



2023年7月期 (2022年7月9日～2023年7月8日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2023 (July 9, 2022 - July 8, 2023)

2023年8月17日  
 August 17, 2023

上場取引所 東証  
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 日経225連動型上場投信  
 コード番号 (1321)  
 連動対象指標 日経平均株価(日経225)  
 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 Nikkei 225 Exchange Traded Fund  
 Code: 1321  
 Underlying index: Nikkei Stock Average(Nikkei 225)  
 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 2023年9月28日  
 分配金支払開始日 2023年8月16日  
 Scheduled date of submission of securities report: September 28, 2023  
 Date of commencing dividend payment: August 16, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2023年7月期の運用状況 (2022年7月9日～2023年7月8日)

Management Status for Year ended July 2023 (from July 9, 2022 to July 8, 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7月期 FY ended Jul. 2023	8,662,818	(98.4)	144,545	(1.6)	8,807,364	(100.0)
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	7,285,903	(98.8)	91,146	(1.2)	7,377,049	(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7月期 FY ended Jul. 2023	271,530	16,179	23,220	264,489
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	276,525	16,958	21,953	271,530

(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))	10口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×10) Net Asset Value per 10 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×10)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2023年7月期 FY ended Jul. 2023	9,295,947	488,582	8,807,364	332,995
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	7,577,131	200,082	7,377,049	271,684

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2023年7月期 FY ended Jul. 2023	5,760
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	4,970

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21期 (2022年7月8日現在) 21st Fiscal Year As of July 8, 2022	第22期 (2023年7月8日現在) 22nd Fiscal Year As of July 8, 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	259,822,860,895	612,887,326,637
株式 Stocks	7,285,903,128,320	8,662,818,839,840
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	437,823,575
未収入金 Accounts receivable - other	-	760,577,291
未収配当金 Accrued dividends receivable	8,828,927,100	9,443,705,850
未収利息 Accrued interest	1,036,072	32,908,438
その他未収収益 Other accrued revenue	179,475,268	217,549,013
差入委託証拠金 Margin deposits	22,396,432,501	9,348,381,773
流動資産合計 Total current assets	7,577,131,860,156	9,295,947,112,417
資産合計 Total assets	7,577,131,860,156	9,295,947,112,417
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	4,089,939,299	177,371,250
未払金 Accounts payable - other	6,483,770,641	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	134,950,590,908	152,345,875,392
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,858,450,639	1,370,666,781
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	5,586,083,967	3,809,989,677
未払利息 Accrued interest expenses	46,056	425,158
有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities	44,651,124,942	328,421,073,050

lent		
その他未払費用 Other accrued expenses	2,462,078,787	2,457,202,434
流動負債合計 Total current liabilities	200,082,085,239	488,582,603,742
負債合計 Total liabilities	200,082,085,239	488,582,603,742
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	3,341,724,189,748	3,255,070,639,669
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	4,035,325,585,169	5,552,293,869,006
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	154,469,862	289,781,470
元本等合計 Total principal and other	7,377,049,774,917	8,807,364,508,675
純資産合計 Total net assets	7,377,049,774,917	8,807,364,508,675
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	7,577,131,860,156	9,295,947,112,417

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第21期 自 2021年7月9日 至 2022年7月8日 21st Fiscal Year From July 9, 2021 to July 8, 2022	第22期 自 2022年7月9日 至 2023年7月8日 22nd Fiscal Year From July 9, 2022 to July 8, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	152,163,042,112	162,866,560,314
受取利息 Interest income	93,454	577,297
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△420,972,456,271	1,566,391,772,706
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△11,176,220,531	50,840,221,009
その他収益 Other revenue	1,049,375,486	3,697,805,930
営業収益合計 Total operating revenue	△278,936,165,750	1,783,796,937,256
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△80,398,011	40,969,954

受託者報酬 Trustee fees	3,861,907,284	2,931,193,088
委託者報酬 Investment trust management fees	11,665,528,866	8,356,140,980
その他費用 Other expenses	2,800,173,889	2,755,452,519
営業費用合計 Total operating expenses	18,247,212,028	14,083,756,541
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△297,183,377,778	1,769,713,180,715
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△297,183,377,778	1,769,713,180,715
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△297,183,377,778	1,769,713,180,715
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	4,568,624,040,998	4,035,325,585,169
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	273,675,962,052	284,271,625,145
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	273,675,962,052	284,271,625,145
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	374,840,449,195	384,670,646,631
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	374,840,449,195	384,670,646,631
分配金 Dividends	134,950,590,908	152,345,875,392
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	4,035,325,585,169	5,552,293,869,006

(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。

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7月9日から2023年7月8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21期 2022年7月8日現在	第22期 2023年7月8日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 271,530,364 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 264,489,367 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 27,168.4 円 (10口当たり純資産額) (271,684 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 33,299.5 円 (10口当たり純資産額) (332,995 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 43,223,100,520 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 303,486,395,230 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第21期 自 2021年7月9日 至 2022年7月8日	第22期 自 2022年7月9日 至 2023年7月8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;">153,292,909,063 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;">139,761,746 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;">153,432,670,809 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">18,327,610,039 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;">135,105,060,770 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">134,950,590,908 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;">154,469,862 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">271,530,364 口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H×10</td> <td style="text-align: right;">4,970 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	153,292,909,063 円	分配準備積立金	B	139,761,746 円	配当等収益合計額	C=A+B	153,432,670,809 円	経費	D	18,327,610,039 円	収益分配可能額	E=C-D	135,105,060,770 円	収益分配金	F	134,950,590,908 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	154,469,862 円	口数	H	271,530,364 口	10口当たり分配金	I=F/H×10	4,970 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;">166,523,973,587 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;">154,469,862 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;">166,678,443,449 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">14,042,786,587 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;">152,635,656,862 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">152,345,875,392 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;">289,781,470 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">264,489,367 口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H×10</td> <td style="text-align: right;">5,760 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	166,523,973,587 円	分配準備積立金	B	154,469,862 円	配当等収益合計額	C=A+B	166,678,443,449 円	経費	D	14,042,786,587 円	収益分配可能額	E=C-D	152,635,656,862 円	収益分配金	F	152,345,875,392 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	289,781,470 円	口数	H	264,489,367 口	10口当たり分配金	I=F/H×10	5,760 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	153,292,909,063 円																																																											
分配準備積立金	B	139,761,746 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	153,432,670,809 円																																																											
経費	D	18,327,610,039 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	135,105,060,770 円																																																											
収益分配金	F	134,950,590,908 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	154,469,862 円																																																											
口数	H	271,530,364 口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	4,970 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	166,523,973,587 円																																																											
分配準備積立金	B	154,469,862 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	166,678,443,449 円																																																											
経費	D	14,042,786,587 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	152,635,656,862 円																																																											
収益分配金	F	152,345,875,392 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	289,781,470 円																																																											
口数	H	264,489,367 口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	5,760 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち2,165,325,229 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2,129,543,297 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21期 自 2021年7月9日 至 2022年7月8日	第22期 自 2022年7月9日 至 2023年7月8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	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左

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。

#### ○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。

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

同左

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

第21期 2022年7月8日現在	第22期 2023年7月8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21期 自2021年7月9日 至2022年7月8日	第22期 自2022年7月9日 至2023年7月8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21期 自2021年7月9日 至2022年7月8日	第22期 自2022年7月9日 至2023年7月8日
期首元本額 3,403,196,608,653円	期首元本額 3,341,724,189,748円
期中追加設定元本額 208,703,952,050円	期中追加設定元本額 199,118,645,100円
期中一部交換元本額 270,176,370,955円	期中一部交換元本額 285,772,195,179円

### 2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第21期 自2021年7月9日 至2022年7月8日	第22期 自2022年7月9日 至2023年7月8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	△435,108,857,206	1,531,746,830,126
合計	△435,108,857,206	1,531,746,830,126

### 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21期(2022年7月8日現在)			第22期(2023年7月8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	93,817,190,159	—	89,728,920,000	△4,089,939,299	143,726,549,875	—	143,989,200,000	260,452,325
合計	93,817,190,159	—	89,728,920,000	△4,089,939,299	143,726,549,875	—	143,989,200,000	260,452,325

(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7月8日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	ニッセイ	9,064,000	643.00	5,828,152,000	貸付有価証券 7,500株
		INPEX	3,625,600	1,602.00	5,808,211,200	
		コムシスホールディングス	9,064,000	2,746.50	24,894,276,000	貸付有価証券 264,500株
		大成建設	1,812,800	5,014.00	9,089,379,200	貸付有価証券 200株
		大林組	9,064,000	1,225.50	11,107,932,000	
		清水建設	9,064,000	899.60	8,153,974,400	貸付有価証券 290,100株
		長谷工コーポレーション	1,812,800	1,762.50	3,195,060,000	貸付有価証券 118,700株
		鹿島建設	4,532,000	2,152.50	9,755,130,000	貸付有価証券 2,900株
		大和ハウス工業	9,064,000	3,697.00	33,509,608,000	貸付有価証券 1,278,200株(45,700株)
		積水ハウス	9,064,000	2,865.00	25,968,360,000	貸付有価証券 5,396,400株
		日揮ホールディングス	9,064,000	1,812.00	16,423,968,000	貸付有価証券



				2,176,500株 (2,176,500株)
日清製粉グループ本社	9,064,000	1,695.00	15,363,480,000	
明治ホールディングス	3,625,600	3,266.00	11,841,209,600	貸付有価証券 1,700株
日本ハム	4,532,000	3,916.00	17,747,312,000	
サッポロホールディングス	1,812,800	3,611.00	6,546,020,800	
アサヒグループホールディングス	9,064,000	5,558.00	50,377,712,000	
キリンホールディングス	9,064,000	2,085.00	18,898,440,000	
宝ホールディングス	9,064,000	1,137.00	10,305,768,000	貸付有価証券 24,600株
キッコーマン	9,064,000	7,966.00	72,203,824,000	貸付有価証券 178,800株
味の素	9,064,000	5,616.00	50,903,424,000	貸付有価証券 415,600株 (68,800株)
ニチレイ	4,532,000	3,052.00	13,831,664,000	貸付有価証券 126,000株
日本たばこ産業	9,064,000	3,096.00	28,062,144,000	
帝人	1,812,800	1,476.00	2,675,692,800	貸付有価証券 13,100株
東レ	9,064,000	798.40	7,236,697,600	
王子ホールディングス	9,064,000	517.40	4,689,713,600	貸付有価証券 646,100株 (498,000株)
日本製紙	906,400	1,184.00	1,073,177,600	貸付有価証券 16,500株 (3,300株)
クラレ	9,064,000	1,384.00	12,544,576,000	
旭化成	9,064,000	979.80	8,880,907,200	
レゾナック・ホールディングス	906,400	2,285.50	2,071,577,200	貸付有価証券 425,800株
住友化学	9,064,000	435.70	3,949,184,800	貸付有価証券 29,300株
日産化学	9,064,000	6,117.00	55,444,488,000	貸付有価証券 8,100株
東ソー	4,532,000	1,688.00	7,650,016,000	貸付有価証券 22,800株
トクヤマ	1,812,800	2,355.00	4,269,144,000	
デンカ	1,812,800	2,692.50	4,880,964,000	貸付有価証券 5,300株
信越化学工業	45,320,000	4,597.00	208,336,040,000	貸付有価証券 2,629,000株
三井化学	1,812,800	4,128.00	7,483,238,400	
三菱ケミカルグループ	4,532,000	851.10	3,857,185,200	貸付有価証券

				3,100株
UBE	906,400	2,495.50	2,261,921,200	貸付有価証券 700株
花王	9,064,000	5,358.00	48,564,912,000	貸付有価証券 18,900株
DIC	906,400	2,623.00	2,377,487,200	貸付有価証券 49,000株
富士フイルムホールディングス	9,064,000	8,298.00	75,213,072,000	
資生堂	9,064,000	6,290.00	57,012,560,000	貸付有価証券 260,900株
日東電工	9,064,000	10,040.00	91,002,560,000	貸付有価証券 16,100株 (16,100株)
協和キリン	9,064,000	2,624.50	23,788,468,000	貸付有価証券 375,400株
武田薬品工業	9,064,000	4,410.00	39,972,240,000	貸付有価証券 566,500株
アステラス製薬	45,320,000	2,061.00	93,404,520,000	貸付有価証券 3,129,100株
住友ファーマ	9,064,000	661.90	5,999,461,600	貸付有価証券 1,540,900株 (645,800株)
塩野義製薬	9,064,000	5,919.00	53,649,816,000	
中外製薬	27,192,000	3,907.00	106,239,144,000	貸付有価証券 532,500株
エーザイ	9,064,000	9,382.00	85,038,448,000	貸付有価証券 268,200株
第一三共	27,192,000	4,133.00	112,384,536,000	貸付有価証券 1,128,600株
大塚ホールディングス	9,064,000	5,216.00	47,277,824,000	貸付有価証券 865,500株
出光興産	3,625,600	2,889.00	10,474,358,400	貸付有価証券 700株
ENEOSホールディングス	9,064,000	496.90	4,503,901,600	
横浜ゴム	4,532,000	3,075.00	13,935,900,000	貸付有価証券 465,200株 (47,800株)
ブリヂストン	9,064,000	5,750.00	52,118,000,000	
AGC	1,812,800	4,959.00	8,989,675,200	
日本板硝子	906,400	645.00	584,628,000	貸付有価証券 2,200株
日本電気硝子	2,719,200	2,506.50	6,815,674,800	貸付有価証券 63,600株
住友大阪セメント	906,400	3,646.00	3,304,734,400	貸付有価証券 300株
太平洋セメント	906,400	2,777.00	2,517,072,800	

東海カーボン	9,064,000	1,274.00	11,547,536,000	
TOTO	4,532,000	4,197.00	19,020,804,000	貸付有価証券 302,700株
日本碍子	9,064,000	1,654.50	14,996,388,000	
日本製鉄	906,400	2,993.50	2,713,308,400	貸付有価証券 223,700株 (123,300 株)
神戸製鋼所	906,400	1,395.00	1,264,428,000	
JFEホールディングス	906,400	1,989.50	1,803,282,800	貸付有価証券 300株
大太平洋金属	906,400	1,520.00	1,377,728,000	貸付有価証券 364,700株 (27,500 株)
三井金属鉱業	906,400	3,248.00	2,943,987,200	貸付有価証券 1,400株
三菱マテリアル	906,400	2,534.00	2,296,817,600	
住友金属鉱山	4,532,000	4,577.00	20,742,964,000	貸付有価証券 9,700株
DOWAホールディングス	1,812,800	4,516.00	8,186,604,800	貸付有価証券 73,100株 (18,800 株)
古河電気工業	906,400	2,556.50	2,317,211,600	貸付有価証券 55,300株 (32,200 株)
住友電気工業	9,064,000	1,716.00	15,553,824,000	貸付有価証券 93,300株
フジクラ	9,064,000	1,178.00	10,677,392,000	
SUMCO	906,400	2,000.00	1,812,800,000	貸付有価証券 3,000株
日本製鋼所	1,812,800	2,989.50	5,419,365,600	貸付有価証券 16,900株
オークマ	1,812,800	7,391.00	13,398,404,800	貸付有価証券 333,000株 (48,500 株)
アマダ	9,064,000	1,385.50	12,558,172,000	貸付有価証券 44,900株
SMC	906,400	76,900.00	69,702,160,000	貸付有価証券 67,600株 (5,200株)
小松製作所	9,064,000	3,727.00	33,781,528,000	
住友重機械工業	1,812,800	3,359.00	6,089,195,200	
日立建機	9,064,000	3,898.00	35,331,472,000	貸付有価証券 57,800株
クボタ	9,064,000	2,011.50	18,232,236,000	貸付有価証券 1,139,900株
荏原製作所	1,812,800	6,906.00	12,519,196,800	
ダイキン工業	9,064,000	29,110.00	263,853,040,000	貸付有価証券 360,000株

日本精工	9,064,000	896.40	8,124,969,600	貸付有価証券 40,000株
NTN	9,064,000	303.20	2,748,204,800	貸付有価証券 150,300株
ジェイテクト	9,064,000	1,309.50	11,869,308,000	貸付有価証券 36,300株
三井E&S	906,400	514.00	465,889,600	貸付有価証券 6,800株
日立造船	1,812,800	914.00	1,656,899,200	貸付有価証券 10,400株
三菱重工業	906,400	6,627.00	6,006,712,800	
IHI	906,400	3,891.00	3,526,802,400	
コニカミノルタ	9,064,000	498.80	4,521,123,200	貸付有価証券 122,500株 (19,900 株)
ミネベアミツミ	9,064,000	2,557.00	23,176,648,000	貸付有価証券 1,208,600株 (618,000株)
日立製作所	1,812,800	8,825.00	15,997,960,000	貸付有価証券 105,600株
三菱電機	9,064,000	1,999.50	18,123,468,000	
富士電機	1,812,800	5,985.00	10,849,608,000	貸付有価証券 20,100株
安川電機	9,064,000	6,217.00	56,350,888,000	貸付有価証券 1,653,400株 (317,700株)
ニデック	7,251,200	7,520.00	54,529,024,000	貸付有価証券 24,900株
オムロン	9,064,000	8,509.00	77,125,576,000	貸付有価証券 1,800株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,812,800	2,850.00	5,166,480,000	貸付有価証券 4,400株
日本電気	906,400	6,942.00	6,292,228,800	
富士通	906,400	18,255.00	16,546,332,000	
ルネサスエレクトロニク ス	9,064,000	2,688.50	24,368,564,000	貸付有価証券 593,600株
セイコーエプソン	18,128,000	2,196.00	39,809,088,000	貸付有価証券 1,527,600株 (899,800株)
パナソニック ホールデ ィングス	9,064,000	1,719.00	15,581,016,000	貸付有価証券 12,400株
シャープ	9,064,000	790.20	7,162,372,800	貸付有価証券 7,396,000株 (229,800株)
ソニーグループ	9,064,000	13,005.00	117,877,320,000	貸付有価証券 575,700株
TDK	27,192,000	5,410.00	147,108,720,000	
アルプスアルパイン	9,064,000	1,221.50	11,071,676,000	貸付有価証券

				1,546,300株
横河電機	9,064,000	2,645.00	23,974,280,000	
アドバンテスト	18,128,000	19,970.00	362,016,160,000	貸付有価証券 64,600株
キーエンス	906,400	65,970.00	59,795,208,000	貸付有価証券 22,900株
カシオ計算機	9,064,000	1,171.00	10,613,944,000	貸付有価証券 350,500株
ファナック	45,320,000	4,753.00	215,405,960,000	貸付有価証券 1,857,000株
京セラ	18,128,000	7,584.00	137,482,752,000	貸付有価証券 132,500株
太陽誘電	9,064,000	4,182.00	37,905,648,000	貸付有価証券 207,200株
村田製作所	7,251,200	8,089.00	58,654,956,800	貸付有価証券 68,500株 (22,900 株)
S C R E E Nホールディングス	1,812,800	15,630.00	28,334,064,000	貸付有価証券 206,900株 (151,400 株)
キヤノン	13,596,000	3,725.00	50,645,100,000	
リコー	9,064,000	1,216.00	11,021,824,000	貸付有価証券 423,200株 (383,800 株)
東京エレクトロン	27,192,000	20,205.00	549,414,360,000	貸付有価証券 535,400株
デンソー	9,064,000	9,569.00	86,733,416,000	貸付有価証券 41,700株
川崎重工業	906,400	3,718.00	3,369,995,200	貸付有価証券 300株
日産自動車	9,064,000	597.10	5,412,114,400	貸付有価証券 2,276,600株
いすゞ自動車	4,532,000	1,757.50	7,964,990,000	
トヨタ自動車	45,320,000	2,299.50	104,213,340,000	貸付有価証券 2,760,500株
日野自動車	9,064,000	597.60	5,416,646,400	貸付有価証券 72,600株
三菱自動車工業	906,400	503.30	456,191,120	貸付有価証券 300,100株 (10,400 株)
マツダ	1,812,800	1,368.00	2,479,910,400	
本田技研工業	18,128,000	4,291.00	77,787,248,000	貸付有価証券 497,800株
スズキ	9,064,000	5,462.00	49,507,568,000	
S U B A R U	9,064,000	2,615.50	23,706,892,000	貸付有価証券 10,600株
ヤマハ発動機	9,064,000	4,076.00	36,944,864,000	貸付有価証券 200株

テルモ	36,256,000	4,321.00	156,662,176,000	貸付有価証券 2,455,500株 (160,000株)
ニコン	9,064,000	1,827.00	16,559,928,000	貸付有価証券 4,200株
オリンパス	36,256,000	2,222.00	80,560,832,000	貸付有価証券 3,812,700株
HOYA	4,532,000	16,315.00	73,939,580,000	貸付有価証券 239,400株
シチズン時計	9,064,000	880.00	7,976,320,000	貸付有価証券 4,496,300株 (1,299,300株)
バンダイナムコホールディングス	27,192,000	3,161.00	85,953,912,000	
凸版印刷	4,532,000	3,099.00	14,044,668,000	貸付有価証券 88,700株
大日本印刷	4,532,000	3,966.00	17,973,912,000	貸付有価証券 8,300株
ヤマハ	9,064,000	5,270.00	47,767,280,000	貸付有価証券 88,900株 (86,700株)
任天堂	9,064,000	6,351.00	57,565,464,000	貸付有価証券 506,400株
東京電力ホールディングス	906,400	525.10	475,950,640	貸付有価証券 274,000株
中部電力	906,400	1,717.50	1,556,742,000	貸付有価証券 17,300株 (17,300株)
関西電力	906,400	1,781.00	1,614,298,400	
東京瓦斯	1,812,800	3,115.00	5,646,872,000	貸付有価証券 1,700株
大阪瓦斯	1,812,800	2,145.50	3,889,362,400	
東武鉄道	1,812,800	3,657.00	6,629,409,600	貸付有価証券 23,600株 (22,200株)
東急	4,532,000	1,703.00	7,717,996,000	貸付有価証券 425,200株
小田急電鉄	4,532,000	1,872.00	8,483,904,000	貸付有価証券 186,800株
京王電鉄	1,812,800	4,241.00	7,688,084,800	貸付有価証券 167,200株
京成電鉄	4,532,000	5,822.00	26,385,304,000	貸付有価証券 104,000株
東日本旅客鉄道	906,400	7,850.00	7,115,240,000	貸付有価証券 200株
西日本旅客鉄道	906,400	5,843.00	5,296,095,200	
東海旅客鉄道	906,400	17,730.00	16,070,472,000	貸付有価証券 800株
ヤマトホールディングス	9,064,000	2,601.50	23,579,996,000	貸付有価証券

				260,600株 (192,000株)
NIPPON EXPRESSホールディング	906,400	8,070.00	7,314,648,000	貸付有価証券 80,000株
日本郵船	2,719,200	3,352.00	9,114,758,400	貸付有価証券 53,300株 (53,300株)
商船三井	2,719,200	3,678.00	10,001,217,600	貸付有価証券 284,200株
川崎汽船	2,719,200	3,877.00	10,542,338,400	貸付有価証券 66,300株
日本航空	9,064,000	3,134.00	28,406,576,000	
ANAホールディングス	906,400	3,427.00	3,106,232,800	貸付有価証券 151,500株
三菱倉庫	4,532,000	3,458.00	15,671,656,000	貸付有価証券 17,300株
ネクソン	18,128,000	2,583.50	46,833,688,000	
Zホールディングス	3,625,600	368.60	1,336,396,160	貸付有価証券 718,100株
トレンドマイクロ	9,064,000	6,821.00	61,825,544,000	貸付有価証券 1,150,500株 (256,700株)
日本電信電話	90,640,000	166.20	15,064,368,000	
KDDI	54,384,000	4,291.00	233,361,744,000	貸付有価証券 166,800株
ソフトバンク	9,064,000	1,536.50	13,926,836,000	貸付有価証券 3,900株
東宝	906,400	5,370.00	4,867,368,000	
NTTデータグループ	45,320,000	1,923.00	87,150,360,000	貸付有価証券 600株
コナミグループ	9,064,000	7,328.00	66,420,992,000	貸付有価証券 611,100株 (22,800株)
ソフトバンクグループ	54,384,000	6,724.00	365,678,016,000	貸付有価証券 388,700株
双日	906,400	3,193.00	2,894,135,200	
伊藤忠商事	9,064,000	5,540.00	50,214,560,000	貸付有価証券 48,100株
丸紅	9,064,000	2,400.50	21,758,132,000	貸付有価証券 100株
豊田通商	9,064,000	7,168.00	64,970,752,000	貸付有価証券 136,800株
三井物産	9,064,000	5,236.00	47,459,104,000	貸付有価証券 45,600株
住友商事	9,064,000	2,973.00	26,947,272,000	貸付有価証券 1,600株
三菱商事	9,064,000	6,832.00	61,925,248,000	貸付有価証券 320,700株

J. フロント リテイリング	4,532,000	1,386.50	6,283,618,000	貸付有価証券 104,600株
三越伊勢丹ホールディングス	9,064,000	1,468.00	13,305,952,000	
セブン&アイ・ホールディングス	9,064,000	6,023.00	54,592,472,000	貸付有価証券 709,000株
高島屋	4,532,000	1,989.00	9,014,148,000	貸付有価証券 355,700株 (106,300株)
丸井グループ	9,064,000	2,451.00	22,215,864,000	貸付有価証券 232,500株
イオン	9,064,000	2,960.00	26,829,440,000	貸付有価証券 806,400株 (169,400株)
ファーストリテイリング	27,192,000	34,560.00	939,755,520,000	貸付有価証券 1,541,300株 (74,700株)
しずおかフィナンシャルグループ	9,064,000	1,046.50	9,485,476,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	9,064,000	588.70	5,335,976,800	貸付有価証券 3,900株
あおぞら銀行	906,400	2,707.50	2,454,078,000	貸付有価証券 735,600株 (102,600株)
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,064,000	1,057.50	9,585,180,000	貸付有価証券 34,200株
りそなホールディングス	906,400	716.30	649,254,320	貸付有価証券 700株
三井住友トラスト・ホールディングス	906,400	5,332.00	4,832,924,800	
三井住友フィナンシャルグループ	906,400	6,200.00	5,619,680,000	貸付有価証券 4,800株
千葉銀行	9,064,000	912.90	8,274,525,600	貸付有価証券 59,900株
ふくおかフィナンシャルグループ	1,812,800	3,095.00	5,610,616,000	貸付有価証券 100株
みずほフィナンシャルグループ	906,400	2,211.00	2,004,050,400	貸付有価証券 5,200株
大和証券グループ本社	9,064,000	723.30	6,555,991,200	貸付有価証券 16,200株
野村ホールディングス	9,064,000	542.20	4,914,500,800	
松井証券	9,064,000	801.00	7,260,264,000	貸付有価証券 1,836,000株 (72,800株)
SOMPOホールディングス	1,812,800	6,556.00	11,884,716,800	貸付有価証券 300株
MS&ADインシュアランスグループホール	2,719,200	5,226.00	14,210,539,200	貸付有価証券 18,500株
第一生命ホールディングス	906,400	2,859.00	2,591,397,600	貸付有価証券 3,400株



東京海上ホールディングス	13,596,000	3,284.00	44,649,264,000	貸付有価証券 118,800株
T&Dホールディングス	1,812,800	2,242.00	4,064,297,600	貸付有価証券 34,800株
クレディセゾン	9,064,000	2,243.00	20,330,552,000	貸付有価証券 103,200株
オリックス	9,064,000	2,571.00	23,303,544,000	
日本取引所グループ	9,064,000	2,364.00	21,427,296,000	貸付有価証券 112,500株 (112,500株)
東急不動産ホールディングス	9,064,000	815.90	7,395,317,600	
三井不動産	9,064,000	2,827.50	25,628,460,000	
三菱地所	9,064,000	1,711.50	15,513,036,000	
東京建物	4,532,000	1,851.50	8,390,998,000	貸付有価証券 479,000株
住友不動産	9,064,000	3,528.00	31,977,792,000	貸付有価証券 131,300株
エムスリー	21,753,600	3,006.00	65,391,321,600	貸付有価証券 40,300株
ディー・エヌ・エー	2,719,200	1,825.00	4,962,540,000	貸付有価証券 9,200株
電通グループ	9,064,000	4,600.00	41,694,400,000	
オリエンタルランド	9,064,000	5,569.00	50,477,416,000	貸付有価証券 114,400株 (114,400株)
サイバーエージェント	7,251,200	1,013.50	7,349,091,200	貸付有価証券 841,800株
楽天グループ	9,064,000	528.90	4,793,949,600	貸付有価証券 4,506,300株
リクルートホールディングス	27,192,000	4,532.00	123,234,144,000	貸付有価証券 1,232,500株
日本郵政	9,064,000	1,043.00	9,453,752,000	
セコム	9,064,000	9,469.00	85,827,016,000	貸付有価証券 200株
小計	銘柄数：225 組入時価比率：98.4%		8,662,818,839,840 100.0%	
合計			8,662,818,839,840	

(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(2023年7月8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。