



2018年10月期 (2018年4月8日～2018年10月7日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended October 2018 (April 8, 2018 - October 7, 2018)

2018年11月16日
 November 16, 2018

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 執行役社長 渡邊 国夫
 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 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: Kunio Watanabe, 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 2018年12月27日
 分配金支払開始日 2018年11月15日
 Scheduled date of submission of securities report: December 27, 2018
 Date of commencing dividend payment: November 15, 2018

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2018年10月期の運用状況 (2018年4月8日～2018年10月7日)

Management Status for Period ended October 2018 (from April 8, 2018 to October 7, 2018)

(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.	%
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	26,365	(99.9)	30	(0.1)	26,395	(100.0)
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	19,606	(99.9)	13	(0.1)	19,619	(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
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	521	194	53	662
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	310	259	48	521

(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
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	26,781	386	26,395	39,834
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	19,926	307	19,619	37,645

(4) 分配金

Dividend Payment

	1口当り分配金 Dividend per 1 unit
	円 JPY
2018年10月期 FY ended Oct. 2018	544
2018年4月期 FY ended Apr. 2018	558

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 (2018年4月7日現在) Prior period As of April 7, 2018	当期 (2018年10月7日現在) Present period As of October 7, 2018
	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	14,898,792	44,766,415
株式 Stocks	19,606,330,100	26,365,477,330
未収配当金 Accrued dividend receivable	305,592,450	371,501,600
流動資産合計 Total current assets	19,926,821,342	26,781,745,345
資産合計 Total assets	19,926,821,342	26,781,745,345
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	290,816,766	360,472,896
未払受託者報酬 Trustee fee payable	2,164,534	3,376,452
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	9,956,832	15,531,626
未払利息 Accrued interest expenses	48	231
その他未払費用 Other accrued expenses	4,106,910	6,849,473
流動負債合計 Total current liabilities	307,045,090	386,230,678
負債合計 Total liabilities	307,045,090	386,230,678
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	18,176,047,875	23,109,360,750
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,443,728,377	3,286,153,917

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	345,482	458,512
元本等合計 Total principal and other	19,619,776,252	26,395,514,667
純資産合計 Total net assets	19,619,776,252	26,395,514,667
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	19,926,821,342	26,781,745,345

(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 2017年10月8日 至 2018年4月7日 Prior period From October 8, 2017 to April 7, 2018	当期 自 2018年4月8日 至 2018年10月7日 Present period From April 8, 2018 to October 7, 2018
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	340,273,500	448,851,400
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△290,740,592	1,375,234,648
その他収益 Other revenue	91	62
営業収益合計 Total operating revenue	49,532,999	1,824,086,110
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	5,061	16,302
受託者報酬 Trustee fee	3,727,240	6,171,812
委託者報酬 Investment trust management fee	17,145,257	28,390,236
その他費用 Other expenses	5,279,596	7,241,234
営業費用合計 Total operating expenses	26,157,154	41,819,584
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	23,375,845	1,782,266,526
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	23,375,845	1,782,266,526
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	23,375,845	1,782,266,526
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	807,320,785	1,443,728,377
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,133,755,830	717,544,162

Increase in surplus or decrease in deficit		
当期追加信託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 additional subscriptions for period	1,133,755,830	717,544,162
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	206,876,445	250,466,300
当期一部交換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 partial exchange	206,876,445	250,466,300
分配金 Dividends	313,847,638	406,918,848
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	1,443,728,377	3,286,153,917

(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、2018年4月8日から2018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 2018年4月7日現在	当期 2018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 521,177 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 662,634 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 37,645 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 39,834 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7日	当期 自 2018年4月8日 至 2018年10月7日																																										
1. 分配金の計算過程 2017年10月8日から2018年1月7日まで	1. 分配金の計算過程 2018年4月8日から2018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>33,648,031 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>76,683 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>33,724,714 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>10,603,742 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>23,120,972 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>23,030,872 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	33,648,031 円	分配準備積立金	B	76,683 円	配当等収益合計額	C=A+B	33,724,714 円	経費	D	10,603,742 円	収益分配可能額	E=C-D	23,120,972 円	収益分配金	F	23,030,872 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>65,252,850 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>345,482 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>65,598,332 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>19,088,443 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>46,509,889 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>46,445,952 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	65,252,850 円	分配準備積立金	B	345,482 円	配当等収益合計額	C=A+B	65,598,332 円	経費	D	19,088,443 円	収益分配可能額	E=C-D	46,509,889 円	収益分配金	F	46,445,952 円
項目																																											
当期配当等収益額	A	33,648,031 円																																									
分配準備積立金	B	76,683 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	33,724,714 円																																									
経費	D	10,603,742 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	23,120,972 円																																									
収益分配金	F	23,030,872 円																																									
項目																																											
当期配当等収益額	A	65,252,850 円																																									
分配準備積立金	B	345,482 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	65,598,332 円																																									
経費	D	19,088,443 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	46,509,889 円																																									
収益分配金	F	46,445,952 円																																									

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	90,100円
口数	H	311,228口
1口当たり分配金	I=F/H	74円

2018年1月8日から2018年4月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	306,620,499円
分配準備積立金	B	90,100円
配当等収益合計額	C=A+B	306,710,599円
経費	D	15,548,351円
収益分配可能額	E=C-D	291,162,248円
収益分配金	F	290,816,766円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	345,482円
口数	H	521,177口
1口当たり分配金	I=F/H	558円

2. その他費用

その他費用のうち1,410,305円は上場に係る費用、3,720,260円は対象指数についての商標使用料であります。

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	63,937円
口数	H	627,648口
1口当たり分配金	I=F/H	74円

2018年7月8日から2018年10月7日まで

項目		
当期配当等収益額	A	383,582,310円
分配準備積立金	B	63,937円
配当等収益合計額	C=A+B	383,646,247円
経費	D	22,714,839円
収益分配可能額	E=C-D	360,931,408円
収益分配金	F	360,472,896円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	458,512円
口数	H	662,634口
1口当たり分配金	I=F/H	544円

2. その他費用

その他費用のうち714,593円は上場に係る費用、6,279,831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 2017年10月8日 至 2018年4月7日	当期 自 2018年4月8日 至 2018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 2018年4月7日現在	当期 2018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>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>

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。	同左
--	----

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7日	当期 自 2018年4月8日 至 2018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 2017年10月8日 至 2018年4月7日	当期 自 2018年4月8日 至 2018年10月7日
期首元本額 10,813,726,125 円	期首元本額 18,176,047,875 円
期中追加設定元本額 9,064,535,625 円	期中追加設定元本額 6,796,056,375 円
期中一部交換元本額 1,702,213,875 円	期中一部交換元本額 1,862,743,500 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7日	当期 自 2018年4月8日 至 2018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	△1,781,211,768	1,805,535,409
合計	△1,781,211,768	1,805,535,409

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(2018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	積水ハウス	323,800	1,691.00	547,545,800	
		日本たばこ産業	329,700	2,941.00	969,647,700	
		デンカ	29,100	3,885.00	113,053,500	
		三井化学	116,900	2,811.00	328,605,900	
		三菱ケミカルホールディングス	517,900	1,065.50	551,822,450	
		宇部興産	60,600	2,952.00	178,891,200	
		武田薬品工業	175,700	4,556.00	800,489,200	
		昭和シェル石油	155,100	2,550.00	395,505,000	

J X T Gホールディングス	625,800	860.30	538,375,740
横浜ゴム	42,600	2,410.00	102,666,000
ブリヂストン	162,300	4,315.00	700,324,500
日本電気硝子	88,700	3,675.00	325,972,500
日本軽金属ホールディングス	478,700	244.00	116,802,800
アマダホールディングス	231,600	1,164.00	269,582,400
小松製作所	144,100	3,400.00	489,940,000
日本精工	301,900	1,308.00	394,885,200
N T N	539,100	468.00	252,298,800
コニカミノルタ	234,500	1,222.00	286,559,000
沖電気工業	125,200	1,474.00	184,544,800
キヤノン	224,200	3,617.00	810,931,400
東京エレクトロン	38,200	15,200.00	580,640,000
日産自動車	896,000	1,037.00	929,152,000
トヨタ自動車	88,700	7,002.00	621,077,400
本田技研工業	175,800	3,326.00	584,710,800
S U B A R U	251,200	3,454.00	867,644,800
トレンドマイクロ	48,500	6,980.00	338,530,000
スカパー J S A Tホールディングス	288,700	540.00	155,898,000
K D D I	222,800	2,978.50	663,609,800
N T T ドコモ	268,000	2,970.00	795,960,000
双日	1,155,700	417.00	481,926,900
伊藤忠商事	341,600	2,272.50	776,286,000
丸紅	730,300	1,043.00	761,702,900
三井物産	368,700	2,098.00	773,532,600
住友商事	347,500	1,916.00	665,810,000
三菱商事	242,100	3,617.00	875,675,700
あおぞら銀行	76,500	4,020.00	307,530,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	897,500	732.70	657,598,250
りそなホールディングス	883,100	652.90	576,575,990
三井住友トラスト・ホールディングス	97,500	4,729.00	461,077,500
三井住友フィナンシャルグループ	162,100	4,722.00	765,436,200
ふくおかフィナンシャルグループ	77,700	3,230.00	250,971,000
みずほフィナンシャルグループ	4,031,600	199.80	805,513,680

	大和証券グループ本社	1,226,000	693.30	849,985,800	
	野村ホールディングス	1,276,800	562.40	718,072,320	
	松井証券	188,200	1,195.00	224,899,000	
	MS & ADインシュアランスグループホール	167,700	3,819.00	640,446,300	
	ソニーフィナンシャルホールディングス	120,800	2,605.00	314,684,000	
	東京海上ホールディングス	126,700	5,618.00	711,800,600	
	日本郵政	621,100	1,369.00	850,285,900	
	小計 銘柄数：49			26,365,477,330	
	組入時価比率：99.9%			100.0%	
	合計			26,365,477,330	

(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(2018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。