



2024年4月期 (2023年10月21日～2024年4月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended April 2024 (October 21, 2023 - April 20, 2024)

2024年5月30日
 May 30, 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	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 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	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7月17日
 分配金支払開始日 2024年5月29日
 Scheduled date of submission of securities report: July 17, 2024
 Date of commencing dividend payment: May 29, 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21日～2024年4月20日)

Management Status for Year ended April 2024 (from October 21, 2023 to April 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4月期 FY ended Apr. 2024	8,984	(98.2)	165	(1.8)	9,149	(100.0)
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	7,555	(97.9)	163	(2.1)	7,718	(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	6,324	176	243	6,257
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	7,677	446	1,799	6,324

(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4月期 FY ended Apr. 2024	9,264	115	9,149	146,214
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	7,814	96	7,718	122,039

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	1,600
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	1,300

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11期 (2023年10月20日現在) 11th Fiscal Year As of October 20, 2023	第12期 (2024年4月20日現在) 12th Fiscal Year As of April 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	90,804,239	154,830,976
株式 Stocks	7,555,015,760	8,984,229,800
未収入金 Accounts receivable - other	82,328,750	14,307,381
未収配当金 Accrued dividends receivable	74,548,680	96,193,847
未収利息 Accrued interest	-	662
差入委託証拠金 Margin deposits	12,075,000	14,912,013
流動資産合計 Total current assets	7,814,772,429	9,264,474,679
資産合計 Total assets	7,814,772,429	9,264,474,679
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	6,478,465	5,702,970
未払金 Accounts payable - other	-	1,427,970
未払収益分配金 Unpaid dividends	82,221,477	100,119,216
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,360,216	1,437,767
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	5,440,775	5,751,015
未払利息 Accrued interest expenses	37	-
その他未払費用 Other accrued expenses	657,733	742,017
流動負債合計 Total current liabilities	96,158,703	115,180,955
負債合計 Total liabilities	96,158,703	115,180,955

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,324,729,000	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	1,393,884,726	2,891,842,724
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	4,692,884	5,250,701
元本等合計 Total principal and other	7,718,613,726	9,149,293,724
純資産合計 Total net assets	7,718,613,726	9,149,293,724
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	7,814,772,429	9,264,474,679

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第11期 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日 11th Fiscal Year From April 21, 2023 to October 20, 2023	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
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	88,760,532	109,105,381
受取利息 Interest income	-	10,111
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	899,069,405	1,495,678,730
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	22,083,320	22,194,735
その他収益 Other revenue	18,405	9,054
営業収益合計 Total operating revenue	1,009,931,662	1,626,998,011
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	36,218	8,467
受託者報酬 Trustee fees	1,360,216	1,437,767
委託者報酬 Investment trust management fees	5,440,775	5,751,015
その他費用 Other expenses	1,056,880	1,250,264
営業費用合計	7,894,089	8,447,513

Total operating expenses		
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	1,002,037,573	1,618,550,498
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	1,002,037,573	1,618,550,498
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	1,002,037,573	1,618,550,498
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	777,844,957	1,393,884,726
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	110,338,763	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	110,338,763	51,288,296
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	414,115,090	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	414,115,090	71,761,580
分配金 Dividends	82,221,477	100,119,216
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,393,884,726	2,891,842,724

(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、2023年10月21日から2024年4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11期 2023年10月20日現在	第12期 2024年4月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 6,324,729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 1,220.39円 (100口当たり純資産額) (122,039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 1,462.14円 (100口当たり純資産額) (146,214円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自2023年4月21日 至2023年10月20日	第12期 自2023年10月21日 至2024年4月20日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <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>88,742,719円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>6,029,513円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>94,772,232円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>7,857,871円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>86,914,361円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>82,221,477円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>4,692,884円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>6,324,729口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,300円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	88,742,719円	分配準備積立金	B	6,029,513円	配当等収益合計額	C=A+B	94,772,232円	経費	D	7,857,871円	収益分配可能額	E=C-D	86,914,361円	収益分配金	F	82,221,477円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,692,884円	口数	H	6,324,729口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300円	<table border="1"> <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
項目																																																													
当期配当等収益額	A	88,742,719円																																																											
分配準備積立金	B	6,029,513円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	94,772,232円																																																											
経費	D	7,857,871円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	86,914,361円																																																											
収益分配金	F	82,221,477円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,692,884円																																																											
口数	H	6,324,729口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300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																																																											

(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11期 自2023年4月21日 至2023年10月20日	第12期 自2023年10月21日 至2024年4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11期 2023年10月20日現在	第12期 2024年4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11期 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日	第12期 自 2023年10月21日 至 2024年4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11期 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日	第12期 自 2023年10月21日 至 2024年4月20日
期首元本額 7,677,276,000円	期首元本額 6,324,729,000円
期中追加設定元本額 446,800,000円	期中追加設定元本額 176,200,000円
期中一部交換元本額 1,799,347,000円	期中一部交換元本額 243,478,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第11期 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日	第12期 自 2023年10月21日 至 2024年4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	571,534,898	1,256,162,611
合計	571,534,898	1,256,162,611

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11期(2023年10月20日現在)			第12期(2024年4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	164,045,000	—	157,570,000	△6,478,465	163,260,000	—	157,560,000	△5,702,970
合計	164,045,000	—	157,570,000	△6,478,465	163,260,000	—	157,560,000	△5,702,970

(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4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	ニッスイ	5,000	940.70	4,703,500	
		マルハニチロ	700	2,968.50	2,077,950	
		石油資源開発	900	6,690.00	6,021,000	
		安藤・間	2,600	1,150.00	2,990,000	
		大成建設	2,500	5,227.00	13,067,500	
		大林組	13,800	1,691.00	23,335,800	
		清水建設	9,000	889.90	8,009,100	
		鹿島建設	6,700	2,834.50	18,991,150	
		奥村組	500	4,765.00	2,382,500	
		戸田建設	3,600	978.20	3,521,520	
		住友林業	2,700	4,330.00	11,691,000	
		大和ハウス工業	10,900	4,220.00	45,998,000	
		積水ハウス	11,100	3,350.00	37,185,000	
		きんでん	2,200	3,028.00	6,661,600	
		森永製菓	1,500	2,471.50	3,707,250	
		カルビー	1,800	3,343.00	6,017,400	
		森永乳業	1,200	2,980.00	3,576,000	
		明治ホールディングス	4,500	3,435.00	15,457,500	
		アサヒグループホールディングス	11,000	5,299.00	58,289,000	
		キリンホールディングス	18,100	2,215.50	40,100,550	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	2,400	2,126.00	5,102,400			
サントリー食品インターナショナル	2,900	5,018.00	14,552,200			

味の素	10,100	5,372.00	54,257,200
キューピー	2,200	3,064.00	6,740,800
カゴメ	1,600	3,589.00	5,742,400
ニチレイ	2,600	3,869.00	10,059,400
東洋水産	1,600	9,122.00	14,595,200
東洋紡	1,800	1,091.00	1,963,800
帝人	3,700	1,482.50	5,485,250
ワコールホールディングス	1,100	3,407.00	3,747,700
ゴールドウイン	400	8,990.00	3,596,000
デサント	800	3,220.00	2,576,000
王子ホールディングス	19,000	633.10	12,028,900
日本製紙	1,500	1,105.00	1,657,500
旭化成	24,900	1,095.00	27,265,500
レゾナック・ホールディングス	2,700	3,732.00	10,076,400
住友化学	24,300	343.60	8,349,480
日産化学	2,300	5,432.00	12,493,600
クレハ	800	2,671.00	2,136,800
信越化学工業	36,500	6,129.00	223,708,500
エア・ウォーター	3,300	2,276.50	7,512,450
日本酸素ホールディングス	4,000	4,319.00	17,276,000
日本触媒	2,000	1,470.50	2,941,000
カネカ	800	3,890.00	3,112,000
三菱瓦斯化学	2,800	2,732.50	7,651,000
三井化学	3,100	4,410.00	13,671,000
三菱ケミカルグループ	24,800	898.80	22,290,240
ダイセル	4,800	1,390.00	6,672,000
住友ベークライト	1,200	4,336.00	5,203,200
積水化学工業	6,300	2,223.50	14,008,050
日本ゼオン	3,100	1,364.00	4,228,400
UBE	1,500	2,741.50	4,112,250
ADEKA	1,300	3,141.00	4,083,300
日油	3,300	2,072.50	6,839,250
花王	10,200	6,273.00	63,984,600
日本ペイントホールディングス	20,200	948.70	19,163,740
関西ペイント	2,800	2,027.50	5,677,000

富士フイルムホールディングス	23,700	3,330.00	78,921,000
資生堂	11,100	4,057.00	45,032,700
ライオン	5,000	1,352.50	6,762,500
ミルボン	600	2,946.00	1,767,600
ファンケル	2,000	1,802.00	3,604,000
コーセー	700	7,671.00	5,369,700
ポーラ・オルビスホールディングス	2,100	1,388.00	2,914,800
小林製薬	900	5,504.00	4,953,600
デクセリアルズ	1,100	5,725.00	6,297,500
日東電工	3,000	13,755.00	41,265,000
エフピコ	900	2,573.50	2,316,150
ニフコ	1,300	3,722.00	4,838,600
ユニ・チャーム	7,700	4,424.00	34,064,800
協和キリン	6,900	2,609.00	18,002,100
武田薬品工業	38,900	4,069.00	158,284,100
アステラス製薬	43,700	1,480.50	64,697,850
住友ファーマ	3,900	389.00	1,517,100
塩野義製薬	7,000	7,114.00	49,798,000
日本新薬	1,300	4,205.00	5,466,500
中外製薬	16,200	4,921.00	79,720,200
エーザイ	5,700	5,901.00	33,635,700
ロート製薬	4,000	2,918.50	11,674,000
小野薬品工業	7,600	2,238.00	17,008,800
参天製薬	8,300	1,452.50	12,055,750
ツムラ	1,200	3,777.00	4,532,400
ネクセラファーマ	1,400	1,450.00	2,030,000
第一三共	38,000	4,636.00	176,168,000
大塚ホールディングス	10,300	6,186.00	63,715,800
ペプチドリーム	2,200	1,468.50	3,230,700
サワイグループホールディングス	800	5,934.00	4,747,200
ENEOSホールディングス	73,800	720.10	53,143,380
コスモエネルギーホールディングス	1,600	7,438.00	11,900,800
ブリヂストン	9,800	6,692.00	65,581,600
TOTO	2,500	4,199.00	10,497,500
日本碍子	3,600	2,014.00	7,250,400

日本特殊陶業	3,000	5,017.00	15,051,000
フジミインコーポレーテッド	900	3,310.00	2,979,000
神戸製鋼所	6,000	1,884.50	11,307,000
J F Eホールディングス	11,700	2,348.00	27,471,600
東京製鐵	1,100	1,610.00	1,771,000
三菱マテリアル	2,200	3,037.00	6,681,400
A R Eホールディングス	1,400	2,000.00	2,800,000
東洋製罐グループホールディングス	2,000	2,379.00	4,758,000
L I X I L	6,800	1,742.00	11,845,600
三浦工業	1,400	2,426.00	3,396,400
DMG 森精機	2,500	4,162.00	10,405,000
ディスコ	2,200	49,800.00	109,560,000
SMC	1,200	76,700.00	92,040,000
小松製作所	17,400	4,353.00	75,742,200
荏原製作所	1,900	12,780.00	24,282,000
ダイキン工業	4,100	19,215.00	78,781,500
栗田工業	1,700	5,836.00	9,921,200
ダイフク	4,400	3,165.00	13,926,000
フジテック	1,000	3,647.00	3,647,000
セガサミーホールディングス	3,000	1,964.00	5,892,000
日立造船	2,600	1,213.00	3,153,800
日清紡ホールディングス	2,300	1,147.00	2,638,100
ブラザー工業	5,200	2,792.00	14,518,400
ミネベアミツミ	5,400	2,746.00	14,828,400
三菱電機	36,300	2,458.00	89,225,400
富士電機	1,900	9,741.00	18,507,900
安川電機	3,900	5,980.00	23,322,000
マブチモーター	1,500	2,618.50	3,927,750
ニデック	8,500	6,592.00	56,032,000
オムロン	3,900	5,012.00	19,546,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,000	2,905.50	2,905,500
日本電気	6,200	10,780.00	66,836,000
富士通	41,100	2,448.00	100,612,800
サンケン電気	500	6,051.00	3,025,500
セイコーエプソン	8,000	2,629.50	21,036,000

アルバック	1,000	9,575.00	9,575,000
TDK	8,300	7,078.00	58,747,400
アルプスアルパイン	4,500	1,242.50	5,591,250
横河電機	5,300	3,380.00	17,914,000
アズビル	3,100	4,179.00	12,954,900
日本光電工業	1,600	4,096.00	6,553,600
堀場製作所	800	14,315.00	11,452,000
シスメックス	11,400	2,322.00	26,470,800
ウシオ電機	2,100	1,957.00	4,109,700
カシオ計算機	3,000	1,308.50	3,925,500
浜松ホトニクス	2,900	5,448.00	15,799,200
新光電気工業	1,300	5,516.00	7,170,800
京セラ	28,000	1,902.00	53,256,000
太陽誘電	2,400	3,522.00	8,452,800
村田製作所	39,700	2,677.00	106,276,900
リコー	13,600	1,354.50	18,421,200
東京エレクトロン	10,700	33,530.00	358,771,000
日野自動車	5,100	472.20	2,408,220
テイ・エス テック	1,400	1,889.00	2,644,600
島津製作所	5,600	4,104.00	22,982,400
ナカニシ	1,400	2,163.00	3,028,200
ニコン	5,200	1,521.00	7,909,200
HOYA	8,100	17,320.00	140,292,000
朝日インテック	4,900	2,141.00	10,490,900
シチズン時計	4,000	1,016.00	4,064,000
メニコン	1,300	1,459.00	1,896,700
バンダイナムコホールディングス	10,900	2,841.50	30,972,350
タカラトミー	2,000	2,464.50	4,929,000
TOPPANホールディングス	4,900	3,546.00	17,375,400
大日本印刷	3,600	4,414.00	15,890,400
アシックス	3,700	6,634.00	24,545,800
ヤマハ	2,500	3,172.00	7,930,000
ビジョン	3,100	1,381.50	4,282,650
コクヨ	1,600	2,517.00	4,027,200
中部電力	14,000	1,940.00	27,160,000

関西電力	12,700	2,308.00	29,311,600
四国電力	2,800	1,212.50	3,395,000
北海道電力	3,300	1,187.50	3,918,750
東京瓦斯	9,400	3,758.00	35,325,200
大阪瓦斯	10,400	3,219.00	33,477,600
東邦瓦斯	1,500	3,584.00	5,376,000
相鉄ホールディングス	1,700	2,609.50	4,436,150
東急	10,600	1,866.00	19,779,600
小田急電鉄	4,800	1,747.00	8,385,600
東日本旅客鉄道	15,700	2,858.00	44,870,600
西武ホールディングス	5,000	2,480.00	12,400,000
近鉄グループホールディングス	3,600	4,118.00	14,824,800
ヤマトホールディングス	4,500	1,997.50	8,988,750
九州旅客鉄道	2,100	3,458.00	7,261,800
S Gホールディングス	6,300	1,780.50	11,217,150
N I P P O N E X P R E S S ホールディン	1,500	7,866.00	11,799,000
日本郵船	11,000	4,153.00	45,683,000
商船三井	7,300	4,590.00	33,507,000
川崎汽船	6,900	2,042.50	14,093,250
日本航空	3,300	2,775.00	9,157,500
ANAホールディングス	3,200	2,958.00	9,465,600
三菱倉庫	900	5,070.00	4,563,000
住友倉庫	800	2,605.00	2,084,000
NEC ネットエスアイ	1,500	2,494.00	3,741,000
T I S	5,100	3,211.00	16,376,100
コーエーテックモホールディングス	2,900	1,429.50	4,145,550
GMO ペイメントゲートウェイ	800	7,313.00	5,850,400
ラクス	1,800	1,571.50	2,828,700
チェンジホールディングス	1,100	1,115.00	1,226,500
ビジョナル	300	7,970.00	2,391,000
野村総合研究所	8,900	3,884.00	34,567,600
ラクスル	1,400	869.00	1,216,600
メルカリ	2,500	1,730.50	4,326,250
S a n s a n	2,000	1,373.00	2,746,000
メドレー	600	3,765.00	2,259,000

ジャストシステム	700	2,579.00	1,805,300
L I N Eヤフー	66,700	347.50	23,178,250
トレンドマイクロ	3,300	7,714.00	25,456,200
日本オラクル	900	11,305.00	10,174,500
大塚商会	5,100	3,103.00	15,825,300
電通総研	600	4,990.00	2,994,000
デジタルガレージ	800	2,548.00	2,038,400
ネットワンシステムズ	2,000	2,640.50	5,281,000
B I P R O G Y	2,100	4,528.00	9,508,800
日本電信電話	681,600	167.90	114,440,640
K D D I	35,000	4,252.00	148,820,000
ソフトバンク	65,700	1,818.00	119,442,600
光通信	400	24,295.00	9,718,000
GMOインターネットグループ	1,500	2,569.00	3,853,500
KADOKAWA	2,100	2,740.50	5,755,050
東宝	2,300	5,402.00	12,424,600
N T Tデータグループ	15,300	2,247.00	34,379,100
S C S K	3,800	2,696.00	10,244,800
富士ソフト	1,200	6,090.00	7,308,000
コナミグループ	1,900	9,078.00	17,248,200
ソフトバンクグループ	25,200	7,648.00	192,729,600
双日	4,700	3,815.00	17,930,500
アルフレッサ ホールディングス	3,700	2,148.00	7,947,600
ダイワボウホールディングス	1,900	2,564.50	4,872,550
コメダホールディングス	1,000	2,533.00	2,533,000
メディopalホールディングス	3,900	2,360.50	9,205,950
伊藤忠商事	27,000	6,504.00	175,608,000
丸紅	31,800	2,597.50	82,600,500
豊田通商	4,700	9,306.00	43,738,200
兼松	1,700	2,453.00	4,170,100
住友商事	21,600	3,721.00	80,373,600
三菱商事	78,300	3,452.00	270,291,600
岩谷産業	1,100	8,843.00	9,727,300
東邦ホールディングス	1,100	3,616.00	3,977,600
サンゲツ	900	3,220.00	2,898,000

サンリオ	2,800	2,628.00	7,358,400
ミスミグループ本社	5,500	2,177.50	11,976,250
ローソン	900	10,345.00	9,310,500
日本マクドナルドホールディングス	2,100	6,880.00	14,448,000
セリア	900	2,831.00	2,547,900
ビックカメラ	1,700	1,543.00	2,623,100
DCMホールディングス	1,700	1,392.00	2,366,400
Monotaro	5,700	1,875.50	10,690,350
J.フロント リテイリング	6,100	1,485.00	9,058,500
ZOZO	3,200	3,314.00	10,604,800
三越伊勢丹ホールディングス	8,400	2,315.50	19,450,200
コスモス薬品	400	14,430.00	5,772,000
ツルハホールディングス	700	9,752.00	6,826,400
トリドールホールディングス	800	3,665.00	2,932,000
FOOD & LIFE COMPANIE	2,400	2,928.00	7,027,200
パン・パシフィック・インターナショナルホ	6,200	3,757.00	23,293,400
スギホールディングス	2,300	2,332.50	5,364,750
日本瓦斯	2,000	2,489.00	4,978,000
しまむら	900	7,285.00	6,556,500
高島屋	4,000	2,218.50	8,874,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,900	1,807.00	3,433,300
丸井グループ	4,500	2,322.00	10,449,000
イオン	14,400	3,231.00	46,526,400
ケーズホールディングス	2,200	1,466.00	3,225,200
アインホールディングス	600	5,889.00	3,533,400
ヤマダホールディングス	12,100	440.60	5,331,260
ニトリホールディングス	1,800	21,260.00	38,268,000
吉野家ホールディングス	1,400	2,826.50	3,957,100
サンドラッグ	1,600	4,375.00	7,000,000
しずおかフィナンシャルグループ	11,300	1,400.00	15,820,000
京都フィナンシャルグループ	5,700	2,694.00	15,355,800
ゆうちょ銀行	36,400	1,528.00	55,619,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	24,100	808.50	19,484,850
あおぞら銀行	2,700	2,415.50	6,521,850

三菱UFJフィナンシャル・グループ	292,500	1,500.00	438,750,000
りそなホールディングス	51,900	981.10	50,919,090
三井住友トラスト・ホールディングス	15,800	3,173.00	50,133,400
三井住友フィナンシャルグループ	31,300	8,536.00	267,176,800
千葉銀行	14,300	1,286.50	18,396,950
七十七銀行	1,300	4,140.00	5,382,000
八十二銀行	8,700	1,012.50	8,808,750
みずほフィナンシャルグループ	59,500	2,942.00	175,049,000
SBIホールディングス	5,400	3,645.00	19,683,000
大和証券グループ本社	31,800	1,080.50	34,359,900
野村ホールディングス	77,000	876.40	67,482,800
松井証券	2,500	800.00	2,000,000
マネックスグループ	4,800	799.00	3,835,200
かんぽ生命保険	4,500	2,872.00	12,924,000
SOMPOホールディングス	24,600	3,021.00	74,316,600
MS&ADインシュアランスグループホール	34,800	2,679.00	93,229,200
第一生命ホールディングス	23,000	3,433.00	78,959,000
東京海上ホールディングス	47,000	4,638.00	217,986,000
T&Dホールディングス	12,300	2,457.50	30,227,250
クレディセゾン	3,700	2,882.50	10,665,250
芙蓉総合リース	400	13,390.00	5,356,000
東京センチュリー	3,200	1,532.50	4,904,000
イオンフィナンシャルサービス	2,500	1,285.50	3,213,750
オリックス	29,500	3,111.00	91,774,500
三菱HCキャピタル	18,400	1,007.00	18,528,800
日本取引所グループ	11,200	3,753.00	42,033,600
ビューリック	10,500	1,437.00	15,088,500
野村不動産ホールディングス	2,400	4,061.00	9,746,400
オープンハウスグループ	1,500	4,474.00	6,711,000
東急不動産ホールディングス	13,400	1,124.00	15,061,600
パーク24	2,500	1,718.50	4,296,250
三井不動産	61,500	1,570.50	96,585,750
三菱地所	23,000	2,798.00	64,354,000
東京建物	3,400	2,520.00	8,568,000

	住友不動産	5,500	5,423.00	29,826,500	
	イオンモール	2,500	1,732.50	4,331,250	
	カチタス	1,200	1,811.00	2,173,200	
	M I X I	900	2,463.00	2,216,700	
	日本M&Aセンターホールディングス	4,900	841.70	4,124,330	
	オープンアップグループ	1,000	1,985.00	1,985,000	
	エス・エム・エス	1,400	2,185.50	3,059,700	
	パーソルホールディングス	50,500	207.70	10,488,850	
	カカクコム	3,000	1,717.00	5,151,000	
	ディップ	900	2,698.00	2,428,200	
	エムスリー	9,700	1,789.50	17,358,150	
	ディー・エヌ・エー	2,000	1,486.50	2,973,000	
	インフォマート	4,600	372.00	1,711,200	
	電通グループ	4,600	4,126.00	18,979,600	
	H. U. グループホールディングス	1,500	2,326.50	3,489,750	
	オリエンタルランド	23,200	4,546.00	105,467,200	
	ラウンドワン	2,800	706.00	1,976,800	
	リゾートトラスト	1,500	2,614.50	3,921,750	
	ユー・エス・エス	6,700	1,185.00	7,939,500	
	サイバーエージェント	12,000	1,007.00	12,084,000	
	エン・ジャパン	800	2,684.00	2,147,200	
	テクノプロ・ホールディングス	1,900	2,814.00	5,346,600	
	リクルートホールディングス	40,000	6,111.00	244,440,000	
	ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,400	2,359.00	3,302,600	
	共立メンテナンス	1,100	3,324.00	3,656,400	
	セコム	3,300	10,700.00	35,310,000	
	小計 銘柄数：326			8,984,229,800	
	組入時価比率：98.2%			100.0%	
	合計			8,984,229,800	

(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4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。