



2020年4月期 (2019年10月21日～2020年4月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2020 (October 21, 2019 – April 20, 2020)

2020年6月1日
 June 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 2020年7月14日
 分配金支払開始日 2020年5月29日
 Scheduled date of submission of securities report: July 14, 2020
 Date of commencing dividend payment: May 29, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年4月期の運用状況 (2019年10月21日～2020年4月20日)

Management Status for Year ended April 2020 (from October 21, 2019 to April 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4月期 FY ended Apr. 2020	6,125	(97.4)	163	(2.6)	6,289	(100.0)
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	7,410	(97.7)	170	(2.3)	7,581	(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4月期 FY ended Apr. 2020	483	0	38	444
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	483	0	0	483

(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4月期 FY ended Apr. 2020	6,375	86	6,289	14,145
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	7,667	85	7,581	15,679

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	161
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	149

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 7 期 (2019 年 10 月 20 日現在) 7th Fiscal Year As of October 20, 2019	第 8 期 (2020 年 4 月 20 日現在) 8th Fiscal Year As of April 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	181,900,483	168,454,094
株式 Stocks	7,410,677,350	6,125,689,670
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	4,875,968	6,585,780
未収入金 Accounts receivable - other	3,055,189	3,977,500
未収配当金 Accrued dividends receivable	66,494,475	67,505,910
差入委託証拠金 Customers' margin	-	3,477,181
流動資産合計 Total current assets	7,667,003,465	6,375,690,135
資産合計 Total assets	7,667,003,465	6,375,690,135
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
前受金 Advances received	1,436,950	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	72,050,738	71,583,981
未払受託者報酬 Trustee fee payable	1,969,583	2,063,851
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	7,090,438	7,429,802
未払利息 Accrued interest expenses	544	186
その他未払費用 Other accrued expenses	2,891,563	5,371,153
流動負債合計 Total current liabilities	85,439,816	86,448,973
負債合計 Total liabilities	85,439,816	86,448,973
純資産の部 Net assets		

元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,214,255,262	5,713,824,471
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,367,308,387	575,416,691
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	251,470	157,018
元本等合計 Total principal and other	7,581,563,649	6,289,241,162
純資産合計 Total net assets	7,581,563,649	6,289,241,162
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	7,667,003,465	6,375,690,135

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第7期 自 2019年4月21日 至 2019年10月20日 7th Fiscal Year From April 21, 2019 to October 20, 2019	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
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	83,826,567	83,830,802
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	84,730,690	△787,892,395
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	4,345,596	△19,757,640
その他収益 Other revenue	106,569	72,931
営業収益合計 Total operating revenue	173,009,422	△723,746,302
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	41,335	30,292
受託者報酬 Trustee fee	1,969,583	2,063,851
委託者報酬 Investment trust management fee	7,090,438	7,429,802
その他費用 Other expenses	2,720,259	2,890,259
営業費用合計 Total operating expenses	11,821,615	12,414,204
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	161,187,807	△736,160,506
経常利益又は経常損失 (△)	161,187,807	△736,160,506

Ordinary profit (loss)		
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	161, 187, 807	△736, 160, 506
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, 278, 171, 318	1, 367, 308, 387
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	-	15, 852, 791
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
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	72, 050, 738	71, 583, 981
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1, 367, 308, 387	575, 416, 691

(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、2019年10月21日から2020年4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7期 2019年10月20日現在	第8期 2020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 483, 562 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 444, 621 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 15, 679 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 14, 145 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 2019年4月21日 至 2019年10月20日			第8期 自 2019年10月21日 至 2020年4月20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	83,891,801円	当期配当等収益額	A	83,873,441円
分配準備積立金	B	190,687円	分配準備積立金	B	251,470円
配当等収益合計額	C=A+B	84,082,488円	配当等収益合計額	C=A+B	84,124,911円
経費	D	11,780,280円	経費	D	12,383,912円
収益分配可能額	E=C-D	72,302,208円	収益分配可能額	E=C-D	71,740,999円
収益分配金	F	72,050,738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	251,470円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	157,018円
口数	H	483,562口	口数	H	444,621口
1口当たり分配金	I=F/H	149円	1口当たり分配金	I=F/H	161円
2. その他費用 その他費用のうち2,361,433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2,476,556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7期 自 2019年4月21日 至 2019年10月20日		第8期 自 2019年10月21日 至 2020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。		3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左	

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第7期 2019年10月20日現在	第8期 2020年4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。 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。</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7期 自 2019年 4月 21日 至 2019年 10月 20日	第8期 自 2019年 10月 21日 至 2020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7期 自 2019年 4月 21日 至 2019年 10月 20日	第8期 自 2019年 10月 21日 至 2020年 4月 20日
期首元本額 6,214,255,262 円	期首元本額 6,214,255,262 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 500,430,791 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第7期 自 2019年 4月 21日 至 2019年 10月 20日	第8期 自 2019年 10月 21日 至 2020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	136,268,729	△663,784,050
合計	136,268,729	△663,784,050

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7期(2019年10月20日現在)				第8期(2020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)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	163,332,800	-	168,220,000	4,875,968	156,592,680	-	163,191,000	6,585,780
合計	163,332,800	-	168,220,000	4,875,968	156,592,680	-	163,191,000	6,585,780

(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	ミライト・ホールディングス	1,700	1,308.00	2,223,600	
		大成建設	5,200	3,090.00	16,068,000	
		清水建設	14,200	800.00	11,360,000	
		長谷工コーポレーション	7,100	1,129.00	8,015,900	
		鹿島建設	11,400	1,044.00	11,901,600	
		大東建託	1,800	10,375.00	18,675,000	
		大和ハウス工業	13,500	2,629.50	35,498,250	
		積水ハウス	14,500	1,761.50	25,541,750	
		山崎製パン	2,600	2,235.00	5,811,000	
		寿スピリッツ	400	4,660.00	1,864,000	
		森永乳業	900	4,300.00	3,870,000	
		ヤクルト本社	2,500	7,000.00	17,500,000	
		明治ホールディングス	3,000	7,650.00	22,950,000	
		アサヒグループホールディングス	9,000	3,549.00	31,941,000	
		キリンホールディングス	21,000	2,071.00	43,491,000	
		サントリー食品インターナショナル	3,300	3,970.00	13,101,000	
		キッコーマン	3,500	4,890.00	17,115,000	
		味の素	11,600	1,913.50	22,196,600	
		キューピー	2,400	2,130.00	5,112,000	
		ニチレイ	2,500	2,739.00	6,847,500	
		日清食品ホールディングス	1,500	9,100.00	13,650,000	
		日本たばこ産業	29,100	1,975.00	57,472,500	
		帝人	4,700	1,744.00	8,196,800	
		東レ	35,700	480.10	17,139,570	
		クラレ	8,300	1,056.00	8,764,800	
		旭化成	29,100	726.70	21,146,970	
昭和電工	3,400	2,338.00	7,949,200			
住友化学	36,500	315.00	11,497,500			

日産化学	2,900	3,870.00	11,223,000
東ソー	6,200	1,261.00	7,818,200
デンカ	2,000	2,599.00	5,198,000
信越化学工業	9,600	11,840.00	113,664,000
エア・ウォーター	3,300	1,494.00	4,930,200
カネカ	1,200	2,880.00	3,456,000
三菱瓦斯化学	4,300	1,269.00	5,456,700
三井化学	4,200	1,900.00	7,980,000
J S R	4,900	1,923.00	9,422,700
三菱ケミカルホールディングス	32,800	603.20	19,784,960
ダイセル	6,900	804.00	5,547,600
積水化学工業	9,300	1,352.00	12,573,600
アイカ工業	1,200	2,997.00	3,596,400
日立化成	2,600	4,610.00	11,986,000
日本化薬	3,600	965.00	3,474,000
花王	12,700	8,760.00	111,252,000
日本ペイントホールディングス	3,300	6,090.00	20,097,000
関西ペイント	4,500	2,063.00	9,283,500
D I C	1,800	2,394.00	4,309,200
資生堂	9,700	6,868.00	66,619,600
ライオン	5,600	2,325.00	13,020,000
ファンケル	1,700	2,551.00	4,336,700
コーセー	800	14,190.00	11,352,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,200	2,142.00	4,712,400
小林製薬	1,200	10,610.00	12,732,000
日東電工	4,200	4,960.00	20,832,000
ニフコ	2,100	1,893.00	3,975,300
ユニ・チャーム	9,100	4,074.00	37,073,400
武田薬品工業	19,300	3,656.00	70,560,800
アステラス製薬	49,300	1,756.00	86,570,800
大日本住友製薬	3,400	1,436.00	4,882,400
塩野義製薬	7,100	5,500.00	39,050,000
日本新薬	1,200	8,150.00	9,780,000
中外製薬	5,300	13,260.00	70,278,000
エーザイ	6,500	7,916.00	51,454,000

小野薬品工業	9,900	2,524.50	24,992,550
参天製薬	9,200	1,908.00	17,553,600
沢井製薬	1,000	5,850.00	5,850,000
第一三共	14,600	7,373.00	107,645,800
大塚ホールディングス	10,600	4,236.00	44,901,600
JXTGホールディングス	83,100	365.50	30,373,050
ブリヂストン	15,600	3,250.00	50,700,000
住友ゴム工業	4,200	1,000.00	4,200,000
AGC	4,700	2,522.00	11,853,400
太平洋セメント	3,200	2,117.00	6,774,400
東海カーボン	4,500	910.00	4,095,000
TOTO	3,600	3,460.00	12,456,000
日本碍子	6,500	1,308.00	8,502,000
日本特殊陶業	3,900	1,523.00	5,939,700
ニチアス	1,300	1,978.00	2,571,400
日本製鉄	20,200	850.30	17,176,060
ジェイ エフ イー ホールディングス	12,300	707.00	8,696,100
日立金属	5,000	1,092.00	5,460,000
日本軽金属ホールディングス	14,000	164.00	2,296,000
古河電気工業	1,600	1,935.00	3,096,000
住友電気工業	18,800	1,065.50	20,031,400
SUMCO	6,000	1,519.00	9,114,000
三和ホールディングス	4,700	780.00	3,666,000
日本発條	4,100	688.00	2,820,800
アマダ	8,600	885.00	7,611,000
FUJ I	1,500	1,657.00	2,485,500
オーエスジー	1,900	1,283.00	2,437,700
DMG 森精機	2,900	952.00	2,760,800
ディスコ	700	24,630.00	17,241,000
ナブテスコ	2,900	2,865.00	8,308,500
SMC	1,600	48,810.00	78,096,000
小松製作所	22,500	1,962.00	44,145,000
住友重機械工業	2,800	2,168.00	6,070,400
日立建機	2,800	2,514.00	7,039,200
ハーモニック・ドライブ・システム	700	4,765.00	3,335,500

ズ				
クボタ	25,900	1,263.50	32,724,650	
ダイキン工業	6,100	13,290.00	81,069,000	
栗田工業	2,500	2,718.00	6,795,000	
椿本チエイン	600	2,412.00	1,447,200	
ダイフク	2,400	7,170.00	17,208,000	
CKD	1,100	1,764.00	1,940,400	
ユニバーサルエンターテインメント	500	1,661.00	830,500	
セガサミーホールディングス	4,600	1,302.00	5,989,200	
日本精工	9,600	686.00	6,585,600	
ジェイテクト	4,900	738.00	3,616,200	
THK	3,100	2,420.00	7,502,000	
マキタ	5,800	3,365.00	19,517,000	
コニカミノルタ	11,300	403.00	4,553,900	
ブラザー工業	5,700	1,701.00	9,695,700	
ミネベアミツミ	9,000	1,644.00	14,796,000	
日立製作所	24,400	3,067.00	74,834,800	
三菱電機	47,300	1,295.00	61,253,500	
富士電機	3,100	2,447.00	7,585,700	
安川電機	5,800	3,255.00	18,879,000	
マブチモーター	1,200	3,200.00	3,840,000	
日本電産	10,800	5,704.00	61,603,200	
オムロン	5,100	5,850.00	29,835,000	
ルネサスエレクトロニクス	16,300	476.00	7,758,800	
セイコーエプソン	6,900	1,053.00	7,265,700	
アルバック	1,000	2,897.00	2,897,000	
パナソニック	56,000	780.60	43,713,600	
シャープ	3,900	1,185.00	4,621,500	
富士通ゼネラル	1,400	1,716.00	2,402,400	
TDK	3,300	8,830.00	29,139,000	
アルプスアルパイン	5,600	1,053.00	5,896,800	
ヒロセ電機	700	10,760.00	7,532,000	
日本航空電子工業	1,200	1,389.00	1,666,800	
アズビル	2,900	2,818.00	8,172,200	
日本光電工業	1,800	3,880.00	6,984,000	

掘場製作所	900	5,380.00	4,842,000
アドバンテスト	4,500	5,030.00	22,635,000
キーエンス	4,900	36,940.00	181,006,000
シスメックス	3,100	7,309.00	22,657,900
オプテックスグループ	700	1,106.00	774,200
レーザーテック	1,900	6,200.00	11,780,000
スタンレー電気	3,400	2,393.00	8,136,200
ファナック	5,200	14,820.00	77,064,000
ローム	2,400	6,630.00	15,912,000
浜松ホトニクス	3,700	4,635.00	17,149,500
京セラ	8,100	5,908.00	47,854,800
太陽誘電	2,900	2,922.00	8,473,800
村田製作所	14,700	5,781.00	84,980,700
小糸製作所	2,300	3,950.00	9,085,000
SCREENホールディングス	1,000	4,615.00	4,615,000
キヤノン	26,300	2,243.00	58,990,900
東京エレクトロン	4,200	23,245.00	97,629,000
トヨタ紡織	1,200	1,261.00	1,513,200
豊田自動織機	3,800	5,290.00	20,102,000
デンソー	11,300	3,744.00	42,307,200
東海理化電機製作所	1,200	1,319.00	1,582,800
日産自動車	58,100	366.20	21,276,220
いすゞ自動車	13,400	748.30	10,027,220
トヨタ自動車	27,900	6,635.00	185,116,500
日野自動車	6,600	598.00	3,946,800
三菱自動車工業	17,400	298.00	5,185,200
ケーヒン	1,100	2,504.00	2,754,400
アイシン精機	4,000	2,931.00	11,724,000
マツダ	15,200	562.00	8,542,400
スズキ	8,100	3,205.00	25,960,500
SUBARU	14,900	2,075.00	30,917,500
ヤマハ発動機	6,900	1,271.00	8,769,900
シマノ	1,900	16,120.00	30,628,000
テイ・エス テック	1,000	2,790.00	2,790,000
テルモ	14,000	3,568.00	49,952,000

島津製作所	5,500	2,809.00	15,449,500
ブイ・テクノロジー	200	3,520.00	704,000
東京精密	1,000	3,225.00	3,225,000
トプコン	2,500	824.00	2,060,000
オリンパス	27,800	1,697.00	47,176,600
HOYA	9,900	9,793.00	96,950,700
朝日インテック	5,300	2,849.00	15,099,700
バンダイナムコホールディングス	5,000	5,409.00	27,045,000
ヤマハ	3,400	4,260.00	14,484,000
ピジョン	2,900	4,035.00	11,701,500
任天堂	2,800	45,930.00	128,604,000
関西電力	18,100	1,170.50	21,186,050
東北電力	11,400	1,050.00	11,970,000
九州電力	9,800	899.00	8,810,200
イーレックス	800	1,442.00	1,153,600
東急	11,500	1,645.00	18,917,500
小田急電鉄	7,300	2,387.00	17,425,100
東日本旅客鉄道	7,900	8,134.00	64,258,600
西日本旅客鉄道	4,200	6,665.00	27,993,000
近鉄グループホールディングス	4,600	5,090.00	23,414,000
日本通運	2,000	5,040.00	10,080,000
九州旅客鉄道	4,000	3,000.00	12,000,000
S Gホールディングス	3,500	2,880.00	10,080,000
日本航空	8,800	1,940.00	17,072,000
ANAホールディングス	7,900	2,483.00	19,615,700
ネクソン	11,400	1,841.00	20,987,400
ブロードリーフ	2,200	497.00	1,093,400
野村総合研究所	8,900	2,595.00	23,095,500
Zホールディングス	34,600	393.00	13,597,800
トレンドマイクロ	3,200	5,030.00	16,096,000
日本オラクル	900	10,360.00	9,324,000
大塚商会	2,700	4,915.00	13,270,500
日本電信電話	72,700	2,510.00	182,477,000
KDDI	45,800	3,144.00	143,995,200
NTTドコモ	31,700	3,220.00	102,074,000

エヌ・ティ・ティ・データ	16,900	1,071.00	18,099,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,300	4,815.00	11,074,500
S C S K	1,300	5,410.00	7,033,000
富士ソフト	600	3,785.00	2,271,000
コナミホールディングス	2,500	3,270.00	8,175,000
ソフトバンクグループ	34,800	4,790.00	166,692,000
双日	23,800	250.00	5,950,000
第一興商	900	3,060.00	2,754,000
伊藤忠商事	33,400	2,127.50	71,058,500
日立ハイテク	1,700	7,940.00	13,498,000
三菱商事	32,700	2,185.00	71,449,500
ミスミグループ本社	5,200	2,498.00	12,989,600
ローソン	1,200	6,080.00	7,296,000
エービーシー・マート	800	5,390.00	4,312,000
アスクル	500	3,515.00	1,757,500
アダストリア	700	1,378.00	964,600
くら寿司	300	4,360.00	1,308,000
セリア	1,000	3,300.00	3,300,000
ジーンズホールディングス	300	5,690.00	1,707,000
Monotaro	3,200	3,190.00	10,208,000
マツモトキヨシホールディングス	1,800	3,795.00	6,831,000
ZOZO	5,100	1,753.00	8,940,300
物語コーポレーション	100	6,090.00	609,000
ウエルシアホールディングス	1,100	8,410.00	9,251,000
すかいらーくホールディングス	4,500	1,566.00	7,047,000
コスモス薬品	200	29,580.00	5,916,000
セブン&アイ・ホールディングス	18,900	3,621.00	68,436,900
ツルハホールディングス	900	14,740.00	13,266,000
トリドールホールディングス	1,200	1,225.00	1,470,000
クスリのアオキホールディングス	400	8,860.00	3,544,000
スシローグローバルホールディングス	2,000	1,739.00	3,478,000
良品計画	6,300	1,204.00	7,585,200
パン・パシフィック・インターナショナルホ	14,000	2,098.00	29,372,000
ゼンショーホールディングス	2,200	2,116.00	4,655,200

ユナイテッドアローズ	500	1,720.00	860,000
スギホールディングス	900	6,380.00	5,742,000
日本瓦斯	900	3,720.00	3,348,000
しまむら	500	6,660.00	3,330,000
イオン	16,100	2,178.50	35,073,850
イズミ	800	2,882.00	2,305,600
ニトリホールディングス	1,900	16,535.00	31,416,500
ファーストリテイリング	600	49,740.00	29,844,000
サンドラッグ	1,700	3,655.00	6,213,500
りそなホールディングス	54,600	318.50	17,390,100
SBIホールディングス	5,900	1,779.00	10,496,100
大和証券グループ本社	41,600	409.20	17,022,720
東京海上ホールディングス	17,300	4,843.00	83,783,900
クレディセゾン	4,000	1,107.00	4,428,000
東京センチュリー	1,000	3,600.00	3,600,000
イオンフィナンシャルサービス	2,800	1,022.00	2,861,600
オリックス	34,400	1,238.50	42,604,400
三菱UFJリース	9,800	503.00	4,929,400
ヒューリック	7,000	1,021.00	7,147,000
オープンハウス	1,600	2,260.00	3,616,000
飯田グループホールディングス	3,600	1,371.00	4,935,600
パーク24	2,800	1,536.00	4,300,800
三井不動産	23,300	1,855.00	43,221,500
イオンモール	2,600	1,267.00	3,294,200
日本空港ビルデング	900	4,140.00	3,726,000
ミクシィ	1,100	1,740.00	1,914,000
パーソルホールディングス	4,500	1,075.00	4,837,500
総合警備保障	1,300	5,440.00	7,072,000
カカクコム	3,600	2,320.00	8,352,000
ディップ	800	1,934.00	1,547,200
エムスリー	8,300	4,005.00	33,241,500
博報堂DYホールディングス	5,800	1,106.00	6,414,800
電通グループ	5,800	2,127.00	12,336,600
オリエンタルランド	4,900	14,440.00	70,756,000
リゾートトラスト	2,000	1,078.00	2,156,000

	サイバーエージェント	2,600	4,390.00	11,414,000	
	楽天	21,800	930.00	20,274,000	
	テクノプロ・ホールディングス	1,000	5,060.00	5,060,000	
	ジャパンマテリアル	1,400	1,563.00	2,188,200	
	リクルートホールディングス	29,500	2,924.00	86,258,000	
	リログループ	2,900	2,328.00	6,751,200	
	エイチ・アイ・エス	800	1,373.00	1,098,400	
	カナモト	700	2,073.00	1,451,100	
	セコム	5,500	9,087.00	49,978,500	
	小計 銘柄数：280			6,125,689,670	
	組入時価比率：97.4%			100.0%	
	合計			6,125,689,670	

(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。