



2020年10月期 (2020年4月8日～2020年10月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended October 2020 (April 8, 2020 – October 7, 2020)

2020年11月18日
 November 18, 2020

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 野村日本株高配当70連動型上場投信
 コード番号 (1577)
 連動対象指標 野村日本株高配当70
 主要投資資産 株式
 売買単位 1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 中川 順子
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 山中 淳 TEL 0120-753104

Fund name: NEXT FUNDS Nomura Japan Equity High Dividend 70 Exchange Traded Fund
 Code: 1577
 Underlying index: Nomura Japan Equity High Dividend 70
 Primary invested assets: Stocks
 Trading unit: 1 unit
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Junko Nakagawa, President & CEO
 Contact person: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2020年12月16日
 分配金支払開始日 2020年11月13日
 Scheduled date of submission of securities report: December 16, 2020
 Date of commencing dividend payment: November 13, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年10月期の運用状況 (2020年4月8日～2020年10月7日)

Management Status for Period ended October 2020 (from April 8, 2020 to October 7, 2020)

(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.	% %
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	61,914	(99.7)	157	(0.3)	62,072	(100.0)
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	71,659	(99.7)	246	(0.3)	71,905	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前特定期間末 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)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当特定期間末 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
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	4,141	0	826	3,314
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	3,998	839	696	4,141

(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))	1口当り基準価額 ((③/当特定期間末発行済口数)×1) Net Asset Value per 1 unit ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×1)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	62,998	926	62,072	18,727
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	73,621	1,715	71,905	17,364

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	261
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	397

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)

	前期 (2020年4月7日現在) Prior period As of April 7, 2020	当期 (2020年10月7日現在) Present period As of October 7, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
コール・ローン Call loans	245,545,268	67,087,360
株式 Stocks	71,659,391,320	61,914,903,505
未収配当金 Accrued dividends receivable	1,716,161,475	1,016,874,025
流動資産合計 Total current assets	73,621,098,063	62,998,864,890
資産合計 Total assets	73,621,098,063	62,998,864,890
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	1,644,043,299	865,113,471
未払受託者報酬 Trustee fee payable	10,671,886	8,620,891
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	57,628,181	46,552,784
未払利息 Accrued interest expenses	221	27
その他未払費用 Other accrued expenses	2,979,569	6,087,573
流動負債合計 Total current liabilities	1,715,323,156	926,374,746
負債合計 Total liabilities	1,715,323,156	926,374,746
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	62,113,363,833	49,715,850,389
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	9,792,411,074	12,356,639,755

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	536,542	3,191,159
元本等合計 Total principal and other	71,905,774,907	62,072,490,144
純資産合計 Total net assets	71,905,774,907	62,072,490,144
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	73,621,098,063	62,998,864,890

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	前期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日 Prior period From October 8, 2019 to April 7, 2020	当期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日 Present period From April 8, 2020 to October 7, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	1,948,307,575	987,129,325
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△14,359,601,291	5,006,886,610
その他収益 Other revenue	1,421,724	898,618
営業収益合計 Total operating revenue	△12,409,871,992	5,994,914,553
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	19,732	25,910
受託者報酬 Trustee fee	22,829,236	17,648,512
委託者報酬 Investment trust management fee	123,277,825	95,301,899
その他費用 Other expenses	8,791,782	7,283,534
営業費用合計 Total operating expenses	154,918,575	120,259,855
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△12,564,790,567	5,874,654,698
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△12,564,790,567	5,874,654,698
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△12,564,790,567	5,874,654,698
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額 (△) Distribution of profit loss from partial exchange	-	-
期首剰余金又は期首欠損金 (△) Surplus (deficit) at beginning of period	24,636,630,889	9,792,411,074
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,557,006,422	-

Increase in surplus or decrease in deficit		
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	4,557,006,422	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	5,039,314,177	2,445,312,546
当期一部交換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 exchange	5,039,314,177	2,445,312,546
分配金 Dividends	1,797,121,493	865,113,471
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	9,792,411,074	12,356,639,755

(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	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。
2. 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。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2020年4月8日から2020年10月7日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

前期 2020年4月7日現在	当期 2020年10月7日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 4,141,167 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,314,611 口
2. 特定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 17,364 円	2. 特定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 18,727 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日	当期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日																																										
1. 分配金の計算過程 2019年10月8日から2020年1月7日まで	1. 分配金の計算過程 2020年4月8日から2020年7月7日まで																																										
<table border="1" style="width: 100%;"> <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 style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">233,557,060 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">2,847,311 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C=A+B</td> <td style="text-align: right;">236,404,371 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">82,548,271 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E=C-D</td> <td style="text-align: right;">153,856,100 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">153,078,194 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	233,557,060 円	分配準備積立金	B	2,847,311 円	配当等収益合計額	C=A+B	236,404,371 円	経費	D	82,548,271 円	収益分配可能額	E=C-D	153,856,100 円	収益分配金	F	153,078,194 円	<table border="1" style="width: 100%;"> <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 style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">42,115,914 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">536,542 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C=A+B</td> <td style="text-align: right;">42,652,456 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">61,297,417 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E=C-D</td> <td style="text-align: right;">0 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">0 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	42,115,914 円	分配準備積立金	B	536,542 円	配当等収益合計額	C=A+B	42,652,456 円	経費	D	61,297,417 円	収益分配可能額	E=C-D	0 円	収益分配金	F	0 円
項目																																											
当期配当等収益額	A	233,557,060 円																																									
分配準備積立金	B	2,847,311 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	236,404,371 円																																									
経費	D	82,548,271 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	153,856,100 円																																									
収益分配金	F	153,078,194 円																																									
項目																																											
当期配当等収益額	A	42,115,914 円																																									
分配準備積立金	B	536,542 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	42,652,456 円																																									
経費	D	61,297,417 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	0 円																																									
収益分配金	F	0 円																																									

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	777,906円
口数	H	3,559,958口
1口当たり分配金	I=F/H	43円

2020年1月8日から2020年4月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	1,716,152,507円
分配準備積立金	B	777,906円
配当等収益合計額	C=A+B	1,716,930,413円
経費	D	72,350,572円
収益分配可能額	E=C-D	1,644,579,841円
収益分配金	F	1,644,043,299円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	536,542円
口数	H	4,141,167口
1口当たり分配金	I=F/H	397円

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	△18,644,961円
口数	H	3,414,522口
1口当たり分配金	I=F/H	0円

2020年7月8日から2020年10月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	945,886,119円
分配準備積立金	B	△18,644,961円
配当等収益合計額	C=A+B	927,241,158円
経費	D	58,936,528円
収益分配可能額	E=C-D	868,304,630円
収益分配金	F	865,113,471円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,191,159円
口数	H	3,314,611口
1口当たり分配金	I=F/H	261円

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

前期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日	当期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 2020年4月7日現在	当期 2020年10月7日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>株式</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(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。 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)

前期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日	当期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7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

前期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日	当期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日
期首元本額 59,968,731,818 円	期首元本額 62,113,363,833 円
期中追加設定元本額 12,586,590,838 円	期中追加設定元本額 0 円
期中一部交換元本額 10,441,958,823 円	期中一部交換元本額 12,397,513,444 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日	当期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7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	△20,727,215,541	2,055,869,284
合計	△20,727,215,541	2,055,869,284

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式(2020年10月7日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	清水建設	1,450,900	791.00	1,147,661,900	
		長谷工コーポレーション	755,700	1,397.00	1,055,712,900	
		鹿島建設	719,500	1,261.00	907,289,500	
		大東建託	77,000	9,357.00	720,489,000	
		大和ハウス工業	294,300	2,925.50	860,974,650	
		日本たばこ産業	448,700	1,991.50	893,586,050	
		帝人	353,200	1,700.00	600,440,000	
		昭和電工	342,000	2,018.00	690,156,000	

住友化学	2,116,600	364.00	770,442,400
東ソー	667,200	1,746.00	1,164,931,200
デンカ	325,700	3,220.00	1,048,754,000
三菱瓦斯化学	650,600	2,007.00	1,305,754,200
三井化学	394,200	2,616.00	1,031,227,200
J S R	520,400	2,513.00	1,307,765,200
三菱ケミカルホールディングス	1,244,700	627.20	780,675,840
宇部興産	454,700	1,835.00	834,374,500
D I C	335,600	2,654.00	890,682,400
武田薬品工業	250,000	3,667.00	916,750,000
出光興産	339,400	2,258.00	766,365,200
E N E O Sホールディングス	2,083,200	385.00	802,032,000
ブリヂストン	235,600	3,477.00	819,181,200
住友ゴム工業	775,000	1,018.00	788,950,000
アマダ	834,700	1,023.00	853,898,100
小松製作所	408,500	2,450.50	1,001,029,250
日本精工	987,600	859.00	848,348,400
ジェイテクト	743,900	881.00	655,375,900
三菱重工業	250,100	2,342.00	585,734,200
コニカミノルタ	1,499,000	301.00	451,199,000
セイコーエプソン	692,600	1,202.00	832,505,200
キヤノン	364,300	1,749.00	637,160,700
本田技研工業	356,300	2,618.50	932,971,550
S U B A R U	361,900	2,130.00	770,847,000
ヤマハ発動機	499,300	1,649.00	823,345,700
ニコン	724,200	716.00	518,527,200
関西電力	868,100	1,030.50	894,577,050
中国電力	737,400	1,329.00	980,004,600
東北電力	961,600	1,007.00	968,331,200
九州電力	1,115,500	966.00	1,077,573,000
日本航空	323,600	2,020.00	653,672,000
日本電信電話	400,100	2,295.50	918,429,550
K D D I	344,300	2,738.50	942,865,550
ソフトバンク	734,900	1,212.00	890,698,800
N T T ドコモ	363,500	3,877.00	1,409,289,500

双日	3,108,700	243.00	755,414,100	
伊藤忠商事	463,700	2,701.50	1,252,685,550	
丸紅	1,367,500	618.90	846,345,750	
三井物産	568,100	1,849.00	1,050,416,900	
住友商事	654,500	1,280.00	837,760,000	
三菱商事	380,400	2,561.00	974,204,400	
ゆうちょ銀行	1,007,700	820.00	826,314,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,368,500	382.00	904,767,000	
あおぞら銀行	386,700	1,789.00	691,806,300	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,853,200	433.90	804,103,480	
りそなホールディングス	2,262,300	368.20	832,978,860	
三井住友トラスト・ホールディングス	264,300	2,892.00	764,355,600	
三井住友フィナンシャルグループ	272,600	3,020.00	823,252,000	
みずほフィナンシャルグループ	636,210	1,342.50	854,111,925	
SBIホールディングス	462,100	2,660.00	1,229,186,000	
大和証券グループ本社	2,117,900	450.00	953,055,000	
かんぽ生命保険	610,900	1,731.00	1,057,467,900	
SOMPOホールディングス	235,600	3,812.00	898,107,200	
MS&ADインシュアランスグループホール	307,800	2,894.00	890,773,200	
第一生命ホールディングス	457,100	1,586.00	724,960,600	
東京海上ホールディングス	185,200	4,774.00	884,144,800	
オリックス	630,700	1,380.50	870,681,350	
三菱UFJリース	1,597,500	494.00	789,165,000	
野村不動産ホールディングス	430,500	2,038.00	877,359,000	
飯田グループホールディングス	594,400	2,095.00	1,245,268,000	
東京建物	566,600	1,286.00	728,647,600	
日本郵政	1,076,000	740.70	796,993,200	
小計 銘柄数：70			61,914,903,505	
組入時価比率：99.7%			100.0%	
合計			61,914,903,505	

(注1) 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(2020年10月7日現在)

該当事項はありません。

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

NEXT FUNDS Nomura Japan Equity High Dividend 70 Exchange Traded Fund (1577) Earnings Report for Fiscal Period ended October 2020
該当事項はありません。