



【1598】

## NFRNファンダメンタル

NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信【正式名称】



- 各構成銘柄の財務指標(売上高、営業キャッシュフロー、配当金)に着目し、投資可能性を追求した指数「Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックス(配当除く)」との連動を目指すETF(上場投資信託)です。

## 1.概要

(2021年1月29日 現在)

銘柄名	NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信		
対象指標	Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックス(配当除く)		
計算期間	毎年4月8日～10月7日、10月8日～翌年4月7日		
分配金支払基準日	毎年4月7日、10月7日(年2回)		
管理会社	野村アセットマネジメント		
銘柄コード	1598	市場価格(終値)(※1)	18,270 円
売買単位	1口単位	1口あたり分配金(※2)	415円
信託報酬(税込)	0.33%	分配金利回り(※3)	2.27%
純資産総額	27 億円	東証マーケットメイク制度(※4)	対象
受益権口数	154,028 口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	18,270 円

※1 上記の期日において約定がない場合、「市場価格(終値)」及び「1売買単位あたりの投資金額」には、直近時点の市場価格を記載しています。

※2 直近12か月の実績分配金を記載しています。

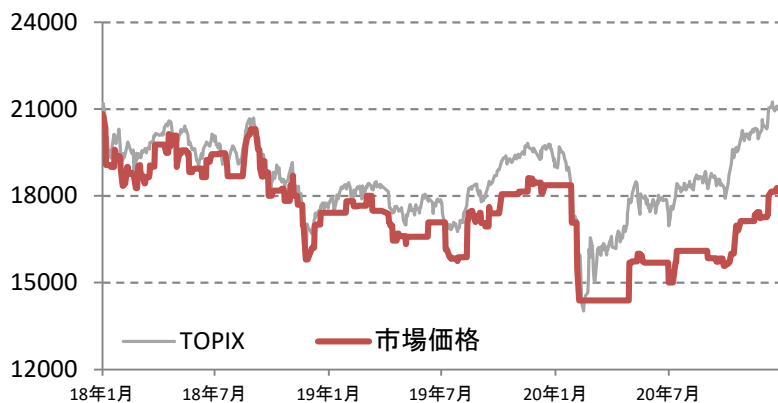
※3 直近12か月の実績分配金及び作成日の終値をもとに算出した分配金利回りを記載しています。

※4 東証が2018年7月2日に導入したETF市場におけるマーケットメイク制度の対象銘柄が否かを記載しています。マーケットメイクとはマーケットメイカーが気配を提示して取引の流動性を提供することです。

(注) 整理銘柄:2021年9月16日が取引最終日となる予定です。なお、上場廃止後は、償還金支払い開始日以降、償還金を受け取ることができます。

## 2.パフォーマンス

(2021年1月29日 現在)



※ 2018年1月31日の市場価格を基準値とし、TOPIXの値を再換算しています。

## ■ 騰落率

期間	当銘柄	(参考)TOPIX
過去3か月	+17.27%	+14.53%
過去6か月	+21.80%	+20.90%
過去1年	-0.54%	+7.38%
過去3年	-12.29%	-1.52%
過去5年	+19.26%	+26.31%

## 3.ファンド組入銘柄

(2021年1月29日 現在)

	証券コード	銘柄名	構成比
1	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	5.26%
2	8316	三井住友フィナンシャルグループ	4.22%
3	7203	トヨタ自動車	2.89%
4	9432	日本電信電話	2.70%
5	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	2.40%

## 4.情報ベンダーコード

情報ベンダー名	ETFコード	対象指標
QUICK	1598/T	SRNFPI/NRIJ
Bloomberg	1598 JP Equity	RNIROFP Index
Refinitiv	1598.T	-

## 5.対象指標の概要

日本国内の取引所に上場している全銘柄のうち浮動株調整時価総額上位98%から構成される、Russell/Nomura Total Marketインデックスの構成銘柄をユニバースとします。各構成銘柄のファンダメンタル指標(調整済み売上高、調整済み営業キャッシュフロー、調整済み配当金)を用いて計算される指数ウェイト(リサーチ・アフィリエイツ社の手法)に基づいて算出されるRussell/Nomura ファンダメンタル・インデックスの構成銘柄から、流動性が著しく低い銘柄や指数ウェイトが極端に低い銘柄を除外して算出される非時価総額加重平均型の指数です。

2000年12月29日を基準日とし、基準時点の指数値を100として算出しています。

## 6. 情報入手一覧

---

- 現在値、インディカティブNAV・PCF  
<http://tse.factsetdigitalsolutions.com/iopv/table?language=jp>
- 基準価額(一口あたりの純資産額)等に関する情報  
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/base-price/index.html>
- ETF/ETN銘柄検索  
<https://money-bu-jpx.com/search/> (東証マネ部!)

## 7. 免責事項

---

- 当資料は、作成時におけるETF/ETNの概要説明のみを目的としており、投資勧誘を目的としているものではなく、また金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。
- ETF/ETNは値動きのある有価証券を投資対象としますので、連動対象である指標及び外国為替相場の変動、組入る有価証券の価格の変動、組入る有価証券の発行会社の倒産や財務状況等の悪化、その他の市場要因の影響等により、市場取引価格又は基準価額が値下がりし、それにより損失が生じることがあります。したがって、投資元本が保証されているものではありません。また、信用取引を利用する場合には、差し入れた保証金以上の損失が生ずるおそれがあります。
- ETF/ETNの売買を行われるに際しては、あらかじめお取引先の金融商品取引業者等より交付される契約締結前交付書面等の書面の内容を十分にお読みいただき、商品の性質、取引の仕組み、リスクの存在、販売手数料、信託報酬などの手数料等を十分に御理解いただいたうえで、御自身の判断と責任で行っていただきますよう、お願い申し上げます。
- 当資料の実績数値は過去のものであり、将来の運用成果等を保証するものではありません。
- 当資料は、更新日現在の内容です。その以後、制度の改正等により、当資料に掲載した内容が予告なく変更される場合があります。また、この資料に掲載されている情報の作成には万全を期していますが、当該情報の完全性を保証するものではありません。当社は、当資料及び当資料から得た情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害等の一切について責任を負いません。
- 本資料の一切の権利は当社に属しており、いかなる目的を問わず、無断複製・転載を禁じます。