



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

2022 年 11 月 30 日  
 November 30, 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 2023 年 1 月 18 日  
 分配金支払開始日 2022 年 11 月 28 日  
 Scheduled date of submission of securities report: January 18, 2023  
 Date of commencing dividend payment: November 28, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

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

Management Status for Year ended October 2022 (from April 21, 2022 to October 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 10 月期 FY ended Oct. 2022	6,876	(98.1)	132	(1.9)	7,008	(100.0)
2022 年 4 月期 FY ended Apr. 2022	6,996	(98.2)	127	(1.8)	7,124	(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 10 月期 FY ended Oct. 2022	369	0	0	369
2022 年 4 月期 FY ended Apr. 2022	487	0	117	369

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	1口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×1) Net Asset Value per 1 unit ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×1)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2022 年 10 月期 FY ended Oct. 2022	7,101	92	7,008	18,973
2022 年 4 月期 FY ended Apr. 2022	7,220	96	7,124	19,285

(4) 分配金

Dividend Payment

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

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無  
 Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無  
 Changes other than those in ① No

II 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit: JPY)

	第 12 期 (2022 年 4 月 20 日現在) 12th Fiscal Year As of April 20, 2022	第 13 期 (2022 年 10 月 20 日現在) 13th Fiscal Year As of October 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	137,146,481	141,090,277
株式 Stocks	6,996,629,660	6,876,528,520
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	4,266,920	2,178,920
未収入金 Accounts receivable - other	6,567,291	-
未収配当金 Accrued dividends receivable	74,718,968	73,864,855
差入委託証拠金 Margin deposits	897,470	7,827,450
流動資産合計 Total current assets	7,220,226,790	7,101,490,022
資産合計 Total assets	7,220,226,790	7,101,490,022
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,991,930	733,460
未払金 Accounts payable - other	-	938,300
未払収益分配金 Unpaid dividends	79,053,740	79,053,740
未払受託者報酬 Trustee fees payable	2,014,533	1,963,264
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	7,252,295	7,067,691
未払利息 Accrued interest expenses	45	178
その他未払費用 Other accrued expenses	5,799,186	2,876,052
流動負債合計 Total current liabilities	96,111,729	92,632,685
負債合計 Total liabilities	96,111,729	92,632,685

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	4,747,287,910	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	2,376,827,151	2,261,569,427
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	72,570	326,296
元本等合計 Total principal and other	7,124,115,061	7,008,857,337
純資産合計 Total net assets	7,124,115,061	7,008,857,337
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	7,220,226,790	7,101,490,022

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	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	第 13 期 自 2022 年 4 月 21 日 至 2022 年 10 月 20 日 13th Fiscal Year From April 21, 2022 to October 20, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	91,054,681	91,092,910
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△408,322,930	△117,892,500
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△8,034,028	2,381,050
その他収益 Other revenue	908	2,657
営業収益合計 Total operating revenue	△325,301,369	△24,415,883
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	11,150	13,848
受託者報酬 Trustee fees	2,014,533	1,963,264
委託者報酬 Investment trust management fees	7,252,295	7,067,691
その他費用 Other expenses	2,771,370	2,743,298
営業費用合計 Total operating expenses	12,049,348	11,788,101
営業利益又は営業損失 (△)	△337,350,717	△36,203,984

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△337,350,717	△36,203,984
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△337,350,717	△36,203,984
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	3,645,460,098	2,376,827,151
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	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	852,228,490	-
分配金 Dividends	79,053,740	79,053,740
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,376,827,151	2,261,569,427

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2022年4月21日から2022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12期 2022年4月20日現在	第13期 2022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 369,410 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	19,285 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	18,973 円
--	----------	--	----------

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 12 期 自 2021 年 10 月 21 日 至 2022 年 4 月 20 日			第 13 期 自 2022 年 4 月 21 日 至 2022 年 10 月 20 日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	91,044,439 円	当期配当等収益額	A	91,081,719 円
分配準備積立金	B	120,069 円	分配準備積立金	B	72,570 円
配当等収益合計額	C=A+B	91,164,508 円	配当等収益合計額	C=A+B	91,154,289 円
経費	D	12,038,198 円	経費	D	11,774,253 円
収益分配可能額	E=C-D	79,126,310 円	収益分配可能額	E=C-D	79,380,036 円
収益分配金	F	79,053,740 円	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	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	326,296 円
口数	H	369,410 口	口数	H	369,410 口
1 口当たり分配金	I=F/H	214 円	1 口当たり分配金	I=F/H	214 円
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。			2. その他費用 その他費用のうち 2,353,236 円は、対象指数についての商標使用料であります。		

(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 12 期 自 2021 年 10 月 21 日 至 2022 年 4 月 20 日		第 13 期 自 2022 年 4 月 21 日 至 2022 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。 ○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。		3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左	

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第12期 2022年4月20日現在	第13期 2022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。	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 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。	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12期 自2021年10月21日 至2022年4月20日	第13期 自2022年4月21日 至2022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12期 自2021年10月21日 至2022年4月20日	第13期 自2022年4月21日 至2022年10月20日
期首元本額 6,261,264,220円	期首元本額 4,747,287,910円
期中追加設定元本額 0円	期中追加設定元本額 0円
期中一部交換元本額 1,513,976,310円	期中一部交換元本額 0円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第12期 自2021年10月21日 至2022年4月20日	第13期 自2022年4月21日 至2022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	△378,645,820	△111,281,290
合計	△378,645,820	△111,281,290

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12期(2022年4月20日現在)				第13期(2022年10月20日現在)			
	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	120,213,970	—	122,496,000	2,274,990	129,163,950	—	130,617,000	1,445,460
合計	120,213,970	—	122,496,000	2,274,990	129,163,950	—	130,617,000	1,445,460

(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	コムシスホールディングス	2,500	2,460.00	6,150,000	
		大林組	14,600	964.00	14,074,400	
		清水建設	11,800	743.00	8,767,400	
		長谷工コーポレーション	4,400	1,557.00	6,850,800	
		鹿島建設	9,700	1,394.00	13,521,800	
		西松建設	900	3,775.00	3,397,500	
		住友林業	2,900	2,280.00	6,612,000	
		大和ハウス工業	11,500	2,982.50	34,298,750	
		積水ハウス	12,300	2,444.00	30,061,200	
		エクシオグループ	2,000	2,195.00	4,390,000	
		日清製粉グループ本社	4,100	1,575.00	6,457,500	
		森永製菓	800	3,835.00	3,068,000	
		山崎製パン	2,100	1,633.00	3,429,300	
		カルビー	1,900	3,040.00	5,776,000	
		ヤクルト本社	2,600	8,310.00	21,606,000	
		明治ホールディングス	2,600	6,250.00	16,250,000	
		日本ハム	1,700	3,625.00	6,162,500	
		アサヒグループホールディングス	8,600	4,277.00	36,782,200	
		キリンホールディングス	17,000	2,201.00	37,417,000	
		宝ホールディングス	3,200	1,056.00	3,379,200	
		サントリー食品インターナショナル	2,700	5,040.00	13,608,000	
		キッコーマン	3,100	8,200.00	25,420,000	
		味の素	9,800	4,091.00	40,091,800	
カゴメ	1,700	2,999.00	5,098,300			
ニチレイ	2,100	2,285.00	4,798,500			



日清食品ホールディングス	1,400	9,650.00	13,510,000
日本たばこ産業	23,800	2,435.50	57,964,900
東洋紡	1,700	1,031.00	1,752,700
帝人	3,900	1,383.00	5,393,700
ゴールドウイン	600	7,760.00	4,656,000
レンゴー	3,900	841.00	3,279,900
クラレ	6,600	1,023.00	6,751,800
旭化成	26,500	949.90	25,172,350
昭和電工	3,500	2,122.00	7,427,000
住友化学	31,100	505.00	15,705,500
日産化学	2,500	6,700.00	16,750,000
東ソー	5,400	1,621.00	8,753,400
トクヤマ	1,400	1,753.00	2,454,200
デンカ	1,700	3,200.00	5,440,000
信越化学工業	8,000	14,935.00	119,480,000
エア・ウォーター	3,400	1,648.00	5,603,200
カネカ	1,000	3,670.00	3,670,000
三菱瓦斯化学	3,600	1,886.00	6,789,600
三井化学	3,900	2,777.00	10,830,300
東京応化工業	700	6,110.00	4,277,000
三菱ケミカルグループ	27,900	668.30	18,645,570
ダイセル	5,400	843.00	4,552,200
住友ベークライト	700	4,040.00	2,828,000
積水化学工業	8,000	1,777.00	14,216,000
日本ゼオン	2,600	1,313.00	3,413,800
アイカ工業	1,100	3,185.00	3,503,500
ADEKA	1,500	2,140.00	3,210,000
花王	10,400	5,706.00	59,342,400
日本ペイントホールディングス	18,200	969.00	17,635,800
D I C	1,500	2,436.00	3,654,000
富士フイルムホールディングス	7,600	6,812.00	51,771,200
ライオン	5,000	1,584.00	7,920,000
ミルボン	500	6,040.00	3,020,000
コーセー	700	15,510.00	10,857,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,900	1,657.00	3,148,300

小林製薬	1,200	7,950.00	9,540,000
タカラバイオ	1,100	1,673.00	1,840,300
日東電工	3,400	7,970.00	27,098,000
エフピコ	900	3,670.00	3,303,000
ユニ・チャーム	8,200	4,637.00	38,023,400
協和キリン	5,600	3,360.00	18,816,000
武田薬品工業	27,800	3,768.00	104,750,400
アステラス製薬	41,200	2,005.50	82,626,600
住友ファーマ	3,100	1,041.00	3,227,100
塩野義製薬	5,800	6,848.00	39,718,400
日本新薬	1,000	7,510.00	7,510,000
中外製薬	13,500	3,604.00	48,654,000
エーザイ	5,700	8,262.00	47,093,400
ロート製薬	2,100	4,645.00	9,754,500
小野薬品工業	8,300	3,445.00	28,593,500
参天製薬	8,100	980.00	7,938,000
JCRファーマ	1,400	1,998.00	2,797,200
第一三共	37,000	4,423.00	163,651,000
大塚ホールディングス	9,000	4,654.00	41,886,000
出光興産	4,300	3,280.00	14,104,000
ENEOSホールディングス	70,300	481.50	33,849,450
TOYO TIRE	2,300	1,656.00	3,808,800
ブリヂストン	12,500	5,083.00	63,537,500
住友ゴム工業	3,500	1,242.00	4,347,000
AGC	4,100	4,540.00	18,614,000
東海カーボン	3,900	940.00	3,666,000
TOTO	3,100	4,635.00	14,368,500
日本碍子	5,500	1,848.00	10,164,000
日本特殊陶業	3,200	2,692.00	8,614,400
フジミインコーポレーテッド	300	6,100.00	1,830,000
JFEホールディングス	10,600	1,407.00	14,914,200
住友金属鉱山	5,100	4,149.00	21,159,900
DOWAホールディングス	1,100	4,930.00	5,423,000
住友電気工業	15,300	1,529.00	23,393,700
SUMCO	6,900	1,834.00	12,654,600

三和ホールディングス	4,100	1,250.00	5,125,000
リンナイ	800	10,040.00	8,032,000
三浦工業	1,800	3,010.00	5,418,000
F U J I	1,500	1,943.00	2,914,500
ディスコ	700	31,000.00	21,700,000
ナブテスコ	2,400	3,035.00	7,284,000
SMC	1,400	58,220.00	81,508,000
小松製作所	19,400	2,663.50	51,671,900
住友重機械工業	2,400	2,779.00	6,669,600
日立建機	2,400	2,651.00	6,362,400
クボタ	21,400	2,000.00	42,800,000
荏原製作所	1,900	4,760.00	9,044,000
ダイキン工業	5,300	22,245.00	117,898,500
栗田工業	2,200	5,180.00	11,396,000
ダイフク	2,200	6,810.00	14,982,000
マキタ	5,000	2,799.00	13,995,000
ブラザー工業	5,100	2,588.00	13,198,800
ミネベアミツミ	7,400	2,087.00	15,443,800
日立製作所	21,400	6,412.00	137,216,800
東芝	8,700	5,403.00	47,006,100
三菱電機	40,600	1,389.00	56,393,400
富士電機	2,800	5,240.00	14,672,000
安川電機	5,000	4,065.00	20,325,000
オムロン	4,200	6,834.00	28,702,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,400	2,207.00	3,089,800
日本電気	5,600	4,840.00	27,104,000
富士通	3,900	16,195.00	63,160,500
ルネサスエレクトロニクス	22,800	1,203.00	27,428,400
セイコーエプソン	6,100	2,031.00	12,389,100
エレコム	900	1,340.00	1,206,000
シャープ	4,700	864.00	4,060,800
アンリツ	3,000	1,615.00	4,845,000
富士通ゼネラル	1,200	3,050.00	3,660,000
TDK	8,500	4,575.00	38,887,500
ヒロセ電機	700	19,840.00	13,888,000

横河電機	5,000	2,368.00	11,840,000
アズビル	2,500	3,970.00	9,925,000
日本光電工業	1,600	3,405.00	5,448,000
堀場製作所	700	5,780.00	4,046,000
アドバンテスト	4,600	7,000.00	32,200,000
キーエンス	4,000	48,050.00	192,200,000
シスメックス	3,100	7,881.00	24,431,100
レーザーテック	1,600	18,580.00	29,728,000
日本電子	900	5,260.00	4,734,000
ファナック	4,400	20,335.00	89,474,000
ローム	1,900	9,960.00	18,924,000
浜松ホトニクス	3,200	6,490.00	20,768,000
新光電気工業	1,500	3,240.00	4,860,000
京セラ	6,900	7,325.00	50,542,500
太陽誘電	2,600	3,790.00	9,854,000
村田製作所	12,400	6,971.00	86,440,400
S C R E E Nホールディングス	900	7,750.00	6,975,000
キヤノン	21,800	3,295.00	71,831,000
東京エレクトロン	3,500	36,700.00	128,450,000
トヨタ紡織	1,200	1,864.00	2,236,800
豊田自動織機	3,300	7,320.00	24,156,000
デンソー	9,700	7,119.00	69,054,300
いすゞ自動車	11,800	1,668.00	19,682,400
トヨタ自動車	99,000	2,004.00	198,396,000
アイシン	3,300	3,855.00	12,721,500
スズキ	7,700	4,677.00	36,012,900
S U B A R U	12,400	2,310.00	28,644,000
ヤマハ発動機	6,000	2,981.00	17,886,000
シマノ	1,600	21,555.00	34,488,000
テルモ	13,400	4,389.00	58,812,600
島津製作所	4,800	3,780.00	18,144,000
東京精密	900	4,240.00	3,816,000
トプコン	2,200	1,561.00	3,434,200
オリンパス	23,700	3,024.00	71,668,800
HOYA	8,400	14,395.00	120,918,000

朝日インテック	4,900	2,503.00	12,264,700
メニコン	1,300	2,933.00	3,812,900
バンダイナムコホールディングス	4,300	9,746.00	41,907,800
ピジョン	2,600	2,046.00	5,319,600
任天堂	25,000	6,096.00	152,400,000
グローブライド	400	2,187.00	874,800
関西電力	15,300	1,139.00	17,426,700
大阪瓦斯	8,000	2,203.00	17,624,000
ヤマトホールディングス	6,000	2,192.00	13,152,000
S Gホールディングス	7,300	2,005.00	14,636,500
N I P P O N E X P R E S S ホールディング	1,600	7,440.00	11,904,000
日本郵船	10,800	2,685.00	28,998,000
三菱倉庫	1,200	3,440.00	4,128,000
日鉄ソリューションズ	700	3,590.00	2,513,000
T I S	4,200	3,945.00	16,569,000
ネクソン	10,900	2,533.00	27,609,700
インターネットイニシアティブ	2,200	2,280.00	5,016,000
野村総合研究所	7,200	3,530.00	25,416,000
Zホールディングス	79,200	384.00	30,412,800
トレンドマイクロ	3,100	7,570.00	23,467,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,100	3,580.00	7,518,000
大塚商会	2,500	4,685.00	11,712,500
ネットワンシステムズ	1,800	3,020.00	5,436,000
B I P R O G Y	1,600	3,210.00	5,136,000
日本電信電話	53,900	4,093.00	220,612,700
K D D I	36,100	4,293.00	154,977,300
ソフトバンク	60,600	1,453.00	88,051,800
エヌ・ティ・ティ・データ	14,600	2,079.00	30,353,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,000	6,650.00	13,300,000
カプコン	3,800	3,745.00	14,231,000
S C S K	3,300	2,194.00	7,240,200
コナミグループ	2,200	6,330.00	13,926,000
双日	3,800	2,198.00	8,352,400
神戸物産	2,600	3,195.00	8,307,000

伊藤忠商事	27,600	3,865.00	106,674,000
丸紅	34,300	1,311.00	44,967,300
豊田通商	4,500	4,640.00	20,880,000
三井物産	33,900	3,212.00	108,886,800
住友商事	24,500	1,891.50	46,341,750
三菱商事	27,700	4,076.00	112,905,200
岩谷産業	900	5,380.00	4,842,000
ミスミグループ本社	4,500	3,150.00	14,175,000
エービーシー・マート	600	6,690.00	4,014,000
くら寿司	400	3,280.00	1,312,000
日本マクドナルドホールディングス	1,700	5,040.00	8,568,000
セリア	900	2,468.00	2,221,200
ジーンズホールディングス	200	4,380.00	876,000
Monotaro	5,500	2,240.00	12,320,000
マツキョココカラ&カンパニー	2,400	5,820.00	13,968,000
ZOZO	2,600	3,020.00	7,852,000
物語コーポレーション	200	6,900.00	1,380,000
ウエルシアホールディングス	2,000	3,200.00	6,400,000
コスモス薬品	400	14,760.00	5,904,000
セブン&アイ・ホールディングス	15,700	5,693.00	89,380,100
ツルハホールディングス	800	8,780.00	7,024,000
トリドールホールディングス	1,100	2,874.00	3,161,400
クスリのアオキホールディングス	400	7,130.00	2,852,000
FOOD & LIFE COMPANYIE	2,400	2,439.00	5,853,600
コーナン商事	600	3,000.00	1,800,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	8,800	2,595.00	22,836,000
ゼンショーホールディングス	2,000	3,735.00	7,470,000
ワークマン	300	4,540.00	1,362,000
スギホールディングス	800	6,170.00	4,936,000
しまむら	500	12,500.00	6,250,000
ケーズホールディングス	3,600	1,182.00	4,255,200
ヤマダホールディングス	15,100	484.00	7,308,400
ニトリホールディングス	1,700	12,170.00	20,689,000
ファーストリテイリング	500	84,230.00	42,115,000

サンドラッグ	1,600	3,600.00	5,760,000
三井住友フィナンシャルグループ	28,800	4,105.00	118,224,000
セブン銀行	12,700	272.00	3,454,400
SBIホールディングス	5,400	2,618.00	14,137,200
大和証券グループ本社	31,100	576.00	17,913,600
東京海上ホールディングス	41,400	2,651.00	109,751,400
東京センチュリー	800	4,920.00	3,936,000
オリックス	27,900	2,105.50	58,743,450
三菱HCキャピタル	14,100	637.00	8,981,700
大東建託	1,400	14,400.00	20,160,000
ヒューリック	6,800	1,074.00	7,303,200
野村不動産ホールディングス	2,500	3,425.00	8,562,500
サムティ	500	2,319.00	1,159,500
オープンハウスグループ	1,500	5,130.00	7,695,000
飯田グループホールディングス	3,200	2,102.00	6,726,400
三井不動産	19,400	2,876.50	55,804,100
三菱地所	24,900	1,928.00	48,007,200
UTグループ	600	2,184.00	1,310,400
エス・エム・エス	1,500	3,135.00	4,702,500
パーソルホールディングス	4,100	2,922.00	11,980,200
カカクコム	3,000	2,536.00	7,608,000
ディップ	700	3,935.00	2,754,500
ベネフィット・ワン	1,600	2,135.00	3,416,000
エムスリー	6,200	4,213.00	26,120,600
博報堂DYホールディングス	4,900	1,244.00	6,095,600
エスプール	1,300	911.00	1,184,300
インフォマート	4,100	445.00	1,824,500
H. U. グループホールディングス	1,200	2,746.00	3,295,200
ビー・エム・エル	400	3,400.00	1,360,000
サイバーエージェント	9,200	1,242.00	11,426,400
テクノプロ・ホールディングス	2,500	3,345.00	8,362,500
Keepert 技研	300	3,815.00	1,144,500
リクルートホールディングス	30,800	4,397.00	135,427,600
インソース	500	2,865.00	1,432,500
バイカレント・コンサルティング	300	36,750.00	11,025,000

	ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,200	1,741.00	2,089,200	
	アンビスホールディングス	400	2,370.00	948,000	
	リログループ	2,600	2,146.00	5,579,600	
	セコム	4,700	8,595.00	40,396,500	
	小計 銘柄数 : 272			6,876,528,520	
	組入時価比率 : 98.1%			100.0%	
	合計			6,876,528,520	

(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 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。