



2022年10月期 (2022年4月8日～2022年10月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2022 (April 8, 2022 – October 7, 2022)

2022年11月16日
 November 16, 2022

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信
 コード番号 (1591)
 連動対象指標 JPX日経インデックス400
 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 JPX-Nikkei Index 400 Exchange Traded Fund
 Code: 1591
 Underlying index: JPX-Nikkei Index 400
 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12月27日
 分配金支払開始日 2022年11月15日
 Scheduled date of submission of securities report: December 27, 2022
 Date of commencing dividend payment: November 15, 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8日～2022年10月7日)

Management Status for Year ended October 2022 (from April 8, 2022 to October 7, 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	1,116,315	(97.5)	28,135	(2.5)	1,144,450	(100.0)
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	1,113,569	(97.6)	27,816	(2.4)	1,141,386	(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	66,786	199	388	66,597
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	67,063	499	775	66,786

(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	1,229,427	84,976	1,144,450	17,185
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	1,203,782	62,395	1,141,386	17,090

(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	215
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	211

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17期 (2022年4月7日現在) 17th Fiscal Year As of April 7, 2022	第18期 (2022年10月7日現在) 18th Fiscal Year As of October 7, 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	61,737,143,913	98,898,101,586
株式 Stocks	1,113,569,348,060	1,116,315,558,700
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,188,198,495	376,522,617
未収入金 Accounts receivable - other	14,063,411,275	26,343,500
未収配当金 Accrued dividends receivable	13,188,418,526	12,360,843,705
未収利息 Accrued interest	3,298,834	750,337
その他未収収益 Other accrued revenue	32,436,273	363,995,725
差入委託証拠金 Margin deposits	-	1,085,130,984
流動資産合計 Total current assets	1,203,782,255,376	1,229,427,247,154
資産合計 Total assets	1,203,782,255,376	1,229,427,247,154
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	511,611,748	-
前受金 Advances received	109,577,452	-
未払金 Accounts payable - other	13,959,594,178	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	14,091,926,180	14,318,479,700
未払受託者報酬 Trustee fees payable	289,933,471	218,445,586
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	871,835,870	642,667,719
未払利息 Accrued interest expenses	7,696	90,877

有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities lent	32,435,433,982	69,438,759,315
その他未払費用 Other accrued expenses	126,065,260	358,168,369
流動負債合計 Total current liabilities	62,395,985,837	84,976,611,566
負債合計 Total liabilities	62,395,985,837	84,976,611,566
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	776,458,453,880	774,263,465,080
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	364,927,815,659	370,187,170,508
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	55,200,243	18,908,559
元本等合計 Total principal and other	1,141,386,269,539	1,144,450,635,588
純資産合計 Total net assets	1,141,386,269,539	1,144,450,635,588
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	1,203,782,255,376	1,229,427,247,154

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第17期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日 17th Fiscal Year From October 8, 2021 to April 7, 2022	第18期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日 18th Fiscal Year From April 8, 2022 to October 7, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	15,339,298,375	14,992,369,853
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△29,666,837,789	5,405,248,009
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△832,896,843	911,009,711
その他収益 Other revenue	242,070,502	440,549,205
営業収益合計 Total operating revenue	△14,918,365,755	21,749,176,778
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△7,695,220	△2,528,550

受託者報酬 Trustee fees	289,933,471	218,445,586
委託者報酬 Investment trust management fees	871,835,870	642,667,719
その他費用 Other expenses	307,796,227	292,146,287
営業費用合計 Total operating expenses	1,461,870,348	1,150,731,042
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△16,380,236,103	20,598,445,736
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△16,380,236,103	20,598,445,736
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△16,380,236,103	20,598,445,736
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	397,138,222,644	364,927,815,659
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	2,965,407,028	1,108,621,357
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	2,965,407,028	1,108,621,357
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	4,703,651,730	2,129,232,544
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	4,703,651,730	2,129,232,544
分配金 Dividends	14,091,926,180	14,318,479,700
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	364,927,815,659	370,187,170,508

(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る場合、当該価額が異なることもあります。

4. その他	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。 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8日から2022年10月7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17期 2022年4月7日現在	第18期 2022年10月7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 66,786,380 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 66,597,580 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 17,090 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 17,185 円
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 29,888,467,090 円	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 65,752,548,110 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日	第18期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日																																																												
1. 分配金の計算過程 <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 10%;"></th> <th style="width: 60%;"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">15,589,064,097 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">27,627,894 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C=A+B</td> <td style="text-align: right;">15,616,691,991 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">1,469,565,568 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E=C-D</td> <td style="text-align: right;">14,147,126,423 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">14,091,926,180 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G=E-F</td> <td style="text-align: right;">55,200,243 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">66,786,380 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H</td> <td style="text-align: right;">211 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	15,589,064,097 円	分配準備積立金	B	27,627,894 円	配当等収益合計額	C=A+B	15,616,691,991 円	経費	D	1,469,565,568 円	収益分配可能額	E=C-D	14,147,126,423 円	収益分配金	F	14,091,926,180 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	55,200,243 円	口数	H	66,786,380 口	1口当たり分配金	I=F/H	211 円	1. 分配金の計算過程 <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 10%;"></th> <th style="width: 60%;"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">15,435,447,608 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">55,200,243 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C=A+B</td> <td style="text-align: right;">15,490,647,851 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">1,153,259,592 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E=C-D</td> <td style="text-align: right;">14,337,388,259 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">14,318,479,700 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G=E-F</td> <td style="text-align: right;">18,908,559 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">66,597,580 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H</td> <td style="text-align: right;">215 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	15,435,447,608 円	分配準備積立金	B	55,200,243 円	配当等収益合計額	C=A+B	15,490,647,851 円	経費	D	1,153,259,592 円	収益分配可能額	E=C-D	14,337,388,259 円	収益分配金	F	14,318,479,700 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	18,908,559 円	口数	H	66,597,580 口	1口当たり分配金	I=F/H	215 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	15,589,064,097 円																																																											
分配準備積立金	B	27,627,894 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	15,616,691,991 円																																																											
経費	D	1,469,565,568 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	14,147,126,423 円																																																											
収益分配金	F	14,091,926,180 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	55,200,243 円																																																											
口数	H	66,786,380 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	211 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	15,435,447,608 円																																																											
分配準備積立金	B	55,200,243 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	15,490,647,851 円																																																											
経費	D	1,153,259,592 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	14,337,388,259 円																																																											
収益分配金	F	14,318,479,700 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	18,908,559 円																																																											
口数	H	66,597,580 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	215 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち236,570,561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231,946,888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17期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日	第18期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7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価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左

<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。 ○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。</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17期 2022年4月7日現在	第18期 2022年10月7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。 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。</p>	<p>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</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第17期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日	第18期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7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17期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日	第18期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日
期首元本額 779,678,088,564円	期首元本額 776,458,453,880円
期中追加設定元本額 5,801,385,626円	期中追加設定元本額 2,323,293,336円
期中一部交換元本額 9,021,020,310円	期中一部交換元本額 4,518,282,136円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第17期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日	第18期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7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	△29,714,176,817	5,494,132,022
合計	△29,714,176,817	5,494,132,022

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17期(2022年4月7日現在)				第18期(2022年10月7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	26,999,766,048	—	27,679,038,500	676,586,747	27,637,277,983	—	28,016,500,000	376,522,617
合計	26,999,766,048	—	27,679,038,500	676,586,747	27,637,277,983	—	28,016,500,000	376,522,617

(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7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	798,000	541.00	431,718,000	
		I N P E X	2,724,500	1,500.00	4,086,750,000	貸付有価証券 1,061,100株
		ウエストホールディングス	72,300	4,005.00	289,561,500	貸付有価証券 49,100株
		ショーボンドホールディングス	100,300	6,450.00	646,935,000	貸付有価証券 4,300株
		ミライト・ワン	276,700	1,477.00	408,685,900	
		安藤・間	391,200	881.00	344,647,200	
		コムシスホールディングス	277,000	2,487.00	688,899,000	
		大成建設	552,400	4,060.00	2,242,744,000	
		大林組	1,842,900	949.00	1,748,912,100	
		清水建設	1,704,200	728.00	1,240,657,600	
		長谷工コーポレーション	531,900	1,578.00	839,338,200	
		鹿島建設	1,350,300	1,403.00	1,894,470,900	貸付有価証券 200株
		西松建設	120,100	3,835.00	460,583,500	貸付有価証券 19,400株
戸田建設	760,700	747.00	568,242,900	貸付有価証券 1,000株		

熊谷組	98,100	2,549.00	250,056,900	貸付有価証券 300株
五洋建設	730,500	734.00	536,187,000	貸付有価証券 14,200株
住友林業	395,300	2,308.00	912,352,400	貸付有価証券 201,800株
大和ハウス工業	1,570,800	2,994.50	4,703,760,600	貸付有価証券 300株
積水ハウス	1,883,400	2,472.00	4,655,764,800	貸付有価証券 923,500株
関電工	322,700	839.00	270,745,300	
エクシオグループ	275,400	2,168.00	597,067,200	
九電工	125,300	2,886.00	361,615,800	
インフロニア・ホールディングス	691,000	1,025.00	708,275,000	貸付有価証券 11,900株
森永製菓	127,800	3,950.00	504,810,000	貸付有価証券 300株
カルビー	289,500	3,015.00	872,842,500	貸付有価証券 6,800株
森永乳業	103,400	4,185.00	432,729,000	貸付有価証券 9,800株
ヤクルト本社	403,300	8,400.00	3,387,720,000	
明治ホールディングス	349,800	6,310.00	2,207,238,000	貸付有価証券 300株
プリマハム	79,400	2,073.00	164,596,200	貸付有価証券 1,900株
日本ハム	222,500	3,715.00	826,587,500	貸付有価証券 3,300株
アサヒグループホールディングス	1,195,400	4,552.00	5,441,460,800	貸付有価証券 458,400株
キリンホールディングス	2,334,600	2,243.00	5,236,507,800	貸付有価証券 577,700株
宝ホールディングス	353,100	1,070.00	377,817,000	貸付有価証券 1,300株
サントリー食品インターナショナル	364,300	5,060.00	1,843,358,000	貸付有価証券 120,500株
キッコーマン	380,900	8,170.00	3,111,953,000	
味の素	1,266,100	4,025.00	5,096,052,500	貸付有価証券 900株
キューピー	278,000	2,360.00	656,080,000	貸付有価証券 8,500株
カゴメ	241,000	2,998.00	722,518,000	貸付有価証券 101,300株
ニチレイ	237,000	2,336.00	553,632,000	
東洋水産	283,200	5,890.00	1,668,048,000	
日清食品ホールディングス	204,800	9,930.00	2,033,664,000	

日本たばこ産業	3,405,600	2,390.50	8,141,086,800	貸付有価証券 496,500株
帝人	544,500	1,410.00	767,745,000	
東レ	3,846,600	746.30	2,870,717,580	
ゴールドウイン	102,500	7,810.00	800,525,000	
王子ホールディングス	2,391,700	540.00	1,291,518,000	
大王製紙	265,700	1,178.00	312,994,600	
レンゴー	479,300	855.00	409,801,500	貸付有価証券 1,100株
クラレ	836,700	1,026.00	858,454,200	貸付有価証券 7,600株
旭化成	3,834,300	983.90	3,772,567,770	
住友化学	4,228,100	505.00	2,135,190,500	貸付有価証券 2,700株
日産化学	277,600	6,650.00	1,846,040,000	
東ソー	766,500	1,649.00	1,263,958,500	
トクヤマ	184,100	1,805.00	332,300,500	貸付有価証券 2,900株
デンカ	208,800	3,250.00	678,600,000	
信越化学工業	982,400	15,455.00	15,182,992,000	
エア・ウォーター	496,600	1,757.00	872,526,200	
日本酸素ホールディングス	510,600	2,391.00	1,220,844,600	貸付有価証券 500株
三菱瓦斯化学	480,300	1,963.00	942,828,900	
三井化学	482,500	2,864.00	1,381,880,000	
三菱ケミカルグループ	3,847,400	677.90	2,608,152,460	貸付有価証券 169,900株
KHネオケム	87,600	2,825.00	247,470,000	貸付有価証券 10,300株
ダイセル	833,300	859.00	715,804,700	貸付有価証券 100株
積水化学工業	1,183,900	1,849.00	2,189,031,100	
日本ゼオン	450,900	1,365.00	615,478,500	
アイカ工業	146,100	3,215.00	469,711,500	
UBE	292,100	1,959.00	572,223,900	
日油	179,000	5,300.00	948,700,000	
花王	1,306,600	5,757.00	7,522,096,200	貸付有価証券 437,900株
日本ペイントホールディングス	2,328,800	984.00	2,291,539,200	貸付有価証券 971,900株
関西ペイント	535,600	2,110.00	1,130,116,000	貸付有価証券 500株

富士フイルムホールディングス	1,112,200	6,961.00	7,742,024,200	
資生堂	1,100,300	5,236.00	5,761,170,800	貸付有価証券 139,800株
ライオン	632,200	1,599.00	1,010,887,800	貸付有価証券 15,500株
ファンケル	256,100	2,871.00	735,263,100	
コーセー	107,100	15,930.00	1,706,103,000	貸付有価証券 29,500株 (8,900株)
小林製薬	161,200	8,410.00	1,355,692,000	貸付有価証券 65,300株
タカラバイオ	165,600	1,767.00	292,615,200	
デクセリアルズ	164,800	3,385.00	557,848,000	
日東電工	382,500	8,170.00	3,125,025,000	
エフピコ	116,300	3,600.00	418,680,000	
ニフコ	211,200	3,125.00	660,000,000	
ユニ・チャーム	1,097,800	4,774.00	5,240,897,200	貸付有価証券 265,900株
協和キリン	636,600	3,395.00	2,161,257,000	貸付有価証券 273,200株
武田薬品工業	4,322,600	3,789.00	16,378,331,400	貸付有価証券 300株
アステラス製薬	5,410,600	1,968.00	10,648,060,800	
住友ファーマ	390,900	1,036.00	404,972,400	
塩野義製薬	734,600	7,046.00	5,175,991,600	
日本新薬	138,000	7,650.00	1,055,700,000	
中外製薬	1,649,500	3,777.00	6,230,161,500	貸付有価証券 461,900株
科研製薬	90,300	3,840.00	346,752,000	貸付有価証券 900株
エーザイ	699,200	7,806.00	5,457,955,200	
ロート製薬	301,600	4,645.00	1,400,932,000	
小野薬品工業	1,220,000	3,413.00	4,163,860,000	
参天製薬	1,102,200	993.00	1,094,484,600	
JCRファーマ	178,400	2,247.00	400,864,800	
東和薬品	91,100	2,215.00	201,786,500	
第一三共	4,590,600	4,277.00	19,633,996,200	
大塚ホールディングス	1,205,600	4,656.00	5,613,273,600	貸付有価証券 274,600株
ペプチドリーム	255,400	1,766.00	451,036,400	貸付有価証券 54,400株 (2,000株)
出光興産	643,800	3,375.00	2,172,825,000	

ENEOSホールディングス	9,520,200	490.10	4,665,850,020	
コスモエネルギーホールディングス	249,800	3,920.00	979,216,000	貸付有価証券 1,100株
横浜ゴム	299,800	2,277.00	682,644,600	貸付有価証券 119,000株
TOYO TIRE	302,800	1,645.00	498,106,000	貸付有価証券 800株
ブリヂストン	1,682,700	4,902.00	8,248,595,400	貸付有価証券 697,000株
住友ゴム工業	516,800	1,204.00	622,227,200	貸付有価証券 188,500株
AGC	536,200	4,650.00	2,493,330,000	貸付有価証券 315,900株
太平洋セメント	359,500	2,055.00	738,772,500	
東海カーボン	442,000	999.00	441,558,000	貸付有価証券 37,400株
TOTO	382,500	4,960.00	1,897,200,000	貸付有価証券 700株
日本碍子	623,200	1,894.00	1,180,340,800	
日本特殊陶業	441,300	2,729.00	1,204,307,700	
MARUWA	21,900	17,440.00	381,936,000	
ニチアス	133,200	2,338.00	311,421,600	
日本製鉄	2,614,100	2,085.50	5,451,705,550	
JFEホールディングス	1,448,700	1,413.00	2,047,013,100	貸付有価証券 94,200株
東京製鐵	182,800	1,340.00	244,952,000	
三井金属鉱業	168,900	3,075.00	519,367,500	貸付有価証券 2,100株
住友金属鉱山	685,700	4,244.00	2,910,110,800	貸付有価証券 1,300株
DOWAホールディングス	146,200	5,170.00	755,854,000	貸付有価証券 1,600株
住友電気工業	2,183,900	1,548.50	3,381,769,150	
アサヒホールディングス	250,600	2,037.00	510,472,200	貸付有価証券 6,100株
SUMCO	1,032,000	1,822.00	1,880,304,000	貸付有価証券 319,000株
三和ホールディングス	590,000	1,277.00	753,430,000	
リンナイ	108,100	10,700.00	1,156,670,000	
三浦工業	246,200	3,065.00	754,603,000	
アマダ	987,800	1,039.00	1,026,324,200	貸付有価証券 200株
FUJII	249,900	1,955.00	488,554,500	

DMG 森精機	321,700	1,719.00	553,002,300	貸付有価証券 213,400株 (156,700 株)
ディスコ	92,200	32,600.00	3,005,720,000	
オプトラン	78,400	2,171.00	170,206,400	貸付有価証券 100株
ナブテスコ	333,000	3,095.00	1,030,635,000	貸付有価証券 20,700株
SMC	185,300	63,650.00	11,794,345,000	
小松製作所	2,868,200	2,716.00	7,790,031,200	
住友重機械工業	338,100	2,772.00	937,213,200	貸付有価証券 3,700株
日立建機	253,600	2,810.00	712,616,000	貸付有価証券 200株
ローツェ	31,200	7,960.00	248,352,000	貸付有価証券 3,000株 (1,000株)
クボタ	2,829,900	2,053.50	5,811,199,650	貸付有価証券 1,314,500株
荏原製作所	217,100	4,920.00	1,068,132,000	貸付有価証券 74,000株
ダイキン工業	691,100	23,225.00	16,050,797,500	
ダイフク	298,500	7,270.00	2,170,095,000	
竹内製作所	96,300	2,775.00	267,232,500	
ホシザキ	341,600	4,230.00	1,444,968,000	貸付有価証券 153,900株
マキタ	715,200	2,868.50	2,051,551,200	
三菱重工業	928,000	4,870.00	4,519,360,000	
I H I	395,100	3,145.00	1,242,589,500	
イビデン	304,400	4,435.00	1,350,014,000	貸付有価証券 400株
ブラザー工業	721,300	2,630.00	1,897,019,000	
ミネベアミツミ	1,006,900	2,245.00	2,260,490,500	
日立製作所	2,563,400	6,539.00	16,762,072,600	
三菱電機	5,906,300	1,347.00	7,955,786,100	貸付有価証券 8,200株
富士電機	352,000	5,520.00	1,943,040,000	
安川電機	628,800	4,385.00	2,757,288,000	貸付有価証券 259,900株
日本電産	1,405,900	8,426.00	11,846,113,400	
オムロン	526,800	7,055.00	3,716,574,000	
MC J	220,000	991.00	218,020,000	貸付有価証券 147,400株
日本電気	750,500	4,770.00	3,579,885,000	

富士通	569,400	16,235.00	9,244,209,000	
ルネサスエレクトロニクス	3,459,200	1,308.00	4,524,633,600	貸付有価証券 974,800株
セイコーエプソン	706,700	2,115.00	1,494,670,500	貸付有価証券 6,900株
ワコム	484,900	692.00	335,550,800	貸付有価証券 54,000株
アルバック	126,100	5,670.00	714,987,000	貸付有価証券 76,500株
エレコム	145,000	1,473.00	213,585,000	貸付有価証券 400株
パナソニック ホールディングス	6,749,400	1,052.00	7,100,368,800	
シャープ	601,100	859.00	516,344,900	貸付有価証券 402,700株 (43,600株)
アンリツ	400,400	1,642.00	657,456,800	
ソニーグループ	1,487,400	9,891.00	14,711,873,400	
TDK	916,600	4,775.00	4,376,765,000	貸付有価証券 17,400株
横河電機	580,600	2,416.00	1,402,729,600	
アズビル	367,000	4,125.00	1,513,875,000	貸付有価証券 2,000株
日本光電工業	242,700	3,225.00	782,707,500	貸付有価証券 300株
堀場製作所	117,000	6,020.00	704,340,000	貸付有価証券 15,000株
アドバンテスト	470,500	7,340.00	3,453,470,000	
キーエンス	355,800	51,930.00	18,476,694,000	貸付有価証券 25,900株
シスメックス	453,200	7,959.00	3,607,018,800	
フェローテックホールディングス	147,400	2,509.00	369,826,600	貸付有価証券 98,700株
レーザーテック	259,400	17,075.00	4,429,255,000	貸付有価証券 110,500株
カシオ計算機	391,400	1,352.00	529,172,800	貸付有価証券 6,000株
ファナック	555,400	20,995.00	11,660,623,000	
浜松ホトニクス	421,600	6,580.00	2,774,128,000	
新光電気工業	185,900	3,420.00	635,778,000	貸付有価証券 14,900株
京セラ	890,300	7,571.00	6,740,461,300	
太陽誘電	281,400	3,905.00	1,098,867,000	貸付有価証券 4,100株
村田製作所	1,726,200	7,073.00	12,209,412,600	

小糸製作所	631,800	2,113.00	1,334,993,400	貸付有価証券 500株
S C R E E Nホールディングス	99,800	8,280.00	826,344,000	貸付有価証券 1,500株
東京エレクトロン	372,500	38,830.00	14,464,175,000	
トヨタ紡織	221,200	1,891.00	418,289,200	
豊田自動織機	448,100	7,420.00	3,324,902,000	
デンソー	1,238,500	7,159.00	8,866,421,500	
いすゞ自動車	1,833,000	1,680.00	3,079,440,000	
トヨタ自動車	7,858,700	1,985.50	15,603,448,850	
アイシン	463,200	3,925.00	1,818,060,000	貸付有価証券 400株
本田技研工業	4,626,800	3,291.00	15,226,798,800	貸付有価証券 100株
スズキ	1,254,500	4,825.00	6,052,962,500	
S U B A R U	1,662,400	2,280.50	3,791,103,200	
ヤマハ発動機	825,700	2,844.00	2,348,290,800	貸付有価証券 380,400株
豊田合成	178,800	2,333.00	417,140,400	
シマノ	214,900	23,945.00	5,145,780,500	貸付有価証券 44,500株
テイ・エス テック	267,200	1,505.00	402,136,000	
テルモ	1,790,800	4,339.00	7,770,281,200	
島津製作所	756,200	3,965.00	2,998,333,000	
東京精密	98,800	4,465.00	441,142,000	
オリンパス	3,031,800	3,012.00	9,131,781,600	貸付有価証券 86,300株
HOYA	1,206,000	14,880.00	17,945,280,000	
朝日インテック	693,800	2,526.00	1,752,538,800	貸付有価証券 71,800株
バンダイナムコホールディングス	523,400	9,711.00	5,082,737,400	貸付有価証券 600株
パイロットコーポレーション	82,200	5,930.00	487,446,000	貸付有価証券 2,200株
ヤマハ	368,000	5,390.00	1,983,520,000	貸付有価証券 2,300株
ピジョン	334,600	2,075.00	694,295,000	貸付有価証券 52,400株
任天堂	2,812,400	6,056.00	17,031,894,400	
中部電力	1,787,200	1,255.00	2,242,936,000	貸付有価証券 6,900株
関西電力	2,213,300	1,147.00	2,538,655,100	
九州電力	1,211,200	731.00	885,387,200	貸付有価証券

				4,100株
北海道電力	549,900	442.00	243,055,800	
電源開発	467,600	2,015.00	942,214,000	貸付有価証券 2,500株
イーレックス	81,500	2,799.00	228,118,500	
レノバ	124,200	3,695.00	458,919,000	貸付有価証券 82,900株 (73,800 株)
東京瓦斯	1,110,800	2,488.00	2,763,670,400	
大阪瓦斯	1,064,300	2,182.00	2,322,302,600	
SBSホールディングス	46,800	2,876.00	134,596,800	貸付有価証券 100株
東海旅客鉄道	445,200	16,940.00	7,541,688,000	
ヤマトホールディングス	820,900	2,220.00	1,822,398,000	貸付有価証券 400株
山九	145,600	4,345.00	632,632,000	
センコーグループホール ディングス	277,700	994.00	276,033,800	
日立物流	115,700	8,590.00	993,863,000	貸付有価証券 4,100株 (2,900株)
AZ-COM丸和ホール ディングス	101,300	1,485.00	150,430,500	貸付有価証券 33,800株
SGホールディングス	1,006,600	2,039.00	2,052,457,400	
NIPPON EXPRESS ホールディング	195,800	7,500.00	1,468,500,000	貸付有価証券 55,100株 (12,000 株)
日本郵船	1,503,500	2,563.00	3,853,470,500	貸付有価証券 1,019,400株 (38,400 株)
商船三井	924,200	2,775.00	2,564,655,000	貸付有価証券 619,200株
川崎汽船	553,700	2,124.00	1,176,058,800	貸付有価証券 373,300株 (3,800 株)
三井倉庫ホールディング ス	58,700	3,180.00	186,666,000	
NECネットエスアイ	205,400	1,627.00	334,185,800	
システナ	885,900	428.00	379,165,200	
日鉄ソリューションズ	107,900	3,555.00	383,584,500	
TIS	542,800	4,025.00	2,184,770,000	
コーエーテクモホールデ ィングス	396,200	2,404.00	952,464,800	貸付有価証券 92,400株 (41,800 株)
ネクソン	1,361,000	2,730.00	3,715,530,000	貸付有価証券 547,900株
ティーガイア	55,100	1,673.00	92,182,300	貸付有価証券

				400株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	161,300	2,291.00	369,538,300	貸付有価証券 2,800株
GMOペイメントゲートウェイ	120,300	11,040.00	1,328,112,000	貸付有価証券 400株
インターネットイニシアティブ	330,800	2,224.00	735,699,200	
ラクス	284,800	1,487.00	423,497,600	貸付有価証券 78,100株 (9,400株)
チェンジ	129,000	1,991.00	256,839,000	貸付有価証券 84,100株
野村総合研究所	1,079,900	3,540.00	3,822,846,000	
インフォコム	67,900	2,005.00	136,139,500	
オービック	195,700	20,620.00	4,035,334,000	貸付有価証券 700株
ジャストシステム	88,300	3,270.00	288,741,000	
Zホールディングス	8,957,200	398.80	3,572,131,360	貸付有価証券 327,000株
トレンドマイクロ	304,300	7,740.00	2,355,282,000	貸付有価証券 99,600株
日本オラクル	100,800	8,090.00	815,472,000	貸付有価証券 1,000株
伊藤忠テクノソリューションズ	282,900	3,445.00	974,590,500	
大塚商会	298,700	4,635.00	1,384,474,500	貸付有価証券 126,900株
電通国際情報サービス	64,000	4,570.00	292,480,000	貸付有価証券 900株
東映アニメーション	24,800	12,690.00	314,712,000	貸付有価証券 4,400株 (4,400株)
デジタルガレージ	102,900	3,710.00	381,759,000	貸付有価証券 1,300株
ネットワンシステムズ	229,000	2,946.00	674,634,000	
BIPROGY	193,900	3,235.00	627,266,500	
USEN-NEXT HOLDINGS	47,200	2,072.00	97,798,400	貸付有価証券 31,500株
日本電信電話	4,235,900	3,968.00	16,808,051,200	
KDDI	3,847,900	4,253.00	16,365,118,700	貸付有価証券 600株
ソフトバンク	9,405,700	1,468.00	13,807,567,600	貸付有価証券 3,000株
光通信	70,800	18,000.00	1,274,400,000	
GMOインターネットグループ	195,800	2,682.00	525,135,600	
東宝	366,400	5,170.00	1,894,288,000	貸付有価証券 180,100株

NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信 (1591) 2022年10月期 決算短信
 NEXT FUNDS JPX-Nikkei Index 400 Exchange Traded Fund (1591) Earnings Report for Fiscal Year ended October 2022

エス・ティ・ティ・デー タ	1,653,400	1,970.00	3,257,198,000	貸付有価証券 9,900株(9,900株)
D T S	115,700	3,480.00	402,636,000	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	288,900	6,610.00	1,909,629,000	
カブコン	576,000	3,810.00	2,194,560,000	
S C S K	429,900	2,209.00	949,649,100	貸付有価証券 300株
N S D	194,500	2,518.00	489,751,000	貸付有価証券 200株
コナミグループ	225,600	6,510.00	1,468,656,000	貸付有価証券 100株
ソフトバンクグループ	3,152,500	5,504.00	17,351,360,000	
双日	639,300	2,227.00	1,423,721,100	
アルフレッサ ホールデ ィングス	646,400	1,728.00	1,116,979,200	
神戸物産	430,100	3,445.00	1,481,694,500	貸付有価証券 185,700株(28,100 株)
ダイワボウホールディ ングス	265,000	2,015.00	533,975,000	
T O K A I ホールディ ングス	301,900	876.00	264,464,400	
シップヘルスケアホール ディングス	179,800	2,865.00	515,127,000	貸付有価証券 33,300株
メディバルホールディ ングス	576,500	1,904.00	1,097,656,000	貸付有価証券 2,300株
伊藤忠商事	3,736,800	3,850.00	14,386,680,000	
丸紅	5,399,400	1,364.50	7,367,481,300	貸付有価証券 100株
豊田通商	556,500	4,760.00	2,648,940,000	
兼松	215,800	1,476.00	318,520,800	
三井物産	4,380,400	3,281.00	14,372,092,400	貸付有価証券 4,400株
住友商事	3,688,100	1,904.00	7,022,142,400	貸付有価証券 2,600株
三菱商事	4,086,800	4,206.00	17,189,080,800	
阪和興業	108,100	3,715.00	401,591,500	
岩谷産業	138,100	5,550.00	766,455,000	貸付有価証券 2,500株
P A L T A C	87,400	4,335.00	378,879,000	貸付有価証券 200株
日鉄物産	38,100	5,250.00	200,025,000	
ミスミグループ本社	782,600	3,380.00	2,645,188,000	
ローソン	137,900	4,570.00	630,203,000	貸付有価証券

				89,600株
エービーシー・マート	97,300	6,650.00	647,045,000	
日本マクドナルドホールディングス	313,500	4,980.00	1,561,230,000	貸付有価証券 185,300株
セリア	149,000	2,513.00	374,437,000	貸付有価証券 4,900株
Monotaro	788,000	2,342.00	1,845,496,000	貸付有価証券 84,000株
マツキヨココカラ&カンパニー	365,200	6,350.00	2,319,020,000	
ZOZO	428,600	3,085.00	1,322,231,000	
ウエルシアホールディングス	329,500	3,115.00	1,026,392,500	貸付有価証券 78,000株
クリエイティブSDホールディングス	91,900	3,230.00	296,837,000	貸付有価証券 300株
ネクステージ	126,800	3,030.00	384,204,000	貸付有価証券 19,700株 (15,900株)
コスモス薬品	62,900	14,730.00	926,517,000	貸付有価証券 3,400株
セブン&アイ・ホールディングス	2,090,000	5,486.00	11,465,740,000	貸付有価証券 703,800株
ツルハホールディングス	136,000	8,760.00	1,191,360,000	貸付有価証券 4,200株
クスリのアオキホールディングス	55,800	7,500.00	418,500,000	貸付有価証券 1,400株
FOOD & LIFE COMPANIE	319,300	2,350.00	750,355,000	
ノジマ	201,500	1,312.00	264,368,000	貸付有価証券 4,200株
良品計画	717,200	1,195.00	857,054,000	貸付有価証券 69,600株
コーナン商事	88,600	3,360.00	297,696,000	貸付有価証券 3,000株
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,246,500	2,674.00	3,333,141,000	貸付有価証券 328,400株
ゼンショーホールディングス	304,300	3,710.00	1,128,953,000	貸付有価証券 46,600株 (14,200株)
ワークマン	64,300	4,725.00	303,817,500	貸付有価証券 43,000株
スギホールディングス	124,400	5,940.00	738,936,000	貸付有価証券 4,000株
日本瓦斯	297,800	2,070.00	616,446,000	
ライフコーポレーション	48,600	2,582.00	125,485,200	貸付有価証券 300株
丸井グループ	451,000	2,496.00	1,125,696,000	
イズミ	98,600	3,210.00	316,506,000	

ヤオコー	70,800	6,480.00	458,784,000	貸付有価証券 14,500株 (1,400株)
ケーズホールディングス	530,500	1,198.00	635,539,000	
ニトリホールディングス	247,300	12,775.00	3,159,257,500	貸付有価証券 4,400株
ファーストリテイリング	83,400	79,890.00	6,662,826,000	貸付有価証券 13,700株
サンドラッグ	234,500	3,600.00	844,200,000	
めぶきフィナンシャルグループ	2,567,700	287.00	736,929,900	貸付有価証券 300株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3,089,600	446.00	1,377,961,600	
新生銀行	407,200	2,290.00	932,488,000	貸付有価証券 78,800株
あおぞら銀行	348,600	2,572.00	896,599,200	貸付有価証券 200株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	22,626,000	652.70	14,767,990,200	
りそなホールディングス	6,604,400	534.50	3,530,051,800	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,032,300	4,258.00	4,395,533,400	
三井住友フィナンシャルグループ	4,050,400	4,141.00	16,772,706,400	貸付有価証券 12,800株
千葉銀行	1,762,600	793.00	1,397,741,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	450,700	2,586.00	1,165,510,200	
セブン銀行	1,853,700	255.00	472,693,500	貸付有価証券 500株
みずほフィナンシャルグループ	7,483,600	1,602.00	11,988,727,200	
GMOフィナンシャルホールディングス	115,800	715.00	82,797,000	貸付有価証券 73,400株 (52,400株)
ジャフコ グループ	216,000	2,246.00	485,136,000	貸付有価証券 27,600株
大和証券グループ本社	4,008,500	580.20	2,325,731,700	貸付有価証券 202,000株
野村ホールディングス	9,529,900	488.90	4,659,168,110	
マネックスグループ	525,500	478.00	251,189,000	貸付有価証券 116,100株 (4,700株)
SOMPOホールディングス	888,100	5,992.00	5,321,495,200	
MS&ADインシュアランスグループホール	1,283,100	3,882.00	4,980,994,200	
第一生命ホールディングス	3,039,600	2,317.00	7,042,753,200	貸付有価証券 460,100株

東京海上ホールディングス	5,210,600	2,592.00	13,505,875,200	貸付有価証券 1,800株
T&Dホールディングス	1,388,700	1,404.00	1,949,734,800	
全国保証	148,900	4,950.00	737,055,000	貸付有価証券 27,800株
芙蓉総合リース	53,600	8,190.00	438,984,000	貸付有価証券 300株
みずほリース	77,000	3,215.00	247,555,000	貸付有価証券 8,900株
東京センチュリー	96,700	4,935.00	477,214,500	
イオンフィナンシャルサービス	339,500	1,453.00	493,293,500	貸付有価証券 144,600株
アコム	1,231,200	317.00	390,290,400	
オリエントコーポレーション	168,920	1,155.00	195,102,600	貸付有価証券 113,000株
オリックス	3,708,400	2,120.50	7,863,662,200	貸付有価証券 200株
三菱HCキャピタル	2,017,500	642.00	1,295,235,000	貸付有価証券 100株
日本取引所グループ	1,454,000	1,992.50	2,897,095,000	貸付有価証券 3,600株
大東建託	203,100	14,420.00	2,928,702,000	
ビューリック	1,207,000	1,094.00	1,320,458,000	貸付有価証券 291,200株
野村不動産ホールディングス	323,300	3,410.00	1,102,453,000	貸付有価証券 200株
プレサンスコーポレーション	68,000	1,544.00	104,992,000	貸付有価証券 500株
オープンハウスグループ	189,400	5,150.00	975,410,000	
東急不動産ホールディングス	1,697,200	796.00	1,350,971,200	
飯田グループホールディングス	509,900	2,064.00	1,052,433,600	
ケアイスター不動産	28,000	4,435.00	124,180,000	貸付有価証券 16,200株 (2,800株)
三井不動産	2,435,600	2,915.50	7,100,991,800	貸付有価証券 600株
三菱地所	3,554,100	1,937.00	6,884,291,700	
東京建物	493,200	2,133.00	1,051,995,600	貸付有価証券 155,700株 (29,900株)
住友不動産	1,122,500	3,415.00	3,833,337,500	
スターツコーポレーション	84,900	2,726.00	231,437,400	
日本エスコン	116,200	829.00	96,329,800	貸付有価証券 2,200株

イオンモール	313,000	1,603.00	501,739,000	貸付有価証券 53,000株
カチタス	154,500	3,175.00	490,537,500	貸付有価証券 100株
UTグループ	87,200	2,287.00	199,426,400	
エス・エム・エス	205,500	3,035.00	623,692,500	
パーソルホールディングス	604,600	2,874.00	1,737,620,400	
総合警備保障	220,500	3,705.00	816,952,500	
カカクコム	443,700	2,610.00	1,158,057,000	
ディップ	106,300	3,755.00	399,156,500	貸付有価証券 29,400株
ベネフィット・ワン	218,900	2,193.00	480,047,700	貸付有価証券 6,700株
エムスリー	1,067,200	4,231.00	4,515,323,200	貸付有価証券 128,600株
博報堂DYホールディングス	765,400	1,090.00	834,286,000	貸付有価証券 2,500株
バリューコマース	40,600	2,277.00	92,446,200	
H. U. グループホールディングス	158,000	2,729.00	431,182,000	
ビー・エム・エル	76,900	3,350.00	257,615,000	
ユー・エス・エス	677,000	2,371.00	1,605,167,000	
サイバーエージェント	1,292,200	1,279.00	1,652,723,800	
フルキャストホールディングス	51,600	2,768.00	142,828,800	貸付有価証券 1,400株
エン・ジャパン	107,400	2,334.00	250,671,600	
テクノプロ・ホールディングス	362,100	3,230.00	1,169,583,000	貸付有価証券 2,200株
ジャパンマテリアル	185,900	1,921.00	357,113,900	貸付有価証券 9,500株
リクルートホールディングス	4,131,000	4,336.00	17,912,016,000	
ベルシステム24ホールディングス	86,900	1,377.00	119,661,300	貸付有価証券 8,200株
ベイクレント・コンサルティング	42,700	40,950.00	1,748,565,000	貸付有価証券 26,300株 (7,300株)
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	191,800	1,905.00	365,379,000	貸付有価証券 2,000株
リログループ	330,700	2,235.00	739,114,500	貸付有価証券 12,900株
トランス・コスモス	76,700	3,730.00	286,091,000	貸付有価証券 3,200株
セコム	595,900	8,523.00	5,078,855,700	貸付有価証券 100株

	メイテック	215,300	2,463.00	530,283,900	
	イオンディライト	69,700	2,941.00	204,987,700	貸付有価証券 700株
小計	銘柄数：400 組入時価比率：97.5%			1,116,315,558,700 100.0%	
合計				1,116,315,558,700	

(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。

(注2) 備考欄の貸付有価証券の()内は、委託者の利害関係人である野村證券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(2022年10月7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。