



2022年4月期 (2021年10月8日~2022年4月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended April 2022 (October 8, 2021 – April 7, 2022)

2022年5月18日
 May 18, 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6月29日
 分配金支払開始日 2022年5月16日
 Scheduled date of submission of securities report: June 29, 2022
 Date of commencing dividend payment: May 16, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2022年4月期の運用状況 (2021年10月8日~2022年4月7日)

Management Status for Period ended April 2022 (from October 8, 2021 to April 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4月期 FY ended Apr. 2022	12,055	(99.6)	48	(0.4)	12,104	(100.0)
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	11,492	(99.9)	13	(0.1)	11,505	(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4月期 FY ended Apr. 2022	10,359	297	0	10,656
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	9,560	2,793	1,994	10,359

(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4月期 FY ended Apr. 2022	12,289	184	12,104	113,584
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	11,651	145	11,505	111,063

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2022年4月期 FY ended Apr. 2022	1,600
2021年10月期 FY ended Oct. 2021	1,300

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 (2021年10月7日現在) Prior period As of October 7, 2021	当期 (2022年4月7日現在) Present period As of April 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	20,511,229	51,900,927
株式 Stocks	11,492,629,750	12,055,375,740
未収配当金 Accrued dividends receivable	138,518,200	182,020,770
流動資産合計 Total current assets	11,651,659,179	12,289,297,437
資産合計 Total assets	11,651,659,179	12,289,297,437
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	134,675,099	170,507,568
未払受託者報酬 Trustee fees payable	1,544,496	1,638,877
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	7,104,675	7,538,792
未払利息 Accrued interest expenses	8	6
その他未払費用 Other accrued expenses	2,637,446	5,271,361
流動負債合計 Total current liabilities	145,961,724	184,956,604
負債合計 Total liabilities	145,961,724	184,956,604
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	10,359,623,000	10,656,723,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,146,074,455	1,447,617,833

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	3,827,331	7,800,425
元本等合計 Total principal and other	11,505,697,455	12,104,340,833
純資産合計 Total net assets	11,505,697,455	12,104,340,833
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	11,651,659,179	12,289,297,437

(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4月8日 至 2021年10月7日 Prior period From April 8, 2021 to October 7, 2021	当期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日 Present period From October 8, 2021 to April 7, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	190,652,350	227,734,170
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	82,993,275	257,393,825
その他収益 Other revenue	6,084	1,796
営業収益合計 Total operating revenue	273,651,709	485,129,791
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	3,189	1,969
受託者報酬 Trustee fees	2,797,753	3,267,222
委託者報酬 Investment trust management fees	12,869,634	15,029,156
その他費用 Other expenses	2,709,617	3,580,788
営業費用合計 Total operating expenses	18,380,193	21,879,135
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	255,271,516	463,250,656
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	255,271,516	463,250,656
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	255,271,516	463,250,656
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	1,000,584,620	1,146,074,455
剰余金増加額又は欠損金減少額	271,083,320	40,176,459

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	271,083,320	40,176,459
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	208,745,810	-
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	208,745,810	-
分配金 Dividends	172,119,191	201,883,737
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,146,074,455	1,447,617,833

(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、2021年10月8日から2022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 2021年10月7日現在	当期 2022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 10,359,623 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 10,656,723 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 1,110.63 円 (100口当たり純資産額) (111,063 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 1,135.84 円 (100口当たり純資産額) (113,584 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2021年4月8日 至 2021年10月7日	当期 自 2021年10月8日 至 2022年4月7日																														
1. 分配金の計算過程 2021年4月8日から2021年7月7日まで	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																														
<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;">45,877,134 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;">3,668,281 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;">49,545,415 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">8,267,250 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	45,877,134 円	分配準備積立金	B	3,668,281 円	配当等収益合計額	C=A+B	49,545,415 円	経費	D	8,267,250 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;">42,887,938 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;">3,827,331 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;">46,715,269 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">10,730,687 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	42,887,938 円	分配準備積立金	B	3,827,331 円	配当等収益合計額	C=A+B	46,715,269 円	経費	D	10,730,687 円
項目																															
当期配当等収益額	A	45,877,134 円																													
分配準備積立金	B	3,668,281 円																													
配当等収益合計額	C=A+B	49,545,415 円																													
経費	D	8,267,250 円																													
項目																															
当期配当等収益額	A	42,887,938 円																													
分配準備積立金	B	3,827,331 円																													
配当等収益合計額	C=A+B	46,715,269 円																													
経費	D	10,730,687 円																													

収益分配可能額	E=C-D	41,278,165円
収益分配金	F	37,444,092円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,834,073円
口数	H	9,361,023口
100口当たり分配金	I=F/H×100	400円

2021年7月8日から2021年10月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	144,778,111円
分配準備積立金	B	3,834,073円
配当等収益合計額	C=A+B	148,612,184円
経費	D	10,109,754円
収益分配可能額	E=C-D	138,502,430円
収益分配金	F	134,675,099円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,827,331円
口数	H	10,359,623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351,220円は上場に係る費用、2,246,553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	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836,439円は上場に係る費用、2,613,719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4月8日 至 2021年10月7日	当期 自 2021年10月8日 至 2022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 2021年10月7日現在	当期 2022年4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 4月 8日 至 2021年 10月 7日	当期 自 2021年 10月 8日 至 2022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 2021年 4月 8日 至 2021年 10月 7日	当期 自 2021年 10月 8日 至 2022年 4月 7日
期首元本額 9,560,338,000円	期首元本額 10,359,623,000円
期中追加設定元本額 2,793,800,000円	期中追加設定元本額 297,100,000円
期中一部交換元本額 1,994,515,000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	前期 自 2021年 4月 8日 至 2021年 10月 7日	当期 自 2021年 10月 8日 至 2022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	162,958,090	122,571,712
合計	162,958,090	122,571,712

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	INPEX	233,400	1,435.00	334,929,000	
		コムシスホールディングス	29,000	2,581.00	74,849,000	
		大成建設	47,800	3,390.00	162,042,000	
		大林組	172,500	878.00	151,455,000	
		清水建設	138,600	714.00	98,960,400	

長谷工コーポレーション	52,100	1,344.00	70,022,400
鹿島建設	113,800	1,445.00	164,441,000
大東建託	17,100	12,660.00	216,486,000
大和ハウス工業	70,700	3,056.00	216,059,200
積水ハウス	94,700	2,247.50	212,838,250
日本ハム	20,200	4,165.00	84,133,000
麒麟ホールディングス	126,600	1,773.50	224,525,100
日本たばこ産業	100,700	2,138.50	215,346,950
クラレ	78,200	1,008.00	78,825,600
旭化成	216,300	1,022.00	221,058,600
東ソー	63,900	1,682.00	107,479,800
デンカ	19,500	3,280.00	63,960,000
三菱瓦斯化学	42,100	1,849.00	77,842,900
三井化学	46,400	2,895.00	134,328,000
三菱ケミカルホールディングス	274,500	780.00	214,110,000
積水化学工業	94,400	1,663.00	156,987,200
花王	38,900	4,943.00	192,282,700
日東電工	26,300	8,560.00	225,128,000
武田薬品工業	74,500	3,640.00	271,180,000
アステラス製薬	125,000	2,008.00	251,000,000
出光興産	50,100	3,290.00	164,829,000
E N E O Sホールディングス	543,500	446.40	242,618,400
ブリヂストン	47,300	4,540.00	214,742,000
日本碍子	64,300	1,673.00	107,573,900
日本特殊陶業	37,600	1,857.00	69,823,200
アマダ	85,700	1,019.00	87,328,300
ナブテスコ	28,600	3,110.00	88,946,000
三菱重工業	78,500	3,908.00	306,778,000
東芝	49,400	4,889.00	241,516,600
セイコーエプソン	72,400	1,745.00	126,338,000
カシオ計算機	49,100	1,334.00	65,499,400
キヤノン	83,500	2,941.00	245,573,500
リコー	169,100	962.00	162,674,200
本田技研工業	72,400	3,217.00	232,910,800
S U B A R U	113,700	1,819.00	206,820,300

ヤマハ発動機	70,200	2,553.00	179,220,600
ニコン	78,800	1,272.00	100,233,600
大日本印刷	60,800	2,721.00	165,436,800
任天堂	4,400	63,180.00	277,992,000
中部電力	168,400	1,218.00	205,111,200
関西電力	180,600	1,117.00	201,730,200
東北電力	115,500	712.00	82,236,000
九州電力	102,600	815.00	83,619,000
東京瓦斯	94,400	2,178.00	205,603,200
九州旅客鉄道	34,300	2,468.00	84,652,400
NIPPON EXPRESSホールディング	18,900	7,770.00	146,853,000
日本オラクル	8,900	8,490.00	75,561,000
日本電信電話	74,200	3,614.00	268,158,800
KDDI	69,600	4,071.00	283,341,600
ソフトバンク	160,800	1,450.00	233,160,000
ソフトバンクグループ	43,000	5,654.00	243,122,000
双日	44,700	1,871.00	83,633,700
アルフレッサホールディングス	46,600	1,717.00	80,012,200
メディカルホールディングス	45,700	2,041.00	93,273,700
三井物産	85,900	3,125.00	268,437,500
住友商事	137,500	2,014.50	276,993,750
三菱商事	64,000	4,324.00	276,736,000
パン・パシフィック・インターナシ ョナルホ	104,200	1,910.00	199,022,000
丸井グループ	45,900	2,242.00	102,907,800
野村不動産ホールディングス	29,400	2,910.00	85,554,000
三菱地所	146,700	1,799.50	263,986,650
東京建物	48,200	1,792.00	86,374,400
電通グループ	56,300	4,885.00	275,025,500
ユー・エス・エス	53,600	2,036.00	109,129,600
日本郵政	260,800	897.30	234,015,840
小計 銘柄数：70			12,055,375,740
組入時価比率：99.6%			100.0%
合計			12,055,375,740

(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。