

# 2024年4月期 決算短信 (2023年9月21日～2024年4月15日)

2024年5月22日

ファンド名 NZAM 上場投信 S&P500 (為替ヘッジあり) 上場取引所 東証  
 コード番号 2086 売買単位 10口  
 連動対象指標 S&P500 指数 (配当込み、TTM、円建て、円ヘッジ)  
 主要投資資産 株式  
 管理会社 農林中金全共連アセットマネジメント株式会社  
 URL <https://www.ja-asset.co.jp/>  
 代表者 代表取締役社長 牛窪 克彦  
 問合せ先責任者 プロダクトガバナンス部 デイスクロージャグループ 田原 輝行 (TEL) 03-5210-8692  
 有価証券報告書提出予定日 2024年7月11日  
 分配金支払開始予定日 2024年5月24日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2024年4月期の運用状況 (2023年9月21日～2024年4月15日)

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

|          | 主要投資資産       |              | 現金・預金・その他の資産<br>(負債控除後) |             | 合計 (純資産)     |              |
|----------|--------------|--------------|-------------------------|-------------|--------------|--------------|
|          | 金額           | 構成比          | 金額                      | 構成比         | 金額           | 構成比          |
| 2024年4月期 | 6,700<br>百万円 | (102.2)<br>% | -141<br>百万円             | (-2.2)<br>% | 6,558<br>百万円 | (100.0)<br>% |

#### (2) 設定・解約実績

|          | 前計算期間末<br>発行済口数<br>(①) | 設定口数<br>(②) | 解約口数<br>(③) | 当計算期間末<br>発行済口数<br>(①+②-③) |
|----------|------------------------|-------------|-------------|----------------------------|
| 2024年4月期 | -<br>千口                | 3,875<br>千口 | 960<br>千口   | 2,915<br>千口                |

#### (3) 基準価額

|          | 総資産<br>(①)   | 負債<br>(②)  | 純資産<br>(③) (①-②) | 100口当たり基準価額<br>(③/当計算期間末発行済口数)×100 |
|----------|--------------|------------|------------------|------------------------------------|
| 2024年4月期 | 6,707<br>百万円 | 148<br>百万円 | 6,558<br>百万円     | 225,007<br>円                       |

#### (4) 分配金

|          | 10口当たり分配金 |
|----------|-----------|
| 2024年4月期 | 118<br>円  |

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

### 2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無  
 ② ①以外の変更 無

## II 財務諸表等

NZAM 上場投信 S&amp;P500 (為替ヘッジあり)

## (1) 【貸借対照表】

|                 | 第1期<br>2024年4月15日現在 |
|-----------------|---------------------|
|                 | 金額(円)               |
| 資産の部            |                     |
| 流動資産            |                     |
| コール・ローン         | 6,708,247           |
| 親投資信託受益証券       | 6,700,728,291       |
| 未収利息            | 13                  |
| 流動資産合計          | 6,707,436,551       |
| 資産合計            | 6,707,436,551       |
| 負債の部            |                     |
| 流動負債            |                     |
| 派生商品評価勘定        | 110,067,100         |
| 未払収益分配金         | 34,397,000          |
| 未払受託者報酬         | 544,072             |
| 未払委託者報酬         | 1,360,113           |
| その他未払費用         | 2,116,998           |
| 流動負債合計          | 148,485,283         |
| 負債合計            | 148,485,283         |
| 純資産の部           |                     |
| 元本等             |                     |
| 元本              | 5,830,000,000       |
| 剰余金             |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 728,951,268         |
| (分配準備積立金)       | 175,839             |
| 元本等合計           | 6,558,951,268       |
| 純資産合計           | 6,558,951,268       |
| 負債純資産合計         | 6,707,436,551       |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

|   | 第1期<br>自 2023年9月21日<br>至 2024年4月15日 |
|---|-------------------------------------|
|   | 金額(円)                               |
| 営業収益                                      |                                     |
| 受取利息                                      | 164                                 |
| 有価証券売買等損益                                 | 929,927,641                         |
| 為替差損益                                     | △413,537,752                        |
| 営業収益合計                                    | 516,390,053                         |
| 営業費用                                      |                                     |
| 支払利息                                      | 3,502                               |
| 受託者報酬                                     | 544,072                             |
| 委託者報酬                                     | 1,360,113                           |
| その他費用                                     | 2,120,748                           |
| 営業費用合計                                    | 4,028,435                           |
| 営業利益又は営業損失(△)                             | 512,361,618                         |
| 経常利益又は経常損失(△)                             | 512,361,618                         |
| 当期純利益又は当期純損失(△)                           | 512,361,618                         |
| 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(△) | -                                   |
| 期首剰余金又は期首欠損金(△)                           | -                                   |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 422,602,450                         |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | -                                   |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 422,602,450                         |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 171,615,800                         |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 171,615,800                         |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | -                                   |
| 分配金                                       | 34,397,000                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△)                           | 728,951,268                         |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                       |  |
|-----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。                           |
| 3. 収益及び費用の計上基準        | 有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。                   |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

|   |
|---|
| 第1期<br>(2024年4月15日現在)   |
| 当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 |                            | 第1期<br>2024年4月15日現在     |
|----|----------------------------|-------------------------|
| 1. | 投資信託財産に係る元本の状況             |                         |
|    | 期首元本額                      | 2,500,000,000円          |
|    | 期中追加設定元本額                  | 5,250,000,000円          |
|    | 期中一部解約元本額                  | 1,920,000,000円          |
| 2. | 計算期間の末日における受益権の総数          | 2,915,000口              |
| 3. | 1口当たり純資産額<br>(100口当たり純資産額) | 2,250.07円<br>(225,007円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目       | 第1期<br>自2023年9月21日<br>至2024年4月15日           |
|----------|---|
| 分配金の計算過程 |   |
|          | A. 配当等収益額 $\Delta 3,338$ 円                  |
|          | B. 親ファンドの配当等収益額 38,601,110円                 |
|          | C. 分配準備積立金額 0円                              |
|          | D. 配当等収益合計額 (A+B+C) 38,597,772円             |
|          | E. 経費 4,024,933円                            |
|          | F. 収益分配可能額 (D-E) 34,572,839円                |
|          | G. 収益分配金 34,397,000円                        |
|          | H. 次期繰越金(分配準備積立金)<br>(F-G) 175,839円         |
|          | I. 口数 2,915,000口                            |
|          | J. 100口当たり分配金 (G/I<br>$\times 100$ ) 1,180円 |

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

| 項目                     | 第1期<br>自 2023年9月21日<br>至 2024年4月15日  |
|------------------------|--|
| 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。  |
| 2. 金融商品の内容及び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等であります。<br>当ファンドが保有する有価証券は、全て売買目的で保有しており、デリバティブ取引は、ヘッジ目的以外にも利用する場合があります。また、これらの詳細は、「(重要な会計方針に係る事項に関する注記) 有価証券の評価基準及び評価方法、デリバティブ等の評価基準及び評価方法」に記載しております。<br>当該金融商品は、株価変動リスク、金利変動リスク、信用リスク、流動性リスク、為替変動リスク、価格変動リスク等に晒されています。                             |
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制     | フロント部門では、ポジションリスク管理及びパフォーマンス管理を行っています。また、決定された運用計画に基づいた運用（あるいはポジション組成）となっているか管理を行っております。<br>ミドル部門は、ファンド運用状況の日々のモニタリングや定期的なフィードバックを行ないフロント部門を牽制しております。法令等のルールや組織的に決定された運用計画に従って運用されるよう、日常的な管理を行うほか、コンプライアンス委員会を開催してこれらの遵守状況を検証しております。また、各種運用リスクとパフォーマンスの計測・管理を行うほか、運用リスク管理会議を開催してこれらの管理状況を検証しております。 |

II 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                     | 第 1 期<br>2024 年 4 月 15 日現在  |
|------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額   | 貸借対照表計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ぬ。   |
| 2. 時価の算定方法             | 親投資信託受益証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br>為替予約取引<br>「(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。<br>コール・ローン等の金銭債権<br>短期で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。  |

(有価証券に関する注記)

第 1 期(自 2023 年 9 月 21 日 至 2024 年 4 月 15 日)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類        | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 739,915,546       |
| 合計        | 739,915,546       |

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

第1期(2024年4月15日現在)

(単位:円)

| 区分        | 種類                  | 契約額等          |       | 時価            | 評価損益         |
|-----------|---------------------|---------------|-------|---------------|--------------|
|           |                     |               | うち1年超 |               |              |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>売建<br>米ドル | 6,739,264,975 | —     | 6,849,332,075 | △110,067,100 |
| 合計        |                     | 6,739,264,975 | —     | 6,849,332,075 | △110,067,100 |

(注) 時価の算定方法

1. 対顧客先物売買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 為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

② 為替予約の受渡日の対顧客先物売買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。

- ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち受渡日に最も近い前後二つの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。

- ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物相場の仲値で評価しております。

2. 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。



## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## ①株式

該当事項はありません。

## ②株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種 類       | 銘 柄                        | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|-----------|----------------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券 | S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド | 2,370,764,326 | 6,700,728,291 |    |
| 合計        |                            | 2,370,764,326 | 6,700,728,291 |    |

(注1) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 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

当表に記載すべき内容は、「(3) 注記表 (デリバティブ取引等に関する注記)」に開示しておりますので、記載を省略しております。

## (参考情報)

当ファンドは、「S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。  
 なお、同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド」の状況  
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

|             | 2024年4月15日現在   |
|-------------|----------------|
|             | 金額(円)          |
| 資産の部        |                |
| 流動資産        |                |
| 預金          | 2,140,061,948  |
| コール・ローン     | 224,341,198    |
| 株式          | 69,641,050,469 |
| 投資証券        | 1,456,793,037  |
| 派生商品評価勘定    | 214,157        |
| 未収配当金       | 45,795,636     |
| 未収利息        | 449            |
| 差入委託証拠金     | 552,416,357    |
| 流動資産合計      | 74,060,673,251 |
| 資産合計        | 74,060,673,251 |
| 負債の部        |                |
| 流動負債        |                |
| 派生商品評価勘定    | 43,246,946     |
| 未払解約金       | 108,199,171    |
| 流動負債合計      | 151,446,117    |
| 負債合計        | 151,446,117    |
| 純資産の部       |                |
| 元本等         |                |
| 元本          | 26,149,191,781 |
| 剰余金         |                |
| 剰余金又は欠損金(△) | 47,760,035,353 |
| 元本等合計       | 73,909,227,134 |
| 純資産合計       | 73,909,227,134 |
| 負債純資産合計     | 74,060,673,251 |

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                        |  |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | <p>株式、投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>  |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法  | <p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知り得る直近の日の主たる取引所の発表する清算値段、又は最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> |
| 3. 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>   |
| 4. 収益及び費用の計上基準         | <p>受取配当金</p> <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。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>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</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>   |
| 5. その他                 | <p>外貨建取引等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条及び第 61 条にしたがって処理しております。</p>   |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

|  |  |
|--|--|
| (2024年 4月15日現在)  |  |
| <p>本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが本書における開示対象ファンドの当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。</p> |  |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 |                                    | 2024年4月15日現在         |
|----|------------------------------------|----------------------|
| 1. | 投資信託財産に係る元本の状況                     |                      |
|    | 本書における開示対象ファンドの期首                  | 2023年9月21日           |
|    | 同期首元本額                             | 18,594,814,897円      |
|    | 同期中追加設定元本額                         | 11,925,261,676円      |
|    | 同期中一部解約元本額                         | 4,370,884,792円       |
|    | 元本の内訳                              |                      |
|    | 農林中金<パートナーズ>つみたて米国株式 S & P 5 0 0   | 8,103,949,020円       |
|    | 農林中金<パートナーズ>日米6資産分散ファンド(安定運用コース)   | 214,630,115円         |
|    | 農林中金<パートナーズ>日米6資産分散ファンド(資産形成コース)   | 1,889,231,460円       |
|    | 農林中金<パートナーズ>米国株式 S&P500 インデックスファンド | 12,616,873,582円      |
|    | NZAM・ベータ S & P 5 0 0               | 803,906,757円         |
|    | NZAM・ベータ 米国2資産(株式+REIT)            | 149,836,521円         |
|    | NZAM 上場投信 S&P500(為替ヘッジあり)          | 2,370,764,326円       |
|    | 合計                                 | 26,149,191,781円      |
| 2. | 本書における開示対象ファンドの計算期間の末日における受益権の総数   | 26,149,191,781口      |
| 3. | 一口当たり純資産額<br>(一万口当たり純資産額)          | 2.8264円<br>(28,264円) |

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

| 項目                     | 自 2023 年 9 月 21 日<br>至 2024 年 4 月 15 日   |
|------------------------|--|
| 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。  |
| 2. 金融商品の内容及び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等であります。<br>当ファンドが保有する有価証券は、全て売買目的で保有しており、デリバティブ取引は、ヘッジ目的以外にも利用する場合があります。また、これらの詳細は、「(重要な会計方針に係る事項に関する注記) 有価証券の評価基準及び評価方法、デリバティブ等の評価基準及び評価方法」に記載しております。<br>当該金融商品は、株価変動リスク、金利変動リスク、信用リスク、流動性リスク、為替変動リスク、価格変動リスク等に晒されています。                             |
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制     | フロント部門では、ポジションリスク管理及びパフォーマンス管理を行っています。また、決定された運用計画に基づいた運用（あるいはポジション組成）となっているか管理を行っております。<br>ミドル部門は、ファンド運用状況の日々のモニタリングや定期的なフィードバックを行ないフロント部門を牽制しております。法令等のルールや組織的に決定された運用計画に従って運用されるよう、日常的な管理を行うほか、コンプライアンス委員会を開催してこれらの遵守状況を検証しております。また、各種運用リスクとパフォーマンスの計測・管理を行うほか、運用リスク管理会議を開催してこれらの管理状況を検証しております。 |

II 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                     | 2024年4月15日現在  |
|------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額   | 貸借対照表計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。   |
| 2. 時価の算定方法             | 株式<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br>投資証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br>先物取引<br>「(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。<br>為替予約取引<br>「(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。<br>コール・ローン等の金銭債権<br>短期で決済されるため、帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。  |

(有価証券に関する注記)

(自 2023年9月21日 至 2024年4月15日)

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類   | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|-------------------|
| 株式   | 7,550,972,140     |
| 投資証券 | 19,988,596        |
| 合計   | 7,570,960,737     |

(デリバティブ取引等に関する注記)  
取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2024年4月15日現在)

(単位：円)

| 区分   | 種類             | 契約額等          |       | 時価            | 評価損益        |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|      |                |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 2,699,812,188 | —     | 2,656,565,242 | △43,246,946 |
| 合計   |                | 2,699,812,188 | —     | 2,656,565,242 | △43,246,946 |

(注) 時価の算定方法

1. 先物取引の時価評価については、原則として計算日に知り得る直近の日の主たる取引所の発表する清算値段、又は最終相場に基づいて評価しております。
2. 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額は含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2024年4月15日現在)

(単位：円)

| 区分        | 種類                  | 契約額等       |       | 時価         | 評価損益    |
|-----------|---------------------|------------|-------|------------|---------|
|           |                     |            | うち1年超 |            |         |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>買建<br>米ドル | 75,100,000 | —     | 75,314,157 | 214,157 |
| 合計        |                     | 75,100,000 | —     | 75,314,157 | 214,157 |

(注) 時価の算定方法

1. 対顧客先物売買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為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

②為替予約の受渡日の対顧客先物売買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。

- ・為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち受渡日に最も近い前後二つの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。

- ・為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物相場の仲値で評価しております。

2. 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。



## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## ①株式

| 通貨        | 銘柄                           | 株式数    | 評価額        |               | 備考 |
|-----------|------------------------------|--------|------------|---------------|----|
|           |                              |        | 単価         | 金額            |    |
| 米ドル       | 3M CO                        | 5,959  | 91.31      | 544,116.29    |    |
|           | ABBOTT LABORATORIES          | 18,718 | 109.11     | 2,042,320.98  |    |
|           | ABBVIE INC                   | 19,036 | 162.28     | 3,089,162.08  |    |
|           | ACCENTURE PLC-CL A           | 6,760  | 315.40     | 2,132,104.00  |    |
|           | ADOBE INC                    | 4,873  | 474.09     | 2,310,240.57  |    |
|           | ADVANCED MICRO DEVICES       | 17,421 | 163.28     | 2,844,500.88  |    |
|           | AES CORP                     | 7,220  | 16.85      | 121,657.00    |    |
|           | AFLAC INC                    | 5,676  | 80.28      | 455,669.28    |    |
|           | AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 3,160  | 140.73     | 444,706.80    |    |
|           | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 2,397  | 231.53     | 554,977.41    |    |
|           | AIRBNB INC-CLASS A           | 4,696  | 159.37     | 748,401.52    |    |
|           | AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 1,626  | 103.47     | 168,242.22    |    |
|           | ALBEMARLE CORP               | 1,265  | 122.58     | 155,063.70    |    |
|           | ALIGN TECHNOLOGY INC         | 768    | 314.97     | 241,896.96    |    |
|           | ALLEGION PLC                 | 947    | 127.42     | 120,666.74    |    |
|           | ALLIANT ENERGY CORP          | 2,751  | 48.00      | 132,048.00    |    |
|           | ALLSTATE CORP                | 2,830  | 166.81     | 472,072.30    |    |
|           | ALPHABET INC-CL A            | 63,538 | 157.73     | 10,021,848.74 |    |
|           | ALPHABET INC-CL C            | 53,196 | 159.19     | 8,468,271.24  |    |
|           | ALTRIA GROUP INC             | 19,014 | 41.05      | 780,524.70    |    |
|           | AMAZON.COM INC               | 98,557 | 186.13     | 18,344,414.41 |    |
|           | AMCOR PLC                    | 15,584 | 8.91       | 138,853.44    |    |
|           | AMEREN CORPORATION           | 2,835  | 71.76      | 203,439.60    |    |
|           | AMERICAN AIRLINES GROUP INC  | 7,054  | 13.15      | 92,760.10     |    |
|           | AMERICAN ELECTRIC POWER      | 5,670  | 82.10      | 465,507.00    |    |
|           | AMERICAN EXPRESS CO          | 6,166  | 218.20     | 1,345,421.20  |    |
|           | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 7,569  | 73.68      | 557,683.92    |    |
|           | AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 2,099  | 116.57     | 244,680.43    |    |
|           | AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 1,080  | 413.70     | 446,796.00    |    |
|           | AMETEK INC                   | 2,488  | 179.71     | 447,118.48    |    |
|           | AMGEN INC                    | 5,768  | 267.28     | 1,541,671.04  |    |
|           | AMPHENOL CORP-CL A           | 6,468  | 113.32     | 732,953.76    |    |
|           | ANALOG DEVICES INC           | 5,346  | 192.27     | 1,027,875.42  |    |
| ANSYS INC | 937                          | 334.20 | 313,145.40 |               |    |

|                                |         |          |               |
|--------------------------------|---------|----------|---------------|
| AON PLC                        | 2,159   | 308.00   | 664,972.00    |
| APA CORP                       | 3,894   | 33.72    | 131,305.68    |
| APPLE INC                      | 156,505 | 176.55   | 27,630,957.75 |
| APPLIED MATERIALS INC          | 8,971   | 207.86   | 1,864,712.06  |
| APTIV PLC                      | 3,009   | 74.19    | 223,237.71    |
| ARCH CAPITAL GROUP             | 4,000   | 89.98    | 359,920.00    |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO      | 5,751   | 60.97    | 350,638.47    |
| ARISTA NETWORKS INC            | 2,717   | 271.22   | 736,904.74    |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO        | 2,338   | 234.58   | 548,448.04    |
| ASSURANT INC                   | 560     | 174.19   | 97,546.40     |
| AT&T INC                       | 77,091  | 16.31    | 1,257,354.21  |
| ATMOS ENERGY CORP              | 1,626   | 113.99   | 185,347.74    |
| AUTODESK INC                   | 2,306   | 236.98   | 546,475.88    |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING      | 4,429   | 243.85   | 1,080,011.65  |
| AUTOZONE INC                   | 186     | 2,962.32 | 550,991.52    |
| AVERY DENNISON CORP            | 868     | 211.23   | 183,347.64    |
| AXON ENTERPRISE INC            | 759     | 310.81   | 235,904.79    |
| BAKER HUGHES CO                | 10,791  | 33.05    | 356,642.55    |
| BALL CORP                      | 3,400   | 65.52    | 222,768.00    |
| BANK OF AMERICA CORP           | 74,233  | 35.79    | 2,656,799.07  |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP   | 8,187   | 55.05    | 450,694.35    |
| BATH & BODY WORKS INC          | 2,436   | 45.22    | 110,155.92    |
| BAXTER INTERNATIONAL INC       | 5,475   | 40.33    | 220,806.75    |
| BECTON DICKINSON & CO          | 3,115   | 235.17   | 732,554.55    |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B    | 19,617  | 403.26   | 7,910,751.42  |
| BEST BUY CO INC                | 2,067   | 78.00    | 161,226.00    |
| BIOGEN INC                     | 1,562   | 198.18   | 309,557.16    |
| BIO-RAD LABORATORIES-A         | 226     | 300.45   | 67,901.70     |
| BIO-TECHNE CORP                | 1,695   | 66.73    | 113,107.35    |
| BLACKROCK INC                  | 1,508   | 763.40   | 1,151,207.20  |
| BLACKSTONE INC                 | 7,756   | 123.47   | 957,633.32    |
| BOEING CO                      | 6,184   | 169.55   | 1,048,497.20  |
| BOOKING HOLDINGS INC           | 376     | 3,531.80 | 1,327,956.80  |
| BORGWARNER INC                 | 2,477   | 33.50    | 82,979.50     |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP         | 15,795  | 68.07    | 1,075,165.65  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO        | 21,939  | 48.28    | 1,059,214.92  |
| BROADCOM INC                   | 4,745   | 1,344.07 | 6,377,612.15  |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 1,270   | 198.83   | 252,514.10    |
| BROWN & BROWN INC              | 2,547   | 81.90    | 208,599.30    |

|                              |        |          |              |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 1,950  | 49.43    | 96,388.50    |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC     | 1,330  | 189.53   | 252,074.90   |
| BUNGE GLOBAL SA              | 1,566  | 103.77   | 162,503.82   |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 1,258  | 70.48    | 88,663.84    |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | 2,933  | 305.85   | 897,058.05   |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC    | 2,326  | 40.10    | 93,272.60    |
| CAMPBELL SOUP CO             | 2,121  | 42.31    | 89,739.51    |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 4,101  | 139.62   | 572,581.62   |
| CARDINAL HEALTH INC          | 2,623  | 105.10   | 275,677.30   |
| CARMAX INC                   | 1,703  | 71.41    | 121,611.23   |
| CARNIVAL CORP                | 10,863 | 14.36    | 155,992.68   |
| CARRIER GLOBAL CORP          | 9,008  | 56.84    | 512,014.72   |
| CATALENT INC                 | 1,949  | 56.30    | 109,728.70   |
| CATERPILLAR INC              | 5,489  | 365.63   | 2,006,943.07 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 1,138  | 178.51   | 203,144.38   |
| CBRE GROUP INC-A             | 3,206  | 89.39    | 286,584.34   |
| CDW CORP/DE                  | 1,444  | 242.91   | 350,762.04   |
| CELANESE CORP-SERIES A       | 1,080  | 156.04   | 168,523.20   |
| CENCORA INC                  | 1,785  | 234.00   | 417,690.00   |
| CENTENE CORP                 | 5,763  | 70.73    | 407,616.99   |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 6,806  | 27.46    | 186,892.76   |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 2,060  | 78.10    | 160,886.00   |
| CHARLES RIVER LABORATORIES   | 553    | 241.34   | 133,461.02   |
| CHARTER COMMUNICATIONS-A     | 1,065  | 260.50   | 277,432.50   |
| CHEVRON CORP                 | 18,701 | 158.96   | 2,972,710.96 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 296    | 2,957.60 | 875,449.60   |
| CHUBB LTD                    | 4,370  | 245.81   | 1,074,189.70 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 2,656  | 101.08   | 268,468.48   |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 1,693  | 118.62   | 200,823.66   |
| CINTAS CORP                  | 929    | 668.41   | 620,952.89   |
| CISCO SYSTEMS INC            | 43,812 | 48.49    | 2,124,443.88 |
| CITIGROUP INC                | 20,519 | 59.68    | 1,224,573.92 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 5,027  | 33.14    | 166,594.78   |
| CLOROX COMPANY               | 1,338  | 141.98   | 189,969.24   |
| CME GROUP INC                | 3,881  | 209.50   | 813,069.50   |
| CMS ENERGY CORP              | 3,175  | 57.66    | 183,070.50   |
| COCA-COLA COMPANY            | 41,954 | 58.28    | 2,445,079.12 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 5,369  | 69.26    | 371,856.94   |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 8,878  | 85.85    | 762,176.30   |

NZAM 上場投信 S & P500(為替ヘッジあり) (2086) 2024年4月期 決算短信

|                             |        |        |              |
|-----------------------------|--------|--------|--------------|
| COMCAST CORP-CL A           | 42,723 | 39.37  | 1,682,004.51 |
| COMERICA INC                | 1,422  | 51.24  | 72,863.28    |
| CONAGRA BRANDS INC          | 5,154  | 29.31  | 151,063.74   |
| CONOCO PHILLIPS             | 12,702 | 131.20 | 1,666,502.40 |
| CONSOLIDATED EDISON INC     | 3,722  | 88.63  | 329,880.86   |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A  | 1,734  | 262.24 | 454,724.16   |
| CONSTELLATION ENERGY GROUP  | 3,444  | 191.67 | 660,111.48   |
| COOPER COS INC/THE          | 2,143  | 93.52  | 200,413.36   |
| COPART INC                  | 9,421  | 55.38  | 521,734.98   |
| CORNING INC                 | 8,279  | 31.49  | 260,705.71   |
| CORPAY INC                  | 779    | 299.91 | 233,629.89   |
| CORTEVA INC                 | 7,567  | 53.76  | 406,801.92   |
| COSTAR GROUP INC            | 4,403  | 90.34  | 397,767.02   |
| COSTCO WHOLESALE CORP       | 4,784  | 731.31 | 3,498,587.04 |
| COTERRA ENERGY INC          | 8,110  | 27.64  | 224,160.40   |
| CSX CORP                    | 21,307 | 35.34  | 752,989.38   |
| CUMMINS INC                 | 1,475  | 298.63 | 440,479.25   |
| CVS HEALTH CORP             | 13,569 | 68.64  | 931,376.16   |
| DANAHER CORP                | 7,091  | 239.95 | 1,701,485.45 |
| DARDEN RESTAURANTS INC      | 1,287  | 153.05 | 196,975.35   |
| DAVITA INC                  | 581    | 130.42 | 75,774.02    |
| DAYFORCE INC                | 1,683  | 60.64  | 102,057.12   |
| DECKERS OUTDOOR CORP        | 277    | 814.37 | 225,580.49   |
| DEERE & CO                  | 2,808  | 397.27 | 1,115,534.16 |
| DELTA AIR LINES INC         | 6,904  | 46.86  | 323,521.44   |
| DEVON ENERGY CORP           | 6,908  | 53.42  | 369,025.36   |
| DEXCOM INC                  | 4,157  | 136.14 | 565,933.98   |
| DIAMONDBACK ENERGY INC      | 1,930  | 206.34 | 398,236.20   |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 2,696  | 120.91 | 325,973.36   |
| DOLLAR GENERAL CORP         | 2,367  | 147.78 | 349,795.26   |
| DOLLAR TREE INC             | 2,232  | 125.19 | 279,424.08   |
| DOMINION ENERGY INC         | 9,022  | 48.91  | 441,266.02   |
| DOMINO'S PIZZA INC          | 376    | 495.31 | 186,236.56   |
| DOVER CORP                  | 1,508  | 172.06 | 259,466.48   |
| DOW INC                     | 7,572  | 57.69  | 436,828.68   |
| DR HORTON INC               | 3,220  | 151.71 | 488,506.20   |
| DTE ENERGY COMPANY          | 2,226  | 106.25 | 236,512.50   |
| DUKE ENERGY CORPORATION     | 8,313  | 94.90  | 788,903.70   |
| DUPONT DE NEMOURS INC       | 4,637  | 73.80  | 342,210.60   |

|  |        |          |              |
|--|--------|----------|--------------|
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY               | 1,265  | 97.98    | 123,944.70   |
| EATON CORP PLC                         | 4,305  | 318.50   | 1,371,142.50 |
| EBAY INC                               | 5,596  | 51.31    | 287,130.76   |
| ECOLAB INC                             | 2,736  | 221.69   | 606,543.84   |
| EDISON INTERNATIONAL                   | 4,136  | 68.63    | 283,853.68   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP              | 6,539  | 90.28    | 590,340.92   |
| ELECTRONIC ARTS INC                    | 2,623  | 127.89   | 335,455.47   |
| ELEVANCE HEALTH INC                    | 2,533  | 497.49   | 1,260,142.17 |
| ELI LILLY & CO                         | 8,598  | 751.64   | 6,462,600.72 |
| EMERSON ELECTRIC CO                    | 6,164  | 112.65   | 694,374.60   |
| ENPHASE ENERGY INC                     | 1,464  | 117.02   | 171,317.28   |
| ENTERGY CORP                           | 2,280  | 102.91   | 234,634.80   |
| EOG RESOURCES INC                      | 6,288  | 135.29   | 850,703.52   |
| EPAM SYSTEMS INC                       | 622    | 259.16   | 161,197.52   |
| EQT CORP                               | 4,435  | 37.25    | 165,203.75   |
| EQUIFAX INC                            | 1,329  | 246.99   | 328,249.71   |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A            | 2,511  | 138.80   | 348,526.80   |
| ETSY INC                               | 1,291  | 67.05    | 86,561.55    |
| EVEREST GROUP LTD                      | 468    | 361.81   | 169,327.08   |
| EVERGY INC                             | 2,477  | 50.95    | 126,203.15   |
| EVERSOURCE ENERGY                      | 3,766  | 58.79    | 221,403.14   |
| EXELON CORP                            | 10,733 | 36.48    | 391,539.84   |
| EXPEDIA GROUP INC                      | 1,410  | 130.46   | 183,948.60   |
| EXPEDITORS INTL WASH INC               | 1,568  | 117.65   | 184,475.20   |
| EXXON MOBIL CORPORATION                | 42,815 | 120.37   | 5,153,641.55 |
| F5 INC                                 | 634    | 187.99   | 119,185.66   |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC           | 411    | 426.24   | 175,184.64   |
| FAIR ISAAC CORP                        | 268    | 1,175.61 | 315,063.48   |
| FASTENAL CO                            | 6,170  | 70.45    | 434,676.50   |
| FEDEX CORP                             | 2,479  | 267.80   | 663,876.20   |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 6,388  | 70.95    | 453,228.60   |
| FIFTH THIRD BANCORP                    | 7,344  | 34.53    | 253,588.32   |
| FIRST SOLAR INC                        | 1,152  | 182.48   | 210,216.96   |
| FIRSTENERGY CORP                       | 5,568  | 37.41    | 208,298.88   |
| FISERV INC                             | 6,471  | 151.20   | 978,415.20   |
| FMC CORP                               | 1,345  | 56.75    | 76,328.75    |
| FORD MOTOR COMPANY                     | 42,080 | 12.61    | 530,628.80   |
| FORTINET INC                           | 6,872  | 66.45    | 456,644.40   |
| FORTIVE CORP                           | 3,781  | 82.41    | 311,592.21   |

|                               |        |        |              |
|-------------------------------|--------|--------|--------------|
| FOX CORP CLASS A              | 2,580  | 30.09  | 77,632.20    |
| FOX CORP CLASS B              | 1,422  | 27.66  | 39,332.52    |
| FRANKLIN RESOURCES INC        | 3,236  | 25.41  | 82,226.76    |
| FREEMPORT-MCMORAN INC         | 15,461 | 49.47  | 764,855.67   |
| GARMIN LTD                    | 1,650  | 143.11 | 236,131.50   |
| GARTNER INC                   | 840    | 465.45 | 390,978.00   |
| GE AEROSPACE                  | 11,734 | 154.63 | 1,814,428.42 |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY      | 4,566  | 86.28  | 393,954.48   |
| GE VERNOVA INC                | 2,934  | 134.00 | 393,156.00   |
| GEN DIGITAL INC               | 6,043  | 20.93  | 126,479.99   |
| GENERAC HOLDINGS INC          | 662    | 131.76 | 87,225.12    |
| GENERAL DYNAMICS CORP         | 2,448  | 287.87 | 704,705.76   |
| GENERAL MILLS INC             | 6,123  | 66.20  | 405,342.60   |
| GENERAL MOTORS CO             | 12,447 | 43.08  | 536,216.76   |
| GENUINE PARTS CO              | 1,512  | 145.38 | 219,814.56   |
| GILEAD SCIENCES INC           | 13,434 | 68.07  | 914,452.38   |
| GLOBAL PAYMENTS INC           | 2,808  | 123.74 | 347,461.92   |
| GLOBE LIFE INC                | 923    | 59.09  | 54,540.07    |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC       | 3,516  | 389.49 | 1,369,446.84 |
| HALLIBURTON CO                | 9,597  | 39.67  | 380,712.99   |
| HARTFORD FINANCIAL            | 3,218  | 97.78  | 314,656.04   |
| HASBRO INC                    | 1,406  | 55.80  | 78,454.80    |
| HCA HEALTHCARE INC            | 2,136  | 322.82 | 689,543.52   |
| HENRY SCHEIN INC              | 1,401  | 71.01  | 99,485.01    |
| HERSHEY CO/THE                | 1,616  | 185.80 | 300,252.80   |
| HESS CORP                     | 2,968  | 153.21 | 454,727.28   |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE    | 14,017 | 17.42  | 244,176.14   |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 2,719  | 205.10 | 557,666.90   |
| HOLOGIC INC                   | 2,531  | 77.33  | 195,722.23   |
| HOME DEPOT INC                | 10,731 | 342.87 | 3,679,337.97 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC   | 7,108  | 196.16 | 1,394,305.28 |
| HORMEL FOODS CORP             | 3,125  | 33.93  | 106,031.25   |
| HOWMET AEROSPACE INC          | 4,217  | 64.00  | 269,888.00   |
| HP INC                        | 9,402  | 28.53  | 268,239.06   |
| HUBBELL INC                   | 578    | 401.74 | 232,205.72   |
| HUMANA INC                    | 1,318  | 312.59 | 411,993.62   |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC   | 879    | 185.47 | 163,028.13   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC     | 15,616 | 13.31  | 207,848.96   |

|                                |        |        |              |
|--------------------------------|--------|--------|--------------|
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES  | 427    | 275.72 | 117,732.44   |
| IDEX CORP                      | 815    | 232.67 | 189,626.05   |
| IDEXX LABORATORIES INC         | 895    | 497.79 | 445,522.05   |
| ILLINOIS TOOL WORKS            | 2,932  | 253.51 | 743,291.32   |
| ILLUMINA INC                   | 1,712  | 127.07 | 217,543.84   |
| INCYTE CORP                    | 2,006  | 53.85  | 108,023.10   |
| INGERSOLL-RAND INC             | 4,365  | 91.92  | 401,230.80   |
| INSULET CORP                   | 753    | 175.22 | 131,940.66   |
| INTEL CORP                     | 45,586 | 35.69  | 1,626,964.34 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC  | 6,174  | 133.55 | 824,537.70   |
| INTERNATIONAL PAPER CO         | 3,731  | 37.14  | 138,569.34   |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC   | 4,130  | 30.45  | 125,758.50   |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP    | 9,866  | 182.27 | 1,798,275.82 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES      | 2,752  | 83.61  | 230,094.72   |
| INTUIT INC                     | 3,018  | 621.11 | 1,874,509.98 |
| INTUITIVE SURGICAL INC         | 3,799  | 384.80 | 1,461,855.20 |
| INVESCO LIMITED                | 4,847  | 15.34  | 74,352.98    |
| IQVIA HOLDINGS INC             | 1,968  | 234.23 | 460,964.64   |
| JABIL CIRCUIT INC              | 1,375  | 134.07 | 184,346.25   |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC    | 786    | 167.57 | 131,710.02   |
| JACOBS SOLUTIONS INC           | 1,355  | 144.65 | 196,000.75   |
| JM SMUCKER CO/THE              | 1,144  | 109.61 | 125,393.84   |
| JOHNSON & JOHNSON              | 25,955 | 147.52 | 3,828,881.60 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 7,348  | 65.29  | 479,750.92   |
| JP MORGAN CHASE & CO           | 31,171 | 182.79 | 5,697,747.09 |
| JUNIPER NETWORKS INC           | 3,471  | 36.65  | 127,212.15   |
| KELLANOVA                      | 2,844  | 55.42  | 157,614.48   |
| KENVUE INC                     | 18,583 | 19.13  | 355,492.79   |
| KEURIG DR PEPPER INC           | 11,229 | 30.22  | 339,340.38   |
| KEYCORP                        | 10,098 | 14.61  | 147,531.78   |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC      | 1,883  | 155.10 | 292,053.30   |
| KIMBERLY-CLARK CORP            | 3,632  | 123.89 | 449,968.48   |
| KINDER MORGAN INC              | 20,850 | 18.13  | 378,010.50   |
| KLA CORPORATION                | 1,458  | 680.78 | 992,577.24   |
| KRAFT HEINZ CO/THE             | 8,596  | 35.94  | 308,940.24   |
| KROGER CO                      | 7,136  | 55.20  | 393,907.20   |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC      | 2,044  | 202.62 | 414,155.28   |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS   | 915    | 205.73 | 188,242.95   |

|                               |        |          |               |
|-------------------------------|--------|----------|---------------|
| LAM RESEARCH CORP             | 1,414  | 957.04   | 1,353,254.56  |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC      | 1,557  | 79.77    | 124,201.89    |
| LAS VEGAS SANDS CORP          | 3,982  | 50.43    | 200,812.26    |
| LEIDOS HOLDINGS INC           | 1,483  | 125.73   | 186,457.59    |
| LENNAR CORP CL-A              | 2,665  | 159.90   | 426,133.50    |
| LINDE PLC                     | 5,228  | 447.41   | 2,339,059.48  |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT INC | 1,530  | 101.04   | 154,591.20    |
| LKQ CORP                      | 2,885  | 49.25    | 142,086.25    |
| LOCKHEED MARTIN CORP          | 2,319  | 450.40   | 1,044,477.60  |
| LOEWS CORP                    | 1,965  | 73.90    | 145,213.50    |
| LOWE'S COS INC                | 6,201  | 232.05   | 1,438,942.05  |
| LULULEMON ATHLETICA INC       | 1,238  | 336.13   | 416,128.94    |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A      | 2,760  | 101.53   | 280,222.80    |
| M & T BANK CORP               | 1,791  | 134.56   | 240,996.96    |
| MARATHON OIL CORP             | 6,310  | 29.09    | 183,557.90    |
| MARATHON PETROLEUM CORP       | 3,968  | 208.77   | 828,399.36    |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC      | 409    | 213.00   | 87,117.00     |
| MARRIOTT INTL-CL A            | 2,660  | 251.06   | 667,819.60    |
| MARSH & MCLENNAN COS          | 5,305  | 198.07   | 1,050,761.35  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS     | 666    | 602.11   | 401,005.26    |
| MASCO CORP                    | 2,370  | 73.55    | 174,313.50    |
| MASTERCARD INCORPORATED       | 8,895  | 465.38   | 4,139,555.10  |
| MATCH GROUP INC               | 2,931  | 32.68    | 95,785.08     |
| MCCORMICK & COMPANY           | 2,711  | 71.76    | 194,541.36    |
| MCDONALD'S CORPORATION        | 7,821  | 267.39   | 2,091,257.19  |
| MCKESSON CORP                 | 1,417  | 523.01   | 741,105.17    |
| MEDTRONIC PLC                 | 14,336 | 80.13    | 1,148,743.68  |
| MERCK & CO. INC.              | 27,322 | 125.74   | 3,435,468.28  |
| META PLATFORMS INC            | 23,721 | 511.90   | 12,142,779.90 |
| METLIFE INC                   | 6,619  | 70.14    | 464,256.66    |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL  | 232    | 1,261.07 | 292,568.24    |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL     | 2,946  | 42.48    | 125,146.08    |
| MICROCHIP TECHNOLOGY          | 5,826  | 85.64    | 498,938.64    |
| MICRON TECHNOLOGY INC         | 11,902 | 122.52   | 1,458,233.04  |
| MICROSOFT CORP                | 80,115 | 421.90   | 33,800,518.50 |
| MODERNA INC                   | 3,577  | 105.14   | 376,085.78    |
| MOHAWK INDUSTRIES INC         | 570    | 113.17   | 64,506.90     |
| MOLINA HEALTHCARE INC         | 625    | 376.57   | 235,356.25    |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B    | 1,996  | 66.34    | 132,414.64    |



|                                     |        |          |               |
|-------------------------------------|--------|----------|---------------|
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC          | 14,518 | 66.69    | 968,205.42    |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC        | 518    | 658.23   | 340,963.14    |
| MONSTER BEVERAGE CORP               | 7,965  | 55.01    | 438,154.65    |
| MOODY'S CORP                        | 1,697  | 377.16   | 640,040.52    |
| MORGAN STANLEY                      | 13,508 | 86.19    | 1,164,254.52  |
| MOSAIC CO/THE                       | 3,524  | 31.12    | 109,666.88    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC              | 1,789  | 343.81   | 615,076.09    |
| MSCI INC                            | 853    | 526.62   | 449,206.86    |
| NASDAQ INC                          | 4,097  | 61.52    | 252,047.44    |
| NETAPP INC                          | 2,221  | 101.81   | 226,120.01    |
| NETFLIX INC                         | 4,666  | 622.83   | 2,906,124.78  |
| NEWMONT CORP                        | 12,426 | 38.64    | 480,140.64    |
| NEWS CORP - CLASS A                 | 4,097  | 24.36    | 99,802.92     |
| NEWS CORP - CLASS B                 | 1,236  | 25.11    | 31,035.96     |
| NEXTERA ENERGY INC                  | 22,121 | 63.08    | 1,395,392.68  |
| NIKE INC -CL B                      | 13,124 | 92.00    | 1,207,408.00  |
| NISOURCE INC                        | 4,457  | 27.07    | 120,650.99    |
| NORDSON CORP                        | 585    | 264.65   | 154,820.25    |
| NORFOLK SOUTHERN CORP               | 2,435  | 245.74   | 598,376.90    |
| NORTHERN TRUST CORP                 | 2,212  | 83.83    | 185,431.96    |
| NORTHROP GRUMMAN CORP               | 1,521  | 456.11   | 693,743.31    |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD. | 4,587  | 17.77    | 81,510.99     |
| NRG ENERGY INC                      | 2,434  | 73.93    | 179,945.62    |
| NUCOR CORP                          | 2,651  | 194.53   | 515,699.03    |
| NVIDIA CORP                         | 26,632 | 881.86   | 23,485,695.52 |
| NVR INC                             | 34     | 7,817.98 | 265,811.32    |
| NXP SEMICONDUCTORS NV               | 2,779  | 233.61   | 649,202.19    |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP           | 7,097  | 69.01    | 489,763.97    |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE           | 1,929  | 221.13   | 426,559.77    |
| OMNICOM GROUP                       | 2,135  | 90.59    | 193,409.65    |
| ON SEMICONDUCTOR CORP               | 4,607  | 66.64    | 307,010.48    |
| ONEOK INC                           | 6,281  | 78.70    | 494,314.70    |
| ORACLE CORP                         | 17,191 | 121.11   | 2,082,002.01  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC             | 637    | 1,076.49 | 685,724.13    |
| OTIS WORLDWIDE CORP                 | 4,372  | 96.16    | 420,411.52    |
| PACCAR INC                          | 5,640  | 118.16   | 666,422.40    |
| PACKAGING CORP OF AMERICA           | 959    | 182.20   | 174,729.80    |
| PALO ALTO NETWORKS INC              | 3,400  | 279.07   | 948,838.00    |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B            | 5,202  | 10.96    | 57,013.92     |

|                                 |        |        |              |
|---------------------------------|--------|--------|--------------|
| PARKER HANNIFIN CORP            | 1,385  | 550.32 | 762,193.20   |
| PAYCHEX INC                     | 3,453  | 123.00 | 424,719.00   |
| PAYCOM SOFTWARE INC             | 518    | 198.00 | 102,564.00   |
| PAYPAL HOLDINGS INC             | 11,556 | 64.59  | 746,402.04   |
| PENTAIR PLC                     | 1,782  | 81.10  | 144,520.20   |
| PEPSICO INC                     | 14,819 | 168.10 | 2,491,073.90 |
| PFIZER INC                      | 60,880 | 25.86  | 1,574,356.80 |
| PG&E CORPORATION                | 23,003 | 16.60  | 381,849.80   |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL     | 16,739 | 88.85  | 1,487,260.15 |
| PHILLIPS 66                     | 4,636  | 162.49 | 753,303.64   |
| PINNACLE WEST CAPITAL           | 1,223  | 72.24  | 88,349.52    |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO    | 2,519  | 270.80 | 682,145.20   |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP    | 4,292  | 150.63 | 646,503.96   |
| POOL CORP                       | 417    | 380.20 | 158,543.40   |
| PPG INDUSTRIES INC              | 2,542  | 134.43 | 341,721.06   |
| PPL CORPORATION                 | 7,948  | 26.63  | 211,655.24   |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP       | 2,365  | 79.82  | 188,774.30   |
| PROCTER & GAMBLE CO             | 25,370 | 155.33 | 3,940,722.10 |
| PROGRESSIVE CORP                | 6,311  | 203.90 | 1,286,812.90 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC        | 3,892  | 109.69 | 426,913.48   |
| PTC INC                         | 1,289  | 180.06 | 232,097.34   |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP    | 5,373  | 65.87  | 353,919.51   |
| PULTEGROUP INC                  | 2,287  | 110.89 | 253,605.43   |
| QORVO INC                       | 1,041  | 111.36 | 115,925.76   |
| QUALCOMM INC                    | 12,033 | 171.29 | 2,061,132.57 |
| QUANTA SERVICES INC             | 1,566  | 254.69 | 398,844.54   |
| QUEST DIAGNOSTICS INC           | 1,197  | 128.53 | 153,850.41   |
| RALPH LAUREN CORP               | 421    | 160.29 | 67,482.09    |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC     | 2,028  | 122.55 | 248,531.40   |
| REGENERON PHARMACEUTICALS, INC. | 1,139  | 904.70 | 1,030,453.30 |
| REGIONS FINANCIAL CORP          | 9,963  | 19.19  | 191,189.97   |
| REPUBLIC SERVICES INC           | 2,205  | 187.82 | 414,143.10   |
| RESMED INC                      | 1,586  | 185.86 | 294,773.96   |
| REVVITY INC                     | 1,331  | 103.49 | 137,745.19   |
| ROBERT HALF INC                 | 1,123  | 72.07  | 80,934.61    |
| ROCKWELL AUTOMATION INC         | 1,236  | 284.82 | 352,037.52   |
| ROLLINS INC                     | 3,027  | 44.35  | 134,247.45   |
| ROPER TECHNOLOGIES INC          | 1,152  | 535.83 | 617,276.16   |
| ROSS STORES INC                 | 3,630  | 135.99 | 493,643.70   |

|                               |        |        |              |
|-------------------------------|--------|--------|--------------|
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD   | 2,544  | 127.67 | 324,792.48   |
| RTX CORPORATION               | 14,306 | 100.10 | 1,432,030.60 |
| S&P GLOBAL INC                | 3,464  | 417.81 | 1,447,293.84 |
| SALESFORCE INC                | 10,437 | 294.32 | 3,071,817.84 |
| SCHLUMBERGER LTD              | 15,390 | 52.00  | 800,280.00   |
| SCHWAB (CHARLES) CORP         | 16,046 | 70.03  | 1,123,701.38 |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS   | 2,101  | 85.19  | 178,984.19   |
| SEMPRA                        | 6,785  | 68.69  | 466,061.65   |
| SERVICENOW INC                | 2,210  | 768.71 | 1,698,849.10 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE       | 2,539  | 318.25 | 808,036.75   |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC        | 1,728  | 101.55 | 175,478.40   |
| SMITH (A. O.) CORP            | 1,324  | 86.50  | 114,526.00   |
| SNAP-ON INC                   | 569    | 289.58 | 164,771.02   |
| SOLVENTUM CORP                | 1,490  | 62.75  | 93,497.50    |
| SOUTHERN CO                   | 11,759 | 68.73  | 808,196.07   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO         | 6,433  | 27.54  | 177,164.82   |
| STANLEY BLACK & DECKER INC    | 1,653  | 91.48  | 151,216.44   |
| STARBUCKS CORP                | 12,207 | 84.92  | 1,036,618.44 |
| STATE STREET CORP             | 3,256  | 75.78  | 246,739.68   |
| STEEL DYNAMICS INC            | 1,640  | 140.63 | 230,633.20   |
| STERIS PLC                    | 1,065  | 204.00 | 217,260.00   |
| STRYKER CORP                  | 3,646  | 342.05 | 1,247,114.30 |
| SUPER MICRO COMPUTER INC      | 543    | 898.49 | 487,880.07   |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 4,387  | 40.41  | 177,278.67   |
| SYNOPSYS INC                  | 1,644  | 557.16 | 915,971.04   |
| SYSCO CORPORATION             | 5,368  | 75.25  | 403,942.00   |
| T ROWE PRICE GROUP            | 2,414  | 115.19 | 278,068.66   |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 1,710  | 147.27 | 251,831.70   |
| TAPESTRY INC                  | 2,473  | 41.14  | 101,739.22   |
| TARGA RESOURCES CORP          | 2,404  | 114.69 | 275,714.76   |
| TARGET CORP                   | 4,978  | 166.12 | 826,945.36   |
| TE CONNECTIVITY LTD           | 3,329  | 142.98 | 475,980.42   |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC     | 509    | 398.48 | 202,826.32   |
| TELEFLEX INC                  | 507    | 214.44 | 108,721.08   |
| TERADYNE INC                  | 1,648  | 105.87 | 174,473.76   |
| TESLA INC                     | 29,874 | 171.05 | 5,109,947.70 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC         | 9,804  | 166.33 | 1,630,699.32 |
| TEXTRON INC                   | 2,113  | 93.96  | 198,537.48   |
| THE CIGNA GROUP               | 3,154  | 349.84 | 1,103,395.36 |

|                              |        |          |              |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| THE WALT DISNEY CO.          | 19,777 | 114.01   | 2,254,775.77 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 4,166  | 565.23   | 2,354,748.18 |
| TJX COMPANIES INC            | 12,288 | 94.42    | 1,160,232.96 |
| T-MOBILE US INC              | 5,631  | 160.05   | 901,241.55   |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 1,166  | 244.89   | 285,541.74   |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       | 2,454  | 296.96   | 728,739.84   |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 600    | 1,220.38 | 732,228.00   |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 2,460  | 221.10   | 543,906.00   |
| TRIMBLE INC                  | 2,682  | 60.54    | 162,368.28   |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 14,380 | 36.77    | 528,752.60   |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | 454    | 413.36   | 187,665.44   |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 3,087  | 57.78    | 178,366.86   |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 22,188 | 75.28    | 1,670,312.64 |
| ULTA BEAUTY INC              | 524    | 442.32   | 231,775.68   |
| UNION PACIFIC CORP           | 6,575  | 234.40   | 1,541,180.00 |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 3,537  | 41.80    | 147,846.60   |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 7,798  | 144.91   | 1,130,008.18 |
| UNITED RENTALS INC           | 724    | 674.81   | 488,562.44   |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 9,973  | 439.20   | 4,380,141.60 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 658    | 166.79   | 109,747.82   |
| US BANCORP                   | 16,788 | 41.58    | 698,045.04   |
| VALERO ENERGY                | 3,671  | 173.54   | 637,065.34   |
| VERALTO CORP                 | 2,364  | 87.37    | 206,542.68   |
| VERISIGN INC                 | 950    | 185.43   | 176,158.50   |
| VERISK ANALYTICS INC         | 1,563  | 222.53   | 347,814.39   |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 45,330 | 39.72    | 1,800,507.60 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 2,779  | 396.55   | 1,102,012.45 |
| VIATRIS INC                  | 12,935 | 11.33    | 146,553.55   |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 17,053 | 275.96   | 4,705,945.88 |
| VULCAN MATERIALS CO          | 1,433  | 262.78   | 376,563.74   |
| WABTEC CORP                  | 1,932  | 146.18   | 282,419.76   |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 7,717  | 17.85    | 137,748.45   |
| WALMART INC                  | 46,154 | 60.14    | 2,775,701.56 |
| WARNER BROS DISCOVERY INC    | 23,926 | 8.34     | 199,542.84   |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 3,952  | 205.37   | 811,622.24   |
| WATERS CORP                  | 638    | 322.66   | 205,857.08   |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 3,401  | 78.97    | 268,576.97   |
| WELLS FARGO & COMPANY        | 38,803 | 56.47    | 2,191,205.41 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 798    | 380.00   | 303,240.00   |

|                              |           |        |                                    |
|------------------------------|-----------|--------|------------------------------------|
| WESTERN DIGITAL CORP         | 3,496     | 72.05  | 251,904.28                         |
| WESTROCK CO                  | 2,771     | 47.99  | 132,980.29                         |
| WILLIAMS COS INC             | 13,116    | 38.08  | 499,457.28                         |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 1,106     | 260.31 | 287,902.86                         |
| WR BERKLEY CORP              | 2,185     | 82.15  | 179,497.75                         |
| WW GRAINGER INC              | 476       | 964.97 | 459,325.72                         |
| WYNN RESORTS LTD             | 1,027     | 101.18 | 103,911.86                         |
| XCEL ENERGY INC              | 5,950     | 53.17  | 316,361.50                         |
| XYLEM INC                    | 2,599     | 128.11 | 332,957.89                         |
| YUM! BRANDS INC              | 3,030     | 137.80 | 417,534.00                         |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 554       | 289.68 | 160,482.72                         |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 2,253     | 124.48 | 280,453.44                         |
| ZOETIS INC                   | 4,950     | 149.98 | 742,401.00                         |
| 米ドル 小計                       | 3,346,734 |        | 453,805,880.81<br>(69,641,050,469) |
| 合 計                          | 3,346,734 |        | 69,641,050,469<br>(69,641,050,469) |

②株式以外の有価証券

| 通貨  | 種類   | 銘柄                                    | 券面総額  | 評価額        | 備考 |
|-----|------|---------------------------------------|-------|------------|----|
| 米ドル | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES       | 1,698 | 206,884.32 |    |
|     |      | AMERICAN TOWER CORP                   | 5,026 | 900,659.20 |    |
|     |      | AVALONBAY COMMUNITIES INC             | 1,529 | 280,999.62 |    |
|     |      | BOSTON PROPERTIES INC                 | 1,557 | 94,369.77  |    |
|     |      | CAMDEN PROPERTY TRUST                 | 1,151 | 112,728.94 |    |
|     |      | CROWN CASTLE INC                      | 4,676 | 452,215.96 |    |
|     |      | DIGITAL REALTY TRUST INC              | 3,265 | 465,229.85 |    |
|     |      | EQUINIX INC                           | 1,012 | 773,218.60 |    |
|     |      | EQUITY RESIDENTIAL                    | 3,721 | 229,548.49 |    |
|     |      | ESSEX PROPERTY TRUST INC              | 692   | 165,588.68 |    |
|     |      | EXTRA SPACE STORAGE INC               | 2,278 | 320,491.82 |    |
|     |      | FEDERAL REALTY INVS TRUST             | 792   | 78,994.08  |    |
|     |      | HEALTHPEAK PROPERTIES INC.            | 7,633 | 141,363.16 |    |
|     |      | HOST HOTELS AND RESORTS INC           | 7,606 | 152,120.00 |    |
|     |      | INVITATION HOMES INC                  | 6,202 | 210,371.84 |    |
|     |      | IRON MOUNTAIN INC                     | 3,148 | 239,310.96 |    |
|     |      | KIMCO REALTY CORP                     | 7,182 | 129,994.20 |    |
|     |      | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | 1,258 | 161,187.54 |    |

|  |                         |         |                                  |  |
|--|-------------------------|---------|----------------------------------|--|
|  | PROLOGIS INC            | 9,962   | 1,185,478.00                     |  |
|  | PUBLIC STORAGE          | 1,706   | 464,270.84                       |  |
|  | REALTY INCOME CORP      | 8,967   | 466,463.34                       |  |
|  | REGENCY CENTERS CORP    | 1,771   | 103,585.79                       |  |
|  | SBA COMMUNICATIONS CORP | 1,163   | 234,739.92                       |  |
|  | SIMON PROPERTY          | 3,514   | 508,862.34                       |  |
|  | UDR INC                 | 3,263   | 119,556.32                       |  |
|  | VENTAS INC              | 4,338   | 185,796.54                       |  |
|  | VICI PROPERTIES INC     | 11,154  | 311,642.76                       |  |
|  | WELLTOWER INC           | 5,967   | 535,776.93                       |  |
|  | WEYERHAEUSER CO         | 7,868   | 261,532.32                       |  |
|  | 米ドル 小計                  | 120,099 | 9,492,982.13<br>(1,456,793,037)  |  |
|  | 合 計                     | 120,099 | 1,456,793,037<br>(1,456,793,037) |  |

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注2) 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わるもので、内書であります。

(注4) 外貨建有価証券の内訳

| 種類  | 銘柄数        | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|-----|------------|--------------|----------------|----------------|
| 米ドル | 株式 474 銘柄  | 94.2%        | —              | 98.0%          |
|     | 投資証券 29 銘柄 | —            | 2.0%           | 2.0%           |

## 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

当表に記載すべき内容は、「(2) 注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に開示しておりますので、記載を省略しております。