



2022年10月期 (2022年4月8日～2022年10月7日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Period ended October 2022 (April 8, 2022 - October 7, 2022)

2022年11月16日  
 November 16, 2022

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 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 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: 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 2022年12月27日  
 分配金支払開始日 2022年11月15日  
 Scheduled date of submission of securities report: December 27, 2022  
 Date of commencing dividend payment: November 15, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2022年10月期の運用状況 (2022年4月8日～2022年10月7日)

Management Status for Period ended October 2022 (from April 8, 2022 to October 7, 2022)

(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.	%
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	78,195	(99.9)	108	(0.1)	78,303	(100.0)
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	73,338	(99.8)	147	(0.2)	73,486	(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
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	3,192	494	413	3,273
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	3,024	502	334	3,192

(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
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	79,619	1,315	78,303	23,918
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	75,010	1,523	73,486	23,017

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	380
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	457

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 (2022年4月7日現在) Prior period As of April 7, 2022	当期 (2022年10月7日現在) Present period As of October 7, 2022
	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	164,521,467	119,604,230
株式 Stocks	73,338,445,100	78,195,845,060
未収配当金 Accrued dividends receivable	1,507,318,450	1,304,352,940
流動資産合計 Total current assets	75,010,285,017	79,619,802,230
資産合計 Total assets	75,010,285,017	79,619,802,230
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	1,459,092,234	1,244,083,900
未払受託者報酬 Trustee fees payable	9,685,124	10,135,783
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	52,299,640	54,733,187
未払利息 Accrued interest expenses	20	109
その他未払費用 Other accrued expenses	2,791,766	6,875,763
流動負債合計 Total current liabilities	1,523,868,784	1,315,828,742
負債合計 Total liabilities	1,523,868,784	1,315,828,742
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	47,888,237,238	49,105,301,095
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	25,598,178,995	29,198,672,393

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	2,712,207	488,151
元本等合計 Total principal and other	73,486,416,233	78,303,973,488
純資産合計 Total net assets	73,486,416,233	78,303,973,488
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	75,010,285,017	79,619,802,230

(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 2021年10月8日 至 2022年4月7日 Prior period From October 8, 2021 to April 7, 2022	当期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日 Present period From April 8, 2022 to October 7, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	1,762,932,800	1,599,192,780
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△346,141,966	2,634,463,995
その他収益 Other revenue	392	18,844
営業収益合計 Total operating revenue	1,416,791,226	4,233,675,619
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	9,392	17,843
受託者報酬 Trustee fees	19,046,028	19,977,529
委託者報酬 Investment trust management fees	102,848,493	107,878,581
その他費用 Other expenses	7,410,583	7,632,611
営業費用合計 Total operating expenses	129,314,496	135,506,564
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	1,287,476,730	4,098,169,055
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	1,287,476,730	4,098,169,055
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	1,287,476,730	4,098,169,055
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	24,569,504,527	25,598,178,995
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,203,186,552	4,613,521,071

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	4,203,186,552	4,613,521,071
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	2,828,973,076	3,645,267,612
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	2,828,973,076	3,645,267,612
分配金 Dividends	1,633,015,738	1,465,929,116
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	25,598,178,995	29,198,672,393

(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、2022年4月8日から2022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 2022年4月7日現在	当期 2022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 3,192,762 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,273,905 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 23,017 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 23,918 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日	当期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日																																				
1. 分配金の計算過程 2021年10月8日から2022年1月7日まで	1. 分配金の計算過程 2022年4月8日から2022年7月7日まで																																				
<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: right;">237,389,284 円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td></td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">2,109,249 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;">239,498,533 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">63,560,419 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;">175,938,114 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	237,389,284 円	当期配当等収益額	A		分配準備積立金	B	2,109,249 円	配当等収益合計額	C=A+B	239,498,533 円	経費	D	63,560,419 円	収益分配可能額	E=C-D	175,938,114 円	<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: right;">288,285,998 円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td></td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">2,712,207 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;">290,998,205 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">66,825,324 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;">224,172,881 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	288,285,998 円	当期配当等収益額	A		分配準備積立金	B	2,712,207 円	配当等収益合計額	C=A+B	290,998,205 円	経費	D	66,825,324 円	収益分配可能額	E=C-D	224,172,881 円
項目	A	237,389,284 円																																			
当期配当等収益額	A																																				
分配準備積立金	B	2,109,249 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	239,498,533 円																																			
経費	D	63,560,419 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	175,938,114 円																																			
項目	A	288,285,998 円																																			
当期配当等収益額	A																																				
分配準備積立金	B	2,712,207 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	290,998,205 円																																			
経費	D	66,825,324 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	224,172,881 円																																			

収益分配金	F	173,923,504円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,014,610円
口数	H	2,947,856口
1口当たり分配金	I=F/H	59円

2022年1月8日から2022年4月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	1,525,534,516円
分配準備積立金	B	2,014,610円
配当等収益合計額	C=A+B	1,527,549,126円
経費	D	65,744,685円
収益分配可能額	E=C-D	1,461,804,441円
収益分配金	F	1,459,092,234円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,712,207円
口数	H	3,192,762口
1口当たり分配金	I=F/H	457円

収益分配金	F	221,845,216円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,327,665円
口数	H	2,919,016口
1口当たり分配金	I=F/H	76円

2022年7月8日から2022年10月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	1,310,907,783円
分配準備積立金	B	2,327,665円
配当等収益合計額	C=A+B	1,313,235,448円
経費	D	68,663,397円
収益分配可能額	E=C-D	1,244,572,051円
収益分配金	F	1,244,083,900円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	488,151円
口数	H	3,273,905口
1口当たり分配金	I=F/H	380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 2021年10月8日 至 2022年4月7日	当期 自 2022年4月8日 至 2022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 2022年4月7日現在	当期 2022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>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>

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。	同左
--	----

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日	当期 自 2022年4月8日 至 2022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 2021年10月8日 至 2022年4月7日	当期 自 2022年4月8日 至 2022年10月7日
期首元本額 45,371,525,030円	期首元本額 47,888,237,238円
期中追加設定元本額 7,530,667,922円	期中追加設定元本額 7,412,580,795円
期中一部交換元本額 5,013,955,714円	期中一部交換元本額 6,195,516,938円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日	当期 自 2022年4月8日 至 2022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	△1,744,543,528	436,083,102
合計	△1,744,543,528	436,083,102

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(2022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	1,102,800	1,500.00	1,654,200,000	
		コムシスホールディングス	376,100	2,487.00	935,360,700	
		大成建設	308,700	4,060.00	1,253,322,000	
		大林組	1,188,600	949.00	1,127,981,400	
		清水建設	1,322,300	728.00	962,634,400	
		長谷工コーポレーション	705,600	1,578.00	1,113,436,800	
		鹿島建設	787,100	1,403.00	1,104,301,300	
		大和ハウス工業	295,900	2,994.50	886,072,550	

キリンホールディングス	533,300	2,243.00	1,196,191,900
日本たばこ産業	456,400	2,390.50	1,091,024,200
クラレ	1,024,700	1,026.00	1,051,342,200
旭化成	913,500	983.90	898,792,650
住友化学	1,834,900	505.00	926,624,500
東ソー	589,400	1,649.00	971,920,600
三菱瓦斯化学	487,400	1,963.00	956,766,200
三井化学	312,800	2,864.00	895,859,200
三菱ケミカルグループ	1,131,600	677.90	767,111,640
ブリヂストン	207,400	4,902.00	1,016,674,800
A G C	184,400	4,650.00	857,460,000
日本特殊陶業	411,000	2,729.00	1,121,619,000
住友金属鉱山	241,300	4,244.00	1,024,077,200
住友電気工業	701,900	1,548.50	1,086,892,150
アマダ	924,600	1,039.00	960,659,400
ブラザー工業	492,700	2,630.00	1,295,801,000
セイコーエプソン	539,500	2,115.00	1,141,042,500
キヤノン	410,600	3,324.00	1,364,834,400
いすゞ自動車	671,500	1,680.00	1,128,120,000
アイシン	257,800	3,925.00	1,011,865,000
本田技研工業	324,700	3,291.00	1,068,587,700
S U B A R U	483,400	2,280.50	1,102,393,700
ヤマハ発動機	350,700	2,844.00	997,390,800
中部電力	938,400	1,255.00	1,177,692,000
関西電力	1,018,800	1,147.00	1,168,563,600
九州電力	1,314,200	731.00	960,680,200
商船三井	458,500	2,775.00	1,272,337,500
日本電信電話	331,800	3,968.00	1,316,582,400
K D D I	315,000	4,253.00	1,339,695,000
ソフトバンク	717,200	1,468.00	1,052,849,600
双日	621,200	2,227.00	1,383,412,400
伊藤忠商事	310,200	3,850.00	1,194,270,000
豊田通商	202,200	4,760.00	962,472,000
三井物産	421,200	3,281.00	1,381,957,200
三菱商事	311,400	4,206.00	1,309,748,400



ヤマダホールディングス	2,517,000	485.00	1,220,745,000	
しずおかフィナンシャルグループ	1,157,700	865.00	1,001,410,500	
ゆうちょ銀行	1,242,400	997.00	1,238,672,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,351,100	446.00	1,048,590,600	
あおぞら銀行	401,100	2,572.00	1,031,629,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,676,700	652.70	1,094,382,090	
りそなホールディングス	2,445,100	534.50	1,306,905,950	
三井住友トラスト・ホールディングス	274,000	4,258.00	1,166,692,000	
三井住友フィナンシャルグループ	277,900	4,141.00	1,150,783,900	
千葉銀行	1,487,800	793.00	1,179,825,400	
みずほフィナンシャルグループ	691,500	1,602.00	1,107,783,000	
SBIホールディングス	371,400	2,651.00	984,581,400	
大和証券グループ本社	1,647,300	580.20	955,763,460	
かんぽ生命保険	592,000	2,151.00	1,273,392,000	
SOMPOホールディングス	217,400	5,992.00	1,302,660,800	
MS&ADインシュアランスグループホール	288,600	3,882.00	1,120,345,200	
第一生命ホールディングス	438,900	2,317.00	1,016,931,300	
東京海上ホールディングス	534,900	2,592.00	1,386,460,800	
T&Dホールディングス	743,400	1,404.00	1,043,733,600	
オリックス	474,800	2,120.50	1,006,813,400	
三菱HCキャピタル	1,850,800	642.00	1,188,213,600	
大東建託	79,200	14,420.00	1,142,064,000	
ヒューリック	944,200	1,094.00	1,032,954,800	
野村不動産ホールディングス	392,900	3,410.00	1,339,789,000	
飯田グループホールディングス	373,900	2,064.00	771,729,600	
東京建物	641,700	2,133.00	1,368,746,100	
日本郵政	1,254,100	975.70	1,223,625,370	
小計 銘柄数：70			78,195,845,060	
組入時価比率：99.9%			100.0%	
合計			78,195,845,060	

(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(2022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。