



2025 年 9 月期 (2025 年 3 月 8 日～2025 年 9 月 7 日) 決算短信  
Earnings Report for Fiscal Period ended September 2025 (March 8, 2025 – September 7, 2025)

2025 年 10 月 17 日  
October 17, 2025

|         |                                                     |                                                                           |
|---------|-----------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|
|         | 上場取引所                                               | 東証                                                                        |
|         | Listed Exchange                                     | TSE                                                                       |
| ファンド名   | NEXT FUNDS ブルームバーク米国国債(7-10年)インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信 |                                                                           |
| コード番号   | ( 2647 )                                            |                                                                           |
| 連動対象指標  | ブルームバーク米国国債(7-10 年)インデックス TTM(為替ヘッジなし、円ベース)         |                                                                           |
| 主要投資資産  | 公社債                                                 |                                                                           |
| 売買単位    | 10 口                                                |                                                                           |
| 管理会社    | 野村アセットマネジメント株式会社                                    | URL <a href="https://www.nomura-am.co.jp">https://www.nomura-am.co.jp</a> |
| 代表者名    | CEO 兼代表取締役社長 小池 広靖                                  |                                                                           |
| 問合せ先責任者 | サポートダイヤル 長坂 智                                       | TEL 0120-753104                                                           |

|                          |                                                                                         |                                                                           |
|--------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|
| Fund name:               | NEXT FUNDS Bloomberg US Treasury Bond (7-10 year) Index (Unhedged) Exchange Traded Fund |                                                                           |
| Code:                    | 2647                                                                                    |                                                                           |
| Underlying index:        | Bloomberg U.S. Treasury 7-10 Year Index TTM JPY Currency Unhedged                       |                                                                           |
| Primary invested assets: | Public and corporate bonds                                                              |                                                                           |
| Trading unit:            | 10 units                                                                                |                                                                           |
| Management co.:          | Nomura Asset Management Co., Ltd.                                                       | URL <a href="https://www.nomura-am.co.jp">https://www.nomura-am.co.jp</a> |
| Representative:          | Hiroyasu Koike, President & CEO                                                         |                                                                           |
| Contact person:          | Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team                                             |                                                                           |

有価証券報告書提出予定日 2025 年 11 月 25 日  
分配金支払開始日 2025 年 10 月 16 日  
Scheduled date of submission of securities report: November 25, 2025  
Date of commencing dividend payment: October 16, 2025

## I ファンドの運用状況

### Fund Management

#### 1. 2025 年 9 月期の運用状況 (2025 年 3 月 8 日～2025 年 9 月 7 日)

Management Status for Period ended September 2025 (from March 8, 2025 to September 7, 2025)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

Assets (fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

|                                   | 主要投資資産                  |              | 現金・預金・その他の資産<br>(負債控除後)                               |              | 合計 (純資産)           |              |
|-----------------------------------|-------------------------|--------------|-------------------------------------------------------|--------------|--------------------|--------------|
|                                   | Primary Invested Assets |              | Cash/Deposits/Other Assets<br>(excluding liabilities) |              | Total (Net Assets) |              |
|                                   | 金額<br>Amount            | 構成比<br>ratio | 金額<br>Amount                                          | 構成比<br>ratio | 金額<br>Amount       | 構成比<br>ratio |
|                                   | 百万円<br>JPY mil.         | %            | 百万円<br>JPY mil.                                       | %            | 百万円<br>JPY mil.    | %            |
| 2025 年 9 月期<br>FY ended Sep. 2025 | 15,578                  | (98.9)       | 174                                                   | (1.1)        | 15,752             | (100.0)      |
| 2025 年 3 月期<br>FY ended Mar. 2025 | 17,298                  | (105.8)      | △950                                                  | (△5.8)       | 16,348             | (100.0)      |

(2) 設定・解約実績

(千口未満切捨て)

Creation and Redemption

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

|                                   | 前特定期間末<br>発行済口数<br>No. of Issued Units<br>at End of Previous<br>Fiscal Period<br>(①) | 設定口数<br>No. of Units Created<br>(②) | 解約口数<br>No. of Units<br>Redeemed<br>(③) | 当特定期間末<br>発行済口数<br>No. of Issued Units<br>at End of Fiscal<br>Period<br>(①+②-③) |
|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
|                                   | 千口<br>'000 units                                                                     | 千口<br>'000 units                    | 千口<br>'000 units                        | 千口<br>'000 units                                                                |
| 2025 年 9 月期<br>FY ended Sep. 2025 | 2,966                                                                                | 908                                 | 1,074                                   | 2,800                                                                           |
| 2025 年 3 月期<br>FY ended Mar. 2025 | 1,536                                                                                | 2,202                               | 772                                     | 2,966                                                                           |

(3) 基準価額

Net Asset Value

|                                   | 総資産<br>Total Assets<br>(①) | 負債<br>Liabilities<br>(②) | 純資産<br>Net Assets<br>(③(①-②)) | 10 口当り基準価額<br>((③/当特定期間末発行済口数)×10)<br>Net Asset Value per 10 units<br>((③/No. of Issued Units at End of Fiscal<br>Period)×10) |
|-----------------------------------|----------------------------|--------------------------|-------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                   | 百万円<br>JPY mil.            | 百万円<br>JPY mil.          | 百万円<br>JPY mil.               | 円<br>JPY                                                                                                                      |
| 2025 年 9 月期<br>FY ended Sep. 2025 | 15,916                     | 163                      | 15,752                        | 56,259                                                                                                                        |
| 2025 年 3 月期<br>FY ended Mar. 2025 | 17,459                     | 1,111                    | 16,348                        | 55,121                                                                                                                        |

(4) 分配金

Dividend Payment

|                                   | 10 口当り分配金<br>Dividend per 10 units |
|-----------------------------------|------------------------------------|
|                                   | 円<br>JPY                           |
| 2025 年 9 月期<br>FY ended Sep. 2025 | 559                                |
| 2025 年 3 月期<br>FY ended Mar. 2025 | 488                                |

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

① 会計基準等の改正に伴う変更

無

Changes accompanying revision to accounting standards, etc.

No

② ①以外の変更

無

Changes other than those in ①

No

## II 財務諸表等 Financial Statements

### (1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit：JPY)

|                                                     | 前期<br>(2025 年 3 月 7 日現在)<br>Prior period<br>As of March 7, 2025 | 当期<br>(2025 年 9 月 7 日現在)<br>Present period<br>As of September 7, 2025 |
|-----------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|
|                                                     | 金額 Amount                                                       | 金額 Amount                                                             |
| 資産の部<br>Assets                                      |                                                                 |                                                                       |
| 流動資産<br>Current assets                              |                                                                 |                                                                       |
| 預金<br>Deposits                                      | 22,565,704                                                      | 21,967,362                                                            |
| 金銭信託<br>Money trusts                                | —                                                               | 3,343                                                                 |
| コール・ローン<br>Call loans                               | 12,492,801                                                      | 14,151,254                                                            |
| 国債証券<br>Government bonds                            | 17,298,876,548                                                  | 15,578,425,369                                                        |
| 派生商品評価勘定<br>Revaluation of derivatives              | 10,496                                                          | —                                                                     |
| 未収入金<br>Accounts receivable - other                 | —                                                               | 169,199,682                                                           |
| 未収利息<br>Accrued interest                            | 101,792,998                                                     | 96,869,623                                                            |
| 前払費用<br>Prepaid expenses                            | 21,485,259                                                      | 33,031,409                                                            |
| その他未収収益<br>Other accrued revenue                    | 915,132                                                         | 549,720                                                               |
| 差入委託証拠金<br>Margin deposits                          | 1,838,714                                                       | 1,874,864                                                             |
| 流動資産合計<br>Total current assets                      | 17,459,977,652                                                  | 15,916,072,626                                                        |
| 資産合計<br>Total assets                                | 17,459,977,652                                                  | 15,916,072,626                                                        |
| 負債の部<br>Liabilities                                 |                                                                 |                                                                       |
| 流動負債<br>Current liabilities                         |                                                                 |                                                                       |
| 派生商品評価勘定<br>Revaluation of derivatives              | —                                                               | 6,102                                                                 |
| 未払金<br>Accounts payable - other                     | 959,311,770                                                     | —                                                                     |
| 未払収益分配金<br>Unpaid dividends                         | 144,740,800                                                     | 156,520,000                                                           |
| 未払受託者報酬<br>Trustee fees payable                     | 1,148,746                                                       | 1,096,247                                                             |
| 未払委託者報酬<br>Investment trust management fees payable | 4,824,708                                                       | 4,604,207                                                             |

|                                                        |                   |                   |
|--------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| その他未払費用<br>Other accrued expenses                      | 1, 141, 536       | 1, 254, 020       |
| 流動負債合計<br>Total current liabilities                    | 1, 111, 167, 560  | 163, 480, 576     |
| 負債合計<br>Total liabilities                              | 1, 111, 167, 560  | 163, 480, 576     |
| 純資産の部<br>Net assets                                    |                   |                   |
| 元本等<br>Principal and other                             |                   |                   |
| 元本<br>Principal                                        | 14, 830, 000, 000 | 14, 000, 000, 000 |
| 剰余金<br>Surplus                                         |                   |                   |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△)<br>Surplus (deficit) at end of period | 1, 518, 810, 092  | 1, 752, 592, 050  |
| (分配準備積立金)<br>(Reserve for distribution)                | 4, 917            | 202, 712          |
| 元本等合計<br>Total principal and other                     | 16, 348, 810, 092 | 15, 752, 592, 050 |
| 純資産合計<br>Total net assets                              | 16, 348, 810, 092 | 15, 752, 592, 050 |
| 負債純資産合計<br>Total liabilities and net assets            | 17, 459, 977, 652 | 15, 916, 072, 626 |

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

(単位：円) (Unit：JPY)

|                                                                               | 前期<br>自 2024 年 9 月 8 日<br>至 2025 年 3 月 7 日<br>Prior period<br>From September 8, 2024<br>to March 7, 2025 | 当期<br>自 2025 年 3 月 8 日<br>至 2025 年 9 月 7 日<br>Present period<br>From March 8, 2025<br>to September 7, 2025 |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                               | 金額 Amount                                                                                                | 金額 Amount                                                                                                  |
| 営業収益<br>Operating revenue                                                     |                                                                                                          |                                                                                                            |
| 受取利息<br>Interest income                                                       | 240, 285, 107                                                                                            | 329, 314, 488                                                                                              |
| 有価証券売買等損益<br>Profit and loss on buying and selling of<br>securities and other | △226, 922, 729                                                                                           | 313, 677, 214                                                                                              |
| 為替差損益<br>Foreign exchange gains or losses                                     | △124, 457, 462                                                                                           | 54, 356, 949                                                                                               |
| その他収益<br>Other revenue                                                        | 648, 979                                                                                                 | 1, 126, 164                                                                                                |
| 営業収益合計<br>Total operating revenue                                             | △110, 446, 105                                                                                           | 698, 474, 815                                                                                              |
| 営業費用<br>Operating expenses                                                    |                                                                                                          |                                                                                                            |
| 受託者報酬<br>Trustee fees                                                         | 1, 845, 544                                                                                              | 2, 271, 352                                                                                                |
| 委託者報酬<br>Investment trust management fees                                     | 7, 751, 232                                                                                              | 9, 539, 608                                                                                                |
| その他費用                                                                         | 2, 736, 830                                                                                              | 2, 175, 497                                                                                                |

|                                                                                                                |               |               |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|
| Other expenses                                                                                                 |               |               |
| 営業費用合計<br>Total operating expenses                                                                             | 12,333,606    | 13,986,457    |
| 営業利益又は営業損失 (△)<br>Operating profit (loss)                                                                      | △122,779,711  | 684,488,358   |
| 経常利益又は経常損失 (△)<br>Ordinary profit (loss)                                                                       | △122,779,711  | 684,488,358   |
| 当期純利益又は当期純損失 (△)<br>Profit (loss)                                                                              | △122,779,711  | 684,488,358   |
| 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 (△)<br>Distribution of profit loss from partial redemptions             | -             | -             |
| 期首剰余金又は期首欠損金 (△)<br>Surplus (deficit) at beginning of period                                                   | 789,167,803   | 1,518,810,092 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額<br>Increase in surplus or decrease in deficit                                                   | 1,587,966,400 | 434,130,000   |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額<br>Increase in surplus or decrease in deficit from additional subscriptions for period | 1,587,966,400 | 434,130,000   |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額<br>Decrease in surplus or increase in deficit                                                   | 506,867,400   | 568,580,000   |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額<br>Decrease in surplus or increase in deficit from partial redemptions                 | 506,867,400   | 568,580,000   |
| 分配金<br>Dividends                                                                                               | 228,677,000   | 316,256,400   |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△)<br>Surplus (deficit) at end of period                                                         | 1,518,810,092 | 1,752,592,050 |

### (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     | 国債証券<br>原則として時価で評価しております。<br>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。<br>為替予約取引<br>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、わが国における特定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<br>約定日基準で計上しております。<br>為替差損益<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 |
| 5. その他                 | 当該財務諸表の特定期間は、2025 年 3 月 8 日から 2025 年 9 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<br>2025 年 3 月 7 日現在                                                           | 当期<br>2025 年 9 月 7 日現在                                                           |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 特定期間の末日における受益権の総数<br>2,966,000 口                                              | 1. 特定期間の末日における受益権の総数<br>2,800,000 口                                              |
| 2. 特定期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額<br>1 口当たり純資産額 5,512.1 円<br>(10 口当たり純資産額) (55,121 円) | 2. 特定期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額<br>1 口当たり純資産額 5,625.9 円<br>(10 口当たり純資産額) (56,259 円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前期<br>自 2024 年 9 月 8 日<br>至 2025 年 3 月 7 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 当期<br>自 2025 年 3 月 8 日<br>至 2025 年 9 月 7 日       |               |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------|---------------|--|----------|---|---------------|---------|---|-----------|----------|-------|---------------|----|---|-------------|---------|-------|---------------|-------|---|---------------|----------------|-------|-----------|----|---|-------------|------------|----------|-------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|----------|---|---------------|---------|---|-----------|----------|-------|---------------|----|---|-------------|---------|-------|---------------|-------|---|---------------|----------------|-------|-----------|----|---|-------------|------------|----------|-------|
| 1. 分配金の計算過程<br>2024 年 9 月 8 日から 2024 年 12 月 7 日まで                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 1. 分配金の計算過程<br>2025 年 3 月 8 日から 2025 年 6 月 7 日まで |               |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>88,419,320 円</td></tr><tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>81,437 円</td></tr><tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>88,500,757 円</td></tr><tr><td>経費</td><td>D</td><td>4,278,705 円</td></tr><tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>84,222,052 円</td></tr><tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>83,936,200 円</td></tr><tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>285,852 円</td></tr><tr><td>口数</td><td>H</td><td>3,266,000 口</td></tr><tr><td>10 口当たり分配金</td><td>I=F/H×10</td><td>257 円</td></tr></table>    | 項目                                               |               |  | 当期配当等収益額 | A | 88,419,320 円  | 分配準備積立金 | B | 81,437 円  | 配当等収益合計額 | C=A+B | 88,500,757 円  | 経費 | D | 4,278,705 円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 84,222,052 円  | 収益分配金 | F | 83,936,200 円  | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 285,852 円 | 口数 | H | 3,266,000 口 | 10 口当たり分配金 | I=F/H×10 | 257 円 | <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>167,236,476 円</td></tr><tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>4,917 円</td></tr><tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>167,241,393 円</td></tr><tr><td>経費</td><td>D</td><td>7,206,336 円</td></tr><tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>160,035,057 円</td></tr><tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>159,736,400 円</td></tr><tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>298,657 円</td></tr><tr><td>口数</td><td>H</td><td>3,182,000 口</td></tr><tr><td>10 口当たり分配金</td><td>I=F/H×10</td><td>502 円</td></tr></table>   | 項目 |  |  | 当期配当等収益額 | A | 167,236,476 円 | 分配準備積立金 | B | 4,917 円   | 配当等収益合計額 | C=A+B | 167,241,393 円 | 経費 | D | 7,206,336 円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 160,035,057 円 | 収益分配金 | F | 159,736,400 円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 298,657 円 | 口数 | H | 3,182,000 口 | 10 口当たり分配金 | I=F/H×10 | 502 円 |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                  |               |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 当期配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | A                                                | 88,419,320 円  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 分配準備積立金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | B                                                | 81,437 円      |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 配当等収益合計額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | C=A+B                                            | 88,500,757 円  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 経費                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | D                                                | 4,278,705 円   |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 収益分配可能額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | E=C-D                                            | 84,222,052 円  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 収益分配金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | F                                                | 83,936,200 円  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 次期繰越金(分配準備積立金)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | G=E-F                                            | 285,852 円     |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | H                                                | 3,266,000 口   |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 10 口当たり分配金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | I=F/H×10                                         | 257 円         |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                  |               |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 当期配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | A                                                | 167,236,476 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 分配準備積立金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | B                                                | 4,917 円       |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 配当等収益合計額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | C=A+B                                            | 167,241,393 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 経費                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | D                                                | 7,206,336 円   |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 収益分配可能額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | E=C-D                                            | 160,035,057 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 収益分配金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | F                                                | 159,736,400 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 次期繰越金(分配準備積立金)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | G=E-F                                            | 298,657 円     |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | H                                                | 3,182,000 口   |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 10 口当たり分配金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | I=F/H×10                                         | 502 円         |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 2024 年 12 月 8 日から 2025 年 3 月 7 日まで                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 2025 年 6 月 8 日から 2025 年 9 月 7 日まで                |               |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>152,514,766 円</td></tr><tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>285,852 円</td></tr><tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>152,800,618 円</td></tr><tr><td>経費</td><td>D</td><td>8,054,901 円</td></tr><tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>144,745,717 円</td></tr><tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>144,740,800 円</td></tr><tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>4,917 円</td></tr><tr><td>口数</td><td>H</td><td>2,966,000 口</td></tr><tr><td>10 口当たり分配金</td><td>I=F/H×10</td><td>488 円</td></tr></table> | 項目                                               |               |  | 当期配当等収益額 | A | 152,514,766 円 | 分配準備積立金 | B | 285,852 円 | 配当等収益合計額 | C=A+B | 152,800,618 円 | 経費 | D | 8,054,901 円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 144,745,717 円 | 収益分配金 | F | 144,740,800 円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 4,917 円   | 口数 | H | 2,966,000 口 | 10 口当たり分配金 | I=F/H×10 | 488 円 | <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>163,204,176 円</td></tr><tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>298,657 円</td></tr><tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>163,502,833 円</td></tr><tr><td>経費</td><td>D</td><td>6,780,121 円</td></tr><tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>156,722,712 円</td></tr><tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>156,520,000 円</td></tr><tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>202,712 円</td></tr><tr><td>口数</td><td>H</td><td>2,800,000 口</td></tr><tr><td>10 口当たり分配金</td><td>I=F/H×10</td><td>559 円</td></tr></table> | 項目 |  |  | 当期配当等収益額 | A | 163,204,176 円 | 分配準備積立金 | B | 298,657 円 | 配当等収益合計額 | C=A+B | 163,502,833 円 | 経費 | D | 6,780,121 円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 156,722,712 円 | 収益分配金 | F | 156,520,000 円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 202,712 円 | 口数 | H | 2,800,000 口 | 10 口当たり分配金 | I=F/H×10 | 559 円 |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                  |               |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 当期配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | A                                                | 152,514,766 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 分配準備積立金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | B                                                | 285,852 円     |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 配当等収益合計額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | C=A+B                                            | 152,800,618 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 経費                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | D                                                | 8,054,901 円   |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 収益分配可能額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | E=C-D                                            | 144,745,717 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 収益分配金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | F                                                | 144,740,800 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 次期繰越金(分配準備積立金)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | G=E-F                                            | 4,917 円       |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | H                                                | 2,966,000 口   |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 10 口当たり分配金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | I=F/H×10                                         | 488 円         |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                  |               |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 当期配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | A                                                | 163,204,176 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 分配準備積立金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | B                                                | 298,657 円     |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 配当等収益合計額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | C=A+B                                            | 163,502,833 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 経費                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | D                                                | 6,780,121 円   |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 収益分配可能額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | E=C-D                                            | 156,722,712 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 収益分配金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | F                                                | 156,520,000 円 |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 次期繰越金(分配準備積立金)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | G=E-F                                            | 202,712 円     |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | H                                                | 2,800,000 口   |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 10 口当たり分配金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | I=F/H×10                                         | 559 円         |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |
| 2. その他費用<br>その他費用のうち 1,508,253 円は、上場に係る費用であります。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 2. その他費用<br>その他費用のうち 687,385 円は、上場に係る費用であります。    |               |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |          |   |               |         |   |           |          |       |               |    |   |             |         |       |               |       |   |               |                |       |           |    |   |             |            |          |       |

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

| 前期<br>自 2024 年 9 月 8 日<br>至 2025 年 3 月 7 日                                                                                                                                                                                                                                                     | 当期<br>自 2025 年 3 月 8 日<br>至 2025 年 9 月 7 日                                 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------|
| <p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>同左</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効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| 前期<br>2025 年 3 月 7 日現在                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 当期<br>2025 年 9 月 7 日現在                                          |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>国債証券<br/>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定<br/>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<br/>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</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p> |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 前期<br>自 2024 年 9 月 8 日<br>至 2025 年 3 月 7 日                            | 当期<br>自 2025 年 3 月 8 日<br>至 2025 年 9 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<br>自 2024 年 9 月 8 日<br>至 2025 年 3 月 7 日 | 当期<br>自 2025 年 3 月 8 日<br>至 2025 年 9 月 7 日 |
|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| 期首元本額 7,680,000,000 円                      | 期首元本額 14,830,000,000 円                     |
| 期中追加設定元本額 11,010,000,000 円                 | 期中追加設定元本額 4,540,000,000 円                  |
| 期中一部解約元本額 3,860,000,000 円                  | 期中一部解約元本額 5,370,000,000 円                  |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類 | 前期<br>自 2024 年 9 月 8 日 | 当期<br>自 2025 年 3 月 8 日 |
|----|------------------------|------------------------|
|----|------------------------|------------------------|

|      | 至 2025 年 3 月 7 日 | 至 2025 年 9 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)  |
| 国債証券 | △60,346,694      | 277,236,892      |
| 合計   | △60,346,694      | 277,236,892      |

### 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(2025 年 3 月 7 日現在) |       |             |          | 当期(2025 年 9 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    |                      |       |             |          |                      |       |             |          |
| 買建        | 970,880,000          | —     | 970,890,496 | 10,496   | —                    | —     | —           | —        |
| 米ドル       | 970,880,000          | —     | 970,890,496 | 10,496   | —                    | —     | —           | —        |
| 売建        | —                    | —     | —           | —        | 167,461,706          | —     | 167,467,808 | △6,102   |
| 米ドル       | —                    | —     | —           | —        | 167,461,706          | —     | 167,467,808 | △6,102   |
| 合計        | 970,880,000          | —     | 970,890,496 | 10,496   | 167,461,706          | —     | 167,467,808 | △6,102   |

(注) 時価の算定方法

#### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

### (4) 【附属明細表】

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式(2025 年 9 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(2025 年 9 月 7 日現在)

| 種類   | 通貨  | 銘柄              | 券面総額         | 評価額          | 備考 |
|------|-----|-----------------|--------------|--------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY N/B | 8,660,000.00 | 8,789,561.37 |    |
|      |     | US TREASURY N/B | 6,690,000.00 | 6,510,467.16 |    |
|      |     | US TREASURY N/B | 6,550,000.00 | 6,306,165.75 |    |
|      |     | US TREASURY N/B | 7,360,000.00 | 7,316,300.00 |    |
|      |     | US TREASURY N/B | 7,940,000.00 | 8,224,413.17 |    |

|                                                                                                                                              |    |                 |                |                  |  |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|-----------------|----------------|------------------|--|
| NEXT FUNDS Bloomberg US Treasury Bond (V) 10 year Index (Unhedged) Exchange Traded Fund (2017) Earnings Report for Fiscal Period ended Sept. |    |                 |                |                  |  |
|                                                                                                                                              | 小計 | US TREASURY N/B | 10,410,000.00  | 10,399,426.56    |  |
|                                                                                                                                              |    | US TREASURY N/B | 10,740,000.00  | 11,000,318.24    |  |
|                                                                                                                                              |    | US TREASURY N/B | 10,360,000.00  | 10,206,016.21    |  |
|                                                                                                                                              |    | US TREASURY N/B | 11,310,000.00  | 11,439,666.88    |  |
|                                                                                                                                              |    | US TREASURY N/B | 11,040,000.00  | 11,472,112.21    |  |
|                                                                                                                                              |    | US TREASURY N/B | 11,140,000.00  | 11,232,252.55    |  |
|                                                                                                                                              |    | US TREASURY N/B | 2,170,000.00   | 2,185,427.18     |  |
|                                                                                                                                              |    | 銘柄数：12          | 104,370,000.00 | 105,082,127.28   |  |
|                                                                                                                                              |    | 組入時価比率：98.9%    |                |                  |  |
| 合計                                                                                                                                           |    |                 |                | 15,578,425,369   |  |
|                                                                                                                                              |    |                 |                | (15,578,425,369) |  |

(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

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。