



2019年4月期 (2018年10月21日～2019年4月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2019 (October 21, 2018 - April 20, 2019)

2019年5月30日
 May 30, 2019

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 兼代表取締役社長 中川 順子
 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: Junko Nakagawa, 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7月10日
 分配金支払開始日 2019年5月29日
 Scheduled date of submission of securities report: July 10, 2019
 Date of commencing dividend payment: May 29, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年4月期の運用状況 (2018年10月21日～2019年4月20日)

Management Status for Year ended April 2019 (from October 21, 2018 to April 20, 2019)

(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.	%
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	7,329	(97.8)	163	(2.2)	7,492	(100.0)
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	7,534	(98.4)	120	(1.6)	7,655	(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
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	483	0	0	483
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	522	0	39	483

(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
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	7,590	97	7,492	15,494
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	7,747	91	7,655	15,832

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2019年4月期 FY ended Apr. 2019	172
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	152

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 5 期 (2018 年 10 月 20 日現在) 5th Fiscal Year As of October 20, 2018	第 6 期 (2019 年 4 月 20 日現在) 6th Fiscal Year As of April 20, 2019
	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	134,282,302	139,054,132
株式 Stocks	7,534,711,680	7,329,005,980
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	505,470	1,479,874
未収入金 Accounts receivable - other	2,104,863	40,674,518
未収配当金 Accrued dividends receivable	67,614,965	76,540,532
差入委託証拠金 Customers' margin	8,342,100	3,442,950
流動資産合計 Total current assets	7,747,561,380	7,590,197,986
資産合計 Total assets	7,747,561,380	7,590,197,986
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	8,574
未払金 Accounts payable - other	607,200	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	73,501,424	83,172,664
未払受託者報酬 Trustee fee payable	2,215,622	1,960,493
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	7,976,191	7,057,719
未払利息 Accrued interest expenses	544	612
その他未払費用 Other accrued expenses	3,248,733	5,571,344
流動負債合計 Total current liabilities	91,900,602	97,771,406
負債合計 Total liabilities	91,900,602	97,771,406

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,214,255,262	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	1,441,405,516	1,278,171,318
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	11,903	190,687
元本等合計 Total principal and other	7,655,660,778	7,492,426,580
純資産合計 Total net assets	7,655,660,778	7,492,426,580
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	7,747,561,380	7,590,197,986

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	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	第6期 自 2018年10月21日 至 2019年4月20日 6th Fiscal Year From October 21, 2018 to April 20, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	86,469,197	94,975,442
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△265,840,360	△161,879,646
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△7,863,845	△1,533,336
その他収益 Other revenue	148,446	120,882
営業収益合計 Total operating revenue	△187,086,562	△68,316,658
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	43,546	39,580
受託者報酬 Trustee fee	2,215,622	1,960,493
委託者報酬 Investment trust management fee	7,976,191	7,057,719
その他費用 Other expenses	3,093,002	2,687,084
営業費用合計 Total operating expenses	13,328,361	11,744,876
営業利益又は営業損失 (△)	△200,414,923	△80,061,534

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△200,414,923	△80,061,534
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△200,414,923	△80,061,534
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	1,871,915,658	1,441,405,516
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	73,501,424	83,172,664
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,441,405,516	1,278,171,318

(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、2018年10月21日から2019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5期 2018年10月20日現在	第6期 2019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 483,562 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 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	15,832 円	1 口当たり純資産額	15,494 円
------------	----------	------------	----------

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 5 期 自 2018 年 4 月 21 日 至 2018 年 10 月 20 日			第 6 期 自 2018 年 10 月 21 日 至 2019 年 4 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	86,574,097 円	当期配当等収益額	A	95,056,744 円
分配準備積立金	B	224,045 円	分配準備積立金	B	11,903 円
配当等収益合計額	C=A+B	86,798,142 円	配当等収益合計額	C=A+B	95,068,647 円
経費	D	13,284,815 円	経費	D	11,705,296 円
収益分配可能額	E=C-D	73,513,327 円	収益分配可能額	E=C-D	83,363,351 円
収益分配金	F	73,501,424 円	収益分配金	F	83,172,664 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,903 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	190,687 円
口数	H	483,562 口	口数	H	483,562 口
1 口当たり分配金	I=F/H	152 円	1 口当たり分配金	I=F/H	172 円
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。			2. その他費用 その他費用のうち 2,352,528 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 5 期 自 2018 年 4 月 21 日 至 2018 年 10 月 20 日		第 6 期 自 2018 年 10 月 21 日 至 2019 年 4 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5期 2018年10月20日現在	第6期 2019年4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5期 自 2018年4月21日 至 2018年10月20日	第6期 自 2018年10月21日 至 2019年4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5期 自 2018年4月21日 至 2018年10月20日	第6期 自 2018年10月21日 至 2019年4月20日
期首元本額 6,720,905,937円	期首元本額 6,214,255,262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 506,650,675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5期 自 2018年4月21日 至 2018年10月20日	第6期 自 2018年10月21日 至 2019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	△252,005,345	△162,353,976
合計	△252,005,345	△162,353,976

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5期(2018年10月20日現在)				第6期(2019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	123,898,750	—	120,061,000	△3,845,418	159,917,900	—	161,400,000	1,471,300
合計	123,898,750	—	120,061,000	△3,845,418	159,917,900	—	161,400,000	1,471,300

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

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(2019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	TATERU	800	271.00	216,800	
		大林組	18,100	1,071.00	19,385,100	
		長谷工コーポレーション	7,500	1,330.00	9,975,000	
		鹿島建設	12,100	1,578.00	19,093,800	
		大東建託	2,000	15,180.00	30,360,000	
		大和ハウス工業	14,700	2,844.00	41,806,800	
		積水ハウス	15,600	1,769.00	27,596,400	
		江崎グリコ	1,200	5,720.00	6,864,000	
		山崎製パン	2,700	1,681.00	4,538,700	
		寿スピリッツ	500	4,725.00	2,362,500	
		ヤクルト本社	2,300	7,300.00	16,790,000	
		明治ホールディングス	3,200	8,610.00	27,552,000	
		日本ハム	2,200	4,325.00	9,515,000	
		アサヒグループホールディングス	9,700	4,839.00	46,938,300	
		キリンホールディングス	22,400	2,490.50	55,787,200	
		コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	3,500	2,682.00	9,387,000	
		サントリー食品インターナショナル	3,500	4,805.00	16,817,500	
		不二製油グループ本社	1,400	3,430.00	4,802,000	
		キッコーマン	3,900	5,390.00	21,021,000	
		味の素	12,400	1,715.00	21,266,000	
		キューピー	2,500	2,564.00	6,410,000	
		ニチレイ	2,700	2,483.00	6,704,100	
		日清食品ホールディングス	1,800	7,680.00	13,824,000	
		日本たばこ産業	30,600	2,564.00	78,458,400	
帝人	5,000	1,929.00	9,645,000			
東レ	38,500	786.50	30,280,250			

クラレ	9,100	1,495.00	13,604,500
旭化成	31,100	1,131.00	35,174,100
住友化学	39,300	548.00	21,536,400
日産化学	3,100	5,120.00	15,872,000
東ソー	6,700	1,820.00	12,194,000
デンカ	2,100	3,275.00	6,877,500
信越化学工業	10,500	10,540.00	110,670,000
エア・ウォーター	3,600	1,727.00	6,217,200
大陽日酸	3,500	1,833.00	6,415,500
カネカ	1,300	4,430.00	5,759,000
三菱瓦斯化学	4,800	1,634.00	7,843,200
三井化学	4,400	2,841.00	12,500,400
J S R	5,300	1,874.00	9,932,200
東京応化工業	900	3,680.00	3,312,000
三菱ケミカルホールディングス	35,100	799.50	28,062,450
ダイセル	7,500	1,245.00	9,337,500
積水化学工業	10,200	1,779.00	18,145,800
アイカ工業	1,300	3,630.00	4,719,000
日立化成	2,800	2,640.00	7,392,000
日本化薬	3,800	1,311.00	4,981,800
花王	13,600	8,283.00	112,648,800
日本ペイントホールディングス	3,600	4,280.00	15,408,000
関西ペイント	5,100	2,166.00	11,046,600
D I C	2,000	3,345.00	6,690,000
資生堂	10,200	8,374.00	85,414,800
コーセー	800	21,840.00	17,472,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,300	3,435.00	7,900,500
日東電工	4,500	6,085.00	27,382,500
エフピコ	600	6,600.00	3,960,000
ニフコ	2,200	3,265.00	7,183,000
ユニ・チャーム	9,700	3,632.00	35,230,400
武田薬品工業	20,500	4,059.00	83,209,500
アステラス製薬	54,500	1,511.50	82,376,750
大日本住友製薬	3,700	2,380.00	8,806,000
塩野義製薬	7,700	6,329.00	48,733,300

田辺三菱製薬	6,000	1,470.00	8,820,000
日本新薬	1,200	7,050.00	8,460,000
中外製薬	5,500	6,790.00	37,345,000
エーザイ	7,100	6,376.00	45,269,600
小野薬品工業	10,900	2,020.00	22,018,000
参天製薬	9,800	1,654.00	16,209,200
日医工	1,100	1,332.00	1,465,200
沢井製薬	1,000	5,850.00	5,850,000
第一三共	16,300	5,011.00	81,679,300
大塚ホールディングス	11,500	3,842.00	44,183,000
JXTGホールディングス	85,200	547.60	46,655,520
ブリヂストン	17,000	4,427.00	75,259,000
住友ゴム工業	4,700	1,442.00	6,777,400
AGC	5,000	3,775.00	18,875,000
太平洋セメント	3,400	3,710.00	12,614,000
TOTO	3,800	4,765.00	18,107,000
日本碍子	7,100	1,663.00	11,807,300
日本特殊陶業	4,400	2,306.00	10,146,400
ニチアス	1,400	2,281.00	3,193,400
日本製鉄	21,000	2,036.00	42,756,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	13,000	1,958.50	25,460,500
日立金属	5,300	1,318.00	6,985,400
古河電気工業	1,800	3,135.00	5,643,000
住友電気工業	20,400	1,536.50	31,344,600
フジクラ	6,800	486.00	3,304,800
三和ホールディングス	5,000	1,311.00	6,555,000
リンナイ	1,000	7,590.00	7,590,000
日本発條	4,300	1,076.00	4,626,800
アマダホールディングス	8,900	1,274.00	11,338,600
オーエスジー	2,000	2,252.00	4,504,000
ディスコ	800	19,750.00	15,800,000
ナブテスコ	3,200	3,525.00	11,280,000
SMC	1,700	45,590.00	77,503,000
小松製作所	24,200	2,836.50	68,643,300
住友重機械工業	3,100	3,950.00	12,245,000

ハーモニック・ドライブ・システムズ	600	4,570.00	2,742,000
クボタ	27,300	1,641.00	44,799,300
ダイキン工業	6,600	13,470.00	88,902,000
栗田工業	2,800	2,929.00	8,201,200
椿本チエイン	600	4,115.00	2,469,000
ダイフク	2,500	6,790.00	16,975,000
CKD	1,200	1,386.00	1,663,200
ユニバーサルエンターテインメント	500	3,600.00	1,800,000
グローリー	1,600	2,844.00	4,550,400
ホシザキ	1,200	7,220.00	8,664,000
日本精工	10,500	1,182.00	12,411,000
NTN	10,800	383.00	4,136,400
ジェイテクト	5,200	1,507.00	7,836,400
THK	3,400	3,075.00	10,455,000
マキタ	6,300	4,135.00	26,050,500
三菱重工業	8,000	4,564.00	36,512,000
コニカミノルタ	12,300	1,108.00	13,628,400
ブラザー工業	6,100	2,207.00	13,462,700
ミネベアミツミ	9,600	2,007.00	19,267,200
三菱電機	51,200	1,523.00	77,977,600
富士電機	3,100	3,460.00	10,726,000
安川電機	6,300	4,340.00	27,342,000
マブチモーター	1,300	4,240.00	5,512,000
日本電産	5,800	15,775.00	91,495,000
オムロン	5,300	6,060.00	32,118,000
ルネサスエレクトロニクス	7,400	643.00	4,758,200
セイコーエプソン	7,500	1,791.00	13,432,500
パナソニック	59,800	1,031.00	61,653,800
富士通ゼネラル	1,500	1,553.00	2,329,500
TDK	3,500	9,860.00	34,510,000
アルプスアルパイン	5,200	2,341.00	12,173,200
ヒロセ電機	800	13,040.00	10,432,000
日本光電工業	2,000	3,090.00	6,180,000
堀場製作所	900	6,790.00	6,111,000
アドバンテスト	4,400	3,320.00	14,608,000

キーエンス	2,600	73,370.00	190,762,000
シスメックス	3,300	6,068.00	20,024,400
オプテックスグループ	800	1,955.00	1,564,000
スタンレー電気	3,600	3,430.00	12,348,000
カシオ計算機	5,500	1,402.00	7,711,000
ファナック	5,500	21,955.00	120,752,500
ローム	2,500	8,500.00	21,250,000
浜松ホトニクス	4,000	4,425.00	17,700,000
京セラ	8,600	6,867.00	59,056,200
村田製作所	15,900	5,981.00	95,097,900
小糸製作所	2,400	6,830.00	16,392,000
S C R E E Nホールディングス	1,100	5,870.00	6,457,000
キヤノン	28,000	3,170.00	88,760,000
東京エレクトロン	4,400	18,155.00	79,882,000
トヨタ紡織	1,300	1,828.00	2,376,400
豊田自動織機	4,100	6,200.00	25,420,000
デンソー	12,000	5,182.00	62,184,000
東海理化電機製作所	1,300	2,093.00	2,720,900
川崎重工業	3,700	2,714.00	10,041,800
日産自動車	63,900	939.30	60,021,270
いすゞ自動車	14,400	1,587.00	22,852,800
トヨタ自動車	32,000	6,958.00	222,656,000
日野自動車	7,000	1,048.00	7,336,000
アイシン精機	4,600	4,940.00	22,724,000
マツダ	16,200	1,345.50	21,797,100
スズキ	8,500	5,170.00	43,945,000
S U B A R U	15,700	2,818.50	44,250,450
ヤマハ発動機	7,100	2,441.00	17,331,100
豊田合成	1,700	2,540.00	4,318,000
シマノ	2,100	18,070.00	37,947,000
テイ・エス テック	1,100	3,500.00	3,850,000
テルモ	14,900	3,175.00	47,307,500
島津製作所	6,000	3,020.00	18,120,000
東京精密	1,000	3,265.00	3,265,000
トプコン	2,600	1,357.00	3,528,200

オリンパス	29,200	1,180.00	34,456,000
HOYA	10,800	7,446.00	80,416,800
朝日インテック	2,700	5,080.00	13,716,000
ニプロ	3,700	1,324.00	4,898,800
バンダイナムコホールディングス	5,400	5,060.00	27,324,000
アシックス	4,400	1,320.00	5,808,000
ヤマハ	3,800	5,680.00	21,584,000
ピジョン	3,000	4,710.00	14,130,000
任天堂	3,000	39,200.00	117,600,000
中部電力	17,400	1,593.00	27,718,200
関西電力	19,200	1,571.50	30,172,800
東北電力	12,300	1,330.00	16,359,000
九州電力	10,700	1,150.00	12,305,000
東京急行電鉄	12,500	1,748.00	21,850,000
小田急電鉄	7,900	2,476.00	19,560,400
京王電鉄	2,600	6,360.00	16,536,000
東日本旅客鉄道	8,600	10,080.00	86,688,000
西日本旅客鉄道	4,500	8,077.00	36,346,500
近鉄グループホールディングス	5,000	4,760.00	23,800,000
日本通運	2,100	6,150.00	12,915,000
センコーグループホールディングス	1,800	883.00	1,589,400
日本航空	9,700	3,746.00	36,336,200
ANAホールディングス	8,700	3,956.00	34,417,200
日鉄ソリューションズ	900	2,788.00	2,509,200
ネクソン	10,600	1,576.00	16,705,600
コロプラ	1,600	680.00	1,088,000
インターネットイニシアティブ	800	2,243.00	1,794,400
野村総合研究所	3,500	5,200.00	18,200,000
ヤフー	35,000	275.00	9,625,000
トレンドマイクロ	3,400	5,450.00	18,530,000
大塚商会	2,900	4,425.00	12,832,500
日本電信電話	38,300	4,586.00	175,643,800
KDDI	50,000	2,467.00	123,350,000
NTTドコモ	35,500	2,364.50	83,939,750
エヌ・ティ・ティ・データ	17,900	1,264.00	22,625,600

スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,400	3,775.00	9,060,000
SCSK	1,400	5,160.00	7,224,000
コナミホールディングス	2,700	4,955.00	13,378,500
ソフトバンクグループ	24,300	11,545.00	280,543,500
第一興商	1,000	5,460.00	5,460,000
日本ライフライン	1,000	1,701.00	1,701,000
伊藤忠商事	36,000	2,000.00	72,000,000
日立ハイテクノロジーズ	1,800	4,745.00	8,541,000
三菱商事	34,400	2,988.50	102,804,400
トラスコ中山	1,000	2,830.00	2,830,000
ミスミグループ本社	5,500	2,940.00	16,170,000
ローソン	1,300	5,160.00	6,708,000
エービーシー・マート	800	6,740.00	5,392,000
アダストリア	800	2,814.00	2,251,200
くらコーポレーション	300	4,990.00	1,497,000
セリア	1,000	3,395.00	3,395,000
ジーンズ	300	5,820.00	1,746,000
Monotaro	3,400	2,478.00	8,425,200
ZOZO	5,000	2,066.00	10,330,000
物語コーポレーション	100	8,930.00	893,000
ウエルシアホールディングス	1,200	4,155.00	4,986,000
すかいらーくホールディングス	3,500	1,828.00	6,398,000
コスモス薬品	200	17,190.00	3,438,000
セブン&アイ・ホールディングス	20,700	3,685.00	76,279,500
クリエイト・レストランツ・ホールディング	1,100	1,301.00	1,431,100
ツルハホールディングス	1,000	8,920.00	8,920,000
トリドールホールディングス	600	2,444.00	1,466,400
クスリのアオキホールディングス	400	7,480.00	2,992,000
良品計画	700	21,200.00	14,840,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	3,700	7,110.00	26,307,000
ゼンショーホールディングス	2,400	2,412.00	5,788,800
ユナイテッドアローズ	600	3,490.00	2,094,000
スギホールディングス	900	5,360.00	4,824,000
ユニー・ファミリーマートホールデ	8,900	2,876.00	25,596,400

インクス				
しまむら	600	8,550.00	5,130,000	
イオン	17,300	2,009.00	34,755,700	
イズミ	800	4,575.00	3,660,000	
ニトリホールディングス	2,000	13,360.00	26,720,000	
パローホールディングス	900	2,618.00	2,356,200	
ファーストリテイリング	700	64,590.00	45,213,000	
サンドラッグ	1,900	2,928.00	5,563,200	
三井住友フィナンシャルグループ	35,700	4,061.00	144,977,700	
大和証券グループ本社	44,900	533.10	23,936,190	
SOMPOホールディングス	10,100	4,246.00	42,884,600	
東京海上ホールディングス	19,100	5,614.00	107,227,400	
クレディセゾン	4,200	1,496.00	6,283,200	
東京センチュリー	1,100	5,160.00	5,676,000	
イオンフィナンシャルサービス	3,100	2,291.00	7,102,100	
日立キャピタル	1,300	2,622.00	3,408,600	
オリックス	37,100	1,585.00	58,803,500	
三菱UFJリース	11,100	569.00	6,315,900	
ヒューリック	7,400	996.00	7,370,400	
野村不動産ホールディングス	3,500	2,050.00	7,175,000	
飯田グループホールディングス	3,800	1,911.00	7,261,800	
パーク24	2,900	2,383.00	6,910,700	
三井不動産	24,900	2,556.50	63,656,850	
イオンモール	3,000	1,713.00	5,139,000	
日本空港ビルデング	1,000	4,565.00	4,565,000	
ミクシィ	1,200	2,485.00	2,982,000	
パーソンホールディングス	4,400	2,020.00	8,888,000	
総合警備保障	1,400	4,790.00	6,706,000	
カカクコム	3,900	2,287.00	8,919,300	
ディップ	900	1,590.00	1,431,000	
エムスリー	8,800	1,835.00	16,148,000	
博報堂DYホールディングス	6,300	1,771.00	11,157,300	
インフォマート	2,500	1,512.00	3,780,000	
電通	6,300	4,590.00	28,917,000	
オリエンタルランド	5,400	12,390.00	66,906,000	

	リゾートトラスト	2,100	1,566.00	3,288,600	
	サイバーエージェント	2,700	4,160.00	11,232,000	
	楽天	24,200	1,220.00	29,524,000	
	テクノプロ・ホールディングス	1,000	6,570.00	6,570,000	
	リクルートホールディングス	28,600	3,180.00	90,948,000	
	ベルシステム24ホールディングス	900	1,571.00	1,413,900	
	リロググループ	3,100	2,993.00	9,278,300	
	エイチ・アイ・エス	900	3,670.00	3,303,000	
	カナモト	700	2,683.00	1,878,100	
	西尾レントオール	400	3,115.00	1,246,000	
	セコム	5,900	9,146.00	53,961,400	
	小計 銘柄数：280			7,329,005,980	
	組入時価比率：97.8%			100.0%	
	合計			7,329,005,980	

(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(2019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。