



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

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	11,778	(99.8)	24	(0.2)	11,803	(100.0)
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	12,055	(99.6)	48	(0.4)	12,104	(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	10,656	2,078	2,968	9,767
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	10,359	297	0	10,656

(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
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	11,941	138	11,803	120,846
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	12,289	184	12,104	113,584

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	1,300
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	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)

	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	51,900,927	23,428,524
株式 Stocks	12,055,375,740	11,778,554,260
未収配当金 Accrued dividends receivable	182,020,770	139,928,090
流動資産合計 Total current assets	12,289,297,437	11,941,910,874
資産合計 Total assets	12,289,297,437	11,941,910,874
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	170,507,568	126,972,573
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,638,877	1,554,022
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	7,538,792	7,148,457
未払利息 Accrued interest expenses	6	21
その他未払費用 Other accrued expenses	5,271,361	3,070,277
流動負債合計 Total current liabilities	184,956,604	138,745,350
負債合計 Total liabilities	184,956,604	138,745,350
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	10,656,723,000	9,767,121,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,447,617,833	2,036,044,524

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	7,800,425	8,555,353
元本等合計 Total principal and other	12,104,340,833	11,803,165,524
純資産合計 Total net assets	12,104,340,833	11,803,165,524
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	12,289,297,437	11,941,910,874

(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	227,734,170	202,797,870
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	257,393,825	795,193,200
その他収益 Other revenue	1,796	11,254
営業収益合計 Total operating revenue	485,129,791	998,002,324
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	1,969	2,829
受託者報酬 Trustee fees	3,267,222	3,315,374
委託者報酬 Investment trust management fees	15,029,156	15,250,669
その他費用 Other expenses	3,580,788	3,255,425
営業費用合計 Total operating expenses	21,879,135	21,824,297
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	463,250,656	976,178,027
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	463,250,656	976,178,027
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	463,250,656	976,178,027
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	1,146,074,455	1,447,617,833
剰余金増加額又は欠損金減少額	40,176,459	410,963,173

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	40,176,459	410,963,173
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	-	618,484,610
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	-	618,484,610
分配金 Dividends	201,883,737	180,229,899
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,447,617,833	2,036,044,524

(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 10,656,723 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 9,767,121 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 1,135.84 円 (100口当たり純資産額) (113,584 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 1,208.46 円 (100口当たり純資産額) (120,846 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		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	42,887,938 円	当期配当等収益額	A	57,206,588 円
分配準備積立金	B	3,827,331 円	分配準備積立金	B	7,800,425 円
配当等収益合計額	C=A+B	46,715,269 円	配当等収益合計額	C=A+B	65,007,013 円
経費	D	10,730,687 円	経費	D	11,609,537 円

収益分配可能額	E=C-D	35,984,582円
収益分配金	F	31,376,169円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,608,413円
口数	H	10,458,723口
100口当たり分配金	I=F/H×100	300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	184,846,059円
分配準備積立金	B	4,608,413円
配当等収益合計額	C=A+B	189,454,472円
経費	D	11,146,479円
収益分配可能額	E=C-D	178,307,993円
収益分配金	F	170,507,568円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	7,800,425円
口数	H	10,656,723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2,613,719円は、対象指数についての商標使用料であります。

収益分配可能額	E=C-D	53,397,476円
収益分配金	F	53,257,326円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	140,150円
口数	H	8,876,221口
100口当たり分配金	I=F/H×100	600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	145,599,707円
分配準備積立金	B	140,150円
配当等収益合計額	C=A+B	145,739,857円
経費	D	10,211,931円
収益分配可能額	E=C-D	135,527,926円
収益分配金	F	126,972,573円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,555,353円
口数	H	9,767,121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2,654,560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 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 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。</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>

(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
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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。	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。 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。	2. 時価の算定方法 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 10,359,623,000円	期首元本額 10,656,723,000円
期中追加設定元本額 297,100,000円	期中追加設定元本額 2,078,400,000円
期中一部交換元本額 0円	期中一部交換元本額 2,968,002,000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	122,571,712	134,847,802
合計	122,571,712	134,847,802

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	INPEX	214,200	1,500.00	321,300,000	
		コムシスホールディングス	26,600	2,487.00	66,154,200	
		大成建設	43,900	4,060.00	178,234,000	
		大林組	158,400	949.00	150,321,600	
		清水建設	127,200	728.00	92,601,600	

長谷工コーポレーション	47,800	1,578.00	75,428,400
鹿島建設	104,400	1,403.00	146,473,200
大和ハウス工業	64,900	2,994.50	194,343,050
積水ハウス	86,900	2,472.00	214,816,800
日本ハム	18,500	3,715.00	68,727,500
麒麟ホールディングス	116,200	2,243.00	260,636,600
日本たばこ産業	92,400	2,390.50	220,882,200
クラレ	71,700	1,026.00	73,564,200
旭化成	198,600	983.90	195,402,540
東ソー	58,600	1,649.00	96,631,400
デンカ	17,900	3,250.00	58,175,000
三菱瓦斯化学	38,600	1,963.00	75,771,800
三井化学	42,600	2,864.00	122,006,400
三菱ケミカルグループ	251,900	677.90	170,763,010
積水化学工業	86,700	1,849.00	160,308,300
花王	35,700	5,757.00	205,524,900
日東電工	24,100	8,170.00	196,897,000
武田薬品工業	68,400	3,789.00	259,167,600
アステラス製薬	114,800	1,968.00	225,926,400
出光興産	46,000	3,375.00	155,250,000
E N E O Sホールディングス	498,800	490.10	244,461,880
ブリヂストン	43,400	4,902.00	212,746,800
日本碍子	59,100	1,894.00	111,935,400
日本特殊陶業	34,500	2,729.00	94,150,500
アマダ	78,700	1,039.00	81,769,300
ナブテスコ	26,300	3,095.00	81,398,500
三菱重工業	72,000	4,870.00	350,640,000
東芝	45,400	5,223.00	237,124,200
セイコーエプソン	66,400	2,115.00	140,436,000
カシオ計算機	45,000	1,352.00	60,840,000
キヤノン	76,600	3,324.00	254,618,400
リコー	155,200	1,085.00	168,392,000
本田技研工業	66,500	3,291.00	218,851,500
S U B A R U	104,400	2,280.50	238,084,200
ヤマハ発動機	64,400	2,844.00	183,153,600

	ニコン	72,300	1,404.00	101,509,200	
	大日本印刷	55,800	2,962.00	165,279,600	
	任天堂	40,000	6,056.00	242,240,000	
	中部電力	154,600	1,255.00	194,023,000	
	関西電力	165,800	1,147.00	190,172,600	
	東北電力	106,000	631.00	66,886,000	
	九州電力	94,200	731.00	68,860,200	
	東京瓦斯	86,700	2,488.00	215,709,600	
	九州旅客鉄道	31,500	3,135.00	98,752,500	
	NIPPON EXPRESSホールディング	17,300	7,500.00	129,750,000	
	日本オラクル	8,200	8,090.00	66,338,000	
	日本電信電話	68,100	3,968.00	270,220,800	
	KDDI	63,800	4,253.00	271,341,400	
	ソフトバンク	147,600	1,468.00	216,676,800	
	ソフトバンクグループ	39,500	5,504.00	217,408,000	
	双日	41,000	2,227.00	91,307,000	
	アルフレッサホールディングス	42,700	1,728.00	73,785,600	
	メディパルホールディングス	42,000	1,904.00	79,968,000	
	三井物産	78,800	3,281.00	258,542,800	
	住友商事	126,200	1,904.00	240,284,800	
	三菱商事	58,800	4,206.00	247,312,800	
	パン・パシフィック・インターナシ ョナルホ	95,600	2,674.00	255,634,400	
	丸井グループ	42,100	2,496.00	105,081,600	
	大東建託	15,700	14,420.00	226,394,000	
	野村不動産ホールディングス	27,000	3,410.00	92,070,000	
	三菱地所	134,600	1,937.00	260,720,200	
	東京建物	44,200	2,133.00	94,278,600	
	電通グループ	51,700	4,330.00	223,861,000	
	ユー・エス・エス	49,200	2,371.00	116,653,200	
	日本郵政	239,400	975.70	233,582,580	
小計	銘柄数：70 組入時価比率：99.8%			11,778,554,260 100.0%	
合計				11,778,554,260	

(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。