



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 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 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 | 3,853 | (99.9) | 2 | (0.1) | 3,856 | (100.0) |
| 2019年10月期 FY ended Oct. 2019 | 4,210 | (100.0) | 1 | (0.0) | 4,211 | (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 | 4,530 | 500 | 495 | 4,535 |
| 2019年10月期 FY ended Oct. 2019 | 4,031 | 499 | 0 | 4,530 |

(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4月期 FY ended Apr. 2020 | 3,910 | 53 | 3,856 | 85,025 |
| 2019年10月期 FY ended Oct. 2019 | 4,259 | 48 | 4,211 | 92,948 |

(4) 分配金

Dividend Payment

| | 100口当り分配金 Dividend per 100 units |
|---------------------------------|-------------------------------------|
| | 円 JPY |
| 2020年4月期 FY ended Apr. 2020 | 1,100 |
| 2019年10月期 FY ended Oct. 2019 | 1,000 |

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3期 (2019年10月20日現在) 3rd Fiscal Year As of October 20, 2019 | 第4期 (2020年4月20日現在) 4th 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 | 8,508,691 | 9,295,895 |
| 株式 Stocks | 4,210,218,230 | 3,853,695,950 |
| 未収入金 Accounts receivable - other | 2,270,600 | - |
| 未収配当金 Accrued dividends receivable | 38,986,450 | 47,048,953 |
| 流動資産合計 Total current assets | 4,259,983,971 | 3,910,040,798 |
| 資産合計 Total assets | 4,259,983,971 | 3,910,040,798 |
| 負債の部 Liabilities | | |
| 流動負債 Current liabilities | | |
| 未払収益分配金 Unpaid dividends | 45,309,090 | 49,892,821 |
| 未払受託者報酬 Trustee fee payable | 596,041 | 671,360 |
| 未払委託者報酬 Investment trust management fee payable | 2,384,082 | 2,685,383 |
| 未払利息 Accrued interest expenses | 24 | 10 |
| その他未払費用 Other accrued expenses | 303,132 | 324,820 |
| 流動負債合計 Total current liabilities | 48,592,369 | 53,574,394 |
| 負債合計 Total liabilities | 48,592,369 | 53,574,394 |
| 純資産の部 Net assets | | |
| 元本等 Principal and other | | |
| 元本 Principal | 4,530,909,000 | 4,535,711,000 |
| 剰余金 Surplus | | |

| | | |
|--|---------------|---------------|
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period | △319,517,398 | △679,244,596 |
| (分配準備積立金) (Reserve for distribution) | 2,183,933 | 1,680,428 |
| 元本等合計 Total principal and other | 4,211,391,602 | 3,856,466,404 |
| 純資産合計 Total net assets | 4,211,391,602 | 3,856,466,404 |
| 負債純資産合計 Total liabilities and net assets | 4,259,983,971 | 3,910,040,798 |

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

(単位：円) (Unit: JPY)

| | 第3期 自 2019年4月21日 至 2019年10月20日 3rd Fiscal Year From April 21, 2019 to October 20, 2019 | 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 |
|---|---|---|
| | 金額 Amount | 金額 Amount |
| 営業収益 Operating revenue | | |
| 受取配当金 Dividend income | 47,931,150 | 53,316,851 |
| 有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other | 115,607,330 | △362,603,333 |
| その他収益 Other revenue | 31,211 | 25,219 |
| 営業収益合計 Total operating revenue | 163,569,691 | △309,261,263 |
| 営業費用 Operating expenses | | |
| 支払利息 Interest expenses | 3,595 | 1,177 |
| 受託者報酬 Trustee fee | 596,041 | 671,360 |
| 委託者報酬 Investment trust management fee | 2,384,082 | 2,685,383 |
| その他費用 Other expenses | 481,564 | 594,834 |
| 営業費用合計 Total operating expenses | 3,465,282 | 3,952,754 |
| 営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss) | 160,104,409 | △313,214,017 |
| 経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss) | 160,104,409 | △313,214,017 |
| 当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss) | 160,104,409 | △313,214,017 |
| 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 (△) | △396,432,468 | △319,517,398 |

| | | |
|--|--------------|--------------|
| Surplus (deficit) at beginning of period | | |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit | - | 10,764,240 |
| 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 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit | 37,880,249 | 7,384,600 |
| 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 | 37,880,249 | 7,384,600 |
| 分配金 Dividends | 45,309,090 | 49,892,821 |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period | △319,517,398 | △679,244,596 |

(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。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 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。 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、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3期 2019年10月20日現在 | 第4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 4,530,909 口 | 1. 計算期間の末日における受益権の総数 4,535,711 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 319,517,398 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 679,244,596 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 929.48 円 (100口当たり純資産額) (92,948 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) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第3期 自2019年4月21日 至2019年10月20日 | 第4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 | 47,958,766円 |
| 分配準備積立金 | B | 2,995,944円 |
| 配当等収益合計額 | C=A+B | 50,954,710円 |
| 経費 | D | 3,461,687円 |
| 収益分配可能額 | E=C-D | 47,493,023円 |
| 収益分配金 | F | 45,309,090円 |
| 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 2,183,933円 |
| 口数 | H | 4,530,909口 |
| 100口当たり分配金 | I=F/H×100 | 1,000円 |

| | | |
|----------------|-----------|-------------|
| 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 |
| 配当等収益合計額 | C=A+B | 55,524,826円 |
| 経費 | D | 3,951,577円 |
| 収益分配可能額 | E=C-D | 51,573,249円 |
| 収益分配金 | F | 49,892,821円 |
| 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 1,680,428円 |
| 口数 | H | 4,535,711口 |
| 100口当たり分配金 | I=F/H×100 | 1,100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3期 自 2019年4月21日 至 2019年10月20日 | 第4期 自 2019年10月21日 至 2020年4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3期 2019年10月20日現在 | 第4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。 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3期 自2019年4月21日 至2019年10月20日 | 第4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3期 自2019年4月21日 至2019年10月20日 | 第4期 自2019年10月21日 至2020年4月20日 |
|------------------------------------|------------------------------------|
| 期首元本額 4,031,209,000円 | 期首元本額 4,530,909,000円 |
| 期中追加設定元本額 499,700,000円 | 期中追加設定元本額 500,100,000円 |
| 期中一部交換元本額 0円 | 期中一部交換元本額 495,298,000円 |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類 | 第3期 自2019年4月21日 至2019年10月20日 | 第4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 | 154,692,304 | △420,519,522 |
| 合計 | 154,692,304 | △420,519,522 |

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 | マルハニチロ | 200 | 2,260.00 | 452,000 | |
| | | 国際石油開発帝石 | 25,000 | 635.00 | 15,875,000 | |
| | | 石油資源開発 | 500 | 1,816.00 | 908,000 | |
| | | 大成建設 | 4,500 | 3,090.00 | 13,905,000 | |
| | | 大林組 | 10,900 | 890.00 | 9,701,000 | |
| | | 清水建設 | 11,300 | 800.00 | 9,040,000 | |
| | | 鹿島建設 | 3,200 | 1,044.00 | 3,340,800 | |
| | | 三井住友建設 | 3,600 | 410.00 | 1,476,000 | |
| | | 熊谷組 | 600 | 2,223.00 | 1,333,800 | |
| | | 大東建託 | 2,800 | 10,375.00 | 29,050,000 | |
| | | 住友林業 | 1,100 | 1,255.00 | 1,380,500 | |
| | | 大和ハウス工業 | 20,900 | 2,629.50 | 54,956,550 | |

| | | | |
|------------------|--------|----------|-------------|
| 積水ハウス | 11,200 | 1,761.50 | 19,728,800 |
| 日清製粉グループ本社 | 2,200 | 1,648.00 | 3,625,600 |
| 森永製菓 | 1,200 | 4,670.00 | 5,604,000 |
| カルビー | 2,600 | 3,290.00 | 8,554,000 |
| アサヒグループホールディングス | 5,000 | 3,549.00 | 17,745,000 |
| キリンホールディングス | 5,400 | 2,071.00 | 11,183,400 |
| サントリー食品インターナショナル | 2,000 | 3,970.00 | 7,940,000 |
| 不二製油グループ本社 | 400 | 2,661.00 | 1,064,400 |
| キッコーマン | 2,800 | 4,890.00 | 13,692,000 |
| 味の素 | 5,700 | 1,913.50 | 10,906,950 |
| キューピー | 1,600 | 2,130.00 | 3,408,000 |
| カゴメ | 1,000 | 2,669.00 | 2,669,000 |
| ニチレイ | 1,900 | 2,739.00 | 5,204,100 |
| 東洋水産 | 1,200 | 5,420.00 | 6,504,000 |
| 東洋紡 | 900 | 1,193.00 | 1,073,700 |
| 帝人 | 3,000 | 1,744.00 | 5,232,000 |
| 東レ | 16,800 | 480.10 | 8,065,680 |
| ゴールドウイン | 500 | 5,720.00 | 2,860,000 |
| 王子ホールディングス | 11,100 | 541.00 | 6,005,100 |
| 日本製紙 | 400 | 1,516.00 | 606,400 |
| クラレ | 4,700 | 1,056.00 | 4,963,200 |
| 旭化成 | 34,500 | 726.70 | 25,071,150 |
| 住友化学 | 29,500 | 315.00 | 9,292,500 |
| エア・ウォーター | 2,300 | 1,494.00 | 3,436,200 |
| 三井化学 | 3,500 | 1,900.00 | 6,650,000 |
| J S R | 3,700 | 1,923.00 | 7,115,100 |
| 東京応化工業 | 500 | 4,255.00 | 2,127,500 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 16,600 | 603.20 | 10,013,120 |
| KHネオケム | 900 | 1,659.00 | 1,493,100 |
| ダイセル | 4,300 | 804.00 | 3,457,200 |
| 積水化学工業 | 7,800 | 1,352.00 | 10,545,600 |
| 日本ゼオン | 3,100 | 837.00 | 2,594,700 |
| 日立化成 | 2,000 | 4,610.00 | 9,220,000 |
| 日油 | 1,900 | 3,660.00 | 6,954,000 |
| 花王 | 18,200 | 8,760.00 | 159,432,000 |

| | | | |
|------------------|--------|-----------|-------------|
| D I C | 1,500 | 2,394.00 | 3,591,000 |
| 富士フイルムホールディングス | 3,600 | 5,362.00 | 19,303,200 |
| 資生堂 | 11,700 | 6,868.00 | 80,355,600 |
| ライオン | 5,200 | 2,325.00 | 12,090,000 |
| マンダム | 400 | 2,073.00 | 829,200 |
| ファンケル | 400 | 2,551.00 | 1,020,400 |
| コーセー | 1,000 | 14,190.00 | 14,190,000 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 1,000 | 2,142.00 | 2,142,000 |
| 小林製薬 | 1,000 | 10,610.00 | 10,610,000 |
| タカラバイオ | 700 | 2,288.00 | 1,601,600 |
| 日東電工 | 3,200 | 4,960.00 | 15,872,000 |
| エフピコ | 300 | 7,950.00 | 2,385,000 |
| ニフコ | 1,600 | 1,893.00 | 3,028,800 |
| ユニ・チャーム | 10,800 | 4,074.00 | 43,999,200 |
| 協和キリン | 3,300 | 2,379.00 | 7,850,700 |
| アステラス製薬 | 67,500 | 1,756.00 | 118,530,000 |
| 大日本住友製薬 | 2,600 | 1,436.00 | 3,733,600 |
| 塩野義製薬 | 12,200 | 5,500.00 | 67,100,000 |
| 日本新薬 | 1,000 | 8,150.00 | 8,150,000 |
| 中外製薬 | 5,800 | 13,260.00 | 76,908,000 |
| 科研製薬 | 700 | 5,540.00 | 3,878,000 |
| エーザイ | 5,500 | 7,916.00 | 43,538,000 |
| ロート製薬 | 1,300 | 3,165.00 | 4,114,500 |
| 参天製薬 | 5,500 | 1,908.00 | 10,494,000 |
| JCRファーマ | 400 | 10,560.00 | 4,224,000 |
| 沢井製薬 | 600 | 5,850.00 | 3,510,000 |
| 第一三共 | 7,800 | 7,373.00 | 57,509,400 |
| 大塚ホールディングス | 4,300 | 4,236.00 | 18,214,800 |
| 大正製薬ホールディングス | 300 | 6,610.00 | 1,983,000 |
| JXTGホールディングス | 56,000 | 365.50 | 20,468,000 |
| ブリヂストン | 15,500 | 3,250.00 | 50,375,000 |
| 日本板硝子 | 300 | 316.00 | 94,800 |
| 住友大阪セメント | 500 | 3,400.00 | 1,700,000 |
| TOTO | 2,300 | 3,460.00 | 7,958,000 |
| 日本碍子 | 3,400 | 1,308.00 | 4,447,200 |

| | | | |
|------------------|--------|-----------|------------|
| 日本特殊陶業 | 2,100 | 1,523.00 | 3,198,300 |
| 東京製鐵 | 2,900 | 665.00 | 1,928,500 |
| 日立金属 | 2,600 | 1,092.00 | 2,839,200 |
| 三井金属鉱業 | 200 | 1,902.00 | 380,400 |
| 住友金属鉱山 | 800 | 2,448.50 | 1,958,800 |
| 古河電気工業 | 800 | 1,935.00 | 1,548,000 |
| 住友電気工業 | 10,600 | 1,065.50 | 11,294,300 |
| フジクラ | 1,200 | 285.00 | 342,000 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 1,000 | 1,054.00 | 1,054,000 |
| LIXILグループ | 700 | 1,245.00 | 871,500 |
| 日本発條 | 2,300 | 688.00 | 1,582,400 |
| 三浦工業 | 1,800 | 4,125.00 | 7,425,000 |
| オーエスジー | 1,500 | 1,283.00 | 1,924,500 |
| ディスコ | 500 | 24,630.00 | 12,315,000 |
| 島精機製作所 | 200 | 1,544.00 | 308,800 |
| 小松製作所 | 16,100 | 1,962.00 | 31,588,200 |
| クボタ | 14,000 | 1,263.50 | 17,689,000 |
| 荏原製作所 | 1,300 | 2,223.00 | 2,889,900 |
| ダイキン工業 | 5,000 | 13,290.00 | 66,450,000 |
| 栗田工業 | 1,700 | 2,718.00 | 4,620,600 |
| ダイフク | 2,000 | 7,170.00 | 14,340,000 |
| セガサミーホールディングス | 700 | 1,302.00 | 911,400 |
| NTN | 900 | 190.00 | 171,000 |
| 三菱重工業 | 1,900 | 2,649.50 | 5,034,050 |
| IHI | 700 | 1,293.00 | 905,100 |
| 日清紡ホールディングス | 400 | 695.00 | 278,000 |
| コニカミノルタ | 4,300 | 403.00 | 1,732,900 |
| ブラザー工業 | 3,300 | 1,701.00 | 5,613,300 |
| ミネベアミツミ | 8,500 | 1,644.00 | 13,974,000 |
| 三菱電機 | 27,600 | 1,295.00 | 35,742,000 |
| 富士電機 | 1,700 | 2,447.00 | 4,159,900 |
| 日本電産 | 6,500 | 5,704.00 | 37,076,000 |
| オムロン | 3,000 | 5,850.00 | 17,550,000 |
| 日本電気 | 1,900 | 4,250.00 | 8,075,000 |
| 沖電気工業 | 900 | 976.00 | 878,400 |

| | | | |
|-----------------|--------|-----------|-------------|
| セイコーエプソン | 3,400 | 1,053.00 | 3,580,200 |
| アンリツ | 1,100 | 2,185.00 | 2,403,500 |
| ソニー | 17,800 | 6,878.00 | 122,428,400 |
| アルプスアルパイン | 1,800 | 1,053.00 | 1,895,400 |
| マクセルホールディングス | 300 | 1,002.00 | 300,600 |
| 横河電機 | 2,800 | 1,393.00 | 3,900,400 |
| アズビル | 1,900 | 2,818.00 | 5,354,200 |
| 堀場製作所 | 600 | 5,380.00 | 3,228,000 |
| シスメックス | 5,200 | 7,309.00 | 38,006,800 |
| ウシオ電機 | 1,300 | 1,026.00 | 1,333,800 |
| カシオ計算機 | 4,100 | 1,719.00 | 7,047,900 |
| 太陽誘電 | 1,400 | 2,922.00 | 4,090,800 |
| キヤノン | 8,500 | 2,243.00 | 19,065,500 |
| リコー | 2,400 | 741.00 | 1,778,400 |
| 東京エレクトロン | 5,100 | 23,245.00 | 118,549,500 |
| デンソー | 5,600 | 3,744.00 | 20,966,400 |
| 川崎重工業 | 800 | 1,492.00 | 1,193,600 |
| 日野自動車 | 3,200 | 598.00 | 1,913,600 |
| 三菱自動車工業 | 6,700 | 298.00 | 1,996,600 |
| マツダ | 4,500 | 562.00 | 2,529,000 |
| 豊田合成 | 600 | 1,824.00 | 1,094,400 |
| 島津製作所 | 4,700 | 2,809.00 | 13,202,300 |
| 東京精密 | 900 | 3,225.00 | 2,902,500 |
| マニー | 2,500 | 2,312.00 | 5,780,000 |
| ニコン | 4,700 | 956.00 | 4,493,200 |
| トプコン | 1,000 | 824.00 | 824,000 |
| HOYA | 14,200 | 9,793.00 | 139,060,600 |
| シチズン時計 | 2,900 | 356.00 | 1,032,400 |
| バンダイナムコホールディングス | 6,400 | 5,409.00 | 34,617,600 |
| タカラトミー | 700 | 842.00 | 589,400 |
| 凸版印刷 | 2,300 | 1,570.00 | 3,611,000 |
| 大日本印刷 | 1,400 | 2,262.00 | 3,166,800 |
| ヤマハ | 4,000 | 4,260.00 | 17,040,000 |
| ピジョン | 4,200 | 4,035.00 | 16,947,000 |
| 中部電力 | 3,700 | 1,529.50 | 5,659,150 |

| | | | |
|----------------|--------|-----------|-------------|
| 四国電力 | 2,300 | 833.00 | 1,915,900 |
| 九州電力 | 3,500 | 899.00 | 3,146,500 |
| 東京瓦斯 | 12,600 | 2,613.50 | 32,930,100 |
| 大阪瓦斯 | 10,300 | 2,122.00 | 21,856,600 |
| 東邦瓦斯 | 1,600 | 5,480.00 | 8,768,000 |
| 東急 | 3,100 | 1,645.00 | 5,099,500 |
| 小田急電鉄 | 1,900 | 2,387.00 | 4,535,300 |
| 西武ホールディングス | 1,600 | 1,251.00 | 2,001,600 |
| 近鉄グループホールディングス | 900 | 5,090.00 | 4,581,000 |
| 南海電気鉄道 | 500 | 2,323.00 | 1,161,500 |
| 日本通運 | 900 | 5,040.00 | 4,536,000 |
| セイノーホールディングス | 1,500 | 1,200.00 | 1,800,000 |
| 日立物流 | 600 | 2,444.00 | 1,466,400 |
| S Gホールディングス | 3,100 | 2,880.00 | 8,928,000 |
| 日本郵船 | 500 | 1,332.00 | 666,000 |
| 商船三井 | 500 | 1,756.00 | 878,000 |
| 川崎汽船 | 200 | 974.00 | 194,800 |
| 日本航空 | 3,000 | 1,940.00 | 5,820,000 |
| ANAホールディングス | 1,600 | 2,483.00 | 3,972,800 |
| 三菱倉庫 | 600 | 2,233.00 | 1,339,800 |
| T I S | 5,500 | 2,052.00 | 11,286,000 |
| 野村総合研究所 | 9,100 | 2,595.00 | 23,614,500 |
| Zホールディングス | 40,000 | 393.00 | 15,720,000 |
| 日本オラクル | 1,800 | 10,360.00 | 18,648,000 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 2,500 | 3,345.00 | 8,362,500 |
| 日本ユニシス | 2,100 | 3,045.00 | 6,394,500 |
| 日本電信電話 | 25,700 | 2,510.00 | 64,507,000 |
| KDD I | 43,400 | 3,144.00 | 136,449,600 |
| N T T ドコモ | 40,000 | 3,220.00 | 128,800,000 |
| 東宝 | 2,200 | 3,475.00 | 7,645,000 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 6,100 | 1,071.00 | 6,533,100 |
| カプコン | 2,300 | 3,400.00 | 7,820,000 |
| S C S K | 1,100 | 5,410.00 | 5,951,000 |
| コナミホールディングス | 1,700 | 3,270.00 | 5,559,000 |
| ソフトバンクグループ | 8,200 | 4,790.00 | 39,278,000 |

| | | | |
|---------------------|--------|----------|------------|
| 双日 | 14,200 | 250.00 | 3,550,000 |
| アルフレッサ ホールディングス | 3,400 | 2,122.00 | 7,214,800 |
| メディパルホールディングス | 2,400 | 2,055.00 | 4,932,000 |
| 伊藤忠商事 | 31,700 | 2,127.50 | 67,441,750 |
| 丸紅 | 20,700 | 495.40 | 10,254,780 |
| 豊田通商 | 1,000 | 2,390.00 | 2,390,000 |
| 三井物産 | 9,300 | 1,470.00 | 13,671,000 |
| 三菱商事 | 7,000 | 2,185.00 | 15,295,000 |
| サンリオ | 700 | 1,559.00 | 1,091,300 |
| PALTAC | 600 | 5,500.00 | 3,300,000 |
| ローソン | 400 | 6,080.00 | 2,432,000 |
| 日本マクドナルドホールディングス | 700 | 5,320.00 | 3,724,000 |
| セリア | 1,200 | 3,300.00 | 3,960,000 |
| Monotaro | 3,300 | 3,190.00 | 10,527,000 |
| J. フロント リテイリング | 3,600 | 785.00 | 2,826,000 |
| ココカラファイン | 100 | 5,180.00 | 518,000 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 4,000 | 615.00 | 2,460,000 |
| ウエルシアホールディングス | 1,000 | 8,410.00 | 8,410,000 |
| すかいらーくホールディングス | 2,000 | 1,566.00 | 3,132,000 |
| ユナイテッドアローズ | 800 | 1,720.00 | 1,376,000 |
| スギホールディングス | 700 | 6,380.00 | 4,466,000 |
| 島忠 | 500 | 2,719.00 | 1,359,500 |
| 青山商事 | 300 | 869.00 | 260,700 |
| しまむら | 300 | 6,660.00 | 1,998,000 |
| 高島屋 | 2,400 | 907.00 | 2,176,800 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 500 | 793.00 | 396,500 |
| 丸井グループ | 2,000 | 1,628.00 | 3,256,000 |
| イオン | 2,400 | 2,178.50 | 5,228,400 |
| イズミ | 500 | 2,882.00 | 1,441,000 |
| ケーズホールディングス | 3,500 | 1,154.00 | 4,039,000 |
| アインホールディングス | 500 | 6,340.00 | 3,170,000 |
| 吉野家ホールディングス | 400 | 2,234.00 | 893,600 |
| ゆうちょ銀行 | 5,900 | 961.00 | 5,669,900 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 9,700 | 305.00 | 2,958,500 |
| 新生銀行 | 3,000 | 1,269.00 | 3,807,000 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|------------|
| あおぞら銀行 | 1,300 | 1,933.00 | 2,512,900 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 118,300 | 418.70 | 49,532,210 |
| りそなホールディングス | 36,200 | 318.50 | 11,529,700 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 10,900 | 2,714.00 | 29,582,600 |
| 千葉銀行 | 13,900 | 474.00 | 6,588,600 |
| 静岡銀行 | 8,500 | 612.00 | 5,202,000 |
| 八十二銀行 | 2,400 | 369.00 | 885,600 |
| 京都銀行 | 1,200 | 3,525.00 | 4,230,000 |
| セブン銀行 | 20,600 | 293.00 | 6,035,800 |
| みずほフィナンシャルグループ | 220,300 | 122.30 | 26,942,690 |
| SBIホールディングス | 3,000 | 1,779.00 | 5,337,000 |
| 大和証券グループ本社 | 11,600 | 409.20 | 4,746,720 |
| 野村ホールディングス | 20,600 | 420.00 | 8,652,000 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 1,000 | 232.00 | 232,000 |
| SOMPOホールディングス | 13,000 | 3,375.00 | 43,875,000 |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 20,900 | 2,939.00 | 61,425,100 |
| 第一生命ホールディングス | 41,400 | 1,324.00 | 54,813,600 |
| T&Dホールディングス | 22,100 | 880.00 | 19,448,000 |
| クレディセゾン | 1,200 | 1,107.00 | 1,328,400 |
| 東京センチュリー | 500 | 3,600.00 | 1,800,000 |
| オリエントコーポレーション | 7,600 | 120.00 | 912,000 |
| 日立キャピタル | 300 | 2,075.00 | 622,500 |
| オリックス | 39,100 | 1,238.50 | 48,425,350 |
| 日本取引所グループ | 28,800 | 2,081.00 | 59,932,800 |
| いちご | 5,200 | 240.00 | 1,248,000 |
| ヒューリック | 3,000 | 1,021.00 | 3,063,000 |
| 東急不動産ホールディングス | 2,900 | 502.00 | 1,455,800 |
| 三井不動産 | 10,000 | 1,855.00 | 18,550,000 |
| 三菱地所 | 13,400 | 1,742.50 | 23,349,500 |
| イオンモール | 2,600 | 1,267.00 | 3,294,200 |
| カカクコム | 5,900 | 2,320.00 | 13,688,000 |
| ベネフィット・ワン | 2,800 | 1,976.00 | 5,532,800 |
| エムスリー | 11,000 | 4,005.00 | 44,055,000 |
| ディー・エヌ・エー | 1,000 | 1,273.00 | 1,273,000 |

| | | | | | |
|--|----------------|--------|-----------|---------------|--|
| | インフォマート | 5,900 | 734.00 | 4,330,600 | |
| | みらかホールディングス | 400 | 2,348.00 | 939,200 | |
| | オリエンタルランド | 5,700 | 14,440.00 | 82,308,000 | |
| | ラウンドワン | 800 | 789.00 | 631,200 | |
| | リゾートトラスト | 1,500 | 1,078.00 | 1,617,000 | |
| | サイバーエージェント | 1,000 | 4,390.00 | 4,390,000 | |
| | 楽天 | 18,700 | 930.00 | 17,391,000 | |
| | エン・ジャパン | 1,500 | 2,211.00 | 3,316,500 | |
| | テクノプロ・ホールディングス | 1,000 | 5,060.00 | 5,060,000 | |
| | リクルートホールディングス | 40,400 | 2,924.00 | 118,129,600 | |
| | エイチ・アイ・エス | 100 | 1,373.00 | 137,300 | |
| | 共立メンテナンス | 400 | 2,414.00 | 965,600 | |
| | 乃村工藝社 | 1,900 | 752.00 | 1,428,800 | |
| | セコム | 3,100 | 9,087.00 | 28,169,700 | |
| | ベネッセホールディングス | 500 | 2,999.00 | 1,499,500 | |
| | 小計 銘柄数：271 | | | 3,853,695,950 | |
| | 組入時価比率：99.9% | | | 100.0% | |
| | 合計 | | | 3,853,695,950 | |

(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

該当事項はありません。