



2021年10月期 (2021年4月21日～2021年10月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2021 (April 21, 2021 – October 20, 2021)

2021年12月1日
 December 1, 2021

		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	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 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	http://www.nomura-am.co.jp
Representative:	Hiroyasu Koike, President & CEO		
Contact person:	Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.		

有価証券報告書提出予定日 2022年1月19日
 分配金支払開始日 2021年11月26日
 Scheduled date of submission of securities report: January 19, 2022
 Date of commencing dividend payment: November 26, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021年10月期の運用状況 (2021年4月21日～2021年10月20日)

Management Status for Year ended October 2021 (from April 21, 2021 to October 20, 2021)

(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.	%
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	8,300	(99.9)	4	(0.1)	8,304	(100.0)
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	5,568	(100.0)	1	(0.0)	5,570	(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
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	5,060	2,999	993	7,066
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	5,036	1,993	1,969	5,060

(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
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	8,352	47	8,304	117,526
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	5,630	60	5,570	110,066

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	600
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	1,100

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6期 (2021年4月20日現在) 6th Fiscal Year As of April 20, 2021	第7期 (2021年10月20日現在) 7th Fiscal Year As of October 20, 2021
	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	10,632,409	12,808,154
株式 Stocks	5,568,705,590	8,300,107,640
未収入金 Accounts receivable - other	-	37,450
未収配当金 Accrued dividends receivable	51,142,621	39,390,413
流動資産合計 Total current assets	5,630,480,620	8,352,343,657
資産合計 Total assets	5,630,480,620	8,352,343,657
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	55,668,569	42,398,130
未払受託者報酬 Trustee fees payable	842,455	932,543
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	3,369,746	3,730,091
未払利息 Accrued interest expenses	5	11
その他未払費用 Other accrued expenses	409,111	467,348
流動負債合計 Total current liabilities	60,289,886	47,528,123
負債合計 Total liabilities	60,289,886	47,528,123
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	5,060,779,000	7,066,355,000
剰余金 Surplus		

期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	509,411,734	1,238,460,534
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	2,103,431	4,867,643
元本等合計 Total principal and other	5,570,190,734	8,304,815,534
純資産合計 Total net assets	5,570,190,734	8,304,815,534
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	5,630,480,620	8,352,343,657

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第6期 自 2020年10月21日 至 2021年4月20日 6th Fiscal Year From October 21, 2020 to April 20, 2021	第7期 自 2021年4月21日 至 2021年10月20日 7th Fiscal Year From April 21, 2021 to October 20, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	57,899,963	50,539,151
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	770,796,880	435,519,696
その他収益 Other revenue	6,954	7,299
営業収益合計 Total operating revenue	828,703,797	486,066,146
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	1,383	1,664
受託者報酬 Trustee fees	842,455	932,543
委託者報酬 Investment trust management fees	3,369,746	3,730,091
その他費用 Other expenses	696,235	719,810
営業費用合計 Total operating expenses	4,909,819	5,384,108
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	823,793,978	480,682,038
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	823,793,978	480,682,038
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	823,793,978	480,682,038
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 (△)	△227,334,692	509,411,734

Surplus (deficit) at beginning of period		
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	76,461,437	386,629,072
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	76,461,437	386,629,072
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	107,840,420	95,864,180
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	107,840,420	95,864,180
分配金 Dividends	55,668,569	42,398,130
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	509,411,734	1,238,460,534

(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。
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。
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。
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、2021年4月21日から2021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6期 2021年4月20日現在	第7期 2021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 5,060,779口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 7,066,355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 1,100.66円 (100口当たり純資産額) (110,066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 1,175.26円 (100口当たり純資産額) (117,526円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自2020年10月21日 至2021年4月20日	第7期 自2021年4月21日 至2021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>57,905,534円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>4,774,902円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>62,680,436円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	57,905,534円	分配準備積立金	B	4,774,902円	配当等収益合計額	C=A+B	62,680,436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>50,544,786円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,103,431円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>52,648,217円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	50,544,786円	分配準備積立金	B	2,103,431円	配当等収益合計額	C=A+B	52,648,217円
項目																									
当期配当等収益額	A	57,905,534円																							
分配準備積立金	B	4,774,902円																							
配当等収益合計額	C=A+B	62,680,436円																							
項目																									
当期配当等収益額	A	50,544,786円																							
分配準備積立金	B	2,103,431円																							
配当等収益合計額	C=A+B	52,648,217円																							

経費	D	4,908,436円	経費	D	5,382,444円
収益分配可能額	E=C-D	57,772,000円	収益分配可能額	E=C-D	47,265,773円
収益分配金	F	55,668,569円	収益分配金	F	42,398,130円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,103,431円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,867,643円
口数	H	5,060,779口	口数	H	7,066,355口
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,100円	100口当たり分配金	I=F/H×100	600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6期 自 2020年10月21日 至 2021年4月20日	第7期 自 2021年4月21日 至 2021年10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、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。</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。 ○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。</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>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第6期 2021年4月20日現在	第7期 2021年10月20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。 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6期 自 2020年10月21日 至 2021年4月20日	第7期 自 2021年4月21日 至 2021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6期 自 2020年10月21日 至 2021年4月20日	第7期 自 2021年4月21日 至 2021年10月20日
期首元本額	5,036,481,000円	5,060,779,000円
期中追加設定元本額	1,993,800,000円	2,999,400,000円
期中一部交換元本額	1,969,502,000円	993,824,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第6期 自 2020年10月21日 至 2021年4月20日	第7期 自 2021年4月21日 至 2021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	530,242,453	456,818,368
合計	530,242,453	456,818,368

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021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	I N P E X	34,300	969.00	33,236,700	
		石油資源開発	1,300	2,153.00	2,798,900	
		安藤・間	5,100	796.00	4,059,600	
		大成建設	6,400	3,680.00	23,552,000	
		大林組	20,200	976.00	19,715,200	
		清水建設	15,500	859.00	13,314,500	
		熊谷組	1,000	2,853.00	2,853,000	
		大東建託	4,600	13,800.00	63,480,000	
		住友林業	4,300	2,145.00	9,223,500	
		大和ハウス工業	26,500	3,791.00	100,461,500	
		積水ハウス	19,300	2,392.50	46,175,250	
		森永製菓	1,400	4,055.00	5,677,000	
		江崎グリコ	900	4,225.00	3,802,500	
		カルビー	3,700	2,780.00	10,286,000	

森永乳業	1,000	6,750.00	6,750,000
アサヒグループホールディングス	4,400	5,231.00	23,016,400
キリンホールディングス	18,700	2,032.00	37,998,400
宝ホールディングス	2,800	1,607.00	4,499,600
不二製油グループ本社	900	2,706.00	2,435,400
キッコーマン	4,400	9,570.00	42,108,000
味の素	15,800	3,411.00	53,893,800
カゴメ	1,300	2,878.00	3,741,400
ニチレイ	3,700	2,862.00	10,589,400
東洋紡	2,400	1,363.00	3,271,200
帝人	4,800	1,571.00	7,540,800
ゴールドウイン	900	6,860.00	6,174,000
王子ホールディングス	18,400	562.00	10,340,800
日本製紙	600	1,177.00	706,200
クラレ	6,800	1,053.00	7,160,400
旭化成	39,300	1,216.00	47,788,800
昭和電工	600	2,866.00	1,719,600
住友化学	24,200	573.00	13,866,600
信越化学工業	14,200	19,510.00	277,042,000
エア・ウォーター	5,100	1,733.00	8,838,300
三井化学	4,300	3,570.00	15,351,000
J S R	5,900	3,945.00	23,275,500
東京応化工業	1,200	6,990.00	8,388,000
三菱ケミカルホールディングス	15,300	974.20	14,905,260
ダイセル	9,500	867.00	8,236,500
積水化学工業	11,600	1,868.00	21,668,800
日本化薬	4,100	1,217.00	4,989,700
花王	18,500	6,555.00	121,267,500
日本ペイントホールディングス	19,600	1,194.00	23,402,400
D I C	2,600	3,100.00	8,060,000
資生堂	3,900	7,482.00	29,179,800
ライオン	9,300	1,908.00	17,744,400
ファンケル	600	3,580.00	2,148,000
コーセー	800	14,040.00	11,232,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,600	2,543.00	4,068,800

タカラバイオ	1,700	3,035.00	5,159,500
日東電工	5,900	8,090.00	47,731,000
ニフコ	2,700	3,650.00	9,855,000
ユニ・チャーム	12,700	4,546.00	57,734,200
協和キリン	8,000	3,775.00	30,200,000
アステラス製薬	62,900	1,950.50	122,686,450
大日本住友製薬	6,700	1,916.00	12,837,200
塩野義製薬	14,000	7,618.00	106,652,000
日本新薬	1,900	8,910.00	16,929,000
中外製薬	41,000	3,968.00	162,688,000
エーザイ	9,500	8,251.00	78,384,500
ロート製薬	3,000	3,450.00	10,350,000
参天製薬	9,400	1,644.00	15,453,600
栄研化学	1,100	1,995.00	2,194,500
JCRファーマ	2,200	2,940.00	6,468,000
第一三共	32,600	2,760.00	89,976,000
大塚ホールディングス	13,400	4,725.00	63,315,000
大正製薬ホールディングス	500	6,410.00	3,205,000
ペプチドリーム	1,100	2,741.00	3,015,100
サワイグループホールディングス	1,100	5,060.00	5,566,000
ENEOSホールディングス	60,300	466.00	28,099,800
ブリヂストン	13,600	5,097.00	69,319,200
日東紡績	600	3,625.00	2,175,000
住友大阪セメント	1,100	3,325.00	3,657,500
TOTO	3,900	5,760.00	22,464,000
日本碍子	5,700	1,951.00	11,120,700
日本特殊陶業	4,100	1,721.00	7,056,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	4,300	1,735.00	7,460,500
東京製鐵	2,500	1,099.00	2,747,500
日立金属	3,400	2,164.00	7,357,600
三井金属鉱業	300	3,450.00	1,035,000
三菱マテリアル	1,100	2,279.00	2,506,900
住友金属鉱山	1,900	4,488.00	8,527,200
DOWAホールディングス	1,300	4,920.00	6,396,000
古河電気工業	800	2,545.00	2,036,000

フジクラ	1,100	661.00	727,100
東洋製罐グループホールディングス	2,700	1,345.00	3,631,500
LIXIL	1,900	3,115.00	5,918,500
ディスコ	1,000	30,750.00	30,750,000
小松製作所	15,600	2,830.00	44,148,000
クボタ	23,000	2,400.00	55,200,000
荏原製作所	2,600	6,140.00	15,964,000
ダイキン工業	7,000	25,730.00	180,110,000
栗田工業	2,600	5,640.00	14,664,000
ダイフク	2,900	10,300.00	29,870,000
セガサミーホールディングス	1,400	1,628.00	2,279,200
ホンザキ	1,300	9,810.00	12,753,000
NTN	1,600	264.00	422,400
三菱重工業	2,500	3,061.00	7,652,500
日清紡ホールディングス	900	898.00	808,200
コニカミノルタ	4,400	609.00	2,679,600
ブラザー工業	7,200	2,353.00	16,941,600
ミネベアミツミ	12,400	2,855.00	35,402,000
三菱電機	42,400	1,606.50	68,115,600
安川電機	4,800	5,070.00	24,336,000
マブチモーター	1,300	3,960.00	5,148,000
日本電産	12,800	12,620.00	161,536,000
オムロン	4,700	10,960.00	51,512,000
日本電気	4,500	6,320.00	28,440,000
富士通	7,600	21,460.00	163,096,000
沖電気工業	600	967.00	580,200
ルネサスエレクトロニクス	4,600	1,372.00	6,311,200
セイコーエプソン	4,000	2,160.00	8,640,000
パナソニック	61,200	1,396.00	85,435,200
アンリツ	3,900	2,035.00	7,936,500
アルプスアルパイン	1,900	1,185.00	2,251,500
横河電機	5,400	2,214.00	11,955,600
アズビル	4,600	4,795.00	22,057,000
日本光電工業	2,900	3,650.00	10,585,000
堀場製作所	800	7,560.00	6,048,000

アドバンテスト	7,300	9,250.00	67,525,000
シスメックス	6,000	14,030.00	84,180,000
ウシオ電機	2,000	2,107.00	4,214,000
カシオ計算機	5,900	1,680.00	9,912,000
浜松ホトニクス	3,700	6,670.00	24,679,000
新光電気工業	1,900	3,865.00	7,343,500
太陽誘電	1,800	5,590.00	10,062,000
村田製作所	20,600	8,652.00	178,231,200
リコー	3,800	1,163.00	4,419,400
川崎重工業	1,500	2,347.00	3,520,500
日産自動車	17,700	604.00	10,690,800
トヨタ自動車	216,200	2,031.50	439,210,300
三菱自動車工業	5,400	380.00	2,052,000
アイシン	2,700	4,175.00	11,272,500
マツダ	6,100	1,061.00	6,472,100
豊田合成	1,500	2,348.00	3,522,000
テルモ	14,000	5,103.00	71,442,000
島津製作所	9,000	4,700.00	42,300,000
マニー	1,700	2,007.00	3,411,900
ニコン	4,400	1,288.00	5,667,200
HOYA	20,000	17,445.00	348,900,000
シチズン時計	2,600	520.00	1,352,000
バンダイナムコホールディングス	8,500	8,788.00	74,698,000
タカラトミー	1,200	1,112.00	1,334,400
凸版印刷	4,200	1,861.00	7,816,200
ピジョン	5,100	2,630.00	13,413,000
任天堂	3,800	50,300.00	191,140,000
コクヨ	2,200	1,802.00	3,964,400
中部電力	21,500	1,303.00	28,014,500
東京瓦斯	18,200	1,926.50	35,062,300
大阪瓦斯	16,200	1,915.00	31,023,000
東邦瓦斯	3,000	3,690.00	11,070,000
相鉄ホールディングス	600	2,185.00	1,311,000
東急	5,000	1,616.00	8,080,000
東日本旅客鉄道	2,500	7,414.00	18,535,000

西武ホールディングス	1,600	1,279.00	2,046,400
近鉄グループホールディングス	1,100	3,625.00	3,987,500
阪急阪神ホールディングス	2,900	3,475.00	10,077,500
日本通運	1,500	7,480.00	11,220,000
ヤマトホールディングス	8,300	2,806.00	23,289,800
日立物流	500	4,775.00	2,387,500
S Gホールディングス	13,100	2,901.00	38,003,100
日本郵船	1,200	7,800.00	9,360,000
日本航空	2,000	2,517.00	5,034,000
ANAホールディングス	1,700	2,753.00	4,680,100
三菱倉庫	1,700	3,225.00	5,482,500
NEC ネットエスアイ	2,400	2,088.00	5,011,200
T I S	8,000	3,150.00	25,200,000
コーエーテクモホールディングス	2,600	5,170.00	13,442,000
チェンジ	1,000	2,269.00	2,269,000
野村総合研究所	15,700	4,190.00	65,783,000
ラクスル	100	6,200.00	620,000
Zホールディングス	65,300	701.30	45,794,890
トレンドマイクロ	5,500	6,370.00	35,035,000
日本オラクル	2,200	10,560.00	23,232,000
オービックビジネスコンサルタント	400	5,890.00	2,356,000
伊藤忠テクノソリューションズ	3,900	3,635.00	14,176,500
大塚商会	4,300	5,760.00	24,768,000
ネットワンシステムズ	3,400	3,875.00	13,175,000
日本ユニシス	3,300	3,180.00	10,494,000
日本電信電話	47,700	3,138.00	149,682,600
KDD I	59,200	3,668.00	217,145,600
GMOインターネット	400	3,105.00	1,242,000
KADOKAWA	400	6,010.00	2,404,000
東宝	2,400	5,480.00	13,152,000
エヌ・ティ・ティ・データ	10,400	2,239.00	23,285,600
S C S K	5,800	2,349.00	13,624,200
富士ソフト	500	5,850.00	2,925,000
コナミホールディングス	1,900	6,650.00	12,635,000
ソフトバンクグループ	10,400	6,712.00	69,804,800

双日	3,900	1,934.00	7,542,600
アルフレッサ ホールディングス	4,600	1,655.00	7,613,000
メディパルホールディングス	4,100	2,136.00	8,757,600
伊藤忠商事	36,400	3,330.00	121,212,000
丸紅	15,400	959.30	14,773,220
豊田通商	1,600	5,050.00	8,080,000
三井物産	16,600	2,591.00	43,010,600
住友商事	12,700	1,612.00	20,472,400
三菱商事	10,900	3,609.00	39,338,100
サンリオ	600	2,712.00	1,627,200
PAL TAC	1,100	5,140.00	5,654,000
オートバックスセブン	1,700	1,535.00	2,609,500
ミスミグループ本社	7,600	4,840.00	36,784,000
スズケン	1,100	3,290.00	3,619,000
ローソン	500	5,350.00	2,675,000
日本マクドナルドホールディングス	2,800	5,150.00	14,420,000
Monotaro	11,400	2,623.00	29,902,200
J. フロント リテイリング	3,900	1,072.00	4,180,800
三越伊勢丹ホールディングス	5,900	838.00	4,944,200
すかいらーくホールディングス	1,400	1,573.00	2,202,200
FOOD & LIFE COMPANYIE	1,500	4,915.00	7,372,500
良品計画	2,600	2,321.00	6,034,600
スギホールディングス	1,300	8,340.00	10,842,000
しまむら	800	9,670.00	7,736,000
高島屋	2,000	1,128.00	2,256,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,400	919.00	1,286,600
丸井グループ	4,400	2,260.00	9,944,000
イオン	4,200	2,629.50	11,043,900
アインホールディングス	500	6,890.00	3,445,000
ニトリホールディングス	3,700	20,655.00	76,423,500
吉野家ホールディングス	500	2,219.00	1,109,500
サンドラッグ	3,300	3,510.00	11,583,000
ゆうちょ銀行	8,400	934.00	7,845,600
新生銀行	2,900	1,896.00	5,498,400
あおぞら銀行	1,900	2,718.00	5,164,200

りそなホールディングス	69,900	442.80	30,951,720
千葉銀行	20,600	741.00	15,264,600
京都銀行	1,500	5,270.00	7,905,000
みずほフィナンシャルグループ	31,900	1,565.00	49,923,500
大和証券グループ本社	21,100	677.60	14,297,360
野村ホールディングス	21,300	570.30	12,147,390
SOMPOホールディングス	19,300	4,970.00	95,921,000
MS&ADインシュアランスグループホール	22,200	3,725.00	82,695,000
第一生命ホールディングス	22,100	2,459.50	54,354,950
T&Dホールディングス	39,900	1,537.00	61,326,300
クレディセゾン	2,200	1,470.00	3,234,000
東京センチュリー	600	6,530.00	3,918,000
オリエン트コーポレーション	8,100	161.00	1,304,100
オリックス	46,300	2,191.50	101,466,450
日本取引所グループ	42,000	2,861.50	120,183,000
いちご	1,800	336.00	604,800
ヒューリック	3,200	1,128.00	3,609,600
野村不動産ホールディングス	2,500	2,954.00	7,385,000
オープンハウス	3,300	7,090.00	23,397,000
三井不動産	15,400	2,635.00	40,579,000
三菱地所	28,200	1,771.50	49,956,300
東京建物	1,400	1,708.00	2,391,200
イオンモール	1,000	1,732.00	1,732,000
カチタス	2,600	4,170.00	10,842,000
日本M&Aセンターホールディングス	15,200	3,395.00	51,604,000
カカクコム	6,100	3,820.00	23,302,000
ベネフィット・ワン	4,100	5,490.00	22,509,000
エムスリー	24,200	7,379.00	178,571,800
アウトソーシング	600	2,043.00	1,225,800
ディー・エヌ・エー	1,400	2,185.00	3,059,000
インフォマート	6,900	1,110.00	7,659,000
H. U. グループホールディングス	800	2,861.00	2,288,800
オリエンタルランド	4,600	17,955.00	82,593,000
ラウンドワン	500	1,406.00	703,000

	リゾートトラスト	2,700	2,045.00	5,521,500	
	サイバーエージェント	12,900	2,081.00	26,844,900	
	楽天グループ	5,200	1,233.00	6,411,600	
	エン・ジャパン	1,600	4,555.00	7,288,000	
	リクルートホールディングス	59,900	7,232.00	433,196,800	
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,400	2,473.00	3,462,200	
	エイチ・アイ・エス	200	2,641.00	528,200	
	共立メンテナンス	300	4,165.00	1,249,500	
	セコム	6,200	8,080.00	50,096,000	
	ベネッセホールディングス	1,000	2,636.00	2,636,000	
	小計 銘柄数：268			8,300,107,640	
	組入時価比率：99.9%			100.0%	
	合計			8,300,107,640	

(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(2021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

該当事項はありません。