



2023年3月期 (2022年9月11日～2023年3月10日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended March 2023 (September 11, 2022 – March 10, 2023)

2023年4月19日
 April 19, 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5月30日
 分配金支払開始日 2023年4月18日
 Scheduled date of submission of securities report: May 30, 2023
 Date of commencing dividend payment: April 18, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2023年3月期の運用状況 (2022年9月11日～2023年3月10日)

Management Status for Year ended March 2023 (from September 11, 2022 to March 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3月期 FY ended Mar. 2023	2,991	(95.5)	142	(4.5)	3,133	(100.0)
2022年9月期 FY ended Sep. 2022	5,386	(93.2)	394	(6.8)	5,781	(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3月期 FY ended Mar. 2023	2,123	400	1,280	1,243
2022年9月期 FY ended Sep. 2022	2,083	560	520	2,123

(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3月期 FY ended Mar. 2023	3,176	42	3,133	252,111
2022年9月期 FY ended Sep. 2022	5,819	38	5,781	272,304

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2023年3月期 FY ended Mar. 2023	2,870
2022年9月期 FY ended Sep. 2022	1,590

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3期 (2022年9月10日現在) 3rd Fiscal Year As of September 10, 2022	第4期 (2023年3月10日現在) 4th Fiscal Year As of March 10, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	337,666,567	51,677,458
コール・ローン Call loans	12,764,922	7,309,533
株式 Stocks	5,207,651,211	2,880,171,614
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	36,199,853	36,080,052
投資証券 Investment securities	142,659,015	75,070,095
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	6,894,251	442,033
未収入金 Accounts receivable - other	5,168,413	28,851,000
未収配当金 Accrued dividends receivable	6,094,973	3,715,494
差入委託証拠金 Margin deposits	64,787,741	93,015,293
流動資産合計 Total current assets	5,819,886,946	3,176,332,572
資産合計 Total assets	5,819,886,946	3,176,332,572
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	378,082	2,571,026
未払収益分配金 Unpaid dividends	33,755,700	35,674,100
未払受託者報酬 Trustee fees payable	565,915	593,724
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	3,112,481	3,265,411
未払利息 Accrued interest expenses	22	6
その他未払費用	1,056,570	489,155

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	38,868,770	42,593,422
負債合計 Total liabilities	38,868,770	42,593,422
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	4,246,000,000	2,486,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,535,018,176	647,739,150
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	162,077	102,152
元本等合計 Total principal and other	5,781,018,176	3,133,739,150
純資産合計 Total net assets	5,781,018,176	3,133,739,150
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	5,819,886,946	3,176,332,572

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第3期 自 2022年3月11日 至 2022年9月10日 3rd Fiscal Year From March 11, 2022 to September 10, 2022	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
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	39,248,478	39,721,301
受取利息 Interest income	4	473,855
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△369,260,044	61,465,654
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△11,072,004	△5,015,777
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	1,119,025,680	△405,693,578
その他収益 Other revenue	183,184	1,238,578
営業収益合計 Total operating revenue	778,125,298	△307,809,967
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	1,772	10,263

受託者報酬 Trustee fees	565,915	593,724
委託者報酬 Investment trust management fees	3,112,481	3,265,411
その他費用 Other expenses	2,004,032	1,950,161
営業費用合計 Total operating expenses	5,684,200	5,819,559
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	772,441,098	△313,629,526
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	772,441,098	△313,629,526
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	772,441,098	△313,629,526
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	748,012,778	1,535,018,176
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	357,349,000	240,400,800
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	357,349,000	240,400,800
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	309,029,000	778,376,200
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	309,029,000	778,376,200
分配金 Dividends	33,755,700	35,674,100
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	1,535,018,176	647,739,150

(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>
--------------------	--

<p>2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p> <p>3. 費用・収益の計上基準</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>5. その他</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2022年9月11日から2023年3月10日までとなっております。</p>
--	--

(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3期 2022年9月10日現在	第4期 2023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 2,123,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,243,000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 2,723.04円 (100口当たり純資産額) (272,304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 2,521.11円 (100口当たり純資産額) (252,111円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自2022年3月11日 至2022年9月10日	第4期 自2022年9月11日 至2023年3月10日																																																												
<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <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>39,429,894円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>170,311円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>39,600,205円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>5,682,428円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>33,917,777円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>33,755,700円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>162,077円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>2,123,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,590円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち1,033,216円は対象指数についての商標使用料、619,417円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。</p>	項目			当期配当等収益額	A	39,429,894円	分配準備積立金	B	170,311円	配当等収益合計額	C=A+B	39,600,205円	経費	D	5,682,428円	収益分配可能額	E=C-D	33,917,777円	収益分配金	F	33,755,700円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	162,077円	口数	H	2,123,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,590円	<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <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> <p>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。</p>	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	39,429,894円																																																											
分配準備積立金	B	170,311円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	39,600,205円																																																											
経費	D	5,682,428円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	33,917,777円																																																											
収益分配金	F	33,755,700円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	162,077円																																																											
口数	H	2,123,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,590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																																																											

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

至 2022年 9月 10日	至 2023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。</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3期 2022年 9月 10日現在	第4期 2023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。</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3期 自 2022年 3月 11日 至 2022年 9月 10日	第4期 自 2022年 9月 11日 至 2023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3期 自 2022年 3月 11日 至 2022年 9月 10日	第4期 自 2022年 9月 11日 至 2023年 3月 10日		
期首元本額	4,166,000,000円	期首元本額	4,246,000,000円
期中追加設定元本額	1,120,000,000円	期中追加設定元本額	800,000,000円
期中一部解約元本額	1,040,000,000円	期中一部解約元本額	2,560,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2022年 3月 11日 至 2022年 9月 10日	第4期 自 2022年 9月 11日 至 2023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	△374,951,008	△26,531,147
投資信託受益証券	△2,385,808	91,807
投資証券	△14,857,825	△7,132,256
合計	△392,194,641	△33,571,596

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3期(2022年 9月 10日現在)				第4期(2023年 3月 10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	381,705,535	—	388,222,285	6,516,750	141,984,919	—	139,856,362	△2,128,557
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	34,792,364	—	34,792,945	△581	36,977,964	—	36,978,400	△436
米ドル	34,792,364	—	34,792,945	△581	36,977,964	—	36,978,400	△436
合計	—	—	—	6,516,169	—	—	—	△2,128,993

(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	BAKER HUGHES CO	924	30.06	27,775.44	
		HALLIBURTON CO	837	35.57	29,772.09	
		SCHLUMBERGER LTD	1,308	52.19	68,264.52	
		APA CORPORATION	296	37.01	10,954.96	
		CONOCOPHILLIPS	1,149	105.81	121,575.69	
		DEVON ENERGY CORP	603	52.98	31,946.94	
		EOG RESOURCES INC	542	115.00	62,330.00	
		EXXON MOBIL CORP	3,798	109.13	414,475.74	
		HESS CORP	256	133.88	34,273.28	
		KINDER MORGAN INC	1,824	17.14	31,263.36	
		MARATHON OIL CORP	586	24.58	14,403.88	
		MARATHON PETROLEUM CORP	432	128.38	55,460.16	
		OCCIDENTAL PETE CORP	671	60.56	40,635.76	
		ONEOK INC	412	65.64	27,043.68	
		PHILLIPS 66	436	101.14	44,097.04	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	219	202.02	44,242.38	
		VALERO ENERGY CORP	356	132.28	47,091.68	
		WILLIAMS COS	1,123	29.89	33,566.47	
		AIR PRODUCTS	205	284.08	58,236.40	
		ALBEMARLE CORP	108	236.75	25,569.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	181	81.11	14,680.91			
CORTEVA INC	659	59.92	39,487.28			
DOW INC	649	55.10	35,759.90			
ECOLAB INC	229	157.65	36,101.85			

FMC CORP	116	123.26	14,298.16
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	235	86.07	20,226.45
LINDE PLC	456	345.92	157,739.52
LYONDELLBASELL INDU-CL A	234	91.16	21,331.44
MOSAIC CO/THE	314	52.54	16,497.56
PPG INDUSTRIES	217	127.40	27,645.80
AMCOR PLC	1,373	10.85	14,897.05
BALL CORP	289	54.69	15,805.41
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	328	36.20	11,873.60
WESTROCK CO	235	30.71	7,216.85
FREEMONT-MCMORAN INC	1,318	39.17	51,626.06
NEWMONT CORP	732	41.74	30,553.68
CARRIER GLOBAL CORP	771	46.15	35,581.65
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	635	63.30	40,195.50
TRANE TECHNOLOGIES PLC	212	189.08	40,084.96
EATON CORP PLC	367	174.37	63,993.79
EMERSON ELEC	545	83.44	45,474.80
GENERAC HOLDINGS INC	58	117.80	6,832.40
ROCKWELL AUTOMATION INC	106	298.92	31,685.52
GENERAL ELECTRIC CO	1,008	91.56	92,292.48
CATERPILLAR INC DEL	480	240.96	115,660.80
CUMMINS INC	130	250.58	32,575.40
DEERE & COMPANY	253	421.42	106,619.26
DOVER CORP	129	150.16	19,370.64
FORTIVE CORP	326	66.15	21,564.90
IDEX CORP	70	223.13	15,619.10
ILLINOIS TOOL WORKS INC	258	234.79	60,575.82
INGERSOLL-RAND INC	373	58.14	21,686.22
NORDSON CORP	50	218.18	10,909.00
OTIS WORLDWIDE CORP	384	84.15	32,313.60
PACCAR	481	74.31	35,743.11
PARKER HANNIFIN CORP	118	350.93	41,409.74
PENTAIR PLC	152	54.39	8,267.28
SNAP-ON INC	49	246.93	12,099.57
STANLEY BLACK & DECKER INC	136	82.50	11,220.00

WABTEC CORP	168	102.70	17,253.60
XYLEM INC	166	100.48	16,679.68
FASTENAL CO	528	52.10	27,508.80
UNITED RENTALS INC	64	453.69	29,036.16
CINTAS CORP	80	434.27	34,741.60
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	189	128.32	24,252.48
WASTE MANAGEMENT INC	344	150.62	51,813.28
FEDEX CORPORATION	221	207.83	45,930.43
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	673	182.88	123,078.24
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	599	15.88	9,512.12
CSX CORP	1,939	29.76	57,704.64
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	76	179.61	13,650.36
UNION PAC CORP	567	199.57	113,156.19
APTIV PLC	250	113.43	28,357.50
BORGWARNER INC	216	48.98	10,579.68
FORD MOTOR COMPANY	3,642	12.45	45,342.90
GENERAL MOTORS CO	1,310	37.82	49,544.20
MOHAWK INDUSTRIES	49	100.20	4,909.80
NEWELL BRANDS INC	347	13.02	4,517.94
PULTEGROUP INC	210	54.44	11,432.40
WHIRLPOOL CORP	50	134.25	6,712.50
HASBRO INC	120	51.21	6,145.20
NIKE INC-B	1,162	117.87	136,964.94
RALPH LAUREN CORPORATION	38	114.70	4,358.60
TAPESTRY INC	222	41.60	9,235.20
V F CORP	305	23.01	7,018.05
CAESARS ENTERTAINMENT INC	198	49.31	9,763.38
DARDEN RESTAURANTS INC	113	144.66	16,346.58
EXPEDIA GROUP INC	139	100.80	14,011.20
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	249	142.41	35,460.09
LAS VEGAS SANDS CORP	303	56.52	17,125.56
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	248	167.73	41,597.04
MCDONALD'S CORP	675	261.63	176,600.25
MGM RESORTS INTERNATIONAL	294	43.18	12,694.92
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	202	68.25	13,786.50

STARBUCKS CORP	1,059	100.30	106,217.70
YUM BRANDS INC	260	126.05	32,773.00
AMAZON.COM INC	8,185	92.25	755,066.25
EBAY INC	500	42.95	21,475.00
ETSY INC	116	107.74	12,497.84
DOLLAR TREE INC	194	139.64	27,090.16
TARGET CORP	424	160.64	68,111.36
BEST BUY COMPANY INC	185	79.00	14,615.00
LOWES COS INC	572	199.05	113,856.60
TJX COS INC	1,071	74.97	80,292.87
KROGER CO	601	47.25	28,397.25
SYSCO CORP	467	74.31	34,702.77
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	662	33.29	22,037.98
WALMART INC	1,302	137.17	178,595.34
BROWN-FORMAN CORP-CL B	169	62.29	10,527.01
COCA COLA CO	3,589	59.46	213,401.94
CONSTELLATION BRANDS INC-A	150	215.80	32,370.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	173	53.06	9,179.38
PEPSICO INC	1,270	171.80	218,186.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	507	77.99	39,540.93
CAMPBELL SOUP CO	185	52.33	9,681.05
CONAGRA BRANDS INC	442	35.08	15,505.36
GENERAL MILLS	547	78.64	43,016.08
HERSHEY CO/THE	136	238.62	32,452.32
HORMEL FOODS CORP	267	39.72	10,605.24
JM SMUCKER CO/THE-NEW	98	148.38	14,541.24
KELLOGG CO	236	64.12	15,132.32
KRAFT HEINZ CO/THE	734	37.79	27,737.86
MCCORMICK & CO INC.	231	72.00	16,632.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,259	64.76	81,532.84
TYSON FOODS INC-CL A	267	57.64	15,389.88
COLGATE PALMOLIVE CO.	770	71.34	54,931.80
PROCTER & GAMBLE CO	2,185	136.57	298,405.45
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	213	243.48	51,861.24
ABBOTT LABORATORIES	1,608	97.85	157,342.80

BAXTER INTERNATIONAL INC.	465	38.99	18,130.35
BECTON, DICKINSON	263	232.23	61,076.49
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,321	47.06	62,166.26
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	570	76.03	43,337.10
HOLOGIC INC	230	78.49	18,052.70
IDEXX LABORATORIES INC	76	472.28	35,893.28
MEDTRONIC PLC	1,226	78.00	95,628.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	149	150.00	22,350.00
CARDINAL HEALTH INC	242	71.29	17,252.18
CENTENE CORP	522	65.54	34,211.88
CVS HEALTH CORP	1,212	77.00	93,324.00
DAVITA INC	51	74.87	3,818.37
ELEVANCE HEALTH INC	220	459.96	101,191.20
HENRY SCHEIN INC	125	77.25	9,656.25
HUMANA INC	117	486.33	56,900.61
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	82	224.15	18,380.30
MCKESSON CORP	131	335.97	44,012.07
QUEST DIAGNOSTICS INC	105	134.89	14,163.45
THE CIGNA GROUP	282	271.93	76,684.26
UNITEDHEALTH GROUP INC	862	464.91	400,752.42
ABBVIE INC	1,631	147.35	240,327.85
AMGEN INC	492	225.79	111,088.68
BIOGEN INC	133	258.99	34,445.67
GILEAD SCIENCES INC	1,157	78.95	91,345.15
MODERNA INC	305	137.36	41,894.80
REGENERON PHARMACEUTICALS	99	743.75	73,631.25
VERTEX PHARMACEUTICALS	237	286.88	67,990.56
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,961	66.51	130,426.11
CATALENT INC	166	69.94	11,610.04
ELI LILLY & CO.	727	316.85	230,349.95
MERCK & CO INC	2,338	107.60	251,568.80
ORGANON & CO	235	23.27	5,468.45
PFIZER INC	5,176	39.46	204,244.96
VIATRIS INC	1,118	10.13	11,325.34
ZOETIS INC	430	167.49	72,020.70

BANK OF AMERICA CORP	6,436	30.54	196,555.44
CITIGROUP	1,786	48.60	86,799.60
COMERICA INC	121	61.91	7,491.11
FIFTH THIRD BANCORP	633	31.69	20,059.77
JPMORGAN CHASE & CO	2,705	130.34	352,569.70
KEYCORP	860	16.07	13,820.20
PNC FINANCIAL	372	137.87	51,287.64
REGIONS FINANCIAL CORP	862	20.66	17,808.92
TRUIST FINANCIAL CORP	1,223	41.62	50,901.26
US BANCORP	1,247	42.30	52,748.10
AFLAC INC	522	64.84	33,846.48
ALLSTATE CORP	245	119.40	29,253.00
AMERICAN INTL GROUP	685	55.80	38,223.00
ASSURANT INC	49	119.88	5,874.12
CHUBB LTD	383	198.87	76,167.21
CINCINNATI FINANCIAL CORP	145	114.91	16,661.95
GLOBE LIFE INC	83	116.21	9,645.43
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	293	72.08	21,119.44
LINCOLN NATIONAL CORP	142	27.34	3,882.28
MARSH & MCLENNAN COS	457	158.83	72,585.31
METLIFE INC	608	64.67	39,319.36
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	210	78.91	16,571.10
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	339	90.70	30,747.30
TRAVELERS COS INC/THE	216	173.92	37,566.72
WILLIS TOWERS WATSON PLC	100	234.51	23,451.00
WR BERKLEY CORP	189	63.91	12,078.99
MASTERCARD INC	783	354.44	277,526.52
VISA INC-CLASS A SHARES	1,508	220.01	331,775.08
ADOBE INC	429	338.37	145,160.73
ANSYS INC	80	300.22	24,017.60
AUTODESK INC.	199	200.49	39,897.51
GEN DIGITAL INC	535	17.74	9,490.90
INTUIT INC	260	404.58	105,190.80
MICROSOFT CORP	6,874	252.32	1,734,447.68
ORACLE CORPORATION	1,417	86.87	123,094.79

ROPER TECHNOLOGIES INC	98	422.80	41,434.40
SALESFORCE INC	922	178.72	164,779.84
TYLER TECHNOLOGIES INC	38	318.34	12,096.92
ARISTA NETWORKS INC	228	148.65	33,892.20
CISCO SYSTEMS	3,786	48.81	184,794.66
JUNIPER NETWORKS INC	299	31.06	9,286.94
MOTOROLA SOLUTIONS INC	154	265.18	40,837.72
APPLE INC	13,790	150.59	2,076,636.10
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,187	14.71	17,460.77
HP INC	816	27.89	22,758.24
SEAGATE TECHNOLOGY	177	63.25	11,195.25
CDW CORPORATION	125	196.21	24,526.25
CORNING INC	702	33.95	23,832.90
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	165	157.42	25,974.30
TE CONNECTIVITY LTD	293	128.06	37,521.58
TRIMBLE INC	227	49.76	11,295.52
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	48	296.91	14,251.68
ADVANCED MICRO DEVICES	1,487	84.03	124,952.61
APPLIED MATERIALS	793	117.04	92,812.72
INTEL CORP	3,806	26.44	100,630.64
LAM RESEARCH	126	490.28	61,775.28
MICRON TECHNOLOGY	1,003	55.60	55,766.80
NVIDIA CORP	2,296	234.36	538,090.56
QUALCOMM INC	1,034	117.22	121,205.48
TEXAS INSTRUMENTS INC	837	173.44	145,169.28
AT & T INC	6,572	18.32	120,399.04
VERIZON COMMUNICATIONS	3,873	36.55	141,558.15
EDISON INTERNATIONAL	352	67.00	23,584.00
ENTERGY CORP	188	102.86	19,337.68
EVERSOURCE ENERGY	321	74.27	23,840.67
EXELON CORPORATION	916	40.59	37,180.44
NEXTERA ENERGY INC	1,832	73.76	135,128.32
CONSOLIDATED EDISON INC	327	91.29	29,851.83
PUBLIC SVC ENTERPRISE	460	57.76	26,569.60
SEMPRA ENERGY	290	147.62	42,809.80

AMERICAN WATER WORKS CO INC	168	135.87	22,826.16
AMERICAN EXPRESS CO	551	172.12	94,838.12
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	352	100.94	35,530.88
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	252	105.64	26,621.28
SYNCHRONY FINANCIAL	415	33.23	13,790.45
AMERIPRISE FINANCIAL INC	98	315.58	30,926.84
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	678	48.00	32,544.00
BLACKROCK INC	139	651.28	90,527.92
CBOE GLOBAL MARKETS INC	98	121.17	11,874.66
CME GROUP INC	332	177.47	58,920.04
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	35	406.03	14,211.05
FRANKLIN RESOURCES INC	262	27.83	7,291.46
GOLDMAN SACHS GROUP	312	342.09	106,732.08
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	515	100.10	51,551.50
INVESCO LTD	419	17.03	7,135.57
MARKETAXESS HOLDINGS INC	35	353.35	12,367.25
MOODYS CORP	145	295.05	42,782.25
MORGAN STANLEY	1,216	92.20	112,115.20
MSCI INC	74	535.04	39,592.96
NASDAQ INC	313	54.32	17,002.16
NORTHERN TRUST CORP	192	86.91	16,686.72
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	179	100.12	17,921.48
S&P GLOBAL INC	307	333.93	102,516.51
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,407	66.47	93,523.29
STATE STREET CORP	338	82.84	27,999.92
T ROWE PRICE GROUP INC	206	111.32	22,931.92
AGILENT TECHNOLOGIES INC	273	138.93	37,927.89
BIO-RAD LABORATORIES-A	20	487.44	9,748.80
CHARLES RIVER LABORATORIES	47	214.92	10,101.24
ILLUMINA INC	145	202.59	29,375.55
METTLER-TOLEDO INTL	21	1,475.57	30,986.97
PERKINELMER INC	116	123.50	14,326.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	362	553.21	200,262.02
WATERS CORP	55	309.35	17,014.25
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	68	315.31	21,441.08

	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	100	78.84	7,884.00	
	VERISK ANALYTICS INC	144	183.17	26,376.48	
	CBRE GROUP INC	291	81.50	23,716.50	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	99	343.01	33,957.99	
	COMCAST CORP-CL A	3,978	35.47	141,099.66	
	INTERPUBRIC GROUP	358	34.25	12,261.50	
	OMNICOM GROUP	188	87.98	16,540.24	
	DISNEY (WALT) CO	1,681	96.14	161,611.34	
	ELECTRONIC ARTS	242	110.46	26,731.32	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	145	112.96	16,379.20	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	2,038	14.77	30,101.26	
	ALPHABET INC-CL A	5,508	92.32	508,498.56	
	ALPHABET INC-CL C	4,883	92.66	452,458.78	
	小計 銘柄数：282			21,176,175.39	
				(2,880,171,614)	
				100.0%	
	組入時価比率：91.9%				
	合計			2,880,171,614	
				(2,880,171,614)	

(注1) 外貨建保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、外貨建保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(2023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	7,500	265,275.00	
		小計	7,500	265,275.00	
				(36,080,052)	
				32.5%	
	合計			36,080,052	
				(36,080,052)	
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	138	19,159.92	
		AMERICAN TOWER CORP	429	82,024.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	129	22,056.42	
		BOSTON PROPERTIES	132	8,176.08	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	265	27,660.70	
		EQUINIX INC	85	58,044.80	

		EQUITY RESIDENTIAL	314	19,110.04	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	60	13,593.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	123	19,730.43	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	67	6,861.47	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	496	11,383.20	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	659	10,609.90	
		IRON MOUNTAIN INC	268	14,155.76	
		KIMCO REALTY CORP	570	11,160.60	
		PROLOGIS INC	851	103,226.30	
		REGENCY CENTERS CORP	142	8,606.62	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	301	35,307.30	
		UDR INC	282	11,632.50	
		VENTAS INC	369	17,195.40	
		WELLTOWER INC	436	31,588.20	
		WEYERHAEUSER CO	679	20,661.97	
	小計	銘柄数：21	6,795	551,945.41	
				(75,070,095)	
		組入時価比率：2.4%		67.5%	
	合計			75,070,095	
				(75,070,095)	
	合計			111,150,147	
				(111,150,147)	

(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。