



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 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 <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 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 <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	4,321	(94.2)	265	(5.8)	4,587	(100.0)
2024年3月期 FY ended Mar. 2024	3,884	(92.3)	324	(7.7)	4,208	(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	1,163	280	220	1,223
2024年3月期 FY ended Mar. 2024	1,283	140	260	1,163

(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	4,632	44	4,587	375,118
2024年3月期 FY ended Mar. 2024	4,237	28	4,208	361,890

(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	2,050
2024年3月期 FY ended Mar. 2024	2,130

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	147,159,729	38,109,018
コール・ローン Call loans	7,982,468	10,967,049
株式 Stocks	3,795,020,995	4,208,487,809
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	553,824	8,776,342
投資証券 Investment securities	88,620,120	104,448,233
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	27,483,477	591,486
未収入金 Accounts receivable - other	22,148,068	-
未収配当金 Accrued dividends receivable	4,412,980	4,633,954
未収利息 Accrued interest	-	71
差入委託証拠金 Margin deposits	143,769,752	256,617,442
流動資産合計 Total current assets	4,237,151,413	4,632,631,404
資産合計 Total assets	4,237,151,413	4,632,631,404
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,285	7,460,689
未払金 Accounts payable - other	-	8,274,433
未払収益分配金 Unpaid dividends	24,771,900	25,071,500
未払受託者報酬 Trustee fees payable	429,657	494,124
未払委託者報酬	2,363,077	2,717,627

Investment trust management fees payable		
未払利息 Accrued interest expenses	9	-
その他未払費用 Other accrued expenses	799,737	923,139
流動負債合計 Total current liabilities	28,365,665	44,941,512
負債合計 Total liabilities	28,365,665	44,941,512
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	2,326,000,000	2,446,000,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	1,882,785,748	2,141,689,892
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	24,733	68,520
元本等合計 Total principal and other	4,208,785,748	4,587,689,892
純資産合計 Total net assets	4,208,785,748	4,587,689,892
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	4,237,151,413	4,632,631,404

(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	24,819,244	25,400,305
受取利息 Interest income	848,490	292,217
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	492,695,904	231,820,738
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	48,903,882	19,082,414
為替差損益 Foreign exchange gains or losses	36,245,803	△105,266,195
その他収益 Other revenue	3,110,330	4,138,093
営業収益合計 Total operating revenue	606,623,653	175,467,572

営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	3,685	59
受託者報酬 Trustee fees	429,657	494,124
委託者報酬 Investment trust management fees	2,363,077	2,717,627
その他費用 Other expenses	1,256,925	1,503,518
営業費用合計 Total operating expenses	4,053,344	4,715,328
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	602,570,309	170,752,244
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	602,570,309	170,752,244
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	602,570,309	170,752,244
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	1,460,750,939	1,882,785,748
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	168,655,800	543,477,600
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	168,655,800	543,477,600
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	324,419,400	430,254,200
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	324,419,400	430,254,200
分配金 Dividends	24,771,900	25,071,500
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	1,882,785,748	2,141,689,892

(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>
--------------------	---

	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。
	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。
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、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 1,163,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,223,000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 3,618.90円 (100口当たり純資産額) (361,890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 3,751.18円 (100口当たり純資産額) (375,118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>28,774,379円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>71,913円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>28,846,292円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>4,049,659円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>24,796,633円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>24,771,900円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>24,733円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,163,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>2,130円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	28,774,379円	分配準備積立金	B	71,913円	配当等収益合計額	C=A+B	28,846,292円	経費	D	4,049,659円	収益分配可能額	E=C-D	24,796,633円	収益分配金	F	24,771,900円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	24,733円	口数	H	1,163,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,130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>29,830,556円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>24,733円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>29,855,289円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>4,715,269円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>25,140,020円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>25,071,500円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>68,520円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,223,000口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>2,050円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	29,830,556円	分配準備積立金	B	24,733円	配当等収益合計額	C=A+B	29,855,289円	経費	D	4,715,269円	収益分配可能額	E=C-D	25,140,020円	収益分配金	F	25,071,500円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	68,520円	口数	H	1,223,000口	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,050円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	28,774,379円																																																											
分配準備積立金	B	71,913円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	28,846,292円																																																											
経費	D	4,049,659円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	24,796,633円																																																											
収益分配金	F	24,771,900円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	24,733円																																																											
口数	H	1,163,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,130円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	29,830,556円																																																											
分配準備積立金	B	24,733円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	29,855,289円																																																											
経費	D	4,715,269円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	25,140,020円																																																											
収益分配金	F	25,071,500円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	68,520円																																																											
口数	H	1,223,000口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,050円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち782,266円は対象指数についての商標使用料、212,573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901,000円は対象指数についての商標使用料、332,048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。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○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なっております。 ○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なっております。 ○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。 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</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>

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。	

(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	2,566,000,000円	期首元本額	2,326,000,000円
期中追加設定元本額	280,000,000円	期中追加設定元本額	560,000,000円
期中一部解約元本額	520,000,000円	期中一部解約元本額	440,000,000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)	
株式	470,006,551	219,112,713
投資信託受益証券	56,897	25,276
投資証券	7,580,288	9,753,083
合計	477,643,736	228,891,072

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	292,936,536	—	320,420,013	27,483,477	417,228,433	—	410,352,270	△6,876,163
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	—	—	—	—	124,827,600	—	124,834,560	6,960
米ドル	—	—	—	—	124,827,600	—	124,834,560	6,960
売建	26,744,560	—	26,745,845	△1,285	—	—	—	—
米ドル	26,744,560	—	26,745,845	△1,285	—	—	—	—
合計	—	—	—	27,482,192	—	—	—	△6,869,203

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(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	926	33.69	31,196.94	
		HALLIBURTON CO	763	28.68	21,882.84	
		SCHLUMBERGER LTD	1,301	40.41	52,573.41	
		CHEVRON CORP	1,560	140.30	218,868.00	
		DEVON ENERGY CORP	545	41.40	22,563.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	165	179.21	29,569.65	
		EQT CORP	559	31.91	17,837.69	
		EXXON MOBIL CORP	4,082	115.01	469,470.82	
		HESS CORP	256	128.88	32,993.28	
		KINDER MORGAN INC	1,786	21.12	37,720.32	
		MARATHON PETROLEUM CORP	324	163.25	52,893.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	624	52.18	32,560.32	
		ONEOK INC	538	92.04	49,517.52	
		PHILLIPS 66	390	127.97	49,908.30	
		TARGA RESOURCES CORP	206	143.93	29,649.58	
		VALERO ENERGY CORP	302	134.16	40,516.32	
		WILLIAMS COS	1,123	44.52	49,995.96	
		AIR PRODUCTS	205	273.82	56,133.10	
ALBEMARLE CORP	96	78.41	7,527.36			

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	174	78.47	13,653.78
CORTEVA INC	645	55.80	35,991.00
DOW INC	651	51.30	33,396.30
ECOLAB INC	234	249.19	58,310.46
FMC CORP	123	61.07	7,511.61
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	223	103.46	23,071.58
LINDE PLC	437	463.08	202,365.96
LYONDELLBASELL INDU-CL A	225	94.78	21,325.50
MOSAIC CO/THE	251	25.06	6,290.06
PPG INDUSTRIES	205	126.14	25,858.70
SHERWIN-WILLIAMS	212	363.90	77,146.80
AMCOR PLC	1,371	11.10	15,218.10
AVERY DENNISON CORP	76	219.58	16,688.08
BALL CORP	292	64.29	18,772.68
SMURFIT WESTROCK PLC	455	44.47	20,233.85
FREEMONT-MCMORAN INC	1,307	40.40	52,802.80
NEWMONT CORP	1,061	50.72	53,813.92
AXON ENTERPRISE INC	62	364.39	22,592.18
GENERAL ELECTRIC CO	996	165.35	164,688.60
ALLEGION PLC	84	134.56	11,303.04
CARRIER GLOBAL CORP	771	70.73	54,532.83
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	622	68.60	42,669.20
MASCO CORP	208	77.32	16,082.56
TRANE TECHNOLOGIES PLC	206	345.30	71,131.80
QUANTA SERVICES INC	136	250.06	34,008.16
AMETEK INC	214	164.30	35,160.20
EATON CORP PLC	364	289.38	105,334.32
EMERSON ELEC	527	99.58	52,478.66
HUBBELL INC	50	378.12	18,906.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	99	259.25	25,665.75
CATERPILLAR INC DEL	445	334.04	148,647.80
CUMMINS INC	126	296.81	37,398.06
DEERE & COMPANY	236	387.23	91,386.28
DOVER CORP	120	178.89	21,466.80
FORTIVE CORP	308	72.31	22,271.48

NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信 (2635) 2024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 2024

IDEX CORP	72	197.17	14,196.24
ILLINOIS TOOL WORKS INC	247	246.74	60,944.78
INGERSOLL-RAND INC	374	87.45	32,706.30
OTIS WORLDWIDE CORP	375	91.68	34,380.00
PACCAR	484	94.97	45,965.48
PARKER HANNIFIN CORP	117	580.20	67,883.40
PENTAIR PLC	158	86.52	13,670.16
STANLEY BLACK & DECKER INC	146	96.19	14,043.74
WABTEC CORP	154	162.72	25,058.88
XYLEM INC	211	129.31	27,284.41
GRAINGER(W.W.) INC	40	972.14	38,885.60
UNITED RENTALS INC	61	695.94	42,452.34
CINTAS CORP	78	804.72	62,768.16
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	189	205.30	38,801.70
WASTE MANAGEMENT INC	332	208.46	69,208.72
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	113	101.07	11,420.91
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	664	128.88	85,576.32
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	476	11.22	5,340.72
DELTA AIR LINES INC	564	43.68	24,635.52
CSX CORP	1,779	33.76	60,059.04
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	78	171.74	13,395.72
NORFOLK SOUTHERN CORP	208	256.81	53,416.48
UBER TECHNOLOGIES INC	1,902	69.80	132,759.60
UNION PAC CORP	555	251.11	139,366.05
APTIV PLC	240	69.08	16,579.20
BORGWARNER INC	171	32.88	5,622.48
GENERAL MOTORS CO	1,051	47.40	49,817.40
TESLA INC	2,525	216.27	546,081.75
DR HORTON INC	273	187.52	51,192.96
MOHAWK INDUSTRIES	52	149.14	7,755.28
PULTEGROUP INC	184	131.60	24,214.40
HASBRO INC	128	67.63	8,656.64
DECKERS OUTDOOR CORP	22	894.09	19,669.98
LULULEMON ATHLETICA INC	100	248.58	24,858.50
NIKE INC-B	1,102	79.49	87,597.98

NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信 (2635) 2024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 2024

RALPH LAUREN CORPORATION	29	173.69	5,037.01
TAPESTRY INC	225	41.29	9,290.25
CAESARS ENTERTAINMENT INC	213	36.00	7,668.00
CARNIVAL CORP	956	16.03	15,324.68
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,250	54.29	67,862.50
EXPEDIA GROUP INC	120	132.86	15,943.20
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	230	214.94	49,436.20
LAS VEGAS SANDS CORP	348	40.00	13,920.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	221	228.59	50,518.39
MCDONALD'S CORP	656	291.29	191,086.24
MGM RESORTS INTERNATIONAL	199	34.97	6,959.03
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	425	17.50	7,437.50
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	219	160.26	35,096.94
STARBUCKS CORP	1,031	92.21	95,068.51
WYNN RESORTS LTD	80	76.91	6,152.80
YUM BRANDS INC	261	133.04	34,723.44
GENUINE PARTS CO	123	136.61	16,803.03
LKQ CORP	257	39.98	10,274.86
POOL CORP	37	346.48	12,819.76
EBAY INC	441	59.43	26,208.63
ETSY INC	90	52.35	4,711.50
BATH & BODY WORKS INC	191	27.54	5,260.14
BEST BUY COMPANY INC	182	98.09	17,852.38
CARMAX INC	151	80.63	12,175.13
HOME DEPOT	902	365.52	329,699.04
LOWES COS INC	521	244.73	127,504.33
ROSS STORES INC	309	150.79	46,594.11
TJX COS INC	1,031	117.07	120,699.17
TRACTOR SUPPLY COMPANY	94	272.79	25,642.26
ULTA BEAUTY INC	42	381.57	16,025.94
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	404	896.49	362,181.96
KROGER CO	627	51.97	32,585.19
SYSCO CORP	461	78.41	36,147.01
TARGET CORP	421	150.59	63,398.39
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	587	8.91	5,230.17

NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信 (2635) 2024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 2024

WALMART INC	3,887	77.34	300,620.58
COCA COLA CO	3,528	71.85	253,486.80
KEURIG DR PEPPER INC	975	37.27	36,338.25
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	152	55.94	8,502.88
PEPSICO INC	1,251	178.19	222,915.69
ARCHER DANIELS MIDLAND	431	59.50	25,644.50
CAMPBELL SOUP CO	198	51.74	10,244.52
CONAGRA BRANDS INC	465	32.83	15,265.95
GENERAL MILLS	522	75.15	39,228.30
HERSHEY CO/THE	129	203.25	26,219.25
HORMEL FOODS CORP	226	32.40	7,322.40
JM SMUCKER CO/THE-NEW	87	120.18	10,455.66
KELLANOVA	232	80.17	18,599.44
KRAFT HEINZ CO/THE	689	36.05	24,838.45
LAMB WESTON HOLDINGS INC	122	63.17	7,706.74
MCCORMICK & CO INC.	222	83.24	18,479.28
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,221	75.71	92,441.91
TYSON FOODS INC-CL A	270	65.78	17,760.60
COLGATE PALMOLIVE CO.	747	107.11	80,011.17
PROCTER & GAMBLE CO	2,148	176.06	378,176.88
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	205	86.91	17,816.55
ABBOTT LABORATORIES	1,583	116.43	184,308.69
BAXTER INTERNATIONAL INC.	480	39.23	18,830.40
BECTON, DICKINSON	263	237.22	62,388.86
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,338	82.65	110,585.70
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	557	65.71	36,600.47
HOLOGIC INC	220	82.69	18,191.80
IDEXX LABORATORIES INC	76	480.34	36,505.84
MEDTRONIC PLC	1,208	90.62	109,468.96
RESMED INC	138	249.56	34,439.28
STRYKER CORP	309	362.78	112,099.02
TELEFLEX INC	38	245.04	9,311.52
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	180	104.83	18,869.40
CARDINAL HEALTH INC	213	112.80	24,026.40
CENCORA INC	153	236.53	36,189.09

CENTENE CORP	494	70.84	34,994.96
CVS HEALTH CORP	1,142	56.47	64,488.74
DAVITA INC	39	150.24	5,859.36
ELEVANCE HEALTH INC	212	543.66	115,255.92
HUMANA INC	111	343.76	38,157.36
QUEST DIAGNOSTICS INC	96	154.29	14,811.84
THE CIGNA GROUP	259	357.61	92,620.99
UNITEDHEALTH GROUP INC	838	594.10	497,855.80
ABBVIE INC	1,607	196.42	315,646.94
AMGEN INC	488	325.92	159,048.96
BIOGEN INC	127	199.27	25,307.29
GILEAD SCIENCES INC	1,134	79.17	89,778.78
INCYTE CORP	126	62.26	7,844.76
MODERNA INC	291	76.61	22,293.51
REGENERON PHARMACEUTICALS	97	1,144.77	111,042.69
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,845	48.50	89,482.50
ELI LILLY & CO.	727	908.27	660,312.29
MERCK & CO INC	2,305	115.41	266,020.05
PFIZER INC	5,157	29.41	151,667.37
ZOETIS INC	415	191.73	79,567.95
BANK OF AMERICA CORP	6,192	39.47	244,398.24
CITIGROUP	1,736	59.54	103,361.44
CITIZENS FINANCIAL GROUP	429	41.45	17,782.05
FIFTH THIRD BANCORP	597	41.60	24,835.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,361	14.66	19,952.26
JPMORGAN CHASE & CO	2,613	216.81	566,524.53
KEYCORP	838	16.18	13,558.84
M & T BANK CORP	146	168.78	24,641.88
PNC FINANCIAL	362	182.61	66,104.82
REGIONS FINANCIAL CORP	861	22.55	19,415.55
TRUIST FINANCIAL CORP	1,232	42.60	52,483.20
US BANCORP	1,420	45.26	64,269.20
CORPAY INC	66	307.40	20,288.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	514	82.39	42,348.46
FISERV INC	532	172.44	91,738.08

NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信 (2635) 2024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 2024

GLOBAL PAYMENTS INC	223	110.00	24,530.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	61	171.90	10,485.90
MASTERCARD INC	747	487.09	363,856.23
PAYPAL HOLDINGS INC	952	69.35	66,021.20
VISA INC-CLASS A SHARES	1,433	285.61	409,279.13
AFLAC INC	476	109.40	52,074.40
ALLSTATE CORP	244	187.20	45,676.80
AMERICAN INTL GROUP	612	72.82	44,565.84
AON PLC	198	350.49	69,397.02
ARCH CAPITAL GROUP LTD	346	111.73	38,658.58
ARTHUR J GALLAGHER & CO	201	298.94	60,086.94
ASSURANT INC	51	193.26	9,856.26
CHUBB LTD	370	292.20	108,114.00
EVEREST GROUP LTD	41	387.02	15,867.82
GLOBE LIFE INC	63	103.36	6,511.68
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	275	116.91	32,150.25
MARSH & MCLENNAN COS	448	230.58	103,299.84
METLIFE INC	552	75.48	41,664.96
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	204	79.21	16,158.84
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	332	114.95	38,163.40
TRAVELERS COS INC/THE	211	241.10	50,872.10
WILLIS TOWERS WATSON PLC	89	294.36	26,198.04
ACCENTURE PLC-CL A	572	341.81	195,515.32
AKAMAI TECHNOLOGIES	133	95.07	12,644.31
ADOBE INC	408	569.88	232,511.04
AUTODESK INC.	197	255.67	50,366.99
MICROSOFT CORP	6,764	405.72	2,744,290.08
SALESFORCE INC	884	245.76	217,251.84
CISCO SYSTEMS	3,685	48.70	179,459.50
APPLE INC	13,118	220.91	2,897,897.38
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,216	17.60	21,401.60
HP INC	752	34.18	25,703.36
WESTERN DIGITAL CORP	307	62.61	19,221.27
TE CONNECTIVITY LTD	283	144.82	40,984.06
ADVANCED MICRO DEVICES	1,471	138.15	203,218.65

APPLIED MATERIALS	756	177.55	134,227.80
INTEL CORP	3,874	19.07	73,877.18
KLA CORP	123	709.89	87,316.47
LAM RESEARCH	119	734.31	87,382.89
MICRON TECHNOLOGY	1,008	86.27	86,960.16
NVIDIA CORP	22,386	106.47	2,383,437.42
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	374	69.39	25,951.86
QUALCOMM INC	1,017	160.77	163,503.09
AT & T INC	6,526	21.50	140,309.00
T-MOBILE US INC	469	195.30	91,595.70
EDISON INTERNATIONAL	335	86.09	28,840.15
ENTERGY CORP	187	122.17	22,845.79
EVERSOURCE ENERGY	309	68.06	21,030.54
EXELON CORPORATION	927	38.73	35,902.71
NEXTERA ENERGY INC	1,870	81.19	151,825.30
CONSOLIDATED EDISON INC	321	104.75	33,624.75
PUBLIC SVC ENTERPRISE	461	80.42	37,073.62
SEMPRA	584	82.94	48,436.96
AMERICAN WATER WORKS CO INC	170	146.01	24,821.70
AMERICAN EXPRESS CO	517	250.92	129,725.64
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	352	142.60	50,195.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	218	133.33	29,065.94
SYNCHRONY FINANCIAL	378	48.17	18,208.26
AMERIPRISE FINANCIAL INC	92	436.35	40,144.20
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	690	67.72	46,726.80
BLACKROCK INC	127	877.94	111,498.38
CBOE GLOBAL MARKETS INC	92	211.34	19,443.28
CME GROUP INC	328	218.54	71,681.12
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	36	428.90	15,440.40
FRANKLIN RESOURCES INC	207	19.55	4,046.85
GOLDMAN SACHS GROUP	293	488.57	143,151.01
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	522	161.70	84,407.40
INVESCO LTD	446	15.93	7,104.78
MARKETAXESS HOLDINGS INC	31	257.80	7,991.80
MOODYS CORP	143	482.25	68,961.75

NEXT FUNDS S&P 500 ESG指数連動型上場投信 (2635) 2024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 2024

MORGAN STANLEY	1,139	98.18	111,827.02
MSCI INC	73	558.34	40,758.82
NASDAQ INC	385	71.65	27,585.25
NORTHERN TRUST CORP	193	87.76	16,937.68
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	175	116.85	20,448.75
S&P GLOBAL INC	291	515.83	150,106.53
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,359	63.01	85,630.59
STATE STREET CORP	264	83.66	22,086.24
T ROWE PRICE GROUP INC	196	103.54	20,293.84
AGILENT TECHNOLOGIES INC	271	138.09	37,422.39
BIO-RAD LABORATORIES-A	15	323.09	4,846.35
CHARLES RIVER LABORATORIES	43	188.16	8,090.88
DANAHER CORP	600	273.09	163,854.00
METTLER-TOLEDO INTL	19	1,384.77	26,310.63
REVVITY INC	117	118.76	13,894.92
WATERS CORP	56	332.10	18,597.60
AUTOMATIC DATA PROCESS	372	275.59	102,519.48
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	103	210.65	21,696.95
DAYFORCE INC	132	56.81	7,498.92
PAYCHEX INC	296	132.22	39,137.12
VERISK ANALYTICS INC	132	273.25	36,069.00
COMCAST CORP-CL A	3,562	39.72	141,482.64
INTERPUBLIC GROUP	363	31.06	11,274.78
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	296	26.60	7,873.60
NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	84	27.64	2,321.76
OMNICOM GROUP	184	98.90	18,197.60
PARAMOUNT GLOBAL	351	10.31	3,618.81
DISNEY (WALT) CO	1,659	88.34	146,556.06
ELECTRONIC ARTS	226	144.30	32,611.80
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	139	156.32	21,728.48
ALPHABET INC-CL A	5,346	148.71	795,003.66
ALPHABET INC-CL C	4,447	149.54	665,004.38
CBRE GROUP INC	280	115.26	32,272.80
COSTAR GROUP INC	355	79.53	28,233.15
小計銘柄数：298			29,321,311.29

				(4,208,487,809)	
		組入時価比率：91.7%		100.0%	
合計				4,208,487,809	(4,208,487,809)

(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	XTRACKERS S&P 500 ESG ETF	1,220	61,146.40	
		小計	銘柄数：1	1,220	61,146.40
				(8,776,342)	
			組入時価比率：0.2%		7.8%
	合計			8,776,342	(8,776,342)
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	148	17,501.00	
		AMERICAN TOWER CORP	425	101,375.25	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	124	27,960.76	
		BXP INC	140	10,402.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	299	44,652.66	
		EQUINIX INC	86	71,534.80	
		EQUITY RESIDENTIAL	302	22,680.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	196	34,249.04	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	73	8,549.76	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	668	14,782.84	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	677	11,353.29	
		IRON MOUNTAIN INC	255	28,149.45	
		KIMCO REALTY CORP	634	14,765.86	
		PROLOGIS INC	843	109,800.75	
		PUBLIC STORAGE	146	51,319.00	
		REGENCY CENTERS CORP	158	11,761.52	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	94	22,544.02	
		UDR INC	290	12,910.80	
		VENTAS INC	355	22,776.80	
		WELLTOWER INC	544	69,267.52	

		WEYERHAEUSER CO	640	19,372.80	
	小計	銘柄数：21	7,097	727,710.12	
				(104,448,233)	
		組入時価比率：2.3%		92.2%	
	合計			104,448,233	
				(104,448,233)	
	合計			113,224,575	
				(113,224,575)	

(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。