



2024年7月期 (2024年1月8日～2024年7月7日) 決算短信  
Earnings Report for Fiscal Period ended July 2024 (January 8, 2024 - July 7, 2024)

2024年8月16日  
August 16, 2024

上場取引所 東証  
Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 日本高配当株アクティブ上場投信  
コード番号 (2084)  
連動対象指標 なし  
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 <https://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 Japan High Dividend Equity Active Exchange Traded Fund  
Code: 2084  
Underlying index: None  
Primary invested assets: Stocks  
Trading unit: 1 unit  
Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <https://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9月25日  
分配金支払開始日 2024年8月15日  
Scheduled date of submission of securities report: September 25, 2024  
Date of commencing dividend payment: August 15, 2024

I ファンドの運用状況

Fund Management

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

Management Status for Period ended July 2024 (from January 8, 2024 to July 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7月期 FY ended Jul. 2024	10,106	(99.0)	98	(1.0)	10,204	(100.0)
2024年1月期 FY ended Jan. 2024	7,425	(97.8)	164	(2.2)	7,589	(100.0)

(2) 設定・解約実績

(千口未満切捨て)

Creation and Redemption

(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)	解約口数 No. of Units Redeemed (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7月期 FY ended Jul. 2024	3,688	894	340	4,242
2024年1月期 FY ended Jan. 2024	0	3,923	235	3,688

(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7月期 FY ended Jul. 2024	10,506	302	10,204	240,565
2024年1月期 FY ended Jan. 2024	7,884	294	7,589	205,786

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2024年7月期 FY ended Jul. 2024	400
2024年1月期 FY ended Jan. 2024	1,900

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 (2024年1月7日現在) Prior period As of January 7, 2024	当期 (2024年7月7日現在) Present period As of July 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	46,535,434	185,663,097
株式 Stocks	7,425,108,150	10,106,178,500
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	478,020	-
未収入金 Accounts receivable - other	390,887,732	195,324,295
未収配当金 Accrued dividends receivable	13,097,100	18,015,100
未収利息 Accrued interest	-	1,326
差入委託証拠金 Margin deposits	7,993,084	1,723,834
流動資産合計 Total current assets	7,884,099,520	10,506,906,152
資産合計 Total assets	7,884,099,520	10,506,906,152
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払金 Accounts payable - other	214,014,585	272,047,581
未払収益分配金 Unpaid dividends	70,072,000	16,968,000
未払受託者報酬 Trustee fees payable	547,938	666,552
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	9,862,785	11,997,813
未払利息 Accrued interest expenses	93	-
その他未払費用 Other accrued expenses	208,130	449,402
流動負債合計 Total current liabilities	294,705,531	302,129,348
負債合計 Total liabilities	294,705,531	302,129,348

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	7,376,000,000	8,484,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	213,393,989	1,720,776,804
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	3,390,713	1,758,227
元本等合計 Total principal and other	7,589,393,989	10,204,776,804
純資産合計 Total net assets	7,589,393,989	10,204,776,804
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	7,884,099,520	10,506,906,152

(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9月6日 至 2024年1月7日 Prior period From September 6, 2023 to January 7, 2024	当期 自 2024年1月8日 至 2024年7月7日 Present period From January 8, 2024 to July 7, 2024
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	84,685,780	179,478,420
受取利息 Interest income	-	21,422
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	223,085,176	1,416,402,061
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	183,130	3,903,150
その他収益 Other revenue	88	475
営業収益合計 Total operating revenue	307,954,174	1,599,805,528
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	33,842	2,519
受託者報酬 Trustee fees	547,938	1,280,869
委託者報酬 Investment trust management fees	9,862,785	23,055,429
その他費用 Other expenses	778,590	2,611,986
営業費用合計	11,223,155	26,950,803

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	296,731,019	1,572,854,725
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	296,731,019	1,572,854,725
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	296,731,019	1,572,854,725
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 (△) Distribution of profit loss from partial redemptions	-	-
期首剰余金又は期首欠損金 (△) Surplus (deficit) at beginning of period	-	213,393,989
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	7,955,100	159,610,240
当期一部解約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 redemptions	7,955,100	-
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	-	159,610,240
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	21,220,130	70,900,150
当期一部解約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 redemptions	-	70,900,150
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	21,220,130	-
分配金 Dividends	70,072,000	154,182,000
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	213,393,989	1,720,776,804

(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	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

足説明	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、2024年1月8日から2024年7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 2024年1月7日現在	当期 2024年7月7日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,688,000 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 4,242,000 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 2,057.86 円 (100口当たり純資産額) (205,786 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 2,405.65 円 (100口当たり純資産額) (240,565 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2023年9月6日 至 2024年1月7日	当期 自 2024年1月8日 至 2024年7月7日																																																																																										
1. 分配金の計算過程 2023年9月6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 style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">84,652,026 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;">84,652,026 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">11,189,313 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;">73,462,713 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">70,072,000 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;">3,390,713 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">3,688,000 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;">1,900 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	84,652,026 円	分配準備積立金	B	0 円	配当等収益合計額	C=A+B	84,652,026 円	経費	D	11,189,313 円	収益分配可能額	E=C-D	73,462,713 円	収益分配金	F	70,072,000 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,390,713 円	口数	H	3,688,000 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,900 円	1. 分配金の計算過程 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 style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">151,095,974 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;">3,390,713 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;">154,486,687 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">13,291,631 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;">141,195,056 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">137,214,000 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;">3,981,056 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">4,158,000 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;">3,300 円</td> </tr> </tbody> </table> 2024年4月8日から2024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 style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">28,401,824 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;">3,981,056 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;">32,382,880 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">13,656,653 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;">18,726,227 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">16,968,000 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;">1,758,227 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">4,242,000 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;">400 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	151,095,974 円	分配準備積立金	B	3,390,713 円	配当等収益合計額	C=A+B	154,486,687 円	経費	D	13,291,631 円	収益分配可能額	E=C-D	141,195,056 円	収益分配金	F	137,214,000 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,981,056 円	口数	H	4,158,000 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	3,300 円	項目			当期配当等収益額	A	28,401,824 円	分配準備積立金	B	3,981,056 円	配当等収益合計額	C=A+B	32,382,880 円	経費	D	13,656,653 円	収益分配可能額	E=C-D	18,726,227 円	収益分配金	F	16,968,000 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,758,227 円	口数	H	4,242,000 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	84,652,026 円																																																																																									
分配準備積立金	B	0 円																																																																																									
配当等収益合計額	C=A+B	84,652,026 円																																																																																									
経費	D	11,189,313 円																																																																																									
収益分配可能額	E=C-D	73,462,713 円																																																																																									
収益分配金	F	70,072,000 円																																																																																									
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,390,713 円																																																																																									
口数	H	3,688,000 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	151,095,974 円																																																																																									
分配準備積立金	B	3,390,713 円																																																																																									
配当等収益合計額	C=A+B	154,486,687 円																																																																																									
経費	D	13,291,631 円																																																																																									
収益分配可能額	E=C-D	141,195,056 円																																																																																									
収益分配金	F	137,214,000 円																																																																																									
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,981,056 円																																																																																									
口数	H	4,158,000 口																																																																																									
100口当たり分配金	I=F/H×100	3,300 円																																																																																									
項目																																																																																											
当期配当等収益額	A	28,401,824 円																																																																																									
分配準備積立金	B	3,981,056 円																																																																																									
配当等収益合計額	C=A+B	32,382,880 円																																																																																									
経費	D	13,656,653 円																																																																																									
収益分配可能額	E=C-D	18,726,227 円																																																																																									
収益分配金	F	16,968,000 円																																																																																									
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,758,227 円																																																																																									
口数	H	4,242,000 口																																																																																									
100口当たり分配金	I=F/H×100	400 円																																																																																									
2. 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。																																																																																											

(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 9月 6日 至 2024年 1月 7日	当期 自 2024年 1月 8日 至 2024年 7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 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。</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>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 2024年 1月 7日現在	当期 2024年 7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 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>

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2023年 9月 6日 至 2024年 1月 7日	当期 自 2024年 1月 8日 至 2024年 7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 自 2023年 9月 6日 至 2024年 1月 7日		当期 自 2024年 1月 8日 至 2024年 7月 7日	
期首元本額	—円	期首元本額	7,376,000,000円
期中追加設定元本額	7,846,000,000円	期中追加設定元本額	1,788,000,000円
期中一部解約元本額	470,000,000円	期中一部解約元本額	680,000,000円

2 有価証券関係  
 売買目的有価証券

種類	前期 自 2023年 9月 6日 至 2024年 1月 7日	当期 自 2024年 1月 8日 至 2024年 7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	249,302,215	446,018,715
合計	249,302,215	446,018,715

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(2024年 1月 7日現在)				当期(2024年 7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	95,180,000	—	95,660,000	478,020	—	—	—	—
合計	95,180,000	—	95,660,000	478,020	—	—	—	—

(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 7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	マルハニチロ	27,100	3,140.00	85,094,000	
		I N P E X	92,400	2,460.50	227,350,200	
		ミライト・ワン	37,200	2,097.00	78,008,400	
		安藤・間	48,600	1,196.00	58,125,600	
		東急建設	49,000	779.00	38,171,000	
		鹿島建設	16,300	2,814.50	45,876,350	
		東洋建設	39,600	1,482.00	58,687,200	

大和ハウス工業	19,700	4,111.00	80,986,700
日本たばこ産業	35,800	4,418.00	158,164,400
日本曹達	7,000	5,310.00	37,170,000
セントラル硝子	17,800	3,765.00	67,017,000
エア・ウォーター	34,600	2,151.00	74,424,600
三菱瓦斯化学	52,700	3,012.00	158,732,400
三井化学	14,800	4,385.00	64,898,000
三菱ケミカルグループ	44,800	909.10	40,727,680
ダイセル	130,100	1,535.00	199,703,500
日本ゼオン	89,700	1,386.50	124,369,050
UBE	22,900	2,806.00	64,257,400
ミルボン	22,000	3,338.00	73,436,000
武田薬品工業	27,300	4,243.00	115,833,900
アステラス製薬	59,800	1,616.50	96,666,700
出光興産	191,600	1,030.50	197,443,800
コスモエネルギーホールディングス	10,100	8,180.00	82,618,000
横浜ゴム	28,900	3,449.00	99,676,100
ブリヂストン	29,100	6,289.00	183,009,900
日本電気硝子	13,800	3,594.00	49,597,200
住友大阪セメント	26,100	4,047.00	105,626,700
日本製鉄	41,500	3,463.00	143,714,500
神戸製鋼所	33,900	2,012.00	68,206,800
JFEホールディングス	40,300	2,369.00	95,470,700
大和工業	9,200	8,016.00	73,747,200
淀川製鋼所	13,900	5,800.00	80,620,000
古河機械金属	15,300	1,857.00	28,412,100
住友電気工業	51,200	2,398.00	122,777,600
横河ブリッジホールディングス	14,200	2,765.00	39,263,000
SANKYO	61,600	1,844.50	113,621,200
日清紡ホールディングス	47,300	1,077.00	50,942,100
芝浦メカトロニクス	23,500	9,020.00	211,970,000
マブチモーター	19,100	2,336.50	44,627,150
ダイヘン	14,400	8,280.00	119,232,000
EIZO	8,700	4,900.00	42,630,000
ホシデン	34,200	2,102.00	71,888,400

ヒロセ電機	5,700	18,145.00	103,426,500
太陽誘電	18,500	4,523.00	83,675,500
KOA	39,100	1,532.00	59,901,200
いすゞ自動車	95,700	2,222.00	212,645,400
極東開発工業	12,100	2,515.00	30,431,500
タチエス	19,400	2,002.00	38,838,800
アイシン	13,300	5,376.00	71,500,800
本田技研工業	141,200	1,733.00	244,699,600
ビジョン	34,700	1,447.50	50,228,250
コクヨ	32,400	2,622.50	84,969,000
四国電力	76,900	1,351.50	103,930,350
大阪瓦斯	41,700	3,376.00	140,779,200
ハマキョウレックス	9,300	4,520.00	42,036,000
センコーグループホールディングス	74,900	1,104.00	82,689,600
セイノーホールディングス	47,500	2,202.00	104,595,000
SGホールディングス	62,600	1,430.00	89,518,000
NIPPON EXPRESSホールディング	8,400	7,332.00	61,588,800
日本郵船	49,000	4,923.00	241,227,000
商船三井	46,600	5,111.00	238,172,600
川崎汽船	91,900	2,700.50	248,175,950
日本航空	22,400	2,566.50	57,489,600
住友倉庫	24,500	2,668.00	65,366,000
上組	24,700	3,378.00	83,436,600
日本電信電話	802,400	155.90	125,094,160
ソフトバンク	78,000	2,039.00	159,042,000
DTS	26,200	4,135.00	108,337,000
リョーサン菱洋ホールディングス	16,700	3,070.00	51,269,000
伯東	8,200	5,230.00	42,886,000
伊藤忠商事	27,000	8,101.00	218,727,000
丸紅	75,200	3,100.00	233,120,000
三井物産	47,200	3,848.00	181,625,600
三愛オブリ	29,100	2,125.00	61,837,500
稲畑産業	22,300	3,635.00	81,060,500
サンゲツ	16,000	2,941.00	47,056,000
VTホールディングス	48,600	510.00	24,786,000

	サンドラッグ	22,500	3,932.00	88,470,000	
	コンコルディア・フィナンシャルグループ	93,000	950.30	88,377,900	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	94,600	1,816.50	171,840,900	
	りそなホールディングス	95,300	1,062.50	101,256,250	
	三井住友トラスト・ホールディングス	35,600	3,766.00	134,069,600	
	三井住友フィナンシャルグループ	19,700	11,165.00	219,950,500	
	ふくおかフィナンシャルグループ	28,500	4,295.00	122,407,500	
	セブン銀行	210,400	274.40	57,733,760	
	みずほフィナンシャルグループ	34,300	3,510.00	120,393,000	
	丸三証券	35,600	1,100.00	39,160,000	
	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	98,700	577.00	56,949,900	
	松井証券	65,600	846.00	55,497,600	
	SOMPOホールディングス	35,000	3,449.00	120,715,000	
	MS&ADインシュアランスグループホール	50,100	3,841.00	192,434,100	
	東京海上ホールディングス	26,200	6,243.00	163,566,600	
	東京センチュリー	27,000	1,511.50	40,810,500	
	UTグループ	10,600	3,315.00	35,139,000	
	H. U. グループホールディングス	29,400	2,421.00	71,177,400	
	ユー・エス・エス	122,700	1,327.50	162,884,250	
	ベルシステム24ホールディングス	47,000	1,569.00	73,743,000	
	ソラスト	49,700	470.00	23,359,000	
	ニシオホールディングス	4,500	4,020.00	18,090,000	
	メイテックグループホールディングス	30,100	3,362.00	101,196,200	
	小計 銘柄数：100			10,106,178,500	
	組入時価比率：99.0%			100.0%	
	合計			10,106,178,500	

(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7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。