



2023年9月期 (2023年3月11日～2023年9月10日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended September 2023 (March 11, 2023 – September 10, 2023)

2023年10月20日
 October 20, 2023

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信
 コード番号 (2635)
 連動対象指標 S&P 500 ESG 指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 10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 S&P 500 ESG Index Exchange Traded Fund
 Code: 2635
 Underlying index: S&P 500 ESG Index
 Primary invested assets: Stocks
 Trading unit: 10 units
 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11月30日
 分配金支払開始日 2023年10月19日
 Scheduled date of submission of securities report: November 30, 2023
 Date of commencing dividend payment: October 19, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2023年9月期の運用状況 (2023年3月11日～2023年9月10日)

Management Status for Year ended September 2023 (from March 11, 2023 to September 10, 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9月期 FY ended Sep. 2023	3,712	(92.2)	314	(7.8)	4,026	(100.0)
2023年3月期 FY ended Mar. 2023	2,991	(95.5)	142	(4.5)	3,133	(100.0)

(2) 設定・解約実績

(千口未満切捨て)

Creation and Redemption

(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)	解約口数 No. of Units Redeemed (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
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	1,243	60	20	1,283
2023年3月期 FY ended Mar. 2023	2,123	400	1,280	1,243

(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
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	4,055	29	4,026	313,854
2023年3月期 FY ended Mar. 2023	3,176	42	3,133	252,111

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	1,930
2023年3月期 FY ended Mar. 2023	2,870

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4期 (2023年3月10日現在) 4th Fiscal Year As of March 10, 2023	第5期 (2023年9月10日現在) 5th Fiscal Year As of September 10, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	51,677,458	193,734,179
コール・ローン Call loans	7,309,533	7,818,049
株式 Stocks	2,880,171,614	3,596,664,734
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	36,080,052	29,990,040
投資証券 Investment securities	75,070,095	85,599,198
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	442,033	2,274,980
未収入金 Accounts receivable - other	28,851,000	17,985,060
未収配当金 Accrued dividends receivable	3,715,494	4,511,401
差入委託証拠金 Margin deposits	93,015,293	117,289,265
流動資産合計 Total current assets	3,176,332,572	4,055,866,906
資産合計 Total assets	3,176,332,572	4,055,866,906
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	2,571,026	1,011,709
未払収益分配金 Unpaid dividends	35,674,100	24,761,900
未払受託者報酬 Trustee fees payable	593,724	397,869
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	3,265,411	2,188,271
未払利息 Accrued interest expenses	6	40
その他未払費用	489,155	756,178

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	42,593,422	29,115,967
負債合計 Total liabilities	42,593,422	29,115,967
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	2,486,000,000	2,566,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	647,739,150	1,460,750,939
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	102,152	71,913
元本等合計 Total principal and other	3,133,739,150	4,026,750,939
純資産合計 Total net assets	3,133,739,150	4,026,750,939
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	3,176,332,572	4,055,866,906

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第4期 自 2022年9月11日 至 2023年3月10日 4th Fiscal Year From September 11, 2022 to March 10, 2023	第5期 自 2023年3月11日 至 2023年9月10日 5th Fiscal Year From March 11, 2023 to September 10, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	39,721,301	25,780,488
受取利息 Interest income	473,855	365,761
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	61,465,654	493,174,299
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△5,015,777	17,868,183
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	△405,693,578	253,056,946
その他収益 Other revenue	1,238,578	2,448,038
営業収益合計 Total operating revenue	△307,809,967	792,693,715
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	10,263	2,238

受託者報酬 Trustee fees	593,724	397,869
委託者報酬 Investment trust management fees	3,265,411	2,188,271
その他費用 Other expenses	1,950,161	1,274,248
営業費用合計 Total operating expenses	5,819,559	3,862,626
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△313,629,526	788,831,089
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△313,629,526	788,831,089
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△313,629,526	788,831,089
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△) Distribution of profit loss from partial redemptions	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△) Surplus (deficit) at beginning of period	1,535,018,176	647,739,150
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	240,400,800	65,439,000
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	240,400,800	65,439,000
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	778,376,200	16,496,400
当期一部解約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 redemptions	778,376,200	16,496,400
分配金 Dividends	35,674,100	24,761,900
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	647,739,150	1,460,750,939

(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	<p>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。</p> <p>投資信託受益証券 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。 市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券 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。</p> <p>先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>
--------------------	--

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 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。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 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。
5. 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3月11日から2023年9月10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4期 2023年3月10日現在	第5期 2023年9月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,243,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,283,000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 2,521.11円 (100口当たり純資産額) (252,111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 3,138.54円 (100口当たり純資産額) (313,854円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自2022年9月11日 至2023年3月10日	第5期 自2023年3月11日 至2023年9月10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>41,423,471円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>162,077円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>41,585,548円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>5,809,296円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>35,776,252円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>35,674,100円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>102,152円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,243,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>2,870円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	41,423,471円	分配準備積立金	B	162,077円	配当等収益合計額	C=A+B	41,585,548円	経費	D	5,809,296円	収益分配可能額	E=C-D	35,776,252円	収益分配金	F	35,674,100円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	102,152円	口数	H	1,243,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,870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>28,592,049円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>102,152円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>28,694,201円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,860,388円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>24,833,813円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>24,761,900円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>71,913円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,283,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,930円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	28,592,049円	分配準備積立金	B	102,152円	配当等収益合計額	C=A+B	28,694,201円	経費	D	3,860,388円	収益分配可能額	E=C-D	24,833,813円	収益分配金	F	24,761,900円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	71,913円	口数	H	1,283,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,930円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	41,423,471円																																																											
分配準備積立金	B	162,077円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	41,585,548円																																																											
経費	D	5,809,296円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	35,776,252円																																																											
収益分配金	F	35,674,100円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	102,152円																																																											
口数	H	1,243,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,870円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	28,592,049円																																																											
分配準備積立金	B	102,152円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	28,694,201円																																																											
経費	D	3,860,388円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	24,833,813円																																																											
収益分配金	F	24,761,900円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	71,913円																																																											
口数	H	1,283,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,930円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち1,080,586円は対象指数についての商標使用料、388,439円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。	2. その他費用 その他費用のうち720,582円は対象指数についての商標使用料、203,061円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。																																																												

(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4期 自2022年9月11日	第5期 自2023年3月11日
--------------------	--------------------

至 2023年3月10日	至 2023年9月10日
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替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>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、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第4期 2023年3月10日現在	第5期 2023年9月10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>投資信託受益証券 (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>投資証券 (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4期 自 2022年9月11日 至 2023年3月10日	第5期 自 2023年3月11日 至 2023年9月10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4期 自 2022年9月11日 至 2023年3月10日	第5期 自 2023年3月11日 至 2023年9月10日
期首元本額 4,246,000,000円	期首元本額 2,486,000,000円
期中追加設定元本額 800,000,000円	期中追加設定元本額 120,000,000円
期中一部解約元本額 2,560,000,000円	期中一部解約元本額 40,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第4期 自 2022年9月11日 至 2023年3月10日	第5期 自 2023年3月11日 至 2023年9月10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	△26,531,147	470,258,897
投資信託受益証券	91,807	1,837,625
投資証券	△7,132,256	1,027,229
合計	△33,571,596	473,123,751

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4期(2023年3月10日現在)				第5期(2023年9月10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	141,984,919	—	139,856,362	△2,128,557	307,892,231	—	309,156,517	1,264,286
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	36,977,964	—	36,978,400	△436	25,713,275	—	25,714,290	△1,015
米ドル	36,977,964	—	36,978,400	△436	25,713,275	—	25,714,290	△1,015
合計	—	—	—	△2,128,993	—	—	—	1,263,271

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

先物の評価においては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

① 計算日において為替予約の受渡日 (以下「当該日」といいます) の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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9月10日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	887	37.20	32,996.40	
		HALLIBURTON CO	797	41.08	32,740.76	
		SCHLUMBERGER LTD	1,259	60.83	76,584.97	
		APA CORPORATION	296	44.37	13,133.52	
		CHEVRON CORP	1,589	166.64	264,790.96	
		CONOCOPHILLIPS	1,087	121.71	132,298.77	
		DEVON ENERGY CORP	577	52.50	30,292.50	
		EOG RESOURCES INC	521	131.55	68,537.55	
		EQT CORP	327	41.76	13,655.52	
		HESS CORP	245	158.33	38,790.85	
		KINDER MORGAN INC	1,747	16.59	28,982.73	
		MARATHON OIL CORP	586	26.70	15,646.20	
		MARATHON PETROLEUM CORP	379	150.89	57,187.31	
		ONEOK INC	394	64.31	25,338.14	
		PHILLIPS 66	412	118.75	48,925.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	210	238.95	50,179.50	
		VALERO ENERGY CORP	323	136.25	44,008.75	
		WILLIAMS COS	1,076	34.19	36,788.44	
		AIR PRODUCTS	197	292.11	57,545.67	
		ALBEMARLE CORP	108	187.57	20,257.56	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	181	80.85	14,633.85			
CORTEVA INC	631	49.56	31,272.36			
DOW INC	623	54.10	33,704.30			
ECOLAB INC	219	181.68	39,787.92			

FMC CORP	116	76.10	8,827.60
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	225	69.20	15,570.00
LINDE PLC	438	386.62	169,339.56
LYONDELLBASELL INDU-CL A	224	98.84	22,140.16
MOSAIC CO/THE	314	36.68	11,517.52
PPG INDUSTRIES	208	136.18	28,325.44
AMCOR PLC	1,373	9.15	12,562.95
BALL CORP	289	51.29	14,822.81
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	328	33.58	11,014.24
WESTROCK CO	235	33.23	7,809.05
FREEMONT-MCMORAN INC	1,266	39.76	50,336.16
NEWMONT CORP	702	38.36	26,928.72
CARRIER GLOBAL CORP	737	57.25	42,193.25
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	608	57.00	34,656.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	203	206.51	41,921.53
QUANTA SERVICES INC	127	208.70	26,504.90
EATON CORP PLC	353	234.81	82,887.93
EMERSON ELEC	506	99.40	50,296.40
GENERAC HOLDINGS INC	58	118.12	6,850.96
ROCKWELL AUTOMATION INC	101	304.44	30,748.44
GENERAL ELECTRIC CO	967	111.79	108,100.93
CATERPILLAR INC DEL	462	281.43	130,020.66
CUMMINS INC	125	232.55	29,068.75
DEERE & COMPANY	240	411.73	98,815.20
DOVER CORP	129	141.72	18,281.88
FORTIVE CORP	310	78.65	24,381.50
IDEX CORP	70	218.50	15,295.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	246	238.40	58,646.40
INGERSOLL-RAND INC	356	69.55	24,759.80
NORDSON CORP	50	233.86	11,693.00
OTIS WORLDWIDE CORP	367	82.97	30,449.99
PACCAR	461	83.05	38,286.05
PARKER HANNIFIN CORP	113	409.11	46,229.43
PENTAIR PLC	152	69.09	10,501.68
STANLEY BLACK & DECKER INC	136	92.29	12,551.44

WABTEC CORP	168	107.73	18,098.64
XYLEM INC	213	95.70	20,384.10
UNITED RENTALS INC	61	467.31	28,505.91
CINTAS CORP	76	497.50	37,810.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	181	146.76	26,563.56
WASTE MANAGEMENT INC	329	156.90	51,620.10
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	105	86.19	9,049.95
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	142	115.50	16,401.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	648	162.24	105,131.52
ALASKA AIR GROUP INC	114	40.02	4,562.28
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	599	14.00	8,386.00
CSX CORP	1,816	29.49	53,553.84
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	76	186.06	14,140.56
NORFOLK SOUTHERN CORP	203	196.19	39,826.57
UNION PAC CORP	543	210.57	114,339.51
APTIV PLC	239	100.68	24,062.52
BORGWARNER INC	216	39.75	8,586.00
FORD MOTOR COMPANY	3,465	11.96	41,441.40
GENERAL MOTORS CO	1,234	32.57	40,191.38
TESLA INC	2,406	251.49	605,084.94
MOHAWK INDUSTRIES	49	94.36	4,623.64
NEWELL BRANDS INC	347	10.16	3,525.52
PULTEGROUP INC	210	80.98	17,005.80
WHIRLPOOL CORP	50	136.12	6,806.00
HASBRO INC	120	70.35	8,442.00
NIKE INC-B	1,109	97.93	108,604.37
RALPH LAUREN CORPORATION	38	116.29	4,419.02
TAPESTRY INC	222	31.79	7,057.38
V F CORP	305	19.19	5,852.95
CAESARS ENTERTAINMENT INC	198	53.37	10,567.26
DARDEN RESTAURANTS INC	107	149.86	16,035.02
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	236	148.36	35,012.96
LAS VEGAS SANDS CORP	303	49.78	15,083.34
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	230	199.87	45,970.10
MCDONALD'S CORP	652	278.33	181,471.16

MGM RESORTS INTERNATIONAL	294	43.40	12,759.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	375	16.49	6,183.75
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	202	97.18	19,630.36
STARBUCKS CORP	1,021	95.10	97,097.10
YUM BRANDS INC	248	127.19	31,543.12
AMAZON.COM INC	7,971	137.85	1,098,802.35
EBAY INC	478	43.12	20,611.36
ETSY INC	116	69.09	8,014.44
BEST BUY COMPANY INC	172	72.67	12,499.24
HOME DEPOT	907	328.42	297,876.94
LOWES COS INC	537	233.61	125,448.57
TJX COS INC	1,026	91.45	93,827.70
TRACTOR SUPPLY COMPANY	98	219.00	21,462.00
DOLLAR GENERAL CORP	199	123.72	24,620.28
DOLLAR TREE INC	184	116.56	21,447.04
KROGER CO	575	45.53	26,179.75
SYSCO CORP	449	69.16	31,052.84
TARGET CORP	408	124.46	50,779.68
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	631	22.04	13,907.24
WALMART INC	1,248	163.47	204,010.56
BROWN-FORMAN CORP-CL B	169	64.20	10,849.80
COCA COLA CO	3,464	58.33	202,055.12
CONSTELLATION BRANDS INC-A	144	259.56	37,376.64
KEURIG DR PEPPER INC	756	33.31	25,182.36
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	173	63.07	10,911.11
PEPSICO INC	1,226	176.40	216,266.40
ARCHER DANIELS MIDLAND	484	78.53	38,008.52
CAMPBELL SOUP CO	185	41.82	7,736.70
CONAGRA BRANDS INC	442	28.88	12,764.96
GENERAL MILLS	522	64.99	33,924.78
HERSHEY CO/THE	130	208.99	27,168.70
HORMEL FOODS CORP	267	36.98	9,873.66
JM SMUCKER CO/THE-NEW	98	140.34	13,753.32
KELLOGG CO	236	59.37	14,011.32
KRAFT HEINZ CO/THE	703	32.68	22,974.04

MCCORMICK & CO INC.	231	80.12	18,507.72
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,210	70.00	84,700.00
TYSON FOODS INC-CL A	250	51.33	12,832.50
COLGATE PALMOLIVE CO.	740	73.56	54,434.40
PROCTER & GAMBLE CO	2,100	153.59	322,539.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	205	155.40	31,857.00
ABBOTT LABORATORIES	1,552	100.67	156,239.84
BAXTER INTERNATIONAL INC.	444	38.97	17,302.68
BECTON, DICKINSON	252	267.06	67,299.12
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,270	53.89	68,440.30
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	548	76.09	41,697.32
HOLOGIC INC	217	72.94	15,827.98
IDEXX LABORATORIES INC	73	477.21	34,836.33
MEDTRONIC PLC	1,181	79.93	94,397.33
TELEFLEX INC	42	206.64	8,678.88
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	187	120.51	22,535.37
CARDINAL HEALTH INC	227	88.59	20,109.93
CENCORA INC	143	178.18	25,479.74
CENTENE CORP	487	66.44	32,356.28
CVS HEALTH CORP	1,140	65.60	74,784.00
DAVITA INC	51	95.34	4,862.34
ELEVANCE HEALTH INC	212	450.33	95,469.96
HENRY SCHEIN INC	125	74.19	9,273.75
HUMANA INC	111	471.98	52,389.78
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	82	205.25	16,830.50
QUEST DIAGNOSTICS INC	97	127.11	12,329.67
THE CIGNA GROUP	265	281.29	74,541.85
UNITEDHEALTH GROUP INC	832	484.81	403,361.92
ABBVIE INC	1,574	148.91	234,384.34
AMGEN INC	474	254.39	120,580.86
BIOGEN INC	127	261.34	33,190.18
GILEAD SCIENCES INC	1,107	73.94	81,851.58
MODERNA INC	292	108.35	31,638.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	95	825.26	78,399.70
VERTEX PHARMACEUTICALS	228	343.96	78,422.88

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,889	59.97	113,283.33
ELI LILLY & CO.	702	573.23	402,407.46
MERCK & CO INC	2,257	107.94	243,620.58
ORGANON & CO	235	19.47	4,575.45
PFIZER INC	5,041	34.28	172,805.48
VIATRIS INC	1,118	10.00	11,180.00
ZOETIS INC	414	187.78	77,740.92
BANK OF AMERICA CORP	6,212	28.13	174,743.56
CITIGROUP	1,719	40.73	70,014.87
FIFTH THIRD BANCORP	633	26.09	16,514.97
JPMORGAN CHASE & CO	2,611	143.72	375,252.92
M & T BANK CORP	151	119.33	18,018.83
PNC FINANCIAL	355	115.77	41,098.35
REGIONS FINANCIAL CORP	862	17.79	15,334.98
TRUIST FINANCIAL CORP	1,174	29.27	34,362.98
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	528	54.39	28,717.92
MASTERCARD INC	747	414.62	309,721.14
PAYPAL HOLDINGS INC	1,007	61.65	62,081.55
VISA INC-CLASS A SHARES	1,446	247.14	357,364.44
AFLAC INC	495	74.65	36,951.75
ALLSTATE CORP	232	107.73	24,993.36
AMERICAN INTL GROUP	657	59.65	39,190.05
ARCH CAPITAL GROUP LTD	329	77.87	25,619.23
ARTHUR J GALLAGHER & CO	189	230.64	43,590.96
ASSURANT INC	49	137.59	6,741.91
CHUBB LTD	368	204.02	75,079.36
EVEREST GROUP LTD	35	367.22	12,852.70
GLOBE LIFE INC	83	108.64	9,017.12
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	277	71.79	19,885.83
LINCOLN NATIONAL CORP	142	24.76	3,515.92
METLIFE INC	583	62.77	36,594.91
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	210	74.68	15,682.80
PROGRESSIVE CO	521	137.41	71,590.61
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	325	94.28	30,641.00
TRAVELERS COS INC/THE	204	160.67	32,776.68

WILLIS TOWERS WATSON PLC	94	203.86	19,162.84
WR BERKLEY CORP	189	61.78	11,676.42
ADOBE INC	410	560.46	229,788.60
AUTODESK INC.	191	221.01	42,212.91
FORTINET INC	577	63.17	36,449.09
GEN DIGITAL INC	535	20.00	10,700.00
INTUIT INC	250	553.61	138,402.50
MICROSOFT CORP	6,640	329.91	2,190,602.40
SALESFORCE INC	874	222.53	194,491.22
TYLER TECHNOLOGIES INC	38	390.91	14,854.58
ARISTA NETWORKS INC	219	195.54	42,823.26
CISCO SYSTEMS	3,657	56.79	207,681.03
F5 INC	54	161.45	8,718.30
JUNIPER NETWORKS INC	299	28.66	8,569.34
MOTOROLA SOLUTIONS INC	148	282.41	41,796.68
APPLE INC	13,203	177.56	2,344,324.68
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,187	17.29	20,523.23
HP INC	762	29.32	22,341.84
SEAGATE TECHNOLOGY	177	63.44	11,228.88
CORNING INC	671	31.52	21,149.92
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	157	131.60	20,661.20
TE CONNECTIVITY LTD	280	128.18	35,890.40
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	48	264.24	12,683.52
ADVANCED MICRO DEVICES	1,432	106.59	152,636.88
APPLIED MATERIALS	748	148.23	110,876.04
INTEL CORP	3,725	38.18	142,220.50
KLA CORP	123	497.18	61,153.14
LAM RESEARCH	120	676.70	81,204.00
MICRON TECHNOLOGY	968	69.87	67,634.16
NVIDIA CORP	2,209	462.41	1,021,463.69
NXP SEMICONDUCTORS NV	231	204.01	47,126.31
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	384	98.51	37,827.84
QUALCOMM INC	992	106.40	105,548.80
SOLAREDEGE TECHNOLOGIES INC	50	152.29	7,614.50
TEXAS INSTRUMENTS INC	807	164.71	132,920.97

AT & T INC	6,331	14.61	92,495.91
VERIZON COMMUNICATIONS	3,738	33.81	126,381.78
CONSTELLATION ENERGY	291	108.54	31,585.14
EDISON INTERNATIONAL	337	68.68	23,145.16
ENTERGY CORP	179	94.35	16,888.65
EVERSOURCE ENERGY	307	61.35	18,834.45
EXELON CORPORATION	879	40.57	35,661.03
NEXTERA ENERGY INC	1,807	66.25	119,713.75
CENTERPOINT ENERGY INC	560	27.95	15,652.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	440	60.16	26,470.40
SEMPRA	556	70.46	39,175.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	170	137.71	23,410.70
AMERICAN EXPRESS CO	528	156.78	82,779.84
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	337	99.92	33,673.04
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	235	89.39	21,006.65
SYNCHRONY FINANCIAL	381	30.92	11,780.52
AMERIPRISE FINANCIAL INC	93	340.46	31,662.78
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	649	44.85	29,107.65
BLACKROCK INC	133	691.06	91,910.98
CBOE GLOBAL MARKETS INC	98	153.56	15,048.88
CME GROUP INC	319	205.29	65,487.51
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	35	430.92	15,082.20
FRANKLIN RESOURCES INC	262	25.93	6,793.66
GOLDMAN SACHS GROUP	297	321.96	95,622.12
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	495	115.23	57,038.85
INVESCO LTD	419	15.34	6,427.46
MARKETAXESS HOLDINGS INC	35	227.29	7,955.15
MOODYS CORP	139	342.12	47,554.68
MORGAN STANLEY	1,163	83.84	97,505.92
MSCI INC	71	546.49	38,800.79
NASDAQ INC	313	51.66	16,169.58
NORTHERN TRUST CORP	192	75.55	14,505.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	179	103.96	18,608.84
S&P GLOBAL INC	293	393.58	115,318.94
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,327	57.82	76,727.14

	STATE STREET CORP	307	69.51	21,339.57
	T ROWE PRICE GROUP INC	206	110.03	22,666.18
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	262	116.26	30,460.12
	BIO-RAD LABORATORIES-A	20	367.88	7,357.60
	ILLUMINA INC	139	158.85	22,080.15
	METTLER-TOLEDO INTL	20	1,162.07	23,241.40
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	344	531.66	182,891.04
	WATERS CORP	55	270.30	14,866.50
	AUTOMATIC DATA PROCESS	369	250.12	92,294.28
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	105	187.13	19,648.65
	PAYCHEX INC	286	120.19	34,374.34
	ROBERT HALF INC	100	73.27	7,327.00
	VERISK ANALYTICS INC	129	245.16	31,625.64
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	93	416.98	38,779.14
	COMCAST CORP-CL A	3,744	44.84	167,880.96
	FOX CORP-CLASS A	264	30.86	8,147.04
	FOX CORP-CLASS B	123	28.46	3,500.58
	INTERPUBRIC GROUP	358	32.04	11,470.32
	NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	340	21.00	7,140.00
	NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	105	21.54	2,261.70
	OMNICOM GROUP	188	79.57	14,959.16
	PARAMOUNT GLOBAL	450	13.02	5,859.00
	DISNEY (WALT) CO	1,626	80.57	131,006.82
	ELECTRONIC ARTS	230	120.94	27,816.20
	NETFLIX INC	396	443.14	175,483.44
	WARNER BROS DISCOVERY INC	1,949	11.03	21,497.47
	ALPHABET INC-CL A	5,301	135.26	717,013.26
	ALPHABET INC-CL C	4,564	136.20	621,616.80
	MATCH GROUP INC	249	44.48	11,075.52
	CBRE GROUP INC	278	85.00	23,630.00
	小計 銘柄数 : 299			24,465,442.72
				(3,596,664,734)
	組入時価比率 : 89.3%			100.0%
合計				3,596,664,734
				(3,596,664,734)

(注1) 外貨建資産証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建資産証券に係るもので、内書であります。

(注3) 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9月10日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	XTRACKERS S&P 500 ESG ETF	5,000	204,000.00	
	小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 0.7%	5,000	204,000.00 (29,990,040) 25.9%	
	合計			29,990,040 (29,990,040)	
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	138	16,057.68	
		AMERICAN TOWER CORP	413	75,393.15	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	123	22,290.06	
		BOSTON PROPERTIES	132	8,704.08	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	254	33,477.20	
		EQUINIX INC	84	65,146.20	
		EQUITY RESIDENTIAL	314	19,970.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	60	13,874.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	189	24,048.36	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	67	6,535.18	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	496	9,984.48	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	659	10,352.89	
		IRON MOUNTAIN INC	268	17,058.20	
		KIMCO REALTY CORP	570	10,579.20	
		PROLOGIS INC	820	101,114.20	
		REGENCY CENTERS CORP	142	9,069.54	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	96	21,239.04	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	289	33,076.05	
		UDR INC	282	11,031.84	
		VENTAS INC	369	15,715.71	
		WELLTOWER INC	444	36,652.20	
	WEYERHAEUSER CO	644	20,897.80		
小計	銘柄数: 22	6,853	582,267.86 (85,599,198)		

	組入時価比率：2.1%		74.1%
合計			85,599,198 (85,599,198)
合計			115,589,238 (115,589,238)

(注1) 投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2) 外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注3) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注4) 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。

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。