



2022年3月期 (2021年9月11日～2022年3月10日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022 (September 11, 2021 – March 10, 2022)

2022年4月20日  
 April 20, 2022

		上場取引所	東証
		Listed Exchange	TSE
ファンド名	NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信		
コード番号	( 2633 )		
連動対象指標	S&P 500 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	<a href="http://www.nomura-am.co.jp">http://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 S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund		
Code:	2633		
Underlying index:	S&P 500 Index		
Primary invested assets:	Stocks		
Trading unit:	10 units		
Management co.:	Nomura Asset Management Co., Ltd.	URL	<a href="http://www.nomura-am.co.jp">http://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 2022年5月18日  
 分配金支払開始日 2022年4月18日  
 Scheduled date of submission of securities report: May 18, 2022  
 Date of commencing dividend payment: April 18, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2022年3月期の運用状況 (2021年9月11日～2022年3月10日)

Management Status for Year ended March 2022 (from September 11, 2021 to March 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3月期 FY ended Mar. 2022	7,846	(97.8)	179	(2.2)	8,025	(100.0)
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	2,476	(89.5)	290	(10.5)	2,767	(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3月期 FY ended Mar. 2022	1,215	2,440	160	3,495
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	0	1,535	320	1,215

(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3月期 FY ended Mar. 2022	8,062	37	8,025	229,634
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	2,775	8	2,767	227,747

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	820
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	650

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1期 (2021年9月10日現在) 1st Fiscal Year As of September 10, 2021	第2期 (2022年3月10日現在) 2nd Fiscal Year As of March 10, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
預金 Deposits	248,826,271	122,103,767
コール・ローン Call loans	2,953,148	8,609,763
株式 Stocks	2,407,660,321	7,628,727,206
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	6,343,944	9,116,065
投資証券 Investment securities	62,661,024	208,166,476
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	9,079,713	-
未収入金 Accounts receivable - other	-	3,190,527
未収配当金 Accrued dividends receivable	2,361,273	8,942,967
差入委託証拠金 Margin deposits	36,084,475	74,122,694
流動資産合計 Total current assets	2,775,970,169	8,062,979,465
資産合計 Total assets	2,775,970,169	8,062,979,465
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	3,050	4,370,181
未払金 Accounts payable - other	-	1,027,675
未払収益分配金 Unpaid dividends	7,897,500	28,659,000
未払受託者報酬 Trustee fees payable	193,630	582,731
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	484,014	1,456,751
未払利息	-	1

Accrued interest expenses		
その他未払費用 Other accrued expenses	262,654	1,165,047
流動負債合計 Total current liabilities	8,840,848	37,261,386
負債合計 Total liabilities	8,840,848	37,261,386
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	2,430,000,000	6,990,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	337,129,321	1,035,718,079
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	39,747	132,925
元本等合計 Total principal and other	2,767,129,321	8,025,718,079
純資産合計 Total net assets	2,767,129,321	8,025,718,079
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	2,775,970,169	8,062,979,465

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第1期 自 2021年3月29日 至 2021年9月10日 1st Fiscal Year From March 29, 2021 to September 10, 2021	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
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	10,312,766	33,600,637
受取利息 Interest income	-	2
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	205,608,432	△369,429,097
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	13,283,389	△18,529,456
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	4,140,253	259,499,733
営業収益合計 Total operating revenue	233,344,840	△94,858,181
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	3,946	8,533

受託者報酬 Trustee fees	193,630	582,731
委託者報酬 Investment trust management fees	484,014	1,456,751
その他費用 Other expenses	1,693,929	2,800,446
営業費用合計 Total operating expenses	2,375,519	4,848,461
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	230,969,321	△99,706,642
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	230,969,321	△99,706,642
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	230,969,321	△99,706,642
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	-	337,129,321
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	148,565,500	910,543,200
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	148,565,500	910,543,200
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	34,508,000	83,588,800
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	34,508,000	83,588,800
分配金 Dividends	7,897,500	28,659,000
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	337,129,321	1,035,718,079

(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しております。</p> <p>為替予約取引</p>
--------------------	--

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。 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。 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。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
5. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年9月11日から2022年3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1期 2021年9月10日現在	第2期 2022年3月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,215,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,495,000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 2,277.47円 (100口当たり純資産額) (227,747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 2,296.34円 (100口当たり純資産額) (229,634円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自2021年3月29日 至2021年9月10日	第2期 自2021年9月11日 至2022年3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>10,308,820円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>10,308,820円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,371,573円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>7,937,247円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>7,897,500円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>39,747円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,215,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>650円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	10,308,820円	分配準備積立金	B	0円	配当等収益合計額	C=A+B	10,308,820円	経費	D	2,371,573円	収益分配可能額	E=C-D	7,937,247円	収益分配金	F	7,897,500円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	39,747円	口数	H	1,215,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	650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>33,592,106円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>39,747円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>33,631,853円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>4,839,928円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>28,791,925円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>28,659,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>132,925円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>3,495,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>820円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	33,592,106円	分配準備積立金	B	39,747円	配当等収益合計額	C=A+B	33,631,853円	経費	D	4,839,928円	収益分配可能額	E=C-D	28,791,925円	収益分配金	F	28,659,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	132,925円	口数	H	3,495,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	820円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	10,308,820円																																																											
分配準備積立金	B	0円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	10,308,820円																																																											
経費	D	2,371,573円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	7,937,247円																																																											
収益分配金	F	7,897,500円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	39,747円																																																											
口数	H	1,215,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	650円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	33,592,106円																																																											
分配準備積立金	B	39,747円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	33,631,853円																																																											
経費	D	4,839,928円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	28,791,925円																																																											
収益分配金	F	28,659,000円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	132,925円																																																											
口数	H	3,495,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	820円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち653,965円は上場に係る費用、354,166円は対象指数についての商標使用料、658,792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825,073円は上場に係る費用、1,060,655円は対象指数についての商標使用料、732,894円は外貨建資産の保管等に要する費用であります。																																																												
3. 追加情報 2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息とし																																																													

て表示しております。

(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 1 期 自 2021 年 3 月 29 日 至 2021 年 9 月 10 日	第 2 期 自 2021 年 9 月 11 日 至 2022 年 3 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。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。 これらは、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。 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。 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。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</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 1 期 2021 年 9 月 10 日現在	第 2 期 2022 年 3 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 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。 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。 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>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>

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

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年3月29日 至 2021年9月10日	第2期 自 2021年9月11日 至 2022年3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1期 自 2021年3月29日 至 2021年9月10日	第2期 自 2021年9月11日 至 2022年3月10日
期首元本額 ー円	期首元本額 2,430,000,000円
期中追加設定元本額 3,070,000,000円	期中追加設定元本額 4,880,000,000円
期中一部解約元本額 640,000,000円	期中一部解約元本額 320,000,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2021年3月29日 至 2021年9月10日	第2期 自 2021年9月11日 至 2022年3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	185,742,690	△377,726,980
投資信託受益証券	218,358	△400,002
投資証券	6,576,280	△4,346,623
合計	192,537,328	△382,473,605

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1期(2021年9月10日現在)				第2期(2022年3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	385,492,250	—	394,527,364	9,035,114	177,958,644	—	173,590,113	△4,368,531
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	113,024,990	—	113,069,589	44,599	—	—	—	—
米ドル	113,024,990	—	113,069,589	44,599	—	—	—	—
売建	7,681,354	—	7,684,404	△3,050	29,000,300	—	29,001,950	△1,650
米ドル	7,681,354	—	7,684,404	△3,050	29,000,300	—	29,001,950	△1,650
合計	—	—	—	9,076,663	—	—	—	△4,370,181

(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3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	1,630	33.81	55,110.30	
		HALLIBURTON CO	1,670	34.84	58,182.80	
		SCHLUMBERGER LTD	2,610	42.56	111,081.60	
		APA CORPORATION	680	38.70	26,316.00	
		CHEVRON CORP	3,593	166.27	597,408.11	
		CONOCOPHILLIPS	2,462	96.21	236,869.02	
		COTERRA ENERGY INC	1,520	25.46	38,699.20	
		DEVON ENERGY CORP	1,170	58.94	68,959.80	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	314	130.05	40,835.70	
		EOG RESOURCES INC	1,093	113.77	124,350.61	
		EXXON MOBIL CORP	7,894	82.79	653,544.26	
		HESS CORP	512	96.70	49,510.40	
		KINDER MORGAN INC	3,630	18.33	66,537.90	
		MARATHON OIL CORP	1,450	23.40	33,930.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	1,147	75.43	86,518.21	
		OCCIDENTAL PETE CORP	1,650	57.50	94,875.00	
ONEOK INC	829	66.61	55,219.69			

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年3月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022

PHILLIPS 66	819	79.35	64,987.65
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	423	230.40	97,459.20
VALERO ENERGY CORP	766	87.14	66,749.24
WILLIAMS COS	2,260	32.50	73,450.00
AIR PRODUCTS	413	227.00	93,751.00
ALBEMARLE CORP	218	187.13	40,794.34
CELANESE CORP-SERIES A	203	138.61	28,137.83
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	404	92.34	37,305.36
CORTEVA INC	1,358	51.53	69,977.74
DOW INC	1,379	59.80	82,464.20
DUPONT DE NEMOURS INC	965	72.49	69,952.85
EASTMAN CHEMICAL CO.	246	108.71	26,742.66
ECOLAB INC	465	165.02	76,734.30
FMC CORP	232	120.00	27,840.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	470	120.82	56,785.40
LINDE PLC	955	292.77	279,595.35
LYONDELLBASELL INDU-CL A	492	98.37	48,398.04
MOSAIC CO/THE	690	57.72	39,826.80
PPG INDUSTRIES	446	122.03	54,425.38
SHERWIN-WILLIAMS	450	241.71	108,769.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	116	373.42	43,316.72
VULCAN MATERIALS CO	247	176.77	43,662.19
AMCOR PLC	2,870	11.09	31,828.30
AVERY DENNISON CORP	154	165.80	25,533.20
BALL CORP	605	86.41	52,278.05
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	721	42.17	30,404.57
PACKAGING CORP OP AMERICA	177	147.65	26,134.05
SEALED AIR CORP	280	64.41	18,034.80
WESTROCK CO	500	42.49	21,245.00
FREEMONT-MCMORAN INC	2,737	46.99	128,611.63
NEWMONT CORP	1,487	75.97	112,967.39
NUCOR CORP	536	130.01	69,685.36
BOEING CO	1,030	178.56	183,916.80
GENERAL DYNAMICS	432	236.81	102,301.92
HOWMET AEROSPACE INC	720	33.98	24,465.60

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年3月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	75	208.15	15,611.25
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	366	255.53	93,523.98
LOCKHEED MARTIN	457	448.72	205,065.04
NORTHROP GRUMMAN CORP	278	449.92	125,077.76
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	2,786	98.52	274,476.72
TEXTRON INC	406	70.03	28,432.18
TRANSDIGM GROUP INC	98	633.93	62,125.14
ALLEGION PLC	164	114.54	18,784.56
CARRIER GLOBAL CORP	1,613	44.59	71,923.67
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	260	84.97	22,092.20
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,321	62.81	82,972.01
MASCO CORP	456	54.11	24,674.16
SMITH (A.O.) CORP	250	67.68	16,920.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	443	150.97	66,879.71
QUANTA SERVICES INC	267	118.72	31,698.24
AMETEK INC	435	130.51	56,771.85
EATON CORP PLC	743	149.12	110,796.16
EMERSON ELEC	1,115	94.39	105,244.85
GENERAC HOLDINGS INC	118	311.20	36,721.60
ROCKWELL AUTOMATION INC	216	271.04	58,544.64
3M CORP	1,074	146.60	157,448.40
GENERAL ELECTRIC CO	2,048	91.25	186,880.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,283	185.40	237,868.20
ROPER TECHNOLOGIES INC	197	443.29	87,328.13
CATERPILLAR INC DEL	1,008	209.78	211,458.24
CUMMINS INC	267	198.44	52,983.48
DEERE & COMPANY	526	368.86	194,020.36
DOVER CORP	268	151.20	40,521.60
FORTIVE CORP	673	58.49	39,363.77
IDEX CORP	142	191.94	27,255.48
ILLINOIS TOOL WORKS INC	532	207.77	110,533.64
INGERSOLL-RAND INC	760	48.57	36,913.20
NORDSON CORP	101	222.45	22,467.45
OTIS WORLDWIDE CORP	796	75.26	59,906.96

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年3月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022

PACCAR	645	87.32	56,321.40
PARKER HANNIFIN CORP	241	278.08	67,017.28
PENTAIR PLC	305	55.52	16,933.60
SNAP-ON INC	100	207.69	20,769.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	304	152.66	46,408.64
WABTEC CORP	350	92.91	32,518.50
XYLEM INC	334	85.59	28,587.06
FASTENAL CO	1,072	54.76	58,702.72
GRAINGER(W.W.) INC	81	487.41	39,480.21
UNITED RENTALS INC	135	315.79	42,631.65
CINTAS CORP	164	374.16	61,362.24
COPART INC	394	115.90	45,664.60
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	387	125.77	48,672.99
ROLLINS INC	397	32.72	12,989.84
WASTE MANAGEMENT INC	717	149.98	107,535.66
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	246	101.59	24,991.14
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	320	100.82	32,262.40
FEDEX CORPORATION	455	216.72	98,607.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,359	206.78	281,014.02
ALASKA AIR GROUP INC	220	48.63	10,698.60
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1,210	14.30	17,303.00
DELTA AIR LINES INC	1,193	32.76	39,082.68
SOUTHWEST AIRLINES	1,107	40.66	45,010.62
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	606	34.90	21,149.40
CSX CORP	4,133	34.61	143,043.13
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	157	199.37	31,301.09
NORFOLK SOUTHERN CORP	454	263.79	119,760.66
OLD DOMINION FREIGHT LINE	174	306.87	53,395.38
UNION PAC CORP	1,198	253.67	303,896.66
APTIV PLC	504	104.61	52,723.44
BORGWARNER INC	450	37.46	16,857.00
FORD MOTOR COMPANY	7,320	16.37	119,828.40
GENERAL MOTORS CO	2,710	42.28	114,578.80
TESLA INC	1,516	858.97	1,302,198.52
DR HORTON INC	606	82.65	50,085.90

GARMIN LTD	285	110.72	31,555.20
LENNAR CORP-A	509	87.50	44,537.50
MOHAWK INDUSTRIES	96	136.86	13,138.56
NEWELL BRANDS INC	710	22.57	16,024.70
NVR INC	6	4,814.16	28,884.96
PULTEGROUP INC	469	47.67	22,357.23
WHIRLPOOL CORP	113	196.40	22,193.20
HASBRO INC	250	89.93	22,482.50
NIKE INC-B	2,377	126.95	301,760.15
PVH CORP	130	75.36	9,796.80
RALPH LAUREN CORPORATION	100	108.64	10,864.00
TAPESTRY INC	510	35.88	18,298.80
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	350	15.26	5,341.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	360	13.76	4,953.60
V F CORP	612	53.49	32,735.88
BOOKING HOLDINGS INC	77	2,035.47	156,731.19
CAESARS ENTERTAINMENT INC	403	77.59	31,268.77
CARNIVAL CORP	1,500	17.27	25,905.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	52	1,420.63	73,872.76
DARDEN RESTAURANTS INC	242	128.56	31,111.52
DOMINOS PIZZA INC	68	397.19	27,008.92
EXPEDIA GROUP INC	272	174.68	47,512.96
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	519	138.52	71,891.88
LAS VEGAS SANDS CORP	640	38.77	24,812.80
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	510	159.47	81,329.70
MCDONALD'S CORP	1,393	222.47	309,900.71
MGM RESORTS INTERNATIONAL	727	40.28	29,283.56
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	650	17.31	11,251.50
PENN NATIONAL GAMING INC	310	43.83	13,587.30
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	419	68.06	28,517.14
STARBUCKS CORP	2,200	87.60	192,720.00
WYNN RESORTS LTD	200	77.27	15,454.00
YUM BRANDS INC	542	116.02	62,882.84
GENUINE PARTS CO	269	121.51	32,686.19
LKQ CORP	500	45.09	22,545.00

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年3月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022

POOL CORP	75	456.74	34,255.50
AMAZON.COM INC	813	2,785.58	2,264,676.54
EBAY INC	1,166	53.06	61,867.96
ETSY INC	236	144.72	34,153.92
DOLLAR GENERAL CORP	435	207.22	90,140.70
DOLLAR TREE INC	419	147.75	61,907.25
TARGET CORP	910	216.00	196,560.00
ADVANCE AUTO PARTS	117	204.88	23,970.96
AUTOZONE	39	1,884.56	73,497.84
BATH & BODY WORKS INC	488	47.69	23,272.72
BEST BUY COMPANY INC	410	101.74	41,713.40
CARMAX INC	300	101.89	30,567.00
HOME DEPOT	1,967	317.20	623,932.40
LOWES COS INC	1,290	225.88	291,385.20
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	126	674.70	85,012.20
ROSS STORES INC	663	88.57	58,721.91
TJX COS INC	2,241	61.19	137,126.79
TRACTOR SUPPLY COMPANY	212	224.85	47,668.20
ULTA BEAUTY INC	101	373.31	37,704.31
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	823	527.65	434,255.95
KROGER CO	1,264	55.34	69,949.76
SYSCO CORP	952	79.76	75,931.52
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,339	48.12	64,432.68
WALMART INC	2,650	139.46	369,569.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	340	64.24	21,841.60
COCA COLA CO	7,245	58.96	427,165.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	306	214.72	65,704.32
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	350	52.48	18,368.00
MONSTER BEVERAGE CORP	699	76.68	53,599.32
PEPSICO INC	2,577	157.40	405,619.80
ARCHER DANIELS MIDLAND	1,040	81.78	85,051.20
CAMPBELL SOUP CO	380	42.63	16,199.40
CONAGRA BRANDS INC	893	31.18	27,843.74
GENERAL MILLS	1,124	64.11	72,059.64
HERSHEY CO/THE	271	204.88	55,522.48

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年3月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022

HORMEL FOODS CORP	530	49.91	26,452.30
JM SMUCKER CO/THE-NEW	200	129.34	25,868.00
KELLOGG CO	480	62.19	29,851.20
KRAFT HEINZ CO/THE	1,326	38.18	50,626.68
LAMB WESTON HOLDINGS INC	280	53.32	14,929.60
MCCORMICK & CO INC.	467	98.31	45,910.77
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,602	61.29	159,476.58
TYSON FOODS INC-CL A	548	90.64	49,670.72
ALTRIA GROUP INC	3,421	51.00	174,471.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,901	93.81	272,142.81
CHURCH & DWIGHT CO INC	451	97.06	43,774.06
CLOROX CO	229	137.27	31,434.83
COLGATE PALMOLIVE CO.	1,572	75.54	118,748.88
KIMBERLY-CLARK CORP	632	123.56	78,089.92
PROCTER & GAMBLE CO	4,510	148.77	670,952.70
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	432	277.68	119,957.76
ABBOTT LABORATORIES	3,297	118.39	390,331.83
ABIOMED INC	85	306.74	26,072.90
ALIGN TECHNOLOGY INC	137	442.05	60,560.85
BAXTER INTERNATIONAL INC.	929	79.74	74,078.46
BECTON, DICKINSON	535	264.84	141,689.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,653	42.07	111,611.71
DENTSPLY SIRONA INC	410	51.31	21,037.10
DEXCOM INC	181	412.24	74,615.44
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,166	105.91	123,491.06
HOLOGIC INC	470	71.16	33,445.20
IDEXX LABORATORIES INC	158	529.92	83,727.36
INTUITIVE SURGICAL INC	665	278.82	185,415.30
MEDTRONIC PLC	2,504	103.58	259,364.32
RESMED INC	272	245.23	66,702.56
STERIS PLC	186	228.65	42,528.90
STRYKER CORP	626	249.69	156,305.94
TELEFLEX INC	87	343.10	29,849.70
THE COOPER COMPANIES, INC.	92	386.73	35,579.16
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	386	117.64	45,409.04

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年3月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022

AMERISOURCEBERGEN CORP	279	145.83	40,686.57
ANTHEM INC	452	465.37	210,347.24
CARDINAL HEALTH INC	530	53.19	28,190.70
CENTENE CORP	1,084	82.85	89,809.40
CIGNA CORP	618	231.26	142,918.68
CVS HEALTH CORP	2,459	103.60	254,752.40
DAVITA INC	123	112.50	13,837.50
HCA HEALTHCARE INC	446	264.36	117,904.56
HENRY SCHEIN INC	260	85.58	22,250.80
HUMANA INC	240	429.17	103,000.80
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	178	265.63	47,282.14
MCKESSON CORP	285	276.53	78,811.05
MOLINA HEALTHCARE INC	109	312.25	34,035.25
QUEST DIAGNOSTICS INC	228	135.58	30,912.24
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,755	485.57	852,175.35
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	140	151.26	21,176.40
ABBVIE INC	3,295	148.84	490,427.80
AMGEN INC	1,050	231.46	243,033.00
BIOGEN INC	274	202.27	55,421.98
GILEAD SCIENCES INC	2,340	59.00	138,060.00
INCYTE CORP	350	72.01	25,203.50
MODERNA INC	657	142.49	93,615.93
REGENERON PHARMACEUTICALS	197	623.43	122,815.71
VERTEX PHARMACEUTICALS	474	239.24	113,399.76
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,138	68.13	281,921.94
CATALENT INC	322	98.69	31,778.18
ELI LILLY & CO.	1,480	262.79	388,929.20
JOHNSON & JOHNSON	4,906	169.36	830,880.16
MERCK & CO INC	4,705	77.79	366,001.95
ORGANON & CO	470	36.46	17,136.20
PFIZER INC	10,463	48.75	510,071.25
VIATRIS INC	2,220	10.28	22,821.60
ZOETIS INC	882	189.58	167,209.56
BANK OF AMERICA CORP	13,427	41.04	551,044.08
CITIGROUP	3,697	55.95	206,847.15



CITIZENS FINANCIAL GROUP	792	47.85	37,897.20
COMERICA INC	240	88.23	21,175.20
FIFTH THIRD BANCORP	1,277	44.74	57,132.98
FIRST REPUBLIC BANK/CA	334	164.80	55,043.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,700	14.71	39,717.00
JPMORGAN CHASE & CO	5,508	133.44	734,987.52
KEYCORP	1,740	23.32	40,576.80
M & T BANK CORP	240	173.21	41,570.40
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	800	20.39	16,312.00
PNC FINANCIAL	788	186.75	147,159.00
REGIONS FINANCIAL CORP	1,780	22.45	39,961.00
SIGNATURE BANK	113	306.49	34,633.37
SVB FINANCIAL GROUP	109	538.94	58,744.46
TRUIST FINANCIAL CORP	2,490	58.52	145,714.80
US BANCORP	2,516	54.51	137,147.16
WELLS FARGO CO	7,431	49.16	365,307.96
ZIONS BANCORP NA	295	65.13	19,213.35
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	3,413	325.40	1,110,590.20
AFLAC INC	1,134	60.39	68,482.26
ALLSTATE CORP	532	122.42	65,127.44
AMERICAN INTL GROUP	1,549	58.28	90,275.72
AON PLC	411	291.00	119,601.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	386	155.94	60,192.84
ASSURANT INC	106	168.77	17,889.62
BROWN & BROWN INC	440	63.54	27,957.60
CHUBB LTD	803	203.94	163,763.82
CINCINNATI FINANCIAL CORP	283	121.36	34,344.88
EVEREST RE GROUP LTD	75	275.48	20,661.00
GLOBE LIFE INC	170	97.45	16,566.50
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	639	67.89	43,381.71
LINCOLN NATIONAL CORP	320	62.27	19,926.40
LOEWS CORP	376	61.03	22,947.28
MARSH & MCLENNAN COS	941	152.32	143,333.12
METLIFE INC	1,331	64.44	85,769.64
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	460	66.17	30,438.20

PROGRESSIVE CO	1,093	104.10	113,781.30
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	702	106.89	75,036.78
TRAVELERS COS INC/THE	458	171.37	78,487.46
WILLIS TOWERS WATSON PLC	232	225.06	52,213.92
WR BERKLEY CORP	260	91.68	23,836.80
ACCENTURE PLC-CL A	1,177	309.42	364,187.34
AKAMAI TECHNOLOGIES	300	109.18	32,754.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	785	209.70	164,614.50
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	217	147.07	31,914.19
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	977	87.96	85,936.92
DXC TECHNOLOGY CO	480	29.98	14,390.40
EPAM SYSTEMS INC	106	198.41	21,031.46
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	1,135	91.98	104,397.30
FISERV INC	1,105	96.27	106,378.35
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	151	230.25	34,767.75
GARTNER INC	153	283.20	43,329.60
GLOBAL PAYMENTS INC	538	128.10	68,917.80
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	1,670	126.22	210,787.40
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	138	177.05	24,432.90
MASTERCARD INC	1,617	328.13	530,586.21
PAYCHEX INC	595	122.30	72,768.50
PAYPAL HOLDINGS INC	2,192	100.22	219,682.24
VERISIGN INC	180	209.59	37,726.20
VISA INC-CLASS A SHARES	3,125	199.76	624,250.00
ADOBE INC	887	450.87	399,921.69
ANSYS INC	163	312.33	50,909.79
AUTODESK INC.	410	204.88	84,000.80
CADENCE DESIGN SYS INC	517	150.89	78,010.13
CERIDIAN HCM HOLDING INC	260	66.04	17,170.40
CITRIX SYSTEMS INC	229	101.92	23,339.68
FORTINET INC	253	287.43	72,719.79
INTUIT INC	528	464.74	245,382.72
MICROSOFT CORP	13,993	288.50	4,036,980.50
NORTONLIFELOCK INC	1,080	27.73	29,948.40
ORACLE CORPORATION	3,009	76.10	228,984.90

PAYCOM SOFTWARE INC	90	311.21	28,008.90
PTC INC	193	109.30	21,094.90
SALESFORCE.COM INC	1,825	203.16	370,767.00
SERVICENOW INC	371	559.58	207,604.18
SYNOPSYS INC	284	307.79	87,412.36
TYLER TECHNOLOGIES INC	76	418.65	31,817.40
ARISTA NETWORKS INC	421	120.61	50,776.81
CISCO SYSTEMS	7,860	55.92	439,531.20
F5 INC	116	199.60	23,153.60
JUNIPER NETWORKS INC	610	33.69	20,550.90
MOTOROLA SOLUTIONS INC	315	221.70	69,835.50
APPLE INC	29,048	162.95	4,733,371.60
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	2,440	16.37	39,942.80
HP INC	2,148	36.05	77,435.40
NETAPP INC	420	80.78	33,927.60
SEAGATE TECHNOLOGY	385	90.39	34,800.15
WESTERN DIGITAL CORP	582	47.77	27,802.14
AMPHENOL CORP-CL A	1,110	74.91	83,150.10
CDW CORPORATION	253	171.00	43,263.00
CORNING INC	1,427	37.63	53,698.01
IPG PHOTONICS CORP	65	114.15	7,419.75
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	343	151.05	51,810.15
TE CONNECTIVITY LTD	608	130.43	79,301.44
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	87	441.42	38,403.54
TRIMBLE INC	464	67.71	31,417.44
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	100	399.11	39,911.00
ADVANCED MICRO DEVICES	3,044	111.05	338,036.20
ANALOG DEVICES INC	1,002	153.62	153,927.24
APPLIED MATERIALS	1,681	128.62	216,210.22
BROADCOM INC	767	597.02	457,914.34
ENPHASE ENERGY INC	251	179.87	45,147.37
INTEL CORP	7,577	47.63	360,892.51
KLA CORP	283	339.56	96,095.48
LAM RESEARCH	262	517.31	135,535.22
MICROCHIP TECHNOLOGY	1,032	70.88	73,148.16

MICRON TECHNOLOGY	2,084	79.44	165,552.96
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	81	418.16	33,870.96
NVIDIA CORP	4,659	230.14	1,072,222.26
NXP SEMICONDUCTORS NV	496	183.35	90,941.60
QORVO INC	203	129.36	26,260.08
QUALCOMM INC	2,087	157.11	327,888.57
SKYWORKS SOLUTIONS INC	309	134.16	41,455.44
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	98	326.98	32,044.04
TERADYNE INC	302	111.75	33,748.50
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,721	172.46	296,803.66
AT & T INC	13,310	23.26	309,590.60
LUMEN TECHNOLOGIES INC	1,680	10.62	17,841.60
VERIZON COMMUNICATIONS	7,712	53.08	409,352.96
T-MOBILE US INC	1,096	121.96	133,668.16
ALLIANT ENERGY CORP	463	59.75	27,664.25
AMERICAN ELECTRIC POWER	935	95.01	88,834.35
CONSTELLATION ENERGY	605	51.33	31,054.65
DUKE ENERGY CORP	1,433	105.33	150,937.89
EDISON INTERNATIONAL	707	65.47	46,287.29
ENTERGY CORP	372	107.98	40,168.56
EVERGY INC	426	63.37	26,995.62
EVERSOURCE ENERGY	642	84.19	54,049.98
EXELON CORPORATION	1,826	43.55	79,522.30
FIRSTENERGY CORP	1,011	44.08	44,564.88
NEXTERA ENERGY INC	3,655	80.32	293,569.60
NRG ENERGY INC	460	37.90	17,434.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	220	73.25	16,115.00
PPL CORPORATION	1,400	26.69	37,366.00
SOUTHERN CO.	1,973	67.12	132,427.76
XCEL ENERGY INC	1,000	69.84	69,840.00
ATMOS ENERGY CORP	249	112.18	27,932.82
AMEREN CORPORATION	480	86.74	41,635.20
CENTERPOINT ENERGY INC	1,170	28.38	33,204.60
CMS ENERGY CORP	540	65.22	35,218.80
CONSOLIDATED EDISON INC	664	88.38	58,684.32

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年3月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022

DOMINION ENERGY INC	1,509	81.00	122,229.00
DTE ENERGY COMPANY	362	125.03	45,260.86
NISOURCE INC	730	29.65	21,644.50
PUBLIC SVC ENTERPRISE	939	65.82	61,804.98
SEMPRA ENERGY	595	152.30	90,618.50
WEC ENERGY GROUP INC	586	92.60	54,263.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	338	153.79	51,981.02
AMERICAN EXPRESS CO	1,169	168.65	197,151.85
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	793	131.91	104,604.63
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	542	107.00	57,994.00
SYNCHRONY FINANCIAL	1,021	36.20	36,960.20
AMERIPRISE FINANCIAL INC	209	274.52	57,374.68
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,419	52.18	74,043.42
BLACKROCK INC	266	693.25	184,404.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	195	115.08	22,440.60
CME GROUP INC	670	230.09	154,160.30
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	70	414.96	29,047.20
FRANKLIN RESOURCES INC	530	28.54	15,126.20
GOLDMAN SACHS GROUP	633	333.59	211,162.47
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,047	128.78	134,832.66
INVESCO LTD	600	20.07	12,042.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	71	348.44	24,739.24
MOODYS CORP	301	323.31	97,316.31
MORGAN STANLEY	2,678	87.40	234,057.20
MSCI INC	154	488.13	75,172.02
NASDAQ INC	218	168.67	36,770.06
NORTHERN TRUST CORP	391	108.03	42,239.73
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	341	95.88	32,695.08
S&P GLOBAL INC	660	391.51	258,396.60
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,800	79.39	222,292.00
STATE STREET CORP	677	83.58	56,583.66
T ROWE PRICE GROUP INC	419	138.88	58,190.72
AES CORP	1,240	21.96	27,230.40
CERNER CORP	552	93.10	51,391.20
AGILENT TECHNOLOGIES INC	560	133.26	74,625.60

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年3月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended March 2022

BIO TECHNE CORP	73	418.30	30,535.90
BIO-RAD LABORATORIES-A	40	554.27	22,170.80
CHARLES RIVER LABORATORIES	94	268.49	25,238.06
DANAHER CORP	1,185	264.82	313,811.70
ILLUMINA INC	291	324.71	94,490.61
IQVIA HOLDINGS INC	356	219.21	78,038.76
METTLER-TOLEDO INTL	43	1,388.29	59,696.47
PERKINELMER INC	235	172.58	40,556.30
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	734	541.70	397,607.80
WATERS CORP	114	321.08	36,603.12
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	138	372.40	51,391.20
EQUIFAX INC	227	225.05	51,086.35
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	240	125.63	30,151.20
LEIDOS HOLDINGS INC	260	102.89	26,751.40
NIELSEN HOLDINGS PLC	650	18.14	11,791.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	211	112.17	23,667.87
VERISK ANALYTICS INC	300	187.27	56,181.00
CBRE GROUP INC	627	87.77	55,031.79
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	231	557.75	128,840.25
COMCAST CORP-CL A	8,497	46.12	391,881.64
DISCOVERY INC - A	320	25.37	8,118.40
DISCOVERY INC - C	580	25.31	14,679.80
DISH NETWORK CORP-A	480	30.94	14,851.20
FOX CORP-CLASS A	600	40.87	24,522.00
FOX CORP-CLASS B	270	37.43	10,106.10
INTERPUBRIC GROUP	730	33.78	24,659.40
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	740	21.13	15,636.20
NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	210	21.52	4,519.20
OMNICOM GROUP	393	76.89	30,217.77
PARAMOUNT GLOBAL	1,126	33.74	37,991.24
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,449	80.83	117,122.67
DISNEY (WALT) CO	3,387	133.65	452,672.55
ELECTRONIC ARTS	525	125.52	65,898.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	253	109.90	27,804.70
NETFLIX INC	826	358.79	296,360.54

	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	215	158.32	34,038.80	
	ALPHABET INC-CL A	561	2,668.40	1,496,972.40	
	ALPHABET INC-CL C	521	2,677.32	1,394,883.72	
	MATCH GROUP INC	524	98.93	51,839.32	
	META PLATFORMS INC	4,410	198.50	875,385.00	
	TWITTER INC	1,487	34.37	51,108.19	
	小計 銘柄数：477			65,759,220.81	
				(7,628,727,206)	
	組入時価比率：95.1%			100.0%	
	合計			7,628,727,206	
				(7,628,727,206)	

(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3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	VANGUARD S&P 500 ETF	200	78,580.00	
	小計	銘柄数：1	200	78,580.00	
		組入時価比率：0.1%		(9,116,065)	4.2%
	合計			9,116,065	(9,116,065)
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	263	50,551.23	
		AMERICAN TOWER CORP	849	197,910.39	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	260	63,559.60	
		BOSTON PROPERTIES	263	32,617.26	
		CROWN CASTLE INTL CORP	805	140,037.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	527	71,382.15	
		DUKE REALTY CORP	705	38,330.85	
		EQUINIX INC	168	118,305.60	
		EQUITY RESIDENTIAL	634	55,652.52	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	121	41,426.77	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	250	49,492.50	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	135	16,119.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,000	32,230.00	

		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,330	24,033.10	
		IRON MOUNTAIN INC	536	27,384.24	
		KIMCO REALTY CORP	1,150	27,519.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	215	45,515.50	
		PROLOGIS INC	1,378	207,361.44	
		PUBLIC STORAGE	284	104,974.92	
		REALTY INCOME CORP	1,055	68,754.35	
		REGENCY CENTERS CORP	290	19,830.20	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	203	66,216.57	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	612	81,132.84	
		UDR INC	540	30,925.80	
		VENTAS INC	745	43,068.45	
		VORNADO REALTY TRUST	300	13,836.00	
		WELLTOWER INC	807	71,629.32	
		WEYERHAEUSER CO	1,400	54,586.00	
	小計	銘柄数 : 28	16,825	1,794,383.90	
				(208,166,476)	
		組入時価比率 : 2.6%		95.8%	
	合計			208,166,476	
				(208,166,476)	
	合計			217,282,541	
				(217,282,541)	

(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。