



2024年9月期 (2024年3月11日～2024年9月10日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended September 2024 (March 11, 2024 – September 10, 2024)

2024年10月22日
 October 22, 2024

| | | | |
|---------|---------------------------------------|---|-----------------|
| | | 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 https://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 https://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 2024年11月27日
 分配金支払開始日 2024年10月18日
 Scheduled date of submission of securities report: November 27, 2024
 Date of commencing dividend payment: October 18, 2024

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2024年9月期の運用状況 (2024年3月11日～2024年9月10日)

Management Status for Year ended September 2024 (from March 11, 2024 to September 10, 2024)

(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. | % |
| 2024年9月期 FY ended Sep. 2024 | 13,067 | (98.4) | 210 | (1.6) | 13,277 | (100.0) |
| 2024年3月期 FY ended Mar. 2024 | 8,769 | (94.6) | 502 | (5.4) | 9,271 | (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 |
| 2024年9月期 FY ended Sep. 2024 | 26,413 | 22,560 | 12,260 | 36,713 |
| 2024年3月期 FY ended Mar. 2024 | 1,805 | 15,490 | 7,127 | 26,413 |

(注) 2023年12月8日付で受益権口数1口につき、10口の割合をもって再分割を行っております。2024年3月期は、前計算期間の末日に再分割が行われたと仮定して発行済口数を算定しております。

(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 |
| 2024年9月期 FY ended Sep. 2024 | 13,350 | 73 | 13,277 | 36,165 |
| 2024年3月期 FY ended Mar. 2024 | 9,320 | 48 | 9,271 | 35,101 |

(4) 分配金

Dividend Payment

| | 100口当り分配金 Dividend per 100 units |
|--------------------------------|-------------------------------------|
| | 円 JPY |
| 2024年9月期 FY ended Sep. 2024 | 170 |
| 2024年3月期 FY ended Mar. 2024 | 170 |

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6期 (2024年3月10日現在) 6th Fiscal Year As of March 10, 2024 | 第7期 (2024年9月10日現在) 7th Fiscal Year As of September 10, 2024 |
|---|--|--|
| | 金額 Amount | 金額 Amount |
| 資産の部 Assets | | |
| 流動資産 Current assets | | |
| 預金 Deposits | 115,827,783 | 39,915,894 |
| コール・ローン Call loans | 10,896,568 | 15,765,066 |
| 株式 Stocks | 8,566,891,932 | 12,758,743,296 |
| 投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities | 11,546,076 | 5,766,805 |
| 投資証券 Investment securities | 190,771,247 | 302,542,434 |
| 派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives | 4,998,037 | - |
| 未収入金 Accounts receivable - other | - | 20,182,858 |
| 未収配当金 Accrued dividends receivable | 9,497,884 | 13,208,525 |
| 未収利息 Accrued interest | - | 102 |
| 差入委託証拠金 Margin deposits | 409,623,567 | 194,411,795 |
| 流動資産合計 Total current assets | 9,320,053,094 | 13,350,536,775 |
| 資産合計 Total assets | 9,320,053,094 | 13,350,536,775 |
| 負債の部 Liabilities | | |
| 流動負債 Current liabilities | | |
| 派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives | 2,272 | 4,695,158 |
| 未払収益分配金 Unpaid dividends | 44,902,100 | 62,412,100 |
| 未払受託者報酬 Trustee fees payable | 747,830 | 1,252,082 |
| 未払委託者報酬 Investment trust management fees payable | 1,645,805 | 2,504,092 |
| 未払利息 | 12 | - |

| | | |
|--|---------------|----------------|
| Accrued interest expenses | | |
| その他未払費用 Other accrued expenses | 1,424,620 | 2,394,631 |
| 流動負債合計 Total current liabilities | 48,722,639 | 73,258,063 |
| 負債合計 Total liabilities | 48,722,639 | 73,258,063 |
| 純資産の部 Net assets | | |
| 元本等 Principal and other | | |
| 元本 Principal | 5,282,600,000 | 7,342,600,000 |
| 剰余金 Surplus | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period | 3,988,730,455 | 5,934,678,712 |
| (分配準備積立金) (Reserve for distribution) | 2,526,897 | 3,602,025 |
| 元本等合計 Total principal and other | 9,271,330,455 | 13,277,278,712 |
| 純資産合計 Total net assets | 9,271,330,455 | 13,277,278,712 |
| 負債純資産合計 Total liabilities and net assets | 9,320,053,094 | 13,350,536,775 |

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

(単位：円) (Unit：JPY)

| | 第6期 自 2023年9月11日 至 2024年3月10日 6th Fiscal Year From September 11, 2023 to March 10, 2024 | 第7期 自 2024年3月11日 至 2024年9月10日 7th Fiscal Year From March 11, 2024 to September 10, 2024 |
|---|--|--|
| | 金額 Amount | 金額 Amount |
| 営業収益 Operating revenue | | |
| 受取配当金 Dividend income | 46,239,309 | 64,627,420 |
| 受取利息 Interest income | 879,275 | 735,190 |
| 有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other | 1,011,892,412 | 477,370,526 |
| 派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives | 76,045,455 | 20,309,069 |
| 為替差損益 Foreign exchange gains or losses | △12,209,071 | △532,104,266 |
| その他収益 Other revenue | 5,798,469 | 6,626,555 |
| 営業収益合計 Total operating revenue | 1,128,645,849 | 37,564,494 |
| 営業費用 Operating expenses | | |

| | | |
|--|---------------|---------------|
| 支払利息 Interest expenses | 8,705 | 102 |
| 受託者報酬 Trustee fees | 747,830 | 1,252,082 |
| 委託者報酬 Investment trust management fees | 1,645,805 | 2,504,092 |
| その他費用 Other expenses | 3,152,275 | 4,745,661 |
| 営業費用合計 Total operating expenses | 5,554,615 | 8,501,937 |
| 営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss) | 1,123,091,234 | 29,062,557 |
| 経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss) | 1,123,091,234 | 29,062,557 |
| 当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss) | 1,123,091,234 | 29,062,557 |
| 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 | 1,822,436,351 | 3,988,730,455 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit | 1,803,097,090 | 4,103,136,200 |
| 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 | 1,803,097,090 | 4,103,136,200 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit | 714,992,120 | 2,123,838,400 |
| 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 | 714,992,120 | 2,123,838,400 |
| 分配金 Dividends | 44,902,100 | 62,412,100 |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period | 3,988,730,455 | 5,934,678,712 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

| | |
|------------------------|---|
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. 費用・収益の計上基準 | 受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。 |
| 5. その他 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2024 年 3 月 11 日から 2024 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 6 期 2024 年 3 月 10 日現在 | 第 7 期 2024 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 26,413,000 口 | 1. 計算期間の末日における受益権の総数 36,713,000 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 351.01 円 (100 口当たり純資産額) (35,101 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 361.65 円 (100 口当たり純資産額) (36,165 円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第 6 期 自 2023 年 9 月 11 日 至 2024 年 3 月 10 日 | 第 7 期 自 2024 年 3 月 11 日 至 2024 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>52,908,348 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>66,559 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>52,974,907 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>5,545,910 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>47,428,997 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>44,902,100 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>2,526,897 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>26,413,000 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>170 円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 | | | 当期配当等収益額 | A | 52,908,348 円 | 分配準備積立金 | B | 66,559 円 | 配当等収益合計額 | C=A+B | 52,974,907 円 | 経費 | D | 5,545,910 円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 47,428,997 円 | 収益分配金 | F | 44,902,100 円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 2,526,897 円 | 口数 | H | 26,413,000 口 | 100 口当たり分配金 | I=F/H×100 | 170 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>71,989,063 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,526,897 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>74,515,960 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>8,501,835 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>66,014,125 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>62,412,100 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>3,602,025 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>36,713,000 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>170 円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 | | | 当期配当等収益額 | A | 71,989,063 円 | 分配準備積立金 | B | 2,526,897 円 | 配当等収益合計額 | C=A+B | 74,515,960 円 | 経費 | D | 8,501,835 円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 66,014,125 円 | 収益分配金 | F | 62,412,100 円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 3,602,025 円 | 口数 | H | 36,713,000 口 | 100 口当たり分配金 | I=F/H×100 | 170 円 |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当期配当等収益額 | A | 52,908,348 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金 | B | 66,559 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 配当等収益合計額 | C=A+B | 52,974,907 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 経費 | D | 5,545,910 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配可能額 | E=C-D | 47,428,997 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金 | F | 44,902,100 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 2,526,897 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 口数 | H | 26,413,000 口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 100 口当たり分配金 | I=F/H×100 | 170 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当期配当等収益額 | A | 71,989,063 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金 | B | 2,526,897 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 配当等収益合計額 | C=A+B | 74,515,960 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 経費 | D | 8,501,835 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配可能額 | E=C-D | 66,014,125 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金 | F | 62,412,100 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 3,602,025 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 口数 | H | 36,713,000 口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 100 口当たり分配金 | I=F/H×100 | 170 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2. その他費用 その他費用のうち 1,360,757 円は対象指数についての商標使用料、1,138,932 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 2,284,938 円は対象指数についての商標使用料、1,538,410 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6期 自 2023年9月11日 至 2024年3月10日 | 第7期 自 2024年3月11日 至 2024年9月10日 |
|---|--|
| <p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> | <p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> |

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| 第6期 2024年3月10日現在 | 第7期 2024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</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> |

| | |
|--------------------------------|--|
| 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6期 自 2023年9月11日 至 2024年3月10日 | 第7期 自 2024年3月11日 至 2024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6期 自 2023年9月11日 至 2024年3月10日 | 第7期 自 2024年3月11日 至 2024年9月10日 |
|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 期首元本額 | 3,610,000,000円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,098,000,000円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,425,400,000円 |
| 期首元本額 | 5,282,600,000円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,512,000,000円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,452,000,000円 |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類 | 第6期 自 2023年9月11日 至 2024年3月10日 | 第7期 自 2024年3月11日 至 2024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 | 975,748,619 | 411,905,425 |
| 投資信託受益証券 | 605,043 | △28,591 |
| 投資証券 | 13,786,700 | 29,055,180 |
| 合計 | 990,140,362 | 440,932,014 |

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6期(2024年3月10日現在) | | | | 第7期(2024年9月10日現在) | | | |
|-----------|-------------------|-------|-------------|-----------|-------------------|-------|-------------|------------|
| | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | うち1年超 | | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 株価指数先物取引 | | | | | | | | |
| 買建 | 491,092,593 | — | 496,090,630 | 4,998,037 | 201,309,796 | — | 196,618,158 | △4,691,638 |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売建 | 47,283,200 | — | 47,285,472 | △2,272 | 63,131,200 | — | 63,134,720 | △3,520 |
| 米ドル | 47,283,200 | — | 47,285,472 | △2,272 | 63,131,200 | — | 63,134,720 | △3,520 |
| 合計 | — | — | — | 4,995,765 | — | — | — | △4,695,158 |

(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いません。

※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(2024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 | 1,980 | 33.69 | 66,706.20 | |
| | | HALLIBURTON CO | 1,750 | 28.68 | 50,190.00 | |
| | | SCHLUMBERGER LTD | 2,830 | 40.41 | 114,360.30 | |
| | | APA CORPORATION | 710 | 24.92 | 17,693.20 | |
| | | CHEVRON CORP | 3,392 | 140.30 | 475,897.60 | |
| | | CONOCOPHILLIPS | 2,314 | 105.60 | 244,358.40 | |
| | | COTERRA ENERGY INC | 1,470 | 22.80 | 33,516.00 | |
| | | DEVON ENERGY CORP | 1,250 | 41.40 | 51,750.00 | |
| | | DIAMONDBACK ENERGY INC | 353 | 179.21 | 63,261.13 | |
| | | EOG RESOURCES INC | 1,134 | 120.50 | 136,647.00 | |
| | | EQT CORP | 1,180 | 31.91 | 37,653.80 | |
| | | EXXON MOBIL CORP | 8,883 | 115.01 | 1,021,633.83 | |
| | | HESS CORP | 544 | 128.88 | 70,110.72 | |
| | | KINDER MORGAN INC | 3,820 | 21.12 | 80,678.40 | |
| | | MARATHON OIL CORP | 1,120 | 26.63 | 29,825.60 | |
| | | MARATHON PETROLEUM CORP | 697 | 163.25 | 113,785.25 | |
| | | OCCIDENTAL PETE CORP | 1,330 | 52.18 | 69,399.40 | |
| | | ONEOK INC | 1,159 | 92.04 | 106,674.36 | |
| | | PHILLIPS 66 | 843 | 127.97 | 107,878.71 | |
| | | TARGA RESOURCES CORP | 437 | 143.93 | 62,897.41 | |
| VALERO ENERGY CORP | 644 | 134.16 | 86,399.04 | | | |
| WILLIAMS COS | 2,410 | 44.52 | 107,293.20 | | | |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | |
|-----------------------------------|-------|--------|------------|
| AIR PRODUCTS | 440 | 273.82 | 120,480.80 |
| ALBEMARLE CORP | 230 | 78.41 | 18,034.30 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 204 | 120.36 | 24,553.44 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 359 | 78.47 | 28,170.73 |
| CORTEVA INC | 1,378 | 55.80 | 76,892.40 |
| DOW INC | 1,389 | 51.30 | 71,255.70 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 825 | 79.56 | 65,637.00 |
| EASTMAN CHEMICAL CO. | 236 | 98.01 | 23,130.36 |
| ECOLAB INC | 503 | 249.19 | 125,342.57 |
| FMC CORP | 240 | 61.07 | 14,656.80 |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE | 504 | 103.46 | 52,143.84 |
| LINDE PLC | 952 | 463.08 | 440,852.16 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 513 | 94.78 | 48,622.14 |
| MOSAIC CO/THE | 640 | 25.06 | 16,038.40 |
| PPG INDUSTRIES | 462 | 126.14 | 58,276.68 |
| SHERWIN-WILLIAMS | 462 | 363.90 | 168,121.80 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 122 | 506.18 | 61,753.96 |
| VULCAN MATERIALS CO | 262 | 231.83 | 60,739.46 |
| AMCOR PLC | 2,900 | 11.10 | 32,190.00 |
| AVERY DENNISON CORP | 160 | 219.58 | 35,132.80 |
| BALL CORP | 610 | 64.29 | 39,216.90 |
| IP (INTERNATIONAL PAPER CO) | 691 | 47.61 | 32,898.51 |
| PACKAGING CORP OP AMERICA | 177 | 204.53 | 36,201.81 |
| SMURFIT WESTROCK PLC | 1,030 | 44.47 | 45,804.10 |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 2,847 | 40.40 | 115,018.80 |
| NEWMONT CORP | 2,280 | 50.72 | 115,641.60 |
| NUCOR CORP | 473 | 140.92 | 66,655.16 |
| STEEL DYNAMICS | 291 | 110.74 | 32,225.34 |
| AXON ENTERPRISE INC | 140 | 364.39 | 51,014.60 |
| BOEING CO | 1,140 | 162.91 | 185,717.40 |
| GENERAL DYNAMICS | 450 | 301.56 | 135,702.00 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 2,165 | 165.35 | 357,982.75 |
| HOWMET AEROSPACE INC | 770 | 93.69 | 72,141.30 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 78 | 267.74 | 20,883.72 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 376 | 229.27 | 86,205.52 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024 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 2024

| | | | |
|------------------------------------|-------|----------|------------|
| LOCKHEED MARTIN | 423 | 576.57 | 243,889.11 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 276 | 524.21 | 144,681.96 |
| RTX CORP | 2,638 | 121.16 | 319,620.08 |
| TEXTRON INC | 381 | 86.88 | 33,101.28 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 111 | 1,302.77 | 144,607.47 |
| ALLEGION PLC | 171 | 134.56 | 23,009.76 |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 241 | 166.16 | 40,044.56 |
| CARRIER GLOBAL CORP | 1,663 | 70.73 | 117,623.99 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 1,331 | 68.60 | 91,306.60 |
| MASCO CORP | 436 | 77.32 | 33,711.52 |
| SMITH (A. O.) CORP | 236 | 77.89 | 18,382.04 |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 448 | 345.30 | 154,694.40 |
| QUANTA SERVICES INC | 290 | 250.06 | 72,517.40 |
| AMETEK INC | 459 | 164.30 | 75,413.70 |
| EATON CORP PLC | 792 | 289.38 | 229,188.96 |
| EMERSON ELEC | 1,136 | 99.58 | 113,122.88 |
| GE VERNOVA INC | 543 | 201.81 | 109,582.83 |
| GENERAC HOLDINGS INC | 125 | 142.37 | 17,796.25 |
| HUBBELL INC | 106 | 378.12 | 40,080.72 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 226 | 259.25 | 58,590.50 |
| 3M CORP | 1,092 | 128.46 | 140,278.32 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 1,290 | 201.16 | 259,496.40 |
| CATERPILLAR INC DEL | 969 | 334.04 | 323,684.76 |
| CUMMINS INC | 271 | 296.81 | 80,435.51 |
| DEERE & COMPANY | 513 | 387.23 | 198,648.99 |
| DOVER CORP | 272 | 178.89 | 48,658.08 |
| FORTIVE CORP | 697 | 72.31 | 50,400.07 |
| IDEX CORP | 150 | 197.17 | 29,575.50 |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 538 | 246.74 | 132,746.12 |
| INGERSOLL-RAND INC | 800 | 87.45 | 69,960.00 |
| NORDSON CORP | 108 | 247.36 | 26,714.88 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 805 | 91.68 | 73,802.40 |
| PACCAR | 1,041 | 94.97 | 98,863.77 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 255 | 580.20 | 147,951.00 |
| PENTAIR PLC | 330 | 86.52 | 28,551.60 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | |
|-----------------------------------|-------|--------|--------------|
| SNAP-ON INC | 104 | 277.02 | 28,810.08 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 300 | 96.19 | 28,857.00 |
| WABTEC CORP | 345 | 162.72 | 56,138.40 |
| XYLEM INC | 482 | 129.31 | 62,327.42 |
| FASTENAL CO | 1,132 | 68.09 | 77,077.88 |
| GRAINGER(W.W.) INC | 87 | 972.14 | 84,576.18 |
| UNITED RENTALS INC | 132 | 695.94 | 91,864.08 |
| CINTAS CORP | 171 | 804.72 | 137,607.12 |
| COPART INC | 1,736 | 49.42 | 85,793.12 |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A | 405 | 205.30 | 83,146.50 |
| ROLLINS INC | 560 | 49.66 | 27,809.60 |
| VERALTO CORP | 440 | 109.49 | 48,175.60 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 723 | 208.46 | 150,716.58 |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 230 | 101.07 | 23,246.10 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC | 280 | 122.53 | 34,308.40 |
| FEDEX CORPORATION | 448 | 283.30 | 126,918.40 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 1,448 | 128.88 | 186,618.24 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 1,250 | 11.22 | 14,025.00 |
| DELTA AIR LINES INC | 1,283 | 43.68 | 56,041.44 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 1,190 | 29.73 | 35,378.70 |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 650 | 48.75 | 31,687.50 |
| CSX CORP | 3,873 | 33.76 | 130,752.48 |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC | 161 | 171.74 | 27,650.14 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 447 | 256.81 | 114,794.07 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 353 | 189.78 | 66,992.34 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 4,140 | 69.80 | 288,972.00 |
| UNION PAC CORP | 1,208 | 251.11 | 303,340.88 |
| APTIV PLC | 540 | 69.08 | 37,303.20 |
| BORGWARNER INC | 450 | 32.88 | 14,796.00 |
| FORD MOTOR COMPANY | 7,780 | 10.66 | 82,934.80 |
| GENERAL MOTORS CO | 2,260 | 47.40 | 107,124.00 |
| TESLA INC | 5,495 | 216.27 | 1,188,403.65 |
| DR HORTON INC | 587 | 187.52 | 110,074.24 |
| GARMIN LTD | 302 | 182.94 | 55,247.88 |
| LENNAR CORP-A | 487 | 180.20 | 87,757.40 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| MOHAWK INDUSTRIES | 100 | 149.14 | 14,914.00 |
| NVR INC | 6 | 9,149.74 | 54,898.44 |
| PULTEGROUP INC | 420 | 131.60 | 55,272.00 |
| HASBRO INC | 260 | 67.63 | 17,583.80 |
| DECKERS OUTDOOR CORP | 51 | 894.09 | 45,598.59 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 227 | 248.58 | 56,428.79 |
| NIKE INC-B | 2,401 | 79.49 | 190,855.49 |
| RALPH LAUREN CORPORATION | 77 | 173.69 | 13,374.13 |
| TAPESTRY INC | 460 | 41.29 | 18,993.40 |
| AIRBNB INC-CLASS A | 872 | 116.36 | 101,465.92 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 67 | 3,802.89 | 254,793.63 |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 420 | 36.00 | 15,120.00 |
| CARNIVAL CORP | 2,040 | 16.03 | 32,701.20 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 2,720 | 54.29 | 147,668.80 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 233 | 156.71 | 36,513.43 |
| DOMINOS PIZZA INC | 69 | 420.16 | 28,991.04 |
| EXPEDIA GROUP INC | 250 | 132.86 | 33,215.00 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 495 | 214.94 | 106,395.30 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 720 | 40.00 | 28,800.00 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA | 475 | 228.59 | 108,580.25 |
| MCDONALD'S CORP | 1,427 | 291.29 | 415,670.83 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 497 | 34.97 | 17,380.09 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 830 | 17.50 | 14,525.00 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 469 | 160.26 | 75,161.94 |
| STARBUCKS CORP | 2,244 | 92.21 | 206,919.24 |
| WYNN RESORTS LTD | 190 | 76.91 | 14,612.90 |
| YUM BRANDS INC | 553 | 133.04 | 73,571.12 |
| GENUINE PARTS CO | 276 | 136.61 | 37,704.36 |
| LKQ CORP | 530 | 39.98 | 21,189.40 |
| POOL CORP | 76 | 346.48 | 26,332.48 |
| AMAZON.COM INC | 18,139 | 175.40 | 3,181,580.60 |
| EBAY INC | 1,006 | 59.43 | 59,786.58 |
| ETSY INC | 230 | 52.35 | 12,040.50 |
| AUTOZONE | 34 | 3,120.50 | 106,097.00 |
| BATH & BODY WORKS INC | 430 | 27.54 | 11,842.20 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | |
|------------------------------|-------|----------|------------|
| BEST BUY COMPANY INC | 380 | 98.09 | 37,274.20 |
| CARMAX INC | 310 | 80.63 | 24,995.30 |
| HOME DEPOT | 1,963 | 365.52 | 717,515.76 |
| LOWES COS INC | 1,133 | 244.73 | 277,279.09 |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC, | 117 | 1,124.02 | 131,510.34 |
| ROSS STORES INC | 669 | 150.79 | 100,878.51 |
| TJX COS INC | 2,239 | 117.07 | 262,119.73 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 214 | 272.79 | 58,377.06 |
| ULTA BEAUTY INC | 95 | 381.57 | 36,249.15 |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 878 | 896.49 | 787,118.22 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 438 | 80.98 | 35,469.24 |
| DOLLAR TREE INC | 415 | 67.42 | 27,979.30 |
| KROGER CO | 1,324 | 51.97 | 68,808.28 |
| SYSCO CORP | 986 | 78.41 | 77,312.26 |
| TARGET CORP | 915 | 150.59 | 137,789.85 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 1,459 | 8.91 | 12,999.69 |
| WALMART INC | 8,460 | 77.34 | 654,296.40 |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B | 350 | 46.34 | 16,219.00 |
| COCA COLA CO | 7,675 | 71.85 | 551,448.75 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 319 | 250.89 | 80,033.91 |
| KEURIG DR PEPPER INC | 2,070 | 37.27 | 77,148.90 |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B | 362 | 55.94 | 20,250.28 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 1,400 | 50.74 | 71,036.00 |
| PEPSICO INC | 2,725 | 178.19 | 485,567.75 |
| ARCHER DANIELS MIDLAND | 983 | 59.50 | 58,488.50 |
| BUNGE GLOBAL SA | 280 | 98.92 | 27,697.60 |
| CAMPBELL SOUP CO | 380 | 51.74 | 19,661.20 |
| CONAGRA BRANDS INC | 943 | 32.83 | 30,958.69 |
| GENERAL MILLS | 1,121 | 75.15 | 84,243.15 |
| HERSHEY CO/THE | 292 | 203.25 | 59,349.00 |
| HORMEL FOODS CORP | 560 | 32.40 | 18,144.00 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 215 | 120.18 | 25,838.70 |
| KELLANOVA | 524 | 80.17 | 42,009.08 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 1,566 | 36.05 | 56,454.30 |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 280 | 63.17 | 17,687.60 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | |
|--------------------------------|-------|--------|------------|
| MCCORMICK & CO INC. | 499 | 83.24 | 41,536.76 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 2,660 | 75.71 | 201,388.60 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 568 | 65.78 | 37,363.04 |
| ALTRIA GROUP INC | 3,401 | 54.13 | 184,096.13 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 3,079 | 127.45 | 392,418.55 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 482 | 105.60 | 50,899.20 |
| CLOROX CO | 250 | 165.20 | 41,300.00 |
| COLGATE PALMOLIVE CO. | 1,626 | 107.11 | 174,160.86 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 668 | 147.18 | 98,316.24 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 4,674 | 176.06 | 822,904.44 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 460 | 86.91 | 39,978.60 |
| KENVUE INC | 3,789 | 23.20 | 87,904.80 |
| ABBOTT LABORATORIES | 3,444 | 116.43 | 400,984.92 |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 139 | 221.38 | 30,771.82 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC. | 1,010 | 39.23 | 39,622.30 |
| BECTON, DICKINSON | 572 | 237.22 | 135,689.84 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 2,913 | 82.65 | 240,759.45 |
| COOPER COS INC/THE | 398 | 108.03 | 42,995.94 |
| DEXCOM INC | 789 | 69.71 | 55,001.19 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 1,197 | 65.71 | 78,654.87 |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC | 843 | 85.12 | 71,756.16 |
| HOLOGIC INC | 466 | 82.69 | 38,533.54 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 164 | 480.34 | 78,775.76 |
| INSULET CORP | 139 | 219.13 | 30,459.07 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 702 | 479.39 | 336,531.78 |
| MEDTRONIC PLC | 2,628 | 90.62 | 238,149.36 |
| RESMED INC | 291 | 249.56 | 72,621.96 |
| SOLVENTUM CORP | 270 | 67.03 | 18,098.10 |
| STERIS PLC | 196 | 245.50 | 48,118.00 |
| STRYKER CORP | 671 | 362.78 | 243,425.38 |
| TELEFLEX INC | 93 | 245.04 | 22,788.72 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 408 | 104.83 | 42,770.64 |
| CARDINAL HEALTH INC | 482 | 112.80 | 54,369.60 |
| CENCORA INC | 328 | 236.53 | 77,581.84 |
| CENTENE CORP | 1,055 | 70.84 | 74,736.20 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | |
|-----------------------------|--------|----------|--------------|
| CVS HEALTH CORP | 2,485 | 56.47 | 140,327.95 |
| DAVITA INC | 103 | 150.24 | 15,474.72 |
| ELEVANCE HEALTH INC | 460 | 543.66 | 250,083.60 |
| HCA HEALTHCARE INC | 384 | 384.95 | 147,820.80 |
| HENRY SCHEIN INC | 252 | 68.89 | 17,360.28 |
| HUMANA INC | 239 | 343.76 | 82,158.64 |
| LABCORP HOLDINGS INC | 167 | 226.91 | 37,893.97 |
| MCKESSON CORP | 257 | 509.42 | 130,920.94 |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 116 | 323.72 | 37,551.52 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 220 | 154.29 | 33,943.80 |
| THE CIGNA GROUP | 563 | 357.61 | 201,334.43 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 1,823 | 594.10 | 1,083,044.30 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 118 | 226.51 | 26,728.18 |
| ABBVIE INC | 3,497 | 196.42 | 686,880.74 |
| AMGEN INC | 1,062 | 325.92 | 346,127.04 |
| BIOGEN INC | 288 | 199.27 | 57,389.76 |
| GILEAD SCIENCES INC | 2,472 | 79.17 | 195,708.24 |
| INCYTE CORP | 310 | 62.26 | 19,300.60 |
| MODERNA INC | 665 | 76.61 | 50,945.65 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 210 | 1,144.77 | 240,401.70 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS | 511 | 471.11 | 240,737.21 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 4,018 | 48.50 | 194,873.00 |
| CATALENT INC | 360 | 59.91 | 21,567.60 |
| ELI LILLY & CO. | 1,581 | 908.27 | 1,435,974.87 |
| JOHNSON & JOHNSON | 4,762 | 166.61 | 793,396.82 |
| MERCK & CO INC | 5,014 | 115.41 | 578,665.74 |
| PFIZER INC | 11,223 | 29.41 | 330,068.43 |
| VIATRIS INC | 2,340 | 11.13 | 26,044.20 |
| ZOETIS INC | 899 | 191.73 | 172,365.27 |
| BANK OF AMERICA CORP | 13,477 | 39.47 | 531,937.19 |
| CITIGROUP | 3,777 | 59.54 | 224,882.58 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 900 | 41.45 | 37,305.00 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 1,357 | 41.60 | 56,451.20 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 2,900 | 14.66 | 42,514.00 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 5,687 | 216.81 | 1,232,998.47 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | |
|-------------------------------|-------|--------|--------------|
| KEYCORP | 1,830 | 16.18 | 29,609.40 |
| M & T BANK CORP | 326 | 168.78 | 55,022.28 |
| PNC FINANCIAL | 791 | 182.61 | 144,444.51 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 1,810 | 22.55 | 40,815.50 |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 2,650 | 42.60 | 112,890.00 |
| US BANCORP | 3,086 | 45.26 | 139,672.36 |
| WELLS FARGO CO | 6,901 | 54.59 | 376,725.59 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 3,585 | 459.61 | 1,647,701.85 |
| CORPAY INC | 139 | 307.40 | 42,728.60 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 1,106 | 82.39 | 91,123.34 |
| FISERV INC | 1,158 | 172.44 | 199,685.52 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 509 | 110.00 | 55,990.00 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 145 | 171.90 | 24,925.50 |
| MASTERCARD INC | 1,626 | 487.09 | 792,008.34 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 2,073 | 69.35 | 143,762.55 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 3,118 | 285.61 | 890,531.98 |
| AFLAC INC | 1,027 | 109.40 | 112,353.80 |
| ALLSTATE CORP | 523 | 187.20 | 97,905.60 |
| AMERICAN INTL GROUP | 1,319 | 72.82 | 96,049.58 |
| AON PLC | 431 | 350.49 | 151,061.19 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 736 | 111.73 | 82,233.28 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 433 | 298.94 | 129,441.02 |
| ASSURANT INC | 103 | 193.26 | 19,905.78 |
| BROWN & BROWN INC | 470 | 103.72 | 48,748.40 |
| CHUBB LTD | 804 | 292.20 | 234,928.80 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 311 | 137.47 | 42,753.17 |
| EVEREST GROUP LTD | 86 | 387.02 | 33,283.72 |
| GLOBE LIFE INC | 170 | 103.36 | 17,571.20 |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES | 589 | 116.91 | 68,859.99 |
| LOEWS CORP | 356 | 80.48 | 28,650.88 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 976 | 230.58 | 225,046.08 |
| METLIFE INC | 1,181 | 75.48 | 89,141.88 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 423 | 79.21 | 33,505.83 |
| PROGRESSIVE CO | 1,160 | 251.31 | 291,519.60 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 713 | 114.95 | 81,959.35 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | |
|---------------------------------|--------|----------|--------------|
| TRAVELERS COS INC/THE | 454 | 241.10 | 109,459.40 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 202 | 294.36 | 59,460.72 |
| WR BERKLEY CORP | 602 | 59.38 | 35,746.76 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 1,245 | 341.81 | 425,553.45 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 303 | 95.07 | 28,806.21 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 987 | 76.13 | 75,140.31 |
| EPAM SYSTEMS INC | 115 | 206.12 | 23,703.80 |
| GARTNER INC | 154 | 492.83 | 75,895.82 |
| GODADDY INC - CLASS A | 280 | 152.87 | 42,803.60 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 1,819 | 203.53 | 370,221.07 |
| VERISIGN INC | 175 | 181.96 | 31,843.00 |
| ADOBE INC | 887 | 569.88 | 505,483.56 |
| ANSYS INC | 173 | 309.70 | 53,578.10 |
| AUTODESK INC. | 424 | 255.67 | 108,404.08 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 539 | 252.81 | 136,264.59 |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 457 | 246.58 | 112,687.06 |
| FAIR ISAAC CORP | 49 | 1,776.49 | 87,048.01 |
| FORTINET INC | 1,255 | 75.10 | 94,250.50 |
| GEN DIGITAL INC | 1,090 | 25.72 | 28,034.80 |
| INTUIT INC | 554 | 626.99 | 347,352.46 |
| MICROSOFT CORP | 14,720 | 405.72 | 5,972,198.40 |
| ORACLE CORPORATION | 3,158 | 139.89 | 441,772.62 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 640 | 344.05 | 220,192.00 |
| PTC INC | 240 | 167.80 | 40,272.00 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 212 | 553.39 | 117,318.68 |
| SALESFORCE INC | 1,924 | 245.76 | 472,842.24 |
| SERVICENOW INC | 406 | 855.58 | 347,365.48 |
| SYNOPSYS INC | 302 | 464.16 | 140,176.32 |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 84 | 588.99 | 49,475.16 |
| ARISTA NETWORKS INC | 503 | 324.77 | 163,359.31 |
| CISCO SYSTEMS | 8,020 | 48.70 | 390,574.00 |
| F5 INC | 116 | 199.93 | 23,191.88 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 640 | 38.34 | 24,537.60 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 330 | 438.87 | 144,827.10 |
| APPLE INC | 28,547 | 220.91 | 6,306,317.77 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 2,570 | 17.60 | 45,232.00 |
| HP INC | 1,708 | 34.18 | 58,379.44 |
| NETAPP INC | 412 | 114.60 | 47,215.20 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 385 | 101.34 | 39,015.90 |
| SUPER MICRO COMPUTER INC | 100 | 409.87 | 40,987.00 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 642 | 62.61 | 40,195.62 |
| AMPHENOL CORP-CL A | 2,380 | 60.73 | 144,537.40 |
| CDW CORPORATION | 266 | 214.14 | 56,961.24 |
| CORNING INC | 1,527 | 40.97 | 62,561.19 |
| JABIL INC | 240 | 102.68 | 24,643.20 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 343 | 145.82 | 50,016.26 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 608 | 144.82 | 88,050.56 |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 94 | 424.26 | 39,880.44 |
| TRIMBLE INC | 480 | 54.31 | 26,068.80 |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 102 | 327.93 | 33,448.86 |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 3,205 | 138.15 | 442,770.75 |
| ANALOG DEVICES INC | 982 | 218.56 | 214,625.92 |
| APPLIED MATERIALS | 1,646 | 177.55 | 292,247.30 |
| BROADCOM INC | 8,632 | 140.82 | 1,215,558.24 |
| ENPHASE ENERGY INC | 267 | 103.04 | 27,511.68 |
| FIRST SOLAR INC | 212 | 205.36 | 43,536.32 |
| INTEL CORP | 8,427 | 19.07 | 160,702.89 |
| KLA CORP | 267 | 709.89 | 189,540.63 |
| LAM RESEARCH | 259 | 734.31 | 190,186.29 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY | 1,075 | 75.41 | 81,065.75 |
| MICRON TECHNOLOGY | 2,192 | 86.27 | 189,103.84 |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 96 | 836.01 | 80,256.96 |
| NVIDIA CORP | 48,720 | 106.47 | 5,187,218.40 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 506 | 230.60 | 116,683.60 |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 849 | 69.39 | 58,912.11 |
| QORVO INC | 195 | 105.27 | 20,527.65 |
| QUALCOMM INC | 2,213 | 160.77 | 355,784.01 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 320 | 99.81 | 31,939.20 |
| TERADYNE INC | 306 | 124.20 | 38,005.20 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 1,803 | 201.17 | 362,709.51 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024 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 2024

| | | | |
|-----------------------------|--------|--------|------------|
| AT & T INC | 14,200 | 21.50 | 305,300.00 |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 8,332 | 42.73 | 356,026.36 |
| T-MOBILE US INC | 1,021 | 195.30 | 199,401.30 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 510 | 59.25 | 30,217.50 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 1,042 | 103.66 | 108,013.72 |
| CONSTELLATION ENERGY | 624 | 174.92 | 109,150.08 |
| DUKE ENERGY CORP | 1,532 | 117.16 | 179,489.12 |
| EDISON INTERNATIONAL | 760 | 86.09 | 65,428.40 |
| ENTERGY CORP | 422 | 122.17 | 51,555.74 |
| EVERGY INC | 460 | 60.44 | 27,802.40 |
| EVERSOURCE ENERGY | 699 | 68.06 | 47,573.94 |
| EXELON CORPORATION | 1,976 | 38.73 | 76,530.48 |
| FIRSTENERGY CORP | 1,030 | 44.48 | 45,814.40 |
| NEXTERA ENERGY INC | 4,069 | 81.19 | 330,362.11 |
| NRG ENERGY INC | 410 | 77.92 | 31,947.20 |
| PG&E CORP | 4,230 | 19.81 | 83,796.30 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP | 220 | 89.48 | 19,685.60 |
| PPL CORPORATION | 1,460 | 32.44 | 47,362.40 |
| SOUTHERN CO. | 2,168 | 89.32 | 193,645.76 |
| XCEL ENERGY INC | 1,103 | 63.49 | 70,029.47 |
| ATMOS ENERGY CORP | 300 | 133.80 | 40,140.00 |
| AMEREN CORPORATION | 526 | 84.59 | 44,494.34 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 1,270 | 27.41 | 34,810.70 |
| CMS ENERGY CORP | 590 | 69.12 | 40,780.80 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 687 | 104.75 | 71,963.25 |
| DOMINION ENERGY INC | 1,662 | 57.37 | 95,348.94 |
| DTE ENERGY COMPANY | 414 | 124.62 | 51,592.68 |
| NISOURCE INC | 890 | 33.45 | 29,770.50 |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE | 989 | 80.42 | 79,535.38 |
| SEMPRA | 1,256 | 82.94 | 104,172.64 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 627 | 94.86 | 59,477.22 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 382 | 146.01 | 55,775.82 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 1,125 | 250.92 | 282,285.00 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 761 | 142.60 | 108,518.60 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 495 | 133.33 | 65,998.35 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | |
|-------------------------------|-------|----------|------------|
| SYNCHRONY FINANCIAL | 791 | 48.17 | 38,102.47 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 197 | 436.35 | 85,960.95 |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP | 1,479 | 67.72 | 100,157.88 |
| BLACKROCK INC | 277 | 877.94 | 243,189.38 |
| BLACKSTONE INC | 1,412 | 139.77 | 197,355.24 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 208 | 211.34 | 43,958.72 |
| CME GROUP INC | 713 | 218.54 | 155,819.02 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 75 | 428.90 | 32,167.50 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 570 | 19.55 | 11,143.50 |
| GOLDMAN SACHS GROUP | 639 | 488.57 | 312,196.23 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 1,140 | 161.70 | 184,338.00 |
| INVESCO LTD | 870 | 15.93 | 13,859.10 |
| KKR & CO INC-A | 1,320 | 118.46 | 156,367.20 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 75 | 257.80 | 19,335.00 |
| MOODYS CORP | 311 | 482.25 | 149,979.75 |
| MORGAN STANLEY | 2,483 | 98.18 | 243,780.94 |
| MSCI INC | 157 | 558.34 | 87,659.38 |
| NASDAQ INC | 824 | 71.65 | 59,039.60 |
| NORTHERN TRUST CORP | 410 | 87.76 | 35,981.60 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 369 | 116.85 | 43,117.65 |
| S&P GLOBAL INC | 634 | 515.83 | 327,036.22 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 2,960 | 63.01 | 186,509.60 |
| STATE STREET CORP | 600 | 83.66 | 50,196.00 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 447 | 103.54 | 46,282.38 |
| AES CORP | 1,410 | 16.20 | 22,842.00 |
| VISTRA CORP | 650 | 74.95 | 48,717.50 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 585 | 138.09 | 80,782.65 |
| BIO TECHNE CORP | 310 | 72.09 | 22,347.90 |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 39 | 323.09 | 12,600.51 |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | 100 | 188.16 | 18,816.00 |
| DANAHER CORP | 1,306 | 273.09 | 356,655.54 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 361 | 240.87 | 86,954.07 |
| METTLER-TOLEDO INTL | 42 | 1,384.77 | 58,160.34 |
| REVVITY INC | 240 | 118.76 | 28,502.40 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 756 | 620.42 | 469,037.52 |

NEXT FUNDS S&P 500 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 (2633) 2024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 2024

| | | | | |
|------------------------------------|--------|--------|------------------|--|
| WATERS CORP | 117 | 332.10 | 38,855.70 | |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 144 | 302.03 | 43,492.32 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 811 | 275.59 | 223,503.49 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 234 | 210.65 | 49,292.10 | |
| DAYFORCE INC | 310 | 56.81 | 17,611.10 | |
| EQUIFAX INC | 245 | 297.39 | 72,860.55 | |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 252 | 144.54 | 36,424.08 | |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 272 | 153.46 | 41,741.12 | |
| PAYCHEX INC | 632 | 132.22 | 83,563.04 | |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 94 | 163.82 | 15,399.08 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 283 | 273.25 | 77,329.75 | |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 194 | 324.84 | 63,018.96 | |
| COMCAST CORP-CL A | 7,747 | 39.72 | 307,710.84 | |
| FOX CORP-CLASS A | 460 | 40.06 | 18,427.60 | |
| FOX CORP-CLASS B | 250 | 37.09 | 9,272.50 | |
| INTERPUBRIC GROUP | 750 | 31.06 | 23,295.00 | |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I | 750 | 26.60 | 19,950.00 | |
| NEWS CORP/NEW-CL B-W/I | 230 | 27.64 | 6,357.20 | |
| OMNICOM GROUP | 390 | 98.90 | 38,571.00 | |
| PARAMOUNT GLOBAL | 1,020 | 10.31 | 10,516.20 | |
| DISNEY (WALT) CO | 3,607 | 88.34 | 318,642.38 | |
| ELECTRONIC ARTS | 483 | 144.30 | 69,696.90 | |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 281 | 94.80 | 26,638.80 | |
| NETFLIX INC | 853 | 675.42 | 576,133.26 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 316 | 156.32 | 49,397.12 | |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 4,442 | 7.30 | 32,426.60 | |
| ALPHABET INC-CL A | 11,636 | 148.71 | 1,730,389.56 | |
| ALPHABET INC-CL C | 9,675 | 149.54 | 1,446,799.50 | |
| MATCH GROUP INC | 530 | 36.03 | 19,095.90 | |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 4,340 | 504.79 | 2,190,788.60 | |
| CBRE GROUP INC | 594 | 115.26 | 68,464.44 | |
| COSTAR GROUP INC | 804 | 79.53 | 63,942.12 | |
| 小計 銘柄数 : 474 | | | 88,892,519.31 | |
| | | | (12,758,743,296) | |
| 組入時価比率 : 96.1% | | | 100.0% | |

| | | | | |
|----|--|--|------------------|--|
| 合計 | | | 12,758,743,296 | |
| | | | (12,758,743,296) | |

(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(2024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 | 80 | 40,178.40 | |
| | | 小計 | 80 | 40,178.40 | |
| | | 銘柄数: 1 | | (5,766,805) | |
| | | 組入時価比率: 0.0% | | 1.9% | |
| | 合計 | | 5,766,805 | (5,766,805) | |
| 投資証券 | 米ドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 310 | 36,657.50 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 925 | 220,640.25 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 281 | 63,362.69 | |
| | | BXP INC | 280 | 20,804.00 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 210 | 25,477.20 | |
| | | CROWN CASTLE INC | 857 | 100,731.78 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 641 | 95,726.94 | |
| | | EQUINIX INC | 188 | 156,378.40 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 684 | 51,368.40 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 127 | 38,106.35 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 424 | 74,089.76 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 148 | 17,333.76 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 1,390 | 30,760.70 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 1,420 | 23,813.40 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 1,140 | 40,686.60 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 576 | 63,584.64 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 1,320 | 30,742.80 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 229 | 36,708.70 | |
| | | PROLOGIS INC | 1,834 | 238,878.50 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 313 | 110,019.50 | |
| REALTY INCOME CORP | 1,725 | 108,433.50 | | | |
| REGENCY CENTERS CORP | 330 | 24,565.20 | | | |

| | | | | | |
|--|----|--------------------------|--------|---------------|--|
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 213 | 51,083.79 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 646 | 104,606.78 | |
| | | UDR INC | 600 | 26,712.00 | |
| | | VENTAS INC | 805 | 51,648.80 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 2,070 | 70,090.20 | |
| | | WELLTOWER INC | 1,188 | 151,268.04 | |
| | | WEYERHAEUSER CO | 1,440 | 43,588.80 | |
| | 小計 | 銘柄数：29 | 22,314 | 2,107,868.98 | |
| | | | | (302,542,434) | |
| | | 組入時価比率：2.3% | | 98.1% | |
| | 合計 | | | 302,542,434 | |
| | | | | (302,542,434) | |
| | 合計 | | | 308,309,239 | |
| | | | | (308,309,239) | |

(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。