



2024年7月期 (2023年7月9日～2024年7月8日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2024 (July 9, 2023 – July 8, 2024)

2024年8月19日
 August 19, 2024

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 日経225連動型上場投信
 コード番号 (1321)
 連動対象指標 日経平均株価(日経225)
 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 Nikkei 225 Exchange Traded Fund
 Code: 1321
 Underlying index: Nikkei Stock Average(Nikkei 225)
 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16日
 Scheduled date of submission of securities report: September 25, 2024
 Date of commencing dividend payment: August 16, 2024

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2024年7月期の運用状況 (2023年7月9日～2024年7月8日)

Management Status for Year ended July 2024 (from July 9, 2023 to July 8, 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	10,809,233	(98.2)	200,803	(1.8)	11,010,036	(100.0)
2023年7月期 FY ended Jul. 2023	8,662,818	(98.4)	144,545	(1.6)	8,807,364	(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7月期 FY ended Jul. 2024	264,489	30,405	32,843	262,051
2023年7月期 FY ended Jul. 2023	271,530	16,179	23,220	264,489

(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))	10口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×10) Net Asset Value per 10 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×10)
	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	11,514,741	504,705	11,010,036	420,147
2023年7月期 FY ended Jul. 2023	9,295,947	488,582	8,807,364	332,995

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2024年7月期 FY ended Jul. 2024	6,170
2023年7月期 FY ended Jul. 2023	5,760

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22期 (2023年7月8日現在) 22nd Fiscal Year As of July 8, 2023	第23期 (2024年7月8日現在) 23rd Fiscal Year As of July 8, 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	612,887,326,637	677,957,127,881
株式 Stocks	8,662,818,839,840	10,809,233,188,150
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	437,823,575	7,503,010,835
未収入金 Accounts receivable - other	760,577,291	7,805,239,500
未収配当金 Accrued dividends receivable	9,443,705,850	9,991,919,550
未収利息 Accrued interest	32,908,438	1,584,005
その他未収収益 Other accrued revenue	217,549,013	174,164,255
差入委託証拠金 Margin deposits	9,348,381,773	2,075,555,596
流動資産合計 Total current assets	9,295,947,112,417	11,514,741,789,772
資産合計 Total assets	9,295,947,112,417	11,514,741,789,772
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	177,371,250	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	152,345,875,392	161,685,953,813
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,370,666,781	1,572,353,241
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	3,809,989,677	4,496,751,151
未払利息 Accrued interest expenses	425,158	26,220,823
有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities lent	328,421,073,050	333,829,563,103
その他未払費用	2,457,202,434	3,094,664,889

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	488,582,603,742	504,705,507,020
負債合計 Total liabilities	488,582,603,742	504,705,507,020
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	3,255,070,639,669	3,225,071,367,223
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	5,552,293,869,006	7,784,964,915,529
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	289,781,470	161,037,904
元本等合計 Total principal and other	8,807,364,508,675	11,010,036,282,752
純資産合計 Total net assets	8,807,364,508,675	11,010,036,282,752
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	9,295,947,112,417	11,514,741,789,772

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第22期 自 2022年7月9日 至 2023年7月8日 22nd Fiscal Year From July 9, 2022 to July 8, 2023	第23期 自 2023年7月9日 至 2024年7月8日 23rd Fiscal Year From July 9, 2023 to July 8, 2024
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	162,866,560,314	174,879,707,322
受取利息 Interest income	577,297	162,261,451
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	1,566,391,772,706	2,238,622,221,686
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	50,840,221,009	60,896,784,265
その他収益 Other revenue	3,697,805,930	1,809,636,333
営業収益合計 Total operating revenue	1,783,796,937,256	2,476,370,611,057
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	40,969,954	145,748,289
受託者報酬 Trustee fees	2,931,193,088	3,028,114,822

委託者報酬 Investment trust management fees	8,356,140,980	8,595,404,023
その他費用 Other expenses	2,755,452,519	3,525,127,725
営業費用合計 Total operating expenses	14,083,756,541	15,294,394,859
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	1,769,713,180,715	2,461,076,216,198
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	1,769,713,180,715	2,461,076,216,198
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	1,769,713,180,715	2,461,076,216,198
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	4,035,325,585,169	5,552,293,869,006
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	284,271,625,145	778,057,050,982
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	284,271,625,145	778,057,050,982
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	384,670,646,631	844,776,266,844
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	384,670,646,631	844,776,266,844
分配金 Dividends	152,345,875,392	161,685,953,813
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	5,552,293,869,006	7,784,964,915,529

(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

4. その他	引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2023年7月9日から2024年7月8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22期 2023年7月8日現在	第23期 2024年7月8日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 264,489,367 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 262,051,789 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 33,299.5 円 (10口当たり純資産額) (332,995 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 42,014.7 円 (10口当たり純資産額) (420,147 円)
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 303,486,395,230 円	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 316,615,905,090 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第22期 自2022年7月9日 至2023年7月8日	第23期 自2023年7月9日 至2024年7月8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>166,523,973,587 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>154,469,862 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>166,678,443,449 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>14,042,786,587 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>152,635,656,862 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>152,345,875,392 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>289,781,470 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>264,489,367 口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>5,760 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	166,523,973,587 円	分配準備積立金	B	154,469,862 円	配当等収益合計額	C=A+B	166,678,443,449 円	経費	D	14,042,786,587 円	収益分配可能額	E=C-D	152,635,656,862 円	収益分配金	F	152,345,875,392 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	289,781,470 円	口数	H	264,489,367 口	10口当たり分配金	I=F/H×10	5,760 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>176,705,856,817 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>289,781,470 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>176,995,638,287 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>15,148,646,570 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>161,846,991,717 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>161,685,953,813 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>161,037,904 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>262,051,789 口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>6,170 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	176,705,856,817 円	分配準備積立金	B	289,781,470 円	配当等収益合計額	C=A+B	176,995,638,287 円	経費	D	15,148,646,570 円	収益分配可能額	E=C-D	161,846,991,717 円	収益分配金	F	161,685,953,813 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	161,037,904 円	口数	H	262,051,789 口	10口当たり分配金	I=F/H×10	6,170 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	166,523,973,587 円																																																											
分配準備積立金	B	154,469,862 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	166,678,443,449 円																																																											
経費	D	14,042,786,587 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	152,635,656,862 円																																																											
収益分配金	F	152,345,875,392 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	289,781,470 円																																																											
口数	H	264,489,367 口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	5,760 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	176,705,856,817 円																																																											
分配準備積立金	B	289,781,470 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	176,995,638,287 円																																																											
経費	D	15,148,646,570 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	161,846,991,717 円																																																											
収益分配金	F	161,685,953,813 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	161,037,904 円																																																											
口数	H	262,051,789 口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	6,170 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち2,129,543,297 円は、対象指数についての商標使用料であります。	2. その他費用 その他費用のうち2,670,888,723 円は、対象指数についての商標使用料であります。																																																												

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第22期 自2022年7月9日 至2023年7月8日	第23期 自2023年7月9日 至2024年7月8日
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。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
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	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左

変動リスクを有しております。 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。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左
---	-------------------------

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第22期 2023年7月8日現在	第23期 2024年7月8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22期 自2022年7月9日 至2023年7月8日	第23期 自2023年7月9日 至2024年7月8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22期 自2022年7月9日 至2023年7月8日	第23期 自2023年7月9日 至2024年7月8日
期首元本額 3,341,724,189,748円	期首元本額 3,255,070,639,669円
期中追加設定元本額 199,118,645,100円	期中追加設定元本額 374,201,719,200円
期中一部交換元本額 285,772,195,179円	期中一部交換元本額 404,200,991,646円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第22期 自2022年7月9日 至2023年7月8日	第23期 自2023年7月9日 至2024年7月8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	1,531,746,830,126	2,069,494,914,972
合計	1,531,746,830,126	2,069,494,914,972

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22期(2023年7月8日現在)				第23期(2024年7月8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	143,726,549,875	—	143,989,200,000	260,452,325	192,128,520,100	—	199,633,950,000	7,503,010,835
合計	143,726,549,875	—	143,989,200,000	260,452,325	192,128,520,100	—	199,633,950,000	7,503,010,835

(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ありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2024年7月8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	ニッセイ	8,665,000	835.40	7,238,741,000	貸付有価証券 9,800株
		INPEX	3,466,000	2,440.50	8,458,773,000	貸付有価証券 800株
		コムシスホールディングス	8,665,000	3,189.00	27,632,685,000	貸付有価証券 143,600株(142,900株)
		大成建設	1,733,000	6,205.00	10,753,265,000	貸付有価証券 21,600株
		大林組	8,665,000	1,937.50	16,788,437,500	貸付有価証券 29,900株(29,700株)
		清水建設	8,665,000	916.00	7,937,140,000	貸付有価証券 25,300株
		長谷工コーポレーション	1,733,000	1,772.50	3,071,742,500	貸付有価証券 469,600株(166,500株)
		鹿島建設	4,332,500	2,788.00	12,079,010,000	
		大和ハウス工業	8,665,000	4,071.00	35,275,215,000	貸付有価証券 505,600株(184,300株)
		積水ハウス	8,665,000	3,546.00	30,726,090,000	貸付有価証券 1,518,300株
		日揮ホールディングス	8,665,000	1,258.00	10,900,570,000	

日清製粉グループ本社	8,665,000	1,807.00	15,657,655,000	
明治ホールディングス	3,466,000	3,528.00	12,228,048,000	貸付有価証券 120,500株 (12,400株)
日本ハム	4,332,500	4,719.00	20,445,067,500	貸付有価証券 51,900株
サッポロホールディングス	1,733,000	5,600.00	9,704,800,000	貸付有価証券 71,700株
アサヒグループホールディングス	8,665,000	5,571.00	48,272,715,000	
麒麟ホールディングス	8,665,000	2,095.50	18,157,507,500	貸付有価証券 353,000株 (292,500株)
キッコーマン	43,325,000	1,885.00	81,667,625,000	貸付有価証券 1,156,800株 (572,200株)
味の素	8,665,000	5,890.00	51,036,850,000	貸付有価証券 520,300株 (74,500株)
ニチレイ	4,332,500	3,428.00	14,851,810,000	貸付有価証券 115,000株 (48,100株)
日本たばこ産業	8,665,000	4,402.00	38,143,330,000	
帝人	1,733,000	1,322.00	2,291,026,000	貸付有価証券 32,500株
東レ	8,665,000	759.90	6,584,533,500	貸付有価証券 15,300株
王子ホールディングス	8,665,000	612.60	5,308,179,000	
日本製紙	866,500	922.00	798,913,000	貸付有価証券 492,500株 (104,000株)
クラレ	8,665,000	1,859.00	16,108,235,000	貸付有価証券 240,800株 (240,800株)
旭化成	8,665,000	1,016.00	8,803,640,000	
レゾナック・ホールディングス	866,500	3,547.00	3,073,475,500	貸付有価証券 141,400株 (31,700株)
住友化学	8,665,000	366.00	3,171,390,000	貸付有価証券 2,315,600株
日産化学	8,665,000	4,912.00	42,562,480,000	貸付有価証券 1,028,100株
東ソー	4,332,500	2,071.50	8,974,773,750	貸付有価証券 15,400株
トクヤマ	1,733,000	2,962.00	5,133,146,000	貸付有価証券 6,200株
デンカ	1,733,000	2,161.50	3,745,879,500	貸付有価証券 169,100株 (39,000株)

信越化学工業	43,325,000	6,446.00	279,272,950,000	貸付有価証券 228,600株 (228,600株)
三井化学	1,733,000	4,310.00	7,469,230,000	貸付有価証券 12,200株
三菱ケミカルグループ	4,332,500	900.80	3,902,716,000	貸付有価証券 142,000株 (141,900株)
UBE	866,500	2,754.00	2,386,341,000	貸付有価証券 35,200株
花王	8,665,000	6,532.00	56,599,780,000	貸付有価証券 1,900株
D I C	866,500	2,974.00	2,576,971,000	貸付有価証券 26,300株
富士フイルムホールディングス	25,995,000	3,851.00	100,106,745,000	貸付有価証券 10,200株 (10,200株)
資生堂	8,665,000	4,664.00	40,413,560,000	貸付有価証券 278,800株
日東電工	8,665,000	12,950.00	112,211,750,000	
協和キリン	8,665,000	2,928.50	25,375,452,500	貸付有価証券 600株
武田薬品工業	8,665,000	4,228.00	36,635,620,000	
アステラス製薬	43,325,000	1,609.50	69,731,587,500	
住友ファーマ	8,665,000	396.00	3,431,340,000	貸付有価証券 6,194,100株 (4,685,100株)
塩野義製薬	8,665,000	6,297.00	54,563,505,000	貸付有価証券 65,500株 (65,500株)
中外製薬	25,995,000	6,193.00	160,987,035,000	貸付有価証券 384,400株 (284,500株)
エーザイ	8,665,000	6,502.00	56,339,830,000	貸付有価証券 800,600株
第一三共	25,995,000	5,830.00	151,550,850,000	
大塚ホールディングス	8,665,000	6,920.00	59,961,800,000	
出光興産	17,330,000	1,026.00	17,780,580,000	貸付有価証券 3,045,000株 (3,045,000株)
E N E O S ホールディングス	8,665,000	834.90	7,234,408,500	貸付有価証券 100株
横浜ゴム	4,332,500	3,469.00	15,029,442,500	
ブリヂストン	8,665,000	6,240.00	54,069,600,000	
A G C	1,733,000	5,221.00	9,047,993,000	貸付有価証券 9,800株 (9,800株)
日本電気硝子	2,599,500	3,634.00	9,446,583,000	

太平洋セメント	866,500	4,037.00	3,498,060,500	
東海カーボン	8,665,000	926.30	8,026,389,500	貸付有価証券 1,976,900株 (603,500株)
TOTO	4,332,500	3,855.00	16,701,787,500	貸付有価証券 660,200株 (246,400 株)
日本碍子	8,665,000	2,047.50	17,741,587,500	
日本製鉄	866,500	3,413.00	2,957,364,500	貸付有価証券 634,800株 (601,700 株)
神戸製鋼所	866,500	1,983.00	1,718,269,500	貸付有価証券 31,300株 (20,800 株)
JFEホールディングス	866,500	2,326.50	2,015,912,250	
三井金属鉱業	866,500	5,266.00	4,562,989,000	貸付有価証券 11,900株
三菱マテリアル	866,500	3,036.00	2,630,694,000	貸付有価証券 14,200株
住友金属鉱山	4,332,500	5,271.00	22,836,607,500	貸付有価証券 197,100株
DOWAホールディングス	1,733,000	5,612.00	9,725,596,000	貸付有価証券 161,200株
古河電気工業	866,500	3,911.00	3,388,881,500	貸付有価証券 76,200株 (63,600 株)
住友電気工業	8,665,000	2,411.50	20,895,647,500	貸付有価証券 356,400株 (356,400 株)
フジクラ	8,665,000	3,088.00	26,757,520,000	貸付有価証券 61,200株
SUMCO	866,500	2,430.00	2,105,595,000	貸付有価証券 4,900株
日本製鋼所	1,733,000	4,607.00	7,983,931,000	貸付有価証券 62,400株 (31,800 株)
オークマ	1,733,000	7,743.00	13,418,619,000	貸付有価証券 401,800株 (244,900 株)
アマダ	8,665,000	1,840.50	15,947,932,500	貸付有価証券 593,600株 (473,600 株)
ディスコ	1,733,000	63,120.00	109,386,960,000	貸付有価証券 6,400株 (4,200株)
SMC	866,500	82,030.00	71,078,995,000	貸付有価証券 48,900株 (1,100株)
小松製作所	8,665,000	4,916.00	42,597,140,000	貸付有価証券 77,800株
住友重機械工業	1,733,000	4,249.00	7,363,517,000	貸付有価証券 1,500株

日立建機	8,665,000	4,529.00	39,243,785,000	貸付有価証券 733,000株 (152,700株)
クボタ	8,665,000	2,257.00	19,556,905,000	貸付有価証券 1,159,300株
荏原製作所	8,665,000	2,464.00	21,350,560,000	
ダイキン工業	8,665,000	23,225.00	201,244,625,000	貸付有価証券 171,900株
日本精工	8,665,000	801.00	6,940,665,000	貸付有価証券 236,500株 (234,800株)
N T N	8,665,000	319.40	2,767,601,000	貸付有価証券 2,774,000株 (2,394,200株)
ジェイテクト	8,665,000	1,113.00	9,644,145,000	
日立造船	1,733,000	1,054.00	1,826,582,000	貸付有価証券 198,500株 (189,700株)
三菱重工業	8,665,000	2,045.00	17,719,925,000	貸付有価証券 58,600株
I H I	866,500	5,585.00	4,839,402,500	貸付有価証券 1,600株 (1,500株)
コニカミノルタ	8,665,000	461.40	3,998,031,000	貸付有価証券 3,101,500株 (248,100株)
ミネベアミツミ	8,665,000	3,515.00	30,457,475,000	貸付有価証券 1,852,200株 (304,400株)
日立製作所	8,665,000	3,646.00	31,592,590,000	貸付有価証券 81,400株
三菱電機	8,665,000	2,734.50	23,694,442,500	
富士電機	1,733,000	9,325.00	16,160,225,000	貸付有価証券 125,700株 (10,200株)
安川電機	8,665,000	5,710.00	49,477,150,000	貸付有価証券 458,900株 (64,000株)
ソシオネクスト	8,665,000	3,914.00	33,914,810,000	貸付有価証券 1,759,900株
ニデック	6,932,000	6,902.00	47,844,664,000	
オムロン	8,665,000	5,707.00	49,451,155,000	貸付有価証券 717,000株 (299,700株)
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,733,000	3,133.00	5,429,489,000	貸付有価証券 17,500株 (13,700株)
日本電気	866,500	13,750.00	11,914,375,000	貸付有価証券 56,100株
富士通	8,665,000	2,628.00	22,771,620,000	貸付有価証券 55,400株 (55,400株)

				株)
ルネサスエレクトロニクス	8,665,000	3,275.00	28,377,875,000	貸付有価証券 18,300株 (18,300株)
セイコーエプソン	17,330,000	2,568.00	44,503,440,000	貸付有価証券 1,753,800株 (574,700株)
パナソニック ホールディングス	8,665,000	1,326.50	11,494,122,500	貸付有価証券 3,800株
シャープ	8,665,000	941.90	8,161,563,500	貸付有価証券 4,905,100株 (144,000株)
ソニーグループ	8,665,000	13,910.00	120,530,150,000	
TDK	25,995,000	10,720.00	278,666,400,000	貸付有価証券 366,300株 (322,000株)
アルプスアルパイン	8,665,000	1,542.50	13,365,762,500	貸付有価証券 2,922,300株 (605,600株)
横河電機	8,665,000	3,953.00	34,252,745,000	貸付有価証券 214,500株 (214,500株)
アドバンテスト	69,320,000	6,625.00	459,245,000,000	貸付有価証券 1,793,000株 (68,300株)
キーエンス	866,500	73,020.00	63,271,830,000	
レーザーテック	3,466,000	33,970.00	117,740,020,000	貸付有価証券 264,100株
カシオ計算機	8,665,000	1,193.00	10,337,345,000	貸付有価証券 202,900株
ファナック	43,325,000	4,397.00	190,500,025,000	貸付有価証券 1,111,000株 (152,400株)
京セラ	69,320,000	1,912.50	132,574,500,000	貸付有価証券 3,917,100株 (153,400株)
太陽誘電	8,665,000	4,656.00	40,344,240,000	貸付有価証券 2,012,500株 (340,800株)
村田製作所	20,796,000	3,574.00	74,324,904,000	貸付有価証券 122,600株
S C R E E Nホールディングス	3,466,000	16,210.00	56,183,860,000	貸付有価証券 322,400株 (69,700株)
キヤノン	12,997,500	4,434.00	57,630,915,000	貸付有価証券 77,000株
リコー	8,665,000	1,413.00	12,243,645,000	貸付有価証券 511,700株 (291,600株)
東京エレクトロン	25,995,000	36,040.00	936,859,800,000	

デンソー	34,660,000	2,527.50	87,603,150,000	貸付有価証券 1,693,100株
川崎重工業	866,500	6,106.00	5,290,849,000	貸付有価証券 114,100株
日産自動車	8,665,000	560.50	4,856,732,500	貸付有価証券 1,660,700株
いすゞ自動車	4,332,500	2,192.50	9,499,006,250	
トヨタ自動車	43,325,000	3,285.00	142,322,625,000	貸付有価証券 100株
日野自動車	8,665,000	420.60	3,644,499,000	貸付有価証券 1,028,300株 (132,800株)
三菱自動車工業	866,500	457.50	396,423,750	貸付有価証券 472,800株 (244,100 株)
マツダ	1,733,000	1,529.50	2,650,623,500	貸付有価証券 516,800株
本田技研工業	51,990,000	1,700.00	88,383,000,000	貸付有価証券 1,027,000株 (718,600株)
スズキ	34,660,000	1,780.00	61,694,800,000	貸付有価証券 4,153,800株
S U B A R U	8,665,000	3,475.00	30,110,875,000	貸付有価証券 193,900株
ヤマハ発動機	25,995,000	1,595.50	41,475,022,500	貸付有価証券 1,624,300株
テルモ	69,320,000	2,739.50	189,902,140,000	貸付有価証券 273,900株
ニコン	8,665,000	1,680.00	14,557,200,000	貸付有価証券 1,097,500株
オリンパス	34,660,000	2,627.50	91,069,150,000	貸付有価証券 2,300株 (2,300株)
HOYA	4,332,500	19,565.00	84,765,362,500	
シチズン時計	8,665,000	1,075.00	9,314,875,000	貸付有価証券 2,948,500株 (395,600株)
バンダイナムコホールディングス	25,995,000	3,076.00	79,960,620,000	貸付有価証券 94,100株
T O P P A Nホールディングス	4,332,500	4,552.00	19,721,540,000	貸付有価証券 49,900株
大日本印刷	4,332,500	5,386.00	23,334,845,000	貸付有価証券 748,400株 (22,000 株)
ヤマハ	8,665,000	3,632.00	31,471,280,000	貸付有価証券 366,500株 (60,400 株)
任天堂	8,665,000	8,791.00	76,174,015,000	
東京電力ホールディングス	866,500	827.50	717,028,750	貸付有価証券 29,900株

中部電力	866,500	1,851.00	1,603,891,500	貸付有価証券 1,300株
関西電力	866,500	2,611.50	2,262,864,750	貸付有価証券 200株
東京瓦斯	1,733,000	3,403.00	5,897,399,000	貸付有価証券 240,100株
大阪瓦斯	1,733,000	3,329.00	5,769,157,000	貸付有価証券 1,300株 (1,300株)
東武鉄道	1,733,000	2,628.50	4,555,190,500	貸付有価証券 1,800株
東急	4,332,500	1,717.00	7,438,902,500	貸付有価証券 716,300株 (249,300株)
小田急電鉄	4,332,500	1,534.00	6,646,055,000	貸付有価証券 528,100株 (148,600株)
京王電鉄	1,733,000	3,663.00	6,347,979,000	貸付有価証券 19,500株 (19,500株)
京成電鉄	4,332,500	5,162.00	22,364,365,000	貸付有価証券 1,074,300株
東日本旅客鉄道	2,599,500	2,599.00	6,756,100,500	貸付有価証券 157,300株
西日本旅客鉄道	1,733,000	2,895.00	5,017,035,000	
東海旅客鉄道	4,332,500	3,465.00	15,012,112,500	貸付有価証券 4,700株 (800株)
ヤマトホールディングス	8,665,000	1,797.00	15,571,005,000	貸付有価証券 1,639,400株 (794,400株)
NIPPON EXPRESS ホールディング	866,500	7,327.00	6,348,845,500	貸付有価証券 179,100株 (31,000株)
日本郵船	2,599,500	4,792.00	12,456,804,000	貸付有価証券 783,300株 (51,500株)
商船三井	2,599,500	4,990.00	12,971,505,000	貸付有価証券 268,200株 (59,200株)
川崎汽船	7,798,500	2,580.00	20,120,130,000	貸付有価証券 4,196,500株 (4,161,300株)
日本航空	8,665,000	2,541.50	22,022,097,500	
ANAホールディングス	866,500	2,997.00	2,596,900,500	貸付有価証券 8,400株
三菱倉庫	4,332,500	5,350.00	23,178,875,000	
ネクソン	17,330,000	3,127.00	54,190,910,000	貸付有価証券 2,586,400株 (1,140,500株)
メルカリ	8,665,000	2,454.00	21,263,910,000	貸付有価証券 6,851,000株

				(460,600株)
LINEヤフー	3,466,000	400.00	1,386,400,000	
トレンドマイクロ	8,665,000	6,723.00	58,254,795,000	貸付有価証券 457,600株 (160,000株)
日本電信電話	86,650,000	154.30	13,370,095,000	貸付有価証券 192,600株
KDDI	51,990,000	4,426.00	230,107,740,000	
ソフトバンク	8,665,000	2,025.50	17,550,957,500	
東宝	866,500	4,590.00	3,977,235,000	貸付有価証券 11,000株 (10,900株)
NTTデータグループ	43,325,000	2,316.00	100,340,700,000	貸付有価証券 1,280,600株
コナミグループ	8,665,000	11,560.00	100,167,400,000	貸付有価証券 21,900株 (1,400株)
ソフトバンクグループ	51,990,000	11,270.00	585,927,300,000	貸付有価証券 100株
双日	866,500	3,890.00	3,370,685,000	貸付有価証券 8,900株 (8,900株)
伊藤忠商事	8,665,000	8,043.00	69,692,595,000	貸付有価証券 1,800株
丸紅	8,665,000	3,047.00	26,402,255,000	
豊田通商	25,995,000	3,239.00	84,197,805,000	
三井物産	17,330,000	3,794.00	65,750,020,000	貸付有価証券 6,500株
住友商事	8,665,000	4,063.00	35,205,895,000	
三菱商事	25,995,000	3,368.00	87,551,160,000	
J.フロントリテイリング	4,332,500	1,949.50	8,446,208,750	貸付有価証券 374,300株 (374,300株)
ZOZO	8,665,000	4,274.00	37,034,210,000	貸付有価証券 4,038,100株 (1,731,500株)
三越伊勢丹ホールディングス	8,665,000	3,480.00	30,154,200,000	貸付有価証券 541,900株 (279,900株)
セブン&アイ・ホールディングス	25,995,000	1,973.50	51,301,132,500	貸付有価証券 77,200株
高島屋	4,332,500	2,969.50	12,865,358,750	貸付有価証券 346,800株 (235,400株)
丸井グループ	8,665,000	2,333.00	20,215,445,000	
イオン	8,665,000	3,433.00	29,746,945,000	貸付有価証券 707,500株 (98,700株)
ニトリホールディングス	4,332,500	16,460.00	71,312,950,000	貸付有価証券 204,800株 (80,100株)

				株)
ファーストリテイリング	25,995,000	42,250.00	1,098,288,750,000	貸付有価証券 272,600株 (267,100株)
しずおかフィナンシャルグループ	8,665,000	1,499.50	12,993,167,500	貸付有価証券 152,700株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	8,665,000	932.10	8,076,646,500	貸付有価証券 557,900株
あおぞら銀行	866,500	2,533.50	2,195,277,750	貸付有価証券 667,500株 (38,500株)
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,665,000	1,791.50	15,523,347,500	
りそなホールディングス	866,500	1,066.50	924,122,250	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,733,000	3,724.00	6,453,692,000	
三井住友フィナンシャルグループ	866,500	11,090.00	9,609,485,000	
千葉銀行	8,665,000	1,372.00	11,888,380,000	貸付有価証券 901,500株 (151,200株)
ふくおかフィナンシャルグループ	1,733,000	4,270.00	7,399,910,000	貸付有価証券 97,700株
みずほフィナンシャルグループ	866,500	3,445.00	2,985,092,500	貸付有価証券 19,900株
大和証券グループ本社	8,665,000	1,257.00	10,891,905,000	貸付有価証券 888,400株 (274,900株)
野村ホールディングス	8,665,000	954.90	8,274,208,500	
SOMPOホールディングス	5,199,000	3,417.00	17,764,983,000	
MS&ADインシュアランスグループホール	7,798,500	3,734.00	29,119,599,000	
第一生命ホールディングス	866,500	4,643.00	4,023,159,500	貸付有価証券 14,400株 (14,200株)
東京海上ホールディングス	12,997,500	6,164.00	80,116,590,000	貸付有価証券 42,400株 (42,400株)
T&Dホールディングス	1,733,000	2,991.50	5,184,269,500	貸付有価証券 48,100株
クレディセゾン	8,665,000	3,355.00	29,071,075,000	貸付有価証券 672,900株 (400,300株)
オリックス	8,665,000	3,653.00	31,653,245,000	
日本取引所グループ	8,665,000	3,993.00	34,599,345,000	貸付有価証券 203,300株
東急不動産ホールディングス	8,665,000	1,088.50	9,431,852,500	

	三井不動産	25,995,000	1,500.50	39,005,497,500	貸付有価証券 693,000株(693,000株)
	三菱地所	8,665,000	2,625.00	22,745,625,000	貸付有価証券 66,100株
	東京建物	4,332,500	2,580.50	11,180,016,250	貸付有価証券 283,000株(133,100株)
	住友不動産	8,665,000	5,010.00	43,411,650,000	貸付有価証券 63,000株
	エムスリー	20,796,000	1,513.50	31,474,746,000	貸付有価証券 1,232,600株
	ディー・エヌ・エー	2,599,500	1,569.00	4,078,615,500	貸付有価証券 19,100株
	電通グループ	8,665,000	3,957.00	34,287,405,000	貸付有価証券 977,400株
	オリエンタルランド	8,665,000	4,483.00	38,845,195,000	貸付有価証券 522,500株
	サイバーエージェント	6,932,000	975.20	6,760,086,400	貸付有価証券 759,100株(742,300株)
	楽天グループ	8,665,000	887.80	7,692,787,000	貸付有価証券 1,826,100株
	リクルートホールディングス	25,995,000	9,010.00	234,214,950,000	
	日本郵政	8,665,000	1,642.50	14,232,262,500	
	セコム	8,665,000	9,429.00	81,702,285,000	貸付有価証券 121,500株(88,000株)
小計	銘柄数：225 組入時価比率：98.2%			10,809,233,188,150 100.0%	
合計				10,809,233,188,150	

(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。

(注2) 備考欄の貸付有価証券の()内は、委託者の利害関係人である野村證券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(2024年7月8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。