



2021年7月期 (2020年7月9日～2021年7月8日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2021 (July 9, 2020 – July 8, 2021)

2021年8月18日  
 August 18, 2021

上場取引所 東証  
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 日経225連動型上場投信  
 コード番号 (1321)  
 連動対象指標 日経平均株価(日経225)  
 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 Nikkei 225 Exchange Traded Fund  
 Code: 1321  
 Underlying index: Nikkei Stock Average(Nikkei 225)  
 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9月29日  
 分配金支払開始日 2021年8月16日  
 Scheduled date of submission of securities report: September 29, 2021  
 Date of commencing dividend payment: August 16, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021年7月期の運用状況 (2020年7月9日～2021年7月8日)

Management Status for Year ended July 2021 (from July 9, 2020 to July 8, 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7月期 FY ended Jul. 2021	7,844,011	(98.4)	127,808	(1.6)	7,971,820	(100.0)
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	6,152,975	(98.4)	96,887	(1.6)	6,249,863	(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7月期 FY ended Jul. 2021	272,004	33,969	29,449	276,525
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	275,190	39,783	42,969	272,004

(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))	10口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×10) Net Asset Value per 10 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×10)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	8,131,330	159,510	7,971,820	288,285
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	6,701,745	451,882	6,249,863	229,771

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	3,650
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	3,890

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19期 (2020年7月8日現在) 19th Fiscal Year As of July 8, 2020	第20期 (2021年7月8日現在) 20th Fiscal Year As of July 8, 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	528,459,572,501	263,987,838,086
株式 Stocks	6,152,975,676,980	7,844,011,835,160
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	55,156,662	-
未収配当金 Accrued dividends receivable	8,172,313,350	7,566,896,000
未収利息 Accrued interest	53,197,248	6,619,238
その他未収収益 Other accrued revenue	868,299,729	270,688,993
差入委託証拠金 Margin deposits	11,161,300,988	15,486,900,736
流動資産合計 Total current assets	6,701,745,517,458	8,131,330,778,213
資産合計 Total assets	6,701,745,517,458	8,131,330,778,213
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	2,253,238,130	3,716,125,036
未払金 Accounts payable - other	2,194,726,100	2,914,951,276
未払収益分配金 Unpaid dividends	105,809,715,879	100,931,726,835
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,493,351,170	2,003,236,641
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	5,591,903,972	6,092,241,712
未払利息 Accrued interest expenses	379,766	197,810
有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities lent	334,474,734,538	41,847,452,428
その他未払費用	64,411,351	2,004,196,824

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	451,882,460,906	159,510,128,562
負債合計 Total liabilities	451,882,460,906	159,510,128,562
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	3,347,558,286,177	3,403,196,608,653
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,902,304,770,375	4,568,624,040,998
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	186,704,631	139,761,746
元本等合計 Total principal and other	6,249,863,056,552	7,971,820,649,651
純資産合計 Total net assets	6,249,863,056,552	7,971,820,649,651
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	6,701,745,517,458	8,131,330,778,213

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第19期 自 2019年7月9日 至 2020年7月8日 19th Fiscal Year From July 9, 2019 to July 8, 2020	第20期 自 2020年7月9日 至 2021年7月8日 20th Fiscal Year From July 9, 2020 to July 8, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	117,840,964,945	117,497,503,148
受取利息 Interest income	1,098,348	67,906
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	262,776,709,323	1,567,555,603,008
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	14,548,299,855	33,133,711,266
その他収益 Other revenue	2,249,904,566	1,289,932,436
営業収益合計 Total operating revenue	397,416,977,037	1,719,476,817,764
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△282,769,010	△93,283,165
受託者報酬 Trustee fees	3,037,058,346	3,730,049,595

委託者報酬 Investment trust management fees	11,407,479,618	11,845,853,774
その他費用 Other expenses	134,440,409	2,420,099,336
営業費用合計 Total operating expenses	14,296,209,363	17,902,719,540
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	383,120,767,674	1,701,574,098,224
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	383,120,767,674	1,701,574,098,224
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	383,120,767,674	1,701,574,098,224
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	2,667,442,759,777	2,902,304,770,375
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	372,769,151,422	517,052,534,060
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	372,769,151,422	517,052,534,060
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	415,218,192,619	451,375,634,826
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	415,218,192,619	451,375,634,826
分配金 Dividends	105,809,715,879	100,931,726,835
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	2,902,304,770,375	4,568,624,040,998

(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。

4. その他	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。 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年7月9日から2021年7月8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19期 2020年7月8日現在	第20期 2021年7月8日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 272,004,411 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 276,525,279 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 22,977.1 円 (10口当たり純資産額) (229,771 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 28,828.5 円 (10口当たり純資産額) (288,285 円)
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 313,430,542,470 円	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 39,079,532,330 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2019年7月9日 至 2020年7月8日	第20期 自 2020年7月9日 至 2021年7月8日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1" style="width: 100%;"> <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>120,374,736,869 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>200,662,014 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>120,575,398,883 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>14,578,978,373 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>105,996,420,510 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>105,809,715,879 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>186,704,631 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>272,004,411 口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>3,890 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	120,374,736,869 円	分配準備積立金	B	200,662,014 円	配当等収益合計額	C=A+B	120,575,398,883 円	経費	D	14,578,978,373 円	収益分配可能額	E=C-D	105,996,420,510 円	収益分配金	F	105,809,715,879 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	186,704,631 円	口数	H	272,004,411 口	10口当たり分配金	I=F/H×10	3,890 円	<table border="1" style="width: 100%;"> <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>118,880,786,655 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>186,704,631 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>119,067,491,286 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>17,996,002,705 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>101,071,488,581 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>100,931,726,835 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>139,761,746 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>276,525,279 口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>3,650 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	118,880,786,655 円	分配準備積立金	B	186,704,631 円	配当等収益合計額	C=A+B	119,067,491,286 円	経費	D	17,996,002,705 円	収益分配可能額	E=C-D	101,071,488,581 円	収益分配金	F	100,931,726,835 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	139,761,746 円	口数	H	276,525,279 口	10口当たり分配金	I=F/H×10	3,650 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	120,374,736,869 円																																																											
分配準備積立金	B	200,662,014 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	120,575,398,883 円																																																											
経費	D	14,578,978,373 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	105,996,420,510 円																																																											
収益分配金	F	105,809,715,879 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	186,704,631 円																																																											
口数	H	272,004,411 口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	3,890 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	118,880,786,655 円																																																											
分配準備積立金	B	186,704,631 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	119,067,491,286 円																																																											
経費	D	17,996,002,705 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	101,071,488,581 円																																																											
収益分配金	F	100,931,726,835 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	139,761,746 円																																																											
口数	H	276,525,279 口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	3,650 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19期 自 2019年7月9日 至 2020年7月8日	第20期 自 2020年7月9日 至 2021年7月8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。 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。	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 同左

<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なっております。                  ○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なっております。                  ○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。</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19期 2020年7月8日現在	第20期 2021年7月8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。                  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                  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19期 自2019年7月9日 至2020年7月8日	第20期 自2020年7月9日 至2021年7月8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。</p>	<p>同左</p>

(その他の注記)

1 元本の移動

第19期 自2019年7月9日 至2020年7月8日	第20期 自2020年7月9日 至2021年7月8日
期首元本額 3,386,771,255,708円	期首元本額 3,347,558,286,177円
期中追加設定元本額 489,617,257,480円	期中追加設定元本額 418,067,313,160円
期中一部交換元本額 528,830,227,011円	期中一部交換元本額 362,428,990,684円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第19期 自2019年7月9日 至2020年7月8日	第20期 自2020年7月9日 至2021年7月8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	268,311,805,208	1,421,317,432,826
合計	268,311,805,208	1,421,317,432,826

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19期(2020年7月8日現在)				第20期(2021年7月8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	98,476,430,988	—	96,280,480,000	△2,198,081,468	130,614,093,576	—	126,900,200,000	△3,716,125,036
合計	98,476,430,988	—	96,280,480,000	△2,198,081,468	130,614,093,576	—	126,900,200,000	△3,716,125,036

(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7月8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	10,046,000	521.00	5,233,966,000	
		マルハニチロ	1,004,600	2,349.00	2,359,805,400	貸付有価証券 1,200株
		I N P E X	4,018,400	791.00	3,178,554,400	貸付有価証券 14,300株
		コムシスホールディングス	10,046,000	3,010.00	30,238,460,000	貸付有価証券 600株
		大成建設	2,009,200	3,690.00	7,413,948,000	貸付有価証券 1,800株
		大林組	10,046,000	893.00	8,971,078,000	貸付有価証券 45,800株
		清水建設	10,046,000	867.00	8,709,882,000	貸付有価証券 312,300株
		長谷工コーポレーション	2,009,200	1,473.00	2,959,551,600	貸付有価証券 200株
		鹿島建設	5,023,000	1,414.00	7,102,522,000	貸付有価証券 1,800株
		大和ハウス工業	10,046,000	3,356.00	33,714,376,000	貸付有価証券 39,300株 (39,300株)
		積水ハウス	10,046,000	2,238.50	22,487,971,000	
日揮ホールディングス	10,046,000	1,008.00	10,126,368,000	貸付有価証券 84,200株		



日清製粉グループ本社	10,046,000	1,637.00	16,445,302,000	貸付有価証券 196,900株
明治ホールディングス	2,009,200	6,690.00	13,441,548,000	貸付有価証券 4,300株
日本ハム	5,023,000	4,240.00	21,297,520,000	貸付有価証券 67,800株
サッポロホールディングス	2,009,200	2,301.00	4,623,169,200	貸付有価証券 3,500株
アサヒグループホールディングス	10,046,000	5,145.00	51,686,670,000	貸付有価証券 203,300株
キリンホールディングス	10,046,000	2,091.00	21,006,186,000	貸付有価証券 816,300株
宝ホールディングス	10,046,000	1,347.00	13,531,962,000	
キッコーマン	10,046,000	6,870.00	69,016,020,000	貸付有価証券 79,600株
味の素	10,046,000	2,807.00	28,199,122,000	貸付有価証券 1,300株
ニチレイ	5,023,000	2,916.00	14,647,068,000	
日本たばこ産業	10,046,000	2,080.50	20,900,703,000	貸付有価証券 3,683,500株
東洋紡	1,004,600	1,293.00	1,298,947,800	
ユニチカ	1,004,600	332.00	333,527,200	貸付有価証券 2,200株
帝人	2,009,200	1,628.00	3,270,977,600	貸付有価証券 70,100株
東レ	10,046,000	713.60	7,168,825,600	貸付有価証券 1,200株
王子ホールディングス	10,046,000	630.00	6,328,980,000	貸付有価証券 400株
日本製紙	1,004,600	1,235.00	1,240,681,000	貸付有価証券 38,000株
クラレ	10,046,000	995.00	9,995,770,000	貸付有価証券 6,500株
旭化成	10,046,000	1,177.50	11,829,165,000	貸付有価証券 100株
昭和電工	1,004,600	3,135.00	3,149,421,000	貸付有価証券 31,800株
住友化学	10,046,000	557.00	5,595,622,000	
日産化学	10,046,000	5,230.00	52,540,580,000	貸付有価証券 23,300株
東ソー	5,023,000	1,954.00	9,814,942,000	
トクヤマ	2,009,200	2,219.00	4,458,414,800	
デンカ	2,009,200	3,660.00	7,353,672,000	貸付有価証券 300株
信越化学工業	10,046,000	18,015.00	180,978,690,000	
三井化学	2,009,200	3,565.00	7,162,798,000	

三菱ケミカルホールディングス	5,023,000	916.70	4,604,584,100	
宇部興産	1,004,600	2,191.00	2,201,078,600	貸付有価証券 2,300株
花王	10,046,000	6,741.00	67,720,086,000	貸付有価証券 2,500株
D I C	1,004,600	2,706.00	2,718,447,600	
富士フイルムホールディングス	10,046,000	8,197.00	82,347,062,000	貸付有価証券 91,000株
資生堂	10,046,000	7,937.00	79,735,102,000	貸付有価証券 250,900株
日東電工	10,046,000	8,050.00	80,870,300,000	貸付有価証券 1,000株
協和キリン	10,046,000	4,025.00	40,435,150,000	貸付有価証券 1,800株
武田薬品工業	10,046,000	3,650.00	36,667,900,000	貸付有価証券 183,700株
アステラス製薬	50,230,000	1,865.50	93,704,065,000	貸付有価証券 146,000株
大日本住友製薬	10,046,000	2,211.00	22,211,706,000	貸付有価証券 30,500株
塩野義製薬	10,046,000	5,775.00	58,015,650,000	
中外製薬	30,138,000	4,215.00	127,031,670,000	
エーザイ	10,046,000	10,480.00	105,282,080,000	貸付有価証券 2,100株
第一三共	30,138,000	2,271.00	68,443,398,000	
大塚ホールディングス	10,046,000	4,299.00	43,187,754,000	貸付有価証券 52,100株
出光興産	4,018,400	2,570.00	10,327,288,000	
E N E O Sホールディングス	10,046,000	462.20	4,643,261,200	貸付有価証券 3,400株
横浜ゴム	5,023,000	2,304.00	11,572,992,000	貸付有価証券 22,600株
ブリヂストン	10,046,000	5,004.00	50,270,184,000	貸付有価証券 2,700株
A G C	2,009,200	4,580.00	9,202,136,000	貸付有価証券 85,000株
日本板硝子	1,004,600	609.00	611,801,400	貸付有価証券 400株
日本電気硝子	3,013,800	2,458.00	7,407,920,400	貸付有価証券 132,200株
住友大阪セメント	1,004,600	2,960.00	2,973,616,000	貸付有価証券 22,800株
太平洋セメント	1,004,600	2,440.00	2,451,224,000	貸付有価証券 3,000株
東海カーボン	10,046,000	1,449.00	14,556,654,000	貸付有価証券 8,600株

TOTO	5,023,000	5,700.00	28,631,100,000	貸付有価証券 54,900株
日本碍子	10,046,000	1,815.00	18,233,490,000	貸付有価証券 5,100株
日本製鉄	1,004,600	1,789.50	1,797,731,700	貸付有価証券 600株
神戸製鋼所	1,004,600	689.00	692,169,400	貸付有価証券 12,200株
ジェイ エフ イー ホールディングス	1,004,600	1,257.00	1,262,782,200	貸付有価証券 2,500株
大太平洋金属	1,004,600	1,648.00	1,655,580,800	貸付有価証券 600株
日本軽金属ホールディングス	1,004,600	1,841.00	1,849,468,600	貸付有価証券 11,300株
三井金属鉱業	1,004,600	3,015.00	3,028,869,000	貸付有価証券 13,800株
東邦亜鉛	1,004,600	1,831.00	1,839,422,600	貸付有価証券 87,000株
三菱マテリアル	1,004,600	2,197.00	2,207,106,200	
住友金属鉱山	5,023,000	4,314.00	21,669,222,000	貸付有価証券 8,900株
DOWAホールディングス	2,009,200	4,320.00	8,679,744,000	
古河電気工業	1,004,600	2,708.00	2,720,456,800	貸付有価証券 1,200株
住友電気工業	10,046,000	1,555.00	15,621,530,000	貸付有価証券 2,200株
フジクラ	10,046,000	535.00	5,374,610,000	
SUMCO	1,004,600	2,670.00	2,682,282,000	貸付有価証券 206,900株
東洋製罐グループホールディングス	10,046,000	1,420.00	14,265,320,000	貸付有価証券 8,600株
日本製鋼所	2,009,200	2,722.00	5,469,042,400	貸付有価証券 3,300株
オークマ	2,009,200	5,270.00	10,588,484,000	貸付有価証券 12,500株
アマダ	10,046,000	1,091.00	10,960,186,000	貸付有価証券 8,900株
小松製作所	10,046,000	2,647.00	26,591,762,000	
住友重機械工業	2,009,200	3,095.00	6,218,474,000	貸付有価証券 14,700株
日立建機	10,046,000	3,245.00	32,599,270,000	貸付有価証券 302,100株
クボタ	10,046,000	2,207.50	22,176,545,000	貸付有価証券 94,400株
荏原製作所	2,009,200	5,480.00	11,010,416,000	貸付有価証券 300株
ダイキン工業	10,046,000	21,950.00	220,509,700,000	貸付有価証券

				4,000株
日本精工	10,046,000	907.00	9,111,722,000	貸付有価証券 85,900株
NTN	10,046,000	279.00	2,802,834,000	
ジェイテクト	10,046,000	1,113.00	11,181,198,000	貸付有価証券 1,400株
日立造船	2,009,200	763.00	1,533,019,600	貸付有価証券 3,800株
三菱重工業	1,004,600	3,225.00	3,239,835,000	
IHI	1,004,600	2,525.00	2,536,615,000	貸付有価証券 3,500株
日清紡ホールディングス	10,046,000	922.00	9,262,412,000	
コニカミノルタ	10,046,000	600.00	6,027,600,000	貸付有価証券 6,600株
ミネベアミツミ	10,046,000	3,030.00	30,439,380,000	貸付有価証券 31,000株
日立製作所	2,009,200	6,479.00	13,017,606,800	貸付有価証券 26,800株
三菱電機	10,046,000	1,465.50	14,722,413,000	
富士電機	2,009,200	5,050.00	10,146,460,000	貸付有価証券 3,000株
安川電機	10,046,000	5,540.00	55,654,840,000	貸付有価証券 107,100株
オムロン	10,046,000	9,030.00	90,715,380,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,009,200	2,726.00	5,477,079,200	貸付有価証券 6,700株
日本電気	1,004,600	5,620.00	5,645,852,000	
富士通	1,004,600	20,850.00	20,945,910,000	
沖電気工業	1,004,600	1,006.00	1,010,627,600	
セイコーエプソン	20,092,000	1,917.00	38,516,364,000	貸付有価証券 477,700株
パナソニック	10,046,000	1,304.00	13,099,984,000	貸付有価証券 200株
シャープ	10,046,000	1,788.00	17,962,248,000	貸付有価証券 1,872,600株 (173,500株)
ソニーグループ	10,046,000	10,975.00	110,254,850,000	
TDK	10,046,000	13,300.00	133,611,800,000	貸付有価証券 6,700株
アルプスアルパイン	10,046,000	1,137.00	11,422,302,000	貸付有価証券 21,800株
横河電機	10,046,000	1,624.00	16,314,704,000	貸付有価証券 30,600株
アドバンテスト	20,092,000	9,420.00	189,266,640,000	貸付有価証券 24,000株

カシオ計算機	10,046,000	1,848.00	18,565,008,000	貸付有価証券 128,100株
ファナック	10,046,000	26,585.00	267,072,910,000	貸付有価証券 500株
京セラ	20,092,000	6,711.00	134,837,412,000	貸付有価証券 500株
太陽誘電	10,046,000	5,520.00	55,453,920,000	貸付有価証券 50,300株
S C R E E Nホールディングス	2,009,200	10,220.00	20,534,024,000	貸付有価証券 22,100株
キヤノン	15,069,000	2,465.00	37,145,085,000	貸付有価証券 1,555,900株
リコー	10,046,000	1,191.00	11,964,786,000	貸付有価証券 114,400株
東京エレクトロン	10,046,000	45,670.00	458,800,820,000	貸付有価証券 3,600株
デンソー	10,046,000	7,399.00	74,330,354,000	貸付有価証券 1,000株
三井E&Sホールディングス	1,004,600	531.00	533,442,600	貸付有価証券 6,800株
川崎重工業	1,004,600	2,341.00	2,351,768,600	貸付有価証券 3,800株
日産自動車	10,046,000	578.60	5,812,615,600	貸付有価証券 300株
いすゞ自動車	5,023,000	1,468.00	7,373,764,000	貸付有価証券 1,200株
トヨタ自動車	10,046,000	9,675.00	97,195,050,000	貸付有価証券 42,100株
日野自動車	10,046,000	953.00	9,573,838,000	
三菱自動車工業	1,004,600	303.00	304,393,800	貸付有価証券 100,500株
マツダ	2,009,200	1,062.00	2,133,770,400	貸付有価証券 1,000株
本田技研工業	20,092,000	3,471.00	69,739,332,000	貸付有価証券 4,100株
スズキ	10,046,000	4,687.00	47,085,602,000	
S U B A R U	10,046,000	2,151.00	21,608,946,000	貸付有価証券 12,100株
ヤマハ発動機	10,046,000	2,798.00	28,108,708,000	貸付有価証券 717,400株
テルモ	40,184,000	4,447.00	178,698,248,000	貸付有価証券 3,400株
ニコン	10,046,000	1,086.00	10,909,956,000	貸付有価証券 600株
オリンパス	40,184,000	2,191.00	88,043,144,000	貸付有価証券 400株
シチズン時計	10,046,000	405.00	4,068,630,000	
バンダイナムコホールディングス	10,046,000	7,379.00	74,129,434,000	

インクス				
凸版印刷	5,023,000	1,732.00	8,699,836,000	
大日本印刷	5,023,000	2,372.00	11,914,556,000	貸付有価証券 6,900株
ヤマハ	10,046,000	5,960.00	59,874,160,000	貸付有価証券 18,000株
東京電力ホールディングス	1,004,600	318.00	319,462,800	
中部電力	1,004,600	1,334.50	1,340,638,700	
関西電力	1,004,600	1,050.00	1,054,830,000	貸付有価証券 6,100株
東京瓦斯	2,009,200	2,041.00	4,100,777,200	貸付有価証券 1,200株
大阪瓦斯	2,009,200	2,006.00	4,030,455,200	貸付有価証券 300株
東武鉄道	2,009,200	2,868.00	5,762,385,600	貸付有価証券 19,400株
東急	5,023,000	1,550.00	7,785,650,000	
小田急電鉄	5,023,000	2,795.00	14,039,285,000	貸付有価証券 54,600株
京王電鉄	2,009,200	6,460.00	12,979,432,000	貸付有価証券 20,900株
京成電鉄	5,023,000	3,590.00	18,032,570,000	貸付有価証券 46,600株
東日本旅客鉄道	1,004,600	8,033.00	8,069,951,800	
西日本旅客鉄道	1,004,600	6,466.00	6,495,743,600	
東海旅客鉄道	1,004,600	17,165.00	17,243,959,000	
日本通運	1,004,600	8,100.00	8,137,260,000	貸付有価証券 200株
ヤマトホールディングス	10,046,000	3,285.00	33,001,110,000	貸付有価証券 400株
日本郵船	1,004,600	5,390.00	5,414,794,000	
商船三井	1,004,600	5,060.00	5,083,276,000	貸付有価証券 2,700株
川崎汽船	1,004,600	3,730.00	3,747,158,000	貸付有価証券 300株
A N Aホールディングス	1,004,600	2,720.00	2,732,512,000	貸付有価証券 400株
三菱倉庫	5,023,000	3,225.00	16,199,175,000	貸付有価証券 47,900株
ネクソン	20,092,000	2,308.00	46,372,336,000	貸付有価証券 113,200株
Zホールディングス	4,018,400	559.10	2,246,687,440	
トレンドマイクロ	10,046,000	5,800.00	58,266,800,000	貸付有価証券 5,800株
スカパーJ S A Tホール	1,004,600	405.00	406,863,000	貸付有価証券

ディングス				7,900株
日本電信電話	4,018,400	2,844.00	11,428,329,600	貸付有価証券 34,000株
KDDI	60,276,000	3,466.00	208,916,616,000	
ソフトバンク	10,046,000	1,450.00	14,566,700,000	
東宝	1,004,600	4,555.00	4,575,953,000	貸付有価証券 500株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	50,230,000	1,727.00	86,747,210,000	貸付有価証券 500株
コナミホールディングス	10,046,000	6,250.00	62,787,500,000	貸付有価証券 30,200株
ソフトバンクグループ	60,276,000	7,380.00	444,836,880,000	
双日	1,004,600	334.00	335,536,400	貸付有価証券 700株
伊藤忠商事	10,046,000	3,188.00	32,026,648,000	
丸紅	10,046,000	942.30	9,466,345,800	
豊田通商	10,046,000	5,120.00	51,435,520,000	貸付有価証券 300株
三井物産	10,046,000	2,528.00	25,396,288,000	
住友商事	10,046,000	1,469.50	14,762,597,000	貸付有価証券 1,400株
三菱商事	10,046,000	3,066.00	30,801,036,000	
J. フロント リテイリ ング	5,023,000	995.00	4,997,885,000	貸付有価証券 6,400株
三越伊勢丹ホールディ ングス	10,046,000	796.00	7,996,616,000	貸付有価証券 157,900株
セブン&アイ・ホールデ ィングス	10,046,000	5,124.00	51,475,704,000	貸付有価証券 36,600株
高島屋	5,023,000	1,241.00	6,233,543,000	貸付有価証券 500株
丸井グループ	10,046,000	2,018.00	20,272,828,000	貸付有価証券 39,800株
イオン	10,046,000	2,896.50	29,098,239,000	貸付有価証券 1,300株
ファーストリテイリング	10,046,000	79,900.00	802,675,400,000	貸付有価証券 9,800株
コンコルディア・フィナ ンシャルグループ	10,046,000	393.00	3,948,078,000	貸付有価証券 148,500株
新生銀行	1,004,600	1,433.00	1,439,591,800	貸付有価証券 5,400株
あおぞら銀行	1,004,600	2,483.00	2,494,421,800	
三菱UFJフィナンシャ ル・グループ	10,046,000	586.70	5,893,988,200	
りそなホールディングス	1,004,600	416.70	418,616,820	
三井住友トラスト・ホ ールディングス	1,004,600	3,510.00	3,526,146,000	

三井住友フィナンシャルグループ	1,004,600	3,749.00	3,766,245,400	
千葉銀行	10,046,000	637.00	6,399,302,000	貸付有価証券 289,100株
ふくおかフィナンシャルグループ	2,009,200	1,857.00	3,731,084,400	貸付有価証券 3,100株
静岡銀行	10,046,000	821.00	8,247,766,000	貸付有価証券 96,400株
みずほフィナンシャルグループ	1,004,600	1,559.50	1,566,673,700	貸付有価証券 1,000株
大和証券グループ本社	10,046,000	557.40	5,599,640,400	
野村ホールディングス	10,046,000	544.50	5,470,047,000	
松井証券	10,046,000	799.00	8,026,754,000	貸付有価証券 13,400株
SOMPOホールディングス	2,511,500	4,285.00	10,761,777,500	
MS&ADインシュアランスグループホール	3,013,800	3,279.00	9,882,250,200	貸付有価証券 21,500株
第一生命ホールディングス	1,004,600	1,921.00	1,929,836,600	
東京海上ホールディングス	5,023,000	5,094.00	25,587,162,000	貸付有価証券 200株
T&Dホールディングス	2,009,200	1,393.00	2,798,815,600	貸付有価証券 2,800株
クレディセゾン	10,046,000	1,313.00	13,190,398,000	貸付有価証券 31,200株
日本取引所グループ	10,046,000	2,416.00	24,271,136,000	
東急不動産ホールディングス	10,046,000	651.00	6,539,946,000	貸付有価証券 22,700株
三井不動産	10,046,000	2,628.00	26,400,888,000	
三菱地所	10,046,000	1,757.50	17,655,845,000	
東京建物	5,023,000	1,656.00	8,318,088,000	貸付有価証券 103,600株
住友不動産	10,046,000	3,875.00	38,928,250,000	貸付有価証券 14,900株
エムスリー	24,110,400	7,757.00	187,024,372,800	貸付有価証券 5,100株
ディー・エヌ・エー	3,013,800	2,241.00	6,753,925,800	貸付有価証券 82,600株
電通グループ	10,046,000	3,990.00	40,083,540,000	貸付有価証券 236,000株
サイバーエージェント	8,036,800	2,295.00	18,444,456,000	貸付有価証券 257,600株
楽天グループ	10,046,000	1,259.00	12,647,914,000	貸付有価証券 709,200株
リクルートホールディングス	30,138,000	5,538.00	166,904,244,000	



	日本郵政	10,046,000	910.20	9,143,869,200	貸付有価証券 32,000株
	セコム	10,046,000	8,401.00	84,396,446,000	貸付有価証券 200株
	小計 銘柄数：225 組入時価比率：98.4%			7,844,011,835,160 100.0%	
	合計			7,844,011,835,160	

(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。

(注2) 備考欄の貸付有価証券の( )内は、委託者の利害関係人である野村證券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(2021年7月8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。