



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 野村株主還元70連動型上場投信
 コード番号 (2529)
 連動対象指標 野村株主還元 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 Shareholder Yield 70 Exchange Traded Fund
 Code: 2529
 Underlying index: Nomura Shareholder Yield 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	7,913	(99.8)	17	(0.2)	7,930	(100.0)
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	5,052	(99.8)	9	(0.2)	5,062	(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	6,252	2,798	199	8,850
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	603	6,145	497	6,252

(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/当特定期間末発行済口数)×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
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	8,017	87	7,930	89,599
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	5,153	91	5,062	80,968

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	900
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	1,400

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	8,337,251	9,537,295
株式 Stocks	5,052,980,950	7,913,074,350
未収配当金 Accrued dividends receivable	92,357,168	95,119,750
流動資産合計 Total current assets	5,153,675,369	8,017,731,395
資産合計 Total assets	5,153,675,369	8,017,731,395
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	87,533,068	79,656,867
未払受託者報酬 Trustee fee payable	525,237	1,085,913
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	2,416,072	4,995,178
未払利息 Accrued interest expenses	7	3
その他未払費用 Other accrued expenses	794,481	1,755,975
流動負債合計 Total current liabilities	91,268,865	87,493,936
負債合計 Total liabilities	91,268,865	87,493,936
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	6,252,362,000	8,850,763,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△1,189,955,496	△920,525,541

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	3,038,531	5,286,437
元本等合計 Total principal and other	5,062,406,504	7,930,237,459
純資産合計 Total net assets	5,062,406,504	7,930,237,459
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	5,153,675,369	8,017,731,395

(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	97,466,907	102,589,450
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△1,020,355,915	564,453,868
その他収益 Other revenue	11,762	298,757
営業収益合計 Total operating revenue	△922,877,246	667,342,075
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	380	2,051
受託者報酬 Trustee fee	727,162	1,869,977
委託者報酬 Investment trust management fee	3,344,894	8,601,853
その他費用 Other expenses	906,524	1,758,591
営業費用合計 Total operating expenses	4,978,960	12,232,472
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△927,856,206	655,109,603
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△927,856,206	655,109,603
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△927,856,206	655,109,603
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	△31,757,463	△1,189,955,496
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	23,047,760

Increase in surplus or decrease in deficit		
当期一部交換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 partial exchange	-	23,047,760
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	140,735,497	320,319,579
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	24,780,740	-
当期追加信託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 additional subscriptions for period	115,954,757	320,319,579
分配金 Dividends	89,606,330	88,407,829
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△1,189,955,496	△920,525,541

(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 6,252,362 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 8,850,763 口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 1,189,955,496 円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 920,525,541 円
3. 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 809.68 円 (100口当たり純資産額) (80,968 円)	3. 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 895.99 円 (100口当たり純資産額) (89,599 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	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

項目		
当期配当等収益額	A	5,146,544円
分配準備積立金	B	145,152円
配当等収益合計額	C=A+B	5,291,696円
経費	D	1,330,568円
収益分配可能額	E=C-D	3,961,128円
収益分配金	F	2,073,262円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,887,866円
口数	H	2,073,262口
100口当たり分配金	I=F/H×100	100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	92,331,745円
分配準備積立金	B	1,887,866円
配当等収益合計額	C=A+B	94,219,611円
経費	D	3,648,012円
収益分配可能額	E=C-D	90,571,599円
収益分配金	F	87,533,068円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,038,531円
口数	H	6,252,362口
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,400円

2. その他費用

その他費用のうち295,825円は上場に係る費用、581,673円は対象指数についての商標使用料であります。

2020年4月8日から2020年7月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	14,366,326円
分配準備積立金	B	3,038,531円
配当等収益合計額	C=A+B	17,404,857円
経費	D	5,173,010円
収益分配可能額	E=C-D	12,231,847円
収益分配金	F	8,750,962円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,480,885円
口数	H	8,750,962口
100口当たり分配金	I=F/H×100	100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	88,519,830円
分配準備積立金	B	3,480,885円
配当等収益合計額	C=A+B	92,000,715円
経費	D	7,057,411円
収益分配可能額	E=C-D	84,943,304円
収益分配金	F	79,656,867円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,286,437円
口数	H	8,850,763口
100口当たり分配金	I=F/H×100	900円

2. その他費用

その他費用のうち181,790円は上場に係る費用、1,502,065円は対象指数についての商標使用料であります。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

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 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、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 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</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>

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。

(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 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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

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 603,700,000円	期首元本額 6,252,362,000円
期中追加設定元本額 6,145,800,000円	期中追加設定元本額 2,798,300,000円
期中一部交換元本額 497,138,000円	期中一部交換元本額 199,899,000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	△1,081,954,469	221,285,398
合計	△1,081,954,469	221,285,398

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	コムシスホールディングス	22,200	2,886.00	64,069,200	

大成建設	40,400	3,640.00	147,056,000
清水建設	111,400	791.00	88,117,400
長谷工コーポレーション	53,500	1,397.00	74,739,500
鹿島建設	91,100	1,261.00	114,877,100
大東建託	13,700	9,357.00	128,190,900
日本ハム	16,400	4,510.00	73,964,000
麒麟ホールディングス	77,300	1,980.00	153,054,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	26,200	1,744.00	45,692,800
日本たばこ産業	76,000	1,991.50	151,354,000
帝人	36,800	1,700.00	62,560,000
クラレ	64,300	1,061.00	68,222,300
昭和電工	27,800	2,018.00	56,100,400
住友化学	286,800	364.00	104,395,200
デンカ	15,800	3,220.00	50,876,000
三菱瓦斯化学	32,700	2,007.00	65,628,900
三井化学	35,600	2,616.00	93,129,600
J S R	37,800	2,513.00	94,991,400
三菱ケミカルホールディングス	226,100	627.20	141,809,920
ダイセル	53,300	806.00	42,959,800
積水化学工業	74,000	1,759.00	130,166,000
宇部興産	20,100	1,835.00	36,883,500
日東電工	29,900	7,050.00	210,795,000
アステラス製薬	98,900	1,505.00	148,844,500
小野薬品工業	73,900	3,197.00	236,258,300
E N E O Sホールディングス	371,300	385.00	142,950,500
ブリヂストン	45,400	3,477.00	157,855,800
A G C	37,100	3,195.00	118,534,500
日本特殊陶業	30,600	1,931.00	59,088,600
日本製鉄	111,800	1,072.00	119,849,600
ジェイ エフ イー ホールディン グス	97,700	782.00	76,401,400
三和ホールディングス	37,600	1,165.00	43,804,000
アマダ	67,800	1,023.00	69,359,400
荏原製作所	18,000	2,981.00	53,658,000
日本精工	74,900	859.00	64,339,100

コニカミノルタ	87,900	301.00	26,457,900
セイコーエプソン	57,100	1,202.00	68,634,200
キヤノン	61,900	1,749.00	108,263,100
東京エレクトロン	7,700	27,560.00	212,212,000
日産自動車	290,600	392.10	113,944,260
いすゞ自動車	106,300	997.10	105,991,730
トヨタ自動車	24,000	7,003.00	168,072,000
三菱自動車工業	139,200	243.00	33,825,600
アイシン精機	31,300	3,475.00	108,767,500
本田技研工業	59,700	2,618.50	156,324,450
S U B A R U	68,100	2,130.00	145,053,000
ヤマハ発動機	55,100	1,649.00	90,859,900
ニコン	64,800	716.00	46,396,800
大日本印刷	51,300	2,099.00	107,678,700
関西電力	142,400	1,030.50	146,743,200
東北電力	89,900	1,007.00	90,529,300
東京瓦斯	69,700	2,390.00	166,583,000
日本航空	54,400	2,020.00	109,888,000
ANAホールディングス	50,800	2,480.00	125,984,000
野村総合研究所	68,400	3,115.00	213,066,000
Zホールディングス	401,000	745.00	298,745,000
日本電信電話	67,000	2,295.50	153,798,500
K D D I	56,800	2,738.50	155,546,800
N T T ドコモ	60,800	3,877.00	235,721,600
双日	185,000	243.00	44,955,000
メディopalホールディングス	35,800	2,085.00	74,643,000
伊藤忠商事	72,900	2,701.50	196,939,350
丸紅	228,000	618.90	141,109,200
三井物産	95,000	1,849.00	175,655,000
住友商事	113,800	1,280.00	145,664,000
三菱商事	63,700	2,561.00	163,135,700
ローソン	10,000	5,070.00	50,700,000
ケーズホールディングス	39,400	1,395.00	54,963,000
野村不動産ホールディングス	25,600	2,038.00	52,172,800
日本郵政	180,200	740.70	133,474,140

	小計	銘柄数：70 組入時価比率：99.8%			7,913,074,350	
					100.0%	
	合計				7,913,074,350	

(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

該当事項はありません。