

2018年4月期（2017年10月21日～2018年4月20日）決算短信

2018年5月30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 増田 真一 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 2018年7月11日
 分配金支払開始日 2018年5月29日

I ファンドの運用状況

1. 2018年4月期の運用状況（2017年10月21日～2018年4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	%
2018年4月期	8,443	(98.3)	149	(1.7)	8,592	(100)
2017年10月期	8,371	(98.1)	161	(1.9)	8,532	(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
2018年4月期	522	0	0	522
2017年10月期	522	0	0	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
2018年4月期	8,692	100	8,592	16,430
2017年10月期	8,627	94	8,532	16,315

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
2018年4月期	151.00
2017年10月期	133.00

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3期 (2017年10月20日現在)	第4期 (2018年4月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	174,141,277	166,185,535
株式	8,371,293,850	8,443,320,570
派生商品評価勘定	11,279,564	5,591,020
未収入金	6,503,994	2,816,713
未収配当金	63,914,530	74,915,386
流動資産合計	8,627,133,215	8,692,829,224
資産合計	8,627,133,215	8,692,829,224
負債の部		
流動負債		
前受金	12,236,850	2,287,100
未払金	-	1,893,158
未払収益分配金	69,557,271	78,971,037
未払受託者報酬	2,149,323	2,362,440
未払委託者報酬	7,737,521	8,504,754
未払利息	184	303
その他未払費用	3,132,280	5,988,837
流動負債合計	94,813,429	100,007,629
負債合計	94,813,429	100,007,629
純資産の部		
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(△)	1,811,413,849	1,871,915,658
(分配準備積立金)	240,988	224,045
元本等合計	8,532,319,786	8,592,821,595
純資産合計	8,532,319,786	8,592,821,595
負債純資産合計	8,627,133,215	8,692,829,224

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 自 2017年4月21日 至 2017年10月20日	第4期 自 2017年10月21日 至 2018年4月20日
営業収益		
受取配当金	82,344,430	93,106,889
有価証券売買等損益	1,243,985,070	53,884,627
派生商品取引等損益	30,391,027	6,634,125

その他収益	104,003	85,131
営業収益合計	1,356,824,530	153,710,772
営業費用		
支払利息	42,025	36,869
受託者報酬	2,149,323	2,362,440
委託者報酬	7,737,521	8,504,754
その他費用	3,014,214	3,333,863
営業費用合計	12,943,083	14,237,926
営業利益又は営業損失(△)	1,343,881,447	139,472,846
経常利益又は経常損失(△)	1,343,881,447	139,472,846
当期純利益又は当期純損失(△)	1,343,881,447	139,472,846
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(△)	537,089,673	1,811,413,849
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	69,557,271	78,971,037
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,811,413,849	1,871,915,658

(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、2017年10月21日から2018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 2017年10月20日現在	第4期 2018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 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 16,315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 16,430円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自2017年4月21日 至2017年10月20日	第4期 自2017年10月21日 至2018年4月20日

1. 分配金の計算過程

項目		
当期配当等収益額	A	82,406,408 円
分配準備積立金	B	292,909 円
配当等収益合計額	C=A+B	82,699,317 円
経費	D	12,901,058 円
収益分配可能額	E=C-D	69,798,259 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	240,988 円
口数	H	522,987 口
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2,579,126円は、対象指数についての商標使用料であります。

1. 分配金の計算過程

項目		
当期配当等収益額	A	93,155,151 円
分配準備積立金	B	240,988 円
配当等収益合計額	C=A+B	93,396,139 円
経費	D	14,201,057 円
収益分配可能額	E=C-D	79,195,082 円
収益分配金	F	78,971,037 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	224,045 円
口数	H	522,987 口
1口当たり分配金	I=F/H	151 円

2. その他費用

その他費用のうち2,834,876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3期 自 2017年4月21日 至 2017年10月20日	第4期 自 2017年10月21日 至 2018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、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。</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3期 2017年10月20日現在	第4期 2018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>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</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>	<p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>
---	-----------------------------

(関連当事者との取引に関する注記)

<p>第3期 自 2017年 4月 21日 至 2017年 10月 20日</p>	<p>第4期 自 2017年 10月 21日 至 2018年 4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3期 自 2017年 4月 21日 至 2017年 10月 20日</p>	<p>第4期 自 2017年 10月 21日 至 2018年 4月 20日</p>
期首元本額	6,720,905,937円
期中追加設定元本額	0円
期中一部交換元本額	0円

期首元本額	6,720,905,937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3期 自 2017年 4月 21日 至 2017年 10月 20日	第4期 自 2017年 10月 21日 至 2018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	1,199,821,020	53,887,915
合計	1,199,821,020	53,887,915

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3期(2017年10月20日現在)				第4期(2018年4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	147,916,500	-	159,206,000	11,279,564	143,192,300	-	148,792,500	5,591,020
合計	147,916,500	-	159,206,000	11,279,564	143,192,300	-	148,792,500	5,591,020

(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(2018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	長谷工コーポレーション	9,000	1,670.00	15,030,000	
		鹿島建設	28,000	1,017.00	28,476,000	
		大東建託	2,400	18,600.00	44,640,000	
		大和ハウス工業	16,800	4,024.00	67,603,200	
		積水ハウス	18,700	1,945.50	36,380,850	
		江崎グリコ	1,300	5,780.00	7,514,000	
		山崎製パン	3,100	2,339.00	7,250,900	
		寿スピリッツ	500	5,130.00	2,565,000	
		カルビー	2,600	3,715.00	9,659,000	
		ヤクルト本社	2,700	7,740.00	20,898,000	
		明治ホールディングス	3,800	8,590.00	32,642,000	
		日本ハム	2,500	4,750.00	11,875,000	
		アサヒグループホールディングス	11,400	5,480.00	62,472,000	
		キリンホールディングス	26,100	3,124.00	81,536,400	
		コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	3,900	4,620.00	18,018,000	
		サントリー食品インターナショナル	4,200	5,400.00	22,680,000	
		不二製油グループ本社	1,700	3,465.00	5,890,500	
		キッコーマン	4,600	4,510.00	20,746,000	
		味の素	15,100	1,973.50	29,799,850	
		キューピー	3,000	2,503.00	7,509,000	
		日清食品ホールディングス	2,200	7,720.00	16,984,000	
		日本たばこ産業	36,400	2,892.00	105,268,800	
		帝人	5,900	2,058.00	12,142,200	
		東レ	45,400	1,022.50	46,421,500	
		クラレ	10,700	1,806.00	19,324,200	
		旭化成	37,000	1,506.00	55,722,000	
		住友化学	46,000	639.00	29,394,000	
日産化学工業	3,700	4,900.00	18,130,000			
東ソー	7,800	2,013.00	15,701,400			
セントラル硝子	1,200	2,645.00	3,174,000			

デンカ	2,600	4,060.00	10,556,000
信越化学工業	12,400	10,670.00	132,308,000
エア・ウォーター	4,300	2,104.00	9,047,200
大陽日酸	4,000	1,665.00	6,660,000
カネカ	8,000	1,078.00	8,624,000
三菱瓦斯化学	5,700	2,635.00	15,019,500
J S R	6,100	2,333.00	14,231,300
三菱ケミカルホールディングス	41,400	1,056.00	43,718,400
ダイセル	8,700	1,249.00	10,866,300
積水化学工業	12,500	1,909.00	23,862,500
アイカ工業	1,600	4,020.00	6,432,000
日立化成	3,300	2,587.00	8,537,100
日本化薬	4,500	1,352.00	6,084,000
花王	16,200	7,853.00	127,218,600
日本ペイントホールディングス	4,000	4,300.00	17,200,000
D I C	2,400	3,745.00	8,988,000
資生堂	11,800	6,925.00	81,715,000
コーセー	1,000	20,560.00	20,560,000
小林製薬	1,600	9,030.00	14,448,000
日東電工	5,400	8,401.00	45,365,400
ニフコ	2,700	3,745.00	10,111,500
ユニ・チャーム	11,900	3,031.00	36,068,900
協和発酵キリン	8,000	2,373.00	18,984,000
武田薬品工業	24,400	4,857.00	118,510,800
アステラス製薬	67,000	1,582.00	105,994,000
大日本住友製薬	4,300	2,016.00	8,668,800
塩野義製薬	9,100	5,497.00	50,022,700
田辺三菱製薬	6,900	2,092.00	14,434,800
日本新薬	1,500	8,480.00	12,720,000
中外製薬	6,400	5,830.00	37,312,000
エーザイ	8,300	7,074.00	58,714,200
小野薬品工業	12,700	2,482.50	31,527,750
参天製薬	11,600	1,764.00	20,462,400
沢井製薬	1,100	4,780.00	5,258,000
第一三共	19,900	3,758.00	74,784,200
大塚ホールディングス	13,600	5,302.00	72,107,200

横浜ゴム	3,400	2,525.00	8,585,000
東洋ゴム工業	3,000	1,854.00	5,562,000
ブリヂストン	20,300	4,572.00	92,811,600
住友ゴム工業	5,200	1,941.00	10,093,200
太平洋セメント	4,000	3,965.00	15,860,000
TOTO	4,500	6,070.00	27,315,000
日本碍子	8,500	1,920.00	16,320,000
日本特殊陶業	5,400	2,621.00	14,153,400
ニチアス	3,000	1,355.00	4,065,000
新日鐵住金	24,100	2,422.50	58,382,250
ジェイ エフ イー ホールディングス	15,200	2,273.00	34,549,600
日立金属	6,000	1,363.00	8,178,000
日本軽金属ホールディングス	16,900	287.00	4,850,300
DOWAホールディングス	1,500	4,120.00	6,180,000
住友電気工業	24,400	1,657.50	40,443,000
フジクラ	7,700	740.00	5,698,000
三和ホールディングス	6,100	1,387.00	8,460,700
リンナイ	1,200	10,480.00	12,576,000
日本発條	5,000	1,189.00	5,945,000
アマダホールディングス	10,700	1,313.00	14,049,100
オーエスジー	2,400	2,415.00	5,796,000
ディスコ	1,000	21,910.00	21,910,000
ナブテスコ	3,800	3,975.00	15,105,000
SMC	1,900	42,360.00	80,484,000
小松製作所	28,900	3,708.00	107,161,200
住友重機械工業	3,700	4,140.00	15,318,000
ハーモニック・ドライブ・システムズ	700	5,720.00	4,004,000
クボタ	31,800	1,829.00	58,162,200
荏原製作所	3,100	4,210.00	13,051,000
ダイキン工業	7,700	12,855.00	98,983,500
栗田工業	3,300	3,475.00	11,467,500
椿本チエイン	4,000	914.00	3,656,000
ユニバーサルエンターテインメント	500	5,120.00	2,560,000
ホンザキ	1,400	9,840.00	13,776,000
日本精工	12,600	1,419.00	17,879,400

NTN	12,900	468.00	6,037,200
ジェイテクト	6,200	1,640.00	10,168,000
不二越	4,000	562.00	2,248,000
THK	4,100	3,925.00	16,092,500
マキタ	7,500	4,945.00	37,087,500
三菱重工業	9,400	4,186.00	39,348,400
日清紡ホールディングス	3,800	1,510.00	5,738,000
コニカミノルタ	14,700	948.00	13,935,600
ブラザー工業	7,200	2,464.00	17,740,800
ミネベアミツミ	11,200	2,202.00	24,662,400
日立製作所	154,000	790.00	121,660,000
三菱電機	60,200	1,714.00	103,182,800
富士電機	19,000	726.00	13,794,000
安川電機	7,400	4,820.00	35,668,000
マブチモーター	1,600	5,480.00	8,768,000
日本電産	6,800	16,785.00	114,138,000
オムロン	6,300	6,080.00	38,304,000
ルネサスエレクトロニクス	1,500	1,107.00	1,660,500
セイコーエプソン	9,100	2,056.00	18,709,600
ワコム	4,700	537.00	2,523,900
パナソニック	70,300	1,581.50	111,179,450
富士通ゼネラル	1,800	1,951.00	3,511,800
TDK	4,200	9,680.00	40,656,000
アルプス電気	6,100	2,637.00	16,085,700
ヒロセ電機	1,000	15,160.00	15,160,000
横河電機	7,000	2,369.00	16,583,000
日本光電工業	2,300	3,010.00	6,923,000
堀場製作所	1,100	7,690.00	8,459,000
キーエンス	2,900	63,490.00	184,121,000
シスメックス	3,900	9,510.00	37,089,000
スタンレー電気	4,200	4,010.00	16,842,000
カシオ計算機	6,700	1,758.00	11,778,600
ファナック	6,100	26,250.00	160,125,000
浜松ホトニクス	4,800	4,045.00	19,416,000
太陽誘電	3,400	1,922.00	6,534,800
村田製作所	6,200	14,215.00	88,133,000

小糸製作所	2,800	7,500.00	21,000,000
SCREENホールディングス	1,300	8,770.00	11,401,000
キヤノン	33,300	3,882.00	129,270,600
東京エレクトロン	5,300	19,610.00	103,933,000
トヨタ紡織	1,600	2,360.00	3,776,000
デンソー	14,000	5,919.00	82,866,000
東海理化電機製作所	1,600	2,186.00	3,497,600
川崎重工業	4,400	3,535.00	15,554,000
日産自動車	77,800	1,135.00	88,303,000
いすゞ自動車	17,300	1,652.50	28,588,250
トヨタ自動車	37,600	6,957.00	261,583,200
日野自動車	8,100	1,380.00	11,178,000
NOK	2,400	2,224.00	5,337,600
アイシン精機	5,600	5,840.00	32,704,000
マツダ	18,300	1,472.00	26,937,600
スズキ	10,300	5,747.00	59,194,100
SUBARU	18,400	3,514.00	64,657,600
ヤマハ発動機	8,400	3,435.00	28,854,000
豊田合成	2,000	2,580.00	5,160,000
シマノ	2,500	14,240.00	35,600,000
テイ・エス テック	1,300	4,415.00	5,739,500
テルモ	8,900	6,190.00	55,091,000
島津製作所	7,000	3,000.00	21,000,000
東京精密	1,200	4,210.00	5,052,000
トプコン	2,600	2,139.00	5,561,400
オリンパス	8,200	4,000.00	32,800,000
HOYA	12,900	5,772.00	74,458,800
朝日インテック	3,200	3,970.00	12,704,000
ニプロ	4,400	1,567.00	6,894,800
バンダイナムコホールディングス	6,300	3,675.00	23,152,500
アシックス	5,100	2,070.00	10,557,000
ヤマハ	4,600	4,930.00	22,678,000
中部電力	20,700	1,674.00	34,651,800
北陸電力	5,400	1,011.00	5,459,400
東北電力	14,400	1,469.00	21,153,600
九州電力	12,700	1,279.00	16,243,300

北海道電力	5,700	695.00	3,961,500
東京瓦斯	12,200	2,846.50	34,727,300
大阪瓦斯	11,600	2,273.50	26,372,600
東邦瓦斯	2,400	3,400.00	8,160,000
東京急行電鉄	15,000	1,769.00	26,535,000
小田急電鉄	9,300	2,291.00	21,306,300
東日本旅客鉄道	10,200	10,190.00	103,938,000
西日本旅客鉄道	5,400	7,588.00	40,975,200
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	1,808.00	7,593,600
近鉄グループホールディングス	5,900	4,340.00	25,606,000
日本通運	2,500	7,720.00	19,300,000
日本航空	11,600	4,222.00	48,975,200
ANAホールディングス	10,400	4,229.00	43,981,600
ネクソン	10,800	1,600.00	17,280,000
コロプラ	1,700	834.00	1,417,800
野村総合研究所	4,200	5,110.00	21,462,000
ヤフー	41,600	449.00	18,678,400
トレンドマイクロ	4,000	6,540.00	26,160,000
伊藤忠テクノソリューションズ	3,000	2,189.00	6,567,000
大塚商会	3,400	5,030.00	17,102,000
日本ユニシス	2,000	2,276.00	4,552,000
日本テレビホールディングス	5,100	1,874.00	9,557,400
日本電信電話	43,500	5,169.00	224,851,500
KDDI	60,200	2,845.00	171,269,000
NTTドコモ	42,500	2,761.50	117,363,750
エヌ・ティ・ティ・データ	21,300	1,170.00	24,921,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,800	4,565.00	12,782,000
SCSK	1,600	4,665.00	7,464,000
第一興商	1,200	5,610.00	6,732,000
IDOM	2,000	821.00	1,642,000
豊田通商	6,500	3,795.00	24,667,500
日立ハイテクノロジーズ	2,200	4,740.00	10,428,000
三菱商事	41,100	2,955.50	121,471,050
岩谷産業	1,100	4,075.00	4,482,500

トラスコ中山	1,200	2,760.00	3,312,000	
ミスミグループ本社	6,500	3,050.00	19,825,000	
ローソン	1,700	7,160.00	12,172,000	
エービーシー・マート	900	7,090.00	6,381,000	
アダストリア	1,000	1,987.00	1,987,000	
くらコーポレーション	300	7,560.00	2,268,000	
セリア	1,100	5,260.00	5,786,000	
MonotaRO	2,000	3,940.00	7,880,000	
ウエルシアホールディングス	1,300	5,440.00	7,072,000	
すかいらーく	3,300	1,567.00	5,171,100	
コスモス薬品	300	23,320.00	6,996,000	
セブン&アイ・ホールディングス	24,600	4,760.00	117,096,000	
ツルハホールディングス	1,200	15,250.00	18,300,000	
クスリのアオキホールディングス	500	7,620.00	3,810,000	
良品計画	800	37,250.00	29,800,000	
ドンキホーテホールディングス	4,100	5,670.00	23,247,000	
ゼンショーホールディングス	2,900	2,528.00	7,331,200	
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	6,430.00	7,073,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2,700	10,000.00	27,000,000	
青山商事	1,400	4,100.00	5,740,000	
しまむら	700	13,700.00	9,590,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,800	2,054.00	5,751,200	
イオン	19,600	2,077.00	40,709,200	
イズミ	1,000	6,890.00	6,890,000	
アインホールディングス	600	7,920.00	4,752,000	
ニトリホールディングス	2,300	18,510.00	42,573,000	
吉野家ホールディングス	1,900	2,040.00	3,876,000	
ファーストリテイリング	1,000	47,510.00	47,510,000	
サンドラッグ	2,300	5,450.00	12,535,000	
三井住友フィナンシャルグループ	41,700	4,522.00	188,567,400	
東京海上ホールディングス	22,200	4,968.00	110,289,600	
東京センチュリー	1,400	6,420.00	8,988,000	
イオンフィナンシャルサービス	3,700	2,531.00	9,364,700	
日立キャピタル	1,500	2,834.00	4,251,000	

オリックス	44,200	1,894.00	83,714,800	
三菱UFJリース	13,600	666.00	9,057,600	
ヒューリック	8,600	1,172.00	10,079,200	
野村不動産ホールディングス	4,200	2,626.00	11,029,200	
飯田グループホールディングス	4,500	2,091.00	9,409,500	
パーク24	3,300	3,085.00	10,180,500	
タカラレーベン	2,700	434.00	1,171,800	
イオンモール	3,600	2,152.00	7,747,200	
LIFULL	1,900	919.00	1,746,100	
パーソルホールディングス	4,600	2,784.00	12,806,400	
総合警備保障	1,600	5,300.00	8,480,000	
カカコム	4,700	2,065.00	9,705,500	
ディップ	900	2,538.00	2,284,200	
エムスリー	4,800	4,555.00	21,864,000	
博報堂DYホールディングス	7,300	1,474.00	10,760,200	
ぐるなび	800	1,519.00	1,215,200	
電通	7,500	5,130.00	38,475,000	
オリエンタルランド	6,400	10,785.00	69,024,000	
リゾートトラスト	2,400	2,244.00	5,385,600	
サイバーエージェント	3,200	5,600.00	17,920,000	
楽天	27,900	779.30	21,742,470	
テクノプロ・ホールディングス	1,200	6,350.00	7,620,000	
リクルートホールディングス	27,500	2,572.00	70,730,000	
リログループ	3,500	2,501.00	8,753,500	
エイチ・アイ・エス	1,100	3,845.00	4,229,500	
共立メンテナンス	900	5,030.00	4,527,000	
カナモト	800	3,625.00	2,900,000	
セコム	6,800	8,165.00	55,522,000	
小計	銘柄数：271		8,443,320,570	
	組入時価比率：98.3%		100.0%	
合計			8,443,320,570	

(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(2018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

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。