



2021年7月期 (2020年7月11日～2021年7月10日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2021 (July 11, 2020 – July 10, 2021)

2021年8月19日
 August 19, 2021

		上場取引所 Listed Exchange	東京・名古屋・福岡・札幌 TSE,NSE,FSE,SSE
ファンド名	NEXT FUNDS 日経300株価指数連動型上場投信		
コード番号	(1319)		
連動対象指標	日経株価指数 300		
主要投資資産	株式		
売買単位	1,000 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 300 Index Exchange Traded Fund		
Code:	1319		
Underlying index:	Nikkei Stock Index 300		
Primary invested assets:	Stocks		
Trading unit:	1,000 units		
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18日
 Scheduled date of submission of securities report: September 29, 2021
 Date of commencing dividend payment: August 18, 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11日～2021年7月10日)

Management Status for Year ended July 2021 (from July 11, 2020 to July 10, 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	2,812	(99.8)	5	(0.2)	2,817	(100.0)
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,506	(98.9)	27	(1.1)	2,534	(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	8,485	3,000	3,954	7,531
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	30,294	1,900	23,709	8,485

(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
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	2,873	55	2,817	37,416
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,742	207	2,534	29,872

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	657.1
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,212.9

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26期 (2020年7月10日現在) 26th Fiscal Year As of July 10, 2020	第27期 (2021年7月10日現在) 27th Fiscal Year As of July 10, 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	199,852,504	56,473,671
株式 Stocks	2,506,895,050	2,812,593,690
未収入金 Accounts receivable - other	20,074,860	-
未収配当金 Accrued dividends receivable	15,302,650	4,026,700
流動資産合計 Total current assets	2,742,125,064	2,873,094,061
資産合計 Total assets	2,742,125,064	2,873,094,061
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払金 Accounts payable - other	556,182	198,500
未払収益分配金 Unpaid dividends	187,779,081	49,487,975
未払受託者報酬 Trustee fees payable	3,631,355	1,085,612
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	15,251,556	4,396,607
未払利息 Accrued interest expenses	114	78
その他未払費用 Other accrued expenses	72,588	21,624
流動負債合計 Total current liabilities	207,290,876	55,190,396
負債合計 Total liabilities	207,290,876	55,190,396
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	2,053,528,752	1,822,567,340

剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	481,305,436	995,336,325
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	1,375	6,570
元本等合計 Total principal and other	2,534,834,188	2,817,903,665
純資産合計 Total net assets	2,534,834,188	2,817,903,665
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	2,742,125,064	2,873,094,061

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第26期 自 2019年7月11日 至 2020年7月10日 26th Fiscal Year From July 11, 2019 to July 10, 2020	第27期 自 2020年7月11日 至 2021年7月10日 27th Fiscal Year From July 11, 2020 to July 10, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	226,829,651	60,925,935
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	14,741,016	591,255,442
その他収益 Other revenue	85,181	10,834
営業収益合計 Total operating revenue	241,655,848	652,192,211
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	39,644	13,094
受託者報酬 Trustee fees	7,494,857	2,224,360
委託者報酬 Investment trust management fees	31,478,292	9,083,593
その他費用 Other expenses	149,835	122,552
営業費用合計 Total operating expenses	39,162,628	11,443,599
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	202,493,220	640,748,612
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	202,493,220	640,748,612
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	202,493,220	640,748,612
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, 204, 741, 352	481, 305, 436
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	157, 225, 000	419, 520, 000
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	157, 225, 000	419, 520, 000
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	1, 895, 375, 055	496, 749, 748
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	1, 895, 375, 055	496, 749, 748
分配金 Dividends	187, 779, 081	49, 487, 975
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	481, 305, 436	995, 336, 325

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年7月11日から2021年7月10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26期 2020年7月10日現在	第27期 2021年7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 8, 485, 656 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 7, 531, 270 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 298.72円 (100口当たり純資産額) (29,872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 374.16円 (100口当たり純資産額) (37,416円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第26期 自2019年7月11日 至2020年7月10日	第27期 自2020年7月11日 至2021年7月10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	226,875,188 円	当期配当等収益額	A	60,923,675 円
分配準備積立金	B	28,252 円	分配準備積立金	B	1,375 円
配当等収益合計額	C=A+B	226,903,440 円	配当等収益合計額	C=A+B	60,925,050 円
経費	D	39,122,984 円	経費	D	11,430,505 円
収益分配可能額	E=C-D	187,780,456 円	収益分配可能額	E=C-D	49,494,545 円
収益分配金	F	187,779,081 円	収益分配金	F	49,487,975 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,375 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,570 円
口数	H	8,485,656 口	口数	H	7,531,270 口
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,212 円 90 銭	100口当たり分配金	I=F/H×100	657 円 10 銭

(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 26 期 自 2019 年 7 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日	第 27 期 自 2020 年 7 月 11 日 至 2021 年 7 月 10 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>○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。</p> <p>○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。</p> <p>○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 26 期 2020 年 7 月 10 日現在	第 27 期 2021 年 7 月 10 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。</p> <p>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</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>

ります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第26期 自 2019年 7月 11日 至 2020年 7月 10日	第27期 自 2020年 7月 11日 至 2021年 7月 10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26期 自 2019年 7月 11日 至 2020年 7月 10日	第27期 自 2020年 7月 11日 至 2021年 7月 10日
期首元本額 7,331,339,906 円	期首元本額 2,053,528,752 円
期中追加設定元本額 459,800,000 円	期中追加設定元本額 726,000,000 円
期中一部交換元本額 5,737,611,154 円	期中一部交換元本額 956,961,412 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第26期 自 2019年 7月 11日 至 2020年 7月 10日	第27期 自 2020年 7月 11日 至 2021年 7月 10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	△13,917,082	399,538,423
合計	△13,917,082	399,538,423

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(2021年7月10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	1,700	520.00	884,000	
		マルハニチロ	300	2,352.00	705,600	
		サカタのタネ	300	3,650.00	1,095,000	
		ホクト	200	1,921.00	384,200	
		I N P E X	8,200	804.00	6,592,800	
		コムシスホールディングス	800	2,993.00	2,394,400	
		大成建設	1,300	3,685.00	4,790,500	
		大林組	4,000	893.00	3,572,000	
		清水建設	4,400	868.00	3,819,200	
		鹿島建設	2,900	1,413.00	4,097,700	
		西松建設	300	3,545.00	1,063,500	

前田建設工業	1,100	949.00	1,043,900
奥村組	200	2,892.00	578,400
戸田建設	1,800	741.00	1,333,800
大東建託	400	12,510.00	5,004,000
N I P P O	700	3,080.00	2,156,000
前田道路	500	2,146.00	1,073,000
住友林業	1,100	1,985.00	2,183,500
大和ハウス工業	3,700	3,312.00	12,254,400
積水ハウス	3,800	2,218.50	8,430,300
中電工	300	2,266.00	679,800
関電工	1,100	874.00	961,400
九電工	400	3,550.00	1,420,000
日揮ホールディングス	1,400	1,002.00	1,402,800
高砂熱学工業	400	1,869.00	747,600
日清製粉グループ本社	1,700	1,650.00	2,805,000
山崎製パン	1,200	1,535.00	1,842,000
ヤクルト本社	1,000	6,310.00	6,310,000
明治ホールディングス	900	6,710.00	6,039,000
雪印メグミルク	400	2,039.00	815,600
日本ハム	600	4,265.00	2,559,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,700	709.00	1,205,300
サッポロホールディングス	400	2,307.00	922,800
アサヒグループホールディングス	2,800	5,043.00	14,120,400
キリンホールディングス	5,100	2,084.00	10,628,400
宝ホールディングス	1,100	1,327.00	1,459,700
伊藤園	500	6,470.00	3,235,000
キッコーマン	1,100	6,840.00	7,524,000
味の素	3,100	2,800.00	8,680,000
キューピー	800	2,450.00	1,960,000
ハウス食品グループ本社	600	3,385.00	2,031,000
ニチレイ	800	2,898.00	2,318,400
日清食品ホールディングス	600	7,780.00	4,668,000
日本たばこ産業	7,400	2,090.50	15,469,700
東洋紡	500	1,286.00	643,000
帝人	1,100	1,633.00	1,796,300

東レ	9,100	705.70	6,421,870
ワコールホールディングス	400	2,464.00	985,600
オンワードホールディングス	900	360.00	324,000
王子ホールディングス	5,700	628.00	3,579,600
日本製紙	600	1,240.00	744,000
レンゴー	1,500	898.00	1,347,000
クラレ	2,000	997.00	1,994,000
旭化成	7,800	1,170.00	9,126,000
住友化学	9,200	557.00	5,124,400
デンカ	500	3,635.00	1,817,500
信越化学工業	2,300	17,690.00	40,687,000
日本酸素ホールディングス	2,400	2,339.00	5,613,600
日本触媒	200	5,190.00	1,038,000
カネカ	400	4,400.00	1,760,000
三菱瓦斯化学	1,300	2,259.00	2,936,700
三井化学	1,100	3,575.00	3,932,500
東京応化工業	300	7,010.00	2,103,000
三菱ケミカルホールディングス	8,400	927.40	7,790,160
ダイセル	1,700	912.00	1,550,400
積水化学工業	2,600	1,867.00	4,854,200
宇部興産	600	2,192.00	1,315,200
花王	2,600	6,664.00	17,326,400
日本ペイントホールディングス	13,200	1,382.00	18,242,400
D I C	500	2,698.00	1,349,000
東洋インキSCホールディングス	300	1,941.00	582,300
富士フイルムホールディングス	2,900	8,182.00	23,727,800
資生堂	2,200	7,910.00	17,402,000
ライオン	1,700	1,956.00	3,325,200
日東電工	800	8,010.00	6,408,000
ユニ・チャーム	3,500	4,363.00	15,270,500
協和キリン	3,000	3,925.00	11,775,000
武田薬品工業	8,800	3,644.00	32,067,200
アステラス製薬	10,400	1,871.00	19,458,400
塩野義製薬	1,700	5,678.00	9,652,600
中外製薬	9,400	4,124.00	38,765,600

エーザイ	1,700	10,695.00	18,181,500
第一三共	10,900	2,237.50	24,388,750
大塚ホールディングス	3,100	4,304.00	13,342,400
大正製薬ホールディングス	500	5,870.00	2,935,000
出光興産	1,700	2,581.00	4,387,700
E N E O Sホールディングス	18,000	464.30	8,357,400
横浜ゴム	900	2,269.00	2,042,100
ブリヂストン	4,000	4,956.00	19,824,000
住友ゴム工業	1,500	1,499.00	2,248,500
A G C	1,300	4,550.00	5,915,000
日本電気硝子	600	2,447.00	1,468,200
太平洋セメント	700	2,470.00	1,729,000
T O T O	1,000	5,610.00	5,610,000
日本碍子	1,800	1,804.00	3,247,200
日本特殊陶業	1,100	1,597.00	1,756,700
日本製鉄	5,300	1,783.50	9,452,550
神戸製鋼所	2,000	693.00	1,386,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	3,400	1,255.00	4,267,000
日立金属	2,400	2,128.00	5,107,200
日本軽金属ホールディングス	300	1,858.00	557,400
三井金属鉱業	300	3,010.00	903,000
三菱マテリアル	700	2,198.00	1,538,600
住友金属鉱山	1,600	4,291.00	6,865,600
D O W Aホールディングス	300	4,250.00	1,275,000
古河機械金属	200	1,237.00	247,400
古河電気工業	400	2,675.00	1,070,000
住友電気工業	4,400	1,544.00	6,793,600
フジクラ	1,700	545.00	926,500
S U M C O	1,600	2,645.00	4,232,000
東洋製罐グループホールディングス	1,100	1,432.00	1,575,200
三和ホールディングス	1,300	1,292.00	1,679,600
L I X I L	1,700	2,818.00	4,790,600
オークマ	200	5,200.00	1,040,000
アマダ	2,000	1,087.00	2,174,000
S M C	400	65,260.00	26,104,000

小松製作所	5,400	2,622.00	14,158,800
住友重機械工業	700	3,060.00	2,142,000
日立建機	1,200	3,210.00	3,852,000
クボタ	6,700	2,221.50	14,884,050
荏原製作所	500	5,420.00	2,710,000
ダイキン工業	1,600	21,300.00	34,080,000
栗田工業	600	5,450.00	3,270,000
椿本チエイン	200	3,160.00	632,000
ダイフク	700	9,660.00	6,762,000
平和	600	1,982.00	1,189,200
アマノ	400	2,794.00	1,117,600
セガサミーホールディングス	1,500	1,452.00	2,178,000
日本精工	3,100	899.00	2,786,900
NTN	3,000	282.00	846,000
ジェイテクト	1,900	1,107.00	2,103,300
不二越	100	4,190.00	419,000
三菱重工業	1,900	3,186.00	6,053,400
IHI	900	2,538.00	2,284,200
コニカミノルタ	2,800	601.00	1,682,800
ブラザー工業	1,500	2,172.00	3,258,000
ミネベアミツミ	2,400	2,996.00	7,190,400
日立製作所	5,400	6,558.00	35,413,200
三菱電機	12,000	1,447.00	17,364,000
富士電機	800	5,010.00	4,008,000
日本電産	3,300	12,560.00	41,448,000
日本電気	1,500	5,610.00	8,415,000
富士通	1,200	21,080.00	25,296,000
パナソニック	13,700	1,296.00	17,755,200
ソニーグループ	7,000	11,055.00	77,385,000
TDK	700	13,270.00	9,289,000
キーエンス	1,400	56,310.00	78,834,000
ファナック	1,100	25,830.00	28,413,000
京セラ	2,100	6,638.00	13,939,800
村田製作所	3,800	8,879.00	33,740,200
キヤノン	7,400	2,477.00	18,329,800

リコー	4,200	1,201.00	5,044,200
東京エレクトロン	900	45,840.00	41,256,000
豊田自動織機	1,800	9,240.00	16,632,000
デンソー	4,400	7,397.00	32,546,800
三井E&Sホールディングス	500	531.00	265,500
川崎重工業	900	2,312.00	2,080,800
日産自動車	23,500	576.10	13,538,350
トヨタ自動車	18,200	9,650.00	175,630,000
新明和工業	400	950.00	380,000
本田技研工業	10,100	3,448.00	34,824,800
シマノ	500	27,955.00	13,977,500
テルモ	4,200	4,404.00	18,496,800
島津製作所	1,700	4,315.00	7,335,500
ニコン	2,100	1,070.00	2,247,000
オリンパス	7,200	2,200.00	15,840,000
HOYA	2,100	14,845.00	31,174,500
シチズン時計	1,800	410.00	738,000
バンダイナムコホールディングス	1,200	7,233.00	8,679,600
トッパン・フォームズ	600	1,069.00	641,400
凸版印刷	2,000	1,740.00	3,480,000
大日本印刷	1,800	2,377.00	4,278,600
NISSHA	300	1,586.00	475,800
アシックス	1,100	2,512.00	2,763,200
ヤマハ	1,100	5,890.00	6,479,000
ビジョン	700	3,230.00	2,261,000
リンテック	400	2,351.00	940,400
任天堂	700	63,290.00	44,303,000
タカラスタンダード	400	1,546.00	618,400
コクヨ	700	1,764.00	1,234,800
オカムラ	600	1,473.00	883,800
東京電力ホールディングス	9,000	321.00	2,889,000
中部電力	4,200	1,334.00	5,602,800
関西電力	5,200	1,052.50	5,473,000
東北電力	2,800	864.00	2,419,200
九州電力	2,600	844.00	2,194,400

東京瓦斯	2,500	2,054.00	5,135,000
大阪瓦斯	2,300	2,016.00	4,636,800
東武鉄道	1,200	2,903.00	3,483,600
東急	3,500	1,580.00	5,530,000
小田急電鉄	2,100	2,816.00	5,913,600
東日本旅客鉄道	2,100	8,111.00	17,033,100
西日本旅客鉄道	1,100	6,542.00	7,196,200
東海旅客鉄道	1,100	17,325.00	19,057,500
近鉄グループホールディングス	1,100	3,965.00	4,361,500
阪急阪神ホールディングス	1,400	3,475.00	4,865,000
日本通運	500	8,120.00	4,060,000
ヤマトホールディングス	2,200	3,295.00	7,249,000
福山通運	300	4,000.00	1,200,000
セイノーホールディングス	1,200	1,365.00	1,638,000
S Gホールディングス	3,600	2,889.00	10,400,400
日本郵船	900	5,340.00	4,806,000
商船三井	700	5,030.00	3,521,000
日本航空	2,400	2,483.00	5,959,200
ANAホールディングス	2,700	2,743.00	7,406,100
三菱倉庫	500	3,215.00	1,607,500
三井倉庫ホールディングス	100	2,544.00	254,400
住友倉庫	500	1,557.00	778,500
上組	700	2,241.00	1,568,700
T I S	1,500	2,817.00	4,225,500
ネクソン	5,000	2,275.00	11,375,000
GMOペイメントゲートウェイ	400	13,790.00	5,516,000
野村総合研究所	3,400	3,580.00	12,172,000
オービック	600	20,430.00	12,258,000
Zホールディングス	42,700	544.30	23,241,610
トレンドマイクロ	800	5,710.00	4,568,000
日本オラクル	700	8,070.00	5,649,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,300	3,385.00	4,400,500
大塚商会	1,100	5,700.00	6,270,000
日本ユニシス	600	3,400.00	2,040,000
日本電信電話	14,700	2,849.50	41,887,650

KDD I	12,900	3,450.00	44,505,000
東宝	1,000	4,605.00	4,605,000
エヌ・ティ・ティ・データ	7,800	1,719.00	13,408,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	700	5,220.00	3,654,000
コナミホールディングス	800	6,300.00	5,040,000
ソフトバンクグループ	9,600	7,327.00	70,339,200
双日	7,000	334.00	2,338,000
伊藤忠商事	8,800	3,184.00	28,019,200
丸紅	9,700	946.30	9,179,110
豊田通商	2,000	5,090.00	10,180,000
三井物産	9,400	2,519.50	23,683,300
住友商事	7,000	1,469.00	10,283,000
三菱商事	8,300	3,063.00	25,422,900
キヤノンマーケティングジャパン	700	2,526.00	1,768,200
岩谷産業	300	6,390.00	1,917,000
サンリオ	500	1,993.00	996,500
スズケン	600	3,285.00	1,971,000
ローソン	600	5,160.00	3,096,000
エービーシー・マート	500	6,270.00	3,135,000
J. フロント リテイリング	1,500	1,015.00	1,522,500
ZOZO	1,700	3,525.00	5,992,500
三越伊勢丹ホールディングス	2,200	799.00	1,757,800
セブン&アイ・ホールディングス	4,900	5,018.00	24,588,200
良品計画	1,600	2,060.00	3,296,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	3,500	2,350.00	8,225,000
しまむら	200	10,130.00	2,026,000
高島屋	1,000	1,251.00	1,251,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	700	933.00	653,100
丸井グループ	1,200	2,046.00	2,455,200
イオン	4,900	2,919.00	14,303,100
イズミ	400	4,005.00	1,602,000
ヤマダホールディングス	5,400	496.00	2,678,400
ニトリホールディングス	600	19,620.00	11,772,000
ファーストリテイリング	600	79,680.00	47,808,000

サンドラッグ	700	3,410.00	2,387,000
めぶきフィナンシャルグループ	6,600	232.00	1,531,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	6,700	395.00	2,646,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	75,800	586.80	44,479,440
りそなホールディングス	10,800	415.50	4,487,400
三井住友トラスト・ホールディングス	2,100	3,506.00	7,362,600
三井住友フィナンシャルグループ	7,700	3,716.00	28,613,200
千葉銀行	4,500	637.00	2,866,500
ふくおかフィナンシャルグループ	1,100	1,851.00	2,036,100
静岡銀行	3,300	822.00	2,712,600
みずほフィナンシャルグループ	14,200	1,560.00	22,152,000
大和証券グループ本社	9,500	562.80	5,346,600
野村ホールディングス	18,000	542.30	9,761,400
SOMPOホールディングス	2,100	4,292.00	9,013,200
MS&ADインシュアランスグループホール	3,300	3,249.00	10,721,700
第一生命ホールディングス	6,200	1,914.50	11,869,900
東京海上ホールディングス	3,900	5,078.00	19,804,200
クレディセゾン	1,000	1,322.00	1,322,000
東京センチュリー	700	5,540.00	3,878,000
イオンフィナンシャルサービス	1,200	1,375.00	1,650,000
アコム	8,700	462.00	4,019,400
オリックス	7,200	1,860.50	13,395,600
三菱HCキャピタル	8,200	588.00	4,821,600
日本取引所グループ	3,000	2,428.00	7,284,000
ヒューリック	3,800	1,243.00	4,723,400
飯田グループホールディングス	1,600	2,618.00	4,188,800
三井不動産	5,400	2,617.50	14,134,500
三菱地所	7,800	1,752.00	13,665,600
住友不動産	2,700	3,776.00	10,195,200
イオンモール	1,300	1,680.00	2,184,000
総合警備保障	600	4,925.00	2,955,000
エムスリー	3,800	7,631.00	28,997,800
ディー・エヌ・エー	700	2,229.00	1,560,300

	博報堂DYホールディングス	2,200	1,682.00	3,700,400	
	電通グループ	1,600	4,000.00	6,400,000	
	H. U. グループホールディングス	300	2,801.00	840,300	
	オリエンタルランド	2,000	15,825.00	31,650,000	
	ユー・エス・エス	1,700	1,871.00	3,180,700	
	サイバーエージェント	2,800	2,272.00	6,361,600	
	楽天グループ	8,800	1,277.00	11,237,600	
	リクルートホールディングス	9,500	5,514.00	52,383,000	
	日本郵政	8,300	910.50	7,557,150	
	トランス・コスモス	300	3,115.00	934,500	
	セコム	1,300	8,335.00	10,835,500	
	ベネッセホールディングス	600	2,732.00	1,639,200	
	小計 銘柄数：300			2,812,593,690	
	組入時価比率：99.8%			100.0%	
	合計			2,812,593,690	

(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7月10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。