

平成29年10月期（平成29年4月21日～平成29年10月20日）決算短信

平成29年11月29日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信  
 コード番号 ( 1480 )  
 連動対象指標 野村企業価値分配指数  
 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30年1月16日  
 分配金支払開始日 平成29年11月28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21日～平成29年10月20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	8,371	(98.1)	161	(1.9)	8,532	(100)
平成29年4月期	7,086	(97.6)	171	(2.4)	7,257	(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	522	0	0	522
平成29年4月期	717	0	194	522

(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	8,627	94	8,532	16,315
平成29年4月期	7,354	96	7,257	13,878

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成29年10月期	133.00
平成29年4月期	142.00

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 野村企業価値分配指数連動型上場投信

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 2 期 (平成 29 年 4 月 20 日現在)	第 3 期 (平成 29 年 10 月 20 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	179,234,328	174,141,277
株式	7,086,809,680	8,371,293,850
派生商品評価勘定	-	11,279,564
未収入金	-	6,503,994
未収配当金	67,963,443	63,914,530
差入委託証拠金	20,430,652	-
流動資産合計	7,354,438,103	8,627,133,215
資産合計	7,354,438,103	8,627,133,215
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,404,964	-
前受金	-	12,236,850
未払金	3,489,050	-
未払収益分配金	74,264,154	69,557,271
未払受託者報酬	2,331,881	2,149,323
未払委託者報酬	8,394,695	7,737,521
未払利息	256	184
その他未払費用	557,493	3,132,280
流動負債合計	96,442,493	94,813,429
負債合計	96,442,493	94,813,429
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,720,905,937	6,720,905,937
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	537,089,673	1,811,413,849
(分配準備積立金)	292,909	240,988
元本等合計	7,257,995,610	8,532,319,786
純資産合計	7,257,995,610	8,532,319,786
負債純資産合計	7,354,438,103	8,627,133,215

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 年 4 月 20 日	第 3 期 自 平成 29 年 4 月 21 日 至 平成 29 年 10 月 20 日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	88,736,821	82,344,430

有価証券売買等損益	655, 119, 910	1, 243, 985, 070
派生商品取引等損益	11, 207, 100	30, 391, 027
その他収益	116, 232	104, 003
営業収益合計	755, 180, 063	1, 356, 824, 530
営業費用		
支払利息	37, 312	42, 025
受託者報酬	2, 331, 881	2, 149, 323
委託者報酬	8, 394, 695	7, 737, 521
その他費用	3, 619, 832	3, 014, 214
営業費用合計	14, 383, 720	12, 943, 083
営業利益又は営業損失 (△)	740, 796, 343	1, 343, 881, 447
経常利益又は経常損失 (△)	740, 796, 343	1, 343, 881, 447
当期純利益又は当期純損失 (△)	740, 796, 343	1, 343, 881, 447
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 (△)	149, 987, 988	537, 089, 673
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	279, 430, 504	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	279, 430, 504	-
分配金	74, 264, 154	69, 557, 271
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	537, 089, 673	1, 811, 413, 849

## (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 21 日から平成 29 年 10 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 2 期 平成 29 年 4 月 20 日現在	第 3 期 平成 29 年 10 月 20 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 522, 987 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 522, 987 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 13, 878 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 16, 315 円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 年 4 月 20 日			第 3 期 自 平成 29 年 4 月 21 日 至 平成 29 年 10 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	88,815,741 円	当期配当等収益額	A	82,406,408 円
分配準備積立金	B	87,730 円	分配準備積立金	B	292,909 円
配当等収益合計額	C=A+B	88,903,471 円	配当等収益合計額	C=A+B	82,699,317 円
経費	D	14,346,408 円	経費	D	12,901,058 円
収益分配可能額	E=C-D	74,557,063 円	収益分配可能額	E=C-D	69,798,259 円
収益分配金	F	74,264,154 円	収益分配金	F	69,557,271 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	292,909 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	240,988 円
口数	H	522,987 口	口数	H	522,987 口
1 口当たり分配金	I=F/H	142 円	1 口当たり分配金	I=F/H	133 円
2. その他費用 その他費用のうち 2,812,489 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 2,579,126 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 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 年 4 月 20 日		第 3 期 自 平成 29 年 4 月 21 日 至 平成 29 年 10 月 20 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。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。		2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左	
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。		3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左	

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

第 2 期 平成 29 年 4 月 20 日現在	第 3 期 平成 29 年 10 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。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</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)

<p>第 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 年 4 月 20 日</p>	<p>第 3 期 自 平成 29 年 4 月 21 日 至 平成 29 年 10 月 20 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 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 年 4 月 20 日</p>	<p>第 3 期 自 平成 29 年 4 月 21 日 至 平成 29 年 10 月 20 日</p>
期首元本額 9,226,028,473 円	期首元本額 6,720,905,937 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 2,505,122,536 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 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 年 4 月 20 日	第 3 期 自 平成 29 年 4 月 21 日 至 平成 29 年 10 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	417,157,738	1,199,821,020
合計	417,157,738	1,199,821,020

## 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 2 期(平成 29 年 4 月 20 日現在)				第 3 期(平成 29 年 10 月 20 日現在)			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1 年超				うち 1 年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	175,656,652	—	168,264,000	△7,404,964	147,916,500	—	159,206,000	11,279,564
合計	175,656,652	—	168,264,000	△7,404,964	147,916,500	—	159,206,000	11,279,564

(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 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	長谷工コーポレーション	9,000	1,552.00	13,968,000	
		鹿島建設	28,000	1,142.00	31,976,000	
		大東建託	2,400	20,595.00	49,428,000	
		大和ハウス工業	16,800	4,067.00	68,325,600	
		積水ハウス	18,600	2,008.50	37,358,100	
		江崎グリコ	1,300	6,300.00	8,190,000	
		山崎製パン	3,100	2,132.00	6,609,200	
		寿スピリッツ	500	4,295.00	2,147,500	
		カルビー	2,600	4,110.00	10,686,000	
		ヤクルト本社	2,700	9,110.00	24,597,000	
		明治ホールディングス	3,800	9,160.00	34,808,000	
		日本ハム	5,000	3,280.00	16,400,000	
		アサヒグループホールディングス	11,400	5,026.00	57,296,400	
		キリンホールディングス	26,000	2,747.00	71,422,000	
		コカ・コーラボトラーズジャパン	3,900	3,850.00	15,015,000	
		サントリー食品インターナショナル	4,200	5,190.00	21,798,000	
		不二製油グループ本社	1,700	3,010.00	5,117,000	
		キッコーマン	4,600	3,710.00	17,066,000	
		味の素	15,100	2,260.00	34,126,000	
		キューピー	3,000	2,803.00	8,409,000	
		日清食品ホールディングス	2,100	7,130.00	14,973,000	
		日本たばこ産業	36,300	3,890.00	141,207,000	
		帝人	5,900	2,331.00	13,752,900	
		東レ	45,300	1,092.50	49,490,250	
		クラレ	10,700	2,172.00	23,240,400	
		旭化成	37,000	1,337.00	49,469,000	
住友化学	46,000	705.00	32,430,000			
日産化学工業	3,700	4,050.00	14,985,000			

東ソー	7,500	2,512.00	18,840,000
セントラル硝子	1,200	2,479.00	2,974,800
デンカ	2,600	3,670.00	9,542,000
信越化学工業	12,400	10,965.00	135,966,000
エア・ウォーター	4,300	2,134.00	9,176,200
大陽日酸	3,900	1,353.00	5,276,700
カネカ	8,000	896.00	7,168,000
三菱瓦斯化学	5,700	2,673.00	15,236,100
J S R	6,100	2,145.00	13,084,500
三菱ケミカルホールディングス	41,300	1,124.00	46,421,200
ダイセル	8,700	1,389.00	12,084,300
積水化学工業	12,400	2,282.00	28,296,800
アイカ工業	1,600	3,710.00	5,936,000
日立化成	3,300	3,035.00	10,015,500
日本化薬	4,000	1,769.00	7,076,000
花王	16,100	7,265.00	116,966,500
日本ペイントホールディングス	4,000	3,880.00	15,520,000
D I C	2,400	4,050.00	9,720,000
資生堂	11,800	4,850.00	57,230,000
コーセー	1,000	14,620.00	14,620,000
小林製薬	1,600	6,590.00	10,544,000
日東電工	5,300	9,729.00	51,563,700
ニフコ	1,300	7,000.00	9,100,000
ユニ・チャーム	11,800	2,649.50	31,264,100
協和発酵キリン	8,000	2,022.00	16,176,000
武田薬品工業	24,300	6,326.00	153,721,800
アステラス製薬	66,900	1,524.50	101,989,050
大日本住友製薬	4,300	1,590.00	6,837,000
塩野義製薬	9,100	6,189.00	56,319,900
田辺三菱製薬	6,900	2,645.00	18,250,500
日本新薬	1,500	7,890.00	11,835,000
中外製薬	6,400	5,310.00	33,984,000
エーザイ	8,300	6,025.00	50,007,500
小野薬品工業	12,700	2,701.00	34,302,700
参天製薬	11,500	1,835.00	21,102,500
沢井製薬	1,100	6,560.00	7,216,000

第一三共	19,900	2,515.50	50,058,450
大塚ホールディングス	13,600	4,772.00	64,899,200
横浜ゴム	3,400	2,485.00	8,449,000
東洋ゴム工業	3,000	2,595.00	7,785,000
ブリヂストン	20,300	5,514.00	111,934,200
住友ゴム工業	5,200	2,096.00	10,899,200
太平洋セメント	4,000	4,405.00	17,620,000
TOTO	4,500	4,875.00	21,937,500
日本碍子	8,400	2,189.00	18,387,600
日本特殊陶業	5,400	2,494.00	13,467,600
ニチアス	3,000	1,390.00	4,170,000
新日鐵住金	24,000	2,676.50	64,236,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	15,200	2,313.00	35,157,600
日立金属	6,000	1,600.00	9,600,000
日本軽金属ホールディングス	16,900	335.00	5,661,500
DOWAホールディングス	1,600	4,545.00	7,272,000
住友電気工業	24,300	1,857.00	45,125,100
フジクラ	7,600	903.00	6,862,800
三和ホールディングス	6,100	1,347.00	8,216,700
リンナイ	1,200	9,710.00	11,652,000
日本発條	4,900	1,277.00	6,257,300
アマダホールディングス	10,700	1,290.00	13,803,000
オーエスジー	2,400	2,442.00	5,860,800
ディスコ	1,000	24,380.00	24,380,000
ナブテスコ	3,800	4,295.00	16,321,000
SMC	1,900	40,700.00	77,330,000
小松製作所	28,900	3,500.00	101,150,000
住友重機械工業	3,600	4,715.00	16,974,000
ハーモニック・ドライブ・システムズ	700	5,540.00	3,878,000
クボタ	31,700	2,035.50	64,525,350
荏原製作所	3,100	3,910.00	12,121,000
ダイキン工業	7,700	11,955.00	92,053,500
栗田工業	3,300	3,335.00	11,005,500
椿本チエイン	4,000	911.00	3,644,000
ユニバーサルエンターテインメント	500	3,800.00	1,900,000

ホシザキ	1,400	10,330.00	14,462,000
日本精工	12,600	1,555.00	19,593,000
NTN	13,000	500.00	6,500,000
ジェイテクト	6,200	1,659.00	10,285,800
不二越	4,000	659.00	2,636,000
THK	4,100	3,950.00	16,195,000
マキタ	7,500	4,495.00	33,712,500
三菱重工業	9,400	4,523.00	42,516,200
日清紡ホールディングス	3,800	1,310.00	4,978,000
コニカミノルタ	14,600	975.00	14,235,000
ブラザー工業	7,200	2,765.00	19,908,000
ミネベアミツミ	11,200	1,921.00	21,515,200
日立製作所	154,000	857.60	132,070,400
三菱電機	60,100	1,908.00	114,670,800
富士電機	19,000	680.00	12,920,000
安川電機	7,400	4,035.00	29,859,000
マブチモーター	1,600	5,840.00	9,344,000
日本電産	6,800	14,180.00	96,424,000
オムロン	6,300	6,210.00	39,123,000
ルネサスエレクトロニクス	1,500	1,280.00	1,920,000
セイコーエプソン	9,000	2,828.00	25,452,000
ワコム	4,700	480.00	2,256,000
パナソニック	70,100	1,637.00	114,753,700
富士通ゼネラル	1,800	2,269.00	4,084,200
TDK	4,200	7,840.00	32,928,000
アルプス電気	6,100	3,120.00	19,032,000
ヒロセ電機	900	16,190.00	14,571,000
横河電機	7,000	2,031.00	14,217,000
日本光電工業	2,300	2,563.00	5,894,900
堀場製作所	1,100	6,510.00	7,161,000
キーエンス	2,900	60,710.00	176,059,000
シスメックス	3,900	7,580.00	29,562,000
スタンレー電気	4,200	4,085.00	17,157,000
カシオ計算機	6,700	1,678.00	11,242,600
ファナック	6,100	25,000.00	152,500,000
浜松ホトニクス	4,800	3,590.00	17,232,000

太陽誘電	3,400	1,764.00	5,997,600
村田製作所	6,200	16,990.00	105,338,000
小糸製作所	2,800	7,530.00	21,084,000
S C R E E Nホールディングス	1,300	8,420.00	10,946,000
キヤノン	33,200	4,030.00	133,796,000
東京エレクトロン	5,200	18,715.00	97,318,000
トヨタ紡織	1,600	2,450.00	3,920,000
デンソー	14,000	5,740.00	80,360,000
東海理化電機製作所	1,600	2,350.00	3,760,000
川崎重工業	4,400	3,880.00	17,072,000
日産自動車	77,700	1,079.00	83,838,300
いすゞ自動車	17,200	1,580.50	27,184,600
トヨタ自動車	37,600	6,999.00	263,162,400
日野自動車	8,100	1,428.00	11,566,800
NOK	2,400	2,691.00	6,458,400
アイシン精機	5,600	6,110.00	34,216,000
マツダ	18,300	1,597.00	29,225,100
スズキ	10,300	5,928.00	61,058,400
S U B A R U	18,300	3,975.00	72,742,500
ヤマハ発動機	8,400	3,290.00	27,636,000
豊田合成	2,000	2,835.00	5,670,000
シマノ	2,500	15,050.00	37,625,000
テイ・エス テック	1,300	3,935.00	5,115,500
テルモ	8,900	4,640.00	41,296,000
島津製作所	7,000	2,271.00	15,897,000
東京精密	1,200	4,090.00	4,908,000
トプコン	2,600	2,266.00	5,891,600
オリンパス	8,200	4,010.00	32,882,000
HOYA	12,800	6,351.00	81,292,800
朝日インテック	1,600	6,220.00	9,952,000
ニプロ	4,400	1,651.00	7,264,400
バンダイナムコホールディングス	6,200	3,940.00	24,428,000
アシックス	5,100	1,724.00	8,792,400
ヤマハ	4,600	4,290.00	19,734,000
中部電力	20,600	1,431.50	29,488,900
北陸電力	5,400	974.00	5,259,600

東北電力	14,400	1,508.00	21,715,200
九州電力	12,700	1,278.00	16,230,600
北海道電力	5,700	825.00	4,702,500
東京瓦斯	12,200	2,895.00	35,319,000
大阪瓦斯	11,600	2,199.00	25,508,400
東邦瓦斯	2,400	3,315.00	7,956,000
東京急行電鉄	15,000	1,708.00	25,620,000
小田急電鉄	9,300	2,193.00	20,394,900
東日本旅客鉄道	10,200	10,980.00	111,996,000
西日本旅客鉄道	5,400	8,098.00	43,729,200
東海旅客鉄道	4,500	20,795.00	93,577,500
西武ホールディングス	4,200	1,990.00	8,358,000
近鉄グループホールディングス	5,900	4,370.00	25,783,000
日本通運	2,500	7,330.00	18,325,000
日本航空	11,600	3,849.00	44,648,400
ANAホールディングス	10,400	4,378.00	45,531,200
ネクソン	5,400	2,912.00	15,724,800
コロプラ	1,700	1,193.00	2,028,100
野村総合研究所	4,200	4,365.00	18,333,000
ヤフー	41,500	531.00	22,036,500
トレンドマイクロ	4,000	5,780.00	23,120,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,500	4,185.00	6,277,500
大塚商会	1,700	7,340.00	12,478,000
日本ユニシス	2,000	1,833.00	3,666,000
日本テレビホールディングス	5,100	2,036.00	10,383,600
日本電信電話	43,400	5,303.00	230,150,200
KDDI	60,100	3,047.00	183,124,700
NTTドコモ	42,400	2,673.00	113,335,200
エヌ・ティ・ティ・データ	21,300	1,281.00	27,285,300
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,800	4,370.00	12,236,000
SCSK	1,600	4,810.00	7,696,000
第一興商	1,200	5,350.00	6,420,000
IDOM	2,000	813.00	1,626,000
豊田通商	6,500	3,950.00	25,675,000
日立ハイテクノロジーズ	2,200	4,495.00	9,889,000

三菱商事	41,000	2,578.50	105,718,500
岩谷産業	1,200	3,425.00	4,110,000
トラスコ中山	1,100	2,846.00	3,130,600
ミスミグループ本社	6,500	2,930.00	19,045,000
ローソン	1,700	7,620.00	12,954,000
エービーシー・マート	900	5,710.00	5,139,000
アダストリア	900	2,556.00	2,300,400
くらコーポレーション	300	5,250.00	1,575,000
セリア	1,100	6,250.00	6,875,000
Monotaro	2,000	3,105.00	6,210,000
ウエルシアホールディングス	1,300	4,290.00	5,577,000
すかいらーく	3,300	1,692.00	5,583,600
コスモス薬品	300	23,890.00	7,167,000
セブン&アイ・ホールディングス	24,500	4,701.00	115,174,500
ツルハホールディングス	1,200	14,070.00	16,884,000
クスリのアオキホールディングス	500	6,250.00	3,125,000
良品計画	800	32,700.00	26,160,000
ドンキホーテホールディングス	4,100	4,585.00	18,798,500
ゼンショーホールディングス	2,900	2,064.00	5,985,600
ユナイテッドアローズ	700	4,095.00	2,866,500
スギホールディングス	1,100	5,880.00	6,468,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2,700	6,410.00	17,307,000
青山商事	1,400	4,135.00	5,789,000
しまむら	700	12,820.00	8,974,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,800	2,140.00	5,992,000
イオン	19,600	1,743.00	34,162,800
イズミ	1,000	5,990.00	5,990,000
アインホールディングス	600	7,520.00	4,512,000
ニトリホールディングス	2,300	16,860.00	38,778,000
吉野家ホールディングス	1,900	1,872.00	3,556,800
ファーストリテイリング	1,000	36,520.00	36,520,000
サンドラッグ	2,300	4,910.00	11,293,000
三井住友フィナンシャルグループ	41,600	4,387.00	182,499,200
東京海上ホールディングス	22,100	4,733.00	104,599,300
東京センチュリー	1,400	5,050.00	7,070,000

イオンフィナンシャルサービス	3,700	2,443.00	9,039,100	
日立キャピタル	1,500	2,769.00	4,153,500	
オリックス	44,100	1,914.50	84,429,450	
三菱UFJリース	13,600	610.00	8,296,000	
ヒューリック	8,600	1,176.00	10,113,600	
野村不動産ホールディングス	4,200	2,395.00	10,059,000	
飯田グループホールディングス	4,500	2,063.00	9,283,500	
パーク24	3,300	2,668.00	8,804,400	
タカラレーベン	2,700	525.00	1,417,500	
イオンモール	3,500	2,023.00	7,080,500	
LIFULL	1,900	903.00	1,715,700	
パーソルホールディングス	4,600	2,731.00	12,562,600	
総合警備保障	1,600	5,330.00	8,528,000	
カカクコム	4,600	1,562.00	7,185,200	
ディップ	900	2,757.00	2,481,300	
エムスリー	4,800	3,285.00	15,768,000	
博報堂DYホールディングス	7,300	1,571.00	11,468,300	
ぐるなび	800	1,725.00	1,380,000	
電通	7,500	5,110.00	38,325,000	
オリエンタルランド	6,400	9,130.00	58,432,000	
リゾートトラスト	2,400	2,204.00	5,289,600	
サイバーエージェント	3,200	3,300.00	10,560,000	
楽天	27,800	1,237.00	34,388,600	
テクノプロ・ホールディングス	1,200	5,080.00	6,096,000	
リクルートホールディングス	27,500	2,709.00	74,497,500	
リログループ	3,500	2,721.00	9,523,500	
エイチ・アイ・エス	1,100	3,775.00	4,152,500	
共立メンテナンス	900	3,330.00	2,997,000	
カナモト	800	3,750.00	3,000,000	
セコム	6,800	8,544.00	58,099,200	
小計	銘柄数：271		8,371,293,850	
	組入時価比率：98.1%		100.0%	
合計			8,371,293,850	

(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 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

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。