



2021年10月期 (2021年4月8日～2021年10月7日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Period ended October 2021 (April 8, 2021 - October 7, 2021)

2021年11月17日  
 November 17, 2021

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 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 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: Hiroyasu Koike, President & CEO  
 Contact person: Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2021年12月27日  
 分配金支払開始日 2021年11月15日  
 Scheduled date of submission of securities report: December 27, 2021  
 Date of commencing dividend payment: November 15, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021年10月期の運用状況 (2021年4月8日～2021年10月7日)

Management Status for Period ended October 2021 (from April 8, 2021 to October 7, 2021)

(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.	%
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	11,492	(99.9)	13	(0.1)	11,505	(100.0)
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	10,532	(99.7)	28	(0.3)	10,560	(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
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	9,560	2,793	1,994	10,359
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	8,850	2,787	2,077	9,560

(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
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	11,651	145	11,505	111,063
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	10,696	135	10,560	110,466

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	1,300
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	1,300

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 (2021年4月7日現在) Prior period As of April 7, 2021	当期 (2021年10月7日現在) Present period As of October 7, 2021
	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	32,964,355	20,511,229
株式 Stocks	10,532,878,280	11,492,629,750
未収配当金 Accrued dividends receivable	130,491,022	138,518,200
流動資産合計 Total current assets	10,696,333,657	11,651,659,179
資産合計 Total assets	10,696,333,657	11,651,659,179
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	124,284,394	134,675,099
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,328,496	1,544,496
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	6,111,043	7,104,675
未払利息 Accrued interest expenses	13	8
その他未払費用 Other accrued expenses	3,687,091	2,637,446
流動負債合計 Total current liabilities	135,411,037	145,961,724
負債合計 Total liabilities	135,411,037	145,961,724
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	9,560,338,000	10,359,623,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,000,584,620	1,146,074,455

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	3,668,281	3,827,331
元本等合計 Total principal and other	10,560,922,620	11,505,697,455
純資産合計 Total net assets	10,560,922,620	11,505,697,455
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	10,696,333,657	11,651,659,179

(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 2020年10月8日 至 2021年4月7日 Prior period From October 8, 2020 to April 7, 2021	当期 自 2021年4月8日 至 2021年10月7日 Present period From April 8, 2021 to October 7, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	154,457,722	190,652,350
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	1,878,081,049	82,993,275
その他収益 Other revenue	118,286	6,084
営業収益合計 Total operating revenue	2,032,657,057	273,651,709
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	1,479	3,189
受託者報酬 Trustee fees	2,356,323	2,797,753
委託者報酬 Investment trust management fees	10,839,001	12,869,634
その他費用 Other expenses	2,780,491	2,709,617
営業費用合計 Total operating expenses	15,977,294	18,380,193
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	2,016,679,763	255,271,516
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	2,016,679,763	255,271,516
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	2,016,679,763	255,271,516
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	△920,525,541	1,000,584,620
剰余金増加額又は欠損金減少額	132,724,430	271,083,320

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	132,724,430	-
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	-	271,083,320
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	88,077,162	208,745,810
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	-	208,745,810
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	88,077,162	-
分配金 Dividends	140,216,870	172,119,191
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	1,000,584,620	1,146,074,455

(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。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2021年4月8日から2021年10月7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)

前期 2021年4月7日現在	当期 2021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 9,560,338 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 10,359,623 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 1,104.66円 (100口当たり純資産額) (110,466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 1,110.63円 (100口当たり純資産額) (111,063円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2020年10月8日 至 2021年4月7日	当期 自 2021年4月8日 至 2021年10月7日

1. 分配金の計算過程

2020年10月8日から2021年1月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	22,220,663円
分配準備積立金	B	5,286,437円
配当等収益合計額	C=A+B	27,507,100円
経費	D	6,773,237円
収益分配可能額	E=C-D	20,733,863円
収益分配金	F	15,932,476円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,801,387円
口数	H	7,966,238口
100口当たり分配金	I=F/H×100	200円

2021年1月8日から2021年4月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	132,353,866円
分配準備積立金	B	4,801,387円
配当等収益合計額	C=A+B	137,155,253円
経費	D	9,202,578円
収益分配可能額	E=C-D	127,952,675円
収益分配金	F	124,284,394円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,668,281円
口数	H	9,560,338口
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300円

2. その他費用

その他費用のうち801,311円は上場に係る費用、1,884,990円は対象指数についての商標使用料であります。

1. 分配金の計算過程

2021年4月8日から2021年7月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	45,877,134円
分配準備積立金	B	3,668,281円
配当等収益合計額	C=A+B	49,545,415円
経費	D	8,267,250円
収益分配可能額	E=C-D	41,278,165円
収益分配金	F	37,444,092円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,834,073円
口数	H	9,361,023口
100口当たり分配金	I=F/H×100	400円

2021年7月8日から2021年10月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	144,778,111円
分配準備積立金	B	3,834,073円
配当等収益合計額	C=A+B	148,612,184円
経費	D	10,109,754円
収益分配可能額	E=C-D	138,502,430円
収益分配金	F	134,675,099円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,827,331円
口数	H	10,359,623口
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,300円

2. その他費用

その他費用のうち351,220円は上場に係る費用、2,246,553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 2020年10月8日 至 2021年4月7日	当期 自 2021年4月8日 至 2021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</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>

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。	

(2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 2021年4月7日現在	当期 2021年10月7日現在
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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。	2. 時価の算定方法 同左
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 2020年10月8日 至 2021年4月7日	当期 自 2021年4月8日 至 2021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 2020年10月8日 至 2021年4月7日	当期 自 2021年4月8日 至 2021年10月7日
期首元本額 8,850,763,000円	期首元本額 9,560,338,000円
期中追加設定元本額 2,787,400,000円	期中追加設定元本額 2,793,800,000円
期中一部交換元本額 2,077,825,000円	期中一部交換元本額 1,994,515,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2020年10月8日 至 2021年4月7日	当期 自 2021年4月8日 至 2021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	1,252,153,368	162,958,090
合計	1,252,153,368	162,958,090

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(2021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	I N P E X	230,600	895.00	206,387,000
		大成建設	43,100	3,620.00	156,022,000
		清水建設	122,100	856.00	104,517,600
		長谷工コーポレーション	51,400	1,461.00	75,095,400
		鹿島建設	100,200	1,446.00	144,889,200
		大東建託	14,900	12,840.00	191,316,000
		大和ハウス工業	63,800	3,621.00	231,019,800
		積水ハウス	93,100	2,303.50	214,455,850
		麒麟ホールディングス	80,400	2,108.50	169,523,400
		日本たばこ産業	93,000	2,181.00	202,833,000
		帝人	40,400	1,524.00	61,569,600
		クラレ	69,400	1,036.00	71,898,400
		住友化学	318,300	552.00	175,701,600
		東ソー	55,800	1,960.00	109,368,000
		三菱瓦斯化学	36,400	2,144.00	78,041,600
		三井化学	39,400	3,525.00	138,885,000
		三菱ケミカルホールディングス	284,100	949.90	269,866,590
		積水化学工業	83,100	1,789.00	148,665,900
		富士フイルムホールディングス	36,000	8,572.00	308,592,000
		日東電工	21,200	7,420.00	157,304,000
		アステラス製薬	122,700	1,931.50	236,995,050
		塩野義製薬	34,700	7,291.00	252,997,700
		出光興産	43,700	3,035.00	132,629,500
		E N E O Sホールディングス	528,000	450.60	237,916,800
		ブリヂストン	57,800	5,130.00	296,514,000
		A G C	41,200	5,530.00	227,836,000
		日本特殊陶業	32,500	1,683.00	54,697,500
		ジェイ エフ イー ホールディングス	108,300	1,592.00	172,413,600
		アマダ	72,800	1,107.00	80,589,600
		荏原製作所	18,900	5,750.00	108,675,000
		日本精工	82,800	763.00	63,176,400
		I H I	29,600	2,670.00	79,032,000
東芝	67,800	4,910.00	332,898,000		
セイコーエプソン	63,800	2,126.00	135,638,800		
アルプスアルパイン	47,500	1,132.00	53,770,000		



ローム	19,500	9,690.00	188,955,000
キヤノン	98,900	2,626.50	259,760,850
日産自動車	349,300	524.70	183,277,710
いすゞ自動車	118,500	1,469.00	174,076,500
トヨタ自動車	123,000	1,869.00	229,887,000
アイシン	34,600	3,970.00	137,362,000
マツダ	129,900	910.00	118,209,000
本田技研工業	68,000	3,332.00	226,576,000
S U B A R U	94,800	2,042.50	193,629,000
大日本印刷	55,300	2,717.00	150,250,100
中部電力	145,000	1,315.00	190,675,000
関西電力	156,600	1,112.50	174,217,500
中国電力	65,800	1,019.00	67,050,200
東北電力	99,700	810.00	80,757,000
東京瓦斯	81,600	2,032.00	165,811,200
九州旅客鉄道	32,600	2,583.00	84,205,800
Zホールディングス	313,200	690.60	216,295,920
日本電信電話	73,900	3,109.00	229,755,100
K D D I	63,800	3,616.00	230,700,800
ソフトバンク	151,300	1,510.00	228,463,000
ソフトバンクグループ	24,300	5,949.00	144,560,700
メディopalホールディングス	39,800	2,077.00	82,664,600
伊藤忠商事	66,000	3,182.00	210,012,000
丸紅	285,100	916.20	261,208,620
三井物産	103,500	2,457.00	254,299,500
住友商事	143,200	1,565.50	224,179,600
三菱商事	77,000	3,480.00	267,960,000
スズケン	15,300	3,190.00	48,807,000
丸井グループ	40,700	2,136.00	86,935,200
ケーズホールディングス	41,300	1,196.00	49,394,800
ヤマダホールディングス	156,300	467.00	72,992,100
野村不動産ホールディングス	27,700	2,758.00	76,396,600
東京建物	42,000	1,640.00	68,880,000
電通グループ	50,500	4,125.00	208,312,500
日本郵政	243,600	921.10	224,379,960

	小計	銘柄数：70 組入時価比率：99.9%			11,492,629,750 100.0%
	合計				11,492,629,750

(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(2021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。