



2023年4月期 (2022年10月8日~2023年4月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended April 2023 (October 8, 2022 – April 7, 2023)

2023年5月17日
 May 17, 2023

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 野村株主還元70連動型上場投信
 コード番号 (2529)
 連動対象指標 野村株主還元70
 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 Shareholder Yield 70 Exchange Traded Fund
 Code: 2529
 Underlying index: Nomura Shareholder Yield 70
 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6月29日
 分配金支払開始日 2023年5月16日
 Scheduled date of submission of securities report: June 29, 2023
 Date of commencing dividend payment: May 16, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2023年4月期の運用状況 (2022年10月8日~2023年4月7日)

Management Status for Period ended April 2023 (from October 8, 2022 to April 7, 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4月期 FY ended Apr. 2023	15,326	(97.6)	377	(2.4)	15,704	(100.0)
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	11,778	(99.8)	24	(0.2)	11,803	(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)

	前特定期間末 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)	当特定期間末 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4月期 FY ended Apr. 2023	9,767	3,093	99	12,760
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	10,656	2,078	2,968	9,767

(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/当特定期間末発行済口数)×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4月期 FY ended Apr. 2023	15,992	288	15,704	123,069
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	11,941	138	11,803	120,846

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	2,000
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	1,300

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)

	前期 (2022年10月7日現在) Prior period As of October 7, 2022	当期 (2023年4月7日現在) Present period As of April 7, 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	23,428,524	352,554,253
株式 Stocks	11,778,554,260	15,326,183,370
未収配当金 Accrued dividends receivable	139,928,090	272,613,550
差入委託証拠金 Margin deposits	-	40,920,000
流動資産合計 Total current assets	11,941,910,874	15,992,271,173
資産合計 Total assets	11,941,910,874	15,992,271,173
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	9,008,910
未払金 Accounts payable - other	-	6,597,370
未払収益分配金 Unpaid dividends	126,972,573	255,209,380
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,554,022	1,997,008
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	7,148,457	9,186,200
未払利息 Accrued interest expenses	21	47
その他未払費用 Other accrued expenses	3,070,277	6,097,460
流動負債合計 Total current liabilities	138,745,350	288,096,375
負債合計 Total liabilities	138,745,350	288,096,375
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		

元本 Principal	9,767,121,000	12,760,469,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,036,044,524	2,943,705,798
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	8,555,353	9,516,947
元本等合計 Total principal and other	11,803,165,524	15,704,174,798
純資産合計 Total net assets	11,803,165,524	15,704,174,798
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	11,941,910,874	15,992,271,173

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	前期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日 Prior period From April 8, 2022 to October 7, 2022	当期 自 2022年10月8日 至 2023年4月7日 Present period From October 8, 2022 to April 7, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	202,797,870	334,360,950
受取利息 Interest income	-	5
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	795,193,200	317,390,777
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	-	△15,606,280
その他収益 Other revenue	11,254	585
営業収益合計 Total operating revenue	998,002,324	636,146,037
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	2,829	4,376
受託者報酬 Trustee fees	3,315,374	3,674,715
委託者報酬 Investment trust management fees	15,250,669	16,903,626
その他費用 Other expenses	3,255,425	3,774,244
営業費用合計 Total operating expenses	21,824,297	24,356,961
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	976,178,027	611,789,076
経常利益又は経常損失 (△)	976,178,027	611,789,076

Ordinary profit (loss)		
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	976,178,027	611,789,076
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	1,447,617,833	2,036,044,524
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	410,963,173	626,975,913
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	410,963,173	626,975,913
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	618,484,610	22,060,730
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	618,484,610	22,060,730
分配金 Dividends	180,229,899	309,042,985
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,036,044,524	2,943,705,798

(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	当該財務諸表の特定期間は、2022年10月8日から2023年4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)

前期 2022年10月7日現在	当期 2023年4月7日現在
--------------------	-------------------

1. 特定期間の末日における受益権の総数 <p style="text-align: right;">9,767,121 口</p> 2. 特定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 1,208.46 円 (100口当たり純資産額) (120,846 円)	1. 特定期間の末日における受益権の総数 <p style="text-align: right;">12,760,469 口</p> 2. 特定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 1,230.69 円 (100口当たり純資産額) (123,069 円)
---	--

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日	当期 自 2022年10月8日 至 2023年4月7日																																																																																																																								
1. 分配金の計算過程 2022年4月8日から2022年7月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin-top: 5px;"> <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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">57,206,588 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;">7,800,425 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;">65,007,013 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">11,609,537 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;">53,397,476 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">53,257,326 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;">140,150 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">8,876,221 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;">600 円</td></tr> </tbody> </table> 2022年7月8日から2022年10月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin-top: 5px;"> <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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">145,599,707 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;">140,150 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;">145,739,857 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">10,211,931 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;">135,527,926 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">126,972,573 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;">8,555,353 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">9,767,121 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;">1,300 円</td></tr> </tbody> </table> 2. その他費用 その他費用のうち2,654,560 円は、対象指数についての商標使用料であります。	項目			当期配当等収益額	A	57,206,588 円	分配準備積立金	B	7,800,425 円	配当等収益合計額	C=A+B	65,007,013 円	経費	D	11,609,537 円	収益分配可能額	E=C-D	53,397,476 円	収益分配金	F	53,257,326 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	140,150 円	口数	H	8,876,221 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	600 円	項目			当期配当等収益額	A	145,599,707 円	分配準備積立金	B	140,150 円	配当等収益合計額	C=A+B	145,739,857 円	経費	D	10,211,931 円	収益分配可能額	E=C-D	135,527,926 円	収益分配金	F	126,972,573 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,555,353 円	口数	H	9,767,121 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300 円	1. 分配金の計算過程 2022年10月8日から2023年1月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin-top: 5px;"> <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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">58,661,942 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;">8,555,353 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;">67,217,295 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">11,055,973 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;">56,161,322 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">53,833,605 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;">2,327,717 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">10,766,721 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;">500 円</td></tr> </tbody> </table> 2023年1月8日から2023年4月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin-top: 5px;"> <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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">275,695,222 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;">2,327,717 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;">278,022,939 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">13,296,612 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;">264,726,327 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">255,209,380 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;">9,516,947 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">12,760,469 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;">2,000 円</td></tr> </tbody> </table> 2. その他費用 その他費用のうち2,939,708 円は、対象指数についての商標使用料であります。	項目			当期配当等収益額	A	58,661,942 円	分配準備積立金	B	8,555,353 円	配当等収益合計額	C=A+B	67,217,295 円	経費	D	11,055,973 円	収益分配可能額	E=C-D	56,161,322 円	収益分配金	F	53,833,605 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,327,717 円	口数	H	10,766,721 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	500 円	項目			当期配当等収益額	A	275,695,222 円	分配準備積立金	B	2,327,717 円	配当等収益合計額	C=A+B	278,022,939 円	経費	D	13,296,612 円	収益分配可能額	E=C-D	264,726,327 円	収益分配金	F	255,209,380 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9,516,947 円	口数	H	12,760,469 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,000 円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	57,206,588 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	7,800,425 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	65,007,013 円																																																																																																																							
経費	D	11,609,537 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	53,397,476 円																																																																																																																							
収益分配金	F	53,257,326 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	140,150 円																																																																																																																							
口数	H	8,876,221 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	600 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	145,599,707 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	140,150 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	145,739,857 円																																																																																																																							
経費	D	10,211,931 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	135,527,926 円																																																																																																																							
収益分配金	F	126,972,573 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,555,353 円																																																																																																																							
口数	H	9,767,121 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	58,661,942 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	8,555,353 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	67,217,295 円																																																																																																																							
経費	D	11,055,973 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	56,161,322 円																																																																																																																							
収益分配金	F	53,833,605 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,327,717 円																																																																																																																							
口数	H	10,766,721 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	500 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	275,695,222 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	2,327,717 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	278,022,939 円																																																																																																																							
経費	D	13,296,612 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	264,726,327 円																																																																																																																							
収益分配金	F	255,209,380 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9,516,947 円																																																																																																																							
口数	H	12,760,469 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,000 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

前期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日	当期 自 2022年10月8日 至 2023年4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、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。	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。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>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。</p> <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>	<p>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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>
--	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 2022年10月7日現在	当期 2023年4月7日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日	当期 自 2022年10月8日 至 2023年4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

前期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日	当期 自 2022年10月8日 至 2023年4月7日
期首元本額 10,656,723,000円	期首元本額 9,767,121,000円
期中追加設定元本額 2,078,400,000円	期中追加設定元本額 3,093,300,000円
期中一部交換元本額 2,968,002,000円	期中一部交換元本額 99,952,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日	当期 自 2022年10月8日 至 2023年4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	134,847,802	653,461,472

合計	134,847,802	653,461,472
----	-------------	-------------

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	前期(2022年10月7日現在)				当期(2023年4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	-	-	-	-	362,790,000	-	353,790,000	△9,008,910
合計	-	-	-	-	362,790,000	-	353,790,000	△9,008,910

(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4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	I N P E X	207,700	1,424.00	295,764,800	
		大成建設	59,300	4,065.00	241,054,500	
		清水建設	179,800	757.00	136,108,600	
		長谷工コーポレーション	63,600	1,529.00	97,244,400	
		鹿島建設	142,000	1,587.00	225,354,000	
		大和ハウス工業	95,400	3,096.00	295,358,400	
		積水ハウス	124,200	2,630.50	326,708,100	
		麒麟ホールディングス	144,200	2,076.00	299,359,200	
		日本たばこ産業	109,000	2,766.50	301,548,500	
		クラレ	98,600	1,198.00	118,122,800	
		住友化学	468,500	449.00	210,356,500	
		東ソー	81,200	1,765.00	143,318,000	
		三菱瓦斯化学	53,500	1,937.00	103,629,500	
		三井化学	58,600	3,265.00	191,329,000	
		J S R	64,200	3,025.00	194,205,000	
三菱ケミカルグループ	423,400	775.80	328,473,720			

積水化学工業	119,700	1,836.00	219,769,200
花王	55,200	5,194.00	286,708,800
関西ペイント	58,900	1,813.00	106,785,700
日東電工	37,900	8,370.00	317,223,000
武田薬品工業	70,500	4,400.00	310,200,000
参天製薬	123,200	1,109.00	136,628,800
出光興産	64,200	2,845.00	182,649,000
E N E O Sホールディングス	647,100	460.50	297,989,550
ブリヂストン	61,800	5,116.00	316,168,800
日本碍子	80,100	1,725.00	138,172,500
日本特殊陶業	49,500	2,666.00	131,967,000
J F Eホールディングス	160,500	1,593.00	255,676,500
住友金属鉱山	62,100	5,016.00	311,493,600
L I X I L	91,900	2,110.00	193,909,000
アマダ	109,100	1,193.00	130,156,300
ナブテスコ	36,300	3,050.00	110,715,000
荏原製作所	27,400	5,850.00	160,290,000
セガサミーホールディングス	54,100	2,507.00	135,628,700
東芝	63,000	4,429.00	279,027,000
セイコーエプソン	94,200	1,891.00	178,132,200
アドバンテスト	34,200	11,200.00	383,040,000
キヤノン	101,500	2,913.50	295,720,250
リコー	200,900	1,007.00	202,306,300
アイシン	47,700	3,575.00	170,527,500
本田技研工業	95,600	3,478.00	332,496,800
ヤマハ発動機	89,500	3,300.00	295,350,000
ニコン	99,900	1,281.00	127,971,900
凸版印刷	85,800	2,655.00	227,799,000
大日本印刷	77,300	3,740.00	289,102,000
任天堂	52,400	5,198.00	272,375,200
東北電力	149,200	663.00	98,919,600
九州電力	130,100	757.00	98,485,700
ヤマトホールディングス	88,100	2,236.00	196,991,600
N I P P O N E X P R E S S ホールディング	24,200	7,610.00	184,162,000
日本郵船	93,200	3,166.00	295,071,200

	商船三井	88,100	3,365.00	296,456,500	
	川崎汽船	84,900	3,100.00	263,190,000	
	日本オラクル	11,000	9,150.00	100,650,000	
	日本電信電話	77,100	3,929.00	302,925,900	
	KDDI	72,800	4,034.00	293,675,200	
	ソフトバンク	194,800	1,498.50	291,907,800	
	ソフトバンクグループ	51,400	5,169.00	265,686,600	
	双日	53,500	2,754.00	147,339,000	
	アルフレッサ ホールディングス	55,000	1,765.00	97,075,000	
	三井物産	75,200	3,943.00	296,513,600	
	住友商事	132,000	2,287.00	301,884,000	
	三菱商事	67,700	4,708.00	318,731,600	
	丸井グループ	54,400	2,035.00	110,704,000	
	ヤマダホールディングス	227,400	462.00	105,058,800	
	野村不動産ホールディングス	39,000	2,922.00	113,958,000	
	飯田グループホールディングス	46,900	2,124.00	99,615,600	
	電通グループ	69,900	4,640.00	324,336,000	
	ユー・エス・エス	61,700	2,180.00	134,506,000	
	日本郵政	261,300	1,088.50	284,425,050	
	小計			15,326,183,370	
	銘柄数：70				
	組入時価比率：97.6%			100.0%	
	合計			15,326,183,370	

(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4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。