



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 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 <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 (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 <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	5,775	(95.2)	291	(4.8)	6,066	(100.0)
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	7,846	(97.8)	179	(2.2)	8,025	(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	3,495	2,200	3,410	2,285
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	1,215	2,440	160	3,495

(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	6,144	78	6,066	265,498
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	8,062	37	8,025	229,634

(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	2,860
2022年3月期 FY ended Mar. 2022	820

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	122,103,767	236,673,004
コール・ローン Call loans	8,609,763	10,917,883
株式 Stocks	7,628,727,206	5,607,196,773
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	9,116,065	7,145,839
投資証券 Investment securities	208,166,476	161,066,292
未収入金 Accounts receivable - other	3,190,527	2,911,123
未収配当金 Accrued dividends receivable	8,942,967	7,531,243
差入委託証拠金 Margin deposits	74,122,694	111,511,485
流動資産合計 Total current assets	8,062,979,465	6,144,953,642
資産合計 Total assets	8,062,979,465	6,144,953,642
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	4,370,181	7,368,335
未払金 Accounts payable - other	1,027,675	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	28,659,000	65,351,000
未払受託者報酬 Trustee fees payable	582,731	1,043,293
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	1,456,751	2,608,154
未払利息 Accrued interest expenses	1	20
その他未払費用	1,165,047	1,946,471

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	37,261,386	78,317,273
負債合計 Total liabilities	37,261,386	78,317,273
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,990,000,000	4,570,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,035,718,079	1,496,636,369
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	132,925	228,462
元本等合計 Total principal and other	8,025,718,079	6,066,636,369
純資産合計 Total net assets	8,025,718,079	6,066,636,369
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	8,062,979,465	6,144,953,642

(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	33,600,637	73,121,508
受取利息 Interest income	2	56,237
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△369,429,097	△742,544,216
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△18,529,456	△40,065,708
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	259,499,733	1,901,820,677
その他収益 Other revenue	-	216,282
営業収益合計 Total operating revenue	△94,858,181	1,192,604,780
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	8,533	9,478

受託者報酬 Trustee fees	582, 731	1, 043, 293
委託者報酬 Investment trust management fees	1, 456, 751	2, 608, 154
その他費用 Other expenses	2, 800, 446	4, 286, 565
営業費用合計 Total operating expenses	4, 848, 461	7, 947, 490
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△99, 706, 642	1, 184, 657, 290
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△99, 706, 642	1, 184, 657, 290
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△99, 706, 642	1, 184, 657, 290
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	1, 035, 718, 079
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	910, 543, 200	1, 150, 092, 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	910, 543, 200	1, 150, 092, 000
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	83, 588, 800	1, 808, 480, 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	83, 588, 800	1, 808, 480, 000
分配金 Dividends	28, 659, 000	65, 351, 000
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1, 035, 718, 079	1, 496, 636, 369

(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、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 3,495,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,285,000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 2,296.34円 (100口当たり純資産額) (229,634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 2,654.98円 (100口当たり純資産額) (265,498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>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	<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>73,384,549円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>132,925円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>73,517,474円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>7,938,012円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>65,579,462円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>65,351,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>228,462円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>2,285,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>2,860円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	73,384,549円	分配準備積立金	B	132,925円	配当等収益合計額	C=A+B	73,517,474円	経費	D	7,938,012円	収益分配可能額	E=C-D	65,579,462円	収益分配金	F	65,351,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	228,462円	口数	H	2,285,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,860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																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	73,384,549円																																																											
分配準備積立金	B	132,925円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	73,517,474円																																																											
経費	D	7,938,012円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	65,579,462円																																																											
収益分配金	F	65,351,000円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	228,462円																																																											
口数	H	2,285,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,860円																																																											
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。	2. その他費用 その他費用のうち291,443円は上場に係る費用、1,903,161円は対象指数についての商標使用料、1,726,130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	第3期 自2022年3月11日
--------------------	--------------------

至 2022 年 3 月 10 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なっております。</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なっております。</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なっております。</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なっております。</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                      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                      これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                      同左</p> <p>2. 時価の算定方法                      同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

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 2,430,000,000円	期首元本額 6,990,000,000円
期中追加設定元本額 4,880,000,000円	期中追加設定元本額 4,400,000,000円
期中一部解約元本額 320,000,000円	期中一部解約元本額 6,820,000,000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	△377,726,980	△336,955,696
投資信託受益証券	△400,002	△145,025
投資証券	△4,346,623	△12,449,937
合計	△382,473,605	△349,550,658

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)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	177,958,644	—	173,590,113	△4,368,531	295,382,720	—	288,015,477	△7,367,243
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	29,000,300	—	29,001,950	△1,650	65,415,395	—	65,416,487	△1,092
米ドル	29,000,300	—	29,001,950	△1,650	65,415,395	—	65,416,487	△1,092
合計	—	—	—	△4,370,181	—	—	—	△7,368,335

(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(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	1,110	23.89	26,517.90	
		HALLIBURTON CO	1,070	28.41	30,398.70	
		SCHLUMBERGER LTD	1,680	38.17	64,125.60	
		APA CORPORATION	400	36.93	14,772.00	
		CHEVRON CORP	2,334	155.95	363,987.30	
		CONOCOPHILLIPS	1,537	108.32	166,487.84	
		COTERRA ENERGY INC	960	29.12	27,955.20	
		DEVON ENERGY CORP	730	68.91	50,304.30	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	203	132.19	26,834.57	
		EOG RESOURCES INC	696	118.31	82,343.76	
		EXXON MOBIL CORP	5,004	94.91	474,929.64	
		HESS CORP	329	118.10	38,854.90	
		KINDER MORGAN INC	2,320	18.03	41,829.60	
		MARATHON OIL CORP	840	25.61	21,512.40	
		MARATHON PETROLEUM CORP	643	98.45	63,303.35	
		OCCIDENTAL PETE CORP	1,060	64.61	68,486.60	
		ONEOK INC	529	61.31	32,432.99	
		PHILLIPS 66	572	85.93	49,151.96	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	267	234.02	62,483.34	
		VALERO ENERGY CORP	485	111.93	54,286.05	
WILLIAMS COS	1,450	32.00	46,400.00			
AIR PRODUCTS	263	253.83	66,757.29			
ALBEMARLE CORP	139	291.43	40,508.77			
CELANESE CORP-SERIES A	129	112.34	14,491.86			

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年9月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	248	102.46	25,410.08
CORTEVA INC	858	62.04	53,230.32
DOW INC	869	49.40	42,928.60
DUPONT DE NEMOURS INC	605	57.43	34,745.15
EASTMAN CHEMICAL CO.	153	91.85	14,053.05
ECOLAB INC	295	170.92	50,421.40
FMC CORP	150	109.98	16,497.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	303	114.16	34,590.48
LINDE PLC	598	283.91	169,778.18
LYONDELLBASELL INDU-CL A	307	82.50	25,327.50
MOSAIC CO/THE	430	54.16	23,288.80
PPG INDUSTRIES	281	127.76	35,900.56
SHERWIN-WILLIAMS	284	240.78	68,381.52
MARTIN MARIETTA MATERIALS	74	352.60	26,092.40
VULCAN MATERIALS CO	158	170.83	26,991.14
AMCOR PLC	1,790	12.18	21,802.20
AVERY DENNISON CORP	97	189.05	18,337.85
BALL CORP	375	58.87	22,076.25
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	441	41.57	18,332.37
PACKAGING CORP OP AMERICA	111	139.51	15,485.61
SEALED AIR CORP	170	54.27	9,225.90
WESTROCK CO	300	40.49	12,147.00
FREEMONT-MCMORAN INC	1,717	30.62	52,574.54
NEWMONT CORP	947	42.39	40,143.33
NUCOR CORP	316	139.42	44,056.72
BOEING CO	661	157.79	104,299.19
GENERAL DYNAMICS	274	227.69	62,387.06
HOWMET AEROSPACE INC	450	35.85	16,132.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	48	232.19	11,145.12
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	229	233.72	53,521.88
LOCKHEED MARTIN	281	419.65	117,921.65
NORTHROP GRUMMAN CORP	174	489.73	85,213.02
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,767	86.56	152,951.52
TEXTRON INC	256	64.14	16,419.84
TRANSDIGM GROUP INC	62	615.58	38,165.96

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022 年 9 月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

ALLEGION PLC	104	98.15	10,207.60
CARRIER GLOBAL CORP	1,003	42.12	42,246.36
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	160	63.11	10,097.60
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	831	57.46	47,749.26
MASCO CORP	276	51.18	14,125.68
SMITH (A.O.) CORP	150	56.85	8,527.50
TRANE TECHNOLOGIES PLC	278	163.29	45,394.62
QUANTA SERVICES INC	171	146.61	25,070.31
AMETEK INC	274	123.99	33,973.26
EATON CORP PLC	474	143.24	67,895.76
EMERSON ELEC	706	83.67	59,071.02
GENERAC HOLDINGS INC	76	233.23	17,725.48
ROCKWELL AUTOMATION INC	138	244.93	33,800.34
3M CORP	676	119.27	80,626.52
GENERAL ELECTRIC CO	1,308	73.77	96,491.16
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	809	187.82	151,946.38
CATERPILLAR INC DEL	634	183.15	116,117.10
CUMMINS INC	168	214.80	36,086.40
DEERE & COMPANY	332	368.48	122,335.36
DOVER CORP	171	127.85	21,862.35
FORTIVE CORP	423	65.27	27,609.21
IDEX CORP	90	208.59	18,773.10
ILLINOIS TOOL WORKS INC	337	203.96	68,734.52
INGERSOLL-RAND INC	480	49.31	23,668.80
NORDSON CORP	64	232.15	14,857.60
OTIS WORLDWIDE CORP	506	72.91	36,892.46
PACCAR	413	86.33	35,654.29
PARKER HANNIFIN CORP	153	274.76	42,038.28
PENTAIR PLC	200	45.67	9,134.00
SNAP-ON INC	63	222.35	14,008.05
STANLEY BLACK & DECKER INC	179	88.05	15,760.95
WABTEC CORP	217	89.79	19,484.43
XYLEM INC	214	96.43	20,636.02
FASTENAL CO	682	50.68	34,563.76

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年9月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

GRAINGER(W.W.) INC	51	570.79	29,110.29
UNITED RENTALS INC	85	304.93	25,919.05
CINTAS CORP	103	429.39	44,227.17
COPART INC	254	116.95	29,705.30
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	248	148.00	36,704.00
ROLLINS INC	270	36.23	9,782.10
WASTE MANAGEMENT INC	454	173.58	78,805.32
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	151	113.23	17,097.73
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	199	101.42	20,182.58
FEDEX CORPORATION	283	202.87	57,412.21
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	872	196.13	171,025.36
ALASKA AIR GROUP INC	150	45.69	6,853.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	770	13.96	10,749.20
DELTA AIR LINES INC	763	32.12	24,507.56
SOUTHWEST AIRLINES	707	37.66	26,625.62
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	386	38.88	15,007.68
CSX CORP	2,583	32.21	83,198.43
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	100	169.85	16,985.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	283	245.93	69,598.19
OLD DOMINION FREIGHT LINE	109	259.78	28,316.02
UNION PAC CORP	746	230.34	171,833.64
APTIV PLC	322	93.42	30,081.24
BORGWARNER INC	280	37.71	10,558.80
FORD MOTOR COMPANY	4,690	15.47	72,554.30
GENERAL MOTORS CO	1,730	40.50	70,065.00
TESLA INC	2,991	289.26	865,176.66
DR HORTON INC	376	72.07	27,098.32
GARMIN LTD	181	89.92	16,275.52
LENNAR CORP-A	309	78.41	24,228.69
MOHAWK INDUSTRIES	61	110.99	6,770.39
NEWELL BRANDS INC	440	17.44	7,673.60
NVR INC	4	4,191.61	16,766.44
PULTEGROUP INC	279	40.82	11,388.78
WHIRLPOOL CORP	67	155.78	10,437.26
HASBRO INC	160	79.77	12,763.20

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年9月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

NIKE INC-B	1,507	108.73	163,856.11
PVH CORP	80	57.88	4,630.40
RALPH LAUREN CORPORATION	55	94.22	5,182.10
TAPESTRY INC	300	34.58	10,374.00
V F CORP	382	42.74	16,326.68
BOOKING HOLDINGS INC	48	1,906.02	91,488.96
CAESARS ENTERTAINMENT INC	253	46.18	11,683.54
CARNIVAL CORP	1,160	10.08	11,692.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	33	1,707.01	56,331.33
DARDEN RESTAURANTS INC	148	130.46	19,308.08
DOMINOS PIZZA INC	43	362.00	15,566.00
EXPEDIA GROUP INC	180	104.98	18,896.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	331	132.97	44,013.07
LAS VEGAS SANDS CORP	410	37.65	15,436.50
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	327	159.40	52,123.80
MCDONALD'S CORP	879	260.08	228,610.32
MGM RESORTS INTERNATIONAL	417	34.06	14,203.02
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	500	14.28	7,140.00
PENN ENTERTAINMENT INC	190	32.21	6,119.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	269	45.16	12,148.04
STARBUCKS CORP	1,362	89.46	121,844.52
WYNN RESORTS LTD	130	61.67	8,017.10
YUM BRANDS INC	339	116.36	39,446.04
GENUINE PARTS CO	168	161.94	27,205.92
LKQ CORP	310	53.12	16,467.20
POOL CORP	48	353.21	16,954.08
AMAZON.COM INC	10,395	129.82	1,349,478.90
EBAY INC	666	44.25	29,470.50
ETSY INC	151	108.30	16,353.30
DOLLAR GENERAL CORP	272	247.41	67,295.52
DOLLAR TREE INC	267	141.56	37,796.52
TARGET CORP	549	171.90	94,373.10
ADVANCE AUTO PARTS	73	180.29	13,161.17
AUTOZONE	24	2,193.25	52,638.00
BATH & BODY WORKS INC	288	39.12	11,266.56

BEST BUY COMPANY INC	240	74.70	17,928.00
CARMAX INC	191	88.88	16,976.08
HOME DEPOT	1,228	299.90	368,277.20
LOWES COS INC	785	204.38	160,438.30
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	78	728.64	56,833.92
ROSS STORES INC	417	92.26	38,472.42
TJX COS INC	1,391	66.47	92,459.77
TRACTOR SUPPLY COMPANY	133	199.79	26,572.07
ULTA BEAUTY INC	62	445.34	27,611.08
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	527	529.12	278,846.24
KROGER CO	784	48.36	37,914.24
SYSCO CORP	605	83.04	50,239.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	849	35.96	30,530.04
WALMART INC	1,668	136.43	227,565.24
BROWN-FORMAN CORP-CL B	220	72.77	16,009.40
COCA COLA CO	4,635	62.12	287,926.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	193	248.24	47,910.32
KEURIG DR PEPPER INC	880	38.46	33,844.80
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	220	51.82	11,400.40
MONSTER BEVERAGE CORP	447	91.42	40,864.74
PEPSICO INC	1,643	172.67	283,696.81
ARCHER DANIELS MIDLAND	668	90.29	60,313.72
CAMPBELL SOUP CO	240	47.84	11,481.60
CONAGRA BRANDS INC	573	34.32	19,665.36
GENERAL MILLS	714	75.63	53,999.82
HERSHEY CO/THE	173	225.48	39,008.04
HORMEL FOODS CORP	340	46.84	15,925.60
JM SMUCKER CO/THE-NEW	129	138.64	17,884.56
KELLOGG CO	300	71.75	21,525.00
KRAFT HEINZ CO/THE	846	36.06	30,506.76
LAMB WESTON HOLDINGS INC	170	79.45	13,506.50
MCCORMICK & CO INC.	297	79.30	23,552.10
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,642	60.95	100,079.90
TYSON FOODS INC-CL A	348	73.94	25,731.12
ALTRIA GROUP INC	2,151	45.15	97,117.65

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,841	95.62	176,036.42
CHURCH & DWIGHT CO INC	288	80.84	23,281.92
CLOROX CO	146	145.80	21,286.80
COLGATE PALMOLIVE CO.	992	77.84	77,217.28
KIMBERLY-CLARK CORP	400	125.50	50,200.00
PROCTER & GAMBLE CO	2,850	137.86	392,901.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	275	247.94	68,183.50
ABBOTT LABORATORIES	2,080	106.99	222,539.20
ABIOMED INC	54	275.57	14,880.78
ALIGN TECHNOLOGY INC	87	257.30	22,385.10
BAXTER INTERNATIONAL INC.	599	58.70	35,161.30
BECTON, DICKINSON	339	260.50	88,309.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,703	42.71	72,735.13
DENTSPLY SIRONA INC	260	32.91	8,556.60
DEXCOM INC	466	91.59	42,680.94
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	739	95.52	70,589.28
HOLOGIC INC	300	68.87	20,661.00
IDEXX LABORATORIES INC	100	364.95	36,495.00
INTUITIVE SURGICAL INC	426	214.78	91,496.28
MEDTRONIC PLC	1,594	87.89	140,096.66
RESMED INC	174	233.07	40,554.18
STERIS PLC	119	204.83	24,374.77
STRYKER CORP	400	220.28	88,112.00
TELEFLEX INC	56	237.46	13,297.76
THE COOPER COMPANIES, INC.	59	307.90	18,166.10
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	249	110.79	27,586.71
AMERISOURCEBERGEN CORP	179	147.54	26,409.66
CARDINAL HEALTH INC	320	70.63	22,601.60
CENTENE CORP	695	91.26	63,425.70
CIGNA CORP	377	290.71	109,597.67
CVS HEALTH CORP	1,558	102.26	159,321.08
DAVITA INC	72	91.27	6,571.44
ELEVANCE HEALTH INC	286	489.35	139,954.10
HCA HEALTHCARE INC	270	216.21	58,376.70
HENRY SCHEIN INC	160	73.34	11,734.40

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年9月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

HUMANA INC	150	486.36	72,954.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	110	238.27	26,209.70
MCKESSON CORP	173	370.16	64,037.68
MOLINA HEALTHCARE INC	70	353.42	24,739.40
QUEST DIAGNOSTICS INC	139	130.20	18,097.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,115	527.51	588,173.65
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	80	101.24	8,099.20
ABBVIE INC	2,099	140.52	294,951.48
AMGEN INC	635	245.45	155,860.75
BIOGEN INC	174	207.98	36,188.52
GILEAD SCIENCES INC	1,490	65.10	96,999.00
INCYTE CORP	220	71.72	15,778.40
MODERNA INC	411	141.28	58,066.08
REGENERON PHARMACEUTICALS	128	708.85	90,732.80
VERTEX PHARMACEUTICALS	304	288.99	87,852.96
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,528	69.38	175,392.64
CATALENT INC	213	93.27	19,866.51
ELI LILLY & CO.	937	315.50	295,623.50
JOHNSON & JOHNSON	3,126	165.39	517,009.14
MERCK & CO INC	3,004	87.42	262,609.68
ORGANON & CO	310	29.36	9,101.60
PFIZER INC	6,663	47.08	313,694.04
VIATRIS INC	1,440	9.68	13,939.20
ZOETIS INC	559	158.49	88,595.91
BANK OF AMERICA CORP	8,427	34.65	291,995.55
CITIGROUP	2,307	49.90	115,119.30
CITIZENS FINANCIAL GROUP	582	37.83	22,017.06
COMERICA INC	155	84.61	13,114.55
FIFTH THIRD BANCORP	817	35.32	28,856.44
FIRST REPUBLIC BANK/CA	213	153.84	32,767.92
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,710	14.14	24,179.40
JPMORGAN CHASE & CO	3,489	118.60	413,795.40
KEYCORP	1,110	18.49	20,523.90
M & T BANK CORP	213	187.90	40,022.70
PNC FINANCIAL	491	162.85	79,959.35



NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022 年 9 月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

REGIONS FINANCIAL CORP	1,110	22.21	24,653.10
SIGNATURE BANK	75	181.08	13,581.00
SVB FINANCIAL GROUP	70	413.98	28,978.60
TRUIST FINANCIAL CORP	1,580	48.05	75,919.00
US BANCORP	1,606	47.05	75,562.30
WELLS FARGO CO	4,501	45.23	203,580.23
ZIONS BANCORP NA	180	58.26	10,486.80
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	2,149	283.34	608,897.66
AFLAC INC	704	61.67	43,415.68
ALLSTATE CORP	327	126.93	41,506.11
AMERICAN INTL GROUP	939	54.33	51,015.87
AON PLC	252	290.95	73,319.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	250	187.09	46,772.50
ASSURANT INC	64	164.42	10,522.88
BROWN & BROWN INC	280	65.55	18,354.00
CHUBB LTD	503	195.11	98,140.33
CINCINNATI FINANCIAL CORP	177	99.68	17,643.36
EVEREST RE GROUP LTD	47	285.53	13,419.91
GLOBE LIFE INC	108	100.92	10,899.36
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	389	66.37	25,817.93
LINCOLN NATIONAL CORP	190	48.87	9,285.30
LOEWS CORP	226	56.67	12,807.42
MARSH & MCLENNAN COS	596	166.27	99,096.92
METLIFE INC	821	66.82	54,859.22
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	280	76.80	21,504.00
PROGRESSIVE CO	695	129.22	89,807.90
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	445	96.95	43,142.75
TRAVELERS COS INC/THE	285	164.51	46,885.35
WILLIS TOWERS WATSON PLC	132	211.24	27,883.68
WR BERKLEY CORP	245	68.01	16,662.45
ACCENTURE PLC-CL A	752	287.96	216,545.92
AKAMAI TECHNOLOGIES	190	90.22	17,141.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	496	241.94	120,002.24
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	139	170.94	23,760.66
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	617	64.35	39,703.95

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年9月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

DXC TECHNOLOGY CO	290	26.60	7,714.00
EPAM SYSTEMS INC	68	428.67	29,149.56
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	726	89.79	65,187.54
FISERV INC	691	105.78	73,093.98
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	92	213.80	19,669.60
GARTNER INC	96	298.56	28,661.76
GLOBAL PAYMENTS INC	334	131.73	43,997.82
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	1,068	128.47	137,205.96
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	87	197.39	17,172.93
MASTERCARD INC	1,020	330.07	336,671.40
PAYCHEX INC	382	125.23	47,837.86
PAYPAL HOLDINGS INC	1,376	96.17	132,329.92
VERISIGN INC	113	187.33	21,168.29
VISA INC-CLASS A SHARES	1,955	200.71	392,388.05
ADOBE INC	561	383.63	215,216.43
ANSYS INC	103	254.88	26,252.64
AUTODESK INC.	258	209.82	54,133.56
CADENCE DESIGN SYS INC	328	171.84	56,363.52
CERIDIAN HCM HOLDING INC	160	62.76	10,041.60
CITRIX SYSTEMS INC	148	103.70	15,347.60
FORTINET INC	790	51.71	40,850.90
INTUIT INC	336	439.04	147,517.44
MICROSOFT CORP	8,885	258.52	2,296,950.20
NORTONLIFELOCK INC	690	23.39	16,139.10
ORACLE CORPORATION	1,869	74.65	139,520.85
PAYCOM SOFTWARE INC	57	364.56	20,779.92
PTC INC	125	119.59	14,948.75
ROPER TECHNOLOGIES INC	126	408.08	51,418.08
SALESFORCE INC	1,180	156.90	185,142.00
SERVICENOW INC	238	450.77	107,283.26
SYNOPSYS INC	182	333.76	60,744.32
TYLER TECHNOLOGIES INC	49	380.24	18,631.76
ARISTA NETWORKS INC	267	122.78	32,782.26
CISCO SYSTEMS	4,940	45.37	224,127.80
F5 INC	72	157.79	11,360.88

JUNIPER NETWORKS INC	380	28.69	10,902.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	199	250.36	49,821.64
APPLE INC	18,266	154.46	2,821,366.36
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,540	13.36	20,574.40
HP INC	1,248	27.50	34,320.00
NETAPP INC	260	71.41	18,566.60
SEAGATE TECHNOLOGY	235	66.13	15,540.55
WESTERN DIGITAL CORP	372	42.41	15,776.52
AMPHENOL CORP-CL A	710	74.88	53,164.80
CDW CORPORATION	161	174.36	28,071.96
CORNING INC	907	33.11	30,030.77
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	216	172.90	37,346.40
TE CONNECTIVITY LTD	383	127.16	48,702.28
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	56	380.07	21,283.92
TRIMBLE INC	294	61.39	18,048.66
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	62	298.30	18,494.60
ADVANCED MICRO DEVICES	1,925	82.78	159,351.50
ANALOG DEVICES INC	622	152.13	94,624.86
APPLIED MATERIALS	1,049	93.79	98,385.71
BROADCOM INC	485	511.93	248,286.05
ENPHASE ENERGY INC	160	317.41	50,785.60
INTEL CORP	4,857	30.75	149,352.75
KLA CORP	177	351.09	62,142.93
LAM RESEARCH	165	439.16	72,461.40
MICROCHIP TECHNOLOGY	662	65.74	43,519.88
MICRON TECHNOLOGY	1,324	55.39	73,336.36
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	52	438.78	22,816.56
NVIDIA CORP	2,975	139.90	416,202.50
NXP SEMICONDUCTORS NV	312	165.45	51,620.40
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	520	70.55	36,686.00
QORVO INC	129	91.12	11,754.48
QUALCOMM INC	1,331	128.85	171,499.35
SKYWORKS SOLUTIONS INC	191	99.88	19,077.08
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	66	314.16	20,734.56
TERADYNE INC	190	86.14	16,366.60

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022年9月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

TEXAS INSTRUMENTS INC	1,095	168.41	184,408.95
AT & T INC	8,500	16.77	142,545.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	1,100	9.66	10,626.00
VERIZON COMMUNICATIONS	4,992	41.32	206,269.44
T-MOBILE US INC	700	145.36	101,755.50
ALLIANT ENERGY CORP	293	62.84	18,412.12
AMERICAN ELECTRIC POWER	610	103.98	63,427.80
CONSTELLATION ENERGY	385	85.79	33,029.15
DUKE ENERGY CORP	915	109.20	99,918.00
EDISON INTERNATIONAL	457	68.53	31,318.21
ENTERGY CORP	242	118.48	28,672.16
EVERGY INC	276	70.12	19,353.12
EVERSOURCE ENERGY	410	91.42	37,482.20
EXELON CORPORATION	1,166	45.37	52,901.42
FIRSTENERGY CORP	681	41.03	27,941.43
NEXTERA ENERGY INC	2,334	90.27	210,690.18
NRG ENERGY INC	280	42.32	11,849.60
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	130	76.65	9,964.50
PPL CORPORATION	870	29.62	25,769.40
SOUTHERN CO.	1,263	79.41	100,294.83
XCEL ENERGY INC	650	76.59	49,783.50
ATMOS ENERGY CORP	165	117.95	19,461.75
AMEREN CORPORATION	307	94.82	29,109.74
CENTERPOINT ENERGY INC	750	32.70	24,525.00
CMS ENERGY CORP	340	69.51	23,633.40
CONSOLIDATED EDISON INC	421	100.66	42,377.86
DOMINION ENERGY INC	964	82.77	79,790.28
DTE ENERGY COMPANY	230	134.68	30,976.40
NISOURCE INC	480	30.24	14,515.20
PUBLIC SVC ENTERPRISE	589	67.88	39,981.32
SEMPRA ENERGY	373	172.94	64,506.62
WEC ENERGY GROUP INC	375	106.01	39,753.75
AMERICAN WATER WORKS CO INC	216	154.52	33,376.32
AMERICAN EXPRESS CO	725	153.52	111,302.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	467	106.44	49,707.48

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022 年 9 月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

DISCOVER FINANCIAL SERVICES	334	101.05	33,750.70
SYNCHRONY FINANCIAL	591	32.60	19,266.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	131	282.34	36,986.54
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	879	43.82	38,517.78
BLACKROCK INC	169	691.92	116,934.48
CBOE GLOBAL MARKETS INC	126	124.11	15,637.86
CME GROUP INC	427	201.98	86,245.46
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	45	448.84	20,197.80
FRANKLIN RESOURCES INC	330	26.26	8,665.80
GOLDMAN SACHS GROUP	408	335.38	136,835.04
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	663	103.21	68,428.23
INVESCO LTD	400	17.36	6,944.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	45	256.94	11,562.30
MOODYS CORP	191	296.11	56,557.01
MORGAN STANLEY	1,662	88.44	146,987.28
MSCI INC	96	482.90	46,358.40
NASDAQ INC	414	63.09	26,119.26
NORTHERN TRUST CORP	248	98.89	24,524.72
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	231	107.45	24,820.95
S&P GLOBAL INC	412	367.06	151,228.72
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,790	73.16	130,956.40
STATE STREET CORP	437	72.06	31,490.22
T ROWE PRICE GROUP INC	270	121.71	32,861.70
AES CORP	790	27.37	21,622.30
AGILENT TECHNOLOGIES INC	357	135.19	48,262.83
BIO TECHNE CORP	47	342.68	16,105.96
BIO-RAD LABORATORIES-A	26	500.33	13,008.58
CHARLES RIVER LABORATORIES	60	213.62	12,817.20
DANAHER CORP	769	288.10	221,548.90
ILLUMINA INC	187	207.31	38,766.97
IQVIA HOLDINGS INC	225	221.12	49,752.00
METTLER-TOLEDO INTL	27	1,284.31	34,676.37
PERKINELMER INC	150	138.62	20,793.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	465	566.56	263,450.40
WATERS CORP	72	308.62	22,220.64

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2022 年 9 月期 決算短信  
 NEXT FUNDS S&P 500 (Unhedged) Exchange Traded Fund (2633) Earnings Report for Fiscal Year ended September 2022

	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	88	308.13	27,115.44
	EQUIFAX INC	145	196.37	28,473.65
	JACOBS SOLUTIONS INC	163	123.28	20,094.64
	LEIDOS HOLDINGS INC	162	94.57	15,320.34
	NIELSEN HOLDINGS PLC	430	27.87	11,984.10
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	130	78.07	10,149.10
	VERISK ANALYTICS INC	188	191.10	35,926.80
	CBRE GROUP INC	387	79.75	30,863.25
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	138	395.91	54,635.58
	COMCAST CORP-CL A	5,307	34.37	182,401.59
	DISH NETWORK CORP-A	300	17.80	5,340.00
	FOX CORP-CLASS A	370	33.52	12,402.40
	FOX CORP-CLASS B	180	30.94	5,569.20
	INTERPUBRIC GROUP	470	27.71	13,023.70
	NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	460	16.80	7,728.00
	NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	140	17.04	2,385.60
	OMNICOM GROUP	243	67.89	16,497.27
	PARAMOUNT GLOBAL	726	22.71	16,487.46
	ACTIVISION BLIZZARD INC	929	77.39	71,895.31
	DISNEY (WALT) CO	2,164	112.33	243,082.12
	ELECTRONIC ARTS	334	127.14	42,464.76
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	163	90.73	14,788.99
	NETFLIX INC	528	227.44	120,088.32
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	188	120.58	22,669.04
	WARNER BROS DISCOVERY INC	2,622	12.54	32,879.88
	ALPHABET INC-CL A	7,146	108.38	774,483.48
	ALPHABET INC-CL C	6,552	109.42	716,919.84
	MATCH GROUP INC	344	59.15	20,347.60
	META PLATFORMS INC-CLASS A	2,725	162.06	441,613.50
	TWITTER INC	907	41.85	37,957.95
小計	銘柄数 : 473			38,990,312.03
				(5,607,196,773)
	組入時価比率 : 92.4%			100.0%
合計				5,607,196,773
				(5,607,196,773)

(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	VANGUARD S&P 500 ETF	135	49,689.45		
	小計	銘柄数 : 1	135	49,689.45		
					(7,145,839)	
			組入時価比率 : 0.1%		4.2%	
合計			7,145,839	(7,145,839)		
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	176	27,621.44		
		AMERICAN TOWER CORP	552	144,441.84		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	166	35,163.78		
		BOSTON PROPERTIES	169	14,473.16		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	127	16,908.78		
		CROWN CASTLE INC	514	89,554.22		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	338	41,459.08		
		DUKE REALTY CORP	455	27,509.30		
		EQUINIX INC	108	70,297.20		
		EQUITY RESIDENTIAL	404	31,019.12		
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	78	21,471.84		
		EXTRA SPACE STORAGE INC	160	32,553.60		
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	85	8,709.10		
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	640	17,062.40		
		HOST HOTELS & RESORTS INC	850	15,019.50		
		IRON MOUNTAIN INC	346	18,268.80		
		KIMCO REALTY CORP	730	15,811.80		
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	137	23,562.63		
		PROLOGIS INC	879	112,432.89		
		PUBLIC STORAGE	181	61,429.59		
		REALTY INCOME CORP	715	47,447.40		
		REGENCY CENTERS CORP	180	11,115.00		
SBA COMMUNICATIONS CORP	128	42,138.88				
SIMON PROPERTY GROUP INC	390	39,990.60				

		UDR INC	360	16,977.60	
		VENTAS INC	475	23,042.25	
		VICI PROPERTIES INC	1,140	38,098.80	
		VORNADO REALTY TRUST	200	5,544.00	
		WELLTOWER INC	537	41,010.69	
		WEYERHAEUSER CO	880	29,858.40	
	小計	銘柄数：30	12,100	1,119,993.69	
				(161,066,292)	
		組入時価比率：2.7%		95.8%	
	合計			161,066,292	
				(161,066,292)	
	合計			168,212,131	
				(168,212,131)	

(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。