



2021年4月期 (2020年10月8日～2021年4月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended April 2021 (October 8, 2020 – April 7, 2021)

2021年5月19日
 May 19, 2021

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 山中 淳 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: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2021年6月29日
 分配金支払開始日 2021年5月14日
 Scheduled date of submission of securities report: June 29, 2021
 Date of commencing dividend payment: May 14, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021年4月期の運用状況 (2020年10月8日～2021年4月7日)

Management Status for Period ended April 2021 (from October 8, 2020 to April 7, 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4月期 FY ended Apr. 2021	10,532	(99.7)	28	(0.3)	10,560	(100.0)
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	7,913	(99.8)	17	(0.2)	7,930	(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
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	8,850	2,787	2,077	9,560
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	6,252	2,798	199	8,850

(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
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	10,696	135	10,560	110,466
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	8,017	87	7,930	89,599

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2021年4月期 FY ended Apr. 2021	1,300
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	900

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 (2020年10月7日現在) Prior period As of October 7, 2020	当期 (2021年4月7日現在) Present period As of April 7, 2021
	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	9,537,295	32,964,355
株式 Stocks	7,913,074,350	10,532,878,280
未収配当金 Accrued dividends receivable	95,119,750	130,491,022
流動資産合計 Total current assets	8,017,731,395	10,696,333,657
資産合計 Total assets	8,017,731,395	10,696,333,657
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	79,656,867	124,284,394
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,085,913	1,328,496
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	4,995,178	6,111,043
未払利息 Accrued interest expenses	3	13
その他未払費用 Other accrued expenses	1,755,975	3,687,091
流動負債合計 Total current liabilities	87,493,936	135,411,037
負債合計 Total liabilities	87,493,936	135,411,037
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	8,850,763,000	9,560,338,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△920,525,541	1,000,584,620

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	5,286,437	3,668,281
元本等合計 Total principal and other	7,930,237,459	10,560,922,620
純資産合計 Total net assets	7,930,237,459	10,560,922,620
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	8,017,731,395	10,696,333,657

(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 2020年4月8日 至 2020年10月7日 Prior period From April 8, 2020 to October 7, 2020	当期 自 2020年10月8日 至 2021年4月7日 Present period From October 8, 2020 to April 7, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	102,589,450	154,457,722
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	564,453,868	1,878,081,049
その他収益 Other revenue	298,757	118,286
営業収益合計 Total operating revenue	667,342,075	2,032,657,057
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	2,051	1,479
受託者報酬 Trustee fees	1,869,977	2,356,323
委託者報酬 Investment trust management fees	8,601,853	10,839,001
その他費用 Other expenses	1,758,591	2,780,491
営業費用合計 Total operating expenses	12,232,472	15,977,294
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	655,109,603	2,016,679,763
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	655,109,603	2,016,679,763
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	655,109,603	2,016,679,763
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	△1,189,955,496	△920,525,541
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,047,760	132,724,430

Increase in surplus or decrease in deficit		
当期一部交換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 partial exchange	23,047,760	132,724,430
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	320,319,579	88,077,162
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	320,319,579	88,077,162
分配金 Dividends	88,407,829	140,216,870
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△920,525,541	1,000,584,620

(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、2020年10月8日から2021年4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 2020年10月7日現在	当期 2021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 8,850,763 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 9,560,338 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 920,525,541 円	
3. 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 895.99 円 (100口当たり純資産額) (89,599 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 1,104.66 円 (100口当たり純資産額) (110,466 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日	当期 自 2020年10月8日 至 2021年4月7日
1. 分配金の計算過程 2020年4月8日から2020年7月7日まで	1. 分配金の計算過程 2020年10月8日から2021年1月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	14,366,326円
分配準備積立金	B	3,038,531円
配当等収益合計額	C=A+B	17,404,857円
経費	D	5,173,010円
収益分配可能額	E=C-D	12,231,847円
収益分配金	F	8,750,962円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,480,885円
口数	H	8,750,962口
100口当たり分配金	I=F/H×100	100円

2020年7月8日から2020年10月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	88,519,830円
分配準備積立金	B	3,480,885円
配当等収益合計額	C=A+B	92,000,715円
経費	D	7,057,411円
収益分配可能額	E=C-D	84,943,304円
収益分配金	F	79,656,867円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,286,437円
口数	H	8,850,763口
100口当たり分配金	I=F/H×100	900円

2. その他費用

その他費用のうち181,790円は上場に係る費用、1,502,065円は対象指数についての商標使用料であります。

項目		
当期配当等収益額	A	22,220,663円
分配準備積立金	B	5,286,437円
配当等収益合計額	C=A+B	27,507,100円
経費	D	6,773,237円
収益分配可能額	E=C-D	20,733,863円
収益分配金	F	15,932,476円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,801,387円
口数	H	7,966,238口
100口当たり分配金	I=F/H×100	200円

2021年1月8日から2021年4月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	132,353,866円
分配準備積立金	B	4,801,387円
配当等収益合計額	C=A+B	137,155,253円
経費	D	9,202,578円
収益分配可能額	E=C-D	127,952,675円
収益分配金	F	124,284,394円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,668,281円
口数	H	9,560,338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801,311円は上場に係る費用、1,884,990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 2020年4月8日 至 2020年10月7日	当期 自 2020年10月8日 至 2021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</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>

把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 2020年10月7日現在	当期 2021年4月7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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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 2020年4月8日 至 2020年10月7日	当期 自 2020年10月8日 至 2021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 2020年4月8日 至 2020年10月7日	当期 自 2020年10月8日 至 2021年4月7日
期首元本額 6,252,362,000円	期首元本額 8,850,763,000円
期中追加設定元本額 2,798,300,000円	期中追加設定元本額 2,787,400,000円
期中一部交換元本額 199,899,000円	期中一部交換元本額 2,077,825,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日	当期 自 2020年10月8日 至 2021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	221,285,398	1,252,153,368
合計	221,285,398	1,252,153,368

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	I N P E X	212,500	769.00	163,412,500	
		大成建設	39,700	4,215.00	167,335,500	

清水建設	112,500	910.00	102,375,000
長谷工コーポレーション	47,400	1,607.00	76,171,800
鹿島建設	92,400	1,569.00	144,975,600
大東建託	13,800	13,160.00	181,608,000
大和ハウス工業	58,800	3,203.00	188,336,400
積水ハウス	85,800	2,347.50	201,415,500
麒麟ホールディングス	74,100	2,090.00	154,869,000
日本たばこ産業	85,800	2,088.50	179,193,300
帝人	37,200	1,885.00	70,122,000
クラレ	64,000	1,254.00	80,256,000
住友化学	293,400	573.00	168,118,200
東ソー	51,400	2,142.00	110,098,800
三菱瓦斯化学	33,500	2,719.00	91,086,500
三井化学	36,400	3,590.00	130,676,000
三菱ケミカルホールディングス	261,900	843.50	220,912,650
積水化学工業	76,600	2,118.00	162,238,800
富士フイルムホールディングス	33,100	6,569.00	217,433,900
日東電工	19,500	9,720.00	189,540,000
アステラス製薬	113,100	1,654.00	187,067,400
塩野義製薬	32,000	5,782.00	185,024,000
出光興産	40,300	2,755.00	111,026,500
E N E O Sホールディングス	486,700	488.40	237,704,280
ブリヂストン	53,300	4,431.00	236,172,300
A G C	37,900	4,745.00	179,835,500
日本特殊陶業	29,900	1,862.00	55,673,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	99,800	1,343.00	134,031,400
アマダ	67,100	1,221.00	81,929,100
荏原製作所	17,400	5,040.00	87,696,000
日本精工	76,300	1,112.00	84,845,600
I H I	27,300	2,205.00	60,196,500
東芝	62,500	4,530.00	283,125,000
セイコーエプソン	58,800	1,800.00	105,840,000
アルプスアルパイン	43,800	1,450.00	63,510,000
ローム	18,000	11,660.00	209,880,000
キヤノン	91,100	2,519.50	229,526,450

日産自動車	321,900	578.20	186,122,580	
いすゞ自動車	109,300	1,200.00	131,160,000	
トヨタ自動車	22,700	8,487.00	192,654,900	
アイシン	31,900	4,065.00	129,673,500	
マツダ	119,700	899.00	107,610,300	
本田技研工業	62,600	3,259.00	204,013,400	
S U B A R U	87,400	2,129.00	186,074,600	
大日本印刷	50,900	2,290.00	116,561,000	
中部電力	133,700	1,360.00	181,832,000	
関西電力	144,400	1,134.00	163,749,600	
中国電力	60,700	1,322.00	80,245,400	
東北電力	91,900	1,025.00	94,197,500	
東京瓦斯	75,300	2,345.00	176,578,500	
九州旅客鉄道	30,000	2,498.00	74,940,000	
Zホールディングス	288,700	557.70	161,007,990	
日本電信電話	68,100	2,851.00	194,153,100	
K D D I	58,800	3,481.00	204,682,800	
ソフトバンク	139,400	1,427.50	198,993,500	
ソフトバンクグループ	22,400	10,000.00	224,000,000	
メディopalホールディングス	36,700	2,170.00	79,639,000	
伊藤忠商事	60,800	3,590.00	218,272,000	
丸紅	262,700	922.90	242,445,830	
三井物産	95,400	2,342.50	223,474,500	
住友商事	132,000	1,580.00	208,560,000	
三菱商事	70,900	3,113.00	220,711,700	
スズケン	14,100	4,165.00	58,726,500	
丸井グループ	37,500	2,098.00	78,675,000	
ケーズホールディングス	38,000	1,577.00	59,926,000	
ヤマダホールディングス	144,100	606.00	87,324,600	
野村不動産ホールディングス	25,500	2,707.00	69,028,500	
東京建物	38,700	1,701.00	65,828,700	
電通グループ	46,600	3,580.00	166,828,000	
日本郵政	224,500	944.00	211,928,000	
小計 銘柄数：70			10,532,878,280	
組入時価比率：99.7%				100.0%

合計			10,532,878,280
----	--	--	----------------

(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。