



2022年9月期 (2022年3月11日～2022年9月10日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022 (March 11, 2022 – September 10, 2022)

2022年10月20日
 October 20, 2022

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信
 コード番号 (2635)
 連動対象指標 S&P 500 ESG 指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 10 口
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 代表者名 CEO 兼代表取締役社長 小池 広靖
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 長坂 智 TEL 0120-753104

Fund name: NEXT FUNDS S&P 500 ESG Index Exchange Traded Fund
 Code: 2635
 Underlying index: S&P 500 ESG Index
 Primary invested assets: Stocks
 Trading unit: 10 units
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Hiroyasu Koike, President & CEO
 Contact person: Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team

有価証券報告書提出予定日 2022年11月30日
 分配金支払開始日 2022年10月19日
 Scheduled date of submission of securities report: November 30, 2022
 Date of commencing dividend payment: October 19, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2022年9月期の運用状況 (2022年3月11日～2022年9月10日)

Management Status for Year ended September 2022 (from March 11, 2022 to September 10, 2022)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

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

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計 (純資産)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	% %	百万円 JPY mil.	% %	百万円 JPY mil.	% %
2022年9月期 FY ended Sep. 2022	5,386	(93.2)	394	(6.8)	5,781	(100.0)
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	4,698	(95.6)	215	(4.4)	4,914	(100.0)

(2) 設定・解約実績

(千口未満切捨て)

Creation and Redemption

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

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	解約口数 No. of Units Redeemed (③)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2022年9月期 FY ended Sep. 2022	2,083	560	520	2,123
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	570	2,333	820	2,083

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	100口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2022年9月期 FY ended Sep. 2022	5,819	38	5,781	272,304
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	4,951	37	4,914	235,910

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2022年9月期 FY ended Sep. 2022	1,590
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	750

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無
 Changes other than those in ① No

II 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit: JPY)

	第2期 (2022年3月10日現在) 2nd Fiscal Year As of March 10, 2022	第3期 (2022年9月10日現在) 3rd Fiscal Year As of September 10, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	162,495,926	337,666,567
コール・ローン Call loans	9,928,124	12,764,922
株式 Stocks	4,546,541,056	5,207,651,211
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	31,386,505	36,199,853
投資証券 Investment securities	120,486,532	142,659,015
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	6,894,251
未収入金 Accounts receivable - other	-	5,168,413
未収配当金 Accrued dividends receivable	5,704,760	6,094,973
差入委託証拠金 Margin deposits	74,562,353	64,787,741
流動資産合計 Total current assets	4,951,105,256	5,819,886,946
資産合計 Total assets	4,951,105,256	5,819,886,946
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	8,258,740	378,082
未払金 Accounts payable - other	10,315,377	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	15,622,500	33,755,700
未払受託者報酬 Trustee fees payable	337,942	565,915
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	1,858,609	3,112,481
未払利息	1	22

Accrued interest expenses		
その他未払費用 Other accrued expenses	699,309	1,056,570
流動負債合計 Total current liabilities	37,092,478	38,868,770
負債合計 Total liabilities	37,092,478	38,868,770
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	4,166,000,000	4,246,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	748,012,778	1,535,018,176
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	170,311	162,077
元本等合計 Total principal and other	4,914,012,778	5,781,018,176
純資産合計 Total net assets	4,914,012,778	5,781,018,176
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	4,951,105,256	5,819,886,946

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第2期 自 2021年9月11日 至 2022年3月10日 2nd Fiscal Year From September 11, 2021 to March 10, 2022	第3期 自 2022年3月11日 至 2022年9月10日 3rd Fiscal Year From March 11, 2022 to September 10, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	19,754,058	39,248,478
受取利息 Interest income	2	4
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△342,522,652	△369,260,044
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	6,185,421	△11,072,004
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	115,211,119	1,119,025,680
その他収益 Other revenue	-	183,184
営業収益合計 Total operating revenue	△201,372,052	778,125,298
営業費用 Operating expenses		

支払利息 Interest expenses	9,021	1,772
受託者報酬 Trustee fees	337,942	565,915
委託者報酬 Investment trust management fees	1,858,609	3,112,481
その他費用 Other expenses	1,763,991	2,004,032
営業費用合計 Total operating expenses	3,969,563	5,684,200
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△205,341,615	772,441,098
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△205,341,615	772,441,098
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△205,341,615	772,441,098
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△) Distribution of profit loss from partial redemptions	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△) Surplus (deficit) at beginning of period	163,971,113	748,012,778
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	1,105,711,580	357,349,000
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from additional subscriptions for period	1,105,711,580	357,349,000
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	300,705,800	309,029,000
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from partial redemptions	300,705,800	309,029,000
分配金 Dividends	15,622,500	33,755,700
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	748,012,778	1,535,018,176

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価</p>
--------------------	---

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
5. その他	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2022年3月11日から2022年9月10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)

第2期 2022年3月10日現在	第3期 2022年9月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,083,000 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,123,000 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2,359.10 円 (100口当たり純資産額) (235,910 円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2,723.04 円 (100口当たり純資産額) (272,304 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自2021年9月11日 至2022年3月10日	第3期 自2022年3月11日 至2022年9月10日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>19,745,039 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>8,314 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>19,753,353 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,960,542 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>15,792,811 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>15,622,500 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>170,311 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>2,083,000 口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>750 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	19,745,039 円	分配準備積立金	B	8,314 円	配当等収益合計額	C=A+B	19,753,353 円	経費	D	3,960,542 円	収益分配可能額	E=C-D	15,792,811 円	収益分配金	F	15,622,500 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	170,311 円	口数	H	2,083,000 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	750 円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>39,429,894 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>170,311 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>39,600,205 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>5,682,428 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>33,917,777 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>33,755,700 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>162,077 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>2,123,000 口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,590 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	39,429,894 円	分配準備積立金	B	170,311 円	配当等収益合計額	C=A+B	39,600,205 円	経費	D	5,682,428 円	収益分配可能額	E=C-D	33,917,777 円	収益分配金	F	33,755,700 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	162,077 円	口数	H	2,123,000 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,590 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	19,745,039 円																																																											
分配準備積立金	B	8,314 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	19,753,353 円																																																											
経費	D	3,960,542 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	15,792,811 円																																																											
収益分配金	F	15,622,500 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	170,311 円																																																											
口数	H	2,083,000 口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	750 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	39,429,894 円																																																											
分配準備積立金	B	170,311 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	39,600,205 円																																																											
経費	D	5,682,428 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	33,917,777 円																																																											
収益分配金	F	33,755,700 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	162,077 円																																																											
口数	H	2,123,000 口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,590 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち581,254円は上場に係る費用、614,149円は対象指数についての商標使用料、465,192円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。	2. その他費用 その他費用のうち197,792円は上場に係る費用、1,033,216円は対象指数についての商標使用料、619,417円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。																																																												

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2021年9月11日 至 2022年3月10日	第3期 自 2022年3月11日 至 2022年9月10日
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第2期 2022年3月10日現在	第3期 2022年9月10日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 2021年9月11日 至 2022年3月10日	第3期 自 2022年3月11日 至 2022年9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第2期 自 2021年9月11日 至 2022年3月10日	第3期 自 2022年3月11日 至 2022年9月10日		
期首元本額	1,140,000,000円	期首元本額	4,166,000,000円
期中追加設定元本額	4,666,000,000円	期中追加設定元本額	1,120,000,000円
期中一部解約元本額	1,640,000,000円	期中一部解約元本額	1,040,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2021年9月11日 至 2022年3月10日	第3期 自 2022年3月11日 至 2022年9月10日
	損益に含まれた評価差額 (円)	損益に含まれた評価差額 (円)
株式	△334,519,813	△374,951,008
投資信託受益証券	△553,406	△2,385,808
投資証券	△5,854,273	△14,857,825
合計	△340,927,492	△392,194,641

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第2期(2022年3月10日現在)				第3期(2022年9月10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								
株価指数先物取引								
買建	219,049,502	—	210,791,620	△8,257,882	381,705,535	—	388,222,285	6,516,750
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	15,080,156	—	15,081,014	△858	34,792,364	—	34,792,945	△581
米ドル	15,080,156	—	15,081,014	△858	34,792,364	—	34,792,945	△581
合計	—	—	—	△8,258,740	—	—	—	6,516,169

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

先物の評価においては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年9月10日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	1,434	23.89	34,258.26	
		HALLIBURTON CO	1,370	28.41	38,921.70	
		SCHLUMBERGER LTD	2,139	38.17	81,645.63	
		APA CORPORATION	554	36.93	20,459.22	
		CONOCOPHILLIPS	1,985	108.32	215,015.20	
		DEVON ENERGY CORP	960	68.91	66,153.60	
		EOG RESOURCES INC	892	118.31	105,532.52	
		EXXON MOBIL CORP	6,453	94.91	612,454.23	
		HESS CORP	420	118.10	49,602.00	
		KINDER MORGAN INC	2,972	18.03	53,585.16	
		MARATHON OIL CORP	1,085	25.61	27,786.85	
		MARATHON PETROLEUM CORP	829	98.45	81,615.05	
		OCCIDENTAL PETE CORP	1,352	64.61	87,352.72	
		ONEOK INC	680	61.31	41,690.80	
		PHILLIPS 66	737	85.93	63,330.41	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	346	234.02	80,970.92	
		VALERO ENERGY CORP	623	111.93	69,732.39	
		WILLIAMS COS	1,852	32.00	59,264.00	
		AIR PRODUCTS	338	253.83	85,794.54	
		ALBEMARLE CORP	178	291.43	51,874.54	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	327	102.46	33,504.42			

CORTEVA INC	1,108	62.04	68,740.32
DOW INC	1,122	49.40	55,426.80
ECOLAB INC	380	170.92	64,949.60
FMC CORP	193	109.98	21,226.14
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	388	114.16	44,294.08
LINDE PLC	771	283.91	218,894.61
LYONDELLBASELL INDU-CL A	401	82.50	33,082.50
MOSAIC CO/THE	565	54.16	30,600.40
PPG INDUSTRIES	362	127.76	46,249.12
AMCOR PLC	2,307	12.18	28,099.26
BALL CORP	494	58.87	29,081.78
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	590	41.57	24,526.30
WESTROCK CO	401	40.49	16,236.49
FREEMONT-MCMORAN INC	2,238	30.62	68,527.56
NEWMONT CORP	1,216	42.39	51,546.24
CARRIER GLOBAL CORP	1,304	42.12	54,924.48
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,071	57.46	61,539.66
TRANE TECHNOLOGIES PLC	356	163.29	58,131.24
EATON CORP PLC	608	143.24	87,089.92
EMERSON ELEC	905	83.67	75,721.35
GENERAC HOLDINGS INC	96	233.23	22,390.08
ROCKWELL AUTOMATION INC	177	244.93	43,352.61
GENERAL ELECTRIC CO	1,676	73.77	123,638.52
CATERPILLAR INC DEL	825	183.15	151,098.75
CUMMINS INC	217	214.80	46,611.60
DEERE & COMPANY	428	368.48	157,709.44
DOVER CORP	219	127.85	27,999.15
FORTIVE CORP	547	65.27	35,702.69
IDEX CORP	116	208.59	24,196.44
ILLINOIS TOOL WORKS INC	435	203.96	88,722.60
INGERSOLL-RAND INC	621	49.31	30,621.51
NORDSON CORP	82	232.15	19,036.30
OTIS WORLDWIDE CORP	648	72.91	47,245.68
PACCAR	529	86.33	45,668.57
PARKER HANNIFIN CORP	196	274.76	53,852.96

PENTAIR PLC	260	45.67	11,874.20
SNAP-ON INC	81	222.35	18,010.35
STANLEY BLACK & DECKER INC	231	88.05	20,339.55
WABTEC CORP	285	89.79	25,590.15
XYLEM INC	275	96.43	26,518.25
FASTENAL CO	877	50.68	44,446.36
UNITED RENTALS INC	110	304.93	33,542.30
CINTAS CORP	134	429.39	57,538.26
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	318	148.00	47,064.00
WASTE MANAGEMENT INC	587	173.58	101,891.46
FEDEX CORPORATION	372	202.87	75,467.64
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,126	196.13	220,842.38
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	987	13.96	13,778.52
CSX CORP	3,381	32.21	108,902.01
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	128	169.85	21,740.80
UNION PAC CORP	963	230.34	221,817.42
APTIV PLC	412	93.42	38,489.04
BORGWARNER INC	365	37.71	13,764.15
FORD MOTOR COMPANY	5,996	15.47	92,758.12
GENERAL MOTORS CO	2,215	40.50	89,707.50
MOHAWK INDUSTRIES	80	110.99	8,879.20
NEWELL BRANDS INC	595	17.44	10,376.80
PULTEGROUP INC	379	40.82	15,470.78
WHIRLPOOL CORP	92	155.78	14,331.76
HASBRO INC	198	79.77	15,794.46
NIKE INC-B	1,945	108.73	211,479.85
PVH CORP	103	57.88	5,961.64
RALPH LAUREN CORPORATION	70	94.22	6,595.40
TAPESTRY INC	414	34.58	14,316.12
V F CORP	492	42.74	21,028.08
CAESARS ENTERTAINMENT INC	326	46.18	15,054.68
DARDEN RESTAURANTS INC	195	130.46	25,439.70
EXPEDIA GROUP INC	229	104.98	24,040.42
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	425	132.97	56,512.25
LAS VEGAS SANDS CORP	524	37.65	19,728.60

MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	417	159.40	66,469.80
MCDONALD'S CORP	1,139	260.08	296,231.12
MGM RESORTS INTERNATIONAL	574	34.06	19,550.44
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	342	45.16	15,444.72
STARBUCKS CORP	1,753	89.46	156,823.38
YUM BRANDS INC	441	116.36	51,314.76
AMAZON.COM INC	13,412	129.82	1,741,145.84
EBAY INC	858	44.25	37,966.50
ETSY INC	198	108.30	21,443.40
DOLLAR TREE INC	343	141.56	48,555.08
TARGET CORP	709	171.90	121,877.10
BEST BUY COMPANY INC	330	74.70	24,651.00
LOWES COS INC	1,013	204.38	207,036.94
TJX COS INC	1,818	66.47	120,842.46
KROGER CO	1,020	48.36	49,327.20
SYSCO CORP	774	83.04	64,272.96
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,092	35.96	39,268.32
WALMART INC	2,156	136.43	294,143.08
BROWN-FORMAN CORP-CL B	279	72.77	20,302.83
COCA COLA CO	5,980	62.12	371,477.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	251	248.24	62,308.24
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	287	51.82	14,872.34
PEPSICO INC	2,119	172.67	365,887.73
ARCHER DANIELS MIDLAND	853	90.29	77,017.37
CAMPBELL SOUP CO	308	47.84	14,734.72
CONAGRA BRANDS INC	731	34.32	25,087.92
GENERAL MILLS	919	75.63	69,503.97
HERSHEY CO/THE	222	225.48	50,056.56
HORMEL FOODS CORP	430	46.84	20,141.20
JM SMUCKER CO/THE-NEW	165	138.64	22,875.60
KELLOGG CO	390	71.75	27,982.50
KRAFT HEINZ CO/THE	1,082	36.06	39,016.92
MCCORMICK & CO INC.	381	79.30	30,213.30
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,116	60.95	128,970.20
TYSON FOODS INC-CL A	446	73.94	32,977.24

COLGATE PALMOLIVE CO.	1,285	77.84	100,024.40
PROCTER & GAMBLE CO	3,678	137.86	507,049.08
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	354	247.94	87,770.76
ABBOTT LABORATORIES	2,695	106.99	288,338.05
BAXTER INTERNATIONAL INC.	763	58.70	44,788.10
BECTON, DICKINSON	434	260.50	113,057.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,172	42.71	92,766.12
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	952	95.52	90,935.04
HOLOGIC INC	381	68.87	26,239.47
IDEXX LABORATORIES INC	129	364.95	47,078.55
MEDTRONIC PLC	2,050	87.89	180,174.50
AMERISOURCEBERGEN CORP	230	147.54	33,934.20
CARDINAL HEALTH INC	422	70.63	29,805.86
CENTENE CORP	889	91.26	81,130.14
CIGNA CORP	492	290.71	143,029.32
CVS HEALTH CORP	2,001	102.26	204,622.26
DAVITA INC	94	91.27	8,579.38
ELEVANCE HEALTH INC	370	489.35	181,059.50
HENRY SCHEIN INC	211	73.34	15,474.74
HUMANA INC	196	486.36	95,326.56
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	142	238.27	33,834.34
MCKESSON CORP	223	370.16	82,545.68
QUEST DIAGNOSTICS INC	181	130.20	23,566.20
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,436	527.51	757,504.36
ABBVIE INC	2,709	140.52	380,668.68
AMGEN INC	819	245.45	201,023.55
BIOGEN INC	224	207.98	46,587.52
GILEAD SCIENCES INC	1,912	65.10	124,471.20
MODERNA INC	538	141.28	76,008.64
REGENERON PHARMACEUTICALS	163	708.85	115,542.55
VERTEX PHARMACEUTICALS	388	288.99	112,128.12
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,264	69.38	226,456.32
CATALENT INC	273	93.27	25,462.71
ELI LILLY & CO.	1,210	315.50	381,755.00
MERCK & CO INC	3,876	87.42	338,839.92

ORGANON & CO	396	29.36	11,626.56
PFIZER INC	8,601	47.08	404,935.08
VIATRIS INC	1,843	9.68	17,840.24
ZOETIS INC	721	158.49	114,271.29
BANK OF AMERICA CORP	10,835	34.65	375,432.75
CITIGROUP	2,977	49.90	148,552.30
COMERICA INC	199	84.61	16,837.39
FIFTH THIRD BANCORP	1,042	35.32	36,803.44
JPMORGAN CHASE & CO	4,505	118.60	534,293.00
KEYCORP	1,416	18.49	26,181.84
PNC FINANCIAL	640	162.85	104,224.00
REGIONS FINANCIAL CORP	1,436	22.21	31,893.56
TRUIST FINANCIAL CORP	2,035	48.05	97,781.75
US BANCORP	2,058	47.05	96,828.90
AFLAC INC	915	61.67	56,428.05
ALLSTATE CORP	428	126.93	54,326.04
AMERICAN INTL GROUP	1,214	54.33	65,956.62
ASSURANT INC	87	164.42	14,304.54
CHUBB LTD	657	195.11	128,187.27
CINCINNATI FINANCIAL CORP	228	99.68	22,727.04
GLOBE LIFE INC	142	100.92	14,330.64
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	510	66.37	33,848.70
LINCOLN NATIONAL CORP	261	48.87	12,755.07
MARSH & MCLENNAN COS	770	166.27	128,027.90
METLIFE INC	1,070	66.82	71,497.40
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	370	76.80	28,416.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	576	96.95	55,843.20
TRAVELERS COS INC/THE	368	164.51	60,539.68
WILLIS TOWERS WATSON PLC	171	211.24	36,122.04
WR BERKLEY CORP	319	68.01	21,695.19
MASTERCARD INC	1,316	330.07	434,372.12
VISA INC-CLASS A SHARES	2,528	200.71	507,394.88
ADOBE INC	724	383.63	277,748.12
ANSYS INC	133	254.88	33,899.04
AUTODESK INC.	335	209.82	70,289.70

INTUIT INC	432	439.04	189,665.28
MICROSOFT CORP	11,464	258.52	2,963,673.28
NORTONLIFELOCK INC	887	23.39	20,746.93
ORACLE CORPORATION	2,402	74.65	179,309.30
ROPER TECHNOLOGIES INC	161	408.08	65,700.88
SALESFORCE INC	1,523	156.90	238,958.70
TYLER TECHNOLOGIES INC	62	380.24	23,574.88
ARISTA NETWORKS INC	342	122.78	41,990.76
CISCO SYSTEMS	6,368	45.37	288,916.16
JUNIPER NETWORKS INC	508	28.69	14,574.52
MOTOROLA SOLUTIONS INC	257	250.36	64,342.52
APPLE INC	23,569	154.46	3,640,467.74
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,972	13.36	26,345.92
HP INC	1,650	27.50	45,375.00
SEAGATE TECHNOLOGY	307	66.13	20,301.91
CDW CORPORATION	207	174.36	36,092.52
CORNING INC	1,139	33.11	37,712.29
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	279	172.90	48,239.10
TE CONNECTIVITY LTD	496	127.16	63,071.36
TRIMBLE INC	383	61.39	23,512.37
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	81	298.30	24,162.30
ADVANCED MICRO DEVICES	2,492	82.78	206,287.76
APPLIED MATERIALS	1,354	93.79	126,991.66
INTEL CORP	6,268	30.75	192,741.00
LAM RESEARCH	213	439.16	93,541.08
MICRON TECHNOLOGY	1,707	55.39	94,550.73
NVIDIA CORP	3,838	139.90	536,936.20
QUALCOMM INC	1,718	128.85	221,364.30
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,408	168.41	237,121.28
AT & T INC	10,972	16.77	184,000.44
VERIZON COMMUNICATIONS	6,437	41.32	265,976.84
EDISON INTERNATIONAL	579	68.53	39,678.87
ENTERGY CORP	306	118.48	36,254.88
EVERSOURCE ENERGY	524	91.42	47,904.08
EXELON CORPORATION	1,493	45.37	67,737.41

NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信 (2635) 2022年9月期 決算短信
NEXT FUNDS S&P 500 ESG Index Exchange Traded Fund (2635) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

NEXTERA ENERGY INC	2,991	90.27	269,997.57
CONSOLIDATED EDISON INC	539	100.66	54,255.74
PUBLIC SVC ENTERPRISE	771	67.88	52,335.48
SEMPRA ENERGY	487	172.94	84,221.78
AMERICAN WATER WORKS CO INC	277	154.52	42,802.04
AMERICAN EXPRESS CO	938	153.52	144,001.76
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	602	106.44	64,076.88
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	439	101.05	44,360.95
SYNCHRONY FINANCIAL	795	32.60	25,917.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	169	282.34	47,715.46
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,128	43.82	49,428.96
BLACKROCK INC	217	691.92	150,146.64
CBOE GLOBAL MARKETS INC	163	124.11	20,229.93
CME GROUP INC	548	201.98	110,685.04
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	58	448.84	26,032.72
FRANKLIN RESOURCES INC	406	26.26	10,661.56
GOLDMAN SACHS GROUP	526	335.38	176,409.88
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	856	103.21	88,347.76
INVESCO LTD	493	17.36	8,558.48
MARKETAXESS HOLDINGS INC	58	256.94	14,902.52
MOODYS CORP	247	296.11	73,139.17
MORGAN STANLEY	2,161	88.44	191,118.84
MSCI INC	124	482.90	59,879.60
NASDAQ INC	534	63.09	33,690.06
NORTHERN TRUST CORP	317	98.89	31,348.13
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	285	107.45	30,623.25
S&P GLOBAL INC	532	367.06	195,275.92
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,292	73.16	167,682.72
STATE STREET CORP	558	72.06	40,209.48
T ROWE PRICE GROUP INC	349	121.71	42,476.79
AGILENT TECHNOLOGIES INC	458	135.19	61,917.02
BIO-RAD LABORATORIES-A	33	500.33	16,510.89
CHARLES RIVER LABORATORIES	77	213.62	16,448.74
ILLUMINA INC	238	207.31	49,339.78
METTLER-TOLEDO INTL	35	1,284.31	44,950.85

	PERKINELMER INC	192	138.62	26,615.04	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	601	566.56	340,502.56	
	WATERS CORP	93	308.62	28,701.66	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	113	308.13	34,818.69	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	547	27.87	15,244.89	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	171	78.07	13,349.97	
	VERISK ANALYTICS INC	246	191.10	47,010.60	
	CBRE GROUP INC	510	79.75	40,672.50	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	178	395.91	70,471.98	
	COMCAST CORP-CL A	6,852	34.37	235,503.24	
	INTERPUBRIC GROUP	600	27.71	16,626.00	
	OMNICOM GROUP	319	67.89	21,656.91	
	DISNEY (WALT) CO	2,792	112.33	313,625.36	
	ELECTRONIC ARTS	429	127.14	54,543.06	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	241	120.58	29,059.78	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	3,371	12.54	42,272.34	
	ALPHABET INC-CL A	9,220	108.38	999,263.60	
	ALPHABET INC-CL C	8,460	109.42	925,693.20	
	TWITTER INC	1,169	41.85	48,922.65	
	小計 銘柄数：285			36,212,024.28	
				(5,207,651,211)	
	組入時価比率：90.1%			100.0%	
	合計			5,207,651,211	
				(5,207,651,211)	

(注1) 外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2) 株式以外の有価証券(2022年9月10日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	XTRACKERS S&P 500 ESG ETF	7,000	251,720.00	
	小計	銘柄数：1	7,000	251,720.00	
		組入時価比率：0.6%			(36,199,853)
	合計			36,199,853	(36,199,853)

投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	222	34,840.68
		AMERICAN TOWER CORP	708	185,262.36
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	213	45,119.79
		BOSTON PROPERTIES	217	18,583.88
		DIGITAL REALTY TRUST INC	433	53,111.78
		EQUINIX INC	140	91,126.00
		EQUITY RESIDENTIAL	521	40,002.38
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	99	27,252.72
		EXTRA SPACE STORAGE INC	204	41,505.84
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	108	11,065.68
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	822	21,914.52
		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,088	19,224.96
		IRON MOUNTAIN INC	441	23,284.80
		KIMCO REALTY CORP	940	20,360.40
		PROLOGIS INC	1,128	144,282.48
		REGENCY CENTERS CORP	235	14,511.25
		SIMON PROPERTY GROUP INC	501	51,372.54
		UDR INC	456	21,504.96
		VENTAS INC	608	29,494.08
		VORNADO REALTY TRUST	230	6,375.60
		WELLTOWER INC	696	53,153.52
		WEYERHAEUSER CO	1,139	38,646.27
	小計	銘柄数 : 22	11,149	991,996.49
			(142,659,015)	
	組入時価比率 : 2.5%		79.8%	
合計			142,659,015	
			(142,659,015)	
合計			178,858,868	
			(178,858,868)	

(注1) 投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2) 外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注3) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注4) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。