



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

2024年11月18日
 November 18, 2024

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 野村株主還元70連動型上場投信
 コード番号 (2529)
 連動対象指標 野村株主還元 70
 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 Shareholder Yield 70 Exchange Traded Fund
 Code: 2529
 Underlying index: Nomura Shareholder Yield 70
 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12月25日
 分配金支払開始日 2024年11月15日
 Scheduled date of submission of securities report: December 25, 2024
 Date of commencing dividend payment: November 15, 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8日~2024年10月7日)

Management Status for Period ended October 2024 (from April 8, 2024 to October 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10月期 FY ended Oct. 2024	77,571	(99.4)	430	(0.6)	78,001	(100.0)
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	28,684	(99.0)	300	(1.0)	28,984	(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)

	前特定期間末 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)	当特定期間末 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	17,049	36,876	8,335	45,589
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	13,641	4,295	888	17,049

(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/当特定期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2024年10月期 FY ended Oct. 2024	79,028	1,027	78,001	171,096
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	29,347	363	28,984	170,004

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2024年10月期 FY ended Oct. 2024	2,100
2024年4月期 FY ended Apr. 2024	1,900

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)

	前期 (2024年4月7日現在) Prior period As of April 7, 2024	当期 (2024年10月7日現在) Present period As of October 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	286,240,291	352,877,255
株式 Stocks	28,684,066,130	77,571,315,390
未収入金 Accounts receivable - other	1,089,110	24,346,140
未収配当金 Accrued dividends receivable	343,899,350	981,050,930
未収利息 Accrued interest	1,794	2,294
差入委託証拠金 Margin deposits	32,300,516	99,164,107
流動資産合計 Total current assets	29,347,597,191	79,028,756,116
資産合計 Total assets	29,347,597,191	79,028,756,116
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	7,034,120	553,425
未払金 Accounts payable - other	1,427,814	365,190
未払収益分配金 Unpaid dividends	323,932,311	957,377,967
未払受託者報酬 Trustee fees payable	3,783,385	9,588,490
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	17,403,534	44,107,020
その他未払費用 Other accrued expenses	9,899,063	15,032,299
流動負債合計 Total current liabilities	363,480,227	1,027,024,391
負債合計 Total liabilities	363,480,227	1,027,024,391
純資産の部 Net assets		

元本等 Principal and other		
元本 Principal	17,049,069,000	45,589,427,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	11,935,047,964	32,412,304,725
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	8,093,757	4,271,749
元本等合計 Total principal and other	28,984,116,964	78,001,731,725
純資産合計 Total net assets	28,984,116,964	78,001,731,725
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	29,347,597,191	79,028,756,116

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	前期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日 Prior period From October 8, 2023 to April 7, 2024	当期 自 2024年4月8日 至 2024年10月7日 Present period From April 8, 2024 to October 7, 2024
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	434,997,650	1,255,142,515
受取利息 Interest income	9,968	186,786
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	3,971,453,177	2,707,697,457
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	50,164,901	10,719,835
その他収益 Other revenue	1,482	1,526
営業収益合計 Total operating revenue	4,456,627,178	3,973,748,119
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	20,200	-
受託者報酬 Trustee fees	6,889,453	16,068,811
委託者報酬 Investment trust management fees	31,691,427	73,916,461
その他費用 Other expenses	8,026,159	15,476,996
営業費用合計 Total operating expenses	46,627,239	105,462,268
営業利益又は営業損失 (△)	4,409,999,939	3,868,285,851

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	4,409,999,939	3,868,285,851
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	4,409,999,939	3,868,285,851
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	6,145,135,673	11,935,047,964
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	2,274,855,285	23,987,847,797
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	2,274,855,285	23,987,847,797
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	504,455,230	6,225,186,320
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	504,455,230	6,225,186,320
分配金 Dividends	390,487,703	1,153,690,567
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	11,935,047,964	32,412,304,725

(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	当該財務諸表の特定期間は、2024年4月8日から2024年10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)

前期 2024年4月7日現在	当期 2024年10月7日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 17,049,069 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 45,589,427 口
2. 特定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 1,700.04 円 (100口当たり純資産額) (170,004 円)	2. 特定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 1,710.96 円 (100口当たり純資産額) (171,096 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日	当期 自 2024年4月8日 至 2024年10月7日																																																																																																																								
<p>1. 分配金の計算過程</p> <p>2023年10月8日から2024年1月7日まで</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">88,346,963 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;">10,199,599 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;">98,546,562 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">20,468,882 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;">78,077,680 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">66,555,392 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;">11,522,288 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">16,638,848 口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td style="text-align: center;">I=F/H×100</td><td style="text-align: right;">400 円</td></tr> </tbody> </table> <p>2024年1月8日から2024年4月7日まで</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">346,641,937 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;">11,522,288 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;">358,164,225 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">26,138,157 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;">332,026,068 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">323,932,311 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;">8,093,757 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">17,049,069 口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td style="text-align: center;">I=F/H×100</td><td style="text-align: right;">1,900 円</td></tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち5,511,500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	88,346,963 円	分配準備積立金	B	10,199,599 円	配当等収益合計額	C=A+B	98,546,562 円	経費	D	20,468,882 円	収益分配可能額	E=C-D	78,077,680 円	収益分配金	F	66,555,392 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,522,288 円	口数	H	16,638,848 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	400 円	項目			当期配当等収益額	A	346,641,937 円	分配準備積立金	B	11,522,288 円	配当等収益合計額	C=A+B	358,164,225 円	経費	D	26,138,157 円	収益分配可能額	E=C-D	332,026,068 円	収益分配金	F	323,932,311 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,093,757 円	口数	H	17,049,069 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,900 円	<p>1. 分配金の計算過程</p> <p>2024年4月8日から2024年7月7日まで</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">249,249,161 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;">8,093,757 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;">257,342,918 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">42,716,690 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;">214,626,228 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">196,312,600 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;">18,313,628 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">39,262,520 口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td style="text-align: center;">I=F/H×100</td><td style="text-align: right;">500 円</td></tr> </tbody> </table> <p>2024年7月8日から2024年10月7日まで</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">1,006,081,666 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;">18,313,628 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;">1,024,395,294 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">62,745,578 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;">961,649,716 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">957,377,967 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;">4,271,749 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">45,589,427 口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td style="text-align: center;">I=F/H×100</td><td style="text-align: right;">2,100 円</td></tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち12,866,497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	249,249,161 円	分配準備積立金	B	8,093,757 円	配当等収益合計額	C=A+B	257,342,918 円	経費	D	42,716,690 円	収益分配可能額	E=C-D	214,626,228 円	収益分配金	F	196,312,600 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	18,313,628 円	口数	H	39,262,520 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	500 円	項目			当期配当等収益額	A	1,006,081,666 円	分配準備積立金	B	18,313,628 円	配当等収益合計額	C=A+B	1,024,395,294 円	経費	D	62,745,578 円	収益分配可能額	E=C-D	961,649,716 円	収益分配金	F	957,377,967 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,271,749 円	口数	H	45,589,427 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,100 円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	88,346,963 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	10,199,599 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	98,546,562 円																																																																																																																							
経費	D	20,468,882 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	78,077,680 円																																																																																																																							
収益分配金	F	66,555,392 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,522,288 円																																																																																																																							
口数	H	16,638,848 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	400 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	346,641,937 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	11,522,288 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	358,164,225 円																																																																																																																							
経費	D	26,138,157 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	332,026,068 円																																																																																																																							
収益分配金	F	323,932,311 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,093,757 円																																																																																																																							
口数	H	17,049,069 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,900 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	249,249,161 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	8,093,757 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	257,342,918 円																																																																																																																							
経費	D	42,716,690 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	214,626,228 円																																																																																																																							
収益分配金	F	196,312,600 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	18,313,628 円																																																																																																																							
口数	H	39,262,520 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	500 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	1,006,081,666 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	18,313,628 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	1,024,395,294 円																																																																																																																							
経費	D	62,745,578 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	961,649,716 円																																																																																																																							
収益分配金	F	957,377,967 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,271,749 円																																																																																																																							
口数	H	45,589,427 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,100 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

前期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日	当期 自 2024年4月8日 至 2024年10月7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>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>

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。

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

前期 2024年4月7日現在	当期 2024年10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。</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)

前期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日	当期 自 2024年4月8日 至 2024年10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

前期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日	当期 自 2024年4月8日 至 2024年10月7日
期首元本額 13,641,713,000円	期首元本額 17,049,069,000円
期中追加設定元本額 4,295,700,000円	期中追加設定元本額 36,876,200,000円
期中一部交換元本額 888,344,000円	期中一部交換元本額 8,335,842,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2023年10月8日 至 2024年4月7日	当期 自 2024年4月8日 至 2024年10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	2,127,974,664	510,516,517
合計	2,127,974,664	510,516,517

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	前期(2024年4月7日現在)				当期(2024年10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	277,629,170	—	270,600,000	△7,034,120	411,471,000	—	410,925,000	△553,425
合計	277,629,170	—	270,600,000	△7,034,120	411,471,000	—	410,925,000	△553,425

(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	INPEX	717,900	2,165.50	1,554,612,450	
		大成建設	204,100	6,325.00	1,290,932,500	
		清水建設	664,800	976.80	649,376,640	
		長谷工コーポレーション	241,300	1,914.50	461,968,850	
		鹿島建設	514,600	2,744.00	1,412,062,400	
		積水ハウス	436,500	3,934.00	1,717,191,000	
		明治ホールディングス	291,300	3,628.00	1,056,836,400	
		麒麟ホールディングス	661,800	2,208.00	1,461,254,400	
		日本たばこ産業	375,100	4,333.00	1,625,308,300	
		クラレ	365,200	2,152.50	786,093,000	
		住友化学	1,764,500	424.00	748,148,000	
		日産化学	142,700	5,195.00	741,326,500	
		東ソー	306,200	1,931.50	591,425,300	
		三菱瓦斯化学	200,500	2,836.00	568,618,000	
		三井化学	208,000	3,808.00	792,064,000	

積水化学工業	447,300	2,280.50	1,020,067,650
花王	235,700	7,116.00	1,677,241,200
関西ペイント	212,000	2,569.00	544,628,000
武田薬品工業	337,200	4,268.00	1,439,169,600
アステラス製薬	810,900	1,759.00	1,426,373,100
塩野義製薬	603,300	2,092.50	1,262,405,250
小野薬品工業	463,000	2,018.50	934,565,500
参天製薬	430,900	1,807.50	778,851,750
出光興産	1,255,200	1,122.00	1,408,334,400
E N E O Sホールディングス	2,439,800	838.90	2,046,748,220
コスモエネルギーホールディングス	79,400	8,420.00	668,548,000
ブリヂストン	234,100	5,717.00	1,338,349,700
A G C	229,600	4,805.00	1,103,228,000
太平洋セメント	145,400	3,375.00	490,725,000
日本碍子	297,200	1,924.00	571,812,800
日本特殊陶業	191,400	4,185.00	801,009,000
日本製鉄	423,300	3,231.00	1,367,682,300
住友金属鉱山	290,600	4,632.00	1,346,059,200
L I X I L	362,600	1,739.50	630,742,700
リンナイ	133,200	3,549.00	472,726,800
アマダ	412,700	1,519.00	626,891,300
ブラザー工業	292,800	2,997.50	877,668,000
セイコーエプソン	350,400	2,824.00	989,529,600
ヒロセ電機	33,600	19,540.00	656,544,000
キヤノン	377,700	4,901.00	1,851,107,700
リコー	669,500	1,679.00	1,124,090,500
本田技研工業	932,600	1,602.00	1,494,025,200
ヤマハ発動機	1,023,100	1,385.00	1,416,993,500
ニコン	351,400	1,671.50	587,365,100
大日本印刷	535,800	2,734.50	1,465,145,100
ヤマハ	521,700	1,288.00	671,949,600
東京瓦斯	422,300	3,416.00	1,442,576,800
ヤマトホールディングス	323,500	1,652.00	534,422,000
N I P P O N E X P R E S S ホールディング	89,600	7,696.00	689,561,600
日本郵船	312,800	4,974.00	1,555,867,200

	商船三井	302,700	4,827.00	1,461,132,900	
	川崎汽船	678,000	2,050.50	1,390,239,000	
	日本オラクル	41,000	15,115.00	619,715,000	
	日本電信電話	7,935,300	149.60	1,187,120,880	
	KDDI	304,800	4,740.00	1,444,752,000	
	ソフトバンク	7,771,000	193.00	1,499,803,000	
	ソフトバンクグループ	217,300	8,745.00	1,900,288,500	
	双日	188,100	3,480.00	654,588,000	
	アルフレッサ ホールディングス	220,100	2,361.50	519,766,150	
	丸紅	613,500	2,519.00	1,545,406,500	
	三井物産	516,100	3,442.00	1,776,416,200	
	住友商事	444,500	3,424.00	1,521,968,000	
	三菱商事	606,700	3,086.00	1,872,276,200	
	丸井グループ	185,100	2,410.00	446,091,000	
	大東建託	79,000	17,205.00	1,359,195,000	
	野村不動産ホールディングス	141,900	3,961.00	562,065,900	
	三菱地所	703,700	2,342.50	1,648,417,250	
	電通グループ	248,600	4,592.00	1,141,571,200	
	ユー・エス・エス	513,000	1,390.00	713,070,000	
	日本郵政	1,085,600	1,416.00	1,537,209,600	
	小計 銘柄数：70			77,571,315,390	
	組入時価比率：99.4%			100.0%	
	合計			77,571,315,390	

(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。