

平成28年10月期（平成28年4月8日～平成28年10月7日）決算短信

平成28年11月16日

上場取引所

東証

ファンド名 NEXT FUNDS 野村日本株高配当70連動型上場投信  
 コード番号 ( 1577 )  
 連動対象指標 野村日本株高配当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兼執行役社長 渡邊 国夫  
 問合せ先責任者 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成28年12月15日  
 分配金支払開始日 平成28年11月15日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年10月期の運用状況（平成28年4月8日～平成28年10月7日）

(1)資産内訳 (百万円未満切捨て)

	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)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
平成28年10月期	68,031	(99.9)	67	(0.1)	68,098	(100)
平成28年4月期	57,923	(99.9)	55	(0.1)	57,979	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前特定期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当特定期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成28年10月期	3,122	978	669	3,432
平成28年4月期	2,201	1,197	276	3,122

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当り基準価額 (③/①)
	百万円	百万円	百万円	円
平成28年10月期	68,894	796	68,098	19,839
平成28年4月期	58,753	774	57,979	18,567

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成28年10月期	215.00
平成28年4月期	233.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有~~無~~  
 ② ①以外の変更 有~~無~~

## II 財務諸表等

## NEXT FUNDS 野村日本株高配当 70 連動型上場投信

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (平成 28 年 4 月 7 日現在)	当期 (平成 28 年 10 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	52,402,469	-
コール・ローン	4,070,261	70,517,110
株式	57,923,555,950	68,031,017,190
未収配当金	773,625,075	793,361,400
流動資産合計	58,753,653,755	68,894,895,700
資産合計	58,753,653,755	68,894,895,700
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	727,591,197	737,992,445
未払受託者報酬	7,025,889	8,241,051
未払委託者報酬	37,939,749	44,501,635
未払利息	-	58
その他未払費用	2,062,480	5,476,156
流動負債合計	774,619,315	796,211,345
負債合計	774,619,315	796,211,345
純資産の部		
元本等		
元本	46,837,512,291	51,484,412,477
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	11,141,522,149	16,614,271,878
(分配準備積立金)	1,418,568	2,088,369
元本等合計	57,979,034,440	68,098,684,355
純資産合計	57,979,034,440	68,098,684,355
負債純資産合計	58,753,653,755	68,894,895,700

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	当期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日
営業収益		
受取配当金	904,193,575	964,718,225
受取利息	9,910	-
有価証券売買等損益	△7,804,220,173	4,801,565,645
その他収益	701,091	791,176
営業収益合計	△6,899,315,597	5,767,075,046
営業費用		
支払利息	-	16,961

受託者報酬	13,346,366	15,865,453
委託者報酬	72,070,327	85,673,392
その他費用	6,447,367	5,870,485
営業費用合計	91,864,060	107,426,291
営業利益又は営業損失(△)	△6,991,179,657	5,659,648,755
経常利益又は経常損失(△)	△6,991,179,657	5,659,648,755
当期純利益又は当期純損失(△)	△6,991,179,657	5,659,648,755
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(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	15,049,581,767	11,141,522,149
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,037,223,874	3,827,657,271
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,037,223,874	3,827,657,271
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,141,858,421	3,157,142,988
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,141,858,421	3,157,142,988
分配金	812,245,414	857,413,309
期末剰余金又は期末欠損金(△)	11,141,522,149	16,614,271,878

## (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 受取配当金は、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。 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、平成 28 年 4 月 8 日から平成 28 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 平成 28 年 4 月 7 日現在	当期 平成 28 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 3,122,709 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,432,523 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 18,567 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 19,839 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自平成 27 年 10 月 8 日 至平成 28 年 4 月 7 日	当期 自平成 28 年 4 月 8 日 至平成 28 年 10 月 7 日																														
1. 分配金の計算過程 平成 27 年 10 月 8 日から平成 28 年 1 月 7 日まで	1. 分配金の計算過程 平成 28 年 4 月 8 日から平成 28 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>128,647,350 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>623,466 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>129,270,816 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>42,915,947 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	128,647,350 円	分配準備積立金	B	623,466 円	配当等収益合計額	C=A+B	129,270,816 円	経費	D	42,915,947 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>172,091,944 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>1,418,568 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>173,510,512 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>51,769,591 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	172,091,944 円	分配準備積立金	B	1,418,568 円	配当等収益合計額	C=A+B	173,510,512 円	経費	D	51,769,591 円
項目																															
当期配当等収益額	A	128,647,350 円																													
分配準備積立金	B	623,466 円																													
配当等収益合計額	C=A+B	129,270,816 円																													
経費	D	42,915,947 円																													
項目																															
当期配当等収益額	A	172,091,944 円																													
分配準備積立金	B	1,418,568 円																													
配当等収益合計額	C=A+B	173,510,512 円																													
経費	D	51,769,591 円																													

収益分配可能額	E=C-D	86,354,869 円
収益分配金	F	84,654,217 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,700,652 円
口数	H	2,064,737 口
1 口当たり分配金	I=F/H	41 円

平成 28 年 1 月 8 日から平成 28 年 4 月 7 日まで

項目		
当期配当等収益額	A	776,257,226 円
分配準備積立金	B	1,700,652 円
配当等収益合計額	C=A+B	777,957,878 円
経費	D	48,948,113 円
収益分配可能額	E=C-D	729,009,765 円
収益分配金	F	727,591,197 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,418,568 円
口数	H	3,122,709 口
1 口当たり分配金	I=F/H	233 円

収益分配可能額	E=C-D	121,740,921 円
収益分配金	F	119,420,864 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,320,057 円
口数	H	2,912,704 口
1 口当たり分配金	I=F/H	41 円

平成 28 年 7 月 8 日から平成 28 年 10 月 7 日まで

項目		
当期配当等収益額	A	793,400,496 円
分配準備積立金	B	2,320,057 円
配当等収益合計額	C=A+B	795,720,553 円
経費	D	55,639,739 円
収益分配可能額	E=C-D	740,080,814 円
収益分配金	F	737,992,445 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,088,369 円
口数	H	3,432,523 口
1 口当たり分配金	I=F/H	215 円

2. 追加情報

平成 28 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

前期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	当期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 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 平成 28 年 4 月 7 日現在	当期 平成 28 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 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	当期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 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 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	当期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日
期首元本額 33,021,453,423 円	期首元本額 46,837,512,291 円
期中追加設定元本額 17,964,497,287 円	期中追加設定元本額 14,682,851,078 円
期中一部交換元本額 4,148,438,419 円	期中一部交換元本額 10,035,950,892 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	当期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 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	△6,370,063,504	7,559,561,323
合計	△6,370,063,504	7,559,561,323

## 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(平成 28 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	大東建託	88,700	15,605.00	1,384,163,500	
		大和ハウス工業	344,500	2,666.00	918,437,000	
		麒麟ホールディングス	676,700	1,667.00	1,128,058,900	
		日本たばこ産業	254,700	4,118.00	1,048,854,600	

クラレ	735,400	1,507.00	1,108,247,800
旭化成	1,503,000	822.60	1,236,367,800
住友化学	1,642,000	472.00	775,024,000
三菱瓦斯化学	893,500	1,493.00	1,333,995,500
J S R	599,100	1,654.00	990,911,400
D I C	349,200	3,230.00	1,127,916,000
田辺三菱製薬	538,300	2,151.00	1,157,883,300
エーザイ	148,200	6,469.00	958,705,800
第一三共	463,700	2,454.50	1,138,151,650
大塚ホールディングス	275,200	4,549.00	1,251,884,800
横浜ゴム	478,400	1,700.00	813,280,000
ブリヂストン	248,800	3,948.00	982,262,400
住友ゴム工業	654,400	1,619.00	1,059,473,600
旭硝子	1,557,000	664.00	1,033,848,000
日本電気硝子	1,699,000	544.00	924,256,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	590,700	1,531.00	904,361,700
三菱マテリアル	273,400	2,754.00	752,943,600
住友金属鉱山	750,000	1,318.00	988,500,000
L I X I Lグループ	406,900	2,251.00	915,931,900
アマダホールディングス	1,001,500	1,085.00	1,086,627,500
小松製作所	556,100	2,367.50	1,316,566,750
住友重機械工業	2,012,000	512.00	1,030,144,000
SANKYO	241,700	3,470.00	838,699,000
セガサミーホールディングス	876,300	1,466.00	1,284,655,800
日本精工	778,800	1,101.00	857,458,800
THK	475,800	2,056.00	978,244,800
ブラザー工業	738,300	1,840.00	1,358,472,000
セイコーエプソン	588,000	1,962.00	1,153,656,000
キヤノン	300,600	2,991.50	899,244,900
リコー	836,200	933.00	780,174,600
東京エレクトロン	148,000	9,217.00	1,364,116,000
川崎重工業	2,306,000	294.00	677,964,000
日産自動車	883,100	1,013.00	894,580,300
トヨタ自動車	342,800	6,006.00	2,058,856,800
日野自動車	770,900	1,121.00	864,178,900

アイシン精機	224,700	4,815.00	1,081,930,500	
本田技研工業	279,300	3,069.00	857,171,700	
大日本印刷	891,000	1,010.00	899,910,000	
北陸電力	620,100	1,197.00	742,259,700	
日本航空	244,600	3,028.00	740,648,800	
フジ・メディア・ホールディングス	791,300	1,431.00	1,132,350,300	
トレンドマイクロ	240,400	3,605.00	866,642,000	
日本電信電話	235,800	4,606.00	1,086,094,800	
KDDI	377,400	3,067.00	1,157,485,800	
NTTドコモ	455,000	2,459.00	1,118,845,000	
双日	4,067,200	270.00	1,098,144,000	
伊藤忠商事	723,500	1,285.00	929,697,500	
丸紅	1,616,700	531.70	859,599,390	
三井物産	736,600	1,402.50	1,033,081,500	
三菱商事	540,900	2,317.50	1,253,535,750	
あおぞら銀行	2,550,000	349.00	889,950,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,380,100	526.60	726,760,660	
りそなホールディングス	1,721,100	434.90	748,506,390	
三井住友トラスト・ホールディングス	226,100	3,385.00	765,348,500	
三井住友フィナンシャルグループ	221,700	3,478.00	771,072,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,765,000	440.00	776,600,000	
みずほフィナンシャルグループ	4,422,200	173.20	765,925,040	
大和証券グループ本社	1,305,000	590.80	770,994,000	
野村ホールディングス	1,419,300	469.20	665,935,560	
ソニーフィナンシャルホールディングス	504,100	1,415.00	713,301,500	
東京海上ホールディングス	228,600	4,053.00	926,515,800	
イオンフィナンシャルサービス	378,800	1,836.00	695,476,800	
オリックス	616,200	1,460.00	899,652,000	
野村不動産ホールディングス	467,700	1,606.00	751,126,200	
ベネッセホールディングス	346,000	2,686.00	929,356,000	
小計 銘柄数：69			68,031,017,190	
組入時価比率：99.9%			100.0%	
合計			68,031,017,190	

(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(平成 28 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。