

平成29年4月期（平成28年10月21日～平成29年4月20日）決算短信

平成29年5月31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 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成29年7月13日  
 分配金支払開始日 平成29年5月29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21日～平成29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	%
平成29年4月期	7,086	(97.6)	171	(2.4)	7,257	(100)
平成28年10月期	9,216	(98.3)	159	(1.7)	9,376	(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	717	0	194	522
平成28年10月期	-	717	0	717

(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	7,354	96	7,257	13,878
平成28年10月期	9,458	82	9,376	13,060

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成29年4月期	142.00
平成28年10月期	102.00

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 1 期 (平成 28 年 10 月 20 日現在)	第 2 期 (平成 29 年 4 月 20 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	89,223,031	179,234,328
株式	9,216,546,520	7,086,809,680
派生商品評価勘定	4,165,580	-
未収入金	74,845,330	-
未収配当金	70,233,044	67,963,443
差入委託証拠金	3,412,000	20,430,652
流動資産合計	9,458,425,505	7,354,438,103
資産合計	9,458,425,505	7,354,438,103
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	7,404,964
未払金	-	3,489,050
未払収益分配金	73,228,146	74,264,154
未払受託者報酬	1,539,490	2,331,881
未払委託者報酬	5,542,127	8,394,695
未払利息	107	256
その他未払費用	2,099,174	557,493
流動負債合計	82,409,044	96,442,493
負債合計	82,409,044	96,442,493
純資産の部		
元本等		
元本	9,226,028,473	6,720,905,937
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	149,987,988	537,089,673
(分配準備積立金)	87,730	292,909
元本等合計	9,376,016,461	7,257,995,610
純資産合計	9,376,016,461	7,257,995,610
負債純資産合計	9,458,425,505	7,354,438,103

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 1 期 自 平成 28 年 5 月 18 日 至 平成 28 年 10 月 20 日	第 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 年 4 月 20 日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	83,482,469	88,736,821
有価証券売買等損益	334,039,132	655,119,910

派生商品取引等損益	4,575,852	11,207,100
その他収益	14	116,232
営業収益合計	422,097,467	755,180,063
営業費用		
支払利息	3,697	37,312
受託者報酬	1,539,490	2,331,881
委託者報酬	5,542,127	8,394,695
その他費用	3,081,293	3,619,832
営業費用合計	10,166,607	14,383,720
営業利益又は営業損失(△)	411,930,860	740,796,343
経常利益又は経常損失(△)	411,930,860	740,796,343
当期純利益又は当期純損失(△)	411,930,860	740,796,343
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(△)	-	149,987,988
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	188,714,726	279,430,504
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	279,430,504
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	188,714,726	-
分配金	73,228,146	74,264,154
期末剰余金又は期末欠損金(△)	149,987,988	537,089,673

## (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、平成 28 年 10 月 21 日から平成 29 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 1 期 平成 28 年 10 月 20 日現在	第 2 期 平成 29 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 717,923 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	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

13,060円

1口当たり純資産額

13,878円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 1 期 自 平成 28 年 5 月 18 日 至 平成 28 年 10 月 20 日			第 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 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	83,478,786円	当期配当等収益額	A	88,815,741円
分配準備積立金	B	0円	分配準備積立金	B	87,730円
配当等収益合計額	C=A+B	83,478,786円	配当等収益合計額	C=A+B	88,903,471円
経費	D	10,162,910円	経費	D	14,346,408円
収益分配可能額	E=C-D	73,315,876円	収益分配可能額	E=C-D	74,557,063円
収益分配金	F	73,228,146円	収益分配金	F	74,264,154円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	87,730円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	292,909円
口数	H	717,923口	口数	H	522,987口
1口当たり分配金	I=F/H	102円	1口当たり分配金	I=F/H	142円
2. その他費用 その他費用のうち 2,387,334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 2,812,489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 1 期 自 平成 28 年 5 月 18 日 至 平成 28 年 10 月 20 日		第 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 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なっております。 ○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なっております。 ○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		3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左	

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なっております。

○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なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 1 期 平成 28 年 10 月 20 日現在	第 2 期 平成 29 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 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 1 期 自 平成 28 年 5 月 18 日 至 平成 28 年 10 月 20 日	第 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 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 1 期 自 平成 28 年 5 月 18 日 至 平成 28 年 10 月 20 日	第 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 年 4 月 20 日
期首元本額	期首元本額
期中追加設定元本額	期中追加設定元本額
期中一部交換元本額	期中一部交換元本額

円 9,226,028,473 円 0 円 円 2,505,122,536 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 1 期 自 平成 28 年 5 月 18 日 至 平成 28 年 10 月 20 日	第 2 期 自 平成 28 年 10 月 21 日 至 平成 29 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	307,399,800	417,157,738
合計	307,399,800	417,157,738

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 1 期(平成 28 年 10 月 20 日現在)			第 2 期(平成 29 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)
市場取引						
株価指数先物取引						

買建	152,912,000	—	157,090,000	4,165,580	175,656,652	—	168,264,000	△7,404,964
合計	152,912,000	—	157,090,000	4,165,580	175,656,652	—	168,264,000	△7,404,964

(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 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	国際石油開発帝石	32,900	1,038.00	34,150,200	
		長谷工コーポレーション	9,400	1,187.00	11,157,800	
		大東建託	2,500	16,090.00	40,225,000	
		大和ハウス工業	16,500	3,225.00	53,212,500	
		積水ハウス	18,700	1,820.00	34,034,000	
		カルビー	2,600	3,760.00	9,776,000	
		ヤクルト本社	2,700	6,100.00	16,470,000	
		明治ホールディングス	3,800	9,420.00	35,796,000	
		日本ハム	5,000	3,050.00	15,250,000	
		アサヒグループホールディングス	11,600	4,137.00	47,989,200	
		麒麟ホールディングス	25,900	2,059.00	53,328,100	
		コカ・コーラボトラーズジャパン	1,500	3,310.00	4,965,000	
		サントリー食品インターナショナル	4,300	4,810.00	20,683,000	
		伊藤園	1,900	4,030.00	7,657,000	
		不二製油グループ本社	1,600	2,546.00	4,073,600	
		キッコーマン	4,800	3,280.00	15,744,000	
		味の素	16,200	2,103.50	34,076,700	
		キューピー	3,100	2,788.00	8,642,800	
		日清食品ホールディングス	2,200	6,290.00	13,838,000	
		日本たばこ産業	37,900	3,643.00	138,069,700	
東レ	46,200	962.00	44,444,400			
クラレ	10,900	1,706.00	18,595,400			
旭化成	37,000	1,030.00	38,110,000			

住友化学	47,000	589.00	27,683,000
日産化学工業	3,800	3,285.00	12,483,000
東ソー	15,000	985.00	14,775,000
セントラル硝子	6,000	453.00	2,718,000
信越化学工業	12,600	9,293.00	117,091,800
エア・ウォーター	4,500	2,024.00	9,108,000
大陽日酸	3,800	1,242.00	4,719,600
カネカ	8,000	838.00	6,704,000
三菱瓦斯化学	5,800	2,242.00	13,003,600
J S R	6,100	1,871.00	11,413,100
三菱ケミカルホールディングス	40,600	835.80	33,933,480
ダイセル	9,000	1,222.00	10,998,000
積水化学工業	12,800	1,786.00	22,860,800
日本ゼオン	4,000	1,177.00	4,708,000
日立化成	3,200	3,020.00	9,664,000
日本化薬	5,000	1,446.00	7,230,000
花王	16,800	6,126.00	102,916,800
日本ペイントホールディングス	4,700	4,020.00	18,894,000
D I C	2,400	3,720.00	8,928,000
資生堂	11,800	2,880.00	33,984,000
コーセー	1,000	9,910.00	9,910,000
小林製薬	1,800	5,550.00	9,990,000
日東電工	5,500	8,135.00	44,742,500
ニフコ	1,400	5,390.00	7,546,000
ユニ・チャーム	12,300	2,601.50	31,998,450
協和発酵キリン	7,900	1,827.00	14,433,300
武田薬品工業	24,800	5,214.00	129,307,200
アステラス製薬	70,600	1,491.50	105,299,900
大日本住友製薬	4,300	1,771.00	7,615,300
塩野義製薬	9,400	5,555.00	52,217,000
田辺三菱製薬	6,900	2,227.00	15,366,300
中外製薬	6,400	3,815.00	24,416,000
エーザイ	8,300	5,688.00	47,210,400
小野薬品工業	12,900	2,214.50	28,567,050
久光製薬	1,800	5,560.00	10,008,000
参天製薬	11,600	1,541.00	17,875,600

ツムラ	2,000	3,405.00	6,810,000
東和薬品	300	5,380.00	1,614,000
沢井製薬	1,100	5,820.00	6,402,000
第一三共	20,600	2,399.50	49,429,700
大塚ホールディングス	13,800	5,023.00	69,317,400
横浜ゴム	3,400	2,060.00	7,004,000
東洋ゴム工業	3,000	1,766.00	5,298,000
ブリヂストン	20,500	4,411.00	90,425,500
住友ゴム工業	5,200	1,880.00	9,776,000
太平洋セメント	40,000	354.00	14,160,000
TOTO	4,500	4,075.00	18,337,500
日本碍子	8,700	2,316.00	20,149,200
日本特殊陶業	5,400	2,245.00	12,123,000
新日鐵住金	23,400	2,448.50	57,294,900
ジェイ エフ イー ホールディングス	15,100	1,806.00	27,270,600
日立金属	5,600	1,449.00	8,114,400
三菱マテリアル	3,600	3,175.00	11,430,000
DOWAホールディングス	8,000	780.00	6,240,000
住友電気工業	24,600	1,700.50	41,832,300
三和ホールディングス	6,400	1,026.00	6,566,400
リンナイ	1,200	9,030.00	10,836,000
日本発條	5,000	1,172.00	5,860,000
オーエスジー	2,500	2,146.00	5,365,000
DMG 森精機	3,800	1,608.00	6,110,400
ディスコ	1,000	16,470.00	16,470,000
ナブテスコ	4,000	3,005.00	12,020,000
SMC	1,900	30,910.00	58,729,000
小松製作所	29,500	2,666.00	78,647,000
ハーモニック・ドライブ・システムズ	800	3,425.00	2,740,000
クボタ	32,400	1,638.00	53,071,200
荏原製作所	3,000	3,190.00	9,570,000
ダイキン工業	7,700	10,480.00	80,696,000
栗田工業	3,400	2,782.00	9,458,800
椿本チエイン	4,000	902.00	3,608,000
タダノ	2,500	1,304.00	3,260,000

セガサミーホールディングス	6,200	1,404.00	8,704,800
ホシザキ	1,300	8,770.00	11,401,000
日本精工	12,800	1,424.00	18,227,200
NTN	13,000	512.00	6,656,000
ジェイテクト	6,100	1,691.00	10,315,100
不二越	4,000	558.00	2,232,000
THK	4,000	2,729.00	10,916,000
マキタ	7,600	3,845.00	29,222,000
三菱重工業	95,000	432.80	41,116,000
IHI	42,000	337.00	14,154,000
コニカミノルタ	14,900	943.00	14,050,700
ブラザー工業	7,400	2,173.00	16,080,200
ミネベアミツミ	9,700	1,505.00	14,598,500
日立製作所	157,000	579.20	90,934,400
三菱電機	61,200	1,483.50	90,790,200
富士電機	19,000	605.00	11,495,000
安川電機	7,500	2,063.00	15,472,500
マブチモーター	1,600	5,940.00	9,504,000
日本電産	6,800	9,981.00	67,870,800
オムロン	6,500	4,715.00	30,647,500
富士通	59,000	683.20	40,308,800
沖電気工業	2,700	1,636.00	4,417,200
セイコーエプソン	8,900	2,223.00	19,784,700
ワコム	4,900	392.00	1,920,800
パナソニック	70,400	1,247.50	87,824,000
アンリツ	4,400	765.00	3,366,000
富士通ゼネラル	1,800	2,251.00	4,051,800
日立国際電気	1,700	2,356.00	4,005,200
TDK	4,200	6,550.00	27,510,000
アルプス電気	6,000	2,903.00	17,418,000
ヒロセ電機	900	14,440.00	12,996,000
日本航空電子工業	2,000	1,349.00	2,698,000
横河電機	6,900	1,628.00	11,233,200
日本光電工業	2,300	2,401.00	5,522,300
堀場製作所	1,100	6,330.00	6,963,000
キーエンス	3,000	43,700.00	131,100,000

シスメックス	4,100	6,750.00	27,675,000
スタンレー電気	4,300	2,970.00	12,771,000
ウシオ電機	3,400	1,360.00	4,624,000
カシオ計算機	7,100	1,504.00	10,678,400
ファナック	6,300	22,190.00	139,797,000
ローム	3,100	7,400.00	22,940,000
浜松ホトニクス	4,900	3,105.00	15,214,500
太陽誘電	3,400	1,233.00	4,192,200
村田製作所	6,300	14,100.00	88,830,000
小糸製作所	2,900	5,320.00	15,428,000
S C R E E Nホールディングス	1,300	7,430.00	9,659,000
キヤノン	33,800	3,483.00	117,725,400
リコー	20,400	909.00	18,543,600
東京エレクトロン	5,300	11,815.00	62,619,500
トヨタ紡織	1,700	2,344.00	3,984,800
豊田自動織機	5,200	5,190.00	26,988,000
デンソー	15,100	4,689.00	70,803,900
東海理化電機製作所	1,600	2,014.00	3,222,400
川崎重工業	44,000	319.00	14,036,000
日産自動車	80,400	1,032.00	82,972,800
いすゞ自動車	17,900	1,370.00	24,523,000
トヨタ自動車	33,000	5,754.00	189,882,000
日野自動車	8,000	1,239.00	9,912,000
三菱自動車工業	21,800	656.00	14,300,800
NOK	2,500	2,521.00	6,302,500
アイシン精機	5,700	4,985.00	28,414,500
マツダ	18,300	1,503.50	27,514,050
スズキ	10,600	4,462.00	47,297,200
S U B A R U	18,600	4,010.00	74,586,000
ヤマハ発動機	8,500	2,481.00	21,088,500
豊田合成	2,100	2,660.00	5,586,000
シマノ	2,500	16,480.00	41,200,000
テイ・エス テック	1,300	2,786.00	3,621,800
テルモ	9,100	3,855.00	35,080,500
島津製作所	7,000	1,774.00	12,418,000
東京精密	1,300	3,250.00	4,225,000

ニコン	10,800	1,531.00	16,534,800
トプコン	2,300	1,792.00	4,121,600
オリンパス	8,000	4,030.00	32,240,000
HOYA	13,700	5,108.00	69,979,600
朝日インテック	1,600	4,800.00	7,680,000
シチズン時計	8,100	696.00	5,637,600
ニプロ	4,000	1,573.00	6,292,000
バンダイナムコホールディングス	6,200	3,215.00	19,933,000
アシックス	5,200	1,883.00	9,791,600
ヤマハ	4,700	3,070.00	14,429,000
ピジョン	3,600	3,465.00	12,474,000
中部電力	20,900	1,448.00	30,263,200
北陸電力	5,500	1,000.00	5,500,000
東北電力	14,600	1,498.00	21,870,800
東京瓦斯	64,000	506.00	32,384,000
大阪瓦斯	59,000	415.80	24,532,200
東京急行電鉄	31,000	787.00	24,397,000
東日本旅客鉄道	10,400	9,544.00	99,257,600
西日本旅客鉄道	5,500	7,270.00	39,985,000
東海旅客鉄道	4,500	18,080.00	81,360,000
日本通運	26,000	569.00	14,794,000
日本航空	11,700	3,342.00	39,101,400
ANAホールディングス	105,000	325.90	34,219,500
ネクソン	4,900	1,695.00	8,305,500
野村総合研究所	4,200	3,940.00	16,548,000
ヤフー	42,500	508.00	21,590,000
トレンドマイクロ	3,800	4,675.00	17,765,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,600	3,130.00	5,008,000
大塚商会	1,700	5,930.00	10,081,000
日本電信電話	39,900	4,769.00	190,283,100
KDDI	61,900	2,861.00	177,095,900
光通信	600	10,600.00	6,360,000
NTTドコモ	45,500	2,587.00	117,708,500
エヌ・ティ・ティ・データ	4,300	5,030.00	21,629,000
カプコン	1,500	2,214.00	3,321,000
SCSK	1,600	4,465.00	7,144,000

第一興商	1,200	4,585.00	5,502,000
I DOM	2,000	583.00	1,166,000
豊田通商	6,600	3,185.00	21,021,000
ミスミグループ本社	6,600	2,018.00	13,318,800
ローソン	2,100	7,350.00	15,435,000
エービーシー・マート	900	6,290.00	5,661,000
ゲオホールディングス	1,100	1,193.00	1,312,300
アダストリア	1,000	2,664.00	2,664,000
セリア	1,000	4,910.00	4,910,000
ジーンズ	400	6,050.00	2,420,000
マツモトキヨシホールディングス	1,300	5,520.00	7,176,000
ウエルシアホールディングス	1,000	3,565.00	3,565,000
すかいらーく	3,400	1,664.00	5,657,600
コスモス薬品	300	22,870.00	6,861,000
セブン&アイ・ホールディングス	24,800	4,548.00	112,790,400
クリエイト・レストランツ・ホールディング	1,400	915.00	1,281,000
ツルハホールディングス	1,100	11,130.00	12,243,000
クスリのアオキホールディングス	500	4,860.00	2,430,000
良品計画	800	25,800.00	20,640,000
ドンキホーテホールディングス	3,900	3,970.00	15,483,000
ユナイテッドアローズ	700	3,430.00	2,401,000
スギホールディングス	1,200	5,470.00	6,564,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	1,900	6,310.00	11,989,000
青山商事	1,500	3,855.00	5,782,500
しまむら	700	15,550.00	10,885,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,800	1,829.00	5,121,200
イオン	20,000	1,616.50	32,330,000
イズミ	1,000	5,520.00	5,520,000
ニトリホールディングス	2,300	15,140.00	34,822,000
吉野家ホールディングス	1,800	1,786.00	3,214,800
バローホールディングス	1,100	2,589.00	2,847,900
ファーストリテイリング	1,100	35,110.00	38,621,000
サンドラッグ	2,300	3,885.00	8,935,500
三井住友フィナンシャルグループ	42,800	3,935.00	168,418,000
大和証券グループ本社	55,000	660.90	36,349,500

東京センチュリー	1,400	3,720.00	5,208,000	
日立キャピタル	1,500	2,727.00	4,090,500	
オリックス	45,100	1,706.50	76,963,150	
三菱UFJリース	13,500	569.00	7,681,500	
ヒューリック	7,800	1,074.00	8,377,200	
野村不動産ホールディングス	4,200	1,767.00	7,421,400	
飯田グループホールディングス	4,500	1,690.00	7,605,000	
パーク24	3,000	2,921.00	8,763,000	
タカラレーベン	2,800	530.00	1,484,000	
イオンモール	3,700	1,943.00	7,189,100	
テンプホールディングス	4,500	1,995.00	8,977,500	
総合警備保障	1,600	4,655.00	7,448,000	
カカコム	4,800	1,586.00	7,612,800	
エムスリー	4,800	2,771.00	13,300,800	
ディー・エヌ・エー	3,600	2,385.00	8,586,000	
博報堂DYホールディングス	7,500	1,311.00	9,832,500	
ぐるなび	800	2,145.00	1,716,000	
ケネディクス	8,000	503.00	4,024,000	
電通	7,600	6,150.00	46,740,000	
みらかホールディングス	1,800	5,000.00	9,000,000	
オリエンタルランド	6,500	6,508.00	42,302,000	
リゾートトラスト	2,300	1,831.00	4,211,300	
サイバーエージェント	3,300	3,200.00	10,560,000	
楽天	27,500	1,173.00	32,257,500	
リクルートホールディングス	7,800	5,660.00	44,148,000	
リログループ	3,500	1,816.00	6,356,000	
エイチ・アイ・エス	1,100	2,526.00	2,778,600	
カナモト	800	2,835.00	2,268,000	
セコム	6,900	7,847.00	54,144,300	
小計 銘柄数：266			7,086,809,680	
組入時価比率：97.6%			100.0%	
合計			7,086,809,680	

(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(平成 29 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。