



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

2024年11月29日
 November 29, 2024

		上場取引所	東証
		Listed Exchange	TSE
ファンド名	NEXT FUNDS MSCI日本株女性活躍指数(セレクト)連動型上場投信		
コード番号	(2518)		
連動対象指標	MSCI 日本株女性活躍指数(セレクト)		
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 MSCI Japan Empowering Women Select Index Exchange Traded Fund		
Code:	2518		
Underlying index:	MSCI Japan Empowering Women (WIN) Select Index		
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 2025年1月15日
 分配金支払開始日 2024年11月28日
 Scheduled date of submission of securities report: January 15, 2025
 Date of commencing dividend payment: November 28, 2024

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2024年10月期の運用状況 (2024年4月21日～2024年10月20日)

Management Status for Year ended October 2024 (from April 21, 2024 to October 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10月期 FY ended Oct. 2024	9,628	(98.5)	141	(1.5)	9,770	(100.0)
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	8,984	(98.2)	165	(1.8)	9,149	(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10月期 FY ended Oct. 2024	6,257	0	0	6,257
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	6,324	176	243	6,257

(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/当計算期間末発行済口数)×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10月期 FY ended Oct. 2024	9,885	115	9,770	156,141
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	9,264	115	9,149	146,214

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2024年10月期 FY ended Oct. 2024	1,700
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	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)

	第12期 (2024年4月20日現在) 12th Fiscal Year As of April 20, 2024	第13期 (2024年10月20日現在) 13th Fiscal Year As of October 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	154,830,976	146,126,020
株式 Stocks	8,984,229,800	9,628,639,500
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	6,347,525
未収入金 Accounts receivable - other	14,307,381	4,976,040
未収配当金 Accrued dividends receivable	96,193,847	95,518,430
未収利息 Accrued interest	662	2,866
差入委託証拠金 Margin deposits	14,912,013	4,047,269
流動資産合計 Total current assets	9,264,474,679	9,885,657,650
資産合計 Total assets	9,264,474,679	9,885,657,650
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	5,702,970	-
未払金 Accounts payable - other	1,427,970	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	100,119,216	106,376,667
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,437,767	1,604,296
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	5,751,015	6,417,112
その他未払費用 Other accrued expenses	742,017	801,571
流動負債合計 Total current liabilities	115,180,955	115,199,646
負債合計 Total liabilities	115,180,955	115,199,646

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,257,451,000	6,257,451,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	2,891,842,724	3,513,007,004
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	5,250,701	1,149,974
元本等合計 Total principal and other	9,149,293,724	9,770,458,004
純資産合計 Total net assets	9,149,293,724	9,770,458,004
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	9,264,474,679	9,885,657,650

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第12期 自 2023年10月21日 至 2024年4月20日 12th Fiscal Year From October 21, 2023 to April 20, 2024	第13期 自 2024年4月21日 至 2024年10月20日 13th Fiscal Year From April 21, 2024 to October 20, 2024
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	109,105,381	111,386,694
受取利息 Interest income	10,111	147,741
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	1,495,678,730	622,011,292
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	22,194,735	3,253,715
その他収益 Other revenue	9,054	36,211
営業収益合計 Total operating revenue	1,626,998,011	736,835,653
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	8,467	-
受託者報酬 Trustee fees	1,437,767	1,604,296
委託者報酬 Investment trust management fees	5,751,015	6,417,112
その他費用 Other expenses	1,250,264	1,273,298
営業費用合計	8,447,513	9,294,706

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	1,618,550,498	727,540,947
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	1,618,550,498	727,540,947
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	1,618,550,498	727,540,947
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	1,393,884,726	2,891,842,724
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	51,288,296	-
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	51,288,296	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	71,761,580	-
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	71,761,580	-
分配金 Dividends	100,119,216	106,376,667
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	2,891,842,724	3,513,007,004

(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、2024年4月21日から2024年10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12期 2024年4月20日現在	第13期 2024年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 6,257,451口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 6,257,451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 1,462.14円 (100口当たり純資産額) (146,214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 1,561.41円 (100口当たり純資産額) (156,141円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自2023年10月21日 至2024年4月20日	第13期 自2024年4月21日 至2024年10月20日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1" style="width: 100%;"> <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>109,116,079円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>4,692,884円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>113,808,963円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>8,439,046円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>105,369,917円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>100,119,216円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>5,250,701円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>6,257,451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>	項目			当期配当等収益額	A	109,116,079円	分配準備積立金	B	4,692,884円	配当等収益合計額	C=A+B	113,808,963円	経費	D	8,439,046円	収益分配可能額	E=C-D	105,369,917円	収益分配金	F	100,119,216円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,250,701円	口数	H	6,257,451口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,600円	<table border="1" style="width: 100%;"> <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>111,570,646円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>5,250,701円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>116,821,347円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>9,294,706円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>107,526,641円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>106,376,667円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>1,149,974円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>6,257,451口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,700円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	111,570,646円	分配準備積立金	B	5,250,701円	配当等収益合計額	C=A+B	116,821,347円	経費	D	9,294,706円	収益分配可能額	E=C-D	107,526,641円	収益分配金	F	106,376,667円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,149,974円	口数	H	6,257,451口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,700円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	109,116,079円																																																											
分配準備積立金	B	4,692,884円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	113,808,963円																																																											
経費	D	8,439,046円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	105,369,917円																																																											
収益分配金	F	100,119,216円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,250,701円																																																											
口数	H	6,257,451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	111,570,646円																																																											
分配準備積立金	B	5,250,701円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	116,821,347円																																																											
経費	D	9,294,706円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	107,526,641円																																																											
収益分配金	F	106,376,667円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,149,974円																																																											
口数	H	6,257,451口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,700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12期 自2023年10月21日 至2024年4月20日	第13期 自2024年4月21日 至2024年10月20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</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>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>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</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12期 2024年4月20日現在	第13期 2024年10月20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)

第12期 自 2023年10月21日 至 2024年4月20日	第13期 自 2024年4月21日 至 2024年10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12期 自 2023年10月21日 至 2024年4月20日	第13期 自 2024年4月21日 至 2024年10月20日
期首元本額 6,324,729,000円	期首元本額 6,257,451,000円
期中追加設定元本額 176,200,000円	期中追加設定元本額 0円
期中一部交換元本額 243,478,000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12期 自 2023年10月21日 至 2024年4月20日	第13期 自 2024年4月21日 至 2024年10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	1,256,162,611	554,845,654
合計	1,256,162,611	554,845,654

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12期(2024年4月20日現在)			第13期(2024年10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	163,260,000	—	157,560,000	△5,702,970	128,150,000	—	134,500,000	6,347,525
合計	163,260,000	—	157,560,000	△5,702,970	128,150,000	—	134,500,000	6,347,525

(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10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	マルハニチロ	900	3,104.00	2,793,600	
		サカタのタネ	600	3,625.00	2,175,000	
		石油資源開発	5,300	1,142.00	6,052,600	
		安藤・間	2,800	1,137.00	3,183,600	
		清水建設	10,200	998.60	10,185,720	
		鹿島建設	7,400	2,675.00	19,795,000	
		奥村組	500	4,430.00	2,215,000	
		住友林業	3,000	6,346.00	19,038,000	
		積水ハウス	13,300	3,826.00	50,885,800	
		きんでん	2,300	3,225.00	7,417,500	
		森永製菓	1,800	2,911.50	5,240,700	
		カルビー	2,200	3,385.00	7,447,000	
		明治ホールディングス	5,300	3,552.00	18,825,600	
		アサヒグループホールディングス	35,500	1,755.50	62,320,250	
		麒麟ホールディングス	21,500	2,201.00	47,321,500	
		コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	2,900	1,962.00	5,689,800	
		味の素	12,500	5,713.00	71,412,500	
		キューピー	2,500	3,560.00	8,900,000	
		カゴメ	1,900	3,207.00	6,093,300	
		ニチレイ	2,900	4,300.00	12,470,000	
東洋水産	1,800	8,963.00	16,133,400			
東洋紡	2,300	986.00	2,267,800			

帝人	4,700	1,401.00	6,584,700
ワコールホールディングス	1,300	4,685.00	6,090,500
ゴールドウイン	500	8,352.00	4,176,000
デサント	800	4,345.00	3,476,000
王子ホールディングス	19,600	570.90	11,189,640
日本製紙	1,900	922.00	1,751,800
旭化成	30,700	1,048.00	32,173,600
レゾナック・ホールディングス	3,900	3,745.00	14,605,500
住友化学	35,500	415.80	14,760,900
クレハ	900	2,851.00	2,565,900
信越化学工業	31,800	5,972.00	189,909,600
エア・ウォーター	3,900	1,968.50	7,677,150
日本酸素ホールディングス	3,400	5,215.00	17,731,000
日本触媒	2,200	1,745.50	3,840,100
カネカ	900	3,801.00	3,420,900
三菱瓦斯化学	2,900	2,724.00	7,899,600
三井化学	3,900	3,520.00	13,728,000
三菱ケミカルグループ	29,000	833.00	24,157,000
ダイセル	5,300	1,328.00	7,038,400
積水化学工業	7,300	2,215.00	16,169,500
日本ゼオン	3,800	1,337.50	5,082,500
アイカ工業	1,200	3,322.00	3,986,400
UBE	1,700	2,554.00	4,341,800
ADEKA	1,500	2,806.00	4,209,000
日油	3,900	2,570.00	10,023,000
花王	11,200	6,869.00	76,932,800
日本ペイントホールディングス	21,400	1,023.00	21,892,200
関西ペイント	3,100	2,486.00	7,706,600
富士フイルムホールディングス	25,200	3,705.00	93,366,000
資生堂	13,000	3,412.00	44,356,000
ライオン	5,900	1,691.00	9,976,900
ミルボン	600	3,103.00	1,861,800
ファンケル	2,400	2,789.00	6,693,600
コーセー	900	8,411.00	7,569,900
ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	1,502.50	3,906,500

小林製薬	1,100	5,749.00	6,323,900
デクセリアルズ	3,600	2,392.50	8,613,000
日東電工	19,500	2,467.00	48,106,500
エフピコ	1,000	2,714.50	2,714,500
ユニ・チャーム	10,100	4,953.00	50,025,300
協和キリン	8,400	2,650.50	22,264,200
武田薬品工業	35,900	4,276.00	153,508,400
アステラス製薬	55,400	1,762.00	97,614,800
塩野義製薬	22,300	2,082.50	46,439,750
日本新薬	1,500	4,171.00	6,256,500
中外製薬	19,800	7,022.00	139,035,600
エーザイ	6,500	5,328.00	34,632,000
ロート製薬	5,100	3,490.00	17,799,000
久光製薬	1,400	4,291.00	6,007,400
参天製薬	10,000	1,802.50	18,025,000
ツムラ	1,300	4,887.00	6,353,100
第一三共	45,500	4,978.00	226,499,000
大塚ホールディングス	10,400	9,049.00	94,109,600
ペプチドリーム	2,500	2,950.00	7,375,000
サワイグループホールディングス	3,200	2,042.00	6,534,400
E N E O Sホールディングス	93,500	775.40	72,499,900
コスモエネルギーホールディングス	2,000	7,744.00	15,488,000
T O T O	3,000	5,144.00	15,432,000
日本碍子	4,000	1,868.00	7,472,000
日本特殊陶業	3,400	4,125.00	14,025,000
フジインコーポレーテッド	900	2,362.00	2,125,800
神戸製鋼所	7,700	1,685.00	12,974,500
東京製鐵	1,200	1,977.00	2,372,400
大同特殊鋼	2,300	1,352.00	3,109,600
三菱マテリアル	2,200	2,537.00	5,581,400
フジクラ	5,300	5,308.00	28,132,400
A R Eホールディングス	1,700	1,799.00	3,058,300
東洋製罐グループホールディングス	2,300	2,244.00	5,161,200
L I X I L	7,200	1,637.00	11,786,400
日本発條	3,900	1,880.50	7,333,950

三浦工業	1,500	3,651.00	5,476,500
DMG森精機	2,500	2,932.50	7,331,250
ディスコ	2,100	38,310.00	80,451,000
SMC	1,300	63,330.00	82,329,000
小松製作所	18,600	4,021.00	74,790,600
TOWA	1,300	1,985.00	2,580,500
クボタ	19,300	2,015.50	38,899,150
荏原製作所	10,500	2,403.50	25,236,750
栗田工業	2,100	5,979.00	12,555,900
フジテック	1,000	4,990.00	4,990,000
セガサミーホールディングス	3,600	2,960.00	10,656,000
カナデビア	2,800	1,017.00	2,847,600
日清紡ホールディングス	2,900	980.00	2,842,000
ブラザー工業	5,400	3,023.00	16,324,200
ミネベアミツミ	6,500	2,801.50	18,209,750
安川電機	4,200	4,391.00	18,442,200
マブチモーター	1,500	2,227.50	3,341,250
ニデック	19,100	2,869.50	54,807,450
オムロン	4,500	6,232.00	28,044,000
日本電気	6,600	13,730.00	90,618,000
富士通	46,300	3,092.00	143,159,600
サンケン電気	600	6,286.00	3,771,600
セイコーエプソン	7,200	2,812.00	20,246,400
アルプスアルパイン	4,600	1,551.50	7,136,900
横河電機	5,700	3,645.00	20,776,500
アズビル	11,300	1,215.50	13,735,150
日本光電工業	3,700	2,227.00	8,239,900
堀場製作所	900	9,387.00	8,448,300
アドバンテスト	17,800	7,968.00	141,830,400
シスメックス	12,400	2,825.50	35,036,200
ウシオ電機	2,000	2,079.00	4,158,000
カシオ計算機	3,700	1,166.00	4,314,200
新光電気工業	1,400	5,472.00	7,660,800
京セラ	28,200	1,700.00	47,940,000
太陽誘電	2,900	2,830.50	8,208,450

村田製作所	42,100	2,783.50	117,185,350
リコー	14,400	1,631.00	23,486,400
東京エレクトロン	10,700	23,500.00	251,450,000
東海理化電機製作所	1,000	1,953.00	1,953,000
テイ・エス テック	1,400	1,720.00	2,408,000
島津製作所	5,500	4,635.00	25,492,500
ナカニシ	1,700	2,598.00	4,416,600
ニコン	5,500	1,812.00	9,966,000
HOYA	8,400	20,115.00	168,966,000
朝日インテック	5,500	2,447.00	13,458,500
シチズン時計	5,300	935.00	4,955,500
メニコン	1,400	1,541.00	2,157,400
バンダイナムコホールディングス	12,600	3,226.00	40,647,600
タカラトミー	2,500	3,951.00	9,877,500
TOPPANホールディングス	5,400	4,323.00	23,344,200
大日本印刷	8,200	2,611.00	21,410,200
アシックス	16,800	2,782.00	46,737,600
ヤマハ	9,200	1,247.00	11,472,400
ビジョン	3,300	1,652.50	5,453,250
コクヨ	1,800	2,614.50	4,706,100
オカムラ	1,100	1,989.00	2,187,900
中部電力	17,000	1,745.50	29,673,500
関西電力	16,200	2,608.00	42,249,600
四国電力	3,900	1,275.00	4,972,500
北海道電力	4,000	1,023.00	4,092,000
東京瓦斯	11,700	3,256.00	38,095,200
大阪瓦斯	11,700	3,196.00	37,393,200
東邦瓦斯	2,000	3,842.00	7,684,000
相鉄ホールディングス	2,000	2,312.50	4,625,000
東急	12,500	1,829.00	22,862,500
富士急行	400	2,547.00	1,018,800
東日本旅客鉄道	17,800	2,986.00	53,150,800
西武ホールディングス	4,500	3,296.00	14,832,000
近鉄グループホールディングス	4,200	3,600.00	15,120,000
ヤマトホールディングス	4,700	1,627.00	7,646,900

九州旅客鉄道	2,600	3,998.00	10,394,800
S Gホールディングス	6,800	1,494.50	10,162,600
N I P P O N E X P R E S S ホールディング	1,600	7,774.00	12,438,400
日本郵船	11,000	5,142.00	56,562,000
商船三井	7,900	4,994.00	39,452,600
川崎汽船	8,100	2,082.00	16,864,200
日本航空	3,400	2,420.00	8,228,000
A N Aホールディングス	3,600	2,945.00	10,602,000
三菱倉庫	1,000	5,212.00	5,212,000
住友倉庫	1,100	2,729.00	3,001,900
N E C ネットエスアイ	1,600	2,703.00	4,324,800
システナ	7,100	368.00	2,612,800
T I S	5,600	3,753.00	21,016,800
コーエーテクモホールディングス	3,700	1,563.50	5,784,950
ネクソン	8,700	2,641.00	22,976,700
S H I F T	300	14,715.00	4,414,500
ラクス	1,900	2,107.00	4,003,300
ビジョナル	600	7,980.00	4,788,000
野村総合研究所	8,500	5,056.00	42,976,000
メルカリ	3,000	2,389.50	7,168,500
S a n s a n	2,000	2,347.00	4,694,000
メドレー	600	3,885.00	2,331,000
ジャストシステム	700	3,450.00	2,415,000
L I N E ヤフー	72,500	417.10	30,239,750
トレンドマイクロ	3,700	8,173.00	30,240,100
日本オラクル	900	15,040.00	13,536,000
大塚商会	5,200	3,446.00	17,919,200
電通総研	800	5,450.00	4,360,000
ネットワンシステムズ	2,000	3,557.00	7,114,000
B I P R O G Y	1,800	4,848.00	8,726,400
日本電信電話	778,200	147.00	114,395,400
K D D I	39,900	4,800.00	191,520,000
ソフトバンク	834,600	187.70	156,654,420
光通信	400	31,340.00	12,536,000
G M O インターネットグループ	1,500	2,566.00	3,849,000

KADOKAWA	2,400	3,377.00	8,104,800
松竹	200	9,700.00	1,940,000
東宝	2,500	5,813.00	14,532,500
NTTデータグループ	16,200	2,442.50	39,568,500
SCSK	3,800	2,913.50	11,071,300
富士ソフト	1,300	9,660.00	12,558,000
ソフトバンクグループ	28,800	9,077.00	261,417,600
双日	5,300	3,359.00	17,802,700
アルフレッサ ホールディングス	4,200	2,298.50	9,653,700
ダイワボウホールディングス	1,800	2,789.50	5,021,100
コメダホールディングス	1,000	2,836.00	2,836,000
長瀬産業	2,000	3,187.00	6,374,000
兼松	1,800	2,338.00	4,208,400
キヤノンマーケティングジャパン	1,000	4,667.00	4,667,000
阪和興業	600	5,140.00	3,084,000
岩谷産業	5,300	2,063.50	10,936,550
稲畑産業	900	3,330.00	2,997,000
東邦ホールディングス	1,300	4,824.00	6,271,200
サンゲツ	1,100	2,829.00	3,111,900
サンリオ	3,700	4,193.00	15,514,100
ミスミグループ本社	6,500	2,562.00	16,653,000
スズケン	1,600	5,190.00	8,304,000
日本マクドナルドホールディングス	2,400	6,650.00	15,960,000
セリア	1,000	3,295.00	3,295,000
ビックカメラ	2,000	1,743.00	3,486,000
DCMホールディングス	2,000	1,492.00	2,984,000
MonotaRO	7,800	2,324.00	18,127,200
J. フロント リテイリング	6,700	1,618.00	10,840,600
ZOZO	3,900	5,441.00	21,219,900
物語コーポレーション	600	3,685.00	2,211,000
三越伊勢丹ホールディングス	9,800	2,306.00	22,598,800
ネクステージ	800	1,432.00	1,145,600
コスモス薬品	1,000	8,008.00	8,008,000
ツルハホールディングス	900	8,791.00	7,911,900
トリドールホールディングス	1,000	3,850.00	3,850,000

FOOD & LIFE COMPANIE	2,700	2,938.50	7,933,950
パン・パシフィック・インターナショナルホ	7,100	3,779.00	26,830,900
スギホールディングス	2,000	2,667.00	5,334,000
日本瓦斯	2,500	2,218.50	5,546,250
しまむら	1,000	8,339.00	8,339,000
高島屋	9,200	1,254.00	11,536,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,600	2,114.00	5,496,400
丸井グループ	4,800	2,424.50	11,637,600
イオン	19,600	3,694.00	72,402,400
イズミ	700	3,365.00	2,355,500
ケーズホールディングス	2,500	1,533.00	3,832,500
アインホールディングス	800	5,133.00	4,106,400
ヤマダホールディングス	12,400	449.70	5,576,280
ニトリホールディングス	2,200	21,015.00	46,233,000
吉野家ホールディングス	1,700	3,132.00	5,324,400
サンドラッグ	1,600	3,942.00	6,307,200
しずおかフィナンシャルグループ	10,000	1,292.00	12,920,000
京都フィナンシャルグループ	6,700	2,335.50	15,647,850
ゆうちょ銀行	42,100	1,419.50	59,760,950
コンコルディア・フィナンシャルグループ	29,400	796.10	23,405,340
あおぞら銀行	3,200	2,705.50	8,657,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	317,800	1,644.00	522,463,200
りそなホールディングス	66,000	1,054.00	69,564,000
三井住友トラストグループ	18,300	3,445.00	63,043,500
三井住友フィナンシャルグループ	113,400	3,263.00	370,024,200
千葉銀行	16,300	1,166.50	19,013,950
群馬銀行	9,300	928.50	8,635,050
七十七銀行	1,700	4,160.00	7,072,000
八十二銀行	9,900	871.00	8,622,900
セブン銀行	16,000	310.30	4,964,800
みずほフィナンシャルグループ	70,100	3,204.00	224,600,400
北洋銀行	7,500	424.00	3,180,000
SBIホールディングス	6,300	3,361.00	21,174,300

大和証券グループ本社	39,200	1,050.00	41,160,000
野村ホールディングス	90,800	800.20	72,658,160
松井証券	3,000	805.00	2,415,000
マネックスグループ	4,900	635.00	3,111,500
かんぽ生命保険	5,100	2,605.00	13,285,500
SOMPOホールディングス	27,900	3,314.00	92,460,600
MS&ADインシュアランスグループホール	41,700	3,529.00	147,159,300
第一生命ホールディングス	25,300	3,893.00	98,492,900
東京海上ホールディングス	58,900	5,702.00	335,847,800
T&Dホールディングス	14,200	2,570.00	36,494,000
クレディセゾン	4,400	3,573.00	15,721,200
芙蓉総合リース	500	11,035.00	5,517,500
東京センチュリー	4,000	1,621.50	6,486,000
イオンフィナンシャルサービス	2,800	1,229.50	3,442,600
オリックス	32,900	3,278.00	107,846,200
三菱HCキャピタル	23,500	1,013.50	23,817,250
日本取引所グループ	28,300	1,828.00	51,732,400
ヒューリック	12,500	1,432.50	17,906,250
野村不動産ホールディングス	2,700	3,772.00	10,184,400
オープンハウスグループ	1,700	5,703.00	9,695,100
東急不動産ホールディングス	15,200	987.70	15,013,040
パーク24	2,900	1,854.00	5,376,600
三井不動産	70,500	1,365.50	96,267,750
三菱地所	27,000	2,335.50	63,058,500
住友不動産	6,500	4,701.00	30,556,500
イオンモール	2,800	2,053.00	5,748,400
カチタス	1,400	1,950.00	2,730,000
MIXI	1,100	2,812.00	3,093,200
オープンアップグループ	1,500	1,987.00	2,980,500
エス・エム・エス	1,900	2,126.00	4,039,400
パーソルホールディングス	56,500	259.20	14,644,800
カカクコム	3,600	2,463.50	8,868,600
ディップ	1,000	2,628.00	2,628,000
エムスリー	11,000	1,741.50	19,156,500
ディー・エヌ・エー	2,300	1,814.50	4,173,350

	電通グループ	6,600	4,748.00	31,336,800	
	H. U. グループホールディングス	1,800	2,639.00	4,750,200	
	オリエンタルランド	27,100	3,547.00	96,123,700	
	ラウンドワン	3,500	971.00	3,398,500	
	リゾートトラスト	1,800	2,806.50	5,051,700	
	ユー・エス・エス	7,300	1,268.50	9,260,050	
	サイバーエージェント	14,000	1,022.00	14,308,000	
	エン・ジャパン	900	2,420.00	2,178,000	
	テクノプロ・ホールディングス	2,000	2,808.50	5,617,000	
	リクルートホールディングス	48,200	9,550.00	460,310,000	
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,200	3,120.00	3,744,000	
	アンビスホールディングス	1,100	1,860.00	2,046,000	
	共立メンテナンス	1,200	2,464.00	2,956,800	
	セコム	7,800	5,332.00	41,589,600	
	メイテックグループホールディングス	1,500	3,193.00	4,789,500	
	小計 銘柄数：315			9,628,639,500	
	組入時価比率：98.5%			100.0%	
	合計			9,628,639,500	

(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10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。