



2023年4月期 (2022年10月21日～2023年4月20日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2023 (October 21, 2022 - April 20, 2023)

2023年5月31日  
 May 31, 2023

上場取引所 東証  
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信  
 コード番号 (1480)  
 連動対象指標 野村企業価値分配指数  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 1口  
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>  
 代表者名 CEO 兼代表取締役社長 小池 広靖  
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 長坂 智 TEL 0120-753104

Fund name: NEXT FUNDS Nomura Enterprise Value Allocation Index Exchange Traded Fund  
 Code: 1480  
 Underlying index: Nomura Enterprise Value Allocation Index  
 Primary invested assets: Stocks  
 Trading unit: 1 unit  
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>  
 Representative: Hiroyasu Koike, President & CEO  
 Contact person: Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team

有価証券報告書提出予定日 2023年7月19日  
 分配金支払開始日 2023年5月29日  
 Scheduled date of submission of securities report: July 19, 2023  
 Date of commencing dividend payment: May 29, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2023年4月期の運用状況 (2022年10月21日～2023年4月20日)

Management Status for Year ended April 2023 (from October 21, 2022 to April 20, 2023)

(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.	% %
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	8,522	(98.3)	149	(1.7)	8,671	(100.0)
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	6,876	(98.1)	132	(1.9)	7,008	(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
2023 年 4 月期 FY ended Apr. 2023	369	55	0	425
2022 年 10 月期 FY ended Oct. 2022	369	0	0	369

(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
2023 年 4 月期 FY ended Apr. 2023	8,784	112	8,671	20,403
2022 年 10 月期 FY ended Oct. 2022	7,101	92	7,008	18,973

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2023 年 4 月期 FY ended Apr. 2023	231
2022 年 10 月期 FY ended Oct. 2022	214

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 13 期 (2022 年 10 月 20 日現在) 13th Fiscal Year As of October 20, 2022	第 14 期 (2023 年 4 月 20 日現在) 14th Fiscal Year As of April 20, 2023
	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	141,090,277	159,293,453
株式 Stocks	6,876,528,520	8,522,376,460
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	2,178,920	3,495,457
未収入金 Accounts receivable - other	-	905,965
未収配当金 Accrued dividends receivable	73,864,855	93,515,166
差入委託証拠金 Margin deposits	7,827,450	5,298,097
流動資産合計 Total current assets	7,101,490,022	8,784,884,598
資産合計 Total assets	7,101,490,022	8,784,884,598
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	733,460	-
未払金 Accounts payable - other	938,300	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	79,053,740	98,181,468
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,963,264	2,054,409
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	7,067,691	7,395,778
未払利息 Accrued interest expenses	178	53
その他未払費用 Other accrued expenses	2,876,052	5,354,466
流動負債合計 Total current liabilities	92,632,685	112,986,174
負債合計 Total liabilities	92,632,685	112,986,174

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	4,747,287,910	5,462,034,828
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,261,569,427	3,209,863,596
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	326,296	141,798
元本等合計 Total principal and other	7,008,857,337	8,671,898,424
純資産合計 Total net assets	7,008,857,337	8,671,898,424
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	7,101,490,022	8,784,884,598

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第 13 期 自 2022 年 4 月 21 日 至 2022 年 10 月 20 日 13th Fiscal Year From April 21, 2022 to October 20, 2022	第 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 年 4 月 20 日 14th Fiscal Year From October 21, 2022 to April 20, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	91,092,910	110,308,720
受取利息 Interest income	-	18
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△117,892,500	531,536,049
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	2,381,050	15,906,758
その他収益 Other revenue	2,657	627
営業収益合計 Total operating revenue	△24,415,883	657,752,172
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	13,848	19,383
受託者報酬 Trustee fees	1,963,264	2,054,409
委託者報酬 Investment trust management fees	7,067,691	7,395,778
その他費用 Other expenses	2,743,298	2,842,825
営業費用合計	11,788,101	12,312,395

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△36,203,984	645,439,777
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△36,203,984	645,439,777
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△36,203,984	645,439,777
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	2,376,827,151	2,261,569,427
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	-	401,035,860
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from additional subscriptions for period	-	401,035,860
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	79,053,740	98,181,468
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,261,569,427	3,209,863,596

(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、2022年10月21日から2023年4月20日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第13期 2022年10月20日現在	第14期 2023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 369,410 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 425,028 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 18,973 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 20,403 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 13 期 自 2022 年 4 月 21 日 至 2022 年 10 月 20 日	第 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 年 4 月 20 日																																																												
<p>1. 分配金の計算過程</p> <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>91,081,719 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>72,570 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>91,154,289 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>11,774,253 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>79,380,036 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>79,053,740 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>326,296 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>369,410 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>214 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用                      その他費用のうち 2,353,236 円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>	項目			当期配当等収益額	A	91,081,719 円	分配準備積立金	B	72,570 円	配当等収益合計額	C=A+B	91,154,289 円	経費	D	11,774,253 円	収益分配可能額	E=C-D	79,380,036 円	収益分配金	F	79,053,740 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	326,296 円	口数	H	369,410 口	1 口当たり分配金	I=F/H	214 円	<p>1. 分配金の計算過程</p> <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>110,289,982 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>326,296 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>110,616,278 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>12,293,012 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>98,323,266 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>98,181,468 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>141,798 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>425,028 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>231 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用                      その他費用のうち 2,465,224 円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>	項目			当期配当等収益額	A	110,289,982 円	分配準備積立金	B	326,296 円	配当等収益合計額	C=A+B	110,616,278 円	経費	D	12,293,012 円	収益分配可能額	E=C-D	98,323,266 円	収益分配金	F	98,181,468 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	141,798 円	口数	H	425,028 口	1 口当たり分配金	I=F/H	231 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	91,081,719 円																																																											
分配準備積立金	B	72,570 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	91,154,289 円																																																											
経費	D	11,774,253 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	79,380,036 円																																																											
収益分配金	F	79,053,740 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	326,296 円																																																											
口数	H	369,410 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	214 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	110,289,982 円																																																											
分配準備積立金	B	326,296 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	110,616,278 円																																																											
経費	D	12,293,012 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	98,323,266 円																																																											
収益分配金	F	98,181,468 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	141,798 円																																																											
口数	H	425,028 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	231 円																																																											

(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 13 期 自 2022 年 4 月 21 日 至 2022 年 10 月 20 日	第 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 年 4 月 20 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。</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>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>

○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。	
--	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 13 期 2022 年 10 月 20 日現在	第 14 期 2023 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 13 期 自 2022 年 4 月 21 日 至 2022 年 10 月 20 日	第 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 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 13 期 自 2022 年 4 月 21 日 至 2022 年 10 月 20 日	第 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 年 4 月 20 日
期首元本額 4,747,287,910 円	期首元本額 4,747,287,910 円
期中追加設定元本額 0 円	期中追加設定元本額 714,746,918 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 13 期 自 2022 年 4 月 21 日 至 2022 年 10 月 20 日	第 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 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	△111,281,290	523,341,496
合計	△111,281,290	523,341,496

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 13 期(2022 年 10 月 20 日現在)			第 14 期(2023 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	129,163,950	-	130,617,000	143,268,623	-	146,772,000
			1,445,460			3,495,457

合計	129,163,950	-	130,617,000	1,445,460	143,268,623	-	146,772,000	3,495,457
----	-------------	---	-------------	-----------	-------------	---	-------------	-----------

(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(2023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	コムシスホールディングス	2,800	2,495.00	6,986,000	
		大林組	16,900	1,032.00	17,440,800	
		清水建設	13,600	763.00	10,376,800	
		長谷工コーポレーション	5,100	1,590.00	8,109,000	
		鹿島建設	11,100	1,677.00	18,614,700	
		西松建設	1,100	3,500.00	3,850,000	
		住友林業	3,400	2,811.00	9,557,400	
		大和ハウス工業	13,300	3,212.00	42,719,600	
		積水ハウス	14,200	2,750.00	39,050,000	
		エクシオグループ	2,300	2,460.00	5,658,000	
		日清製粉グループ本社	4,800	1,625.00	7,800,000	
		森永製菓	900	3,800.00	3,420,000	
		山崎製パン	2,400	1,584.00	3,801,600	
		カルビー	2,200	2,859.00	6,289,800	
		ヤクルト本社	3,100	9,840.00	30,504,000	
		明治ホールディングス	6,000	3,240.00	19,440,000	
		日本ハム	2,000	3,910.00	7,820,000	
		アサヒグループホールディングス	10,000	5,063.00	50,630,000	
		キリンホールディングス	19,700	2,178.50	42,916,450	
		宝ホールディングス	3,700	1,046.00	3,870,200	
サントリー食品インターナショナル	3,100	5,030.00	15,593,000			
キッコーマン	3,600	7,310.00	26,316,000			
味の素	11,300	4,859.00	54,906,700			
カゴメ	2,000	3,170.00	6,340,000			



ニチレイ	2,500	2,735.00	6,837,500
日清食品ホールディングス	1,600	12,320.00	19,712,000
日本たばこ産業	27,400	2,879.50	78,898,300
東洋紡	1,900	1,019.00	1,936,100
帝人	4,500	1,478.00	6,651,000
ゴールドウイン	700	12,230.00	8,561,000
レンゴー	4,500	868.00	3,906,000
クラレ	7,600	1,249.00	9,492,400
旭化成	30,500	948.70	28,935,350
レゾナック・ホールディングス	4,100	2,200.00	9,020,000
住友化学	35,900	461.00	16,549,900
日産化学	2,900	5,990.00	17,371,000
東ソー	6,300	1,802.00	11,352,600
トクヤマ	1,600	2,149.00	3,438,400
デンカ	1,900	2,724.00	5,175,600
信越化学工業	46,100	4,046.00	186,520,600
エア・ウォーター	3,900	1,671.00	6,516,900
カネカ	1,100	3,510.00	3,861,000
三菱瓦斯化学	4,100	1,958.00	8,027,800
三井化学	4,500	3,425.00	15,412,500
東京応化工業	800	7,030.00	5,624,000
三菱ケミカルグループ	32,100	799.40	25,660,740
ダイセル	6,300	1,029.00	6,482,700
住友ベークライト	800	5,060.00	4,048,000
積水化学工業	9,200	1,885.00	17,342,000
日本ゼオン	3,000	1,427.00	4,281,000
アイカ工業	1,200	3,060.00	3,672,000
ADEKA	1,800	2,274.00	4,093,200
花王	12,000	5,350.00	64,200,000
日本ペイントホールディングス	21,000	1,237.00	25,977,000
D I C	1,800	2,454.00	4,417,200
富士フイルムホールディングス	8,700	6,851.00	59,603,700
ライオン	5,800	1,445.00	8,381,000
ミルボン	600	5,590.00	3,354,000
コーセー	900	16,150.00	14,535,000

ポーラ・オルビスホールディングス	2,200	1,822.00	4,008,400
小林製薬	1,300	8,390.00	10,907,000
タカラバイオ	1,200	1,746.00	2,095,200
日東電工	3,900	8,440.00	32,916,000
エフピコ	1,100	3,270.00	3,597,000
ユニ・チャーム	9,500	5,409.00	51,385,500
協和キリン	6,400	3,080.00	19,712,000
武田薬品工業	32,100	4,482.00	143,872,200
アステラス製薬	47,500	2,000.00	95,000,000
住友ファーマ	3,600	836.00	3,009,600
塩野義製薬	6,700	6,030.00	40,401,000
日本新薬	1,200	6,070.00	7,284,000
中外製薬	15,500	3,268.00	50,654,000
エーザイ	6,500	7,621.00	49,536,500
ロート製薬	4,900	2,804.00	13,739,600
小野薬品工業	9,500	2,682.00	25,479,000
参天製薬	9,400	1,071.00	10,067,400
JCRファーマ	1,600	1,467.00	2,347,200
第一三共	42,600	4,765.00	202,989,000
大塚ホールディングス	10,300	4,432.00	45,649,600
出光興産	4,900	2,845.00	13,940,500
ENEOSホールディングス	81,000	473.90	38,385,900
TOYO TIRE	2,600	1,570.00	4,082,000
ブリヂストン	14,400	5,336.00	76,838,400
住友ゴム工業	4,000	1,201.00	4,804,000
AGC	4,700	5,010.00	23,547,000
東海カーボン	4,500	1,215.00	5,467,500
TOTO	3,600	4,555.00	16,398,000
日本碍子	6,300	1,769.00	11,144,700
日本特殊陶業	3,700	2,730.00	10,101,000
フジミインコーポレーテッド	400	6,840.00	2,736,000
JFEホールディングス	12,200	1,654.00	20,178,800
住友金属鉱山	5,900	5,282.00	31,163,800
DOWAホールディングス	1,300	4,355.00	5,661,500
住友電気工業	17,700	1,688.50	29,886,450

SUMCO	7,900	1,919.00	15,160,100
三和ホールディングス	4,700	1,429.00	6,716,300
リンナイ	2,800	3,275.00	9,170,000
三浦工業	2,000	3,380.00	6,760,000
FUJII	1,700	2,233.00	3,796,100
ディスコ	2,300	14,590.00	33,557,000
ナブテスコ	2,800	3,170.00	8,876,000
SMC	1,600	68,570.00	109,712,000
小松製作所	22,400	3,288.00	73,651,200
住友重機械工業	2,800	3,205.00	8,974,000
日立建機	2,800	3,145.00	8,806,000
クボタ	24,700	2,000.50	49,412,350
荏原製作所	2,200	6,000.00	13,200,000
ダイキン工業	6,100	23,235.00	141,733,500
栗田工業	2,600	6,050.00	15,730,000
ダイフク	7,500	2,440.00	18,300,000
マキタ	5,800	3,205.00	18,589,000
ブラザー工業	5,900	2,071.00	12,218,900
ミネベアミツミ	8,500	2,427.00	20,629,500
日立製作所	24,700	7,683.00	189,770,100
東芝	10,000	4,402.00	44,020,000
三菱電機	46,800	1,617.00	75,675,600
富士電機	3,200	5,120.00	16,384,000
安川電機	5,800	5,490.00	31,842,000
オムロン	4,800	7,643.00	36,686,400
ジーエス・ユアサコーポレーション	1,600	2,284.00	3,654,400
日本電気	6,500	5,130.00	33,345,000
富士通	4,500	18,205.00	81,922,500
ルネサスエレクトロニクス	26,300	1,858.50	48,878,550
セイコーエプソン	7,100	1,981.00	14,065,100
エレコム	1,000	1,257.00	1,257,000
シャープ	5,400	961.00	5,189,400
アンリツ	3,500	1,222.00	4,277,000
富士通ゼネラル	1,400	3,885.00	5,439,000
TDK	9,800	4,645.00	45,521,000

ヒロセ電機	800	17,850.00	14,280,000
横河電機	5,800	2,178.00	12,632,400
アズビル	2,800	3,665.00	10,262,000
日本光電工業	1,900	3,700.00	7,030,000
堀場製作所	800	7,520.00	6,016,000
アドバンテスト	5,300	11,620.00	61,586,000
キーエンス	4,700	62,530.00	293,891,000
シスメックス	3,600	8,920.00	32,112,000
レーザーテック	1,900	20,720.00	39,368,000
日本電子	1,000	3,980.00	3,980,000
ファナック	25,300	4,664.00	117,999,200
ローム	2,200	10,630.00	23,386,000
浜松ホトニクス	3,700	7,120.00	26,344,000
新光電気工業	1,700	4,005.00	6,808,500
京セラ	8,000	7,022.00	56,176,000
太陽誘電	3,000	4,230.00	12,690,000
村田製作所	14,300	7,862.00	112,426,600
S C R E E Nホールディングス	1,000	10,850.00	10,850,000
キヤノン	25,100	2,985.50	74,936,050
東京エレクトロン	12,200	15,395.00	187,819,000
トヨタ紡織	1,400	2,096.00	2,934,400
豊田自動織機	3,800	7,540.00	28,652,000
デンソー	11,100	7,458.00	82,783,800
いすゞ自動車	13,600	1,546.00	21,025,600
トヨタ自動車	114,100	1,813.50	206,920,350
アイシン	3,800	3,650.00	13,870,000
スズキ	8,900	4,660.00	41,474,000
S U B A R U	14,300	2,121.50	30,337,450
ヤマハ発動機	6,900	3,440.00	23,736,000
シマノ	1,900	23,090.00	43,871,000
テルモ	15,500	3,953.00	61,271,500
島津製作所	5,500	4,210.00	23,155,000
東京精密	1,000	5,010.00	5,010,000
トプコン	2,500	1,893.00	4,732,500
オリンパス	27,300	2,450.50	66,898,650

HOYA	9,700	14,230.00	138,031,000
朝日インテック	5,700	2,416.00	13,771,200
メニコン	1,500	2,796.00	4,194,000
バンダイナムコホールディングス	14,900	2,990.00	44,551,000
ビジョン	3,000	2,060.00	6,180,000
任天堂	28,800	5,516.00	158,860,800
グローブライド	400	2,429.00	971,600
関西電力	17,700	1,330.00	23,541,000
大阪瓦斯	9,200	2,166.00	19,927,200
ヤマトホールディングス	6,900	2,291.00	15,807,900
S Gホールディングス	8,500	1,911.00	16,243,500
N I P P O N E X P R E S S ホールディング	1,800	7,830.00	14,094,000
日本郵船	12,300	3,409.00	41,930,700
三菱倉庫	1,400	3,240.00	4,536,000
日鉄ソリューションズ	800	3,620.00	2,896,000
T I S	4,900	3,675.00	18,007,500
ネクソン	12,600	3,215.00	40,509,000
インターネットイニシアティブ	2,500	2,738.00	6,845,000
野村総合研究所	8,400	3,275.00	27,510,000
Zホールディングス	91,400	376.30	34,393,820
トレンドマイクロ	3,600	6,700.00	24,120,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,400	3,315.00	7,956,000
大塚商会	2,800	4,820.00	13,496,000
ネットワンシステムズ	2,100	3,140.00	6,594,000
B I P R O G Y	1,800	3,255.00	5,859,000
日本電信電話	62,100	4,024.00	249,890,400
K D D I	41,700	4,125.00	172,012,500
ソフトバンク	69,900	1,527.50	106,772,250
エヌ・ティ・ティ・データ	16,800	1,845.00	30,996,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,300	6,370.00	14,651,000
カプコン	4,400	4,950.00	21,780,000
S C S K	3,800	1,975.00	7,505,000
コナミグループ	2,500	6,360.00	15,900,000
双日	4,400	2,885.00	12,694,000

神戸物産	3,000	3,740.00	11,220,000
伊藤忠商事	31,900	4,469.00	142,561,100
丸紅	39,600	1,934.50	76,606,200
豊田通商	5,200	5,720.00	29,744,000
三井物産	39,100	4,242.00	165,862,200
住友商事	28,300	2,449.00	69,306,700
三菱商事	32,000	4,992.00	159,744,000
岩谷産業	1,100	6,430.00	7,073,000
ミスミグループ本社	5,200	3,295.00	17,134,000
エービーシー・マート	700	7,870.00	5,509,000
くら寿司	500	3,370.00	1,685,000
日本マクドナルドホールディングス	1,900	5,610.00	10,659,000
セリア	1,000	2,420.00	2,420,000
ジズホールディングス	300	3,100.00	930,000
Monotaro	6,300	1,885.00	11,875,500
マツキョココカラ&カンパニー	2,700	7,190.00	19,413,000
ZOZO	3,000	3,045.00	9,135,000
物語コーポレーション	700	2,809.00	1,966,300
ウエルシアホールディングス	2,300	2,805.00	6,451,500
コスモス薬品	500	12,660.00	6,330,000
セブン&アイ・ホールディングス	18,100	6,009.00	108,762,900
ツルハホールディングス	1,000	8,770.00	8,770,000
トリドールホールディングス	1,300	2,875.00	3,737,500
クスリのアオキホールディングス	400	6,420.00	2,568,000
FOOD & LIFE COMPANYIE	2,800	3,285.00	9,198,000
コーナン商事	700	3,590.00	2,513,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	10,200	2,560.00	26,112,000
ゼンショーホールディングス	2,300	4,205.00	9,671,500
ワークマン	300	5,670.00	1,701,000
スギホールディングス	900	5,830.00	5,247,000
しまむら	600	12,650.00	7,590,000
ケーズホールディングス	4,200	1,177.00	4,943,400
ヤマダホールディングス	17,400	466.00	8,108,400
ニトリホールディングス	1,900	17,485.00	33,221,500

ファーストリテイリング	1,600	32,550.00	52,080,000
サンドラッグ	1,800	3,675.00	6,615,000
三井住友フィナンシャルグループ	33,300	5,728.00	190,742,400
セブン銀行	14,600	280.00	4,088,000
SBIホールディングス	6,300	2,694.00	16,972,200
大和証券グループ本社	35,800	631.00	22,589,800
東京海上ホールディングス	47,800	2,707.50	129,418,500
東京センチュリー	900	4,545.00	4,090,500
オリックス	32,200	2,316.00	74,575,200
三菱HCキャピタル	16,300	701.00	11,426,300
大東建託	1,700	13,430.00	22,831,000
ヒューリック	7,800	1,133.00	8,837,400
野村不動産ホールディングス	2,900	3,055.00	8,859,500
サムティ	600	2,133.00	1,279,800
オープンハウスグループ	1,700	5,160.00	8,772,000
飯田グループホールディングス	3,700	2,280.00	8,436,000
三井不動産	22,300	2,524.50	56,296,350
三菱地所	28,700	1,619.50	46,479,650
UTグループ	700	2,545.00	1,781,500
エス・エム・エス	1,700	3,095.00	5,261,500
パーソルホールディングス	4,700	2,698.00	12,680,600
カカクコム	3,500	1,849.00	6,471,500
ディップ	800	3,325.00	2,660,000
ベネフィット・ワン	1,800	1,826.00	3,286,800
エムスリー	7,200	3,388.00	24,393,600
博報堂DYホールディングス	5,700	1,535.00	8,749,500
エスプール	1,500	630.00	945,000
インフォマート	4,700	283.00	1,330,100
H. U. グループホールディングス	1,300	2,683.00	3,487,900
ビー・エム・エル	500	2,961.00	1,480,500
サイバーエージェント	10,600	1,182.00	12,529,200
テクノプロ・ホールディングス	2,900	3,615.00	10,483,500
Keeper 技研	300	4,795.00	1,438,500
リクルートホールディングス	35,500	3,791.00	134,580,500
インソース	1,100	1,226.00	1,348,600

	ベিকাレント・コンサルティング	3,500	4,915.00	17,202,500	
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,400	2,072.00	2,900,800	
	アンビスホールディングス	400	3,045.00	1,218,000	
	リログループ	3,000	2,018.00	6,054,000	
	セコム	5,400	8,496.00	45,878,400	
	小計 銘柄数：272			8,522,376,460	
	組入時価比率：98.3%			100.0%	
	合計			8,522,376,460	

(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(2023 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。