



2021年10月期 (2021年4月8日～2021年10月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2021 (April 8, 2021 – October 7, 2021)

2021年11月17日
 November 17, 2021

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, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2021年12月27日
 分配金支払開始日 2021年11月15日
 Scheduled date of submission of securities report: December 27, 2021
 Date of commencing dividend payment: November 15, 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8日～2021年10月7日)

Management Status for Year ended October 2021 (from April 8, 2021 to October 7, 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	1,146,727	(97.4)	30,088	(2.6)	1,176,816	(100.0)
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	1,165,742	(98.2)	20,788	(1.8)	1,186,530	(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	66,758	499	194	67,063
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	63,843	3,893	978	66,758

(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	1,217,624	40,807	1,176,816	17,548
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	1,214,253	27,723	1,186,530	17,773

(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	172
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	163

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15期 (2021年4月7日現在) 15th Fiscal Year As of April 7, 2021	第16期 (2021年10月7日現在) 16th Fiscal Year As of October 7, 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	36,654,568,830	45,816,384,238
株式 Stocks	1,165,742,046,540	1,146,727,567,830
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	437,447,070	-
未収入金 Accounts receivable - other	435,052,000	11,495,745,500
未収配当金 Accrued dividends receivable	10,138,297,534	10,424,991,647
未収利息 Accrued interest	1,771,499	2,619,825
その他未収収益 Other accrued revenue	63,295,328	33,336,199
差入委託証拠金 Margin deposits	780,962,890	3,123,362,106
流動資産合計 Total current assets	1,214,253,441,691	1,217,624,007,345
資産合計 Total assets	1,214,253,441,691	1,217,624,007,345
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	72,410,490	1,665,669,636
未払収益分配金 Unpaid dividends	10,881,705,916	11,534,890,008
未払受託者報酬 Trustee fees payable	264,865,106	289,924,316
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	796,743,253	871,446,893
未払利息 Accrued interest expenses	14,531	19,569
有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities lent	15,583,007,848	26,081,742,090
その他未払費用	124,498,935	364,003,625

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	27,723,246,079	40,807,696,137
負債合計 Total liabilities	27,723,246,079	40,807,696,137
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	776,139,343,432	779,678,088,564
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	410,390,852,180	397,138,222,644
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	5,403,102	27,627,894
元本等合計 Total principal and other	1,186,530,195,612	1,176,816,311,208
純資産合計 Total net assets	1,186,530,195,612	1,176,816,311,208
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	1,214,253,441,691	1,217,624,007,345

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第15期 自 2020年10月8日 至 2021年4月7日 15th Fiscal Year From October 8, 2020 to April 7, 2021	第16期 自 2021年4月8日 至 2021年10月7日 16th Fiscal Year From April 8, 2021 to October 7, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	11,975,272,039	12,887,071,302
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	185,729,967,332	△14,956,046,809
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	3,727,021,442	△431,895,326
その他収益 Other revenue	206,994,287	120,545,493
営業収益合計 Total operating revenue	201,639,255,100	△2,380,325,340
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△6,785,422	△5,113,068
受託者報酬 Trustee fees	264,865,106	289,924,316
委託者報酬 Investment trust management fees	796,743,253	871,446,893

その他費用 Other expenses	293,241,638	294,243,854
営業費用合計 Total operating expenses	1,348,064,575	1,450,501,995
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	200,291,190,525	△3,830,827,335
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	200,291,190,525	△3,830,827,335
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	200,291,190,525	△3,830,827,335
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	206,505,425,560	410,390,852,180
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	18,797,189,773	3,266,205,567
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	18,797,189,773	3,266,205,567
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	4,321,247,762	1,153,117,760
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	4,321,247,762	1,153,117,760
分配金 Dividends	10,881,705,916	11,534,890,008
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	410,390,852,180	397,138,222,644

(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8日から2021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15期 2021年4月7日現在	第16期 2021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 66,758,932 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 67,063,314 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 17,773 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 17,548 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 14,802,079,080 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 24,780,907,160 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自2020年10月8日 至2021年4月7日	第16期 自2021年4月8日 至2021年10月7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>12,189,051,748 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>52,907,267 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>12,241,959,015 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,354,849,997 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>10,887,109,018 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>10,881,705,916 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>5,403,102 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>66,758,932 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>163 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	12,189,051,748 円	分配準備積立金	B	52,907,267 円	配当等収益合計額	C=A+B	12,241,959,015 円	経費	D	1,354,849,997 円	収益分配可能額	E=C-D	10,887,109,018 円	収益分配金	F	10,881,705,916 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,403,102 円	口数	H	66,758,932 口	1口当たり分配金	I=F/H	163 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>13,012,729,863 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>5,403,102 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>13,018,132,965 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,455,615,063 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>11,562,517,902 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>11,534,890,008 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>27,627,894 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>67,063,314 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>172 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	13,012,729,863 円	分配準備積立金	B	5,403,102 円	配当等収益合計額	C=A+B	13,018,132,965 円	経費	D	1,455,615,063 円	収益分配可能額	E=C-D	11,562,517,902 円	収益分配金	F	11,534,890,008 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,627,894 円	口数	H	67,063,314 口	1口当たり分配金	I=F/H	172 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	12,189,051,748 円																																																											
分配準備積立金	B	52,907,267 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	12,241,959,015 円																																																											
経費	D	1,354,849,997 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	10,887,109,018 円																																																											
収益分配金	F	10,881,705,916 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,403,102 円																																																											
口数	H	66,758,932 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	163 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	13,012,729,863 円																																																											
分配準備積立金	B	5,403,102 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	13,018,132,965 円																																																											
経費	D	1,455,615,063 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	11,562,517,902 円																																																											
収益分配金	F	11,534,890,008 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,627,894 円																																																											
口数	H	67,063,314 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	172 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち217,860,453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236,869,127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15期 自2020年10月8日 至2021年4月7日	第16期 自2021年4月8日 至2021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
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。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

<p>○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。</p> <p>○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。</p> <p>○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>	
---	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第15期 2021年4月7日現在	第16期 2021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。</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15期 自2020年10月8日 至2021年4月7日	第16期 自2021年4月8日 至2021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15期 自2020年10月8日 至2021年4月7日	第16期 自2021年4月8日 至2021年10月7日
期首元本額 742,242,322,060円	期首元本額 776,139,343,432円
期中追加設定元本額 45,269,900,100円	期中追加設定元本額 5,802,443,592円
期中一部交換元本額 11,372,878,728円	期中一部交換元本額 2,263,698,460円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第15期 自2020年10月8日 至2021年4月7日	第16期 自2021年4月8日 至2021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	179,929,759,692	△12,136,664,154
合計	179,929,759,692	△12,136,664,154

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15期(2021年4月7日現在)	第16期(2021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	20,310,175,890	—	20,677,140,000	365,036,580	31,675,925,106	—	30,013,074,000	△1,665,669,636
合計	20,310,175,890	—	20,677,140,000	365,036,580	31,675,925,106	—	30,013,074,000	△1,665,669,636

(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	749,100	627.00	469,685,700	
		I N P E X	3,236,300	895.00	2,896,488,500	貸付有価証券 349,300株
		ミライト・ホールディングス	279,700	2,127.00	594,921,900	貸付有価証券 1,500株
		安藤・間	517,300	795.00	411,253,500	貸付有価証券 135,000株
		東急建設	236,300	796.00	188,094,800	貸付有価証券 4,500株
		コムシスホールディングス	286,000	2,856.00	816,816,000	貸付有価証券 400株
		東建コーポレーション	24,800	9,430.00	233,864,000	
		大成建設	579,800	3,620.00	2,098,876,000	貸付有価証券 300株
		大林組	1,862,900	951.00	1,771,617,900	
		清水建設	1,745,100	856.00	1,493,805,600	
		長谷工コーポレーション	610,200	1,461.00	891,502,200	貸付有価証券 2,000株
		鹿島建設	1,365,000	1,446.00	1,973,790,000	貸付有価証券 43,900株
		西松建設	133,300	3,485.00	464,550,500	貸付有価証券 82,200株 (23,200株)
三井住友建設	450,000	511.00	229,950,000	貸付有価証券 600株		

戸田建設	773,600	757.00	585,615,200	
熊谷組	86,300	2,856.00	246,472,800	
大東建託	203,400	12,840.00	2,611,656,000	貸付有価証券 4,100株
N I P P O	154,100	4,040.00	622,564,000	
五洋建設	791,200	774.00	612,388,800	貸付有価証券 3,500株
住友林業	476,600	2,029.00	967,021,400	貸付有価証券 158,100株
大和ハウス工業	1,720,200	3,621.00	6,228,844,200	貸付有価証券 9,400株
積水ハウス	2,020,400	2,303.50	4,653,991,400	貸付有価証券 4,100株
関電工	302,900	920.00	278,668,000	貸付有価証券 600株
エクシオグループ	282,500	2,660.00	751,450,000	
九電工	130,700	3,615.00	472,480,500	
インフロニア・ホールディングス	717,800	926.00	664,682,800	
森永製菓	139,900	4,085.00	571,491,500	貸付有価証券 1,400株
カルビー	271,700	2,715.00	737,665,500	
森永乳業	110,300	6,560.00	723,568,000	
ヤクルト本社	410,100	5,700.00	2,337,570,000	
明治ホールディングス	394,200	7,210.00	2,842,182,000	
プリマハム	83,900	2,766.00	232,067,400	貸付有価証券 1,200株
日本ハム	227,900	4,040.00	920,716,000	貸付有価証券 7,200株
アサヒグループホールディングス	1,402,600	5,595.00	7,847,547,000	貸付有価証券 88,800株
キリンホールディングス	2,191,400	2,108.50	4,620,566,900	貸付有価証券 309,300株
サントリー食品インターナショナル	398,900	4,645.00	1,852,890,500	貸付有価証券 16,600株
伊藤園	181,000	7,210.00	1,305,010,000	貸付有価証券 16,500株
キッコーマン	429,100	8,620.00	3,698,842,000	貸付有価証券 100株
味の素	1,417,900	3,222.00	4,568,473,800	
キューピー	332,000	2,539.00	842,948,000	貸付有価証券 2,700株
カゴメ	226,200	2,871.00	649,420,200	貸付有価証券 11,400株
アリアケジャパン	54,500	6,930.00	377,685,000	

ニチレイ	284,000	2,919.00	828,996,000	
東洋水産	306,700	4,875.00	1,495,162,500	貸付有価証券 3,700株
日清食品ホールディングス	233,900	8,830.00	2,065,337,000	貸付有価証券 100株
日本たばこ産業	3,196,700	2,181.00	6,972,002,700	貸付有価証券 714,800株
帝人	547,600	1,524.00	834,542,400	貸付有価証券 13,000株
東レ	4,212,400	707.40	2,979,851,760	
ゴールドウイン	96,300	6,610.00	636,543,000	
王子ホールディングス	2,619,100	553.00	1,448,362,300	
大王製紙	280,500	2,024.00	567,732,000	貸付有価証券 300株
レンゴー	599,900	869.00	521,313,100	貸付有価証券 19,900株
クラレ	850,800	1,036.00	881,428,800	貸付有価証券 5,900株
旭化成	3,856,200	1,136.00	4,380,643,200	
昭和電工	504,500	2,598.00	1,310,691,000	貸付有価証券 73,700株
住友化学	4,579,600	552.00	2,527,939,200	貸付有価証券 205,600株
日産化学	316,500	6,100.00	1,930,650,000	
東ソー	899,300	1,960.00	1,762,628,000	
トクヤマ	172,800	2,123.00	366,854,400	
デンカ	212,300	3,720.00	789,756,000	
信越化学工業	926,300	18,375.00	17,020,762,500	
エア・ウォーター	593,200	1,671.00	991,237,200	
日本酸素ホールディングス	479,200	2,650.00	1,269,880,000	貸付有価証券 200株
三菱瓦斯化学	582,900	2,144.00	1,249,737,600	
三井化学	502,200	3,525.00	1,770,255,000	貸付有価証券 600株
三菱ケミカルホールディングス	3,889,200	949.90	3,694,351,080	貸付有価証券 108,800株
ダイセル	782,200	858.00	671,127,600	貸付有価証券 4,400株
積水化学工業	1,217,400	1,789.00	2,177,928,600	貸付有価証券 9,300株
日本ゼオン	524,700	1,466.00	769,210,200	
アイカ工業	162,100	3,535.00	573,023,500	貸付有価証券 200株
宇部興産	293,800	2,182.00	641,071,600	貸付有価証券

				4,200株
日油	219,100	6,000.00	1,314,600,000	貸付有価証券 200株
花王	1,314,000	6,640.00	8,724,960,000	貸付有価証券 75,900株
日本ペイントホールディングス	2,185,900	1,171.00	2,559,688,900	貸付有価証券 185,600株
関西ペイント	653,600	2,660.00	1,738,576,000	貸付有価証券 12,100株
D I C	245,700	3,025.00	743,242,500	貸付有価証券 700株
富士フイルムホールディングス	1,044,000	8,572.00	8,949,168,000	
資生堂	1,106,600	7,814.00	8,646,972,400	貸付有価証券 30,200株
ライオン	717,100	1,872.00	1,342,411,200	貸付有価証券 200株
ファンケル	216,400	3,730.00	807,172,000	貸付有価証券 900株
コーセー	111,700	13,700.00	1,530,290,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	253,600	2,527.00	640,847,200	貸付有価証券 7,100株
小林製薬	166,500	8,720.00	1,451,880,000	貸付有価証券 100株
日東電工	359,100	7,420.00	2,664,522,000	
エフピコ	109,200	3,925.00	428,610,000	貸付有価証券 500株
ニフコ	218,100	3,385.00	738,268,500	
ユニ・チャーム	1,145,000	4,697.00	5,378,065,000	貸付有価証券 30,300株
協和キリン	697,100	3,685.00	2,568,813,500	貸付有価証券 4,400株
武田薬品工業	4,627,500	3,221.00	14,905,177,500	
アステラス製薬	5,150,400	1,931.50	9,947,997,600	
大日本住友製薬	440,300	1,835.00	807,950,500	貸付有価証券 1,900株
塩野義製薬	747,000	7,291.00	5,446,377,000	貸付有価証券 10,700株
日本新薬	168,400	8,630.00	1,453,292,000	貸付有価証券 100株
中外製薬	1,858,000	3,878.00	7,205,324,000	貸付有価証券 69,900株
科研製薬	101,700	4,495.00	457,141,500	貸付有価証券 1,600株
エーザイ	656,300	8,034.00	5,272,714,200	
ロート製薬	283,100	3,355.00	949,800,500	

小野薬品工業	1,364,200	2,390.50	3,261,120,100	貸付有価証券 400株
参天製薬	1,033,800	1,506.00	1,556,902,800	
JCRファーマ	167,400	2,902.00	485,794,800	貸付有価証券 800株
東和薬品	85,500	3,170.00	271,035,000	
第一三共	4,668,100	2,890.00	13,490,809,000	
大塚ホールディングス	1,234,600	4,764.00	5,881,634,400	貸付有価証券 41,600株
ペプチドリーム	311,700	2,949.00	919,203,300	貸付有価証券 76,000株
サワイグループホールディングス	130,100	5,080.00	660,908,000	
出光興産	659,200	3,035.00	2,000,672,000	貸付有価証券 31,000株
ENEOSホールディングス	8,936,200	450.60	4,026,651,720	貸付有価証券 642,200株
コスモエネルギーホールディングス	187,600	2,559.00	480,068,400	
横浜ゴム	344,000	1,967.00	676,648,000	貸付有価証券 1,000株
TOYO TIRE	312,600	1,882.00	588,313,200	貸付有価証券 400株
ブリヂストン	1,711,100	5,130.00	8,777,943,000	貸付有価証券 244,100株
住友ゴム工業	533,600	1,401.00	747,573,600	貸付有価証券 23,900株
AGC	545,300	5,530.00	3,015,509,000	貸付有価証券 5,400株
太平洋セメント	337,500	2,349.00	792,787,500	
東海カーボン	497,800	1,368.00	680,990,400	貸付有価証券 2,700株
TOTO	424,300	5,170.00	2,193,631,000	
日本碍子	653,700	1,814.00	1,185,811,800	
日本特殊陶業	451,900	1,683.00	760,547,700	貸付有価証券 35,200株
ニチアス	150,100	2,542.00	381,554,200	
三井金属鉱業	158,500	3,080.00	488,180,000	
住友金属鉱山	750,900	3,974.00	2,984,076,600	
住友電気工業	2,049,900	1,461.50	2,995,928,850	
アサヒホールディングス	220,500	2,021.00	445,630,500	貸付有価証券 22,800株
SUMCO	749,200	2,111.00	1,581,561,200	貸付有価証券 468,100株 (24,600株)

三和ホールディングス	553,800	1,351.00	748,183,800	貸付有価証券 2,000株
リンナイ	114,200	11,490.00	1,312,158,000	貸付有価証券 400株
日本製鋼所	178,300	2,889.00	515,108,700	
三浦工業	254,200	4,190.00	1,065,098,000	貸付有価証券 600株
アマダ	861,000	1,107.00	953,127,000	
F U J I	234,500	2,619.00	614,155,500	貸付有価証券 100株
オーエスジー	271,700	1,815.00	493,135,500	貸付有価証券 1,600株
DMG 森精機	348,400	1,884.00	656,385,600	貸付有価証券 9,000株
ディスコ	79,900	29,290.00	2,340,271,000	貸付有価証券 2,800株
オプトラン	73,600	2,197.00	161,699,200	貸付有価証券 400株
ナブテスコ	334,900	3,925.00	1,314,482,500	
SMC	173,900	62,610.00	10,887,879,000	
小松製作所	2,691,400	2,636.50	7,095,876,100	
住友重機械工業	340,000	2,840.00	965,600,000	
日立建機	277,700	3,085.00	856,704,500	
クボタ	2,897,600	2,266.00	6,565,961,600	貸付有価証券 235,700株
荏原製作所	246,600	5,750.00	1,417,950,000	
ダイキン工業	756,800	23,575.00	17,841,560,000	貸付有価証券 1,800株
ダイフク	326,900	9,770.00	3,193,813,000	
竹内製作所	99,400	2,509.00	249,394,600	貸付有価証券 600株
ホシザキ	173,600	9,680.00	1,680,448,000	貸付有価証券 1,900株
日本精工	1,220,000	763.00	930,860,000	貸付有価証券 1,100株
マキタ	774,600	5,500.00	4,260,300,000	
三菱重工業	933,300	2,932.50	2,736,902,250	
I H I	399,400	2,670.00	1,066,398,000	貸付有価証券 300株
ブラザー工業	725,400	2,350.00	1,704,690,000	貸付有価証券 100株
ミネベアミツミ	1,023,900	2,591.00	2,652,924,900	貸付有価証券 100株
日立製作所	2,705,600	6,273.00	16,972,228,800	貸付有価証券 30,200株

三菱電機	5,940,000	1,493.50	8,871,390,000	
富士電機	357,900	4,720.00	1,689,288,000	貸付有価証券 500株
安川電機	639,400	5,130.00	3,280,122,000	貸付有価証券 41,300株
日本電産	1,336,700	11,530.00	15,412,151,000	貸付有価証券 3,700株
オムロン	494,500	10,040.00	4,964,780,000	
MC J	187,700	1,213.00	227,680,100	貸付有価証券 4,400株
日本電気	754,800	5,830.00	4,400,484,000	貸付有価証券 19,600株
富士通	534,500	19,180.00	10,251,710,000	
ルネサスエレクトロニクス	3,214,100	1,299.00	4,175,115,900	貸付有価証券 9,100株
セイコーエプソン	737,000	2,126.00	1,566,862,000	貸付有価証券 1,800株
ワコム	430,000	685.00	294,550,000	貸付有価証券 290,900株
アルバック	109,200	5,940.00	648,648,000	
エレコム	136,100	1,717.00	233,683,700	貸付有価証券 7,900株 (7,800株)
パナソニック	6,334,900	1,256.50	7,959,801,850	貸付有価証券 24,000株
アンリツ	357,100	1,984.00	708,486,400	貸付有価証券 241,600株
ソニーグループ	1,591,300	11,695.00	18,610,253,500	
TDK	860,400	3,635.00	3,127,554,000	貸付有価証券 300株
横河電機	594,500	1,940.00	1,153,330,000	
アズビル	401,700	4,410.00	1,771,497,000	貸付有価証券 400株
日本光電工業	245,500	3,615.00	887,482,500	
堀場製作所	109,800	7,310.00	802,638,000	貸付有価証券 24,100株
アドバンテスト	441,700	9,090.00	4,015,053,000	
キーエンス	306,900	62,230.00	19,098,387,000	貸付有価証券 200株
シスメックス	463,600	13,200.00	6,119,520,000	
レーザーテック	260,800	23,660.00	6,170,528,000	貸付有価証券 4,200株
スタンレー電気	415,700	2,672.00	1,110,750,400	貸付有価証券 9,900株
カシオ計算機	477,700	1,623.00	775,307,100	貸付有価証券 23,400株

ファンック	521,300	22,425.00	11,690,152,500	
浜松ホトニクス	426,100	6,380.00	2,718,518,000	
京セラ	905,400	6,576.00	5,953,910,400	
太陽誘電	264,200	6,150.00	1,624,830,000	
村田製作所	1,744,900	8,505.00	14,840,374,500	貸付有価証券 140,800株(64,100 株)
小糸製作所	355,800	6,320.00	2,248,656,000	貸付有価証券 2,300株
S C R E E Nホールディ ングス	103,000	9,010.00	928,030,000	
東京エレクトロン	347,900	45,890.00	15,965,131,000	
トヨタ紡織	173,100	1,914.00	331,313,400	
豊田自動織機	480,700	8,620.00	4,143,634,000	
デンソー	1,307,900	7,196.00	9,411,648,400	貸付有価証券 13,600株
いすゞ自動車	1,577,200	1,469.00	2,316,906,800	
トヨタ自動車	8,861,800	1,869.00	16,562,704,200	貸付有価証券 100株
日野自動車	741,800	1,088.00	807,078,400	貸付有価証券 200株
アイシン	434,800	3,970.00	1,726,156,000	貸付有価証券 1,200株
本田技研工業	4,677,100	3,332.00	15,584,097,200	貸付有価証券 3,300株
スズキ	1,177,500	4,708.00	5,543,670,000	貸付有価証券 7,400株
S U B A R U	1,702,300	2,042.50	3,476,947,750	
ヤマハ発動機	775,100	3,030.00	2,348,553,000	貸付有価証券 600株
豊田合成	191,800	2,164.00	415,055,200	
シマノ	239,400	29,905.00	7,159,257,000	貸付有価証券 14,700株
テイ・エス テック	275,900	1,431.00	394,812,900	貸付有価証券 1,200株
テルモ	1,821,000	4,890.00	8,904,690,000	貸付有価証券 100株
島津製作所	764,400	4,525.00	3,458,910,000	
ブイ・テクノロジー	27,800	4,240.00	117,872,000	
東京精密	100,300	4,170.00	418,251,000	
オリンパス	3,115,100	2,307.00	7,186,535,700	
H O Y A	1,159,100	16,325.00	18,922,307,500	
朝日インテック	651,200	2,780.00	1,810,336,000	貸付有価証券 26,200株

バンダイナムコホールディングス	491,300	7,910.00	3,886,183,000	
パイロットコーポレーション	100,300	4,115.00	412,734,500	貸付有価証券 1,200株
ヤマハ	353,300	6,660.00	2,352,978,000	
ピジョン	359,000	2,680.00	962,120,000	貸付有価証券 177,500株
任天堂	266,300	50,150.00	13,354,945,000	
中部電力	1,817,300	1,315.00	2,389,749,500	貸付有価証券 200株
関西電力	2,250,700	1,112.50	2,503,903,750	貸付有価証券 121,300株
中国電力	856,800	1,019.00	873,079,200	貸付有価証券 10,400株
東北電力	1,391,200	810.00	1,126,872,000	貸付有価証券 73,000株
九州電力	1,311,800	856.00	1,122,900,800	貸付有価証券 112,200株
北海道電力	555,900	545.00	302,965,500	
電源開発	472,600	1,636.00	773,173,600	貸付有価証券 7,600株
イーレックス	87,300	2,486.00	217,027,800	貸付有価証券 59,000株 (26,300株)
レノバ	101,400	4,400.00	446,160,000	貸付有価証券 1,600株
東京瓦斯	1,138,600	2,032.00	2,313,635,200	
大阪瓦斯	1,075,900	2,011.00	2,163,634,900	貸付有価証券 500株
東海旅客鉄道	493,900	16,845.00	8,319,745,500	
阪急阪神ホールディングス	750,300	3,350.00	2,513,505,000	
日本通運	194,800	7,430.00	1,447,364,000	
ヤマトホールディングス	788,300	2,716.00	2,141,022,800	
山九	144,300	5,080.00	733,044,000	
センコーグループホールディングス	310,300	1,003.00	311,230,900	貸付有価証券 5,200株
日立物流	116,000	4,685.00	543,460,000	貸付有価証券 300株
丸和運輸機関	118,800	1,538.00	182,714,400	貸付有価証券 24,500株
九州旅客鉄道	435,200	2,583.00	1,124,121,600	
S Gホールディングス	1,063,000	2,910.00	3,093,330,000	貸付有価証券 3,600株
日本郵船	470,400	7,750.00	3,645,600,000	

商船三井	333,700	7,090.00	2,365,933,000	貸付有価証券 300株
近鉄エクスプレス	106,200	2,696.00	286,315,200	
NEC ネットエスアイ	192,800	2,009.00	387,335,200	
システナ	207,900	2,030.00	422,037,000	
日鉄ソリューションズ	84,400	3,600.00	303,840,000	
T I S	582,900	2,882.00	1,679,917,800	
コーエーテクモホールディングス	155,000	4,920.00	762,600,000	貸付有価証券 6,500株
ネクソン	1,313,000	1,709.00	2,243,917,000	
ティーガイア	62,000	1,983.00	122,946,000	貸付有価証券 3,800株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	158,000	2,011.00	317,738,000	貸付有価証券 66,200株
GMOペイメントゲートウェイ	113,000	13,520.00	1,527,760,000	貸付有価証券 600株
ラクス	233,900	3,395.00	794,090,500	貸付有価証券 21,700株
アカツキ	23,300	3,110.00	72,463,000	
野村総合研究所	1,012,500	3,945.00	3,994,312,500	
インフォコム	53,100	2,263.00	120,165,300	貸付有価証券 4,600株
オービック	183,700	20,670.00	3,797,079,000	
ジャストシステム	82,900	5,650.00	468,385,000	貸付有価証券 700株
Zホールディングス	8,009,000	690.60	5,531,015,400	貸付有価証券 209,300株
トレンドマイクロ	311,400	5,940.00	1,849,716,000	貸付有価証券 900株
日本オラクル	118,300	9,700.00	1,147,510,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	265,600	3,395.00	901,712,000	
大塚商会	315,400	5,430.00	1,712,622,000	
電通国際情報サービス	84,100	3,880.00	326,308,000	
東映アニメーション	23,200	19,980.00	463,536,000	貸付有価証券 15,700株 (1,600株)
デジタルガレージ	96,300	4,750.00	457,425,000	
日本ユニシス	202,200	2,893.00	584,964,600	
USEN-NEXT HOLDINGS	55,400	3,215.00	178,111,000	
日本電信電話	5,945,800	3,109.00	18,485,492,200	貸付有価証券 3,100株
KDDI	4,674,500	3,616.00	16,902,992,000	貸付有価証券 6,600株

光通信	68,700	17,810.00	1,223,547,000	
東宝	343,900	5,100.00	1,753,890,000	貸付有価証券 900株
エヌ・ティ・ティ・データ	1,551,900	2,058.00	3,193,810,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	248,600	5,820.00	1,446,852,000	貸付有価証券 700株
カブコン	499,600	2,900.00	1,448,840,000	貸付有価証券 2,600株
S C S K	403,500	2,242.00	904,647,000	
コナミホールディングス	211,700	6,120.00	1,295,604,000	貸付有価証券 600株
ソフトバンクグループ	2,213,500	5,949.00	13,168,111,500	貸付有価証券 4,600株
双日	646,340	1,880.00	1,215,119,200	貸付有価証券 82,600株
アルフレッサ ホールディングス	606,800	1,638.00	993,938,400	
神戸物産	454,100	3,600.00	1,634,760,000	貸付有価証券 287,200株
ダイワボウホールディングス	266,600	1,848.00	492,676,800	貸付有価証券 19,400株
T O K A I ホールディングス	283,400	877.00	248,541,800	
シップヘルスケアホールディングス	206,300	2,806.00	578,877,800	貸付有価証券 7,700株
コメダホールディングス	127,600	2,056.00	262,345,600	
メディパルホールディングス	586,300	2,077.00	1,217,745,100	貸付有価証券 1,500株
日本ライフライン	189,000	1,299.00	245,511,000	
伊藤忠商事	4,092,100	3,182.00	13,021,062,200	
丸紅	5,769,200	916.20	5,285,741,040	
豊田通商	587,700	4,530.00	2,662,281,000	
兼松	233,800	1,336.00	312,356,800	
三井物産	4,542,800	2,457.00	11,161,659,600	
住友商事	3,692,200	1,565.50	5,780,139,100	
三菱商事	3,562,100	3,480.00	12,396,108,000	
岩谷産業	140,400	6,530.00	916,812,000	
P A L T A C	93,800	5,080.00	476,504,000	貸付有価証券 1,000株
日鉄物産	41,700	4,860.00	202,662,000	
ミスミグループ本社	734,100	4,425.00	3,248,392,500	
ローソン	148,000	5,420.00	802,160,000	貸付有価証券 1,800株

エービーシー・マート	91,300	6,070.00	554,191,000	貸付有価証券 1,500株
日本マクドナルドホールディングス	269,700	5,110.00	1,378,167,000	貸付有価証券 155,100株
セリア	139,900	3,950.00	552,605,000	貸付有価証券 10,000株
ビックカメラ	347,000	1,035.00	359,145,000	貸付有価証券 66,900株 (11,100株)
Monotaro	739,600	2,429.00	1,796,488,400	貸付有価証券 79,100株
マツキヨココカラ&カンパニー	241,800	5,470.00	1,322,646,000	
ZOZO	344,900	3,965.00	1,367,528,500	
ウエルシアホールディングス	309,300	4,120.00	1,274,316,000	貸付有価証券 2,300株
クリエイティブSDホールディングス	86,300	3,670.00	316,721,000	貸付有価証券 7,400株 (2,300株)
コスモス薬品	59,000	18,780.00	1,108,020,000	貸付有価証券 3,400株
セブン&アイ・ホールディングス	2,288,800	4,801.00	10,988,528,800	貸付有価証券 99,000株
ツルハホールディングス	127,600	13,780.00	1,758,328,000	貸付有価証券 700株
クスリのアオキホールディングス	58,200	7,450.00	433,590,000	貸付有価証券 12,000株 (1,400株)
FOOD & LIFE COMPANIE	342,500	4,795.00	1,642,287,500	貸付有価証券 1,200株
ノジマ	104,100	2,788.00	290,230,800	貸付有価証券 1,200株
良品計画	673,200	2,244.00	1,510,660,800	貸付有価証券 2,900株
コーナン商事	83,200	3,630.00	302,016,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,169,800	2,388.00	2,793,482,400	
ゼンショーホールディングス	314,200	2,566.00	806,237,200	貸付有価証券 32,300株
ワークマン	75,500	6,160.00	465,080,000	貸付有価証券 51,000株
スギホールディングス	116,800	8,020.00	936,736,000	貸付有価証券 2,500株
ライフコーポレーション	54,700	4,045.00	221,261,500	
丸井グループ	495,000	2,136.00	1,057,320,000	
イズミ	119,000	3,605.00	428,995,000	貸付有価証券 11,400株
ヤオコー	66,400	6,580.00	436,912,000	貸付有価証券 17,700株
ケーズホールディングス	498,000	1,196.00	595,608,000	貸付有価証券

				1,700株
アインホールディングス	84,900	6,360.00	539,964,000	貸付有価証券 4,400株
ニトリホールディングス	232,200	20,805.00	4,830,921,000	貸付有価証券 15,600株
ファーストリテイリング	78,300	71,470.00	5,596,101,000	貸付有価証券 5,100株
サンドラッグ	220,100	3,445.00	758,244,500	
めぶきフィナンシャルグループ	3,044,300	248.00	754,986,400	貸付有価証券 100株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3,569,400	460.00	1,641,924,000	貸付有価証券 25,700株
新生銀行	477,700	1,903.00	909,063,100	貸付有価証券 124,800株 (31,900株)
あおぞら銀行	349,100	2,718.00	948,853,800	貸付有価証券 41,000株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	28,678,800	650.80	18,664,163,040	貸付有価証券 86,400株
りそなホールディングス	6,524,400	454.10	2,962,730,040	貸付有価証券 13,800株
三井住友トラスト・ホールディングス	1,107,400	3,859.00	4,273,456,600	貸付有価証券 3,000株
三井住友フィナンシャルグループ	4,054,500	3,904.00	15,828,768,000	貸付有価証券 176,700株
千葉銀行	1,955,200	744.00	1,454,668,800	貸付有価証券 500株
ふくおかフィナンシャルグループ	528,800	2,144.00	1,133,747,200	貸付有価証券 600株
セブン銀行	1,957,500	254.00	497,205,000	貸付有価証券 15,300株
みずほフィナンシャルグループ	7,961,200	1,565.50	12,463,258,600	貸付有価証券 192,600株
FPG	197,100	677.00	133,436,700	貸付有価証券 15,600株
GMOフィナンシャルホールディングス	108,700	846.00	91,960,200	貸付有価証券 2,000株
SBIホールディングス	722,200	2,719.00	1,963,661,800	
ジャフコグループ	74,600	6,980.00	520,708,000	貸付有価証券 700株 (700株)
大和証券グループ本社	4,387,700	656.10	2,878,769,970	貸付有価証券 37,700株
野村ホールディングス	8,945,300	548.10	4,902,918,930	貸付有価証券 244,200株
SOMPOホールディングス	1,032,800	4,936.00	5,097,900,800	貸付有価証券 46,700株
MS&ADインシュアランスグループホール	1,422,800	3,705.00	5,271,474,000	貸付有価証券 25,300株

第一生命ホールディングス	2,883,500	2,484.50	7,164,055,750	貸付有価証券 25,500株
東京海上ホールディングス	1,929,600	6,025.00	11,625,840,000	貸付有価証券 4,700株
T&Dホールディングス	1,751,100	1,560.00	2,731,716,000	
全国保証	152,400	5,150.00	784,860,000	貸付有価証券 89,800株
芙蓉総合リース	61,400	7,590.00	466,026,000	
みずほリース	90,400	3,500.00	316,400,000	貸付有価証券 24,100株
東京センチュリー	136,100	6,030.00	820,683,000	貸付有価証券 4,900株
イオンフィナンシャルサービス	358,500	1,492.00	534,882,000	貸付有価証券 8,900株
アコム	1,155,700	397.00	458,812,900	貸付有価証券 8,600株
オリエントコーポレーション	1,584,900	165.00	261,508,500	貸付有価証券 4,600株
オリックス	3,556,800	2,115.50	7,524,410,400	貸付有価証券 100株
三菱HCキャピタル	2,026,300	585.00	1,185,385,500	貸付有価証券 170,000株
日本取引所グループ	1,582,700	2,725.50	4,313,648,850	
いちご	652,400	351.00	228,992,400	貸付有価証券 800株
ヒューリック	1,242,900	1,125.00	1,398,262,500	貸付有価証券 524,400株
野村不動産ホールディングス	336,500	2,758.00	928,067,000	
サムティ	83,300	2,253.00	187,674,900	貸付有価証券 56,400株
プレサンスコーポレーション	96,400	1,776.00	171,206,400	貸付有価証券 800株
オープンハウス	186,000	6,270.00	1,166,220,000	貸付有価証券 300株
東急不動産ホールディングス	1,593,100	647.00	1,030,735,700	
飯田グループホールディングス	488,700	2,726.00	1,332,196,200	
三井不動産	2,670,200	2,528.00	6,750,265,600	貸付有価証券 300株
三菱地所	3,848,900	1,710.00	6,581,619,000	貸付有価証券 5,600株
東京建物	578,600	1,640.00	948,904,000	貸付有価証券 3,500株
住友不動産	1,317,000	3,958.00	5,212,686,000	貸付有価証券 16,300株
スターツコーポレーショ	69,700	2,635.00	183,659,500	

ン				
日本エスコン	109,100	789.00	86,079,900	貸付有価証券 1,200株
イオンモール	293,800	1,615.00	474,487,000	貸付有価証券 21,500株
カチタス	145,100	3,860.00	560,086,000	
ミクシィ	144,300	2,510.00	362,193,000	貸付有価証券 600株
日本M&Aセンターホールディングス	931,000	3,125.00	2,909,375,000	
UTグループ	81,900	3,205.00	262,489,500	貸付有価証券 35,000株 (100株)
エス・エム・エス	192,800	3,910.00	753,848,000	貸付有価証券 8,300株
パーソルホールディングス	567,500	2,822.00	1,601,485,000	貸付有価証券 2,400株
総合警備保障	225,800	4,855.00	1,096,259,000	
カカクコム	419,300	3,745.00	1,570,278,500	
ディップ	88,700	4,115.00	365,000,500	貸付有価証券 19,000株
ベネフィット・ワン	206,500	5,150.00	1,063,475,000	貸付有価証券 12,500株
エムスリー	1,001,500	7,260.00	7,270,890,000	貸付有価証券 400株
アウトソーシング	325,100	1,845.00	599,809,500	貸付有価証券 21,600株
博報堂DYホールディングス	790,000	1,810.00	1,429,900,000	貸付有価証券 2,600株
オリエンタルランド	603,700	17,360.00	10,480,232,000	貸付有価証券 21,200株
ユー・エス・エス	635,500	1,774.00	1,127,377,000	貸付有価証券 2,700株
フルキャストホールディングス	48,400	2,471.00	119,596,400	貸付有価証券 600株
エン・ジャパン	100,900	4,125.00	416,212,500	貸付有価証券 400株
テクノプロ・ホールディングス	339,900	3,285.00	1,116,571,500	貸付有価証券 41,700株
アイ・アールジャパンホールディングス	23,000	11,480.00	264,040,000	貸付有価証券 2,300株
ジャパンマテリアル	174,500	1,332.00	232,434,000	貸付有価証券 200株
リクルートホールディングス	3,146,200	6,688.00	21,041,785,600	貸付有価証券 10,200株
ベルシステム24ホールディングス	95,100	1,593.00	151,494,300	貸付有価証券 1,100株
バイカレント・コンサルティング	37,300	44,100.00	1,644,930,000	

	ジャパンエレベーターサービスホールディング	163,700	2,359.00	386,168,300	
	リログループ	310,300	2,294.00	711,828,200	貸付有価証券 101,900株
	カナモト	100,000	2,546.00	254,600,000	貸付有価証券 67,700株
	セコム	559,300	7,959.00	4,451,468,700	
	メイテック	68,600	6,050.00	415,030,000	貸付有価証券 100株
	イオンディライト	69,900	3,470.00	242,553,000	
小計	銘柄数：400 組入時価比率：97.4%			1,146,727,567,830 100.0%	
合計				1,146,727,567,830	

(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(2021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。