



2019年4月期 (2018年10月8日～2019年4月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2019 (October 8, 2018 - April 7, 2019)

2019年5月17日
 May 17, 2019

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

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 Russell/Nomura Fundamental Index Exchange Traded Fund
 Code: 1598
 Underlying index: Russell/Nomura Fundamental Prime Index (exclusive of dividends)
 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6月26日
 分配金支払開始日 2019年5月16日
 Scheduled date of submission of securities report: June 26, 2019
 Date of commencing dividend payment: May 16, 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8日～2019年4月7日)

Management Status for Year ended April 2019 (from October 8, 2018 to April 7, 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	2,688	(97.8)	61	(2.2)	2,749	(100.0)
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	3,014	(97.9)	64	(2.1)	3,078	(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	154	0	0	154
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	154	0	0	154

(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	2,793	43	2,749	17,851
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	3,119	40	3,078	19,986

(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	235
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	204

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10期 (2018年10月7日現在) 10th Fiscal Year As of October 7, 2018	第11期 (2019年4月7日現在) 11th Fiscal Year As of April 7, 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	66,876,670	64,176,016
株式 Stocks	3,014,195,350	2,688,252,265
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	2,134,656	1,279,755
未収入金 Accounts receivable - other	3,704,761	657,998
未収配当金 Accrued dividends receivable	32,286,594	37,667,702
差入委託証拠金 Customers' margin	-	1,122,249
流動資産合計 Total current assets	3,119,198,031	2,793,155,985
資産合計 Total assets	3,119,198,031	2,793,155,985
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	471,836	-
前受金 Advances received	1,344,500	-
未払金 Accounts payable - other	1,050,885	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	31,421,712	36,196,580
未払受託者報酬 Trustee fee payable	805,883	737,345
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	4,029,343	3,686,641
未払利息 Accrued interest expenses	346	411
その他未払費用 Other accrued expenses	1,602,120	2,919,418
流動負債合計 Total current liabilities	40,726,625	43,540,395

負債合計 Total liabilities	40,726,625	43,540,395
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	2,053,039,212	2,053,039,212
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,025,432,194	696,576,378
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	75,511	130,241
元本等合計 Total principal and other	3,078,471,406	2,749,615,590
純資産合計 Total net assets	3,078,471,406	2,749,615,590
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	3,119,198,031	2,793,155,985

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第10期 自 2018年4月8日 至 2018年10月7日 10th Fiscal Year From April 8, 2018 to October 7, 2018	第11期 自 2018年10月8日 至 2019年4月7日 11th Fiscal Year From October 8, 2018 to April 7, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	37,820,687	42,112,051
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	176,636,140	△325,068,827
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	2,551,491	△3,841,719
その他収益 Other revenue	37,015	34,442
営業収益合計 Total operating revenue	217,045,333	△286,764,053
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	18,027	18,228
受託者報酬 Trustee fee	805,883	737,345
委託者報酬 Investment trust management fee	4,029,343	3,686,641
その他費用 Other expenses	1,609,121	1,452,969
営業費用合計	6,462,374	5,895,183

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	210,582,959	△292,659,236
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	210,582,959	△292,659,236
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	210,582,959	△292,659,236
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	846,270,947	1,025,432,194
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	-	-
分配金 Dividends	31,421,712	36,196,580
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,025,432,194	696,576,378

(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8日から2019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10期 2018年10月7日現在	第11期 2019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 19,986 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 17,851 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 2018年 4月 8日 至 2018年 10月 7日			第11期 自 2018年 10月 8日 至 2019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	37,839,675 円	当期配当等収益額	A	42,128,265 円
分配準備積立金	B	101,895 円	分配準備積立金	B	75,511 円
配当等収益合計額	C=A+B	37,941,570 円	配当等収益合計額	C=A+B	42,203,776 円
経費	D	6,444,347 円	経費	D	5,876,955 円
収益分配可能額	E=C-D	31,497,223 円	収益分配可能額	E=C-D	36,326,821 円
収益分配金	F	31,421,712 円	収益分配金	F	36,196,580 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	75,511 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	130,241 円
口数	H	154,028 口	口数	H	154,028 口
1口当たり分配金	I=F/H	204 円	1口当たり分配金	I=F/H	235 円
2. その他費用 その他費用のうち 1,451,211 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 1,327,151 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10期 自 2018年 4月 8日 至 2018年 10月 7日		第11期 自 2018年 10月 8日 至 2019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10期 2018年 10月 7日現在		第11期 2019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		1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左	

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。	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10期 自 2018年4月8日 至 2018年10月7日	第11期 自 2018年10月8日 至 2019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10期 自 2018年4月8日 至 2018年10月7日	第11期 自 2018年10月8日 至 2019年4月7日
期首元本額	2,053,039,212円
期中追加設定元本額	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10期 自 2018年4月8日 至 2018年10月7日	第11期 自 2018年10月8日 至 2019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	176,532,756	△296,188,289
合計	176,532,756	△296,188,289

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10期(2018年10月7日現在)				第11期(2019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	61,105,900	-	62,772,500	1,662,820	58,767,249	-	60,051,000	1,279,755
合計	61,105,900	-	62,772,500	1,662,820	58,767,249	-	60,051,000	1,279,755

(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(2019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	781.00	1,483,900	
		マルハニチロ	200	3,795.00	759,000	
		国際石油開発帝石	5,200	1,055.00	5,486,000	
		石油資源開発	500	2,375.00	1,187,500	
		ミライト・ホールディングス	500	1,635.00	817,500	
		安藤・間	1,000	729.00	729,000	
		コムシスホールディングス	600	3,015.00	1,809,000	
		大成建設	1,300	4,965.00	6,454,500	
		大林組	5,200	1,125.00	5,850,000	
		清水建設	3,600	961.00	3,459,600	
		長谷工コーポレーション	2,300	1,411.00	3,245,300	
		鹿島建設	2,800	1,627.00	4,555,600	
		西松建設	400	2,432.00	972,800	
		三井住友建設	900	738.00	664,200	
		前田建設工業	600	1,142.00	685,200	
		奥村組	200	3,540.00	708,000	
		戸田建設	1,300	696.00	904,800	
		熊谷組	300	3,275.00	982,500	
		大東建託	500	15,690.00	7,845,000	
		NIPPO	500	2,084.00	1,042,000	
		前田道路	500	2,195.00	1,097,500	
		五洋建設	1,400	527.00	737,800	
		住友林業	1,100	1,576.00	1,733,600	
		大和ハウス工業	3,300	3,556.00	11,734,800	
		積水ハウス	5,200	1,832.50	9,529,000	
		関電工	700	967.00	676,900	
		きんでん	1,000	1,841.00	1,841,000	
協和エクシオ	400	3,080.00	1,232,000			
九電工	200	3,220.00	644,000			

日揮	1,100	1,617.00	1,778,700
千代田化工建設	1,000	286.00	286,000
日本製粉	400	1,857.00	742,800
日清製粉グループ本社	800	2,482.00	1,985,600
江崎グリコ	200	5,790.00	1,158,000
山崎製パン	800	1,787.00	1,429,600
カルビー	300	2,965.00	889,500
森永乳業	400	3,630.00	1,452,000
ヤクルト本社	200	7,270.00	1,454,000
明治ホールディングス	600	8,800.00	5,280,000
雪印メグミルク	400	2,506.00	1,002,400
プリマハム	300	2,105.00	631,500
日本ハム	1,000	4,085.00	4,085,000
丸大食品	300	1,919.00	575,700
伊藤ハム米久ホールディングス	1,600	696.00	1,113,600
サッポロホールディングス	500	2,391.00	1,195,500
アサヒグループホールディングス	1,400	4,749.00	6,648,600
キリンホールディングス	3,900	2,588.00	10,093,200
宝ホールディングス	500	1,277.00	638,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	700	2,734.00	1,913,800
サントリー食品インターナショナル	700	5,020.00	3,514,000
伊藤園	300	5,460.00	1,638,000
日清オイリオグループ	300	3,290.00	987,000
不二製油グループ本社	200	3,630.00	726,000
キッコーマン	300	5,350.00	1,605,000
味の素	3,300	1,725.50	5,694,150
キューピー	700	2,520.00	1,764,000
ハウス食品グループ本社	300	4,405.00	1,321,500
カゴメ	300	3,010.00	903,000
ニチレイ	600	2,615.00	1,569,000
東洋水産	500	4,225.00	2,112,500
日清食品ホールディングス	300	7,590.00	2,277,000
日本たばこ産業	6,300	2,697.50	16,994,250
東洋紡	700	1,539.00	1,077,300
帝人	1,500	1,928.00	2,892,000

東レ	10,100	776.80	7,845,680
ワコールホールディングス	300	2,785.00	835,500
T S I ホールディングス	1,000	647.00	647,000
オンワードホールディングス	1,300	603.00	783,900
王子ホールディングス	5,300	713.00	3,778,900
日本製紙	1,200	2,292.00	2,750,400
北越コーポレーション	1,300	650.00	845,000
大王製紙	500	1,332.00	666,000
レンゴー	1,300	1,012.00	1,315,600
クラレ	2,500	1,496.00	3,740,000
旭化成	6,100	1,181.00	7,204,100
昭和電工	500	4,270.00	2,135,000
住友化学	14,900	549.00	8,180,100
日産化学	300	5,320.00	1,596,000
クレハ	100	6,840.00	684,000
日本曹達	200	3,040.00	608,000
東ソー	2,200	1,818.00	3,999,600
トクヤマ	500	2,868.00	1,434,000
セントラル硝子	400	2,686.00	1,074,400
東亜合成	800	1,229.00	983,200
デンカ	500	3,400.00	1,700,000
信越化学工業	1,400	10,330.00	14,462,000
エア・ウォーター	1,000	1,729.00	1,729,000
大陽日酸	600	1,783.00	1,069,800
日本触媒	200	7,620.00	1,524,000
カネカ	400	4,430.00	1,772,000
三菱瓦斯化学	1,300	1,711.00	2,224,300
三井化学	1,600	2,938.00	4,700,800
J S R	1,400	1,887.00	2,641,800
東京応化工業	200	3,495.00	699,000
三菱ケミカルホールディングス	14,100	828.70	11,684,670
ダイセル	2,300	1,275.00	2,932,500
住友ベークライト	200	4,420.00	884,000
積水化学工業	2,800	1,860.00	5,208,000
日本ゼオン	900	1,206.00	1,085,400

アイカ工業	200	3,865.00	773,000
宇部興産	1,100	2,502.00	2,752,200
日立化成	900	2,522.00	2,269,800
日本化薬	900	1,360.00	1,224,000
ADEKA	500	1,678.00	839,000
日油	300	3,835.00	1,150,500
花王	1,400	8,514.00	11,919,600
日本ペイントホールディングス	400	4,485.00	1,794,000
関西ペイント	800	2,202.00	1,761,600
DIC	700	3,515.00	2,460,500
東洋インキSCホールディングス	300	2,659.00	797,700
富士フイルムホールディングス	2,800	5,156.00	14,436,800
資生堂	500	7,840.00	3,920,000
ライオン	600	2,259.00	1,355,400
ポーラ・オルビスホールディングス	200	3,420.00	684,000
小林製薬	100	9,130.00	913,000
日東電工	900	6,346.00	5,711,400
ニフコ	500	3,090.00	1,545,000
ユニ・チャーム	900	3,494.00	3,144,600
協和発酵キリン	800	2,331.00	1,864,800
武田薬品工業	4,000	4,499.00	17,996,000
アステラス製薬	10,400	1,650.50	17,165,200
大日本住友製薬	300	2,687.00	806,100
塩野義製薬	700	6,592.00	4,614,400
田辺三菱製薬	1,100	1,503.00	1,653,300
中外製薬	300	7,200.00	2,160,000
科研製薬	100	5,000.00	500,000
エーザイ	500	6,476.00	3,238,000
ロート製薬	200	2,937.00	587,400
小野薬品工業	800	2,103.50	1,682,800
久光製薬	100	5,110.00	511,000
参天製薬	1,000	1,624.00	1,624,000
ツムラ	200	3,390.00	678,000
沢井製薬	200	6,290.00	1,258,000
第一三共	1,900	5,269.00	10,011,100

大塚ホールディングス	1,700	4,390.00	7,463,000
大正製薬ホールディングス	100	10,570.00	1,057,000
出光興産	1,251	3,605.00	4,509,855
JXTGホールディングス	33,600	538.10	18,080,160
コスモエネルギーホールディングス	500	2,381.00	1,190,500
横浜ゴム	800	2,171.00	1,736,800
TOYO TIRE	700	1,337.00	935,900
ブリヂストン	5,400	4,448.00	24,019,200
住友ゴム工業	2,000	1,397.00	2,794,000
AGC	1,700	3,895.00	6,621,500
日本板硝子	900	945.00	850,500
日本電気硝子	600	3,160.00	1,896,000
住友大阪セメント	300	4,555.00	1,366,500
太平洋セメント	1,200	3,990.00	4,788,000
TOTO	600	4,775.00	2,865,000
日本碍子	1,400	1,713.00	2,398,200
日本特殊陶業	800	2,300.00	1,840,000
ニチアス	300	2,266.00	679,800
日本製鉄	10,000	2,065.50	20,655,000
神戸製鋼所	5,600	895.00	5,012,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	4,700	1,985.00	9,329,500
大和工業	200	3,130.00	626,000
丸一鋼管	200	3,250.00	650,000
大同特殊鋼	300	4,755.00	1,426,500
日立金属	1,700	1,319.00	2,242,300
日本軽金属ホールディングス	6,100	256.00	1,561,600
三井金属鉱業	600	3,085.00	1,851,000
三菱マテリアル	1,400	3,110.00	4,354,000
住友金属鉱山	1,300	3,613.00	4,696,900
DOWAホールディングス	500	3,840.00	1,920,000
UACJ	300	2,148.00	644,400
古河電気工業	600	3,050.00	1,830,000
住友電気工業	8,300	1,517.00	12,591,100
フジクラ	3,900	459.00	1,790,100
リョービ	200	2,661.00	532,200

SUMCO	1,000	1,454.00	1,454,000
東洋製罐グループホールディングス	1,200	2,270.00	2,724,000
三和ホールディングス	1,100	1,341.00	1,475,100
三協立山	500	1,372.00	686,000
LIXILグループ	2,600	1,654.00	4,300,400
リンナイ	200	7,760.00	1,552,000
日本発條	1,900	1,055.00	2,004,500
日本製鋼所	300	2,142.00	642,600
オークマ	100	6,480.00	648,000
アマダホールディングス	2,300	1,213.00	2,789,900
牧野フライス製作所	200	4,965.00	993,000
オーエスジー	400	2,280.00	912,000
DMG森精機	1,200	1,561.00	1,873,200
ディスコ	100	18,490.00	1,849,000
ナブテスコ	600	3,495.00	2,097,000
SMC	200	43,550.00	8,710,000
小松製作所	4,200	2,841.50	11,934,300
住友重機械工業	800	3,825.00	3,060,000
日立建機	600	3,090.00	1,854,000
クボタ	4,600	1,673.50	7,698,100
荏原製作所	600	3,315.00	1,989,000
ダイキン工業	700	13,090.00	9,163,000
栗田工業	600	2,997.00	1,798,200
椿本チエイン	200	4,040.00	808,000
ダイフク	200	6,430.00	1,286,000
タダノ	500	1,180.00	590,000
フジテック	500	1,373.00	686,500
平和	300	2,237.00	671,100
SANKYO	300	4,240.00	1,272,000
アマノ	300	2,615.00	784,500
グローリー	500	2,746.00	1,373,000
セガサミーホールディングス	1,300	1,317.00	1,712,100
ホシザキ	100	7,290.00	729,000
日本精工	3,000	1,146.00	3,438,000
NTN	3,900	365.00	1,423,500

ジェイテクト	2,000	1,462.00	2,924,000
THK	600	3,030.00	1,818,000
マキタ	600	4,135.00	2,481,000
日立造船	1,800	351.00	631,800
三菱重工業	2,900	4,743.00	13,754,700
I H I	700	2,825.00	1,977,500
日清紡ホールディングス	1,400	1,044.00	1,461,600
イビデン	1,300	1,751.00	2,276,300
コニカミノルタ	4,000	1,122.00	4,488,000
ブラザー工業	1,600	2,171.00	3,473,600
ミネベアミツミ	1,500	1,853.00	2,779,500
日立製作所	9,700	3,775.00	36,617,500
東芝	1,600	3,755.00	6,008,000
三菱電機	13,300	1,544.00	20,535,200
富士電機	600	3,465.00	2,079,000
安川電機	600	3,965.00	2,379,000
マブチモーター	300	4,050.00	1,215,000
日本電産	300	15,060.00	4,518,000
JVCケンウッド	2,200	262.00	576,400
オムロン	1,200	5,640.00	6,768,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	600	2,344.00	1,406,400
日本電気	2,500	3,825.00	9,562,500
富士通	1,600	7,843.00	12,548,800
沖電気工業	1,000	1,322.00	1,322,000
ルネサスエレクトロニクス	2,500	584.00	1,460,000
セイコーエプソン	2,200	1,779.00	3,913,800
アルバック	300	3,685.00	1,105,500
ジャパンディスプレイ	13,500	90.00	1,215,000
パナソニック	18,500	991.30	18,339,050
シャープ	700	1,294.00	905,800
アンリツ	400	2,155.00	862,000
富士通ゼネラル	400	1,570.00	628,000
ソニー	4,200	4,816.00	20,227,200
TDK	700	9,600.00	6,720,000
アルプスアルパイン	1,400	2,418.00	3,385,200

フォスター電機	600	1,736.00	1,041,600
ヒロセ電機	100	12,460.00	1,246,000
日本航空電子工業	400	1,621.00	648,400
マクセルホールディングス	500	1,664.00	832,000
横河電機	800	2,349.00	1,879,200
アズビル	600	2,681.00	1,608,600
日本光電工業	300	3,230.00	969,000
堀場製作所	200	6,510.00	1,302,000
アドバンテスト	400	2,962.00	1,184,800
キーエンス	100	71,580.00	7,158,000
シスメックス	200	6,541.00	1,308,200
スタンレー電気	600	3,235.00	1,941,000
ウシオ電機	600	1,374.00	824,400
カシオ計算機	1,200	1,423.00	1,707,600
ファナック	600	20,985.00	12,591,000
ローム	500	7,810.00	3,905,000
浜松ホトニクス	300	4,475.00	1,342,500
京セラ	1,500	6,783.00	10,174,500
太陽誘電	500	2,489.00	1,244,500
村田製作所	1,800	5,855.00	10,539,000
小糸製作所	400	6,790.00	2,716,000
S C R E E Nホールディングス	200	5,100.00	1,020,000
キヤノン	7,800	3,270.00	25,506,000
リコー	5,700	1,194.00	6,805,800
東京エレクトロン	600	17,685.00	10,611,000
トヨタ紡織	600	1,776.00	1,065,600
ユニプレス	600	1,836.00	1,101,600
豊田自動織機	900	6,050.00	5,445,000
デンソー	3,400	4,672.00	15,884,800
東海理化電機製作所	500	2,037.00	1,018,500
三井E&Sホールディングス	500	1,197.00	598,500
川崎重工業	1,300	2,839.00	3,690,700
日産自動車	27,900	944.10	26,340,390
いすゞ自動車	4,300	1,526.00	6,561,800
トヨタ自動車	16,100	6,840.00	110,124,000

日野自動車	2,700	984.00	2,656,800
三菱自動車工業	7,300	620.00	4,526,000
日産車体	1,200	978.00	1,173,600
新明和工業	600	1,418.00	850,800
日信工業	500	1,508.00	754,000
タチエス	500	1,743.00	871,500
NOK	1,100	1,846.00	2,030,600
KYB	200	3,015.00	603,000
プレス工業	1,300	599.00	778,700
ケーヒン	500	1,953.00	976,500
アイシン精機	1,900	4,275.00	8,122,500
マツダ	8,600	1,307.50	11,244,500
本田技研工業	18,900	3,179.00	60,083,100
スズキ	2,300	5,023.00	11,552,900
SUBARU	5,100	2,759.00	14,070,900
ヤマハ発動機	1,800	2,351.00	4,231,800
ショーワ	600	1,510.00	906,000
エクセディ	200	2,624.00	524,800
豊田合成	700	2,573.00	1,801,100
日本精機	400	1,869.00	747,600
エフ・シー・シー	200	2,481.00	496,200
シマノ	200	17,780.00	3,556,000
テイ・エス テック	500	3,475.00	1,737,500
テルモ	1,200	3,359.00	4,030,800
島津製作所	400	3,225.00	1,290,000
ニコン	2,000	1,578.00	3,156,000
オリンパス	2,800	1,209.00	3,385,200
HOYA	1,600	7,540.00	12,064,000
シチズン時計	2,200	632.00	1,390,400
ニプロ	900	1,405.00	1,264,500
バンダイナムコホールディングス	900	5,060.00	4,554,000
パイロットコーポレーション	100	4,460.00	446,000
タカラトミー	600	1,153.00	691,800
凸版印刷	2,900	1,737.00	5,037,300
大日本印刷	2,400	2,658.00	6,379,200

アシックス	1,000	1,529.00	1,529,000
ヤマハ	400	5,620.00	2,248,000
ビジョン	100	4,360.00	436,000
リンテック	300	2,516.00	754,800
任天堂	100	33,210.00	3,321,000
コクヨ	400	1,645.00	658,000
東京電力ホールディングス	36,900	665.00	24,538,500
中部電力	7,100	1,679.00	11,920,900
関西電力	6,200	1,596.50	9,898,300
中国電力	2,800	1,370.00	3,836,000
北陸電力	2,000	858.00	1,716,000
東北電力	5,300	1,411.00	7,478,300
四国電力	1,500	1,384.00	2,076,000
九州電力	3,200	1,287.00	4,118,400
北海道電力	2,500	634.00	1,585,000
沖縄電力	400	1,901.00	760,400
電源開発	1,200	2,687.00	3,224,400
東京瓦斯	4,200	2,999.50	12,597,900
大阪瓦斯	3,600	2,181.00	7,851,600
東邦瓦斯	600	4,890.00	2,934,000
東武鉄道	900	3,115.00	2,803,500
相鉄ホールディングス	300	3,305.00	991,500
東京急行電鉄	2,200	1,840.00	4,048,000
京浜急行電鉄	700	1,800.00	1,260,000
小田急電鉄	800	2,577.00	2,061,600
京王電鉄	300	6,740.00	2,022,000
京成電鉄	300	3,930.00	1,179,000
東日本旅客鉄道	1,900	10,385.00	19,731,500
西日本旅客鉄道	1,000	8,302.00	8,302,000
東海旅客鉄道	500	24,870.00	12,435,000
西武ホールディングス	800	1,861.00	1,488,800
西日本鉄道	300	2,667.00	800,100
近鉄グループホールディングス	800	4,925.00	3,940,000
阪急阪神ホールディングス	1,100	4,060.00	4,466,000
南海電気鉄道	500	2,948.00	1,474,000

京阪ホールディングス	300	4,480.00	1,344,000
名古屋鉄道	900	2,962.00	2,665,800
日本通運	700	6,310.00	4,417,000
ヤマトホールディングス	1,600	2,850.50	4,560,800
山九	200	5,120.00	1,024,000
センコーグループホールディングス	800	904.00	723,200
ニッコンホールディングス	400	2,704.00	1,081,600
セイノーホールディングス	1,100	1,531.00	1,684,100
日立物流	400	3,170.00	1,268,000
九州旅客鉄道	700	3,565.00	2,495,500
S Gホールディングス	600	3,175.00	1,905,000
日本郵船	2,600	1,739.00	4,521,400
商船三井	1,300	2,668.00	3,468,400
川崎汽船	1,000	1,376.00	1,376,000
日本航空	3,200	3,887.00	12,438,400
ANAホールディングス	2,500	4,085.00	10,212,500
三菱倉庫	300	3,105.00	931,500
住友倉庫	400	1,434.00	573,600
上組	700	2,636.00	1,845,200
T I S	300	5,160.00	1,548,000
ネクソン	1,000	1,751.00	1,751,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	8,000	375.00	3,000,000
野村総合研究所	400	5,050.00	2,020,000
フジ・メディア・ホールディングス	1,200	1,504.00	1,804,800
ヤフー	4,400	280.00	1,232,000
トレンドマイクロ	300	5,390.00	1,617,000
日本オラクル	100	7,290.00	729,000
伊藤忠テクノソリューションズ	400	2,543.00	1,017,200
大塚商会	400	4,190.00	1,676,000
ネットワンシステムズ	300	2,816.00	844,800
エイベックス	400	1,431.00	572,400
日本ユニシス	300	2,793.00	837,900
東京放送ホールディングス	500	2,082.00	1,041,000
日本テレビホールディングス	900	1,688.00	1,519,200
テレビ朝日ホールディングス	400	1,975.00	790,000

日本電信電話	16,700	4,673.00	78,039,100
KDDI	11,900	2,406.00	28,631,400
光通信	100	20,660.00	2,066,000
NTTドコモ	8,700	2,380.00	20,706,000
カドカワ	600	1,273.00	763,800
東宝	300	4,285.00	1,285,500
エヌ・ティ・ティ・データ	2,800	1,207.00	3,379,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	300	3,735.00	1,120,500
SCSK	200	4,930.00	986,000
コナミホールディングス	300	4,905.00	1,471,500
ソフトバンクグループ	4,300	10,920.00	46,956,000
あらた	200	4,000.00	800,000
双日	13,300	390.00	5,187,000
アルフレッサホールディングス	1,400	3,135.00	4,389,000
ダイワボウホールディングス	100	6,030.00	603,000
マクニカ・富士エレホールディングス	500	1,626.00	813,000
シップヘルスケアホールディングス	200	4,400.00	880,000
三菱食品	300	2,874.00	862,200
第一興商	200	5,590.00	1,118,000
メディopalホールディングス	1,800	2,594.00	4,669,200
伊藤忠商事	11,300	2,022.00	22,848,600
丸紅	22,500	802.20	18,049,500
長瀬産業	1,200	1,699.00	2,038,800
豊田通商	2,300	3,695.00	8,498,500
兼松	900	1,300.00	1,170,000
三井物産	15,700	1,782.50	27,985,250
日立ハイテクノロジーズ	400	4,795.00	1,918,000
住友商事	10,700	1,602.00	17,141,400
三菱商事	8,700	3,161.00	27,500,700
キャノンマーケティングジャパン	400	2,242.00	896,800
阪和興業	500	3,300.00	1,650,000
岩谷産業	300	3,570.00	1,071,000
三愛石油	800	995.00	796,000
稲畑産業	600	1,609.00	965,400

東邦ホールディングス	500	2,711.00	1,355,500
サンゲツ	400	2,075.00	830,000
伊藤忠エネクス	900	911.00	819,900
リョーサン	300	3,080.00	924,000
PAL TAC	200	6,020.00	1,204,000
日鉄物産	300	4,695.00	1,408,500
オートバックスセブン	600	1,872.00	1,123,200
加藤産業	300	3,715.00	1,114,500
因幡電機産業	200	4,520.00	904,000
ミスミグループ本社	400	2,807.00	1,122,800
スズケン	700	6,360.00	4,452,000
ローソン	300	5,980.00	1,794,000
エービーシー・マート	100	6,390.00	639,000
ゲオホールディングス	500	1,508.00	754,000
アダストリア	400	2,945.00	1,178,000
エディオン	1,200	973.00	1,167,600
ビックカメラ	600	1,191.00	714,600
DCMホールディングス	1,000	1,054.00	1,054,000
J. フロント リテイリング	2,000	1,282.00	2,564,000
マツモトキヨシホールディングス	400	3,585.00	1,434,000
ZOZO	200	1,933.00	386,600
ココカラファイン	100	4,495.00	449,500
三越伊勢丹ホールディングス	3,000	1,100.00	3,300,000
ウエルシアホールディングス	100	3,840.00	384,000
すかいらーくホールディングス	1,000	1,788.00	1,788,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	700	1,099.00	769,300
セブン&アイ・ホールディングス	4,800	4,086.00	19,612,800
ツルハホールディングス	100	9,340.00	934,000
良品計画	100	27,030.00	2,703,000
コーナン商事	200	2,719.00	543,800
パン・パシフィック・インターナシ ョナルホ	300	7,020.00	2,106,000
ゼンショーホールディングス	400	2,450.00	980,000
スギホールディングス	200	4,845.00	969,000
ユニー・ファミリーマートホールデ ィングス	600	2,739.00	1,643,400

日本瓦斯	200	3,100.00	620,000
島忠	300	2,873.00	861,900
コメリ	300	2,718.00	815,400
青山商事	400	2,544.00	1,017,600
しまむら	200	9,160.00	1,832,000
高島屋	1,500	1,421.00	2,131,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,100	1,532.00	1,685,200
丸井グループ	800	2,229.00	1,783,200
イオン	4,400	2,239.00	9,851,600
イズミ	200	5,030.00	1,006,000
平和堂	200	2,187.00	437,400
ケーズホールディングス	1,700	1,002.00	1,703,400
アインホールディングス	100	8,060.00	806,000
ヤマダ電機	7,800	542.00	4,227,600
ニトリホールディングス	200	13,510.00	2,702,000
吉野家ホールディングス	400	1,757.00	702,800
アークス	500	2,428.00	1,214,000
バローホールディングス	400	2,677.00	1,070,800
サンドラッグ	400	3,040.00	1,216,000
めぶきフィナンシャルグループ	12,800	298.00	3,814,400
九州フィナンシャルグループ	1,700	483.00	821,100
ゆうちょ銀行	5,100	1,237.00	6,308,700
コンコルディア・フィナンシャルグループ	7,200	449.00	3,232,800
西日本フィナンシャルホールディングス	1,800	1,030.00	1,854,000
第四北越フィナンシャルグループ	300	3,340.00	1,002,000
新生銀行	1,300	1,577.00	2,050,100
あおぞら銀行	1,500	2,770.00	4,155,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	131,100	571.80	74,962,980
りそなホールディングス	67,100	497.10	33,355,410
三井住友トラスト・ホールディングス	19,100	4,094.00	78,195,400
三井住友フィナンシャルグループ	32,100	4,044.00	129,812,400
千葉銀行	6,000	639.00	3,834,000
群馬銀行	1,400	457.00	639,800

武蔵野銀行	200	2,298.00	459,600
千葉興業銀行	2,400	314.00	753,600
筑波銀行	2,500	203.00	507,500
東邦銀行	5,900	306.00	1,805,400
ふくおかフィナンシャルグループ	5,300	2,629.00	13,933,700
静岡銀行	1,400	879.00	1,230,600
スルガ銀行	4,300	545.00	2,343,500
八十二銀行	7,100	483.00	3,429,300
大垣共立銀行	500	2,373.00	1,186,500
北國銀行	800	3,595.00	2,876,000
滋賀銀行	500	2,656.00	1,328,000
南都銀行	400	2,157.00	862,800
百五銀行	2,700	368.00	993,600
京都銀行	200	4,890.00	978,000
紀陽銀行	1,700	1,607.00	2,731,900
ほくほくフィナンシャルグループ	3,600	1,233.00	4,438,800
広島銀行	4,300	597.00	2,567,100
山陰合同銀行	2,500	831.00	2,077,500
中国銀行	1,200	1,080.00	1,296,000
伊予銀行	1,600	621.00	993,600
百十四銀行	300	2,344.00	703,200
阿波銀行	200	2,884.00	576,800
大分銀行	200	3,560.00	712,000
宮崎銀行	300	2,815.00	844,500
琉球銀行	500	1,205.00	602,500
セブン銀行	3,300	321.00	1,059,300
みずほフィナンシャルグループ	474,900	174.80	83,012,520
山口フィナンシャルグループ	900	945.00	850,500
北洋銀行	11,900	295.00	3,510,500
東和銀行	1,300	765.00	994,500
トモニホールディングス	2,400	431.00	1,034,400
池田泉州ホールディングス	4,100	291.00	1,193,100
SBIホールディングス	800	2,538.00	2,030,400
ジャフコ	300	4,155.00	1,246,500
大和証券グループ本社	11,000	548.00	6,028,000

野村ホールディングス	34,100	419.50	14,304,950
岡三証券グループ	1,300	430.00	559,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,100	423.00	465,300
SOMPOホールディングス	2,100	4,157.00	8,729,700
MS&ADインシュアランスグループホール	5,600	3,405.00	19,068,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,200	2,204.00	4,848,800
第一生命ホールディングス	13,900	1,651.00	22,948,900
東京海上ホールディングス	4,600	5,518.00	25,382,800
T&Dホールディングス	4,700	1,211.00	5,691,700
クレディセゾン	800	1,504.00	1,203,200
日本証券金融	4,000	583.00	2,332,000
イオンフィナンシャルサービス	600	2,260.00	1,356,000
オリックス	9,300	1,637.50	15,228,750
日本取引所グループ	1,300	1,851.00	2,406,300
ヒューリック	800	1,047.00	837,600
野村不動産ホールディングス	700	2,138.00	1,496,600
東急不動産ホールディングス	2,100	624.00	1,310,400
飯田グループホールディングス	1,100	1,987.00	2,185,700
パーク24	300	2,334.00	700,200
三井不動産	2,600	2,702.50	7,026,500
三菱地所	3,800	1,937.50	7,362,500
東京建物	1,500	1,322.00	1,983,000
住友不動産	700	4,324.00	3,026,800
レオパレス21	3,300	228.00	752,400
イオンモール	500	1,813.00	906,500
ミクシィ	500	2,579.00	1,289,500
パーソルホールディングス	600	1,885.00	1,131,000
総合警備保障	200	4,865.00	973,000
カカクコム	300	2,135.00	640,500
ディー・エヌ・エー	600	1,603.00	961,800
博報堂DYホールディングス	1,200	1,793.00	2,151,600
電通	900	4,700.00	4,230,000
みらかホールディングス	500	2,802.00	1,401,000
オリエンタルランド	300	12,275.00	3,682,500

	ダスキン	400	2,681.00	1,072,400	
	ユー・エス・エス	600	2,110.00	1,266,000	
	サイバーエージェント	200	4,190.00	838,000	
	楽天	2,700	1,060.00	2,862,000	
	テクノプロ・ホールディングス	100	6,570.00	657,000	
	リクルートホールディングス	1,900	3,061.00	5,815,900	
	日本郵政	6,700	1,303.00	8,730,100	
	ベルシステム24ホールディングス	500	1,462.00	731,000	
	エイチ・アイ・エス	200	3,855.00	771,000	
	カナモト	200	2,773.00	554,600	
	セコム	700	9,305.00	6,513,500	
	メイテック	100	5,070.00	507,000	
	ベネッセホールディングス	500	2,891.00	1,445,500	
	小計 銘柄数：562			2,688,252,265	
	組入時価比率：97.8%			100.0%	
	合計			2,688,252,265	

(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。