

【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】	2024年5月29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】	C E O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】	N E X T F U N D S 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、2023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（2023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（2024年5月29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(2024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

野村証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%

3 投資リスク

< 更新後 >

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

パフォーマンスの考査

投資信託の信託財産についてパフォーマンスに基づいた定期的な考査（分析、評価）の結果の報告、審議を行ないます。

運用リスクの管理

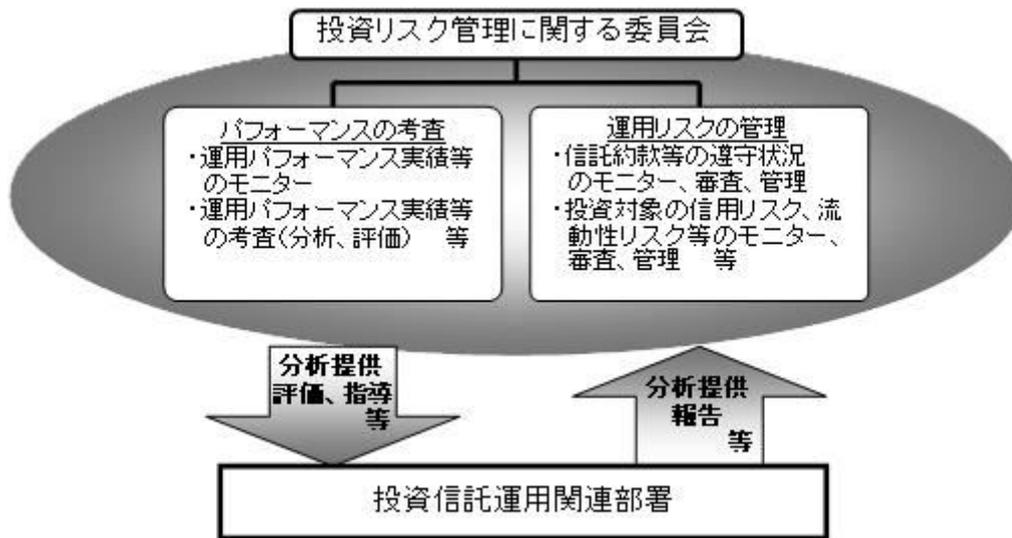
投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行なうことにより、適切な管理を行ないます。

流動性リスク管理について

流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。リスク管理関連の委員会が、流

動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について監督します。

リスク管理体制図

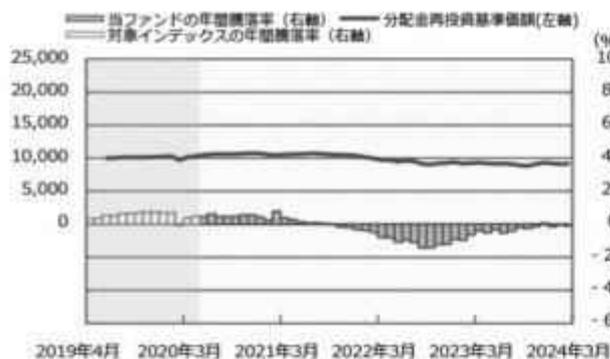


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

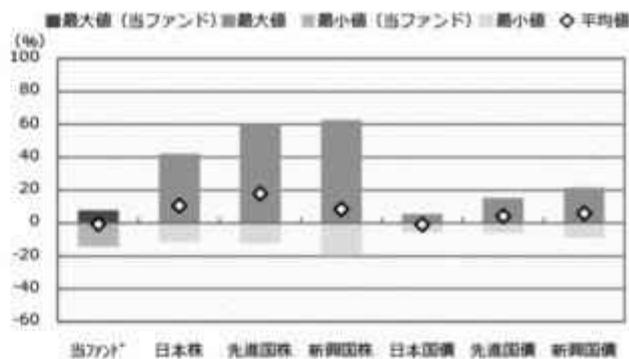
< 更新後 >

■ リスクの定量的比較 (2019年4月末～2024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	15.3	21.5
最小値 (%)	△14.3	△11.4	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値 (%)	△0.7	10.7	17.9	8.4	△0.8	4.3	5.9

- * 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、2019年4月から2024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。
- * 2019年4月から2024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・マーケット・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）・・・配当込みTOPIX（「東証株価指数【TOPIX】（配当込み）」といいます。）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標準又は商標は、株式会社J P X 総研又は株式会社J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）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）に係る標準又は商標に関するすべての権利はJ P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の錯誤、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X 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J P X 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、知的財産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・マーケット・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・マーケット・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メーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格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も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、JP Morgan 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イ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、または買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「JPMS LLC」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）についての奨励、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関連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。JPMS LLCはNASDAQ、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（2024年5月29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(2024年5月29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、2024年5月29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>

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(2024年5月29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(2024年5月29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%)。

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。

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。

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。

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(2024年5月29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(2024年5月29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。

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(2024年5月29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、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>

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です。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> ・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 <ul style="list-style-type: none"> ・譲渡益 ・譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・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、一定の額を上限として、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無期限で非課税となります。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し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、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。

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。

上記は2024年3月末現在の情報に基づくものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更される場合があります。

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。

以下は2024年3月29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	15,699,065,586	100.98
現金・預金・その他資産（負債控除後）		152,937,557	0.98
合計（純資産総額）		15,546,128,029	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	16,458,890,262	97.05
現金・預金・その他資産（負債控除後）		499,592,192	2.94
合計（純資産総額）		16,958,482,454	100.00

(2) 投資資産

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	9,702,759,942	1.5886	15,414,683,523	1.6180	15,699,065,586	100.98

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	100.98
合計	100.98

(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	WELLS FARGO & COMPANY	400,000	15,322.88	61,291,526	15,325.13	61,300,556	5.574	2029/7/25	0.36
2	アメリカ	社債券	ABBVIE INC	350,000	14,326.06	50,141,234	14,422.82	50,479,896	2.95	2026/11/21	0.29
3	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	300,000	14,632.37	43,897,131	14,785.69	44,357,077	3.96	2027/1/29	0.26
4	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	300,000	14,530.10	43,590,300	14,629.06	43,887,194	3.625	2027/1/20	0.25
5	アメリカ	社債券	WARNERMEDIA HOLDINGS INC	300,000	14,294.66	42,883,994	14,453.53	43,360,619	3.755	2027/3/15	0.25
6	アメリカ	社債券	WELLS FARGO & COMPANY	300,000	14,122.88	42,368,654	14,415.62	43,246,879	3.526	2028/3/24	0.25
7	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	300,000	13,512.11	40,536,331	14,071.07	42,213,216	1.093	2026/12/9	0.24
8	アメリカ	社債券	JP MORGAN CHASE & CO	300,000	13,654.14	40,962,430	14,040.08	42,120,244	1.578	2027/4/22	0.24
9	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	300,000	13,009.98	39,029,953	13,384.19	40,152,578	2.087	2029/6/14	0.23

10	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	300,000	12,780.28	38,340,855	13,048.56	39,145,696	2.496	2031/2/13	0.23
11	アメリカ	社債券	US BANCORP	250,000	15,305.88	38,264,705	15,443.44	38,608,619	5.85	2033/10/21	0.22
12	アメリカ	社債券	CITIBANK NA	250,000	15,330.26	38,325,657	15,306.76	38,266,917	5.488	2026/12/4	0.22
13	アメリカ	社債券	WELLS FARGO BANK NA	250,000	15,318.60	38,296,509	15,246.83	38,117,081	5.45	2026/8/7	0.22
14	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA NA	250,000	15,157.04	37,892,623	15,237.67	38,094,188	5.65	2025/8/18	0.22
15	アメリカ	社債券	AMAZON.COM INC	250,000	15,275.49	38,188,725	15,087.11	37,717,791	4.6	2025/12/1	0.22
16	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY BANK NA	250,000	14,917.67	37,294,176	15,045.84	37,614,623	4.754	2026/4/21	0.22
17	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	300,000	12,200.63	36,601,895	12,425.06	37,275,208	2.383	2032/7/21	0.21
18	アメリカ	社債券	GENERAL MOTORS FINL CO	250,000	14,702.10	36,755,269	14,870.17	37,175,447	3.8	2025/4/7	0.21
19	アメリカ	社債券	UBS GROUP AG	250,000	14,096.57	35,241,435	14,860.03	37,150,082	3.75	2025/3/26	0.21
20	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	250,000	14,538.45	36,346,125	14,668.32	36,670,809	4.431	2030/1/23	0.21
21	アメリカ	社債券	GSK CONSUMER HEALTHCARE	250,000	14,365.95	35,914,876	14,494.67	36,236,690	3.375	2027/3/24	0.21
22	アメリカ	社債券	NATIONAL AUSTRALIA BK/NY	250,000	14,308.39	35,770,991	14,348.84	35,872,118	2.5	2026/7/12	0.21
23	アメリカ	社債券	JP MORGAN CHASE & CO	240,000	14,570.05	34,968,136	14,602.26	35,045,431	4.203	2029/7/23	0.20
24	アメリカ	社債券	AMERICAN EXPRESS CO	250,000	13,678.01	34,195,036	13,885.39	34,713,494	1.65	2026/11/4	0.20
25	アメリカ	社債券	HSBC HOLDINGS PLC	200,000	16,516.10	33,032,212	17,350.49	34,700,980	8.113	2033/11/3	0.20
26	アメリカ	社債券	CREDIT SUISSE NEW YORK	250,000	13,096.51	32,741,277	13,797.95	34,494,880	1.25	2026/8/7	0.20
27	アメリカ	社債券	PNC BANK NA	250,000	13,016.17	32,540,442	13,154.68	32,886,724	2.7	2029/10/22	0.19
28	アメリカ	社債券	BARCLAYS PLC	200,000	15,713.17	31,426,357	16,152.59	32,305,186	7.119	2034/6/27	0.19
29	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000	15,226.09	30,452,185	16,152.47	32,304,941	7.35	2030/3/6	0.19
30	アメリカ	社債券	HSBC HOLDINGS PLC	200,000	16,269.50	32,539,008	16,115.25	32,230,504	7.39	2028/11/3	0.19

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	97.05
合計	97.05

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。

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

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

2024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
第8特定期間	(2023年 9月 7日)	14,582	14,696	807.8900	814.1900	811.2
第9特定期間	(2024年 3月 7日)	15,316	15,441	808.2500	814.8500	808.8
	2023年 3月末日	13,217		843.5000		845
	4月末日	13,318		846.6700		848.5
	5月末日	13,199		837.5200		837.6
	6月末日	13,492		824.2400		826.1
	7月末日	14,096		826.2700		828.2
	8月末日	14,281		820.7500		827
	9月末日	14,506		799.7100		800.2
	10月末日	14,438		789.8300		791.7
	11月末日	14,986		814.9100		813.3
	12月末日	15,323		824.7500		825
	2024年 1月末日	15,299		819.5000		822.4
	2月末日	15,362		810.6900		811
	3月末日	15,546		807.5900		808.8

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。

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
第8特定期間	2023年 3月 8日～2023年 9月 7日	12.8000円
第9特定期間	2023年 9月 8日～2024年 3月 7日	13.0000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。

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%
第8特定期間	2023年 3月 8日～2023年 9月 7日	1.5%
第9特定期間	2023年 9月 8日～2024年 3月 7日	1.7%

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
第8特定期間	2023年 3月 8日～2023年 9月 7日	2,410,000		18,050,000
第9特定期間	2023年 9月 8日～2024年 3月 7日	1,000,000	100,000	18,950,000

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

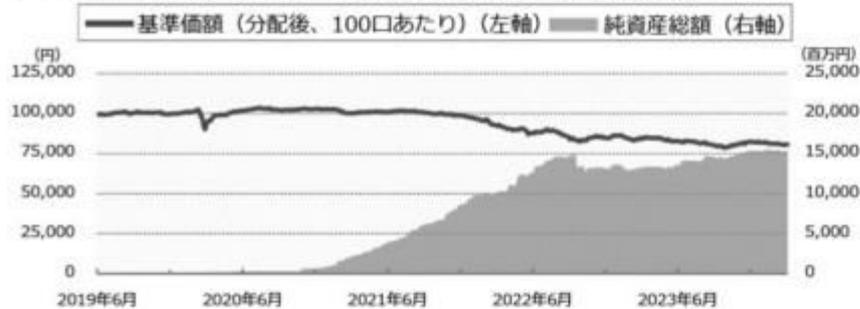
参考情報

< 更新後 >



運用実績（2024年3月29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）

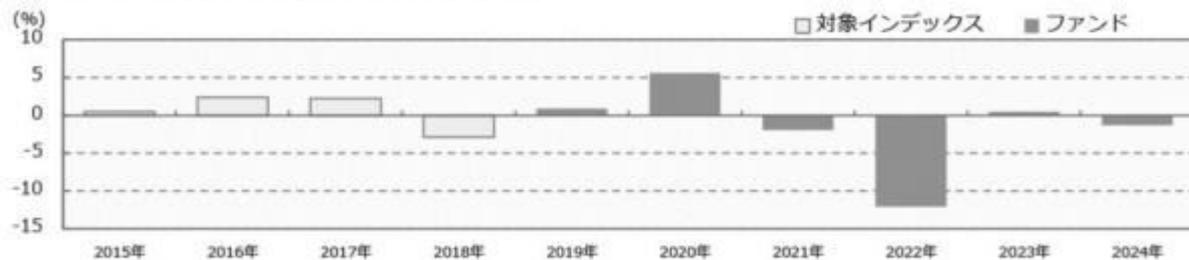
2024年3月	660 円
2023年12月	640 円
2023年9月	630 円
2023年6月	650 円
2023年3月	610 円
設定来累計	11,210 円

■ 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	WELLS FARGO & COMPANY	社債券	0.4
2	ABBVIE INC	社債券	0.3
3	JPMORGAN CHASE & CO	社債券	0.3
4	MORGAN STANLEY	社債券	0.3
5	WARNERMEDIA HOLDINGS INC	社債券	0.3
6	WELLS FARGO & COMPANY	社債券	0.3
7	GOLDMAN SACHS GROUP INC	社債券	0.2
8	JP MORGAN CHASE & CO	社債券	0.2
9	BANK OF AMERICA CORP	社債券	0.2
10	BANK OF AMERICA 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。
- ・2015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。
- ・2024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(2023年9月8日から2024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

	前期 (2023年 9月 7日現在)	当期 (2024年 3月 7日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	58,526,252	17,192,689
親投資信託受益証券	14,827,273,783	15,172,183,523
派生商品評価勘定	-	127,827,160
未収入金	80,000,000	136,621,513
流動資産合計	14,965,800,035	15,453,824,885
資産合計	14,965,800,035	15,453,824,885
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	257,291,392	-
未払金	1,153,450	130,690
未払収益分配金	113,715,000	125,070,000
未払受託者報酬	771,796	838,190
未払委託者報酬	9,647,463	10,477,385
未払利息	110	5
その他未払費用	829,718	878,049
流動負債合計	383,408,929	137,394,319
負債合計	383,408,929	137,394,319
純資産の部		
元本等		
元本	18,050,000,000	18,950,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,467,608,894	3,633,569,434
(分配準備積立金)	93,984	1,138,239
元本等合計	14,582,391,106	15,316,430,566
純資産合計	14,582,391,106	15,316,430,566
負債純資産合計	14,965,800,035	15,453,824,885

(2) 損益及び剰余金計算書

	前期 自 2023年 3月 8日 至 2023年 9月 7日	当期 自 2023年 9月 8日 至 2024年 3月 7日
(単位:円)		
営業収益		
受取利息	5	-
有価証券売買等損益	1,367,161,648	877,309,740
為替差損益	1,566,411,487	607,094,378
営業収益合計	199,249,834	270,215,362
営業費用		

	前期	当期
	自 2023年 3月 8日 至 2023年 9月 7日	自 2023年 9月 8日 至 2024年 3月 7日
支払利息	11,952	8,621
受託者報酬	1,506,726	1,639,630
委託者報酬	18,834,041	20,495,400
その他費用	2,180,826	2,560,351
営業費用合計	22,533,545	24,704,002
営業利益又は営業損失（ ）	221,783,379	245,511,360
経常利益又は経常損失（ ）	221,783,379	245,511,360
当期純利益又は当期純損失（ ）	221,783,379	245,511,360
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（ ）	2,611,175,915	3,467,608,894
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	17,960,000
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	17,960,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	417,584,600	185,449,900
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	417,584,600	185,449,900
分配金	217,065,000	243,982,000
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,467,608,894	3,633,569,434

(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、2023年 9月 8日から2024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 2023年 9月 7日現在	当期 2024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 18,050,000口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 18,950,000口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 3,467,608,894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 3,633,569,434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 807.89円 (100口当たり純資産額) (80,789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 808.25円 (100口当たり純資産額) (80,825円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2023年 3月 8日 至 2023年 9月 7日	当期 自 2023年 9月 8日 至 2024年 3月 7日																																																
1. 分配金の計算過程 2023年 3月 8日から2023年 6月 7日まで	1. 分配金の計算過程 2023年 9月 8日から2023年12月 7日まで																																																
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>3,936円</td> </tr> <tr> <td>親ファンドの配当等収益額</td> <td>B</td> <td>113,990,610円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>C</td> <td>600,744円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>114,587,418円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>11,011,349円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>103,576,069円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>103,350,000円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	3,936円	親ファンドの配当等収益額	B	113,990,610円	分配準備積立金	C	600,744円	配当等収益合計額	D=A+B+C	114,587,418円	経費	E	11,011,349円	収益分配可能額	F=D-E	103,576,069円	収益分配金	G	103,350,000円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>6,260円</td> </tr> <tr> <td>親ファンドの配当等収益額</td> <td>B</td> <td>131,044,740円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>C</td> <td>93,984円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>131,132,464円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>11,942,656円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>119,189,808円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>118,912,000円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	6,260円	親ファンドの配当等収益額	B	131,044,740円	分配準備積立金	C	93,984円	配当等収益合計額	D=A+B+C	131,132,464円	経費	E	11,942,656円	収益分配可能額	F=D-E	119,189,808円	収益分配金	G	118,912,000円
項目																																																	
当期配当等収益額	A	3,936円																																															
親ファンドの配当等収益額	B	113,990,610円																																															
分配準備積立金	C	600,744円																																															
配当等収益合計額	D=A+B+C	114,587,418円																																															
経費	E	11,011,349円																																															
収益分配可能額	F=D-E	103,576,069円																																															
収益分配金	G	103,350,000円																																															
項目																																																	
当期配当等収益額	A	6,260円																																															
親ファンドの配当等収益額	B	131,044,740円																																															
分配準備積立金	C	93,984円																																															
配当等収益合計額	D=A+B+C	131,132,464円																																															
経費	E	11,942,656円																																															
収益分配可能額	F=D-E	119,189,808円																																															
収益分配金	G	118,912,000円																																															

次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	226,069円
口数	I	15,900,000口
100口当たり分配金	J=G/I × 100	650円
2023年 6月 8日から2023年 9月 7日まで		
項目		
当期配当等収益額	A	8,011円
親ファンドの配当等収益額	B	125,101,170円
分配準備積立金	C	226,069円
配当等収益合計額	D=A+B+C	125,319,228円
経費	E	11,510,244円
収益分配可能額	F=D-E	113,808,984円
収益分配金	G	113,715,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	93,984円
口数	I	18,050,000口
100口当たり分配金	J=G/I × 100	630円

次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	277,808円
口数	I	18,580,000口
100口当たり分配金	J=G/I × 100	640円
2023年12月 8日から2024年 3月 7日まで		
項目		
当期配当等収益額	A	2,361円
親ファンドの配当等収益額	B	138,685,517円
分配準備積立金	C	277,808円
配当等収益合計額	D=A+B+C	138,960,964円
経費	E	12,752,725円
収益分配可能額	F=D-E	126,208,239円
収益分配金	G	125,070,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,138,239円
口数	I	18,950,000口
100口当たり分配金	J=G/I × 100	660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 2023年 3月 8日 至 2023年 9月 7日	当期 自 2023年 9月 8日 至 2024年 3月 7日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、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。</p> <p>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。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2023年 9月 7日現在	当期 2024年 3月 7日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法 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。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2023年 3月 8日 至 2023年 9月 7日	当期 自 2023年 9月 8日 至 2024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 2023年 3月 8日 至 2023年 9月 7日	当期 自 2023年 9月 8日 至 2024年 3月 7日
期首元本額	15,640,000,000円	18,050,000,000円
期中追加設定元本額	2,410,000,000円	1,000,000,000円
期中一部解約元本額	0円	100,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2023年 3月 8日 至 2023年 9月 7日	当期 自 2023年 9月 8日 至 2024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	747,444,087	478,608,735
合計	747,444,087	478,608,735

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	前期(2023年 9月 7日現在)				当期(2024年 3月 7日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年 超				うち1年 超			
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	14,771,123,414	-	15,028,414,806	257,291,392	15,279,818,910	-	15,151,991,750	127,827,160
米ドル	14,771,123,414	-	15,028,414,806	257,291,392	15,279,818,910	-	15,151,991,750	127,827,160
合計	14,771,123,414	-	15,028,414,806	257,291,392	15,279,818,910	-	15,151,991,750	127,827,160

(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。

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。

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2024年3月7日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2024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	9,553,068,583	15,172,183,523	
	小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 99.1%	9,553,068,583	15,172,183,523	100.0%
合計				15,172,183,523	

(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)

(2024年 3月 7日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	55,468,254
コール・ローン	9,827,774
社債券	16,207,584,073
派生商品評価勘定	1,328,719
未収入金	122,037,173
未収利息	152,352,816
前払費用	13,711,764
流動資産合計	16,562,310,573
資産合計	16,562,310,573
負債の部	
流動負債	
未払解約金	146,000,000
未払利息	3
流動負債合計	146,000,003
負債合計	146,000,003
純資産の部	
元本等	
元本	10,336,489,988
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	6,079,820,582
元本等合計	16,416,310,570
純資産合計	16,416,310,570
負債純資産合計	16,562,310,573

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)

2024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	1,5882円
(10,000口当たり純資産額)	(15,882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 2023年 9月 8日 至 2024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っております。	

(2)金融商品の時価等に関する事項

2024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

2024年 3月 7日現在	
期首	2023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	10,652,813,359円
同期中における追加設定元本額	1,039,792,070円
同期中における一部解約元本額	1,356,115,441円
期末元本額	10,336,489,988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	9,553,068,583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)	783,421,405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(2024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(2024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	93,001.64	
		3M COMPANY	60,000.00	53,814.55	
		ABBOTT LABORATORIES	50,000.00	49,348.83	
		ABBOTT LABORATORIES	100,000.00	97,625.89	

ABBVIE INC	350,000.00	332,905.40	
ABBVIE INC	100,000.00	98,429.47	
ABBVIE INC	100,000.00	100,347.16	
ABBVIE INC	100,000.00	92,493.21	
ADOBE INC	100,000.00	88,052.73	
ADVENT HEALTH SYSTEM	30,000.00	26,982.85	
ADVOCATE HEALTH & HOSPIT	50,000.00	48,238.59	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	150,000.00	138,835.72	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	150,000.00	145,835.61	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	150,000.00	135,697.63	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	150,000.00	128,218.11	
AFFILIATED MANAGERS GROU	50,000.00	44,572.04	
AFLAC INC	50,000.00	46,796.14	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	50,000.00	47,705.88	
AGREE LP	50,000.00	43,050.92	
AIR LEASE CORP	100,000.00	91,988.30	
AIR LEASE CORP	100,000.00	97,299.74	
AIR LEASE CORP	100,000.00	83,984.63	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	100,000.00	85,934.36	
ALABAMA POWER CO	50,000.00	40,567.96	
ALABAMA POWER CO	50,000.00	43,673.19	
ALBEMARLE CORP	50,000.00	47,922.11	
ALEXANDRIA REAL ESTATE E	50,000.00	48,605.92	
ALEXANDRIA REAL ESTATE E	30,000.00	28,787.80	
ALEXANDRIA REAL ESTATE E	100,000.00	87,815.77	
ALLEGION US HOLDING CO	50,000.00	50,388.72	
ALLSTATE CORP	100,000.00	79,709.75	
ALLY FINANCIAL INC	100,000.00	97,623.75	
ALLY FINANCIAL INC	150,000.00	128,153.83	
ALPHABET INC	100,000.00	88,647.58	
ALPHABET INC	70,000.00	57,190.01	
ALTRIA GROUP INC	100,000.00	98,999.00	
ALTRIA GROUP INC	100,000.00	90,651.24	
AMAZON.COM INC	250,000.00	249,248.90	
AMAZON.COM INC	100,000.00	96,195.79	
AMAZON.COM INC	80,000.00	76,161.80	
AMAZON.COM INC	180,000.00	150,572.57	
AMAZON.COM INC	150,000.00	139,817.20	
AMCOR FLEXIBLES NORTH AM	100,000.00	85,315.97	
AMEREN CORP	100,000.00	88,535.44	
AMERICAN ELECTRIC POWER	100,000.00	85,110.55	
AMERICAN ELECTRIC POWER	50,000.00	44,749.85	
AMERICAN EXPRESS CO	120,000.00	115,320.90	

AMERICAN EXPRESS CO	100,000.00	101,551.54	
AMERICAN EXPRESS CO	250,000.00	229,298.10	
AMERICAN EXPRESS CO	100,000.00	107,346.07	
AMERICAN EXPRESS CREDIT	100,000.00	97,443.98	
AMERICAN EXPRESS CREDIT	50,000.00	48,929.93	
AMERICAN HOMES 4 RENT	50,000.00	49,176.68	
AMERICAN HONDA FINANCE	100,000.00	94,095.25	
AMERICAN HONDA FINANCE	100,000.00	100,905.14	
AMERICAN HONDA FINANCE	100,000.00	100,153.93	
AMERICAN HONDA FINANCE	100,000.00	103,472.22	
AMERICAN HONDA FINANCE	50,000.00	41,518.17	
AMERICAN INTERNATIONAL	50,000.00	49,853.04	
AMERICAN INTL GROUP	50,000.00	48,858.94	
AMERICAN TOWER CORP	50,000.00	47,058.29	
AMERICAN TOWER CORP	100,000.00	94,543.52	
AMERICAN TOWER CORP	150,000.00	143,367.90	
AMERICAN TOWER CORP	100,000.00	88,324.31	
AMERICAN TOWER CORP	50,000.00	40,522.82	
AMERICAN TOWER CORP	100,000.00	81,670.62	
AMERICAN WATER CAPITAL	50,000.00	46,836.26	
AMERICAN WATER CAPITAL C	50,000.00	48,339.04	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	100,000.00	95,369.58	
AMERISOURCEBERGEN CORP	100,000.00	86,048.68	
AMGEN INC	200,000.00	189,350.52	
AMGEN INC	100,000.00	92,555.26	
AMGEN INC	150,000.00	151,243.87	
AMGEN INC	100,000.00	96,186.16	
AMGEN INC	100,000.00	84,695.93	
AMGEN INC	100,000.00	101,059.80	
AMPHENOL CORP	50,000.00	48,321.86	
AMPHENOL CORP	50,000.00	41,460.69	
ANALOG DEVICES INC	20,000.00	19,366.50	
ANALOG DEVICES INC	50,000.00	41,550.87	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	100,000.00	97,363.69	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	110,000.00	109,946.50	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	100,000.00	93,078.50	
ANTHEM INC	50,000.00	42,746.22	
AON CORP	80,000.00	78,686.36	
AON CORP/AON GLOBAL HOLD	100,000.00	84,094.14	
APPALACHIAN POWER CO	60,000.00	56,552.24	
APPALACHIAN POWER CO	50,000.00	42,655.36	
APPLE INC	200,000.00	191,311.92	
APPLE INC	200,000.00	185,223.72	

APPLE INC	100,000.00	94,838.48
APPLE INC	200,000.00	187,553.62
APPLE INC	140,000.00	133,050.16
APPLE INC	100,000.00	88,337.91
APPLE INC	100,000.00	84,529.93
APPLE INC	100,000.00	83,136.02
APPLE INC	100,000.00	82,263.26
APPLIED MATERIALS INC	20,000.00	19,215.32
APTIV PLC / APTIV CORP	50,000.00	43,557.34
ARCELORMITTAL SA	100,000.00	104,255.79
ARCHER-DANIELS-MIDLAND C	100,000.00	91,211.97
ARES CAPITAL CORP	150,000.00	136,890.76
ARES CAPITAL CORP	100,000.00	82,463.77
ARIZONA PUBLIC SERVICE	100,000.00	81,341.25
ARROW ELECTRONICS INC	50,000.00	47,634.90
ASCENSION HEALTH	50,000.00	44,893.36
ASSURANT INC	50,000.00	41,179.97
ASTRAZENECA FINANCE LLC	100,000.00	100,456.16
ASTRAZENECA FINANCE LLC	50,000.00	50,483.09
ASTRAZENECA PLC	100,000.00	97,448.68
ASTRAZENECA PLC	100,000.00	81,807.62
AT&T INC	100,000.00	93,313.46
AT&T INC	100,000.00	95,408.22
AT&T INC	160,000.00	146,947.16
AT&T INC	70,000.00	68,202.95
AT&T INC	100,000.00	96,430.32
AT&T INC	100,000.00	86,170.63
AT&T INC	100,000.00	81,195.41
ATHENE HOLDING LTD	50,000.00	48,159.52
ATHENE HOLDING LTD	40,000.00	35,043.67
ATMOS ENERGY CORP	40,000.00	37,797.67
AUTODESK INC	50,000.00	41,835.03
AUTOMATIC DATA PROCESSNG	100,000.00	89,495.60
AUTONATION INC	100,000.00	88,582.07
AUTOZONE INC	200,000.00	189,022.77
AVALONBAY COMMUNITIES	90,000.00	84,756.96
AVALONBAY COMMUNITIES	70,000.00	57,716.44
AVERY DENNISON CORP	50,000.00	43,954.39
AVNET INC	50,000.00	48,635.15
AXA EQUITABLE HOLDINGS I	70,000.00	67,851.67
AXA SA	50,000.00	59,390.25
BAKER HUGHES LLC/CO-OBL	100,000.00	92,501.17
BAKER HUGHES LLC/CO-OBL	30,000.00	27,622.99

BALTIMORE GAS & ELECTRIC	70,000.00	58,829.63	
BANCO SANTANDER SA	200,000.00	181,669.02	
BANCO SANTANDER SA	200,000.00	192,319.14	
BANCO SANTANDER SA	200,000.00	203,230.58	
BANCO SANTANDER SA	200,000.00	164,580.88	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	197,438.42	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	94,777.11	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	99,215.52	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	186,729.26	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	185,976.60	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	96,472.94	
BANK OF AMERICA CORP	90,000.00	87,222.29	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	96,330.84	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	95,683.93	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	97,606.55	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	95,085.96	
BANK OF AMERICA CORP	300,000.00	265,191.33	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	189,550.16	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	88,828.90	
BANK OF AMERICA CORP	300,000.00	258,213.54	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	86,213.58	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	82,041.27	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	169,228.64	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	169,334.82	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	81,903.28	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	169,981.04	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	94,998.34	
BANK OF AMERICA CORP	150,000.00	149,603.04	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	104,030.58	
BANK OF AMERICA CORP	170,000.00	135,780.39	
BANK OF AMERICA NA	250,000.00	252,110.92	
BANK OF MONTREAL	100,000.00	100,465.18	
BANK OF MONTREAL	100,000.00	92,480.21	
BANK OF MONTREAL	100,000.00	103,079.40	
BANK OF MONTREAL	20,000.00	18,556.50	
BANK OF MONTREAL	50,000.00	40,602.31	
BANK OF NOVA SCOTIA	100,000.00	98,017.82	
BANK OF NOVA SCOTIA	30,000.00	29,547.82	
BANK OF NOVA SCOTIA	100,000.00	92,379.32	
BANK OF NOVA SCOTIA	150,000.00	138,068.65	
BANK OF NOVA SCOTIA	100,000.00	94,355.42	
BANK OF NOVA SCOTIA	50,000.00	45,155.49	
BANK OF NY MELLON CORP	200,000.00	197,591.98	

BANK OF NY MELLON CORP	50,000.00	46,165.02	
BANK OF NY MELLON CORP	100,000.00	88,309.43	
BANK OF NY MELLON CORP	50,000.00	52,709.07	
BANK OF NY MELLON CORP	100,000.00	81,253.75	
BANK OF NY MELLON CORP	100,000.00	104,803.96	
BARCLAYS PLC	200,000.00	197,948.42	
BARCLAYS PLC	200,000.00	193,986.78	
BARCLAYS PLC	200,000.00	212,138.62	
BARCLAYS PLC	200,000.00	191,269.28	
BARCLAYS PLC	200,000.00	210,029.92	
BAT CAPITAL CORP	100,000.00	91,053.14	
BAT CAPITAL CORP	50,000.00	47,525.88	
BAT CAPITAL CORP	50,000.00	56,179.28	
BAT INTL FINANCE PLC	150,000.00	139,331.16	
BAT INTL FINANCE PLC	100,000.00	97,004.08	
BAXTER INTERNATIONAL INC	100,000.00	79,767.72	
BECTON DICKINSON & CO	50,000.00	44,240.61	
BECTON DICKINSON AND CO	33,000.00	31,705.25	
BECTON DICKINSON AND CO	50,000.00	41,103.74	
BELL CANADA	50,000.00	49,908.16	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	50,000.00	47,098.59	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	50,000.00	46,618.95	
BERKSHIRE HATHAWAY FIN	50,000.00	44,154.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC	80,000.00	77,534.44	
BERRY GLOBAL INC	50,000.00	45,334.72	
BEST BUY CO INC	50,000.00	41,490.64	
BHP BILLITON FIN USA LTD	100,000.00	99,875.04	
BHP BILLITON FIN USA LTD	100,000.00	101,648.78	
BIO-RAD LABS	50,000.00	45,036.90	
BIOGEN INC	50,000.00	49,063.31	
BIOGEN INC	70,000.00	59,114.77	
BLACK HILLS CORP	50,000.00	44,918.48	
BLACKROCK INC	100,000.00	87,917.88	
BLACKROCK INC	100,000.00	82,054.04	
BLACKSTONE PRIVATE CRE	100,000.00	90,636.29	
BLACKSTONE PRIVATE CRE	100,000.00	91,524.49	
BLACKSTONE SECURED LEND	100,000.00	89,960.64	
BLOCK FINANCIAL LLC	40,000.00	39,702.29	
BLUE OWL CAPITAL CORP	150,000.00	140,318.13	
BLUE OWL CREDIT INCOME	50,000.00	51,329.28	
BOEING CO	100,000.00	95,239.19	
BOEING CO	210,000.00	208,739.49	
BOEING CO	100,000.00	93,117.84	

BOEING CO	100,000.00	99,113.94	
BOEING CO	50,000.00	45,038.50	
BOOKING HOLDINGS INC	50,000.00	48,574.66	
BOOKING HOLDINGS INC	50,000.00	49,436.45	
BORGWARNER INC	50,000.00	46,297.58	
BOSTON PROPERTIES LP	30,000.00	27,943.17	
BOSTON PROPERTIES LP	50,000.00	51,881.26	
BOSTON PROPERTIES LP	100,000.00	85,057.29	
BOSTON PROPERTIES LP	50,000.00	39,353.24	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	50,000.00	44,140.46	
BP CAP MARKETS AMERICA	130,000.00	126,278.98	
BP CAP MARKETS AMERICA	100,000.00	96,354.45	
BP CAP MARKETS AMERICA	100,000.00	96,383.11	
BP CAP MARKETS AMERICA	50,000.00	47,051.79	
BP CAP MARKETS AMERICA	150,000.00	128,827.03	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN	50,000.00	50,233.77	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	100,000.00	100,229.90	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	100,000.00	100,521.31	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	100,000.00	93,805.97	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	100,000.00	81,097.46	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	100,000.00	105,187.69	
BRITISH TELECOM PLC	80,000.00	98,702.96	
BRIXMOR OPERATING PART	50,000.00	48,484.55	
BRIXMOR OPERATING PART	50,000.00	46,292.06	
BROADCOM CORP	100,000.00	96,702.14	
BROADCOM CRP / CAYMN FI	100,000.00	97,004.77	
BROADCOM INC	70,000.00	62,542.34	
BROADCOM INC	100,000.00	99,017.87	
BROADCOM INC	100,000.00	92,906.83	
BROADRIDGE FINANCIAL SOL	50,000.00	42,316.42	
BROOKFIELD FINANCE INC	50,000.00	49,658.35	
BROOKFIELD FINANCE INC	70,000.00	59,469.24	
BROWN & BROWN INC	50,000.00	48,680.86	
BRUNSWICK CORP	50,000.00	45,087.54	
BUNGE LTD FINANCE CORP	50,000.00	47,394.26	
BURLINGTN NORTH SANTA FE	50,000.00	47,695.88	
BURLINGTON RESOURCES LLC	100,000.00	115,512.22	
CAMDEN PROPERTY TRUST	60,000.00	58,264.23	
CAMPBELL SOUP CO	50,000.00	48,479.16	
CANADIAN IMPERIAL BANK	100,000.00	91,920.25	
CANADIAN IMPERIAL BANK	100,000.00	101,146.15	
CANADIAN IMPERIAL BANK	100,000.00	103,971.68	
CANADIAN NATL RAILWAY	50,000.00	54,326.49	

CANADIAN NATL RAILWAY	50,000.00	53,762.22	
CANADIAN NATL RESOURCES	100,000.00	87,850.51	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	50,000.00	44,853.26	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	120,000.00	102,244.08	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	98,497.66	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	99,282.06	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	96,201.66	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	98,108.53	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	98,197.03	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	99,642.16	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	103,812.74	
CARDINAL HEALTH INC	20,000.00	19,013.73	
CARLISLE COS INC	50,000.00	47,719.58	
CARRIER GLOBAL CORP	110,000.00	97,065.82	
CATERPILLAR FINL SERVICE	100,000.00	98,141.65	
CATERPILLAR FINL SERVICE	100,000.00	93,471.01	
CATERPILLAR INC	150,000.00	134,609.25	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	50,000.00	48,598.40	
CBRE SERVICES INC	50,000.00	41,507.40	
CBS CORP	130,000.00	115,920.41	
CDW LLC/CDW FINANCE	50,000.00	46,597.50	
CDW LLC/CDW FINANCE	100,000.00	90,646.93	
CELANESE US HOLDINGS LLC	28,000.00	28,072.76	
CELANESE US HOLDINGS LLC	100,000.00	103,411.26	
CELANESE US HOLDINGS LLC	100,000.00	104,711.05	
CENTENE CORP	150,000.00	133,056.85	
CENTENE CORP	150,000.00	143,062.21	
CENTENE CORP	100,000.00	85,786.22	
CENTERPOINT ENER HOUSTON	100,000.00	84,874.63	
CENTERPOINT ENERGY INC	50,000.00	44,654.19	
CENTERPOINT ENERGY RES	100,000.00	81,880.41	
CGI INC	50,000.00	40,466.21	
CHARLES SCHWAB CORP	100,000.00	91,933.36	
CHARLES SCHWAB CORP	100,000.00	92,994.28	
CHARLES SCHWAB CORP	100,000.00	89,300.69	
CHARLES SCHWAB CORP	150,000.00	152,387.41	
CHARLES SCHWAB CORP	50,000.00	51,855.75	
CHARLES SCHWAB CORP	100,000.00	85,734.53	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	150,000.00	148,098.15	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	150,000.00	127,696.57	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	50,000.00	40,737.79	
CHENIERE CORP CHRISTI HD	110,000.00	102,264.55	
CHENIERE ENERGY PARTNERS	100,000.00	95,096.63	

CHENIERE ENERGY PARTNERS	50,000.00	42,337.84	
CHEVRON CORP	100,000.00	96,140.17	
CHEVRON USA INC	100,000.00	93,817.29	
CHOICE HOTELS INTL INC	50,000.00	43,478.18	
CHUBB INA HOLDINGS INC	100,000.00	96,673.05	
CI FINANCIAL CORP	50,000.00	40,435.68	
CIGNA CORP	184,000.00	170,303.77	
CIGNA CORP	100,000.00	97,675.68	
CIGNA CORP	100,000.00	84,163.10	
CINTAS CORPORATION NO.2	50,000.00	48,667.48	
CISCO SYSTEMS INC	100,000.00	94,646.18	
CISCO SYSTEMS INC	100,000.00	100,891.91	
CISCO SYSTEMS INC	100,000.00	101,852.57	
CITIBANK NA	250,000.00	252,786.27	
CITIGROUP INC	100,000.00	98,315.26	
CITIGROUP INC	120,000.00	118,315.32	
CITIGROUP INC	100,000.00	97,688.22	
CITIGROUP INC	200,000.00	200,564.36	
CITIGROUP INC	200,000.00	190,349.64	
CITIGROUP INC	200,000.00	184,819.60	
CITIGROUP INC	100,000.00	91,818.51	
CITIGROUP INC	100,000.00	97,310.55	
CITIGROUP INC	100,000.00	96,519.41	
CITIGROUP INC	100,000.00	94,091.24	
CITIGROUP INC	100,000.00	95,653.01	
CITIGROUP INC	100,000.00	94,344.54	
CITIGROUP INC	150,000.00	130,000.36	
CITIGROUP INC	150,000.00	143,319.81	
CITIGROUP INC	100,000.00	83,429.35	
CITIGROUP INC	200,000.00	169,945.86	
CITIGROUP INC	200,000.00	179,116.54	
CITIGROUP INC	100,000.00	101,688.40	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,000.00	42,004.10	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	80,000.00	70,143.74	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,000.00	46,105.27	
CLOROX COMPANY	70,000.00	68,780.26	
CNA FINANCIAL CORP	50,000.00	47,173.96	
CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	100,000.00	96,264.63	
COCA-COLA CO/THE	100,000.00	95,230.44	
COCA-COLA CO/THE	100,000.00	90,792.62	
COCA-COLA CO/THE	100,000.00	84,517.31	
COCA-COLA CO/THE	50,000.00	42,731.82	
COLGATE-PALMOLIVE CO	100,000.00	95,821.93	

COLUMBIA PIPELINE GROUP	50,000.00	49,331.96	
COMCAST CORP	100,000.00	98,362.08	
COMCAST CORP	200,000.00	191,345.10	
COMCAST CORP	100,000.00	88,769.10	
COMCAST CORP	200,000.00	184,737.40	
COMCAST CORP	100,000.00	96,372.90	
COMCAST CORP	100,000.00	82,992.83	
COMCAST CORP	100,000.00	80,568.25	
COMERICA INC	100,000.00	90,768.61	
COMMONSPIRIT HEALTH	100,000.00	91,552.52	
COMMONWEALTH EDISON CO	60,000.00	56,831.93	
CON EDISON CO OF NY INC	50,000.00	48,194.59	
CON EDISON CO OF NY INC	50,000.00	42,595.18	
CONAGRA BRANDS INC	100,000.00	87,284.16	
CONAGRA BRANDS INC	20,000.00	19,777.29	
CONNECTICUT LIGHT & PWR	100,000.00	82,086.64	
CONSTELLATION BRANDS INC	140,000.00	138,097.48	
CONSTELLATION BRANDS INC	100,000.00	82,566.01	
CONSTELLATION EN GEN LLC	80,000.00	81,530.18	
CONSUMERS ENERGY CO	80,000.00	77,078.19	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	150,000.00	140,068.57	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	50,000.00	50,059.99	
CORPORATE OFFICE PROP LP	60,000.00	48,968.10	
COSTCO WHOLESALE CORP	150,000.00	126,147.62	
CREDIT SUISSE NEW YORK	250,000.00	227,608.92	
CROWN CASTLE INC	100,000.00	90,584.99	
CROWN CASTLE INC	100,000.00	93,405.65	
CROWN CASTLE INTL CORP	100,000.00	95,754.32	
CROWN CASTLE INTL CORP	100,000.00	82,745.02	
CSX CORP	100,000.00	96,743.78	
CSX CORP	30,000.00	26,346.38	
CSX CORP	50,000.00	47,231.30	
CUBESMART LP	50,000.00	47,985.69	
CUMMINS INC	40,000.00	37,602.64	
CVS HEALTH CORP	100,000.00	95,289.93	
CVS HEALTH CORP	200,000.00	192,507.00	
CVS HEALTH CORP	100,000.00	88,305.11	
CVS HEALTH CORP	100,000.00	97,638.86	
CVS HEALTH CORP	150,000.00	122,734.83	
CVS HEALTH CORP	50,000.00	40,687.84	
D.R. HORTON INC	50,000.00	44,277.33	
DCP MIDSTREAM OPERATING	50,000.00	49,751.07	
DELL INT LLC / EMC CORP	100,000.00	100,541.98	

DELL INT LLC / EMC CORP	79,000.00	80,188.60	
DELL INT LLC/EMC CORP	100,000.00	101,567.21	
DEUTSCHE BANK AG	100,000.00	97,755.28	
DEUTSCHE BANK NY	150,000.00	136,619.73	
DEUTSCHE BANK NY	150,000.00	131,688.43	
DEUTSCHE BANK NY	200,000.00	185,684.26	
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN	110,000.00	130,813.57	
DEVON FINANCING CORP ULC	80,000.00	92,072.56	
DH EUROPE FINANCE II	50,000.00	44,900.16	
DIAGEO CAPITAL PLC	200,000.00	203,189.04	
DIAMONDBACK ENERGY INC	50,000.00	46,253.68	
DIAMONDBACK ENERGY INC	50,000.00	53,108.56	
DIGITAL REALTY TRUST LP	100,000.00	97,385.64	
DISCOVER FINANCIAL SVS	100,000.00	113,040.64	
DISCOVERY COMMUNICATIONS	100,000.00	88,813.67	
DOLLAR GENERAL CORP	50,000.00	48,579.39	
DOLLAR GENERAL CORP	100,000.00	100,640.42	
DOLLAR TREE INC	30,000.00	29,124.73	
DOLLAR TREE INC	50,000.00	42,233.70	
DOMINION ENERGY INC	80,000.00	78,217.84	
DOMINION ENERGY INC	100,000.00	90,765.77	
DOMINION ENERGY SOUTH	50,000.00	56,084.24	
DOVER CORP	30,000.00	27,028.93	
DOW CHEMICAL CO/THE	70,000.00	78,226.80	
DOWDUPONT INC	60,000.00	59,280.44	
DOWDUPONT INC	50,000.00	50,131.85	
DTE ELECTRIC CO	60,000.00	53,768.80	
DTE ELECTRIC CO	50,000.00	43,434.18	
DTE ENERGY CO	120,000.00	113,311.92	
DUKE ENERGY CAROLINAS	100,000.00	95,520.30	
DUKE ENERGY CORP	100,000.00	92,751.30	
DUKE ENERGY CORP	100,000.00	86,337.91	
DUKE ENERGY CORP	100,000.00	94,610.35	
DUKE ENERGY OHIO INC	200,000.00	169,553.34	
DUKE ENERGY PROGRESS LLC	100,000.00	89,446.04	
DXC TECHNOLOGY CO	50,000.00	43,371.12	
E. I. DU PONT DE NEMOURS	50,000.00	43,190.17	
EAGLE MATERIALS INC	30,000.00	25,199.10	
EASTMAN CHEMICAL CO	50,000.00	48,864.52	
EATON CORP	50,000.00	47,410.32	
EATON CORP	30,000.00	28,417.65	
EBAY INC	100,000.00	92,529.16	
EBAY INC	50,000.00	53,668.80	

ECOLAB INC	100,000.00	95,117.12	
ELECTRONIC ARTS INC	50,000.00	41,133.47	
ELEVANCE HEALTH INC	50,000.00	46,573.06	
ELEVANCE HEALTH INC	50,000.00	51,403.56	
ELI LILLY & CO	100,000.00	95,405.05	
ELI LILLY & CO	113,000.00	107,311.32	
EMERA US FINANCE	50,000.00	40,955.82	
EMERSON ELECTRIC CO	50,000.00	45,226.81	
EMERSON ELECTRIC CO	50,000.00	44,458.97	
ENABLE MIDSTREAM PARTNER	80,000.00	75,965.00	
ENBRIDGE INC	150,000.00	137,551.86	
ENBRIDGE INC	150,000.00	136,633.86	
ENBRIDGE INC	50,000.00	51,023.32	
ENEL CHILE SA	50,000.00	48,666.22	
ENERGY TRANSFER EQUITY	150,000.00	152,035.87	
ENERGY TRANSFER LP	100,000.00	97,786.88	
ENERGY TRANSFER LP	50,000.00	53,639.50	
ENERGY TRANSFER OPERATNG	130,000.00	128,875.48	
ENERGY CORP	50,000.00	46,815.50	
ENERGY CORP	50,000.00	41,578.96	
ENERGY LOUISIANA LLC	100,000.00	94,348.93	
ENERGY LOUISIANA LLC	100,000.00	80,016.31	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	50,000.00	46,258.34	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	50,000.00	48,600.30	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	100,000.00	89,633.90	
EOG RESOURCES INC	50,000.00	48,918.34	
EPR PROPERTIES	50,000.00	44,049.47	
EQT CORP	100,000.00	106,630.80	
EQUIFAX INC	50,000.00	50,020.70	
EQUIFAX INC	50,000.00	44,486.88	
EQUINIX INC	100,000.00	94,598.57	
EQUINIX INC	100,000.00	91,778.60	
ERP OPERATING LP	30,000.00	28,418.26	
ERP OPERATING LP	80,000.00	73,045.26	
ESSENTIAL UTILITIES INC	50,000.00	41,650.57	
ESSEX PORTFOLIO LP	100,000.00	87,565.42	
ESSEX PORTFOLIO LP	30,000.00	26,615.35	
ESTEE LAUDER CO INC	100,000.00	87,907.42	
EVERGY INC	50,000.00	44,659.33	
EVERGY METRO	50,000.00	42,655.68	
EVERSOURCE ENERGY	100,000.00	91,172.06	
EVERSOURCE ENERGY	50,000.00	50,607.28	
EVERSOURCE ENERGY	50,000.00	41,808.33	

EVERSOURCE ENERGY	50,000.00	43,390.93
EXELON CORP	100,000.00	93,464.48
EXELON CORP	40,000.00	37,700.90
EXELON CORP	50,000.00	50,023.17
EXPEDIA INC	100,000.00	95,096.22
EXTRA SPACE STORAGE LP	50,000.00	47,315.15
EXTRA SPACE STORAGE LP	50,000.00	41,429.83
EXTRA SPACE STORAGE LP	50,000.00	41,623.70
EXXON MOBIL CORPORATION	100,000.00	97,907.08
EXXON MOBIL CORPORATION	100,000.00	94,858.56
EXXON MOBIL CORPORATION	90,000.00	81,016.74
EXXON MOBIL CORPORATION	100,000.00	88,770.04
FAIRFAX FINL HLDGS LTD	50,000.00	49,281.68
FAIRFAX FINL HLDGS LTD	50,000.00	43,689.60
FEDERAL REALTY INVESTMEN	50,000.00	45,263.53
FEDEX CORP	100,000.00	96,634.97
FEDEX CORP	50,000.00	42,215.21
FIDELITY NATL FINANCIAL	50,000.00	44,478.09
FIDELITY NATL INFO SERV	80,000.00	74,122.68
FIDELITY NATL INFO SERV	100,000.00	84,137.16
FIFTH THIRD BANCORP	100,000.00	95,129.43
FIFTH THIRD BANCORP	100,000.00	102,277.37
FIRST AMERICAN FINANCIAL	50,000.00	39,752.34
FIRST CITIZENS BANCSHARE	50,000.00	47,882.08
FISERV INC	30,000.00	29,434.83
FISERV INC	100,000.00	91,786.74
FISERV INC	100,000.00	92,691.84
FISERV INC	100,000.00	87,203.24
FLEX LTD	100,000.00	102,161.41
FLORIDA POWER & LIGHT CO	50,000.00	47,539.07
FLORIDA POWER & LIGHT CO	150,000.00	149,094.25
FLOWSERVE CORPORATION	50,000.00	41,263.96
FMC CORP	50,000.00	47,087.74
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	204,376.88
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	194,196.94
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	194,908.70
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	213,513.34
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	212,726.84
FORTIS INC	30,000.00	28,398.00
FORTIVE CORPORATION	30,000.00	28,750.41
FORTUNE BRANDS HOME & SE	50,000.00	45,633.74
FOX CORP	100,000.00	90,743.25
FRANCE TELECOM	60,000.00	73,087.22

FREEPORT-MCMORAN INC	100,000.00	96,523.54	
FS KKR CAPITAL CORP	100,000.00	91,075.06	
GATX CORP	50,000.00	47,091.91	
GATX CORP	50,000.00	39,697.51	
GE HEALTHCARE HLDG LLC	100,000.00	101,811.02	
GE HEALTHCARE HLDG LLC	100,000.00	105,221.45	
GENERAL DYNAMICS CORP	100,000.00	92,054.14	
GENERAL DYNAMICS CORP	100,000.00	96,880.29	
GENERAL MILLS INC	100,000.00	98,491.45	
GENERAL MILLS INC	50,000.00	41,288.46	
GENERAL MOTORS CO	100,000.00	100,496.55	
GENERAL MOTORS FINL CO	250,000.00	245,387.87	
GENERAL MOTORS FINL CO	100,000.00	92,954.42	
GENERAL MOTORS FINL CO	150,000.00	137,859.73	
GENERAL MOTORS FINL CO	100,000.00	97,736.72	
GENERAL MOTORS FINL CO	100,000.00	89,771.38	
GENERAL MOTORS FINL CO	100,000.00	101,957.59	
GENERAL MOTORS FINL CO	100,000.00	95,600.08	
GENERAL MOTORS FINL CO	100,000.00	82,421.07	
GENUINE PARTS CO	30,000.00	24,342.31	
GEORGIA POWER CO	50,000.00	48,154.23	
GEORGIA POWER CO	70,000.00	62,411.53	
GEORGIA-PACIFIC LLC	50,000.00	57,219.15	
GILEAD SCIENCES INC	50,000.00	48,692.01	
GILEAD SCIENCES INC	50,000.00	41,244.97	
GILEAD SCIENCES INC	50,000.00	51,146.43	
GLAXOSMITHKLINE CAP INC	100,000.00	97,231.15	
GLOBAL PAYMENTS INC	100,000.00	89,723.34	
GLOBAL PAYMENTS INC	50,000.00	42,130.04	
GLOBE LIFE INC	50,000.00	48,573.89	
GLP CAPITAL LP / FIN II	50,000.00	49,562.45	
GLP CAPITAL LP / FIN II	100,000.00	97,913.74	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	300,000.00	278,515.83	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	150,000.00	138,884.61	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	200,000.00	182,441.52	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	200,000.00	183,753.18	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	100,000.00	95,711.26	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	100,000.00	96,520.04	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	100,000.00	80,908.28	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	250,000.00	210,228.12	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	300,000.00	246,564.27	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	100,000.00	85,772.68	
GSK CONSUMER HEALTHCARE	250,000.00	238,354.07	

GXO LOGISTICS INC	50,000.00	45,718.29	
HALLIBURTON CO	50,000.00	44,828.52	
HASBRO INC	70,000.00	64,603.45	
HCA INC	50,000.00	49,976.29	
HCA INC	100,000.00	94,169.46	
HCA INC	100,000.00	91,791.31	
HCA INC	200,000.00	189,672.16	
HCA INC	100,000.00	88,294.31	
HEALTHCARE TRUST OF AMER	80,000.00	69,564.22	
HEALTHPEAK PROPERTIES	130,000.00	115,160.65	
HEICO CORP	50,000.00	50,608.06	
HERSHEY COMPANY	100,000.00	89,586.16	
HESS CORP	100,000.00	97,688.59	
HF SINCLAIR CORP	50,000.00	47,236.50	
HIGHWOODS REALTY LP	50,000.00	45,491.96	
HOME DEPOT INC	130,000.00	121,534.97	
HOME DEPOT INC	150,000.00	131,563.14	
HOME DEPOT INC	150,000.00	120,209.31	
HOME DEPOT INC	70,000.00	57,366.70	
HONEYWELL INTERNATIONAL	100,000.00	90,122.43	
HONEYWELL INTERNATIONAL	100,000.00	98,583.11	
HONEYWELL INTERNATIONAL	60,000.00	51,174.54	
HOST HOTELS & RESORTS LP	50,000.00	44,583.98	
HOST HOTELS & RESORTS LP	50,000.00	41,582.44	
HP ENTERPRISE CO	100,000.00	93,195.89	
HP INC	100,000.00	99,438.32	
HP INC	100,000.00	84,283.46	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	194,566.82	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	191,158.98	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	191,483.26	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	192,219.44	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	212,648.44	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	186,914.66	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	171,962.06	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	166,330.22	
HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	227,304.70	
HUBBELL INC	50,000.00	41,825.55	
HUMANA INC	100,000.00	98,974.19	
HUMANA INC	50,000.00	40,084.76	
HUMANA INC	50,000.00	51,782.85	
HUNTINGTON BANCSHARES	100,000.00	84,991.50	
HUNTINGTON BANCSHARES	50,000.00	38,260.71	
HUNTINGTON INGALLS INDUS	60,000.00	56,868.64	

HUNTSMAN INTERNATIONAL L	50,000.00	41,737.49	
HYATT HOTELS CORP	80,000.00	79,978.64	
IBM CORP	100,000.00	96,558.10	
IBM CORP	100,000.00	92,834.53	
IBM CORP	150,000.00	135,868.93	
IBM CORP	100,000.00	93,846.34	
IBM CORP	100,000.00	84,327.08	
IDEX CORP	50,000.00	42,560.62	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	20,000.00	19,082.94	
ILLUMINA INC	50,000.00	50,594.58	
ING GROEP NV	200,000.00	192,692.62	
ING GROEP NV	200,000.00	208,457.12	
INTEL CORP	200,000.00	194,157.84	
INTEL CORP	100,000.00	96,666.32	
INTEL CORP	100,000.00	100,382.54	
INTEL CORP	200,000.00	176,717.22	
INTEL CORP	100,000.00	101,307.98	
INTERCONTINENTALEXCHANGE	100,000.00	96,948.00	
INTERCONTINENTALEXCHANGE	140,000.00	134,337.00	
INTERCONTINENTALEXCHANGE	50,000.00	48,368.00	
INTERPUBLIC GROUP COS	50,000.00	49,036.09	
INTERSTATE POWER & LIGHT	50,000.00	42,655.95	
INTUIT INC	50,000.00	47,313.79	
INTUIT INC	100,000.00	82,886.91	
INVITATION HOMES OP	50,000.00	44,080.18	
IPALCO ENTERPRISES INC	50,000.00	46,525.10	
IQVIA INC	50,000.00	51,820.75	
JABIL INC	50,000.00	46,423.87	
JABIL INC	50,000.00	43,189.06	
JACKSON FINANCIAL INC	50,000.00	50,434.79	
JACOBS ENGINEERING GROUP	50,000.00	51,818.97	
JB HUNT TRANSPRT SVCS	50,000.00	48,873.55	
JBS USA/FOOD/FINANCE	100,000.00	92,164.55	
JBS USA/FOOD/FINANCE	50,000.00	42,533.92	
JBS USA/FOOD/FINANCE	50,000.00	49,145.68	
JEFFERIES GRP LLC / CAP	100,000.00	93,715.49	
JM SMUCKER CO	50,000.00	51,782.42	
JM SMUCKER CO	50,000.00	43,316.20	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	98,741.06	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	100,421.31	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	91,917.01	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	99,261.91	
JOHN DEERE CAPITAL CORP	150,000.00	142,386.01	

JOHN DEERE CAPITAL CORP	100,000.00	94,601.95
JOHN DEERE CAPITAL CORP	50,000.00	41,763.85
JOHNSON & JOHNSON	100,000.00	93,977.17
JOHNSON & JOHNSON	100,000.00	88,909.18
JOHNSON & JOHNSON	60,000.00	57,045.39
JOHNSON CONTROLS/TYCO FI	50,000.00	41,216.84
JP MORGAN CHASE & CO	300,000.00	277,998.63
JP MORGAN CHASE & CO	100,000.00	97,777.78
JP MORGAN CHASE & CO	240,000.00	232,235.92
JP MORGAN CHASE & CO	170,000.00	138,446.75
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	192,667.56
JPMORGAN CHASE & CO	150,000.00	146,808.96
JPMORGAN CHASE & CO	300,000.00	293,227.35
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	102,177.63
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	94,082.39
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	182,800.74
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	192,243.94
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	97,607.71
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	88,701.01
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	175,444.58
JPMORGAN CHASE & CO	150,000.00	125,003.26
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	171,299.60
JPMORGAN CHASE & CO	200,000.00	192,232.46
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	98,298.90
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	100,795.02
KELLOGG CO	100,000.00	84,985.41
KEMPER CORP	50,000.00	42,353.69
KENVUE INC	50,000.00	50,389.61
KENVUE INC	100,000.00	101,058.46
KEURIG DR PEPPER INC	100,000.00	93,989.71
KEURIG DR PEPPER INC	50,000.00	47,860.76
KEYCORP	150,000.00	136,522.14
KEYSIGHT TECHNOLOGIES	50,000.00	44,863.87
KILROY REALTY LP	100,000.00	94,766.38
KIMBERLY-CLARK CORP	100,000.00	91,844.80
KIMCO REALTY CORP	100,000.00	88,261.03
KINDER MORGAN INC	150,000.00	137,515.63
KINDER MORGAN INC	100,000.00	95,426.15
KINDER MORGAN INC	50,000.00	49,170.99
KIRBY CORPORATION	50,000.00	48,124.89
KITE REALTY GROUP LP	50,000.00	47,571.50
KONINKLIJKE KPN NV	30,000.00	35,236.90
KRAFT HEINZ FOODS CO	150,000.00	145,390.96

KROGER CO	100,000.00	80,811.42	
KYNDRYL HOLDINGS INC	70,000.00	58,501.00	
L3 HARRIS TECH	100,000.00	97,679.22	
L3HARRIS TECH INC	100,000.00	89,487.09	
LABORATORY CORP OF AMER	40,000.00	36,033.39	
LABORATORY CORP OF AMER	50,000.00	42,828.43	
LAM RESEARCH CORP	60,000.00	58,673.51	
LAM RESEARCH CORP	50,000.00	42,270.22	
LAZARD GROUP LLC	60,000.00	57,185.01	
LEAR CORP	50,000.00	45,107.47	
LEIDOS INC	100,000.00	94,537.49	
LENNAR CORP	60,000.00	59,301.93	
LINCOLN NATIONAL CORP	60,000.00	57,457.40	
LKQ CORP	50,000.00	50,892.88	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	200,000.00	190,403.92	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	200,000.00	195,391.46	
LOCKHEED MARTIN CORP	100,000.00	103,113.12	
LOEWS CORP	30,000.00	27,367.78	
LOWE'S COS INC	100,000.00	98,557.43	
LOWE'S COS INC	100,000.00	98,902.16	
LOWE'S COS INC	150,000.00	142,202.70	
LOWE'S COS INC	100,000.00	91,714.62	
LXP INDUSTRIAL TRUST	30,000.00	24,965.32	
LYB INT FINANCE III	50,000.00	46,850.61	
M&T BANK CORPORATION	100,000.00	92,597.66	
MAGNA INTERNATIONAL INC	50,000.00	43,383.33	
MANULIFE FINANCIAL CORP	50,000.00	47,922.76	
MARATHON OIL CORP	50,000.00	53,923.45	
MARATHON PETROLEUM CORP	50,000.00	49,563.21	
MARATHON PETROLEUM CORP	40,000.00	38,355.50	
MARRIOTT INTERNATIONAL	100,000.00	98,191.81	
MARRIOTT INTERNATIONAL	50,000.00	49,760.68	
MARRIOTT INTERNATIONAL	100,000.00	86,304.20	
MARSH & MCLENNAN COS INC	100,000.00	98,315.58	
MARSH & MCLENNAN COS INC	50,000.00	52,767.50	
MARTIN MARIETTA MATERIAL	50,000.00	43,655.07	
MARVELL TECHNOLOGY INC	80,000.00	74,361.11	
MASCO CORP	30,000.00	26,231.99	
MASTERCARD INC	100,000.00	96,171.23	
MASTERCARD INC	50,000.00	46,571.94	
MASTERCARD INC	100,000.00	82,977.10	
MCCORMICK & CO	70,000.00	66,556.44	
MCDONALD'S CORP	100,000.00	94,860.72	

MCDONALD'S CORP	100,000.00	96,037.81	
MCDONALD'S CORP	100,000.00	86,305.16	
MCKESSON CORP	100,000.00	100,475.41	
MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS	50,000.00	48,690.01	
MERCEDES-BENZ FIN NA	50,000.00	61,201.49	
MERCK & CO INC	100,000.00	91,014.06	
MERCK & CO INC	50,000.00	47,272.75	
MERCK & CO INC	100,000.00	83,968.58	
MERCK & CO INC	50,000.00	49,203.58	
META PLATFORMS INC	50,000.00	48,102.21	
META PLATFORMS INC	50,000.00	50,081.17	
META PLATFORMS INC	100,000.00	93,799.22	
META PLATFORMS INC	50,000.00	50,609.46	
METLIFE INC	100,000.00	98,598.21	
MICRON TECHNOLOGY INC	100,000.00	97,315.40	
MICRON TECHNOLOGY INC	50,000.00	53,577.24	
MICRON TECHNOLOGY INC	50,000.00	51,673.31	
MICROSOFT CORP	130,000.00	123,518.25	
MICROSOFT CORP	100,000.00	96,888.03	
MICROSOFT CORP	50,000.00	41,304.47	
MID-AMERICA APARTMENTS	30,000.00	27,225.60	
MID-AMERICA APARTMENTS	50,000.00	40,360.92	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	200,000.00	196,449.76	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	200,000.00	182,903.88	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	200,000.00	199,289.16	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	200,000.00	203,797.60	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	200,000.00	189,192.02	
MIZUHO FINANCIAL GROUP	200,000.00	183,924.30	
MIZUHO FINANCIAL GROUP	200,000.00	182,506.92	
MIZUHO FINANCIAL GROUP	200,000.00	177,825.28	
MOHAWK INDUSTRIES INC	30,000.00	27,609.93	
MOLSON COORS BREWING CO	50,000.00	47,700.47	
MONDELEZ INTERNATIONAL	50,000.00	46,791.60	
MONDELEZ INTERNATIONAL	33,000.00	29,412.10	
MONDELEZ INTERNATIONAL	50,000.00	43,506.43	
MOODY'S CORPORATION	50,000.00	48,678.79	
MORGAN STANLEY	200,000.00	197,843.56	
MORGAN STANLEY	100,000.00	92,449.32	
MORGAN STANLEY	300,000.00	289,792.20	
MORGAN STANLEY	100,000.00	96,532.52	
MORGAN STANLEY	100,000.00	92,438.13	
MORGAN STANLEY	200,000.00	194,309.30	
MORGAN STANLEY	100,000.00	103,712.41	

MORGAN STANLEY	100,000.00	99,945.21	
MORGAN STANLEY	250,000.00	242,417.92	
MORGAN STANLEY	200,000.00	183,425.64	
MORGAN STANLEY	200,000.00	165,760.30	
MORGAN STANLEY	100,000.00	85,011.95	
MORGAN STANLEY	200,000.00	194,411.76	
MORGAN STANLEY	100,000.00	106,993.84	
MORGAN STANLEY	100,000.00	99,585.83	
MORGAN STANLEY	200,000.00	192,815.00	
MORGAN STANLEY BANK NA	250,000.00	248,943.55	
MOSAIC CO	50,000.00	50,583.77	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20,000.00	19,772.66	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	100,000.00	84,194.48	
MPLX LP	150,000.00	140,093.98	
MPLX LP	80,000.00	68,699.75	
NASDAQ INC	20,000.00	19,429.01	
NASDAQ INC	50,000.00	50,694.36	
NATIONAL AUSTRALIA BK/NY	250,000.00	236,695.57	
NATIONAL FUEL GAS CO	50,000.00	42,272.21	
NATIONAL GRID PLC	50,000.00	50,915.86	
NATIONAL RURAL UTIL COOP	100,000.00	100,509.84	
NATIONAL RURAL UTIL COOP	100,000.00	94,571.87	
NATIONAL RURAL UTIL COOP	50,000.00	39,971.61	
NATIONAL RURAL UTIL COOP	30,000.00	29,310.18	
NATWEST GROUP PLC	200,000.00	183,689.32	
NATWEST GROUP PLC	200,000.00	200,472.98	
NETAPP INC	50,000.00	45,937.29	
NETFLIX INC	80,000.00	80,290.32	
NETFLIX INC	80,000.00	83,401.36	
NEWMONT GOLDCORP CORP	100,000.00	89,573.26	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	50,000.00	48,363.19	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	100,000.00	91,574.95	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	100,000.00	98,800.46	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	100,000.00	99,722.77	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	160,000.00	140,965.00	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	100,000.00	82,291.57	
NIKE INC	100,000.00	94,306.66	
NIKE INC	30,000.00	27,179.54	
NISOURCE FINANCE CORP	100,000.00	95,364.98	
NISOURCE INC	100,000.00	92,173.41	
NNN REIT INC	50,000.00	42,609.76	
NOMURA HOLDINGS INC	200,000.00	183,450.08	
NOMURA HOLDINGS INC	200,000.00	177,672.50	

NORFOLK SOUTHERN CORP	50,000.00	48,984.66	
NORFOLK SOUTHERN CORP	80,000.00	70,936.88	
NORTHERN STATES PWR-MINN	50,000.00	42,101.24	
NORTHERN TRUST CORP	50,000.00	48,714.46	
NORTHERN TRUST CORP	50,000.00	42,642.00	
NORTHERN TRUST CORP	80,000.00	74,400.27	
NORTHROP GRUMMAN CORP	50,000.00	47,765.18	
NORTHROP GRUMMAN CORP	50,000.00	47,214.21	
NORTHROP GRUMMAN CORP	50,000.00	48,705.70	
NOVARTIS CAPITAL CORP	200,000.00	194,238.78	
NSTAR ELECTRIC CO	50,000.00	40,410.19	
NUCOR CORP	100,000.00	98,129.00	
NUTRIEN LTD	50,000.00	48,530.08	
NUTRIEN LTD	70,000.00	62,653.05	
NVENT FINANCE SARL	50,000.00	48,662.13	
NVIDIA CORP	50,000.00	44,570.44	
NVIDIA CORP	80,000.00	72,725.16	
NVR INC	50,000.00	44,410.78	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA	50,000.00	48,122.11	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA	50,000.00	48,941.70	
NXP BV/NXP FUNDING LLC	100,000.00	101,844.49	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	100,000.00	95,563.80	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	50,000.00	40,477.75	
OAKTREE SPECIALTY LEND	50,000.00	44,744.03	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	100,000.00	104,197.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	50,000.00	58,227.75	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	50,000.00	52,887.00	
OKLAHOMA G&E CO	50,000.00	45,387.17	
OMEGA HLTHCARE INVESTORS	100,000.00	96,624.81	
OMNICOM GROUP INC	50,000.00	42,409.23	
ONCOR ELECTRIC DELIVERY	150,000.00	132,942.63	
ONEOK INC	100,000.00	95,358.53	
ONEOK INC	100,000.00	96,956.59	
ONEOK INC	100,000.00	105,720.65	
ORACLE CORP	100,000.00	93,152.02	
ORACLE CORP	100,000.00	94,560.47	
ORACLE CORP	100,000.00	93,622.44	
ORACLE CORP	100,000.00	90,142.76	
ORACLE CORP	100,000.00	89,119.20	
ORACLE CORP	200,000.00	180,822.54	
ORACLE CORP	100,000.00	106,762.55	
ORIX CORP	80,000.00	67,838.12	
OTIS WORLDWIDE CORP	100,000.00	96,495.40	

OTIS WORLDWIDE CORP	30,000.00	26,369.00	
OVINTIV INC	100,000.00	101,475.03	
OWENS CORNING	50,000.00	46,486.88	
OWL ROCK CORE INCOME COR	50,000.00	45,704.56	
PACCAR FINANCIAL CORP	100,000.00	92,475.39	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	200,000.00	191,720.82	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	120,000.00	114,140.68	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	100,000.00	86,459.66	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	100,000.00	101,299.80	
PACIFICORP	70,000.00	65,078.14	
PACIFICORP	100,000.00	100,014.36	
PARAMOUNT GLOBAL	50,000.00	40,988.13	
PARKER-HANNIFIN CORP	100,000.00	98,426.77	
PAYPAL HOLDINGS INC	100,000.00	86,033.00	
PEPSICO INC	100,000.00	100,888.49	
PEPSICO INC	200,000.00	188,813.70	
PEPSICO INC	100,000.00	90,124.15	
PEPSICO INC	100,000.00	82,823.60	
PERKINELMER INC	50,000.00	41,239.79	
PFIZER INC	100,000.00	95,900.27	
PFIZER INC	100,000.00	95,606.65	
PFIZER INC	70,000.00	58,897.86	
PFIZER INC	100,000.00	81,508.34	
PFIZER INVESTMENT ENTER	100,000.00	99,017.89	
PFIZER INVESTMENT ENTER	100,000.00	98,835.02	
PFIZER INVESTMENT ENTER	100,000.00	99,198.00	
PFIZER INVESTMENT ENTER	100,000.00	98,656.99	
PHILIP MORRIS INTL INC	100,000.00	99,869.55	
PHILIP MORRIS INTL INC	150,000.00	138,924.73	
PHILIP MORRIS INTL INC	100,000.00	99,435.49	
PHILIP MORRIS INTL INC	100,000.00	103,051.18	
PHILIP MORRIS INTL INC	100,000.00	98,860.67	
PHILLIPS 66	140,000.00	135,590.85	
PIEDMONT NATURAL GAS CO	20,000.00	18,556.75	
PILGRIM'S PRIDE CORP	50,000.00	45,227.24	
PILGRIM'S PRIDE CORP	50,000.00	42,210.00	
PIONEER NATURAL RESOURCE	100,000.00	92,935.52	
PLAINS ALL AMER PIPELINE	100,000.00	98,331.70	
PNC BANK NA	250,000.00	217,521.80	
PNC FINANCIAL SERVICES	100,000.00	100,267.85	
PNC FINANCIAL SERVICES	100,000.00	99,001.83	
PNC FINANCIAL SERVICES	100,000.00	92,993.38	
PNC FINANCIAL SERVICES	100,000.00	93,674.14	

PPG INDUSTRIES INC	100,000.00	92,627.22	
PPL CAPITAL FUNDING INC	20,000.00	19,114.94	
PRECISION CASTPARTS CORP	50,000.00	48,973.80	
PRINCIPAL FINANCIAL GRP	80,000.00	75,249.89	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	150,000.00	139,094.56	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	100,000.00	94,860.72	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	50,000.00	46,117.49	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	150,000.00	121,934.29	
PROGRESSIVE CORP	100,000.00	93,404.96	
PROGRESSIVE CORP	20,000.00	19,415.61	
PROLOGIS L P	100,000.00	96,798.39	
PROLOGIS LP	200,000.00	166,018.28	
PROSPECT CAPITAL CORP	30,000.00	27,115.09	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	50,000.00	46,721.43	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	200,000.00	196,313.04	
PRUDENTIAL FUNDING ASIA	50,000.00	44,856.84	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC	70,000.00	67,096.26	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC	100,000.00	87,831.14	
PUBLIC SERVICE ENTERPRIS	50,000.00	51,549.83	
PUBLIC SERVICE ENTERPRIS	70,000.00	56,650.78	
PUBLIC STORAGE	100,000.00	92,484.75	
PUBLIC STORAGE	50,000.00	46,970.28	
PUGET ENERGY INC	50,000.00	44,774.85	
QORVO INC	50,000.00	46,872.25	
QUALCOMM INC	120,000.00	104,964.04	
QUALCOMM INC	100,000.00	96,407.08	
QUANTA SERVICES INC	50,000.00	43,763.56	
QUEST DIAGNOSTICS INC	100,000.00	88,864.70	
RADIAN GROUP INC	50,000.00	48,519.43	
RAYTHEON TECH CORP	150,000.00	120,792.54	
REALTY INCOME CORP	30,000.00	29,685.58	
REALTY INCOME CORP	100,000.00	91,501.86	
REALTY INCOME CORP	50,000.00	47,248.80	
REALTY INCOME CORP	80,000.00	70,610.49	
REALTY INCOME CORP	50,000.00	51,076.30	
REALTY INCOME CORP	50,000.00	48,228.33	
REGAL REXNORD CORP	50,000.00	50,229.25	
REGAL REXNORD CORP	100,000.00	102,356.72	
REGENCY CENTERS LP	50,000.00	44,616.82	
REGENERON PHARMACEUTICAL	50,000.00	40,852.16	
REGIONS FINANCIAL CORP	40,000.00	38,374.11	
REINSURANCE GRP OF AMER	50,000.00	44,600.27	
RELX CAPITAL INC	50,000.00	48,084.10	

RENAISSANCERE HOLDINGS L	50,000.00	46,605.53	
REPUBLIC SERVICES INC	150,000.00	139,529.79	
REPUBLIC SERVICES INC	50,000.00	49,622.75	
REXFORD INDUSTRIAL REALT	50,000.00	39,890.39	
RIO TINTO FIN USA PLC	50,000.00	50,410.97	
ROCKWELL AUTOMATION	50,000.00	40,519.87	
ROGERS COMMUNICATIONS IN	50,000.00	48,549.58	
ROGERS COMMUNICATIONS IN	50,000.00	47,209.32	
ROGERS COMMUNICATIONS IN	70,000.00	62,946.53	
ROPER TECHNOLOGIES INC	50,000.00	46,909.90	
ROPER TECHNOLOGIES INC	100,000.00	80,598.87	
ROSS STORES INC	50,000.00	41,037.34	
ROYAL BANK OF CANADA	100,000.00	97,974.46	
ROYAL BANK OF CANADA	100,000.00	92,750.30	
ROYAL BANK OF CANADA	50,000.00	49,571.27	
ROYAL BANK OF CANADA	100,000.00	96,178.76	
ROYAL BANK OF CANADA	100,000.00	97,748.27	
ROYAL BANK OF CANADA	100,000.00	101,140.02	
ROYAL BANK OF CANADA	150,000.00	124,450.23	
ROYALTY PHARMA PLC	100,000.00	89,212.78	
RTX CORP	100,000.00	95,934.70	
RTX CORPORATION	100,000.00	96,752.79	
RYDER SYSTEM INC	100,000.00	94,564.51	
RYDER SYSTEM INC	50,000.00	46,993.28	
S&P GLOBAL INC	200,000.00	200,213.08	
SABINE PASS LIQUEFACTION	100,000.00	100,968.61	
SABINE PASS LIQUEFACTION	50,000.00	49,784.56	
SABINE PASS LIQUEFACTION	50,000.00	48,507.40	
SABINE PASS LIQUEFACTION	50,000.00	48,266.71	
SABRA HEALTH CARE LP	50,000.00	40,991.42	
SALESFORCE.COM INC	100,000.00	97,135.40	
SAN DIEGO G & E	50,000.00	43,610.76	
SANDS CHINA LTD	200,000.00	180,025.04	
SANTANDER HOLDINGS USA	100,000.00	93,962.68	
SANTANDER HOLDINGS USA	100,000.00	102,433.95	
SANTANDER UK GROUP HLDGS	200,000.00	187,421.24	
SCHLUMBERGER INVESTMENT	100,000.00	88,794.97	
SEMPRA ENERGY	50,000.00	48,897.68	
SEMPRA ENERGY	30,000.00	28,330.78	
SEMPRA ENERGY	50,000.00	45,935.96	
SERVICENOW INC	50,000.00	40,586.49	
SHELL INTERNATIONAL FIN	100,000.00	96,015.00	
SHELL INTERNATIONAL FIN	100,000.00	89,910.93	

SHERWIN-WILLIAMS CO	50,000.00	45,346.43	
SHIRE ACQ INV IRELAND DA	130,000.00	124,223.45	
SIMON PROPERTY GROUP LP	120,000.00	116,096.53	
SIMON PROPERTY GROUP LP	100,000.00	101,875.42	
SIXTH STREET SPECIALTY	50,000.00	51,223.23	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	50,000.00	46,332.72	
SMITH & NEPHEW PLC	50,000.00	41,268.37	
SOLVENTUM CORP	100,000.00	100,386.27	
SONOCO PRODUCTS CO	50,000.00	46,192.06	
SOUTHERN CAL EDISON	100,000.00	102,686.65	
SOUTHERN CAL EDISON	130,000.00	126,152.36	
SOUTHERN CALIF GAS CO	50,000.00	47,526.98	
SOUTHERN CALIF GAS CO	50,000.00	47,185.22	
SOUTHERN CO	200,000.00	191,875.50	
SOUTHERN CO	50,000.00	47,104.93	
SOUTHERN CO GAS CAPITAL	50,000.00	40,523.62	
SOUTHWEST AIRLINES CO	100,000.00	100,013.76	
SOUTHWEST GAS CORP	50,000.00	46,095.89	
SOUTHWESTERN ELEC POWER	100,000.00	93,320.30	
SPRINT CAPITAL CORP	100,000.00	121,577.52	
SPRINT CORP	100,000.00	103,427.30	
STANLEY BLACK & DECKER I	100,000.00	96,543.72	
STARBUCKS CORP	100,000.00	99,538.39	
STARBUCKS CORP	100,000.00	92,076.77	
STARBUCKS CORP	100,000.00	87,676.05	
STATE STREET CORP	200,000.00	183,791.16	
STATE STREET CORP	150,000.00	140,586.88	
STATE STREET CORP	50,000.00	44,531.86	
STEEL DYNAMICS INC	100,000.00	89,271.82	
STORE CAPITAL CORP	50,000.00	39,377.89	
STRYKER CORP	100,000.00	95,985.79	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	100,000.00	94,674.10	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	200,000.00	182,726.74	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	150,000.00	142,985.52	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	200,000.00	197,313.24	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	200,000.00	178,959.96	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	200,000.00	177,622.74	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	50,000.00	41,530.94	
SUN COMMUNITIES OPER LP	50,000.00	43,760.30	
SUTTER HEALTH	50,000.00	43,035.76	
SUZANO AUSTRIA GMBH	200,000.00	175,894.78	
SYNCHRONY FINANCIAL	200,000.00	186,133.57	
SYSCO CORPORATION	100,000.00	83,619.87	

T-MOBILE USA INC	200,000.00	195,853.96
T-MOBILE USA INC	150,000.00	144,335.29
T-MOBILE USA INC	100,000.00	89,660.25
T-MOBILE USA INC	100,000.00	88,633.76
T-MOBILE USA INC	200,000.00	187,332.58
T-MOBILE USA INC	200,000.00	164,077.10
T-MOBILE USA INC	100,000.00	84,094.74
TAKE-TWO INTERACTIVE SOF	100,000.00	99,796.65
TANGER PROPERTIES LP	50,000.00	40,754.99
TAPESTRY INC	100,000.00	105,272.91
TAPESTRY INC	50,000.00	40,832.21
TARGA RESOURCES CORP	150,000.00	149,763.10
TARGA RESOURCES PARTNERS	100,000.00	90,067.37
TARGET CORP	150,000.00	139,185.76
TARGET CORP	50,000.00	49,029.26
TD SYNEX CORP	60,000.00	54,809.83
TELEDYNE TECHNOLOGIES IN	50,000.00	45,066.88
TELEFONICA EUROPE BV	60,000.00	68,844.90
TELUS CORP	50,000.00	43,971.79
TEXAS INSTRUMENTS INC	70,000.00	66,021.56
TEXAS INSTRUMENTS INC	50,000.00	42,275.23
TEXTRON INC	50,000.00	47,936.09
THERMO FISHER SCIENTIFIC	100,000.00	100,344.92
THERMO FISHER SCIENTIFIC	100,000.00	101,397.56
TIMKEN CO	50,000.00	46,201.66
TJX COS INC	50,000.00	47,774.05
TOLL BROS FINANCE CORP	50,000.00	46,323.22
TORONTO-DOMINION BANK	100,000.00	91,233.10
TORONTO-DOMINION BANK	100,000.00	92,393.76
TORONTO-DOMINION BANK	150,000.00	140,992.36
TORONTO-DOMINION BANK	150,000.00	123,514.08
TORONTO-DOMINION BANK	50,000.00	47,887.54
TORONTO-DOMINION BANK	100,000.00	96,180.19
TOTALENERGIES CAP INTL	50,000.00	47,348.71
TOTALENERGIES CAPITAL SA	50,000.00	48,497.75
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	100,000.00	98,133.93
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	100,000.00	93,597.50
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	100,000.00	91,996.56
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	100,000.00	101,255.17
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	160,000.00	148,348.64
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	100,000.00	104,143.30
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	100,000.00	81,952.24
TRANE TECH FIN LTD	24,000.00	22,858.87

TRANSCANADA PIPELINES	50,000.00	49,686.18	
TRANSCANADA PIPELINES	100,000.00	96,939.68	
TRIMBLE INC	40,000.00	42,155.66	
TRUIST BANK	200,000.00	191,192.66	
TRUIST FINANCIAL CORP	130,000.00	122,503.90	
TRUIST FINANCIAL CORP	100,000.00	98,169.19	
TRUIST FINANCIAL CORP	100,000.00	106,620.63	
TSMC ARIZONA CORP	200,000.00	184,305.80	
TYCO ELECTRONICS GROUP S	50,000.00	42,791.06	
TYSON FOODS INC	50,000.00	47,570.21	
TYSON FOODS INC	50,000.00	48,377.30	
UBS GROUP AG	250,000.00	245,208.67	
UDR INC	100,000.00	96,365.77	
UNILEVER CAPITAL CORP	100,000.00	94,891.73	
UNILEVER CAPITAL CORP	200,000.00	162,964.14	
UNION PACIFIC CORP	130,000.00	124,702.51	
UNION PACIFIC CORP	50,000.00	43,400.56	
UNITED PARCEL SERVICE	80,000.00	71,900.77	
UNITED PARCEL SERVICE	100,000.00	99,026.51	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	100,000.00	94,710.19	
UNITEDHEALTH GROUP INC	100,000.00	98,330.21	
UNITEDHEALTH GROUP INC	100,000.00	96,775.70	
UNITEDHEALTH GROUP INC	100,000.00	96,704.88	
UNITEDHEALTH GROUP INC	100,000.00	84,756.94	
UNITEDHEALTH GROUP INC	150,000.00	142,859.44	
UNITEDHEALTH GROUP INC	50,000.00	51,561.85	
UNIVERSAL HEALTH SVCS	50,000.00	42,252.90	
UPMC	50,000.00	50,228.58	
US BANCORP	50,000.00	50,220.79	
US BANCORP	100,000.00	103,617.07	
US BANCORP	100,000.00	97,812.21	
US BANCORP	100,000.00	101,624.83	
US BANCORP	100,000.00	89,171.53	
US BANCORP	50,000.00	47,292.33	
US BANCORP	250,000.00	255,007.02	
VALE OVERSEAS LIMITED	100,000.00	90,471.00	
VALERO ENERGY CORP	100,000.00	85,416.24	
VALERO ENERGY PARTNERS	30,000.00	29,380.84	
VENTAS REALTY LP	50,000.00	41,129.72	
VERALTO CORP	50,000.00	50,580.58	
VERISIGN INC	50,000.00	41,943.62	
VERISK ANALYTICS INC	30,000.00	28,922.97	
VERIZON COMM INC	200,000.00	190,970.68	

VERIZON COMMUNICATIONS	100,000.00	93,018.44	
VERIZON COMMUNICATIONS	100,000.00	89,789.94	
VERIZON COMMUNICATIONS	100,000.00	97,864.11	
VERIZON COMMUNICATIONS	150,000.00	135,431.67	
VERIZON COMMUNICATIONS	100,000.00	81,422.75	
VERIZON COMMUNICATIONS	100,000.00	85,261.88	
VERIZON COMMUNICATIONS	100,000.00	82,125.68	
VF CORP	50,000.00	48,018.44	
VIATRIS INC	50,000.00	47,522.60	
VIATRIS INC	100,000.00	90,698.86	
VICI PROPERTIES LP	50,000.00	48,804.96	
VICI PROPERTIES LP	50,000.00	47,573.59	
VIRGINIA ELEC & POWER CO	50,000.00	48,326.63	
VIRGINIA ELEC & POWER CO	70,000.00	58,307.34	
VISA INC	100,000.00	97,152.85	
VISA INC	100,000.00	86,620.76	
VMWARE INC	100,000.00	98,328.29	
VMWARE INC	100,000.00	87,215.73	
VMWARE INC	50,000.00	48,607.02	
VODAFONE GROUP PLC	100,000.00	98,446.21	
VONTIER CORP	50,000.00	41,427.93	
VULCAN MATERIALS	50,000.00	46,039.61	
WABTEC	60,000.00	59,170.16	
WALMART INC	100,000.00	96,445.44	
WALMART INC	100,000.00	91,619.12	
WALMART INC	100,000.00	82,856.34	
WALMART INC	100,000.00	96,586.59	
WALT DISNEY COMPANY/THE	50,000.00	48,948.22	
WALT DISNEY COMPANY/THE	100,000.00	96,349.62	
WALT DISNEY COMPANY/THE	50,000.00	43,523.69	
WALT DISNEY COMPANY/THE	150,000.00	132,079.08	
WARNERMEDIA HLDGS INC	100,000.00	89,216.73	
WARNERMEDIA HOLDINGS INC	100,000.00	98,031.06	
WARNERMEDIA HOLDINGS INC	300,000.00	285,009.78	
WASTE CONNECTIONS INC	50,000.00	44,348.94	
WASTE CONNECTIONS INC	50,000.00	44,002.10	
WASTE MANAGEMENT INC	50,000.00	50,328.72	
WASTE MANAGEMENT INC	50,000.00	43,716.33	
WASTE MANAGEMENT INC	50,000.00	48,818.59	
WEC ENERGY GROUP INC	50,000.00	49,805.21	
WEC ENERGY GROUP INC	70,000.00	62,041.23	
WELLS FARGO & COMPANY	50,000.00	48,776.03	
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	98,765.06	

WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	95,478.84
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	97,577.82
WELLS FARGO & COMPANY	300,000.00	285,209.25
WELLS FARGO & COMPANY	200,000.00	190,194.00
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	98,645.33
WELLS FARGO & COMPANY	400,000.00	405,363.04
WELLS FARGO & COMPANY	200,000.00	172,182.00
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	96,117.13
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	86,939.97
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	96,750.88
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	99,668.17
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	100,737.64
WELLS FARGO BANK NA	250,000.00	252,423.20
WELLTOWER INC	100,000.00	98,255.96
WELLTOWER INC	100,000.00	84,241.70
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	100,000.00	97,864.55
WESTLAKE CORP	50,000.00	48,172.61
WESTPAC BANKING CORP	200,000.00	184,302.14
WESTPAC BANKING CORP	100,000.00	101,986.14
WESTPAC BANKING CORP	140,000.00	125,192.41
WESTPAC BANKING CORP	150,000.00	144,365.20
WESTPAC BANKING CORP	100,000.00	81,984.87
WEYERHAEUSER CO	50,000.00	47,262.39
WEYERHAEUSER CO	50,000.00	47,179.25
WHIRLPOOL CORP	50,000.00	41,495.62
WILLIAMS COMPANIES INC	100,000.00	98,147.60
WILLIAMS COMPANIES INC	50,000.00	47,996.40
WILLIAMS COMPANIES INC	50,000.00	45,626.60
WILLIAMS COMPANIES INC	50,000.00	42,581.29
WILLIS NORTH AMERICA INC	50,000.00	49,225.35
WILLIS NORTH AMERICA INC	30,000.00	26,855.84
WISCONSIN ELECTRIC POWER	50,000.00	49,552.68
WISCONSIN POWER & LIGHT	50,000.00	46,152.71
WORKDAY INC	100,000.00	94,237.16
WP CAREY INC	50,000.00	41,551.19
WRKCO INC	100,000.00	96,225.80
WRKCO INC	50,000.00	47,552.30
XCEL ENERGY INC	100,000.00	88,930.49
XCEL ENERGY INC	100,000.00	80,129.48
XILINX INC	50,000.00	43,432.31
XYLEM INC	30,000.00	27,022.77
YALE UNIVERSITY	50,000.00	42,124.74
ZIMMER BIOMET HOLDINGS	50,000.00	42,362.49

		ZOETIS INC	80,000.00	75,011.76	
	小計	銘柄数：1,209	116,074,000.00	108,761,133.23 (16,207,584,073)	
		組入時価比率：98.7%		100.0%	
	合計			16,207,584,073 (16,207,584,073)	

(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	2024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	142,872,639	-	141,543,920	1,328,719
米ドル	142,872,639	-	141,543,920	1,328,719
合計	142,872,639	-	141,543,920	1,328,719

(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。

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。

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

2024年3月29日現在

資産総額	31,159,974,635円
負債総額	15,613,846,606円
純資産総額（ - ）	15,546,128,029円
発行済口数	19,250,000口
1口当たり純資産額（ / ）	807.59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

2024年3月29日現在

資産総額	17,200,676,054円
負債総額	242,193,600円
純資産総額（ - ）	16,958,482,454円

発行済口数	10,481,094,553口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6180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

2024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。

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2024年3月29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	999	54,367,722
単位型株式投資信託	170	648,033
追加型公社債投資信託	14	7,027,080
単位型公社債投資信託	445	870,253
合計	1,628	62,913,087

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(2022年4月1日から2023年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2023年4月1日から2023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

区分	注記 番号	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		2,006	1,865
金銭の信託		35,894	42,108
有価証券		29,300	21,900
前払金		11	11
前払費用		454	775
未収入金		694	1,775
未収委託者報酬		27,176	26,116
未収運用受託報酬		4,002	3,780
短期貸付金		1,835	1,001
未収還付法人税等		-	2,083
その他		57	84
貸倒引当金		15	15
流動資産計		101,417	101,486
固定資産			
有形固定資産		1,744	1,335
建物	2	1,219	906
器具備品	2	525	428
無形固定資産		5,210	5,563
ソフトウェア		5,209	5,562
その他		0	0
投資その他の資産		16,067	16,336
投資有価証券		2,201	1,793
関係会社株式		9,214	10,025
長期差入保証金		443	520
長期前払費用		13	10
前払年金費用		1,297	1,553
繰延税金資産		2,784	2,340
その他		112	92
固定資産計		23,023	23,235
資産合計		124,440	124,722

区分	注記 番号	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(負債の部)			
流動負債			

預り金			120		124
未払金			17,615		17,879
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		17		57	
未払手数料		8,357		8,409	
関係会社未払金		8,149		8,911	
その他未払金		1,089		500	
未払費用	1		9,512		9,682
未払法人税等			1,319		1,024
前受収益			22		22
賞与引当金			4,416		3,635
その他			121		46
流動負債計			33,127		32,414
固定負債					
退職給付引当金			3,194		2,940
時効後支払損引当金			588		595
資産除去債務			1,123		1,123
固定負債計			4,905		4,659
負債合計			38,033		37,074
(純資産の部)					
株主資本			86,232		87,419
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			55,322		56,509
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		54,637		55,823	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,030		31,217	
評価・換算差額等			174		229
その他有価証券評価差額金			174		229
純資産合計			86,407		87,648
負債・純資産合計			124,440		124,722

(2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			115,733		113,491
運用受託報酬			17,671		18,198
その他営業収益			530		331
営業収益計			133,935		132,021
営業費用					
支払手数料			39,087		38,684
広告宣伝費			804		1,187
公告費			0		0
調査費			26,650		29,050

調査費		4,867		6,045	
委託調査費		21,783		23,004	
委託計算費			1,384		1,363
営業雑経費			3,094		3,302
通信費		72		89	
印刷費		918		903	
協会費		79		83	
諸経費		2,023		2,225	
営業費用計			71,021		73,587
一般管理費					
給料			12,033		11,316
役員報酬		229		226	
給料・手当		7,375		7,752	
賞与		4,427		3,337	
交際費			47		78
寄付金			73		115
旅費交通費			65		283
租税公課			1,049		963
不動産賃借料			1,432		1,232
退職給付費用			1,212		829
固定資産減価償却費			2,525		2,409
諸経費			11,116		12,439
一般管理費計			29,556		29,669
営業利益			33,357		28,763

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	3,530		7,645	
受取利息		10		45	
為替差益		-		49	
その他		1,268		637	
営業外収益計			4,809		8,377
営業外費用					
金銭の信託運用損		1,387		1,736	
時効後支払損引当金繰入額		12		10	
為替差損		23		-	
その他		266		8	
営業外費用計			1,689		1,755
経常利益			36,477		35,385
特別利益					
投資有価証券等売却益		26		10	
株式報酬受入益		53		46	
固定資産売却益		9		-	
資産除去債務履行差額		141		-	

特別利益計			230		57
特別損失					
投資有価証券等売却損		0		16	
関係会社株式評価損		727		-	
固定資産除却損	2	374		52	
資産除去債務履行差額		0		-	
事務所移転費用		54		-	
特別損失計			1,158		69
税引前当期純利益			35,549		35,374
法人税、住民税及び事業税			10,474		8,890
法人税等調整額			171		419
当期純利益			24,904		26,064

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金	別途積立金		
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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 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	30,030	55,322	86,232
当期変動額									
剰余金の配当							24,877	24,877	24,877
当期純利益							26,064	26,064	26,064
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,186	1,186	1,186
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,217	56,509	87,419

(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
当期変動額			
剰余金の配当			24,877
当期純利益			26,064
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	54	54	54
当期変動額合計	54	54	1,240
当期末残高	229	229	87,648

[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
--------------------	-----------------------------------

	<p>(2) その他有価証券 市場価格のない ... 時価法 株式等以外のもの (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) 市場価格のない ... 移動平均法による原価法 株式等</p>						
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	<p>(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。</p> <table data-bbox="687 775 1042 864"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(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。</p>	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
建物	6年						
附属設備	6～15年						
器具備品	4～15年						
6. 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。 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。 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。</p> <p>(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。</p>						

7. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p> <p>委託者報酬</p> <p>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。</p> <p>運用受託報酬</p> <p>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。</p> <p>成功報酬</p> <p>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。</p>
----------------	---

[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]

（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。）を当事業年度の期首から適用し、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。

これにより、「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。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27 - 3項に従って、前事業年度に係るものについては記載していません。

[未適用の会計基準等]

該当事項はありません。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2022年3月31日)	当事業年度末 (2023年3月31日)
------------------------	------------------------

<p>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。</p> <p>未払費用 1,223百万円</p>	<p>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。</p> <p>未払費用 1,350百万円</p>
<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <p>建物 589百万円</p> <p>器具備品 618</p> <hr/> <p>合計 1,207</p>	<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <p>建物 901百万円</p> <p>器具備品 657</p> <hr/> <p>合計 1,559</p>

損益計算書関係

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
<p>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。</p> <p>受取配当金 3,525百万円</p>	<p>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。</p> <p>受取配当金 7,634百万円</p>
<p>2. 固定資産除却損</p> <p>建物 346百万円</p> <p>器具備品 28</p> <p>ソフトウェア -</p> <hr/> <p>合計 374</p>	<p>2. 固定資産除却損</p> <p>建物 0百万円</p> <p>器具備品 0</p> <p>ソフトウェア 52</p> <hr/> <p>合計 52</p>

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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

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

(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

2023年5月23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 55,782百万円
配当の原資 利益剰余金
1株当たり配当額 10,830円
基準日 2023年3月31日
効力発生日 2023年6月30日

金融商品関係

前事業年度(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、自ら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せんが、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。

	前事業年度（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、前事業年度において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）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。

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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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

2023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	42,108	42,108	-
資産計	42,108	42,108	-
(2)その他（デリバティブ取引）	46	46	-
負債計	46	46	-

(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（ ）	10,261
組合出資金等	1,557
合計	11,819

（ ）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。

- (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	1,865	-	-	-
金銭の信託	42,108	-	-	-
未収委託者報酬	26,116	-	-	-
未収運用受託報酬	3,780	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	21,900	-	-	-
短期貸付金	1,001			
合計	96,772	-	-	-

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）	-	42,108	-	42,108
資産計	-	42,108	-	42,108
デリバティブ取引（通貨関連）	-	46	-	46
負債計	-	46	-	46

- (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

前事業年度（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	前事業年度 (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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1．売買目的有価証券(2023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(2023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(2023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	9,919
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2023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	21,900	21,900	-
小計	21,900	21,900	-
合計	21,900	21,900	-

市場価格のない株式等（貸借対照表計上額235百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,557百万円）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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	66	-	16
合計	66	-	16

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 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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	952	-	46	46

退職給付関係

前事業年度(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业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

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%

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	2.35%

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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	21,967 百万円
勤務費用	853
利息費用	188
数理計算上の差異の発生額	1,476
退職給付の支払額	1,133
その他	83
退職給付債務の期末残高	20,314

(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	19,687 百万円
期待運用収益	462
数理計算上の差異の発生額	716
事業主からの拠出額	819
退職給付の支払額	874
年金資産の期末残高	19,378

(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	17,386 百万円
年金資産	19,378
	1,991
非積立型制度の退職給付債務	2,927
未積立退職給付債務	935
未認識数理計算上の差異	398
未認識過去勤務費用	53
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,387
退職給付引当金	2,940
前払年金費用	1,553
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,387

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	853 百万円
利息費用	188
期待運用収益	462
数理計算上の差異の費用処理額	127
過去勤務費用の費用処理額	52
確定給付制度に係る退職給付費用	653

(5) 年金資産に関する事項

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	34%
株式	27%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	21%
合計	100%

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

確定給付型企业年金制度の割引率	1.4%
退職一時金制度の割引率	1.1%
長期期待運用収益率	2.35%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

税効果会計関係

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

前事業年度末 (2022年3月31日)	当事業年度末 (2023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		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	
	百万円		百万円
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	1,381	賞与引当金	1,138
退職給付引当金	990	退職給付引当金	911
関係会社株式評価減	1,010	関係会社株式評価減	1,010
未払事業税	285	未払事業税	227
投資有価証券評価減	110	投資有価証券評価減	11
減価償却超過額	272	減価償却超過額	331
時効後支払損引当金	182	時効後支払損引当金	184
関係会社株式売却損	505	関係会社株式売却損	505
ゴルフ会員権評価減	92	ゴルフ会員権評価減	78
資産除去債務	348	資産除去債務	348
未払社会保険料	114	未払社会保険料	85
その他	84	その他	44
繰延税金資産小計	5,376	繰延税金資産小計	4,878
評価性引当額	1,795	評価性引当額	1,696
繰延税金資産合計	3,581	繰延税金資産合計	3,181
繰延税金負債		繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	233	資産除去債務に対応する除去費用	171
関係会社株式評価益	81	関係会社株式評価益	84
その他有価証券評価差額金	78	その他有価証券評価差額金	102
前払年金費用	402	前払年金費用	481
繰延税金負債合計	796	繰延税金負債合計	840
繰延税金資産の純額	2,784	繰延税金資産の純額	2,340
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		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%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.4%
タックスヘイブン税制	1.8%	タックスヘイブン税制	2.1%
外国税額控除	0.5%	外国税額控除	0.6%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.4%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%
その他	0.1%	その他	0.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.3%

2. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

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	当事業年度
	自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
期首残高	1,371	1,123
有形固定資産の取得に伴う増加	48	-
資産除去債務の履行による減少	296	-
期末残高	1,123	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

前事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

区分	前事業年度 (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。

当事業年度（自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）

区分	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
委託者報酬	113,491百万円
運用受託報酬	17,245百万円
成功報酬（注）	952百万円
その他営業収益	331百万円
合計	132,021百万円

(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 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

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。

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 2022年4月1日 至 2023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

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。

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 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 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	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	野村証券株式会社	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上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(株) (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 2022年4月1日 至 2023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	5,736	短期貸付 金	1,001
							資金の返済	6,489		
							貸付金利息	44	未収利息	11

(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	野村証券株式会社	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)	27,180	未払手 数 料	5,773

(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(株)(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,775円81銭	1株当たり純資産額	17,016円74銭
1株当たり当期純利益	4,835円10銭	1株当たり当期純利益	5,060円34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。		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		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	損益計算書上の当期純利益	26,064百万円
普通株式に係る当期純利益	24,904百万円	普通株式に係る当期純利益	26,064百万円
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	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

		2023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		7,755
金銭の信託		42,741
未収委託者報酬		28,981
未収運用受託報酬		5,565
短期貸付金		747
その他		1,398
貸倒引当金		17
流動資産計		87,173
固定資産		
有形固定資産	1	1,140
無形固定資産		5,519
ソフトウェア		5,518
その他		0
投資その他の資産		16,784
投資有価証券		1,862
関係会社株式		10,025
長期差入保証金		519
前払年金費用		1,721
繰延税金資産		1,761
その他		893
固定資産計		23,444
資産合計		110,617

		2023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		
短期借入金		29,900
未払金		12,829
未払収益分配金		1
未払償還金		40
未払手数料		9,305
関係会社未払金		2,395
その他未払金	2	1,085
未払費用		10,122
未払法人税等		2,521
賞与引当金		1,993
その他		201
流動負債計		57,568
固定負債		
退職給付引当金		2,855
時効後支払損引当金		601
資産除去債務		1,123
固定負債計		4,579
負債合計		62,148
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		48,142
		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		17,232
利益準備金		685
その他利益剰余金		16,547
繰越利益剰余金		16,547
評価・換算差額等		325
その他有価証券評価差額金		325
純資産合計		48,468
負債・純資産合計		110,617

中間損益計算書

区分	注記 番号	自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日 金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		59,892
運用受託報酬		10,062
その他営業収益		156
営業収益計		70,111
営業費用		
支払手数料		20,743
調査費		15,670
その他営業費用		2,845
営業費用計		39,259
一般管理費	1	15,475
営業利益		15,376
営業外収益	2	7,161
営業外費用	3	715
経常利益		21,822
特別利益	4	11
特別損失	5	10
税引前中間純利益		21,823
法人税、住民税及び事業税		4,781
法人税等調整額		536
中間純利益		16,505

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	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		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	31,217	56,509	87,419
当中間期変動額									
剰余金の配当							55,782	55,782	55,782
中間純利益							16,505	16,505	16,505
別途積立金の取崩						24,606	24,606	-	-
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	-	-	-	-	-	24,606	14,669	39,276	39,276
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	-	16,547	17,232	48,142

（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	229	229	87,648
当中間期変動額			
剰余金の配当			55,782
中間純利益			16,505
別途積立金の取崩			-
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	96	96	96
当中間期変動額合計	96	96	39,179
当中間期末残高	325	325	48,468

[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 ... 時価法 株式等以外のもの (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) 市場価格のない ... 移動平均法による原価法 株式等						
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。 <table border="1"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table>	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
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业年金について、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。 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。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业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业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	<p>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。</p> <p>委託者報酬</p> <p>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。</p> <p>運用受託報酬</p> <p>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。</p> <p>成功報酬</p> <p>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。</p>
----------------	---

[注記事項]

中間貸借対照表関係

2023年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,754百万円
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 2023年4月 1日 至 2023年9月30日	
1 減価償却実施額 有形固定資産 無形固定資産	196百万円 958百万円
2 営業外収益のうち主要なもの 受取配当金	6,692百万円
3 営業外費用のうち主要なもの 金銭の信託運用損	627百万円
4 特別利益の内訳 株式報酬受入益	11百万円
5 特別損失の内訳 固定資産除却損	10百万円

中間株主資本等変動計算書関係

		自 2023年4月 1日			
		至 2023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					
2023年5月23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		55,782百万円		
	(2) 1株当たり配当額		10,830円		
	(3) 基準日		2023年3月31日		
	(4) 効力発生日		2023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

2023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	42,741	42,741	-
資産計	42,741	42,741	-
(2) その他（デリバティブ取引）	60	60	-
負債計	60	60	-

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期貸付金、短期借入金、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（ ）	10,266
組合出資金等	1,621
合計	11,888

() 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。

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）	-	42,741	-	42,741
資産計	-	42,741	-	42,741
デリバティブ取引（通貨関連）	-	60	-	60
負債計	-	60	-	60

（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の時価に分類してあります。

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あり、レベル2の時価に分類してあります。

有価証券関係

当中間会計期間末（2023年9月30日）

1．売買目的有価証券(2023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(2023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(2023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(2023年9月30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

当中間会計期間（2023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	684	-	60	60

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 2023年4月 1日 至 2023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2023年4月 1日 至2023年9月30日)
委託者報酬	59,884百万円
運用受託報酬	9,422百万円
成功報酬(注)	646百万円
その他営業収益	156百万円
合計	70,111百万円

(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せん。

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 2023年4月1日 至 2023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

営業収益

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。

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識別されていないため、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 2023年4月 1日 至 2023年9月30日
1株当たり純資産額	9,410円05銭
1株当たり中間純利益	3,204円61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、記載していません。	
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	16,505百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	16,505百万円
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	50,000百万円	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。

* 2024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	5,505百万円	
S M B C 日興証券株式会社	135,000百万円	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	
パークレイズ証券株式会社	38,945百万円	
B N P パリバ証券株式会社	102,025百万円	
B o f A 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 U F J モルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	

* 2024年3月末現在

3 資本関係

< 訂正前 >

(2023年3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。

< 訂正後 >

(2023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

2024年5月17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2023年9月8日から2024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2024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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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

2023年6月9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 公認会計士 湯原 尚
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 水永 真太郎
業務執行社員

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2023年3月31日現在の財政状態及び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、継続企業的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

2023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2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023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（2023年4月1日から2023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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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。