



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

2023 年 11 月 29 日  
 November 29, 2023

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 2024 年 1 月 17 日  
 分配金支払開始日 2023 年 11 月 28 日  
 Scheduled date of submission of securities report: January 17, 2024  
 Date of commencing dividend payment: November 28, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

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

Management Status for Year ended October 2023 (from April 21, 2023 to October 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 10 月期 FY ended Oct. 2023	9,331	(98.3)	162	(1.7)	9,494	(100.0)
2023 年 4 月期 FY ended Apr. 2023	8,522	(98.3)	149	(1.7)	8,671	(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 10 月期 FY ended Oct. 2023	425	15	14	426
2023 年 4 月期 FY ended Apr. 2023	369	55	0	425

(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
2023 年 10 月期 FY ended Oct. 2023	9,616	121	9,494	22,276
2023 年 4 月期 FY ended Apr. 2023	8,784	112	8,671	20,403

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2023 年 10 月期 FY ended Oct. 2023	219
2023 年 4 月期 FY ended Apr. 2023	231

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 14 期 (2023 年 4 月 20 日現在) 14th Fiscal Year As of April 20, 2023	第 15 期 (2023 年 10 月 20 日現在) 15th Fiscal Year As of October 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	159,293,453	173,346,914
株式 Stocks	8,522,376,460	9,331,928,490
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	3,495,457	-
未収入金 Accounts receivable - other	905,965	-
未収配当金 Accrued dividends receivable	93,515,166	89,225,231
差入委託証拠金 Margin deposits	5,298,097	21,663,110
流動資産合計 Total current assets	8,784,884,598	9,616,163,745
資産合計 Total assets	8,784,884,598	9,616,163,745
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	7,863,920
未払金 Accounts payable - other	-	4,597,740
未払収益分配金 Unpaid dividends	98,181,468	93,342,618
未払受託者報酬 Trustee fees payable	2,054,409	2,643,229
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	7,395,778	9,515,582
未払利息 Accrued interest expenses	53	71
その他未払費用 Other accrued expenses	5,354,466	3,834,725
流動負債合計 Total current liabilities	112,986,174	121,797,885
負債合計 Total liabilities	112,986,174	121,797,885

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	5,462,034,828	5,477,378,922
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	3,209,863,596	4,016,986,938
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	141,798	182,245
元本等合計 Total principal and other	8,671,898,424	9,494,365,860
純資産合計 Total net assets	8,671,898,424	9,494,365,860
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	8,784,884,598	9,616,163,745

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	第 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 年 4 月 20 日 14th Fiscal Year From October 21, 2022 to April 20, 2023	第 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 年 10 月 20 日 15th Fiscal Year From April 21, 2023 to October 20, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	110,308,720	109,202,778
受取利息 Interest income	18	-
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	531,536,049	766,369,533
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	15,906,758	13,208,180
その他収益 Other revenue	627	1,155
営業収益合計 Total operating revenue	657,752,172	888,781,646
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	19,383	38,957
受託者報酬 Trustee fees	2,054,409	2,643,229
委託者報酬 Investment trust management fees	7,395,778	9,515,582
その他費用 Other expenses	2,842,825	3,623,100
営業費用合計	12,312,395	15,820,868

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	645,439,777	872,960,778
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	645,439,777	872,960,778
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	645,439,777	872,960,778
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	2,261,569,427	3,209,863,596
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	401,035,860	166,395,198
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	401,035,860	166,395,198
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	-	138,890,016
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	-	138,890,016
分配金 Dividends	98,181,468	93,342,618
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	3,209,863,596	4,016,986,938

(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、2023年4月21日から2023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 14 期 2023 年 4 月 20 日現在	第 15 期 2023 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 425,028 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 426,222 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 20,403 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 22,276 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 年 4 月 20 日	第 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 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" style="width: 100%;"> <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>110,289,982 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>326,296 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>110,616,278 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>12,293,012 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>98,323,266 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>98,181,468 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>141,798 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>425,028 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>231 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	110,289,982 円	分配準備積立金	B	326,296 円	配当等収益合計額	C=A+B	110,616,278 円	経費	D	12,293,012 円	収益分配可能額	E=C-D	98,323,266 円	収益分配金	F	98,181,468 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	141,798 円	口数	H	425,028 口	1 口当たり分配金	I=F/H	231 円	<table border="1" style="width: 100%;"> <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>109,164,976 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>141,798 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>109,306,774 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>15,781,911 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>93,524,863 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>93,342,618 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>182,245 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>426,222 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>219 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	109,164,976 円	分配準備積立金	B	141,798 円	配当等収益合計額	C=A+B	109,306,774 円	経費	D	15,781,911 円	収益分配可能額	E=C-D	93,524,863 円	収益分配金	F	93,342,618 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	182,245 円	口数	H	426,222 口	1 口当たり分配金	I=F/H	219 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	110,289,982 円																																																											
分配準備積立金	B	326,296 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	110,616,278 円																																																											
経費	D	12,293,012 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	98,323,266 円																																																											
収益分配金	F	98,181,468 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	141,798 円																																																											
口数	H	425,028 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	231 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	109,164,976 円																																																											
分配準備積立金	B	141,798 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	109,306,774 円																																																											
経費	D	15,781,911 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	93,524,863 円																																																											
収益分配金	F	93,342,618 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	182,245 円																																																											
口数	H	426,222 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	219 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち 2,465,224 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 3,173,931 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 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 年 4 月 20 日	第 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 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。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
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なっております。 ○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なっております。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

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 14 期 2023 年 4 月 20 日現在	第 15 期 2023 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。 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。	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 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 年 4 月 20 日	第 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 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 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 年 4 月 20 日	第 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 年 10 月 20 日
期首元本額 4,747,287,910 円	期首元本額 5,462,034,828 円
期中追加設定元本額 714,746,918 円	期中追加設定元本額 205,590,298 円
期中一部交換元本額 0 円	期中一部交換元本額 190,246,204 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 14 期 自 2022 年 10 月 21 日 至 2023 年 4 月 20 日	第 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 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	523,341,496	675,673,208
合計	523,341,496	675,673,208

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 14 期(2023 年 4 月 20 日現在)			第 15 期(2023 年 10 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)
	うち 1 年超			うち 1 年超		

市場取引								
株価指数先物取引								
買建	143,268,623	—	146,772,000	3,495,457	167,677,110	—	159,821,000	△7,863,920
合計	143,268,623	—	146,772,000	3,495,457	167,677,110	—	159,821,000	△7,863,920

(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 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	26,000	2,230.00	57,980,000	
		大林組	17,000	1,253.50	21,309,500	
		長谷工コーポレーション	4,900	1,849.00	9,060,100	
		鹿島建設	11,000	2,370.00	26,070,000	
		住友林業	3,600	3,492.00	12,571,200	
		大和ハウス工業	13,400	3,982.00	53,358,800	
		積水ハウス	14,300	2,866.00	40,983,800	
		エクシオグループ	2,300	2,995.00	6,888,500	
		森永製菓	900	5,172.00	4,654,800	
		カルビー	2,200	2,696.00	5,931,200	
		ヤクルト本社	6,500	3,540.00	23,010,000	
		明治ホールディングス	6,000	3,688.00	22,128,000	
		アサヒグループホールディングス	10,700	5,281.00	56,506,700	
		キリンホールディングス	19,800	2,071.50	41,015,700	
		宝ホールディングス	3,600	1,216.50	4,379,400	
		サントリー食品インターナショナル	3,100	4,378.00	13,571,800	
		キッコーマン	3,600	8,228.00	29,620,800	
		味の素	11,500	5,565.00	63,997,500	
		ニチレイ	2,400	3,214.00	7,713,600	
		日清食品ホールディングス	1,600	12,240.00	19,584,000	
日本たばこ産業	27,700	3,423.00	94,817,100			

ゴールドウイン	700	9,851.00	6,895,700
レンゴー	4,600	992.70	4,566,420
クラレ	7,600	1,701.50	12,931,400
旭化成	30,900	924.70	28,573,230
レゾナック・ホールディングス	4,300	2,457.50	10,567,250
住友化学	36,300	402.20	14,599,860
日産化学	2,900	6,359.00	18,441,100
東ソー	6,300	1,788.50	11,267,550
トクヤマ	1,600	2,251.50	3,602,400
デンカ	1,900	2,716.00	5,160,400
信越化学工業	46,400	4,297.00	199,380,800
エア・ウォーター	4,000	1,845.50	7,382,000
カネカ	1,200	3,740.00	4,488,000
三菱瓦斯化学	4,100	2,019.50	8,279,950
三井化学	4,500	3,656.00	16,452,000
東京応化工業	800	8,603.00	6,882,400
三菱ケミカルグループ	33,400	855.20	28,563,680
ダイセル	6,500	1,226.50	7,972,250
住友ベークライト	800	6,659.00	5,327,200
積水化学工業	9,300	2,019.50	18,781,350
日本ゼオン	3,000	1,507.00	4,521,000
ADEKA	1,700	2,652.00	4,508,400
花王	11,700	5,444.00	63,694,800
日本ペイントホールディングス	16,900	965.50	16,316,950
D I C	1,800	2,385.50	4,293,900
富士フイルムホールディングス	8,900	8,470.00	75,383,000
ライオン	5,900	1,418.00	8,366,200
ミルボン	600	4,001.00	2,400,600
ポーラ・オルビスホールディングス	2,200	1,664.50	3,661,900
小林製薬	1,400	6,165.00	8,631,000
デクセリアルズ	1,400	3,740.00	5,236,000
日東電工	3,900	9,414.00	36,714,600
エフピコ	1,100	2,577.50	2,835,250
ユニ・チャーム	9,400	5,053.00	47,498,200
協和キリン	6,400	2,374.00	15,193,600

武田薬品工業	29,500	4,352.00	128,384,000
アステラス製薬	47,800	1,882.00	89,959,600
住友ファーマ	3,700	480.00	1,776,000
塩野義製薬	6,800	6,993.00	47,552,400
日本新薬	1,200	5,510.00	6,612,000
中外製薬	15,500	4,548.00	70,494,000
エーザイ	6,700	8,085.00	54,169,500
ロート製薬	4,900	3,395.00	16,635,500
小野薬品工業	9,400	2,631.50	24,736,100
JCRファーマ	1,700	1,115.50	1,896,350
第一三共	45,100	4,095.00	184,684,500
大塚ホールディングス	10,400	4,980.00	51,792,000
出光興産	5,000	3,332.00	16,660,000
ENEOSホールディングス	81,700	565.00	46,160,500
横浜ゴム	2,600	2,849.50	7,408,700
TOYO TIRE	2,700	2,225.00	6,007,500
ブリヂストン	14,200	5,808.00	82,473,600
住友ゴム工業	4,000	1,490.00	5,960,000
AGC	4,800	5,169.00	24,811,200
東海カーボン	4,700	1,134.00	5,329,800
TOTO	3,600	3,674.00	13,226,400
日本碍子	6,200	1,774.00	10,998,800
日本特殊陶業	3,800	3,184.00	12,099,200
フジミインコーポレーテッド	1,100	2,920.00	3,212,000
日本製鉄	21,000	3,219.00	67,599,000
JFEホールディングス	12,400	2,069.50	25,661,800
住友金属鉱山	6,000	4,138.00	24,828,000
住友電気工業	17,900	1,606.00	28,747,400
SUMCO	8,600	1,953.50	16,800,100
三和ホールディングス	4,700	2,028.00	9,531,600
リンナイ	2,800	2,688.00	7,526,400
アマダ	8,500	1,470.50	12,499,250
FUJ I	1,800	2,355.50	4,239,900
DMG森精機	3,000	2,467.50	7,402,500
ディスコ	2,400	28,000.00	67,200,000

ナブテスコ	2,800	2,692.00	7,537,600
S M C	1,600	70,110.00	112,176,000
小松製作所	22,900	3,810.00	87,249,000
住友重機械工業	2,800	3,533.00	9,892,400
日立建機	2,800	4,089.00	11,449,200
クボタ	24,900	2,018.00	50,248,200
荏原製作所	2,100	6,556.00	13,767,600
ダイキン工業	6,100	22,015.00	134,291,500
栗田工業	2,600	4,332.00	11,263,200
ダイフク	7,700	2,573.00	19,812,100
C K D	1,300	2,038.00	2,649,400
竹内製作所	900	4,580.00	4,122,000
セガサミーホールディングス	4,200	2,405.00	10,101,000
T H K	3,000	2,730.50	8,191,500
マキタ	5,900	3,616.00	21,334,400
イビデン	2,800	7,414.00	20,759,200
ブラザー工業	6,100	2,365.00	14,426,500
ミネベアミツミ	8,500	2,352.00	19,992,000
日立製作所	24,900	8,750.00	217,875,000
東芝	9,700	4,601.00	44,629,700
三菱電機	47,700	1,765.00	84,190,500
富士電機	3,300	6,237.00	20,582,100
安川電機	5,900	5,155.00	30,414,500
オムロン	4,800	6,210.00	29,808,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,600	2,440.00	3,904,000
日本電気	6,600	7,636.00	50,397,600
富士通	4,500	17,020.00	76,590,000
ルネサスエレクトロニクス	30,100	2,249.00	67,694,900
セイコーエプソン	7,300	2,309.00	16,855,700
ワコム	3,900	559.00	2,180,100
パナソニック ホールディングス	57,800	1,487.50	85,977,500
アンリツ	3,400	997.10	3,390,140
T D K	9,900	5,606.00	55,499,400
ヒロセ電機	700	17,820.00	12,474,000
横河電機	5,900	2,711.50	15,997,850

アズビル	2,800	4,492.00	12,577,600
日本光電工業	1,900	3,571.00	6,784,900
堀場製作所	800	7,790.00	6,232,000
アドバンテスト	20,000	4,259.00	85,180,000
キーエンス	4,600	54,630.00	251,298,000
シスメックス	3,900	7,056.00	27,518,400
フェローテックホールディングス	1,100	2,801.00	3,081,100
レーザーテック	1,900	26,500.00	50,350,000
山一電機	500	1,737.00	868,500
日本電子	1,100	4,841.00	5,325,100
ファナック	25,700	3,823.00	98,251,100
ローム	8,700	2,724.50	23,703,150
浜松ホトニクス	3,700	5,921.00	21,907,700
三井ハイテック	400	6,730.00	2,692,000
新光電気工業	1,700	5,476.00	9,309,200
京セラ	8,100	7,324.00	59,324,400
太陽誘電	3,100	3,472.00	10,763,200
村田製作所	43,900	2,632.00	115,544,800
S C R E E Nホールディングス	2,000	7,243.00	14,486,000
キヤノン	25,200	3,695.00	93,114,000
リコー	15,600	1,226.50	19,133,400
東京エレクトロン	12,000	20,085.00	241,020,000
トヨタ紡織	1,400	2,549.00	3,568,600
豊田自動織機	3,800	11,140.00	42,332,000
デンソー	43,300	2,312.50	100,131,250
いすゞ自動車	14,100	1,771.00	24,971,100
トヨタ自動車	122,300	2,617.00	320,059,100
アイシン	3,700	5,386.00	19,928,200
スズキ	9,000	5,788.00	52,092,000
S U B A R U	14,800	2,683.50	39,715,800
ヤマハ発動機	6,900	3,778.00	26,068,200
シマノ	1,900	20,570.00	39,083,000
テイ・エス テック	2,000	1,663.50	3,327,000
テルモ	16,000	3,869.00	61,904,000
島津製作所	5,600	3,701.00	20,725,600

ナカニシ	1,700	3,290.00	5,593,000
東京精密	1,000	7,080.00	7,080,000
ニコン	7,700	1,490.00	11,473,000
トプコン	2,600	1,705.00	4,433,000
オリンパス	28,500	1,965.50	56,016,750
HOYA	9,500	14,615.00	138,842,500
朝日インテック	5,800	2,550.00	14,790,000
メニコン	1,600	1,710.00	2,736,000
ニプロ	3,600	1,085.00	3,906,000
バンダイナムコホールディングス	14,900	3,107.00	46,294,300
TOPPANホールディングス	6,600	3,302.00	21,793,200
ヤマハ	3,600	3,945.00	14,202,000
ビジョン	2,900	1,607.00	4,660,300
任天堂	28,800	6,101.00	175,708,800
S Gホールディングス	8,500	1,905.00	16,192,500
日本郵船	12,700	3,863.00	49,060,100
商船三井	8,600	4,088.00	35,156,800
T I S	4,900	3,142.00	15,395,800
ネクソン	12,300	2,500.00	30,750,000
インターネットイニシアティブ	2,600	2,452.00	6,375,200
野村総合研究所	9,200	3,739.00	34,398,800
L I N Eヤフー	71,400	382.30	27,296,220
トレンドマイクロ	3,600	5,597.00	20,149,200
フューチャー	1,100	1,446.00	1,590,600
伊藤忠テクノソリューションズ	2,400	4,321.00	10,370,400
大塚商会	2,800	5,952.00	16,665,600
サイボウズ	600	1,701.00	1,020,600
ネットワンシステムズ	2,100	2,663.50	5,593,350
B I P R O G Y	1,900	3,669.00	6,971,100
日本電信電話	1,492,200	173.60	259,045,920
K D D I	41,000	4,452.00	182,532,000
ソフトバンク	73,700	1,673.50	123,336,950
N T Tデータグループ	17,000	1,768.00	30,056,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,300	5,048.00	11,610,400
カプコン	4,400	5,288.00	23,267,200

SCSK	3,800	2,466.00	9,370,800
富士ソフト	1,100	5,410.00	5,951,000
コナミグループ	2,500	8,116.00	20,290,000
双日	4,100	3,109.00	12,746,900
丸紅	39,300	2,215.50	87,069,150
豊田通商	5,200	8,061.00	41,917,200
三井物産	38,400	5,518.00	211,891,200
住友商事	28,600	2,951.00	84,398,600
三菱商事	32,200	6,947.00	223,693,400
岩谷産業	1,100	7,216.00	7,937,600
ミスミグループ本社	5,400	2,333.00	12,598,200
エービーシー・マート	2,300	2,332.00	5,363,600
アダストリア	600	3,050.00	1,830,000
くら寿司	500	3,255.00	1,627,500
日本マクドナルドホールディングス	2,200	5,740.00	12,628,000
セリア	1,100	2,084.00	2,292,400
Monotaro	6,500	1,215.50	7,900,750
マツキョココカラ&カンパニー	8,300	2,560.00	21,248,000
ZOZO	3,000	2,792.00	8,376,000
ウエルシアホールディングス	2,300	2,373.50	5,459,050
コスモス薬品	500	14,265.00	7,132,500
セブン&アイ・ホールディングス	18,200	5,227.00	95,131,400
ツルハホールディングス	1,000	10,530.00	10,530,000
クスリのアオキホールディングス	400	9,265.00	3,706,000
FOOD & LIFE COMPANY	3,000	2,486.50	7,459,500
パン・パシフィック・インターナショナルホ	10,300	2,825.50	29,102,650
ゼンショーホールディングス	2,300	7,032.00	16,173,600
ワークマン	400	4,110.00	1,644,000
スギホールディングス	900	5,667.00	5,100,300
しまむら	600	14,675.00	8,805,000
ケーズホールディングス	4,000	1,383.00	5,532,000
ヤマダホールディングス	17,600	461.40	8,120,640
ニトリホールディングス	1,900	15,615.00	29,668,500
ファーストリテイリング	1,600	33,840.00	54,144,000

サンドラッグ	1,800	3,955.00	7,119,000	
三井住友フィナンシャルグループ	33,700	7,190.00	242,303,000	
セブン銀行	14,700	293.80	4,318,860	
SBIホールディングス	6,800	3,121.00	21,222,800	
東京海上ホールディングス	47,900	3,353.00	160,608,700	
芙蓉総合リース	400	11,690.00	4,676,000	
東京センチュリー	800	5,831.00	4,664,800	
オリックス	32,000	2,699.50	86,384,000	
三菱HCキャピタル	16,700	959.60	16,025,320	
大東建託	1,600	15,465.00	24,744,000	
野村不動産ホールディングス	3,000	3,687.00	11,061,000	
オープンハウスグループ	1,800	4,754.00	8,557,200	
飯田グループホールディングス	3,600	2,312.00	8,323,200	
三井不動産	22,300	3,290.00	73,367,000	
三菱地所	28,700	1,954.50	56,094,150	
UTグループ	700	1,932.00	1,352,400	
エス・エム・エス	1,800	2,275.00	4,095,000	
パーソルホールディングス	49,200	216.40	10,646,880	
カカクコム	3,400	1,414.00	4,807,600	
ディップ	900	2,935.00	2,641,500	
新日本科学	500	1,682.00	841,000	
ベネフィット・ワン	1,900	970.90	1,844,710	
エムスリー	7,000	2,399.50	16,796,500	
博報堂DYホールディングス	5,700	1,213.00	6,914,100	
インフォマート	4,700	369.00	1,734,300	
H. U. グループホールディングス	1,400	2,444.50	3,422,300	
サイバーエージェント	10,900	777.90	8,479,110	
テクノプロ・ホールディングス	2,800	2,953.00	8,268,400	
Keeper 技研	300	5,660.00	1,698,000	
リクルートホールディングス	37,400	4,498.00	168,225,200	
インソース	1,200	852.00	1,022,400	
バイカレント・コンサルティング	3,600	3,969.00	14,288,400	
セコム	5,400	10,090.00	54,486,000	
小計 銘柄数：263			9,331,928,490	
組入時価比率：98.3%				100.0%

合計			9,331,928,490
----	--	--	---------------

(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 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。