

平成26年10月期（平成26年4月8日～平成26年10月7日）決算短信

平成26年11月19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 投信ディスクロージャー部長 村山 治子 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成26年12月18日  
 分配金支払開始日 平成26年11月14日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年10月期の運用状況（平成26年4月8日～平成26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26年10月期	24,209	(99.9)	21	(0.1)	24,230	(100)
平成26年4月期	22,439	(99.9)	32	(0.1)	22,472	(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26年10月期	1,297	459	456	1,299
平成26年4月期	1,096	378	178	1,297

(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26年10月期	24,482	252	24,230	18,642
平成26年4月期	22,755	283	22,472	17,326

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成26年10月期	179.00
平成26年4月期	205.00

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 26 年 4 月 7 日現在)	当期 (平成 26 年 10 月 7 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	33,845,487	23,047,641
株式	22,439,592,900	24,209,256,340
未収配当金	282,041,620	250,563,975
未収利息	67	36
流動資産合計	22,755,480,074	24,482,867,992
資産合計	22,755,480,074	24,482,867,992
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	265,892,790	232,665,990
未払受託者報酬	2,576,725	2,726,022
未払委託者報酬	13,914,288	14,720,499
その他未払費用	751,889	1,907,401
流動負債合計	283,135,692	252,019,912
負債合計	283,135,692	252,019,912
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	19,454,272,962	19,495,850,190
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	3,018,071,420	4,734,997,890
(分配準備積立金)	1,270,782	1,204,129
元本等合計	22,472,344,382	24,230,848,080
純資産合計	22,472,344,382	24,230,848,080
負債純資産合計	22,755,480,074	24,482,867,992

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	当期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	324,844,520	297,387,255
受取利息	5,590	6,620
有価証券売買等損益	850,357,189	1,438,320,296
その他収益	3,690	358,936
営業収益合計	1,175,210,989	1,736,073,107
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	4,935,225	5,623,506
委託者報酬	26,650,152	30,366,891

その他費用	3,217,173	2,117,149
営業費用合計	34,802,550	38,107,546
営業利益又は営業損失(△)	1,140,408,439	1,697,965,561
経常利益又は経常損失(△)	1,140,408,439	1,697,965,561
当期純利益又は当期純損失(△)	1,140,408,439	1,697,965,561
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(△)	1,758,396,449	3,018,071,420
剰余金増加額又は欠損金減少額	911,065,965	1,707,003,419
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	911,065,965	1,707,003,419
剰余金減少額又は欠損金増加額	502,434,883	1,428,330,592
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	502,434,883	1,428,330,592
分配金	289,364,550	259,711,918
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,018,071,420	4,734,997,890

## (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った場合、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 26 年 4 月 8 日から平成 26 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 26 年 4 月 7 日現在	当期 平成 26 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 1,297,038 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 1,299,810 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 17,326 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 18,642 円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	当期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日																																										
1. 分配金の計算過程 平成 25 年 10 月 8 日から平成 26 年 1 月 7 日まで	1. 分配金の計算過程 平成 26 年 4 月 8 日から平成 26 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>39,451,305 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>584,082 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>40,035,387 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>16,014,093 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>24,021,294 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>23,471,760 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	39,451,305 円	分配準備積立金	B	584,082 円	配当等収益合計額	C=A+B	40,035,387 円	経費	D	16,014,093 円	収益分配可能額	E=C-D	24,021,294 円	収益分配金	F	23,471,760 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>46,402,958 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>1,270,782 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>47,673,740 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>19,673,799 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>27,999,941 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>27,045,928 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	46,402,958 円	分配準備積立金	B	1,270,782 円	配当等収益合計額	C=A+B	47,673,740 円	経費	D	19,673,799 円	収益分配可能額	E=C-D	27,999,941 円	収益分配金	F	27,045,928 円
項目																																											
当期配当等収益額	A	39,451,305 円																																									
分配準備積立金	B	584,082 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	40,035,387 円																																									
経費	D	16,014,093 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	24,021,294 円																																									
収益分配金	F	23,471,760 円																																									
項目																																											
当期配当等収益額	A	46,402,958 円																																									
分配準備積立金	B	1,270,782 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	47,673,740 円																																									
経費	D	19,673,799 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	27,999,941 円																																									
収益分配金	F	27,045,928 円																																									

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	549,534 円
口数	H	977,990 口
1 口当たり分配金	I=F/H	24 円

平成 26 年 1 月 8 日から平成 26 年 4 月 7 日まで

項目		
当期配当等収益額	A	285,402,495 円
分配準備積立金	B	549,534 円
配当等収益合計額	C=A+B	285,952,029 円
経費	D	18,788,457 円
収益分配可能額	E=C-D	267,163,572 円
収益分配金	F	265,892,790 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,270,782 円
口数	H	1,297,038 口
1 口当たり分配金	I=F/H	205 円

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	954,013 円
口数	H	1,040,228 口
1 口当たり分配金	I=F/H	26 円

平成 26 年 7 月 8 日から平成 26 年 10 月 7 日まで

項目		
当期配当等収益額	A	251,349,853 円
分配準備積立金	B	954,013 円
配当等収益合計額	C=A+B	252,303,866 円
経費	D	18,433,747 円
収益分配可能額	E=C-D	233,870,119 円
収益分配金	F	232,665,990 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,204,129 円
口数	H	1,299,810 口
1 口当たり分配金	I=F/H	179 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 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	当期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 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 26 年 4 月 7 日現在	当期 平成 26 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</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>

<p>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)

前期 自 平成 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	当期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 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 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	当期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日
期首元本額 16,446,313,506 円	期首元本額 19,454,272,962 円
期中追加設定元本額 5,683,526,073 円	期中追加設定元本額 6,889,100,696 円
期中一部交換元本額 2,675,566,617 円	期中一部交換元本額 6,847,523,468 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 平成 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 月 7 日	当期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 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	△1,084,426,388	△59,890,648
合計	△1,084,426,388	△59,890,648

## 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 26 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	32,500	12,700.00	412,750,000	
		キリンホールディングス	219,400	1,434.00	314,619,600	
		日本たばこ産業	91,700	3,602.50	330,349,250	
		王子ホールディングス	734,000	394.00	289,196,000	
		クラレ	276,900	1,301.00	360,246,900	
		住友化学	872,000	375.00	327,000,000	
		電気化学工業	781,000	349.00	272,569,000	
		三井化学	1,416,000	311.00	440,376,000	
		三菱ケミカルホールディングス	717,800	530.50	380,792,900	

宇部興産	1,644,000	169.00	277,836,000
花王	100,200	4,252.50	426,100,500
D I C	1,129,000	240.00	270,960,000
協和発酵キリン	303,000	1,319.00	399,657,000
武田薬品工業	67,700	4,678.00	316,700,600
アステラス製薬	275,900	1,660.50	458,131,950
塩野義製薬	145,900	2,526.00	368,543,400
田辺三菱製薬	232,400	1,637.00	380,438,800
エーザイ	81,200	4,358.50	353,910,200
小野薬品工業	40,800	9,400.00	383,520,000
参天製薬	66,200	6,130.00	405,806,000
第一三共	170,100	1,670.00	284,067,000
大塚ホールディングス	115,800	3,875.50	448,782,900
昭和シェル石油	308,300	1,014.00	312,616,200
東燃ゼネラル石油	343,000	952.00	326,536,000
J Xホールディングス	627,000	493.70	309,549,900
横浜ゴム	336,000	940.00	315,840,000
旭硝子	530,000	572.20	303,266,000
日本電気硝子	615,000	500.00	307,500,000
住友金属鉱山	239,000	1,480.50	353,839,500
小松製作所	151,800	2,445.00	371,151,000
日立建機	157,500	2,089.00	329,017,500
SANKYO	70,000	3,830.00	268,100,000
コニカミノルタ	372,400	1,167.00	434,590,800
ブラザー工業	300,700	1,948.00	585,763,600
キヤノン	102,800	3,503.00	360,108,400
日産自動車	359,300	1,021.00	366,845,300
日野自動車	241,300	1,518.00	366,293,400
ダイハツ工業	177,200	1,624.00	287,772,800
本田技研工業	82,000	3,591.00	294,462,000
HOYA	124,600	3,618.50	450,865,100
凸版印刷	422,000	767.00	323,674,000
大日本印刷	319,000	1,080.00	344,520,000
北陸電力	232,600	1,383.00	321,685,800
電源開発	102,800	3,455.00	355,174,000

西日本旅客鉄道	72,900	4,951.00	360,927,900
日本通運	658,000	448.00	294,784,000
日本航空	115,600	2,925.00	338,130,000
フジ・メディア・ホールディングス	165,400	1,518.00	251,077,200
日本電信電話	62,000	6,538.00	405,356,000
KDDI	57,900	6,609.00	382,661,100
NTTドコモ	204,800	1,752.00	358,809,600
双日	1,705,800	166.00	283,162,800
伊藤忠商事	259,900	1,266.50	329,163,350
丸紅	424,700	719.50	305,571,650
三井物産	234,800	1,662.00	390,237,600
住友商事	256,500	1,157.50	296,898,750
三菱商事	161,500	2,148.00	346,902,000
あおぞら銀行	1,113,000	364.00	405,132,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	521,900	610.00	318,359,000
りそなホールディングス	633,300	603.10	381,943,230
三井住友トラスト・ホールディングス	676,000	443.70	299,941,200
三井住友フィナンシャルグループ	67,900	4,391.00	298,148,900
横浜銀行	585,000	584.60	341,991,000
ふくおかフィナンシャルグループ	728,000	502.00	365,456,000
セブン銀行	906,500	437.00	396,140,500
みずほフィナンシャルグループ	1,547,800	195.70	302,904,460
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	399,100	705.00	281,365,500
ディー・エヌ・エー	172,400	1,308.00	225,499,200
ユー・エス・エス	220,900	1,609.00	355,428,100
ベネッセホールディングス	85,600	3,525.00	301,740,000
小計	銘柄数：70		24,209,256,340
	組入時価比率：99.9%		100.0%
合計			24,209,256,340

(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 26 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。