.00	11,389,700
マンダム	500	1,796.00	898,000
ファンケル	600	3,470.00	2,082,000
コーセー	1,000	14,710.00	14,710,000

ポーラ・オルビスホールディングス	2,100	2,085.00	4,378,500
小林製薬	1,200	10,350.00	12,420,000
タカラバイオ	800	2,765.00	2,212,000
エフピコ	800	4,130.00	3,304,000
ユニ・チャーム	10,400	5,079.00	52,821,600
協和キリン	4,500	2,651.00	11,929,500
アステラス製薬	76,700	1,486.50	114,014,550
大日本住友製薬	4,500	1,218.00	5,481,000
塩野義製薬	15,000	5,217.00	78,255,000
日本新薬	1,100	8,330.00	9,163,000
中外製薬	28,700	4,353.00	124,931,100
科研製薬	900	4,450.00	4,005,000
エーザイ	7,800	8,638.00	67,376,400
ロート製薬	2,000	3,395.00	6,790,000
参天製薬	5,100	2,084.00	10,628,400
JCRファーマ	1,500	2,718.00	4,077,000
沢井製薬	600	5,030.00	3,018,000
第一三共	31,800	2,745.00	87,291,000
大塚ホールディングス	7,000	4,109.00	28,763,000
大正製薬ホールディングス	300	6,730.00	2,019,000
ENEOSホールディングス	60,700	367.70	22,319,390
コスモエネルギーホールディングス	1,000	1,533.00	1,533,000
ブリヂストン	17,600	3,363.00	59,188,800
住友大阪セメント	700	3,325.00	2,327,500
TOTO	2,600	4,645.00	12,077,000
日本碍子	3,500	1,501.00	5,253,500
日本特殊陶業	2,500	1,941.00	4,852,500
東京製鐵	3,300	739.00	2,438,700
日立金属	2,500	1,597.00	3,992,500
三井金属鉱業	200	2,537.00	507,400
三菱マテリアル	700	1,880.00	1,316,000
住友金属鉱山	1,100	3,314.00	3,645,400
古河電気工業	600	2,497.00	1,498,200
住友電気工業	11,900	1,136.50	13,524,350
フジクラ	1,300	280.00	364,000

東洋製罐グループホールディングス	1,300	1,011.00	1,314,300
LIXILグループ	1,000	2,198.00	2,198,000
日本発條	2,100	647.00	1,358,700
ディスコ	600	28,990.00	17,394,000
ナブテスコ	1,800	3,900.00	7,020,000
SMC	900	57,870.00	52,083,000
小松製作所	15,200	2,415.50	36,715,600
荏原製作所	1,600	2,911.00	4,657,600
ダイキン工業	5,700	19,615.00	111,805,500
栗田工業	1,800	3,320.00	5,976,000
ダイフク	2,200	11,230.00	24,706,000
ユニバーサルエンターテインメント	100	1,821.00	182,100
セガサミーホールディングス	1,100	1,307.00	1,437,700
ホンザキ	1,000	8,900.00	8,900,000
三菱重工業	1,500	2,192.00	3,288,000
日清紡ホールディングス	400	710.00	284,000
コニカミノルタ	4,300	250.00	1,075,000
ブラザー工業	4,000	1,552.00	6,208,000
ミネベアミツミ	8,600	1,958.00	16,838,800
三菱電機	31,400	1,361.50	42,751,100
富士電機	1,800	3,220.00	5,796,000
安川電機	2,100	4,090.00	8,589,000
東芝テック	100	4,250.00	425,000
マブチモーター	800	4,255.00	3,404,000
日本電産	6,300	10,240.00	64,512,000
オムロン	3,300	7,840.00	25,872,000
日本電気	3,000	5,770.00	17,310,000
沖電気工業	1,900	1,089.00	2,069,100
セイコーエプソン	3,600	1,037.00	3,733,200
アンリツ	1,400	2,492.00	3,488,800
ソニー	13,700	7,900.00	108,230,000
アルプスアルパイン	1,400	1,503.00	2,104,200
横河電機	3,300	1,644.00	5,425,200
アズビル	2,700	4,385.00	11,839,500
日本光電工業	1,600	3,380.00	5,408,000

掘場製作所	500	5,300.00	2,650,000
アドバンテスト	6,400	5,610.00	35,904,000
シスメックス	5,400	10,235.00	55,269,000
ウシオ電機	1,700	1,234.00	2,097,800
カシオ計算機	5,100	1,544.00	7,874,400
太陽誘電	1,500	3,860.00	5,790,000
村田製作所	10,500	7,268.00	76,314,000
キヤノン	7,800	1,632.00	12,729,600
リコー	2,700	662.00	1,787,400
東京エレクトロン	5,300	29,315.00	155,369,500
デンソー	6,600	4,836.00	31,917,600
川崎重工業	1,000	1,292.00	1,292,000
三菱自動車工業	4,800	212.00	1,017,600
マツダ	6,600	603.00	3,979,800
豊田合成	800	2,458.00	1,966,400
テルモ	11,700	4,005.00	46,858,500
島津製作所	5,800	2,989.00	17,336,200
マニー	1,700	2,808.00	4,773,600
ニコン	4,900	622.00	3,047,800
トプコン	900	1,073.00	965,700
シチズン時計	3,100	262.00	812,200
バンダイナムコホールディングス	7,400	7,860.00	58,164,000
タカラトミー	700	950.00	665,000
凸版印刷	2,500	1,422.00	3,555,000
大日本印刷	2,200	2,088.00	4,593,600
ピジョン	4,700	4,925.00	23,147,500
中部電力	4,700	1,238.50	5,820,950
四国電力	2,300	790.00	1,817,000
九州電力	2,700	929.00	2,508,300
東京瓦斯	13,300	2,326.50	30,942,450
大阪瓦斯	11,700	1,988.00	23,259,600
東邦瓦斯	1,800	5,320.00	9,576,000
東急	3,600	1,238.00	4,456,800
小田急電鉄	2,000	2,484.00	4,968,000
東日本旅客鉄道	3,300	5,887.00	19,427,100

西武ホールディングス	1,800	1,097.00	1,974,600
近鉄グループホールディングス	1,000	4,165.00	4,165,000
阪急阪神ホールディングス	3,000	3,130.00	9,390,000
日本通運	900	5,930.00	5,337,000
セイノーホールディングス	1,900	1,376.00	2,614,400
日立物流	1,000	3,335.00	3,335,000
S Gホールディングス	3,700	5,600.00	20,720,000
日本郵船	600	1,965.00	1,179,000
商船三井	500	2,366.00	1,183,000
日本航空	3,100	1,980.00	6,138,000
ANAホールディングス	1,500	2,373.00	3,559,500
三菱倉庫	700	2,857.00	1,999,900
T I S	6,900	2,218.00	15,304,200
コーエーテクモホールディングス	1,100	5,210.00	5,731,000
野村総合研究所	12,700	3,135.00	39,814,500
Zホールディングス	63,900	770.00	49,203,000
日本オラクル	1,900	10,620.00	20,178,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,900	3,850.00	11,165,000
大塚商会	3,400	5,040.00	17,136,000
ネットワンシステムズ	1,800	4,775.00	8,595,000
日本ユニシス	2,600	3,325.00	8,645,000
日本電信電話	27,500	2,204.50	60,623,750
K D D I	45,600	2,725.00	124,260,000
N T T ドコモ	33,100	3,885.00	128,593,500
東宝	2,300	4,520.00	10,396,000
エヌ・ティ・ティ・データ	6,900	1,312.00	9,052,800
カプコン	2,500	6,220.00	15,550,000
S C S K	1,200	5,760.00	6,912,000
コナミホールディングス	1,400	4,275.00	5,985,000
ソフトバンクグループ	7,200	7,140.00	51,408,000
双日	14,500	233.00	3,378,500
アルフレッサ ホールディングス	3,100	2,044.00	6,336,400
神戸物産	1,100	5,790.00	6,369,000
メディパルホールディングス	2,700	1,928.00	5,205,600
伊藤忠商事	34,600	2,602.50	90,046,500

丸紅	20,300	587.40	11,924,220
豊田通商	1,100	2,939.00	3,232,900
三井物産	10,200	1,784.50	18,201,900
三菱商事	7,300	2,471.00	18,038,300
サンリオ	1,000	1,899.00	1,899,000
PALTAC	700	5,750.00	4,025,000
ローソン	500	5,090.00	2,545,000
日本マクドナルドホールディングス	1,000	5,080.00	5,080,000
Monotaro	5,000	5,900.00	29,500,000
J. フロント リテイリング	2,800	829.00	2,321,200
ココカラファイン	200	7,060.00	1,412,000
三越伊勢丹ホールディングス	4,900	534.00	2,616,600
ウエルシアホールディングス	2,800	4,435.00	12,418,000
すかいらーくホールディングス	1,700	1,534.00	2,607,800
良品計画	7,400	2,219.00	16,420,600
ゼンショーホールディングス	700	2,429.00	1,700,300
ファミリーマート	1,500	2,305.00	3,457,500
島忠	500	4,195.00	2,097,500
しまむら	400	10,910.00	4,364,000
高島屋	2,400	813.00	1,951,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	700	710.00	497,000
丸井グループ	2,700	2,025.00	5,467,500
イオン	3,200	2,830.50	9,057,600
イズミ	700	3,740.00	2,618,000
ケーズホールディングス	4,600	1,382.00	6,357,200
アインホールディングス	600	7,190.00	4,314,000
吉野家ホールディングス	500	1,873.00	936,500
サンドラッグ	2,000	4,120.00	8,240,000
ゆうちょ銀行	6,700	811.00	5,433,700
新生銀行	2,800	1,342.00	3,757,600
あおぞら銀行	1,500	1,755.00	2,632,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	120,600	417.60	50,362,560
りそなホールディングス	38,600	351.50	13,567,900
三井住友フィナンシャルグループ	12,400	2,945.00	36,518,000
千葉銀行	15,200	570.00	8,664,000

静岡銀行	8,800	718.00	6,318,400
京都銀行	1,400	4,760.00	6,664,000
みずほフィナンシャルグループ	23,490	1,288.50	30,266,865
SBIホールディングス	3,400	2,563.00	8,714,200
大和証券グループ本社	12,200	453.10	5,527,820
野村ホールディングス	37,000	487.30	18,030,100
SOMPOホールディングス	15,800	3,881.00	61,319,800
MS&ADインシュアランスグループホール	29,200	2,924.50	85,395,400
第一生命ホールディングス	40,600	1,574.50	63,924,700
T&Dホールディングス	22,700	1,061.00	24,084,700
クレディセゾン	1,400	1,188.00	1,663,200
東京センチュリー	600	5,570.00	3,342,000
オリエン特コーポレーション	7,500	115.00	862,500
日立キャピタル	400	2,327.00	930,800
オリックス	47,300	1,320.50	62,459,650
日本取引所グループ	29,300	2,669.00	78,201,700
いちご	3,900	316.00	1,232,400
ヒューリック	3,100	1,013.00	3,140,300
東急不動産ホールディングス	2,700	472.00	1,274,400
三井不動産	10,800	1,887.50	20,385,000
三菱地所	11,700	1,608.50	18,819,450
イオンモール	1,600	1,655.00	2,648,000
カチタス	2,200	3,340.00	7,348,000
カカクコム	6,000	2,980.00	17,880,000
ベネフィット・ワン	3,500	2,930.00	10,255,000
エムスリー	12,900	7,240.00	93,396,000
ディー・エヌ・エー	1,100	1,863.00	2,049,300
インフォマート	5,900	946.00	5,581,400
ケネディクス	7,000	534.00	3,738,000
H. U. グループホールディングス	400	2,800.00	1,120,000
オリエンタルランド	6,700	14,900.00	99,830,000
ラウンドワン	900	919.00	827,100
リゾートトラスト	2,200	1,728.00	3,801,600
ユー・エス・エス	7,200	1,991.00	14,335,200
サイバーエージェント	1,600	6,790.00	10,864,000

	楽天	4,700	1,122.00	5,273,400	
	エン・ジャパン	1,600	2,756.00	4,409,600	
	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	48,100	4,345.00	208,994,500	
	エイチ・アイ・エス	200	1,651.00	330,200	
	共立メンテナンス	500	4,050.00	2,025,000	
	乃村工藝社	2,000	728.00	1,456,000	
	セコム	3,800	9,093.00	34,553,400	
	ベネッセホールディングス	700	2,605.00	1,823,500	
	小計 銘柄数：267			4,805,149,905	
	組入時価比率：99.9%			100.0%	
	合計			4,805,149,905	

(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

該当事項はありません。