



2021 年 10 月期 (2021 年 4 月 21 日～2021 年 10 月 20 日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2021 (April 21, 2021 – October 20, 2021)

2021 年 12 月 1 日
 December 1, 2021

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, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2022 年 1 月 19 日
 分配金支払開始日 2021 年 11 月 26 日
 Scheduled date of submission of securities report: January 19, 2022
 Date of commencing dividend payment: November 26, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021 年 10 月期の運用状況 (2021 年 4 月 21 日～2021 年 10 月 20 日)

Management Status for Year ended October 2021 (from April 21, 2021 to October 20, 2021)

(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.	%
2021 年 10 月期 FY ended Oct. 2021	9,771	(98.6)	135	(1.4)	9,906	(100.0)
2021 年 4 月期 FY ended Apr. 2021	8,408	(98.1)	161	(1.9)	8,569	(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
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	446	79	39	487
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	485	39	78	446

(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
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	9,997	90	9,906	20,333
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	8,654	84	8,569	19,173

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	152
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	152

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 10 期 (2021 年 4 月 20 日現在) 10th Fiscal Year As of April 20, 2021	第 11 期 (2021 年 10 月 20 日現在) 11th Fiscal Year As of October 20, 2021
	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	171,865,212	149,108,883
株式 Stocks	8,408,339,030	9,771,216,590
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,249,500	-
未収入金 Accounts receivable - other	774,900	22,032
未収配当金 Accrued dividends receivable	66,389,480	66,414,600
差入委託証拠金 Margin deposits	6,060,540	10,742,798
流動資産合計 Total current assets	8,654,678,662	9,997,504,903
資産合計 Total assets	8,654,678,662	9,997,504,903
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,395,520	1,755,970
未払金 Accounts payable - other	-	784,977
未払収益分配金 Unpaid dividends	67,940,504	74,057,440
未払受託者報酬 Trustee fees payable	2,229,951	2,337,561
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	8,027,772	8,415,190
未払利息 Accrued interest expenses	86	135
その他未払費用 Other accrued expenses	5,377,682	3,429,312
流動負債合計 Total current liabilities	84,971,515	90,780,585
負債合計 Total liabilities	84,971,515	90,780,585

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	5,744,101,427	6,261,264,220
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,825,605,720	3,645,460,098
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	198,671	120,069
元本等合計 Total principal and other	8,569,707,147	9,906,724,318
純資産合計 Total net assets	8,569,707,147	9,906,724,318
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	8,654,678,662	9,997,504,903

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	第 10 期 自 2020 年 10 月 21 日 至 2021 年 4 月 20 日 10th Fiscal Year From October 21, 2020 to April 20, 2021	第 11 期 自 2021 年 4 月 21 日 至 2021 年 10 月 20 日 11th Fiscal Year From April 21, 2021 to October 20, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	81,099,032	87,942,373
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	1,291,290,694	540,817,924
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	26,119,078	7,131,741
その他収益 Other revenue	20,211	34,072
営業収益合計 Total operating revenue	1,398,529,015	635,926,110
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	16,662	20,375
受託者報酬 Trustee fees	2,229,951	2,337,561
委託者報酬 Investment trust management fees	8,027,772	8,415,190
その他費用 Other expenses	3,110,379	3,224,481
営業費用合計 Total operating expenses	13,384,764	13,997,607
営業利益又は営業損失 (△)	1,385,144,251	621,928,503

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	1,385,144,251	621,928,503
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	1,385,144,251	621,928,503
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	1,652,872,098	2,825,605,720
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	262,437,021	541,990,312
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	262,437,021	541,990,312
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	406,907,146	270,006,997
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	406,907,146	270,006,997
分配金 Dividends	67,940,504	74,057,440
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,825,605,720	3,645,460,098

(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、2021年4月21日から2021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 10 期 2021 年 4 月 20 日現在	第 11 期 2021 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 446,977 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 487,220 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 19,173 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 20,333 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 10 期 自 2020 年 10 月 21 日 至 2021 年 4 月 20 日	第 11 期 自 2021 年 4 月 21 日 至 2021 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>81,102,581 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>404,696 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>81,507,277 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>13,368,102 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>68,139,175 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>67,940,504 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>198,671 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>446,977 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>152 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	81,102,581 円	分配準備積立金	B	404,696 円	配当等収益合計額	C=A+B	81,507,277 円	経費	D	13,368,102 円	収益分配可能額	E=C-D	68,139,175 円	収益分配金	F	67,940,504 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	198,671 円	口数	H	446,977 口	1 口当たり分配金	I=F/H	152 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>87,956,070 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>198,671 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>88,154,741 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>13,977,232 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>74,177,509 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>74,057,440 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>120,069 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>487,220 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>152 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	87,956,070 円	分配準備積立金	B	198,671 円	配当等収益合計額	C=A+B	88,154,741 円	経費	D	13,977,232 円	収益分配可能額	E=C-D	74,177,509 円	収益分配金	F	74,057,440 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	120,069 円	口数	H	487,220 口	1 口当たり分配金	I=F/H	152 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	81,102,581 円																																																											
分配準備積立金	B	404,696 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	81,507,277 円																																																											
経費	D	13,368,102 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	68,139,175 円																																																											
収益分配金	F	67,940,504 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	198,671 円																																																											
口数	H	446,977 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	152 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	87,956,070 円																																																											
分配準備積立金	B	198,671 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	88,154,741 円																																																											
経費	D	13,977,232 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	74,177,509 円																																																											
収益分配金	F	74,057,440 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	120,069 円																																																											
口数	H	487,220 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	152 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち 2,675,885 円は、対象指数についての商標使用料であります。	2. その他費用 その他費用のうち 2,816,255 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 10 期 自 2020 年 10 月 21 日 至 2021 年 4 月 20 日	第 11 期 自 2021 年 4 月 21 日 至 2021 年 10 月 20 日
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関す	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

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 10 期 2021 年 4 月 20 日現在	第 11 期 2021 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</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。 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</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 10 期 自 2020 年 10 月 21 日 至 2021 年 4 月 20 日	第 11 期 自 2021 年 4 月 21 日 至 2021 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 10 期 自 2020 年 10 月 21 日 至 2021 年 4 月 20 日	第 11 期 自 2021 年 4 月 21 日 至 2021 年 10 月 20 日
期首元本額 6,238,106,718 円	期首元本額 5,744,101,427 円
期中追加設定元本額 513,564,513 円	期中追加設定元本額 1,027,000,516 円
期中一部交換元本額 1,007,569,804 円	期中一部交換元本額 509,837,723 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 10 期 自 2020 年 10 月 21 日 至 2021 年 4 月 20 日	第 11 期 自 2021 年 4 月 21 日 至 2021 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	1,144,787,751	541,937,164
合計	1,144,787,751	541,937,164

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 10 期(2021 年 4 月 20 日現在)			第 11 期(2021 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)
市場取引						
株価指数先物取引						

買建	160,077,890	—	159,941,000	△146,020	131,604,930	—	129,856,000	△1,755,970
合計	160,077,890	—	159,941,000	△146,020	131,604,930	—	129,856,000	△1,755,970

(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(2021 年 10 月 20 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	コムシスホールディングス	3,200	2,928.00	9,369,600	
		大成建設	5,500	3,680.00	20,240,000	
		大林組	19,300	976.00	18,836,800	
		清水建設	15,600	859.00	13,400,400	
		長谷工コーポレーション	6,600	1,512.00	9,979,200	
		鹿島建設	12,800	1,461.00	18,700,800	
		大東建託	1,900	13,800.00	26,220,000	
		住友林業	3,900	2,145.00	8,365,500	
		大和ハウス工業	15,200	3,791.00	57,623,200	
		積水ハウス	16,200	2,392.50	38,758,500	
		エクシオグループ	2,700	2,695.00	7,276,500	
		インフロニア・ホールディングス	5,700	920.00	5,244,000	
		日清製粉グループ本社	5,300	1,856.00	9,836,800	
		森永製菓	1,000	4,055.00	4,055,000	
		カルビー	2,500	2,780.00	6,950,000	
		森永乳業	1,000	6,750.00	6,750,000	
		ヤクルト本社	3,300	5,750.00	18,975,000	
		明治ホールディングス	3,400	7,110.00	24,174,000	
		日本ハム	2,300	4,060.00	9,338,000	
		アサヒグループホールディングス	10,900	5,231.00	57,017,900	
キリンホールディングス	22,900	2,032.00	46,532,800			
宝ホールディングス	4,200	1,607.00	6,749,400			
サントリー食品インターナショナル	3,700	4,455.00	16,483,500			

伊藤園	1,700	7,290.00	12,393,000
キッコーマン	4,000	9,570.00	38,280,000
味の素	12,900	3,411.00	44,001,900
キューピー	2,800	2,537.00	7,103,600
ニチレイ	2,800	2,862.00	8,013,600
日清食品ホールディングス	1,800	8,820.00	15,876,000
日本たばこ産業	31,800	2,295.50	72,996,900
帝人	5,200	1,571.00	8,169,200
東レ	39,300	719.50	28,276,350
ゴールドウイン	700	6,860.00	4,802,000
レンゴー	5,000	867.00	4,335,000
クラレ	8,900	1,053.00	9,371,700
旭化成	34,200	1,216.00	41,587,200
昭和電工	3,900	2,866.00	11,177,400
住友化学	40,800	573.00	23,378,400
日産化学	3,300	6,440.00	21,252,000
東ソー	7,200	1,930.00	13,896,000
トクヤマ	1,800	2,066.00	3,718,800
デンカ	2,200	3,865.00	8,503,000
信越化学工業	10,400	19,510.00	202,904,000
エア・ウォーター	4,400	1,733.00	7,625,200
カネカ	1,300	4,500.00	5,850,000
三菱瓦斯化学	4,700	2,355.00	11,068,500
三井化学	5,100	3,570.00	18,207,000
J S R	5,600	3,945.00	22,092,000
三菱ケミカルホールディングス	36,400	974.20	35,460,880
ダイセル	7,200	867.00	6,242,400
積水化学工業	10,700	1,868.00	19,987,600
トリケミカル研究所	700	3,365.00	2,355,500
A D E K A	2,000	2,530.00	5,060,000
花王	14,100	6,555.00	92,425,500
日本ペイントホールディングス	19,000	1,194.00	22,686,000
D I C	2,000	3,100.00	6,200,000
富士フイルムホールディングス	10,100	8,811.00	88,991,100
資生堂	11,400	7,482.00	85,294,800

ライオン	6,500	1,908.00	12,402,000
ミルボン	600	6,820.00	4,092,000
ファンケル	2,400	3,580.00	8,592,000
コーセー	1,000	14,040.00	14,040,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	2,543.00	6,611,800
小林製薬	1,500	8,720.00	13,080,000
タカラバイオ	1,400	3,035.00	4,249,000
日東電工	4,400	8,090.00	35,596,000
エフピコ	1,200	3,875.00	4,650,000
ユニ・チャーム	10,600	4,546.00	48,187,600
協和キリン	7,300	3,775.00	27,557,500
武田薬品工業	37,700	3,246.00	122,374,200
アステラス製薬	53,000	1,950.50	103,376,500
大日本住友製薬	4,000	1,916.00	7,664,000
塩野義製薬	7,700	7,618.00	58,658,600
日本新薬	1,300	8,910.00	11,583,000
中外製薬	18,100	3,968.00	71,820,800
エーザイ	7,300	8,251.00	60,232,300
ロート製薬	2,800	3,450.00	9,660,000
小野薬品工業	10,800	2,441.50	26,368,200
参天製薬	10,700	1,644.00	17,590,800
ツムラ	1,800	3,525.00	6,345,000
JCRファーマ	1,800	2,940.00	5,292,000
第一三共	50,900	2,760.00	140,484,000
大幸薬品	1,000	854.00	854,000
大塚ホールディングス	11,900	4,725.00	56,227,500
出光興産	5,600	3,265.00	18,284,000
ENEOSホールディングス	93,300	466.00	43,477,800
TOYO TIRE	2,900	1,888.00	5,475,200
ブリヂストン	16,000	5,097.00	81,552,000
住友ゴム工業	4,600	1,446.00	6,651,600
AGC	5,300	5,800.00	30,740,000
東海カーボン	5,000	1,463.00	7,315,000
TOTO	4,100	5,760.00	23,616,000
日本碍子	7,300	1,951.00	14,242,300

日本特殊陶業	4,200	1,721.00	7,228,200
DOWAホールディングス	1,400	4,920.00	6,888,000
住友電気工業	20,600	1,552.00	31,971,200
SUMCO	7,400	2,199.00	16,272,600
三和ホールディングス	5,400	1,447.00	7,813,800
三浦工業	2,300	4,400.00	10,120,000
FUJII	1,800	2,638.00	4,748,400
DMG森精機	3,400	1,977.00	6,721,800
ディスコ	900	30,750.00	27,675,000
ナブテスコ	3,300	3,965.00	13,084,500
SMC	1,800	66,640.00	119,952,000
小松製作所	25,600	2,830.00	72,448,000
住友重機械工業	3,100	2,923.00	9,061,300
日立建機	3,200	3,375.00	10,800,000
クボタ	28,600	2,400.00	68,640,000
荏原製作所	2,400	6,140.00	14,736,000
ダイキン工業	6,900	25,730.00	177,537,000
栗田工業	2,900	5,640.00	16,356,000
ダイフク	2,800	10,300.00	28,840,000
グローリー	1,400	2,414.00	3,379,600
マキタ	6,600	5,770.00	38,082,000
ブラザー工業	6,600	2,353.00	15,529,800
ミネベアミツミ	10,200	2,855.00	29,121,000
日立製作所	28,300	6,830.00	193,289,000
三菱電機	53,000	1,606.50	85,144,500
富士電機	3,700	5,130.00	18,981,000
安川電機	6,600	5,070.00	33,462,000
明電舎	900	2,449.00	2,204,100
オムロン	5,500	10,960.00	60,280,000
富士通	5,200	21,460.00	111,592,000
セイコーエプソン	8,200	2,160.00	17,712,000
エレコム	1,100	1,776.00	1,953,600
パナソニック	64,400	1,396.00	89,902,400
シャープ	5,600	1,379.00	7,722,400
アンリツ	4,000	2,035.00	8,140,000

富士通ゼネラル	1,600	2,837.00	4,539,200
TDK	11,200	4,000.00	44,800,000
横河電機	6,500	2,214.00	14,391,000
アズビル	3,300	4,795.00	15,823,500
日本光電工業	2,100	3,650.00	7,665,000
堀場製作所	1,000	7,560.00	7,560,000
アドバンテスト	6,100	9,250.00	56,425,000
キーエンス	4,500	68,410.00	307,845,000
シスメックス	3,700	14,030.00	51,911,000
日本電子	1,100	8,580.00	9,438,000
ファナック	5,800	24,890.00	144,362,000
浜松ホトニクス	4,200	6,670.00	28,014,000
京セラ	9,100	6,819.00	62,052,900
太陽誘電	3,400	5,590.00	19,006,000
村田製作所	16,100	8,652.00	139,297,200
小糸製作所	2,700	6,810.00	18,387,000
キヤノン	28,900	2,904.00	83,925,600
東京エレクトロン	4,700	50,960.00	239,512,000
トヨタ紡織	1,400	2,101.00	2,941,400
豊田自動織機	4,400	9,700.00	42,680,000
デンソー	12,800	7,878.00	100,838,400
いすゞ自動車	15,200	1,568.00	23,833,600
トヨタ自動車	138,900	2,031.50	282,175,350
アイシン	4,400	4,175.00	18,370,000
スズキ	10,100	5,250.00	53,025,000
SUBARU	16,700	2,304.00	38,476,800
ヤマハ発動機	7,800	3,120.00	24,336,000
シマノ	2,100	30,110.00	63,231,000
デルモ	17,300	5,103.00	88,281,900
島津製作所	6,200	4,700.00	29,140,000
東京精密	1,100	4,570.00	5,027,000
オリンパス	32,000	2,525.00	80,800,000
HOYA	11,100	17,445.00	193,639,500
朝日インテック	6,300	2,993.00	18,855,900
スノーピーク	400	5,420.00	2,168,000

バンダイナムコホールディングス	5,700	8,788.00	50,091,600
ピジョン	3,400	2,630.00	8,942,000
任天堂	3,300	50,300.00	165,990,000
関西電力	20,100	1,079.00	21,687,900
東北電力	12,800	780.00	9,984,000
九州電力	11,400	839.00	9,564,600
電源開発	4,000	1,595.00	6,380,000
東京瓦斯	10,500	1,926.50	20,228,250
大阪瓦斯	10,500	1,915.00	20,107,500
東海旅客鉄道	3,800	17,215.00	65,417,000
日本通運	2,100	7,480.00	15,708,000
山九	1,400	5,370.00	7,518,000
S Gホールディングス	9,600	2,901.00	27,849,600
T I S	5,600	3,150.00	17,640,000
ネクソン	14,300	1,995.00	28,528,500
野村総合研究所	8,700	4,190.00	36,453,000
Zホールディングス	78,200	701.30	54,841,660
トレンドマイクロ	3,900	6,370.00	24,843,000
日本オラクル	1,000	10,560.00	10,560,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,700	3,635.00	9,814,500
大塚商会	3,200	5,760.00	18,432,000
サイボウズ	700	2,514.00	1,759,800
ネットワンシステムズ	2,500	3,875.00	9,687,500
日本ユニシス	2,100	3,180.00	6,678,000
日本電信電話	74,000	3,138.00	232,212,000
K D D I	47,300	3,668.00	173,496,400
ソフトバンク	62,600	1,533.50	95,997,100
エヌ・ティ・ティ・データ	19,200	2,239.00	42,988,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,600	5,930.00	15,418,000
カプコン	5,000	3,250.00	16,250,000
S C S K	4,300	2,349.00	10,100,700
コナミホールディングス	2,900	6,650.00	19,285,000
双日	5,200	1,934.00	10,056,800
神戸物産	3,200	3,890.00	12,448,000
伊藤忠商事	37,200	3,330.00	123,876,000

丸紅	45,400	959.30	43,552,220
豊田通商	5,900	5,050.00	29,795,000
三井物産	46,500	2,591.00	120,481,500
住友商事	32,100	1,612.00	51,745,200
三菱商事	35,900	3,609.00	129,563,100
岩谷産業	1,200	6,780.00	8,136,000
ミスミグループ本社	6,100	4,840.00	29,524,000
エービーシー・マート	900	5,630.00	5,067,000
くら寿司	600	3,650.00	2,190,000
セリア	1,100	3,865.00	4,251,500
ジズホールディングス	300	7,310.00	2,193,000
Monotaro	7,200	2,623.00	18,885,600
マツキョココカラ&カンパニー	2,200	5,160.00	11,352,000
ZOZO	3,000	4,240.00	12,720,000
ウエルシアホールディングス	2,700	4,215.00	11,380,500
コスモス薬品	600	17,960.00	10,776,000
セブン&アイ・ホールディングス	20,800	4,765.00	99,112,000
ツルハホールディングス	1,100	13,850.00	15,235,000
トリドールホールディングス	1,600	2,797.00	4,475,200
クスリのアオキホールディングス	500	7,550.00	3,775,000
FOOD & LIFE COMPANYIE	3,000	4,915.00	14,745,000
コーナン商事	800	3,655.00	2,924,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	11,800	2,501.00	29,511,800
ゼンショーホールディングス	2,600	2,663.00	6,923,800
ワークマン	400	6,190.00	2,476,000
スギホールディングス	1,000	8,340.00	8,340,000
日本瓦斯	3,000	1,440.00	4,320,000
ライフコーポレーション	400	3,860.00	1,544,000
しまむら	600	9,670.00	5,802,000
ヤオコー	500	6,650.00	3,325,000
ケーズホールディングス	5,300	1,200.00	6,360,000
ヤマダホールディングス	20,000	462.00	9,240,000
ニトリホールディングス	2,200	20,655.00	45,441,000
ファーストリテイリング	600	75,500.00	45,300,000

サンドラッグ	2,100	3,510.00	7,371,000
りそなホールディングス	64,900	442.80	28,737,720
三井住友フィナンシャルグループ	38,500	3,915.00	150,727,500
セブン銀行	16,900	247.00	4,174,300
SBIホールディングス	7,100	3,035.00	21,548,500
大和証券グループ本社	42,100	677.60	28,526,960
東京海上ホールディングス	18,500	6,111.00	113,053,500
東京センチュリー	1,200	6,530.00	7,836,000
オリックス	38,500	2,191.50	84,372,750
ヒューリック	8,000	1,128.00	9,024,000
野村不動産ホールディングス	3,500	2,954.00	10,339,000
サムティ	700	2,358.00	1,650,600
オープンハウス	1,900	7,090.00	13,471,000
飯田グループホールディングス	4,200	2,799.00	11,755,800
三井不動産	25,600	2,635.00	67,456,000
三菱地所	32,500	1,771.50	57,573,750
住友不動産	8,600	4,154.00	35,724,400
ミクシィ	1,200	2,635.00	3,162,000
エス・エム・エス	1,900	4,320.00	8,208,000
パーソルホールディングス	5,400	2,960.00	15,984,000
カカクコム	4,000	3,820.00	15,280,000
ディップ	900	4,215.00	3,793,500
ベネフィット・ワン	1,900	5,490.00	10,431,000
エムスリー	8,400	7,379.00	61,983,600
博報堂DYホールディングス	6,500	1,891.00	12,291,500
エスプール	1,600	1,229.00	1,966,400
インフォマート	5,300	1,110.00	5,883,000
H. U. グループホールディングス	1,500	2,861.00	4,291,500
オリエンタルランド	5,500	17,955.00	98,752,500
サイバーエージェント	12,000	2,081.00	24,972,000
楽天グループ	24,700	1,233.00	30,455,100
エン・ジャパン	900	4,555.00	4,099,500
テクノプロ・ホールディングス	3,300	3,600.00	11,880,000
Keiper 技研	400	3,370.00	1,348,000
リクルートホールディングス	37,500	7,232.00	271,200,000

	インソース	600	2,305.00	1,383,000	
	ベйкаレント・コンサルティング	400	45,100.00	18,040,000	
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,400	2,473.00	3,462,200	
	リログループ	3,400	2,367.00	8,047,800	
	セコム	6,200	8,080.00	50,096,000	
	小計 銘柄数：272			9,771,216,590	
	組入時価比率：98.6%			100.0%	
	合計			9,771,216,590	

(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(2021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。