



2024年4月期 (2023年10月21日～2024年4月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2024 (October 21, 2023 - April 20, 2024)

2024年5月30日
 May 30, 2024

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信
 コード番号 (1480)
 連動対象指標 野村企業価値分配指数
 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 Nomura Enterprise Value Allocation Index Exchange Traded Fund
 Code: 1480
 Underlying index: Nomura Enterprise Value Allocation 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7月17日
 分配金支払開始日 2024年5月29日
 Scheduled date of submission of securities report: July 17, 2024
 Date of commencing dividend payment: May 29, 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21日～2024年4月20日)

Management Status for Year ended April 2024 (from October 21, 2023 to April 20, 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	11,060	(98.5)	167	(1.5)	11,227	(100.0)
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	9,331	(98.3)	162	(1.7)	9,494	(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
2024 年 4 月期 FY ended Apr. 2024	426	0	0	426
2023 年 10 月期 FY ended Oct. 2023	425	15	14	426

(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/当計算期間末発行済口数)×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	11,367	139	11,227	26,343
2023 年 10 月期 FY ended Oct. 2023	9,616	121	9,494	22,276

(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	255
2023 年 10 月期 FY ended Oct. 2023	219

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 15 期 (2023 年 10 月 20 日現在) 15th Fiscal Year As of October 20, 2023	第 16 期 (2024 年 4 月 20 日現在) 16th Fiscal Year As of April 20, 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	173,346,914	184,936,338
株式 Stocks	9,331,928,490	11,060,357,120
未収配当金 Accrued dividends receivable	89,225,231	103,186,510
未収利息 Accrued interest	-	792
差入委託証拠金 Margin deposits	21,663,110	19,121,850
流動資産合計 Total current assets	9,616,163,745	11,367,602,610
資産合計 Total assets	9,616,163,745	11,367,602,610
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	7,863,920	7,271,931
未払金 Accounts payable - other	4,597,740	2,782,491
未払収益分配金 Unpaid dividends	93,342,618	108,686,610
未払受託者報酬 Trustee fees payable	2,643,229	2,952,637
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	9,515,582	10,629,451
未払利息 Accrued interest expenses	71	-
その他未払費用 Other accrued expenses	3,834,725	7,423,669
流動負債合計 Total current liabilities	121,797,885	139,746,789
負債合計 Total liabilities	121,797,885	139,746,789
純資産の部 Net assets		

元本等 Principal and other		
元本 Principal	5,477,378,922	5,477,378,922
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	4,016,986,938	5,750,476,899
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	182,245	39,013
元本等合計 Total principal and other	9,494,365,860	11,227,855,821
純資産合計 Total net assets	9,494,365,860	11,227,855,821
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	9,616,163,745	11,367,602,610

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 年 10 月 20 日 15th Fiscal Year From April 21, 2023 to October 20, 2023	第 16 期 自 2023 年 10 月 21 日 至 2024 年 4 月 20 日 16th Fiscal Year From October 21, 2023 to April 20, 2024
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	109,202,778	126,332,759
受取利息 Interest income	-	11,981
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	766,369,533	1,710,814,795
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	13,208,180	22,818,398
その他収益 Other revenue	1,155	606
営業収益合計 Total operating revenue	888,781,646	1,859,978,539
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	38,957	9,091
受託者報酬 Trustee fees	2,643,229	2,952,637
委託者報酬 Investment trust management fees	9,515,582	10,629,451
その他費用 Other expenses	3,623,100	4,210,789
営業費用合計 Total operating expenses	15,820,868	17,801,968
営業利益又は営業損失 (△)	872,960,778	1,842,176,571

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	872,960,778	1,842,176,571
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	872,960,778	1,842,176,571
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	3,209,863,596	4,016,986,938
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	166,395,198	-
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	166,395,198	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	138,890,016	-
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	138,890,016	-
分配金 Dividends	93,342,618	108,686,610
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	4,016,986,938	5,750,476,899

(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	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2023年10月21日から2024年4月20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 15 期 2023 年 10 月 20 日現在	第 16 期 2024 年 4 月 20 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 426, 222 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 426, 222 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 22, 276 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 26, 343 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 年 10 月 20 日	第 16 期 自 2023 年 10 月 21 日 至 2024 年 4 月 20 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: 30%;"></th> <th style="width: 40%;"></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;">109, 164, 976 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;">141, 798 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;">109, 306, 774 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">15, 781, 911 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;">93, 524, 863 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">93, 342, 618 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;">182, 245 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">426, 222 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H</td> <td style="text-align: right;">219 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち 3, 173, 931 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	109, 164, 976 円	分配準備積立金	B	141, 798 円	配当等収益合計額	C=A+B	109, 306, 774 円	経費	D	15, 781, 911 円	収益分配可能額	E=C-D	93, 524, 863 円	収益分配金	F	93, 342, 618 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	182, 245 円	口数	H	426, 222 口	1 口当たり分配金	I=F/H	219 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: 30%;"></th> <th style="width: 40%;"></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;">126, 336, 255 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;">182, 245 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;">126, 518, 500 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">17, 792, 877 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;">108, 725, 623 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">108, 686, 610 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;">39, 013 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">426, 222 口</td> </tr> <tr> <td>1 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H</td> <td style="text-align: right;">255 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち 3, 543, 108 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	126, 336, 255 円	分配準備積立金	B	182, 245 円	配当等収益合計額	C=A+B	126, 518, 500 円	経費	D	17, 792, 877 円	収益分配可能額	E=C-D	108, 725, 623 円	収益分配金	F	108, 686, 610 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	39, 013 円	口数	H	426, 222 口	1 口当たり分配金	I=F/H	255 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	109, 164, 976 円																																																											
分配準備積立金	B	141, 798 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	109, 306, 774 円																																																											
経費	D	15, 781, 911 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	93, 524, 863 円																																																											
収益分配金	F	93, 342, 618 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	182, 245 円																																																											
口数	H	426, 222 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	219 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	126, 336, 255 円																																																											
分配準備積立金	B	182, 245 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	126, 518, 500 円																																																											
経費	D	17, 792, 877 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	108, 725, 623 円																																																											
収益分配金	F	108, 686, 610 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	39, 013 円																																																											
口数	H	426, 222 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	255 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 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 年 10 月 20 日	第 16 期 自 2023 年 10 月 21 日 至 2024 年 4 月 20 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。 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。</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</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>

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。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 15 期 2023 年 10 月 20 日現在	第 16 期 2024 年 4 月 20 日現在
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 せん。 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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 年 10 月 20 日	第 16 期 自 2023 年 10 月 21 日 至 2024 年 4 月 20 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 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 年 10 月 20 日	第 16 期 自 2023 年 10 月 21 日 至 2024 年 4 月 20 日
期首元本額 5,462,034,828 円	期首元本額 5,477,378,922 円
期中追加設定元本額 205,590,298 円	期中追加設定元本額 0 円
期中一部交換元本額 190,246,204 円	期中一部交換元本額 0 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 15 期 自 2023 年 4 月 21 日 至 2023 年 10 月 20 日	第 16 期 自 2023 年 10 月 21 日 至 2024 年 4 月 20 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	675,673,208	1,710,763,093
合計	675,673,208	1,710,763,093

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 15 期(2023 年 10 月 20 日現在)			第 16 期(2024 年 4 月 20 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)
市場取引						
株価指数先物取引						

買建	167,677,110	—	159,821,000	△7,863,920	172,703,001	—	165,438,000	△7,271,931
合計	167,677,110	—	159,821,000	△7,863,920	172,703,001	—	165,438,000	△7,271,931

(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20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	INPEX	26,200	2,409.00	63,115,800	
		大林組	17,100	1,691.00	28,916,100	
		長谷工コーポレーション	5,000	1,800.00	9,000,000	
		鹿島建設	11,100	2,834.50	31,462,950	
		住友林業	3,600	4,330.00	15,588,000	
		大和ハウス工業	13,500	4,220.00	56,970,000	
		積水ハウス	14,400	3,350.00	48,240,000	
		エクシオグループ	4,800	1,651.00	7,924,800	
		森永製菓	1,900	2,471.50	4,695,850	
		カルビー	2,200	3,343.00	7,354,600	
		ヤクルト本社	6,600	2,978.50	19,658,100	
		明治ホールディングス	6,100	3,435.00	20,953,500	
		アサヒグループホールディングス	10,700	5,299.00	56,699,300	
		キリンホールディングス	20,000	2,215.50	44,310,000	
		宝ホールディングス	3,700	1,000.00	3,700,000	
		サントリー食品インターナショナル	3,100	5,018.00	15,555,800	
		キッコーマン	18,000	1,861.00	33,498,000	
		味の素	11,500	5,372.00	61,778,000	
		ニチレイ	2,400	3,869.00	9,285,600	
		日清食品ホールディングス	4,700	4,065.00	19,105,500	
日本たばこ産業	27,900	4,072.00	113,608,800			
ゴールドウイン	700	8,990.00	6,293,000			
レンゴー	4,700	1,156.00	5,433,200			

クラレ	7,700	1,690.00	13,013,000
旭化成	31,200	1,095.00	34,164,000
レゾナック・ホールディングス	4,400	3,732.00	16,420,800
住友化学	36,600	343.60	12,575,760
日産化学	2,900	5,432.00	15,752,800
東ソー	6,300	2,106.50	13,270,950
トクヤマ	1,600	2,814.00	4,502,400
デンカ	1,900	2,220.00	4,218,000
信越化学工業	46,700	6,129.00	286,224,300
エア・ウォーター	4,000	2,276.50	9,106,000
カネカ	1,200	3,890.00	4,668,000
三菱瓦斯化学	4,200	2,732.50	11,476,500
三井化学	4,600	4,410.00	20,286,000
東京応化工業	2,500	4,141.00	10,352,500
三菱ケミカルグループ	33,600	898.80	30,199,680
ダイセル	6,600	1,390.00	9,174,000
住友ベークライト	1,600	4,336.00	6,937,600
積水化学工業	9,300	2,223.50	20,678,550
日本ゼオン	3,100	1,364.00	4,228,400
ADEKA	1,800	3,141.00	5,653,800
花王	11,800	6,273.00	74,021,400
日本ペイントホールディングス	17,000	948.70	16,127,900
D I C	1,800	2,857.00	5,142,600
富士フイルムホールディングス	27,000	3,330.00	89,910,000
ライオン	6,000	1,352.50	8,115,000
ミルボン	600	2,946.00	1,767,600
ポーラ・オルビスホールディングス	2,200	1,388.00	3,053,600
小林製薬	1,400	5,504.00	7,705,600
デクセリアルズ	1,500	5,725.00	8,587,500
日東電工	3,900	13,755.00	53,644,500
エフピコ	1,100	2,573.50	2,830,850
ユニ・チャーム	9,500	4,424.00	42,028,000
協和キリン	6,500	2,609.00	16,958,500
武田薬品工業	29,700	4,069.00	120,849,300
アステラス製薬	48,100	1,480.50	71,212,050

住友ファーマ	3,800	389.00	1,478,200
塩野義製薬	6,800	7,114.00	48,375,200
日本新薬	1,200	4,205.00	5,046,000
中外製薬	15,600	4,921.00	76,767,600
エーザイ	6,800	5,901.00	40,126,800
ロート製薬	4,900	2,918.50	14,300,650
小野薬品工業	9,500	2,238.00	21,261,000
JCRファーマ	1,700	781.00	1,327,700
第一三共	45,400	4,636.00	210,474,400
大塚ホールディングス	10,500	6,186.00	64,953,000
出光興産	25,000	1,024.00	25,600,000
Eneosホールディングス	82,300	720.10	59,264,230
横浜ゴム	2,600	3,936.00	10,233,600
TOYO TIRE	2,700	2,859.50	7,720,650
ブリヂストン	14,300	6,692.00	95,695,600
住友ゴム工業	4,000	1,859.00	7,436,000
AGC	4,800	5,668.00	27,206,400
東海カーボン	4,800	1,022.00	4,905,600
TOTO	3,600	4,199.00	15,116,400
日本碍子	6,300	2,014.00	12,688,200
日本特殊陶業	3,900	5,017.00	19,566,300
フジインコーポレーテッド	1,100	3,310.00	3,641,000
日本製鉄	21,200	3,412.00	72,334,400
JFEホールディングス	12,500	2,348.00	29,350,000
住友金属鉱山	6,000	5,127.00	30,762,000
住友電気工業	18,000	2,384.50	42,921,000
SUMCO	8,600	2,361.50	20,308,900
三和ホールディングス	4,800	2,452.50	11,772,000
リンナイ	2,800	3,300.00	9,240,000
アマダ	8,500	1,661.50	14,122,750
FUJ I	1,900	2,505.00	4,759,500
DMG森精機	3,000	4,162.00	12,486,000
ディスコ	2,400	49,800.00	119,520,000
ナブテスコ	2,800	2,509.50	7,026,600
SMC	1,600	76,700.00	122,720,000

小松製作所	23,100	4,353.00	100,554,300
住友重機械工業	2,800	4,510.00	12,628,000
日立建機	2,800	4,484.00	12,555,200
クボタ	25,100	2,390.50	60,001,550
荏原製作所	2,100	12,780.00	26,838,000
ダイキン工業	6,200	19,215.00	119,133,000
栗田工業	2,600	5,836.00	15,173,600
ダイフク	7,800	3,165.00	24,687,000
CKD	1,300	2,889.00	3,755,700
竹内製作所	900	5,690.00	5,121,000
セガサミーホールディングス	4,200	1,964.00	8,248,800
THK	3,000	3,266.00	9,798,000
マキタ	5,900	4,143.00	24,443,700
イビデン	2,800	5,931.00	16,606,800
ブラザー工業	6,100	2,792.00	17,031,200
ミネベアミツミ	8,500	2,746.00	23,341,000
日立製作所	25,100	13,330.00	334,583,000
三菱電機	48,000	2,458.00	117,984,000
富士電機	3,300	9,741.00	32,145,300
安川電機	6,000	5,980.00	35,880,000
オムロン	4,800	5,012.00	24,057,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,600	2,905.50	4,648,800
日本電気	6,600	10,780.00	71,148,000
富士通	46,000	2,448.00	112,608,000
ルネサスエレクトロニクス	30,300	2,396.50	72,613,950
セイコーエプソン	7,400	2,629.50	19,458,300
ワコム	3,900	580.00	2,262,000
パナソニック ホールディングス	58,200	1,359.00	79,093,800
アンリツ	3,400	1,179.50	4,010,300
TDK	10,000	7,078.00	70,780,000
ヒロセ電機	700	15,800.00	11,060,000
横河電機	5,900	3,380.00	19,942,000
アズビル	2,800	4,179.00	11,701,200
日本光電工業	1,900	4,096.00	7,782,400
堀場製作所	900	14,315.00	12,883,500

アドバンテスト	20,200	5,484.00	110,776,800
キーエンス	4,600	62,600.00	287,960,000
シスメックス	11,700	2,322.00	27,167,400
フェローテックホールディングス	1,100	2,770.00	3,047,000
レーザーテック	1,900	34,350.00	65,265,000
山一電機	500	2,528.00	1,264,000
日本電子	1,100	6,386.00	7,024,600
ファナック	25,900	4,265.00	110,463,500
ローム	8,700	2,126.00	18,496,200
浜松ホトニクス	3,700	5,448.00	20,157,600
三井ハイテック	400	6,766.00	2,706,400
新光電気工業	1,700	5,516.00	9,377,200
京セラ	32,700	1,902.00	62,195,400
太陽誘電	3,100	3,522.00	10,918,200
村田製作所	44,200	2,677.00	118,323,400
S C R E E Nホールディングス	2,000	16,810.00	33,620,000
キヤノン	25,400	4,351.00	110,515,400
リコー	15,700	1,354.50	21,265,650
東京エレクトロン	12,100	33,530.00	405,713,000
トヨタ紡織	1,400	2,414.50	3,380,300
豊田自動織機	3,800	13,810.00	52,478,000
デンソー	43,600	2,819.50	122,930,200
いすゞ自動車	14,200	1,930.50	27,413,100
トヨタ自動車	123,200	3,522.00	433,910,400
アイシン	3,700	6,068.00	22,451,600
スズキ	36,400	1,711.50	62,298,600
S U B A R U	14,900	3,300.00	49,170,000
ヤマハ発動機	21,000	1,379.50	28,969,500
シマノ	1,900	23,200.00	44,080,000
テイ・エス テック	2,100	1,889.00	3,966,900
テルモ	32,200	2,538.50	81,739,700
島津製作所	5,700	4,104.00	23,392,800
ナカニシ	1,700	2,163.00	3,677,100
東京精密	1,000	10,770.00	10,770,000
ニコン	7,800	1,521.00	11,863,800

トプコン	2,600	1,719.50	4,470,700
オリンパス	28,700	2,096.50	60,169,550
HOYA	9,600	17,320.00	166,272,000
朝日インテック	5,900	2,141.00	12,631,900
メニコン	1,600	1,459.00	2,334,400
ニプロ	3,700	1,234.50	4,567,650
バンダイナムコホールディングス	15,000	2,841.50	42,622,500
TOPPANホールディングス	6,700	3,546.00	23,758,200
ヤマハ	3,600	3,172.00	11,419,200
ピジョン	2,900	1,381.50	4,006,350
任天堂	29,000	7,455.00	216,195,000
S Gホールディングス	8,500	1,780.50	15,134,250
日本郵船	12,800	4,153.00	53,158,400
商船三井	8,700	4,590.00	39,933,000
T I S	5,000	3,211.00	16,055,000
ネクソン	12,400	2,332.00	28,916,800
インターネットイニシアティブ	2,600	2,723.00	7,079,800
野村総合研究所	9,300	3,884.00	36,121,200
L I N Eヤフー	71,900	347.50	24,985,250
トレンドマイクロ	3,700	7,714.00	28,541,800
フューチャー	1,100	1,749.00	1,923,900
大塚商会	5,800	3,103.00	17,997,400
サイボウズ	600	1,571.00	942,600
ネットワンシステムズ	2,100	2,640.50	5,545,050
B I P R O G Y	1,900	4,528.00	8,603,200
日本電信電話	1,503,400	167.90	252,420,860
K D D I	41,300	4,252.00	175,607,600
ソフトバンク	74,300	1,818.00	135,077,400
N T Tデータグループ	17,100	2,247.00	38,423,700
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,400	5,511.00	13,226,400
カプコン	8,800	2,487.50	21,890,000
S C S K	3,900	2,696.00	10,514,400
富士ソフト	1,200	6,090.00	7,308,000
コナミグループ	2,500	9,078.00	22,695,000
双日	4,200	3,815.00	16,023,000

丸紅	39,600	2,597.50	102,861,000
豊田通商	5,300	9,306.00	49,321,800
三井物産	38,700	7,125.00	275,737,500
住友商事	28,800	3,721.00	107,164,800
三菱商事	97,400	3,452.00	336,224,800
岩谷産業	1,100	8,843.00	9,727,300
ミスミグループ本社	5,400	2,177.50	11,758,500
エービーシー・マート	2,300	3,057.00	7,031,100
アダストリア	600	3,380.00	2,028,000
くら寿司	500	4,640.00	2,320,000
日本マクドナルドホールディングス	2,200	6,880.00	15,136,000
セリア	1,100	2,831.00	3,114,100
Monotaro	6,500	1,875.50	12,190,750
マツキヨココカラ&カンパニー	8,400	2,228.50	18,719,400
ZOZO	3,000	3,314.00	9,942,000
ウエルシアホールディングス	2,300	2,262.00	5,202,600
コスモス薬品	500	14,430.00	7,215,000
セブン&アイ・ホールディングス	55,200	1,995.50	110,151,600
ツルハホールディングス	1,000	9,752.00	9,752,000
クスリのアオキホールディングス	1,300	2,743.50	3,566,550
FOOD & LIFE COMPANYIE	3,000	2,928.00	8,784,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	10,400	3,757.00	39,072,800
ゼンショーホールディングス	2,300	5,929.00	13,636,700
ワークマン	400	3,840.00	1,536,000
スギホールディングス	2,700	2,332.50	6,297,750
しまむら	1,200	7,285.00	8,742,000
ケーズホールディングス	4,000	1,466.00	5,864,000
ヤマダホールディングス	17,700	440.60	7,798,620
ニトリホールディングス	1,900	21,260.00	40,394,000
ファーストリテイリング	1,600	40,520.00	64,832,000
サンドラッグ	1,800	4,375.00	7,875,000
三井住友フィナンシャルグループ	34,000	8,536.00	290,224,000
セブン銀行	14,900	275.00	4,097,500
SBIホールディングス	6,900	3,645.00	25,150,500

東京海上ホールディングス	48,200	4,638.00	223,551,600	
芙蓉総合リース	400	13,390.00	5,356,000	
東京センチュリー	3,400	1,532.50	5,210,500	
オリックス	32,200	3,111.00	100,174,200	
三菱HCキャピタル	16,800	1,007.00	16,917,600	
大東建託	1,600	16,725.00	26,760,000	
野村不動産ホールディングス	3,000	4,061.00	12,183,000	
オープンハウスグループ	1,800	4,474.00	8,053,200	
飯田グループホールディングス	3,700	1,930.00	7,141,000	
三井不動産	67,500	1,570.50	106,008,750	
三菱地所	28,900	2,798.00	80,862,200	
UTグループ	700	3,325.00	2,327,500	
エス・エム・エス	1,800	2,185.50	3,933,900	
パーソルホールディングス	49,600	207.70	10,301,920	
カカクコム	3,500	1,717.00	6,009,500	
ディップ	900	2,698.00	2,428,200	
新日本科学	500	1,423.00	711,500	
ベネフィット・ワン	1,900	2,165.50	4,114,450	
エムスリー	7,000	1,789.50	12,526,500	
博報堂DYホールディングス	5,800	1,420.50	8,238,900	
インフォマート	4,700	372.00	1,748,400	
H. U. グループホールディングス	1,400	2,326.50	3,257,100	
サイバーエージェント	11,000	1,007.00	11,077,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,900	2,814.00	8,160,600	
Keeper 技研	300	4,245.00	1,273,500	
リクルートホールディングス	37,600	6,111.00	229,773,600	
インソース	1,200	700.00	840,000	
バイカレント・コンサルティング	3,600	3,271.00	11,775,600	
セコム	5,400	10,700.00	57,780,000	
小計 銘柄数：261			11,060,357,120	
組入時価比率：98.5%			100.0%	
合計			11,060,357,120	

(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20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。