



2020年4月期 (2019年10月8日～2020年4月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended April 2020 (October 8, 2019 – April 7, 2020)

2020年5月19日
 May 19, 2020

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 中川 順子
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 山中 淳 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: Junko Nakagawa, President & CEO
 Contact person: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2020年6月30日
 分配金支払開始日 2020年5月15日
 Scheduled date of submission of securities report: June 30, 2020
 Date of commencing dividend payment: May 15, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年4月期の運用状況 (2019年10月8日～2020年4月7日)

Management Status for Period ended April 2020 (from October 8, 2019 to April 7, 2020)

(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.	%
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	71,659	(99.7)	246	(0.3)	71,905	(100.0)
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	84,500	(99.9)	104	(0.1)	84,605	(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
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	3,998	839	696	4,141
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	3,776	438	217	3,998

(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
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	73,621	1,715	71,905	17,364
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	86,055	1,450	84,605	21,161

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	397
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	343

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 (2019年10月7日現在) Prior period As of October 7, 2019	当期 (2020年4月7日現在) Present period As of April 7, 2020
	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	105,649,715	245,545,268
株式 Stocks	84,500,717,230	71,659,391,320
未収配当金 Accrued dividends receivable	1,449,221,000	1,716,161,475
流動資産合計 Total current assets	86,055,587,945	73,621,098,063
資産合計 Total assets	86,055,587,945	73,621,098,063
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	1,371,376,426	1,644,043,299
未払受託者報酬 Trustee fee payable	11,121,408	10,671,886
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	60,055,558	57,628,181
未払利息 Accrued interest expenses	58	221
その他未払費用 Other accrued expenses	7,671,788	2,979,569
流動負債合計 Total current liabilities	1,450,225,238	1,715,323,156
負債合計 Total liabilities	1,450,225,238	1,715,323,156
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	59,968,731,818	62,113,363,833
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	24,636,630,889	9,792,411,074

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	2,847,311	536,542
元本等合計 Total principal and other	84,605,362,707	71,905,774,907
純資産合計 Total net assets	84,605,362,707	71,905,774,907
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	86,055,587,945	73,621,098,063

(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 2019年4月8日 至 2019年10月7日 Prior period From April 8, 2019 to October 7, 2019	当期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日 Present period From October 8, 2019 to April 7, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	1,707,124,600	1,948,307,575
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△8,343,342,909	△14,359,601,291
その他収益 Other revenue	1,662,118	1,421,724
営業収益合計 Total operating revenue	△6,634,556,191	△12,409,871,992
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	42,347	19,732
受託者報酬 Trustee fee	22,253,591	22,829,236
委託者報酬 Investment trust management fee	120,169,319	123,277,825
その他費用 Other expenses	8,583,930	8,791,782
営業費用合計 Total operating expenses	151,049,187	154,918,575
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△6,785,605,378	△12,564,790,567
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△6,785,605,378	△12,564,790,567
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△6,785,605,378	△12,564,790,567
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	31,820,489,569	24,636,630,889
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,712,351,153	4,557,006,422

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	2,712,351,153	4,557,006,422
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	1,553,112,205	5,039,314,177
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	1,553,112,205	5,039,314,177
分配金 Dividends	1,557,492,250	1,797,121,493
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	24,636,630,889	9,792,411,074

(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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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る場合、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、2019年10月8日から2020年4月7日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

前期 2019年10月7日現在	当期 2020年4月7日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,998,182 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 4,141,167 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 21,161 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 17,364 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2019年4月8日 至 2019年10月7日	当期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日																																										
1. 分配金の計算過程 2019年4月8日から2019年7月7日まで	1. 分配金の計算過程 2019年10月8日から2020年1月7日まで																																										
<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">259,862,313 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">2,602,030 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;">262,464,343 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">75,587,408 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;">186,876,935 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">186,115,824 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	259,862,313 円	分配準備積立金	B	2,602,030 円	配当等収益合計額	C=A+B	262,464,343 円	経費	D	75,587,408 円	収益分配可能額	E=C-D	186,876,935 円	収益分配金	F	186,115,824 円	<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">233,557,060 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">2,847,311 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;">236,404,371 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">82,548,271 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;">153,856,100 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">153,078,194 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	233,557,060 円	分配準備積立金	B	2,847,311 円	配当等収益合計額	C=A+B	236,404,371 円	経費	D	82,548,271 円	収益分配可能額	E=C-D	153,856,100 円	収益分配金	F	153,078,194 円
項目																																											
当期配当等収益額	A	259,862,313 円																																									
分配準備積立金	B	2,602,030 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	262,464,343 円																																									
経費	D	75,587,408 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	186,876,935 円																																									
収益分配金	F	186,115,824 円																																									
項目																																											
当期配当等収益額	A	233,557,060 円																																									
分配準備積立金	B	2,847,311 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	236,404,371 円																																									
経費	D	82,548,271 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	153,856,100 円																																									
収益分配金	F	153,078,194 円																																									

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	761,111円
口数	H	3,877,413口
1口当たり分配金	I=F/H	48円

2019年7月8日から2019年10月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	1,448,882,058円
分配準備積立金	B	761,111円
配当等収益合計額	C=A+B	1,449,643,169円
経費	D	75,419,432円
収益分配可能額	E=C-D	1,374,223,737円
収益分配金	F	1,371,376,426円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,847,311円
口数	H	3,998,182口
1口当たり分配金	I=F/H	343円

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	777,906円
口数	H	3,559,958口
1口当たり分配金	I=F/H	43円

2020年1月8日から2020年4月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	1,716,152,507円
分配準備積立金	B	777,906円
配当等収益合計額	C=A+B	1,716,930,413円
経費	D	72,350,572円
収益分配可能額	E=C-D	1,644,579,841円
収益分配金	F	1,644,043,299円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	536,542円
口数	H	4,141,167口
1口当たり分配金	I=F/H	397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 2019年4月8日 至 2019年10月7日	当期 自 2019年10月8日 至 2020年4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 2019年10月7日現在	当期 2020年4月7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</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>

(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)

前期 自 2019年 4月 8日 至 2019年 10月 7日	当期 自 2019年 10月 8日 至 2020年 4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 2019年 4月 8日 至 2019年 10月 7日	当期 自 2019年 10月 8日 至 2020年 4月 7日
期首元本額 56,644,968,417円	期首元本額 59,968,731,818円
期中追加設定元本額 6,581,471,206円	期中追加設定元本額 12,586,590,838円
期中一部交換元本額 3,257,707,805円	期中一部交換元本額 10,441,958,823円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2019年 4月 8日 至 2019年 10月 7日	当期 自 2019年 10月 8日 至 2020年 4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	△3,128,020,260	△20,727,215,541
合計	△3,128,020,260	△20,727,215,541

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(2020年4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	清水建設	1,815,900	831.00	1,509,012,900	
		長谷工コーポレーション	945,900	1,100.00	1,040,490,000	
		鹿島建設	900,600	1,088.00	979,852,800	
		大東建託	96,200	10,170.00	978,354,000	
		大和ハウス工業	368,300	2,654.50	977,652,350	
		日本たばこ産業	561,500	1,990.50	1,117,665,750	
		昭和電工	428,000	2,282.00	976,696,000	
		住友化学	2,649,000	318.00	842,382,000	

東ソー	835,000	1,260.00	1,052,100,000
デンカ	407,700	2,852.00	1,162,760,400
三菱瓦斯化学	814,200	1,262.00	1,027,520,400
三井化学	493,400	1,895.00	934,993,000
J S R	651,400	1,973.00	1,285,212,200
三菱ケミカルホールディングス	1,557,600	638.10	993,904,560
宇部興産	569,200	1,631.00	928,365,200
D I C	420,000	2,303.00	967,260,000
武田薬品工業	312,800	3,471.00	1,085,728,800
出光興産	424,800	2,565.00	1,089,612,000
J X T Gホールディングス	2,607,100	393.50	1,025,893,850
ブリヂストン	294,900	3,286.00	969,041,400
住友ゴム工業	969,900	963.00	934,013,700
アマダ	1,044,800	853.00	891,214,400
小松製作所	511,300	1,793.50	917,016,550
日本精工	1,236,100	645.00	797,284,500
ジェイテクト	931,000	705.00	656,355,000
三菱重工業	313,000	2,638.00	825,694,000
コニカミノルタ	1,876,100	407.00	763,572,700
セイコーエプソン	866,800	1,075.00	931,810,000
キヤノン	455,900	2,282.00	1,040,363,800
三菱自動車工業	2,728,200	308.00	840,285,600
マツダ	1,356,200	559.00	758,115,800
本田技研工業	445,900	2,355.50	1,050,317,450
S U B A R U	453,100	1,874.00	849,109,400
ヤマハ発動機	624,700	1,302.00	813,359,400
ニコン	906,400	995.00	901,868,000
関西電力	1,086,700	1,129.00	1,226,884,300
中国電力	922,900	1,481.00	1,366,814,900
東北電力	1,203,400	1,006.00	1,210,620,400
九州電力	1,396,300	876.00	1,223,158,800
日本航空	405,200	1,855.50	751,848,600
日本電信電話	500,600	2,594.50	1,298,806,700
K D D I	430,800	3,251.00	1,400,530,800
ソフトバンク	920,000	1,396.50	1,284,780,000

	N T T ドコモ	455,000	3,382.00	1,538,810,000	
	双日	3,890,700	244.00	949,330,800	
	伊藤忠商事	580,300	2,139.00	1,241,261,700	
	丸紅	1,711,500	519.00	888,268,500	
	三井物産	711,000	1,504.00	1,069,344,000	
	住友商事	819,200	1,190.50	975,257,600	
	三菱商事	476,100	2,235.00	1,064,083,500	
	ゆうちょ銀行	1,261,100	975.00	1,229,572,500	
	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,964,600	308.00	913,096,800	
	あおぞら銀行	483,900	1,923.00	930,539,700	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,319,200	415.60	963,859,520	
	りそなホールディングス	2,831,400	334.30	946,537,020	
	三井住友トラスト・ホールディングス	330,800	3,121.00	1,032,426,800	
	三井住友フィナンシャルグループ	341,300	2,724.00	929,701,200	
	みずほフィナンシャルグループ	7,962,700	124.00	987,374,800	
	SBIホールディングス	578,400	1,611.00	931,802,400	
	大和証券グループ本社	2,650,500	438.10	1,161,184,050	
	かんぽ生命保険	764,700	1,338.00	1,023,168,600	
	SOMPOホールディングス	294,900	3,550.00	1,046,895,000	
	MS&ADインシュアランスグループホール	385,300	3,060.00	1,179,018,000	
	第一生命ホールディングス	572,200	1,364.50	780,766,900	
	東京海上ホールディングス	231,700	5,007.00	1,160,121,900	
	オリックス	789,300	1,235.00	974,785,500	
	三菱UFJリース	1,999,400	483.00	965,710,200	
	野村不動産ホールディングス	538,800	1,714.00	923,503,200	
	飯田グループホールディングス	743,900	1,387.00	1,031,789,300	
	日本郵政	1,346,600	848.70	1,142,859,420	
	小計 銘柄数：70			71,659,391,320	
	組入時価比率：99.7%			100.0%	
	合計			71,659,391,320	

(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(2020年4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。