



2021年4月期 (2020年10月8日～2021年4月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2021 (October 8, 2020 - April 7, 2021)

2021年5月19日
 May 19, 2021

		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	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 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:	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6月29日
 分配金支払開始日 2021年5月14日
 Scheduled date of submission of securities report: June 29, 2021
 Date of commencing dividend payment: May 14, 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8日～2021年4月7日)

Management Status for Year ended April 2021 (from October 8, 2020 to April 7, 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	3,059	(98.1)	59	(1.9)	3,119	(100.0)
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	2,389	(96.6)	83	(3.4)	2,472	(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	154	0	0	154
2020年10月期 FY ended Oct. 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
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	3,164	45	3,119	20,250
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	2,505	32	2,472	16,053

(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	246
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	175

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14期 (2020年10月7日現在) 14th Fiscal Year As of October 7, 2020	第15期 (2021年4月7日現在) 15th Fiscal Year As of April 7, 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	79,681,091	60,094,181
株式 Stocks	2,389,527,290	3,059,641,900
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,526,080	656,040
未収入金 Accounts receivable - other	758,780	1,156,340
未収配当金 Accrued dividends receivable	30,514,364	39,385,153
差入委託証拠金 Margin deposits	3,048,099	3,421,499
流動資産合計 Total current assets	2,505,055,704	3,164,355,113
資産合計 Total assets	2,505,055,704	3,164,355,113
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	262,479	193,589
未払収益分配金 Unpaid dividends	26,954,900	37,890,888
未払受託者報酬 Trustee fees payable	655,002	758,606
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	3,274,924	3,792,972
未払利息 Accrued interest expenses	33	23
その他未払費用 Other accrued expenses	1,300,130	2,680,187
流動負債合計 Total current liabilities	32,447,468	45,316,265
負債合計 Total liabilities	32,447,468	45,316,265
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	419,569,024	1,065,999,636
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	136,742	104,688
元本等合計 Total principal and other	2,472,608,236	3,119,038,848
純資産合計 Total net assets	2,472,608,236	3,119,038,848
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	2,505,055,704	3,164,355,113

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	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	第15期 自 2020年10月8日 至 2021年4月7日 15th Fiscal Year From October 8, 2020 to April 7, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	32,203,134	43,927,277
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	254,059,226	633,785,756
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	11,738,551	12,676,910
その他収益 Other revenue	24,800	7,363
営業収益合計 Total operating revenue	298,025,711	690,397,306
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	12,686	7,460
受託者報酬 Trustee fees	655,002	758,606
委託者報酬 Investment trust management fees	3,274,924	3,792,972
その他費用 Other expenses	1,318,222	1,516,768
営業費用合計 Total operating expenses	5,260,834	6,075,806
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	292,764,877	684,321,500
経常利益又は経常損失 (△)	292,764,877	684,321,500

Ordinary profit (loss)		
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	292,764,877	684,321,500
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	153,759,047	419,569,024
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	26,954,900	37,890,888
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	419,569,024	1,065,999,636

(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8日から2021年4月7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14期 2020年10月7日現在	第15期 2021年4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 16,053 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 20,250 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期	第15期
------	------

自 2020年4月8日 至 2020年10月7日			自 2020年10月8日 至 2021年4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	32,215,248円	当期配当等収益額	A	43,927,180円
分配準備積立金	B	124,542円	分配準備積立金	B	136,742円
配当等収益合計額	C=A+B	32,339,790円	配当等収益合計額	C=A+B	44,063,922円
経費	D	5,248,148円	経費	D	6,068,346円
収益分配可能額	E=C-D	27,091,642円	収益分配可能額	E=C-D	37,995,576円
収益分配金	F	26,954,900円	収益分配金	F	37,890,888円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	136,742円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	104,688円
口数	H	154,028口	口数	H	154,028口
1口当たり分配金	I=F/H	175円	1口当たり分配金	I=F/H	246円
2. その他費用 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。			2. その他費用 その他費用のうち1,365,425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14期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日	第15期 自 2020年10月8日 至 2021年4月7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。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
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。	
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。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左
○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。	

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第14期 2020年10月7日現在	第15期 2021年4月7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	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左

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。	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14期 自 2020年 4月 8日 至 2020年 10月 7日	第15期 自 2020年 10月 8日 至 2021年 4月 7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14期 自 2020年 4月 8日 至 2020年 10月 7日	第15期 自 2020年 10月 8日 至 2021年 4月 7日
期首元本額	2,053,039,212 円
期中追加設定元本額	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14期 自 2020年 4月 8日 至 2020年 10月 7日	第15期 自 2020年 10月 8日 至 2021年 4月 7日
	損益に含まれた評価差額 (円)	
株式	251,972,271	620,043,437
合計	251,972,271	620,043,437

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14期(2020年10月7日現在)				第15期(2021年4月7日現在)			
	契約額等 (円)	うち1年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	81,080,899	-	82,350,000	1,263,601	58,514,249	-	58,980,000	462,451
合計	81,080,899	-	82,350,000	1,263,601	58,514,249	-	58,980,000	462,451

(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	3,100	533.00	1,652,300	
		マルハニチロ	500	2,640.00	1,320,000	
		I N P E X	11,300	769.00	8,689,700	
		石油資源開発	600	2,089.00	1,253,400	
		ミライト・ホールディングス	600	1,832.00	1,099,200	
		安藤・間	1,100	884.00	972,400	
		コムシスホールディングス	600	3,435.00	2,061,000	
		大成建設	1,500	4,215.00	6,322,500	
		大林組	6,100	1,054.00	6,429,400	
		清水建設	4,500	910.00	4,095,000	
		長谷工コーポレーション	1,800	1,607.00	2,892,600	
		鹿島建設	3,600	1,569.00	5,648,400	
		西松建設	400	2,814.00	1,125,600	
		三井住友建設	1,500	499.00	748,500	
		前田建設工業	900	989.00	890,100	
		奥村組	300	2,876.00	862,800	
		戸田建設	1,400	812.00	1,136,800	
		熊谷組	300	3,055.00	916,500	
		大東建託	700	13,160.00	9,212,000	
		N I P P O	300	3,025.00	907,500	
		五洋建設	1,700	898.00	1,526,600	
		住友林業	1,100	2,433.00	2,676,300	
		大和ハウス工業	3,800	3,203.00	12,171,400	
		積水ハウス	4,400	2,347.50	10,329,000	
		関電工	900	956.00	860,400	
		きんでん	800	1,906.00	1,524,800	
		協和エクシオ	500	2,996.00	1,498,000	
九電工	300	4,195.00	1,258,500			
日揮ホールディングス	2,000	1,323.00	2,646,000			
大気社	200	3,135.00	627,000			

ニッポン	400	1,639.00	655,600
日清製粉グループ本社	1,000	1,847.00	1,847,000
森永製菓	200	3,910.00	782,000
江崎グリコ	200	4,455.00	891,000
山崎製パン	800	1,746.00	1,396,800
カルビー	300	2,811.00	843,300
森永乳業	200	5,730.00	1,146,000
ヤクルト本社	300	5,570.00	1,671,000
明治ホールディングス	500	6,970.00	3,485,000
雪印メグミルク	400	2,290.00	916,000
プリマハム	200	3,525.00	705,000
日本ハム	700	4,945.00	3,461,500
伊藤ハム米久ホールディングス	1,400	740.00	1,036,000
サッポロホールディングス	500	2,290.00	1,145,000
アサヒグループホールディングス	1,700	4,725.00	8,032,500
キリンホールディングス	4,400	2,090.00	9,196,000
宝ホールディングス	600	1,513.00	907,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	1,200	1,825.00	2,190,000
サントリー食品インターナショナル	700	3,930.00	2,751,000
伊藤園	200	6,500.00	1,300,000
日清オイリオグループ	300	3,260.00	978,000
不二製油グループ本社	200	3,010.00	602,000
キッコーマン	300	6,640.00	1,992,000
味の素	2,200	2,228.50	4,902,700
キューピー	700	2,630.00	1,841,000
ハウス食品グループ本社	200	3,650.00	730,000
カゴメ	200	3,480.00	696,000
ニチレイ	500	2,859.00	1,429,500
東洋水産	300	4,650.00	1,395,000
日清食品ホールディングス	200	8,100.00	1,620,000
日本たばこ産業	6,300	2,088.50	13,157,550
東洋紡	700	1,470.00	1,029,000
帝人	1,800	1,885.00	3,393,000
東レ	13,700	702.30	9,621,510
ワコールホールディングス	400	2,486.00	994,400

オンワードホールディングス	2,400	315.00	756,000
王子ホールディングス	8,000	730.00	5,840,000
日本製紙	1,400	1,340.00	1,876,000
北越コーポレーション	2,100	585.00	1,228,500
大王製紙	400	1,932.00	772,800
レンゴー	1,400	950.00	1,330,000
クラレ	2,800	1,254.00	3,511,200
旭化成	8,800	1,248.50	10,986,800
昭和電工	1,700	3,420.00	5,814,000
住友化学	18,900	573.00	10,829,700
日産化学	300	6,110.00	1,833,000
クレハ	100	7,780.00	778,000
日本曹達	200	3,545.00	709,000
東ソー	2,000	2,142.00	4,284,000
トクヤマ	500	2,899.00	1,449,500
セントラル硝子	300	2,406.00	721,800
東亜合成	600	1,313.00	787,800
デンカ	600	4,435.00	2,661,000
信越化学工業	900	19,010.00	17,109,000
エア・ウォーター	1,100	1,936.00	2,129,600
日本酸素ホールディングス	600	2,160.00	1,296,000
日本触媒	200	6,450.00	1,290,000
カネカ	500	4,500.00	2,250,000
三菱瓦斯化学	1,300	2,719.00	3,534,700
三井化学	1,600	3,590.00	5,744,000
J S R	900	3,535.00	3,181,500
東京応化工業	100	7,720.00	772,000
三菱ケミカルホールディングス	23,700	843.50	19,990,950
ダイセル	3,300	878.00	2,897,400
住友ベークライト	200	4,565.00	913,000
積水化学工業	2,500	2,118.00	5,295,000
日本ゼオン	700	1,738.00	1,216,600
アイカ工業	200	4,090.00	818,000
宇部興産	1,400	2,358.00	3,301,200
日本化薬	1,100	1,056.00	1,161,600

ADEKA	500	2,350.00	1,175,000
日油	200	5,990.00	1,198,000
花王	1,300	7,434.00	9,664,200
日本ペイントホールディングス	700	1,613.00	1,129,100
関西ペイント	400	2,908.00	1,163,200
DIC	700	3,005.00	2,103,500
東洋インキSCホールディングス	400	2,118.00	847,200
富士フイルムホールディングス	1,900	6,569.00	12,481,100
資生堂	600	7,483.00	4,489,800
ライオン	600	2,212.00	1,327,200
コーセー	100	16,090.00	1,609,000
ポーラ・オルビスホールディングス	300	2,688.00	806,400
小林製薬	100	10,260.00	1,026,000
日東電工	900	9,720.00	8,748,000
ニフコ	400	4,050.00	1,620,000
ユニ・チャーム	500	4,660.00	2,330,000
協和キリン	500	3,250.00	1,625,000
武田薬品工業	3,800	3,826.00	14,538,800
アステラス製薬	10,100	1,654.00	16,705,400
大日本住友製薬	600	1,902.00	1,141,200
塩野義製薬	900	5,782.00	5,203,800
中外製薬	400	4,388.00	1,755,200
科研製薬	200	4,360.00	872,000
エーザイ	500	7,379.00	3,689,500
ロート製薬	200	2,932.00	586,400
小野薬品工業	700	2,788.00	1,951,600
久光製薬	200	6,950.00	1,390,000
参天製薬	800	1,508.00	1,206,400
ツムラ	200	3,960.00	792,000
第一三共	2,400	3,001.00	7,202,400
キョーリン製薬ホールディングス	300	1,916.00	574,800
大塚ホールディングス	1,600	4,565.00	7,304,000
大正製薬ホールディングス	100	7,030.00	703,000
サワイグループホールディングス	200	5,210.00	1,042,000
出光興産	2,500	2,755.00	6,887,500

E N E O Sホールディングス	64,100	488.40	31,306,440
コスモエネルギーホールディングス	1,500	2,525.00	3,787,500
横浜ゴム	1,200	1,982.00	2,378,400
TOYO TIRE	500	1,957.00	978,500
ブリヂストン	5,600	4,431.00	24,813,600
住友ゴム工業	2,600	1,318.00	3,426,800
AGC	1,900	4,745.00	9,015,500
日本板硝子	2,600	612.00	1,591,200
日本電気硝子	800	2,694.00	2,155,200
住友大阪セメント	400	3,645.00	1,458,000
太平洋セメント	1,300	2,873.00	3,734,900
東海カーボン	600	1,883.00	1,129,800
TOTO	500	6,610.00	3,305,000
日本碍子	1,500	2,061.00	3,091,500
日本特殊陶業	1,000	1,862.00	1,862,000
ニチアス	300	2,762.00	828,600
日本製鉄	16,600	1,919.00	31,855,400
神戸製鋼所	9,300	774.00	7,198,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	12,000	1,343.00	16,116,000
東京製鐵	800	911.00	728,800
大和工業	200	3,355.00	671,000
丸一鋼管	300	2,563.00	768,900
大同特殊鋼	300	4,920.00	1,476,000
日立金属	1,300	1,813.00	2,356,900
日本軽金属ホールディングス	900	2,208.00	1,987,200
三井金属鉱業	600	3,970.00	2,382,000
三菱マテリアル	2,000	2,634.00	5,268,000
住友金属鉱山	1,200	4,984.00	5,980,800
DOWAホールディングス	400	4,825.00	1,930,000
UACJ	500	2,634.00	1,317,000
古河電気工業	800	3,005.00	2,404,000
住友電気工業	9,500	1,680.00	15,960,000
フジクラ	5,200	549.00	2,854,800
リョービ	500	1,704.00	852,000
SUMCO	1,400	2,793.00	3,910,200

東洋製罐グループホールディングス	2,200	1,389.00	3,055,800
三和ホールディングス	1,100	1,432.00	1,575,200
L I X I L	1,900	3,210.00	6,099,000
リンナイ	100	12,090.00	1,209,000
ジーテクト	500	1,530.00	765,000
東プレ	600	1,592.00	955,200
日本発條	2,500	822.00	2,055,000
日本製鋼所	300	2,699.00	809,700
オークマ	100	6,510.00	651,000
アマダ	2,300	1,221.00	2,808,300
F U J I	300	2,948.00	884,400
牧野フライス製作所	200	4,455.00	891,000
オーエスジー	500	1,998.00	999,000
DMG森精機	1,200	1,799.00	2,158,800
ナブテスコ	300	5,360.00	1,608,000
S M C	100	64,730.00	6,473,000
小松製作所	4,400	3,423.00	15,061,200
住友重機械工業	1,000	3,290.00	3,290,000
日立建機	500	3,480.00	1,740,000
クボタ	3,600	2,446.50	8,807,400
荏原製作所	600	5,040.00	3,024,000
ダイキン工業	500	22,505.00	11,252,500
栗田工業	400	4,810.00	1,924,000
椿本チエイン	300	3,055.00	916,500
ダイフク	100	11,280.00	1,128,000
フジテック	200	2,302.00	460,400
平和	300	1,823.00	546,900
SANKYO	500	2,919.00	1,459,500
アマノ	200	2,681.00	536,200
グローリー	400	2,361.00	944,400
セガサミーホールディングス	1,000	1,641.00	1,641,000
T P R	400	1,645.00	658,000
ホシザキ	100	10,250.00	1,025,000
日本精工	3,700	1,112.00	4,114,400
N T N	6,700	341.00	2,284,700

ジェイテクト	3,200	1,135.00	3,632,000
THK	600	3,955.00	2,373,000
マキタ	500	4,805.00	2,402,500
日立造船	1,600	833.00	1,332,800
三菱重工業	4,900	3,378.00	16,552,200
IHI	1,800	2,205.00	3,969,000
日清紡ホールディングス	1,900	875.00	1,662,500
イビデン	300	5,340.00	1,602,000
コニカミノルタ	11,100	593.00	6,582,300
ブラザー工業	1,900	2,441.00	4,637,900
ミネベアミツミ	1,600	2,889.00	4,622,400
日立製作所	8,600	5,046.00	43,395,600
東芝	4,600	4,530.00	20,838,000
三菱電機	11,600	1,670.50	19,377,800
富士電機	700	4,870.00	3,409,000
安川電機	400	5,800.00	2,320,000
マブチモーター	200	4,845.00	969,000
日本電産	500	13,940.00	6,970,000
JVCケンウッド	4,800	231.00	1,108,800
オムロン	600	9,000.00	5,400,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	600	3,070.00	1,842,000
日本電気	1,100	6,660.00	7,326,000
富士通	800	16,810.00	13,448,000
沖電気工業	900	1,188.00	1,069,200
ルネサスエレクトロニクス	2,200	1,270.00	2,794,000
セイコーエプソン	3,200	1,800.00	5,760,000
アルバック	200	5,050.00	1,010,000
パナソニック	22,000	1,405.00	30,910,000
シャープ	1,400	1,912.00	2,676,800
アンリツ	200	2,452.00	490,400
ソニーグループ	3,900	12,165.00	47,443,500
TDK	500	16,640.00	8,320,000
アルプスアルパイン	2,400	1,450.00	3,480,000
フォスター電機	500	1,285.00	642,500
ホシデン	600	1,132.00	679,200

ヒロセ電機	100	17,430.00	1,743,000
日本航空電子工業	400	1,777.00	710,800
横河電機	900	2,080.00	1,872,000
アズビル	300	4,760.00	1,428,000
日本光電工業	200	3,225.00	645,000
堀場製作所	100	7,190.00	719,000
アドバンテスト	300	10,920.00	3,276,000
キーエンス	100	50,500.00	5,050,000
シスメックス	100	11,600.00	1,160,000
スタンレー電気	700	3,325.00	2,327,500
ウシオ電機	600	1,493.00	895,800
カシオ計算機	1,000	2,066.00	2,066,000
ファナック	500	27,680.00	13,840,000
ローム	400	11,660.00	4,664,000
浜松ホトニクス	200	6,550.00	1,310,000
京セラ	1,400	7,140.00	9,996,000
太陽誘電	400	5,620.00	2,248,000
村田製作所	1,300	9,194.00	11,952,200
小糸製作所	500	7,340.00	3,670,000
S C R E E Nホールディングス	100	10,930.00	1,093,000
キヤノン	11,300	2,519.50	28,470,350
リコー	7,200	1,170.00	8,424,000
東京エレクトロン	400	49,250.00	19,700,000
トヨタ紡織	700	1,897.00	1,327,900
ユニプレス	1,200	1,085.00	1,302,000
豊田自動織機	700	9,720.00	6,804,000
デンソー	3,200	7,259.00	23,228,800
東海理化電機製作所	700	1,878.00	1,314,600
三井E&Sホールディングス	1,500	552.00	828,000
川崎重工業	2,200	2,617.00	5,757,400
日産自動車	65,900	578.20	38,103,380
いすゞ自動車	6,100	1,200.00	7,320,000
トヨタ自動車	10,600	8,487.00	89,962,200
日野自動車	3,300	918.00	3,029,400
三菱自動車工業	13,900	308.00	4,281,200

武蔵精密工業	500	2,007.00	1,003,500
日産車体	900	810.00	729,000
新明和工業	700	1,011.00	707,700
タチエス	600	1,267.00	760,200
NOK	1,500	1,459.00	2,188,500
フタバ産業	1,000	603.00	603,000
KYB	300	2,995.00	898,500
プレス工業	2,100	347.00	728,700
アイシン	2,200	4,065.00	8,943,000
マツダ	14,600	899.00	13,125,400
本田技研工業	18,000	3,259.00	58,662,000
スズキ	2,600	4,850.00	12,610,000
SUBARU	6,600	2,129.00	14,051,400
ヤマハ発動機	3,100	2,745.00	8,509,500
エクセディ	500	1,664.00	832,000
豊田合成	600	2,887.00	1,732,200
日本精機	600	1,282.00	769,200
エフ・シー・シー	300	1,864.00	559,200
シマノ	100	25,785.00	2,578,500
テイ・エス テック	1,100	1,645.00	1,809,500
テルモ	900	3,911.00	3,519,900
島津製作所	500	4,085.00	2,042,500
東京精密	100	5,630.00	563,000
ニコン	5,100	1,087.00	5,543,700
トプコン	500	1,392.00	696,000
オリンパス	1,500	2,206.00	3,309,000
HOYA	600	13,400.00	8,040,000
シチズン時計	4,700	388.00	1,823,600
ニプロ	800	1,318.00	1,054,400
バンダイナムコホールディングス	400	8,105.00	3,242,000
パイロットコーポレーション	200	3,540.00	708,000
タカラトミー	700	1,008.00	705,600
凸版印刷	2,800	1,947.00	5,451,600
大日本印刷	2,200	2,290.00	5,038,000
アシックス	900	1,805.00	1,624,500

ヤマハ	400	6,250.00	2,500,000
ピジョン	200	4,095.00	819,000
リンテック	300	2,581.00	774,300
任天堂	100	63,800.00	6,380,000
コクヨ	600	1,738.00	1,042,800
東京電力ホールディングス	58,800	353.00	20,756,400
中部電力	7,800	1,360.00	10,608,000
関西電力	9,500	1,134.00	10,773,000
中国電力	2,300	1,322.00	3,040,600
北陸電力	2,200	742.00	1,632,400
東北電力	7,300	1,025.00	7,482,500
四国電力	2,400	838.00	2,011,200
九州電力	6,300	1,054.00	6,640,200
北海道電力	4,800	482.00	2,313,600
沖縄電力	500	1,494.00	747,000
電源開発	2,100	1,881.00	3,950,100
東京瓦斯	3,500	2,345.00	8,207,500
大阪瓦斯	2,800	2,087.00	5,843,600
東邦瓦斯	300	6,490.00	1,947,000
東武鉄道	800	2,951.00	2,360,800
相鉄ホールディングス	300	2,440.00	732,000
東急	2,500	1,443.00	3,607,500
京浜急行電鉄	700	1,569.00	1,098,300
小田急電鉄	700	2,974.00	2,081,800
京王電鉄	200	7,280.00	1,456,000
京成電鉄	400	3,550.00	1,420,000
東日本旅客鉄道	2,400	7,575.00	18,180,000
西日本旅客鉄道	1,400	6,051.00	8,471,400
東海旅客鉄道	600	16,080.00	9,648,000
西武ホールディングス	1,400	1,183.00	1,656,200
西日本鉄道	200	2,930.00	586,000
近鉄グループホールディングス	600	4,150.00	2,490,000
阪急阪神ホールディングス	1,100	3,480.00	3,828,000
南海電気鉄道	500	2,527.00	1,263,500
京阪ホールディングス	300	4,440.00	1,332,000

名古屋鉄道	800	2,585.00	2,068,000
日本通運	700	8,200.00	5,740,000
ヤマトホールディングス	1,400	3,095.00	4,333,000
山九	300	4,890.00	1,467,000
センコーグループホールディングス	800	1,059.00	847,200
ニッコンホールディングス	400	2,241.00	896,400
セイノーホールディングス	1,200	1,559.00	1,870,800
日立物流	200	3,710.00	742,000
九州旅客鉄道	900	2,498.00	2,248,200
S Gホールディングス	700	2,542.00	1,779,400
日本郵船	1,900	3,960.00	7,524,000
商船三井	1,400	4,120.00	5,768,000
川崎汽船	500	2,679.00	1,339,500
日本航空	5,000	2,427.00	12,135,000
ANAホールディングス	3,200	2,514.00	8,044,800
三菱倉庫	200	3,330.00	666,000
住友倉庫	400	1,487.00	594,800
上組	700	2,185.00	1,529,500
近鉄エクスプレス	200	2,819.00	563,800
T I S	600	2,589.00	1,553,400
ネクソン	600	3,545.00	2,127,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	500	2,234.00	1,117,000
野村総合研究所	800	3,350.00	2,680,000
フジ・メディア・ホールディングス	2,000	1,349.00	2,698,000
Zホールディングス	9,100	557.70	5,075,070
トレンドマイクロ	300	5,530.00	1,659,000
日本オラクル	100	10,740.00	1,074,000
伊藤忠テクノソリューションズ	200	3,550.00	710,000
大塚商会	300	5,140.00	1,542,000
ネットワンシステムズ	100	3,505.00	350,500
日本ユニシス	300	3,435.00	1,030,500
T B Sホールディングス	600	2,221.00	1,332,600
日本テレビホールディングス	1,400	1,444.00	2,021,600
テレビ朝日ホールディングス	400	2,053.00	821,200
日本電信電話	27,600	2,851.00	78,687,600

KDD I	11,500	3,481.00	40,031,500
ソフトバンク	18,800	1,427.50	26,837,000
東宝	200	4,645.00	929,000
エヌ・ティ・ティ・データ	2,900	1,703.00	4,938,700
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	6,240.00	1,248,000
SCSK	200	6,490.00	1,298,000
コナミホールディングス	300	6,630.00	1,989,000
ソフトバンクグループ	6,800	10,000.00	68,000,000
あらた	200	4,760.00	952,000
双日	16,500	314.00	5,181,000
アルフレッサ ホールディングス	1,800	2,108.00	3,794,400
ダイワボウホールディングス	700	1,651.00	1,155,700
マクニカ・富士エレホールディングス	500	2,282.00	1,141,000
シップヘルスケアホールディングス	300	3,065.00	919,500
三菱食品	200	3,065.00	613,000
第一興商	200	4,305.00	861,000
メディパルホールディングス	2,100	2,170.00	4,557,000
伊藤忠商事	7,500	3,590.00	26,925,000
丸紅	28,200	922.90	26,025,780
長瀬産業	1,300	1,769.00	2,299,700
豊田通商	2,800	4,830.00	13,524,000
兼松	1,000	1,483.00	1,483,000
三井物産	12,700	2,342.50	29,749,750
山善	500	1,052.00	526,000
住友商事	12,700	1,580.00	20,066,000
三菱商事	12,400	3,113.00	38,601,200
キヤノンマーケティングジャパン	400	2,540.00	1,016,000
阪和興業	800	3,385.00	2,708,000
岩谷産業	300	6,770.00	2,031,000
三愛石油	800	1,283.00	1,026,400
稲畑産業	700	1,674.00	1,171,800
東邦ホールディングス	700	2,006.00	1,404,200
サンゲツ	400	1,636.00	654,400
伊藤忠エネクス	800	1,104.00	883,200

リョーサン	400	2,258.00	903,200
PAL TAC	200	5,860.00	1,172,000
日鉄物産	400	4,030.00	1,612,000
オートバックスセブン	600	1,509.00	905,400
加藤産業	200	3,510.00	702,000
因幡電機産業	300	2,709.00	812,700
ミスミグループ本社	400	3,220.00	1,288,000
スズケン	800	4,165.00	3,332,000
ローソン	400	5,430.00	2,172,000
エービーシー・マート	100	6,130.00	613,000
ゲオホールディングス	400	1,202.00	480,800
アダストリア	400	1,964.00	785,600
日本マクドナルドホールディングス	100	5,110.00	511,000
エディオン	1,400	1,220.00	1,708,000
ビックカメラ	700	1,306.00	914,200
DCMホールディングス	600	1,154.00	692,400
J. フロント リテイリング	2,500	1,023.00	2,557,500
マツモトキヨシホールディングス	400	4,810.00	1,924,000
ココカラファイン	100	8,380.00	838,000
三越伊勢丹ホールディングス	5,300	758.00	4,017,400
ウエルシアホールディングス	200	3,870.00	774,000
すかいらーくホールディングス	1,000	1,718.00	1,718,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	600	1,168.00	700,800
コスモス薬品	100	17,190.00	1,719,000
セブン&アイ・ホールディングス	5,700	4,538.00	25,866,600
ツルハホールディングス	100	14,050.00	1,405,000
FOOD & LIFE COMP ANIE	200	5,220.00	1,044,000
ノジマ	200	2,875.00	575,000
良品計画	900	2,594.00	2,334,600
コーナン商事	200	3,275.00	655,000
パン・パシフィック・インターナシ ョナルホ	700	2,595.00	1,816,500
ゼンショーホールディングス	300	3,005.00	901,500
スギホールディングス	200	8,900.00	1,780,000
上新電機	200	3,155.00	631,000

日本瓦斯	300	1,920.00	576,000
コメリ	200	3,085.00	617,000
青山商事	2,100	862.00	1,810,200
しまむら	200	11,600.00	2,320,000
高島屋	2,500	1,160.00	2,900,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,100	846.00	1,776,600
丸井グループ	700	2,098.00	1,468,600
イオン	3,000	3,276.00	9,828,000
イズミ	200	4,310.00	862,000
平和堂	300	2,351.00	705,300
ヤオコー	100	6,890.00	689,000
ケーズホールディングス	1,600	1,577.00	2,523,200
アインホールディングス	100	7,340.00	734,000
ヤマダホールディングス	6,600	606.00	3,999,600
ニトリホールディングス	100	20,245.00	2,024,500
アークス	500	2,387.00	1,193,500
バローホールディングス	300	2,491.00	747,300
サンドラッグ	400	4,015.00	1,606,000
めぶきフィナンシャルグループ	19,200	257.00	4,934,400
九州フィナンシャルグループ	2,000	473.00	946,000
ゆうちょ銀行	3,200	1,007.00	3,222,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,600	442.00	2,475,200
西日本フィナンシャルホールディングス	3,400	782.00	2,658,800
ひろぎんホールディングス	1,300	655.00	851,500
新生銀行	1,800	1,733.00	3,119,400
あおぞら銀行	1,900	2,479.00	4,710,100
三菱UFJフィナンシャル・グループ	300,000	597.00	179,100,000
りそなホールディングス	54,700	458.80	25,096,360
三井住友トラスト・ホールディングス	20,500	3,808.00	78,064,000
三井住友フィナンシャルグループ	34,800	3,978.00	138,434,400
千葉銀行	4,600	717.00	3,298,200
群馬銀行	4,100	380.00	1,558,000
武蔵野銀行	400	1,780.00	712,000

青森銀行	400	2,513.00	1,005,200
ふくおかフィナンシャルグループ	4,200	2,068.00	8,685,600
静岡銀行	1,400	856.00	1,198,400
八十二銀行	10,000	386.00	3,860,000
大垣共立銀行	400	2,131.00	852,400
北國銀行	600	2,688.00	1,612,800
滋賀銀行	600	2,382.00	1,429,200
百五銀行	3,400	327.00	1,111,800
京都銀行	100	6,660.00	666,000
紀陽銀行	400	1,597.00	638,800
ほくほくフィナンシャルグループ	3,500	1,024.00	3,584,000
山陰合同銀行	1,100	534.00	587,400
百十四銀行	500	1,632.00	816,000
セブン銀行	3,900	248.00	967,200
みずほフィナンシャルグループ	44,400	1,580.00	70,152,000
北洋銀行	7,000	300.00	2,100,000
池田泉州ホールディングス	4,600	175.00	805,000
SBIホールディングス	1,000	3,120.00	3,120,000
ジャフコグループ	200	6,970.00	1,394,000
大和証券グループ本社	9,600	576.00	5,529,600
野村ホールディングス	23,100	584.60	13,504,260
かんぽ生命保険	900	2,232.00	2,008,800
SOMPOホールディングス	2,300	4,175.00	9,602,500
MS&ADインシュアランスグループホール	6,000	3,224.00	19,344,000
第一生命ホールディングス	15,800	2,046.00	32,326,800
東京海上ホールディングス	5,000	5,213.00	26,065,000
T&Dホールディングス	8,200	1,425.00	11,685,000
全国保証	100	5,170.00	517,000
クレディセゾン	800	1,370.00	1,096,000
日本証券金融	7,700	838.00	6,452,600
イオンフィナンシャルサービス	1,700	1,491.00	2,534,700
オリックス	14,100	1,830.50	25,810,050
三菱HCキャピタル	1,300	642.00	834,600
日本取引所グループ	800	2,646.00	2,116,800
ヒューリック	1,100	1,311.00	1,442,100

野村不動産ホールディングス	600	2,707.00	1,624,200
東急不動産ホールディングス	3,200	651.00	2,083,200
飯田グループホールディングス	1,000	2,736.00	2,736,000
パーク24	600	2,066.00	1,239,600
三井不動産	3,100	2,492.50	7,726,750
三菱地所	4,200	1,950.50	8,192,100
東京建物	700	1,701.00	1,190,700
住友不動産	1,000	3,856.00	3,856,000
イオンモール	500	1,914.00	957,000
ミクシィ	400	2,787.00	1,114,800
パーソルホールディングス	1,000	2,161.00	2,161,000
総合警備保障	200	5,140.00	1,028,000
カカクコム	200	3,050.00	610,000
アウトソーシング	500	1,745.00	872,500
ディー・エヌ・エー	500	2,228.00	1,114,000
博報堂DYホールディングス	1,100	1,813.00	1,994,300
電通グループ	1,300	3,580.00	4,654,000
H. U. グループホールディングス	300	3,580.00	1,074,000
オリエンタルランド	200	16,595.00	3,319,000
ダスキン	300	2,832.00	849,600
ユー・エス・エス	500	2,133.00	1,066,500
サイバーエージェント	600	1,941.00	1,164,600
楽天グループ	2,000	1,315.00	2,630,000
テクノプロ・ホールディングス	100	8,770.00	877,000
リクルートホールディングス	1,900	5,240.00	9,956,000
日本郵政	10,200	944.00	9,628,800
エイチ・アイ・エス	300	2,244.00	673,200
カナモト	300	2,793.00	837,900
セコム	600	9,328.00	5,596,800
メイテック	100	5,960.00	596,000
ベネッセホールディングス	400	2,514.00	1,005,600
小計 銘柄数：547			3,059,641,900
組入時価比率：98.1%			100.0%
合計			3,059,641,900

(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 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。