



2022年3月期 (2021年9月11日～2022年3月10日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022 (September 11, 2021 – March 10, 2022)

2022年4月20日  
 April 20, 2022

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 2022年5月18日  
 分配金支払開始日 2022年4月18日  
 Scheduled date of submission of securities report: May 18, 2022  
 Date of commencing dividend payment: April 18, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2022年3月期の運用状況 (2021年9月11日～2022年3月10日)

Management Status for Year ended March 2022 (from September 11, 2021 to March 10, 2022)

(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.	%
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	4,698	(95.6)	215	(4.4)	4,914	(100.0)
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	985	(75.6)	318	(24.4)	1,303	(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
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	570	2,333	820	2,083
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	0	690	120	570

(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
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	4,951	37	4,914	235,910
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	1,307	3	1,303	228,767

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	750
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	540

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1期 (2021年9月10日現在) 1st Fiscal Year As of September 10, 2021	第2期 (2022年3月10日現在) 2nd Fiscal Year As of March 10, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	269,993,624	162,495,926
コール・ローン Call loans	2,908,559	9,928,124
株式 Stocks	951,057,613	4,546,541,056
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	10,236,765	31,386,505
投資証券 Investment securities	24,560,639	120,486,532
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	12,652,145	-
未収入金 Accounts receivable - other	2,176,925	-
未収配当金 Accrued dividends receivable	967,921	5,704,760
差入委託証拠金 Margin deposits	33,260,376	74,562,353
流動資産合計 Total current assets	1,307,814,567	4,951,105,256
資産合計 Total assets	1,307,814,567	4,951,105,256
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,676	8,258,740
未払金 Accounts payable - other	-	10,315,377
未払収益分配金 Unpaid dividends	3,078,000	15,622,500
未払受託者報酬 Trustee fees payable	98,113	337,942
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	539,547	1,858,609
未払利息	-	1

Accrued interest expenses		
その他未払費用 Other accrued expenses	126, 118	699, 309
流動負債合計 Total current liabilities	3, 843, 454	37, 092, 478
負債合計 Total liabilities	3, 843, 454	37, 092, 478
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	1, 140, 000, 000	4, 166, 000, 000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	163, 971, 113	748, 012, 778
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	8, 314	170, 311
元本等合計 Total principal and other	1, 303, 971, 113	4, 914, 012, 778
純資産合計 Total net assets	1, 303, 971, 113	4, 914, 012, 778
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	1, 307, 814, 567	4, 951, 105, 256

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第1期 自 2021年3月29日 至 2021年9月10日 1st Fiscal Year From March 29, 2021 to September 10, 2021	第2期 自 2021年9月11日 至 2022年3月10日 2nd Fiscal Year From September 11, 2021 to March 10, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	4, 808, 268	19, 754, 058
受取利息 Interest income	-	2
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	89, 022, 094	△342, 522, 652
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	22, 309, 821	6, 185, 421
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	5, 635, 584	115, 211, 119
営業収益合計 Total operating revenue	121, 775, 767	△201, 372, 052
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	2, 020	9, 021

受託者報酬 Trustee fees	98, 113	337, 942
委託者報酬 Investment trust management fees	539, 547	1, 858, 609
その他費用 Other expenses	1, 082, 274	1, 763, 991
営業費用合計 Total operating expenses	1, 721, 954	3, 969, 563
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	120, 053, 813	△205, 341, 615
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	120, 053, 813	△205, 341, 615
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	120, 053, 813	△205, 341, 615
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	-	163, 971, 113
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	61, 102, 500	1, 105, 711, 580
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	61, 102, 500	1, 105, 711, 580
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	14, 107, 200	300, 705, 800
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	14, 107, 200	300, 705, 800
分配金 Dividends	3, 078, 000	15, 622, 500
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	163, 971, 113	748, 012, 778

(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、2021年9月11日から2022年3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1期 2021年9月10日現在	第2期 2022年3月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 570,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,083,000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 2,287.67円 (100口当たり純資産額) (228,767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 2,359.10円 (100口当たり純資産額) (235,910円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自2021年3月29日 至2021年9月10日	第2期 自2021年9月11日 至2022年3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>4,806,248円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>4,806,248円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,719,934円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>3,086,314円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>3,078,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>8,314円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>570,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>540円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	4,806,248円	分配準備積立金	B	0円	配当等収益合計額	C=A+B	4,806,248円	経費	D	1,719,934円	収益分配可能額	E=C-D	3,086,314円	収益分配金	F	3,078,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,314円	口数	H	570,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	540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>19,745,039円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>8,314円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>19,753,353円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,960,542円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>15,792,811円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>15,622,500円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>170,311円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>2,083,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>750円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	19,745,039円	分配準備積立金	B	8,314円	配当等収益合計額	C=A+B	19,753,353円	経費	D	3,960,542円	収益分配可能額	E=C-D	15,792,811円	収益分配金	F	15,622,500円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	170,311円	口数	H	2,083,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	750円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	4,806,248円																																																											
分配準備積立金	B	0円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	4,806,248円																																																											
経費	D	1,719,934円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	3,086,314円																																																											
収益分配金	F	3,078,000円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,314円																																																											
口数	H	570,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	540円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	19,745,039円																																																											
分配準備積立金	B	8,314円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	19,753,353円																																																											
経費	D	3,960,542円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	15,792,811円																																																											
収益分配金	F	15,622,500円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	170,311円																																																											
口数	H	2,083,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	750円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち607,176円は上場に係る費用、179,585円は対象指数についての商標使用料、278,060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581,254円は上場に係る費用、614,149円は対象指数についての商標使用料、465,192円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。																																																												
3. 追加情報 2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息とし																																																													

て表示しております。

(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1期 自 2021年 3月 29日 至 2021年 9月 10日	第2期 自 2021年 9月 11日 至 2022年 3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。 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、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。 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。 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。</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1期 2021年 9月 10日現在	第2期 2022年 3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。 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。 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>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>

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。	
--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年 3月 29日 至 2021年 9月 10日	第2期 自 2021年 9月 11日 至 2022年 3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1期 自 2021年 3月 29日 至 2021年 9月 10日	第2期 自 2021年 9月 11日 至 2022年 3月 10日
期首元本額	1,140,000,000円
期中追加設定元本額	4,666,000,000円
期中一部解約元本額	1,640,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2021年 3月 29日 至 2021年 9月 10日	第2期 自 2021年 9月 11日 至 2022年 3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	76,041,869	△334,519,813
投資信託受益証券	892,621	△553,406
投資証券	2,968,200	△5,854,273
合計	79,902,690	△340,927,492

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1期(2021年 9月 10日現在)				第2期(2022年 3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	304,332,116	-	316,984,261	12,652,145	219,049,502	-	210,791,620	△8,257,882
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	3,500,216	-	3,501,892	△1,676	15,080,156	-	15,081,014	△858
米ドル	3,500,216	-	3,501,892	△1,676	15,080,156	-	15,081,014	△858
合計	-	-	-	12,650,469	-	-	-	△8,258,740

(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(2022年3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	HALLIBURTON CO	1,292	34.84	45,013.28	
		SCHLUMBERGER LTD	2,025	42.56	86,184.00	
		APA CORPORATION	524	38.70	20,278.80	
		CHEVRON CORP	2,783	166.27	462,729.41	
		CONOCOPHILLIPS	1,904	96.21	183,183.84	
		DEVON ENERGY CORP	909	58.94	53,576.46	
		EXXON MOBIL CORP	6,112	82.79	506,012.48	
		HESS CORP	398	96.70	38,486.60	
		KINDER MORGAN INC	2,815	18.33	51,598.95	
		MARATHON PETROLEUM CORP	889	75.43	67,057.27	
		OCCIDENTAL PETE CORP	1,281	57.50	73,657.50	
		ONEOK INC	644	66.61	42,896.84	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	328	230.40	75,571.20	
		WILLIAMS COS	1,754	32.50	57,005.00	
		AIR PRODUCTS	320	227.00	72,640.00	
		ALBEMARLE CORP	169	187.13	31,624.97	
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	310	92.34	28,625.40	
		CORTEVA INC	1,052	51.53	54,209.56	
		DOW INC	1,068	59.80	63,866.40	

EASTMAN CHEMICAL CO.	194	108.71	21,089.74
ECOLAB INC	360	165.02	59,407.20
FMC CORP	183	120.00	21,960.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	367	120.82	44,340.94
LINDE PLC	740	292.77	216,649.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	380	98.37	37,380.60
MOSAIC CO/THE	535	57.72	30,880.20
PPG INDUSTRIES	343	122.03	41,856.29
MARTIN MARIETTA MATERIALS	90	373.42	33,607.80
BALL CORP	468	86.41	40,439.88
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	559	42.17	23,573.03
WESTROCK CO	385	42.49	16,358.65
FREEMONT-MCMORAN INC	2,120	46.99	99,618.80
NEWMONT CORP	1,151	75.97	87,441.47
HOWMET AEROSPACE INC	555	33.98	18,858.90
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	283	255.53	72,314.99
TRANSDIGM GROUP INC	76	633.93	48,178.68
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,023	62.81	64,254.63
TRANE TECHNOLOGIES PLC	343	150.97	51,782.71
AMETEK INC	334	130.51	43,590.34
EATON CORP PLC	575	149.12	85,744.00
EMERSON ELEC	863	94.39	81,458.57
ROCKWELL AUTOMATION INC	167	271.04	45,263.68
GENERAL ELECTRIC CO	1,585	91.25	144,631.25
ROPER TECHNOLOGIES INC	152	443.29	67,380.08
CATERPILLAR INC DEL	781	209.78	163,838.18
CUMMINS INC	206	198.44	40,878.64
DEERE & COMPANY	407	368.86	150,126.02
DOVER CORP	208	151.20	31,449.60
FORTIVE CORP	518	58.49	30,297.82
IDEX CORP	110	191.94	21,113.40
ILLINOIS TOOL WORKS INC	412	207.77	85,601.24
INGERSOLL-RAND INC	588	48.57	28,559.16
PACCAR	501	87.32	43,747.32
PARKER HANNIFIN CORP	186	278.08	51,722.88

PENTAIR PLC	239	55.52	13,269.28
SNAP-ON INC	78	207.69	16,199.82
STANLEY BLACK & DECKER INC	235	152.66	35,875.10
WABTEC CORP	270	92.91	25,085.70
XYLEM INC	260	85.59	22,253.40
FASTENAL CO	830	54.76	45,450.80
GRAINGER(W.W.) INC	62	487.41	30,219.42
UNITED RENTALS INC	105	315.79	33,157.95
CINTAS CORP	127	374.16	47,518.32
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	302	125.77	37,982.54
WASTE MANAGEMENT INC	556	149.98	83,388.88
FEDEX CORPORATION	353	216.72	76,502.16
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,053	206.78	217,739.34
ALASKA AIR GROUP INC	181	48.63	8,802.03
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	935	14.30	13,370.50
DELTA AIR LINES INC	924	32.76	30,270.24
CSX CORP	3,202	34.61	110,821.22
NORFOLK SOUTHERN CORP	351	263.79	92,590.29
UNION PAC CORP	928	253.67	235,405.76
APTIV PLC	391	104.61	40,902.51
BORGWARNER INC	346	37.46	12,961.16
FORD MOTOR COMPANY	5,667	16.37	92,768.79
GENERAL MOTORS CO	2,096	42.28	88,618.88
TESLA INC	1,174	858.97	1,008,430.78
NEWELL BRANDS INC	547	22.57	12,345.79
PULTEGROUP INC	366	47.67	17,447.22
WHIRLPOOL CORP	88	196.40	17,283.20
HASBRO INC	187	89.93	16,816.91
NIKE INC-B	1,845	126.95	234,222.75
PVH CORP	103	75.36	7,762.08
RALPH LAUREN CORPORATION	70	108.64	7,604.80
TAPESTRY INC	397	35.88	14,244.36
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	272	15.26	4,150.72
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	310	13.76	4,265.60
V F CORP	471	53.49	25,193.79

BOOKING HOLDINGS INC	59	2,035.47	120,092.73
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	402	138.52	55,685.04
LAS VEGAS SANDS CORP	496	38.77	19,229.92
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	395	159.47	62,990.65
MCDONALD'S CORP	1,079	222.47	240,045.13
MGM RESORTS INTERNATIONAL	562	40.28	22,637.36
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	324	68.06	22,051.44
STARBUCKS CORP	1,703	87.60	149,182.80
YUM BRANDS INC	423	116.02	49,076.46
AMAZON.COM INC	630	2,785.58	1,754,915.40
EBAY INC	904	53.06	47,966.24
ETSY INC	183	144.72	26,483.76
DOLLAR TREE INC	325	147.75	48,018.75
TARGET CORP	705	216.00	152,280.00
BEST BUY COMPANY INC	320	101.74	32,556.80
CARMAX INC	234	101.89	23,842.26
HOME DEPOT	1,524	317.20	483,412.80
LOWES COS INC	1,000	225.88	225,880.00
TJX COS INC	1,736	61.19	106,225.84
KROGER CO	977	55.34	54,067.18
SYSCO CORP	740	79.76	59,022.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,037	48.12	49,900.44
WALMART INC	2,053	139.46	286,311.38
BROWN-FORMAN CORP-CL B	264	64.24	16,959.36
COCA COLA CO	5,612	58.96	330,883.52
CONSTELLATION BRANDS INC-A	237	214.72	50,888.64
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	272	52.48	14,274.56
PEPSICO INC	1,996	157.40	314,170.40
ARCHER DANIELS MIDLAND	808	81.78	66,078.24
CAMPBELL SOUP CO	292	42.63	12,447.96
CONAGRA BRANDS INC	692	31.18	21,576.56
GENERAL MILLS	874	64.11	56,032.14
HERSHEY CO/THE	210	204.88	43,024.80
HORMEL FOODS CORP	407	49.91	20,313.37
JM SMUCKER CO/THE-NEW	156	129.34	20,177.04

KELLOGG CO	369	62.19	22,948.11
KRAFT HEINZ CO/THE	1,025	38.18	39,134.50
MCCORMICK & CO INC.	360	98.31	35,391.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,014	61.29	123,438.06
TYSON FOODS INC-CL A	426	90.64	38,612.64
COLGATE PALMOLIVE CO.	1,217	75.54	91,932.18
PROCTER & GAMBLE CO	3,494	148.77	519,802.38
ABBOTT LABORATORIES	2,553	118.39	302,249.67
BAXTER INTERNATIONAL INC.	723	79.74	57,652.02
BECTON, DICKINSON	415	264.84	109,908.60
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,057	42.07	86,537.99
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	901	105.91	95,424.91
HOLOGIC INC	366	71.16	26,044.56
IDEXX LABORATORIES INC	122	529.92	64,650.24
MEDTRONIC PLC	1,943	103.58	201,255.94
AMERISOURCEBERGEN CORP	216	145.83	31,499.28
ANTHEM INC	350	465.37	162,879.50
CARDINAL HEALTH INC	407	53.19	21,648.33
CIGNA CORP	478	231.26	110,542.28
CVS HEALTH CORP	1,906	103.60	197,461.60
DAVITA INC	94	112.50	10,575.00
HENRY SCHEIN INC	200	85.58	17,116.00
HUMANA INC	186	429.17	79,825.62
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	138	265.63	36,656.94
MCKESSON CORP	220	276.53	60,836.60
QUEST DIAGNOSTICS INC	177	135.58	23,997.66
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,360	485.57	660,375.20
ABBVIE INC	2,552	148.84	379,839.68
AMGEN INC	813	231.46	188,176.98
BIOGEN INC	212	202.27	42,881.24
GILEAD SCIENCES INC	1,811	59.00	106,849.00
INCYTE CORP	271	72.01	19,514.71
REGENERON PHARMACEUTICALS	153	623.43	95,384.79
VERTEX PHARMACEUTICALS	367	239.24	87,801.08
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,204	68.13	218,288.52

ELI LILLY & CO.	1,146	262.79	301,157.34
MERCK & CO INC	3,647	77.79	283,700.13
PFIZER INC	8,103	48.75	395,021.25
VIATRIS INC	1,746	10.28	17,948.88
BANK OF AMERICA CORP	10,397	41.04	426,692.88
CITIGROUP	2,865	55.95	160,296.75
COMERICA INC	189	88.23	16,675.47
FIFTH THIRD BANCORP	987	44.74	44,158.38
JPMORGAN CHASE & CO	4,266	133.44	569,255.04
KEYCORP	1,344	23.32	31,342.08
PNC FINANCIAL	610	186.75	113,917.50
REGIONS FINANCIAL CORP	1,376	22.45	30,891.20
AFLAC INC	879	60.39	53,082.81
ALLSTATE CORP	414	122.42	50,681.88
ARTHUR J GALLAGHER & CO	299	155.94	46,626.06
ASSURANT INC	82	168.77	13,839.14
CHUBB LTD	622	203.94	126,850.68
GLOBE LIFE INC	134	97.45	13,058.30
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	491	67.89	33,333.99
LINCOLN NATIONAL CORP	245	62.27	15,256.15
MARSH & MCLENNAN COS	729	152.32	111,041.28
METLIFE INC	1,032	64.44	66,502.08
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	356	66.17	23,556.52
PROGRESSIVE CO	845	104.10	87,964.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	546	106.89	58,361.94
TRAVELERS COS INC/THE	355	171.37	60,836.35
ACCENTURE PLC-CL A	912	309.42	282,191.04
AKAMAI TECHNOLOGIES	235	109.18	25,657.30
DXC TECHNOLOGY CO	364	29.98	10,912.72
MASTERCARD INC	1,252	328.13	410,818.76
VISA INC-CLASS A SHARES	2,421	199.76	483,618.96
ADOBE INC	687	450.87	309,747.69
ANSYS INC	126	312.33	39,353.58
AUTODESK INC.	317	204.88	64,946.96
INTUIT INC	409	464.74	190,078.66

MICROSOFT CORP	10,839	288.50	3,127,051.50
NORTONLIFELOCK INC	840	27.73	23,293.20
ORACLE CORPORATION	2,328	76.10	177,160.80
SALESFORCE.COM INC	1,413	203.16	287,065.08
ARISTA NETWORKS INC	324	120.61	39,077.64
CISCO SYSTEMS	6,089	55.92	340,496.88
JUNIPER NETWORKS INC	469	33.69	15,800.61
MOTOROLA SOLUTIONS INC	244	221.70	54,094.80
APPLE INC	22,501	162.95	3,666,537.95
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,888	16.37	30,906.56
HP INC	1,664	36.05	59,987.20
SEAGATE TECHNOLOGY	296	90.39	26,755.44
AMPHENOL CORP-CL A	863	74.91	64,647.33
CORNING INC	1,109	37.63	41,731.67
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	266	151.05	40,179.30
TE CONNECTIVITY LTD	471	130.43	61,432.53
TRIMBLE INC	362	67.71	24,511.02
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	77	399.11	30,731.47
ADVANCED MICRO DEVICES	2,358	111.05	261,855.90
ANALOG DEVICES INC	776	153.62	119,209.12
APPLIED MATERIALS	1,304	128.62	167,720.48
INTEL CORP	5,871	47.63	279,635.73
KLA CORP	219	339.56	74,363.64
LAM RESEARCH	203	517.31	105,013.93
MICRON TECHNOLOGY	1,615	79.44	128,295.60
NVIDIA CORP	3,609	230.14	830,575.26
QUALCOMM INC	1,617	157.11	254,046.87
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,333	172.46	229,889.18
AT & T INC	10,309	23.26	239,787.34
VERIZON COMMUNICATIONS	5,977	53.08	317,259.16
EDISON INTERNATIONAL	548	65.47	35,877.56
ENTERGY CORP	290	107.98	31,314.20
EVERSOURCE ENERGY	496	84.19	41,758.24
EXELON CORPORATION	1,412	43.55	61,492.60
FIRSTENERGY CORP	786	44.08	34,646.88

NEXTERA ENERGY INC	2,833	80.32	227,546.56
CONSOLIDATED EDISON INC	511	88.38	45,162.18
PUBLIC SVC ENTERPRISE	730	65.82	48,048.60
SEMPRA ENERGY	461	152.30	70,210.30
AMERICAN WATER WORKS CO INC	262	153.79	40,292.98
AMERICAN EXPRESS CO	906	168.65	152,796.90
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	614	131.91	80,992.74
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	423	107.00	45,261.00
SYNCHRONY FINANCIAL	790	36.20	28,598.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	162	274.52	44,472.24
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,097	52.18	57,241.46
BLACKROCK INC	206	693.25	142,809.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	154	115.08	17,722.32
CME GROUP INC	519	230.09	119,416.71
FRANKLIN RESOURCES INC	406	28.54	11,587.24
GOLDMAN SACHS GROUP	490	333.59	163,459.10
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	813	128.78	104,698.14
INVESCO LTD	493	20.07	9,894.51
MARKETAXESS HOLDINGS INC	55	348.44	19,164.20
MOODYS CORP	233	323.31	75,331.23
MORGAN STANLEY	2,072	87.40	181,092.80
MSCI INC	119	488.13	58,087.47
NASDAQ INC	169	168.67	28,505.23
NORTHERN TRUST CORP	300	108.03	32,409.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	267	95.88	25,599.96
S&P GLOBAL INC	511	391.51	200,061.61
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,170	79.39	172,276.30
STATE STREET CORP	528	83.58	44,130.24
T ROWE PRICE GROUP INC	324	138.88	44,997.12
AGILENT TECHNOLOGIES INC	437	133.26	58,234.62
BIO-RAD LABORATORIES-A	31	554.27	17,182.37
DANAHER CORP	918	264.82	243,104.76
ILLUMINA INC	226	324.71	73,384.46
METTLER-TOLEDO INTL	33	1,388.29	45,813.57
PERKINELMER INC	182	172.58	31,409.56



	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	569	541.70	308,227.30	
	WATERS CORP	88	321.08	28,255.04	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	107	372.40	39,846.80	
	LEIDOS HOLDINGS INC	203	102.89	20,886.67	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	518	18.14	9,396.52	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	161	112.17	18,059.37	
	VERISK ANALYTICS INC	233	187.27	43,633.91	
	CBRE GROUP INC	483	87.77	42,392.91	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	179	557.75	99,837.25	
	COMCAST CORP-CL A	6,582	46.12	303,561.84	
	DISCOVERY INC - A	244	25.37	6,190.28	
	DISCOVERY INC - C	438	25.31	11,085.78	
	INTERPUBRIC GROUP	568	33.78	19,187.04	
	NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	567	21.13	11,980.71	
	NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	176	21.52	3,787.52	
	OMNICOM GROUP	307	76.89	23,605.23	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	1,124	80.83	90,852.92	
	DISNEY (WALT) CO	2,623	133.65	350,563.95	
	ELECTRONIC ARTS	408	125.52	51,212.16	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	195	109.90	21,430.50	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	166	158.32	26,281.12	
	ALPHABET INC-CL A	434	2,668.40	1,158,085.60	
	ALPHABET INC-CL C	404	2,677.32	1,081,637.28	
	小計 銘柄数：287			39,190,940.92	
				(4,546,541,056)	
	組入時価比率：92.5%			100.0%	
	合計			4,546,541,056	
				(4,546,541,056)	

(注1) 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2) 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(2022年3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	7,000	270,550.00	
	小計	銘柄数：1	7,000	270,550.00	

				(31,386,505)	
		組入時価比率：0.6%		20.7%	
	合計			31,386,505	
				(31,386,505)	
投資証券	米ドル	AMERICAN TOWER CORP	657	153,153.27	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	202	49,380.92	
		BOSTON PROPERTIES	205	25,424.10	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	410	55,534.50	
		DUKE REALTY CORP	550	29,903.50	
		EQUINIX INC	130	91,546.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	493	43,275.54	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	94	32,182.78	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	193	38,208.21	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	778	25,074.94	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,031	18,630.17	
		IRON MOUNTAIN INC	418	21,355.62	
		KIMCO REALTY CORP	890	21,297.70	
		PROLOGIS INC	1,067	160,562.16	
		REALTY INCOME CORP	817	53,243.89	
		REGENCY CENTERS CORP	222	15,180.36	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	474	62,838.18	
		VENTAS INC	576	33,298.56	
		VORNADO REALTY TRUST	230	10,607.60	
		WELLTOWER INC	628	55,741.28	
		WEYERHAEUSER CO	1,081	42,148.19	
	小計	銘柄数：21	11,146	1,038,587.47	
				(120,486,532)	
		組入時価比率：2.5%		79.3%	
	合計			120,486,532	
				(120,486,532)	
	合計			151,873,037	
				(151,873,037)	

(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。