



2019年10月期 (2019年4月18日～2019年10月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended October 2019 (April 18, 2019 – October 7, 2019)

2019年11月18日
 November 18, 2019

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 中川 順子
 問合せ先責任者 商品企画部長 増田 真一 TEL(03)-3241-9511

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: Junko Nakagawa, President & CEO
 Contact person: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 2019年12月26日
 分配金支払開始日 2019年11月15日
 Scheduled date of submission of securities report: December 26, 2019
 Date of commencing dividend payment: November 15, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年10月期の運用状況 (2019年4月18日～2019年10月7日)

Management Status for Period ended October 2019 (from April 18, 2019 to October 7, 2019)

(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.	% %
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	570	(99.8)	1	(0.2)	571	(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
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	0	603	0	603

(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
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	580	8	571	94,740

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2019年10月期 FY ended Oct. 2019	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)

	当期 (2019年10月7日現在) Present period As of October 7, 2019
	金額 Amount
資産の部 Assets	
流動資産 Current assets	
コール・ローン Call loans	2,059,004
株式 Stocks	570,557,970
未収配当金 Accrued dividends receivable	7,729,406
流動資産合計 Total current assets	580,346,380
資産合計 Total assets	580,346,380
負債の部 Liabilities	
流動負債 Current liabilities	
未払収益分配金 Unpaid dividends	7,848,100
未払受託者報酬 Trustee fee payable	76,906
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	353,723
未払利息 Accrued interest expenses	1
その他未払費用 Other accrued expenses	125,113
流動負債合計 Total current liabilities	8,403,843
負債合計 Total liabilities	8,403,843
純資産の部 Net assets	
元本等 Principal and other	
元本 Principal	603,700,000
剰余金 Surplus	
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△31,757,463

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	145,152
元本等合計 Total principal and other	571,942,537
純資産合計 Total net assets	571,942,537
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	580,346,380

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	当期 自 2019年4月18日 至 2019年10月7日 Present period From April 18, 2019 to October 7, 2019
	金額 Amount
営業収益 Operating revenue	
受取配当金 Dividend income	9,486,306
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△25,725,325
営業収益合計 Total operating revenue	△16,239,019
営業費用 Operating expenses	
支払利息 Interest expenses	103
受託者報酬 Trustee fee	137,158
委託者報酬 Investment trust management fee	630,837
その他費用 Other expenses	724,956
営業費用合計 Total operating expenses	1,493,054
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△17,732,073
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△17,732,073
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△17,732,073
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	-
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,177,290

Decrease in surplus or increase in deficit	
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	6,177,290
分配金 Dividends	7,848,100
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△31,757,463

(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4月18日から2019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)

当期 2019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	603,700 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	31,757,463 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	947.40 円
(100口当たり純資産額)	(94,740 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

当期 自 2019年4月18日 至 2019年10月7日		
1. 分配金の計算過程 2019年4月18日から2019年7月7日まで		
項目		
当期配当等収益額	A	1,484,882 円
分配準備積立金	B	0 円
配当等収益合計額	C=A+B	1,484,882 円
経費	D	977,544 円
収益分配可能額	E=C-D	507,338 円
収益分配金	F	0 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	507,338 円

口数	H	603,700口
100口当たり分配金	$I=F/H \times 100$	0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	8,001,321円
分配準備積立金	B	507,338円
配当等収益合計額	C=A+B	8,508,659円
経費	D	515,407円
収益分配可能額	E=C-D	7,993,252円
収益分配金	F	7,848,100円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	145,152円
口数	H	603,700口
100口当たり分配金	$I=F/H \times 100$	1,300円

2. その他費用

その他費用のうち609,864円は、上場に係る費用であります。

3. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

当期 自 2019年4月18日 至 2019年10月7日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>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>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

当期 2019年10月7日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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>

(関連当事者との取引に関する注記)

当期 自 2019年 4月 18日 至 2019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。

(その他の注記)

1 元本の移動

当期 自 2019年 4月 18日 至 2019年 10月 7日	
期首元本額	-円
期中追加設定元本額	603,700,000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	当期 自 2019年 4月 18日 至 2019年 10月 7日
	損益に含まれた評価差額 (円)
株式	△10,392,630
合計	△10,392,630

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(2019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	コムシスホールディングス	1,500	2,992.00	4,488,000	
		大成建設	2,300	3,970.00	9,131,000	
		大東建託	700	13,770.00	9,639,000	
		積水ハウス	6,800	2,149.00	14,613,200	
		キリンホールディングス	4,800	2,282.50	10,956,000	
		コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	1,900	2,440.00	4,636,000	
		味の素	5,600	2,011.50	11,264,400	
		キューピー	1,300	2,379.00	3,092,700	
		日本たばこ産業	4,200	2,346.00	9,853,200	
		帝人	2,600	2,024.00	5,262,400	
		デンカ	1,100	2,888.00	3,176,800	
		三菱瓦斯化学	2,400	1,402.00	3,364,800	
		三井化学	2,400	2,392.00	5,740,800	

J S R	2,700	1,731.00	4,673,700
三菱ケミカルホールディングス	13,300	760.80	10,118,640
ダイセル	3,900	907.00	3,537,300
積水化学工業	5,200	1,676.00	8,715,200
宇部興産	1,500	2,130.00	3,195,000
富士フイルムホールディングス	2,600	4,573.00	11,889,800
日東電工	2,000	5,188.00	10,376,000
ニフコ	1,200	2,510.00	3,012,000
武田薬品工業	3,000	3,621.00	10,863,000
アステラス製薬	7,900	1,505.50	11,893,450
田辺三菱製薬	3,300	1,166.00	3,847,800
ブリヂストン	2,600	4,131.00	10,740,600
住友ゴム工業	2,400	1,264.00	3,033,600
A G C	2,600	3,320.00	8,632,000
日本電気硝子	1,200	2,340.00	2,808,000
日本碍子	3,700	1,518.00	5,616,600
日本特殊陶業	2,200	1,987.00	4,371,400
日本製鉄	5,800	1,481.00	8,589,800
住友電気工業	7,600	1,341.50	10,195,400
L I X I Lグループ	3,900	1,909.00	7,445,100
アマダホールディングス	4,900	1,120.00	5,488,000
SANKYO	700	3,685.00	2,579,500
日本精工	5,400	910.00	4,914,000
ジェイテクト	2,700	1,214.00	3,277,800
セイコーエプソン	3,900	1,420.00	5,538,000
カシオ計算機	2,800	1,653.00	4,628,400
ファナック	700	19,250.00	13,475,000
キヤノン	3,700	2,825.50	10,454,350
東京エレクトロン	900	20,845.00	18,760,500
日産自動車	12,500	657.10	8,213,750
いすゞ自動車	7,100	1,161.00	8,243,100
トヨタ自動車	1,700	6,986.00	11,876,200
アイシン精機	2,300	3,385.00	7,785,500
本田技研工業	3,800	2,730.00	10,374,000
SUBARU	4,700	2,895.50	13,608,850

HOYA	1,700	8,524.00	14,490,800	
大日本印刷	3,600	2,777.00	9,997,200	
中国電力	4,000	1,417.00	5,668,000	
東京瓦斯	4,000	2,769.50	11,078,000	
日本航空	2,800	3,271.00	9,158,800	
野村総合研究所	5,000	2,197.00	10,985,000	
Zホールディングス	19,500	319.00	6,220,500	
日本オラクル	500	9,170.00	4,585,000	
日本電信電話	2,500	5,284.00	13,210,000	
KDDI	4,200	2,939.00	12,343,800	
NTTドコモ	4,500	2,819.00	12,685,500	
伊藤忠商事	5,900	2,209.00	13,033,100	
丸紅	14,300	694.60	9,932,780	
三井物産	6,500	1,730.00	11,245,000	
住友商事	7,100	1,665.50	11,825,050	
ローソン	700	5,680.00	3,976,000	
丸井グループ	2,700	2,283.00	6,164,100	
ヤマダ電機	9,500	513.00	4,873,500	
野村不動産ホールディングス	1,900	2,393.00	4,546,700	
カカコム	2,000	2,636.00	5,272,000	
楽天	12,300	1,036.00	12,742,800	
日本郵政	8,700	981.00	8,534,700	
小計 銘柄数：70			570,557,970	
組入時価比率：99.8%			100.0%	
合計			570,557,970	

(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(2019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。