



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 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 <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 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 <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	11,422	(99.2)	97	(0.8)	11,520	(100.0)
2024 年 4 月期 FY ended Apr. 2024	11,060	(98.5)	167	(1.5)	11,227	(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	426	0	0	426
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	426	0	0	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10月期 FY ended Oct. 2024	11,648	128	11,520	27,029
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	11,367	139	11,227	26,343

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2024年10月期 FY ended Oct. 2024	256
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	255

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 16 期 (2024 年 4 月 20 日現在) 16th Fiscal Year As of April 20, 2024	第 17 期 (2024 年 10 月 20 日現在) 17th 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	184,936,338	109,972,309
株式 Stocks	11,060,357,120	11,422,781,950
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	4,434,960
未収入金 Accounts receivable - other	-	5,294,781
未収配当金 Accrued dividends receivable	103,186,510	103,244,445
未収利息 Accrued interest	792	2,157
差入委託証拠金 Margin deposits	19,121,850	3,106,474
流動資産合計 Total current assets	11,367,602,610	11,648,837,076
資産合計 Total assets	11,367,602,610	11,648,837,076
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	7,271,931	-
未払金 Accounts payable - other	2,782,491	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	108,686,610	109,112,832
未払受託者報酬 Trustee fees payable	2,952,637	3,205,369
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	10,629,451	11,539,271
その他未払費用 Other accrued expenses	7,423,669	4,692,283
流動負債合計 Total current liabilities	139,746,789	128,549,755
負債合計 Total liabilities	139,746,789	128,549,755

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	5,750,476,899	6,042,908,399
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	39,013	87,687
元本等合計 Total principal and other	11,227,855,821	11,520,287,321
純資産合計 Total net assets	11,227,855,821	11,520,287,321
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	11,367,602,610	11,648,837,076

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	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	第 17 期 自 2024 年 4 月 21 日 至 2024 年 10 月 20 日 17th 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	126,332,759	128,185,381
受取利息 Interest income	11,981	118,851
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	1,710,814,795	286,860,666
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	22,818,398	5,522,160
その他収益 Other revenue	606	1,356
営業収益合計 Total operating revenue	1,859,978,539	420,688,414
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	9,091	-
受託者報酬 Trustee fees	2,952,637	3,205,369
委託者報酬 Investment trust management fees	10,629,451	11,539,271
その他費用 Other expenses	4,210,789	4,399,442
営業費用合計	17,801,968	19,144,082

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	1,842,176,571	401,544,332
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	1,842,176,571	401,544,332
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	1,842,176,571	401,544,332
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	4,016,986,938	5,750,476,899
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	-	-
分配金 Dividends	108,686,610	109,112,832
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	5,750,476,899	6,042,908,399

(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 16 期 2024 年 4 月 20 日現在	第 17 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 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	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	1 口当たり純資産額	27,029 円
------------	----------	------------	----------

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 16 期 自 2023 年 10 月 21 日 至 2024 年 4 月 20 日	第 17 期 自 2024 年 4 月 21 日 至 2024 年 10 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: 25%;">項目</th> <th style="width: 25%;"></th> <th style="width: 50%;"></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	<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: 25%;">項目</th> <th style="width: 25%;"></th> <th style="width: 50%;"></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;">128,305,588 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;">39,013 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;">128,344,601 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">19,144,082 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;">109,200,519 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">109,112,832 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;">87,687 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;">256 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち 3,843,174 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	128,305,588 円	分配準備積立金	B	39,013 円	配当等収益合計額	C=A+B	128,344,601 円	経費	D	19,144,082 円	収益分配可能額	E=C-D	109,200,519 円	収益分配金	F	109,112,832 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	87,687 円	口数	H	426,222 口	1 口当たり分配金	I=F/H	256 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																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	128,305,588 円																																																											
分配準備積立金	B	39,013 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	128,344,601 円																																																											
経費	D	19,144,082 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	109,200,519 円																																																											
収益分配金	F	109,112,832 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	87,687 円																																																											
口数	H	426,222 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	256 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 16 期 自 2023 年 10 月 21 日 至 2024 年 4 月 20 日	第 17 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 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。</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なっております。</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なっております。</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なっております。</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 同左</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

第16期 2024年4月20日現在	第17期 2024年10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16期 自2023年10月21日 至2024年4月20日	第17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16期 自2023年10月21日 至2024年4月20日	第17期 自2024年4月21日 至2024年10月20日
期首元本額 5,477,378,922円	期首元本額 5,477,378,922円
期中追加設定元本額 0円	期中追加設定元本額 0円
期中一部交換元本額 0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16期 自2023年10月21日 至2024年4月20日	第17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	1,710,763,093	225,039,029
合計	1,710,763,093	225,039,029

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16期(2024年4月20日現在)				第17期(2024年10月20日現在)			
	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	172,703,001	—	165,438,000	△7,271,931	87,021,300	—	91,460,000	4,434,960
合計	172,703,001	—	165,438,000	△7,271,931	87,021,300	—	91,460,000	4,434,960

(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	サカタのタネ	800	3,625.00	2,900,000	
		I N P E X	26,000	2,003.00	52,078,000	
		石油資源開発	4,100	1,142.00	4,682,200	
		大成建設	4,300	6,252.00	26,883,600	
		大林組	17,500	1,883.00	32,952,500	
		戸田建設	5,100	934.10	4,763,910	
		住友林業	3,800	6,346.00	24,114,800	
		大和ハウス工業	13,900	4,547.00	63,203,300	
		積水ハウス	14,400	3,826.00	55,094,400	
		エクシオグループ	4,700	1,569.50	7,376,650	
		インフロニア・ホールディングス	4,800	1,152.00	5,529,600	
		カルビー	2,200	3,385.00	7,447,000	
		森永乳業	1,800	3,496.00	6,292,800	
		ヤクルト本社	6,700	3,375.00	22,612,500	
		明治ホールディングス	6,200	3,552.00	22,022,400	
		アサヒグループホールディングス	33,500	1,755.50	58,809,250	
		麒麟ホールディングス	20,200	2,201.00	44,460,200	
		宝ホールディングス	3,700	1,226.50	4,538,050	
		サントリー食品インターナショナル	3,200	5,246.00	16,787,200	
		キッコーマン	18,300	1,673.00	30,615,900	
		味の素	11,700	5,713.00	66,842,100	
		ニチレイ	2,500	4,300.00	10,750,000	
		日清食品ホールディングス	4,700	4,101.00	19,274,700	
日本たばこ産業	28,900	4,250.00	122,825,000			
レンゴー	4,900	952.60	4,667,740			

クラレ	7,800	2,052.00	16,005,600
旭化成	32,000	1,048.00	33,536,000
日産化学	3,000	5,294.00	15,882,000
東ソー	6,500	1,917.50	12,463,750
信越化学工業	46,700	5,972.00	278,892,400
エア・ウォーター	4,200	1,968.50	8,267,700
カネカ	1,200	3,801.00	4,561,200
三菱瓦斯化学	4,300	2,724.00	11,713,200
三井化学	4,400	3,520.00	15,488,000
東京応化工業	2,500	3,625.00	9,062,500
ダイセル	6,500	1,328.00	8,632,000
住友ベークライト	1,700	4,010.00	6,817,000
積水化学工業	9,500	2,215.00	21,042,500
日本ゼオン	3,200	1,337.50	4,280,000
ADEKA	1,800	2,806.00	5,050,800
日油	5,200	2,570.00	13,364,000
花王	11,800	6,869.00	81,054,200
日本ペイントホールディングス	23,400	1,023.00	23,938,200
関西ペイント	4,500	2,486.00	11,187,000
太陽ホールディングス	800	3,930.00	3,144,000
富士フイルムホールディングス	25,400	3,705.00	94,107,000
ミルボン	600	3,103.00	1,861,800
ポーラ・オルビスホールディングス	2,300	1,502.50	3,455,750
小林製薬	1,300	5,749.00	7,473,700
デクセリアルズ	4,200	2,392.50	10,048,500
日東電工	19,700	2,467.00	48,599,900
ユニ・チャーム	9,700	4,953.00	48,044,100
協和キリン	6,700	2,650.50	17,758,350
武田薬品工業	28,900	4,276.00	123,576,400
アステラス製薬	48,300	1,762.00	85,104,600
塩野義製薬	20,500	2,082.50	42,691,250
日本新薬	1,300	4,171.00	5,422,300
中外製薬	16,000	7,022.00	112,352,000
エーザイ	7,100	5,328.00	37,828,800
ロート製薬	5,000	3,490.00	17,450,000

小野薬品工業	9,800	1,996.50	19,565,700
東和薬品	600	3,130.00	1,878,000
第一三共	46,600	4,978.00	231,974,800
大塚ホールディングス	11,000	9,049.00	99,539,000
E N E O Sホールディングス	79,800	775.40	61,876,920
横浜ゴム	2,700	3,153.00	8,513,100
TOYO TIRE	2,800	2,117.00	5,927,600
ブリヂストン	14,400	5,550.00	79,920,000
住友ゴム工業	4,200	1,525.00	6,405,000
A G C	4,900	4,640.00	22,736,000
東海カーボン	4,900	867.30	4,249,770
T O T O	3,700	5,144.00	19,032,800
日本碍子	6,300	1,868.00	11,768,400
日本特殊陶業	4,100	4,125.00	16,912,500
フジミインコーポレーテッド	1,200	2,362.00	2,834,400
日本製鉄	22,100	3,044.00	67,272,400
J F Eホールディングス	13,500	1,852.50	25,008,750
住友金属鉱山	6,200	4,355.00	27,001,000
住友電気工業	18,100	2,329.00	42,154,900
フジクラ	6,300	5,308.00	33,440,400
S U M C O	9,200	1,519.00	13,974,800
三和ホールディングス	4,900	3,618.00	17,728,200
リンナイ	2,800	3,430.00	9,604,000
アマダ	8,800	1,533.50	13,494,800
F U J I	2,000	2,257.50	4,515,000
DMG 森精機	3,400	2,932.50	9,970,500
ディスコ	2,500	38,310.00	95,775,000
ナブテスコ	2,900	2,461.00	7,136,900
S M C	1,600	63,330.00	101,328,000
小松製作所	23,600	4,021.00	94,895,600
住友重機械工業	2,800	3,509.00	9,825,200
日立建機	2,800	3,482.00	9,749,600
クボタ	24,500	2,015.50	49,379,750
荏原製作所	10,900	2,403.50	26,198,150
ダイキン工業	6,400	18,765.00	120,096,000

栗田工業	2,700	5,979.00	16,143,300
ダイフク	8,200	2,769.00	22,705,800
C K D	1,300	2,781.00	3,615,300
竹内製作所	900	4,780.00	4,302,000
アマノ	1,400	4,426.00	6,196,400
グローリー	1,100	2,531.00	2,784,100
セガサミーホールディングス	4,300	2,960.00	12,728,000
ホシザキ	2,600	5,249.00	13,647,400
T H K	3,000	2,505.50	7,516,500
P I L L A R	500	4,395.00	2,197,500
三菱重工業	81,100	2,321.50	188,273,650
I H I	3,500	8,343.00	29,200,500
ブラザー工業	6,200	3,023.00	18,742,600
ミネベアミツミ	8,700	2,801.50	24,373,050
三菱電機	49,700	2,352.00	116,894,400
富士電機	3,500	8,131.00	28,458,500
安川電機	6,100	4,391.00	26,785,100
ソシオネクスト	3,000	2,882.00	8,646,000
芝浦メカトロニクス	300	10,310.00	3,093,000
J V C ケンウッド	4,400	1,270.00	5,588,000
日東工業	600	2,962.00	1,777,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,900	2,763.50	5,250,650
日本電気	6,700	13,730.00	91,991,000
富士通	45,900	3,092.00	141,922,800
ルネサスエレクトロニクス	30,600	2,086.00	63,831,600
セイコーエプソン	7,400	2,812.00	20,808,800
アルバック	1,200	7,309.00	8,770,800
パナソニック ホールディングス	59,900	1,270.50	76,102,950
アンリツ	3,400	1,132.00	3,848,800
T D K	51,500	1,821.50	93,807,250
ヒロセ電機	700	18,545.00	12,981,500
横河電機	6,100	3,645.00	22,234,500
アズビル	11,700	1,215.50	14,221,350
日本光電工業	3,900	2,227.00	8,685,300
堀場製作所	900	9,387.00	8,448,300

アドバンテスト	20,300	7,968.00	161,750,400
キーエンス	5,100	65,800.00	335,580,000
日置電機	200	8,310.00	1,662,000
シスメックス	12,000	2,825.50	33,906,000
日本マイクロニクス	700	3,600.00	2,520,000
フェローテックホールディングス	1,100	2,490.00	2,739,000
レーザーテック	2,000	21,345.00	42,690,000
日本電子	1,200	5,555.00	6,666,000
ファナック	26,300	3,983.00	104,752,900
ローム	8,900	1,699.50	15,125,550
浜松ホトニクス	7,500	1,979.00	14,842,500
三井ハイテック	2,300	880.20	2,024,460
新光電気工業	1,700	5,472.00	9,302,400
京セラ	33,600	1,700.00	57,120,000
太陽誘電	3,200	2,830.50	9,057,600
村田製作所	44,800	2,783.50	124,700,800
S C R E E Nホールディングス	2,100	9,827.00	20,636,700
キヤノン	25,300	5,053.00	127,840,900
リコー	14,200	1,631.00	23,160,200
東京エレクトロン	11,500	23,500.00	270,250,000
トヨタ紡織	1,400	1,900.50	2,660,700
豊田自動織機	4,000	11,080.00	44,320,000
デンソー	44,100	2,086.50	92,014,650
いすゞ自動車	14,800	1,959.50	29,000,600
トヨタ自動車	120,700	2,552.50	308,086,750
三菱自動車工業	17,600	401.00	7,057,600
カヤバ	400	4,870.00	1,948,000
アイシン	11,200	1,590.00	17,808,000
スズキ	37,900	1,496.00	56,698,400
S U B A R U	15,800	2,596.00	41,016,800
ヤマハ発動機	21,700	1,351.50	29,327,550
シマノ	2,000	24,025.00	48,050,000
テイ・エス テック	2,000	1,720.00	3,440,000
テルモ	32,900	2,936.50	96,610,850
島津製作所	5,800	4,635.00	26,883,000

ナカニシ	1,800	2,598.00	4,676,400
東京精密	1,000	7,832.00	7,832,000
マニー	1,600	1,740.50	2,784,800
ニコン	7,500	1,812.00	13,590,000
トプコン	2,700	1,583.00	4,274,100
オリンパス	31,200	2,818.50	87,937,200
タムロン	800	4,470.00	3,576,000
HOYA	9,600	20,115.00	193,104,000
朝日インテック	6,100	2,447.00	14,926,700
シチズン時計	5,000	935.00	4,675,000
メニコン	1,700	1,541.00	2,619,700
ニプロ	3,700	1,419.50	5,252,150
バンダイナムコホールディングス	15,300	3,226.00	49,357,800
パイロットコーポレーション	700	4,693.00	3,285,100
TOPPANホールディングス	6,500	4,323.00	28,099,500
アシックス	16,500	2,782.00	45,903,000
ヤマハ	11,100	1,247.00	13,841,700
ピジョン	3,000	1,652.50	4,957,500
任天堂	29,400	8,019.00	235,758,600
オカムラ	1,400	1,989.00	2,784,600
東日本旅客鉄道	24,100	2,986.00	71,962,600
西日本旅客鉄道	11,700	2,720.00	31,824,000
近鉄グループホールディングス	4,700	3,600.00	16,920,000
センコーグループホールディングス	2,500	1,359.00	3,397,500
九州旅客鉄道	3,400	3,998.00	13,593,200
S Gホールディングス	8,600	1,494.50	12,852,700
日本郵船	12,800	5,142.00	65,817,600
商船三井	8,900	4,994.00	44,446,600
日本航空	11,400	2,420.00	27,588,000
三菱倉庫	1,500	5,212.00	7,818,000
日鉄ソリューションズ	1,700	3,500.00	5,950,000
T I S	4,900	3,753.00	18,389,700
コーエーテクモホールディングス	3,000	1,563.50	4,690,500
ネクソン	12,800	2,641.00	33,804,800
インターネットイニシアティブ	2,600	2,920.50	7,593,300

野村総合研究所	10,100	5,056.00	51,065,600
L I N Eヤフー	74,000	417.10	30,865,400
トレンドマイクロ	3,700	8,173.00	30,240,100
大塚商会	5,800	3,446.00	19,986,800
サイボウズ	600	2,102.00	1,261,200
B I P R O G Y	1,900	4,848.00	9,211,200
日本電信電話	1,474,200	147.00	216,707,400
K D D I	40,800	4,800.00	195,840,000
ソフトバンク	760,600	187.70	142,764,620
東宝	2,700	5,813.00	15,695,100
N T Tデータグループ	16,700	2,442.50	40,789,750
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,400	5,790.00	13,896,000
カプコン	9,000	3,238.00	29,142,000
S C S K	3,900	2,913.50	11,362,650
富士ソフト	1,200	9,660.00	11,592,000
コナミグループ	2,600	14,100.00	36,660,000
双日	4,000	3,359.00	13,436,000
第一興商	1,800	1,834.50	3,302,100
伊藤忠商事	32,300	7,587.00	245,060,100
丸紅	39,800	2,410.50	95,937,900
豊田通商	16,000	2,670.50	42,728,000
兼松	2,000	2,338.00	4,676,000
三井物産	76,400	3,181.00	243,028,400
住友商事	28,800	3,288.00	94,694,400
岩谷産業	4,600	2,063.50	9,492,100
サンゲツ	1,000	2,829.00	2,829,000
ミスミグループ本社	5,700	2,562.00	14,603,400
エービーシー・マート	2,400	3,071.00	7,370,400
アダストリア	600	3,920.00	2,352,000
日本マクドナルドホールディングス	2,400	6,650.00	15,960,000
パルグループホールディングス	1,100	3,145.00	3,459,500
セリア	1,100	3,295.00	3,624,500
M o n o t a R O	6,700	2,324.00	15,570,800
マツキヨココカラ&カンパニー	8,700	2,120.00	18,444,000
Z O Z O	3,300	5,441.00	17,955,300

ウエルシアホールディングス	2,300	1,960.50	4,509,150
ネクステージ	1,100	1,432.00	1,575,200
コスモス薬品	1,000	8,008.00	8,008,000
セブン&アイ・ホールディングス	55,900	2,212.00	123,650,800
ツルハホールディングス	1,000	8,791.00	8,791,000
クスリのアオキホールディングス	1,300	3,282.00	4,266,600
FOOD & LIFE COMP ANIE	3,000	2,938.50	8,815,500
良品計画	6,400	2,543.00	16,275,200
パン・パシフィック・インターナシ ョナルホ	10,600	3,779.00	40,057,400
ゼンショーホールディングス	2,500	7,843.00	19,607,500
スギホールディングス	2,800	2,667.00	7,467,600
しまむら	1,200	8,339.00	10,006,800
イオン	16,300	3,694.00	60,212,200
ヤオコー	600	9,405.00	5,643,000
ニトリホールディングス	2,000	21,015.00	42,030,000
ファーストリテイリング	1,900	53,570.00	101,783,000
サンドラッグ	1,800	3,942.00	7,095,600
三井住友フィナンシャルグループ	97,800	3,263.00	319,121,400
セブン銀行	15,200	310.30	4,716,560
SBIホールディングス	7,400	3,361.00	24,871,400
東京海上ホールディングス	48,200	5,702.00	274,836,400
芙蓉総合リース	400	11,035.00	4,414,000
みずほリース	3,000	1,001.00	3,003,000
東京センチュリー	3,500	1,621.50	5,675,250
オリックス	32,000	3,278.00	104,896,000
三菱HCキャピタル	18,900	1,013.50	19,155,150
大東建託	1,700	16,715.00	28,415,500
野村不動産ホールディングス	3,000	3,772.00	11,316,000
オープンハウスグループ	1,800	5,703.00	10,265,400
三菱地所	28,400	2,335.50	66,328,200
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	51,100	259.20	13,245,120
カカクコム	3,400	2,463.50	8,375,900
ディップ	900	2,628.00	2,365,200

	エムスリー	7,000	1,741.50	12,190,500	
	博報堂DYホールディングス	5,900	1,200.50	7,082,950	
	電通グループ	5,300	4,748.00	25,164,400	
	オリエンタルランド	26,500	3,547.00	93,995,500	
	リゾートトラスト	2,000	2,806.50	5,613,000	
	サイバーエージェント	11,300	1,022.00	11,548,600	
	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	2,900	2,808.50	8,144,650	
	K e e P e r 技研	300	4,220.00	1,266,000	
	ジャパンマテリアル	1,700	1,860.00	3,162,000	
	リクルートホールディングス	39,200	9,550.00	374,360,000	
	インソース	1,300	1,016.00	1,320,800	
	ペイカレント	3,600	5,313.00	19,126,800	
	セコム	10,900	5,332.00	58,118,800	
	小計 銘柄数：283			11,422,781,950	
	組入時価比率：99.2%			100.0%	
	合計			11,422,781,950	

(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。