



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 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 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	28,684	(99.0)	300	(1.0)	28,984	(100.0)
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	19,422	(98.2)	364	(1.8)	19,786	(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	13,641	4,295	888	17,049
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	12,760	4,494	3,612	13,641

(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
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	29,347	363	28,984	170,004
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	20,048	261	19,786	145,047

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	1,900
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	1,600

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	351,485,431	286,240,291
株式 Stocks	19,422,193,700	28,684,066,130
未収入金 Accounts receivable - other	-	1,089,110
未収配当金 Accrued dividends receivable	225,254,240	343,899,350
未収利息 Accrued interest	-	1,794
差入委託証拠金 Margin deposits	49,407,700	32,300,516
流動資産合計 Total current assets	20,048,341,071	29,347,597,191
資産合計 Total assets	20,048,341,071	29,347,597,191
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	14,890,125	7,034,120
未払金 Accounts payable - other	10,409,900	1,427,814
未払収益分配金 Unpaid dividends	218,267,408	323,932,311
未払受託者報酬 Trustee fees payable	2,464,635	3,783,385
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	11,337,287	17,403,534
未払利息 Accrued interest expenses	588	-
その他未払費用 Other accrued expenses	4,122,455	9,899,063
流動負債合計 Total current liabilities	261,492,398	363,480,227
負債合計 Total liabilities	261,492,398	363,480,227

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	13,641,713,000	17,049,069,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	6,145,135,673	11,935,047,964
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	10,199,599	8,093,757
元本等合計 Total principal and other	19,786,848,673	28,984,116,964
純資産合計 Total net assets	19,786,848,673	28,984,116,964
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	20,048,341,071	29,347,597,191

(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	291,884,090	434,997,650
受取利息 Interest income	-	9,968
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	2,103,835,633	3,971,453,177
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	48,671,245	50,164,901
その他収益 Other revenue	2,495	1,482
営業収益合計 Total operating revenue	2,444,393,463	4,456,627,178
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	71,817	20,200
受託者報酬 Trustee fees	4,365,852	6,889,453
委託者報酬 Investment trust management fees	20,082,860	31,691,427
その他費用 Other expenses	4,274,676	8,026,159
営業費用合計	28,795,205	46,627,239

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	2,415,598,258	4,409,999,939
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	2,415,598,258	4,409,999,939
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	2,415,598,258	4,409,999,939
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	2,943,705,798	6,145,135,673
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	2,065,919,635	2,274,855,285
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	2,065,919,635	2,274,855,285
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	1,017,679,290	504,455,230
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	1,017,679,290	504,455,230
分配金 Dividends	262,408,728	390,487,703
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	6,145,135,673	11,935,047,964

(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、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。

(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 13,641,713 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 17,049,069 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 1,450.47 円 (100口当たり純資産額) (145,047 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 1,700.04 円 (100口当たり純資産額) (170,004 円)

(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																																																																																																																								
<p>1. 分配金の計算過程</p> <p>2023年4月8日から2023年7月7日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>57,473,694 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>9,516,947 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>66,990,641 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>12,533,224 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>54,457,417 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>44,141,320 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>10,316,097 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>11,035,330 口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>400 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2023年7月8日から2023年10月7日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>234,341,074 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>10,316,097 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>244,657,171 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>16,190,164 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>228,467,007 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>218,267,408 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>10,199,599 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>13,641,713 口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,600 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち3,496,940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	57,473,694 円	分配準備積立金	B	9,516,947 円	配当等収益合計額	C=A+B	66,990,641 円	経費	D	12,533,224 円	収益分配可能額	E=C-D	54,457,417 円	収益分配金	F	44,141,320 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	10,316,097 円	口数	H	11,035,330 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	400 円	項目			当期配当等収益額	A	234,341,074 円	分配準備積立金	B	10,316,097 円	配当等収益合計額	C=A+B	244,657,171 円	経費	D	16,190,164 円	収益分配可能額	E=C-D	228,467,007 円	収益分配金	F	218,267,408 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	10,199,599 円	口数	H	13,641,713 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,600 円	<p>1. 分配金の計算過程</p> <p>2023年10月8日から2024年1月7日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>88,346,963 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>10,199,599 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>98,546,562 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>20,468,882 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>78,077,680 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>66,555,392 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>11,522,288 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>16,638,848 口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>400 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2024年1月8日から2024年4月7日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>346,641,937 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>11,522,288 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>358,164,225 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>26,138,157 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>332,026,068 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>323,932,311 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>8,093,757 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>17,049,069 口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,900 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち5,511,500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	88,346,963 円	分配準備積立金	B	10,199,599 円	配当等収益合計額	C=A+B	98,546,562 円	経費	D	20,468,882 円	収益分配可能額	E=C-D	78,077,680 円	収益分配金	F	66,555,392 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,522,288 円	口数	H	16,638,848 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	400 円	項目			当期配当等収益額	A	346,641,937 円	分配準備積立金	B	11,522,288 円	配当等収益合計額	C=A+B	358,164,225 円	経費	D	26,138,157 円	収益分配可能額	E=C-D	332,026,068 円	収益分配金	F	323,932,311 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,093,757 円	口数	H	17,049,069 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,900 円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	57,473,694 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	9,516,947 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	66,990,641 円																																																																																																																							
経費	D	12,533,224 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	54,457,417 円																																																																																																																							
収益分配金	F	44,141,320 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	10,316,097 円																																																																																																																							
口数	H	11,035,330 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	400 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	234,341,074 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	10,316,097 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	244,657,171 円																																																																																																																							
経費	D	16,190,164 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	228,467,007 円																																																																																																																							
収益分配金	F	218,267,408 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	10,199,599 円																																																																																																																							
口数	H	13,641,713 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,600 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	88,346,963 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	10,199,599 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	98,546,562 円																																																																																																																							
経費	D	20,468,882 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	78,077,680 円																																																																																																																							
収益分配金	F	66,555,392 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,522,288 円																																																																																																																							
口数	H	16,638,848 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	400 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	346,641,937 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	11,522,288 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	358,164,225 円																																																																																																																							
経費	D	26,138,157 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	332,026,068 円																																																																																																																							
収益分配金	F	323,932,311 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,093,757 円																																																																																																																							
口数	H	17,049,069 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,900 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 至 2023年10月7日	当期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>同左</p>

<p>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</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っております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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>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 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</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>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</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>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>	<p>同左</p>

(その他の注記)

1 元本の移動

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
期首元本額 12,760,469,000円	期首元本額 13,641,713,000円
期中追加設定元本額 4,494,200,000円	期中追加設定元本額 4,295,700,000円
期中一部交換元本額 3,612,956,000円	期中一部交換元本額 888,344,000円

2 有価証券関係
 売買目的有価証券

種類	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
	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	157,061,746	2,127,974,664
合計	157,061,746	2,127,974,664

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	354,332,700	—	339,450,000	△14,890,125	277,629,170	—	270,600,000	△7,034,120
合計	354,332,700	—	339,450,000	△14,890,125	277,629,170	—	270,600,000	△7,034,120

(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	267,200	2,470.00	659,984,000	
		大成建設	76,000	5,599.00	425,524,000	
		清水建設	247,400	905.90	224,119,660	
		長谷工コーポレーション	89,800	1,860.00	167,028,000	
		鹿島建設	191,500	3,023.00	578,904,500	
		積水ハウス	162,500	3,496.00	568,100,000	
		明治ホールディングス	108,400	3,346.00	362,706,400	
		キリンホールディングス	246,300	2,125.00	523,387,500	
		日本たばこ産業	139,600	4,098.00	572,080,800	
		クラレ	135,900	1,624.00	220,701,600	
		住友化学	656,700	350.10	229,910,670	
		日産化学	53,100	5,642.00	299,590,200	
		東ソー	114,000	2,150.00	245,100,000	

三菱瓦斯化学	74,600	2,644.00	197,242,400
三井化学	77,400	4,414.00	341,643,600
積水化学工業	166,500	2,217.50	369,213,750
花王	87,700	6,145.00	538,916,500
関西ペイント	78,900	2,197.50	173,382,750
武田薬品工業	125,500	4,120.00	517,060,000
アステラス製薬	301,800	1,602.50	483,634,500
塩野義製薬	74,800	7,578.00	566,834,400
小野薬品工業	172,300	2,447.00	421,618,100
参天製薬	160,300	1,486.50	238,285,950
出光興産	467,100	1,041.00	486,251,100
E N E O Sホールディングス	908,000	727.00	660,116,000
コスモエネルギーホールディングス	29,500	7,747.00	228,536,500
ブリヂストン	87,100	6,575.00	572,682,500
A G C	85,400	5,538.00	472,945,200
太平洋セメント	54,100	3,502.00	189,458,200
日本碍子	110,600	1,999.50	221,144,700
日本特殊陶業	71,200	4,905.00	349,236,000
日本製鉄	157,500	3,595.00	566,212,500
住友金属鉱山	108,100	5,059.00	546,877,900
L I X I L	134,900	1,830.50	246,934,450
リンナイ	49,600	3,365.00	166,904,000
アマダ	153,600	1,673.50	257,049,600
ブラザー工業	109,000	2,811.50	306,453,500
セイコーエプソン	130,400	2,654.50	346,146,800
ヒロセ電機	12,500	15,250.00	190,625,000
キヤノン	140,600	4,408.00	619,764,800
リコー	249,100	1,346.00	335,288,600
本田技研工業	347,100	1,835.50	637,102,050
ヤマハ発動機	380,700	1,420.00	540,594,000
ニコン	130,800	1,525.00	199,470,000
大日本印刷	99,700	4,590.00	457,623,000
ヤマハ	64,700	3,233.00	209,175,100
東京瓦斯	157,100	3,507.00	550,949,700
ヤマトホールディングス	120,400	2,161.00	260,184,400

NIPPON EXPRESSホールディング	33,300	7,557.00	251,648,100	
日本郵船	116,400	4,079.00	474,795,600	
商船三井	112,600	4,525.00	509,515,000	
川崎汽船	252,300	1,996.00	503,590,800	
日本オラクル	15,300	11,005.00	168,376,500	
日本電信電話	2,953,100	175.00	516,792,500	
KDDI	113,400	4,405.00	499,527,000	
ソフトバンク	289,200	1,921.00	555,553,200	
ソフトバンクグループ	80,900	8,537.00	690,643,300	
双日	70,000	3,948.00	276,360,000	
アルフレッサホールディングス	81,900	2,198.00	180,016,200	
丸紅	228,300	2,608.00	595,406,400	
三井物産	96,000	7,071.00	678,816,000	
住友商事	165,400	3,666.00	606,356,400	
三菱商事	225,800	3,472.00	783,977,600	
丸井グループ	68,900	2,481.50	170,975,350	
大東建託	29,400	17,080.00	502,152,000	
野村不動産ホールディングス	52,800	4,186.00	221,020,800	
三菱地所	261,900	2,785.00	729,391,500	
電通グループ	92,500	4,165.00	385,262,500	
ユー・エス・エス	191,000	1,233.50	235,598,500	
日本郵政	404,000	1,499.00	605,596,000	
小計	銘柄数：70		28,684,066,130	
	組入時価比率：99.0%		100.0%	
合計			28,684,066,130	

(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。