



2024年3月期 (2023年9月11日～2024年3月10日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended March 2024 (September 11, 2023 – March 10, 2024)

2024年4月19日
 April 19, 2024

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 2024年5月29日
 分配金支払開始日 2024年4月18日
 Scheduled date of submission of securities report: May 29, 2024
 Date of commencing dividend payment: April 18, 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11日～2024年3月10日)

Management Status for Year ended March 2024 (from September 11, 2023 to March 10, 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 (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.	% %
2024年3月期 FY ended Mar. 2024	3,884	(92.3)	324	(7.7)	4,208	(100.0)
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	3,712	(92.2)	314	(7.8)	4,026	(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
2024年3月期 FY ended Mar. 2024	1,283	140	260	1,163
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	1,243	60	20	1,283

(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
2024年3月期 FY ended Mar. 2024	4,237	28	4,208	361,890
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	4,055	29	4,026	313,854

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2024年3月期 FY ended Mar. 2024	2,130
2023年9月期 FY ended Sep. 2023	1,930

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5期 (2023年9月10日現在) 5th Fiscal Year As of September 10, 2023	第6期 (2024年3月10日現在) 6th Fiscal Year As of March 10, 2024
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	193,734,179	147,159,729
コール・ローン Call loans	7,818,049	7,982,468
株式 Stocks	3,596,664,734	3,795,020,995
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	29,990,040	553,824
投資証券 Investment securities	85,599,198	88,620,120
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	2,274,980	27,483,477
未収入金 Accounts receivable - other	17,985,060	22,148,068
未収配当金 Accrued dividends receivable	4,511,401	4,412,980
差入委託証拠金 Margin deposits	117,289,265	143,769,752
流動資産合計 Total current assets	4,055,866,906	4,237,151,413
資産合計 Total assets	4,055,866,906	4,237,151,413
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,011,709	1,285
未払収益分配金 Unpaid dividends	24,761,900	24,771,900
未払受託者報酬 Trustee fees payable	397,869	429,657
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	2,188,271	2,363,077
未払利息 Accrued interest expenses	40	9
その他未払費用	756,178	799,737

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	29,115,967	28,365,665
負債合計 Total liabilities	29,115,967	28,365,665
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	2,566,000,000	2,326,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,460,750,939	1,882,785,748
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	71,913	24,733
元本等合計 Total principal and other	4,026,750,939	4,208,785,748
純資産合計 Total net assets	4,026,750,939	4,208,785,748
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	4,055,866,906	4,237,151,413

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第5期 自 2023年3月11日 至 2023年9月10日 5th Fiscal Year From March 11, 2023 to September 10, 2023	第6期 自 2023年9月11日 至 2024年3月10日 6th Fiscal Year From September 11, 2023 to March 10, 2024
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	25,780,488	24,819,244
受取利息 Interest income	365,761	848,490
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	493,174,299	492,695,904
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	17,868,183	48,903,882
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	253,056,946	36,245,803
その他収益 Other revenue	2,448,038	3,110,330
営業収益合計 Total operating revenue	792,693,715	606,623,653
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	2,238	3,685

受託者報酬 Trustee fees	397,869	429,657
委託者報酬 Investment trust management fees	2,188,271	2,363,077
その他費用 Other expenses	1,274,248	1,256,925
営業費用合計 Total operating expenses	3,862,626	4,053,344
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	788,831,089	602,570,309
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	788,831,089	602,570,309
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	788,831,089	602,570,309
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	647,739,150	1,460,750,939
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	65,439,000	168,655,800
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	65,439,000	168,655,800
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	16,496,400	324,419,400
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from partial redemptions	16,496,400	324,419,400
分配金 Dividends	24,761,900	24,771,900
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	1,460,750,939	1,882,785,748

(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、2023年9月11日から2024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5期 2023年9月10日現在	第6期 2024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 1,283,000 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,163,000 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 3,138.54 円 (100口当たり純資産額) (313,854 円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 3,618.90 円 (100口当たり純資産額) (361,890 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2023年3月11日 至 2023年9月10日	第6期 自 2023年9月11日 至 2024年3月10日																																																												
<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 10%;">A</th> <th style="width: 60%;">金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">28,592,049 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">102,152 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C=A+B</td> <td style="text-align: right;">28,694,201 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">3,860,388 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E=C-D</td> <td style="text-align: right;">24,833,813 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">24,761,900 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G=E-F</td> <td style="text-align: right;">71,913 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">1,283,000 口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H×100</td> <td style="text-align: right;">1,930 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち720,582円は対象指数についての商標使用料、203,061円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。</p>	項目	A	金額	当期配当等収益額	A	28,592,049 円	分配準備積立金	B	102,152 円	配当等収益合計額	C=A+B	28,694,201 円	経費	D	3,860,388 円	収益分配可能額	E=C-D	24,833,813 円	収益分配金	F	24,761,900 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	71,913 円	口数	H	1,283,000 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,930 円	<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 10%;">A</th> <th style="width: 60%;">金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">28,774,379 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">71,913 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C=A+B</td> <td style="text-align: right;">28,846,292 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">4,049,659 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E=C-D</td> <td style="text-align: right;">24,796,633 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">24,771,900 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G=E-F</td> <td style="text-align: right;">24,733 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">1,163,000 口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I=F/H×100</td> <td style="text-align: right;">2,130 円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち782,266円は対象指数についての商標使用料、212,573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	A	金額	当期配当等収益額	A	28,774,379 円	分配準備積立金	B	71,913 円	配当等収益合計額	C=A+B	28,846,292 円	経費	D	4,049,659 円	収益分配可能額	E=C-D	24,796,633 円	収益分配金	F	24,771,900 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	24,733 円	口数	H	1,163,000 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,130 円
項目	A	金額																																																											
当期配当等収益額	A	28,592,049 円																																																											
分配準備積立金	B	102,152 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	28,694,201 円																																																											
経費	D	3,860,388 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	24,833,813 円																																																											
収益分配金	F	24,761,900 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	71,913 円																																																											
口数	H	1,283,000 口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,930 円																																																											
項目	A	金額																																																											
当期配当等収益額	A	28,774,379 円																																																											
分配準備積立金	B	71,913 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	28,846,292 円																																																											
経費	D	4,049,659 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	24,796,633 円																																																											
収益分配金	F	24,771,900 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	24,733 円																																																											
口数	H	1,163,000 口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,130 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5期 自 2023年3月11日	第6期 自 2023年9月11日
---------------------	---------------------

至 2023年9月10日	至 2024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5期 2023年9月10日現在	第6期 2024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5期 自 2023年3月11日 至 2023年9月10日	第6期 自 2023年9月11日 至 2024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5期 自 2023年3月11日 至 2023年9月10日	第6期 自 2023年9月11日 至 2024年3月10日
期首元本額 2,486,000,000円	期首元本額 2,566,000,000円
期中追加設定元本額 120,000,000円	期中追加設定元本額 280,000,000円
期中一部解約元本額 40,000,000円	期中一部解約元本額 520,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2023年3月11日 至 2023年9月10日	第6期 自 2023年9月11日 至 2024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	470,258,897	470,006,551
投資信託受益証券	1,837,625	56,897
投資証券	1,027,229	7,580,288
合計	473,123,751	477,643,736

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5期(2023年9月10日現在)				第6期(2024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	307,892,231	—	309,156,517	1,264,286	292,936,536	—	320,420,013	27,483,477
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	25,713,275	—	25,714,290	△1,015	26,744,560	—	26,745,845	△1,285
米ドル	25,713,275	—	25,714,290	△1,015	26,744,560	—	26,745,845	△1,285
合計	—	—	—	1,263,271	—	—	—	27,482,192

(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(2024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	839	30.83	25,866.37	
		HALLIBURTON CO	747	36.19	27,033.93	
		SCHLUMBERGER LTD	1,170	50.78	59,412.60	
		APA CORPORATION	224	30.55	6,843.20	
		CHEVRON CORP	1,437	149.37	214,644.69	
		CONOCOPHILLIPS	972	112.74	109,583.28	
		DEVON ENERGY CORP	535	45.89	24,551.15	
		EOG RESOURCES INC	478	117.85	56,332.30	
		EQT CORP	312	37.26	11,625.12	
		HESS CORP	230	144.33	33,195.90	
		KINDER MORGAN INC	1,610	17.87	28,770.70	
		MARATHON OIL CORP	441	24.66	10,875.06	
		MARATHON PETROLEUM CORP	311	178.97	55,659.67	
		ONEOK INC	484	77.44	37,480.96	
		PHILLIPS 66	360	149.21	53,715.60	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	193	241.38	46,586.34	
		VALERO ENERGY CORP	283	149.03	42,175.49	
		WILLIAMS COS	1,010	35.92	36,279.20	
		AIR PRODUCTS	182	245.17	44,620.94	
		ALBEMARLE CORP	96	122.66	11,775.36	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	156	83.88	13,085.28			
CORTEVA INC	577	54.49	31,440.73			
DOW INC	574	56.94	32,683.56			
ECOLAB INC	208	224.57	46,710.56			

FMC CORP	91	63.40	5,769.40
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	209	78.85	16,479.65
LINDE PLC	397	465.29	184,720.13
LYONDELLBASELL INDU-CL A	210	99.02	20,794.20
MOSAIC CO/THE	242	31.93	7,727.06
PPG INDUSTRIES	193	140.90	27,193.70
AMCOR PLC	1,183	9.42	11,143.86
BALL CORP	258	65.18	16,816.44
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	283	35.88	10,154.04
WESTROCK CO	210	45.33	9,519.30
FREEMONT-MCMORAN INC	1,174	39.81	46,736.94
NEWMONT CORP	944	33.89	31,992.16
CARRIER GLOBAL CORP	687	59.55	40,910.85
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	557	61.32	34,155.24
TRANE TECHNOLOGIES PLC	187	287.45	53,753.15
QUANTA SERVICES INC	119	244.32	29,074.08
EATON CORP PLC	327	301.13	98,469.51
EMERSON ELEC	467	110.28	51,500.76
GENERAC HOLDINGS INC	45	113.71	5,116.95
ROCKWELL AUTOMATION INC	94	294.14	27,649.16
GENERAL ELECTRIC CO	891	166.50	148,351.50
CATERPILLAR INC DEL	418	340.22	142,211.96
CUMMINS INC	116	266.21	30,880.36
DEERE & COMPANY	219	375.32	82,195.08
DOVER CORP	118	171.90	20,284.20
FORTIVE CORP	288	85.01	24,482.88
IDEX CORP	64	238.73	15,278.72
ILLINOIS TOOL WORKS INC	224	261.48	58,571.52
INGERSOLL-RAND INC	331	91.16	30,173.96
NORDSON CORP	46	267.39	12,299.94
OTIS WORLDWIDE CORP	335	96.94	32,474.90
PACCAR	428	114.33	48,933.24
PARKER HANNIFIN CORP	105	539.48	56,645.40
PENTAIR PLC	142	81.56	11,581.52
STANLEY BLACK & DECKER INC	131	91.12	11,936.72

WABTEC CORP	147	141.99	20,872.53
XYLEM INC	197	126.97	25,013.09
UNITED RENTALS INC	55	679.28	37,360.40
CINTAS CORP	71	628.38	44,614.98
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	167	184.00	30,728.00
WASTE MANAGEMENT INC	300	207.26	62,178.00
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	85	72.61	6,171.85
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	123	122.06	15,013.38
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	592	153.41	90,818.72
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	476	14.90	7,092.40
CSX CORP	1,618	37.92	61,354.56
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	69	202.29	13,958.01
NORFOLK SOUTHERN CORP	185	255.36	47,241.60
UNION PAC CORP	499	249.04	124,270.96
APTIV PLC	237	78.77	18,668.49
BORGWARNER INC	171	32.28	5,519.88
FORD MOTOR COMPANY	3,260	12.41	40,456.60
GENERAL MOTORS CO	1,135	39.35	44,662.25
TESLA INC	2,264	178.65	404,463.60
MOHAWK INDUSTRIES	39	121.56	4,740.84
PULTEGROUP INC	181	113.80	20,597.80
WHIRLPOOL CORP	40	108.14	4,325.60
HASBRO INC	95	51.36	4,879.20
NIKE INC-B	1,007	98.19	98,877.33
RALPH LAUREN CORPORATION	29	179.71	5,211.59
TAPESTRY INC	169	46.93	7,931.17
V F CORP	241	16.09	3,877.69
CAESARS ENTERTAINMENT INC	157	41.69	6,545.33
DARDEN RESTAURANTS INC	101	173.19	17,492.19
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	213	204.94	43,652.22
LAS VEGAS SANDS CORP	312	51.49	16,064.88
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	204	246.91	50,369.64
MCDONALD'S CORP	594	291.11	172,919.34
MGM RESORTS INTERNATIONAL	205	42.91	8,796.55
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	310	19.63	6,085.30

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	197	124.35	24,496.95
STARBUCKS CORP	941	90.95	85,583.95
YUM BRANDS INC	233	140.38	32,708.54
AMAZON.COM INC	7,445	176.82	1,316,424.90
EBAY INC	436	50.78	22,140.08
ETSY INC	90	68.40	6,156.00
BEST BUY COMPANY INC	165	79.52	13,120.80
HOME DEPOT	819	376.55	308,394.45
LOWES COS INC	475	241.72	114,817.00
TJX COS INC	942	95.76	90,205.92
TRACTOR SUPPLY COMPANY	91	249.09	22,667.19
DOLLAR GENERAL CORP	180	158.93	28,607.40
DOLLAR TREE INC	171	150.02	25,653.42
KROGER CO	542	55.48	30,070.16
SYSCO CORP	413	79.87	32,986.31
TARGET CORP	378	171.54	64,842.12
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	587	20.94	12,291.78
WALMART INC	3,504	60.36	211,501.44
BROWN-FORMAN CORP-CL B	133	54.60	7,261.80
COCA COLA CO	3,186	59.44	189,375.84
CONSTELLATION BRANDS INC-A	132	255.30	33,699.60
KEURIG DR PEPPER INC	824	28.96	23,863.04
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	152	64.02	9,731.04
PEPSICO INC	1,126	163.11	183,661.86
ARCHER DANIELS MIDLAND	437	54.25	23,707.25
CAMPBELL SOUP CO	143	42.07	6,016.01
CONAGRA BRANDS INC	391	27.80	10,869.80
GENERAL MILLS	476	64.28	30,597.28
HERSHEY CO/THE	123	192.52	23,679.96
HORMEL FOODS CORP	211	33.97	7,167.67
JM SMUCKER CO/THE-NEW	87	117.54	10,225.98
KELLANOVA	216	53.60	11,577.60
KRAFT HEINZ CO/THE	653	34.50	22,528.50
MCCORMICK & CO INC.	206	68.39	14,088.34
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,114	71.00	79,094.00

TYSON FOODS INC-CL A	234	53.67	12,558.78
COLGATE PALMOLIVE CO.	674	88.14	59,406.36
PROCTER & GAMBLE CO	1,930	160.62	309,996.60
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	190	148.17	28,152.30
ABBOTT LABORATORIES	1,421	120.92	171,827.32
BAXTER INTERNATIONAL INC.	415	43.49	18,048.35
BECTON, DICKINSON	238	237.62	56,553.56
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,199	67.82	81,316.18
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	497	93.81	46,623.57
HOLOGIC INC	201	76.32	15,340.32
IDEXX LABORATORIES INC	68	563.22	38,298.96
MEDTRONIC PLC	1,089	85.15	92,728.35
TELEFLEX INC	38	228.88	8,697.44
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	171	127.36	21,778.56
CARDINAL HEALTH INC	202	113.67	22,961.34
CENCORA INC	136	237.63	32,317.68
CENTENE CORP	437	79.66	34,811.42
CVS HEALTH CORP	1,052	74.30	78,163.60
DAVITA INC	39	134.08	5,229.12
ELEVANCE HEALTH INC	192	501.58	96,303.36
HENRY SCHEIN INC	95	75.22	7,145.90
HUMANA INC	101	340.72	34,412.72
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	70	218.36	15,285.20
QUEST DIAGNOSTICS INC	92	127.39	11,719.88
THE CIGNA GROUP	240	342.74	82,257.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	757	478.78	362,436.46
ABBVIE INC	1,445	180.57	260,923.65
AMGEN INC	438	272.86	119,512.68
BIOGEN INC	119	219.36	26,103.84
GILEAD SCIENCES INC	1,020	73.66	75,133.20
MODERNA INC	272	99.48	27,058.56
REGENERON PHARMACEUTICALS	88	973.31	85,651.28
VERTEX PHARMACEUTICALS	211	410.54	86,623.94
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,666	53.28	88,764.48
ELI LILLY & CO.	653	780.16	509,444.48

MERCK & CO INC	2,075	123.99	257,279.25
PFIZER INC	4,623	26.79	123,850.17
VIATRIS INC	982	12.33	12,108.06
ZOETIS INC	376	181.51	68,247.76
BANK OF AMERICA CORP	5,638	35.63	200,881.94
CITIGROUP	1,567	57.72	90,447.24
FIFTH THIRD BANCORP	558	36.38	20,300.04
JPMORGAN CHASE & CO	2,367	187.87	444,688.29
M & T BANK CORP	139	143.37	19,928.43
PNC FINANCIAL	326	150.44	49,043.44
REGIONS FINANCIAL CORP	787	19.55	15,385.85
TRUIST FINANCIAL CORP	1,092	36.92	40,316.64
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	485	69.15	33,537.75
MASTERCARD INC	678	467.54	316,992.12
PAYPAL HOLDINGS INC	883	58.50	51,655.50
VISA INC-CLASS A SHARES	1,305	278.26	363,129.30
AFLAC INC	435	82.29	35,796.15
ALLSTATE CORP	214	156.64	33,520.96
AMERICAN INTL GROUP	575	74.72	42,964.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	306	87.69	26,833.14
ARTHUR J GALLAGHER & CO	177	249.91	44,234.07
ASSURANT INC	39	178.91	6,977.49
CHUBB LTD	334	248.82	83,105.88
EVEREST GROUP LTD	32	367.50	11,760.00
GLOBE LIFE INC	63	127.19	8,012.97
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	252	97.06	24,459.12
METLIFE INC	509	71.37	36,327.33
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	186	79.97	14,874.42
PROGRESSIVE CO	479	196.12	93,941.48
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	296	110.72	32,773.12
TRAVELERS COS INC/THE	187	219.40	41,027.80
WILLIS TOWERS WATSON PLC	85	274.36	23,320.60
WR BERKLEY CORP	174	84.19	14,649.06
ADOBE INC	373	556.04	207,402.92
AUTODESK INC.	175	253.84	44,422.00

FORTINET INC	522	73.07	38,142.54
GEN DIGITAL INC	462	21.89	10,113.18
INTUIT INC	229	649.34	148,698.86
MICROSOFT CORP	6,085	409.14	2,489,616.90
SALESFORCE INC	797	302.42	241,028.74
TYLER TECHNOLOGIES INC	34	422.07	14,350.38
ARISTA NETWORKS INC	206	286.48	59,014.88
CISCO SYSTEMS	3,316	48.90	162,152.40
F5 INC	49	193.02	9,457.98
JUNIPER NETWORKS INC	234	37.35	8,739.90
MOTOROLA SOLUTIONS INC	136	334.20	45,451.20
APPLE INC	11,969	169.00	2,022,761.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,050	18.18	19,089.00
HP INC	712	30.56	21,758.72
SEAGATE TECHNOLOGY	159	93.81	14,915.79
CORNING INC	629	32.60	20,505.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	145	157.31	22,809.95
TE CONNECTIVITY LTD	254	142.46	36,184.84
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	42	288.59	12,120.78
ADVANCED MICRO DEVICES	1,323	211.38	279,655.74
APPLIED MATERIALS	685	212.61	145,637.85
INTEL CORP	3,452	46.15	159,309.80
KLA CORP	111	723.26	80,281.86
LAM RESEARCH	108	994.57	107,413.56
MICRON TECHNOLOGY	899	98.98	88,983.02
NVIDIA CORP	2,022	926.69	1,873,767.18
NXP SEMICONDUCTORS NV	211	259.04	54,657.44
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	353	82.96	29,284.88
QUALCOMM INC	911	175.72	160,080.92
TEXAS INSTRUMENTS INC	744	175.27	130,400.88
AT & T INC	5,882	17.05	100,288.10
VERIZON COMMUNICATIONS	3,442	39.53	136,062.26
CONSTELLATION ENERGY	261	179.58	46,870.38
EDISON INTERNATIONAL	314	68.96	21,653.44
ENTERGY CORP	178	102.84	18,305.52

EVERSOURCE ENERGY	286	59.42	16,994.12
EXELON CORPORATION	815	36.83	30,016.45
NEXTERA ENERGY INC	1,680	56.25	94,500.00
CENTERPOINT ENERGY INC	533	28.31	15,089.23
PUBLIC SVC ENTERPRISE	408	65.26	26,626.08
SEMPRA	515	70.60	36,359.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	159	118.61	18,858.99
AMERICAN EXPRESS CO	471	223.42	105,230.82
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	312	137.65	42,946.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	205	121.52	24,911.60
SYNCHRONY FINANCIAL	351	41.57	14,591.07
AMERIPRISE FINANCIAL INC	83	412.78	34,260.74
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	630	55.73	35,109.90
BLACKROCK INC	115	831.70	95,645.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	89	183.81	16,359.09
CME GROUP INC	295	213.53	62,991.35
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	32	467.26	14,952.32
FRANKLIN RESOURCES INC	207	27.97	5,789.79
GOLDMAN SACHS GROUP	267	388.43	103,710.81
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	469	138.85	65,120.65
INVESCO LTD	327	15.66	5,120.82
MARKETAXESS HOLDINGS INC	31	209.08	6,481.48
MOODYS CORP	129	391.58	50,513.82
MORGAN STANLEY	1,035	86.14	89,154.90
MSCI INC	65	550.17	35,761.05
NASDAQ INC	287	59.13	16,970.31
NORTHERN TRUST CORP	175	81.92	14,336.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	158	120.93	19,106.94
S&P GLOBAL INC	265	426.67	113,067.55
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,219	68.19	83,123.61
STATE STREET CORP	259	72.25	18,712.75
T ROWE PRICE GROUP INC	183	116.89	21,390.87
AGILENT TECHNOLOGIES INC	240	149.31	35,834.40
BIO-RAD LABORATORIES-A	15	339.40	5,091.00
ILLUMINA INC	130	136.00	17,680.00

	METTLER-TOLEDO INTL	18	1,350.46	24,308.28	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	316	597.66	188,860.56	
	WATERS CORP	48	361.00	17,328.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESS	337	244.25	82,312.25	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	96	204.90	19,670.40	
	PAYCHEX INC	263	121.13	31,857.19	
	ROBERT HALF INC	78	80.26	6,260.28	
	VERISK ANALYTICS INC	119	236.14	28,100.66	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	84	282.00	23,688.00	
	COMCAST CORP-CL A	3,288	41.74	137,241.12	
	FOX CORP-CLASS A	185	28.66	5,302.10	
	FOX CORP-CLASS B	96	26.11	2,506.56	
	INTERPUBRIC GROUP	328	32.54	10,673.12	
	NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	278	26.14	7,266.92	
	NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	84	27.21	2,285.64	
	OMNICOM GROUP	168	92.74	15,580.32	
	PARAMOUNT GLOBAL	351	10.80	3,790.80	
	DISNEY (WALT) CO	1,498	110.18	165,049.64	
	ELECTRONIC ARTS	204	135.40	27,621.60	
	NETFLIX INC	358	608.51	217,846.58	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	1,860	8.74	16,256.40	
	ALPHABET INC-CL A	4,845	134.38	651,071.10	
	ALPHABET INC-CL C	4,078	135.24	551,508.72	
	MATCH GROUP INC	203	34.11	6,924.33	
	CBRE GROUP INC	255	92.86	23,679.30	
	小計 銘柄数：294			25,666,312.70	
				(3,795,020,995)	
	組入時価比率：90.2%			100.0%	
合計				3,795,020,995	
				(3,795,020,995)	

(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(2024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	80	3,745.60	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	80	3,745.60 (553,824) 0.6%	
	合計			553,824 (553,824)	
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	132	16,387.80	
		AMERICAN TOWER CORP	382	78,206.86	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	116	21,463.48	
		BOSTON PROPERTIES	105	6,630.75	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	248	37,574.48	
		EQUINIX INC	77	69,766.62	
		EQUITY RESIDENTIAL	291	18,312.63	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	55	13,337.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	173	25,337.58	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	53	5,405.47	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	589	10,331.06	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	602	12,527.62	
		IRON MOUNTAIN INC	246	19,930.92	
		KIMCO REALTY CORP	568	10,996.48	
		PROLOGIS INC	756	100,351.44	
		REGENCY CENTERS CORP	120	7,371.60	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	90	19,631.25	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	267	39,969.90	
		UDR INC	221	8,329.49	
		VENTAS INC	339	14,760.06	
		WELLTOWER INC	453	41,694.12	
		WEYERHAEUSER CO	612	21,034.44	
小計	銘柄数：22 組入時価比率：2.1%	6,495	599,351.55 (88,620,120) 99.4%		
合計			88,620,120 (88,620,120)		
合計			89,173,944 (89,173,944)		

(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。