



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

2023年11月29日  
 November 29, 2023

		上場取引所	東証
		Listed Exchange	TSE
ファンド名	NEXT FUNDS MSCI日本株女性活躍指数(セレクト)連動型上場投信		
コード番号	( 2518 )		
連動対象指標	MSCI 日本株女性活躍指数(セレクト)		
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	<a href="http://www.nomura-am.co.jp">http://www.nomura-am.co.jp</a>
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 MSCI Japan Empowering Women Select Index Exchange Traded Fund		
Code:	2518		
Underlying index:	MSCI Japan Empowering Women (WIN) Select Index		
Primary invested assets:	Stocks		
Trading unit:	1 unit		
Management co.:	Nomura Asset Management Co., Ltd.	URL	<a href="http://www.nomura-am.co.jp">http://www.nomura-am.co.jp</a>
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 2024年1月17日  
 分配金支払開始日 2023年11月28日  
 Scheduled date of submission of securities report: January 17, 2024  
 Date of commencing dividend payment: November 28, 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21日～2023年10月20日)

Management Status for Year ended October 2023 (from April 21, 2023 to October 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10月期 FY ended Oct. 2023	7,555	(97.9)	163	(2.1)	7,718	(100.0)
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	8,307	(98.3)	147	(1.7)	8,455	(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	7,677	446	1,799	6,324
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	6,421	1,336	79	7,677

(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))	100口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	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	7,814	96	7,718	122,039
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	8,569	114	8,455	110,132

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	1,300
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	1,400

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 (2023年4月20日現在) 10th Fiscal Year As of April 20, 2023	第11期 (2023年10月20日現在) 11th Fiscal Year As of October 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	42,587,394	90,804,239
株式 Stocks	8,307,766,540	7,555,015,760
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,361,535	-
未収入金 Accounts receivable - other	106,438,095	82,328,750
未収配当金 Accrued dividends receivable	106,849,059	74,548,680
差入委託証拠金 Margin deposits	4,235,000	12,075,000
流動資産合計 Total current assets	8,569,237,623	7,814,772,429
資産合計 Total assets	8,569,237,623	7,814,772,429
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	6,478,465
未払収益分配金 Unpaid dividends	107,481,864	82,221,477
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,204,374	1,360,216
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	4,817,446	5,440,775
未払利息 Accrued interest expenses	14	37
その他未払費用 Other accrued expenses	612,968	657,733
流動負債合計 Total current liabilities	114,116,666	96,158,703
負債合計 Total liabilities	114,116,666	96,158,703
純資産の部 Net assets		

元本等 Principal and other		
元本 Principal	7,677,276,000	6,324,729,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	777,844,957	1,393,884,726
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	6,029,513	4,692,884
元本等合計 Total principal and other	8,455,120,957	7,718,613,726
純資産合計 Total net assets	8,455,120,957	7,718,613,726
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	8,569,237,623	7,814,772,429

(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 2022年10月21日 至 2023年4月20日 10th Fiscal Year From October 21, 2022 to April 20, 2023	第11期 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日 11th Fiscal Year From April 21, 2023 to October 20, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	117,812,035	88,760,532
受取利息 Interest income	4	-
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	340,245,566	899,069,405
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	1,361,535	22,083,320
その他収益 Other revenue	9,133	18,405
営業収益合計 Total operating revenue	459,428,273	1,009,931,662
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	3,677	36,218
受託者報酬 Trustee fees	1,204,374	1,360,216
委託者報酬 Investment trust management fees	4,817,446	5,440,775
その他費用 Other expenses	965,526	1,056,880
営業費用合計 Total operating expenses	6,991,023	7,894,089
営業利益又は営業損失(△)	452,437,250	1,002,037,573

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	452,437,250	1,002,037,573
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	452,437,250	1,002,037,573
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	326,861,292	777,844,957
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	111,115,939	110,338,763
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	111,115,939	110,338,763
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	5,087,660	414,115,090
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	5,087,660	414,115,090
分配金 Dividends	107,481,864	82,221,477
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	777,844,957	1,393,884,726

(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21日から2023年10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10期 2023年4月20日現在	第11期 2023年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 7,677,276口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 6,324,729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 1,101.32円 (100口当たり純資産額) (110,132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 1,220.39円 (100口当たり純資産額) (122,039円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自2022年10月21日 至2023年4月20日	第11期 自2023年4月21日 至2023年10月20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>117,817,495円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,681,228円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>120,498,723円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>6,987,346円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>113,511,377円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>107,481,864円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>6,029,513円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>7,677,276口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,400円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	117,817,495円	分配準備積立金	B	2,681,228円	配当等収益合計額	C=A+B	120,498,723円	経費	D	6,987,346円	収益分配可能額	E=C-D	113,511,377円	収益分配金	F	107,481,864円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,029,513円	口数	H	7,677,276口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,400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>88,742,719円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>6,029,513円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>94,772,232円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>7,857,871円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>86,914,361円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>82,221,477円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>4,692,884円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>6,324,729口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,300円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	88,742,719円	分配準備積立金	B	6,029,513円	配当等収益合計額	C=A+B	94,772,232円	経費	D	7,857,871円	収益分配可能額	E=C-D	86,914,361円	収益分配金	F	82,221,477円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,692,884円	口数	H	6,324,729口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	117,817,495円																																																											
分配準備積立金	B	2,681,228円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	120,498,723円																																																											
経費	D	6,987,346円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	113,511,377円																																																											
収益分配金	F	107,481,864円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,029,513円																																																											
口数	H	7,677,276口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,400円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	88,742,719円																																																											
分配準備積立金	B	6,029,513円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	94,772,232円																																																											
経費	D	7,857,871円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	86,914,361円																																																											
収益分配金	F	82,221,477円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,692,884円																																																											
口数	H	6,324,729口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300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10期 自2022年10月21日 至2023年4月20日	第11期 自2023年4月21日 至2023年10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。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

## ○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10期 2023年4月20日現在	第11期 2023年10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10期 自 2022年10月21日 至 2023年4月20日	第11期 自 2023年4月21日 至 2023年10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10期 自 2022年10月21日 至 2023年4月20日	第11期 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日
期首元本額 6,421,074,000円	期首元本額 7,677,276,000円
期中追加設定元本額 1,336,100,000円	期中追加設定元本額 446,800,000円
期中一部交換元本額 79,898,000円	期中一部交換元本額 1,799,347,000円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第10期 自 2022年10月21日 至 2023年4月20日	第11期 自 2023年4月21日 至 2023年10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	233,270,201	571,534,898
合計	233,270,201	571,534,898

## 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(2023年4月20日現在)			第11期(2023年10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)
	うち1年超			うち1年超		
市場取引						
株価指数先物取引						
買建	141,330,000	—	142,695,000	1,361,535	164,045,000	—
					157,570,000	△6,478,465

合計	141,330,000	-	142,695,000	1,361,535	164,045,000	-	157,570,000	△6,478,465
----	-------------	---	-------------	-----------	-------------	---	-------------	------------

(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	ニッスイ	3,200	693.00	2,217,600	
		マルハニチロ	300	2,454.50	736,350	
		石油資源開発	800	5,360.00	4,288,000	
		大成建設	3,000	4,920.00	14,760,000	
		大林組	11,700	1,253.50	14,665,950	
		清水建設	7,000	1,032.50	7,227,500	
		鹿島建設	8,000	2,370.00	18,960,000	
		住友林業	3,900	3,492.00	13,618,800	
		大和ハウス工業	20,600	3,982.00	82,029,200	
		積水ハウス	14,800	2,866.00	42,416,800	
		森永製菓	700	5,172.00	3,620,400	
		カルビー	2,300	2,696.00	6,200,800	
		森永乳業	500	5,460.00	2,730,000	
		ヤクルト本社	5,000	3,540.00	17,700,000	
		明治ホールディングス	4,400	3,688.00	16,227,200	
		アサヒグループホールディングス	6,800	5,281.00	35,910,800	
		キリンホールディングス	22,800	2,071.50	47,230,200	
		コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	600	1,887.00	1,132,200	
		サントリー食品インターナショナル	2,900	4,378.00	12,696,200	
		味の素	8,900	5,565.00	49,528,500	
キューピー	1,300	2,556.00	3,322,800			
カゴメ	1,500	3,077.00	4,615,500			
ニチレイ	2,600	3,214.00	8,356,400			

東洋水産	1,600	5,980.00	9,568,000
東洋紡	1,000	1,011.50	1,011,500
帝人	1,600	1,372.00	2,195,200
ゴールドウイン	1,000	9,851.00	9,851,000
デサント	500	4,305.00	2,152,500
王子ホールディングス	15,000	618.20	9,273,000
日本製紙	300	1,288.00	386,400
レンゴー	2,000	992.70	1,985,400
旭化成	18,700	924.70	17,291,890
レゾナック・ホールディングス	1,100	2,457.50	2,703,250
住友化学	11,400	402.20	4,585,080
日産化学	4,900	6,359.00	31,159,100
クレハ	400	9,160.00	3,664,000
信越化学工業	66,200	4,297.00	284,461,400
エア・ウォーター	3,100	1,845.50	5,721,050
日本酸素ホールディングス	3,600	3,697.00	13,309,200
三井化学	3,300	3,656.00	12,064,800
J S R	1,000	4,010.00	4,010,000
三菱ケミカルグループ	11,800	855.20	10,091,360
ダイセル	6,200	1,226.50	7,604,300
住友ベークライト	600	6,659.00	3,995,400
積水化学工業	8,200	2,019.50	16,559,900
日本ゼオン	3,400	1,507.00	5,123,800
UBE	800	2,287.50	1,830,000
日油	1,900	6,006.00	11,411,400
花王	11,300	5,444.00	61,517,200
日本ペイントホールディングス	19,900	965.50	19,213,450
関西ペイント	3,200	2,177.50	6,968,000
富士フイルムホールディングス	5,100	8,470.00	43,197,000
資生堂	2,300	4,711.00	10,835,300
ライオン	4,700	1,418.00	6,664,600
ファンケル	1,800	2,224.00	4,003,200
コーセー	600	10,015.00	6,009,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,900	1,664.50	3,162,550
小林製薬	1,300	6,165.00	8,014,500

デクセリアルズ	1,600	3,740.00	5,984,000
日東電工	4,500	9,414.00	42,363,000
エフピコ	1,000	2,577.50	2,577,500
ニフコ	1,700	3,729.00	6,339,300
ユニ・チャーム	10,700	5,053.00	54,067,100
協和キリン	6,300	2,374.00	14,956,200
武田薬品工業	7,900	4,352.00	34,380,800
アステラス製薬	53,100	1,882.00	99,934,200
住友ファーマ	1,700	480.00	816,000
日本新薬	1,900	5,510.00	10,469,000
中外製薬	35,400	4,548.00	160,999,200
エーザイ	2,800	8,085.00	22,638,000
ロート製薬	6,000	3,395.00	20,370,000
小野薬品工業	13,300	2,631.50	34,998,950
参天製薬	5,700	1,294.50	7,378,650
ツムラ	1,000	2,621.00	2,621,000
JCRファーマ	1,000	1,115.50	1,115,500
そーせいグループ	500	1,344.00	672,000
大塚ホールディングス	8,800	4,980.00	43,824,000
ペプチドリーム	1,600	1,256.00	2,009,600
サワイグループホールディングス	300	4,575.00	1,372,500
ENEOSホールディングス	26,700	565.00	15,085,500
コスモエネルギーホールディングス	2,100	5,324.00	11,180,400
ブリヂストン	7,400	5,808.00	42,979,200
TOTO	3,000	3,674.00	11,022,000
日本碍子	4,600	1,774.00	8,160,400
日本特殊陶業	4,300	3,184.00	13,691,200
神戸製鋼所	2,500	1,788.00	4,470,000
JFEホールディングス	3,100	2,069.50	6,415,450
東京製鐵	1,700	1,637.00	2,782,900
三菱マテリアル	700	2,325.00	1,627,500
古河電気工業	200	2,245.50	449,100
AREホールディングス	1,800	1,880.00	3,384,000
東洋製罐グループホールディングス	1,500	2,460.50	3,690,750
LIXIL	2,700	1,616.50	4,364,550

三浦工業	2,000	2,953.00	5,906,000
DMG森精機	1,500	2,467.50	3,701,250
ディスコ	3,700	28,000.00	103,600,000
SMC	1,900	70,110.00	133,209,000
小松製作所	19,500	3,810.00	74,295,000
荏原製作所	2,900	6,556.00	19,012,400
ダイキン工業	5,400	22,015.00	118,881,000
栗田工業	2,000	4,332.00	8,664,000
ダイフク	7,000	2,573.00	18,011,000
フジテック	1,300	3,235.00	4,205,500
CKD	900	2,038.00	1,834,200
セガサミーホールディングス	2,800	2,405.00	6,734,000
三菱重工業	3,800	7,914.00	30,073,200
日清紡ホールディングス	600	1,089.00	653,400
コニカミノルタ	2,900	450.20	1,305,580
ブラザー工業	4,000	2,365.00	9,460,000
ミネベアミツミ	6,000	2,352.00	14,112,000
東芝	4,200	4,601.00	19,324,200
三菱電機	34,100	1,765.00	60,186,500
富士電機	2,500	6,237.00	15,592,500
安川電機	5,600	5,155.00	28,868,000
マブチモーター	700	4,355.00	3,048,500
ニデック	9,700	6,699.00	64,980,300
オムロン	3,100	6,210.00	19,251,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	900	2,440.00	2,196,000
日本電気	3,900	7,636.00	29,780,400
富士通	3,900	17,020.00	66,378,000
サンケン電気	200	8,030.00	1,606,000
セイコーエプソン	4,400	2,309.00	10,159,600
TDK	6,500	5,606.00	36,439,000
アルプスアルパイン	1,000	1,236.50	1,236,500
横河電機	3,300	2,711.50	8,947,950
アズビル	2,800	4,492.00	12,577,600
日本光電工業	1,800	3,571.00	6,427,800
堀場製作所	900	7,790.00	7,011,000

シスメックス	5,300	7,056.00	37,396,800
ウシオ電機	700	1,935.50	1,354,850
カシオ計算機	3,000	1,184.50	3,553,500
浜松ホトニクス	3,800	5,921.00	22,499,800
新光電気工業	1,100	5,476.00	6,023,600
京セラ	3,900	7,324.00	28,563,600
太陽誘電	2,200	3,472.00	7,638,400
村田製作所	41,700	2,632.00	109,754,400
リコー	2,800	1,226.50	3,434,200
東京エレクトロン	18,900	20,085.00	379,606,500
テイ・エス テック	1,100	1,663.50	1,829,850
島津製作所	6,100	3,701.00	22,576,100
ナカニシ	2,200	3,290.00	7,238,000
ニコン	1,900	1,490.00	2,831,000
HOYA	17,000	14,615.00	248,455,000
朝日インテック	5,600	2,550.00	14,280,000
シチズン時計	1,200	881.00	1,057,200
メニコン	1,300	1,710.00	2,223,000
バンダイナムコホールディングス	17,500	3,107.00	54,372,500
TOPPANホールディングス	3,400	3,302.00	11,226,800
大日本印刷	2,900	3,870.00	11,223,000
アシックス	2,100	4,646.00	9,756,600
ヤマハ	3,100	3,945.00	12,229,500
ビジョン	4,600	1,607.00	7,392,200
中部電力	14,600	1,795.00	26,207,000
関西電力	10,200	1,943.00	19,818,600
四国電力	1,300	1,020.00	1,326,000
九州電力	4,100	953.30	3,908,530
東京瓦斯	20,700	3,402.00	70,421,400
大阪瓦斯	15,300	2,466.00	37,729,800
東邦瓦斯	2,700	2,590.00	6,993,000
東急	3,900	1,645.00	6,415,500
小田急電鉄	1,400	2,066.00	2,892,400
東日本旅客鉄道	1,700	7,739.00	13,156,300
西武ホールディングス	1,300	1,427.00	1,855,100

近鉄グループホールディングス	1,400	4,144.00	5,801,600
阪急阪神ホールディングス	1,900	4,637.00	8,810,300
ヤマトホールディングス	2,800	2,381.00	6,666,800
九州旅客鉄道	1,000	3,021.00	3,021,000
S Gホールディングス	12,600	1,905.00	24,003,000
N I P P O N E X P R E S S ホールディン	1,700	7,580.00	12,886,000
日本郵船	8,600	3,863.00	33,221,800
商船三井	8,700	4,088.00	35,565,600
川崎汽船	1,400	5,225.00	7,315,000
日本航空	800	2,657.00	2,125,600
A N Aホールディングス	600	2,871.50	1,722,900
三菱倉庫	900	3,879.00	3,491,100
住友倉庫	800	2,385.00	1,908,000
N E C ネットエスアイ	1,400	1,977.00	2,767,800
T I S	5,200	3,142.00	16,338,400
コーエーテクモホールディングス	4,300	2,026.50	8,713,950
ネクソン	8,500	2,500.00	21,250,000
G M O ペイメントゲートウェイ	2,200	6,281.00	13,818,200
ラクス	1,100	1,800.50	1,980,550
チェンジホールディングス	1,400	1,507.00	2,109,800
ビジョナル	900	6,820.00	6,138,000
野村総合研究所	11,600	3,739.00	43,372,400
ラクスル	400	1,138.00	455,200
メルカリ	500	3,054.00	1,527,000
S a n s a n	700	1,102.00	771,400
メドレー	200	4,230.00	846,000
L I N E ヤフー	38,800	382.30	14,833,240
トレンドマイクロ	2,900	5,597.00	16,231,300
日本オラクル	1,900	10,575.00	20,092,500
大塚商会	3,000	5,952.00	17,856,000
電通国際情報サービス	900	5,210.00	4,689,000
デジタルガレージ	300	2,809.00	842,700
ネットワンシステムズ	3,300	2,663.50	8,789,550
B I P R O G Y	2,700	3,669.00	9,906,300
日本電信電話	740,000	173.60	128,464,000

KDD I	41,400	4,452.00	184,312,800
ソフトバンク	46,600	1,673.50	77,985,100
光通信	400	21,335.00	8,534,000
GMOインターネットグループ	300	2,182.50	654,750
KADOKAWA	900	2,995.50	2,695,950
東宝	1,800	4,866.00	8,758,800
NTTデータグループ	9,500	1,768.00	16,796,000
SCSK	4,000	2,466.00	9,864,000
富士ソフト	900	5,410.00	4,869,000
コナミグループ	1,900	8,116.00	15,420,400
ソフトバンクグループ	5,000	6,255.00	31,275,000
双日	4,200	3,109.00	13,057,800
アルフレッサ ホールディングス	2,400	2,381.50	5,715,600
コメダホールディングス	1,100	2,667.00	2,933,700
メディパルホールディングス	2,600	2,485.00	6,461,000
伊藤忠商事	43,000	5,312.00	228,416,000
丸紅	13,800	2,215.50	30,573,900
豊田通商	6,200	8,061.00	49,978,200
住友商事	11,500	2,951.00	33,936,500
三菱商事	26,000	6,947.00	180,622,000
岩谷産業	2,200	7,216.00	15,875,200
サンリオ	600	6,431.00	3,858,600
ミスミグループ本社	8,000	2,333.00	18,664,000
ローソン	700	6,935.00	4,854,500
日本マクドナルドホールディングス	3,000	5,740.00	17,220,000
セリア	1,400	2,084.00	2,917,600
ビックカメラ	1,300	1,084.00	1,409,200
DCMホールディングス	1,700	1,199.00	2,038,300
Monotaro	13,300	1,215.50	16,166,150
J.フロント リテイリング	2,700	1,385.00	3,739,500
マツキョココカラ&カンパニー	6,400	2,560.00	16,384,000
ZOZO	4,700	2,792.00	13,122,400
三越伊勢丹ホールディングス	2,600	1,632.00	4,243,200
コスモス薬品	600	14,265.00	8,559,000
ツルハホールディングス	800	10,530.00	8,424,000

トリドールホールディングス	100	3,450.00	345,000
FOOD & LIFE COMP ANIE	700	2,486.50	1,740,550
良品計画	4,000	2,001.00	8,004,000
パン・パシフィック・インターナシ ョナルホ	8,200	2,825.50	23,169,100
コロワイド	300	2,255.50	676,650
スギホールディングス	900	5,667.00	5,100,300
しまむら	600	14,675.00	8,805,000
高島屋	2,000	1,972.50	3,945,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	300	1,591.00	477,300
丸井グループ	5,100	2,352.00	11,995,200
イオン	2,900	3,059.00	8,871,100
ケーズホールディングス	2,500	1,383.00	3,457,500
アインホールディングス	600	4,072.00	2,443,200
ヤマダホールディングス	8,400	461.40	3,875,760
ニトリホールディングス	2,600	15,615.00	40,599,000
吉野家ホールディングス	500	3,160.00	1,580,000
サンドラッグ	2,300	3,955.00	9,096,500
京都フィナンシャルグループ	1,600	8,461.00	13,537,600
ゆうちょ銀行	32,600	1,334.00	43,488,400
コンコルディア・フィナンシャルグ ループ	18,600	689.00	12,815,400
あおぞら銀行	3,700	2,858.50	10,576,450
りそなホールディングス	29,400	807.40	23,737,560
三井住友トラスト・ホールディング ス	4,800	5,603.00	26,894,400
三井住友フィナンシャルグループ	19,300	7,190.00	138,767,000
千葉銀行	17,600	1,103.00	19,412,800
七十七銀行	1,500	3,220.00	4,830,000
八十二銀行	4,100	821.00	3,366,100
みずほフィナンシャルグループ	20,800	2,546.00	52,956,800
SBIホールディングス	2,500	3,121.00	7,802,500
大和証券グループ本社	15,000	851.30	12,769,500
野村ホールディングス	19,100	581.50	11,106,650
マネックスグループ	1,500	638.00	957,000
かんぽ生命保険	4,100	2,717.00	11,139,700

SOMPOホールディングス	14,700	6,370.00	93,639,000
MS&ADインシュアランスグループホール	22,900	5,427.00	124,278,300
第一生命ホールディングス	12,400	3,089.00	38,303,600
東京海上ホールディングス	93,100	3,353.00	312,164,300
T&Dホールディングス	17,600	2,543.50	44,765,600
クレディセゾン	2,400	2,253.50	5,408,400
東京センチュリー	400	5,831.00	2,332,400
イオンフィナンシャルサービス	2,600	1,226.00	3,187,600
オリックス	50,400	2,699.50	136,054,800
三菱HCキャピタル	12,400	959.60	11,899,040
日本取引所グループ	31,600	2,954.00	93,346,400
ヒューリック	9,200	1,345.50	12,378,600
野村不動産ホールディングス	2,100	3,687.00	7,742,700
オープンハウスグループ	2,500	4,754.00	11,885,000
東急不動産ホールディングス	4,300	884.50	3,803,350
パーク24	700	1,659.00	1,161,300
三井不動産	10,000	3,290.00	32,900,000
三菱地所	20,100	1,954.50	39,285,450
東京建物	1,600	2,031.50	3,250,400
イオンモール	900	1,736.50	1,562,850
カチタス	3,800	2,057.00	7,816,600
日本空港ビルデング	300	6,407.00	1,922,100
MIXI	600	2,289.00	1,373,400
日本M&Aセンターホールディングス	9,200	665.30	6,120,760
オープンアップグループ	1,500	1,869.00	2,803,500
エス・エム・エス	2,500	2,275.00	5,687,500
パーソルホールディングス	75,300	216.40	16,294,920
カカクコム	5,200	1,414.00	7,352,800
ディップ	700	2,935.00	2,054,500
ベネフィット・ワン	3,600	970.90	3,495,240
エムスリー	16,000	2,399.50	38,392,000
アウトソーシング	1,000	1,095.00	1,095,000
ディー・エヌ・エー	800	1,435.00	1,148,000
インフォマート	3,800	369.00	1,402,200

	電通グループ	1,400	4,416.00	6,182,400	
	H. U. グループホールディングス	500	2,444.50	1,222,250	
	オリエンタルランド	20,300	4,578.00	92,933,400	
	ラウンドワン	2,000	534.00	1,068,000	
	リゾートトラスト	1,300	2,097.00	2,726,100	
	ユー・エス・エス	6,000	2,586.50	15,519,000	
	サイバーエージェント	8,500	777.90	6,612,150	
	エン・ジャパン	1,100	2,125.00	2,337,500	
	テクノプロ・ホールディングス	4,100	2,953.00	12,107,300	
	リクルートホールディングス	73,800	4,498.00	331,952,400	
	共立メンテナンス	300	5,577.00	1,673,100	
	セコム	3,900	10,090.00	39,351,000	
	ベネッセホールディングス	1,200	1,778.00	2,133,600	
	小計 銘柄数 : 313			7,555,015,760	
	組入時価比率 : 97.9%			100.0%	
	合計			7,555,015,760	

(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10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。