



2024年4月期 (2023年10月8日～2024年4月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended April 2024 (October 8, 2023 – April 7, 2024)

2024年5月17日
 May 17, 2024

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 日経平均高配当株50指数連動型上場投信
 コード番号 (1489)
 連動対象指標 日経平均高配当株50指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 代表者名 CEO 兼代表取締役社長 小池 広靖
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 長坂 智 TEL 0120-753104

Fund name: NEXT FUNDS Nikkei 225 High Dividend Yield Stock 50 Index Exchange Traded Fund
 Code: 1489
 Underlying index: Nikkei 225 High Dividend Yield Stock 50 Index
 Primary invested assets: Stocks
 Trading unit: 1 unit
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Hiroyasu Koike, President & CEO
 Contact person: Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team

有価証券報告書提出予定日 2024年6月25日
 分配金支払開始日 2024年5月16日
 Scheduled date of submission of securities report: June 25, 2024
 Date of commencing dividend payment: May 16, 2024

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2024年4月期の運用状況 (2023年10月8日～2024年4月7日)

Management Status for Period ended April 2024 (from October 8, 2023 to April 7, 2024)

(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.	%
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	242,310	(97.7)	5,715	(2.3)	248,025	(100.0)
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	181,844	(97.5)	4,636	(2.5)	186,481	(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
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	3,329	41,203	31,220	109,867
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	1,970	1,728	369	3,329

(注) 2024年1月19日付で受益権口数1口につき、30口の割合をもって再分割を行っております。前計算期間の末日に再分割が行われたと仮定して発行済口数を算定しております。

(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/当特定期間末発行済口数)×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
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	251,607	3,581	248,025	2,258
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	189,770	3,288	186,481	1,867

(注) 2024年1月19日付で受益権口数1口につき、30口の割合をもって再分割を行っております。前計算期間の末日に再分割が行われたと仮定して1口当り基準価額を算定しております。

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	30
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	893

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 (2023年10月7日現在) Prior period As of October 7, 2023	当期 (2024年4月7日現在) Present period As of April 7, 2024
	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	1,511,699,661	2,096,868,569
株式 Stocks	181,844,990,540	242,310,142,280
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	15,479,915
未収入金 Accounts receivable - other	2,991,985,916	3,293,989,650
未収配当金 Accrued dividends receivable	3,051,967,150	3,609,370,150
未収利息 Accrued interest	-	13,146
差入委託証拠金 Margin deposits	369,430,000	281,208,617
流動資産合計 Total current assets	189,770,073,267	251,607,072,327
資産合計 Total assets	189,770,073,267	251,607,072,327
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	177,493,505	71,111,396
未払収益分配金 Unpaid dividends	2,973,224,747	3,296,011,410
未払受託者報酬 Trustee fees payable	18,426,420	27,918,710
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	84,761,507	128,426,036
未払利息 Accrued interest expenses	2,528	-
その他未払費用 Other accrued expenses	34,586,768	58,192,164
流動負債合計 Total current liabilities	3,288,495,475	3,581,659,716
負債合計 Total liabilities	3,288,495,475	3,581,659,716

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	116, 115, 580, 125	127, 720, 442, 138
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	70, 365, 997, 667	120, 304, 970, 473
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	2, 442, 289	84, 371, 046
元本等合計 Total principal and other	186, 481, 577, 792	248, 025, 412, 611
純資産合計 Total net assets	186, 481, 577, 792	248, 025, 412, 611
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	189, 770, 073, 267	251, 607, 072, 327

(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 2023年4月8日 至 2023年10月7日 Prior period From April 8, 2023 to October 7, 2023	当期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日 Present period From October 8, 2023 to April 7, 2024
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	3, 390, 028, 950	4, 170, 261, 750
受取利息 Interest income	-	74, 135
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	18, 923, 433, 296	35, 299, 558, 391
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	351, 340, 264	425, 154, 224
その他収益 Other revenue	530	447
営業収益合計 Total operating revenue	22, 664, 803, 040	39, 895, 048, 947
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	424, 944	185, 878
受託者報酬 Trustee fees	30, 923, 883	52, 624, 324
委託者報酬 Investment trust management fees	142, 249, 797	242, 071, 825
その他費用 Other expenses	36, 324, 791	71, 679, 888
営業費用合計 Total operating expenses	209, 923, 415	366, 561, 915

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	22,454,879,625	39,528,487,032
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	22,454,879,625	39,528,487,032
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	22,454,879,625	39,528,487,032
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	18,685,946,703	70,365,997,667
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	37,620,477,309	39,209,026,832
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	37,620,477,309	39,209,026,832
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	5,216,790,215	25,076,695,398
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	5,216,790,215	25,076,695,398
分配金 Dividends	3,178,515,755	3,721,845,660
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	70,365,997,667	120,304,970,473

(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る場合、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、2023年10月8日から2024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。

(追加情報)

当期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日
(1) 2024年1月18日の最終の受益者名簿に記載された受益者の有する受益権口数1口につき、30口の割合をもって再分割を行っております。 (2) 再分割により増加した受益権口数 80,923,456口 (3) 再分割による受益権の効力発生日 2024年1月19日

(貸借対照表に関する注記)

前期 2023年10月7日現在	当期 2024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 3,329,479口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 109,867,047口
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 1,867円	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 2,258円

(注) 2024年1月19日付で受益権口数1口につき、30口の割合をもって再分割を行っております。前計算期間の末日に再分割が行われたと仮定して1口当たり純資産額を算定しております。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日	当期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日																																																																																																																								
1. 分配金の計算過程 2023年4月8日から2023年7月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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>290,271,369円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>851,979円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>291,123,348円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>85,053,467円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>206,069,881円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>205,291,008円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>778,873円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>1,973,952口</td></tr> <tr><td>1口当たり分配金</td><td>I=F/H</td><td>104円</td></tr> </tbody> </table> 2023年7月8日から2023年10月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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>3,099,333,167円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>778,873円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>3,100,112,040円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>124,445,004円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>2,975,667,036円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>2,973,224,747円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>2,442,289円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>3,329,479口</td></tr> <tr><td>1口当たり分配金</td><td>I=F/H</td><td>893円</td></tr> </tbody> </table> 2. その他費用 その他費用のうち31,119,649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	290,271,369円	分配準備積立金	B	851,979円	配当等収益合計額	C=A+B	291,123,348円	経費	D	85,053,467円	収益分配可能額	E=C-D	206,069,881円	収益分配金	F	205,291,008円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	778,873円	口数	H	1,973,952口	1口当たり分配金	I=F/H	104円	項目			当期配当等収益額	A	3,099,333,167円	分配準備積立金	B	778,873円	配当等収益合計額	C=A+B	3,100,112,040円	経費	D	124,445,004円	収益分配可能額	E=C-D	2,975,667,036円	収益分配金	F	2,973,224,747円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,442,289円	口数	H	3,329,479口	1口当たり分配金	I=F/H	893円	1. 分配金の計算過程 2023年10月8日から2024年1月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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>593,290,279円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>2,442,289円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>595,732,568円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>168,093,630円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>427,638,938円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>425,834,250円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>1,804,688円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>2,838,895口</td></tr> <tr><td>1口当たり分配金</td><td>I=F/H</td><td>150円</td></tr> </tbody> </table> 2024年1月8日から2024年4月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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>3,576,860,175円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>1,804,688円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>3,578,664,863円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>198,282,407円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>3,380,382,456円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>3,296,011,410円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>84,371,046円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>109,867,047口</td></tr> <tr><td>1口当たり分配金</td><td>I=F/H</td><td>30円</td></tr> </tbody> </table> 2. その他費用 その他費用のうち52,966,899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	593,290,279円	分配準備積立金	B	2,442,289円	配当等収益合計額	C=A+B	595,732,568円	経費	D	168,093,630円	収益分配可能額	E=C-D	427,638,938円	収益分配金	F	425,834,250円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,804,688円	口数	H	2,838,895口	1口当たり分配金	I=F/H	150円	項目			当期配当等収益額	A	3,576,860,175円	分配準備積立金	B	1,804,688円	配当等収益合計額	C=A+B	3,578,664,863円	経費	D	198,282,407円	収益分配可能額	E=C-D	3,380,382,456円	収益分配金	F	3,296,011,410円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	84,371,046円	口数	H	109,867,047口	1口当たり分配金	I=F/H	30円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	290,271,369円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	851,979円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	291,123,348円																																																																																																																							
経費	D	85,053,467円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	206,069,881円																																																																																																																							
収益分配金	F	205,291,008円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	778,873円																																																																																																																							
口数	H	1,973,952口																																																																																																																							
1口当たり分配金	I=F/H	104円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	3,099,333,167円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	778,873円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	3,100,112,040円																																																																																																																							
経費	D	124,445,004円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	2,975,667,036円																																																																																																																							
収益分配金	F	2,973,224,747円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,442,289円																																																																																																																							
口数	H	3,329,479口																																																																																																																							
1口当たり分配金	I=F/H	893円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	593,290,279円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	2,442,289円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	595,732,568円																																																																																																																							
経費	D	168,093,630円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	427,638,938円																																																																																																																							
収益分配金	F	425,834,250円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,804,688円																																																																																																																							
口数	H	2,838,895口																																																																																																																							
1口当たり分配金	I=F/H	150円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	3,576,860,175円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	1,804,688円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	3,578,664,863円																																																																																																																							
経費	D	198,282,407円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	3,380,382,456円																																																																																																																							
収益分配金	F	3,296,011,410円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	84,371,046円																																																																																																																							
口数	H	109,867,047口																																																																																																																							
1口当たり分配金	I=F/H	30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 2023年4月8日	当期 自 2023年10月8日
-------------------	--------------------

至 2023年10月7日	至 2024年4月7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、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。</p> <p>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。</p> <p>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>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 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。</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

前期 2023年10月7日現在	当期 2024年4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。</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>	<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)

前期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日	当期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日
<p>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。</p>	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

前期	当期

自 2023年4月8日 至 2023年10月7日		自 2023年10月8日 至 2024年4月7日	
期首元本額	68,733,603,000円	期首元本額	116,115,580,125円
期中追加設定元本額	60,271,114,500円	期中追加設定元本額	47,899,024,575円
期中一部交換元本額	12,889,137,375円	期中一部交換元本額	36,294,162,562円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日	当期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日
	損益に含まれた評価差額 (円)	
株式	4,760,560,540	21,573,021,489
合計	4,760,560,540	21,573,021,489

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(2023年10月7日現在)				当期(2024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	4,680,765,000	—	4,503,370,000	△177,493,505	5,656,949,016	—	5,601,420,000	△55,631,481
合計	4,680,765,000	—	4,503,370,000	△177,493,505	5,656,949,016	—	5,601,420,000	△55,631,481

(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(2024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	3,525,800	2,470.00	8,708,726,000	
		長谷工コーポレーション	740,000	1,860.00	1,376,400,000	
		積水ハウス	1,152,200	3,496.00	4,028,091,200	
		日本たばこ産業	1,986,700	4,098.00	8,141,496,600	
		東ソー	1,499,200	2,150.00	3,223,280,000	
		デンカ	441,100	2,325.00	1,025,557,500	
		三井化学	544,200	4,414.00	2,402,098,800	

三菱ケミカルグループ	3,775,000	909.50	3,433,362,500
UBE	474,600	2,746.50	1,303,488,900
D I C	390,500	2,995.00	1,169,547,500
武田薬品工業	1,161,200	4,120.00	4,784,144,000
出光興産	5,928,000	1,041.00	6,171,048,000
E N E O Sホールディングス	9,875,800	727.00	7,179,706,600
ブリヂストン	599,100	6,575.00	3,939,082,500
A G C	586,600	5,538.00	3,248,590,800
日本電気硝子	449,500	3,791.00	1,704,054,500
日本製鉄	2,224,100	3,595.00	7,995,639,500
神戸製鋼所	3,285,300	1,975.50	6,490,110,150
J F Eホールディングス	2,802,600	2,480.50	6,951,849,300
三井金属鉱業	362,200	4,777.00	1,730,229,400
アマダ	679,600	1,673.50	1,137,310,600
セイコーエプソン	795,800	2,654.50	2,112,451,100
キヤノン	1,207,600	4,408.00	5,323,100,800
いすゞ自動車	2,195,700	2,041.00	4,481,423,700
シチズン時計	1,318,000	1,045.00	1,377,310,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディング	236,300	7,557.00	1,785,719,100
日本郵船	1,637,600	4,079.00	6,679,770,400
商船三井	1,902,200	4,525.00	8,607,455,000
川崎汽船	5,779,400	1,996.00	11,535,682,400
ソフトバンク	4,065,700	1,921.00	7,810,209,700
双日	1,205,700	3,948.00	4,760,103,600
三井物産	932,500	7,071.00	6,593,707,500
住友商事	1,667,700	3,666.00	6,113,788,200
三菱商事	2,322,400	3,472.00	8,063,372,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3,641,600	761.00	2,771,257,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,686,600	1,525.50	8,674,908,300
りそなホールディングス	5,293,100	956.00	5,060,203,600
三井住友トラスト・ホールディングス	1,323,900	3,201.00	4,237,803,900
三井住友フィナンシャルグループ	936,000	8,741.00	8,181,576,000
ふくおかフィナンシャルグループ	828,300	3,969.00	3,287,522,700

	みずほフィナンシャルグループ	2,718,200	2,933.50	7,973,839,700	
	大和証券グループ本社	3,251,600	1,118.50	3,636,914,600	
	野村ホールディングス	5,142,900	922.70	4,745,353,830	
	SOMPOホールディングス	2,547,400	3,167.00	8,067,615,800	
	MS & ADインシュアランスグループホール	2,265,800	2,746.00	6,221,886,800	
	東京海上ホールディングス	1,475,300	4,760.00	7,022,428,000	
	T & Dホールディングス	1,402,200	2,627.50	3,684,280,500	
	日本郵政	4,907,700	1,499.00	7,356,642,300	
	小計 銘柄数：48			242,310,142,280	
	組入時価比率：97.7%			100.0%	
	合計			242,310,142,280	

(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(2024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。