



2023年8月期 (2023年2月11日～2023年8月10日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended August 2023 (February 11, 2023 – August 10, 2023)

2023年9月20日
 September 20, 2023

		上場取引所	東証
		Listed Exchange	TSE
ファンド名	NEXT FUNDS ダウ・ジョーンズ工業株30種平均株価(為替ヘッジあり)連動型上場投信		
コード番号	(2846)		
連動対象指標	ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均株価(TTM、円建て、円ヘッジ)		
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 DJIA (Yen-Hedged) Exchange Traded Fund		
Code:	2846		
Underlying index:	DJIA JPY Hedged Index (T-1 TTM)		
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10月30日
 分配金支払開始日 2023年9月15日
 Scheduled date of submission of securities report: October 30, 2023
 Date of commencing dividend payment: September 15, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2023年8月期の運用状況 (2023年2月11日～2023年8月10日)

Management Status for Year ended August 2023 (from February 11, 2023 to August 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8月期 FY ended Aug. 2023	11,763	(101.3)	△149	(△1.3)	11,613	(100.0)
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	8,800	(99.4)	49	(0.6)	8,849	(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8月期 FY ended Aug. 2023	4,600	2,860	1,510	5,950
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	5,580	2,470	3,450	4,600

(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8月期 FY ended Aug. 2023	11,986	372	11,613	195,187
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	9,048	198	8,849	192,388

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2023年8月期 FY ended Aug. 2023	1,300
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	1,580

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2期 (2023年2月10日現在) 2nd Fiscal Year As of February 10, 2023	第3期 (2023年8月10日現在) 3rd Fiscal Year As of August 10, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	12,509,222	13,194,049
コール・ローン Call loans	116,962,746	68,981,816
株式 Stocks	8,757,668,274	11,757,934,825
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	42,931,712	5,309,878
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	7,163	60,660
未収入金 Accounts receivable - other	82,687,547	67,504,443
未収配当金 Accrued dividends receivable	7,906,964	8,935,700
差入委託証拠金 Margin deposits	28,104,267	64,089,636
流動資産合計 Total current assets	9,048,777,895	11,986,011,007
資産合計 Total assets	9,048,777,895	11,986,011,007
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	107,626,809	274,851,769
未払金 Accounts payable - other	901,739	1,166,305
未払収益分配金 Unpaid dividends	72,680,000	77,350,000
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,762,000	1,799,754
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	13,188,166	14,378,090
未払利息 Accrued interest expenses	108	123
その他未払費用	2,784,538	2,859,402

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	198,943,360	372,405,443
負債合計 Total liabilities	198,943,360	372,405,443
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	9,200,000,000	11,900,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△350,165,465	△286,394,436
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	122,341	152,909
元本等合計 Total principal and other	8,849,834,535	11,613,605,564
純資産合計 Total net assets	8,849,834,535	11,613,605,564
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	9,048,777,895	11,986,011,007

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

(単位：円) (Unit : JPY)

	第2期 自 2022年8月11日 至 2023年2月10日 2nd Fiscal Year From August 11, 2022 to February 10, 2023	第3期 自 2023年2月11日 至 2023年8月10日 3rd Fiscal Year From February 11, 2023 to August 10, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	89,624,809	96,672,741
受取利息 Interest income	102,746	236,553
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	733,990,978	497,742,757
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△42,353,590	9,242,628
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	△89,194,483	△275,245,024
その他収益 Other revenue	1,364,276	1,243,516
営業収益合計 Total operating revenue	693,534,736	329,893,171
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	39,310	31,578

受託者報酬 Trustee fees	1,762,000	1,799,754
委託者報酬 Investment trust management fees	13,188,166	14,378,090
その他費用 Other expenses	3,621,780	4,562,820
営業費用合計 Total operating expenses	18,611,256	20,772,242
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	674,923,480	309,120,929
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	674,923,480	309,120,929
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	674,923,480	309,120,929
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	△474,952,945	△350,165,465
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	147,162,000	221,222,200
当期一部解約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 partial redemptions	147,162,000	221,222,200
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	624,618,000	389,222,100
当期追加信託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 additional subscriptions for period	624,618,000	389,222,100
分配金 Dividends	72,680,000	77,350,000
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△350,165,465	△286,394,436

(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。 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。 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。 為替予約取引 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>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p>

	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2月11日から2023年8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2期 2023年2月10日現在	第3期 2023年8月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 4,600,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 5,950,000口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 350,165,465円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 286,394,436円
3. 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 1,923.88円 (100口当たり純資産額) (192,388円)	3. 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 1,951.87円 (100口当たり純資産額) (195,187円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自2022年8月11日 至2023年2月10日	第3期 自2023年2月11日 至2023年8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>91,052,521円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>321,766円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>91,374,287円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>18,571,946円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>72,802,341円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>72,680,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>122,341円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>4,600,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,580円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	91,052,521円	分配準備積立金	B	321,766円	配当等収益合計額	C=A+B	91,374,287円	経費	D	18,571,946円	収益分配可能額	E=C-D	72,802,341円	収益分配金	F	72,680,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	122,341円	口数	H	4,600,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,580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>98,121,232円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>122,341円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>98,243,573円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>20,740,664円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>77,502,909円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>77,350,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>152,909円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>5,950,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,300円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	98,121,232円	分配準備積立金	B	122,341円	配当等収益合計額	C=A+B	98,243,573円	経費	D	20,740,664円	収益分配可能額	E=C-D	77,502,909円	収益分配金	F	77,350,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	152,909円	口数	H	5,950,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	91,052,521円																																																											
分配準備積立金	B	321,766円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	91,374,287円																																																											
経費	D	18,571,946円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	72,802,341円																																																											
収益分配金	F	72,680,000円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	122,341円																																																											
口数	H	4,600,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,580円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	98,121,232円																																																											
分配準備積立金	B	122,341円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	98,243,573円																																																											
経費	D	20,740,664円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	77,502,909円																																																											
収益分配金	F	77,350,000円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	152,909円																																																											
口数	H	5,950,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち2,925,847円は、対象指数についての商標使用料であります。	2. その他費用 その他費用のうち2,976,105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2期 自2022年8月11日	第3期 自2023年2月11日
--------------------	--------------------

至 2023年 2月 10日	至 2023年 8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2期 2023年 2月 10日現在	第3期 2023年 8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>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2期	第3期
-----	-----

自 2022年 8月 11日 至 2023年 2月 10日	自 2023年 2月 11日 至 2023年 8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2期 自 2022年 8月 11日 至 2023年 2月 10日	第3期 自 2023年 2月 11日 至 2023年 8月 10日
期首元本額 11,160,000,000円	期首元本額 9,200,000,000円
期中追加設定元本額 4,940,000,000円	期中追加設定元本額 5,720,000,000円
期中一部解約元本額 6,900,000,000円	期中一部解約元本額 3,020,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2022年 8月 11日 至 2023年 2月 10日	第3期 自 2023年 2月 11日 至 2023年 8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	475,307,151	539,977,439
投資信託受益証券	469,972	142,995
合計	475,777,123	540,120,434

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2期(2023年 2月 10日現在)				第3期(2023年 8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	66,759,189	—	66,646,577	△112,612	128,106,405	—	126,691,998	△1,414,407
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	8,797,154,040	—	8,904,661,074	△107,507,034	11,701,314,733	—	11,974,691,435	△273,376,702
米ドル	8,797,154,040	—	8,904,661,074	△107,507,034	11,701,314,733	—	11,974,691,435	△273,376,702
合計	—	—	—	△107,619,646	—	—	—	△274,791,109

(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8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	CHEVRON CORP	15,326	159.86	2,450,014.36	
		DOW INC	15,326	55.54	851,206.04	
		BOEING CO	15,326	237.86	3,645,442.36	
		3M CORP	15,326	103.71	1,589,459.46	
		HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,326	189.24	2,900,292.24	
		CATERPILLAR INC DEL	15,326	284.53	4,360,706.78	
		NIKE INC-B	15,326	109.69	1,681,108.94	
		MCDONALD'S CORP	15,326	288.23	4,417,412.98	
		HOME DEPOT	15,326	328.21	5,030,146.46	
		WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	15,326	29.26	448,438.76	
		WALMART INC	15,326	160.91	2,466,106.66	
		COCA COLA CO	15,326	61.06	935,805.56	
		PROCTER & GAMBLE CO	15,326	156.89	2,404,496.14	
		UNITEDHEALTH GROUP INC	15,326	502.11	7,695,337.86	
		AMGEN INC	15,326	259.32	3,974,338.32	
		JOHNSON & JOHNSON	15,326	173.07	2,652,470.82	
		MERCK & CO INC	15,326	106.10	1,626,088.60	
		JPMORGAN CHASE & CO	15,326	153.79	2,356,985.54	
		VISA INC-CLASS A SHARES	15,326	239.76	3,674,561.76	
		TRAVELERS COS INC/THE	15,326	167.29	2,563,886.54	
		INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	15,326	142.49	2,183,801.74	
		MICROSOFT CORP	15,326	322.23	4,938,496.98	
		SALESFORCE INC	15,326	205.86	3,155,010.36	
		CISCO SYSTEMS	15,326	52.99	812,124.74	
APPLE INC	15,326	178.19	2,730,939.94			
INTEL CORP	15,326	34.28	525,375.28			

	VERIZON COMMUNICATIONS	15,326	32.71	501,313.46	
	AMERICAN EXPRESS CO	15,326	163.82	2,510,705.32	
	GOLDMAN SACHS GROUP	15,326	342.69	5,252,066.94	
	DISNEY (WALT) CO	15,326	87.49	1,340,871.74	
	小計 銘柄数：30			81,675,012.68	
				(11,757,934,825)	
	組入時価比率：101.2%			100.0%	
	合計			11,757,934,825	
				(11,757,934,825)	

(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(2023年8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	SPDR DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE ETF TR	105	36,884.40	
	小計	銘柄数：1	105	36,884.40	
				(5,309,878)	
		組入時価比率：0.0%		100.0%	
	合計			5,309,878	
				(5,309,878)	

(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。