

平成29年10月期（平成29年4月8日～平成29年10月7日）決算短信

平成29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29年12月20日
 分配金支払開始日 平成29年11月15日

I ファンドの運用状況

1. 平成29年10月期の運用状況（平成29年4月8日～平成29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29年10月期	94,637	(99.9)	112	(0.1)	94,750	(100)
平成29年4月期	89,593	(99.9)	75	(0.1)	89,669	(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29年10月期	4,026	479	683	3,821
平成29年4月期	3,432	1,618	1,024	4,026

(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/当特定期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
平成29年10月期	95,782	1,031	94,750	24,793
平成29年4月期	90,879	1,209	89,669	22,272

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成29年10月期	248.00
平成29年4月期	283.00

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 29 年 4 月 7 日現在)	当期 (平成 29 年 10 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	87,224,251	118,977,722
株式	89,593,976,910	94,637,565,680
未収配当金	1,198,010,030	1,025,532,000
流動資産合計	90,879,211,191	95,782,075,402
資産合計	90,879,211,191	95,782,075,402
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,139,406,110	947,759,528
未払受託者報酬	10,521,789	11,878,767
未払委託者報酬	56,817,635	64,145,310
未払利息	96	252
その他未払費用	3,091,590	8,070,097
流動負債合計	1,209,837,220	1,031,853,954
負債合計	1,209,837,220	1,031,853,954
純資産の部		
元本等		
元本	60,388,523,830	57,320,343,389
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	29,280,850,141	37,429,878,059
(分配準備積立金)	4,021,689	2,282,131
元本等合計	89,669,373,971	94,750,221,448
純資産合計	89,669,373,971	94,750,221,448
負債純資産合計	90,879,211,191	95,782,075,402

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日	当期 自 平成 29 年 4 月 8 日 至 平成 29 年 10 月 7 日
営業収益		
受取配当金	1,373,802,130	1,247,203,025
有価証券売買等損益	5,285,139,998	9,702,828,621
その他収益	908,730	1,205,246
営業収益合計	6,659,850,858	10,951,236,892
営業費用		
支払利息	18,135	29,513
受託者報酬	18,888,284	23,424,651
委託者報酬	101,996,673	126,493,045
その他費用	8,817,296	8,412,452
営業費用合計	129,720,388	158,359,661

営業利益又は営業損失 (△)	6,530,130,470	10,792,877,231
経常利益又は経常損失 (△)	6,530,130,470	10,792,877,231
当期純利益又は当期純損失 (△)	6,530,130,470	10,792,877,231
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 (△)	16,614,271,878	29,280,850,141
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,622,851,671	4,091,284,182
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,622,851,671	4,091,284,182
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,243,346,726	5,643,345,327
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,243,346,726	5,643,345,327
分配金	1,243,057,152	1,091,788,168
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	29,280,850,141	37,429,878,059

(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 29 年 4 月 8 日から平成 29 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 29 年 4 月 7 日現在	当期 平成 29 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 4,026,170 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,821,611 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 22,272 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 24,793 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日	当期 自 平成 29 年 4 月 8 日 至 平成 29 年 10 月 7 日																																																						
1. 分配金の計算過程 平成 28 年 10 月 8 日から平成 29 年 1 月 7 日まで	1. 分配金の計算過程 平成 29 年 4 月 8 日から平成 29 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>160,180,248 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,088,369 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>162,268,617 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>56,808,377 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>105,460,240 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>103,651,042 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>1,809,198 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>2,727,659 口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	160,180,248 円	分配準備積立金	B	2,088,369 円	配当等収益合計額	C=A+B	162,268,617 円	経費	D	56,808,377 円	収益分配可能額	E=C-D	105,460,240 円	収益分配金	F	103,651,042 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,809,198 円	口数	H	2,727,659 口	<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>220,027,621 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>4,021,689 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>224,049,310 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>78,396,422 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>145,652,888 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>144,028,640 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>1,624,248 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>3,600,716 口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	220,027,621 円	分配準備積立金	B	4,021,689 円	配当等収益合計額	C=A+B	224,049,310 円	経費	D	78,396,422 円	収益分配可能額	E=C-D	145,652,888 円	収益分配金	F	144,028,640 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,624,248 円	口数	H	3,600,716 口
項目																																																							
当期配当等収益額	A	160,180,248 円																																																					
分配準備積立金	B	2,088,369 円																																																					
配当等収益合計額	C=A+B	162,268,617 円																																																					
経費	D	56,808,377 円																																																					
収益分配可能額	E=C-D	105,460,240 円																																																					
収益分配金	F	103,651,042 円																																																					
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,809,198 円																																																					
口数	H	2,727,659 口																																																					
項目																																																							
当期配当等収益額	A	220,027,621 円																																																					
分配準備積立金	B	4,021,689 円																																																					
配当等収益合計額	C=A+B	224,049,310 円																																																					
経費	D	78,396,422 円																																																					
収益分配可能額	E=C-D	145,652,888 円																																																					
収益分配金	F	144,028,640 円																																																					
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,624,248 円																																																					
口数	H	3,600,716 口																																																					

1 口当たり分配金	I=F/H	38 円	1 口当たり分配金	I=F/H	40 円
平成 29 年 1 月 8 日から平成 29 年 4 月 7 日まで			平成 29 年 7 月 8 日から平成 29 年 10 月 7 日まで		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	1,214,512,477 円	当期配当等収益額	A	1,028,351,137 円
分配準備積立金	B	1,809,198 円	分配準備積立金	B	1,624,248 円
配当等収益合計額	C=A+B	1,216,321,675 円	配当等収益合計額	C=A+B	1,029,975,385 円
経費	D	72,893,876 円	経費	D	79,933,726 円
収益分配可能額	E=C-D	1,143,427,799 円	収益分配可能額	E=C-D	950,041,659 円
収益分配金	F	1,139,406,110 円	収益分配金	F	947,759,528 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,021,689 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,282,131 円
口数	H	4,026,170 口	口数	H	3,821,611 口
1 口当たり分配金	I=F/H	283 円	1 口当たり分配金	I=F/H	248 円

(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 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日	当期 自 平成 29 年 4 月 8 日 至 平成 29 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>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 平成 29 年 4 月 7 日現在	当期 平成 29 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</p> <p>(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</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日	当期 自 平成 29 年 4 月 8 日 至 平成 29 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 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日	当期 自 平成 29 年 4 月 8 日 至 平成 29 年 10 月 7 日
期首元本額 51,484,412,477 円	期首元本額 60,388,523,830 円
期中追加設定元本額 24,271,126,817 円	期中追加設定元本額 7,190,040,632 円
期中一部交換元本額 15,367,015,464 円	期中一部交換元本額 10,258,221,073 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日	当期 自 平成 29 年 4 月 8 日 至 平成 29 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	△5,205,614,027	2,665,543,852
合計	△5,205,614,027	2,665,543,852

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 29 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	62,800	20,235.00	1,270,758,000	
		大和ハウス工業	382,700	3,918.00	1,499,418,600	
		日本たばこ産業	276,400	3,690.00	1,019,916,000	
		クラレ	698,500	2,127.00	1,485,709,500	
		住友化学	2,271,000	696.00	1,580,616,000	
		デンカ	468,900	3,765.00	1,765,408,500	
		J S R	707,600	2,081.00	1,472,515,600	
		宇部興産	510,500	3,285.00	1,676,992,500	
		D I C	345,200	4,175.00	1,441,210,000	
		田辺三菱製薬	541,100	2,599.00	1,406,318,900	
		エーザイ	171,300	5,889.00	1,008,785,700	

第一三共	478,200	2,500.00	1,195,500,000
横浜ゴム	598,900	2,418.00	1,448,140,200
ブリヂストン	277,800	5,196.00	1,443,448,800
住友ゴム工業	625,300	2,088.00	1,305,626,400
旭硝子	307,300	4,245.00	1,304,488,500
日本電気硝子	386,700	4,305.00	1,664,743,500
アマダホールディングス	924,200	1,252.00	1,157,098,400
小松製作所	481,800	3,281.00	1,580,785,800
住友重機械工業	370,300	4,440.00	1,644,132,000
セガサミーホールディングス	666,500	1,590.00	1,059,735,000
日本精工	969,400	1,531.00	1,484,151,400
三菱重工業	255,400	4,467.00	1,140,871,800
コニカミノルタ	1,174,700	951.00	1,117,139,700
セイコーエプソン	507,400	2,686.00	1,362,876,400
カシオ計算機	825,100	1,619.00	1,335,836,900
キヤノン	368,000	3,909.00	1,438,512,000
リコー	1,285,200	1,136.00	1,459,987,200
東京エレクトロン	114,000	17,025.00	1,940,850,000
日産自動車	1,055,000	1,091.50	1,151,532,500
トヨタ自動車	185,400	6,889.00	1,277,220,600
本田技研工業	368,100	3,395.00	1,249,699,500
S U B A R U	277,700	4,005.00	1,112,188,500
大日本印刷	522,700	2,679.00	1,400,313,300
北陸電力	935,300	963.00	900,693,900
電源開発	479,800	2,877.00	1,380,384,600
日本航空	346,600	3,770.00	1,306,682,000
フジ・メディア・ホールディングス	737,200	1,621.00	1,195,001,200
トレンドマイクロ	307,700	5,680.00	1,747,736,000
日本電信電話	241,900	5,174.00	1,251,590,600
K D D I	367,200	2,988.00	1,097,193,600
N T T ドコモ	432,800	2,562.00	1,108,833,600
双日	4,076,300	312.00	1,271,805,600
伊藤忠商事	793,900	1,837.50	1,458,791,250
丸紅	2,020,100	761.60	1,538,508,160
三井物産	775,900	1,644.00	1,275,579,600
ヤマダ電機	1,975,500	607.00	1,199,128,500

めぶきフィナンシャルグループ	2,921,000	443.00	1,294,003,000	
ゆうちょ銀行	899,900	1,395.00	1,255,360,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,257,600	578.30	1,305,570,080	
あおぞら銀行	315,700	4,315.00	1,362,245,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,049,600	734.80	1,506,046,080	
りそなホールディングス	2,393,600	577.10	1,381,346,560	
三井住友トラスト・ホールディングス	310,900	4,141.00	1,287,436,900	
三井住友フィナンシャルグループ	305,800	4,350.00	1,330,230,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	2,455,000	532.00	1,306,060,000	
みずほフィナンシャルグループ	6,217,800	198.50	1,234,233,300	
SBIホールディングス	890,400	1,711.00	1,523,474,400	
大和証券グループ本社	1,820,000	645.10	1,174,082,000	
野村ホールディングス	2,121,300	642.50	1,362,935,250	
MS&ADインシュアランスグループホール	359,500	3,705.00	1,331,947,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	771,000	1,838.00	1,417,098,000	
東京海上ホールディングス	269,700	4,503.00	1,214,459,100	
イオンフィナンシャルサービス	606,200	2,368.00	1,435,481,600	
オリックス	677,100	1,827.00	1,237,061,700	
日本取引所グループ	727,800	2,061.00	1,499,995,800	
野村不動産ホールディングス	632,600	2,383.00	1,507,485,800	
ユー・エス・エス	631,100	2,289.00	1,444,587,900	
日本郵政	846,200	1,312.00	1,110,214,400	
ベネッセホールディングス	372,300	3,980.00	1,481,754,000	
小計	銘柄数：70 組入時価比率：99.9%		94,637,565,680 100.0%	
合計			94,637,565,680	

(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 29 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。