



2024年3月期 (2023年9月8日～2024年3月7日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended March 2024 (September 8, 2023 – March 7, 2024)

2024年4月17日  
 April 17, 2024

上場取引所 東証  
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信  
 コード番号 (2511)  
 連動対象指標 FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)  
 主要投資資産 親投資信託証券および公社債  
 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 International Bond FTSE World Government Bond Index (ex Japan Unhedged) Exchange Traded Fund  
 Code: 2511  
 Underlying index: FTSE World Government Bond Index (ex Japan, JPY Base)  
 Primary invested assets: Mother fund, Public and corporate bonds  
 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 2024年5月29日  
 分配金支払開始日 2024年4月15日  
 Scheduled date of submission of securities report: May 29, 2024  
 Date of commencing dividend payment: April 15, 2024

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2024年3月期の運用状況 (2023年9月8日～2024年3月7日)

Management Status for Year ended March 2024 (from September 8, 2023 to March 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<br>(負債控除後)                               |              | 合計 (純資産)           |              |
|--------------------------------|-------------------------|--------------|---|--------------|--------------------|--------------|
|                                | Primary Invested Assets |              | Cash/Deposits/Other Assets<br>(excluding liabilities) |              | Total (Net Assets) |              |
|                                | 金額<br>Amount            | 構成比<br>ratio | 金額<br>Amount  | 構成比<br>ratio | 金額<br>Amount       | 構成比<br>ratio |
|                                | 百万円<br>JPY mil.         | %            | 百万円<br>JPY mil.                                       | %            | 百万円<br>JPY mil.    | %            |
| 2024年3月期<br>FY ended Mar. 2024 | 34,579                  | (100.0)      | 13  | (0.0)        | 34,593             | (100.0)      |
| 2023年9月期<br>FY ended Sep. 2023 | 31,517                  | (100.0)      | 15  | (0.0)        | 31,533             | (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<br>発行済口数<br>No. of Issued Units<br>at End of Previous<br>Fiscal Period<br>(①) | 設定口数<br>No. of Units Created<br>(②) | 解約口数<br>No. of Units<br>Redeemed<br>(③) | 当計算期間末<br>発行済口数<br>No. of Issued Units<br>at End of Fiscal<br>Period<br>(①+②-③) |
|--------------------------------|--|-------------------------------------|---|---|
|                                | 千口<br>'000 units   | 千口<br>'000 units                    | 千口<br>'000 units                        | 千口<br>'000 units  |
| 2024年3月期<br>FY ended Mar. 2024 | 30,710   | 4,460                               | 2,900                                   | 32,270  |
| 2023年9月期<br>FY ended Sep. 2023 | 28,290   | 11,310                              | 8,890                                   | 30,710  |

(3) 基準価額

Net Asset Value

|                                | 総資産<br>Total Assets<br>(①) | 負債<br>Liabilities<br>(②) | 純資産<br>Net Assets<br>(③(①-②)) | 100口当り基準価額<br>((③/当計算期間末発行済口数)×100)<br>Net Asset Value per 100 units<br>((③/No. of Issued Units at End of Fiscal<br>Period)×100) |
|--------------------------------|----------------------------|--------------------------|-------------------------------|--|
|                                | 百万円<br>JPY mil.            | 百万円<br>JPY mil.          | 百万円<br>JPY mil.               | 円<br>JPY   |
| 2024年3月期<br>FY ended Mar. 2024 | 35,123                     | 529                      | 34,593                        | 107,200  |
| 2023年9月期<br>FY ended Sep. 2023 | 32,050                     | 517                      | 31,533                        | 102,680  |

(4) 分配金

Dividend Payment

|                                | 100口当り分配金<br>Dividend per 100 units |
|--------------------------------|-------------------------------------|
|                                | 円<br>JPY                            |
| 2024年3月期<br>FY ended Mar. 2024 | 1,560                               |
| 2023年9月期<br>FY ended Sep. 2023 | 1,610                               |

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12期<br>(2023年9月7日現在)<br>12th Fiscal Year<br>As of September 7, 2023 | 第13期<br>(2024年3月7日現在)<br>13th Fiscal Year<br>As of March 7, 2024 |
|--|--|--|
|  | 金額 Amount  | 金額 Amount  |
| 資産の部<br>Assets   |  |  |
| 流動資産<br>Current assets                                 |  |  |
| コール・ローン<br>Call loans                                  | 25,538,992   | 29,251,584   |
| 親投資信託受益証券<br>Parents trust beneficiary securities      | 31,517,609,269   | 34,579,776,117   |
| 未収入金<br>Accounts receivable - other                    | 507,007,950  | 514,065,598  |
| 流動資産合計<br>Total current assets                         | 32,050,156,211   | 35,123,093,299   |
| 資産合計<br>Total assets                                   | 32,050,156,211   | 35,123,093,299   |
| 負債の部<br>Liabilities                                    |  |  |
| 流動負債<br>Current liabilities                            |  |  |
| 未払収益分配金<br>Unpaid dividends                            | 494,431,000  | 503,412,000  |
| 未払受託者報酬<br>Trustee fees payable                        | 3,442,049  | 3,704,341  |
| 未払委託者報酬<br>Investment trust management fees payable    | 17,210,178   | 18,521,620   |
| 未払利息<br>Accrued interest expenses                      | 48   | 9  |
| その他未払費用<br>Other accrued expenses                      | 1,997,477  | 3,859,347  |
| 流動負債合計<br>Total current liabilities                    | 517,080,752  | 529,497,317  |
| 負債合計<br>Total liabilities                              | 517,080,752  | 529,497,317  |
| 純資産の部<br>Net assets                                    |  |  |
| 元本等<br>Principal and other                             |  |  |
| 元本<br>Principal  | 30,710,000,000   | 32,270,000,000   |
| 剰余金<br>Surplus   |  |  |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△)<br>Surplus (deficit) at end of period | 823,075,459  | 2,323,595,982  |

|   |                |                |
|---|----------------|----------------|
| (分配準備積立金)<br>(Reserve for distribution)     | 941,354        | 1,991,792      |
| 元本等合計<br>Total principal and other          | 31,533,075,459 | 34,593,595,982 |
| 純資産合計<br>Total net assets                   | 31,533,075,459 | 34,593,595,982 |
| 負債純資産合計<br>Total liabilities and net assets | 32,050,156,211 | 35,123,093,299 |

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

(単位：円) (Unit：JPY)

|   | 第12期<br>自 2023年3月8日<br>至 2023年9月7日<br>12th Fiscal Year<br>From March 8, 2023<br>to September 7, 2023 | 第13期<br>自 2023年9月8日<br>至 2024年3月7日<br>13th Fiscal Year<br>From September 8, 2023<br>to March 7, 2024 |
|---|--|--|
|   | 金額 Amount  | 金額 Amount  |
| 営業収益<br>Operating revenue   |  |  |
| 有価証券売買等損益<br>Profit and loss on buying and selling of securities and other                        | 2,702,325,783  | 2,048,360,091  |
| 営業収益合計<br>Total operating revenue   | 2,702,325,783  | 2,048,360,091  |
| 営業費用<br>Operating expenses  |  |  |
| 支払利息<br>Interest expenses   | 12,202   | 21,234   |
| 受託者報酬<br>Trustee fees   | 3,442,049  | 3,704,341  |
| 委託者報酬<br>Investment trust management fees   | 17,210,178   | 18,521,620   |
| その他費用<br>Other expenses   | 4,638,829  | 5,775,173  |
| 営業費用合計<br>Total operating expenses  | 25,303,258   | 28,022,368   |
| 営業利益又は営業損失(△)<br>Operating profit (loss)  | 2,677,022,525  | 2,020,337,723  |
| 経常利益又は経常損失(△)<br>Ordinary profit (loss)   | 2,677,022,525  | 2,020,337,723  |
| 当期純利益又は当期純損失(△)<br>Profit (loss)  | 2,677,022,525  | 2,020,337,723  |
| 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(△)<br>Distribution of profit loss from partial redemptions | -  | -  |
| 期首剰余金又は期首欠損金(△)<br>Surplus (deficit) at beginning of period                                       | △1,246,035,766   | 823,075,459  |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額<br>Increase in surplus or decrease in deficit                                      | 114,826,700  | 152,032,700  |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額<br>Increase in surplus or decrease in deficit from partial redemptions    | 114,826,700  | -  |

|  |             |               |
|--|-------------|---------------|
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額<br>Increase in surplus or decrease in deficit from additional subscriptions for period | -           | 152,032,700   |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額<br>Decrease in surplus or increase in deficit   | 228,307,000 | 168,437,900   |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額<br>Decrease in surplus or increase in deficit from partial redemptions                 | -           | 168,437,900   |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額<br>Decrease in surplus or increase in deficit from additional subscriptions for period | 228,307,000 | -             |
| 分配金<br>Dividends   | 494,431,000 | 503,412,000   |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△)<br>Surplus (deficit) at end of period  | 823,075,459 | 2,323,595,982 |

(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     | 親投資信託受益証券<br>基準価額で評価しております。                                      |
| 2. 費用・収益の計上基準          | 有価証券売買等損益<br>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。 |
| 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9月8日から2024年3月7日までとなっております。           |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

| 第12期<br>2023年9月7日現在   | 第13期<br>2024年3月7日現在   |
|---|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>30,710,000口   | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>32,270,000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<br>1口当たり純資産額 1,026.80円<br>(100口当たり純資産額) (102,680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<br>1口当たり純資産額 1,072.00円<br>(100口当たり純資産額) (107,200円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第12期<br>自2023年3月8日<br>至2023年9月7日   | 第13期<br>自2023年9月8日<br>至2024年3月7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>△12,202円</td> </tr> <tr> <td>親ファンドの配当等収益額</td> <td>B</td> <td>520,425,155円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>C</td> <td>250,457円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>520,663,410円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>25,291,056円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>495,372,354円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>494,431,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>941,354円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目                               |              |  | 当期配当等収益額 | A | △12,202円 | 親ファンドの配当等収益額 | B | 520,425,155円 | 分配準備積立金 | C | 250,457円 | 配当等収益合計額 | D=A+B+C | 520,663,410円 | 経費 | E | 25,291,056円 | 収益分配可能額 | F=D-E | 495,372,354円 | 収益分配金 | G | 494,431,000円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | H=F-G | 941,354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>△21,234円</td> </tr> <tr> <td>親ファンドの配当等収益額</td> <td>B</td> <td>532,484,806円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>C</td> <td>941,354円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>533,404,926円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>28,001,134円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>505,403,792円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>503,412,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>1,991,792円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 |  |  | 当期配当等収益額 | A | △21,234円 | 親ファンドの配当等収益額 | B | 532,484,806円 | 分配準備積立金 | C | 941,354円 | 配当等収益合計額 | D=A+B+C | 533,404,926円 | 経費 | E | 28,001,134円 | 収益分配可能額 | F=D-E | 505,403,792円 | 収益分配金 | G | 503,412,000円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | H=F-G | 1,991,792円 |
| 項目   |                                  |              |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 当期配当等収益額   | A                                | △12,202円     |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 親ファンドの配当等収益額   | B                                | 520,425,155円 |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 分配準備積立金  | C                                | 250,457円     |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 配当等収益合計額   | D=A+B+C                          | 520,663,410円 |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 経費   | E                                | 25,291,056円  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 収益分配可能額  | F=D-E                            | 495,372,354円 |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 収益分配金  | G                                | 494,431,000円 |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 次期繰越金(分配準備積立金)   | H=F-G                            | 941,354円     |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 項目   |                                  |              |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 当期配当等収益額   | A                                | △21,234円     |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 親ファンドの配当等収益額   | B                                | 532,484,806円 |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 分配準備積立金  | C                                | 941,354円     |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 配当等収益合計額   | D=A+B+C                          | 533,404,926円 |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 経費   | E                                | 28,001,134円  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 収益分配可能額  | F=D-E                            | 505,403,792円 |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 収益分配金  | G                                | 503,412,000円 |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |
| 次期繰越金(分配準備積立金)   | H=F-G                            | 1,991,792円   |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |          |  |    |  |  |          |   |          |              |   |              |         |   |          |          |         |              |    |   |             |         |       |              |       |   |              |                |       |            |

|            |           |              |
|------------|-----------|--------------|
| 口数         | I         | 30,710,000 口 |
| 100口当たり分配金 | J=G/I×100 | 1,610 円      |

2. その他費用

その他費用のうち 3,161,135 円は、対象指数についての商標使用料であります。

|            |           |              |
|------------|-----------|--------------|
| 口数         | I         | 32,270,000 口 |
| 100口当たり分配金 | J=G/I×100 | 1,560 円      |

2. その他費用

その他費用のうち 3,358,867 円は、対象指数についての商標使用料であります。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

| 第12期<br>自 2023年 3月 8日<br>至 2023年 9月 7日   | 第13期<br>自 2023年 9月 8日<br>至 2024年 3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、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、金利変動リスク、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>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>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。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>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。</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> |

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| 第12期<br>2023年 9月 7日現在  | 第13期<br>2024年 3月 7日現在   |
|--|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>親投資信託受益証券<br/>(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>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>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</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p> |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 第12期<br>自 2023年 3月 8日<br>至 2023年 9月 7日                 | 第13期<br>自 2023年 9月 8日<br>至 2024年 3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 | 同左                                     |

ため、該当事項はございません。

(その他の注記)

1 元本の移動

|           | 第12期<br>自 2023年3月8日<br>至 2023年9月7日 | 第13期<br>自 2023年9月8日<br>至 2024年3月7日 |
|-----------|------------------------------------|------------------------------------|
| 期首元本額     | 28,290,000,000円                    | 30,710,000,000円                    |
| 期中追加設定元本額 | 11,310,000,000円                    | 4,460,000,000円                     |
| 期中一部解約元本額 | 8,890,000,000円                     | 2,900,000,000円                     |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類        | 第12期<br>自 2023年3月8日<br>至 2023年9月7日 | 第13期<br>自 2023年9月8日<br>至 2024年3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)                    |
| 親投資信託受益証券 | 2,424,343,099                      | 1,944,488,029                      |
| 合計        | 2,424,343,099                      | 1,944,488,029                      |

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2024年3月7日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2024年3月7日現在)

(単位:円)

| 種類        | 通貨  | 銘柄                       | 券面総額           | 評価額                      | 備考 |
|-----------|-----|--------------------------|----------------|--------------------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 外国債券マザーファンド              | 11,892,893,148 | 34,579,776,117           |    |
|           | 小計  | 銘柄数: 1<br>組入時価比率: 100.0% | 11,892,893,148 | 34,579,776,117<br>100.0% |    |
| 合計        |     |                          |                | 34,579,776,117           |    |

(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) 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

該当事項はありません。