



2021年9月期 (2021年3月29日～2021年9月10日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended September 2021 (March 29, 2021 – September 10, 2021)

2021年10月20日  
 October 20, 2021

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, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2021年11月29日  
 分配金支払開始日 2021年10月19日  
 Scheduled date of submission of securities report: November 29, 2021  
 Date of commencing dividend payment: October 19, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021年9月期の運用状況 (2021年3月29日～2021年9月10日)

Management Status for Year ended September 2021 (from March 29, 2021 to September 10, 2021)

(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.	% %
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	985	(75.6)	318	(24.4)	1,303	(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
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	0	690	120	570

(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
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	1,307	3	1,303	228,767

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2021年9月期 FY ended Sep. 2021	540

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
	金額 Amount
資産の部 Assets	
流動資産 Current assets	
預金 Deposits	269,993,624
コール・ローン Call loans	2,908,559
株式 Stocks	951,057,613
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	10,236,765
投資証券 Investment securities	24,560,639
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	12,652,145
未収入金 Accounts receivable - other	2,176,925
未収配当金 Accrued dividends receivable	967,921
差入委託証拠金 Margin deposits	33,260,376
流動資産合計 Total current assets	1,307,814,567
資産合計 Total assets	1,307,814,567
負債の部 Liabilities	
流動負債 Current liabilities	
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,676
未払収益分配金 Unpaid dividends	3,078,000
未払受託者報酬 Trustee fees payable	98,113
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	539,547
その他未払費用 Other accrued expenses	126,118
流動負債合計 Total current liabilities	3,843,454

Total current liabilities	
負債合計 Total liabilities	3,843,454
純資産の部 Net assets	
元本等 Principal and other	
元本 Principal	1,140,000,000
剰余金 Surplus	
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	163,971,113
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	8,314
元本等合計 Total principal and other	1,303,971,113
純資産合計 Total net assets	1,303,971,113
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	1,307,814,567

(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
	金額 Amount
営業収益 Operating revenue	
受取配当金 Dividend income	4,808,268
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	89,022,094
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	22,309,821
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	5,635,584
営業収益合計 Total operating revenue	121,775,767
営業費用 Operating expenses	
支払利息 Interest expenses	2,020
受託者報酬 Trustee fees	98,113
委託者報酬 Investment trust management fees	539,547
その他費用 Other expenses	1,082,274

営業費用合計 Total operating expenses	1,721,954
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	120,053,813
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	120,053,813
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	120,053,813
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	-
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	61,102,500
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	61,102,500
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	14,107,200
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	14,107,200
分配金 Dividends	3,078,000
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	163,971,113

### (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 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。</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。 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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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る場合、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3月29日から2021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1期 2021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	570,000 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	2,287.67 円
(100口当たり純資産額)	(228,767 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		
1. 分配金の計算過程		
項目		
当期配当等収益額	A	4,806,248 円
分配準備積立金	B	0 円
配当等収益合計額	C=A+B	4,806,248 円
経費	D	1,719,934 円
収益分配可能額	E=C-D	3,086,314 円
収益分配金	F	3,078,000 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,314 円
口数	H	570,000 口
100口当たり分配金	I=F/H×100	540 円
2. その他費用		
その他費用のうち607,176円は上場に係る費用、179,585円は対象指数についての商標使用料、278,060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

1. 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。

○市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。

○信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。

○流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第1期

2021年9月10日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法

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。

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

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。

(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

期首元本額	—円
期中追加設定元本額	1,380,000,000円
期中一部解約元本額	240,000,000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	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		76,041,869
投資信託受益証券		892,621
投資証券		2,968,200
合計		79,902,690

### 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)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	304,332,116	—	316,984,261	12,652,145
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	3,500,216	—	3,501,892	△1,676
米ドル	3,500,216	—	3,501,892	△1,676
合計	—	—	—	12,650,469

(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ございません。

### (4) 【附属明細表】

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式(2021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	HALLIBURTON CO	275	19.32	5,313.00
		SCHLUMBERGER LTD	432	26.62	11,499.84
		APA CORPORATION	117	18.93	2,214.81
		CHEVRON CORP	596	96.00	57,216.00
		CONOCOPHILLIPS	419	55.58	23,288.02
		DEVON ENERGY CORP	183	28.45	5,206.35
		EXXON MOBIL CORP	1,309	54.09	70,803.81
		HESS CORP	84	68.58	5,760.72
		KINDER MORGAN INC	602	15.98	9,619.96
		MARATHON PETROLEUM CORP	201	57.25	11,507.25
		OCCIDENTAL PETE CORP	259	25.07	6,493.13
		ONEOK INC	138	52.40	7,231.20
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	72	150.30	10,821.60
		WILLIAMS COS	375	24.14	9,052.50
		AIR PRODUCTS	68	267.12	18,164.16
		ALBEMARLE CORP	36	243.41	8,762.76
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	66	45.40	2,996.40
		CORTEVA INC	230	43.58	10,023.40
		DOW INC	230	60.28	13,864.40
		EASTMAN CHEMICAL CO.	42	109.37	4,593.54
		ECOLAB INC	77	227.51	17,518.27
		FMC CORP	40	97.50	3,900.00
		INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	77	150.84	11,614.68
		LINDE PLC	162	312.70	50,657.40
		LYONDELLBASELL INDU-CL A	80	91.59	7,327.20
		MOSAIC CO/THE	107	31.57	3,377.99
		PPG INDUSTRIES	73	154.56	11,282.88
		MARTIN MARIETTA MATERIALS	19	367.79	6,988.01
		BALL CORP	101	95.46	9,641.46
		IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	122	58.58	7,146.76
WESTROCK CO	81	51.78	4,194.18		
FREEMONT-MCMORAN INC	451	34.81	15,699.31		
NEWMONT CORP	247	57.31	14,155.57		
HOWMET AEROSPACE INC	121	31.67	3,832.07		

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	64	232.05	14,851.20
TRANSDIGM GROUP INC	17	598.07	10,167.19
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	223	75.63	16,865.49
TRANE TECHNOLOGIES PLC	74	190.17	14,072.58
AMETEK INC	71	131.76	9,354.96
EATON CORP PLC	123	161.53	19,868.19
EMERSON ELEC	186	100.08	18,614.88
ROCKWELL AUTOMATION INC	36	315.03	11,341.08
GENERAL ELECTRIC CO	338	103.29	34,912.02
ROPER TECHNOLOGIES INC	32	478.91	15,325.12
CATERPILLAR INC DEL	169	205.42	34,715.98
CUMMINS INC	46	232.98	10,717.08
DEERE & COMPANY	97	364.84	35,389.48
DOVER CORP	44	174.84	7,692.96
FORTIVE CORP	105	75.78	7,956.90
IDEX CORP	23	217.74	5,008.02
ILLINOIS TOOL WORKS INC	89	219.99	19,579.11
INGERSOLL-RAND INC	115	53.89	6,197.35
PACCAR	107	83.21	8,903.47
PARKER HANNIFIN CORP	40	288.02	11,520.80
PENTAIR PLC	51	76.20	3,886.20
SNAP-ON INC	17	220.31	3,745.27
STANLEY BLACK & DECKER INC	50	188.55	9,427.50
WABTEC CORP	55	89.30	4,911.50
XYLEM INC	56	133.94	7,500.64
FASTENAL CO	178	53.41	9,506.98
GRAINGER(W.W.) INC	14	416.54	5,831.56
UNITED RENTALS INC	22	342.08	7,525.76
CINTAS CORP	27	400.06	10,801.62
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	65	123.99	8,059.35
WASTE MANAGEMENT INC	120	153.80	18,456.00
FEDEX CORPORATION	75	259.22	19,441.50
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	222	189.01	41,960.22
ALASKA AIR GROUP INC	38	58.20	2,211.60
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	198	20.20	3,999.60

DELTA AIR LINES INC	197	41.09	8,094.73
CSX CORP	708	31.35	22,195.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	78	247.62	19,314.36
UNION PAC CORP	207	210.05	43,480.35
APTIV PLC	83	148.93	12,361.19
BORGWARNER INC	74	42.60	3,152.40
FORD MOTOR COMPANY	1,208	12.76	15,414.08
GENERAL MOTORS CO	392	48.42	18,980.64
TESLA INC	239	754.86	180,411.54
LEGGETT & PLATT INC	41	47.14	1,932.74
NEWELL BRANDS INC	117	25.62	2,997.54
PULTEGROUP INC	82	48.48	3,975.36
WHIRLPOOL CORP	19	217.24	4,127.56
HASBRO INC	39	98.04	3,823.56
HANESBRANDS INC	108	18.82	2,032.56
NIKE INC-B	393	163.34	64,192.62
PVH CORP	22	110.78	2,437.16
RALPH LAUREN CORPORATION	15	113.76	1,706.40
TAPESTRY INC	86	40.52	3,484.72
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	58	23.16	1,343.28
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	60	20.00	1,200.00
V F CORP	99	72.15	7,142.85
BOOKING HOLDINGS INC	13	2,318.67	30,142.71
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	86	125.75	10,814.50
LAS VEGAS SANDS CORP	102	43.67	4,454.34
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	82	136.09	11,159.38
MCDONALD'S CORP	231	238.61	55,118.91
MGM RESORTS INTERNATIONAL	127	42.76	5,430.52
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	68	81.65	5,552.20
STARBUCKS CORP	364	118.79	43,239.56
YUM BRANDS INC	93	129.25	12,020.25
AMAZON.COM INC	133	3,484.16	463,393.28
EBAY INC	200	73.00	14,600.00
ETSY INC	39	216.63	8,448.57
DOLLAR TREE INC	73	91.20	6,657.60

NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信 (2635) 2021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 2021

TARGET CORP	155	245.44	38,043.20
BEST BUY COMPANY INC	71	112.39	7,979.69
CARMAX INC	50	133.23	6,661.50
GAP INC	64	24.60	1,574.40
HOME DEPOT	329	331.77	109,152.33
LOWES COS INC	219	203.01	44,459.19
TJX COS INC	371	69.45	25,765.95
KROGER CO	235	46.13	10,840.55
SYSCO CORP	158	77.97	12,319.26
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	222	50.57	11,226.54
WALMART INC	429	146.42	62,814.18
BROWN-FORMAN CORP-CL B	56	71.20	3,987.20
COCA COLA CO	1,199	55.86	66,976.14
CONSTELLATION BRANDS INC-A	53	216.01	11,448.53
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	58	46.05	2,670.90
PEPSICO INC	427	155.73	66,496.71
ARCHER DANIELS MIDLAND	173	59.66	10,321.18
CAMPBELL SOUP CO	63	42.80	2,696.40
CONAGRA BRANDS INC	151	33.22	5,016.22
GENERAL MILLS	189	58.45	11,047.05
HERSHEY CO/THE	45	175.40	7,893.00
HORMEL FOODS CORP	87	42.20	3,671.40
JM SMUCKER CO/THE-NEW	34	120.78	4,106.52
KELLOGG CO	79	63.00	4,977.00
KRAFT HEINZ CO/THE	200	36.56	7,312.00
MCCORMICK & CO INC.	77	86.76	6,680.52
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	437	60.61	26,486.57
TYSON FOODS INC-CL A	91	75.58	6,877.78
COLGATE PALMOLIVE CO.	262	77.30	20,252.60
PROCTER & GAMBLE CO	761	143.99	109,576.39
ABBOTT LABORATORIES	548	127.98	70,133.04
BAXTER INTERNATIONAL INC.	156	81.72	12,748.32
BECTON, DICKINSON	90	260.15	23,413.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	438	45.41	19,889.58
DANAHER CORP	196	328.38	64,362.48

NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信 (2635) 2021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 2021

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	193	122.08	23,561.44
HOLOGIC INC	80	79.95	6,396.00
IDEXX LABORATORIES INC	26	676.57	17,590.82
MEDTRONIC PLC	417	133.43	55,640.31
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	23	461.24	10,608.52
AMERISOURCEBERGEN CORP	46	123.60	5,685.60
ANTHEM INC	76	371.43	28,228.68
CARDINAL HEALTH INC	91	53.29	4,849.39
CIGNA CORP	109	213.95	23,320.55
CVS HEALTH CORP	405	85.41	34,591.05
DAVITA INC	22	129.09	2,839.98
HENRY SCHEIN INC	44	77.77	3,421.88
HUMANA INC	40	417.12	16,684.80
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	30	303.16	9,094.80
MCKESSON CORP	49	204.64	10,027.36
QUEST DIAGNOSTICS INC	41	157.35	6,451.35
UNITEDHEALTH GROUP INC	292	414.55	121,048.60
ABBVIE INC	546	107.27	58,569.42
AMGEN INC	179	215.58	38,588.82
BIOGEN INC	47	300.15	14,107.05
GILEAD SCIENCES INC	389	70.61	27,467.29
INCYTE CORP	58	72.69	4,216.02
REGENERON PHARMACEUTICALS	33	646.11	21,321.63
VERTEX PHARMACEUTICALS	80	188.09	15,047.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	693	63.58	44,060.94
ELI LILLY & CO.	246	240.00	59,040.00
MERCK & CO INC	782	73.82	57,727.24
PERRIGO CO PLC	41	44.22	1,813.02
PFIZER INC	1,725	46.03	79,401.75
VIATRIS INC	373	14.29	5,330.17
BANK OF AMERICA CORP	2,349	40.93	96,144.57
CITIGROUP	645	70.46	45,446.70
COMERICA INC	43	73.12	3,144.16
FIFTH THIRD BANCORP	220	38.80	8,536.00
JPMORGAN CHASE & CO	937	159.19	149,161.03

KEYCORP	300	19.97	5,991.00
PNC FINANCIAL	131	192.28	25,188.68
REGIONS FINANCIAL CORP	297	19.66	5,839.02
AFLAC INC	198	55.14	10,917.72
ALLSTATE CORP	94	132.09	12,416.46
ARTHUR J GALLAGHER & CO	60	145.39	8,723.40
ASSURANT INC	18	169.84	3,057.12
CHUBB LTD	139	181.08	25,170.12
GLOBE LIFE INC	29	93.09	2,699.61
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	111	68.62	7,616.82
LINCOLN NATIONAL CORP	56	66.45	3,721.20
MARSH & MCLENNAN COS	157	160.29	25,165.53
METLIFE INC	232	61.03	14,158.96
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	78	65.26	5,090.28
PROGRESSIVE CO	181	93.22	16,872.82
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	123	104.54	12,858.42
TRAVELERS COS INC/THE	78	157.96	12,320.88
UNUM GROUP	63	26.32	1,658.16
ACCENTURE PLC-CL A	196	341.10	66,855.60
AKAMAI TECHNOLOGIES	50	113.38	5,669.00
DXC TECHNOLOGY CO	79	35.49	2,803.71
MASTERCARD INC	271	351.41	95,232.11
VISA INC-CLASS A SHARES	524	227.49	119,204.76
ADOBE INC	148	661.68	97,928.64
ANSYS INC	27	371.97	10,043.19
AUTODESK INC.	68	287.68	19,562.24
INTUIT INC	85	567.75	48,258.75
MICROSOFT CORP	2,332	297.25	693,187.00
NORTONLIFELOCK INC	180	27.38	4,928.40
ORACLE CORPORATION	573	89.54	51,306.42
SALESFORCE.COM INC	299	260.74	77,961.26
ARISTA NETWORKS INC	17	358.13	6,088.21
CISCO SYSTEMS	1,305	58.60	76,473.00
JUNIPER NETWORKS INC	101	28.14	2,842.14
MOTOROLA SOLUTIONS INC	52	244.00	12,688.00

APPLE INC	4,860	154.07	748,780.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	402	14.66	5,893.32
HP INC	387	28.21	10,917.27
SEAGATE TECHNOLOGY	62	87.34	5,415.08
AMPHENOL CORP-CL A	185	75.22	13,915.70
CORNING INC	238	38.61	9,189.18
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	58	180.79	10,485.82
TE CONNECTIVITY LTD	102	145.77	14,868.54
TRIMBLE INC	78	93.65	7,304.70
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	17	577.47	9,816.99
ADVANCED MICRO DEVICES	375	106.15	39,806.25
ANALOG DEVICES INC	166	168.81	28,022.46
APPLIED MATERIALS	284	135.00	38,340.00
INTEL CORP	1,256	53.40	67,070.40
KLA CORP	48	347.83	16,695.84
LAM RESEARCH	44	593.61	26,118.84
MICRON TECHNOLOGY	346	72.87	25,213.02
NVIDIA CORP	768	221.77	170,319.36
QUALCOMM INC	351	141.58	49,694.58
TEXAS INSTRUMENTS INC	285	188.47	53,713.95
AT & T INC	2,205	27.42	60,461.10
VERIZON COMMUNICATIONS	1,279	54.44	69,628.76
EDISON INTERNATIONAL	117	58.66	6,863.22
ENTERGY CORP	62	112.94	7,002.28
EVERSOURCE ENERGY	106	89.81	9,519.86
EXELON CORPORATION	302	50.23	15,169.46
FIRSTENERGY CORP	168	38.37	6,446.16
NEXTERA ENERGY INC	606	85.84	52,019.04
CONSOLIDATED EDISON INC	106	76.38	8,096.28
PUBLIC SVC ENTERPRISE	156	63.32	9,877.92
SEMPRA ENERGY	94	133.81	12,578.14
AMERICAN WATER WORKS CO INC	56	187.54	10,502.24
AMERICAN EXPRESS CO	202	159.39	32,196.78
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	142	155.78	22,120.76
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	95	120.30	11,428.50

NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信 (2635) 2021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 2021

SYNCHRONY FINANCIAL	168	46.58	7,825.44
AMERIPRISE FINANCIAL INC	36	269.55	9,703.80
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	249	52.88	13,167.12
BLACKROCK INC	44	922.14	40,574.16
CBOE GLOBAL MARKETS INC	33	124.29	4,101.57
CME GROUP INC	111	192.46	21,363.06
FRANKLIN RESOURCES INC	84	31.36	2,634.24
GOLDMAN SACHS GROUP	106	404.58	42,885.48
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	174	119.45	20,784.30
INVESCO LTD	116	24.78	2,874.48
MARKETAXESS HOLDINGS INC	12	443.63	5,323.56
MOODYS CORP	50	382.50	19,125.00
MORGAN STANLEY	464	103.84	48,181.76
MSCI INC	26	652.86	16,974.36
NASDAQ INC	36	197.94	7,125.84
NORTHERN TRUST CORP	64	114.58	7,333.12
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	38	137.87	5,239.06
S&P GLOBAL INC	74	451.39	33,402.86
SCHWAB (CHARLES) CORP	463	72.33	33,488.79
STATE STREET CORP	109	87.89	9,580.01
T ROWE PRICE GROUP INC	70	217.21	15,204.70
AGILENT TECHNOLOGIES INC	94	177.23	16,659.62
BIO-RAD LABORATORIES-A	7	810.79	5,675.53
ILLUMINA INC	45	459.25	20,666.25
METTLER-TOLEDO INTL	7	1,584.80	11,093.60
PERKINELMER INC	35	186.85	6,539.75
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	122	568.78	69,391.16
WATERS CORP	19	422.02	8,018.38
IHS MARKIT LTD	115	119.85	13,782.75
LEIDOS HOLDINGS INC	41	99.06	4,061.46
NIELSEN HOLDINGS PLC	111	20.28	2,251.08
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	35	103.33	3,616.55
VERISK ANALYTICS INC	50	204.86	10,243.00
CBRE GROUP INC	104	98.14	10,206.56
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	44	785.41	34,558.04

	COMCAST CORP-CL A	1,413	59.56	84,158.28
	DISCOVERY INC - A	50	26.79	1,339.50
	DISCOVERY INC - C	90	25.72	2,314.80
	INTERPUBRIC GROUP	121	36.82	4,455.22
	NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	121	22.05	2,668.05
	NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	38	21.53	818.14
	OMNICOM GROUP	66	72.12	4,759.92
	ACTIVISION BLIZZARD INC	240	78.05	18,732.00
	DISNEY (WALT) CO	561	185.91	104,295.51
	ELECTRONIC ARTS	89	142.31	12,665.59
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	44	86.38	3,800.72
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	36	157.03	5,653.08
	ALPHABET INC-CL A	93	2,870.82	266,986.26
	ALPHABET INC-CL C	88	2,898.27	255,047.76
	小計 銘柄数：293			8,663,304.91
				(951,057,613)
	組入時価比率：72.9%			100.0%
合計				951,057,613
				(951,057,613)

(注1) 外貨建保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、外貨建保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(2021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	2,350	93,248.00	
		小計			
		銘柄数：1	2,350	93,248.00	
		組入時価比率：0.8%			(10,236,765)
				29.4%	
	合計			10,236,765	
				(10,236,765)	
投資証券	米ドル	AMERICAN TOWER CORP	140	41,554.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	43	9,718.00	
		BOSTON PROPERTIES	44	4,901.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	87	13,735.56	
		DUKE REALTY CORP	116	5,960.08	

		EQUINIX INC	28	23,927.68
		EQUITY RESIDENTIAL	106	8,741.82
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	20	6,566.00
		EXTRA SPACE STORAGE INC	41	7,672.74
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	167	5,946.87
		HOST HOTELS & RESORTS INC	218	3,507.62
		IRON MOUNTAIN INC	89	4,255.98
		KIMCO REALTY CORP	186	3,985.98
		PROLOGIS INC	229	30,850.88
		REALTY INCOME CORP	115	8,012.05
		REGENCY CENTERS CORP	49	3,351.60
		SIMON PROPERTY GROUP INC	102	13,325.28
		VENTAS INC	116	6,519.20
		VORNADO REALTY TRUST	49	2,029.09
		WELLTOWER INC	129	11,108.19
		WEYERHAEUSER CO	231	8,054.97
	小計	銘柄数 : 21	2,305	223,725.99
				(24,560,639)
		組入時価比率 : 1.9%		70.6%
	合計			24,560,639
				(24,560,639)
	合計			34,797,404
				(34,797,404)

(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。