



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

2020年11月18日
 November 18, 2020

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 日経平均高配当株50指数連動型上場投信
 コード番号 (1489)
 連動対象指標 日経平均高配当株50指数
 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 Nikkei 225 High Dividend Yield Stock 50 Index Exchange Traded Fund
 Code: 1489
 Underlying index: Nikkei 225 High Dividend Yield Stock 50 Index
 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12月16日
 分配金支払開始日 2020年11月13日
 Scheduled date of submission of securities report: December 16, 2020
 Date of commencing dividend payment: November 13, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

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

Management Status for Period ended October 2020 (from April 8, 2020 to October 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10月期 FY ended Oct. 2020	26,466	(99.7)	66	(0.3)	26,533	(100.0)
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	28,463	(99.3)	204	(0.7)	28,668	(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10月期 FY ended Oct. 2020	1,097	24	178	944
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	1,150	309	362	1,097

(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10月期 FY ended Oct. 2020	27,002	468	26,533	28,097
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	29,328	660	28,668	26,118

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2020年10月期 FY ended Oct. 2020	465
2020年4月期 FY ended Apr. 2020	569

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4月7日現在) Prior period As of April 7, 2020	当期 (2020年10月7日現在) Present period As of October 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	207,540,825	51,636,804
株式 Stocks	28,463,647,970	26,466,620,340
未収配当金 Accrued dividends receivable	657,484,750	483,858,270
流動資産合計 Total current assets	29,328,673,545	27,002,115,414
資産合計 Total assets	29,328,673,545	27,002,115,414
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	624,556,022	439,116,240
未払受託者報酬 Trustee fee payable	4,545,658	3,815,946
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	20,909,971	17,553,334
未払利息 Accrued interest expenses	187	21
その他未払費用 Other accrued expenses	10,571,360	8,426,938
流動負債合計 Total current liabilities	660,583,198	468,912,479
負債合計 Total liabilities	660,583,198	468,912,479
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	38,280,125,250	32,933,718,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△9,612,034,903	△6,400,515,065

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	953, 135	387, 378
元本等合計 Total principal and other	28, 668, 090, 347	26, 533, 202, 935
純資産合計 Total net assets	28, 668, 090, 347	26, 533, 202, 935
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	29, 328, 673, 545	27, 002, 115, 414

(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10月8日 至 2020年4月7日 Prior period From October 8, 2019 to April 7, 2020	当期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日 Present period From April 8, 2020 to October 7, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	799, 118, 550	512, 079, 470
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△6, 913, 915, 090	2, 137, 637, 359
その他収益 Other revenue	254	194
営業収益合計 Total operating revenue	△6, 114, 796, 286	2, 649, 717, 023
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	10, 340	14, 595
受託者報酬 Trustee fee	9, 650, 771	7, 658, 197
委託者報酬 Investment trust management fee	44, 393, 475	35, 227, 666
その他費用 Other expenses	12, 451, 934	9, 305, 386
営業費用合計 Total operating expenses	66, 506, 520	52, 205, 844
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△6, 181, 302, 806	2, 597, 511, 179
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△6, 181, 302, 806	2, 597, 511, 179
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△6, 181, 302, 806	2, 597, 511, 179
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	△3, 292, 761, 428	△9, 612, 034, 903
剰余金増加額又は欠損金減少額	2, 396, 060, 940	1, 259, 638, 470

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	2,396,060,940	1,259,638,470
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	1,802,160,196	185,190,234
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	1,802,160,196	185,190,234
分配金 Dividends	731,871,413	460,439,577
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△9,612,034,903	△6,400,515,065

(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、2020年4月8日から2020年10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 2020年4月7日現在	当期 2020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 1,097,638 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 944,336 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 9,612,034,903 円	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 6,400,515,065 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 26,118 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 28,097 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日	当期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日																		
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	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																		
<table border="1"> <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>A</td> <td>142,297,150 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>212,264 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	142,297,150 円	分配準備積立金	B	212,264 円	<table border="1"> <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>A</td> <td>47,294,438 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>953,135 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	47,294,438 円	分配準備積立金	B	953,135 円
項目																			
当期配当等収益額	A	142,297,150 円																	
分配準備積立金	B	212,264 円																	
項目																			
当期配当等収益額	A	47,294,438 円																	
分配準備積立金	B	953,135 円																	

配当等収益合計額	C=A+B	142,509,414円
経費	D	34,666,242円
収益分配可能額	E=C-D	107,843,172円
収益分配金	F	107,315,391円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	527,781円
口数	H	1,041,897口
1口当たり分配金	I=F/H	103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	656,811,314円
分配準備積立金	B	527,781円
配当等収益合計額	C=A+B	657,339,095円
経費	D	31,829,938円
収益分配可能額	E=C-D	625,509,157円
収益分配金	F	624,556,022円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	953,135円
口数	H	1,097,638口
1口当たり分配金	I=F/H	569円

2. その他費用

その他費用のうち2,412,630円は上場に係る費用、
9,653,333円は対象指数についての商標使用料であります。

配当等収益合計額	C=A+B	48,247,573円
経費	D	26,058,777円
収益分配可能額	E=C-D	22,188,796円
収益分配金	F	21,323,337円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	865,459円
口数	H	1,015,397口
1口当たり分配金	I=F/H	21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	464,770,631円
分配準備積立金	B	865,459円
配当等収益合計額	C=A+B	465,636,090円
経費	D	26,132,472円
収益分配可能額	E=C-D	439,503,618円
収益分配金	F	439,116,240円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	387,378円
口数	H	944,336口
1口当たり分配金	I=F/H	465円

2. その他費用

その他費用のうち1,370,974円は上場に係る費用、
7,628,143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 2019年10月8日 至 2020年4月7日	当期 自 2020年4月8日 至 2020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。</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	当期
----	----

2020年4月7日現在	2020年10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 2019年10月8日 至 2020年4月7日	当期 自 2020年4月8日 至 2020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 2019年10月8日 至 2020年4月7日	当期 自 2020年4月8日 至 2020年10月7日
期首元本額 40,116,642,750円	期首元本額 38,280,125,250円
期中追加設定元本額 10,807,762,500円	期中追加設定元本額 871,107,750円
期中一部交換元本額 12,644,280,000円	期中一部交換元本額 6,217,515,000円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2019年10月8日 至 2020年4月7日	当期 自 2020年4月8日 至 2020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	△7,143,080,732	513,546,083
合計	△7,143,080,732	513,546,083

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	長谷工コーポレーション	258,600	1,397.00	361,264,200	
		積水ハウス	303,100	1,859.50	563,614,450	
		日本たばこ産業	488,500	1,991.50	972,847,750	
		住友化学	1,169,000	364.00	425,516,000	

デンカ	163,300	3,220.00	525,826,000
三井化学	124,600	2,616.00	325,953,600
三菱ケミカルホールディングス	725,700	627.20	455,159,040
宇部興産	96,900	1,835.00	177,811,500
D I C	60,800	2,654.00	161,363,200
武田薬品工業	222,100	3,667.00	814,440,700
出光興産	248,800	2,258.00	561,790,400
E N E O Sホールディングス	1,864,300	385.00	717,755,500
ブリヂストン	178,000	3,477.00	618,906,000
A G C	167,100	3,195.00	533,884,500
日本電気硝子	196,100	1,990.00	390,239,000
東海カーボン	351,600	1,184.00	416,294,400
日本軽金属ホールディングス	55,820	1,700.00	94,894,000
アマダ	260,200	1,023.00	266,184,600
日本精工	351,700	859.00	302,110,300
日清紡ホールディングス	215,000	722.00	155,230,000
コニカミノルタ	1,129,500	301.00	339,979,500
沖電気工業	187,000	1,164.00	217,668,000
セイコーエプソン	448,900	1,202.00	539,577,800
キヤノン	461,000	1,749.00	806,289,000
関西電力	532,100	1,030.50	548,329,050
スカパー J S A Tホールディングス	424,700	461.00	195,786,700
日本電信電話	332,500	2,295.50	763,253,750
K D D I	244,800	2,738.50	670,384,800
N T T ドコモ	276,300	3,877.00	1,071,215,100
双日	1,310,500	243.00	318,451,500
伊藤忠商事	229,700	2,701.50	620,534,550
三井物産	422,000	1,849.00	780,278,000
住友商事	563,700	1,280.00	721,536,000
三菱商事	385,500	2,561.00	987,265,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	530,500	382.00	202,651,000
あおぞら銀行	203,400	1,789.00	363,882,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,188,700	433.90	949,676,930
りそなホールディングス	1,490,000	368.20	548,618,000

	三井住友トラスト・ホールディングス	184,700	2,892.00	534,152,400	
	三井住友フィナンシャルグループ	310,600	3,020.00	938,012,000	
	ふくおかフィナンシャルグループ	106,800	1,804.00	192,667,200	
	みずほフィナンシャルグループ	673,520	1,342.50	904,200,600	
	大和証券グループ本社	1,118,500	450.00	503,325,000	
	野村ホールディングス	825,300	494.10	407,780,730	
	松井証券	195,100	932.00	181,833,200	
	SOMPOホールディングス	156,500	3,812.00	596,578,000	
	MS&ADインシュアランスグループホール	263,500	2,894.00	762,569,000	
	東京海上ホールディングス	161,600	4,774.00	771,478,400	
	T&Dホールディングス	414,600	1,098.00	455,230,800	
	日本郵政	988,700	740.70	732,330,090	
	小計 銘柄数：50			26,466,620,340	
	組入時価比率：99.7%			100.0%	
	合計			26,466,620,340	

(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。