

平成29年10月期（平成29年4月8日～平成29年10月7日）決算短信

平成29年11月16日

上場取引所 東証

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兼執行役社長 渡邊 国夫
 問合せ先責任者 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成29年12月20日
 分配金支払開始日 平成29年11月15日

I ファンドの運用状況

1. 平成29年10月期の運用状況（平成29年4月8日～平成29年10月7日）

(1)資産内訳 (百万円未満切捨て)

	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)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
平成29年10月期	2,840	(98.4)	46	(1.6)	2,887	(100)
平成29年4月期	2,516	(97.5)	64	(2.5)	2,581	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成29年10月期	154	0	0	154
平成29年4月期	154	0	0	154

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
平成29年10月期	2,923	35	2,887	18,747
平成29年4月期	2,619	38	2,581	16,757

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成29年10月期	175.00
平成29年4月期	183.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有 無
 ② ①以外の変更 有 無

II 財務諸表等

NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (平成29年4月7日現在)	第8期 (平成29年10月7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	42,676,148	49,696,847
株式	2,516,994,470	2,840,656,650
派生商品評価勘定	-	3,150,684
未収入金	25,348,900	1,730,010
未収配当金	29,650,872	28,028,818
差入委託証拠金	4,793,400	-
流動資産合計	2,619,463,790	2,923,263,009
資産合計	2,619,463,790	2,923,263,009
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,962,936	-
前受金	-	2,847,600
未払収益分配金	28,187,124	26,954,900
未払受託者報酬	703,672	741,078
未払委託者報酬	3,518,310	3,705,325
未払利息	47	104
その他未払費用	4,002,919	1,473,952
流動負債合計	38,375,008	35,722,959
負債合計	38,375,008	35,722,959
純資産の部		
元本等		
元本	2,053,039,212	2,053,039,212
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	528,049,570	834,500,838
(分配準備積立金)	22,895	53,482
元本等合計	2,581,088,782	2,887,540,050
純資産合計	2,581,088,782	2,887,540,050
負債純資産合計	2,619,463,790	2,923,263,009

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 自 平成28年10月8日 至 平成29年4月7日	第8期 自 平成29年4月8日 至 平成29年10月7日
営業収益		
受取配当金	33,684,114	32,885,615
有価証券売買等損益	267,748,047	297,713,955
派生商品取引等損益	3,557,466	8,706,726
その他収益	18,461	25,467

営業収益合計	305,008,088	339,331,763
営業費用		
支払利息	8,494	15,248
受託者報酬	703,672	741,078
委託者報酬	3,518,310	3,705,325
その他費用	1,408,000	1,463,944
営業費用合計	5,638,476	5,925,595
営業利益又は営業損失(△)	299,369,612	333,406,168
経常利益又は経常損失(△)	299,369,612	333,406,168
当期純利益又は当期純損失(△)	299,369,612	333,406,168
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(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	256,867,082	528,049,570
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	28,187,124	26,954,900
期末剰余金又は期末欠損金(△)	528,049,570	834,500,838

(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 受取配当金は、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。 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、平成 29 年 4 月 8 日から平成 29 年 10 月 7 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 7 期 平成 29 年 4 月 7 日現在	第 8 期 平成 29 年 10 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 16,757 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 18,747 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 7 期 自平成 28 年 10 月 8 日 至平成 29 年 4 月 7 日	第 8 期 自平成 29 年 4 月 8 日 至平成 29 年 10 月 7 日
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程

項目		
当期配当等収益額	A	33,694,081 円
分配準備積立金	B	145,920 円
配当等収益合計額	C=A+B	33,840,001 円
経費	D	5,629,982 円
収益分配可能額	E=C-D	28,210,019 円
収益分配金	F	28,187,124 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	22,895 円
口数	H	154,028 口
1 口当たり分配金	I=F/H	183 円

2. その他費用

その他費用のうち 1,266,553 円は、対象指数についての商標使用料であります。

項目		
当期配当等収益額	A	32,895,834 円
分配準備積立金	B	22,895 円
配当等収益合計額	C=A+B	32,918,729 円
経費	D	5,910,347 円
収益分配可能額	E=C-D	27,008,382 円
収益分配金	F	26,954,900 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	53,482 円
口数	H	154,028 口
1 口当たり分配金	I=F/H	175 円

2. その他費用

その他費用のうち 1,323,323 円は、対象指数についての商標使用料であります。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日	第 8 期 自 平成 29 年 4 月 8 日 至 平成 29 年 10 月 7 日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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。</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>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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 7 期 平成 29 年 4 月 7 日現在	第 8 期 平成 29 年 10 月 7 日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>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</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

<p>おります。</p> <p>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。</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 ります。</p>	
--	--

(関連当事者との取引に関する注記)

<p>第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日</p>	<p>第 8 期 自 平成 29 年 4 月 8 日 至 平成 29 年 10 月 7 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。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

<p>第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日</p>	<p>第 8 期 自 平成 29 年 4 月 8 日 至 平成 29 年 10 月 7 日</p>
期首元本額 2,053,039,212 円	期首元本額 2,053,039,212 円
期中追加設定元本額 0 円	期中追加設定元本額 0 円
期中一部交換元本額 0 円	期中一部交換元本額 0 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日	第 8 期 自 平成 29 年 4 月 8 日 至 平成 29 年 10 月 7 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	239,831,720	296,623,443
合計	239,831,720	296,623,443

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第 7 期(平成 29 年 4 月 7 日現在)			第 8 期(平成 29 年 10 月 7 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)
市場取引						
株価指数先物取引						
買建	64,727,400	62,769,000	△1,962,936	42,408,900	45,562,500	3,150,684
合計	64,727,400	62,769,000	△1,962,936	42,408,900	45,562,500	3,150,684

(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(平成 29 年 10 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	2,000	652.00	1,304,000	
		マルハニチロ	200	3,495.00	699,000	
		国際石油開発帝石	6,700	1,180.00	7,906,000	
		石油資源開発	400	2,396.00	958,400	
		ミライト・ホールディングス	800	1,369.00	1,095,200	
		コムシスホールディングス	800	2,698.00	2,158,400	
		ミサワホーム	700	959.00	671,300	
		大成建設	1,000	5,890.00	5,890,000	
		大林組	3,200	1,359.00	4,348,800	
		清水建設	2,300	1,252.00	2,879,600	
		長谷工コーポレーション	2,400	1,524.00	3,657,600	
		鹿島建設	4,000	1,114.00	4,456,000	
		西松建設	300	3,195.00	958,500	
		前田建設工業	600	1,300.00	780,000	
		戸田建設	1,000	862.00	862,000	
		熊谷組	200	3,405.00	681,000	
		大東建託	300	20,235.00	6,070,500	
		五洋建設	1,100	704.00	774,400	
		住友林業	1,300	1,796.00	2,334,800	
		大和ハウス工業	2,800	3,918.00	10,970,400	
		積水ハウス	3,900	1,946.00	7,589,400	
		関電工	600	1,114.00	668,400	
		きんでん	1,200	1,775.00	2,130,000	
		協和エクシオ	600	2,206.00	1,323,600	
		日揮	1,400	1,849.00	2,588,600	
		千代田化工建設	900	650.00	585,000	
		日本製粉	400	1,714.00	685,600	
		日清製粉グループ本社	1,000	1,916.00	1,916,000	
		江崎グリコ	100	6,010.00	601,000	
		山崎製パン	500	2,082.00	1,041,000	
カルビー	200	4,000.00	800,000			
森永乳業	200	4,365.00	873,000			

ヤクルト本社	300	8,180.00	2,454,000
明治ホールディングス	300	8,850.00	2,655,000
雪印メグミルク	200	3,175.00	635,000
日本ハム	1,000	3,175.00	3,175,000
丸大食品	1,000	544.00	544,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,100	1,038.00	1,141,800
サッポロホールディングス	300	3,315.00	994,500
アサヒグループホールディングス	1,700	4,910.00	8,347,000
キリンホールディングス	5,300	2,718.50	14,408,050
宝ホールディングス	600	1,045.00	627,000
コカ・コーラボトラーズジャパン	800	3,780.00	3,024,000
サントリー食品インターナショナル	500	5,040.00	2,520,000
伊藤園	300	3,770.00	1,131,000
日清オイリオグループ	300	3,715.00	1,114,500
不二製油グループ本社	300	2,964.00	889,200
キッコーマン	400	3,515.00	1,406,000
味の素	2,700	2,218.50	5,989,950
キューピー	500	2,781.00	1,390,500
ハウス食品グループ本社	300	3,430.00	1,029,000
カゴメ	200	3,615.00	723,000
ニチレイ	600	2,846.00	1,707,600
東洋水産	400	4,240.00	1,696,000
日清食品ホールディングス	200	6,900.00	1,380,000
日本たばこ産業	4,300	3,690.00	15,867,000
グンゼ	100	5,050.00	505,000
東洋紡	600	2,113.00	1,267,800
帝人	1,300	2,259.00	2,936,700
東レ	6,900	1,094.50	7,552,050
ワコールホールディングス	300	3,275.00	982,500
T S I ホールディングス	1,000	865.00	865,000
オンワードホールディングス	1,000	847.00	847,000
王子ホールディングス	8,000	600.00	4,800,000
日本製紙	1,100	2,116.00	2,327,600
北越紀州製紙	1,100	728.00	800,800
大王製紙	600	1,349.00	809,400
レンゴー	1,700	643.00	1,093,100

クラレ	2,100	2,127.00	4,466,700
旭化成	8,700	1,386.00	12,058,200
昭和電工	1,800	3,570.00	6,426,000
住友化学	15,000	696.00	10,440,000
日産化学工業	400	3,880.00	1,552,000
日本曹達	1,000	695.00	695,000
東ソー	1,600	2,472.00	3,955,200
トクヤマ	300	2,650.00	795,000
セントラル硝子	400	2,453.00	981,200
東亜合成	700	1,495.00	1,046,500
デンカ	800	3,765.00	3,012,000
信越化学工業	1,400	10,105.00	14,147,000
エア・ウォーター	800	2,066.00	1,652,800
大陽日酸	700	1,341.00	938,700
日本触媒	200	8,030.00	1,606,000
カネカ	2,000	873.00	1,746,000
三菱瓦斯化学	1,300	2,589.00	3,365,700
三井化学	1,200	3,350.00	4,020,000
J S R	1,500	2,081.00	3,121,500
東京応化工業	200	3,940.00	788,000
三菱ケミカルホールディングス	14,400	1,106.00	15,926,400
ダイセル	1,600	1,355.00	2,168,000
住友ベークライト	1,000	828.00	828,000
積水化学工業	2,700	2,190.00	5,913,000
日本ゼオン	1,000	1,486.00	1,486,000
アイカ工業	200	3,715.00	743,000
宇部興産	1,200	3,285.00	3,942,000
日立化成	600	3,025.00	1,815,000
日本化薬	900	1,735.00	1,561,500
ADEKA	500	1,966.00	983,000
日油	300	3,075.00	922,500
花王	1,700	6,586.00	11,196,200
日本ペイントホールディングス	200	3,665.00	733,000
関西ペイント	500	2,731.00	1,365,500
D I C	600	4,175.00	2,505,000
東洋インキSCホールディングス	2,000	636.00	1,272,000

富士フイルムホールディングス	3,100	4,425.00	13,717,500
資生堂	1,400	4,452.00	6,232,800
ライオン	500	2,038.00	1,019,000
コーセー	100	13,000.00	1,300,000
ポーラ・オルビスホールディングス	200	3,355.00	671,000
小林製薬	100	6,240.00	624,000
日東電工	800	9,470.00	7,576,000
ニフコ	200	6,740.00	1,348,000
ユニ・チャーム	1,000	2,620.00	2,620,000
協和発酵キリン	900	1,960.00	1,764,000
武田薬品工業	3,500	6,185.00	21,647,500
アステラス製薬	9,600	1,456.00	13,977,600
大日本住友製薬	400	1,519.00	607,600
塩野義製薬	600	6,263.00	3,757,800
田辺三菱製薬	700	2,599.00	1,819,300
中外製薬	400	4,735.00	1,894,000
科研製薬	100	5,700.00	570,000
エーザイ	800	5,889.00	4,711,200
ロート製薬	400	2,561.00	1,024,400
小野薬品工業	500	2,559.00	1,279,500
久光製薬	200	5,420.00	1,084,000
参天製薬	900	1,745.00	1,570,500
ツムラ	200	4,085.00	817,000
沢井製薬	100	6,490.00	649,000
第一三共	3,100	2,500.00	7,750,000
キョーリン製薬ホールディングス	200	2,278.00	455,600
大塚ホールディングス	1,800	4,506.00	8,110,800
大正製薬ホールディングス	100	8,570.00	857,000
昭和シェル石油	2,500	1,288.00	3,220,000
富士石油	1,500	438.00	657,000
出光興産	1,400	3,170.00	4,438,000
JXTGホールディングス	61,600	570.20	35,124,320
コスモエネルギーホールディングス	500	2,609.00	1,304,500
横浜ゴム	1,000	2,418.00	2,418,000
東洋ゴム工業	700	2,537.00	1,775,900
ブリヂストン	3,800	5,196.00	19,744,800

住友ゴム工業	1,400	2,088.00	2,923,200
旭硝子	1,900	4,245.00	8,065,500
日本板硝子	1,000	887.00	887,000
日本電気硝子	800	4,305.00	3,444,000
住友大阪セメント	3,000	497.00	1,491,000
太平洋セメント	1,000	4,350.00	4,350,000
東海カーボン	1,700	1,080.00	1,836,000
TOTO	500	4,925.00	2,462,500
日本碍子	800	2,160.00	1,728,000
日本特殊陶業	800	2,451.00	1,960,800
新日鐵住金	8,400	2,654.50	22,297,800
神戸製鋼所	5,200	1,368.00	7,113,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	6,700	2,254.00	15,101,800
日新製鋼	900	1,493.00	1,343,700
大和工業	200	3,050.00	610,000
丸一鋼管	200	3,305.00	661,000
大同特殊鋼	300	6,740.00	2,022,000
山陽特殊製鋼	200	2,982.00	596,400
愛知製鋼	100	4,455.00	445,500
日立金属	1,200	1,585.00	1,902,000
日本軽金属ホールディングス	4,000	336.00	1,344,000
三井金属鉱業	700	6,000.00	4,200,000
三菱マテリアル	1,500	3,940.00	5,910,000
住友金属鉱山	2,000	3,859.00	7,718,000
DOWAホールディングス	400	4,350.00	1,740,000
UACJ	200	3,280.00	656,000
古河電気工業	600	6,510.00	3,906,000
住友電気工業	6,300	1,839.00	11,585,700
フジクラ	2,700	914.00	2,467,800
SUMCO	1,200	1,803.00	2,163,600
東洋製罐グループホールディングス	1,200	1,942.00	2,330,400
三和ホールディングス	1,000	1,281.00	1,281,000
三協立山	400	1,580.00	632,000
LIXILグループ	1,700	3,070.00	5,219,000
リンナイ	100	9,650.00	965,000

日本発條	1,500	1,240.00	1,860,000
日本製鋼所	300	2,681.00	804,300
オークマ	100	6,410.00	641,000
アマダホールディングス	1,600	1,252.00	2,003,200
オーエスジー	300	2,571.00	771,300
DMG 森精機	900	2,056.00	1,850,400
ディスコ	100	22,890.00	2,289,000
ナブテスコ	500	4,140.00	2,070,000
SMC	100	39,520.00	3,952,000
小松製作所	5,300	3,281.00	17,389,300
住友重機械工業	900	4,440.00	3,996,000
日立建機	900	3,410.00	3,069,000
クボタ	3,900	2,065.00	8,053,500
荏原製作所	500	3,780.00	1,890,000
ダイキン工業	600	11,560.00	6,936,000
栗田工業	600	3,205.00	1,923,000
椿本チエイン	1,000	909.00	909,000
ダイフク	300	5,320.00	1,596,000
タダノ	400	1,325.00	530,000
フジテック	500	1,573.00	786,500
平和	300	2,214.00	664,200
SANKYO	400	3,645.00	1,458,000
グローリー	300	4,065.00	1,219,500
セガサミーホールディングス	1,300	1,590.00	2,067,000
ホシザキ	100	9,940.00	994,000
日本精工	2,400	1,531.00	3,674,400
NTN	3,400	490.00	1,666,000
ジェイテクト	1,600	1,617.00	2,587,200
THK	600	3,860.00	2,316,000
マキタ	600	4,470.00	2,682,000
日立造船	1,300	598.00	777,400
三菱重工業	2,300	4,467.00	10,274,100
IHI	800	4,005.00	3,204,000
日清紡ホールディングス	1,200	1,333.00	1,599,600
イビデン	1,300	1,813.00	2,356,900
コニカミノルタ	4,900	951.00	4,659,900

ブラザー工業	1,300	2,565.00	3,334,500
ミネベアミツミ	2,000	1,805.00	3,610,000
日立製作所	48,000	812.10	38,980,800
東芝	23,000	315.00	7,245,000
三菱電機	10,400	1,797.00	18,688,800
富士電機	3,000	631.00	1,893,000
安川電機	800	3,570.00	2,856,000
東芝テック	1,000	623.00	623,000
マブチモーター	100	5,720.00	572,000
日本電産	400	13,915.00	5,566,000
JVCケンウッド	1,900	333.00	632,700
オムロン	1,200	5,690.00	6,828,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	2,000	592.00	1,184,000
日本電気	2,500	3,065.00	7,662,500
富士通	15,000	848.80	12,732,000
沖電気工業	700	1,523.00	1,066,100
セイコーエプソン	1,600	2,686.00	4,297,600
アルバック	200	6,940.00	1,388,000
ジャパンディスプレイ	7,100	248.00	1,760,800
パナソニック	16,900	1,624.50	27,454,050
アンリツ	1,100	925.00	1,017,500
ソニー	5,400	4,151.00	22,415,400
TDK	900	7,650.00	6,885,000
アルプス電気	800	3,020.00	2,416,000
パイオニア	3,600	211.00	759,600
フォスター電機	300	2,367.00	710,100
ホンデン	900	1,905.00	1,714,500
ヒロセ電機	100	15,860.00	1,586,000
マクセルホールディングス	500	2,492.00	1,246,000
アルパイン	500	2,083.00	1,041,500
横河電機	900	1,982.00	1,783,800
アズビル	300	4,750.00	1,425,000
日本光電工業	300	2,598.00	779,400
堀場製作所	100	6,330.00	633,000
アドバンテスト	400	2,271.00	908,400

キーエンス	100	59,390.00	5,939,000
シスメックス	100	7,300.00	730,000
スタンレー電気	600	3,930.00	2,358,000
ウシオ電機	600	1,548.00	928,800
カシオ計算機	1,100	1,619.00	1,780,900
ファナック	500	23,900.00	11,950,000
ローム	500	9,630.00	4,815,000
浜松ホトニクス	300	3,455.00	1,036,500
新光電気工業	900	776.00	698,400
京セラ	1,600	7,115.00	11,384,000
太陽誘電	900	1,724.00	1,551,600
村田製作所	500	16,365.00	8,182,500
小糸製作所	300	6,970.00	2,091,000
ミツバ	300	1,765.00	529,500
S C R E E Nホールディングス	100	7,780.00	778,000
キヤノン	9,400	3,909.00	36,744,600
リコー	6,500	1,136.00	7,384,000
東京エレクトロン	600	17,025.00	10,215,000
トヨタ紡織	400	2,425.00	970,000
ユニプレス	600	3,175.00	1,905,000
豊田自動織機	900	6,450.00	5,805,000
デンソー	3,100	5,740.00	17,794,000
東海理化電機製作所	500	2,273.00	1,136,500
三井造船	800	1,481.00	1,184,800
川崎重工業	1,200	3,855.00	4,626,000
日産自動車	19,400	1,091.50	21,175,100
いすゞ自動車	4,600	1,509.50	6,943,700
トヨタ自動車	14,800	6,889.00	101,957,200
日野自動車	2,200	1,378.00	3,031,600
三菱自動車工業	14,900	919.00	13,693,100
日産車体	1,000	1,202.00	1,202,000
新明和工業	800	1,028.00	822,400
日信工業	400	2,026.00	810,400
タチエス	400	2,047.00	818,800
NOK	600	2,554.00	1,532,400
フタバ産業	1,100	1,236.00	1,359,600

K Y B	200	6,910.00	1,382,000
プレス工業	1,200	601.00	721,200
ケーヒン	500	1,946.00	973,000
アイシン精機	1,500	6,030.00	9,045,000
マツダ	4,000	1,730.00	6,920,000
本田技研工業	14,200	3,395.00	48,209,000
スズキ	3,100	5,932.00	18,389,200
S U B A R U	2,400	4,005.00	9,612,000
ヤマハ発動機	1,400	3,265.00	4,571,000
ショーワ	1,400	1,394.00	1,951,600
エクセディ	200	3,410.00	682,000
豊田合成	600	2,787.00	1,672,200
日本精機	300	2,285.00	685,500
エフ・シー・シー	200	2,522.00	504,400
シマノ	100	14,600.00	1,460,000
テイ・エス テック	500	3,825.00	1,912,500
テルモ	800	4,495.00	3,596,000
島津製作所	600	2,220.00	1,332,000
ニコン	2,400	1,948.00	4,675,200
オリンパス	500	3,935.00	1,967,500
HOYA	1,900	6,125.00	11,637,500
シチズン時計	2,100	769.00	1,614,900
ニプロ	800	1,630.00	1,304,000
バンダイナムコホールディングス	900	3,850.00	3,465,000
トッパン・フォームズ	500	1,220.00	610,000
凸版印刷	4,000	1,116.00	4,464,000
大日本印刷	2,900	2,679.00	7,769,100
アシックス	500	1,715.00	857,500
ヤマハ	500	4,195.00	2,097,500
ピジョン	200	3,765.00	753,000
リンテック	400	2,942.00	1,176,800
任天堂	200	43,670.00	8,734,000
コクヨ	400	1,840.00	736,000
東京電力ホールディングス	32,300	464.00	14,987,200
中部電力	6,500	1,409.50	9,161,750
関西電力	7,200	1,495.50	10,767,600

中国電力	3,000	1,221.00	3,663,000
北陸電力	1,800	963.00	1,733,400
東北電力	3,700	1,474.00	5,453,800
四国電力	1,800	1,345.00	2,421,000
九州電力	2,100	1,240.00	2,604,000
北海道電力	1,500	814.00	1,221,000
沖縄電力	400	2,493.00	997,200
電源開発	1,300	2,877.00	3,740,100
東京瓦斯	4,400	2,814.50	12,383,800
大阪瓦斯	3,000	2,140.00	6,420,000
東邦瓦斯	400	3,355.00	1,342,000
静岡ガス	700	897.00	627,900
東武鉄道	1,000	3,075.00	3,075,000
相鉄ホールディングス	300	2,718.00	815,400
東京急行電鉄	2,500	1,615.00	4,037,500
京浜急行電鉄	500	2,255.00	1,127,500
小田急電鉄	800	2,111.00	1,688,800
京王電鉄	300	4,560.00	1,368,000
京成電鉄	400	3,100.00	1,240,000
東日本旅客鉄道	1,600	10,300.00	16,480,000
西日本旅客鉄道	1,000	7,669.00	7,669,000
東海旅客鉄道	600	19,715.00	11,829,000
西武ホールディングス	400	1,919.00	767,600
西日本鉄道	300	2,728.00	818,400
近鉄グループホールディングス	700	4,180.00	2,926,000
阪急阪神ホールディングス	1,100	4,230.00	4,653,000
南海電気鉄道	400	2,807.00	1,122,800
京阪ホールディングス	300	3,305.00	991,500
名古屋鉄道	800	2,416.00	1,932,800
日本通運	900	7,080.00	6,372,000
ヤマトホールディングス	2,100	2,247.50	4,719,750
山九	400	4,650.00	1,860,000
ニッコンホールディングス	300	2,775.00	832,500
セイノーホールディングス	1,300	1,563.00	2,031,900
日立物流	400	2,689.00	1,075,600
日本郵船	2,700	2,346.00	6,334,200

商船三井	1,100	3,420.00	3,762,000
川崎汽船	1,100	2,971.00	3,268,100
日本航空	3,200	3,770.00	12,064,000
ANAホールディングス	2,400	4,208.00	10,099,200
三菱倉庫	200	2,873.00	574,600
上組	800	2,564.00	2,051,200
T I S	400	3,195.00	1,278,000
グリーン	1,100	779.00	856,900
ネクソン	400	3,060.00	1,224,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,700	307.00	1,135,900
野村総合研究所	500	4,200.00	2,100,000
フジ・メディア・ホールディングス	1,500	1,621.00	2,431,500
オービック	100	6,840.00	684,000
ヤフー	3,400	517.00	1,757,800
トレンドマイクロ	400	5,680.00	2,272,000
日本オラクル	100	8,750.00	875,000
伊藤忠テクノソリューションズ	300	4,010.00	1,203,000
大塚商会	300	7,110.00	2,133,000
ネットワンシステムズ	1,000	1,146.00	1,146,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	400	1,531.00	612,400
日本ユニシス	400	1,715.00	686,000
東京放送ホールディングス	500	2,139.00	1,069,500
日本テレビホールディングス	800	1,959.00	1,567,200
テレビ朝日ホールディングス	300	2,187.00	656,100
スカパーJ S A Tホールディングス	1,200	502.00	602,400
日本電信電話	14,500	5,174.00	75,023,000
K D D I	8,300	2,988.00	24,800,400
光通信	100	13,900.00	1,390,000
N T T ドコモ	8,000	2,562.00	20,496,000
カドカワ	400	1,346.00	538,400
東宝	300	3,930.00	1,179,000
エス・ティ・ティ・データ	3,400	1,206.00	4,100,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	4,275.00	855,000
S C S K	200	4,655.00	931,000

コナミホールディングス	300	5,360.00	1,608,000
ソフトバンクグループ	3,700	9,173.00	33,940,100
あらた	200	4,690.00	938,000
双日	21,000	312.00	6,552,000
アルフレッサ ホールディングス	1,500	2,088.00	3,132,000
ダイワボウホールディングス	300	4,910.00	1,473,000
マクニカ・富士エレホールディングス	500	2,164.00	1,082,000
シップヘルスケアホールディングス	200	3,510.00	702,000
三菱食品	200	3,265.00	653,000
第一興商	200	5,310.00	1,062,000
メディパルホールディングス	1,700	2,050.00	3,485,000
黒田電気	300	1,969.00	590,700
伊藤忠商事	18,200	1,837.50	33,442,500
丸紅	30,200	761.60	23,000,320
長瀬産業	1,400	1,877.00	2,627,800
豊田通商	3,000	3,755.00	11,265,000
兼松	1,400	1,402.00	1,962,800
三井物産	20,700	1,644.00	34,030,800
日立ハイテクノロジーズ	300	4,275.00	1,282,500
カメイ	700	1,798.00	1,258,600
住友商事	14,200	1,581.00	22,450,200
三菱商事	13,400	2,610.00	34,974,000
キヤノンマーケティングジャパン	400	2,582.00	1,032,800
阪和興業	600	4,045.00	2,427,000
岩谷産業	300	3,380.00	1,014,000
三愛石油	1,400	1,274.00	1,783,600
稲畑産業	700	1,495.00	1,046,500
東邦ホールディングス	500	2,145.00	1,072,500
サンゲツ	400	1,971.00	788,400
伊藤忠エネクス	1,000	1,218.00	1,218,000
サンリオ	300	2,113.00	633,900
リョーサン	300	4,415.00	1,324,500
三信電気	600	1,672.00	1,003,200
PAL TAC	400	4,485.00	1,794,000
日鉄住金物産	300	5,950.00	1,785,000

オートバックスセブン	800	1,863.00	1,490,400
加藤産業	300	3,375.00	1,012,500
因幡電機産業	200	4,695.00	939,000
ミスミグループ本社	400	2,833.00	1,133,200
スズケン	800	4,020.00	3,216,000
ローソン	300	7,460.00	2,238,000
エービーシー・マート	100	5,950.00	595,000
ゲオホールディングス	600	1,595.00	957,000
アダストリア	200	2,576.00	515,200
日本マクドナルドホールディングス	200	4,875.00	975,000
エディオン	1,200	1,070.00	1,284,000
ビックカメラ	700	1,289.00	902,300
DCMホールディングス	1,000	1,009.00	1,009,000
J. フロント リテイリング	1,900	1,595.00	3,030,500
マツモトキヨシホールディングス	300	7,600.00	2,280,000
ココカラファイン	200	6,240.00	1,248,000
三越伊勢丹ホールディングス	3,000	1,221.00	3,663,000
すかいらーく	600	1,676.00	1,005,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	800	1,032.00	825,600
セブン&アイ・ホールディングス	4,500	4,328.00	19,476,000
ツルハホールディングス	100	13,460.00	1,346,000
良品計画	100	32,200.00	3,220,000
コーナン商事	300	2,076.00	622,800
ドンキホーテホールディングス	400	4,315.00	1,726,000
ゼンショーホールディングス	300	2,036.00	610,800
スギホールディングス	100	5,720.00	572,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	300	6,180.00	1,854,000
日本瓦斯	200	3,580.00	716,000
島忠	300	2,937.00	881,100
コメリ	300	3,280.00	984,000
青山商事	400	4,020.00	1,608,000
しまむら	100	12,870.00	1,287,000
高島屋	3,000	1,071.00	3,213,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	900	2,066.00	1,859,400
丸井グループ	1,100	1,692.00	1,861,200

イオン	6,100	1,691.50	10,318,150
イズミ	200	5,610.00	1,122,000
平和堂	300	2,417.00	725,100
ケーズホールディングス	900	2,543.00	2,288,700
ヤマダ電機	6,900	607.00	4,188,300
ニトリホールディングス	100	16,020.00	1,602,000
吉野家ホールディングス	400	1,871.00	748,400
アークス	400	2,516.00	1,006,400
バローホールディングス	300	2,413.00	723,900
ファーストリテイリング	100	35,230.00	3,523,000
サンドラッグ	300	4,625.00	1,387,500
じもとホールディングス	4,200	213.00	894,600
めぶきフィナンシャルグループ	4,500	443.00	1,993,500
東京T Yフィナンシャルグループ	600	2,889.00	1,733,400
ゆうちょ銀行	5,000	1,395.00	6,975,000
富山第一銀行	1,100	548.00	602,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	15,300	578.30	8,847,990
西日本フィナンシャルホールディングス	1,200	1,268.00	1,521,600
新生銀行	600	1,845.00	1,107,000
あおぞら銀行	2,100	4,315.00	9,061,500
三菱UF J フィナンシャル・グループ	108,600	734.80	79,799,280
りそなホールディングス	91,400	577.10	52,746,940
三井住友トラスト・ホールディングス	14,400	4,141.00	59,630,400
三井住友フィナンシャルグループ	25,900	4,350.00	112,665,000
第四銀行	200	5,400.00	1,080,000
北越銀行	400	2,596.00	1,038,400
千葉銀行	7,000	823.00	5,761,000
群馬銀行	2,600	704.00	1,830,400
武蔵野銀行	200	3,455.00	691,000
千葉興業銀行	2,000	600.00	1,200,000
七十七銀行	1,700	2,790.00	4,743,000
秋田銀行	300	3,410.00	1,023,000
岩手銀行	400	4,580.00	1,832,000
東邦銀行	12,500	428.00	5,350,000

ふくおかフィナンシャルグループ	17,000	532.00	9,044,000	
静岡銀行	2,000	1,033.00	2,066,000	
十六銀行	700	3,700.00	2,590,000	
スルガ銀行	900	2,452.00	2,206,800	
八十二銀行	5,600	708.00	3,964,800	
山梨中央銀行	3,000	475.00	1,425,000	
大垣共立銀行	400	3,145.00	1,258,000	
福井銀行	300	2,935.00	880,500	
北國銀行	500	4,780.00	2,390,000	
南都銀行	300	3,175.00	952,500	
百五銀行	4,700	504.00	2,368,800	
京都銀行	300	5,770.00	1,731,000	
紀陽銀行	1,600	1,892.00	3,027,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	2,500	1,826.00	4,565,000	
広島銀行	3,700	919.00	3,400,300	
山陰合同銀行	3,500	984.00	3,444,000	
中国銀行	2,300	1,567.00	3,604,100	
伊予銀行	2,400	911.00	2,186,400	
百十四銀行	4,000	396.00	1,584,000	
四国銀行	800	1,645.00	1,316,000	
阿波銀行	1,000	730.00	730,000	
大分銀行	300	4,515.00	1,354,500	
宮崎銀行	300	3,830.00	1,149,000	
佐賀銀行	200	2,687.00	537,400	
十八銀行	2,000	278.00	556,000	
沖縄銀行	200	4,505.00	901,000	
琉球銀行	900	1,708.00	1,537,200	
セブン銀行	3,100	401.00	1,243,100	
みずほフィナンシャルグループ	538,400	198.50	106,872,400	
山口フィナンシャルグループ	3,000	1,329.00	3,987,000	
名古屋銀行	200	4,320.00	864,000	
北洋銀行	7,800	361.00	2,815,800	
愛媛銀行	800	1,421.00	1,136,800	
京葉銀行	2,000	529.00	1,058,000	
関西アーバン銀行	400	1,409.00	563,600	
栃木銀行	1,100	482.00	530,200	

東和銀行	1,000	1,167.00	1,167,000
トモニホールディングス	2,100	516.00	1,083,600
フィデアホールディングス	7,500	207.00	1,552,500
池田泉州ホールディングス	3,600	439.00	1,580,400
SBIホールディングス	1,100	1,711.00	1,882,100
大和証券グループ本社	40,000	645.10	25,804,000
野村ホールディングス	31,000	642.50	19,917,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,200	676.00	811,200
SOMPOホールディングス	1,700	4,528.00	7,697,600
MS&ADインシュアランスグループホール	3,800	3,705.00	14,079,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	3,300	1,838.00	6,065,400
第一生命ホールディングス	16,200	2,065.00	33,453,000
東京海上ホールディングス	3,500	4,503.00	15,760,500
T&Dホールディングス	6,700	1,647.50	11,038,250
クレディセゾン	800	2,313.00	1,850,400
日本証券金融	2,100	633.00	1,329,300
イオンフィナンシャルサービス	500	2,368.00	1,184,000
オリックス	7,700	1,827.00	14,067,900
日本取引所グループ	800	2,061.00	1,648,800
野村不動産ホールディングス	900	2,383.00	2,144,700
東急不動産ホールディングス	1,700	693.00	1,178,100
飯田グループホールディングス	900	2,010.00	1,809,000
パーク 2 4	300	2,702.00	810,600
三井不動産	2,600	2,555.00	6,643,000
三菱地所	3,000	1,999.50	5,998,500
東京建物	1,400	1,500.00	2,100,000
住友不動産	1,000	3,514.00	3,514,000
大京	300	2,216.00	664,800
レオパレス 2 1	1,700	827.00	1,405,900
イオンモール	500	1,974.00	987,000
GCA	700	990.00	693,000
パーソルホールディングス	400	2,564.00	1,025,600
総合警備保障	100	5,030.00	503,000
ディー・エヌ・エー	500	2,525.00	1,262,500

博報堂DYホールディングス	1,400	1,537.00	2,151,800	
電通	800	5,040.00	4,032,000	
みらかホールディングス	300	5,180.00	1,554,000	
オリエンタルランド	400	8,882.00	3,552,800	
ダスキン	500	3,005.00	1,502,500	
ラウンドワン	700	1,476.00	1,033,200	
ユー・エス・エス	700	2,289.00	1,602,300	
サイバーエージェント	200	3,235.00	647,000	
楽天	700	1,242.00	869,400	
リクルートホールディングス	2,700	2,543.00	6,866,100	
日本郵政	1,600	1,312.00	2,099,200	
ベルシステム24ホールディングス	800	1,177.00	941,600	
エイチ・アイ・エス	200	3,625.00	725,000	
セコム	800	8,386.00	6,708,800	
メイテック	200	5,470.00	1,094,000	
アサツー ディ・ケイ	400	3,850.00	1,540,000	
ベネッセホールディングス	500	3,980.00	1,990,000	
小計	銘柄数 : 579		2,840,656,650	
	組入時価比率 : 98.4%		100.0%	
合計			2,840,656,650	

(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(平成 29 年 10 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。