



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 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		

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	6,746	(100.0)	1	(0.0)	6,747	(100.0)
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	6,873	(100.0)	2	(0.0)	6,876	(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	6,334	170	84	6,421
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	7,066	2,415	3,146	6,334

(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
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	6,839	92	6,747	105,090
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	6,978	101	6,876	108,557

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	1,300
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	1,500

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8期 (2022年4月20日現在) 8th Fiscal Year As of April 20, 2022	第9期 (2022年10月20日現在) 9th 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	15,045,901	13,848,801
株式 Stocks	6,873,894,920	6,746,275,520
未収入金 Accounts receivable - other	-	6,852,406
未収配当金 Accrued dividends receivable	89,505,267	72,977,952
流動資産合計 Total current assets	6,978,446,088	6,839,954,679
資産合計 Total assets	6,978,446,088	6,839,954,679
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払金 Accounts payable - other	-	2,272,631
未払収益分配金 Unpaid dividends	95,021,430	83,473,962
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,196,498	1,140,061
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	4,785,907	4,560,194
未払利息 Accrued interest expenses	5	17
その他未払費用 Other accrued expenses	601,391	572,522
流動負債合計 Total current liabilities	101,605,231	92,019,387
負債合計 Total liabilities	101,605,231	92,019,387
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,334,762,000	6,421,074,000

剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	542,078,857	326,861,292
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	2,773,612	2,681,228
元本等合計 Total principal and other	6,876,840,857	6,747,935,292
純資産合計 Total net assets	6,876,840,857	6,747,935,292
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	6,978,446,088	6,839,954,679

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第8期 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日 8th Fiscal Year From October 21, 2021 to April 20, 2022	第9期 自 2022年4月21日 至 2022年10月20日 9th 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	100,198,438	90,040,936
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△523,223,356	△222,915,683
その他収益 Other revenue	7,323	13,933
営業収益合計 Total operating revenue	△423,017,595	△132,860,814
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	925	2,618
受託者報酬 Trustee fees	1,196,498	1,140,061
委託者報酬 Investment trust management fees	4,785,907	4,560,194
その他費用 Other expenses	1,295,032	970,418
営業費用合計 Total operating expenses	7,278,362	6,673,291
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△430,295,957	△139,534,105
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△430,295,957	△139,534,105
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△430,295,957	△139,534,105
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	1,238,460,534	542,078,857
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	326,012,820	15,165,892
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	326,012,820	15,165,892
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	497,077,110	7,375,390
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	497,077,110	7,375,390
分配金 Dividends	95,021,430	83,473,962
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	542,078,857	326,861,292

(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、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8期 2022年4月20日現在	第9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 6,334,762 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 6,421,074 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 1,085.57 円 (100口当たり純資産額) (108,557 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 1,050.90 円 (100口当たり純資産額) (105,090 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自2021年10月21日 至2022年4月20日	第9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												
<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>100,204,836 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	100,204,836 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>90,052,251 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	90,052,251 円
項目													
当期配当等収益額	A	100,204,836 円											
項目													
当期配当等収益額	A	90,052,251 円											

分配準備積立金	B	4,867,643円	分配準備積立金	B	2,773,612円
配当等収益合計額	C=A+B	105,072,479円	配当等収益合計額	C=A+B	92,825,863円
経費	D	7,277,437円	経費	D	6,670,673円
収益分配可能額	E=C-D	97,795,042円	収益分配可能額	E=C-D	86,155,190円
収益分配金	F	95,021,430円	収益分配金	F	83,473,962円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,773,612円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,681,228円
口数	H	6,334,762口	口数	H	6,421,074口
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,500円	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8期 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日	第9期 自 2022年4月21日 至 2022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8期 2022年4月20日現在	第9期 2022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8期 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日	第9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8期 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日	第9期 自 2022年4月21日 至 2022年10月20日
期首元本額 7,066,355,000 円	期首元本額 6,334,762,000 円
期中追加設定元本額 2,415,000,000 円	期中追加設定元本額 170,400,000 円
期中一部交換元本額 3,146,593,000 円	期中一部交換元本額 84,088,000 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第8期 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日	第9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	△397,201,209	△219,650,799
合計	△397,201,209	△219,650,799

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(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	日本水産	4,200	540.00	2,268,000	
		マルハニチロ	300	2,389.00	716,700	
		I N P E X	13,600	1,483.00	20,168,800	
		石油資源開発	200	3,720.00	744,000	
		安藤・間	3,900	843.00	3,287,700	
		大成建設	3,800	4,030.00	15,314,000	
		大林組	15,600	964.00	15,038,400	
		清水建設	9,100	743.00	6,761,300	
		西松建設	700	3,775.00	2,642,500	
		熊谷組	800	2,549.00	2,039,200	
		住友林業	4,100	2,280.00	9,348,000	
		大和ハウス工業	19,100	2,982.50	56,965,750	

積水ハウス	15,000	2,444.00	36,660,000
日揮ホールディングス	1,800	1,722.00	3,099,600
森永製菓	1,100	3,835.00	4,218,500
カルビー	2,800	3,040.00	8,512,000
森永乳業	800	4,205.00	3,364,000
ヤクルト本社	2,600	8,310.00	21,606,000
アサヒグループホールディングス	4,900	4,277.00	20,957,300
キリンホールディングス	20,900	2,201.00	46,000,900
宝ホールディングス	2,700	1,056.00	2,851,200
サントリー食品インターナショナル	2,600	5,040.00	13,104,000
不二製油グループ本社	400	2,335.00	934,000
味の素	10,600	4,091.00	43,364,600
キューピー	1,400	2,403.00	3,364,200
カゴメ	1,200	2,999.00	3,598,800
ニチレイ	2,900	2,285.00	6,626,500
東洋水産	1,700	6,050.00	10,285,000
東洋紡	1,300	1,031.00	1,340,300
帝人	2,500	1,383.00	3,457,500
ゴールドウイン	600	7,760.00	4,656,000
王子ホールディングス	17,900	534.00	9,558,600
日本製紙	400	897.00	358,800
レンゴー	2,400	841.00	2,018,400
旭化成	27,300	949.90	25,932,270
昭和電工	1,000	2,122.00	2,122,000
住友化学	28,200	505.00	14,241,000
日産化学	5,500	6,700.00	36,850,000
デンカ	1,700	3,200.00	5,440,000
エア・ウォーター	3,700	1,648.00	6,097,600
三井化学	5,000	2,777.00	13,885,000
J S R	3,700	2,717.00	10,052,900
東京応化工業	700	6,110.00	4,277,000
三菱ケミカルグループ	17,100	668.30	11,427,930
ダイセル	5,900	843.00	4,973,700
住友ベークライト	600	4,040.00	2,424,000
日油	2,000	5,210.00	10,420,000

花王	13,300	5,706.00	75,889,800
日本ペイントホールディングス	18,400	969.00	17,829,600
関西ペイント	3,500	2,113.00	7,395,500
D I C	900	2,436.00	2,192,400
富士フイルムホールディングス	5,100	6,812.00	34,741,200
資生堂	2,100	5,196.00	10,911,600
ライオン	6,500	1,584.00	10,296,000
ファンケル	2,400	2,872.00	6,892,800
コーセー	500	15,510.00	7,755,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,400	1,657.00	2,319,800
小林製薬	1,400	7,950.00	11,130,000
タカラバイオ	2,100	1,673.00	3,513,300
デクセリアルズ	1,400	3,240.00	4,536,000
日東電工	4,400	7,970.00	35,068,000
エフピコ	900	3,670.00	3,303,000
ニフコ	2,100	3,150.00	6,615,000
ユニ・チャーム	12,000	4,637.00	55,644,000
協和キリン	6,200	3,360.00	20,832,000
アステラス製薬	26,300	2,005.50	52,744,650
住友ファーマ	3,000	1,041.00	3,123,000
塩野義製薬	8,500	6,848.00	58,208,000
日本新薬	1,900	7,510.00	14,269,000
中外製薬	34,600	3,604.00	124,698,400
エーザイ	3,400	8,262.00	28,090,800
ロート製薬	2,500	4,645.00	11,612,500
小野薬品工業	10,300	3,445.00	35,483,500
参天製薬	6,600	980.00	6,468,000
J C Rファーマ	2,500	1,998.00	4,995,000
第一三共	30,700	4,423.00	135,786,100
大塚ホールディングス	7,200	4,654.00	33,508,800
ペプチドリーム	900	1,607.00	1,446,300
サワイグループホールディングス	500	4,230.00	2,115,000
出光興産	6,300	3,280.00	20,664,000
E N E O Sホールディングス	79,600	481.50	38,327,400
コスモエネルギーホールディングス	900	3,820.00	3,438,000

ブリヂストン	7,700	5,083.00	39,139,100
住友大阪セメント	600	3,195.00	1,917,000
TOTO	3,300	4,635.00	15,295,500
日本碍子	5,200	1,848.00	9,609,600
日本特殊陶業	3,500	2,692.00	9,422,000
JFEホールディングス	8,100	1,407.00	11,396,700
東京製鐵	2,000	1,317.00	2,634,000
三井金属鉱業	500	3,005.00	1,502,500
三菱マテリアル	500	1,972.00	986,000
住友金属鉱山	1,600	4,149.00	6,638,400
DOWAホールディングス	1,500	4,930.00	7,395,000
古河電気工業	400	2,301.00	920,400
フジクラ	1,100	876.00	963,600
東洋製罐グループホールディングス	2,000	1,776.00	3,552,000
LIXIL	3,500	2,166.00	7,581,000
日本発條	4,100	825.00	3,382,500
三浦工業	2,000	3,010.00	6,020,000
ディスコ	1,000	31,000.00	31,000,000
SMC	1,400	58,220.00	81,508,000
小松製作所	16,600	2,663.50	44,214,100
クボタ	22,200	2,000.00	44,400,000
荏原製作所	3,000	4,760.00	14,280,000
ダイキン工業	5,500	22,245.00	122,347,500
栗田工業	2,100	5,180.00	10,878,000
ダイフク	2,100	6,810.00	14,301,000
CKD	1,100	1,745.00	1,919,500
セガサミーホールディングス	2,200	1,891.00	4,160,200
日本精工	3,800	741.00	2,815,800
三菱重工業	3,500	4,892.00	17,122,000
日清紡ホールディングス	800	1,036.00	828,800
コニカミノルタ	2,500	446.00	1,115,000
ブラザー工業	5,000	2,588.00	12,940,000
ミネベアミツミ	8,400	2,087.00	17,530,800
東芝	5,800	5,403.00	31,337,400
三菱電機	41,500	1,389.00	57,643,500

マブチモーター	900	3,915.00	3,523,500
日本電産	10,600	7,737.00	82,012,200
オムロン	3,800	6,834.00	25,969,200
ジーエス・ユアサコーポレーション	1,100	2,207.00	2,427,700
日本電気	3,400	4,840.00	16,456,000
富士通	4,200	16,195.00	68,019,000
ルネサスエレクトロニクス	5,600	1,203.00	6,736,800
セイコーエプソン	2,900	2,031.00	5,889,900
アンリツ	2,200	1,615.00	3,553,000
TDK	4,900	4,575.00	22,417,500
アルプスアルパイン	1,500	1,094.00	1,641,000
横河電機	3,200	2,368.00	7,577,600
アズビル	2,800	3,970.00	11,116,000
日本光電工業	2,700	3,405.00	9,193,500
堀場製作所	600	5,780.00	3,468,000
アドバンテスト	6,500	7,000.00	45,500,000
シスメックス	5,100	7,881.00	40,193,100
ウシオ電機	1,400	1,516.00	2,122,400
カシオ計算機	3,800	1,315.00	4,997,000
浜松ホトニクス	2,900	6,490.00	18,821,000
新光電気工業	900	3,240.00	2,916,000
京セラ	4,400	7,325.00	32,230,000
太陽誘電	2,700	3,790.00	10,233,000
村田製作所	16,800	6,971.00	117,112,800
リコー	2,400	1,104.00	2,649,600
東京エレクトロン	5,900	36,700.00	216,530,000
川崎重工業	1,000	2,409.00	2,409,000
トヨタ自動車	169,200	2,004.00	339,076,800
三菱自動車工業	3,300	504.00	1,663,200
アイシン	2,500	3,855.00	9,637,500
マツダ	6,900	964.00	6,651,600
豊田合成	800	2,278.00	1,822,400
テルモ	10,500	4,389.00	46,084,500
島津製作所	6,400	3,780.00	24,192,000
マニー	2,100	2,163.00	4,542,300

ニコン	2,300	1,355.00	3,116,500
トプコン	1,000	1,561.00	1,561,000
HOYA	16,200	14,395.00	233,199,000
シチズン時計	1,200	636.00	763,200
バンダイナムコホールディングス	5,500	9,746.00	53,603,000
凸版印刷	2,100	2,180.00	4,578,000
大日本印刷	4,100	2,903.00	11,902,300
アシックス	1,500	2,323.00	3,484,500
ヤマハ	4,000	5,570.00	22,280,000
ピジョン	4,500	2,046.00	9,207,000
任天堂	42,300	6,096.00	257,860,800
中部電力	12,200	1,233.00	15,042,600
関西電力	10,100	1,139.00	11,503,900
レノバ	700	3,505.00	2,453,500
東京瓦斯	12,800	2,587.00	33,113,600
大阪瓦斯	14,300	2,203.00	31,502,900
東邦瓦斯	2,300	2,883.00	6,630,900
相鉄ホールディングス	500	2,401.00	1,200,500
東急	3,700	1,759.00	6,508,300
東日本旅客鉄道	1,900	8,187.00	15,555,300
西武ホールディングス	1,200	1,465.00	1,758,000
近鉄グループホールディングス	1,000	5,210.00	5,210,000
阪急阪神ホールディングス	2,100	4,525.00	9,502,500
南海電気鉄道	600	3,035.00	1,821,000
ヤマトホールディングス	4,700	2,192.00	10,302,400
日立物流	500	8,630.00	4,315,000
九州旅客鉄道	1,200	3,195.00	3,834,000
S Gホールディングス	10,900	2,005.00	21,854,500
NIPPON EXPRESSホールディング	1,300	7,440.00	9,672,000
日本郵船	5,400	2,685.00	14,499,000
川崎汽船	1,000	2,282.00	2,282,000
日本航空	800	2,837.00	2,269,600
ANAホールディングス	700	2,966.50	2,076,550
三菱倉庫	1,000	3,440.00	3,440,000
NECネットエスアイ	1,600	1,625.00	2,600,000

T I S	4,200	3,945.00	16,569,000
コーエーテクモホールディングス	2,900	2,193.00	6,359,700
GMOペイメントゲートウェイ	1,100	9,980.00	10,978,000
チェンジ	500	1,910.00	955,000
野村総合研究所	10,200	3,530.00	36,006,000
ラクスル	100	2,745.00	274,500
メルカリ	700	2,141.00	1,498,700
S a n s a n	300	1,223.00	366,900
Zホールディングス	38,600	384.00	14,822,400
トレンドマイクロ	4,100	7,570.00	31,037,000
日本オラクル	2,000	8,110.00	16,220,000
オービックビジネスコンサルタント	500	4,465.00	2,232,500
伊藤忠テクノソリューションズ	3,000	3,580.00	10,740,000
大塚商会	2,700	4,685.00	12,649,500
ネットワンシステムズ	2,600	3,020.00	7,852,000
B I P R O G Y	2,600	3,210.00	8,346,000
日本電信電話	23,800	4,093.00	97,413,400
K D D I	39,600	4,293.00	170,002,800
ソフトバンク	43,100	1,453.00	62,624,300
K A D O K A W A	800	2,673.00	2,138,400
東宝	2,100	5,170.00	10,857,000
エヌ・ティ・ティ・データ	8,100	2,079.00	16,839,900
S C S K	3,600	2,194.00	7,898,400
コナミグループ	2,200	6,330.00	13,926,000
ソフトバンクグループ	6,300	5,780.00	36,414,000
双日	3,600	2,198.00	7,912,800
アルフレッサ ホールディングス	2,400	1,670.00	4,008,000
神戸物産	6,600	3,195.00	21,087,000
ダイワボウホールディングス	2,100	1,842.00	3,868,200
メディパルホールディングス	3,100	1,839.00	5,700,900
伊藤忠商事	34,000	3,865.00	131,410,000
丸紅	11,600	1,311.00	15,207,600
豊田通商	5,800	4,640.00	26,912,000
三井物産	40,400	3,212.00	129,764,800
住友商事	15,600	1,891.50	29,507,400

三菱商事	24,200	4,076.00	98,639,200
サンリオ	400	3,960.00	1,584,000
PAL TAC	800	4,080.00	3,264,000
オートバックスセブン	900	1,416.00	1,274,400
ミスミグループ本社	7,400	3,150.00	23,310,000
スズケン	900	3,180.00	2,862,000
ローソン	500	4,715.00	2,357,500
ジズホールディングス	300	4,380.00	1,314,000
ビックカメラ	1,400	1,220.00	1,708,000
Monotaro	12,200	2,240.00	27,328,000
J. フロント リテイリング	2,200	1,249.00	2,747,800
ZOZO	4,500	3,020.00	13,590,000
三越伊勢丹ホールディングス	2,900	1,387.00	4,022,300
すかいらーくホールディングス	1,600	1,585.00	2,536,000
コスモス薬品	600	14,760.00	8,856,000
FOOD & LIFE COMPANYIE	1,400	2,439.00	3,414,600
良品計画	4,100	1,360.00	5,576,000
コロワイド	200	1,821.00	364,200
スギホールディングス	1,000	6,170.00	6,170,000
しまむら	600	12,500.00	7,500,000
高島屋	1,700	1,921.00	3,265,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	400	1,298.00	519,200
丸井グループ	4,100	2,493.00	10,221,300
イオン	3,000	2,796.00	8,388,000
イズミ	800	3,035.00	2,428,000
ケーズホールディングス	3,600	1,182.00	4,255,200
アインホールディングス	500	6,370.00	3,185,000
ヤマダホールディングス	11,800	484.00	5,711,200
ニトリホールディングス	2,800	12,170.00	34,076,000
吉野家ホールディングス	500	2,302.00	1,151,000
サンドラッグ	2,300	3,600.00	8,280,000
ゆうちょ銀行	9,200	994.00	9,144,800
新生銀行	1,500	2,321.00	3,481,500
あおぞら銀行	2,800	2,560.00	7,168,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	155,400	693.00	107,692,200

プ			
りそなホールディングス	25,900	574.30	14,874,370
三井住友トラスト・ホールディングス	3,600	4,299.00	15,476,400
三井住友フィナンシャルグループ	16,100	4,105.00	66,090,500
千葉銀行	13,800	828.00	11,426,400
八十二銀行	3,500	489.00	1,711,500
京都銀行	1,000	5,530.00	5,530,000
みずほフィナンシャルグループ	29,000	1,621.50	47,023,500
SBIホールディングス	7,500	2,618.00	19,635,000
大和証券グループ本社	16,500	576.00	9,504,000
野村ホールディングス	14,500	481.40	6,980,300
マネックスグループ	1,200	483.00	579,600
かんぽ生命保険	6,300	2,145.00	13,513,500
SOMPOホールディングス	20,000	6,084.00	121,680,000
MS&ADインシュアランスグループホール	25,700	3,922.00	100,795,400
第一生命ホールディングス	12,500	2,318.00	28,975,000
T&Dホールディングス	24,900	1,374.00	34,212,600
クレディセゾン	1,900	1,623.00	3,083,700
オリエントコーポレーション	710	1,160.00	823,600
オリックス	40,700	2,105.50	85,693,850
日本取引所グループ	29,400	1,962.00	57,682,800
ヒューリック	5,600	1,074.00	6,014,400
野村不動産ホールディングス	1,600	3,425.00	5,480,000
オープンハウスグループ	2,400	5,130.00	12,312,000
東急不動産ホールディングス	3,900	783.00	3,053,700
三井不動産	7,700	2,876.50	22,149,050
三菱地所	15,300	1,928.00	29,498,400
東京建物	1,300	2,081.00	2,705,300
イオンモール	1,000	1,644.00	1,644,000
カチタス	3,200	3,100.00	9,920,000
MIXI	700	2,285.00	1,599,500
日本M&Aセンターホールディングス	13,700	1,718.00	23,536,600
パーソルホールディングス	5,100	2,922.00	14,902,200
カカクコム	4,600	2,536.00	11,665,600

	ディップ	300	3,935.00	1,180,500	
	ベネフィット・ワン	4,000	2,135.00	8,540,000	
	エムスリー	15,400	4,213.00	64,880,200	
	アウトソーシング	900	1,110.00	999,000	
	ディー・エヌ・エー	1,300	1,879.00	2,442,700	
	インフォマート	2,900	445.00	1,290,500	
	H. U. グループホールディングス	500	2,746.00	1,373,000	
	オリエンタルランド	2,300	19,695.00	45,298,500	
	ラウンドワン	900	653.00	587,700	
	リゾートトラスト	1,200	2,377.00	2,852,400	
	ユー・エス・エス	5,800	2,215.00	12,847,000	
	サイバーエージェント	12,400	1,242.00	15,400,800	
	エン・ジャパン	1,300	2,484.00	3,229,200	
	テクノプロ・ホールディングス	4,300	3,345.00	14,383,500	
	リクルートホールディングス	57,700	4,397.00	253,706,900	
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,700	1,741.00	2,959,700	
	エイチ・アイ・エス	200	2,161.00	432,200	
	共立メンテナンス	200	6,290.00	1,258,000	
	セコム	4,600	8,595.00	39,537,000	
	ベネッセホールディングス	800	2,145.00	1,716,000	
	小計 銘柄数：310			6,746,275,520	
	組入時価比率：100.0%			100.0%	
	合計			6,746,275,520	

(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

該当事項はありません。