



2023年1月期 (2022年7月9日～2023年1月8日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended January 2023 (July 9, 2022 – January 8, 2023)

2023年2月17日
 February 17, 2023

| | | | |
|--------------------------|--|---|-----------------|
| | | 上場取引所 | 東証 |
| | | Listed Exchange | TSE |
| ファンド名 | NEXT FUNDS SolactiveジャパンESGコア指数連動型上場投信 | | |
| コード番号 | (2850) | | |
| 連動対象指標 | Solactive ジャパン ESG コア指数 | | |
| 主要投資資産 | 株式 | | |
| 売買単位 | 10 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 Solactive Japan ESG Core Index Exchange Traded Fund | | |
| Code: | 2850 | | |
| Underlying index: | Solactive Japan ESG Core Index | | |
| Primary invested assets: | Stocks | | |
| Trading unit: | 10 units | | |
| 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3月29日
 分配金支払開始日 2023年2月16日
 Scheduled date of submission of securities report: March 29, 2023
 Date of commencing dividend payment: February 16, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

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

Management Status for Year ended January 2023 (from July 9, 2022 to January 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1月期 FY ended Jan. 2023 | 52,925 | (99.8) | 84 | (0.2) | 53,010 | (100.0) |
| 2022年7月期 FY ended Jul. 2022 | 54,691 | (99.9) | 28 | (0.1) | 54,719 | (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1月期 FY ended Jan. 2023 | 28,268 | 0 | 47 | 28,221 |
| 2022年7月期 FY ended Jul. 2022 | 0 | 28,268 | 0 | 28,268 |

(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)) | 100口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100) |
|--------------------------------|----------------------------|--------------------------|-------------------------------|--|
| | 百万円 JPY mil. | 百万円 JPY mil. | 百万円 JPY mil. | 円 JPY |
| 2023年1月期 FY ended Jan. 2023 | 53,531 | 520 | 53,010 | 187,840 |
| 2022年7月期 FY ended Jul. 2022 | 54,781 | 62 | 54,719 | 193,570 |

(4) 分配金

Dividend Payment

| | 100口当り分配金 Dividend per 100 units |
|--------------------------------|-------------------------------------|
| | 円 JPY |
| 2023年1月期 FY ended Jan. 2023 | 1,680 |
| 2022年7月期 FY ended Jul. 2022 | 150 |

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1期 (2022年7月8日現在) 1st Fiscal Year As of July 8, 2022 | 第2期 (2023年1月8日現在) 2nd Fiscal Year As of January 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 | 26,361,320 | 91,682,417 |
| 株式 Stocks | 54,691,176,710 | 52,925,654,150 |
| 未収入金 Accounts receivable - other | - | 447,223,333 |
| 未収配当金 Accrued dividends receivable | 64,173,433 | 66,715,250 |
| 流動資産合計 Total current assets | 54,781,711,463 | 53,531,275,150 |
| 資産合計 Total assets | 54,781,711,463 | 53,531,275,150 |
| 負債の部 Liabilities | | |
| 流動負債 Current liabilities | | |
| 未払収益分配金 Unpaid dividends | 42,402,900 | 474,114,664 |
| 未払受託者報酬 Trustee fees payable | 2,385,803 | 6,227,370 |
| 未払委託者報酬 Investment trust management fees payable | 11,928,971 | 31,136,774 |
| 未払利息 Accrued interest expenses | 4 | 124 |
| その他未払費用 Other accrued expenses | 5,470,985 | 9,183,237 |
| 流動負債合計 Total current liabilities | 62,188,663 | 520,662,169 |
| 負債合計 Total liabilities | 62,188,663 | 520,662,169 |
| 純資産の部 Net assets | | |
| 元本等 Principal and other | | |
| 元本 Principal | 56,537,200,000 | 56,442,222,000 |
| 剰余金 Surplus | | |

| | | |
|--|----------------|----------------|
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period | △1,817,677,200 | △3,431,609,019 |
| (分配準備積立金) (Reserve for distribution) | 1,393,074 | 390,381 |
| 元本等合計 Total principal and other | 54,719,522,800 | 53,010,612,981 |
| 純資産合計 Total net assets | 54,719,522,800 | 53,010,612,981 |
| 負債純資産合計 Total liabilities and net assets | 54,781,711,463 | 53,531,275,150 |

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

(単位：円) (Unit：JPY)

| | 第1期 自 2022年4月7日 至 2022年7月8日 1st Fiscal Year From April 7, 2022 to July 8, 2022 | 第2期 自 2022年7月9日 至 2023年1月8日 2nd Fiscal Year From July 9, 2022 to January 8, 2023 |
|--|---|---|
| | 金額 Amount | 金額 Amount |
| 営業収益 Operating revenue | | |
| 受取配当金 Dividend income | 64,173,433 | 524,116,466 |
| 受取利息 Interest income | - | 7 |
| 有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other | △407,115,364 | △1,613,731,436 |
| その他収益 Other revenue | 85 | 1,213 |
| 営業収益合計 Total operating revenue | △342,941,846 | △1,089,613,750 |
| 営業費用 Operating expenses | | |
| 支払利息 Interest expenses | 1,525 | 18,317 |
| 受託者報酬 Trustee fees | 2,385,803 | 6,227,370 |
| 委託者報酬 Investment trust management fees | 11,928,971 | 31,136,774 |
| その他費用 Other expenses | 6,061,245 | 13,623,254 |
| 営業費用合計 Total operating expenses | 20,377,544 | 51,005,715 |
| 営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss) | △363,319,390 | △1,140,619,465 |
| 経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss) | △363,319,390 | △1,140,619,465 |
| 当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss) | △363,319,390 | △1,140,619,465 |
| 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 | - | △1,817,677,200 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit | - | 802,310 |
| 当期一部交換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 partial exchange | - | 802,310 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit | 1,411,954,910 | - |
| 当期追加信託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 additional subscriptions for period | 1,411,954,910 | - |
| 分配金 Dividends | 42,402,900 | 474,114,664 |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period | △1,817,677,200 | △3,431,609,019 |

(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。 |
| 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。 |
| 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 | 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1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1期 2022年7月8日現在 | 第2期 2023年1月8日現在 |
|---|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 28,268,600 口 | 1. 計算期間の末日における受益権の総数 28,221,111 口 |
| 2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 1,817,677,200 円 | 2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 3,431,609,019 円 |
| 3. 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 1,935.70 円 (100口当たり純資産額) (193,570 円) | 3. 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 1,878.40 円 (100口当たり純資産額) (187,840 円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第1期 自 2022年4月7日 | 第2期 自 2022年7月9日 |
|--------------------|--------------------|
|--------------------|--------------------|

| 至 2022年7月8日 | 至 2023年1月8日 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|-------------|--------------|--|----------|---|-------------|---------|---|----|----------|-------|-------------|----|---|-------------|---------|-------|-------------|-------|---|-------------|----------------|-------|------------|----|---|-------------|------------|-----------|------|---|----|--|--|----------|---|--------------|---------|---|------------|----------|-------|--------------|----|---|-------------|---------|-------|--------------|-------|---|--------------|----------------|-------|----------|----|---|-------------|------------|-----------|--------|
| <p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 20%;"></th> <th style="width: 50%;"></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;">64,171,993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;">0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;">64,171,993円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">20,376,019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;">43,795,974円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">42,402,900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;">1,393,074円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">28,268,600口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H×100</td> <td style="text-align: right;">150円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち4,337,788円は、対象指数についての商標使用料であります。</p> <p>3. 追加情報 2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。</p> | 項目 | | | 当期配当等収益額 | A | 64,171,993円 | 分配準備積立金 | B | 0円 | 配当等収益合計額 | C=A+B | 64,171,993円 | 経費 | D | 20,376,019円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 43,795,974円 | 収益分配金 | F | 42,402,900円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 1,393,074円 | 口数 | H | 28,268,600口 | 100口当たり分配金 | I=F/H×100 | 150円 | <p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 20%;"></th> <th style="width: 50%;"></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;">524,099,369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;">1,393,074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;">525,492,443円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">50,987,398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;">474,505,045円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">474,114,664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;">390,381円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">28,221,111口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H×100</td> <td style="text-align: right;">1,680円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち11,442,635円は、対象指数についての商標使用料であります。</p> | 項目 | | | 当期配当等収益額 | A | 524,099,369円 | 分配準備積立金 | B | 1,393,074円 | 配当等収益合計額 | C=A+B | 525,492,443円 | 経費 | D | 50,987,398円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 474,505,045円 | 収益分配金 | F | 474,114,664円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 390,381円 | 口数 | H | 28,221,111口 | 100口当たり分配金 | I=F/H×100 | 1,680円 |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当期配当等収益額 | A | 64,171,993円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金 | B | 0円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 配当等収益合計額 | C=A+B | 64,171,993円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 経費 | D | 20,376,019円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配可能額 | E=C-D | 43,795,974円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金 | F | 42,402,900円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 1,393,074円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 口数 | H | 28,268,600口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 100口当たり分配金 | I=F/H×100 | 150円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当期配当等収益額 | A | 524,099,369円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金 | B | 1,393,074円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 配当等収益合計額 | C=A+B | 525,492,443円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 経費 | D | 50,987,398円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配可能額 | E=C-D | 474,505,045円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金 | F | 474,114,664円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 390,381円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 口数 | H | 28,221,111口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 100口当たり分配金 | I=F/H×100 | 1,680円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

(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1期 自 2022年4月7日 至 2022年7月8日 | 第2期 自 2022年7月9日 至 2023年1月8日 |
|---|--|
| <p>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。</p> <p>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、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。</p> <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>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>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> <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1期 | 第2期 |
|-----|-----|
| | |

| 2022年7月8日現在 | 2023年1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。 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1期 自 2022年4月7日 至 2022年7月8日 | 第2期 自 2022年7月9日 至 2023年1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1期 自 2022年4月7日 至 2022年7月8日 | 第2期 自 2022年7月9日 至 2023年1月8日 |
|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 期首元本額 ー円 | 期首元本額 56,537,200,000円 |
| 期中追加設定元本額 56,537,200,000円 | 期中追加設定元本額 0円 |
| 期中一部交換元本額 0円 | 期中一部交換元本額 94,978,000円 |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類 | 第1期 自 2022年4月7日 至 2022年7月8日 | 第2期 自 2022年7月9日 至 2023年1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 | △235,247,275 | △1,638,320,561 |
| 合計 | △235,247,275 | △1,638,320,561 |

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2023年1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 | 大和ハウス工業 | 52,100 | 2,987.50 | 155,648,750 | |
| | | アサヒグループホールディングス | 84,900 | 4,070.00 | 345,543,000 | |
| | | 麒麟ホールディングス | 128,100 | 1,946.00 | 249,282,600 | |
| | | 味の素 | 84,700 | 3,886.00 | 329,144,200 | |

| | | | |
|-----------------|---------|-----------|---------------|
| 東レ | 116,400 | 728.90 | 84,843,960 |
| 王子ホールディングス | 65,600 | 523.00 | 34,308,800 |
| 旭化成 | 100,500 | 929.50 | 93,414,750 |
| 日産化学 | 9,500 | 5,670.00 | 53,865,000 |
| 日本酸素ホールディングス | 14,200 | 1,958.00 | 27,803,600 |
| 三井化学 | 13,600 | 2,985.00 | 40,596,000 |
| 花王 | 82,000 | 5,105.00 | 418,610,000 |
| 富士フイルムホールディングス | 88,200 | 6,628.00 | 584,589,600 |
| 資生堂 | 63,000 | 6,635.00 | 418,005,000 |
| ユニ・チャーム | 61,500 | 4,802.00 | 295,323,000 |
| 協和キリン | 71,600 | 2,913.00 | 208,570,800 |
| 武田薬品工業 | 443,200 | 4,080.00 | 1,808,256,000 |
| アステラス製薬 | 550,300 | 1,924.00 | 1,058,777,200 |
| 塩野義製薬 | 84,800 | 6,438.00 | 545,942,400 |
| 日本新薬 | 16,300 | 7,070.00 | 115,241,000 |
| 中外製薬 | 173,300 | 3,308.00 | 573,276,400 |
| エーザイ | 75,300 | 8,147.00 | 613,469,100 |
| 小野薬品工業 | 113,400 | 2,881.00 | 326,705,400 |
| 第一三共 | 527,000 | 4,065.00 | 2,142,255,000 |
| 大塚ホールディングス | 105,600 | 4,103.00 | 433,276,800 |
| ブリヂストン | 108,100 | 4,692.00 | 507,205,200 |
| SMC | 13,600 | 56,640.00 | 770,304,000 |
| 小松製作所 | 228,600 | 2,833.50 | 647,738,100 |
| クボタ | 300,400 | 1,837.50 | 551,985,000 |
| ダイキン工業 | 66,700 | 20,250.00 | 1,350,675,000 |
| 三菱重工業 | 69,500 | 5,027.00 | 349,376,500 |
| 日立製作所 | 195,800 | 6,556.00 | 1,283,664,800 |
| 東芝 | 90,300 | 4,605.00 | 415,831,500 |
| 三菱電機 | 477,600 | 1,300.00 | 620,880,000 |
| 日本電産 | 119,700 | 6,848.00 | 819,705,600 |
| オムロン | 45,900 | 6,447.00 | 295,917,300 |
| 富士通 | 45,800 | 17,390.00 | 796,462,000 |
| ルネサスエレクトロニクス | 247,800 | 1,204.50 | 298,475,100 |
| パナソニック ホールディングス | 455,000 | 1,095.50 | 498,452,500 |
| ソニーグループ | 228,100 | 10,635.00 | 2,425,843,500 |

| | | | |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|
| TDK | 87,300 | 4,295.00 | 374,953,500 |
| アドバンテスト | 44,700 | 8,510.00 | 380,397,000 |
| キーエンス | 46,400 | 51,510.00 | 2,390,064,000 |
| シスメックス | 42,600 | 7,693.00 | 327,721,800 |
| レーザーテック | 17,100 | 22,030.00 | 376,713,000 |
| ファナック | 45,200 | 19,795.00 | 894,734,000 |
| 京セラ | 75,000 | 6,543.00 | 490,725,000 |
| 村田製作所 | 147,100 | 6,800.00 | 1,000,280,000 |
| キヤノン | 235,800 | 2,864.50 | 675,449,100 |
| 東京エレクトロン | 36,400 | 41,170.00 | 1,498,588,000 |
| デンソー | 72,500 | 6,549.00 | 474,802,500 |
| トヨタ自動車 | 1,654,600 | 1,825.00 | 3,019,645,000 |
| 本田技研工業 | 242,200 | 3,123.00 | 756,390,600 |
| スズキ | 66,600 | 4,258.00 | 283,582,800 |
| テルモ | 202,300 | 3,608.00 | 729,898,400 |
| オリンパス | 347,000 | 2,388.50 | 828,809,500 |
| HOYA | 110,600 | 12,640.00 | 1,397,984,000 |
| 朝日インテック | 67,600 | 2,061.00 | 139,323,600 |
| バンダイナムコホールディングス | 44,600 | 8,162.00 | 364,025,200 |
| 任天堂 | 273,800 | 5,483.00 | 1,501,245,400 |
| 東日本旅客鉄道 | 82,200 | 7,310.00 | 600,882,000 |
| 東海旅客鉄道 | 39,600 | 15,800.00 | 625,680,000 |
| 西武ホールディングス | 19,000 | 1,420.00 | 26,980,000 |
| ANAホールディングス | 95,700 | 2,759.50 | 264,084,150 |
| オービック | 14,100 | 19,420.00 | 273,822,000 |
| 日本電信電話 | 167,900 | 3,741.00 | 628,113,900 |
| KDDI | 118,400 | 3,988.00 | 472,179,200 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 140,400 | 1,885.00 | 264,654,000 |
| ソフトバンクグループ | 80,100 | 5,816.00 | 465,861,600 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 127,600 | 5,553.00 | 708,562,800 |
| イオン | 125,900 | 2,712.50 | 341,503,750 |
| ファーストリテイリング | 10,000 | 79,530.00 | 795,300,000 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 926,300 | 902.40 | 835,893,120 |
| りそなホールディングス | 181,000 | 718.40 | 130,030,400 |
| 三井住友トラスト・ホールディング | 25,000 | 4,580.00 | 114,500,000 |

| | | | | |
|----------------------|--------------|-----------|----------------|--|
| ス | | | | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 91,300 | 5,293.00 | 483,250,900 | |
| 千葉銀行 | 51,700 | 962.00 | 49,735,400 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 13,100 | 2,948.00 | 38,618,800 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 190,400 | 1,892.00 | 360,236,800 | |
| 大和証券グループ本社 | 113,700 | 582.00 | 66,173,400 | |
| 野村ホールディングス | 232,800 | 488.90 | 113,815,920 | |
| SOMPOホールディングス | 24,600 | 5,688.00 | 139,924,800 | |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 34,500 | 4,149.00 | 143,140,500 | |
| 第一生命ホールディングス | 71,600 | 2,963.50 | 212,186,600 | |
| 東京海上ホールディングス | 138,900 | 2,716.50 | 377,321,850 | |
| 日本取引所グループ | 42,100 | 1,836.00 | 77,295,600 | |
| 大東建託 | 4,700 | 13,310.00 | 62,557,000 | |
| ヒューリック | 39,200 | 1,018.00 | 39,905,600 | |
| 野村不動産ホールディングス | 9,200 | 2,798.00 | 25,741,600 | |
| オープンハウスグループ | 5,700 | 4,905.00 | 27,958,500 | |
| 東急不動産ホールディングス | 47,000 | 626.00 | 29,422,000 | |
| 三井不動産 | 68,500 | 2,342.00 | 160,427,000 | |
| 三菱地所 | 97,600 | 1,656.00 | 161,625,600 | |
| 住友不動産 | 23,400 | 3,002.00 | 70,246,800 | |
| イオンモール | 7,400 | 1,653.00 | 12,232,200 | |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 22,300 | 1,679.00 | 37,441,700 | |
| エムスリー | 121,800 | 3,528.00 | 429,710,400 | |
| オリエンタルランド | 33,200 | 18,900.00 | 627,480,000 | |
| リクルートホールディングス | 400,600 | 4,339.00 | 1,738,203,400 | |
| セコム | 54,000 | 7,377.00 | 398,358,000 | |
| 小計 | 銘柄数：99 | | 52,925,654,150 | |
| | 組入時価比率：99.8% | | 100.0% | |
| 合計 | | | 52,925,654,150 | |

(注1) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2) 株式以外の有価証券(2023年1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

該当事項はありません。