



2023年10月期 (2023年4月8日～2023年10月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2023 (April 8, 2023 – October 7, 2023)

2023年11月16日
 November 16, 2023

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信
 コード番号 (1591)
 連動対象指標 JPX日経インデックス400
 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 JPX-Nikkei Index 400 Exchange Traded Fund
 Code: 1591
 Underlying index: JPX-Nikkei Index 400
 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12月27日
 分配金支払開始日 2023年11月15日
 Scheduled date of submission of securities report: December 27, 2023
 Date of commencing dividend payment: November 15, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2023年10月期の運用状況 (2023年4月8日～2023年10月7日)

Management Status for Year ended October 2023 (from April 8, 2023 to October 7, 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10月期 FY ended Oct. 2023	1,321,408	(97.6)	33,141	(2.4)	1,354,550	(100.0)
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	1,146,879	(97.5)	29,367	(2.5)	1,176,247	(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 10 月期 FY ended Oct. 2023	66,222	599	582	66,240
2023 年 4 月期 FY ended Apr. 2023	66,597	299	674	66,222

(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 10 月期 FY ended Oct. 2023	1,492,530	137,980	1,354,550	20,449
2023 年 4 月期 FY ended Apr. 2023	1,283,658	107,410	1,176,247	17,762

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2023 年 10 月期 FY ended Oct. 2023	220
2023 年 4 月期 FY ended Apr. 2023	240

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19期 (2023年4月7日現在) 19th Fiscal Year As of April 7, 2023	第20期 (2023年10月7日現在) 20th Fiscal Year As of October 7, 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	119,506,154,345	153,710,687,418
株式 Stocks	1,146,879,995,410	1,321,408,569,950
未収配当金 Accrued dividends receivable	14,031,986,546	13,137,754,282
未収利息 Accrued interest	1,333,190	4,767,998
その他未収収益 Other accrued revenue	367,634,805	112,187,516
差入委託証拠金 Margin deposits	2,871,226,720	4,156,356,100
流動資産合計 Total current assets	1,283,658,331,016	1,492,530,323,264
資産合計 Total assets	1,283,658,331,016	1,492,530,323,264
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	541,076,020	1,482,847,050
未払金 Accounts payable - other	501,316,980	737,326,950
未払収益分配金 Unpaid dividends	15,893,478,960	14,572,804,840
未払受託者報酬 Trustee fees payable	169,370,401	194,693,263
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	484,879,854	558,677,916
未払利息 Accrued interest expenses	15,945	257,222
有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities lent	89,691,932,286	120,038,318,674
その他未払費用 Other accrued expenses	128,701,445	395,317,283
流動負債合計	107,410,771,891	137,980,243,198

Total current liabilities		
負債合計 Total liabilities	107,410,771,891	137,980,243,198
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	769,906,609,954	770,106,495,772
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	406,340,949,171	584,443,584,294
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	38,631,407	71,787,594
元本等合計 Total principal and other	1,176,247,559,125	1,354,550,080,066
純資産合計 Total net assets	1,176,247,559,125	1,354,550,080,066
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	1,283,658,331,016	1,492,530,323,264

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第19期 自 2022年10月8日 至 2023年4月7日 19th Fiscal Year From October 8, 2022 to April 7, 2023	第20期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日 20th Fiscal Year From April 8, 2023 to October 7, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	16,402,485,094	15,513,968,355
受取利息 Interest income	14,114	-
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	37,228,474,590	172,656,731,302
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	1,332,960,969	4,304,185,780
その他収益 Other revenue	459,537,122	177,720,935
営業収益合計 Total operating revenue	55,423,471,889	192,652,606,372
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	3,200,994	8,014,213
受託者報酬 Trustee fees	169,370,401	194,693,263
委託者報酬 Investment trust management fees	484,879,854	558,677,916

その他費用 Other expenses	291,383,273	324,342,871
営業費用合計 Total operating expenses	948,834,522	1,085,728,263
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	54,474,637,367	191,566,878,109
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	54,474,637,367	191,566,878,109
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	54,474,637,367	191,566,878,109
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	370,187,170,508	406,340,949,171
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	1,740,658,632	5,583,648,294
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	1,740,658,632	5,583,648,294
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	4,168,038,376	4,475,086,440
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from partial exchange	4,168,038,376	4,475,086,440
分配金 Dividends	15,893,478,960	14,572,804,840
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	406,340,949,171	584,443,584,294

(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、2023年4月8日から2023年

10月7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19期 2023年4月7日現在	第20期 2023年10月7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 66,222,829 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 66,240,022 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 17,762 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 20,449 円
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 84,058,738,350 円	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 116,308,241,050 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自2022年10月8日 至2023年4月7日	第20期 自2023年4月8日 至2023年10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>16,858,835,336 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>18,908,559 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>16,877,743,895 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>945,633,528 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>15,932,110,367 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>15,893,478,960 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>38,631,407 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>66,222,829 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>240 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	16,858,835,336 円	分配準備積立金	B	18,908,559 円	配当等収益合計額	C=A+B	16,877,743,895 円	経費	D	945,633,528 円	収益分配可能額	E=C-D	15,932,110,367 円	収益分配金	F	15,893,478,960 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	38,631,407 円	口数	H	66,222,829 口	1口当たり分配金	I=F/H	240 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>15,683,675,077 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>38,631,407 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>15,722,306,484 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,077,714,050 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>14,644,592,434 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>14,572,804,840 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>71,787,594 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>66,240,022 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>220 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	15,683,675,077 円	分配準備積立金	B	38,631,407 円	配当等収益合計額	C=A+B	15,722,306,484 円	経費	D	1,077,714,050 円	収益分配可能額	E=C-D	14,644,592,434 円	収益分配金	F	14,572,804,840 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	71,787,594 円	口数	H	66,240,022 口	1口当たり分配金	I=F/H	220 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	16,858,835,336 円																																																											
分配準備積立金	B	18,908,559 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	16,877,743,895 円																																																											
経費	D	945,633,528 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	15,932,110,367 円																																																											
収益分配金	F	15,893,478,960 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	38,631,407 円																																																											
口数	H	66,222,829 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	240 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	15,683,675,077 円																																																											
分配準備積立金	B	38,631,407 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	15,722,306,484 円																																																											
経費	D	1,077,714,050 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	14,644,592,434 円																																																											
収益分配金	F	14,572,804,840 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	71,787,594 円																																																											
口数	H	66,240,022 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	220 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち233,898,151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261,345,047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19期 自2022年10月8日 至2023年4月7日	第20期 自2023年4月8日 至2023年10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。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

<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なっております。</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なっております。</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なっております。</p>	
---	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第19期 2023年4月7日現在	第20期 2023年10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。 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。</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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第19期 自 2022年10月8日 至 2023年4月7日	第20期 自 2023年4月8日 至 2023年10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19期 自 2022年10月8日 至 2023年4月7日	第20期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日
期首元本額 774,263,465,080円	期首元本額 769,906,609,954円
期中追加設定元本額 3,485,974,718円	期中追加設定元本額 6,970,751,958円
期中一部交換元本額 7,842,829,844円	期中一部交換元本額 6,770,866,140円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第19期 自 2022年10月8日 至 2023年4月7日	第20期 自 2023年4月8日 至 2023年10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	36,469,875,112	161,169,929,959
合計	36,469,875,112	161,169,929,959

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19期(2023年4月7日現在)	第20期(2023年10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)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	29,593,556,720	—	29,055,190,000	△541,076,020	34,409,580,600	—	32,929,395,000	△1,482,847,050
合計	29,593,556,720	—	29,055,190,000	△541,076,020	34,409,580,600	—	32,929,395,000	△1,482,847,050

(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10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	ニッセイ	810,600	710.30	575,769,180	
		三井松島ホールディングス	36,700	2,568.00	94,245,600	貸付有価証券 23,500株
		I N P E X	2,998,000	1,916.50	5,745,667,000	貸付有価証券 1,556,000株 (11,500株)
		ウエストホールディングス	69,700	3,080.00	214,676,000	貸付有価証券 46,600株 (41,700株)
		ショーボンドホールディングス	110,400	5,763.00	636,235,200	貸付有価証券 5,300株
		ミライト・ワン	268,100	1,920.50	514,886,050	
		タマホーム	50,900	3,430.00	174,587,000	貸付有価証券 28,700株 (400株)
		安藤・間	469,600	1,117.00	524,543,200	貸付有価証券 5,900株
		コムシスホールディングス	258,800	3,047.00	788,563,600	
		大成建設	530,600	5,113.00	2,712,957,800	貸付有価証券 44,200株
		大林組	2,027,900	1,295.50	2,627,144,450	貸付有価証券 5,400株
		清水建設	1,607,800	1,022.50	1,643,975,500	
		長谷工コーポレーション	585,300	1,867.50	1,093,047,750	貸付有価証券 26,000株
鹿島建設	1,257,300	2,369.50	2,979,172,350	貸付有価証券		

				11,400株
住友林業	490,000	3,653.00	1,789,970,000	貸付有価証券 158,900株(25,200株)
大和ハウス工業	1,567,800	3,998.00	6,268,064,400	貸付有価証券 15,400株
積水ハウス	1,719,200	2,828.50	4,862,757,200	貸付有価証券 1,017,200株
関電工	310,700	1,347.00	418,512,900	
エクシオグループ	261,200	2,992.50	781,641,000	貸付有価証券 3,000株
九電工	137,900	4,657.00	642,200,300	貸付有価証券 4,900株
インフロニア・ホールディングス	594,200	1,508.50	896,350,700	
森永製菓	101,500	5,347.00	542,720,500	
カルビー	260,600	2,746.50	715,737,900	貸付有価証券 40,700株
森永乳業	103,400	5,606.00	579,660,400	貸付有価証券 400株
ヤクルト本社	813,600	3,756.00	3,055,881,600	
明治ホールディングス	697,900	3,748.00	2,615,729,200	
日本ハム	222,600	4,412.00	982,111,200	貸付有価証券 14,900株
アサヒグループホールディングス	1,315,400	5,514.00	7,253,115,600	貸付有価証券 880,600株(63,900株)
キリンホールディングス	2,371,300	2,086.50	4,947,717,450	貸付有価証券 1,120,300株
宝ホールディングス	388,600	1,241.50	482,446,900	貸付有価証券 25,400株
サントリー食品インターナショナル	400,800	4,545.00	1,821,636,000	貸付有価証券 107,100株
キッコーマン	377,300	8,195.00	3,091,973,500	貸付有価証券 2,400株
味の素	1,374,500	5,900.00	8,109,550,000	
ニチレイ	260,800	3,231.00	842,644,800	
東洋水産	287,700	5,872.00	1,689,374,400	
日清食品ホールディングス	200,100	13,100.00	2,621,310,000	
日本たばこ産業	3,459,200	3,303.00	11,425,737,600	貸付有価証券 808,000株(75,100株)
東レ	3,880,000	733.00	2,844,040,000	貸付有価証券 3,100株
ゴールドウイン	102,600	10,040.00	1,030,104,000	

王子ホールディングス	2,412,400	620.20	1,496,170,480	貸付有価証券 46,000株(24,900 株)
レンゴー	527,400	994.90	524,710,260	貸付有価証券 2,900株
クラレ	843,900	1,672.50	1,411,422,750	貸付有価証券 335,300株(57,400 株)
旭化成	3,616,500	908.40	3,285,228,600	
住友化学	4,296,100	389.60	1,673,760,560	貸付有価証券 148,600株
日産化学	272,000	6,325.00	1,720,400,000	貸付有価証券 100株
東ソー	773,100	1,841.50	1,423,663,650	
トクヤマ	187,000	2,192.50	409,997,500	
デンカ	210,600	2,690.00	566,514,000	貸付有価証券 17,600株
信越化学工業	4,262,700	4,279.00	18,240,093,300	貸付有価証券 45,700株
エア・ウォーター	546,400	1,842.50	1,006,742,000	
日本酸素ホールディング ス	561,800	3,513.00	1,973,603,400	
三菱瓦斯化学	432,400	1,963.00	848,801,200	貸付有価証券 2,700株
三井化学	477,500	3,720.00	1,776,300,000	
東京応化工業	92,100	8,877.00	817,571,700	貸付有価証券 61,500株
三菱ケミカルグループ	3,908,000	888.50	3,472,258,000	貸付有価証券 182,900株
KHネオケム	88,300	2,206.00	194,789,800	貸付有価証券 8,900株
ダイセル	806,500	1,195.50	964,170,750	
住友ベークライト	85,800	6,547.00	561,732,600	
積水化学工業	1,174,000	2,083.00	2,445,442,000	貸付有価証券 39,500株
日本ゼオン	347,300	1,531.50	531,889,950	貸付有価証券 10,200株
アイカ工業	146,100	3,424.00	500,246,400	
扶桑化学工業	53,700	3,970.00	213,189,000	貸付有価証券 300株
ADEKA	201,900	2,574.00	519,690,600	
日油	179,100	6,026.00	1,079,256,600	貸付有価証券 100株
花王	1,309,500	5,505.00	7,208,797,500	貸付有価証券 602,300株(38,600 株)

日本ペイントホールディングス	3,075,100	1,008.00	3,099,700,800	貸付有価証券 951,900株 (146,200株)
関西ペイント	464,300	2,102.00	975,958,600	
太陽ホールディングス	88,100	2,461.00	216,814,100	
富士フイルムホールディングス	1,112,600	8,530.00	9,490,478,000	
資生堂	1,210,700	5,197.00	6,292,007,900	貸付有価証券 462,400株
ライオン	759,000	1,427.00	1,083,093,000	貸付有価証券 176,700株
コーセー	117,900	10,915.00	1,286,878,500	貸付有価証券 11,600株 (100株)
小林製薬	168,700	6,728.00	1,135,013,600	貸付有価証券 30,400株
タカラバイオ	156,200	1,337.00	208,839,400	貸付有価証券 20,900株
デクセリアルズ	158,500	3,638.00	576,623,000	貸付有価証券 20,800株
日東電工	420,900	9,462.00	3,982,555,800	貸付有価証券 4,100株
ニフコ	209,200	3,900.00	815,880,000	貸付有価証券 100株
ユニ・チャーム	1,208,000	5,302.00	6,404,816,000	貸付有価証券 345,900株
協和キリン	700,500	2,567.00	1,798,183,500	貸付有価証券 265,400株
武田薬品工業	4,489,600	4,484.00	20,131,366,400	
アステラス製薬	5,477,500	2,030.00	11,119,325,000	
塩野義製薬	731,000	6,513.00	4,761,003,000	貸付有価証券 200株
日本新薬	136,700	6,008.00	821,293,600	
中外製薬	1,815,100	4,434.00	8,048,153,400	貸付有価証券 655,000株 (36,700株)
エーザイ	705,300	8,210.00	5,790,513,000	貸付有価証券 2,100株
ロート製薬	561,700	3,656.00	2,053,575,200	
小野薬品工業	1,118,700	2,782.50	3,112,782,750	貸付有価証券 35,500株
JCRファーマ	196,300	1,275.50	250,380,650	貸付有価証券 33,500株
第一三共	4,466,800	3,963.00	17,701,928,400	貸付有価証券 3,900株
大塚ホールディングス	1,206,100	5,108.00	6,160,758,800	貸付有価証券 501,300株 (45,800株)

ペプチドリーム	281,100	1,488.00	418,276,800	貸付有価証券 90,400株
出光興産	644,000	3,077.00	1,981,588,000	
E N E O Sホールディングス	9,835,600	522.00	5,134,183,200	貸付有価証券 70,000株
コスモエネルギーホールディングス	229,200	4,780.00	1,095,576,000	
横浜ゴム	293,300	2,938.50	861,862,050	貸付有価証券 113,700株 (7,100株)
TOYO TIRE	333,200	2,234.00	744,368,800	貸付有価証券 115,900株
ブリヂストン	1,697,300	5,855.00	9,937,691,500	貸付有価証券 898,400株 (28,800株)
住友ゴム工業	568,700	1,595.50	907,360,850	貸付有価証券 232,000株
A G C	540,900	5,011.00	2,710,449,900	貸付有価証券 60,000株
T O T O	382,600	3,763.00	1,439,723,800	
日本碍子	674,200	1,886.00	1,271,541,200	貸付有価証券 400株
日本特殊陶業	441,400	3,260.00	1,438,964,000	
MARUWA	21,400	23,380.00	500,332,000	
フジミインコーポレーテッド	138,500	3,035.00	420,347,500	
ニチアス	146,600	2,961.00	434,082,600	
日本製鉄	2,671,000	3,326.00	8,883,746,000	貸付有価証券 1,290,200株 (979,600株)
J F Eホールディングス	1,659,000	2,083.50	3,456,526,500	貸付有価証券 59,900株
東京製鐵	167,600	1,636.00	274,193,600	貸付有価証券 1,700株
丸一鋼管	181,600	3,623.00	657,936,800	
日本冶金工業	43,600	4,235.00	184,646,000	貸付有価証券 100株
大紀アルミニウム工業所	84,900	1,209.00	102,644,100	貸付有価証券 44,600株
三井金属鉱業	173,500	3,662.00	635,357,000	貸付有価証券 6,800株
住友金属鉱山	691,600	4,136.00	2,860,457,600	貸付有価証券 8,300株
D O W Aホールディングス	134,000	4,465.00	598,310,000	貸付有価証券 15,800株 (1,000株)
住友電気工業	2,059,800	1,665.50	3,430,596,900	貸付有価証券 72,100株

AREホールディングス	241,300	1,831.00	441,820,300	貸付有価証券 9,800株
SUMCO	1,059,900	1,910.50	2,024,938,950	貸付有価証券 710,100株 (181,800 株)
三和ホールディングス	549,400	1,976.00	1,085,614,400	
リンナイ	324,400	2,802.50	909,131,000	貸付有価証券 700株
三浦工業	243,800	3,038.00	740,664,400	
アマダ	931,700	1,441.50	1,343,045,550	貸付有価証券 44,800株
FUJII	253,800	2,328.50	590,973,300	
DMG森精機	354,000	2,432.50	861,105,000	貸付有価証券 237,100株 (78,200 株)
ディスコ	281,100	27,520.00	7,735,872,000	
ナブテスコ	366,400	2,672.00	979,020,800	貸付有価証券 175,800株
SMC	189,400	67,330.00	12,752,302,000	貸付有価証券 300株
小松製作所	2,736,200	3,769.00	10,312,737,800	貸付有価証券 52,200株
住友重機械工業	345,400	3,514.00	1,213,735,600	貸付有価証券 193,500株
日立建機	232,500	4,208.00	978,360,000	
ローツェ	30,500	9,390.00	286,395,000	貸付有価証券 19,700株
クボタ	3,064,200	2,131.50	6,531,342,300	貸付有価証券 1,847,600株 (206,200株)
荏原製作所	239,600	6,625.00	1,587,350,000	貸付有価証券 62,900株 (18,500 株)
ダイキン工業	694,500	23,025.00	15,990,862,500	貸付有価証券 1,000株
オルガノ	80,200	3,920.00	314,384,000	
ダイフク	903,300	2,719.50	2,456,524,350	貸付有価証券 186,700株 (59,100 株)
SANKYO	114,700	6,675.00	765,622,500	
竹内製作所	105,900	4,525.00	479,197,500	
セガサミーホールディングス	469,400	2,607.00	1,223,725,800	
ホシザキ	344,500	5,118.00	1,763,151,000	貸付有価証券 62,400株
マキタ	726,500	3,698.00	2,686,597,000	
三菱重工業	1,021,100	7,660.00	7,821,626,000	貸付有価証券

				10,500株
I H I	367,900	2,928.50	1,077,395,150	貸付有価証券 53,500株
イビデン	335,000	8,065.00	2,701,775,000	貸付有価証券 39,400株
ブラザー工業	780,200	2,387.50	1,862,727,500	貸付有価証券 37,400株
ミネベアミツミ	1,015,700	2,435.00	2,473,229,500	貸付有価証券 56,200株
日立製作所	2,284,600	8,772.00	20,040,511,200	貸付有価証券 6,400株
三菱電機	6,035,000	1,765.00	10,651,775,000	
富士電機	355,100	6,365.00	2,260,211,500	
安川電機	691,900	5,353.00	3,703,740,700	貸付有価証券 367,100株 (46,200株)
ニデック	1,418,100	6,801.00	9,644,498,100	貸付有価証券 32,600株
オムロン	535,100	6,401.00	3,425,175,100	
MC J	242,000	1,123.00	271,766,000	貸付有価証券 28,300株
日本電気	825,900	7,655.00	6,322,264,500	
富士通	581,800	17,490.00	10,175,682,000	
ルネサスエレクトロニクス	3,810,800	2,145.00	8,174,166,000	貸付有価証券 1,186,000株 (30,100株)
セイコーエプソン	749,200	2,280.00	1,708,176,000	貸付有価証券 59,300株 (21,600株)
ワコム	444,100	593.00	263,351,300	貸付有価証券 13,500株
アルバック	138,700	5,275.00	731,642,500	貸付有価証券 16,400株
エレコム	139,600	1,723.00	240,530,800	
パナソニックホールディングス	6,897,000	1,544.50	10,652,416,500	貸付有価証券 569,200株
アンリツ	411,300	1,035.50	425,901,150	貸付有価証券 125,300株 (800株)
ソニーグループ	1,567,600	12,260.00	19,218,776,000	
TDK	924,600	5,322.00	4,920,721,200	貸付有価証券 500株
ヒロセ電機	94,000	17,120.00	1,609,280,000	貸付有価証券 900株
横河電機	638,800	2,672.00	1,706,873,600	
アズビル	403,900	4,698.00	1,897,522,200	
日本光電工業	267,100	3,711.00	991,208,100	貸付有価証券

				1,400株
堀場製作所	110,300	7,709.00	850,302,700	貸付有価証券 3,900株
アドバンテスト	1,822,100	4,170.00	7,598,157,000	貸付有価証券 15,600株
キーエンス	299,500	55,040.00	16,484,480,000	貸付有価証券 124,600株
シスメックス	498,800	7,286.00	3,634,256,800	貸付有価証券 800株
フェローテックホールディングス	172,600	2,725.00	470,335,000	貸付有価証券 115,600株
レーザーテック	265,000	23,160.00	6,137,400,000	貸付有価証券 96,900株 (53,400株)
日本電子	144,800	4,639.00	671,727,200	貸付有価証券 1,000株
ファナック	2,819,300	3,920.00	11,051,656,000	貸付有価証券 27,700株
ローム	1,068,900	2,768.50	2,959,249,650	
浜松ホトニクス	463,900	6,233.00	2,891,488,700	
三井ハイテック	59,700	7,050.00	420,885,000	貸付有価証券 39,100株
新光電気工業	204,600	5,506.00	1,126,527,600	貸付有価証券 1,100株
京セラ	898,100	7,283.00	6,540,862,300	貸付有価証券 8,000株
太陽誘電	281,500	3,632.00	1,022,408,000	貸付有価証券 39,000株
村田製作所	5,260,100	2,655.00	13,965,565,500	
小糸製作所	695,300	2,341.00	1,627,697,300	貸付有価証券 104,900株
S C R E E Nホールディングス	197,700	7,142.00	1,411,973,400	貸付有価証券 14,200株 (6,600株)
東京エレクトロン	988,500	19,440.00	19,216,440,000	
トヨタ紡織	243,400	2,542.00	618,722,800	貸付有価証券 4,900株
豊田自動織機	422,700	11,025.00	4,660,267,500	貸付有価証券 10,700株
デンソー	4,770,000	2,303.50	10,987,695,000	
いすゞ自動車	1,680,800	1,761.50	2,960,729,200	貸付有価証券 42,600株
トヨタ自動車	8,803,500	2,572.00	22,642,602,000	貸付有価証券 222,500株
カヤバ	55,700	4,585.00	255,384,500	
アイシン	446,000	5,296.00	2,362,016,000	貸付有価証券 32,800株
マツダ	1,912,400	1,520.50	2,907,804,200	

本田技研工業	14,045,800	1,618.50	22,733,127,300	貸付有価証券 238,300株
スズキ	1,061,900	5,762.00	6,118,667,800	貸付有価証券 1,800株
S U B A R U	1,829,300	2,701.00	4,940,939,300	貸付有価証券 3,900株
ヤマハ発動機	832,900	3,715.00	3,094,223,500	貸付有価証券 394,300株 (27,500株)
豊田合成	168,800	2,955.00	498,804,000	貸付有価証券 1,800株
シマノ	234,700	20,615.00	4,838,340,500	貸付有価証券 116,500株
テルモ	1,778,200	3,862.00	6,867,408,400	
島津製作所	704,100	3,898.00	2,744,581,800	
ナカニシ	244,500	3,335.00	815,407,500	
東京精密	127,300	7,180.00	914,014,000	貸付有価証券 600株
オリンパス	3,558,800	1,939.00	6,900,513,200	貸付有価証券 380,600株
HOYA	1,190,300	14,940.00	17,783,082,000	
朝日インテック	646,000	2,730.50	1,763,903,000	貸付有価証券 339,400株 (77,100株)
バンダイナムコホールディングス	1,583,900	3,037.00	4,810,304,300	
パイロットコーポレーション	81,400	5,239.00	426,454,600	貸付有価証券 10,900株
ヤマハ	364,500	4,073.00	1,484,608,500	貸付有価証券 100株
ピジョン	368,200	1,661.50	611,764,300	貸付有価証券 6,000株
任天堂	3,106,700	6,245.00	19,401,341,500	貸付有価証券 16,300株
中部電力	2,130,500	1,813.50	3,863,661,750	貸付有価証券 44,400株
関西電力	2,232,500	1,952.50	4,358,956,250	
電源開発	435,300	2,326.00	1,012,507,800	貸付有価証券 2,500株 (2,500株)
イーレックス	102,700	796.00	81,749,200	貸付有価証券 68,800株 (17,400株)
レノバ	154,100	1,061.00	163,500,100	貸付有価証券 102,300株 (8,500株)
東京瓦斯	1,222,300	3,457.00	4,225,491,100	
大阪瓦斯	1,171,100	2,387.00	2,795,415,700	

SBSホールディングス	51,500	2,719.00	140,028,500	貸付有価証券 2,400株
ヤマトホールディングス	739,100	2,405.50	1,777,905,050	
山九	146,900	5,103.00	749,630,700	
センコーグループホールディングス	305,600	1,033.00	315,684,800	貸付有価証券 4,900株
AZ-COM丸和ホールディングス	139,400	2,080.00	289,952,000	貸付有価証券 20,500株 (15,900株)
SGホールディングス	1,107,600	1,918.50	2,124,930,600	貸付有価証券 24,600株
NIPPON EXPRESSホールディングス	195,900	7,669.00	1,502,357,100	貸付有価証券 129,500株 (700株)
日本郵船	1,544,200	3,951.00	6,101,134,200	貸付有価証券 1,400株
商船三井	1,017,500	4,016.00	4,086,280,000	貸付有価証券 333,400株
川崎汽船	433,600	5,445.00	2,360,952,000	貸付有価証券 290,500株 (11,000株)
NSユナイテッド海運	31,100	3,930.00	122,223,000	貸付有価証券 20,800株
三井倉庫ホールディングス	53,900	4,090.00	220,451,000	貸付有価証券 500株
NECネットエスアイ	193,700	1,984.00	384,300,800	貸付有価証券 3,100株
システナ	974,800	264.00	257,347,200	
日鉄ソリューションズ	98,900	4,215.00	416,863,500	貸付有価証券 2,200株
TIS	634,200	3,289.00	2,085,883,800	
コーエーテクモホールディングス	363,300	2,104.00	764,383,200	貸付有価証券 6,000株
ネクソン	1,294,500	2,614.50	3,384,470,250	貸付有価証券 861,000株
SHIFT	38,500	26,050.00	1,002,925,000	貸付有価証券 7,000株
ティーガイア	60,600	1,757.00	106,474,200	貸付有価証券 100株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	150,900	2,304.50	347,749,050	貸付有価証券 15,300株
GMOペイメントゲートウェイ	115,900	7,904.00	916,073,600	貸付有価証券 2,000株
インターネットイニシアティブ	316,800	2,455.50	777,902,400	貸付有価証券 500株
ラクス	274,300	2,012.00	551,891,600	貸付有価証券 20,100株 (700株)
チェンジホールディングス	142,000	1,641.00	233,022,000	貸付有価証券 95,100株 (4,700株)

野村総合研究所	1,155,100	3,840.00	4,435,584,000	
オービック	193,800	22,895.00	4,437,051,000	
ジャストシステム	83,300	2,819.00	234,822,700	
L I N E ヤフー	8,253,300	402.90	3,325,254,570	貸付有価証券 4,256,200株
トレンドマイクロ	274,000	5,645.00	1,546,730,000	貸付有価証券 94,300株 (19,900 株)
日本オラクル	110,900	10,740.00	1,191,066,000	貸付有価証券 2,800株
伊藤忠テクノソリューションズ	155,700	4,317.00	672,156,900	貸付有価証券 100株
大塚商会	287,600	6,030.00	1,734,228,000	貸付有価証券 15,000株
電通国際情報サービス	70,500	5,450.00	384,225,000	貸付有価証券 400株
東映アニメーション	27,200	13,380.00	363,936,000	貸付有価証券 16,900株
デジタルガレージ	102,900	3,180.00	327,222,000	貸付有価証券 21,000株
ネットワンシステムズ	216,000	2,826.50	610,524,000	貸付有価証券 5,600株
B I P R O G Y	213,400	3,737.00	797,475,800	貸付有価証券 2,700株
U S E N - N E X T H O L D I N G S	65,000	3,105.00	201,825,000	
日本電信電話	119,204,600	173.10	20,634,316,260	貸付有価証券 1,420,900株
K D D I	4,480,700	4,492.00	20,127,304,400	
ソフトバンク	9,324,300	1,678.00	15,646,175,400	
光通信	68,200	21,765.00	1,484,373,000	貸付有価証券 500株
GMOインターネットグループ	214,300	2,235.50	479,067,650	貸付有価証券 31,200株
K A D O K A W A	306,500	3,077.00	943,100,500	貸付有価証券 4,000株
東宝	362,900	5,032.00	1,826,112,800	貸付有価証券 161,300株 (23,600 株)
N T T データグループ	1,819,300	1,926.00	3,503,971,800	貸付有価証券 500株
D T S	123,500	3,205.00	395,817,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	291,400	5,131.00	1,495,173,400	貸付有価証券 1,500株
カブコン	576,200	5,414.00	3,119,546,800	
S C S K	473,200	2,562.00	1,212,338,400	

NSD	206,900	2,929.00	606,010,100	
コナミグループ	248,200	7,674.00	1,904,686,800	貸付有価証券 700株
ソフトバンクグループ	2,860,300	6,079.00	17,387,763,700	
双日	609,700	3,032.00	1,848,610,400	貸付有価証券 1,100株
アルフレッサホールディングス	614,000	2,405.00	1,476,670,000	貸付有価証券 4,700株
神戸物産	473,200	3,759.00	1,778,758,800	貸付有価証券 313,800株 (46,200株)
ダイワボウホールディングス	250,000	2,860.50	715,125,000	
マクニカホールディングス	144,700	6,930.00	1,002,771,000	貸付有価証券 4,100株
シップヘルスケアホールディングス	219,800	2,227.50	489,604,500	貸付有価証券 3,400株
メディバルホールディングス	584,900	2,515.00	1,471,023,500	
IDOM	184,900	709.00	131,094,100	貸付有価証券 117,200株
伊藤忠商事	3,573,800	5,178.00	18,505,136,400	貸付有価証券 22,000株
丸紅	4,735,000	2,195.00	10,393,325,000	貸付有価証券 184,800株
豊田通商	535,800	8,172.00	4,378,557,600	
兼松	237,500	1,995.00	473,812,500	
三井物産	3,702,300	5,093.00	18,855,813,900	貸付有価証券 92,600株
住友商事	3,701,500	2,845.50	10,532,618,250	
三菱商事	2,932,800	6,865.00	20,133,672,000	貸付有価証券 49,600株
キャノンマーケティングジャパン	141,700	3,851.00	545,686,700	貸付有価証券 11,900株
阪和興業	109,800	4,450.00	488,610,000	
岩谷産業	139,300	7,107.00	990,005,100	貸付有価証券 5,100株
稲畑産業	120,900	3,055.00	369,349,500	貸付有価証券 6,600株
伊藤忠エネクス	151,600	1,443.00	218,758,800	
加賀電子	49,600	6,250.00	310,000,000	
PALTAC	96,200	4,537.00	436,459,400	
ミスミグループ本社	923,400	2,314.50	2,137,209,300	
ローソン	151,800	6,831.00	1,036,945,800	貸付有価証券 97,200株

エービーシー・マート	267,700	2,674.00	715,829,800	貸付有価証券 143,200株
アスクル	126,500	1,972.00	249,458,000	貸付有価証券 84,200株 (7,300株)
日本マクドナルドホールディングス	373,700	5,740.00	2,145,038,000	貸付有価証券 250,300株
セリア	164,000	2,105.00	345,220,000	貸付有価証券 109,800株 (94,000株)
Monotaro	867,100	1,485.50	1,288,077,050	貸付有価証券 580,900株 (137,200株)
マツキヨココカラ&カンパニー	1,112,800	2,670.50	2,971,732,400	
ZOZO	404,300	2,804.00	1,133,657,200	貸付有価証券 5,000株
ウエルシアホールディングス	317,300	2,604.50	826,407,850	貸付有価証券 212,500株 (7,000株)
クリエイトSDホールディングス	101,100	3,400.00	343,740,000	貸付有価証券 9,200株
ネクステージ	139,700	1,962.00	274,091,400	貸付有価証券 93,300株
コスモス薬品	60,500	15,720.00	951,060,000	貸付有価証券 1,100株
セブン&アイ・ホールディングス	2,108,200	5,789.00	12,204,369,800	貸付有価証券 657,800株
ツルハホールディングス	128,400	10,635.00	1,365,534,000	貸付有価証券 70,700株 (2,900株)
クスリのアオキホールディングス	54,500	9,780.00	533,010,000	貸付有価証券 2,100株
FOOD & LIFE COMPANIE	326,200	2,572.50	839,149,500	
ノジマ	199,600	1,339.00	267,264,400	貸付有価証券 200株
良品計画	667,800	1,787.00	1,193,358,600	貸付有価証券 454,500株 (26,400株)
コーナン商事	82,500	3,825.00	315,562,500	貸付有価証券 40,800株
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,235,000	3,025.00	3,735,875,000	貸付有価証券 310,800株 (59,800株)
ゼンショーホールディングス	334,800	6,745.00	2,258,226,000	貸付有価証券 92,100株
ワークマン	70,800	4,340.00	307,272,000	貸付有価証券 45,700株 (3,800株)
VTホールディングス	232,300	493.00	114,523,900	貸付有価証券 400株
スギホールディングス	123,200	6,017.00	741,294,400	貸付有価証券 42,900株 (15,000株)

				株)
日本瓦斯	324,100	2,228.00	722,094,800	
ライフコーポレーション	53,500	3,615.00	193,402,500	
コメリ	94,100	3,110.00	292,651,000	貸付有価証券 14,800株
しまむら	71,800	15,150.00	1,087,770,000	貸付有価証券 18,400株 (14,100 株)
イズミ	93,000	3,879.00	360,747,000	貸付有価証券 34,900株
ヤオコー	69,200	7,718.00	534,085,600	貸付有価証券 22,500株
ケーズホールディングス	432,400	1,388.00	600,171,200	貸付有価証券 127,900株
ニトリホールディングス	247,400	15,555.00	3,848,307,000	貸付有価証券 42,600株
ファーストリテイリング	275,200	31,550.00	8,682,560,000	貸付有価証券 24,400株 (1,100株)
サンドラッグ	232,200	4,132.00	959,450,400	
めぶきフィナンシャルグループ	2,825,500	414.20	1,170,322,100	貸付有価証券 100株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3,055,200	686.90	2,098,616,880	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	19,083,800	1,239.00	23,644,828,200	
りそなホールディングス	7,150,300	822.50	5,881,121,750	貸付有価証券 446,400株
三井住友トラスト・ホールディングス	1,023,100	5,618.00	5,747,775,800	貸付有価証券 24,000株
三井住友フィナンシャルグループ	3,209,300	7,284.00	23,376,541,200	貸付有価証券 77,800株
千葉銀行	1,586,900	1,092.00	1,732,894,800	貸付有価証券 7,500株
ふくおかフィナンシャルグループ	454,600	3,602.00	1,637,469,200	貸付有価証券 600株
セブン銀行	2,039,800	307.00	626,218,600	貸付有価証券 145,600株
みずほフィナンシャルグループ	8,234,900	2,490.50	20,509,018,450	貸付有価証券 155,300株
SBIホールディングス	829,900	3,130.00	2,597,587,000	貸付有価証券 24,800株 (24,800 株)
ジャフコグループ	190,100	1,566.00	297,696,600	貸付有価証券 83,400株
大和証券グループ本社	4,071,600	854.10	3,477,553,560	貸付有価証券 275,700株
野村ホールディングス	10,259,500	597.60	6,131,077,200	
マネックスグループ	613,500	675.00	414,112,500	貸付有価証券

				233,800株
SOMPOホールディングス	977,300	6,215.00	6,073,919,500	貸付有価証券 69,500株
MS&ADインシュアランスグループホール	1,158,800	5,442.00	6,306,189,600	貸付有価証券 2,200株
第一生命ホールディングス	2,781,800	3,101.00	8,626,361,800	貸付有価証券 407,600株
東京海上ホールディングス	5,628,300	3,349.00	18,849,176,700	貸付有価証券 4,100株
全国保証	148,900	4,898.00	729,312,200	貸付有価証券 13,200株
芙蓉総合リース	52,400	11,580.00	606,792,000	
みずほリース	84,800	4,720.00	400,256,000	
東京センチュリー	106,400	5,825.00	619,780,000	
イオンフィナンシャルサービス	326,900	1,271.00	415,489,900	貸付有価証券 217,000株
アコム	1,016,100	355.30	361,020,330	貸付有価証券 18,600株
ジャックス	60,700	5,020.00	304,714,000	
オリエントコーポレーション	148,600	1,110.00	164,946,000	貸付有価証券 20,600株
オリックス	3,737,700	2,712.00	10,136,642,400	貸付有価証券 400株
三菱HCキャピタル	2,220,000	977.20	2,169,384,000	貸付有価証券 41,800株
日本取引所グループ	1,599,900	2,862.50	4,579,713,750	貸付有価証券 500株
大東建託	208,600	15,570.00	3,247,902,000	貸付有価証券 8,900株
ヒューリック	1,328,200	1,346.50	1,788,421,300	貸付有価証券 240,100株 (2,700株)
野村不動産ホールディングス	356,300	3,781.00	1,347,170,300	
プレサンスコーポレーション	90,200	1,725.00	155,595,000	貸付有価証券 14,200株
オープンハウスグループ	208,500	4,924.00	1,026,654,000	
東急不動産ホールディングス	1,711,900	893.90	1,530,267,410	貸付有価証券 600株
飯田グループホールディングス	484,900	2,368.00	1,148,243,200	貸付有価証券 13,000株
ケアイスター不動産	27,400	4,515.00	123,711,000	貸付有価証券 1,000株
三井不動産	2,429,900	3,286.00	7,984,651,400	貸付有価証券 600株
三菱地所	3,435,800	1,973.00	6,778,833,400	貸付有価証券 92,100株

東京建物	497,400	2,041.50	1,015,442,100	貸付有価証券 141,600株
住友不動産	1,029,300	3,720.00	3,828,996,000	
スターツコーポレーション	81,700	2,905.00	237,338,500	
カチタス	153,000	2,089.00	319,617,000	貸付有価証券 48,500株
日本M&Aセンターホールディングス	1,019,800	707.50	721,508,500	貸付有価証券 47,100株
UTグループ	87,300	2,089.00	182,369,700	貸付有価証券 49,900株 (2,000株)
パソナグループ	72,100	1,558.00	112,331,800	貸付有価証券 1,100株
エス・エム・エス	227,200	2,628.50	597,195,200	貸付有価証券 10,200株
パーソルホールディングス	6,554,400	238.60	1,563,879,840	貸付有価証券 37,700株
総合警備保障	1,103,100	883.80	974,919,780	貸付有価証券 3,400株
カカコム	436,200	1,443.00	629,436,600	
ディップ	104,000	3,535.00	367,640,000	貸付有価証券 69,600株
ベネフィット・ワン	275,300	1,011.00	278,328,300	貸付有価証券 39,000株
エムスリー	1,174,400	2,658.50	3,122,142,400	貸付有価証券 96,500株
博報堂DYホールディングス	758,000	1,211.50	918,317,000	貸付有価証券 87,200株
H. U. グループホールディングス	174,000	2,485.50	432,477,000	貸付有価証券 40,200株
ビー・エム・エル	73,200	2,830.00	207,156,000	
ユー・エス・エス	611,200	2,495.00	1,524,944,000	貸付有価証券 172,200株
サイバーエージェント	1,313,200	787.20	1,033,751,040	貸付有価証券 91,000株
フルキャストホールディングス	56,700	1,841.00	104,384,700	貸付有価証券 3,400株
テクノプロ・ホールディングス	351,600	3,202.00	1,125,823,200	貸付有価証券 70,200株
ジャパンマテリアル	181,900	2,388.00	434,377,200	貸付有価証券 34,800株
リクルートホールディングス	4,400,000	4,599.00	20,235,600,000	貸付有価証券 13,000株
ベルシステム24ホールディングス	79,700	1,520.00	121,144,000	貸付有価証券 29,800株
バイカレント・コンサルティング	470,400	4,797.00	2,256,508,800	貸付有価証券 235,100株 (23,700株)

	ジャパンエレベーターサービスホールディング	211,800	2,146.00	454,522,800	貸付有価証券 10,200株
	リログループ	330,800	1,534.50	507,612,600	貸付有価証券 33,100株
	トランス・コスモス	73,800	3,115.00	229,887,000	貸付有価証券 5,300株
	セコム	605,300	10,080.00	6,101,424,000	
	メイテックグループホールディングス	231,900	2,623.50	608,389,650	貸付有価証券 40,800株
	イオンディライト	65,700	3,340.00	219,438,000	貸付有価証券 42,800株
小計	銘柄数：400 組入時価比率：97.6%			1,321,408,569,950 100.0%	
合計				1,321,408,569,950	

(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。

(注2) 備考欄の貸付有価証券の()内は、委託者の利害関係人である野村證券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(2023年10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。