



2024年4月期 (2023年10月8日～2024年4月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2024 (October 8, 2023 - April 7, 2024)

2024年5月17日
 May 17, 2024

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信
 コード番号 (1591)
 連動対象指標 JPX日経インデックス400
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 代表者名 CEO兼代表取締役社長 小池 広靖
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 長坂 智 TEL 0120-753104

Fund name: NEXT FUNDS JPX-Nikkei Index 400 Exchange Traded Fund
 Code: 1591
 Underlying index: JPX-Nikkei Index 400
 Primary invested assets: Stocks
 Trading unit: 1 unit
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Hiroyasu Koike, President & CEO
 Contact person: Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team

有価証券報告書提出予定日 2024年6月25日
 分配金支払開始日 2024年5月16日
 Scheduled date of submission of securities report: June 25, 2024
 Date of commencing dividend payment: May 16, 2024

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2024年4月期の運用状況 (2023年10月8日～2024年4月7日)

Management Status for Year ended April 2024 (from October 8, 2023 to April 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4月期 FY ended Apr. 2024	1,578,540	(97.8)	35,771	(2.2)	1,614,311	(100.0)
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	1,321,408	(97.6)	33,141	(2.4)	1,354,550	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	66,240	2,295	2,821	65,713
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	66,222	599	582	66,240

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	1口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×1) Net Asset Value per 1 unit ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×1)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	1,707,324	93,012	1,614,311	24,566
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	1,492,530	137,980	1,354,550	20,449

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	261
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	220

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20期 (2023年10月7日現在) 20th Fiscal Year As of October 7, 2023	第21期 (2024年4月7日現在) 21st Fiscal Year As of April 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	153,710,687,418	104,146,152,314
株式 Stocks	1,321,408,569,950	1,578,540,213,400
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	50,625,550
未収入金 Accounts receivable - other	-	6,948,729,800
未収配当金 Accrued dividends receivable	13,137,754,282	15,362,172,655
未収利息 Accrued interest	4,767,998	652,953
その他未収収益 Other accrued revenue	112,187,516	197,268,273
差入委託証拠金 Margin deposits	4,156,356,100	2,078,588,505
流動資産合計 Total current assets	1,492,530,323,264	1,707,324,403,450
資産合計 Total assets	1,492,530,323,264	1,707,324,403,450
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,482,847,050	363,705,500
未払金 Accounts payable - other	737,326,950	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	14,572,804,840	17,151,351,129
未払受託者報酬 Trustee fees payable	194,693,263	217,250,348
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	558,677,916	624,086,798
未払利息 Accrued interest expenses	257,222	2,288,359
有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities	120,038,318,674	74,488,861,390

lent		
その他未払費用 Other accrued expenses	395,317,283	164,974,425
流動負債合計 Total current liabilities	137,980,243,198	93,012,517,949
負債合計 Total liabilities	137,980,243,198	93,012,517,949
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	770,106,495,772	763,990,836,114
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	584,443,584,294	850,321,049,387
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	71,787,594	34,735,815
元本等合計 Total principal and other	1,354,550,080,066	1,614,311,885,501
純資産合計 Total net assets	1,354,550,080,066	1,614,311,885,501
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	1,492,530,323,264	1,707,324,403,450

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第20期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日 20th Fiscal Year From April 8, 2023 to October 7, 2023	第21期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日 21st Fiscal Year From October 8, 2023 to April 7, 2024
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	15,513,968,355	18,025,334,817
受取利息 Interest income	-	3,708,070
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	172,656,731,302	264,153,888,717
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	4,304,185,780	6,652,429,800
その他収益 Other revenue	177,720,935	309,439,616
営業収益合計 Total operating revenue	192,652,606,372	289,144,801,020
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	8,014,213	6,281,707

受託者報酬 Trustee fees	194,693,263	217,250,348
委託者報酬 Investment trust management fees	558,677,916	624,086,798
その他費用 Other expenses	324,342,871	376,564,300
営業費用合計 Total operating expenses	1,085,728,263	1,224,183,153
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	191,566,878,109	287,920,617,867
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	191,566,878,109	287,920,617,867
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	191,566,878,109	287,920,617,867
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	406,340,949,171	584,443,584,294
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	5,583,648,294	28,871,696,723
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	5,583,648,294	28,871,696,723
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	4,475,086,440	33,763,498,368
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	4,475,086,440	33,763,498,368
分配金 Dividends	14,572,804,840	17,151,351,129
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	584,443,584,294	850,321,049,387

(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。

4. その他	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。 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2023年10月8日から2024年4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)

第20期 2023年10月7日現在	第21期 2024年4月7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 66,240,022 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 65,713,989 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 20,449 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 24,566 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 116,308,241,050 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 70,986,921,290 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第20期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日	第21期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日																																																												
1. 分配金の計算過程 <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 10%;"></th> <th style="width: 60%;"></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;">15,683,675,077 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;">38,631,407 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;">15,722,306,484 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">1,077,714,050 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;">14,644,592,434 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">14,572,804,840 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;">71,787,594 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">66,240,022 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;">220 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	15,683,675,077 円	分配準備積立金	B	38,631,407 円	配当等収益合計額	C=A+B	15,722,306,484 円	経費	D	1,077,714,050 円	収益分配可能額	E=C-D	14,644,592,434 円	収益分配金	F	14,572,804,840 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	71,787,594 円	口数	H	66,240,022 口	1口当たり分配金	I=F/H	220 円	1. 分配金の計算過程 <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 10%;"></th> <th style="width: 60%;"></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;">18,332,200,796 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;">71,787,594 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;">18,403,988,390 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">1,217,901,446 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;">17,186,086,944 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">17,151,351,129 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;">34,735,815 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">65,713,989 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;">261 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	18,332,200,796 円	分配準備積立金	B	71,787,594 円	配当等収益合計額	C=A+B	18,403,988,390 円	経費	D	1,217,901,446 円	収益分配可能額	E=C-D	17,186,086,944 円	収益分配金	F	17,151,351,129 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	34,735,815 円	口数	H	65,713,989 口	1口当たり分配金	I=F/H	261 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	15,683,675,077 円																																																											
分配準備積立金	B	38,631,407 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	15,722,306,484 円																																																											
経費	D	1,077,714,050 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	14,644,592,434 円																																																											
収益分配金	F	14,572,804,840 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	71,787,594 円																																																											
口数	H	66,240,022 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	220 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	18,332,200,796 円																																																											
分配準備積立金	B	71,787,594 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	18,403,988,390 円																																																											
経費	D	1,217,901,446 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	17,186,086,944 円																																																											
収益分配金	F	17,151,351,129 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	34,735,815 円																																																											
口数	H	65,713,989 口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	261 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち261,345,047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287,801,611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20期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日	第21期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7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。	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>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。</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20期 2023年10月7日現在	第21期 2024年4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。 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。</p>	<p>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</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第20期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日	第21期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7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20期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日	第21期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日
期首元本額 769,906,609,954 円	期首元本額 770,106,495,772 円
期中追加設定元本額 6,970,751,958 円	期中追加設定元本額 26,682,820,974 円
期中一部交換元本額 6,770,866,140 円	期中一部交換元本額 32,798,480,632 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第20期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日	第21期 自 2023年10月8日 至 2024年4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	161,169,929,959	253,775,798,738
合計	161,169,929,959	253,775,798,738

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20期(2023年10月7日現在)				第21期(2024年4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	34,409,580,600	—	32,929,395,000	△1,482,847,050	35,656,984,000	—	35,346,285,000	△313,079,950
合計	34,409,580,600	—	32,929,395,000	△1,482,847,050	35,656,984,000	—	35,346,285,000	△313,079,950

(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4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	ニッセイ	811,600	928.80	753,814,080	貸付有価証券 9,300株
		三井松島ホールディングス	48,100	2,983.00	143,482,300	貸付有価証券 32,200株
		I N P E X	2,725,700	2,470.00	6,732,479,000	貸付有価証券 1,198,000株 (162,000株)
		ウエストホールディングス	69,700	2,735.00	190,629,500	貸付有価証券 46,900株
		ショーボンドホールディングス	110,600	6,116.00	676,429,600	貸付有価証券 500株
		ミライト・ワン	245,000	1,893.00	463,785,000	
		タマホーム	51,000	4,425.00	225,675,000	貸付有価証券 6,200株(1,500株)
		安藤・間	470,200	1,176.00	552,955,200	
		コムシスホールディングス	259,100	3,463.00	897,263,300	貸付有価証券 200株
		大成建設	531,200	5,599.00	2,974,188,800	貸付有価証券 11,800株
		大林組	2,030,400	1,773.00	3,599,899,200	
		清水建設	1,609,800	905.90	1,458,317,820	貸付有価証券 9,500株

長谷工コーポレーション	520,900	1,860.00	968,874,000	貸付有価証券 600株
鹿島建設	1,258,800	3,023.00	3,805,352,400	貸付有価証券 77,000株
住友林業	490,700	4,848.00	2,378,913,600	貸付有価証券 218,700株
大和ハウス工業	1,570,000	4,453.00	6,991,210,000	貸付有価証券 65,900株
積水ハウス	1,721,900	3,496.00	6,019,762,400	貸付有価証券 47,300株 (31,000 株)
関電工	355,500	1,688.00	600,084,000	貸付有価証券 30,100株
エクシオグループ	554,900	1,625.50	901,989,950	貸付有価証券 100株
九電工	122,700	6,405.00	785,893,500	貸付有価証券 2,800株
インフロンティア・ホールディングス	654,500	1,431.50	936,916,750	貸付有価証券 190,100株 (187,000 株)
森永製菓	244,000	2,559.00	624,396,000	
カルビー	260,900	3,454.00	901,148,600	貸付有価証券 8,400株
森永乳業	199,100	3,131.00	623,382,100	貸付有価証券 3,100株
ヤクルト本社	814,600	3,084.00	2,512,226,400	貸付有価証券 112,300株 (300株)
明治ホールディングス	698,800	3,346.00	2,338,184,800	貸付有価証券 11,800株
日本ハム	245,200	4,953.00	1,214,475,600	
アサヒグループホールディングス	1,317,000	5,533.00	7,286,961,000	貸付有価証券 182,700株
キリンホールディングス	2,374,200	2,125.00	5,045,175,000	貸付有価証券 200株
宝ホールディングス	384,300	1,032.50	396,789,750	貸付有価証券 30,900株
サントリー食品インターナショナル	401,300	5,200.00	2,086,760,000	貸付有価証券 28,300株
キッコーマン	1,888,600	1,902.00	3,592,117,200	貸付有価証券 8,700株
味の素	1,354,500	5,547.00	7,513,411,500	貸付有価証券 57,800株
ニチレイ	261,200	4,059.00	1,060,210,800	貸付有価証券 300株
東洋水産	288,000	8,947.00	2,576,736,000	
日清食品ホールディングス	601,200	4,136.00	2,486,563,200	貸付有価証券 15,200株
日本たばこ産業	3,463,500	4,098.00	14,193,423,000	貸付有価証券 81,500株

東レ	3,884,800	732.70	2,846,392,960	貸付有価証券 91,400株
ゴールドウイン	102,700	9,620.00	987,974,000	貸付有価証券 11,700株
王子ホールディングス	2,415,400	643.10	1,553,343,740	貸付有価証券 61,900株
レンゴー	528,100	1,139.00	601,505,900	貸付有価証券 700株
クラレ	845,000	1,624.00	1,372,280,000	貸付有価証券 152,200株
旭化成	3,922,700	1,093.50	4,289,472,450	
住友化学	4,302,900	350.10	1,506,445,290	貸付有価証券 534,500株 (27,500 株)
日産化学	272,400	5,642.00	1,536,880,800	貸付有価証券 30,100株
東ソー	774,100	2,150.00	1,664,315,000	貸付有価証券 100株
トクヤマ	187,300	2,742.00	513,576,600	
デンカ	210,900	2,325.00	490,342,500	貸付有価証券 6,300株
信越化学工業	4,604,300	6,168.00	28,399,322,400	貸付有価証券 900株
エア・ウォーター	547,100	2,291.00	1,253,406,100	
日本酸素ホールディング ス	562,500	4,542.00	2,554,875,000	貸付有価証券 1,400株
三菱瓦斯化学	423,200	2,644.00	1,118,940,800	貸付有価証券 600株
三井化学	478,200	4,414.00	2,110,774,800	貸付有価証券 6,100株
東京応化工業	276,600	4,282.00	1,184,401,200	貸付有価証券 104,700株
三菱ケミカルグループ	4,238,900	909.50	3,855,279,550	貸付有価証券 71,100株
KHネオケム	88,500	2,404.00	212,754,000	貸付有価証券 100株
ダイセル	745,400	1,421.00	1,059,213,400	
住友ベークライト	162,400	4,495.00	729,988,000	貸付有価証券 7,300株
積水化学工業	1,165,100	2,217.50	2,583,609,250	貸付有価証券 400株
日本ゼオン	397,500	1,338.00	531,855,000	貸付有価証券 11,200株
アイカ工業	146,300	3,750.00	548,625,000	貸付有価証券 1,000株
扶桑化学工業	61,500	4,255.00	261,682,500	貸付有価証券 2,500株
ADEKA	202,200	3,277.00	662,609,400	貸付有価証券

				3,900株
日油	525,000	2,028.00	1,064,700,000	
花王	1,311,100	6,145.00	8,056,709,500	貸付有価証券 19,200株
日本ペイントホールディングス	3,078,900	1,049.00	3,229,766,100	貸付有価証券 305,800株 (65,800株)
関西ペイント	568,200	2,197.50	1,248,619,500	貸付有価証券 31,200株 (1,000株)
太陽ホールディングス	100,900	3,225.00	325,402,500	貸付有価証券 400株
富士フイルムホールディングス	3,231,100	3,334.00	10,772,487,400	
資生堂	1,212,200	4,141.00	5,019,720,200	貸付有価証券 211,500株
ライオン	738,900	1,350.00	997,515,000	貸付有価証券 40,800株
コーセー	118,000	7,727.00	911,786,000	貸付有価証券 74,800株
小林製薬	169,000	5,362.00	906,178,000	貸付有価証券 21,100株
タカラバイオ	156,400	960.00	150,144,000	貸付有価証券 7,200株
デクセリアルズ	145,800	6,088.00	887,630,400	貸付有価証券 11,600株
日東電工	372,900	13,875.00	5,173,987,500	
ニフコ	173,600	3,779.00	656,034,400	貸付有価証券 400株
ユニ・チャーム	1,209,500	4,551.00	5,504,434,500	貸付有価証券 305,800株
協和キリン	701,400	2,651.50	1,859,762,100	貸付有価証券 118,900株 (29,800株)
武田薬品工業	4,495,300	4,120.00	18,520,636,000	貸付有価証券 228,700株
アステラス製薬	5,092,600	1,602.50	8,160,891,500	貸付有価証券 200株
塩野義製薬	731,900	7,578.00	5,546,338,200	
日本新薬	152,100	4,372.00	664,981,200	
中外製薬	1,817,300	5,436.00	9,878,842,800	貸付有価証券 246,000株
エーザイ	706,200	6,104.00	4,310,644,800	貸付有価証券 24,100株
ロート製薬	562,400	2,885.00	1,622,524,000	貸付有価証券 300株
小野薬品工業	1,232,100	2,447.00	3,014,948,700	貸付有価証券 46,700株
JCRファーマ	196,500	813.00	159,754,500	貸付有価証券

				8,000株
第一三共	4,472,400	4,661.00	20,845,856,400	
大塚ホールディングス	1,207,500	6,218.00	7,508,235,000	貸付有価証券 20,500株
ペプチドリーム	281,400	1,497.50	421,396,500	貸付有価証券 68,000株
出光興産	3,223,900	1,041.00	3,356,079,900	貸付有価証券 39,000株
E N E O Sホールディングス	9,191,300	727.00	6,682,075,100	貸付有価証券 69,800株
コスモエネルギーホールディングス	172,100	7,747.00	1,333,258,700	
横浜ゴム	293,600	3,927.00	1,152,967,200	貸付有価証券 85,300株
TOYO TIRE	333,600	2,806.00	936,081,600	貸付有価証券 175,000株
ブリヂストン	1,699,400	6,575.00	11,173,555,000	貸付有価証券 33,900株
住友ゴム工業	569,400	1,854.00	1,055,667,600	貸付有価証券 295,000株
A G C	517,700	5,538.00	2,867,022,600	貸付有価証券 207,200株
T O T O	383,100	4,212.00	1,613,617,200	貸付有価証券 4,400株
日本碍子	675,300	1,999.50	1,350,262,350	
日本特殊陶業	486,200	4,905.00	2,384,811,000	貸付有価証券 200株
M A R U W A	21,400	35,700.00	763,980,000	
フジミインコーポレーテッド	156,100	3,405.00	531,520,500	貸付有価証券 6,600株
ニチアス	146,800	3,980.00	584,264,000	貸付有価証券 4,900株
日本製鉄	2,674,300	3,595.00	9,614,108,500	貸付有価証券 16,900株
J F Eホールディングス	1,661,000	2,480.50	4,120,110,500	貸付有価証券 12,100株
東京製鐵	167,800	1,650.00	276,870,000	貸付有価証券 32,300株
丸一鋼管	181,800	4,123.00	749,561,400	貸付有価証券 1,500株
日本冶金工業	43,600	4,700.00	204,920,000	貸付有価証券 17,700株
大紀アルミニウム工業所	75,600	1,238.00	93,592,800	貸付有価証券 49,800株
三井金属鉱業	173,800	4,777.00	830,242,600	
住友金属鉱山	692,500	5,059.00	3,503,357,500	
D O W Aホールディング	147,600	5,608.00	827,740,800	貸付有価証券

ス				6,800株
住友電気工業	2,234,200	2,291.00	5,118,552,200	貸付有価証券 200株
AREホールディングス	224,300	1,966.00	440,973,800	貸付有価証券 100株
SUMCO	1,061,200	2,531.00	2,685,897,200	貸付有価証券 467,700株 (46,300 株)
三和ホールディングス	600,100	2,651.50	1,591,165,150	貸付有価証券 22,600株
リンナイ	285,800	3,365.00	961,717,000	貸付有価証券 10,200株 (7,500株)
三浦工業	244,100	2,959.50	722,413,950	
アマダ	932,900	1,673.50	1,561,208,150	貸付有価証券 16,000株
FUJI	275,300	2,571.00	707,796,300	
DMG森精機	354,400	3,943.00	1,397,399,200	貸付有価証券 237,700株 (142,600 株)
ディスコ	281,500	54,560.00	15,358,640,000	貸付有価証券 19,000株 (17,300 株)
ナブテスコ	366,900	2,560.50	939,447,450	貸付有価証券 216,100株
SMC	175,000	83,060.00	14,535,500,000	貸付有価証券 2,800株
小松製作所	2,740,400	4,468.00	12,244,107,200	貸付有価証券 101,400株
住友重機械工業	345,900	4,687.00	1,621,233,300	貸付有価証券 106,200株
日立建機	232,800	4,686.00	1,090,900,800	貸付有価証券 13,400株
ローゼ	30,500	20,980.00	639,890,000	貸付有価証券 800株
クボタ	3,056,600	2,482.00	7,586,481,200	貸付有価証券 635,700株 (333,700 株)
荏原製作所	239,900	13,100.00	3,142,690,000	貸付有価証券 70,100株
ダイキン工業	695,400	20,165.00	14,022,741,000	
オルガノ	70,200	6,990.00	490,698,000	貸付有価証券 200株
ダイフク	986,700	3,451.00	3,405,101,700	
SANKYO	562,800	1,649.50	928,338,600	貸付有価証券 7,000株
竹内製作所	106,100	5,940.00	630,234,000	貸付有価証券 67,500株
セガサミーホールディン	522,200	1,928.50	1,007,062,700	貸付有価証券

グス				5,100株
ホシザキ	345,000	5,531.00	1,908,195,000	貸付有価証券 109,300株
マキタ	666,800	4,245.00	2,830,566,000	
三菱重工業	10,224,100	1,328.50	13,582,716,850	貸付有価証券 398,100株
I H I	435,300	3,876.00	1,687,222,800	貸付有価証券 36,000株
イビデン	304,900	6,327.00	1,929,102,300	貸付有価証券 84,800株 (12,000 株)
ブラザー工業	781,200	2,811.50	2,196,343,800	貸付有価証券 23,800株
ミネベアミツミ	1,017,000	2,848.50	2,896,924,500	貸付有価証券 97,000株
日立製作所	2,260,800	13,865.00	31,345,992,000	貸付有価証券 6,600株
三菱電機	6,507,300	2,371.50	15,432,061,950	貸付有価証券 196,500株
富士電機	355,500	9,928.00	3,529,404,000	貸付有価証券 9,500株
安川電機	635,000	6,174.00	3,920,490,000	貸付有価証券 159,900株 (35,900 株)
ニデック	1,290,800	6,061.00	7,823,538,800	貸付有価証券 23,400株
オムロン	446,500	5,332.00	2,380,738,000	貸付有価証券 4,300株
MC J	242,300	1,340.00	324,682,000	貸付有価証券 163,000株
日本電気	767,800	11,055.00	8,488,029,000	貸付有価証券 2,500株
富士通	5,380,000	2,384.50	12,828,610,000	
ルネサスエレクトロニクス	3,644,400	2,697.00	9,828,946,800	貸付有価証券 200株
セイコーエプソン	750,100	2,654.50	1,991,140,450	貸付有価証券 66,300株 (30,100 株)
ワコム	427,700	616.00	263,463,200	貸付有価証券 1,900株
アルバック	128,200	9,885.00	1,267,257,000	貸付有価証券 66,700株
エレコム	139,700	1,528.00	213,461,600	
パナソニック ホールディングス	6,906,600	1,382.00	9,544,921,200	貸付有価証券 851,500株
アンリツ	411,800	1,202.50	495,189,500	貸付有価証券 100株
ソニーグループ	1,569,500	12,780.00	20,058,210,000	貸付有価証券 200株

TDK	925,700	7,417.00	6,865,916,900	貸付有価証券 9,800株
ヒロセ電機	86,300	15,250.00	1,316,075,000	貸付有価証券 3,600株
横河電機	639,600	3,474.00	2,221,970,400	貸付有価証券 1,900株
アズビル	398,200	4,288.00	1,707,481,600	貸付有価証券 2,000株
日本光電工業	248,300	3,877.00	962,659,100	
堀場製作所	110,500	14,830.00	1,638,715,000	貸付有価証券 31,600株
アドバンテスト	1,658,500	6,042.00	10,020,657,000	貸付有価証券 7,000株
キーエンス	299,900	64,950.00	19,478,505,000	貸付有価証券 26,800株
シスメックス	1,498,400	2,508.00	3,757,987,200	貸付有価証券 11,000株
フェローテックホールディングス	183,600	2,859.00	524,912,400	貸付有価証券 123,500株 (52,100株)
レーザーテック	265,300	39,540.00	10,489,962,000	貸付有価証券 4,500株
日本電子	145,000	6,750.00	978,750,000	
ファナック	2,822,800	4,228.00	11,934,798,400	貸付有価証券 59,200株
ローム	1,070,200	2,397.00	2,565,269,400	貸付有価証券 188,200株
浜松ホトニクス	464,500	5,223.00	2,426,083,500	
三井ハイテック	51,300	7,962.00	408,450,600	貸付有価証券 2,300株
新光電気工業	204,800	5,602.00	1,147,289,600	貸付有価証券 4,500株
京セラ	3,596,700	1,938.50	6,972,202,950	貸付有価証券 40,600株
太陽誘電	281,900	3,599.00	1,014,558,100	貸付有価証券 42,600株
村田製作所	5,266,600	2,719.50	14,322,518,700	
小糸製作所	599,700	2,313.50	1,387,405,950	貸付有価証券 178,700株 (9,600株)
SCREENホールディングス	197,900	18,285.00	3,618,601,500	貸付有価証券 17,200株
東京エレクトロン	989,800	37,270.00	36,889,846,000	
トヨタ紡織	243,700	2,507.00	610,955,900	貸付有価証券 25,500株
豊田自動織機	493,700	14,340.00	7,079,658,000	貸付有価証券 18,300株

デンソー	4,775,900	2,823.00	13,482,365,700	貸付有価証券 94,700株
いすゞ自動車	1,682,900	2,041.00	3,434,798,900	貸付有価証券 42,500株
トヨタ自動車	8,814,400	3,619.00	31,899,313,600	貸付有価証券 97,100株
カヤバ	54,600	4,975.00	271,635,000	貸付有価証券 3,300株
アイシン	446,500	5,879.00	2,624,973,500	貸付有価証券 10,900株
マツダ	1,914,700	1,740.50	3,332,535,350	貸付有価証券 67,200株
本田技研工業	13,663,900	1,835.50	25,080,088,450	貸付有価証券 196,100株
スズキ	4,252,700	1,758.50	7,478,372,950	貸付有価証券 444,800株
S U B A R U	1,795,200	3,432.00	6,161,126,400	
ヤマハ発動機	2,501,800	1,420.00	3,552,556,000	貸付有価証券 395,700株 (237,500株)
豊田合成	165,700	3,163.00	524,109,100	貸付有価証券 9,700株
シマノ	233,800	22,070.00	5,159,966,000	貸付有価証券 6,800株
テルモ	3,237,000	2,658.00	8,603,946,000	貸付有価証券 1,700株
島津製作所	769,100	4,072.00	3,131,775,200	貸付有価証券 18,000株
ナカニシ	244,900	2,277.00	557,637,300	貸付有価証券 4,700株
東京精密	118,500	11,405.00	1,351,492,500	貸付有価証券 8,100株
オリンパス	3,419,600	2,130.00	7,283,748,000	貸付有価証券 11,400株
HOYA	1,107,400	17,425.00	19,296,445,000	
朝日インテック	705,600	2,422.00	1,708,963,200	貸付有価証券 18,800株
バンダイナムコホールディングス	1,585,900	2,767.50	4,388,978,250	貸付有価証券 9,900株
パイロットコーポレーション	81,500	4,134.00	336,921,000	貸付有価証券 15,900株
ヤマハ	364,900	3,233.00	1,179,721,700	貸付有価証券 40,100株
ピジョン	368,700	1,419.00	523,185,300	貸付有価証券 204,000株
任天堂	3,110,600	7,741.00	24,079,154,600	貸付有価証券 2,300株
中部電力	2,133,100	1,948.50	4,156,345,350	

関西電力	2,235,300	2,262.00	5,056,248,600	
電源開発	475,500	2,510.50	1,193,742,750	貸付有価証券 52,800株 (40,800 株)
イーレックス	103,100	693.00	71,448,300	貸付有価証券 66,800株 (21,300 株)
レノバ	154,400	1,226.00	189,294,400	貸付有価証券 103,900株 (28,400 株)
東京瓦斯	1,126,900	3,507.00	3,952,038,300	貸付有価証券 45,600株
大阪瓦斯	1,172,600	3,303.00	3,873,097,800	
SBSホールディングス	51,600	2,654.00	136,946,400	貸付有価証券 9,500株
ヤマトホールディングス	740,000	2,161.00	1,599,140,000	貸付有価証券 17,700株
山九	147,100	5,131.00	754,770,100	貸付有価証券 3,300株
センコーグループホール ディングス	306,000	1,189.00	363,834,000	貸付有価証券 41,900株
AZ-COM丸和ホール ディングス	147,700	1,280.00	189,056,000	貸付有価証券 11,800株
SGホールディングス	970,400	1,889.00	1,833,085,600	
NIPPON EXPRESS ホールディン	196,100	7,557.00	1,481,927,700	貸付有価証券 19,300株
日本郵船	1,656,500	4,079.00	6,756,863,500	貸付有価証券 251,700株 (24,900 株)
商船三井	1,254,900	4,525.00	5,678,422,500	貸付有価証券 180,200株 (81,300 株)
川崎汽船	1,392,500	1,996.00	2,779,430,000	貸付有価証券 854,700株 (322,500 株)
NSユニテッド海運	31,100	4,500.00	139,950,000	貸付有価証券 15,200株 (15,200 株)
三井倉庫ホールディン グス	54,000	4,640.00	250,560,000	
NECネットエスアイ	226,300	2,452.00	554,887,600	
システナ	878,400	260.00	228,384,000	
日鉄ソリューションズ	99,000	5,140.00	508,860,000	貸付有価証券 1,000株
TIS	635,000	3,154.00	2,002,790,000	
コーエーテクモホール ディングス	363,800	1,572.00	571,893,600	貸付有価証券 130,700株
ネクソン	1,273,400	2,407.50	3,065,710,500	貸付有価証券 382,300株 (62,800 株)

				株)
SHIFT	38,600	21,465.00	828,549,000	貸付有価証券 25,400株 (1,400株)
ティーガイア	60,700	2,016.00	122,371,200	貸付有価証券 4,000株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	151,100	2,273.00	343,450,300	貸付有価証券 48,400株
GMOペイメントゲート ウェイ	116,000	8,610.00	998,760,000	貸付有価証券 1,800株
インターネットイニシア ティブ	277,500	2,727.00	756,742,500	貸付有価証券 2,300株
ラクス	274,600	1,893.50	519,955,100	貸付有価証券 9,900株
チェンジホールディング ス	126,400	1,196.00	151,174,400	貸付有価証券 85,000株 (6,300株)
野村総合研究所	1,286,200	4,222.00	5,430,336,400	貸付有価証券 49,800株
オービック	194,000	21,820.00	4,233,080,000	貸付有価証券 6,600株
ジャストシステム	83,400	2,635.00	219,759,000	貸付有価証券 200株
LINEヤフー	8,265,800	373.10	3,083,969,980	貸付有価証券 1,900株
トレンドマイクロ	274,500	7,748.00	2,126,826,000	貸付有価証券 15,800株
日本オラクル	111,100	11,005.00	1,222,655,500	貸付有価証券 100株
大塚商会	575,800	3,151.00	1,814,345,800	貸付有価証券 11,400株
電通総研	70,600	4,825.00	340,645,000	貸付有価証券 45,100株 (31,800 株)
東映アニメーション	136,400	2,895.00	394,878,000	貸付有価証券 56,500株
デジタルガレージ	92,800	3,160.00	293,248,000	貸付有価証券 400株
ネットワンシステムズ	234,300	2,746.00	643,387,800	貸付有価証券 5,600株
BIPROGY	189,900	4,488.00	852,271,200	
U-NEXT HOLD INGS	65,100	4,925.00	320,617,500	貸付有価証券 4,700株
日本電信電話	110,826,700	175.00	19,394,672,500	
KDDI	4,486,200	4,405.00	19,761,711,000	
ソフトバンク	9,349,500	1,921.00	17,960,389,500	
光通信	58,500	27,140.00	1,587,690,000	貸付有価証券 2,000株
GMOインターネットグ ループ	214,500	2,713.00	581,938,500	貸付有価証券 4,100株

KADOKAWA	306,900	2,724.00	835,995,600	貸付有価証券 43,800株
東宝	323,000	4,855.00	1,568,165,000	貸付有価証券 26,400株
NTTデータグループ	1,518,000	2,325.00	3,529,350,000	
DTS	122,400	4,010.00	490,824,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	265,200	5,537.00	1,468,412,400	貸付有価証券 100株
カブコン	1,038,400	2,722.00	2,826,524,800	貸付有価証券 86,700株 (10,600株)
SCSK	406,200	2,810.50	1,141,625,100	貸付有価証券 2,300株
NSD	207,200	2,951.00	611,447,200	貸付有価証券 2,100株
コナミグループ	217,400	10,025.00	2,179,435,000	
ソフトバンクグループ	2,863,900	8,537.00	24,449,114,300	貸付有価証券 800株
双日	681,900	3,948.00	2,692,141,200	貸付有価証券 29,300株
アルフレッサ ホールディングス	614,700	2,198.00	1,351,110,600	貸付有価証券 1,900株
神戸物産	473,800	3,628.00	1,718,946,400	貸付有価証券 38,700株
ダイワボウホールディングス	271,200	2,472.50	670,542,000	貸付有価証券 400株
マクニカホールディングス	144,900	6,993.00	1,013,285,700	貸付有価証券 42,100株 (33,100株)
シップヘルスケアホールディングス	220,100	2,034.50	447,793,450	
メディパルホールディングス	622,700	2,340.00	1,457,118,000	貸付有価証券 7,200株
IDOM	162,000	1,060.00	171,720,000	貸付有価証券 500株
伊藤忠商事	3,903,500	6,791.00	26,508,668,500	
丸紅	5,080,200	2,608.00	13,249,161,600	
豊田通商	536,500	9,971.00	5,349,441,500	
兼松	256,100	2,528.00	647,420,800	
三井物産	3,968,900	7,071.00	28,064,091,900	
住友商事	3,706,700	3,666.00	13,588,762,200	
三菱商事	9,248,100	3,472.00	32,109,403,200	
キャノンマーケティングジャパン	141,900	4,281.00	607,473,900	貸付有価証券 300株
阪和興業	110,000	5,810.00	639,100,000	貸付有価証券 4,100株

岩谷産業	139,400	8,964.00	1,249,581,600	貸付有価証券 3,000株
稲畑産業	121,000	3,150.00	381,150,000	貸付有価証券 1,600株
伊藤忠エネクス	151,800	1,600.00	242,880,000	
加賀電子	55,900	5,940.00	332,046,000	貸付有価証券 1,700株
PAL TAC	82,500	4,268.00	352,110,000	
ミスミグループ本社	924,900	2,196.00	2,031,080,400	貸付有価証券 13,500株
ローソン	130,300	10,335.00	1,346,650,500	貸付有価証券 52,800株 (4,500株)
エービーシー・マート	268,000	2,914.00	780,952,000	貸付有価証券 110,300株
アスクル	147,800	2,211.00	326,785,800	貸付有価証券 8,700株 (3,400株)
日本マクドナルドホールディングス	374,200	6,900.00	2,581,980,000	貸付有価証券 251,700株 (16,900株)
セリア	180,600	2,934.00	529,880,400	貸付有価証券 11,100株
Monotaro	868,200	1,747.50	1,517,179,500	貸付有価証券 410,200株
マツキヨココカラ&カンパニー	1,114,100	2,390.00	2,662,699,000	貸付有価証券 300株
ZOZO	390,300	3,667.00	1,431,230,100	貸付有価証券 262,600株
ウエルシアホールディングス	317,700	2,462.00	782,177,400	貸付有価証券 73,300株
クリエイトSDホールディングス	86,800	3,220.00	279,496,000	貸付有価証券 17,800株
ネクステージ	139,900	2,574.00	360,102,600	貸付有価証券 94,000株
コスモス薬品	52,000	13,870.00	721,240,000	貸付有価証券 300株 (300株)
セブン&アイ・ホールディングス	6,270,200	2,140.00	13,418,228,000	貸付有価証券 116,200株 (53,000株)
ツルハホールディングス	128,600	10,635.00	1,367,661,000	貸付有価証券 15,900株
クスリのアオキホールディングス	184,300	2,977.00	548,661,100	貸付有価証券 600株
FOOD & LIFE COMPANIE	326,600	3,138.00	1,024,870,800	
ノジマ	177,600	1,792.00	318,259,200	
良品計画	668,600	2,516.00	1,682,197,600	貸付有価証券 349,300株
コーナン商事	75,100	4,360.00	327,436,000	貸付有価証券 4,100株

パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,236,900	3,828.00	4,734,853,200	貸付有価証券 510,500株
ゼンショーホールディングス	311,900	6,286.00	1,960,603,400	貸付有価証券 7,700株
ワークマン	70,900	3,965.00	281,118,500	貸付有価証券 47,700株 (8,100株)
V Tホールディングス	232,600	515.00	119,789,000	
スギホールディングス	370,100	2,510.00	928,951,000	貸付有価証券 900株
日本瓦斯	324,500	2,603.50	844,835,750	貸付有価証券 200株
ライフコーポレーション	64,200	3,835.00	246,207,000	貸付有価証券 400株
コメリ	94,200	3,515.00	331,113,000	貸付有価証券 13,200株
しまむら	143,800	7,697.00	1,106,828,600	貸付有価証券 15,000株
イズミ	108,600	3,766.00	408,987,600	貸付有価証券 12,300株
ヤオコー	72,600	8,764.00	636,266,400	貸付有価証券 100株
ケーズホールディングス	411,300	1,422.00	584,868,600	貸付有価証券 37,500株 (4,800株)
ニトリホールディングス	223,000	23,565.00	5,254,995,000	貸付有価証券 100,100株 (58,800株)
ファーストリテイリング	275,500	44,160.00	12,166,080,000	貸付有価証券 13,600株
サンドラッグ	206,700	4,553.00	941,105,100	貸付有価証券 200株
めぶきフィナンシャルグループ	2,641,900	514.20	1,358,464,980	貸付有価証券 221,900株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3,059,000	761.00	2,327,899,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	18,580,400	1,525.50	28,344,400,200	貸付有価証券 279,300株
りそなホールディングス	6,593,400	956.00	6,303,290,400	貸付有価証券 212,900株
三井住友トラスト・ホールディングス	2,048,800	3,201.00	6,558,208,800	貸付有価証券 41,600株
三井住友フィナンシャルグループ	3,214,700	8,741.00	28,099,692,700	
千葉銀行	1,588,800	1,246.50	1,980,439,200	貸付有価証券 69,300株
ふくおかフィナンシャルグループ	496,500	3,969.00	1,970,608,500	貸付有価証券 17,300株
セブン銀行	1,787,000	295.00	527,165,000	貸付有価証券 1,031,100株 (17,300株)

みずほフィナンシャルグループ	7,695,400	2,933.50	22,574,455,900	
SBIホールディングス	840,400	3,803.00	3,196,041,200	貸付有価証券 59,100株
ジャフコグループ	169,900	1,824.00	309,897,600	貸付有価証券 41,700株
大和証券グループ本社	4,416,400	1,118.50	4,939,743,400	貸付有価証券 500株
野村ホールディングス	9,587,400	922.70	8,846,293,980	貸付有価証券 700株
マネックスグループ	558,400	852.00	475,756,800	貸付有価証券 107,500株
SOMPOホールディングス	2,572,900	3,167.00	8,148,374,300	貸付有価証券 88,300株
MS&ADインシュアランスグループホール	3,829,400	2,746.00	10,515,532,400	貸付有価証券 47,600株
第一生命ホールディングス	2,785,500	3,742.00	10,423,341,000	貸付有価証券 400,100株
東京海上ホールディングス	5,635,300	4,760.00	26,824,028,000	貸付有価証券 500株
全国保証	149,100	5,444.00	811,700,400	貸付有価証券 34,300株
芙蓉総合リース	52,500	13,650.00	716,625,000	貸付有価証券 3,300株
みずほリース	477,400	1,105.00	527,527,000	貸付有価証券 13,600株
東京センチュリー	426,100	1,583.50	674,729,350	貸付有価証券 28,900株
イオンフィナンシャルサービス	327,300	1,408.50	461,002,050	貸付有価証券 211,500株
アコム	1,017,400	397.00	403,907,800	貸付有価証券 18,600株
ジャックス	60,700	5,460.00	331,422,000	
オリエントコーポレーション	186,000	1,049.00	195,114,000	貸付有価証券 61,500株
オリックス	3,419,000	3,187.00	10,896,353,000	
三菱HCキャピタル	2,540,300	1,034.00	2,626,670,200	貸付有価証券 125,500株
日本取引所グループ	1,469,800	4,131.00	6,071,743,800	貸付有価証券 100株
大東建託	208,900	17,080.00	3,568,012,000	貸付有価証券 30,300株
ビューリック	1,329,800	1,477.00	1,964,114,600	貸付有価証券 166,700株
野村不動産ホールディングス	317,300	4,186.00	1,328,217,800	貸付有価証券 35,900株
プレサンスコーポレーション	90,400	1,749.00	158,109,600	貸付有価証券 48,400株

NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信 (1591) 2024年4月期 決算短信
NEXT FUNDS JPX-Nikkei Index 400 Exchange Traded Fund (1591) Earnings Report for Fiscal Year ended April 2024

オープンハウスグループ	208,800	4,927.00	1,028,757,600	貸付有価証券 2,600株
東急不動産ホールディングス	1,714,000	1,178.00	2,019,092,000	貸付有価証券 73,000株
飯田グループホールディングス	546,200	1,965.50	1,073,556,100	貸付有価証券 128,300株
ケイアイスター不動産	27,500	3,760.00	103,400,000	貸付有価証券 16,300株 (6,900株)
三井不動産	7,909,400	1,590.00	12,575,946,000	貸付有価証券 669,300株
三菱地所	3,726,700	2,785.00	10,378,859,500	貸付有価証券 156,000株
東京建物	498,100	2,509.00	1,249,732,900	貸付有価証券 97,400株
住友不動産	824,500	5,608.00	4,623,796,000	貸付有価証券 8,700株
スターツコーポレーション	81,800	3,255.00	266,259,000	
カチタス	153,200	1,893.00	290,007,600	貸付有価証券 23,000株
日本M&Aセンターホールディングス	948,200	911.60	864,379,120	貸付有価証券 80,200株
UTグループ	76,800	3,535.00	271,488,000	
パソナグループ	72,200	2,684.00	193,784,800	貸付有価証券 3,600株
エス・エム・エス	208,500	2,450.00	510,825,000	貸付有価証券 7,800株
パーソルホールディングス	6,057,700	208.00	1,260,001,600	貸付有価証券 6,400株
総合警備保障	994,000	813.80	808,917,200	
カカクコム	386,200	1,818.50	702,304,700	
ディップ	91,100	2,715.00	247,336,500	貸付有価証券 58,100株
ベネフィット・ワン	68,900	2,164.50	149,134,050	貸付有価証券 700株
エムスリー	1,176,000	2,035.00	2,393,160,000	貸付有価証券 81,000株
博報堂DYホールディングス	759,000	1,380.00	1,047,420,000	貸付有価証券 83,000株
H. U. グループホールディングス	174,200	2,383.00	415,118,600	貸付有価証券 2,300株
ビー・エム・エル	73,200	2,925.00	214,110,000	貸付有価証券 3,900株
ユー・エス・エス	1,335,200	1,233.50	1,646,969,200	貸付有価証券 400株
サイバーエージェント	1,315,100	1,052.00	1,383,485,200	
フルキャストホールディングス	56,800	1,406.00	79,860,800	

	テクノプロ・ホールディングス	348,400	2,925.00	1,019,070,000	貸付有価証券 181,800株
	ジャパンマテリアル	182,100	2,453.00	446,691,300	貸付有価証券 1,400株
	リクルートホールディングス	4,405,500	6,671.00	29,389,090,500	
	ベルシステム24ホールディングス	63,900	1,532.00	97,894,800	
	ベイカレント・コンサルティング	437,300	2,904.50	1,270,137,850	貸付有価証券 15,800株
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	192,800	2,486.00	479,300,800	貸付有価証券 7,600株
	リログループ	298,100	1,235.00	368,153,500	貸付有価証券 600株
	トランス・コスモス	73,900	3,095.00	228,720,500	貸付有価証券 9,500株
	セコム	606,000	10,715.00	6,493,290,000	貸付有価証券 13,300株
	メイテックグループホールディングス	214,300	2,875.50	616,219,650	貸付有価証券 1,300株
	イオンディライト	63,900	3,520.00	224,928,000	貸付有価証券 3,200株
小計	銘柄数：399 組入時価比率：97.8%			1,578,540,213,400 100.0%	
合計				1,578,540,213,400	

(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4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。