



2022年10月期 (2022年4月21日～2022年10月20日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended October 2022 (April 21, 2022 – October 20, 2022)

2022年11月30日
 November 30, 2022

		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		

有価証券報告書提出予定日	2023年1月18日
分配金支払開始日	2022年11月28日
Scheduled date of submission of securities report:	January 18, 2023
Date of commencing dividend payment:	November 28, 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21日～2022年10月20日)

Management Status for Year ended October 2022 (from April 21, 2022 to October 20, 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	1,773	(100.0)	0	(0.0)	1,774	(100.0)
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	1,736	(99.9)	0	(0.1)	1,737	(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
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	861	48	0	910
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	661	349	149	861

(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
2022年10月期 FY ended Oct. 2022	1,796	22	1,774	194,911
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	1,761	23	1,737	201,566

(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	2,300
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	2,600

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2期 (2022年4月20日現在) 2nd Fiscal Year As of April 20, 2022	第3期 (2022年10月20日現在) 3rd Fiscal Year As of October 20, 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	2,745,126	3,720,199
株式 Stocks	1,725,661,180	1,754,911,560
投資証券 Investment securities	10,651,200	18,254,800
未収配当金 Accrued dividends receivable	22,047,496	19,440,800
流動資産合計 Total current assets	1,761,105,002	1,796,327,359
資産合計 Total assets	1,761,105,002	1,796,327,359
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	22,408,568	20,933,864
未払受託者報酬 Trustee fees payable	200,457	189,904
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	1,002,219	949,466
未払利息 Accrued interest expenses	-	4
その他未払費用 Other accrued expenses	263,416	237,948
流動負債合計 Total current liabilities	23,874,660	22,311,186
負債合計 Total liabilities	23,874,660	22,311,186
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	1,723,736,000	1,820,336,000
剰余金 Surplus		

期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	13,494,342	△46,319,827
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	325,726	719,380
元本等合計 Total principal and other	1,737,230,342	1,774,016,173
純資産合計 Total net assets	1,737,230,342	1,774,016,173
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	1,761,105,002	1,796,327,359

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第2期 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日 2nd Fiscal Year From October 21, 2021 to April 20, 2022	第3期 自 2022年4月21日 至 2022年10月20日 3rd Fiscal Year From April 21, 2022 to October 20, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	24,360,322	22,876,981
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△51,440,963	△59,943,139
その他収益 Other revenue	1,912	2,569
営業収益合計 Total operating revenue	△27,078,729	△37,063,589
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	142	348
受託者報酬 Trustee fees	200,457	189,904
委託者報酬 Investment trust management fees	1,002,219	949,466
その他費用 Other expenses	525,646	412,314
営業費用合計 Total operating expenses	1,728,464	1,552,032
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△28,807,193	△38,615,621
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△28,807,193	△38,615,621
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△28,807,193	△38,615,621
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 (△)	57,975,971	13,494,342

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	15,191,362	-
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	15,191,362	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	8,457,230	264,684
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	8,457,230	-
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	-	264,684
分配金 Dividends	22,408,568	20,933,864
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	13,494,342	△46,319,827

(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、2022年4月21日から2022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2期 2022年4月20日現在	第3期 2022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 861,868 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 910,168 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 46,319,827 円
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	3. 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	2,015.66円	1口当たり純資産額	1,949.11円
(100口当たり純資産額)	(201,566円)	(100口当たり純資産額)	(194,911円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自2021年10月21日 至2022年4月20日			第3期 自2022年4月21日 至2022年10月20日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	24,362,092円	当期配当等収益額	A	22,879,202円
分配準備積立金	B	100,524円	分配準備積立金	B	325,726円
配当等収益合計額	C=A+B	24,462,616円	配当等収益合計額	C=A+B	23,204,928円
経費	D	1,728,322円	経費	D	1,551,684円
収益分配可能額	E=C-D	22,734,294円	収益分配可能額	E=C-D	21,653,244円
収益分配金	F	22,408,568円	収益分配金	F	20,933,864円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	325,726円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	719,380円
口数	H	861,868口	口数	H	910,168口
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,600円	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,300円
2. その他費用 その他費用のうち186,601円は上場に係る費用、302,683円は対象指数についての商標使用料であります。			2. その他費用 その他費用のうち78,279円は上場に係る費用、294,976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

第2期 自2021年10月21日 至2022年4月20日		第3期 自2022年4月21日 至2022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。		1. 金融商品に対する取組方針 同左	
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。		2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左	
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 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。		3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左	

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第2期 2022年4月20日現在	第3期 2022年10月20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。 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。</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)

第2期 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日	第3期 自 2022年4月21日 至 2022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。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第2期 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日	第3期 自 2022年4月21日 至 2022年10月20日
期首元本額	1,323,400,000円
期中追加設定元本額	698,800,000円
期中一部交換元本額	298,464,000円
期首元本額	1,723,736,000円
期中追加設定元本額	96,600,000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2期 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日	第3期 自 2022年4月21日 至 2022年10月20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	△43,433,712	△58,123,525
投資証券	△697,484	△2,027,183
合計	△44,131,196	△60,150,708

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	I N P E X	8,300	1,483.00	12,308,900	
		大成建設	1,400	4,030.00	5,642,000	

大林組	5,200	964.00	5,012,800
清水建設	4,400	743.00	3,269,200
鹿島建設	3,400	1,394.00	4,739,600
大和ハウス工業	4,800	2,982.50	14,316,000
積水ハウス	4,900	2,444.00	11,975,600
ヤクルト本社	1,000	8,310.00	8,310,000
明治ホールディングス	900	6,250.00	5,625,000
サントリー食品インターナショナル	1,100	5,040.00	5,544,000
伊藤園	400	5,280.00	2,112,000
キッコーマン	1,200	8,200.00	9,840,000
味の素	3,600	4,091.00	14,727,600
日清食品ホールディングス	500	9,650.00	4,825,000
東レ	11,000	722.50	7,947,500
旭化成	10,000	949.90	9,499,000
住友化学	11,800	505.00	5,959,000
三井化学	1,500	2,777.00	4,165,500
三菱ケミカルグループ	10,200	668.30	6,816,660
積水化学工業	2,900	1,777.00	5,153,300
花王	3,800	5,706.00	21,682,800
日本ペイントホールディングス	6,600	969.00	6,395,400
富士フイルムホールディングス	2,900	6,812.00	19,754,800
資生堂	3,200	5,196.00	16,627,200
小林製薬	400	7,950.00	3,180,000
日東電工	1,100	7,970.00	8,767,000
ユニ・チャーム	3,200	4,637.00	14,838,400
アステラス製薬	14,600	2,005.50	29,280,300
塩野義製薬	2,100	6,848.00	14,380,800
中外製薬	5,300	3,604.00	19,101,200
エーザイ	2,000	8,262.00	16,524,000
第一三共	13,900	4,423.00	61,479,700
ENEOSホールディングス	24,400	481.50	11,748,600
TOTO	1,100	4,635.00	5,098,500
日本製鉄	6,400	2,117.50	13,552,000
JFEホールディングス	3,900	1,407.00	5,487,300
住友金属鉱山	2,000	4,149.00	8,298,000

L I X I L	2,400	2,166.00	5,198,400
小松製作所	7,300	2,663.50	19,443,550
日立建機	900	2,651.00	2,385,900
クボタ	8,100	2,000.00	16,200,000
ダイキン工業	2,000	22,245.00	44,490,000
栗田工業	800	5,180.00	4,144,000
ダイフク	800	6,810.00	5,448,000
ホシザキ	900	4,210.00	3,789,000
イビデン	900	4,070.00	3,663,000
安川電機	1,900	4,065.00	7,723,500
オムロン	1,500	6,834.00	10,251,000
富士通	1,600	16,195.00	25,912,000
パナソニック ホールディングス	17,500	1,043.50	18,261,250
ソニーグループ	10,000	9,725.00	97,250,000
TDK	3,100	4,575.00	14,182,500
ヒロセ電機	200	19,840.00	3,968,000
横河電機	1,800	2,368.00	4,262,400
アズビル	900	3,970.00	3,573,000
シスメックス	1,300	7,881.00	10,245,300
ファナック	1,500	20,335.00	30,502,500
ローム	700	9,960.00	6,972,000
村田製作所	4,600	6,971.00	32,066,600
リコー	4,600	1,104.00	5,078,400
東京エレクトロン	1,200	36,700.00	44,040,000
トヨタ自動車	84,200	2,004.00	168,736,800
ヤマハ発動機	2,400	2,981.00	7,154,400
テルモ	5,100	4,389.00	22,383,900
島津製作所	1,900	3,780.00	7,182,000
HOYA	2,900	14,395.00	41,745,500
大日本印刷	1,800	2,903.00	5,225,400
ヤマハ	1,100	5,570.00	6,127,000
任天堂	8,800	6,096.00	53,644,800
東京瓦斯	3,200	2,587.00	8,278,400
大阪瓦斯	3,000	2,203.00	6,609,000
東武鉄道	1,500	3,555.00	5,332,500

東急	4,200	1,759.00	7,387,800
小田急電鉄	2,300	1,902.00	4,374,600
京王電鉄	800	5,410.00	4,328,000
西日本旅客鉄道	1,700	6,027.00	10,245,900
近鉄グループホールディングス	1,400	5,210.00	7,294,000
阪急阪神ホールディングス	1,800	4,525.00	8,145,000
S Gホールディングス	2,300	2,005.00	4,611,500
N I P P O N E X P R E S S ホールディング	600	7,440.00	4,464,000
日本郵船	3,800	2,685.00	10,203,000
A N Aホールディングス	1,300	2,966.50	3,856,450
野村総合研究所	2,700	3,530.00	9,531,000
Zホールディングス	21,100	384.00	8,102,400
K D D I	12,800	4,293.00	54,950,400
ソフトバンク	22,800	1,453.00	33,128,400
エヌ・ティ・ティ・データ	5,000	2,079.00	10,395,000
S C S K	1,200	2,194.00	2,632,800
伊藤忠商事	9,400	3,865.00	36,331,000
丸紅	12,300	1,311.00	16,125,300
三井物産	11,100	3,212.00	35,653,200
ウエルシアホールディングス	700	3,200.00	2,240,000
イオン	5,200	2,796.00	14,539,200
ファーストリテイリング	500	84,230.00	42,115,000
しずおかフィナンシャルグループ	3,500	931.00	3,258,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	94,900	693.00	65,765,700
りそなホールディングス	17,200	574.30	9,877,960
三井住友トラスト・ホールディングス	2,700	4,299.00	11,607,300
野村ホールディングス	23,100	481.40	11,120,340
S O M P Oホールディングス	2,500	6,084.00	15,210,000
M S & A Dインシュアランスグループホール	3,500	3,922.00	13,727,000
第一生命ホールディングス	7,800	2,318.00	18,080,400
オリックス	9,500	2,105.50	20,002,250
ヒューリック	3,000	1,074.00	3,222,000
三菱地所	9,400	1,928.00	18,123,200

	住友不動産	2,500	3,473.00	8,682,500	
	リクルートホールディングス	11,400	4,397.00	50,125,800	
	小計 銘柄数：107			1,754,911,560	
	組入時価比率：98.9%			100.0%	
	合計			1,754,911,560	

(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	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	17	5,038,800	
		日本ビルファンド投資法人 投資証券	12	7,416,000	
		ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	10	5,800,000	
	小計	銘柄数：3 組入時価比率：1.0%	39	18,254,800 100.0%	
合計				18,254,800	

(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。