

2018年4月期（2017年10月8日～2018年4月7日）決算短信

2018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	増田 真一	TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日	2018年6月27日
分配金支払開始日	2018年5月16日

ファンドの運用状況

1. 2018年4月期の運用状況（2017年10月8日～2018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	%
2018年4月期	2,836	(97.8)	62	(2.2)	2,899	(100)
2017年10月期	2,840	(98.4)	46	(1.6)	2,887	(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()	設定口数()	交換口数()	当計算期間末 発行済口数 (+ -)
	千口	千口	千口	千口
2018年4月期	154	0	0	154
2017年10月期	154	0	0	154

(3)基準価額

	総資産 ()	負債 ()	純資産 ((-))	1口当り基準価額 ((/ 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	2,939	39	2,899	18,823
2017年10月期	2,923	35	2,887	18,747

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
2018年4月期	208.00
2017年10月期	175.00

2. 会計方針の変更

会計基準等の改正に伴う変更
以外の変更

有(無)
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8期 (2017年10月7日現在)	第9期 (2018年4月7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	49,696,847	32,151,723
株式	2,840,656,650	2,836,973,590
派生商品評価勘定	3,150,684	1,022,720
未収入金	1,730,010	33,508,210
未収配当金	28,028,818	34,588,135
差入委託証拠金	-	951,000
流動資産合計	2,923,263,009	2,939,195,378
資産合計	2,923,263,009	2,939,195,378
負債の部		
流動負債		
前受金	2,847,600	-
未払収益分配金	26,954,900	32,037,824
未払受託者報酬	741,078	816,187
未払委託者報酬	3,705,325	4,080,886
未払利息	104	106
その他未払費用	1,473,952	2,950,216
流動負債合計	35,722,959	39,885,219
負債合計	35,722,959	39,885,219
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(△)	834,500,838	846,270,947
(分配準備積立金)	53,482	101,895
元本等合計	2,887,540,050	2,899,310,159
純資産合計	2,887,540,050	2,899,310,159
負債純資産合計	2,923,263,009	2,939,195,378

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2017年4月8日 至 2017年10月7日	第9期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7日
営業収益		
受取配当金	32,885,615	38,600,800
有価証券売買等損益	297,713,955	8,674,244
派生商品取引等損益	8,706,726	3,047,452
その他収益	25,467	23,418
営業収益合計	339,331,763	50,345,914
営業費用		

支払利息	15,248	8,988
受託者報酬	741,078	816,187
委託者報酬	3,705,325	4,080,886
その他費用	1,463,944	1,631,920
営業費用合計	5,925,595	6,537,981
営業利益又は営業損失(△)	333,406,168	43,807,933
経常利益又は経常損失(△)	333,406,168	43,807,933
当期純利益又は当期純損失(△)	333,406,168	43,807,933
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(△)	528,049,570	834,500,838
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	26,954,900	32,037,824
期末剰余金又は期末欠損金(△)	834,500,838	846,270,947

(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8日から2018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8期 2017年10月7日現在	第9期 2018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 18,747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 18,823円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自2017年4月8日 至2017年10月7日	第9期 自2017年10月8日 至2018年4月7日																		
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																		
<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>32,895,834円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>22,895円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	32,895,834円	分配準備積立金	B	22,895円	<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>38,615,230円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>53,482円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	38,615,230円	分配準備積立金	B	53,482円
項目																			
当期配当等収益額	A	32,895,834円																	
分配準備積立金	B	22,895円																	
項目																			
当期配当等収益額	A	38,615,230円																	
分配準備積立金	B	53,482円																	

配当等収益合計額	C=A+B	32,918,729円
経費	D	5,910,347円
収益分配可能額	E=C-D	27,008,382円
収益分配金	F	26,954,900円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	53,482円
口数	H	154,028口
1口当たり分配金	I=F/H	175円

2. その他費用

その他費用のうち1,323,323円は、対象指数についての商標使用料であります。

配当等収益合計額	C=A+B	38,668,712円
経費	D	6,528,993円
収益分配可能額	E=C-D	32,139,719円
収益分配金	F	32,037,824円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	101,895円
口数	H	154,028口
1口当たり分配金	I=F/H	208円

2. その他費用

その他費用のうち1,469,085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8期 自 2017年4月8日 至 2017年10月7日	第9期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7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。</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8期 2017年10月7日現在	第9期 2018年4月7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。</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>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>

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。	
--	--

(関連当事者との取引に関する注記)

第8期 自 2017年4月8日 至 2017年10月7日	第9期 自 2017年10月8日 至 2018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8期 自 2017年4月8日 至 2017年10月7日	第9期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7日
期首元本額 2,053,039,212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 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8期 自 2017年4月8日 至 2017年10月7日	第9期 自 2017年10月8日 至 2018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	296,623,443	△5,520,290
合計	296,623,443	△5,520,290

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8期(2017年10月7日現在)				第9期(2018年4月7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	42,408,900	—	45,562,500	3,150,684	59,348,500	—	60,375,000	1,022,720
合計	42,408,900	—	45,562,500	3,150,684	59,348,500	—	60,375,000	1,022,720

(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	1,900	567.00	1,077,300
		マルハニチロ	200	3,570.00	714,000
		国際石油開発帝石	6,800	1,326.50	9,020,200
		石油資源開発	500	2,448.00	1,224,000
		ミライト・ホールディングス	600	1,692.00	1,015,200
		安藤・間	800	815.00	652,000
		コムシスホールディングス	600	2,792.00	1,675,200
		大成建設	900	5,470.00	4,923,000
		大林組	3,400	1,148.00	3,903,200
		清水建設	2,500	965.00	2,412,500
		長谷工コーポレーション	2,000	1,624.00	3,248,000
		鹿島建設	3,000	989.00	2,967,000
		西松建設	300	2,728.00	818,400
		前田建設工業	500	1,289.00	644,500
		奥村組	200	4,240.00	848,000
		戸田建設	1,000	787.00	787,000
		熊谷組	200	3,390.00	678,000
		大東建託	400	19,325.00	7,730,000
		N I P P O	400	2,404.00	961,600
		前田道路	400	2,152.00	860,800
		五洋建設	1,300	776.00	1,008,800
		住友林業	1,200	1,705.00	2,046,000
		大和ハウス工業	2,600	4,057.00	10,548,200
		積水ハウス	4,300	1,942.00	8,350,600
		関電工	600	1,217.00	730,200
		きんでん	1,000	1,756.00	1,756,000
		協和エクシオ	500	2,728.00	1,364,000
		九電工	200	5,360.00	1,072,000
		日揮	1,500	2,334.00	3,501,000
		千代田化工建設	1,400	982.00	1,374,800
日本製粉	500	1,700.00	850,000		
日清製粉グループ本社	1,000	2,181.00	2,181,000		
江崎グリコ	200	5,720.00	1,144,000		
山崎製パン	800	2,276.00	1,820,800		
カルビー	200	3,680.00	736,000		

森永乳業	300	4,660.00	1,398,000
ヤクルト本社	200	8,130.00	1,626,000
明治ホールディングス	500	8,370.00	4,185,000
雪印メグミルク	300	3,130.00	939,000
日本ハム	600	4,535.00	2,721,000
丸大食品	1,000	518.00	518,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,200	966.00	1,159,200
サッポロホールディングス	300	3,190.00	957,000
アサヒグループホールディングス	1,500	5,755.00	8,632,500
キリンホールディングス	3,800	3,025.00	11,495,000
宝ホールディングス	700	1,221.00	854,700
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	400	4,460.00	1,784,000
サントリー食品インターナショナル	600	5,430.00	3,258,000
伊藤園	300	4,330.00	1,299,000
日清オイリオグループ	200	3,145.00	629,000
不二製油グループ本社	300	3,415.00	1,024,500
キッコーマン	500	4,395.00	2,197,500
味の素	3,100	1,921.50	5,956,650
キューピー	600	2,572.00	1,543,200
ハウス食品グループ本社	300	3,675.00	1,102,500
カゴメ	300	3,890.00	1,167,000
ニチレイ	600	3,160.00	1,896,000
東洋水産	500	4,260.00	2,130,000
日清食品ホールディングス	300	7,550.00	2,265,000
日本たばこ産業	5,700	3,014.00	17,179,800
東洋紡	600	2,099.00	1,259,400
帝人	1,400	1,971.00	2,759,400
東レ	7,600	974.60	7,406,960
ワコールホールディングス	300	3,135.00	940,500
T S I ホールディングス	800	811.00	648,800
オンワードホールディングス	900	966.00	869,400
王子ホールディングス	7,000	687.00	4,809,000
日本製紙	1,100	1,975.00	2,172,500
北越紀州製紙	1,100	658.00	723,800
大王製紙	600	1,481.00	888,600

レンゴー	1,900	917.00	1,742,300
クラレ	1,900	1,763.00	3,349,700
旭化成	6,500	1,402.50	9,116,250
昭和電工	800	3,765.00	3,012,000
住友化学	12,000	603.00	7,236,000
日産化学工業	400	4,610.00	1,844,000
日本曹達	1,000	595.00	595,000
東ソー	1,300	1,878.00	2,441,400
トクヤマ	300	3,275.00	982,500
セントラル硝子	400	2,522.00	1,008,800
東亜合成	700	1,249.00	874,300
デンカ	600	3,720.00	2,232,000
信越化学工業	1,300	10,550.00	13,715,000
エア・ウォーター	900	2,038.00	1,834,200
大陽日酸	700	1,592.00	1,114,400
日本触媒	200	7,060.00	1,412,000
カネカ	2,000	1,052.00	2,104,000
三菱瓦斯化学	1,000	2,474.00	2,474,000
三井化学	1,200	3,260.00	3,912,000
J S R	1,500	2,334.00	3,501,000
東京応化工業	200	3,755.00	751,000
三菱ケミカルホールディングス	11,500	994.70	11,439,050
ダイセル	2,100	1,161.00	2,438,100
住友ベークライト	1,000	967.00	967,000
積水化学工業	2,400	1,896.00	4,550,400
日本ゼオン	800	1,490.00	1,192,000
アイカ工業	200	3,980.00	796,000
宇部興産	900	3,075.00	2,767,500
日立化成	600	2,488.00	1,492,800
日本化薬	700	1,317.00	921,900
A D E K A	500	1,888.00	944,000
日油	300	3,140.00	942,000
花王	1,800	8,315.00	14,967,000
日本ペイントホールディングス	400	4,030.00	1,612,000
関西ペイント	600	2,445.00	1,467,000
D I C	600	3,590.00	2,154,000

東洋インキSCホールディングス	1,000	650.00	650,000
富士フイルムホールディングス	3,200	4,248.00	13,593,600
資生堂	900	7,229.00	6,506,100
ライオン	600	2,324.00	1,394,400
コーセー	100	23,580.00	2,358,000
ポーラ・オルビスホールディングス	200	4,845.00	969,000
小林製薬	100	8,690.00	869,000
日東電工	700	8,071.00	5,649,700
ニフコ	300	3,640.00	1,092,000
ユニ・チャーム	1,200	3,107.00	3,728,400
協和発酵キリン	800	2,444.00	1,955,200
武田薬品工業	3,100	5,000.00	15,500,000
アステラス製薬	12,900	1,610.00	20,769,000
大日本住友製薬	600	1,933.00	1,159,800
塩野義製薬	700	5,596.00	3,917,200
田辺三菱製薬	800	2,105.00	1,684,000
中外製薬	400	5,620.00	2,248,000
科研製薬	200	6,470.00	1,294,000
エーザイ	1,000	6,966.00	6,966,000
ロート製薬	300	3,160.00	948,000
小野薬品工業	800	3,307.00	2,645,600
久光製薬	200	8,510.00	1,702,000
参天製薬	1,100	1,753.00	1,928,300
ツムラ	200	3,780.00	756,000
沢井製薬	100	4,790.00	479,000
第一三共	3,700	3,732.00	13,808,400
キョーリン製薬ホールディングス	300	2,128.00	638,400
大塚ホールディングス	2,100	5,456.00	11,457,600
大正製薬ホールディングス	100	10,160.00	1,016,000
昭和シェル石油	2,300	1,431.00	3,291,300
出光興産	1,200	3,820.00	4,584,000
JXTGホールディングス	43,300	656.70	28,435,110
コスモエネルギーホールディングス	500	3,390.00	1,695,000
横浜ゴム	900	2,507.00	2,256,300
東洋ゴム工業	500	1,859.00	929,500
ブリヂストン	3,800	4,704.00	17,875,200

住友ゴム工業	1,500	1,996.00	2,994,000
旭硝子	1,700	4,305.00	7,318,500
日本板硝子	1,100	856.00	941,600
日本電気硝子	500	3,055.00	1,527,500
住友大阪セメント	3,000	478.00	1,434,000
太平洋セメント	900	3,910.00	3,519,000
東海カーボン	600	1,351.00	810,600
TOTO	600	5,920.00	3,552,000
日本碍子	1,100	1,835.00	2,018,500
日本特殊陶業	900	2,542.00	2,287,800
ニチアス	1,000	1,359.00	1,359,000
新日鐵住金	8,500	2,300.00	19,550,000
神戸製鋼所	6,700	1,054.00	7,061,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	5,300	2,130.00	11,289,000
日新製鋼	600	1,228.00	736,800
大和工業	300	3,000.00	900,000
丸一鋼管	300	3,260.00	978,000
大同特殊鋼	200	5,400.00	1,080,000
山陽特殊製鋼	200	2,696.00	539,200
日立金属	1,400	1,256.00	1,758,400
日本軽金属ホールディングス	3,800	276.00	1,048,800
三井金属鉱業	300	4,485.00	1,345,500
三菱マテリアル	1,200	3,150.00	3,780,000
住友金属鉱山	1,400	4,316.00	6,042,400
DOWAホールディングス	400	3,805.00	1,522,000
UACJ	200	2,728.00	545,600
古河電気工業	300	5,090.00	1,527,000
住友電気工業	6,800	1,624.00	11,043,200
フジクラ	2,400	705.00	1,692,000
SUMCO	800	2,585.00	2,068,000
東洋製罐グループホールディングス	1,400	1,580.00	2,212,000
三和ホールディングス	1,000	1,386.00	1,386,000
三協立山	400	1,617.00	646,800
LIXILグループ	1,700	2,405.00	4,088,500
リンナイ	200	10,390.00	2,078,000

日本発條	1,600	1,136.00	1,817,600
日本製鋼所	300	3,225.00	967,500
オークマ	100	5,790.00	579,000
アマダホールディングス	1,800	1,259.00	2,266,200
牧野フライス製作所	1,000	929.00	929,000
オーエスジー	300	2,357.00	707,100
DMG森精機	1,000	1,907.00	1,907,000
ナブテスコ	400	3,875.00	1,550,000
SMC	100	41,030.00	4,103,000
小松製作所	4,400	3,472.00	15,276,800
住友重機械工業	600	3,980.00	2,388,000
日立建機	700	3,935.00	2,754,500
クボタ	4,100	1,813.50	7,435,350
荏原製作所	500	3,715.00	1,857,500
ダイキン工業	700	11,830.00	8,281,000
栗田工業	600	3,465.00	2,079,000
椿本チエイン	1,000	878.00	878,000
ダイフク	200	5,820.00	1,164,000
タダノ	500	1,586.00	793,000
フジテック	500	1,391.00	695,500
平和	400	2,072.00	828,800
SANKYO	400	3,755.00	1,502,000
アマノ	200	2,883.00	576,600
グローリー	300	3,845.00	1,153,500
セガサミーホールディングス	1,300	1,660.00	2,158,000
ホンザキ	100	9,620.00	962,000
日本精工	2,400	1,365.00	3,276,000
NTN	3,300	439.00	1,448,700
ジェイテクト	2,000	1,564.00	3,128,000
THK	400	3,875.00	1,550,000
マキタ	700	5,190.00	3,633,000
日立造船	1,400	538.00	753,200
三菱重工業	2,700	3,975.00	10,732,500
IHI	800	3,370.00	2,696,000
日清紡ホールディングス	1,300	1,414.00	1,838,200
イビデン	1,200	1,590.00	1,908,000

コニカミノルタ	5,500	898.00	4,939,000
ブラザー工業	1,200	2,388.00	2,865,600
ミネベアミツミ	1,200	2,167.00	2,600,400
日立製作所	38,000	765.10	29,073,800
東芝	17,000	292.00	4,964,000
三菱電機	10,000	1,673.00	16,730,000
富士電機	3,000	716.00	2,148,000
安川電機	400	4,650.00	1,860,000
マブチモーター	200	5,280.00	1,056,000
日本電産	400	16,060.00	6,424,000
JVCケンウッド	2,000	353.00	706,000
オムロン	900	5,970.00	5,373,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	2,000	571.00	1,142,000
日本電気	2,600	2,900.00	7,540,000
富士通	13,000	655.00	8,515,000
沖電気工業	900	1,403.00	1,262,700
セイコーエプソン	1,500	1,888.00	2,832,000
アルバック	100	5,870.00	587,000
ジャパンディスプレイ	8,300	159.00	1,319,700
パナソニック	13,900	1,528.00	21,239,200
シャープ	200	3,170.00	634,000
アンリツ	800	1,267.00	1,013,600
富士通ゼネラル	300	1,907.00	572,100
ソニー	5,900	5,205.00	30,709,500
TDK	1,000	9,280.00	9,280,000
アルプス電気	900	2,535.00	2,281,500
パイオニア	4,800	172.00	825,600
フォスター電機	300	2,618.00	785,400
ホンデン	300	1,277.00	383,100
ヒロセ電機	105	14,670.00	1,540,350
マクセルホールディングス	300	2,167.00	650,100
アルパイン	400	2,023.00	809,200
横河電機	900	2,115.00	1,903,500
アズビル	300	4,815.00	1,444,500
日本光電工業	300	3,005.00	901,500

堀場製作所	100	8,050.00	805,000
アドバンテスト	300	2,183.00	654,900
キーエンス	100	61,400.00	6,140,000
シスメックス	200	9,800.00	1,960,000
スタンレー電気	600	4,045.00	2,427,000
ウシオ電機	600	1,440.00	864,000
カシオ計算機	1,300	1,601.00	2,081,300
ファナック	500	25,810.00	12,905,000
ローム	300	9,690.00	2,907,000
浜松ホトニクス	300	3,980.00	1,194,000
新光電気工業	800	780.00	624,000
京セラ	1,300	5,931.00	7,710,300
太陽誘電	700	1,835.00	1,284,500
村田製作所	600	14,060.00	8,436,000
小糸製作所	300	7,350.00	2,205,000
ミツバ	400	1,384.00	553,600
SCREENホールディングス	100	9,190.00	919,000
キヤノン	7,700	3,826.00	29,460,200
リコー	6,500	1,063.00	6,909,500
東京エレクトロン	400	19,600.00	7,840,000
トヨタ紡織	500	2,345.00	1,172,500
ユニプレス	400	2,494.00	997,600
豊田自動織機	800	6,370.00	5,096,000
デンソー	3,200	5,772.00	18,470,400
東海理化電機製作所	500	2,205.00	1,102,500
三井E&Sホールディングス	900	1,672.00	1,504,800
川崎重工業	1,100	3,300.00	3,630,000
日産自動車	26,100	1,115.50	29,114,550
いすゞ自動車	4,600	1,622.50	7,463,500
トヨタ自動車	16,900	6,728.00	113,703,200
日野自動車	2,200	1,343.00	2,954,600
三菱自動車工業	7,600	791.00	6,011,600
日産車体	1,000	1,158.00	1,158,000
新明和工業	800	960.00	768,000
日信工業	400	1,880.00	752,000
タチエス	400	1,896.00	758,400

NOK	700	2,092.00	1,464,400
フタバ産業	500	874.00	437,000
KYB	100	5,020.00	502,000
プレス工業	1,100	615.00	676,500
ケーヒン	600	2,262.00	1,357,200
アイシン精機	1,500	5,820.00	8,730,000
マツダ	6,000	1,420.00	8,520,000
本田技研工業	16,500	3,681.00	60,736,500
スズキ	2,100	5,857.00	12,299,700
SUBARU	3,900	3,590.00	14,001,000
ヤマハ発動機	1,300	3,245.00	4,218,500
ショーワ	600	1,771.00	1,062,600
エクセディ	200	3,360.00	672,000
豊田合成	700	2,459.00	1,721,300
日本精機	300	1,922.00	576,600
エフ・シー・シー	300	3,025.00	907,500
シマノ	200	15,340.00	3,068,000
テイ・エス テック	400	4,255.00	1,702,000
テルモ	800	5,800.00	4,640,000
島津製作所	600	3,025.00	1,815,000
ニコン	2,200	1,865.00	4,103,000
オリンパス	600	4,030.00	2,418,000
HOYA	1,600	5,349.00	8,558,400
シチズン時計	1,900	773.00	1,468,700
ニプロ	800	1,522.00	1,217,600
バンダイナムコホールディングス	900	3,535.00	3,181,500
凸版印刷	5,000	862.00	4,310,000
大日本印刷	2,600	2,259.00	5,873,400
アシックス	900	2,067.00	1,860,300
ヤマハ	500	4,815.00	2,407,500
ビジョン	200	5,100.00	1,020,000
リンテック	300	3,075.00	922,500
任天堂	100	45,130.00	4,513,000
コクヨ	400	2,183.00	873,200
東京電力ホールディングス	41,900	412.00	17,262,800
中部電力	8,300	1,531.50	12,711,450

関西電力	5,700	1,460.00	8,322,000
中国電力	3,500	1,302.00	4,557,000
北陸電力	2,600	947.00	2,462,200
東北電力	4,700	1,425.00	6,697,500
四国電力	1,300	1,317.00	1,712,100
九州電力	2,200	1,263.00	2,778,600
北海道電力	1,600	700.00	1,120,000
沖縄電力	300	3,100.00	930,000
電源開発	1,300	2,725.00	3,542,500
東京瓦斯	4,200	2,816.50	11,829,300
大阪瓦斯	3,500	2,144.50	7,505,750
東邦瓦斯	700	3,260.00	2,282,000
静岡ガス	700	934.00	653,800
東武鉄道	900	3,290.00	2,961,000
相鉄ホールディングス	400	2,882.00	1,152,800
東京急行電鉄	2,600	1,735.00	4,511,000
京浜急行電鉄	500	1,925.00	962,500
小田急電鉄	1,000	2,216.00	2,216,000
京王電鉄	400	4,690.00	1,876,000
京成電鉄	400	3,435.00	1,374,000
東日本旅客鉄道	1,700	9,915.00	16,855,500
西日本旅客鉄道	1,000	7,582.00	7,582,000
東海旅客鉄道	600	20,805.00	12,483,000
西武ホールディングス	700	1,838.00	1,286,600
西日本鉄道	300	2,888.00	866,400
近鉄グループホールディングス	800	4,245.00	3,396,000
阪急阪神ホールディングス	1,000	4,045.00	4,045,000
南海電気鉄道	400	2,783.00	1,113,200
京阪ホールディングス	400	3,380.00	1,352,000
名古屋鉄道	1,000	2,764.00	2,764,000
日本通運	700	7,410.00	5,187,000
ヤマトホールディングス	2,500	2,778.50	6,946,250
山九	300	5,260.00	1,578,000
ニッコンホールディングス	300	2,895.00	868,500
セイノーホールディングス	1,100	1,894.00	2,083,400
日立物流	400	2,977.00	1,190,800

九州旅客鉄道	600	3,445.00	2,067,000
日本郵船	2,600	2,068.00	5,376,800
商船三井	1,100	2,966.00	3,262,600
川崎汽船	900	2,382.00	2,143,800
日本航空	3,200	4,312.00	13,798,400
ANAホールディングス	1,900	4,173.00	7,928,700
三菱倉庫	300	2,289.00	686,700
上組	600	2,343.00	1,405,800
T I S	400	4,215.00	1,686,000
ネクソン	800	1,661.00	1,328,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,600	371.00	2,077,600
野村総合研究所	500	5,200.00	2,600,000
フジ・メディア・ホールディングス	1,500	1,803.00	2,704,500
ヤフー	3,400	481.00	1,635,400
トレンドマイクロ	300	6,290.00	1,887,000
日本オラクル	100	9,070.00	907,000
伊藤忠テクノソリューションズ	400	2,211.00	884,400
大塚商会	400	5,050.00	2,020,000
ネットワンシステムズ	700	1,549.00	1,084,300
エイベックス	400	1,477.00	590,800
日本ユニシス	500	2,264.00	1,132,000
東京放送ホールディングス	500	2,288.00	1,144,000
日本テレビホールディングス	900	1,846.00	1,661,400
テレビ朝日ホールディングス	300	2,434.00	730,200
スカパーJ S A Tホールディングス	1,200	485.00	582,000
日本電信電話	15,700	5,129.00	80,525,300
KDD I	10,800	2,770.00	29,916,000
光通信	100	17,630.00	1,763,000
NTTドコモ	9,500	2,806.00	26,657,000
カドカワ	500	1,118.00	559,000
東宝	300	3,620.00	1,086,000
エヌ・ティ・ティ・データ	3,400	1,117.00	3,797,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	4,660.00	932,000
S C S K	200	4,685.00	937,000
コナミホールディングス	300	5,540.00	1,662,000

ソフトバンクグループ	3,900	7,636.00	29,780,400
あらた	200	6,340.00	1,268,000
双日	18,000	335.00	6,030,000
アルフレッサ ホールディングス	2,000	2,352.00	4,704,000
ダイワボウホールディングス	200	4,590.00	918,000
マクニカ・富士エレホールディングス	300	1,880.00	564,000
シップヘルスケアホールディングス	200	3,920.00	784,000
三菱食品	200	3,205.00	641,000
第一興商	200	5,710.00	1,142,000
メディopalホールディングス	2,000	2,180.00	4,360,000
伊藤忠商事	14,400	2,062.00	29,692,800
丸紅	29,400	764.80	22,485,120
長瀬産業	1,200	1,813.00	2,175,600
豊田通商	2,400	3,610.00	8,664,000
兼松	1,000	1,537.00	1,537,000
三井物産	20,300	1,794.00	36,418,200
日立ハイテクノロジーズ	400	4,775.00	1,910,000
カメイ	500	1,477.00	738,500
住友商事	13,100	1,794.50	23,507,950
三菱商事	12,800	2,844.00	36,403,200
キヤノンマーケティングジャパン	400	2,872.00	1,148,800
阪和興業	600	4,315.00	2,589,000
岩谷産業	400	3,965.00	1,586,000
三愛石油	900	1,662.00	1,495,800
稲畑産業	700	1,629.00	1,140,300
東邦ホールディングス	700	2,538.00	1,776,600
サンゲツ	400	2,270.00	908,000
伊藤忠エネクス	900	1,056.00	950,400
リョーサン	300	3,840.00	1,152,000
PAL TAC	300	5,660.00	1,698,000
日鉄住金物産	200	5,870.00	1,174,000
オートバックスセブン	700	2,084.00	1,458,800
加藤産業	300	3,810.00	1,143,000
因幡電機産業	200	4,700.00	940,000
ミスミグループ本社	300	2,889.00	866,700

スズケン	900	4,380.00	3,942,000
ローソン	300	7,440.00	2,232,000
エービーシー・マート	100	7,230.00	723,000
ゲオホールディングス	500	1,773.00	886,500
アダストリア	300	2,130.00	639,000
エディオン	1,200	1,273.00	1,527,600
ビックカメラ	600	1,769.00	1,061,400
DCMホールディングス	1,100	1,105.00	1,215,500
J. フロント リテイリング	2,000	1,853.00	3,706,000
マツモトキヨシホールディングス	400	4,660.00	1,864,000
ココカラファイン	100	7,500.00	750,000
三越伊勢丹ホールディングス	3,000	1,187.00	3,561,000
ウエルシアホールディングス	200	5,010.00	1,002,000
すかいらーく	800	1,565.00	1,252,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	900	1,152.00	1,036,800
セブン&アイ・ホールディングス	5,400	4,780.00	25,812,000
ツルハホールディングス	100	15,210.00	1,521,000
スシローグローバルホールディングス	200	5,600.00	1,120,000
コーナン商事	300	2,621.00	786,300
ドンキホーテホールディングス	500	6,070.00	3,035,000
ゼンショーホールディングス	400	2,604.00	1,041,600
スギホールディングス	200	5,920.00	1,184,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	300	9,440.00	2,832,000
日本瓦斯	200	5,400.00	1,080,000
島忠	400	3,420.00	1,368,000
コメリ	200	2,863.00	572,600
青山商事	400	4,225.00	1,690,000
しまむら	200	14,080.00	2,816,000
高島屋	3,000	1,031.00	3,093,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	900	2,089.00	1,880,100
丸井グループ	1,300	2,283.00	2,967,900
イオン	6,400	1,988.50	12,726,400
イズミ	200	7,820.00	1,564,000
平和堂	300	2,623.00	786,900

ケーズホールディングス	1,700	1,547.00	2,629,900
ヤマダ電機	7,200	650.00	4,680,000
ニトリホールディングス	100	19,205.00	1,920,500
吉野家ホールディングス	400	2,224.00	889,600
アークス	500	2,732.00	1,366,000
パローホールディングス	400	3,015.00	1,206,000
ファーストリテイリング	100	46,270.00	4,627,000
サンドラッグ	300	5,210.00	1,563,000
めぶきフィナンシャルグループ	8,000	404.00	3,232,000
東京T Yフィナンシャルグループ	500	2,662.00	1,331,000
九州フィナンシャルグループ	2,800	522.00	1,461,600
ゆうちょ銀行	5,000	1,421.00	7,105,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	31,200	587.00	18,314,400
西日本フィナンシャルホールディングス	800	1,243.00	994,400
新生銀行	1,300	1,617.00	2,102,100
あおぞら銀行	1,900	4,225.00	8,027,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	95,600	692.80	66,231,680
りそなホールディングス	65,600	557.00	36,539,200
三井住友トラスト・ホールディングス	20,200	4,303.00	86,920,600
三井住友フィナンシャルグループ	25,100	4,432.00	111,243,200
第四銀行	300	4,845.00	1,453,500
北越銀行	400	2,388.00	955,200
千葉銀行	7,100	840.00	5,964,000
群馬銀行	2,700	595.00	1,606,500
武蔵野銀行	200	3,460.00	692,000
千葉興業銀行	2,100	482.00	1,012,200
七十七銀行	400	2,506.00	1,002,400
青森銀行	300	3,295.00	988,500
秋田銀行	200	2,860.00	572,000
岩手銀行	300	4,340.00	1,302,000
東邦銀行	10,700	413.00	4,419,100
ふくおかフィナンシャルグループ	24,000	558.00	13,392,000
静岡銀行	1,400	1,018.00	1,425,200
十六銀行	300	2,797.00	839,100

スルガ銀行	1,000	1,492.00	1,492,000
八十二銀行	5,100	553.00	2,820,300
山梨中央銀行	1,000	449.00	449,000
大垣共立銀行	600	2,721.00	1,632,600
福井銀行	400	2,356.00	942,400
北國銀行	500	4,280.00	2,140,000
滋賀銀行	2,000	543.00	1,086,000
南都銀行	600	2,910.00	1,746,000
百五銀行	3,600	502.00	1,807,200
京都銀行	200	5,910.00	1,182,000
紀陽銀行	2,100	1,701.00	3,572,100
ほくほくフィナンシャルグループ	3,300	1,479.00	4,880,700
広島銀行	5,000	805.00	4,025,000
山陰合同銀行	3,000	946.00	2,838,000
中国銀行	1,700	1,266.00	2,152,200
伊予銀行	1,900	809.00	1,537,100
百十四銀行	4,000	361.00	1,444,000
四国銀行	600	1,517.00	910,200
大分銀行	300	3,935.00	1,180,500
宮崎銀行	400	3,450.00	1,380,000
十八銀行	3,000	271.00	813,000
琉球銀行	400	1,631.00	652,400
セブン銀行	3,300	359.00	1,184,700
みずほフィナンシャルグループ	556,700	190.60	106,107,020
山口フィナンシャルグループ	1,000	1,285.00	1,285,000
北洋銀行	11,800	352.00	4,153,600
愛媛銀行	900	1,288.00	1,159,200
京葉銀行	1,000	481.00	481,000
東和銀行	1,200	1,407.00	1,688,400
トモニホールディングス	2,000	469.00	938,000
フィデアホールディングス	5,200	194.00	1,008,800
池田泉州ホールディングス	4,600	406.00	1,867,600
SBIホールディングス	1,300	2,579.00	3,352,700
大和証券グループ本社	30,000	666.50	19,995,000
野村ホールディングス	32,700	616.30	20,153,010
岡三証券グループ	1,000	642.00	642,000

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,300	740.00	962,000
SOMPOホールディングス	2,100	4,346.00	9,126,600
MS&ADインシュアランスグループホール	5,100	3,422.00	17,452,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	3,100	1,953.00	6,054,300
第一生命ホールディングス	14,700	1,947.50	28,628,250
東京海上ホールディングス	4,700	4,815.00	22,630,500
T&Dホールディングス	6,400	1,654.50	10,588,800
クレディセゾン	600	1,733.00	1,039,800
日本証券金融	7,000	658.00	4,606,000
イオンフィナンシャルサービス	500	2,405.00	1,202,500
オリックス	8,200	1,852.00	15,186,400
日本取引所グループ	1,100	1,974.00	2,171,400
ヒューリック	600	1,158.00	694,800
野村不動産ホールディングス	600	2,521.00	1,512,600
東急不動産ホールディングス	2,000	763.00	1,526,000
飯田グループホールディングス	1,000	2,017.00	2,017,000
パーク24	400	2,956.00	1,182,400
三井不動産	2,800	2,671.00	7,478,800
三菱地所	3,300	1,797.50	5,931,750
東京建物	1,300	1,611.00	2,094,300
住友不動産	1,000	3,918.00	3,918,000
レオパレス21	2,000	909.00	1,818,000
イオンモール	500	2,234.00	1,117,000
ミクシィ	200	3,730.00	746,000
パーソルホールディングス	500	3,135.00	1,567,500
総合警備保障	200	5,230.00	1,046,000
カカクコム	400	1,967.00	786,800
ディー・エヌ・エー	600	2,013.00	1,207,800
博報堂DYホールディングス	1,400	1,473.00	2,062,200
電通	1,000	4,730.00	4,730,000
みらかホールディングス	300	4,325.00	1,297,500
オリエンタルランド	300	10,920.00	3,276,000
ダスキン	400	2,801.00	1,120,400
リゾートトラスト	300	2,124.00	637,200

	ユー・エス・エス	600	2,227.00	1,336,200	
	サイバーエージェント	300	5,450.00	1,635,000	
	楽天	900	853.10	767,790	
	リクルートホールディングス	2,200	2,656.50	5,844,300	
	日本郵政	4,200	1,290.00	5,418,000	
	ベルシステム24ホールディングス	700	1,504.00	1,052,800	
	エイチ・アイ・エス	200	3,750.00	750,000	
	セコム	800	8,038.00	6,430,400	
	メイテック	100	6,240.00	624,000	
	ベネッセホールディングス	400	3,890.00	1,556,000	
	小計 銘柄数：574			2,836,973,590	
	組入時価比率：97.8%			100.0%	
	合計			2,836,973,590	

(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。