



2022年4月期 (2021年10月21日～2022年4月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2022 (October 21, 2021 - April 20, 2022)

2022年6月1日
 June 1, 2022

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 2022年7月13日
 分配金支払開始日 2022年5月27日
 Scheduled date of submission of securities report: July 13, 2022
 Date of commencing dividend payment: May 27, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2022年4月期の運用状況 (2021年10月21日～2022年4月20日)

Management Status for Year ended April 2022 (from October 21, 2021 to April 20, 2022)

(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.	%
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	6,996	(98.2)	127	(1.8)	7,124	(100.0)
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	9,771	(98.6)	135	(1.4)	9,906	(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
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	487	0	117	369
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	446	79	39	487

(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
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	7,220	96	7,124	19,285
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	9,997	90	9,906	20,333

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	214
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	152

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 11 期 (2021 年 10 月 20 日現在) 11th Fiscal Year As of October 20, 2021	第 12 期 (2022 年 4 月 20 日現在) 12th Fiscal Year As of April 20, 2022
	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	149,108,883	137,146,481
株式 Stocks	9,771,216,590	6,996,629,660
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	4,266,920
未収入金 Accounts receivable - other	22,032	6,567,291
未収配当金 Accrued dividends receivable	66,414,600	74,718,968
差入委託証拠金 Margin deposits	10,742,798	897,470
流動資産合計 Total current assets	9,997,504,903	7,220,226,790
資産合計 Total assets	9,997,504,903	7,220,226,790
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,755,970	1,991,930
未払金 Accounts payable - other	784,977	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	74,057,440	79,053,740
未払受託者報酬 Trustee fees payable	2,337,561	2,014,533
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	8,415,190	7,252,295
未払利息 Accrued interest expenses	135	45
その他未払費用 Other accrued expenses	3,429,312	5,799,186
流動負債合計 Total current liabilities	90,780,585	96,111,729
負債合計 Total liabilities	90,780,585	96,111,729

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,261,264,220	4,747,287,910
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	3,645,460,098	2,376,827,151
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	120,069	72,570
元本等合計 Total principal and other	9,906,724,318	7,124,115,061
純資産合計 Total net assets	9,906,724,318	7,124,115,061
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	9,997,504,903	7,220,226,790

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第11期 自 2021年4月21日 至 2021年10月20日 11th Fiscal Year From April 21, 2021 to October 20, 2021	第12期 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日 12th Fiscal Year From October 21, 2021 to April 20, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	87,942,373	91,054,681
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	540,817,924	△408,322,930
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	7,131,741	△8,034,028
その他収益 Other revenue	34,072	908
営業収益合計 Total operating revenue	635,926,110	△325,301,369
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	20,375	11,150
受託者報酬 Trustee fees	2,337,561	2,014,533
委託者報酬 Investment trust management fees	8,415,190	7,252,295
その他費用 Other expenses	3,224,481	2,771,370
営業費用合計 Total operating expenses	13,997,607	12,049,348
営業利益又は営業損失 (△)	621,928,503	△337,350,717

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	621,928,503	△337,350,717
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	621,928,503	△337,350,717
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	2,825,605,720	3,645,460,098
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	541,990,312	-
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	541,990,312	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	270,006,997	852,228,490
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	270,006,997	852,228,490
分配金 Dividends	74,057,440	79,053,740
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	3,645,460,098	2,376,827,151

(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、2021年10月21日から2022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 11 期 2021 年 10 月 20 日現在	第 12 期 2022 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 487,220 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 369,410 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 20,333 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 19,285 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 11 期 自 2021 年 4 月 21 日 至 2021 年 10 月 20 日	第 12 期 自 2021 年 10 月 21 日 至 2022 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>87,956,070 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>198,671 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>88,154,741 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>13,977,232 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>74,177,509 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>74,057,440 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>120,069 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>487,220 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>152 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち 2,816,255 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	87,956,070 円	分配準備積立金	B	198,671 円	配当等収益合計額	C=A+B	88,154,741 円	経費	D	13,977,232 円	収益分配可能額	E=C-D	74,177,509 円	収益分配金	F	74,057,440 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	120,069 円	口数	H	487,220 口	1 口当たり分配金	I=F/H	152 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>91,044,439 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>120,069 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>91,164,508 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>12,038,198 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>79,126,310 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>72,570 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 2,417,384 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	91,044,439 円	分配準備積立金	B	120,069 円	配当等収益合計額	C=A+B	91,164,508 円	経費	D	12,038,198 円	収益分配可能額	E=C-D	79,126,310 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	72,570 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	87,956,070 円																																																											
分配準備積立金	B	198,671 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	88,154,741 円																																																											
経費	D	13,977,232 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	74,177,509 円																																																											
収益分配金	F	74,057,440 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	120,069 円																																																											
口数	H	487,220 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	152 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	91,044,439 円																																																											
分配準備積立金	B	120,069 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	91,164,508 円																																																											
経費	D	12,038,198 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	79,126,310 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	72,570 円																																																											
口数	H	369,410 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	214 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 11 期 自 2021 年 4 月 21 日 至 2021 年 10 月 20 日	第 12 期 自 2021 年 10 月 21 日 至 2022 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。</p> <p>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</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>

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。

○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。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第11期 2021年10月20日現在	第12期 2022年4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。</p> <p>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。</p> <p>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11期 自2021年4月21日 至2021年10月20日	第12期 自2021年10月21日 至2022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11期 自2021年4月21日 至2021年10月20日	第12期 自2021年10月21日 至2022年4月20日
期首元本額 5,744,101,427円	期首元本額 6,261,264,220円
期中追加設定元本額 1,027,000,516円	期中追加設定元本額 0円
期中一部交換元本額 509,837,723円	期中一部交換元本額 1,513,976,310円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第11期 自2021年4月21日 至2021年10月20日	第12期 自2021年10月21日 至2022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	541,937,164	△378,645,820
合計	541,937,164	△378,645,820

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11期(2021年10月20日現在)			第12期(2022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	131,604,930	—	129,856,000	△1,755,970	120,213,970	—	122,496,000	2,274,990
合計	131,604,930	—	129,856,000	△1,755,970	120,213,970	—	122,496,000	2,274,990

(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(2022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	2,400	2,667.00	6,400,800	
		大成建設	4,200	3,545.00	14,889,000	
		大林組	14,600	903.00	13,183,800	
		清水建設	11,800	733.00	8,649,400	
		長谷工コーポレーション	5,000	1,407.00	7,035,000	
		鹿島建設	9,700	1,475.00	14,307,500	
		大東建託	1,400	12,470.00	17,458,000	
		住友林業	3,000	2,119.00	6,357,000	
		大和ハウス工業	11,500	3,113.00	35,799,500	
		積水ハウス	12,300	2,253.50	27,718,050	
		エクシオグループ	2,000	2,151.00	4,302,000	
		インフロニア・ホールディングス	4,300	964.00	4,145,200	
		日清製粉グループ本社	4,000	1,725.00	6,900,000	
		森永製菓	800	3,940.00	3,152,000	
		カルビー	1,900	2,315.00	4,398,500	
		森永乳業	700	5,050.00	3,535,000	
		ヤクルト本社	2,500	6,540.00	16,350,000	
		明治ホールディングス	2,600	6,390.00	16,614,000	
		日本ハム	1,700	4,110.00	6,987,000	
		アサヒグループホールディングス	8,200	4,516.00	37,031,200	
キリンホールディングス	17,300	1,785.50	30,889,150			
宝ホールディングス	3,200	1,060.00	3,392,000			
サントリー食品インターナショナル	2,800	4,880.00	13,664,000			

伊藤園	1,300	5,350.00	6,955,000
キッコーマン	3,100	8,360.00	25,916,000
味の素	9,700	3,426.00	33,232,200
キューピー	2,100	2,149.00	4,512,900
ニチレイ	2,100	2,300.00	4,830,000
日清食品ホールディングス	1,400	8,860.00	12,404,000
日本たばこ産業	24,000	2,202.00	52,848,000
帝人	3,900	1,356.00	5,288,400
東レ	29,700	627.00	18,621,900
ゴールドウイン	500	6,250.00	3,125,000
レンゴー	3,800	758.00	2,880,400
クラレ	6,700	1,042.00	6,981,400
旭化成	25,800	1,076.00	27,760,800
昭和電工	2,900	2,409.00	6,986,100
住友化学	30,800	560.00	17,248,000
日産化学	2,500	7,260.00	18,150,000
東ソー	5,400	1,773.00	9,574,200
トクヤマ	1,400	1,677.00	2,347,800
デンカ	1,700	3,360.00	5,712,000
信越化学工業	7,900	17,630.00	139,277,000
エア・ウォーター	3,300	1,673.00	5,520,900
カネカ	1,000	3,465.00	3,465,000
三菱瓦斯化学	3,500	1,865.00	6,527,500
三井化学	3,800	2,953.00	11,221,400
J S R	4,200	3,520.00	14,784,000
三菱ケミカルホールディングス	27,500	793.20	21,813,000
ダイセル	5,400	783.00	4,228,200
積水化学工業	8,100	1,675.00	13,567,500
トリケミカル研究所	600	2,626.00	1,575,600
ADEKA	1,500	2,639.00	3,958,500
花王	10,600	5,058.00	53,614,800
日本ペイントホールディングス	14,400	1,031.00	14,846,400
D I C	1,500	2,439.00	3,658,500
富士フイルムホールディングス	7,700	7,473.00	57,542,100
資生堂	8,600	6,120.00	52,632,000

ライオン	4,900	1,281.00	6,276,900
ミルボン	500	5,250.00	2,625,000
ファンケル	1,800	2,549.00	4,588,200
コーセー	700	12,960.00	9,072,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,900	1,509.00	2,867,100
小林製薬	1,100	9,360.00	10,296,000
タカラバイオ	1,100	2,218.00	2,439,800
日東電工	3,300	8,770.00	28,941,000
エフピコ	900	2,814.00	2,532,600
ユニ・チャーム	8,000	4,448.00	35,584,000
協和キリン	5,500	2,700.00	14,850,000
武田薬品工業	28,500	3,760.00	107,160,000
アステラス製薬	40,100	2,053.00	82,325,300
住友ファーマ	3,000	1,089.00	3,267,000
塩野義製薬	5,800	6,880.00	39,904,000
日本新薬	1,000	8,910.00	8,910,000
中外製薬	13,700	4,215.00	57,745,500
エーザイ	5,500	5,731.00	31,520,500
ロート製薬	2,100	3,330.00	6,993,000
小野薬品工業	8,200	3,220.00	26,404,000
参天製薬	8,100	1,020.00	8,262,000
ツムラ	1,400	3,185.00	4,459,000
JCRファーマ	1,400	2,331.00	3,263,400
第一三共	38,500	2,896.50	111,515,250
大幸薬品	800	595.00	476,000
大塚ホールディングス	9,000	4,175.00	37,575,000
出光興産	4,200	3,525.00	14,805,000
ENEOSホールディングス	70,500	458.90	32,352,450
TOYO TIRE	2,200	1,477.00	3,249,400
ブリヂストン	12,100	4,739.00	57,341,900
住友ゴム工業	3,400	1,139.00	3,872,600
AGC	4,000	4,950.00	19,800,000
東海カーボン	3,800	1,061.00	4,031,800
TOTO	3,100	4,405.00	13,655,500
日本碍子	5,500	1,717.00	9,443,500

日本特殊陶業	3,100	1,959.00	6,072,900
DOWAホールディングス	1,100	6,130.00	6,743,000
住友電気工業	15,600	1,417.50	22,113,000
SUMCO	5,600	1,907.00	10,679,200
三和ホールディングス	4,100	1,173.00	4,809,300
三浦工業	1,700	2,696.00	4,583,200
FUJII	1,400	2,133.00	2,986,200
DMG森精機	2,500	1,614.00	4,035,000
ディスコ	700	30,050.00	21,035,000
ナブテスコ	2,500	3,130.00	7,825,000
SMC	1,400	65,140.00	91,196,000
小松製作所	19,300	3,029.00	58,459,700
住友重機械工業	2,400	2,762.00	6,628,800
日立建機	2,400	3,250.00	7,800,000
クボタ	21,600	2,273.00	49,096,800
荏原製作所	1,800	6,040.00	10,872,000
ダイキン工業	5,200	20,245.00	105,274,000
栗田工業	2,200	4,295.00	9,449,000
ダイフク	2,100	8,050.00	16,905,000
グローリー	1,000	2,039.00	2,039,000
マキタ	5,000	3,792.00	18,960,000
ブラザー工業	5,000	2,245.00	11,225,000
ミネベアミツミ	7,700	2,559.00	19,704,300
日立製作所	21,300	6,009.00	127,991,700
三菱電機	40,000	1,394.00	55,760,000
富士電機	2,800	5,630.00	15,764,000
安川電機	5,000	4,555.00	22,775,000
明電舎	700	2,327.00	1,628,900
オムロン	4,100	7,563.00	31,008,300
富士通	3,900	18,915.00	73,768,500
セイコーエプソン	6,200	1,831.00	11,352,200
エレコム	800	1,516.00	1,212,800
パナソニックホールディングス	48,600	1,140.50	55,428,300
シャープ	4,200	1,118.00	4,695,600
アンリツ	3,000	1,608.00	4,824,000

富士通ゼネラル	1,200	2,259.00	2,710,800
TDK	8,400	4,070.00	34,188,000
横河電機	4,900	2,130.00	10,437,000
アズビル	2,500	3,890.00	9,725,000
日本光電工業	1,600	3,025.00	4,840,000
堀場製作所	700	5,920.00	4,144,000
アドバンテスト	4,600	8,440.00	38,824,000
キーエンス	3,400	53,590.00	182,206,000
シスメックス	2,800	8,953.00	25,068,400
日本電子	800	5,680.00	4,544,000
ファナック	4,400	21,000.00	92,400,000
浜松ホトニクス	3,100	5,860.00	18,166,000
京セラ	6,900	6,835.00	47,161,500
太陽誘電	2,600	5,080.00	13,208,000
村田製作所	12,200	7,787.00	95,001,400
小糸製作所	2,000	4,750.00	9,500,000
キヤノン	21,900	3,114.00	68,196,600
東京エレクトロン	3,500	54,730.00	191,555,000
トヨタ紡織	1,100	1,943.00	2,137,300
豊田自動織機	3,300	7,900.00	26,070,000
デンソー	9,700	7,538.00	73,118,600
いすゞ自動車	11,500	1,581.00	18,181,500
トヨタ自動車	105,000	2,258.50	237,142,500
アイシン	3,400	3,965.00	13,481,000
スズキ	7,600	4,126.00	31,357,600
SUBARU	12,600	1,936.00	24,393,600
ヤマハ発動機	5,900	2,733.00	16,124,700
シマノ	1,600	25,495.00	40,792,000
デルモ	13,100	3,923.00	51,391,300
島津製作所	4,700	4,115.00	19,340,500
東京精密	800	4,395.00	3,516,000
オリンパス	24,200	2,393.50	57,922,700
HOYA	8,300	13,025.00	108,107,500
朝日インテック	4,800	2,699.00	12,955,200
スノーピーク	600	2,714.00	1,628,400

バンダイナムコホールディングス	4,300	9,008.00	38,734,400
ピジョン	2,500	2,083.00	5,207,500
任天堂	2,500	64,260.00	160,650,000
関西電力	15,200	1,219.00	18,528,800
東北電力	9,700	741.00	7,187,700
九州電力	8,600	843.00	7,249,800
電源開発	3,000	1,820.00	5,460,000
東京瓦斯	7,900	2,320.00	18,328,000
大阪瓦斯	8,000	2,142.00	17,136,000
東海旅客鉄道	2,900	16,175.00	46,907,500
山九	1,000	3,790.00	3,790,000
S Gホールディングス	7,200	2,148.00	15,465,600
N I P P O N E X P R E S S ホールディング	1,600	7,500.00	12,000,000
T I S	4,200	2,797.00	11,747,400
ネクソン	10,800	2,944.00	31,795,200
野村総合研究所	6,600	4,060.00	26,796,000
Zホールディングス	59,100	520.00	30,732,000
トレンドマイクロ	3,000	7,130.00	21,390,000
日本オラクル	800	8,470.00	6,776,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,000	3,020.00	6,040,000
大塚商会	2,400	4,155.00	9,972,000
サイボウズ	500	1,281.00	640,500
ネットワンシステムズ	1,900	3,065.00	5,823,500
B I P R O G Y	1,500	3,150.00	4,725,000
日本電信電話	55,900	3,792.00	211,972,800
K D D I	35,700	4,225.00	150,832,500
ソフトバンク	47,300	1,493.00	70,618,900
エヌ・ティ・ティ・データ	14,500	2,372.00	34,394,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,000	5,060.00	10,120,000
カプコン	3,800	2,935.00	11,153,000
S C S K	3,300	2,023.00	6,675,900
コナミホールディングス	2,200	8,070.00	17,754,000
双日	3,900	2,032.00	7,924,800
神戸物産	2,400	3,500.00	8,400,000

伊藤忠商事	28,100	4,032.00	113,299,200
丸紅	34,300	1,480.50	50,781,150
豊田通商	4,500	4,845.00	21,802,500
三井物産	35,100	3,294.00	115,619,400
住友商事	24,300	2,114.00	51,370,200
三菱商事	27,100	4,529.00	122,735,900
岩谷産業	900	5,020.00	4,518,000
ミスミグループ本社	4,600	3,235.00	14,881,000
エービーシー・マート	700	5,300.00	3,710,000
くら寿司	400	3,405.00	1,362,000
セリア	900	2,572.00	2,314,800
ジズホールディングス	200	4,675.00	935,000
Monotaro	5,500	2,473.00	13,601,500
マツキョココカラ&カンパニー	1,700	4,095.00	6,961,500
ZOZO	2,300	3,125.00	7,187,500
ウエルシアホールディングス	2,000	2,616.00	5,232,000
コスモス薬品	400	12,100.00	4,840,000
セブン&アイ・ホールディングス	15,700	5,810.00	91,217,000
ツルハホールディングス	800	6,470.00	5,176,000
トリドールホールディングス	1,200	2,485.00	2,982,000
クスリのアオキホールディングス	400	5,990.00	2,396,000
FOOD & LIFE COMPANYIE	2,300	3,220.00	7,406,000
コーナン商事	600	3,690.00	2,214,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	8,900	1,901.00	16,918,900
ゼンショーホールディングス	2,000	2,981.00	5,962,000
ワークマン	300	4,605.00	1,381,500
スギホールディングス	800	5,500.00	4,400,000
日本瓦斯	2,300	1,551.00	3,567,300
ライフコーポレーション	300	3,030.00	909,000
しまむら	500	11,270.00	5,635,000
ヤオコー	400	6,810.00	2,724,000
ケーズホールディングス	4,000	1,231.00	4,924,000
ヤマダホールディングス	15,100	380.00	5,738,000
ニトリホールディングス	1,600	13,680.00	21,888,000

ファーストリテイリング	400	64,470.00	25,788,000
サンドラッグ	1,600	2,919.00	4,670,400
りそなホールディングス	49,100	571.70	28,070,470
三井住友フィナンシャルグループ	29,100	3,981.00	115,847,100
セブン銀行	12,800	245.00	3,136,000
SBIホールディングス	5,400	2,904.00	15,681,600
大和証券グループ本社	31,800	656.80	20,886,240
東京海上ホールディングス	14,000	6,792.00	95,088,000
東京センチュリー	900	4,020.00	3,618,000
オリックス	29,100	2,400.00	69,840,000
ヒューリック	6,000	1,083.00	6,498,000
野村不動産ホールディングス	2,700	3,020.00	8,154,000
サムティ	500	2,085.00	1,042,500
オープンハウスグループ	1,400	5,350.00	7,490,000
飯田グループホールディングス	3,200	2,114.00	6,764,800
三井不動産	19,400	2,717.50	52,719,500
三菱地所	24,600	1,839.50	45,251,700
住友不動産	6,500	3,464.00	22,516,000
ミクシィ	900	2,283.00	2,054,700
エス・エム・エス	1,500	3,345.00	5,017,500
パーソルホールディングス	4,000	2,669.00	10,676,000
カカクコム	3,000	2,623.00	7,869,000
ディップ	700	4,055.00	2,838,500
ベネフィット・ワン	1,500	2,212.00	3,318,000
エムスリー	6,300	4,467.00	28,142,100
博報堂DYホールディングス	4,900	1,544.00	7,565,600
エスプール	1,200	1,336.00	1,603,200
インフォマート	4,000	663.00	2,652,000
H. U. グループホールディングス	1,200	2,938.00	3,525,600
オリエンタルランド	4,100	22,585.00	92,598,500
サイバーエージェント	9,100	1,418.00	12,903,800
楽天グループ	18,600	961.00	17,874,600
エン・ジャパン	700	3,110.00	2,177,000
テクノプロ・ホールディングス	2,500	3,190.00	7,975,000
Keeper 技研	300	2,765.00	829,500

	リクルートホールディングス	28,300	5,095.00	144,188,500	
	インソース	400	2,105.00	842,000	
	ペイカレント・コンサルティング	300	38,850.00	11,655,000	
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,100	1,579.00	1,736,900	
	リログループ	2,600	1,865.00	4,849,000	
	セコム	4,700	8,883.00	41,750,100	
	小計 銘柄数：272			6,996,629,660	
	組入時価比率：98.2%			100.0%	
	合計			6,996,629,660	

(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(2022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。