



2018年10月期 (2018年4月21日～2018年10月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2018 (April 21, 2018 – October 20, 2018)

2018年11月29日
 November 29, 2018

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

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

Fund name: NEXT FUNDS Nomura Enterprise Value Allocation Index Exchange Traded Fund
 Code: 1480
 Underlying index: Nomura Enterprise Value Allocation Index
 Primary invested assets: Stocks
 Trading unit: 1 unit
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Kunio Watanabe, President & CEO
 Contact person: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 2019年1月16日
 分配金支払開始日 2018年11月28日
 Scheduled date of submission of securities report: January 16, 2019
 Date of commencing dividend payment: November 28, 2018

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2018年10月期の運用状況 (2018年4月21日～2018年10月20日)

Management Status for Year ended October 2018 (from April 21, 2018 to October 20, 2018)

(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.	%
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	7,534	(98.4)	120	(1.6)	7,655	(100.0)
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	8,443	(98.3)	149	(1.7)	8,592	(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
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	522	0	39	483
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	522	0	0	522

(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))	1口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×1) Net Asset Value per 1 unit ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×1)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	7,747	91	7,655	15,832
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	8,692	100	8,592	16,430

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	152
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	151

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 4 期 (2018 年 4 月 20 日現在) 4th Fiscal Year As of April 20, 2018	第 5 期 (2018 年 10 月 20 日現在) 5th Fiscal Year As of October 20, 2018
	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	166,185,535	134,282,302
株式 Stocks	8,443,320,570	7,534,711,680
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	5,591,020	505,470
未収入金 Accounts receivable - other	2,816,713	2,104,863
未収配当金 Accrued dividend receivable	74,915,386	67,614,965
差入委託証拠金 Customers' margin	-	8,342,100
流動資産合計 Total current assets	8,692,829,224	7,747,561,380
資産合計 Total assets	8,692,829,224	7,747,561,380
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	-	4,350,888
前受金 Advances received	2,287,100	-
未払金 Accounts payable - other	1,893,158	607,200
未払収益分配金 Unpaid dividends	78,971,037	73,501,424
未払受託者報酬 Trustee fee payable	2,362,440	2,215,622
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	8,504,754	7,976,191
未払利息 Accrued interest expenses	303	544
その他未払費用 Other accrued expenses	5,988,837	3,248,733
流動負債合計 Total current liabilities	100,007,629	91,900,602

負債合計 Total liabilities	100,007,629	91,900,602
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,720,905,937	6,214,255,262
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,871,915,658	1,441,405,516
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	224,045	11,903
元本等合計 Total principal and other	8,592,821,595	7,655,660,778
純資産合計 Total net assets	8,592,821,595	7,655,660,778
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	8,692,829,224	7,747,561,380

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第 4 期 自 2017 年 10 月 21 日 至 2018 年 4 月 20 日 4th Fiscal Year From October 21, 2017 to April 20, 2018	第 5 期 自 2018 年 4 月 21 日 至 2018 年 10 月 20 日 5th Fiscal Year From April 21, 2018 to October 20, 2018
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	93,106,889	86,469,197
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	53,884,627	△265,840,360
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	6,634,125	△7,863,845
その他収益 Other revenue	85,131	148,446
営業収益合計 Total operating revenue	153,710,772	△187,086,562
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	36,869	43,546
受託者報酬 Trustee fee	2,362,440	2,215,622
委託者報酬 Investment trust management fee	8,504,754	7,976,191
その他費用 Other expenses	3,333,863	3,093,002
営業費用合計	14,237,926	13,328,361

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	139,472,846	△200,414,923
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	139,472,846	△200,414,923
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	139,472,846	△200,414,923
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	1,811,413,849	1,871,915,658
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	-	156,593,795
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	-	156,593,795
分配金 Dividends	78,971,037	73,501,424
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,871,915,658	1,441,405,516

(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 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。 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った場合、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、2018年4月21日から2018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4期 2018年4月20日現在	第5期 2018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	1. 計算期間の末日における受益権の総数

522,987 口	483,562 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	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	1 口当たり純資産額 15,832 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 4 期 自 2017 年 10 月 21 日 至 2018 年 4 月 20 日	第 5 期 自 2018 年 4 月 21 日 至 2018 年 10 月 20 日																																																												
<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>93,155,151 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>240,988 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>93,396,139 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>14,201,057 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>79,195,082 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>78,971,037 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>224,045 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>522,987 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>151 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>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。</p>	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	<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>86,574,097 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>224,045 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>86,798,142 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>13,284,815 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>73,513,327 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>73,501,424 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>11,903 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>483,562 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>152 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち 2,659,555 円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>	項目			当期配当等収益額	A	86,574,097 円	分配準備積立金	B	224,045 円	配当等収益合計額	C=A+B	86,798,142 円	経費	D	13,284,815 円	収益分配可能額	E=C-D	73,513,327 円	収益分配金	F	73,501,424 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,903 円	口数	H	483,562 口	1 口当たり分配金	I=F/H	152 円
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																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	86,574,097 円																																																											
分配準備積立金	B	224,045 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	86,798,142 円																																																											
経費	D	13,284,815 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	73,513,327 円																																																											
収益分配金	F	73,501,424 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,903 円																																																											
口数	H	483,562 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	152 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 4 期 自 2017 年 10 月 21 日 至 2018 年 4 月 20 日	第 5 期 自 2018 年 4 月 21 日 至 2018 年 10 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</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>

把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 4 期 2018 年 4 月 20 日現在	第 5 期 2018 年 10 月 20 日現在
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。 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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 4 期 自 2017 年 10 月 21 日 至 2018 年 4 月 20 日	第 5 期 自 2018 年 4 月 21 日 至 2018 年 10 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 4 期 自 2017 年 10 月 21 日 至 2018 年 4 月 20 日	第 5 期 自 2018 年 4 月 21 日 至 2018 年 10 月 20 日
期首元本額 6,720,905,937 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 0 円	期中一部交換元本額 506,650,675 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 4 期 自 2017 年 10 月 21 日 至 2018 年 4 月 20 日	第 5 期 自 2018 年 4 月 21 日 至 2018 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	53,887,915	△252,005,345
合計	53,887,915	△252,005,345

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 4 期 (2018 年 4 月 20 日現在)				第 5 期 (2018 年 10 月 20 日現在)			
	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	143,192,300	—	148,792,500	5,591,020	123,898,750	—	120,061,000	△3,845,418
合計	143,192,300	—	148,792,500	5,591,020	123,898,750	—	120,061,000	△3,845,418

(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 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	TATERU	800	518.00	414,400	
		大林組	18,200	1,049.00	19,091,800	
		長谷工コーポレーション	7,600	1,450.00	11,020,000	
		鹿島建設	12,200	1,548.00	18,885,600	
		大東建託	2,000	14,490.00	28,980,000	
		大和ハウス工業	14,800	3,425.00	50,690,000	
		積水ハウス	15,700	1,663.00	26,109,100	
		江崎グリコ	1,200	5,730.00	6,876,000	
		山崎製パン	2,700	2,108.00	5,691,600	
		寿スピリッツ	500	4,550.00	2,275,000	
		ヤクルト本社	2,300	8,560.00	19,688,000	
		明治ホールディングス	3,300	7,510.00	24,783,000	
		日本ハム	2,200	4,060.00	8,932,000	
		アサヒグループホールディングス	9,800	4,810.00	47,138,000	
		キリンホールディングス	22,600	2,663.00	60,183,800	
		コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	3,500	2,890.00	10,115,000	
		サントリー食品インターナショナル	3,600	4,465.00	16,074,000	
		不二製油グループ本社	1,400	3,445.00	4,823,000	
		キッコーマン	3,900	6,580.00	25,662,000	
		味の素	12,500	1,852.50	23,156,250	
		キューピー	2,500	2,555.00	6,387,500	
ニチレイ	2,700	2,774.00	7,489,800			
日清食品ホールディングス	1,800	7,380.00	13,284,000			
日本たばこ産業	30,800	2,936.00	90,428,800			

帝人	5,000	2,010.00	10,050,000
東レ	38,700	821.20	31,780,440
クラレ	9,100	1,593.00	14,496,300
旭化成	31,300	1,479.00	46,292,700
住友化学	39,500	586.00	23,147,000
日産化学	3,200	5,850.00	18,720,000
東ソー	6,700	1,599.00	10,713,300
デンカ	2,100	3,805.00	7,990,500
信越化学工業	10,600	8,911.00	94,456,600
エア・ウォーター	3,600	1,899.00	6,836,400
大陽日酸	3,500	1,742.00	6,097,000
カネカ	1,300	5,030.00	6,539,000
三菱瓦斯化学	4,800	1,997.00	9,585,600
三井化学	4,400	2,669.00	11,743,600
J S R	5,300	1,879.00	9,958,700
東京応化工業	900	3,020.00	2,718,000
三菱ケミカルホールディングス	35,300	924.30	32,627,790
ダイセル	7,600	1,246.00	9,469,600
積水化学工業	10,300	1,806.00	18,601,800
アイカ工業	1,400	4,140.00	5,796,000
日立化成	2,800	1,902.00	5,325,600
日本化薬	3,800	1,292.00	4,909,600
花王	13,700	8,115.00	111,175,500
日本ペイントホールディングス	3,600	3,700.00	13,320,000
関西ペイント	5,100	1,744.00	8,894,400
D I C	2,000	3,395.00	6,790,000
資生堂	10,300	6,931.00	71,389,300
コーセー	800	17,530.00	14,024,000
シーズ・ホールディングス	700	3,700.00	2,590,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,300	3,270.00	7,521,000
日東電工	4,600	7,779.00	35,783,400
エフピコ	600	5,930.00	3,558,000
ニフコ	2,200	2,702.00	5,944,400
ユニ・チャーム	9,700	3,245.00	31,476,500
武田薬品工業	20,600	4,641.00	95,604,600

アステラス製薬	54,800	1,888.50	103,489,800
大日本住友製薬	3,700	2,646.00	9,790,200
塩野義製薬	7,700	7,372.00	56,764,400
田辺三菱製薬	6,000	1,774.00	10,644,000
日本新薬	1,300	6,890.00	8,957,000
中外製薬	5,600	6,800.00	38,080,000
エーザイ	7,100	10,795.00	76,644,500
小野薬品工業	10,900	2,878.00	31,370,200
参天製薬	9,900	1,760.00	17,424,000
日医工	1,100	1,616.00	1,777,600
沢井製薬	1,000	6,070.00	6,070,000
第一三共	16,400	4,532.00	74,324,800
大塚ホールディングス	11,600	5,514.00	63,962,400
JXTGホールディングス	85,600	799.60	68,445,760
ブリヂストン	17,100	4,266.00	72,948,600
住友ゴム工業	4,700	1,595.00	7,496,500
AGC	5,100	4,405.00	22,465,500
太平洋セメント	3,400	3,440.00	11,696,000
TOTO	3,800	4,570.00	17,366,000
日本碍子	7,100	1,680.00	11,928,000
日本特殊陶業	4,400	2,858.00	12,575,200
ニチアス	1,400	2,724.00	3,813,600
新日鐵住金	21,100	2,202.00	46,462,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	13,100	2,405.50	31,512,050
日立金属	5,300	1,356.00	7,186,800
古河電気工業	1,800	3,095.00	5,571,000
住友電気工業	20,500	1,578.50	32,359,250
フジクラ	6,800	485.00	3,298,000
三和ホールディングス	5,100	1,341.00	6,839,100
リンナイ	1,000	8,370.00	8,370,000
日本発條	4,300	1,067.00	4,588,100
アマダホールディングス	9,000	1,110.00	9,990,000
オーエスジー	2,000	2,340.00	4,680,000
ディスコ	800	18,780.00	15,024,000
ナブテスコ	3,200	2,699.00	8,636,800

SMC	1,700	33,890.00	57,613,000
小松製作所	24,400	3,074.00	75,005,600
住友重機械工業	3,100	3,670.00	11,377,000
ハーモニック・ドライブ・システムズ	600	3,300.00	1,980,000
クボタ	27,500	1,869.00	51,397,500
ダイキン工業	6,600	13,690.00	90,354,000
栗田工業	2,800	2,816.00	7,884,800
椿本チエイン	600	4,705.00	2,823,000
ダイフク	2,500	5,100.00	12,750,000
CKD	1,200	1,307.00	1,568,400
ユニバーサルエンターテインメント	500	3,625.00	1,812,500
グローリー	1,600	2,669.00	4,270,400
ホンザキ	1,200	11,090.00	13,308,000
日本精工	10,600	1,182.00	12,529,200
NTN	10,800	434.00	4,687,200
ジェイテクト	5,200	1,530.00	7,956,000
THK	3,400	2,518.00	8,561,200
マキタ	6,300	4,890.00	30,807,000
三菱重工業	8,000	4,318.00	34,544,000
コニカミノルタ	12,300	1,162.00	14,292,600
ブラザー工業	6,100	2,118.00	12,919,800
ミネベアミツミ	9,600	1,825.00	17,520,000
三菱電機	51,500	1,400.00	72,100,000
富士電機	3,100	3,980.00	12,338,000
安川電機	6,300	3,195.00	20,128,500
マブチモーター	1,300	4,015.00	5,219,500
日本電産	5,800	14,565.00	84,477,000
オムロン	5,400	4,575.00	24,705,000
ルネサスエレクトロニクス	7,500	649.00	4,867,500
セイコーエプソン	7,500	1,898.00	14,235,000
パナソニック	60,100	1,231.50	74,013,150
富士通ゼネラル	1,500	1,723.00	2,584,500
TDK	3,500	10,360.00	36,260,000
アルプス電気	5,300	2,753.00	14,590,900
ヒロセ電機	800	10,490.00	8,392,000

日本光電工業	2,000	3,535.00	7,070,000
堀場製作所	900	5,280.00	4,752,000
アドバンテスト	4,400	2,177.00	9,578,800
キーエンス	2,600	56,540.00	147,004,000
シスメックス	3,300	8,680.00	28,644,000
オプテックスグループ	800	2,071.00	1,656,800
スタンレー電気	3,600	3,685.00	13,266,000
カシオ計算機	5,500	1,673.00	9,201,500
ファナック	5,500	19,175.00	105,462,500
ローム	2,600	7,380.00	19,188,000
浜松ホトニクス	4,000	4,080.00	16,320,000
京セラ	8,700	6,246.00	54,340,200
村田製作所	5,300	16,310.00	86,443,000
小糸製作所	2,400	6,110.00	14,664,000
SCREENホールディングス	1,100	6,410.00	7,051,000
キヤノン	28,200	3,555.00	100,251,000
東京エレクトロン	4,500	14,985.00	67,432,500
トヨタ紡織	1,300	1,986.00	2,581,800
豊田自動織機	4,200	5,830.00	24,486,000
デンソー	12,100	5,166.00	62,508,600
東海理化電機製作所	1,300	2,214.00	2,878,200
川崎重工業	3,700	3,125.00	11,562,500
日産自動車	64,300	1,001.50	64,396,450
いすゞ自動車	14,500	1,495.50	21,684,750
トヨタ自動車	32,200	6,577.00	211,779,400
日野自動車	7,000	1,137.00	7,959,000
アイシン精機	4,600	4,640.00	21,344,000
マツダ	16,300	1,268.50	20,676,550
スズキ	8,600	5,704.00	49,054,400
SUBARU	15,800	3,291.00	51,997,800
ヤマハ発動機	7,200	2,713.00	19,533,600
豊田合成	1,800	2,553.00	4,595,400
シマノ	2,100	15,870.00	33,327,000
テイ・エス テック	1,100	3,240.00	3,564,000
テルモ	7,500	6,490.00	48,675,000

島津製作所	6,000	3,230.00	19,380,000
東京精密	1,000	2,864.00	2,864,000
トプコン	2,600	1,840.00	4,784,000
オリンパス	7,400	4,095.00	30,303,000
HOYA	10,800	6,369.00	68,785,200
朝日インテック	2,700	5,270.00	14,229,000
ニプロ	3,800	1,455.00	5,529,000
バンダイナムコホールディングス	5,500	4,240.00	23,320,000
アシックス	4,400	1,757.00	7,730,800
ヤマハ	3,800	5,390.00	20,482,000
ビジョン	3,000	4,970.00	14,910,000
任天堂	3,000	38,070.00	114,210,000
中部電力	17,500	1,684.50	29,478,750
関西電力	19,300	1,723.00	33,253,900
東北電力	12,400	1,506.00	18,674,400
九州電力	10,700	1,339.00	14,327,300
東京急行電鉄	12,600	1,892.00	23,839,200
小田急電鉄	7,900	2,544.00	20,097,600
京王電鉄	2,600	6,130.00	15,938,000
東日本旅客鉄道	8,700	9,800.00	85,260,000
西日本旅客鉄道	4,500	7,562.00	34,029,000
近鉄グループホールディングス	5,000	4,310.00	21,550,000
日本通運	2,100	6,820.00	14,322,000
センコーグループホールディングス	1,800	881.00	1,585,800
日本航空	9,800	3,894.00	38,161,200
ANAホールディングス	8,800	3,660.00	32,208,000
新日鉄住金ソリューションズ	900	3,450.00	3,105,000
ネクソン	10,700	1,366.00	14,616,200
コロプラ	1,600	780.00	1,248,000
インターネットイニシアティブ	800	2,176.00	1,740,800
野村総合研究所	3,500	5,340.00	18,690,000
ヤフー	35,200	378.00	13,305,600
トレンドマイクロ	3,400	6,750.00	22,950,000
大塚商会	2,900	3,930.00	11,397,000
日本電信電話	38,500	4,995.00	192,307,500

KDD I	50,300	2,982.00	149,994,600
NTTドコモ	35,700	2,912.50	103,976,250
エヌ・ティ・ティ・データ	18,000	1,507.00	27,126,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,400	4,210.00	10,104,000
SCSK	1,400	4,940.00	6,916,000
コナミホールディングス	2,700	4,500.00	12,150,000
ソフトバンクグループ	24,400	9,530.00	232,532,000
第一興商	1,000	5,380.00	5,380,000
日本ライフライン	1,100	2,043.00	2,247,300
伊藤忠商事	36,200	2,144.50	77,630,900
日立ハイテクノロジーズ	1,900	3,725.00	7,077,500
三菱商事	34,600	3,380.00	116,948,000
トラスコ中山	1,000	2,909.00	2,909,000
ミスミグループ本社	5,500	2,465.00	13,557,500
ローソン	1,300	7,030.00	9,139,000
エービーシー・マート	800	6,500.00	5,200,000
アダストリア	800	1,829.00	1,463,200
くらコーポレーション	300	6,700.00	2,010,000
セリア	1,000	3,840.00	3,840,000
ジンズ	300	6,500.00	1,950,000
Monotaro	3,500	3,030.00	10,605,000
ZOZO	5,100	2,996.00	15,279,600
物語コーポレーション	100	10,770.00	1,077,000
ウエルシアホールディングス	1,200	6,200.00	7,440,000
すかいらくホールディングス	3,500	1,730.00	6,055,000
コスモス薬品	200	22,990.00	4,598,000
セブン&アイ・ホールディングス	20,800	4,844.00	100,755,200
クリエイト・レストランツ・ホールディング	1,200	1,247.00	1,496,400
ツルハホールディングス	1,000	12,070.00	12,070,000
トリドールホールディングス	600	2,053.00	1,231,800
クスリのアオキホールディングス	400	8,340.00	3,336,000
良品計画	700	30,500.00	21,350,000
ドンキホーテホールディングス	3,700	6,900.00	25,530,000
ゼンショーホールディングス	2,400	2,105.00	5,052,000

ユナイテッドアローズ	600	4,710.00	2,826,000
スギホールディングス	900	5,250.00	4,725,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2,200	13,070.00	28,754,000
しまむら	600	9,600.00	5,760,000
イオン	17,400	2,622.50	45,631,500
イズミ	800	6,090.00	4,872,000
ニトリホールディングス	2,000	14,910.00	29,820,000
バローホールディングス	900	2,459.00	2,213,100
ファーストリテイリング	700	55,940.00	39,158,000
サンドラッグ	1,900	3,915.00	7,438,500
三井住友フィナンシャルグループ	35,900	4,450.00	159,755,000
大和証券グループ本社	45,200	674.60	30,491,920
SOMPOホールディングス	10,100	4,743.00	47,904,300
東京海上ホールディングス	19,200	5,556.00	106,675,200
クレディセゾン	4,200	1,721.00	7,228,200
東京センチュリー	1,200	6,420.00	7,704,000
イオンフィナンシャルサービス	3,100	2,169.00	6,723,900
日立キャピタル	1,300	2,864.00	3,723,200
オリックス	37,400	1,810.00	67,694,000
三菱UFJリース	11,200	616.00	6,899,200
ヒューリック	7,500	1,000.00	7,500,000
野村不動産ホールディングス	3,600	2,187.00	7,873,200
飯田グループホールディングス	3,800	1,989.00	7,558,200
パーク24	2,900	3,240.00	9,396,000
三井不動産	25,000	2,588.50	64,712,500
イオンモール	3,000	2,060.00	6,180,000
日本空港ビルデング	1,000	4,500.00	4,500,000
ミクシィ	1,200	2,578.00	3,093,600
パーソルホールディングス	4,400	2,416.00	10,630,400
総合警備保障	1,400	4,925.00	6,895,000
カカクコム	3,900	2,116.00	8,252,400
ディップ	900	2,508.00	2,257,200
エムスリー	8,800	2,271.00	19,984,800
博報堂DYホールディングス	6,300	1,977.00	12,455,100
インフォマート	2,500	1,252.00	3,130,000

	電通	6,300	5,580.00	35,154,000	
	オリエンタルランド	5,400	10,845.00	58,563,000	
	リゾートトラスト	2,100	1,720.00	3,612,000	
	サイバーエージェント	2,800	5,400.00	15,120,000	
	楽天	24,400	792.80	19,344,320	
	テクノプロ・ホールディングス	1,000	6,060.00	6,060,000	
	リクルートホールディングス	28,800	3,308.00	95,270,400	
	ベルシステム24ホールディングス	900	1,583.00	1,424,700	
	リログループ	3,100	2,879.00	8,924,900	
	エイチ・アイ・エス	900	3,635.00	3,271,500	
	カナモト	700	3,950.00	2,765,000	
	西尾レントオール	400	3,705.00	1,482,000	
	セコム	5,900	9,357.00	55,206,300	
	小計 銘柄数：281			7,534,711,680	
	組入時価比率：98.4%			100.0%	
	合計			7,534,711,680	

(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。