【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年5月30日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	ＣＥＯ兼代表取締役社長 小池　広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目２番１号
【事務連絡者氏名】	松井　秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 （東京都中央区日本橋兜町2番1号）

１【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2022年11月30日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

２【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報　第1ファンドの状況　5運用状況
第二部ファンド情報　第3ファンドの経理状況

また、それ以外の訂正事項につきましては、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部＿は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

第一部【証券情報】

（４）発行（売出）価格

＜訂正前＞

取得申込日の翌営業日の基準価額※に100.10%以内（2022年11月30日現在100.10%）の率を乗じて得た価額（「販売基準価額」といいます。）とします。

なお、取得申込日の午後3時30分までに委託者に追加設定の連絡をして受理されたものを当日の申込みとします。

※「基準価額」とは、純資産総額を計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、ファンドにおいては100口当りの価額で表示されます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社
サポートダイヤル　0120-753104（フリーダイヤル）
＜受付時間＞　営業日の午前9時～午後5時
インターネットホームページ　http://www.nomura-am.co.jp/

＜訂正後＞

取得申込日の翌営業日の基準価額※に100.10%以内（2023年5月30日現在100.10%）の率を乗じて得た価額（「販売基準価額」といいます。）とします。

なお、取得申込日の午後3時30分までに委託者に追加設定の連絡をして受理されたものを当日の申込みとします。

※「基準価額」とは、純資産総額を計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、ファンドにおいては100口当りの価額で表示されます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社
サポートダイヤル　0120-753104（フリーダイヤル）
＜受付時間＞　営業日の午前9時～午後5時
インターネットホームページ　http://www.nomura-am.co.jp/

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１ファンドの性格

（３）ファンドの仕組み

＜更新後＞

■委託会社の概況(2023年4月末現在)■

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月１日	野村證券投資信託委託株式会社として設立
1997年10月１日	投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更
2000年11月１日	野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

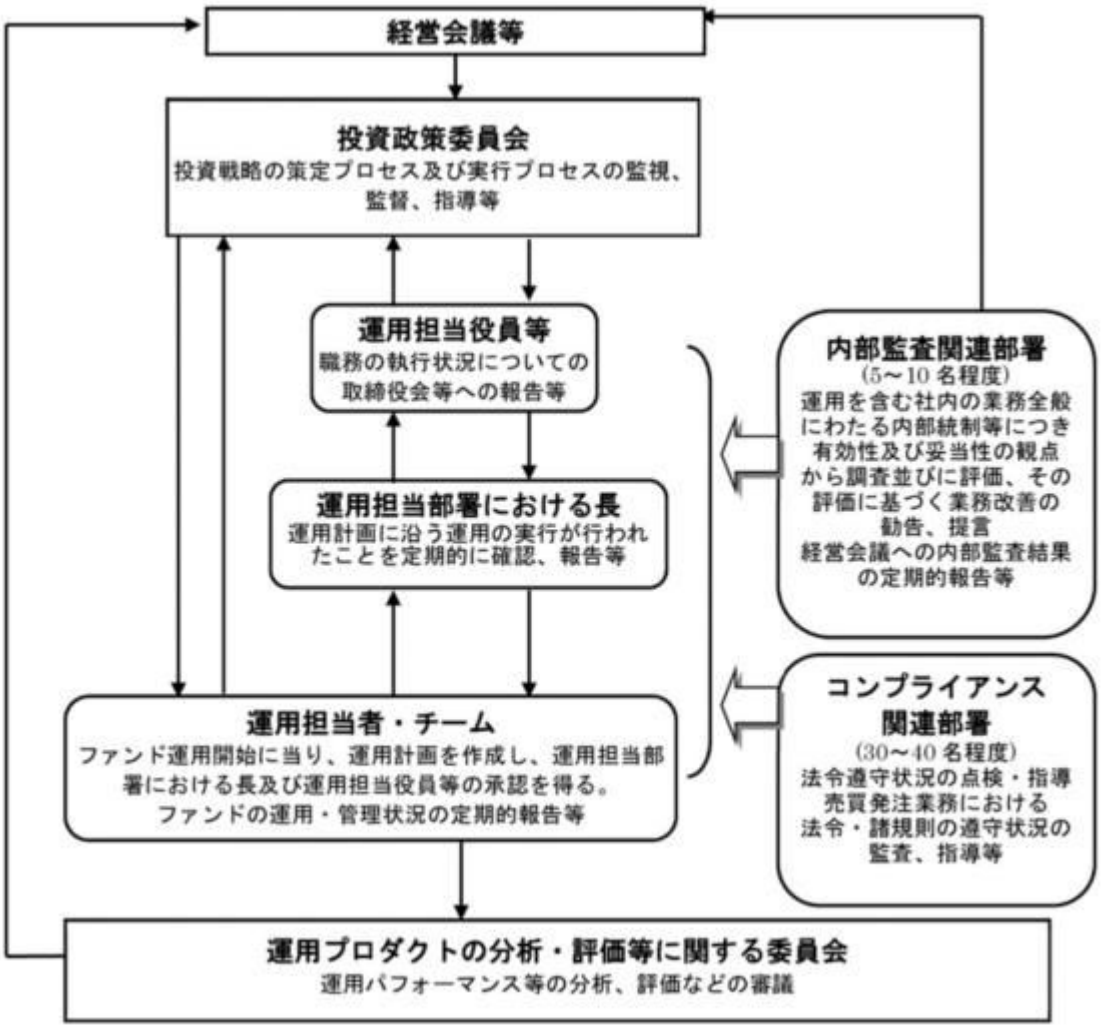
名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋1-13-1	5,150,693株	100%

２投資方針

（３）運用体制

＜更新後＞

ファンドを含む委託会社における投資信託の内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。



≪委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等≫

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

運用の外部委託を行う場合、「運用の外部委託先」に対しては、外部委託先が行った日々の約定について、投資ガイドラインに沿ったものであるかを確認しています。また、コンプライアンスレポートの提出を義務付け、定期的に管理状況に関する報告を受けています。さらに、外部委託先の管理体制、コンプライアンス体制等について調査ならびに評価を行い、定期的に商品に関する委員会に報告しています。

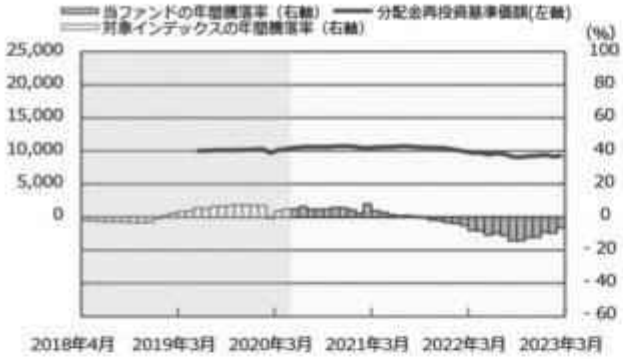
ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

３投資リスク

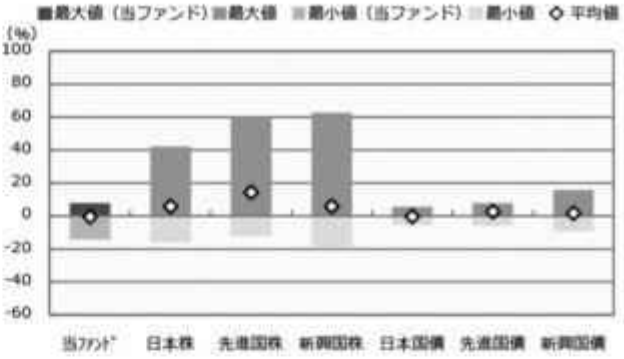
＜更新後＞

リスクの定量的比較（2018年4月末～2023年3月末：月次）

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値（%）	**7.7**	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値（%）	**△ 14.3**	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値（%）	**△ 0.5**	5.9	14.3	5.9	△ 0.3	2.7	1.7

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。当初元本（100口あたり）を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、2018年4月から2023年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2020年5月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。
＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2018年4月から2023年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

<代表的な資産クラスの指数>
○日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
○先進国株：MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円ベース）
○新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
○日本国債：NOMURA-BPI国債
○先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
○新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

○東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。
○MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
○NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
○FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
○JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファーメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメークを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
米国のJ.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
JPMSLLCはNASD, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

（出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC　他）

4 手数料等及び税金

（1）申込手数料

＜更新後＞

販売基準価額（取得申込日の翌営業日の基準価額に100.10%以内（2023年5月30日現在100.10%）の率を乗じて得た価額）に、販売会社が独自に定める率を乗じて得た手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額※とします。

※詳しくは販売会社にお問い合わせ下さい。なお、販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。

購入時手数料は、ファンドの購入に関する事務手続き等の対価として、購入時に頂戴するものです。

（３）信託報酬等

＜更新後＞

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、次の第1号により計算した額に、第2号により計算した額を加算して得た額とします。

1.信託財産の純資産総額に年0.297%(税抜年0.27%)以内で委託会社が定める率(2023年5月30日現在年0.297%(税抜年0.27%))（「信託報酬率」といいます。）を乗じて得た額とし、その配分については以下の通り(税抜)とします。

＜委託会社＞	＜受託会社＞
年0.25%	年0.02%

＊上記配分は、2023年5月30日現在の信託報酬率における配分です。

2.信託財産に属する有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料の44%(税抜40%)以内の額から、当該貸付に係る事務の処理を第三者に委託した場合に要する費用を控除した額とし、その配分については、委託会社は80%、受託会社は20%とします。

ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

＊上場投資信託証券に投資する場合は、信託報酬に加え、投資する上場投資信託証券に関連する費用がかかりますが、投資する上場投資信託証券とその比率があらかじめ定まっていないため記載することができません。

≪支払先の役務の内容≫

＜委託会社＞	＜受託会社＞
ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等

（４）その他の手数料等

＜更新後＞

①ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、有価証券の貸付に係る事務の処理を第三者に委託した場合に要する費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、信託財

産中から支払われます。なお、ファンドの上場に係る費用および対象指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(以下「商標使用料」といいます。)ならびに当該上場に係る費用および当該商標使用料に係る消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支払うことができます。なお、信託財産中から支払わない金額については、委託者が負担します。

◆対象指数に係る商標使用料（2023年5月30日現在）

ファンドの純資産総額に対し、年0.02%以下の率を乗じて得た額とします。

◆ファンドの上場に係る費用（2023年5月30日現在）

・追加上場料：追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して、0.00825%（税抜0.0075%）。

・年間上場料：毎年末の純資産総額に対して、最大0.00825%（税抜0.0075%）。

②ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用は信託財産中から支払われます。

③監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときに信託財産中から支払われます。

④ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中から支払われます。

⑤販売基準価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に100.10%以内（2023年5月30日現在100.10%）の率を乗じた価額となります。したがって、購入時には、基準価額に0.10%以内（2023年5月30日現在0.10%）の率を乗じて得た額を１口あたりに換算して、購入する口数に応じてご負担いただきます。

⑥ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額※をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.10%以内（2023年5月30日現在0.10%）の率を乗じて得た額を1口当たりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

※「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資家との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、クローズド期間の有無に関係なく、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、信託財産に繰り入れられます。

＊これらの費用等の中には、運用状況等により変動するものがあり、事前に料率、上限額等を表示することができないものがあります。

（５）課税上の取扱い

＜更新後＞

①個人の受益者に対する課税

●収益分配金の受取時

分配金については、20.315%(国税(所得税及び復興特別所得税)15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

●受益権の売却時、換金(解約)時および償還時

売却時、換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)※については、申告分離課税により20.315%(国税15.315%および地方税5%)の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率によ

り源泉徴収が行なわれます。

※売却時、換金(解約)時および償還時の価額から取得費(買付・申込手数料(税込)を含む)及び譲渡費用を控除した利益が譲渡益として課税対象となります。

≪損益通算について≫

以下の所得間で損益通算が可能です。上場株式等の配当所得については申告分離課税を選択したものに限ります。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》(注2)	《配当所得》
・特定公社債(注1)の利子 ・公募公社債投資信託の収益分配金	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の ・譲渡益 ・譲渡損	・上場株式の配当 ・公募株式投資信託の収益分配金

（注1）「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

（注2）株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

＊少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入したETFなどから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、分配金の受取方法によっては非課税とならない場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

●収益分配金の受取時

分配金については、15.315%(国税15.315%)の税率で源泉徴収※が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

●受益権の売却時、換金(解約)時および償還時

法人の投資家については、受益権の売却時、換金(解約)時および償還時における源泉徴収はありません。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2023年3月末現在）が変更になる場合があります。

なお、上記のほか、日本の非居住者である受益者には、日本以外の国における税金が課せられる場合があ

ります。

５運用状況

以下は2023年3月31日現在の運用状況であります。
また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）投資状況

ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	12,986,390,713	98.25
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	231,190,339	1.74
合計（純資産総額）		13,217,581,052	100.00

（参考）米国投資適格社債１－１０年インデックスマザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	アメリカ	14,307,510,150	98.25
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	254,004,833	1.74
合計（純資産総額）		14,561,514,983	100.00

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	米国投資適格社債１－１０年インデックスマザーファンド	9,587,590,043	1.3587	13,027,112,135	1.3545	12,986,390,713	98.25

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.25
合　　計	98.25

（参考）米国投資適格社債１－１０年インデックスマザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
1	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	350,000	12,148.44	42,519,560	12,210.70	42,737,460	0.855	2026/2/12	0.29
2	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	330,000	12,434.31	41,033,235	12,387.87	40,879,981	0.864	2025/10/21	0.28
3	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	300,000	13,074.58	39,223,762	12,792.44	38,377,343	3.625	2027/1/20	0.26
4	アメリカ	社債券	WELLS FARGO & COMPANY	300,000	12,902.75	38,708,270	12,567.72	37,703,162	3.584	2028/5/22	0.25
5	アメリカ	社債券	JP MORGAN CHASE & CO	300,000	12,143.82	36,431,478	11,979.17	35,937,510	1.578	2027/4/22	0.24
6	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	300,000	11,950.10	35,850,327	11,934.40	35,803,212	1.093	2026/12/9	0.24
7	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	300,000	11,687.93	35,063,804	11,423.17	34,269,513	2.087	2029/6/14	0.23
8	アメリカ	社債券	WELLS FARGO & COMPANY	300,000	11,790.50	35,371,501	11,284.75	33,854,257	2.572	2031/2/11	0.23
9	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	300,000	11,560.71	34,682,137	11,261.21	33,783,658	2.496	2031/2/13	0.23
10	アメリカ	社債券	ORACLE CORP	260,000	13,128.20	34,133,343	12,934.98	33,630,962	2.95	2024/11/15	0.23
11	アメリカ	社債券	AMAZON.COM INC	250,000	13,375.29	33,438,249	13,428.78	33,571,959	4.6	2025/12/1	0.23
12	アメリカ	社債券	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	250,000	13,246.30	33,115,774	13,048.85	32,622,127	2.5	2024/3/22	0.22
13	アメリカ	社債券	GENERAL MOTORS FINL CO	250,000	13,195.83	32,989,588	12,951.96	32,379,917	3.8	2025/4/7	0.22
14	アメリカ	社債券	NATIONAL AUSTRALIA BK/NY	250,000	13,319.75	33,299,378	12,916.79	32,291,977	3.5	2025/6/9	0.22
15	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	250,000	13,122.03	32,805,082	12,863.54	32,158,864	3.85	2027/1/26	0.22
16	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	250,000	13,431.66	33,579,172	12,790.73	31,976,836	4.431	2030/1/23	0.21
17	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	250,000	12,623.85	31,559,631	12,702.03	31,755,090	0.976	2025/4/22	0.21
18	アメリカ	社債券	ABBVIE INC	250,000	12,821.57	32,053,946	12,675.22	31,688,054	2.95	2026/11/21	0.21
19	アメリカ	社債券	THERMO FISHER SCIENTIFIC	250,000	12,709.48	31,773,713	12,652.06	31,630,155	1.215	2024/10/18	0.21
20	アメリカ	社債券	GSK CONSUMER HEALTHCARE	250,000	12,949.20	32,373,013	12,647.02	31,617,574	3.375	2027/3/24	0.21
21	アメリカ	社債券	DISCOVER BANK	250,000	13,023.06	32,557,667	12,646.89	31,617,249	2.45	2024/9/12	0.21
22	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	250,000	12,583.16	31,457,908	12,632.80	31,582,008	0.969	2025/6/23	0.21
23	アメリカ	社債券	MITSUBISHI UFJ FIN GRP	250,000	12,747.31	31,868,295	12,379.97	30,949,944	3.741	2029/3/7	0.21
24	アメリカ	社債券	CREDIT SUISSE GROUP AG	250,000	12,961.08	32,402,723	12,318.14	30,795,356	3.75	2025/3/26	0.21
25	アメリカ	社債券	JP MORGAN CHASE & CO	240,000	13,201.63	31,683,916	12,815.34	30,756,832	4.203	2029/7/23	0.21
26	アメリカ	社債券	TRUIST BANK	250,000	12,713.33	31,783,338	12,292.03	30,730,093	1.5	2025/3/10	0.21
27	アメリカ	社債券	APPLE INC	240,000	13,023.70	31,256,884	12,770.54	30,649,317	3	2027/11/13	0.21
28	アメリカ	社債券	BAT INTL FINANCE PLC	250,000	11,978.72	29,946,803	12,066.91	30,167,285	1.668	2026/3/25	0.20
29	アメリカ	社債券	BANK OF MONTREAL	240,000	12,709.73	30,503,357	12,489.04	29,973,717	1.85	2025/5/1	0.20
30	アメリカ	社債券	AMERICAN EXPRESS CO	250,000	12,287.52	30,718,807	11,928.52	29,821,308	1.65	2026/11/4	0.20

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)

社債券	98.25
合　　計	98.25

②投資不動産物件

ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信

該当事項はありません。

（参考）米国投資適格社債１－１０年インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信

該当事項はありません。

（参考）米国投資適格社債１－１０年インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（３）運用実績

①純資産の推移

ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信

2023年3月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産及び金融商品取引所の取引価格の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)		東京証券取引所取引価格（円）
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）	
第1特定期間　(2020年 3月 7日)	183	184	1,019.5800	1,026.1800	1,024
第2特定期間　(2020年 9月 7日)	317	319	1,023.0800	1,030.6800	1,025
第3特定期間　(2021年 3月 7日)	1,651	1,658	1,007.2100	1,011.3100	1,006
第4特定期間　(2021年 9月 7日)	5,453	5,484	1,009.9000	1,015.6000	1,012
第5特定期間　(2022年 3月 7日)	10,048	10,105	955.1900	960.5900	957.5
第6特定期間　(2022年 9月 7日)	14,491	14,589	866.1800	872.0800	868.5
第7特定期間　(2023年 3月 7日)	13,028	13,124	833.0500	839.1500	835.6
2022年 3月末日	10,102	―	928.5800	―	931.6
4月末日	11,040	―	906.4300	―	908.6

5月末日	12,406	―	908.2400	―	908.6
6月末日	13,126	―	879.1900	―	880.9
7月末日	13,963	―	898.5300	―	903.1
8月末日	14,507	―	881.3800	―	883.1
9月末日	14,595	―	840.2600	―	840.5
10月末日	13,434	―	834.9400	―	835.9
11月末日	13,153	―	851.3300	―	854.2
12月末日	13,116	―	846.2300	―	846
2023年 1月末日	13,424	―	859.4200	―	860.8
2月末日	12,902	―	840.5700	―	840.1
3月末日	13,217	―	843.5000	―	845

※決算日が休日の場合は、前営業日の取引価格を記載しております。

②分配の推移

ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信

	計算期間	1口当たりの分配金
第1特定期間	2019年 6月26日～2020年 3月 7日	17.3000円
第2特定期間	2020年 3月 8日～2020年 9月 7日	13.9000円
第3特定期間	2020年 9月 8日～2021年 3月 7日	8.4000円
第4特定期間	2021年 3月 8日～2021年 9月 7日	11.3000円
第5特定期間	2021年 9月 8日～2022年 3月 7日	11.3000円
第6特定期間	2022年 3月 8日～2022年 9月 7日	11.5000円
第7特定期間	2022年 9月 8日～2023年 3月 7日	12.6000円

※各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

③収益率の推移

ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信

	計算期間	収益率
第1特定期間	2019年 6月26日～2020年 3月 7日	3.7%
第2特定期間	2020年 3月 8日～2020年 9月 7日	1.7%
第3特定期間	2020年 9月 8日～2021年 3月 7日	△0.7%
第4特定期間	2021年 3月 8日～2021年 9月 7日	1.4%
第5特定期間	2021年 9月 8日～2022年 3月 7日	△4.3%
第6特定期間	2022年 3月 8日～2022年 9月 7日	△8.1%
第7特定期間	2022年 9月 8日～2023年 3月 7日	△2.4%

※各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

※各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（期間中の分配金を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（４）設定及び解約の実績

ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1特定期間	2019年 6月26日～2020年 3月 7日	180,000	―	180,000
第2特定期間	2020年 3月 8日～2020年 9月 7日	130,000	―	310,000
第3特定期間	2020年 9月 8日～2021年 3月 7日	1,340,000	10,000	1,640,000
第4特定期間	2021年 3月 8日～2021年 9月 7日	3,850,000	90,000	5,400,000
第5特定期間	2021年 9月 8日～2022年 3月 7日	5,120,000	―	10,520,000
第6特定期間	2022年 3月 8日～2022年 9月 7日	6,390,000	180,000	16,730,000
第7特定期間	2022年 9月 8日～2023年 3月 7日	1,690,000	2,780,000	15,640,000

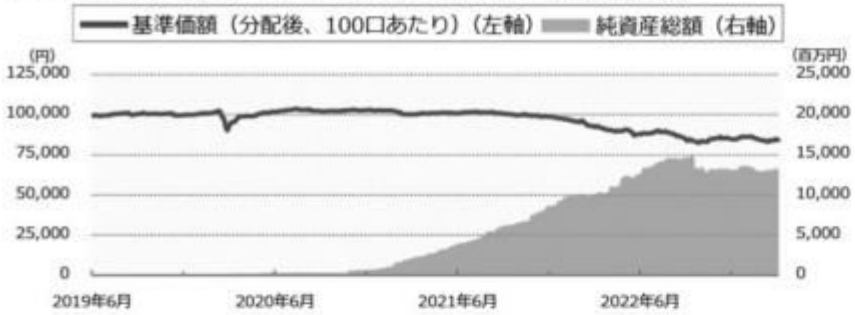
※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

≪参考情報≫

＜更新後＞

運用実績（2023年3月31日現在）

基準価額・純資産の推移（日次：設定来）



分配の推移

（100口あたり、課税前）

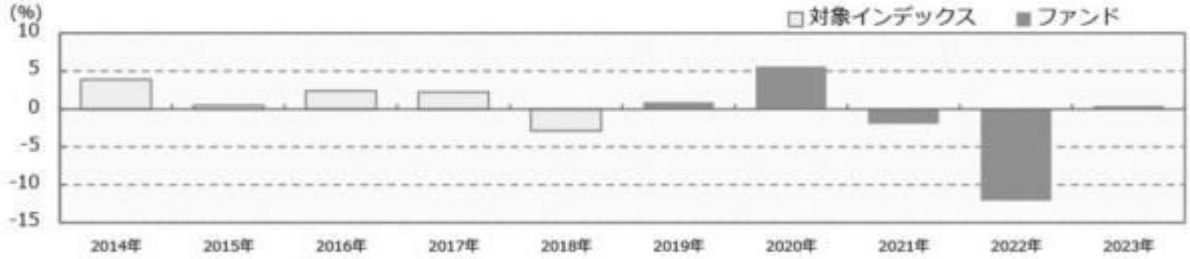
2023年3月	610 円
2022年12月	650 円
2022年9月	590 円
2022年6月	560 円
2022年3月	540 円
設定来累計	8,630 円

主要な資産の状況

実質的な銘柄別投資比率（上位）

順位	銘柄	種類	投資比率（%）
1	GOLDMAN SACHS GROUP INC	社債券	0.3
2	MORGAN STANLEY	社債券	0.3
3	MORGAN STANLEY	社債券	0.3
4	WELLS FARGO & COMPANY	社債券	0.2
5	JP MORGAN CHASE & CO	社債券	0.2
6	GOLDMAN SACHS GROUP INC	社債券	0.2
7	BANK OF AMERICA CORP	社債券	0.2
8	WELLS FARGO & COMPANY	社債券	0.2
9	BANK OF AMERICA CORP	社債券	0.2
10	ORACLE CORP	社債券	0.2

年間収益率の推移（暦年ベース）



・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
・2014年から2018年は対象インデックスの年間収益率。
・2019年は設定日（2019年6月26日）から年末までの収益率。
・2023年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●対象インデックスの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第３【ファンドの経理状況】

(１)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「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)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(２)当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は原則として6ヶ月毎に作成しております。

(３)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(2022年9月8日から2023年3月7日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１財務諸表

ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信

（１）貸借対照表

（単位：円）

	前期 (2022年 9月 7日現在)	当期 (2023年 3月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	25,080,791	18,956,348
親投資信託受益証券	14,841,262,586	13,001,112,135
派生商品評価勘定	-	10,713,484
未収入金	107,000,000	104,342,848
流動資産合計	14,973,343,377	13,135,124,815
資産合計	14,973,343,377	13,135,124,815
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	370,715,583	-
未払金	1,105,112	438,132
未払収益分配金	98,707,000	95,404,000
未払受託者報酬	753,734	719,153
未払委託者報酬	9,421,678	8,989,390
未払利息	24	5
その他未払費用	1,392,348	750,050
流動負債合計	482,095,479	106,300,730
負債合計	482,095,479	106,300,730
純資産の部		
元本等		
元本	16,730,000,000	15,640,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△2,238,752,102	△2,611,175,915
（分配準備積立金）	637,128	600,744
元本等合計	14,491,247,898	13,028,824,085
純資産合計	14,491,247,898	13,028,824,085
負債純資産合計	14,973,343,377	13,135,124,815

（２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	前期 自　2022年 3月 8日 至　2022年 9月 7日	当期 自　2022年 9月 8日 至　2023年 3月 7日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,856,955,955	△581,150,451
為替差損益	△2,787,619,538	231,923,744
営業収益合計	△930,663,583	△349,226,707
営業費用		
支払利息	6,136	26,531
受託者報酬	1,352,824	1,475,819
委託者報酬	16,910,296	18,447,684
その他費用	1,860,168	2,356,572
営業費用合計	20,129,424	22,306,606
営業利益又は営業損失（△）	△950,793,007	△371,533,313
経常利益又は経常損失（△）	△950,793,007	△371,533,313
当期純利益又は当期純損失（△）	△950,793,007	△371,533,313
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（△）	△471,451,595	△2,238,752,102
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,910,800	449,878,400
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,910,800	449,878,400
剰余金減少額又は欠損金増加額	656,215,300	254,939,900
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	656,215,300	254,939,900
分配金	175,203,000	195,829,000
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△2,238,752,102	△2,611,175,915

（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	親投資信託受益証券 基準価額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。
２.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 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。
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。 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。
４.その他	当該財務諸表の特定期間は、2022年 9月 8日から2023年 3月 7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）

前期 2022年 9月 7日現在	当期 2023年 3月 7日現在
1． 特定期間の末日における受益権の総数 16,730,000口	1． 特定期間の末日における受益権の総数 15,640,000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 2,238,752,102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 2,611,175,915円
3． 特定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 866.18円 (100口当たり純資産額) (86,618円)	3． 特定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 833.05円 (100口当たり純資産額) (83,305円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期
自 2022年 3月 8日
至 2022年 9月 7日

1.分配金の計算過程

2022年 3月 8日から2022年 6月 7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	△854円
親ファンドの配当等収益額	B	85,933,547円
分配準備積立金	C	589,401円
配当等収益合計額	D=A+B+C	86,522,094円
経費	E	8,921,219円
収益分配可能額	F=D-E	77,600,875円
収益分配金	G	76,496,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,104,875円
口数	I	13,660,000口
100口当たり分配金	J=G/I×100	560円

2022年 6月 8日から2022年 9月 7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	△5,282円
親ファンドの配当等収益額	B	109,446,604円
分配準備積立金	C	1,104,875円
配当等収益合計額	D=A+B+C	110,546,197円
経費	E	11,202,069円
収益分配可能額	F=D-E	99,344,128円
収益分配金	G	98,707,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	637,128円
口数	I	16,730,000口
100口当たり分配金	J=G/I×100	590円

当期
自 2022年 9月 8日
至 2023年 3月 7日

1.分配金の計算過程

2022年 9月 8日から2022年12月 7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	△12,502円
親ファンドの配当等収益額	B	111,793,034円
分配準備積立金	C	637,128円
配当等収益合計額	D=A+B+C	112,417,660円
経費	E	11,283,667円
収益分配可能額	F=D-E	101,133,993円
収益分配金	G	100,425,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	708,993円
口数	I	15,450,000口
100口当たり分配金	J=G/I×100	650円

2022年12月 8日から2023年 3月 7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	△14,029円
親ファンドの配当等収益額	B	106,306,188円
分配準備積立金	C	708,993円
配当等収益合計額	D=A+B+C	107,001,152円
経費	E	10,996,408円
収益分配可能額	F=D-E	96,004,744円
収益分配金	G	95,404,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	600,744円
口数	I	15,640,000口
100口当たり分配金	J=G/I×100	610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

前期 自 2022年 3月 8日 至 2022年 9月 7日	当期 自 2022年 9月 8日 至 2023年 3月 7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。	1.金融商品に対する取組方針 同左
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の２ 有価証券関係に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析･把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集･分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。	3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2022年 9月 7日現在	当期 2023年 3月 7日現在
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。	１．貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
２．時価の算定方法	２．時価の算定方法

親投資信託受益証券 （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。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

前期 自 2022年 3月 8日 至 2022年 9月 7日	当期 自 2022年 9月 8日 至 2023年 3月 7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

前期 自 2022年 3月 8日 至 2022年 9月 7日		当期 自 2022年 9月 8日 至 2023年 3月 7日	
期首元本額	10,520,000,000円	期首元本額	16,730,000,000円
期中追加設定元本額	6,390,000,000円	期中追加設定元本額	1,690,000,000円
期中一部解約元本額	180,000,000円	期中一部解約元本額	2,780,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2022年 3月 8日 至 2022年 9月 7日	当期 自 2022年 9月 8日 至 2023年 3月 7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）
親投資信託受益証券	877,182,583	△86,112,754
合計	877,182,583	△86,112,754

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

	前期(2022年 9月 7日現在)	当期(2023年 3月 7日現在)

種類	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）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	14,617,222,247	－	14,987,937,830	△370,715,583	13,082,803,413	－	13,072,089,929	10,713,484
米ドル	14,617,222,247	－	14,987,937,830	△370,715,583	13,082,803,413	－	13,072,089,929	10,713,484
合計	14,617,222,247	－	14,987,937,830	△370,715,583	13,082,803,413	－	13,072,089,929	10,713,484

（注）時価の算定方法

１為替予約取引

1)計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

（４）附属明細表

第1　有価証券明細表

(1)株式(2023年3月7日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2023年3月7日現在)

（単位:円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	米国投資適格社債１－１０年インデックスマザーファンド	9,568,083,703	13,001,112,135	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：99.8%	9,568,083,703	13,001,112,135 100.0%	
合計				13,001,112,135	

(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)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。

（参考）

当ファンドは「米国投資適格社債１－１０年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、すべて同親投資信託の受益証券です。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

米国投資適格社債１－１０年インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	(2023年 3月 7日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	268,481,626
コール・ローン	10,584,730
社債券	14,253,157,449
未収利息	121,450,987
前払費用	14,485,597
流動資産合計	14,668,160,389
資産合計	14,668,160,389
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	438,750
未払金	54,925,392
未払解約金	104,000,000
未払利息	3
流動負債合計	159,364,145
負債合計	159,364,145
純資産の部	
元本等	
元本	10,677,819,607
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,830,976,637
元本等合計	14,508,796,244
純資産合計	14,508,796,244
負債純資産合計	14,668,160,389

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	社債券

	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、価格情報会社の提供する価額等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。
２.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
３.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 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。

（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）

2023年 3月 7日現在	
１． 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	1.3588円
(10,000口当たり純資産額)	(13,588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

自 2022年 9月 8日 至 2023年 3月 7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その金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。
○市場リスクの管理
市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析･把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。
○信用リスクの管理
信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集･分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。
○流動性リスクの管理
流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2023年 3月 7日現在
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。 ２．時価の算定方法 社債券 （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。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）
元本の移動及び期末元本額の内訳

2023年 3月 7日現在	
期首	2022年 9月 8日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	11,361,164,463円
同期中における追加設定元本額	2,632,182,616円
同期中における一部解約元本額	3,315,527,472円
期末元本額	10,677,819,607円
期末元本額の内訳＊	
ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信	9,568,083,703円
米国投資適格社債１－１０年インデックス・為替ヘッジ型Ｆ（適格機関投資家専用）	1,109,735,904円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1　有価証券明細表
(1)株式(2023年3月7日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2023年3月7日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	3M COMPANY	100,000.00	90,982.14	
		3M COMPANY	60,000.00	52,626.33	
		ABBOTT LABORATORIES	50,000.00	48,512.96	
		ABBOTT LABORATORIES	100,000.00	96,428.90	
		ABBVIE INC	200,000.00	190,768.72	
		ABBVIE INC	250,000.00	230,696.42	
		ABBVIE INC	100,000.00	95,722.41	
		ABBVIE INC	100,000.00	88,655.32	
		ACTIVISION BLIZZARD	50,000.00	38,998.04	
		ADOBE INC	100,000.00	85,321.58	
		ADVANCE AUTO PARTS	50,000.00	42,350.14	
		ADVOCATE HEALTH & HOSPIT	50,000.00	46,592.69	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	150,000.00	150,602.71	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	150,000.00	132,395.68	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	150,000.00	141,837.40	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	150,000.00	128,341.71	
		AFFILIATED MANAGERS GROU	50,000.00	42,240.46	
		AGILENT TECHNOLOGIES INC	100,000.00	92,510.45	
		AGREE LP	50,000.00	41,458.92	
		AIR LEASE CORP	100,000.00	94,932.23	
		AIR LEASE CORP	100,000.00	93,036.01	
		AIR LEASE CORP	100,000.00	78,733.79	
		AIR PRODUCTS & CHEMICALS	100,000.00	83,597.44	
		AIRCASTLE LTD	100,000.00	97,512.09	
		ALABAMA POWER CO	50,000.00	42,559.95	
		ALBEMARLE CORP	50,000.00	47,518.38	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE E	50,000.00	47,655.90	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE E	100,000.00	84,269.26	
		ALIBABA GROUP HOLDING	200,000.00	183,230.42	
		ALLEGHANY CORP	50,000.00	46,096.96	

ALLEGION US HOLDING CO	50,000.00	48,768.45	
ALLSTATE CORP	50,000.00	44,307.61	
ALLY FINANCIAL INC	100,000.00	95,191.93	
ALLY FINANCIAL INC	150,000.00	122,664.03	
ALPHABET INC	100,000.00	85,181.68	
ALPHABET INC	70,000.00	55,216.98	
ALTRIA GROUP INC	100,000.00	93,687.29	
ALTRIA GROUP INC	100,000.00	86,100.62	
AMAZON.COM INC	200,000.00	189,267.26	
AMAZON.COM INC	250,000.00	247,741.80	
AMAZON.COM INC	100,000.00	94,273.57	
AMAZON.COM INC	80,000.00	74,554.40	
AMAZON.COM INC	100,000.00	98,477.10	
AMAZON.COM INC	180,000.00	144,403.77	
AMAZON.COM INC	150,000.00	137,222.61	
AMCOR FLEXIBLES NORTH AM	100,000.00	80,946.49	
AMEREN CORP	100,000.00	95,269.51	
AMERICAN ELECTRIC POWER	100,000.00	89,126.25	
AMERICAN ELECTRIC POWER	50,000.00	42,000.00	
AMERICAN EXPRESS CO	120,000.00	112,563.60	
AMERICAN EXPRESS CO	250,000.00	220,784.35	
AMERICAN EXPRESS CREDIT	100,000.00	95,249.22	
AMERICAN EXPRESS CREDIT	50,000.00	47,736.66	
AMERICAN HOMES 4 RENT	50,000.00	47,464.22	
AMERICAN HONDA FINANCE	200,000.00	190,726.58	
AMERICAN HONDA FINANCE	100,000.00	85,499.40	
AMERICAN HONDA FINANCE	50,000.00	39,979.16	
AMERICAN INTL GROUP	66,000.00	61,987.17	
AMERICAN INTL GROUP	50,000.00	48,481.29	
AMERICAN TOWER CORP	100,000.00	93,815.47	
AMERICAN TOWER CORP	50,000.00	44,958.90	
AMERICAN TOWER CORP	150,000.00	139,456.41	
AMERICAN TOWER CORP	50,000.00	38,544.61	
AMERICAN TOWER CORP	100,000.00	77,411.16	
AMERICAN WATER CAPITAL	50,000.00	45,797.32	

AMERICAN WATER CAPITAL C	50,000.00	47,532.11	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	100,000.00	95,673.40	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	20,000.00	18,455.70	
AMERISOURCEBERGEN CORP	100,000.00	83,138.73	
AMGEN INC	100,000.00	91,777.99	
AMGEN INC	100,000.00	89,724.79	
AMGEN INC	100,000.00	88,846.76	
AMGEN INC	100,000.00	81,075.82	
AMPHENOL CORP	50,000.00	46,920.86	
AMPHENOL CORP	50,000.00	39,745.65	
ANALOG DEVICES INC	20,000.00	18,934.33	
ANALOG DEVICES INC	100,000.00	80,642.12	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	100,000.00	95,742.80	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	110,000.00	108,613.65	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	100,000.00	91,319.58	
ANTHEM INC	180,000.00	170,414.08	
ANTHEM INC	50,000.00	41,537.35	
AON CORP	50,000.00	48,332.24	
AON CORP/AON GLOBAL HOLD	100,000.00	81,439.04	
APPALACHIAN POWER CO	60,000.00	56,135.17	
APPALACHIAN POWER CO	50,000.00	41,320.33	
APPLE INC	200,000.00	184,556.87	
APPLE INC	200,000.00	177,575.78	
APPLE INC	200,000.00	181,786.56	
APPLE INC	240,000.00	223,046.25	
APPLE INC	100,000.00	84,943.68	
APPLE INC	100,000.00	81,682.95	
APPLE INC	100,000.00	80,286.58	
APPLE INC	100,000.00	79,454.85	
APPLIED MATERIALS INC	20,000.00	18,828.49	
APTIV PLC / APTIV CORP	50,000.00	41,887.90	
ARCELORMITTAL SA	100,000.00	102,093.84	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND C	100,000.00	90,092.63	
ARES CAPITAL CORP	90,000.00	77,549.00	
ARES CAPITAL CORP	100,000.00	76,517.55	

ARIZONA PUBLIC SERVICE	50,000.00	38,507.59	
ARROW ELECTRONICS INC	50,000.00	45,700.65	
ASCENSION HEALTH	50,000.00	42,819.49	
ASSURANT INC	50,000.00	37,996.15	
ASTRAZENECA PLC	200,000.00	191,867.28	
ASTRAZENECA PLC	100,000.00	78,675.26	
AT&T INC	200,000.00	179,651.12	
AT&T INC	160,000.00	142,461.29	
AT&T INC	70,000.00	66,392.13	
AT&T INC	100,000.00	94,021.08	
AT&T INC	100,000.00	82,733.15	
AT&T INC	100,000.00	78,232.94	
ATHENE HOLDING LTD	40,000.00	33,670.83	
ATMOS ENERGY CORP	40,000.00	37,102.64	
AUTODESK INC	50,000.00	40,006.93	
AUTOMATIC DATA PROCESSNG	50,000.00	48,094.97	
AUTONATION INC	80,000.00	77,120.83	
AUTONATION INC	50,000.00	41,891.69	
AUTOZONE INC	150,000.00	137,176.69	
AVALONBAY COMMUNITIES	90,000.00	82,648.62	
AVALONBAY COMMUNITIES	100,000.00	79,046.33	
AVANGRID INC	80,000.00	75,926.96	
AVERY DENNISON CORP	50,000.00	41,368.94	
AVNET INC	50,000.00	47,404.08	
AXA EQUITABLE HOLDINGS I	70,000.00	66,512.71	
AXA SA	50,000.00	60,457.80	
BAIDU INC	200,000.00	189,661.16	
BAKER HUGHES LLC/CO-OBL	100,000.00	89,168.89	
BAKER HUGHES LLC/CO-OBL	30,000.00	26,345.06	
BALTIMORE GAS & ELECTRIC	70,000.00	56,399.77	
BANCO SANTANDER SA	200,000.00	197,350.84	
BANCO SANTANDER SA	200,000.00	177,522.82	
BANCO SANTANDER SA	200,000.00	172,751.48	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	98,106.72	
BANK OF AMERICA CORP	250,000.00	236,441.25	

BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	97,171.29	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	185,735.06	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	186,328.24	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	194,415.72	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	98,334.36	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	178,214.88	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	177,933.64	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	94,155.98	
BANK OF AMERICA CORP	90,000.00	85,773.87	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	93,801.88	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	178,655.32	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	191,181.60	
BANK OF AMERICA CORP	300,000.00	252,500.43	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	182,724.28	
BANK OF AMERICA CORP	300,000.00	247,941.90	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	163,242.84	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	163,307.70	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	78,740.30	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	82,384.25	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	93,541.62	
BANK OF AMERICA CORP	150,000.00	145,114.20	
BANK OF AMERICA CORP	170,000.00	127,651.14	
BANK OF MONTREAL	100,000.00	93,134.44	
BANK OF MONTREAL	240,000.00	223,356.33	
BANK OF MONTREAL	100,000.00	87,900.17	
BANK OF MONTREAL	20,000.00	17,791.97	
BANK OF MONTREAL	50,000.00	39,394.58	
BANK OF NOVA SCOTIA	150,000.00	144,067.74	
BANK OF NOVA SCOTIA	30,000.00	29,084.58	
BANK OF NOVA SCOTIA	100,000.00	88,139.65	
BANK OF NOVA SCOTIA	150,000.00	133,139.56	
BANK OF NOVA SCOTIA	100,000.00	91,500.53	
BANK OF NOVA SCOTIA	50,000.00	43,727.99	
BANK OF NY MELLON CORP	100,000.00	95,132.88	
BANK OF NY MELLON CORP	100,000.00	92,700.64	

BANK OF NY MELLON CORP	100,000.00	97,850.41	
BANK OF NY MELLON CORP	120,000.00	112,556.84	
BANK OF NY MELLON CORP	50,000.00	44,643.58	
BANK OF NY MELLON CORP	100,000.00	83,394.49	
BANK OF NY MELLON CORP	100,000.00	77,850.73	
BARCLAYS PLC	200,000.00	197,046.46	
BARCLAYS PLC	200,000.00	186,875.48	
BARCLAYS PLC	200,000.00	210,399.24	
BARCLAYS PLC	200,000.00	155,151.12	
BAT CAPITAL CORP	30,000.00	28,935.51	
BAT CAPITAL CORP	100,000.00	85,800.58	
BAT INTL FINANCE PLC	250,000.00	222,507.07	
BAT INTL FINANCE PLC	100,000.00	93,674.62	
BAXALTA INC	100,000.00	96,911.34	
BAXTER INTERNATIONAL INC	100,000.00	93,038.66	
BAXTER INTERNATIONAL INC	100,000.00	74,802.87	
BAYLOR SCOTT & WHITE HOL	100,000.00	78,271.65	
BB&T CORPORATION	150,000.00	139,059.94	
BECTON DICKINSON AND CO	91,000.00	88,681.03	
BECTON DICKINSON AND CO	33,000.00	31,093.09	
BECTON DICKINSON AND CO	50,000.00	39,409.58	
BELL CANADA	50,000.00	39,224.26	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	150,000.00	145,104.16	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	50,000.00	46,005.75	
BERKSHIRE HATHAWAY FIN	50,000.00	43,134.36	
BERKSHIRE HATHAWAY INC	130,000.00	124,114.39	
BERRY GLOBAL INC	50,000.00	42,920.88	
BEST BUY CO INC	50,000.00	39,333.37	
BIO-RAD LABS	50,000.00	43,674.41	
BIOGEN INC	50,000.00	48,347.25	
BIOGEN INC	70,000.00	56,838.57	
BLACK HILLS CORP	200,000.00	186,656.66	
BLACKROCK INC	100,000.00	94,026.76	
BLACKROCK INC	100,000.00	80,609.78	
BLACKSTONE PRIVATE CRE	100,000.00	96,485.78	

BLACKSTONE PRIVATE CRE	100,000.00	85,927.59	
BLACKSTONE SECURED LEND	100,000.00	84,094.65	
BLOCK FINANCIAL LLC	40,000.00	39,635.20	
BOARDWALK PIPELINES LP	80,000.00	78,462.26	
BOEING CO	100,000.00	98,670.92	
BOEING CO	200,000.00	185,619.02	
BOEING CO	210,000.00	206,469.73	
BOEING CO	100,000.00	97,321.78	
BOOKING HOLDINGS INC	50,000.00	48,500.12	
BORGWARNER INC	50,000.00	44,893.27	
BOSTON PROPERTIES LP	30,000.00	27,018.35	
BOSTON PROPERTIES LP	50,000.00	51,908.40	
BOSTON PROPERTIES LP	100,000.00	83,083.77	
BOSTON PROPERTIES LP	80,000.00	60,842.64	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	50,000.00	42,760.62	
BP CAP MARKETS AMERICA	180,000.00	171,729.16	
BP CAP MARKETS AMERICA	100,000.00	94,653.35	
BP CAP MARKETS AMERICA	50,000.00	45,869.97	
BP CAP MARKETS AMERICA	150,000.00	125,610.96	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN	50,000.00	49,098.71	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	100,000.00	89,580.96	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	66,000.00	62,413.18	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	150,000.00	141,219.13	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	100,000.00	78,616.21	
BRITISH TELECOM PLC	80,000.00	97,073.23	
BRIXMOR OPERATING PART	70,000.00	67,803.67	
BRIXMOR OPERATING PART	50,000.00	44,308.14	
BROADCOM CORP	100,000.00	93,378.47	
BROADCOM INC	200,000.00	193,860.38	
BROADCOM INC	70,000.00	59,311.39	
BROADCOM INC	100,000.00	95,347.52	
BROADCOM INC	100,000.00	88,187.10	
BROADRIDGE FINANCIAL SOL	50,000.00	40,567.70	
BROOKFIELD FINANCE INC	70,000.00	56,778.99	
BROOKFIELD FINANCE LLC	140,000.00	137,555.29	

BROWN & BROWN INC	50,000.00	46,712.02	
BRUNSWICK CORP	50,000.00	42,505.18	
BUNGE LTD FINANCE CORP	50,000.00	45,535.54	
BURLINGTN NORTH SANTA FE	50,000.00	47,087.36	
BURLINGTON RESOURCES LLC	100,000.00	114,289.02	
CAMDEN PROPERTY TRUST	60,000.00	56,851.86	
CAMPBELL SOUP CO	100,000.00	95,264.38	
CANADIAN IMPERIAL BANK	150,000.00	143,862.24	
CANADIAN IMPERIAL BANK	100,000.00	87,815.77	
CANADIAN NATL RAILWAY	80,000.00	86,538.37	
CANADIAN NATL RESOURCES	50,000.00	42,203.29	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	100,000.00	93,267.37	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	120,000.00	98,521.81	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	97,328.39	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	98,254.78	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	93,704.89	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	96,714.99	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	95,551.50	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	94,321.06	
CARDINAL HEALTH INC	20,000.00	18,569.35	
CARLISLE COS INC	100,000.00	93,543.50	
CARRIER GLOBAL CORP	110,000.00	93,080.52	
CATERPILLAR FINL SERVICE	100,000.00	93,387.40	
CATERPILLAR FINL SERVICE	100,000.00	96,771.60	
CATERPILLAR INC	200,000.00	173,697.94	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	50,000.00	47,718.24	
CBRE SERVICES INC	50,000.00	40,592.81	
CBS CORP	130,000.00	116,596.61	
CDW LLC/CDW FINANCE	50,000.00	44,624.00	
CDW LLC/CDW FINANCE	100,000.00	86,406.50	
CELANESE US HOLDINGS LLC	100,000.00	99,664.53	
CELANESE US HOLDINGS LLC	100,000.00	98,713.38	
CENTENE CORP	100,000.00	84,898.00	
CENTENE CORP	150,000.00	137,920.39	
CENTENE CORP	100,000.00	82,251.50	

CENTERPOINT ENER HOUSTON	100,000.00	82,900.69	
CENTERPOINT ENERGY INC	50,000.00	42,603.75	
CENTERPOINT ENERGY RES	50,000.00	39,324.29	
CGI INC	50,000.00	38,411.15	
CHARLES SCHWAB	20,000.00	18,747.15	
CHARLES SCHWAB CORP	200,000.00	193,566.58	
CHARLES SCHWAB CORP	100,000.00	88,317.35	
CHARLES SCHWAB CORP	60,000.00	46,985.55	
CHARLES SCHWAB CORP	100,000.00	84,613.01	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	150,000.00	146,948.49	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	150,000.00	120,534.48	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	50,000.00	39,171.16	
CHENIERE CORP CHRISTI HD	110,000.00	98,825.63	
CHENIERE ENERGY PARTNERS	100,000.00	90,184.22	
CHEVRON CORP	100,000.00	92,832.83	
CHEVRON USA INC	100,000.00	98,018.39	
CHEVRON USA INC	100,000.00	90,770.90	
CHOICE HOTELS INTL INC	50,000.00	43,067.30	
CHUBB INA HOLDINGS INC	120,000.00	115,131.40	
CI FINANCIAL CORP	50,000.00	37,888.77	
CIGNA CORP	100,000.00	97,598.49	
CIGNA CORP	100,000.00	88,963.46	
CIGNA CORP	100,000.00	96,201.75	
CIGNA CORP	100,000.00	81,444.18	
CINTAS CORPORATION NO. 2	100,000.00	96,365.18	
CINTAS CORPORATION NO.2	20,000.00	19,045.49	
CISCO SYSTEMS INC	100,000.00	92,357.58	
CITIGROUP INC	100,000.00	96,800.73	
CITIGROUP INC	100,000.00	98,199.81	
CITIGROUP INC	120,000.00	117,501.45	
CITIGROUP INC	100,000.00	95,368.23	
CITIGROUP INC	200,000.00	200,147.84	
CITIGROUP INC	200,000.00	185,846.12	
CITIGROUP INC	200,000.00	175,682.34	
CITIGROUP INC	100,000.00	87,450.11	

		CITIGROUP INC	100,000.00	95,751.97	
		CITIGROUP INC	100,000.00	93,992.85	
		CITIGROUP INC	200,000.00	181,782.56	
		CITIGROUP INC	100,000.00	96,936.90	
		CITIGROUP INC	120,000.00	112,196.70	
		CITIGROUP INC	150,000.00	125,261.89	
		CITIGROUP INC	100,000.00	93,142.10	
		CITIGROUP INC	100,000.00	80,516.58	
		CITIGROUP INC	100,000.00	79,062.97	
		CITIGROUP INC	200,000.00	165,191.76	
		CITIGROUP INC	200,000.00	174,822.74	
		CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,000.00	41,277.12	
		CITIZENS FINANCIAL GROUP	80,000.00	69,754.22	
		CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,000.00	47,017.67	
		CLOROX COMPANY	70,000.00	66,920.98	
		CME GROUP INC	50,000.00	47,546.08	
		CNA FINANCIAL CORP	100,000.00	91,694.16	
		CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	100,000.00	94,449.98	
		CNO FINANCIAL GROUP INC	50,000.00	47,258.20	
		COCA-COLA CO/THE	100,000.00	93,281.51	
		COCA-COLA CO/THE	100,000.00	87,952.83	
		COCA-COLA CO/THE	100,000.00	82,241.84	
		COCA-COLA CO/THE	50,000.00	41,350.89	
		COCA-COLA FEMSA SAB CV	150,000.00	130,917.00	
		COLGATE-PALMOLIVE CO	100,000.00	93,824.59	
		COLUMBIA PIPELINE GROUP	50,000.00	48,845.99	
		COMCAST CORP	100,000.00	95,947.76	
		COMCAST CORP	200,000.00	194,265.72	
		COMCAST CORP	100,000.00	100,443.91	
		COMCAST CORP	200,000.00	187,016.56	
		COMCAST CORP	100,000.00	86,083.59	
		COMCAST CORP	100,000.00	90,268.62	
		COMCAST CORP	100,000.00	80,108.16	
		COMCAST CORP	100,000.00	77,290.28	
		COMMONSPIRIT HEALTH	80,000.00	76,744.64	

COMMONWEALTH EDISON CO	60,000.00	55,334.74	
CON EDISON CO OF NY INC	50,000.00	40,944.48	
CONAGRA BRANDS INC	100,000.00	82,943.28	
CONAGRA BRANDS INC	20,000.00	19,337.41	
CONOCOPHILLIPS COMPANY	100,000.00	94,631.81	
CONSTELLATION BRANDS INC	140,000.00	136,751.46	
CONSTELLATION BRANDS INC	100,000.00	79,087.43	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	150,000.00	135,008.23	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	50,000.00	49,009.67	
CORPORATE OFFICE PROP LP	60,000.00	45,043.57	
COSTCO WHOLESALE CORP	100,000.00	87,144.11	
COSTCO WHOLESALE CORP	80,000.00	65,283.44	
CREDIT SUISSE GROUP AG	250,000.00	229,799.67	
CROWN CASTLE INC	100,000.00	86,441.19	
CROWN CASTLE INTL CORP	100,000.00	90,768.21	
CROWN CASTLE INTL CORP	50,000.00	46,909.69	
CROWN CASTLE INTL CORP	100,000.00	80,699.61	
CSX CORP	100,000.00	94,695.49	
CSX CORP	50,000.00	46,127.02	
CUBESMART LP	50,000.00	46,242.90	
CUMMINS INC	40,000.00	36,110.60	
CVS HEALTH CORP	100,000.00	97,989.83	
CVS HEALTH CORP	200,000.00	188,115.66	
CVS HEALTH CORP	100,000.00	84,436.60	
CVS HEALTH CORP	150,000.00	117,409.44	
CVS HEALTH CORP	50,000.00	38,925.63	
D.R. HORTON INC	50,000.00	41,800.46	
DCP MIDSTREAM OPERATING	50,000.00	48,039.78	
DELL INT LLC / EMC CORP	100,000.00	100,534.41	
DELL INT LLC / EMC CORP	150,000.00	151,471.78	
DELL INT LLC/EMC CORP	50,000.00	48,528.79	
DEUTSCHE BANK AG	150,000.00	143,415.12	
DEUTSCHE BANK NY	150,000.00	143,149.00	
DEUTSCHE BANK NY	150,000.00	134,111.55	
DEUTSCHE BANK NY	150,000.00	130,088.80	

DEUTSCHE BANK NY	200,000.00	176,184.26	
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN	110,000.00	130,546.37	
DEVON FINANCING CORP ULC	80,000.00	89,982.91	
DH EUROPE FINANCE II	50,000.00	43,068.76	
DIAGEO CAPITAL PLC	200,000.00	181,748.38	
DIAMONDBACK ENERGY INC	50,000.00	44,238.28	
DIGITAL REALTY TRUST LP	100,000.00	94,136.40	
DISCOVER BANK	250,000.00	237,670.77	
DISCOVER FINANCIAL SVS	100,000.00	96,724.58	
DISCOVERY COMMUNICATIONS	100,000.00	86,505.21	
DOLLAR GENERAL CORP	70,000.00	66,558.65	
DOLLAR GENERAL CORP	50,000.00	47,472.72	
DOLLAR TREE INC	30,000.00	28,466.80	
DOLLAR TREE INC	50,000.00	40,211.49	
DOMINION ENERGY INC	80,000.00	76,483.35	
DOMINION ENERGY INC	100,000.00	87,903.80	
DOVER CORP	30,000.00	25,877.38	
DOW CHEMICAL CO/THE	90,000.00	88,038.92	
DOWDUPONT INC	60,000.00	58,895.85	
DOWDUPONT INC	100,000.00	98,183.56	
DTE ELECTRIC CO	60,000.00	51,572.59	
DTE ENERGY CO	120,000.00	109,782.74	
DUKE ENERGY CAROLINAS	100,000.00	92,926.53	
DUKE ENERGY CORP	100,000.00	89,023.01	
DUKE ENERGY CORP	100,000.00	81,975.92	
DUKE ENERGY CORP	100,000.00	92,556.35	
DUKE ENERGY OHIO INC	100,000.00	81,527.26	
DUKE ENERGY PROGRESS LLC	100,000.00	87,539.52	
DXC TECHNOLOGY CO	50,000.00	41,573.35	
E.I. DU PONT DE NEMOURS	50,000.00	41,883.41	
E*TRADE FINANCIAL CORP	100,000.00	96,861.76	
EASTERN ENERGY GAS	100,000.00	95,306.83	
EASTMAN CHEMICAL CO	50,000.00	47,747.83	
EATON CORP	50,000.00	46,003.96	
EBAY INC	100,000.00	88,700.91	

EBAY INC	50,000.00	52,489.84	
ECOLAB INC	100,000.00	92,262.58	
EDISON INTERNATIONAL	100,000.00	100,188.04	
ELECTRONIC ARTS INC	50,000.00	39,163.38	
ELEVANCE HEALTH INC	50,000.00	45,938.10	
ELI LILLY & CO	113,000.00	104,583.13	
EMERA US FINANCE	50,000.00	39,280.27	
EMERSON ELECTRIC CO	50,000.00	43,537.02	
EMERSON ELECTRIC CO	50,000.00	42,651.59	
ENABLE MIDSTREAM PARTNER	80,000.00	72,790.26	
ENBRIDGE INC	150,000.00	141,845.77	
ENBRIDGE INC	100,000.00	87,873.28	
ENEL CHILE SA	50,000.00	47,678.89	
ENERGY TRANSFER OPERATNG	100,000.00	94,406.43	
ENERGY TRANSFER OPERATNG	130,000.00	125,415.91	
ENSTAR GROUP LTD	50,000.00	37,752.24	
ENTERGY ARKANSAS LLC	200,000.00	190,566.54	
ENTERGY CORP	50,000.00	44,521.10	
ENTERGY CORP	50,000.00	39,570.99	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	100,000.00	82,006.42	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	100,000.00	97,000.50	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	100,000.00	85,755.61	
EOG RESOURCES INC	100,000.00	97,669.53	
EPR PROPERTIES	100,000.00	81,595.84	
EQT CORP	100,000.00	103,532.00	
EQUIFAX INC	50,000.00	42,428.93	
EQUINIX INC	50,000.00	47,572.24	
EQUINIX INC	100,000.00	90,436.06	
EQUINIX INC	100,000.00	88,379.18	
ERP OPERATING LP	80,000.00	69,646.65	
ESSENTIAL UTILITIES INC	50,000.00	40,066.73	
ESSEX PORTFOLIO LP	100,000.00	83,205.32	
ESSEX PORTFOLIO LP	30,000.00	25,475.87	
ESTEE LAUDER CO INC	100,000.00	94,769.38	
EVERGY INC	50,000.00	42,720.93	

EVERGY METRO	100,000.00	82,047.16	
EVERSOURCE ENERGY	100,000.00	87,646.39	
EVERSOURCE ENERGY	60,000.00	56,216.41	
EVERSOURCE ENERGY	50,000.00	42,795.73	
EXELON CORP	100,000.00	90,535.25	
EXELON CORP	40,000.00	36,633.15	
EXPEDIA INC	150,000.00	137,180.52	
EXTRA SPACE STORAGE LP	50,000.00	39,665.94	
EXXON MOBIL CORPORATION	100,000.00	95,989.15	
EXXON MOBIL CORPORATION	100,000.00	91,644.68	
EXXON MOBIL CORPORATION	90,000.00	79,297.21	
EXXON MOBIL CORPORATION	100,000.00	86,556.20	
FAIRFAX FINL HLDGS LTD	50,000.00	47,683.22	
FAIRFAX FINL HLDGS LTD	50,000.00	40,959.18	
FEDERAL REALTY INVESTMEN	50,000.00	43,487.60	
FEDEX CORP	100,000.00	94,446.08	
FEDEX CORP	50,000.00	40,684.38	
FIDELITY NATL FINANCIAL	50,000.00	43,152.62	
FIDELITY NATL INFO SERV	80,000.00	70,356.08	
FIDELITY NATL INFO SERV	100,000.00	95,712.93	
FIFTH THIRD BANCORP	200,000.00	176,753.14	
FIRST AMERICAN FINANCIAL	50,000.00	37,394.65	
FIRST CITIZENS BANCSHARE	50,000.00	46,939.64	
FISERV INC	30,000.00	28,960.22	
FISERV INC	100,000.00	88,638.05	
FISERV INC	100,000.00	89,403.31	
FISERV INC	100,000.00	83,553.99	
FLEX LTD	100,000.00	94,961.87	
FLORIDA POWER & LIGHT CO	100,000.00	95,029.22	
FLOWSERVE CORPORATION	50,000.00	38,363.39	
FORTUNE BRANDS HOME & SE	50,000.00	42,537.23	
FOX CORP	100,000.00	88,126.86	
FRANCE TELECOM	60,000.00	73,147.27	
FRANKLIN RESOURCES INC	80,000.00	61,857.36	
FREEPORT-MCMORAN INC	100,000.00	93,376.00	

FS KKR CAPITAL CORP	100,000.00	85,527.83	
GATX CORP	50,000.00	45,244.29	
GATX CORP	50,000.00	37,621.27	
GE HEALTHCARE HLDG LLC	100,000.00	100,989.33	
GE HEALTHCARE HLDG LLC	100,000.00	103,386.21	
GENERAL DYNAMICS CORP	100,000.00	88,404.61	
GENERAL DYNAMICS CORP	100,000.00	94,565.14	
GENERAL MILLS INC	100,000.00	97,430.60	
GENERAL MILLS INC	50,000.00	40,008.07	
GENERAL MOTORS CO	100,000.00	95,456.53	
GENERAL MOTORS FINL CO	100,000.00	92,974.18	
GENERAL MOTORS FINL CO	160,000.00	151,581.56	
GENERAL MOTORS FINL CO	250,000.00	240,773.10	
GENERAL MOTORS FINL CO	100,000.00	95,716.45	
GENERAL MOTORS FINL CO	100,000.00	91,137.84	
GENERAL MOTORS FINL CO	100,000.00	77,027.02	
GEORGIA POWER CO	70,000.00	59,242.42	
GEORGIA-PACIFIC LLC	50,000.00	56,174.97	
GILEAD SCIENCES INC	50,000.00	47,757.60	
GILEAD SCIENCES INC	100,000.00	84,293.39	
GILEAD SCIENCES INC	100,000.00	79,060.28	
GLAXOSMITHKLINE CAP INC	150,000.00	145,344.52	
GLOBAL PAYMENTS INC	150,000.00	131,163.24	
GLOBAL PAYMENTS INC	100,000.00	85,114.01	
GLOBAL PAYMENTS INC	50,000.00	39,730.67	
GLOBE LIFE INC	50,000.00	47,711.19	
GLP CAPITAL LP / FIN II	100,000.00	94,681.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	200,000.00	192,868.98	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	350,000.00	317,472.22	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	300,000.00	264,390.33	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	100,000.00	101,730.24	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	250,000.00	236,895.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	150,000.00	132,267.33	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	200,000.00	173,230.92	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	200,000.00	175,135.14	

GOLDMAN SACHS GROUP INC	100,000.00	92,901.19	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	160,000.00	134,506.48	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	150,000.00	121,191.97	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	200,000.00	157,911.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	100,000.00	80,170.15	
GSK CONSUMER HEALTHCARE	250,000.00	231,785.27	
GXO LOGISTICS INC	50,000.00	42,804.76	
HALLIBURTON CO	50,000.00	43,175.98	
HASBRO INC	70,000.00	61,578.01	
HCA INC	100,000.00	99,058.51	
HCA INC	50,000.00	49,250.58	
HCA INC	100,000.00	90,735.68	
HCA INC	100,000.00	87,548.20	
HCA INC	200,000.00	182,000.66	
HCA INC	100,000.00	84,635.95	
HCP INC	100,000.00	93,727.40	
HEALTHCARE TRUST OF AMER	80,000.00	68,149.12	
HESS CORP	100,000.00	95,702.37	
HF SINCLAIR CORP	50,000.00	44,110.83	
HIGHWOODS REALTY LP	50,000.00	43,312.14	
HOME DEPOT INC	200,000.00	190,970.98	
HOME DEPOT INC	130,000.00	118,480.21	
HOME DEPOT INC	150,000.00	114,993.96	
HOME DEPOT INC	70,000.00	55,259.74	
HONEYWELL INTERNATIONAL	200,000.00	184,568.82	
HONEYWELL INTERNATIONAL	60,000.00	49,494.30	
HORMEL FOODS CORP	100,000.00	85,408.95	
HOST HOTELS & RESORTS LP	50,000.00	38,485.18	
HP ENTERPRISE CO	100,000.00	89,686.45	
HP INC	100,000.00	88,043.09	
HP INC	100,000.00	78,553.10	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	193,354.54	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	189,213.54	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	188,616.54	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	182,905.52	

HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	183,830.18	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	186,251.74	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	211,318.02	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	163,716.86	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	158,313.86	
HUBBELL INC	50,000.00	40,111.02	
HUDSON PACIFIC PROPERTIE	50,000.00	37,546.94	
HUMANA INC	100,000.00	98,381.52	
HUMANA INC	40,000.00	38,215.75	
HUMANA INC	50,000.00	38,614.03	
HUNTINGTON BANCSHARES	100,000.00	83,474.37	
HUNTINGTON BANCSHARES	50,000.00	36,892.63	
HUNTINGTON INGALLS INDUS	60,000.00	54,695.16	
HUNTSMAN INTERNATIONAL L	50,000.00	39,682.94	
HYATT HOTELS CORP	80,000.00	79,449.74	
IBM CORP	200,000.00	194,581.92	
IBM CORP	100,000.00	89,730.25	
IBM CORP	150,000.00	131,161.03	
IBM CORP	100,000.00	90,849.11	
IBM CORP	100,000.00	80,435.30	
IDEX CORP	50,000.00	41,009.11	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	20,000.00	18,505.65	
ILLUMINA INC	50,000.00	50,021.65	
ING GROEP NV	200,000.00	177,325.32	
ING GROEP NV	200,000.00	187,505.78	
INGERSOLL-RAND LUX FINAN	50,000.00	47,371.04	
INGERSOLL-RAND LUX FINAN	24,000.00	22,018.65	
INGREDION INC	50,000.00	42,622.30	
INTEL CORP	200,000.00	190,711.37	
INTEL CORP	100,000.00	94,850.03	
INTEL CORP	200,000.00	168,844.42	
INTEL CORP	50,000.00	46,124.19	
INTERCONTINENTALEXCHANGE	100,000.00	97,423.00	
INTERCONTINENTALEXCHANGE	140,000.00	131,416.60	
INTERPUBLIC GROUP COS	50,000.00	47,508.70	

INTERSTATE POWER & LIGHT	50,000.00	40,925.07	
INTUIT INC	50,000.00	45,395.96	
INVITATION HOMES OP	50,000.00	41,268.54	
JABIL INC	50,000.00	41,157.19	
JACKSON FINANCIAL INC	50,000.00	48,765.82	
JB HUNT TRANSPRT SVCS	50,000.00	47,978.89	
JBS USA/FOOD/FINANCE	100,000.00	86,754.50	
JBS USA/FOOD/FINANCE	50,000.00	47,601.49	
JEFFERIES GRP LLC / CAP	100,000.00	90,514.16	
JM SMUCKER CO	50,000.00	41,763.81	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	94,276.31	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	96,830.00	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	97,766.10	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	99,823.14	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	88,294.16	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	150,000.00	138,341.38	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	91,329.21	
JOHNSON & JOHNSON	100,000.00	90,479.59	
JOHNSON & JOHNSON	100,000.00	85,628.81	
JOHNSON & JOHNSON	60,000.00	55,709.16	
JOHNSON CONTROLS/TYCO FI	50,000.00	39,945.43	
JP MORGAN CHASE & CO	300,000.00	265,153.71	
JP MORGAN CHASE & CO	100,000.00	95,816.32	
JP MORGAN CHASE & CO	240,000.00	224,853.28	
JP MORGAN CHASE & CO	170,000.00	132,025.67	
JPMORGAN CHASE & CO	70,000.00	68,434.70	
JPMORGAN CHASE & CO	250,000.00	234,658.02	
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	185,869.10	
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	188,477.48	
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	185,964.20	
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	185,586.62	
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	96,049.21	
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	95,732.83	
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	175,154.32	
JPMORGAN CHASE & CO	110,000.00	102,424.48	

JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	90,605.69	
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	94,959.27	
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	84,736.97	
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	168,589.46	
JPMORGAN CHASE & CO	150,000.00	120,063.87	
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	165,290.42	
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	187,294.62	
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	96,088.35	
JUNIPER NETWORKS INC	100,000.00	88,816.18	
KANSAS CITY SOUTHERN	50,000.00	43,202.94	
KELLOGG CO	100,000.00	81,491.01	
KEMPER CORP	50,000.00	41,982.56	
KEURIG DR PEPPER INC	100,000.00	91,341.65	
KEURIG DR PEPPER INC	100,000.00	92,712.32	
KEYCORP	100,000.00	97,269.56	
KEYCORP	100,000.00	93,954.53	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES	100,000.00	85,747.31	
KILROY REALTY LP	80,000.00	76,584.51	
KIMBERLY-CLARK CORP	100,000.00	89,695.63	
KIMCO REALTY CORP	100,000.00	84,267.88	
KINDER MORGAN INC	200,000.00	175,446.44	
KINDER MORGAN INC	100,000.00	77,550.70	
KINROSS GOLD CORP	50,000.00	47,460.57	
KIRBY CORPORATION	50,000.00	46,810.21	
KITE REALTY GROUP LP	50,000.00	46,169.62	
KLA-TENCOR CORP	50,000.00	47,535.58	
KRAFT HEINZ FOODS CO	150,000.00	142,280.83	
KROGER CO	100,000.00	76,269.64	
KYNDRYL HOLDINGS INC	70,000.00	52,429.05	
L3 HARRIS TECH	100,000.00	96,174.87	
LABORATORY CORP OF AMER	40,000.00	34,241.66	
LABORATORY CORP OF AMER	50,000.00	41,682.95	
LAM RESEARCH CORP	60,000.00	57,706.56	
LAZARD GROUP LLC	60,000.00	55,577.08	
LEAR CORP	50,000.00	42,928.91	

LEGGETT & PLATT INC	50,000.00	45,985.66	
LEIDOS INC	100,000.00	91,551.77	
LENNAR CORP	50,000.00	49,388.86	
LENNAR CORP	60,000.00	57,304.45	
LIFE STORAGE LP	50,000.00	39,891.35	
LINCOLN NATIONAL CORP	60,000.00	55,393.11	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	200,000.00	187,336.66	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	200,000.00	192,347.60	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	200,000.00	188,725.64	
LOCKHEED MARTIN CORP	100,000.00	102,221.12	
LOWE'S COS INC	100,000.00	97,296.07	
LOWE'S COS INC	100,000.00	98,290.75	
LOWE'S COS INC	100,000.00	95,181.09	
LOWE'S COS INC	100,000.00	88,690.42	
LYB INT FINANCE III	50,000.00	44,786.64	
M&T BANK CORPORATION	100,000.00	97,332.60	
M&T BANK CORPORATION	50,000.00	47,664.01	
MAGALLANES INC	100,000.00	95,786.53	
MAGALLANES INC	150,000.00	137,861.04	
MAGALLANES INC	100,000.00	87,350.14	
MAGELLAN MIDSTREAM PARTN	50,000.00	43,688.35	
MAGNA INTERNATIONAL INC	60,000.00	58,621.20	
MANULIFE FINANCIAL CORP	100,000.00	90,505.51	
MARATHON OIL CORP	50,000.00	51,597.28	
MARATHON PETROLEUM CORP	50,000.00	49,183.57	
MARATHON PETROLEUM CORP	40,000.00	36,915.16	
MARRIOTT INTERNATIONAL	100,000.00	96,632.83	
MARRIOTT INTERNATIONAL	16,000.00	16,153.32	
MARRIOTT INTERNATIONAL	70,000.00	57,844.85	
MARSH & MCLENNAN COS INC	200,000.00	190,886.91	
MARTIN MARIETTA MATERIAL	50,000.00	41,410.25	
MARVELL TECHNOLOGY INC	80,000.00	71,363.02	
MASCO CORP	30,000.00	24,829.41	
MASTERCARD INC	100,000.00	94,397.60	
MASTERCARD INC	100,000.00	80,745.08	

MCCORMICK & CO	70,000.00	64,914.85	
MCDONALD'S CORP	100,000.00	91,281.38	
MCDONALD'S CORP	100,000.00	94,096.94	
MCDONALD'S CORP	100,000.00	82,805.62	
MCKESSON CORP	80,000.00	78,770.57	
MEAD JOHNSON NUTRITION C	100,000.00	96,996.54	
MERCEDES-BENZ FIN NA	50,000.00	61,694.95	
MERCK & CO INC	200,000.00	177,159.18	
MERCK & CO INC	50,000.00	46,316.51	
MERCK & CO INC	100,000.00	81,360.90	
META PLATFORMS INC	50,000.00	46,982.20	
META PLATFORMS INC	100,000.00	89,498.93	
METLIFE INC	120,000.00	114,947.11	
MICRON TECHNOLOGY INC	100,000.00	94,840.69	
MICROSOFT CORP	130,000.00	120,267.48	
MICROSOFT CORP	200,000.00	190,977.06	
MID-AMERICA APARTMENTS	30,000.00	28,306.08	
MID-AMERICA APARTMENTS	50,000.00	38,950.93	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	200,000.00	187,456.80	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	200,000.00	184,623.16	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	200,000.00	195,842.20	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	250,000.00	228,316.05	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	200,000.00	182,208.10	
MIZUHO FINANCIAL GROUP	200,000.00	174,073.06	
MIZUHO FINANCIAL GROUP	200,000.00	175,048.26	
MIZUHO FINANCIAL GROUP	200,000.00	167,723.32	
MOHAWK INDUSTRIES INC	30,000.00	26,224.67	
MOLSON COORS BREWING CO	100,000.00	92,401.60	
MONDELEZ INTERNATIONAL	50,000.00	45,571.59	
MONDELEZ INTERNATIONAL	33,000.00	28,407.66	
MONDELEZ INTERNATIONAL	50,000.00	42,252.25	
MOODY'S CORPORATION	100,000.00	91,946.06	
MORGAN STANLEY	200,000.00	191,784.30	
MORGAN STANLEY	330,000.00	304,095.99	
MORGAN STANLEY	200,000.00	185,293.04	

		MORGAN STANLEY	100,000.00	93,281.97	
		MORGAN STANLEY	100,000.00	98,008.29	
		MORGAN STANLEY	300,000.00	283,662.45	
		MORGAN STANLEY	200,000.00	189,726.38	
		MORGAN STANLEY	200,000.00	190,119.52	
		MORGAN STANLEY	250,000.00	235,037.02	
		MORGAN STANLEY	100,000.00	83,901.37	
		MORGAN STANLEY	200,000.00	177,697.32	
		MORGAN STANLEY	100,000.00	78,122.41	
		MORGAN STANLEY	200,000.00	158,920.54	
		MORGAN STANLEY	100,000.00	81,929.72	
		MORGAN STANLEY	100,000.00	105,872.66	
		MORGAN STANLEY	100,000.00	93,531.03	
		MOTOROLA SOLUTIONS INC	20,000.00	19,271.46	
		MOTOROLA SOLUTIONS INC	100,000.00	79,447.18	
		MPLX LP	150,000.00	134,397.55	
		MPLX LP	100,000.00	94,466.65	
		MPLX LP	80,000.00	65,632.08	
		NASDAQ INC	20,000.00	19,108.91	
		NATIONAL AUSTRALIA BK/NY	250,000.00	240,645.15	
		NATIONAL FUEL GAS CO	50,000.00	39,434.39	
		NATIONAL RETAIL PROP INC	50,000.00	46,415.97	
		NATIONAL RURAL UTIL COOP	100,000.00	100,461.06	
		NATIONAL RURAL UTIL COOP	100,000.00	91,750.70	
		NATIONAL RURAL UTIL COOP	50,000.00	37,979.51	
		NATWEST GROUP PLC	200,000.00	175,587.54	
		NATWEST GROUP PLC	200,000.00	197,545.96	
		NATWEST GROUP PLC	200,000.00	153,675.14	
		NETAPP INC	80,000.00	77,175.72	
		NEWFIELD EXPLORATION CO	100,000.00	99,000.32	
		NEWMONT GOLDCORP CORP	100,000.00	84,696.67	
		NEXTERA ENERGY CAPITAL	50,000.00	46,738.07	
		NEXTERA ENERGY CAPITAL	100,000.00	88,098.44	
		NEXTERA ENERGY CAPITAL	100,000.00	97,218.53	
		NEXTERA ENERGY CAPITAL	100,000.00	97,873.35	

NEXTERA ENERGY CAPITAL	60,000.00	50,729.71	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	60,000.00	54,082.87	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	100,000.00	79,384.85	
NIKE INC	100,000.00	95,290.69	
NIKE INC	30,000.00	26,638.49	
NISOURCE FINANCE CORP	100,000.00	93,294.88	
NISOURCE INC	50,000.00	44,706.73	
NORFOLK SOUTHERN CORP	50,000.00	47,933.20	
NORFOLK SOUTHERN CORP	80,000.00	67,565.80	
NORTHERN STATES PWR-MINN	50,000.00	41,148.15	
NORTHERN TRUST CORP	50,000.00	48,370.34	
NORTHERN TRUST CORP	50,000.00	40,862.06	
NORTHERN TRUST CORP	80,000.00	72,413.95	
NORTHROP GRUMMAN CORP	50,000.00	46,822.86	
NORTHROP GRUMMAN CORP	50,000.00	46,142.88	
NORTHROP GRUMMAN CORP	50,000.00	47,827.32	
NOVARTIS CAPITAL CORP	100,000.00	94,017.65	
NOVARTIS CAPITAL CORP	200,000.00	190,400.16	
NSTAR ELECTRIC CO	80,000.00	71,827.10	
NUCOR CORP	100,000.00	93,082.14	
NUTRIEN LTD	70,000.00	59,633.01	
NVENT FINANCE SARL	50,000.00	46,186.62	
NVIDIA CORP	50,000.00	47,382.51	
NVIDIA CORP	50,000.00	42,545.89	
NVIDIA CORP	80,000.00	70,652.22	
NVR INC	50,000.00	42,676.00	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA	200,000.00	187,588.64	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA	80,000.00	69,330.68	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	100,000.00	92,155.22	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	50,000.00	38,861.46	
OKLAHOMA G&E CO	50,000.00	44,119.81	
OMEGA HLTHCARE INVESTORS	100,000.00	93,756.59	
OMNICOM GROUP INC	40,000.00	38,211.13	
OMNICOM GROUP INC	50,000.00	41,159.61	
ONCOR ELECTRIC DELIVERY	20,000.00	19,362.09	

ONCOR ELECTRIC DELIVERY	100,000.00	89,224.19	
ONCOR ELECTRIC DELIVERY	50,000.00	43,242.79	
ONE GAS INC	50,000.00	40,827.39	
ONEOK INC	100,000.00	91,492.27	
ONEOK INC	50,000.00	50,345.66	
ORACLE CORP	260,000.00	249,497.01	
ORACLE CORP	100,000.00	94,316.53	
ORACLE CORP	100,000.00	89,394.96	
ORACLE CORP	100,000.00	90,530.92	
ORACLE CORP	100,000.00	85,369.97	
ORACLE CORP	200,000.00	173,963.28	
ORACLE CORP	100,000.00	104,333.73	
ORIX CORP	80,000.00	64,306.55	
OTIS WORLDWIDE CORP	100,000.00	93,298.37	
OTIS WORLDWIDE CORP	30,000.00	25,308.65	
OWENS CORNING	50,000.00	44,975.12	
OWL ROCK CAPITAL CORP	80,000.00	75,720.91	
OWL ROCK CAPITAL CORP	50,000.00	42,533.87	
OWL ROCK CORE INCOME COR	100,000.00	97,596.43	
PACCAR FINANCIAL CORP	100,000.00	90,105.90	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	200,000.00	185,208.42	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	120,000.00	108,293.56	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	100,000.00	81,898.37	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	50,000.00	48,377.94	
PACIFICORP	20,000.00	18,275.22	
PACIFICORP	100,000.00	85,441.07	
PACKAGING CORP OF AMERIC	50,000.00	42,935.37	
PARAMOUNT GLOBAL	50,000.00	41,232.43	
PARKER-HANNIFIN CORP	100,000.00	95,681.92	
PARKER-HANNIFIN CORP	100,000.00	95,360.50	
PAYPAL HOLDINGS INC	90,000.00	83,058.97	
PAYPAL HOLDINGS INC	100,000.00	82,638.71	
PEPSICO INC	100,000.00	96,698.02	
PEPSICO INC	200,000.00	184,553.44	
PEPSICO INC	100,000.00	88,064.92	

PEPSICO INC	100,000.00	80,550.44	
PERKINELMER INC	50,000.00	38,683.28	
PFIZER INC	100,000.00	93,741.80	
PFIZER INC	100,000.00	93,124.92	
PFIZER INC	70,000.00	57,075.56	
PFIZER INC	100,000.00	79,445.85	
PHILIP MORRIS INTL INC	100,000.00	99,341.21	
PHILIP MORRIS INTL INC	150,000.00	134,496.30	
PHILIP MORRIS INTL INC	100,000.00	101,252.60	
PHILLIPS 66	140,000.00	132,234.27	
PHYSICIANS REALTY LP	50,000.00	39,847.41	
PIEDMONT NATURAL GAS CO	20,000.00	18,047.12	
PIONEER NATURAL RESOURCE	100,000.00	88,858.61	
PLAINS ALL AMER PIPELINE	100,000.00	95,854.08	
PLAINS ALL AMERICAN PIPE	50,000.00	43,690.82	
PNC BANK NA	250,000.00	212,471.52	
PNC FINANCIAL SERVICES	180,000.00	164,935.56	
PNC FINANCIAL SERVICES	100,000.00	93,071.60	
PPG INDUSTRIES INC	100,000.00	88,580.72	
PPL CAPITAL FUNDING INC	20,000.00	18,677.33	
PRAXAIR INC	100,000.00	95,959.88	
PRECISION CASTPARTS CORP	50,000.00	48,090.15	
PRINCIPAL FINANCIAL GRP	80,000.00	74,130.27	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	150,000.00	133,475.25	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	100,000.00	92,857.65	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	50,000.00	39,276.63	
PROGRESSIVE CORP	100,000.00	90,987.21	
PROGRESSIVE CORP	20,000.00	18,820.68	
PROLOGIS L P	100,000.00	95,153.84	
PROLOGIS LP	100,000.00	93,951.57	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	100,000.00	89,982.17	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	200,000.00	189,310.00	
PRUDENTIAL FUNDING ASIA	50,000.00	44,281.17	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC	100,000.00	88,523.11	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC	20,000.00	18,660.57	

PUBLIC SERVICE ENTERPRIS	120,000.00	115,956.88	
PUBLIC STORAGE	100,000.00	88,676.05	
PUBLIC STORAGE	100,000.00	88,420.10	
PUGET ENERGY INC	50,000.00	42,448.02	
QORVO INC	50,000.00	44,685.00	
QUALCOMM INC	120,000.00	100,722.76	
QUALCOMM INC	100,000.00	95,424.46	
QUANTA SERVICES INC	50,000.00	41,619.02	
QUEST DIAGNOSTICS INC	100,000.00	94,473.38	
RADIAN GROUP INC	50,000.00	47,306.25	
RALPH LAUREN CORP	50,000.00	48,092.17	
RAYTHEON TECH CORP	100,000.00	97,074.97	
RAYTHEON TECH CORP	50,000.00	47,566.40	
RAYTHEON TECH CORP	150,000.00	117,257.47	
REALTY INCOME CORP	60,000.00	58,128.60	
REALTY INCOME CORP	30,000.00	29,433.74	
REALTY INCOME CORP	100,000.00	87,253.61	
REALTY INCOME CORP	50,000.00	46,250.86	
REALTY INCOME CORP	50,000.00	50,751.39	
REGAL REXNORD CORP	50,000.00	49,688.13	
REGAL REXNORD CORP	50,000.00	49,193.38	
REGENCY CENTERS LP	50,000.00	42,154.71	
REGENERON PHARMACEUTICAL	50,000.00	38,873.45	
REINSURANCE GRP OF AMER	50,000.00	42,680.46	
RELX CAPITAL INC	50,000.00	46,405.71	
REPUBLIC SERVICES INC	150,000.00	132,922.96	
REPUBLIC SERVICES INC	50,000.00	38,409.38	
REXFORD INDUSTRIAL REALT	50,000.00	38,630.01	
ROCKWELL AUTOMATION	50,000.00	39,348.42	
ROGERS COMMUNICATIONS IN	50,000.00	47,461.55	
ROGERS COMMUNICATIONS IN	50,000.00	45,652.36	
ROGERS COMMUNICATIONS IN	70,000.00	61,195.98	
ROPER TECHNOLOGIES INC	100,000.00	77,003.87	
ROSS STORES INC	50,000.00	38,985.01	
ROYAL BANK OF CANADA	200,000.00	187,117.36	

ROYAL BANK OF CANADA	100,000.00	96,253.37	
ROYAL BANK OF CANADA	100,000.00	88,536.26	
ROYAL BANK OF CANADA	100,000.00	94,335.05	
ROYAL BANK OF CANADA	100,000.00	95,879.20	
ROYAL BANK OF CANADA	150,000.00	119,710.41	
ROYALTY PHARMA PLC	100,000.00	84,699.55	
RPM INTERNATIONAL INC	50,000.00	39,380.14	
RYDER SYSTEM INC	100,000.00	97,879.12	
S&P GLOBAL INC	200,000.00	197,798.00	
SABINE PASS LIQUEFACTION	200,000.00	201,247.12	
SABINE PASS LIQUEFACTION	100,000.00	93,767.88	
SABRA HEALTH CARE LP	50,000.00	37,041.47	
SALESFORCE.COM INC	100,000.00	95,344.51	
SAN DIEGO G & E	50,000.00	42,262.86	
SANOFI	100,000.00	94,446.99	
SANTANDER HOLDINGS USA	50,000.00	48,623.70	
SANTANDER HOLDINGS USA	150,000.00	142,603.14	
SANTANDER UK GROUP HLDGS	200,000.00	181,948.74	
SCHLUMBERGER INVESTMENT	50,000.00	42,985.01	
SEMPRA ENERGY	50,000.00	47,831.13	
SEMPRA ENERGY	50,000.00	41,817.56	
SERVICENOW INC	50,000.00	38,131.18	
SHELL INTERNATIONAL FIN	100,000.00	96,168.48	
SHELL INTERNATIONAL FIN	100,000.00	93,558.75	
SHELL INTERNATIONAL FIN	100,000.00	87,658.35	
SHERWIN-WILLIAMS CO	100,000.00	93,566.60	
SHERWIN-WILLIAMS CO	50,000.00	43,373.49	
SHIRE ACQ INV IRELAND DA	130,000.00	120,949.85	
SIMON PROPERTY GROUP LP	120,000.00	113,727.64	
SIMON PROPERTY GROUP LP	100,000.00	86,655.45	
SIMON PROPERTY GROUP LP	100,000.00	85,311.71	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	50,000.00	44,041.54	
SMITH & NEPHEW PLC	50,000.00	39,413.74	
SOUTHERN CAL EDISON	100,000.00	102,118.78	
SOUTHERN CAL EDISON	130,000.00	122,163.37	

SOUTHERN CALIF GAS CO	100,000.00	95,236.35	
SOUTHERN CO	200,000.00	187,250.72	
SOUTHERN CO	100,000.00	85,292.51	
SOUTHWEST AIRLINES CO	100,000.00	99,444.49	
SOUTHWEST GAS CORP	50,000.00	44,462.90	
SOUTHWESTERN ELEC POWER	100,000.00	89,313.60	
SPIRIT REALTY LP	80,000.00	65,308.71	
STANLEY BLACK & DECKER I	100,000.00	94,174.78	
STARBUCKS CORP	100,000.00	88,734.21	
STARBUCKS CORP	100,000.00	85,022.95	
STATE STREET CORP	50,000.00	47,621.63	
STATE STREET CORP	200,000.00	176,680.44	
STATE STREET CORP	100,000.00	80,646.98	
STATE STREET CORP	100,000.00	91,645.23	
STEEL DYNAMICS INC	80,000.00	76,232.28	
STORE CAPITAL CORP	50,000.00	36,686.00	
STRYKER CORP	150,000.00	136,595.86	
STRYKER CORP	50,000.00	40,652.96	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	100,000.00	91,176.32	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	200,000.00	173,342.82	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	150,000.00	137,617.27	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	200,000.00	188,066.12	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	200,000.00	169,178.16	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	200,000.00	167,538.18	
SUN COMMUNITIES OPER LP	50,000.00	42,077.89	
SUTTER HEALTH	50,000.00	40,898.34	
SUZANO AUSTRIA GMBH	200,000.00	168,445.26	
SVB FINANCIAL GROUP	100,000.00	87,210.60	
SYNCHRONY FINANCIAL	150,000.00	145,974.18	
SYNCHRONY FINANCIAL	120,000.00	109,630.28	
SYNNEX CORP	200,000.00	187,157.66	
SYSCO CORPORATION	100,000.00	80,509.87	
T-MOBILE USA INC	200,000.00	191,558.24	
T-MOBILE USA INC	150,000.00	140,918.29	
T-MOBILE USA INC	100,000.00	85,373.65	

T-MOBILE USA INC	100,000.00	84,536.22	
T-MOBILE USA INC	200,000.00	181,708.78	
T-MOBILE USA INC	200,000.00	157,061.50	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOF	100,000.00	94,145.85	
TANGER PROPERTIES LP	50,000.00	36,782.06	
TAPESTRY INC	50,000.00	39,588.61	
TARGA RESOURCES PARTNERS	100,000.00	85,061.64	
TARGET CORP	150,000.00	141,648.51	
TARGET CORP	100,000.00	89,946.98	
TC PIPELINES LP	50,000.00	47,173.70	
TELEDYNE TECHNOLOGIES IN	100,000.00	89,131.61	
TELEFONICA EUROPE BV	60,000.00	67,948.68	
TELUS CORP	50,000.00	42,519.88	
TEXAS INSTRUMENTS INC	70,000.00	64,545.16	
TEXAS INSTRUMENTS INC	50,000.00	40,875.07	
THERMO FISHER SCIENTIFIC	250,000.00	234,245.12	
THERMO FISHER SCIENTIFIC	50,000.00	39,853.47	
TIMKEN CO	50,000.00	44,894.08	
TJX COS INC	100,000.00	83,542.64	
TOLL BROS FINANCE CORP	50,000.00	43,308.45	
TORONTO-DOMINION BANK	100,000.00	97,000.27	
TORONTO-DOMINION BANK	100,000.00	91,162.08	
TORONTO-DOMINION BANK	150,000.00	130,256.64	
TORONTO-DOMINION BANK	100,000.00	88,714.04	
TORONTO-DOMINION BANK	150,000.00	136,765.00	
TORONTO-DOMINION BANK	150,000.00	117,294.75	
TORONTO-DOMINION BANK	50,000.00	46,350.51	
TORONTO-DOMINION BANK	100,000.00	93,764.42	
TOTALENERGIES CAP INTL	50,000.00	46,091.25	
TOTALENERGIES CAPITAL SA	50,000.00	47,870.26	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	250,000.00	242,730.05	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	200,000.00	186,948.02	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	100,000.00	85,064.72	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	160,000.00	146,180.81	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	100,000.00	79,620.89	

TRANSCANADA PIPELINES	50,000.00	49,215.15	
TRANSCANADA PIPELINES	100,000.00	94,307.89	
TRANSCONT GAS PIPE LINE	60,000.00	63,518.35	
TRUIST BANK	250,000.00	231,850.77	
TRUIST FINANCIAL CORP	100,000.00	90,994.36	
TRUIST FINANCIAL CORP	100,000.00	97,414.48	
TRUIST FINANCIAL CORP	100,000.00	94,458.83	
TSMC ARIZONA CORP	200,000.00	177,856.86	
TYCO ELECTRONICS GROUP S	50,000.00	41,339.20	
TYSON FOODS INC	130,000.00	123,194.60	
UDR INC	70,000.00	58,836.43	
UNILEVER CAPITAL CORP	200,000.00	187,228.50	
UNILEVER CAPITAL CORP	100,000.00	78,567.83	
UNION ELECTRIC CO	100,000.00	92,468.79	
UNION PACIFIC CORP	100,000.00	93,598.12	
UNION PACIFIC CORP	130,000.00	121,333.66	
UNION PACIFIC CORP	50,000.00	42,256.06	
UNITED PARCEL SERVICE	100,000.00	97,595.77	
UNITED PARCEL SERVICE	50,000.00	43,100.15	
UNITED PARCEL SERVICE	50,000.00	48,802.34	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	100,000.00	92,583.51	
UNITEDHEALTH GROUP INC	100,000.00	97,009.65	
UNITEDHEALTH GROUP INC	100,000.00	94,749.92	
UNITEDHEALTH GROUP INC	100,000.00	94,466.20	
UNITEDHEALTH GROUP INC	100,000.00	82,443.93	
UNITEDHEALTH GROUP INC	100,000.00	94,194.34	
UNIVERSAL HEALTH SVCS	50,000.00	40,056.80	
US BANCORP	140,000.00	134,523.73	
US BANCORP	150,000.00	138,423.27	
US BANCORP	50,000.00	50,506.99	
US BANCORP	100,000.00	88,100.66	
US BANCORP	50,000.00	47,677.90	
US BANCORP	150,000.00	154,804.17	
VALE OVERSEAS LIMITED	50,000.00	43,580.08	
VALERO ENERGY CORP	100,000.00	81,217.77	

VALERO ENERGY PARTNERS	30,000.00	28,875.72	
VENTAS REALTY LP	100,000.00	94,546.32	
VENTAS REALTY LP	100,000.00	78,814.87	
VERISIGN INC	50,000.00	40,325.94	
VERISK ANALYTICS INC	30,000.00	27,650.38	
VERIZON COMM INC	100,000.00	92,486.13	
VERIZON COMMUNICATIONS	200,000.00	178,698.58	
VERIZON COMMUNICATIONS	130,000.00	125,120.71	
VERIZON COMMUNICATIONS	100,000.00	86,374.74	
VERIZON COMMUNICATIONS	200,000.00	191,427.04	
VERIZON COMMUNICATIONS	100,000.00	77,320.61	
VERIZON COMMUNICATIONS	100,000.00	81,777.57	
VERIZON COMMUNICATIONS	100,000.00	78,696.22	
VF CORP	50,000.00	46,778.28	
VIATRIS INC	50,000.00	45,604.75	
VIATRIS INC	100,000.00	86,262.41	
VICI PROPERTIES LP	100,000.00	93,979.95	
VICI PROPERTIES LP	50,000.00	46,383.10	
VIRGINIA ELEC & POWER CO	50,000.00	47,289.22	
VIRGINIA ELEC & POWER CO	70,000.00	56,367.24	
VISA INC	100,000.00	95,328.03	
VISA INC	150,000.00	134,304.13	
VMWARE INC	100,000.00	96,516.40	
VMWARE INC	100,000.00	82,105.73	
VMWARE INC	50,000.00	47,113.83	
VODAFONE GROUP PLC	100,000.00	97,661.83	
VONTIER CORP	50,000.00	38,272.00	
VORNADO REALTY LP	50,000.00	42,810.93	
VULCAN MATERIALS	50,000.00	44,209.75	
WABTEC	30,000.00	28,832.27	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE	100,000.00	93,666.07	
WALMART INC	200,000.00	194,179.00	
WALMART INC	100,000.00	87,640.93	
WALMART INC	200,000.00	161,476.00	
WALT DISNEY COMPANY/THE	200,000.00	193,219.20	

WALT DISNEY COMPANY/THE	50,000.00	48,172.95	
WALT DISNEY COMPANY/THE	100,000.00	94,346.28	
WALT DISNEY COMPANY/THE	50,000.00	41,713.33	
WALT DISNEY COMPANY/THE	150,000.00	127,565.01	
WARNERMEDIA HOLDINGS INC	100,000.00	95,549.34	
WASTE CONNECTIONS INC	50,000.00	42,481.34	
WASTE CONNECTIONS INC	50,000.00	42,736.11	
WASTE MANAGEMENT INC	100,000.00	88,867.95	
WASTE MANAGEMENT INC	50,000.00	41,800.04	
WEC ENERGY GROUP INC	70,000.00	59,235.54	
WELLS FARGO	50,000.00	55,575.05	
WELLS FARGO & COMPANY	200,000.00	191,026.72	
WELLS FARGO & COMPANY	200,000.00	187,134.68	
WELLS FARGO & COMPANY	200,000.00	186,201.80	
WELLS FARGO & COMPANY	50,000.00	47,887.65	
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	97,608.05	
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	96,273.09	
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	92,640.13	
WELLS FARGO & COMPANY	300,000.00	277,938.09	
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	97,439.42	
WELLS FARGO & COMPANY	300,000.00	250,889.40	
WELLS FARGO & COMPANY	200,000.00	190,941.08	
WELLTOWER INC	100,000.00	96,563.17	
WELLTOWER INC	100,000.00	79,681.52	
WESTERN DIGITAL CORP	100,000.00	78,857.50	
WESTLAKE CORP	50,000.00	46,937.71	
WESTPAC BANKING CORP	100,000.00	96,644.23	
WESTPAC BANKING CORP	200,000.00	175,918.20	
WESTPAC BANKING CORP	100,000.00	101,385.31	
WESTPAC BANKING CORP	140,000.00	122,013.85	
WESTPAC BANKING CORP	100,000.00	93,056.31	
WESTPAC BANKING CORP	100,000.00	76,357.79	
WEYERHAEUSER CO	50,000.00	45,350.46	
WHIRLPOOL CORP	50,000.00	39,732.06	
WILLIAMS COMPANIES INC	100,000.00	96,306.70	

		WILLIAMS COMPANIES INC	50,000.00	46,890.96	
		WILLIAMS COMPANIES INC	50,000.00	43,746.12	
		WILLIAMS COMPANIES INC	50,000.00	40,672.70	
		WILLIS NORTH AMERICA INC	100,000.00	96,419.98	
		WILLIS NORTH AMERICA INC	30,000.00	25,598.76	
		WISCONSIN ELECTRIC POWER	50,000.00	48,663.29	
		WISCONSIN POWER & LIGHT	50,000.00	43,664.16	
		WORKDAY INC	100,000.00	91,071.80	
		WP CAREY INC	100,000.00	97,552.87	
		WRKCO INC	100,000.00	93,285.75	
		WRKCO INC	50,000.00	45,143.85	
		XCEL ENERGY INC	100,000.00	87,661.15	
		XILINX INC	100,000.00	84,319.21	
		XYLEM INC	30,000.00	25,694.06	
		ZIMMER BIOMET HOLDINGS	50,000.00	40,476.18	
		ZOETIS INC	80,000.00	73,719.20	
	小計	銘柄数：1,131 組入時価比率：98.2%	115,502,000.00	104,702,544.99 (14,253,157,449) 100.0%	
合計				14,253,157,449 (14,253,157,449)	

(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。

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

種類	2023年 3月 7日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	101,644,500	－	102,083,250	△438,750
米ドル	101,644,500	－	102,083,250	△438,750
合計	101,644,500	－	102,083,250	△438,750

（注）時価の算定方法

１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。

２ファンドの現況

純資産額計算書

ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　ブルームバーグ米国投資適格社債（１－１０年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信

2023年3月31日現在

Ⅰ　資産総額	26,389,018,987円
Ⅱ　負債総額	13,171,437,935円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,217,581,052円
Ⅳ　発行済口数	15,670,000口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	843.50円

（参考）米国投資適格社債１－１０年インデックスマザーファンド

2023年3月31日現在

Ⅰ　資産総額	14,561,514,987円
Ⅱ　負債総額	4円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,561,514,983円
Ⅳ　発行済口数	10,750,361,472口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3545円

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１委託会社等の概況

＜更新後＞

(1)資本金の額

2023年4月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数　　20,000,000株

発行済株式総数　　5,150,693株

過去５年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

＜更新後＞

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

当社は監査等委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表取締役および監査等委員会を設けております。各機関の権限は以下のとおりです。

株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また代表取締役等を選任し、取締役の職務の執行を監督します。

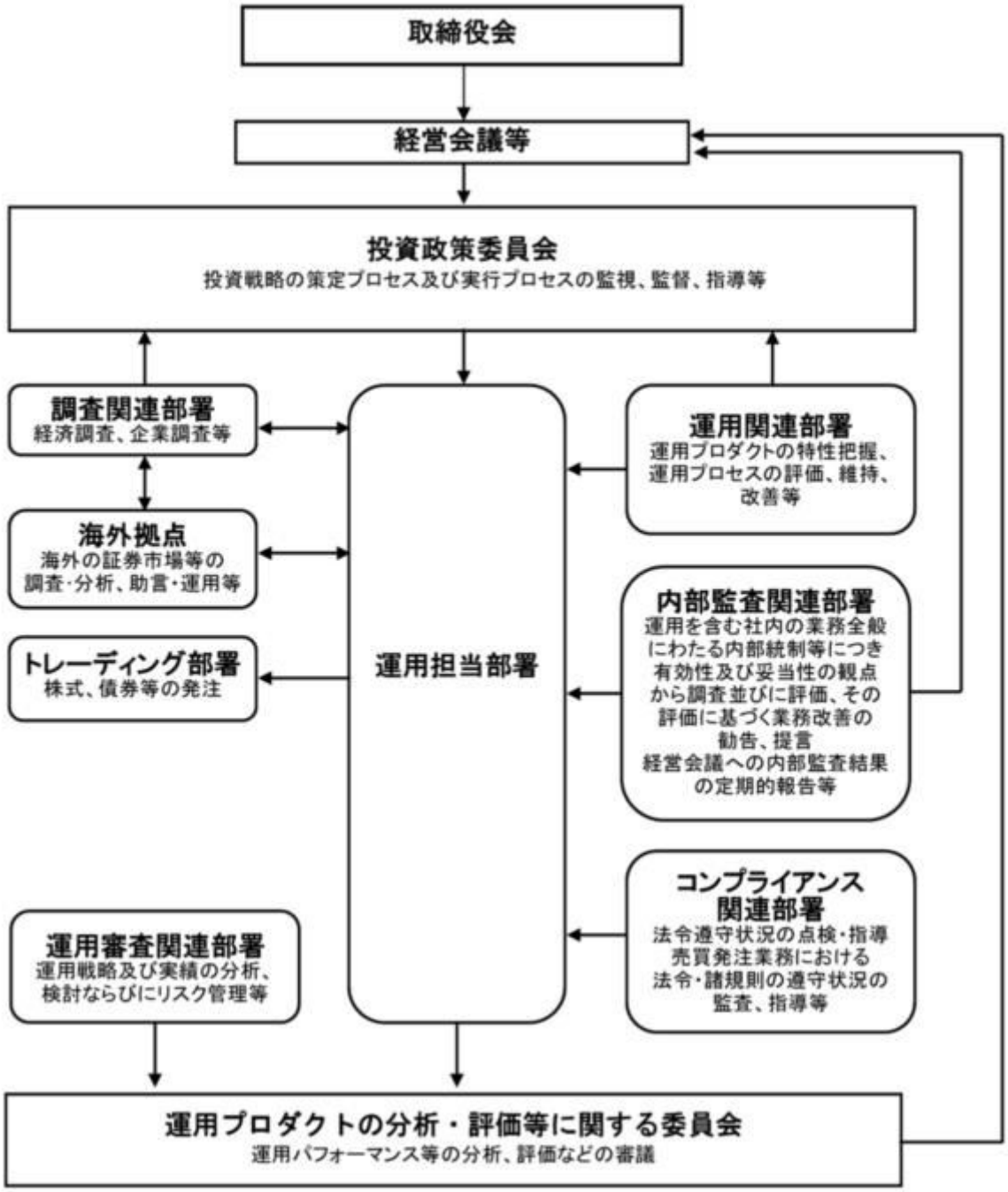
代表取締役・業務執行取締役

代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役員が含まれます。

監査等委員会

監査等委員である取締役３名以上（但し、過半数は社外取締役）で構成され、取締役の職務執行の適法性および妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容や監査等委員である取締役以外の取締役の選任・解任・辞任および報酬等についての監査等委員会としての意見を決定します。

(b)投資信託の運用体制



２事業の内容及び営業の概況

＜更新後＞

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は2023年3月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)。

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	997	39,994,963
単位型株式投資信託	195	823,331
追加型公社債投資信託	14	6,075,675
単位型公社債投資信託	476	1,061,590
合計	1,682	47,955,558

３委託会社等の経理状況

＜更新後＞

１．委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

２．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

３．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

（１）貸借対照表

		前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
区分	注記番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			4,281		2,006
金銭の信託			35,912		35,894
有価証券			30,400		29,300
前払金			-		11
前払費用			167		454
未収入金			632		694
未収委託者報酬			24,499		27,176
未収運用受託報酬			4,347		4,002
短期貸付金			-		1,835
その他			268		57

貸倒引当金			△14		△15
流動資産計			100,496		101,417
固定資産					
有形固定資産			2,666		1,744
建物	※２	1,935		1,219	
器具備品	※２	731		525	
無形固定資産			5,429		5,210
ソフトウェア		5,428		5,209	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,487		16,067
投資有価証券		1,767		2,201	
関係会社株式		9,942		9,214	
長期差入保証金		330		443	
長期前払費用		15		13	
前払年金費用		1,301		1,297	
繰延税金資産		3,008		2,784	
その他		122		112	
固定資産計			24,583		23,023
資産合計			125,080		124,440

		前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
区分	注記番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			123		120
未払金			16,948		17,615
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		8		17	
未払手数料		7,256		8,357	
関係会社未払金		8,671		8,149	
その他未払金		1,011		1,089	
未払費用	※１		9,171		9,512
未払法人税等			2,113		1,319
前受収益			22		22
賞与引当金			3,795		4,416
その他			-		121
流動負債計			32,175		33,127
固定負債					
退職給付引当金			3,299		3,194
時効後支払損引当金			580		588
資産除去債務			1,371		1,123
固定負債計			5,250		4,905
負債合計			37,425		38,033
(純資産の部)					
株主資本			87,596		86,232
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	

利益剰余金			56,686		55,322
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		56,001		54,637	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		31,395		30,030	
評価・換算差額等			57		174
その他有価証券評価差額金			57		174
純資産合計			87,654		86,407
負債・純資産合計			125,080		124,440

（２）損益計算書

		前事業年度 (自　2020年4月1日 至　2021年3月31日)		当事業年度 (自　2021年4月1日 至　2022年3月31日)	
区分	注記番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			106,355		115,733
運用受託報酬			16,583		17,671
その他営業収益			428		530
営業収益計			123,367		133,935
営業費用					
支払手数料			34,739		39,087
広告宣伝費			1,005		804
公告費			0		0
調査費			24,506		26,650
調査費		5,532		4,867	
委託調査費		18,974		21,783	
委託計算費			1,358		1,384
営業雑経費			4,149		3,094
通信費		73		72	
印刷費		976		918	
協会費		88		79	
諸経費		3,011		2,023	
営業費用計			65,760		71,021
一般管理費					
給料			10,985		12,033
役員報酬		147		229	
給料・手当		7,156		7,375	
賞与		3,682		4,427	
交際費			35		47
旅費交通費			64		65
租税公課			1,121		1,049
不動産賃借料			1,147		1,432
退職給付費用			1,267		1,212
固定資産減価償却費			2,700		2,525
諸経費			10,739		11,190
一般管理費計			28,063		29,556

営業利益			29,542		33,357

		前事業年度 (自　2020年4月1日 至　2021年3月31日)		当事業年度 (自　2021年4月1日 至　2022年3月31日)	
区分	注記番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	※１	4,540		3,530	
受取利息		0		10	
金銭の信託運用益		1,698		-	
その他		447		1,268	
営業外収益計			6,687		4,809
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,387	
時効後支払損引当金繰入額		13		12	
為替差損		26		23	
その他		32		266	
営業外費用計			72		1,689
経常利益			36,157		36,477
特別利益					
投資有価証券等売却益		71		26	
株式報酬受入益		48		53	
固定資産売却益		-		9	
資産除去債務履行差額		-		141	
移転補償金		2,077		-	
特別利益計			2,197		230
特別損失					
投資有価証券等売却損		-		0	
投資有価証券等評価損		36		-	
関係会社株式評価損		582		727	
固定資産除却損	※２	105		374	
資産除去債務履行差額		-		0	
事務所移転費用		406		54	
特別損失計			1,129		1,158
税引前当期純利益			37,225		35,549
法人税、住民税及び事業税			11,239		10,474
法人税等調整額			△290		171
当期純利益			26,276		24,904

（３）株主資本等変動計算書

前事業年度(自　2020年4月１日　至　2021年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本							
		資本剰余金			利益剰余金			株　主
						その他利益剰余金		

	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	資本合計
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
当期変動額									
剰余金の配当							△23,950	△23,950	△23,950
当期純利益							26,276	26,276	26,276
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	2,326	2,326	2,326
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	10	10	85,281
当期変動額			
剰余金の配当			△23,950
当期純利益			26,276
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	46	46	46
当期変動額合計	46	46	2,372
当期末残高	57	57	87,654

当事業年度(自　2021年4月1日　至　2022年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596
当期変動額									
剰余金の配当							△26,268	△26,268	△26,268
当期純利益							24,904	24,904	24,904

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	△1,364	△1,364	△1,364
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	57	57	87,654
当期変動額			
剰余金の配当			△26,268
当期純利益			24,904
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	116	116	116
当期変動額合計	116	116	△1,247
当期末残高	174	174	86,407

[重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの … 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの … 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4．外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6年 附属設備 6～15年 器具備品 4～15年

	(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
６．引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
７．収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。 ① 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年４回、もしくは年２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。 ② 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年４回、もしくは年２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。 ③ 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。
８．消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。

9．連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

［会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[会計方針の変更]

（収益認識に関する会計基準等の適用）
「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識しています。
これにより、営業外収益に計上しておりますシステム利用サービスに係る収益について、従来は、当該システム利用サービスに係るシステム関連費用を控除し、純額で認識しておりましたが、控除せず、総額で収益を認識する方法に変更しております。
収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の繰越利益剰余金に反映させ、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。
これによる財務諸表に与える影響は軽微であります。
なお、収益認識会計基準第89-３項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識に関する注記」については記載しておりません。

（時価の算定に関する会計基準の適用）
「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる財務諸表に与える影響はありません。
また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2019年7月4日）第７－４項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

［未適用の会計基準等]

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号　2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

・「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号　2021年8月12日　企業会計基準委員会）

（1）概要

2020年3月27日に成立した「所得税法等の一部を改正する法律」（令和２年法律第８号）において、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを明らかにすることを目的として企業基準委員会から公表されたものです。

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

[注記事項]

◇　貸借対照表関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022年3月31日)
※１．関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払費用　1,256百万円 ※２．有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物　346百万円 器具備品　643 合計　990	※１．関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払費用　1,223百万円 ※２．有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物　589百万円 器具備品　618 合計　1,207

◇　損益計算書関係

前事業年度 (自　2020年4月１日 至　2021年3月31日)	当事業年度 (自　2021年4月１日 至　2022年3月31日)
※１．関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　4,334百万円	※１．関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　3,525百万円
※２．固定資産除却損 建物　-百万円 器具備品　2 ソフトウェア　102 合計　105	※２．固定資産除却損 建物　346百万円 器具備品　28 ソフトウェア　- 合計　374

◇　株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自　2020年4月１日　至　2021年3月31日)

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	―	―	5,150,693株

２．剰余金の配当に関する事項

（１）配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	23,950百万円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	4,650円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月30日

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

当事業年度(自　2021年4月１日　至　2022年3月31日)

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	―	―	5,150,693株

２．剰余金の配当に関する事項

（１）配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2022年5月18日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,877百万円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	4,830円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月30日

◇　金融商品関係

前事業年度（自 2020年4月１日　至 2021年3月31日）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとん

どないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

２．金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	4,281	4,281	-
(2)金銭の信託	35,912	35,912	-
(3)未収委託者報酬	24,499	24,499	-
(4)未収運用受託報酬	4,347	4,347	-
(5)有価証券及び投資有価証券	30,400	30,400	-
その他有価証券	30,400	30,400	-
資産計	99,441	99,441	-
(6)未払金	16,948	16,948	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	8	8	-
未払手数料	7,256	7,256	-
関係会社未払金	8,671	8,671	-
その他未払金	1,011	1,011	-
(7)未払費用	9,171	9,171	-
(8)未払法人税等	2,113	2,113	-
負債計	28,233	28,233	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引

先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,767百万円、関係会社株式9,942百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について618百万円（投資有価証券35百万円、関係会社株式582百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	4,281	-	-	-
金銭の信託	35,912	-	-	-
未収委託者報酬	24,499	-	-	-
未収運用受託報酬	4,347	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	30,400	-	-	-
合計	99,441	-	-	-

当事業年度（自 2021年4月１日　至 2022年3月31日）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的と

して、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバディブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

２．金融商品の時価等に関する事項

2022年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	35,894	35,894	-
資産計	35,894	35,894	-
(2)その他（デリバティブ取引）	121	121	-
負債計	121	121	-

（注）1　現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、有価証券、短期貸付金、未払金、未払費用、未払法人税等は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注）2　投資有価証券及び関係会社株式は、市場価格のない株式等及び組合出資金等であることから、上表には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

	当事業年度（百万円）
市場価格のない株式等（※）1．2	9,529
組合出資金等	1,886
合計	11,415

（※）1　市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。
　　2　非上場株式等について、当事業年度において727百万円減損処理を行っております。

（注）3　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	2,006	-	-	-
金銭の信託	35,894	-	-	-
未収委託者報酬	27,176	-	-	-
未収運用受託報酬	4,002	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	29,300	-	-	-
短期貸付金	1,835			
合計	100,215	-	-	-

３．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。
レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価
レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価
レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

区分	貸借対照表計上額　（単位：百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他）（※）	-	1,736	-	1,736
資産計	-	1,736	-	1,736
デリバティブ取引（通貨関連）	-	121	-	121
負債計	-	121	-	121

（※）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、投資信託を主要な構成物とする金銭の信託34,157百万円は表中に含まれておりません。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

<u>金銭の信託</u>
信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。
信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

デリバティブ取引

時価の算定方法は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算出しており、レベル２の時価に分類しております。

◇　有価証券関係

前事業年度　（自　2020年4月１日　至　2021年3月31日）

１．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

２．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

３．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額

区分	前事業年度 （百万円）
子会社株式	9,835
関連会社株式	106

４．その他有価証券(2021年3月31日)

区分	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	30,400	30,400	-
小計	30,400	30,400	-
合計	30,400	30,400	-

※非上場株式（貸借対照表計上額312百万円）及び投資事業有限責任組合への出資金（貸借対照表計上額1,455百万円）は、記載しておりません。

５．事業年度中に売却したその他有価証券（自　2020年4月１日　至　2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度　（自　2021年4月１日　至　2022年3月31日）

１．売買目的有価証券(2022年3月31日)

該当事項はありません。

２．満期保有目的の債券(2022年3月31日)

該当事項はありません。

３．子会社株式及び関連会社株式(2022年3月31日)

市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

区分	当事業年度 （百万円）
子会社株式	9,107
関連会社株式	106

４．その他有価証券(2022年3月31日)

区分	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	29,300	29,300	-
小計	29,300	29,300	-
合計	29,300	29,300	-

※市場価格のない株式等（貸借対照表計上額315百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,886百万円）は、記載しておりません。

５．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

◇　デリバティブ取引関係

１．　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度　（自 2020年4月１日　至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度　（自 2021年4月１日　至 2022年3月31日）

区分	取引の種類	契約額等 （百万円）	契約額等のうち一年超 （百万円）	時価 （百万円）	評価損益 （百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,714	-	△121	△121

◇　退職給付関係

前事業年度(自　2020年4月１日　至　2021年3月31日)

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	△893
退職給付の支払額	△781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,413 百万円
期待運用収益	409
数理計算上の差異の発生額	1,328
事業主からの拠出額	824
退職給付の支払額	△626
年金資産の期末残高	19,349

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	19,959百万円
年金資産	△19,349
	610
非積立型制度の退職給付債務	3,311
未積立退職給付債務	3,921
未認識数理計算上の差異	△2,074
未認識過去勤務費用	151
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
退職給付引当金	3,299
前払年金費用	△1,301
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,016 百万円
利息費用	139
期待運用収益	△409
数理計算上の差異の費用処理額	469
過去勤務費用の費用処理額	△34
確定給付制度に係る退職給付費用	1,182

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	52%
株式	30%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

②長期期待運用収益率の設定方法
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.8%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

当事業年度(自　2021年4月1日　至　2022年3月31日)

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,270 百万円
勤務費用	961
利息費用	176
数理計算上の差異の発生額	△1,521
退職給付の支払額	△904
その他	△14
退職給付債務の期末残高	21,967

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	19,349 百万円
期待運用収益	454
数理計算上の差異の発生額	△258
事業主からの拠出額	814
退職給付の支払額	△672
年金資産の期末残高	19,687

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	18,807 百万円
年金資産	△19,687
	△879
非積立型制度の退職給付債務	3,159
未積立退職給付債務	2,279
未認識数理計算上の差異	△489
未認識過去勤務費用	106
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896
退職給付引当金	3,194
前払年金費用	△1,297
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	961 百万円
利息費用	176
期待運用収益	△454
数理計算上の差異の費用処理額	322
過去勤務費用の費用処理額	△45
確定給付制度に係る退職給付費用	959

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	51%
株式	32%
生保一般勘定	10%
生保特別勘定	6%
その他	1%
合計	100%

②長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

◇　税効果会計関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022年3月31日)

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,176
退職給付引当金	1,022
関係会社株式評価減	784
未払事業税	430
投資有価証券評価減	428
減価償却超過額	223
時効後支払損引当金	179
関係会社株式売却損	148
ゴルフ会員権評価減	135
資産除去債務	425
未払社会保険料	95
その他	358
繰延税金資産小計	5,410
評価性引当額	△1,530
繰延税金資産合計	3,879
繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	△361
関係会社株式評価益	△80
その他有価証券評価差額金	△25
前払年金費用	△403
繰延税金負債合計	△871
繰延税金資産の純額	3,008

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率	31.0%
(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△3.5%
タックスヘイブン税制	1.9%
外国税額控除	△0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%
その他	0.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,381
退職給付引当金	990
関係会社株式評価減	1,010
未払事業税	285
投資有価証券評価減	110
減価償却超過額	272
時効後支払損引当金	182
関係会社株式売却損	505
ゴルフ会員権評価減	92
資産除去債務	348
未払社会保険料	114
その他	84
繰延税金資産小計	5,376
評価性引当額	△1,795
繰延税金資産合計	3,581
繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	△233
関係会社株式評価益	△81
その他有価証券評価差額金	△78
前払年金費用	△402
繰延税金負債合計	△796
繰延税金資産の純額	2,784

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率	31.0%
(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△2.9%
タックスヘイブン税制	1.8%
外国税額控除	△0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.4%
その他	0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.9%

◇　資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該不動産賃貸借契約期間とし、割引率は0.0%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：百万円）

	前事業年度 自　2020年4月 1日 至　2021年3月31日	当事業年度 自　2021年4月 1日 至　2022年3月31日
期首残高	-	1,371
有形固定資産の取得に伴う増加	1,371	48
資産除去債務の履行による減少	-	△296
期末残高	1,371	1,123

◇　収益認識に関する注記

１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報
当事業年度（自　2021年4月 1日　至　2022年3月31日）

委託者報酬	115,670百万円
運用受託報酬	16,675百万円
成功報酬（注）	1,058百万円
その他営業収益	530百万円
合計	133,935百万円

（注）成功報酬は、損益計算書において委託者報酬または運用受託報酬に含めて表示しております。

２．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
[重要な会計方針] 7．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

３．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

◇　セグメント情報等

前事業年度(自　2020年4月１日　至　2021年3月31日)

１．セグメント情報
当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報
（１）製品・サービスごとの情報
当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

（２）地域ごとの情報
① 売上高
本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。
② 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

（３）主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

当事業年度(自　2021年4月１日　至　2022年3月31日)

１．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報

（１）製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

（２）地域ごとの情報

① 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

② 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

（３）主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

◇　関連当事者情報

前事業年度(自　2020年4月１日　至　2021年3月31日)

１．関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

（イ）子会社等

該当はありません。

（ウ）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)

親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000(百万円)	証券業	―	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1）	26,722	未払手数料	5,690
							コマーシャル・ペーパーの償還(*2)	20,000	有価証券	-
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1．上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2．取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1） 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。
(*2） コマーシャル･ペーパーの購入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自　2021年4月１日　至　2022年3月31日)

1．関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

（イ）子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	ノムラ･エーエム・ファイナンス・インク	ケイマン	2,500(米ドル)	資金管理	直接100%	資産の賃貸借	資金の貸付	3,427	短期貸付金	1,835
							資金の返済	1,709		
							貸付金利息の受取	9	未収利息	4

（ウ）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000(百万円)	証券業	－	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1）	29,119	未払手数料	6,013

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1．上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2．取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1） 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

◇　1株当たり情報

前事業年度 (自　2020年4月1日 至　2021年3月31日)	当事業年度 (自　2021年4月1日 至　2022年3月31日)
1株当たり純資産額　17,018円01銭 1株当たり当期純利益　5,101円61銭	1株当たり純資産額　16,775円81銭 1株当たり当期純利益　4,835円10銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益　26,276百万円 普通株式に係る当期純利益　26,276百万円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数　5,150,693株	潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益　24,904百万円 普通株式に係る当期純利益　24,904百万円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数　5,150,693株

中間財務諸表

◇中間貸借対照表

		2022年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		1,959
金銭の信託		40,970
有価証券		8,000
未収委託者報酬		27,052
未収運用受託報酬		4,915
短期貸付金		1,448
その他		923
貸倒引当金		△16
流動資産計		85,253
固定資産		
有形固定資産	※1	1,534
無形固定資産		5,483
ソフトウェア		5,482
その他		0
投資その他の資産		15,974
投資有価証券		2,133
関係会社株式		10,025
長期差入保証金		519
前払年金費用		1,433
繰延税金資産		1,758
その他		104
固定資産計		22,993
資産合計		108,246

		2022年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払金		12,363
未払収益分配金		0
未払償還金		11
未払手数料		8,301
関係会社未払金		3,205
その他未払金	※2	842
未払費用		9,504
未払法人税等		1,213
賞与引当金		2,096
その他		226
流動負債計		25,405
固定負債		
退職給付引当金		3,045
時効後支払損引当金		595
資産除去債務		1,123
固定負債計		4,763
負債合計		30,169
(純資産の部)		
株主資本		77,770
資本金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		46,860
利益準備金		685
その他利益剰余金		46,175
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		21,568
評価・換算差額等		307

その他有価証券評価差額金		307
純資産合計		78,077
負債・純資産合計		108,246

◇中間損益計算書

		自　2022年4月 1日 至　2022年9月30日
区分	注記番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		57,740
運用受託報酬		9,162
その他営業収益		181
営業収益計		67,085
営業費用		
支払手数料		19,423
調査費		14,540
その他営業費用		2,613
営業費用計		36,577
一般管理費	※１	14,575
営業利益		15,931
営業外収益	※２	7,366
営業外費用	※３	1,574
経常利益		21,723
特別利益	※４	30
特別損失	※５	49
税引前中間純利益		21,705
法人税、住民税及び事業税		4,322
法人税等調整額		966
中間純利益		16,415

◇中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自　2022年4月1日　至　2022年9月30日)

（単位：百万円）

	株主資本							
		資本剰余金			利益剰余金			株　主
						その他利益剰余金		

	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	資本合計
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232
当中間期変動額									
剰余金の配当							△24,877	△24,877	△24,877
中間純利益							16,415	16,415	16,415
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	－	－	－	－	－	－	△8,461	△8,461	△8,461
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	21,568	46,860	77,770

（単位：百万円）

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	174	174	86,407
当中間期変動額			
剰余金の配当			△24,877
中間純利益			16,415
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	132	132	132
当中間期変動額合計	132	132	△8,329
当中間期末残高	307	307	78,077

[重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの … 時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。） 市場価格のない株式等 … 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4．外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

５．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物　6年 附属設備　6～15年 器具備品　4～15年 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。	
６．引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。	

７．収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。 ①　委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年４回、もしくは年２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。 ②　運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年４回、もしくは年２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。 ③　成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。
８．消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。

[会計方針の変更]

（時価の算定に関する会計基準の適用）
「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27－２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。
これによる中間財務諸表に与える影響はありません。

[追加情報]

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号　2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。
また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

[注記事項]

◇中間貸借対照表関係

2022年9月30日現在
※１　有形固定資産の減価償却累計額 1,577百万円

※２　消費税等の取扱い
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

◇中間損益計算書関係

自　2022年4月 1日
至　2022年9月30日

※１　減価償却実施額

有形固定資産	210百万円
無形固定資産	992百万円

※２　営業外収益のうち主要なもの

受取配当金	6,933百万円

※３　営業外費用のうち主要なもの

金銭の信託運用損	1,439百万円
時効後支払損引当金繰入	7百万円

※４　特別利益の内訳

投資有価証券等売却益	10百万円
株式報酬受入益	19百万円

※５　特別損失の内訳

投資有価証券等売却損	16百万円
固定資産除却損	33百万円

◇中間株主資本等変動計算書関係

自　2022年4月 1日
至　2022年9月30日

１　発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式	5,150,693株	―	―	5,150,693株

２　配当に関する事項
配当金支払額
2022年5月18日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。
・普通株式の配当に関する事項

(1) 配当金の総額	24,877百万円
(2) 1株当たり配当額	4,830円
(3) 基準日	2022年3月31日
(4) 効力発生日	2022年6月30日

◇金融商品関係

１．金融商品の時価等に関する事項

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	40,970	40,970	-

資産計	40,970	40,970	-
(2)その他（デリバティブ取引）	74	74	-
負債計	74	74	-

（注１）　現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、有価証券、短期貸付金、未払金、未払費用、未払法人税等は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注２）　投資有価証券及び関係会社株式は、市場価格のない株式等及び組合出資金等であることから、上表には含まれておりません。当該金融商品の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）
市場価格のない株式等（※）	10,260
組合出資金等	1,898
合計	12,159

（※）市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。

２．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	中間貸借対照表計上額　(単位：百万円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他）	-	40,970	-	40,970
資産計	-	40,970	-	40,970
デリバティブ取引（通貨関連）	-	74	-	74
負債計	-	74	-	74

（注）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。構成物のレベルに基づき、レベル２の時価に分類しております。

デリバティブ取引

時価の算定方法は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算出しており、レベル２の時価に分類しております。

◇有価証券関係

当中間会計期間末　(2022年9月30日)

１．売買目的有価証券(2022年9月30日)

該当事項はありません。

２．満期保有目的の債券(2022年9月30日)

該当事項はありません。

３．子会社株式及び関連会社株式(2022年9月30日)

市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額

区分	中間貸借対照表計上額（百万円）
子会社株式	9,919
関連会社株式	106

４．その他有価証券(2022年9月30日)

区分	中間貸借対照表計上額(百万円)	取得原価(百万円)	差額(百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	8,000	8,000	-
小計	8,000	8,000	-
合計	8,000	8,000	-

◇デリバティブ取引関係

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

当中間会計期間　(2022年9月30日)

区分	取引の種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち一年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,371	-	△74	△74

◇資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減　(単位：百万円)

	自　2022年4月 1日 至　2022年9月30日
期首残高	1,123
有形固定資産の取得に伴う増加	-
時の経過による調整額	-
中間期末残高	1,123

◇収益認識に関する注記

１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

区分	当中間会計期間 （自　2022年4月 1日 至　2022年9月30日）
委託者報酬	57,740百万円
運用受託報酬	8,912百万円
成功報酬（注）	250百万円
その他営業収益	181百万円
合計	67,085百万円

（注）成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬または運用受託報酬に含めて表示しております。

２．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 7．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

３．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

◇セグメント情報等

当中間会計期間(自　2022年4月1日　至　2022年9月30日)

１．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

② 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

◇１株当たり情報

自　2022年4月 1日 至　2022年9月30日

１株当たり純資産額　　15,158円67銭

１株当たり中間純利益　　3,187円11銭

(注) １.潜在株式調整後１株当たり中間純利益につきましては、潜在株式がないため、記載しておりません。
２.１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

中間純利益	16,415百万円
普通株主に帰属しない金額	―
普通株式に係る中間純利益	16,415百万円
期中平均株式数	5,150千株

第２【その他の関係法人の概況】

１名称、資本金の額及び事業の内容

＜更新後＞

(1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額*	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

＊　2023年3月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額*	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,500百万円	
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	
バークレイズ証券株式会社	38,945百万円	
ＢＮＰパリバ証券株式会社	102,025百万円	
ＢｏｆＡ証券株式会社	83,140百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	

＊　2023年3月末現在

２関係業務の概要

＜更新後＞

(1) 受託者

ファンドの受託会社（受託者）として、信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行ないます。

(2) 販売会社

ファンドの販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、信託契約の一部解約に関する事務、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務、一部解約金の支払いに関する事務ならびに償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

３資本関係

＜訂正前＞

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1)受託者

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

＜訂正後＞

(2022年9月末現在の持株比率5.0%以上を記載します。)

(1)_受託者

該当事項はありません。

(2)_販売会社

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

２０２３年5月１６日

野村アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会　御　　中

EY新日本有限責任監査法人

東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　根　津　昌　史

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているNEXT FUNDS ブルームバーグ米国投資適格社債（1-10年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信の２０２２年９月８日から２０２３年３月７日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、NEXT FUNDS ブルームバーグ米国投資適格社債（1-10年）インデックス（為替ヘッジあり）連動型上場投信の２０２３年３月７日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　　上

（注）1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

次へ

独立監査人の監査報告書

２０２２年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯　原	尚
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津　村	健二郎
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	水　永	真太郎

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の２０２１年４月１日から２０２２年3月３１日までの第６３期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の２０２２年3月３１日現在の財政状態及びに同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　　上

（注）　１．上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

２０２２年１１月２４日

野村アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯　原　　尚
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	水　永　真太郎

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の２０２２年４月１日から２０２３年３月３１日までの第６４期事業年度の中間会計期間（２０２２年４月１日から２０２２年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の２０２２年９月３０日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（２０２２年４月１日から２０２２年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財

務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　　上

(注)　1．上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。