

平成29年4月期（平成28年10月8日～平成29年4月7日）決算短信

平成29年5月17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6月29日
 分配金支払開始日 平成29年5月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成29年4月期の運用状況（平成28年10月8日～平成29年4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4月期	2,516	(97.5)	64	(2.5)	2,581	(100)
平成28年10月期	2,271	(98.3)	38	(1.7)	2,309	(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4月期	154	0	0	154
平成28年10月期	449	0	295	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4月期	2,619	38	2,581	16,757
平成28年10月期	2,344	34	2,309	14,997

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成29年4月期	183.00
平成28年10月期	153.00

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 6 期 (平成 28 年 10 月 7 日現在)	第 7 期 (平成 29 年 4 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	46,041,307	42,676,148
株式	2,271,311,450	2,516,994,470
派生商品評価勘定	351,684	-
未収入金	102,812	25,348,900
未収配当金	24,786,708	29,650,872
差入委託証拠金	2,104,200	4,793,400
流動資産合計	2,344,698,161	2,619,463,790
資産合計	2,344,698,161	2,619,463,790
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,962,936
未払収益分配金	23,566,284	28,187,124
未払受託者報酬	1,405,091	703,672
未払委託者報酬	7,025,407	3,518,310
未払利息	38	47
その他未払費用	2,795,047	4,002,919
流動負債合計	34,791,867	38,375,008
負債合計	34,791,867	38,375,008
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(△)	256,867,082	528,049,570
(分配準備積立金)	145,920	22,895
元本等合計	2,309,906,294	2,581,088,782
純資産合計	2,309,906,294	2,581,088,782
負債純資産合計	2,344,698,161	2,619,463,790

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日
営業収益		
受取配当金	34,930,986	33,684,114
受取利息	7	-
有価証券売買等損益	332,413,482	267,748,047
派生商品取引等損益	5,420,738	3,557,466

その他収益	59,828	18,461
営業収益合計	372,825,041	305,008,088
営業費用		
支払利息	20,631	8,494
受託者報酬	1,405,091	703,672
委託者報酬	7,025,407	3,518,310
その他費用	2,842,196	1,408,000
営業費用合計	11,293,325	5,638,476
営業利益又は営業損失(△)	361,531,716	299,369,612
経常利益又は経常損失(△)	361,531,716	299,369,612
当期純利益又は当期純損失(△)	361,531,716	299,369,612
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(△)	277,447,411	256,867,082
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	358,545,761	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	358,545,761	-
分配金	23,566,284	28,187,124
期末剰余金又は期末欠損金(△)	256,867,082	528,049,570

(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、平成 28 年 10 月 8 日から平成 29 年 4 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 6 期 平成 28 年 10 月 7 日現在	第 7 期 平成 29 年 4 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 14,997 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 16,757 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 6 期	第 7 期
-------	-------

自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日			自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 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	34,970,190 円	当期配当等収益額	A	33,694,081 円
分配準備積立金	B	14,708 円	分配準備積立金	B	145,920 円
配当等収益合計額	C=A+B	34,984,898 円	配当等収益合計額	C=A+B	33,840,001 円
経費	D	11,272,694 円	経費	D	5,629,982 円
収益分配可能額	E=C-D	23,712,204 円	収益分配可能額	E=C-D	28,210,019 円
収益分配金	F	23,566,284 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	145,920 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	口数	H	154,028 口
1 口当たり分配金	I=F/H	153 円	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 2,525,928 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 1,266,553 円は、対象指数についての商標使用料であります。		
3. 追加情報 平成 28 年 1 月 29 日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。					

(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 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日		第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 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。		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 6 期 平成 28 年 10 月 7 日現在	第 7 期 平成 29 年 4 月 7 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 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 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 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 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日
期首元本額 5,993,104,941 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 3,940,065,729 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 6 期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	第 7 期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 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	156,227,982	239,831,720
合計	156,227,982	239,831,720

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 6 期(平成 28 年 10 月 7 日現在)			第 7 期(平成 29 年 4 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	36,122,400	—	36,477,000	351,684	64,727,400	—
合計	36,122,400	—	36,477,000	351,684	64,727,400	—

(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 4 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	526.00	1,052,000	
		マルハニチロ	200	3,270.00	654,000	
		国際石油開発帝石	6,700	1,126.50	7,547,550	
		石油資源開発	400	2,566.00	1,026,400	
		ミライト・ホールディングス	800	1,071.00	856,800	
		コムシスホールディングス	800	2,017.00	1,613,600	
		ミサワホーム	700	982.00	687,400	
		大成建設	5,000	823.00	4,115,000	
		大林組	3,200	1,040.00	3,328,000	
		清水建設	2,000	1,014.00	2,028,000	
		長谷工コーポレーション	2,300	1,151.00	2,647,300	
		鹿島建設	4,000	734.00	2,936,000	
		西松建設	1,000	541.00	541,000	
		前田建設工業	1,000	949.00	949,000	
		戸田建設	1,000	654.00	654,000	
		熊谷組	2,000	282.00	564,000	
		大東建託	300	15,405.00	4,621,500	
		五洋建設	1,100	534.00	587,400	
		住友林業	1,300	1,603.00	2,083,900	
		パナホーム	1,000	1,021.00	1,021,000	
		大和ハウス工業	2,700	3,175.00	8,572,500	
		積水ハウス	3,800	1,789.00	6,798,200	
		関電工	1,000	1,007.00	1,007,000	
		きんでん	1,100	1,515.00	1,666,500	
		協和エクシオ	600	1,586.00	951,600	
		日揮	1,400	1,933.00	2,706,200	
千代田化工建設	1,000	720.00	720,000			

日本製粉	400	1,646.00	658,400
日清製粉グループ本社	1,000	1,668.00	1,668,000
江崎グリコ	100	5,690.00	569,000
山崎製パン	500	2,310.00	1,155,000
カルビー	200	3,870.00	774,000
森永乳業	1,000	846.00	846,000
ヤクルト本社	300	6,400.00	1,920,000
明治ホールディングス	300	9,530.00	2,859,000
雪印メグミルク	200	3,140.00	628,000
日本ハム	1,000	3,025.00	3,025,000
丸大食品	1,000	486.00	486,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,100	1,035.00	1,138,500
サッポロホールディングス	300	3,015.00	904,500
アサヒグループホールディングス	1,700	4,305.00	7,318,500
キリンホールディングス	5,200	2,110.00	10,972,000
宝ホールディングス	600	1,180.00	708,000
コカ・コーラボトラーズジャパン	800	3,390.00	2,712,000
サントリー食品インターナショナル	500	4,770.00	2,385,000
伊藤園	300	4,060.00	1,218,000
日清オイリオグループ	2,000	669.00	1,338,000
不二製油グループ本社	300	2,584.00	775,200
キッコーマン	400	3,325.00	1,330,000
味の素	2,700	2,152.50	5,811,750
キューピー	500	2,852.00	1,426,000
ハウス食品グループ本社	300	2,429.00	728,700
カゴメ	200	2,922.00	584,400
ニチレイ	500	2,735.00	1,367,500
東洋水産	400	4,175.00	1,670,000
日清食品ホールディングス	200	6,330.00	1,266,000
日本たばこ産業	4,300	3,689.00	15,862,700
ゲンゼ	1,000	449.00	449,000
東洋紡	6,000	192.00	1,152,000
帝人	1,300	2,054.00	2,670,200
東レ	6,800	982.50	6,681,000
ワコールホールディングス	1,000	1,344.00	1,344,000
T S I ホールディングス	1,000	787.00	787,000

オンワードホールディングス	1,000	795.00	795,000
王子ホールディングス	8,000	513.00	4,104,000
日本製紙	1,100	2,000.00	2,200,000
北越紀州製紙	1,100	752.00	827,200
大王製紙	600	1,425.00	855,000
レンゴー	1,600	632.00	1,011,200
クラレ	2,100	1,673.00	3,513,300
旭化成	9,000	1,041.00	9,369,000
昭和電工	1,800	1,893.00	3,407,400
住友化学	14,000	595.00	8,330,000
日産化学工業	400	3,210.00	1,284,000
日本曹達	1,000	600.00	600,000
東ソー	3,000	962.00	2,886,000
トクヤマ	2,000	493.00	986,000
セントラル硝子	2,000	457.00	914,000
東亜合成	700	1,236.00	865,200
デンカ	4,000	552.00	2,208,000
信越化学工業	1,400	9,415.00	13,181,000
エア・ウォーター	800	2,056.00	1,644,800
大陽日酸	600	1,286.00	771,600
日本触媒	200	7,240.00	1,448,000
カネカ	2,000	829.00	1,658,000
三菱瓦斯化学	1,300	2,247.00	2,921,100
三井化学	6,000	526.00	3,156,000
J S R	1,500	1,871.00	2,806,500
東京応化工業	200	3,330.00	666,000
三菱ケミカルホールディングス	14,200	836.60	11,879,720
ダイセル	1,600	1,269.00	2,030,400
住友ベークライト	1,000	647.00	647,000
積水化学工業	2,700	1,805.00	4,873,500
日本ゼオン	1,000	1,190.00	1,190,000
アイカ工業	200	2,942.00	588,400
宇部興産	12,000	251.00	3,012,000
日立化成	600	3,035.00	1,821,000
日本化薬	1,000	1,464.00	1,464,000
ADEKA	500	1,589.00	794,500

日油	1,000	1,212.00	1,212,000
花王	1,700	6,254.00	10,631,800
日本ペイントホールディングス	200	3,990.00	798,000
関西ペイント	500	2,375.00	1,187,500
D I C	500	3,915.00	1,957,500
東洋インキ S Cホールディングス	2,000	531.00	1,062,000
富士フイルムホールディングス	3,000	4,217.00	12,651,000
資生堂	1,400	2,923.50	4,092,900
ライオン	500	2,051.00	1,025,500
コーセー	100	10,070.00	1,007,000
ポーラ・オルビスホールディングス	200	2,652.00	530,400
小林製薬	100	5,600.00	560,000
日東電工	800	8,309.00	6,647,200
ニフコ	200	5,540.00	1,108,000
ユニ・チャーム	1,000	2,666.50	2,666,500
協和発酵キリン	900	1,715.00	1,543,500
武田薬品工業	3,500	5,230.00	18,305,000
アステラス製薬	9,500	1,494.00	14,193,000
大日本住友製薬	400	1,800.00	720,000
塩野義製薬	600	5,869.00	3,521,400
田辺三菱製薬	700	2,350.00	1,645,000
中外製薬	400	3,855.00	1,542,000
科研製薬	100	6,480.00	648,000
エーザイ	800	5,776.00	4,620,800
ロート製薬	400	2,097.00	838,800
小野薬品工業	500	2,317.00	1,158,500
久光製薬	200	6,520.00	1,304,000
参天製薬	900	1,517.00	1,365,300
ツムラ	200	3,470.00	694,000
沢井製薬	100	5,950.00	595,000
第一三共	3,100	2,469.00	7,653,900
キョーリン製薬ホールディングス	200	2,330.00	466,000
大塚ホールディングス	1,700	5,120.00	8,704,000
大正製薬ホールディングス	100	9,010.00	901,000
昭和シェル石油	2,500	1,111.00	2,777,500
富士石油	1,500	362.00	543,000

出光興産	1,400	3,860.00	5,404,000
JXTGホールディングス	60,900	537.90	32,758,110
コスモエネルギーホールディングス	500	1,902.00	951,000
横浜ゴム	1,000	2,108.00	2,108,000
東洋ゴム工業	700	1,901.00	1,330,700
ブリヂストン	3,700	4,488.00	16,605,600
住友ゴム工業	1,400	1,889.00	2,644,600
旭硝子	9,000	883.00	7,947,000
日本板硝子	1,000	787.00	787,000
日本電気硝子	4,000	647.00	2,588,000
住友大阪セメント	3,000	452.00	1,356,000
太平洋セメント	9,000	363.00	3,267,000
東海カーボン	1,700	470.00	799,000
TOTO	500	4,195.00	2,097,500
日本碍子	800	2,417.00	1,933,600
日本特殊陶業	800	2,372.00	1,897,600
新日鐵住金	8,300	2,454.00	20,368,200
神戸製鋼所	5,100	964.00	4,916,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	6,600	1,809.00	11,939,400
日新製鋼	900	1,431.00	1,287,900
大和工業	200	2,738.00	547,600
丸一鋼管	200	3,135.00	627,000
大同特殊鋼	2,000	524.00	1,048,000
山陽特殊製鋼	1,000	563.00	563,000
愛知製鋼	100	4,170.00	417,000
日立金属	1,200	1,461.00	1,753,200
日本軽金属ホールディングス	4,000	236.00	944,000
三井金属鉱業	7,000	350.00	2,450,000
三菱マテリアル	1,500	3,210.00	4,815,000
住友金属鉱山	4,000	1,537.50	6,150,000
DOWAホールディングス	2,000	764.00	1,528,000
UACJ	2,000	293.00	586,000
古河電気工業	600	4,200.00	2,520,000
住友電気工業	6,200	1,738.50	10,778,700
フジクラ	2,600	789.00	2,051,400

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	1,777.00	2,132,400
三和ホールディングス	1,000	1,036.00	1,036,000
三協立山	300	1,583.00	474,900
LIXILグループ	1,700	2,738.00	4,654,600
リンナイ	100	8,880.00	888,000
日本発條	1,500	1,190.00	1,785,000
日本製鋼所	300	1,773.00	531,900
オークマ	1,000	1,107.00	1,107,000
アマダホールディングス	1,600	1,284.00	2,054,400
オーエスジー	300	2,251.00	675,300
DMG森精機	900	1,698.00	1,528,200
ディスコ	100	16,870.00	1,687,000
ナブテスコ	500	3,050.00	1,525,000
SMC	100	31,520.00	3,152,000
小松製作所	5,300	2,852.50	15,118,250
住友重機械工業	4,000	755.00	3,020,000
日立建機	900	2,676.00	2,408,400
クボタ	3,900	1,652.00	6,442,800
荏原製作所	500	3,380.00	1,690,000
ダイキン工業	600	10,765.00	6,459,000
栗田工業	600	2,778.00	1,666,800
椿本チエイン	1,000	931.00	931,000
ダイフク	300	2,745.00	823,500
タダノ	400	1,294.00	517,600
フジテック	500	1,246.00	623,000
平和	300	2,707.00	812,100
SANKYO	400	3,690.00	1,476,000
グローリー	300	3,580.00	1,074,000
セガサミーホールディングス	1,200	1,478.00	1,773,600
ホシザキ	100	8,780.00	878,000
日本精工	2,400	1,486.00	3,566,400
NTN	3,000	542.00	1,626,000
ジェイテクト	1,600	1,700.00	2,720,000
THK	600	2,739.00	1,643,400
マキタ	600	3,885.00	2,331,000

日立造船	1,200	619.00	742,800
三菱重工業	22,000	440.80	9,697,600
I H I	8,000	367.00	2,936,000
日清紡ホールディングス	1,200	1,081.00	1,297,200
イビデン	1,300	1,654.00	2,150,200
コニカミノルタ	4,800	953.00	4,574,400
ブラザー工業	1,300	2,211.00	2,874,300
ミネベアミツミ	2,000	1,483.00	2,966,000
日立製作所	47,000	586.10	27,546,700
東芝	23,000	216.00	4,968,000
三菱電機	10,200	1,541.00	15,718,200
富士電機	3,000	621.00	1,863,000
安川電機	800	2,116.00	1,692,800
東芝テック	1,000	598.00	598,000
マブチモーター	100	6,100.00	610,000
日本電産	400	10,435.00	4,174,000
JVCケンウッド	1,900	281.00	533,900
オムロン	1,200	4,840.00	5,808,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	2,000	496.00	992,000
日本電気	24,000	264.00	6,336,000
富士通	15,000	667.90	10,018,500
沖電気工業	600	1,604.00	962,400
セイコーエプソン	1,600	2,304.00	3,686,400
アルバック	200	5,060.00	1,012,000
ジャパンディスプレイ	7,000	239.00	1,673,000
パナソニック	16,800	1,255.00	21,084,000
アンリツ	1,100	811.00	892,100
ソニー	5,300	3,547.00	18,799,100
TDK	900	6,750.00	6,075,000
アルプス電気	800	2,988.00	2,390,400
パイオニア	3,600	203.00	730,800
フォスター電機	300	1,842.00	552,600
ホンデン	900	1,032.00	928,800
ヒロセ電機	100	15,080.00	1,508,000
日立マクセル	500	1,947.00	973,500

アルパイン	500	1,506.00	753,000
横河電機	900	1,726.00	1,553,400
アズビル	300	3,645.00	1,093,500
日本光電工業	300	2,440.00	732,000
堀場製作所	100	5,990.00	599,000
アドバンテスト	400	2,036.00	814,400
キーエンス	100	44,140.00	4,414,000
シスメックス	100	6,840.00	684,000
スタンレー電気	600	3,070.00	1,842,000
ウシオ電機	600	1,359.00	815,400
カシオ計算機	1,100	1,525.00	1,677,500
ファナック	500	22,650.00	11,325,000
ローム	500	7,320.00	3,660,000
浜松ホトニクス	300	3,105.00	931,500
新光電気工業	900	704.00	633,600
京セラ	1,600	6,002.00	9,603,200
太陽誘電	900	1,301.00	1,170,900
村田製作所	500	14,855.00	7,427,500
小糸製作所	300	5,550.00	1,665,000
ミツバ	300	2,051.00	615,300
SCREENホールディングス	100	7,750.00	775,000
キヤノン	9,300	3,465.00	32,224,500
リコー	6,400	889.00	5,689,600
東京エレクトロン	600	12,100.00	7,260,000
トヨタ紡織	400	2,416.00	966,400
ユニプレス	600	2,213.00	1,327,800
豊田自動織機	900	5,230.00	4,707,000
デンソー	3,100	4,702.00	14,576,200
東海理化電機製作所	500	2,075.00	1,037,500
三井造船	8,000	172.00	1,376,000
川崎重工業	12,000	328.00	3,936,000
日産自動車	19,100	1,010.50	19,300,550
いすゞ自動車	4,500	1,433.00	6,448,500
トヨタ自動車	14,600	5,832.00	85,147,200
日野自動車	2,200	1,290.00	2,838,000
三菱自動車工業	14,700	670.00	9,849,000

日産車体	1,000	1,006.00	1,006,000
新明和工業	1,000	1,032.00	1,032,000
日信工業	400	1,897.00	758,800
タチエス	300	2,111.00	633,300
NOK	600	2,462.00	1,477,200
フタバ産業	1,100	757.00	832,700
KYB	2,000	524.00	1,048,000
プレス工業	1,200	519.00	622,800
ケーヒン	500	1,730.00	865,000
アイシン精機	1,400	5,150.00	7,210,000
マツダ	4,000	1,502.00	6,008,000
本田技研工業	14,000	3,157.00	44,198,000
スズキ	3,100	4,515.00	13,996,500
SUBARU	2,400	3,941.00	9,458,400
ヤマハ発動機	1,400	2,524.00	3,533,600
ショーワ	1,400	911.00	1,275,400
エクセディ	200	3,045.00	609,000
豊田合成	600	2,720.00	1,632,000
エフ・シー・シー	200	2,148.00	429,600
シマノ	100	16,290.00	1,629,000
テイ・エス テック	500	2,843.00	1,421,500
テルモ	700	3,875.00	2,712,500
島津製作所	600	1,786.00	1,071,600
ニコン	2,300	1,570.00	3,611,000
オリンパス	400	4,145.00	1,658,000
HOYA	1,900	5,266.00	10,005,400
シチズン時計	2,000	691.00	1,382,000
ニプロ	800	1,557.00	1,245,600
バンダイナムコホールディングス	900	3,265.00	2,938,500
トッパン・フォームズ	500	1,090.00	545,000
凸版印刷	4,000	1,115.00	4,460,000
大日本印刷	6,000	1,206.00	7,236,000
アシックス	500	1,828.00	914,000
ヤマハ	400	3,015.00	1,206,000
ビジョン	200	3,550.00	710,000
リンテック	400	2,332.00	932,800

任天堂	200	25,765.00	5,153,000
コクヨ	400	1,430.00	572,000
東京電力ホールディングス	31,900	424.00	13,525,600
中部電力	6,400	1,464.00	9,369,600
関西電力	7,100	1,396.50	9,915,150
中国電力	3,000	1,235.00	3,705,000
北陸電力	1,800	1,047.00	1,884,600
東北電力	3,600	1,500.00	5,400,000
四国電力	1,800	1,225.00	2,205,000
九州電力	2,100	1,195.00	2,509,500
北海道電力	1,500	814.00	1,221,000
沖縄電力	300	2,601.00	780,300
電源開発	1,300	2,520.00	3,276,000
東京瓦斯	22,000	509.80	11,215,600
大阪瓦斯	15,000	423.20	6,348,000
東邦瓦斯	2,000	780.00	1,560,000
静岡ガス	600	749.00	449,400
東武鉄道	5,000	556.00	2,780,000
相鉄ホールディングス	2,000	519.00	1,038,000
東京急行電鉄	5,000	804.00	4,020,000
京浜急行電鉄	1,000	1,229.00	1,229,000
小田急電鉄	800	2,137.00	1,709,600
京王電鉄	2,000	878.00	1,756,000
京成電鉄	400	2,612.00	1,044,800
東日本旅客鉄道	1,600	9,750.00	15,600,000
西日本旅客鉄道	1,000	7,300.00	7,300,000
東海旅客鉄道	600	18,350.00	11,010,000
西武ホールディングス	400	1,898.00	759,200
西日本鉄道	1,000	466.00	466,000
近鉄グループホールディングス	7,000	404.00	2,828,000
阪急阪神ホールディングス	1,000	3,635.00	3,635,000
南海電気鉄道	2,000	547.00	1,094,000
京阪ホールディングス	2,000	687.00	1,374,000
名古屋鉄道	4,000	516.00	2,064,000
日本通運	8,000	570.00	4,560,000
ヤマトホールディングス	2,100	2,343.50	4,921,350

山九	2,000	672.00	1,344,000
ニッコンホールディングス	300	2,332.00	699,600
セイノーホールディングス	1,300	1,249.00	1,623,700
日立物流	300	2,298.00	689,400
日本郵船	27,000	227.00	6,129,000
商船三井	11,000	341.00	3,751,000
川崎汽船	11,000	291.00	3,201,000
日本航空	3,200	3,380.00	10,816,000
ANAホールディングス	24,000	330.60	7,934,400
上組	2,000	990.00	1,980,000
T I S	400	2,789.00	1,115,600
グリーン	1,100	729.00	801,900
ネクソン	400	1,772.00	708,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,600	251.00	903,600
野村総合研究所	500	4,020.00	2,010,000
フジ・メディア・ホールディングス	1,500	1,587.00	2,380,500
オービック	100	5,310.00	531,000
ヤフー	3,400	518.00	1,761,200
トレンドマイクロ	400	4,875.00	1,950,000
日本オラクル	100	6,470.00	647,000
伊藤忠テクノソリューションズ	300	3,265.00	979,500
大塚商会	200	5,980.00	1,196,000
ネットワンシステムズ	1,000	898.00	898,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	400	1,600.00	640,000
日本ユニシス	400	1,496.00	598,400
東京放送ホールディングス	500	1,994.00	997,000
日本テレビホールディングス	800	1,903.00	1,522,400
テレビ朝日ホールディングス	300	2,097.00	629,100
スカパーJ S A Tホールディングス	1,200	488.00	585,600
日本電信電話	14,400	4,890.00	70,416,000
K D D I	8,200	2,898.00	23,763,600
光通信	100	10,570.00	1,057,000
N T T ドコモ	7,900	2,634.00	20,808,600
カドカワ	400	1,552.00	620,800
東宝	300	3,020.00	906,000

エヌ・ティ・ティ・データ	700	5,120.00	3,584,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	3,190.00	638,000
S C S K	200	4,410.00	882,000
コナミホールディングス	300	4,650.00	1,395,000
ソフトバンクグループ	3,700	7,996.00	29,585,200
あらた	200	2,993.00	598,600
双日	20,800	272.00	5,657,600
アルフレッサ ホールディングス	1,500	1,971.00	2,956,500
ダイワボウホールディングス	3,000	306.00	918,000
マクニカ・富士エレホールディングス	500	1,521.00	760,500
シップヘルスケアホールディングス	200	2,945.00	589,000
三菱食品	200	3,495.00	699,000
第一興商	200	4,450.00	890,000
メディカルホールディングス	1,700	1,798.00	3,056,600
黒田電気	300	2,353.00	705,900
伊藤忠商事	18,000	1,572.00	28,296,000
丸紅	29,900	682.30	20,400,770
長瀬産業	1,400	1,532.00	2,144,800
豊田通商	3,000	3,330.00	9,990,000
兼松	7,000	196.00	1,372,000
三井物産	20,400	1,616.50	32,976,600
日立ハイテクノロジーズ	300	4,455.00	1,336,500
カメイ	700	1,185.00	829,500
住友商事	14,100	1,487.50	20,973,750
三菱商事	13,300	2,447.00	32,545,100
キヤノンマーケティングジャパン	400	2,222.00	888,800
阪和興業	3,000	770.00	2,310,000
岩谷産業	2,000	637.00	1,274,000
三愛石油	1,400	917.00	1,283,800
稲畑産業	700	1,334.00	933,800
東邦ホールディングス	500	2,323.00	1,161,500
サンゲツ	400	1,925.00	770,000
伊藤忠エネクス	1,000	911.00	911,000
サンリオ	300	2,000.00	600,000
リョーサン	300	3,385.00	1,015,500

三信電気	600	1,252.00	751,200
PAL TAC	400	3,260.00	1,304,000
日鉄住金物産	300	4,550.00	1,365,000
オートバックスセブン	800	1,620.00	1,296,000
加藤産業	300	2,750.00	825,000
因幡電機産業	200	3,970.00	794,000
ミスミグループ本社	400	2,000.00	800,000
スズケン	800	3,600.00	2,880,000
ローソン	300	7,700.00	2,310,000
エービーシー・マート	100	6,450.00	645,000
ゲオホールディングス	500	1,179.00	589,500
アダストリア	200	2,588.00	517,600
日本マクドナルドホールディングス	200	3,285.00	657,000
エディオン	1,200	1,034.00	1,240,800
ビックカメラ	700	994.00	695,800
DCMホールディングス	1,000	1,012.00	1,012,000
J. フロント リテイリング	1,800	1,581.00	2,845,800
マツモトキヨシホールディングス	300	5,540.00	1,662,000
ココカラファイン	200	4,745.00	949,000
三越伊勢丹ホールディングス	3,000	1,190.00	3,570,000
すかいらーく	600	1,605.00	963,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	700	1,009.00	706,300
セブン&アイ・ホールディングス	4,500	4,637.00	20,866,500
ツルハホールディングス	100	10,820.00	1,082,000
良品計画	100	24,900.00	2,490,000
コーナン商事	300	2,081.00	624,300
ドンキホーテホールディングス	400	3,900.00	1,560,000
ゼンショーホールディングス	300	1,802.00	540,600
スギホールディングス	100	5,210.00	521,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	300	6,560.00	1,968,000
日本瓦斯	200	3,305.00	661,000
島忠	300	2,634.00	790,200
コメリ	300	2,723.00	816,900
青山商事	400	3,825.00	1,530,000
しまむら	100	15,460.00	1,546,000

高島屋	3,000	966.00	2,898,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	900	1,767.00	1,590,300
丸井グループ	1,100	1,482.00	1,630,200
イオン	6,000	1,640.00	9,840,000
イズミ	200	4,920.00	984,000
平和堂	300	2,336.00	700,800
ケーズホールディングス	900	2,031.00	1,827,900
ヤマダ電機	6,800	552.00	3,753,600
ニトリホールディングス	100	15,100.00	1,510,000
吉野家ホールディングス	400	1,596.00	638,400
アークス	400	2,664.00	1,065,600
パローホールディングス	300	2,560.00	768,000
ファーストリテイリング	100	34,500.00	3,450,000
サンドラッグ	300	3,825.00	1,147,500
じもとホールディングス	4,200	187.00	785,400
めぶきフィナンシャルグループ	4,400	420.00	1,848,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	600	3,100.00	1,860,000
ゆうちょ銀行	5,000	1,353.00	6,765,000
富山第一銀行	1,100	525.00	577,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	15,100	499.40	7,540,940
西日本フィナンシャルホールディングス	1,200	1,070.00	1,284,000
新生銀行	6,000	194.00	1,164,000
あおぞら銀行	21,000	388.00	8,148,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	107,500	667.70	71,777,750
りそなホールディングス	90,400	557.30	50,379,920
三井住友トラスト・ホールディングス	14,300	3,713.00	53,095,900
三井住友フィナンシャルグループ	25,600	3,893.00	99,660,800
第四銀行	2,000	425.00	850,000
北越銀行	400	2,670.00	1,068,000
千葉銀行	7,000	698.00	4,886,000
群馬銀行	2,600	555.00	1,443,000
武蔵野銀行	200	3,145.00	629,000
千葉興業銀行	2,000	586.00	1,172,000
七十七銀行	8,000	463.00	3,704,000

秋田銀行	3,000	342.00	1,026,000
岩手銀行	400	4,495.00	1,798,000
東邦銀行	12,000	401.00	4,812,000
ふくおかフィナンシャルグループ	17,000	471.00	8,007,000
静岡銀行	2,000	875.00	1,750,000
十六銀行	7,000	347.00	2,429,000
スルガ銀行	900	2,313.00	2,081,700
八十二銀行	5,600	602.00	3,371,200
山梨中央銀行	3,000	475.00	1,425,000
大垣共立銀行	4,000	309.00	1,236,000
福井銀行	3,000	256.00	768,000
北國銀行	5,000	411.00	2,055,000
南都銀行	300	3,990.00	1,197,000
百五銀行	5,000	434.00	2,170,000
京都銀行	1,000	796.00	796,000
紀陽銀行	1,600	1,676.00	2,681,600
ほくほくフィナンシャルグループ	2,400	1,655.00	3,972,000
広島銀行	7,000	455.00	3,185,000
山陰合同銀行	3,400	871.00	2,961,400
中国銀行	2,300	1,544.00	3,551,200
伊予銀行	2,400	730.00	1,752,000
百十四銀行	4,000	357.00	1,428,000
四国銀行	4,000	280.00	1,120,000
阿波銀行	1,000	683.00	683,000
大分銀行	3,000	426.00	1,278,000
宮崎銀行	3,000	333.00	999,000
佐賀銀行	2,000	294.00	588,000
十八銀行	2,000	348.00	696,000
沖縄銀行	200	4,045.00	809,000
琉球銀行	900	1,476.00	1,328,400
セブン銀行	3,100	383.00	1,187,300
みずほフィナンシャルグループ	532,700	193.90	103,290,530
山口フィナンシャルグループ	3,000	1,185.00	3,555,000
名古屋銀行	200	3,910.00	782,000
北洋銀行	7,800	402.00	3,135,600
愛媛銀行	800	1,341.00	1,072,800

京葉銀行	2,000	469.00	938,000
関西アーバン銀行	400	1,341.00	536,400
栃木銀行	1,100	499.00	548,900
東和銀行	10,000	108.00	1,080,000
トモニホールディングス	2,100	555.00	1,165,500
フィデアホールディングス	7,400	202.00	1,494,800
池田泉州ホールディングス	3,600	453.00	1,630,800
SBIホールディングス	1,100	1,503.00	1,653,300
大和証券グループ本社	39,000	663.40	25,872,600
野村ホールディングス	30,700	658.90	20,228,230
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,200	565.00	678,000
SOMPOホールディングス	1,700	3,940.00	6,698,000
MS&ADインシュアランスグループホール	3,800	3,500.00	13,300,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	3,300	1,723.00	5,685,900
第一生命ホールディングス	16,000	1,857.00	29,712,000
東京海上ホールディングス	3,400	4,539.00	15,432,600
T&Dホールディングス	6,700	1,541.00	10,324,700
クレディセゾン	800	1,966.00	1,572,800
日本証券金融	2,100	573.00	1,203,300
イオンフィナンシャルサービス	500	2,138.00	1,069,000
オリックス	7,600	1,670.00	12,692,000
日本取引所グループ	800	1,571.00	1,256,800
野村不動産ホールディングス	900	1,748.00	1,573,200
東急不動産ホールディングス	1,700	605.00	1,028,500
飯田グループホールディングス	900	1,654.00	1,488,600
パーク24	300	2,900.00	870,000
三井不動産	2,600	2,362.00	6,141,200
三菱地所	3,000	2,029.50	6,088,500
東京建物	1,400	1,465.00	2,051,000
住友不動産	1,000	2,866.50	2,866,500
大京	3,000	223.00	669,000
レオパレス21	1,700	575.00	977,500
イオンモール	500	1,793.00	896,500
GCA	600	904.00	542,400

テンプホールディングス	400	2,035.00	814,000	
総合警備保障	100	4,620.00	462,000	
ディー・エヌ・エー	500	2,258.00	1,129,000	
博報堂DYホールディングス	1,400	1,315.00	1,841,000	
電通	800	6,010.00	4,808,000	
みらかホールディングス	300	5,130.00	1,539,000	
オリエンタルランド	400	6,508.00	2,603,200	
ダスキン	500	2,467.00	1,233,500	
ラウンドワン	700	940.00	658,000	
ユー・エス・エス	700	1,870.00	1,309,000	
サイバーエージェント	200	3,285.00	657,000	
楽天	700	1,180.50	826,350	
リクルートホールディングス	900	5,680.00	5,112,000	
日本郵政	1,600	1,357.00	2,171,200	
ベルシステム24ホールディングス	800	958.00	766,400	
エイチ・アイ・エス	200	2,654.00	530,800	
セコム	700	7,967.00	5,576,900	
メイテック	200	4,530.00	906,000	
アサツー ディ・ケイ	400	2,899.00	1,159,600	
ベネッセホールディングス	500	3,425.00	1,712,500	
小計	銘柄数：578		2,516,994,470	
	組入時価比率：97.5%		100.0%	
合計			2,516,994,470	

(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 4 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。