



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

2023年11月16日
 November 16, 2023

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 日経平均高配当株50指数連動型上場投信
 コード番号 (1489)
 連動対象指標 日経平均高配当株50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 <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 Nikkei 225 High Dividend Yield Stock 50 Index Exchange Traded Fund
 Code: 1489
 Underlying index: Nikkei 225 High Dividend Yield Stock 50 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 2023年12月27日
 分配金支払開始日 2023年11月15日
 Scheduled date of submission of securities report: December 27, 2023
 Date of commencing dividend payment: November 15, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

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

Management Status for Period ended October 2023 (from April 8, 2023 to October 7, 2023)

(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.	%
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	181,844	(97.5)	4,636	(2.5)	186,481	(100.0)
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	84,328	(96.5)	3,091	(3.5)	87,419	(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
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	1,970	1,728	369	3,329
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	1,420	819	269	1,970

(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/当特定期間末発行済口数)×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
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	189,770	3,288	186,481	56,009
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	89,483	2,063	87,419	44,356

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2023年10月期 FY ended Oct. 2023	893
2023年4月期 FY ended Apr. 2023	966

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 (2023年4月7日現在) Prior period As of April 7, 2023	当期 (2023年10月7日現在) Present period As of October 7, 2023
	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	1,070,995,179	1,511,699,661
株式 Stocks	84,328,195,680	181,844,990,540
未収入金 Accounts receivable - other	1,902,009,606	2,991,985,916
未収配当金 Accrued dividends receivable	1,971,130,550	3,051,967,150
差入委託証拠金 Margin deposits	211,059,926	369,430,000
流動資産合計 Total current assets	89,483,390,941	189,770,073,267
資産合計 Total assets	89,483,390,941	189,770,073,267
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	84,856,156	177,493,505
未払収益分配金 Unpaid dividends	1,903,846,896	2,973,224,747
未払受託者報酬 Trustee fees payable	9,834,678	18,426,420
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	45,239,498	84,761,507
未払利息 Accrued interest expenses	142	2,528
その他未払費用 Other accrued expenses	20,063,868	34,586,768
流動負債合計 Total current liabilities	2,063,841,238	3,288,495,475
負債合計 Total liabilities	2,063,841,238	3,288,495,475
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		

元本 Principal	68,733,603,000	116,115,580,125
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	18,685,946,703	70,365,997,667
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	851,979	2,442,289
元本等合計 Total principal and other	87,419,549,703	186,481,577,792
純資産合計 Total net assets	87,419,549,703	186,481,577,792
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	89,483,390,941	189,770,073,267

(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 2022年10月8日 至 2023年4月7日 Prior period From October 8, 2022 to April 7, 2023	当期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日 Present period From April 8, 2023 to October 7, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	2,243,161,300	3,390,028,950
受取利息 Interest income	148	-
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	6,143,905,308	18,923,433,296
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△84,856,156	351,340,264
その他収益 Other revenue	243	530
営業収益合計 Total operating revenue	8,302,210,843	22,664,803,040
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	31,589	424,944
受託者報酬 Trustee fees	18,095,440	30,923,883
委託者報酬 Investment trust management fees	83,238,992	142,249,797
その他費用 Other expenses	24,306,745	36,324,791
営業費用合計 Total operating expenses	125,672,766	209,923,415
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	8,176,538,077	22,454,879,625
経常利益又は経常損失 (△)	8,176,538,077	22,454,879,625

Ordinary profit (loss)		
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	8,176,538,077	22,454,879,625
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	7,110,555,779	18,685,946,703
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	7,758,529,938	37,620,477,309
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	7,758,529,938	37,620,477,309
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	2,242,742,980	5,216,790,215
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	2,242,742,980	5,216,790,215
分配金 Dividends	2,116,934,111	3,178,515,755
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	18,685,946,703	70,365,997,667

(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、2023年4月8日から2023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 2023年4月7日現在	当期 2023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 <p style="text-align: right;">1, 970, 856 口</p> 2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 <p style="text-align: right;">1口当たり純資産額 44, 356 円</p>	1. 特定期間の末日における受益権の総数 <p style="text-align: right;">3, 329, 479 口</p> 2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 <p style="text-align: right;">1口当たり純資産額 56, 009 円</p>
---	---

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2022年10月8日 至 2023年4月7日	当期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日																																																																																																																								
1. 分配金の計算過程 2022年10月8日から2023年1月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin-top: 5px;"> <thead> <tr><th style="width: 30%;">項目</th><th style="width: 30%;"></th><th style="width: 40%;"></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;">269, 292, 122 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;">297, 165 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;">269, 589, 287 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">56, 122, 809 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;">213, 466, 478 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">213, 087, 215 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;">379, 263 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">1, 469, 567 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;">145 円</td></tr> </tbody> </table> 2023年1月8日から2023年4月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin-top: 5px;"> <thead> <tr><th style="width: 30%;">項目</th><th style="width: 30%;"></th><th style="width: 40%;"></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, 973, 837, 980 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;">379, 263 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, 974, 217, 243 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">69, 518, 368 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;">1, 904, 698, 875 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">1, 903, 846, 896 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;">851, 979 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">1, 970, 856 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;">966 円</td></tr> </tbody> </table> 2. その他費用 その他費用のうち18,127,724円は、対象指数についての商標使用料であります。	項目			当期配当等収益額	A	269, 292, 122 円	分配準備積立金	B	297, 165 円	配当等収益合計額	C=A+B	269, 589, 287 円	経費	D	56, 122, 809 円	収益分配可能額	E=C-D	213, 466, 478 円	収益分配金	F	213, 087, 215 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	379, 263 円	口数	H	1, 469, 567 口	1口当たり分配金	I=F/H	145 円	項目			当期配当等収益額	A	1, 973, 837, 980 円	分配準備積立金	B	379, 263 円	配当等収益合計額	C=A+B	1, 974, 217, 243 円	経費	D	69, 518, 368 円	収益分配可能額	E=C-D	1, 904, 698, 875 円	収益分配金	F	1, 903, 846, 896 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	851, 979 円	口数	H	1, 970, 856 口	1口当たり分配金	I=F/H	966 円	1. 分配金の計算過程 2023年4月8日から2023年7月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin-top: 5px;"> <thead> <tr><th style="width: 30%;">項目</th><th style="width: 30%;"></th><th style="width: 40%;"></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;">290, 271, 369 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;">851, 979 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;">291, 123, 348 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">85, 053, 467 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;">206, 069, 881 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">205, 291, 008 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;">778, 873 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">1, 973, 952 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;">104 円</td></tr> </tbody> </table> 2023年7月8日から2023年10月7日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin-top: 5px;"> <thead> <tr><th style="width: 30%;">項目</th><th style="width: 30%;"></th><th style="width: 40%;"></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;">3, 099, 333, 167 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;">778, 873 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;">3, 100, 112, 040 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">124, 445, 004 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;">2, 975, 667, 036 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">2, 973, 224, 747 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;">2, 442, 289 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">3, 329, 479 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;">893 円</td></tr> </tbody> </table> 2. その他費用 その他費用のうち31,119,649円は、対象指数についての商標使用料であります。	項目			当期配当等収益額	A	290, 271, 369 円	分配準備積立金	B	851, 979 円	配当等収益合計額	C=A+B	291, 123, 348 円	経費	D	85, 053, 467 円	収益分配可能額	E=C-D	206, 069, 881 円	収益分配金	F	205, 291, 008 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	778, 873 円	口数	H	1, 973, 952 口	1口当たり分配金	I=F/H	104 円	項目			当期配当等収益額	A	3, 099, 333, 167 円	分配準備積立金	B	778, 873 円	配当等収益合計額	C=A+B	3, 100, 112, 040 円	経費	D	124, 445, 004 円	収益分配可能額	E=C-D	2, 975, 667, 036 円	収益分配金	F	2, 973, 224, 747 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2, 442, 289 円	口数	H	3, 329, 479 口	1口当たり分配金	I=F/H	893 円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	269, 292, 122 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	297, 165 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	269, 589, 287 円																																																																																																																							
経費	D	56, 122, 809 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	213, 466, 478 円																																																																																																																							
収益分配金	F	213, 087, 215 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	379, 263 円																																																																																																																							
口数	H	1, 469, 567 口																																																																																																																							
1口当たり分配金	I=F/H	145 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	1, 973, 837, 980 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	379, 263 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	1, 974, 217, 243 円																																																																																																																							
経費	D	69, 518, 368 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	1, 904, 698, 875 円																																																																																																																							
収益分配金	F	1, 903, 846, 896 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	851, 979 円																																																																																																																							
口数	H	1, 970, 856 口																																																																																																																							
1口当たり分配金	I=F/H	966 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	290, 271, 369 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	851, 979 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	291, 123, 348 円																																																																																																																							
経費	D	85, 053, 467 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	206, 069, 881 円																																																																																																																							
収益分配金	F	205, 291, 008 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	778, 873 円																																																																																																																							
口数	H	1, 973, 952 口																																																																																																																							
1口当たり分配金	I=F/H	104 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	3, 099, 333, 167 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	778, 873 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	3, 100, 112, 040 円																																																																																																																							
経費	D	124, 445, 004 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	2, 975, 667, 036 円																																																																																																																							
収益分配金	F	2, 973, 224, 747 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2, 442, 289 円																																																																																																																							
口数	H	3, 329, 479 口																																																																																																																							
1口当たり分配金	I=F/H	893 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 2022年10月8日 至 2023年4月7日	当期 自 2023年4月8日 至 2023年10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。 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	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 同左

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なっております。

○市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。

○信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。

○流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

同左

(2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 2023年4月7日現在	当期 2023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。 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</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 2022年10月8日 至 2023年4月7日	当期 自 2023年4月8日 至 2023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 2022年10月8日 至 2023年4月7日	当期 自 2023年4月8日 至 2023年10月7日
期首元本額 49,556,468,250円	期首元本額 68,733,603,000円
期中追加設定元本額 28,575,389,250円	期中追加設定元本額 60,271,114,500円
期中一部交換元本額 9,398,254,500円	期中一部交換元本額 12,889,137,375円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2022年10月8日 至 2023年4月7日	当期 自 2023年4月8日 至 2023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	1,913,749,783	4,760,560,540
合計	1,913,749,783	4,760,560,540

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(2023年4月7日現在)				当期(2023年10月7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	3,111,649,926	—	3,026,870,000	△84,856,156	4,680,765,000	—	4,503,370,000	△177,493,505
合計	3,111,649,926	—	3,026,870,000	△84,856,156	4,680,765,000	—	4,503,370,000	△177,493,505

(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(2023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	I N P E X	3,151,500	1,916.50	6,039,849,750	
		長谷工コーポレーション	661,400	1,867.50	1,235,164,500	
		積水ハウス	1,029,900	2,828.50	2,913,072,150	
		日本たばこ産業	1,775,800	3,303.00	5,865,467,400	
		東ソー	1,340,000	1,841.50	2,467,610,000	
		デンカ	394,300	2,690.00	1,060,667,000	
		三井化学	486,400	3,720.00	1,809,408,000	
		三菱ケミカルグループ	3,374,300	888.50	2,998,065,550	
		UBE	424,200	2,317.50	983,083,500	
		D I C	349,000	2,370.00	827,130,000	
		武田薬品工業	1,037,900	4,484.00	4,653,943,600	
		出光興産	1,059,800	3,077.00	3,261,004,600	
		E N E O Sホールディングス	8,827,600	522.00	4,608,007,200	
		ブリヂストン	535,500	5,855.00	3,135,352,500	
		A G C	524,400	5,011.00	2,627,768,400	
		日本電気硝子	401,700	2,753.00	1,105,880,100	
		日本製鉄	1,988,000	3,326.00	6,612,088,000	

神戸製鋼所	2,936,600	1,805.00	5,300,563,000
JFEホールディングス	2,505,100	2,083.50	5,219,375,850
三井金属鉱業	323,700	3,662.00	1,185,389,400
アマダ	607,500	1,441.50	875,711,250
セイコーエプソン	711,300	2,280.00	1,621,764,000
キヤノン	1,079,400	3,505.00	3,783,297,000
いすゞ自動車	1,962,600	1,761.50	3,457,119,900
シチズン時計	1,178,100	894.00	1,053,221,400
NIPPON EXPRESSホールディング	211,200	7,669.00	1,619,692,800
日本郵船	1,463,800	3,951.00	5,783,473,800
商船三井	1,700,300	4,016.00	6,828,404,800
川崎汽船	1,722,000	5,445.00	9,376,290,000
ソフトバンク	3,634,100	1,678.00	6,098,019,800
双日	1,077,800	3,032.00	3,267,889,600
三井物産	833,600	5,093.00	4,245,524,800
住友商事	1,490,600	2,845.50	4,241,502,300
三菱商事	692,000	6,865.00	4,750,580,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3,255,100	686.90	2,235,928,190
あおぞら銀行	1,274,200	2,925.00	3,727,035,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,083,000	1,239.00	6,297,837,000
りそなホールディングス	4,731,200	822.50	3,891,412,000
三井住友トラスト・ホールディングス	591,700	5,618.00	3,324,170,600
三井住友フィナンシャルグループ	836,700	7,284.00	6,094,522,800
ふくおかフィナンシャルグループ	740,400	3,602.00	2,666,920,800
みずほフィナンシャルグループ	2,429,700	2,490.50	6,051,167,850
大和証券グループ本社	2,906,500	854.10	2,482,441,650
野村ホールディングス	4,597,000	597.60	2,747,167,200
SOMPOホールディングス	759,000	6,215.00	4,717,185,000
MS&ADインシュアランスグループホール	675,100	5,442.00	3,673,894,200
東京海上ホールディングス	1,318,700	3,349.00	4,416,326,300
T&Dホールディングス	1,253,400	2,510.00	3,146,034,000
日本郵政	4,386,800	1,245.00	5,461,566,000
小計 銘柄数：49			181,844,990,540

	組入時価比率：97.5%			100.0%
合計				181,844,990,540

(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(2023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。