



2021年10月期 (2021年7月15日～2021年10月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2021 (July 15, 2021 - October 20, 2021)

2021年12月1日
 December 1, 2021

		上場取引所	東証
		Listed Exchange	TSE
ファンド名	NEXT FUNDS MSCIジャパンカンントリーESGリーダーズ指数連動型上場投信		
コード番号	(2643)		
連動対象指標	MSCI ジャパンカンントリーESG リーダーズ指数		
主要投資資産	株式および投資証券		
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 MSCI Japan Country ESG Leaders Index Exchange Traded Fund		
Code:	2643		
Underlying index:	MSCI Japan Country ESG Leaders Index		
Primary invested assets:	Stocks, REITs		
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 2022年1月19日
 分配金支払開始日 2021年11月26日
 Scheduled date of submission of securities report: January 19, 2022
 Date of commencing dividend payment: November 26, 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7月15日～2021年10月20日)

Management Status for Year ended October 2021 (from July 15, 2021 to October 20, 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	1,378	(99.8)	2	(0.2)	1,381	(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)	交換口数 No. of Units Exchanged (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
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	0	661	0	661

(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
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	1,392	11	1,381	208,762

(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	1,600

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1期 (2021年10月20日現在) 1st Fiscal Year As of October 20, 2021
	金額 Amount
資産の部 Assets	
流動資産 Current assets	
コール・ローン Call loans	1,890,995
株式 Stocks	1,370,296,330
投資証券 Investment securities	8,574,800
未収配当金 Accrued dividends receivable	11,814,842
流動資産合計 Total current assets	1,392,576,967
資産合計 Total assets	1,392,576,967
負債の部 Liabilities	
流動負債 Current liabilities	
未払収益分配金 Unpaid dividends	10,587,200
未払受託者報酬 Trustee fees payable	76,984
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	384,869
未払利息 Accrued interest expenses	1
その他未払費用 Other accrued expenses	151,942
流動負債合計 Total current liabilities	11,200,996
負債合計 Total liabilities	11,200,996
純資産の部 Net assets	
元本等 Principal and other	
元本 Principal	1,323,400,000
剰余金 Surplus	

期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	57,975,971
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	100,524
元本等合計 Total principal and other	1,381,375,971
純資産合計 Total net assets	1,381,375,971
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	1,392,576,967

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	第1期 自 2021年7月15日 至 2021年10月20日 1st Fiscal Year From July 15, 2021 to October 20, 2021
	金額 Amount
営業収益 Operating revenue	
受取配当金 Dividend income	11,948,142
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	65,910,612
その他収益 Other revenue	81
営業収益合計 Total operating revenue	77,858,835
営業費用 Operating expenses	
支払利息 Interest expenses	123
受託者報酬 Trustee fees	76,984
委託者報酬 Investment trust management fees	384,869
その他費用 Other expenses	798,523
営業費用合計 Total operating expenses	1,260,499
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	76,598,336
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	76,598,336
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	76,598,336
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	
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	8,035,165
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	8,035,165
分配金 Dividends	10,587,200
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	57,975,971

(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。 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。
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	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年7月15日から2021年10月20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1期 2021年10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	661,700 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	2,087.62 円
(100口当たり純資産額)	(208,762 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2021年7月15日 至 2021年10月20日		
1. 分配金の計算過程		
項目		
当期配当等収益額	A	11,948,100 円
分配準備積立金	B	0 円
配当等収益合計額	C=A+B	11,948,100 円

経費	D	1,260,376円
収益分配可能額	E=C-D	10,687,724円
収益分配金	F	10,587,200円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	100,524円
口数	H	661,700口
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,600円

2. その他費用

その他費用のうち675,419円は、上場に係る費用であります。

3. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(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1期 自 2021年7月15日 至 2021年10月20日
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。
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、REITの価格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。
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。 ○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。 ○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。 ○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。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第1期 2021年10月20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。
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。 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1期 自 2021年7月15日 至 2021年10月20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1期 自 2021年 7月 15日 至 2021年 10月 20日	
期首元本額	－円
期中追加設定元本額	1,323,400,000円
期中一部交換元本額	0円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2021年 7月 15日 至 2021年 10月 20日	
	損益に含まれた評価差額 (円)	
株式	66,665,049	
投資証券	△32,850	
合計	66,632,199	

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20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	INPEX	5,600	969.00	5,426,400	
		大成建設	1,000	3,680.00	3,680,000	
		大林組	3,500	976.00	3,416,000	
		清水建設	3,000	859.00	2,577,000	
		鹿島建設	2,500	1,461.00	3,652,500	
		大和ハウス工業	3,100	3,791.00	11,752,100	
		積水ハウス	3,400	2,392.50	8,134,500	
		ヤクルト本社	700	5,750.00	4,025,000	
		サントリー食品インターナショナル	800	4,455.00	3,564,000	
		キッコーマン	800	9,570.00	7,656,000	
		味の素	2,500	3,411.00	8,527,500	
		東洋水産	500	4,835.00	2,417,500	
		日清食品ホールディングス	300	8,820.00	2,646,000	
		東レ	7,600	719.50	5,468,200	
		旭化成	6,900	1,216.00	8,390,400	

住友化学	8,100	573.00	4,641,300
三井化学	1,000	3,570.00	3,570,000
J S R	1,100	3,945.00	4,339,500
三菱ケミカルホールディングス	7,000	974.20	6,819,400
積水化学工業	2,100	1,868.00	3,922,800
花王	2,600	6,555.00	17,043,000
日本ペイントホールディングス	3,900	1,194.00	4,656,600
関西ペイント	1,000	2,674.00	2,674,000
富士フイルムホールディングス	2,000	8,811.00	17,622,000
資生堂	2,200	7,482.00	16,460,400
小林製薬	300	8,720.00	2,616,000
日東電工	800	8,090.00	6,472,000
ユニ・チャーム	2,200	4,546.00	10,001,200
アステラス製薬	10,200	1,950.50	19,895,100
大日本住友製薬	1,000	1,916.00	1,916,000
塩野義製薬	1,400	7,618.00	10,665,200
中外製薬	3,700	3,968.00	14,681,600
エーザイ	1,300	8,251.00	10,726,300
第一三共	9,600	2,760.00	26,496,000
E N E O Sホールディングス	16,800	466.00	7,828,800
T O T O	800	5,760.00	4,608,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	2,700	1,735.00	4,684,500
日立金属	1,200	2,164.00	2,596,800
住友金属鉱山	1,400	4,488.00	6,283,200
L I X I L	1,500	3,115.00	4,672,500
三浦工業	500	4,400.00	2,200,000
ナブテスコ	600	3,965.00	2,379,000
小松製作所	4,800	2,830.00	13,584,000
日立建機	600	3,375.00	2,025,000
クボタ	5,600	2,400.00	13,440,000
ダイキン工業	1,400	25,730.00	36,022,000
栗田工業	500	5,640.00	2,820,000
ダイフク	600	10,300.00	6,180,000
ホンザキ	300	9,810.00	2,943,000
イビデン	600	6,180.00	3,708,000

安川電機	1,300	5,070.00	6,591,000
オムロン	1,000	10,960.00	10,960,000
日本電気	1,300	6,320.00	8,216,000
富士通	1,100	21,460.00	23,606,000
パナソニック	12,100	1,396.00	16,891,600
ソニーグループ	6,900	12,820.00	88,458,000
TDK	2,100	4,000.00	8,400,000
ヒロセ電機	200	18,660.00	3,732,000
横河電機	1,200	2,214.00	2,656,800
アズビル	700	4,795.00	3,356,500
シスメックス	900	14,030.00	12,627,000
スタンレー電気	700	2,851.00	1,995,700
ローム	500	10,130.00	5,065,000
村田製作所	3,100	8,652.00	26,821,200
東京エレクトロン	800	50,960.00	40,768,000
デンソー	2,400	7,878.00	18,907,200
トヨタ自動車	58,000	2,031.50	117,827,000
マツダ	3,100	1,061.00	3,289,100
ヤマハ発動機	1,600	3,120.00	4,992,000
島津製作所	1,300	4,700.00	6,110,000
HOYA	2,000	17,445.00	34,890,000
大日本印刷	1,200	2,821.00	3,385,200
ヤマハ	700	7,230.00	5,061,000
任天堂	600	50,300.00	30,180,000
東京瓦斯	2,100	1,926.50	4,045,650
大阪瓦斯	2,000	1,915.00	3,830,000
東邦瓦斯	400	3,690.00	1,476,000
東武鉄道	1,000	2,880.00	2,880,000
東急	2,700	1,616.00	4,363,200
小田急電鉄	1,600	2,522.00	4,035,200
京王電鉄	600	5,880.00	3,528,000
東日本旅客鉄道	1,700	7,414.00	12,603,800
西日本旅客鉄道	1,200	5,369.00	6,442,800
東海旅客鉄道	800	17,215.00	13,772,000
近鉄グループホールディングス	900	3,625.00	3,262,500

阪急阪神ホールディングス	1,200	3,475.00	4,170,000
日本通運	400	7,480.00	2,992,000
S Gホールディングス	1,700	2,901.00	4,931,700
日本郵船	900	7,800.00	7,020,000
ANAホールディングス	900	2,753.00	2,477,700
野村総合研究所	1,800	4,190.00	7,542,000
Zホールディングス	14,600	701.30	10,238,980
大塚商会	600	5,760.00	3,456,000
日本電信電話	7,000	3,138.00	21,966,000
KDDI	8,800	3,668.00	32,278,400
ソフトバンク	15,700	1,533.50	24,075,950
エヌ・ティ・ティ・データ	3,400	2,239.00	7,612,600
カブコン	1,000	3,250.00	3,250,000
S C S K	900	2,349.00	2,114,100
神戸物産	700	3,890.00	2,723,000
伊藤忠商事	6,500	3,330.00	21,645,000
丸紅	8,500	959.30	8,154,050
ローソン	300	5,350.00	1,605,000
Z O Z O	700	4,240.00	2,968,000
イオン	3,600	2,629.50	9,466,200
ヤマダホールディングス	3,700	462.00	1,709,400
ファーストリテイリング	300	75,500.00	22,650,000
りそなホールディングス	11,700	442.80	5,180,760
三井住友トラスト・ホールディングス	1,800	3,915.00	7,047,000
三井住友フィナンシャルグループ	7,100	3,915.00	27,796,500
静岡銀行	2,400	950.00	2,280,000
野村ホールディングス	16,800	570.30	9,581,040
S O M P Oホールディングス	1,700	4,970.00	8,449,000
M S & A Dインシュアランスグループホール	2,400	3,725.00	8,940,000
第一生命ホールディングス	5,600	2,459.50	13,773,200
東京海上ホールディングス	3,400	6,111.00	20,777,400
T & Dホールディングス	2,900	1,537.00	4,457,300
東京センチュリー	200	6,530.00	1,306,000
オリックス	6,700	2,191.50	14,683,050

	三井不動産	5,000	2,635.00	13,175,000	
	三菱地所	6,500	1,771.50	11,514,750	
	総合警備保障	400	5,010.00	2,004,000	
	オリエンタルランド	1,100	17,955.00	19,750,500	
	サイバーエージェント	2,200	2,081.00	4,578,200	
	リクルートホールディングス	7,400	7,232.00	53,516,800	
	セコム	1,100	8,080.00	8,888,000	
	小計 銘柄数：126			1,370,296,330	
	組入時価比率：99.2%			100.0%	
	合計			1,370,296,330	

(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20日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	日本ビルファンド投資法人 投資証券	8	5,912,000	
		オリックス不動産投資法人 投資証券	14	2,662,800	
	小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.6%	22	8,574,800 100.0%	
	合計			8,574,800	

(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) 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

該当事項はありません。