



2023年4月期 (2022年10月21日～2023年4月20日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2023 (October 21, 2022 - April 20, 2023)

2023年5月31日  
 May 31, 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 2023年7月19日  
 分配金支払開始日 2023年5月29日  
 Scheduled date of submission of securities report: July 19, 2023  
 Date of commencing dividend payment: May 29, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2023年4月期の運用状況 (2022年10月21日～2023年4月20日)

Management Status for Year ended April 2023 (from October 21, 2022 to April 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4月期 FY ended Apr. 2023	8,307	(98.3)	147	(1.7)	8,455	(100.0)
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	6,746	(100.0)	1	(0.0)	6,747	(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4月期 FY ended Apr. 2023	6,421	1,336	79	7,677
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	6,334	170	84	6,421

(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4月期 FY ended Apr. 2023	8,569	114	8,455	110,132
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	6,839	92	6,747	105,090

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	1,400
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	1,300

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9期 (2022年10月20日現在) 9th Fiscal Year As of October 20, 2022	第10期 (2023年4月20日現在) 10th Fiscal Year As of April 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	13,848,801	42,587,394
株式 Stocks	6,746,275,520	8,307,766,540
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	1,361,535
未収入金 Accounts receivable - other	6,852,406	106,438,095
未収配当金 Accrued dividends receivable	72,977,952	106,849,059
差入委託証拠金 Margin deposits	-	4,235,000
流動資産合計 Total current assets	6,839,954,679	8,569,237,623
資産合計 Total assets	6,839,954,679	8,569,237,623
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	83,473,962	107,481,864
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,140,061	1,204,374
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	4,560,194	4,817,446
未払利息 Accrued interest expenses	17	14
その他未払費用 Other accrued expenses	572,522	612,968
流動負債合計 Total current liabilities	92,019,387	114,116,666
負債合計 Total liabilities	92,019,387	114,116,666
純資産の部 Net assets		

元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,421,074,000	7,677,276,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	326,861,292	777,844,957
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	2,681,228	6,029,513
元本等合計 Total principal and other	6,747,935,292	8,455,120,957
純資産合計 Total net assets	6,747,935,292	8,455,120,957
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	6,839,954,679	8,569,237,623

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	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	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
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	90,040,936	117,812,035
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	△222,915,683	340,245,566
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	-	1,361,535
その他収益 Other revenue	13,933	9,133
営業収益合計 Total operating revenue	△132,860,814	459,428,273
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	2,618	3,677
受託者報酬 Trustee fees	1,140,061	1,204,374
委託者報酬 Investment trust management fees	4,560,194	4,817,446
その他費用 Other expenses	970,418	965,526
営業費用合計 Total operating expenses	6,673,291	6,991,023
営業利益又は営業損失(△)	△139,534,105	452,437,250

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△139,534,105	452,437,250
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△139,534,105	452,437,250
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	542,078,857	326,861,292
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	15,165,892	111,115,939
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	15,165,892	111,115,939
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	7,375,390	5,087,660
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	7,375,390	5,087,660
分配金 Dividends	83,473,962	107,481,864
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	326,861,292	777,844,957

(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10月21日から2023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9期 2022年10月20日現在	第10期 2023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 6,421,074口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 7,677,276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 1,050.90円 (100口当たり純資産額) (105,090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 1,101.32円 (100口当たり純資産額) (110,132円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自2022年4月21日 至2022年10月20日	第10期 自2022年10月21日 至2023年4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>90,052,251円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,773,612円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>92,825,863円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>6,670,673円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>86,155,190円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>83,473,962円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>2,681,228円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>6,421,074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	90,052,251円	分配準備積立金	B	2,773,612円	配当等収益合計額	C=A+B	92,825,863円	経費	D	6,670,673円	収益分配可能額	E=C-D	86,155,190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	2,681,228円	口数	H	6,421,074口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300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>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
項目																																																													
当期配当等収益額	A	90,052,251円																																																											
分配準備積立金	B	2,773,612円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	92,825,863円																																																											
経費	D	6,670,673円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	86,155,190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	2,681,228円																																																											
口数	H	6,421,074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																																																											

(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9期 自2022年4月21日 至2022年10月20日	第10期 自2022年10月21日 至2023年4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、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。	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。
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9期 2022年10月20日現在	第10期 2023年4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。 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 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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2022年4月21日 至2022年10月20日	第10期 自2022年10月21日 至2023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9期 自2022年4月21日 至2022年10月20日	第10期 自2022年10月21日 至2023年4月20日
期首元本額 6,334,762,000円	期首元本額 6,421,074,000円
期中追加設定元本額 170,400,000円	期中追加設定元本額 1,336,100,000円
期中一部交換元本額 84,088,000円	期中一部交換元本額 79,898,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第9期 自2022年4月21日 至2022年10月20日	第10期 自2022年10月21日 至2023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	△219,650,799	233,270,201
合計	△219,650,799	233,270,201

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9期(2022年10月20日現在)			第10期(2023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	-	-	-	141,330,000	142,695,000	1,361,535

合計	-	-	-	-	141,330,000	-	142,695,000	1,361,535
----	---	---	---	---	-------------	---	-------------	-----------

(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	ニッセイ	4,100	585.00	2,398,500	
		マルハニチロ	500	2,477.00	1,238,500	
		I N P E X	17,200	1,471.00	25,301,200	
		石油資源開発	300	4,450.00	1,335,000	
		安藤・間	4,500	856.00	3,852,000	
		大成建設	4,300	4,230.00	18,189,000	
		大林組	12,900	1,032.00	13,312,800	
		清水建設	9,800	763.00	7,477,400	
		熊谷組	800	2,775.00	2,220,000	
		住友林業	4,500	2,811.00	12,649,500	
		大和ハウス工業	25,000	3,212.00	80,300,000	
		積水ハウス	17,400	2,750.00	47,850,000	
		日揮ホールディングス	4,400	1,694.00	7,453,600	
		森永製菓	1,100	3,800.00	4,180,000	
		カルビー	3,100	2,859.00	8,862,900	
		森永乳業	800	4,810.00	3,848,000	
		ヤクルト本社	3,300	9,840.00	32,472,000	
		アサヒグループホールディングス	4,700	5,063.00	23,796,100	
		キリンホールディングス	27,300	2,178.50	59,473,050	
		コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	700	1,441.00	1,008,700	
サントリー食品インターナショナル	3,100	5,030.00	15,593,000			
不二製油グループ本社	400	2,038.00	815,200			
味の素	11,300	4,859.00	54,906,700			



キューピー	1,500	2,242.00	3,363,000
カゴメ	1,400	3,170.00	4,438,000
ニチレイ	2,900	2,735.00	7,931,500
東洋水産	1,800	5,710.00	10,278,000
東洋紡	1,500	1,019.00	1,528,500
帝人	2,700	1,478.00	3,990,600
ゴールドウイン	1,000	12,230.00	12,230,000
デサント	400	4,345.00	1,738,000
王子ホールディングス	22,000	531.00	11,682,000
日本製紙	500	1,054.00	527,000
レンゴー	2,600	868.00	2,256,800
旭化成	29,400	948.70	27,891,780
レゾナック・ホールディングス	1,400	2,200.00	3,080,000
住友化学	24,600	461.00	11,340,600
日産化学	6,500	5,990.00	38,935,000
デンカ	1,900	2,724.00	5,175,600
エア・ウォーター	4,000	1,671.00	6,684,000
三井化学	4,900	3,425.00	16,782,500
J S R	1,400	3,065.00	4,291,000
東京応化工業	900	7,030.00	6,327,000
三菱ケミカルグループ	21,300	799.40	17,027,220
ダイセル	6,500	1,029.00	6,688,500
住友ベークライト	800	5,060.00	4,048,000
積水化学工業	9,600	1,885.00	18,096,000
アイカ工業	1,500	3,060.00	4,590,000
日油	2,400	6,180.00	14,832,000
花王	13,800	5,350.00	73,830,000
日本ペイントホールディングス	18,100	1,237.00	22,389,700
関西ペイント	4,300	1,857.00	7,985,100
富士フイルムホールディングス	6,200	6,851.00	42,476,200
資生堂	2,400	6,703.00	16,087,200
ライオン	6,800	1,445.00	9,826,000
ファンケル	2,400	2,458.00	5,899,200
コーセー	600	16,150.00	9,690,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,300	1,822.00	4,190,600

小林製薬	1,600	8,390.00	13,424,000
タカラバイオ	2,200	1,746.00	3,841,200
デクセリアルズ	1,900	2,553.00	4,850,700
日東電工	5,100	8,440.00	43,044,000
エフピコ	1,000	3,270.00	3,270,000
ニフコ	2,200	3,750.00	8,250,000
ユニ・チャーム	11,800	5,409.00	63,826,200
協和キリン	7,400	3,080.00	22,792,000
武田薬品工業	8,200	4,482.00	36,752,400
アステラス製薬	51,000	2,000.00	102,000,000
住友ファーマ	5,900	836.00	4,932,400
日本新薬	1,700	6,070.00	10,319,000
中外製薬	39,000	3,268.00	127,452,000
エーザイ	3,400	7,621.00	25,911,400
ロート製薬	6,500	2,804.00	18,226,000
小野薬品工業	11,400	2,682.00	30,574,800
参天製薬	8,000	1,071.00	8,568,000
JCRファーマ	2,900	1,467.00	4,254,300
第一三共	23,000	4,765.00	109,595,000
大塚ホールディングス	7,000	4,432.00	31,024,000
ペプチドリーム	800	1,881.00	1,504,800
サワイグループホールディングス	400	3,830.00	1,532,000
出光興産	3,200	2,845.00	9,104,000
E N E O Sホールディングス	109,400	473.90	51,844,660
コスモエネルギーホールディングス	2,500	4,320.00	10,800,000
ブリヂストン	9,000	5,336.00	48,024,000
住友大阪セメント	500	3,725.00	1,862,500
TOTO	3,800	4,555.00	17,309,000
日本碍子	6,100	1,769.00	10,790,900
日本特殊陶業	4,800	2,730.00	13,104,000
神戸製鋼所	2,900	1,050.00	3,045,000
JFEホールディングス	4,200	1,654.00	6,946,800
東京製鐵	2,200	1,414.00	3,110,800
大和工業	1,200	5,440.00	6,528,000
三井金属鉱業	600	3,265.00	1,959,000

三菱マテリアル	1,000	2,255.00	2,255,000
古河電気工業	300	2,460.00	738,000
フジクラ	1,400	908.00	1,271,200
東洋製罐グループホールディングス	2,600	1,870.00	4,862,000
L I X I L	3,600	2,050.00	7,380,000
日本発條	3,400	962.00	3,270,800
三浦工業	2,300	3,380.00	7,774,000
ディスコ	4,100	14,590.00	59,819,000
SMC	1,800	68,570.00	123,426,000
小松製作所	20,900	3,288.00	68,719,200
クボタ	23,400	2,000.50	46,811,700
荏原製作所	3,200	6,000.00	19,200,000
ダイキン工業	6,000	23,235.00	139,410,000
栗田工業	2,500	6,050.00	15,125,000
ダイフク	7,700	2,440.00	18,788,000
CKD	1,200	2,044.00	2,452,800
セガサミーホールディングス	3,100	2,520.00	7,812,000
日本精工	2,100	759.00	1,593,900
三菱重工業	4,600	5,090.00	23,414,000
日清紡ホールディングス	800	1,019.00	815,200
コニカミノルタ	3,200	552.00	1,766,400
ブラザー工業	5,300	2,071.00	10,976,300
ミネベアミツミ	10,500	2,427.00	25,483,500
東芝	7,600	4,402.00	33,455,200
三菱電機	40,500	1,617.00	65,488,500
富士電機	3,200	5,120.00	16,384,000
マブチモーター	900	3,885.00	3,496,500
ニデック	11,700	6,632.00	77,594,400
オムロン	3,200	7,643.00	24,457,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,100	2,284.00	2,512,400
日本電気	3,900	5,130.00	20,007,000
富士通	5,300	18,205.00	96,486,500
ルネサスエレクトロニクス	6,800	1,858.50	12,637,800
セイコーエプソン	4,500	1,981.00	8,914,500
アンリツ	2,500	1,222.00	3,055,000

TDK	6,300	4,645.00	29,263,500
アルプスアルパイン	1,000	1,222.00	1,222,000
横河電機	3,600	2,178.00	7,840,800
アズビル	3,300	3,665.00	12,094,500
日本光電工業	2,700	3,700.00	9,990,000
堀場製作所	700	7,520.00	5,264,000
アドバンテスト	7,400	11,620.00	85,988,000
シスメックス	5,100	8,920.00	45,492,000
ウシオ電機	700	1,652.00	1,156,400
カシオ計算機	3,700	1,293.00	4,784,100
浜松ホトニクス	3,900	7,120.00	27,768,000
新光電気工業	1,500	4,005.00	6,007,500
京セラ	4,500	7,022.00	31,599,000
太陽誘電	3,800	4,230.00	16,074,000
村田製作所	18,200	7,862.00	143,088,400
リコー	2,800	1,044.00	2,923,200
東京エレクトロン	21,400	15,395.00	329,453,000
トヨタ自動車	197,900	1,813.50	358,891,650
三菱自動車工業	8,900	513.00	4,565,700
アイシン	2,300	3,650.00	8,395,000
豊田合成	900	2,198.00	1,978,200
テイ・エス テック	1,500	1,684.00	2,526,000
島津製作所	6,900	4,210.00	29,049,000
マニー	2,400	1,799.00	4,317,600
ニコン	2,400	1,324.00	3,177,600
トプコン	1,200	1,893.00	2,271,600
HOYA	19,000	14,230.00	270,370,000
朝日インテック	5,600	2,416.00	13,529,600
シチズン時計	1,500	744.00	1,116,000
バンダイナムコホールディングス	21,300	2,990.00	63,687,000
タカラトミー	2,000	1,445.00	2,890,000
凸版印刷	3,900	2,755.00	10,744,500
大日本印刷	3,900	3,820.00	14,898,000
アシックス	1,700	3,850.00	6,545,000
ヤマハ	3,900	5,250.00	20,475,000

ビジョン	4,300	2,060.00	8,858,000
任天堂	49,400	5,516.00	272,490,400
中部電力	16,100	1,456.00	23,441,600
関西電力	14,400	1,330.00	19,152,000
四国電力	1,600	780.00	1,248,000
東京瓦斯	18,500	2,550.00	47,175,000
大阪瓦斯	17,000	2,166.00	36,822,000
東邦瓦斯	3,000	2,463.00	7,389,000
東急	4,600	1,861.00	8,560,600
東日本旅客鉄道	2,200	7,635.00	16,797,000
西日本旅客鉄道	1,300	5,802.00	7,542,600
西武ホールディングス	1,500	1,500.00	2,250,000
近鉄グループホールディングス	1,400	4,485.00	6,279,000
阪急阪神ホールディングス	2,200	4,170.00	9,174,000
南海電気鉄道	400	3,045.00	1,218,000
ヤマトホールディングス	4,000	2,291.00	9,164,000
九州旅客鉄道	1,400	3,040.00	4,256,000
S Gホールディングス	13,400	1,911.00	25,607,400
NIPPON EXPRESSホールディング	1,500	7,830.00	11,745,000
日本郵船	11,600	3,409.00	39,544,400
商船三井	11,000	3,495.00	38,445,000
川崎汽船	2,100	3,380.00	7,098,000
日本航空	1,000	2,586.00	2,586,000
ANAホールディングス	800	2,859.00	2,287,200
三菱倉庫	1,100	3,240.00	3,564,000
住友倉庫	1,300	2,247.00	2,921,100
上組	2,500	2,839.00	7,097,500
NEC ネットエスアイ	1,500	1,635.00	2,452,500
T I S	6,000	3,675.00	22,050,000
コーエーテクモホールディングス	4,500	2,309.00	10,390,500
GMO ペイメントゲートウェイ	1,000	10,690.00	10,690,000
ラクス	1,300	2,072.00	2,693,600
チェンジホールディングス	1,000	2,486.00	2,486,000
野村総合研究所	11,500	3,275.00	37,662,500
ラクスル	300	1,346.00	403,800

メルカリ	400	2,240.00	896,000
Zホールディングス	36,600	376.30	13,772,580
トレンドマイクロ	4,400	6,700.00	29,480,000
日本オラクル	2,300	9,190.00	21,137,000
オービックビジネスコンサルタント	600	5,000.00	3,000,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,900	3,315.00	9,613,500
大塚商会	3,000	4,820.00	14,460,000
デジタルガレージ	1,200	4,550.00	5,460,000
ネットワンシステムズ	2,500	3,140.00	7,850,000
B I P R O G Y	2,900	3,255.00	9,439,500
日本電信電話	30,100	4,024.00	121,122,400
K D D I	51,100	4,125.00	210,787,500
ソフトバンク	47,000	1,527.50	71,792,500
光通信	700	17,970.00	12,579,000
K A D O K A W A	1,000	2,863.00	2,863,000
東宝	2,400	5,230.00	12,552,000
エヌ・ティ・ティ・データ	11,100	1,845.00	20,479,500
S C S K	4,300	1,975.00	8,492,500
富士ソフト	400	7,810.00	3,124,000
コナミグループ	2,500	6,360.00	15,900,000
ソフトバンクグループ	6,800	5,094.00	34,639,200
双日	4,600	2,885.00	13,271,000
アルフレッサ ホールディングス	2,400	1,877.00	4,504,800
神戸物産	7,800	3,740.00	29,172,000
ダイワボウホールディングス	1,800	2,468.00	4,442,400
メディopalホールディングス	2,800	2,027.00	5,675,600
伊藤忠商事	43,600	4,469.00	194,848,400
丸紅	16,400	1,934.50	31,725,800
豊田通商	6,300	5,720.00	36,036,000
住友商事	13,600	2,449.00	33,306,400
三菱商事	35,200	4,992.00	175,718,400
サンリオ	500	6,230.00	3,115,000
ミスミグループ本社	10,100	3,295.00	33,279,500
スズケン	900	3,690.00	3,321,000
ローソン	600	5,930.00	3,558,000

ジズホールディングス	200	3,100.00	620,000
ビックカメラ	1,700	1,129.00	1,919,300
DCMホールディングス	2,500	1,423.00	3,557,500
Monotaro	14,100	1,885.00	26,578,500
J.フロント リテイリング	3,000	1,423.00	4,269,000
マツキヨココカラ&カンパニー	2,300	7,190.00	16,537,000
ZOZO	5,100	3,045.00	15,529,500
三越伊勢丹ホールディングス	3,000	1,502.00	4,506,000
すかいらーくホールディングス	1,700	1,791.00	3,044,700
コスモス薬品	700	12,660.00	8,862,000
ツルハホールディングス	900	8,770.00	7,893,000
FOOD & LIFE COMPANYIE	1,700	3,285.00	5,584,500
良品計画	5,200	1,440.00	7,488,000
コロワイド	300	2,042.00	612,600
スギホールディングス	1,200	5,830.00	6,996,000
しまむら	600	12,650.00	7,590,000
高島屋	2,400	2,068.00	4,963,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	500	1,601.00	800,500
丸井グループ	4,900	2,126.00	10,417,400
イオン	3,600	2,719.50	9,790,200
イズミ	800	3,155.00	2,524,000
ケーズホールディングス	3,800	1,177.00	4,472,600
アインホールディングス	600	5,570.00	3,342,000
ヤマダホールディングス	12,100	466.00	5,638,600
ニトリホールディングス	3,100	17,485.00	54,203,500
吉野家ホールディングス	700	2,477.00	1,733,900
サンドラッグ	2,500	3,675.00	9,187,500
ゆうちょ銀行	9,100	1,109.00	10,091,900
SBI新生銀行	1,600	2,495.00	3,992,000
あおぞら銀行	4,000	2,479.00	9,916,000
りそなホールディングス	31,200	679.50	21,200,400
三井住友トラスト・ホールディングス	4,800	4,912.00	23,577,600
三井住友フィナンシャルグループ	19,700	5,728.00	112,841,600
千葉銀行	17,400	896.00	15,590,400

八十二銀行	3,900	602.00	2,347,800
京都銀行	1,600	6,610.00	10,576,000
みずほフィナンシャルグループ	20,300	2,055.50	41,726,650
SBIホールディングス	8,400	2,694.00	22,629,600
大和証券グループ本社	17,500	631.00	11,042,500
野村ホールディングス	20,000	526.10	10,522,000
マネックスグループ	1,600	489.00	782,400
かんぽ生命保険	6,000	2,219.00	13,314,000
SOMPOホールディングス	22,700	5,612.00	127,392,400
MS&ADインシュアランスグループホール	30,800	4,433.00	136,536,400
第一生命ホールディングス	15,000	2,561.00	38,415,000
東京海上ホールディングス	125,900	2,707.50	340,874,250
T&Dホールディングス	22,300	1,710.00	38,133,000
クレディセゾン	2,500	1,870.00	4,675,000
芙蓉総合リース	400	9,720.00	3,888,000
東京センチュリー	600	4,545.00	2,727,000
オリエントコーポレーション	700	1,130.00	791,000
オリックス	55,700	2,316.00	129,001,200
三菱HCキャピタル	9,000	701.00	6,309,000
日本取引所グループ	37,500	2,134.00	80,025,000
ヒューリック	6,300	1,133.00	7,137,900
野村不動産ホールディングス	2,100	3,055.00	6,415,500
オープンハウスグループ	2,700	5,160.00	13,932,000
東急不動産ホールディングス	4,900	658.00	3,224,200
三井不動産	10,700	2,524.50	27,012,150
三菱地所	26,100	1,619.50	42,268,950
東京建物	1,800	1,642.00	2,955,600
イオンモール	900	1,805.00	1,624,500
カチタス	3,800	2,576.00	9,788,800
MIXI	700	2,796.00	1,957,200
日本M&Aセンターホールディングス	13,900	1,006.00	13,983,400
エス・エム・エス	2,900	3,095.00	8,975,500
パーソルホールディングス	6,300	2,698.00	16,997,400
ディップ	400	3,325.00	1,330,000



	ベネフィット・ワン	4,200	1,826.00	7,669,200	
	エムスリー	16,500	3,388.00	55,902,000	
	アウトソーシング	900	1,364.00	1,227,600	
	ディー・エヌ・エー	1,400	1,825.00	2,555,000	
	インフォマート	2,800	283.00	792,400	
	H. U. グループホールディングス	500	2,683.00	1,341,500	
	オリエンタルランド	14,700	4,885.00	71,809,500	
	ラウンドワン	2,800	546.00	1,528,800	
	リゾートトラスト	1,700	2,214.00	3,763,800	
	ユー・エス・エス	7,100	2,221.00	15,769,100	
	サイバーエージェント	14,800	1,182.00	17,493,600	
	エン・ジャパン	1,600	2,381.00	3,809,600	
	テクノプロ・ホールディングス	5,000	3,615.00	18,075,000	
	リクルートホールディングス	71,200	3,791.00	269,919,200	
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	2,400	2,072.00	4,972,800	
	エイチ・アイ・エス	200	2,021.00	404,200	
	共立メンテナンス	300	5,320.00	1,596,000	
	セコム	5,200	8,496.00	44,179,200	
	ベネッセホールディングス	1,400	1,927.00	2,697,800	
	小計 銘柄数：320			8,307,766,540	
	組入時価比率：98.3%			100.0%	
	合計			8,307,766,540	

(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。