

平成26年4月期（平成25年10月8日～平成26年4月7日）決算短信

平成26年5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6月26日
 分配金支払開始日 平成26年5月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年4月期の運用状況（平成25年10月8日～平成26年4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4月期	22,439	(99.9)	32	(0.1)	22,472	(100)
平成25年10月期	18,190	(99.9)	13	(0.1)	18,204	(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4月期	1,096	378	178	1,297
平成25年10月期	817	438	159	1,096

(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26年4月期	22,755	283	22,472	17,326
平成25年10月期	18,402	197	18,204	16,603

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成26年4月期	205.00
平成25年10月期	168.00

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 25 年 10 月 7 日現在)	当期 (平成 26 年 4 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	15,939,396	33,845,487
株式	18,190,769,400	22,439,592,900
未収配当金	195,906,945	282,041,620
未収利息	34	67
流動資産合計	18,402,615,775	22,755,480,074
資産合計	18,402,615,775	22,755,480,074
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	184,210,992	265,892,790
未払受託者報酬	1,957,127	2,576,725
未払委託者報酬	10,568,472	13,914,288
その他未払費用	1,169,229	751,889
流動負債合計	197,905,820	283,135,692
負債合計	197,905,820	283,135,692
純資産の部		
元本等		
元本	16,446,313,506	19,454,272,962
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,758,396,449	3,018,071,420
(分配準備積立金)	584,082	1,270,782
元本等合計	18,204,709,955	22,472,344,382
純資産合計	18,204,709,955	22,472,344,382
負債純資産合計	18,402,615,775	22,755,480,074

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成 25 年 4 月 8 日 至 平成 25 年 10 月 7 日	当期 自 平成 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 月 7 日
営業収益		
受取配当金	216,584,605	324,844,520
受取利息	4,053	5,590
有価証券売買等損益	732,526,791	850,357,189
その他収益	17,343	3,690
営業収益合計	949,132,792	1,175,210,989
営業費用		
受託者報酬	3,551,450	4,935,225
委託者報酬	19,177,784	26,650,152
その他費用	1,234,813	3,217,173
営業費用合計	23,964,047	34,802,550

営業利益又は営業損失 (△)	925, 168, 745	1, 140, 408, 439
経常利益又は経常損失 (△)	925, 168, 745	1, 140, 408, 439
当期純利益又は当期純損失 (△)	925, 168, 745	1, 140, 408, 439
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 (△)	549, 239, 389	1, 758, 396, 449
剰余金増加額又は欠損金減少額	820, 492, 993	911, 065, 965
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	820, 492, 993	911, 065, 965
剰余金減少額又は欠損金増加額	343, 740, 020	502, 434, 883
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	343, 740, 020	502, 434, 883
分配金	192, 764, 658	289, 364, 550
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1, 758, 396, 449	3, 018, 071, 420

(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 25 年 10 月 8 日から平成 26 年 4 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 25 年 10 月 7 日現在	当期 平成 26 年 4 月 7 日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 1, 096, 494 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 1, 297, 038 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 16, 603 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 17, 326 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成 25 年 4 月 8 日 至 平成 25 年 10 月 7 日	当期 自 平成 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 月 7 日																																																						
1. 分配金の計算過程 平成 25 年 4 月 8 日から平成 25 年 7 月 7 日まで	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																																																						
<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>19, 044, 305 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>706, 786 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>19, 751, 091 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>10, 825, 331 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>8, 925, 760 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>8, 553, 666 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>372, 094 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>777, 606 口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	19, 044, 305 円	分配準備積立金	B	706, 786 円	配当等収益合計額	C=A+B	19, 751, 091 円	経費	D	10, 825, 331 円	収益分配可能額	E=C-D	8, 925, 760 円	収益分配金	F	8, 553, 666 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	372, 094 円	口数	H	777, 606 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>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> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>549, 534 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>977, 990 口</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	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	549, 534 円	口数	H	977, 990 口
項目																																																							
当期配当等収益額	A	19, 044, 305 円																																																					
分配準備積立金	B	706, 786 円																																																					
配当等収益合計額	C=A+B	19, 751, 091 円																																																					
経費	D	10, 825, 331 円																																																					
収益分配可能額	E=C-D	8, 925, 760 円																																																					
収益分配金	F	8, 553, 666 円																																																					
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	372, 094 円																																																					
口数	H	777, 606 口																																																					
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																																																					
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	11 円
平成 25 年 7 月 8 日から平成 25 年 10 月 7 日まで		
項目		
当期配当等収益額	A	197,561,696 円
分配準備積立金	B	372,094 円
配当等収益合計額	C=A+B	197,933,790 円
経費	D	13,138,716 円
収益分配可能額	E=C-D	184,795,074 円
収益分配金	F	184,210,992 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	584,082 円
口数	H	1,096,494 口
1 口当たり分配金	I=F/H	168 円

2. その他費用

その他費用のうち 382,588 円は上場に係る費用であります。

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

2. その他費用

その他費用のうち 2,026,886 円は上場に係る費用であります。

(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 平成 25 年 4 月 8 日 至 平成 25 年 10 月 7 日	当期 自 平成 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 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 25 年 10 月 7 日現在	当期 平成 26 年 4 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>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>

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 平成 25 年 4 月 8 日 至 平成 25 年 10 月 7 日	当期 自 平成 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 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 4 月 8 日 至 平成 25 年 10 月 7 日	当期 自 平成 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 月 7 日
期首元本額 12,262,282,460 円	期首元本額 16,446,313,506 円
期中追加設定元本額 6,575,171,626 円	期中追加設定元本額 5,683,526,073 円
期中一部交換元本額 2,391,140,580 円	期中一部交換元本額 2,675,566,617 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 4 月 8 日 至 平成 25 年 10 月 7 日	当期 自 平成 25 年 10 月 8 日 至 平成 26 年 4 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	△647,484,607	△1,084,426,388
合計	△647,484,607	△1,084,426,388

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 4 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	9,978.00	324,285,000	
		麒麟ホールディングス	219,000	1,382.00	302,658,000	
		日本たばこ産業	91,500	3,274.00	299,571,000	
		王子ホールディングス	733,000	454.00	332,782,000	
		クラレ	276,400	1,179.00	325,875,600	
		住友化学	870,000	386.00	335,820,000	
		電気化学工業	780,000	364.00	283,920,000	
		三井化学	1,414,000	252.00	356,328,000	

三菱ケミカルホールディングス	716,600	428.00	306,704,800
宇部興産	1,641,000	186.00	305,226,000
花王	100,100	3,609.00	361,260,900
D I C	1,127,000	267.00	300,909,000
協和発酵キリン	303,000	1,087.00	329,361,000
武田薬品工業	67,600	4,821.00	325,899,600
アステラス製薬	275,400	1,194.00	328,827,600
塩野義製薬	145,700	1,855.00	270,273,500
田辺三菱製薬	232,000	1,469.00	340,808,000
エーザイ	81,100	3,925.00	318,317,500
小野薬品工業	40,800	8,620.00	351,696,000
参天製薬	66,100	4,780.00	315,958,000
第一三共	169,800	1,813.00	307,847,400
大塚ホールディングス	115,600	2,957.00	341,829,200
昭和シェル石油	307,800	923.00	284,099,400
東燃ゼネラル石油	343,000	909.00	311,787,000
J Xホールディングス	626,000	502.00	314,252,000
横浜ゴム	335,000	948.00	317,580,000
旭硝子	529,000	590.00	312,110,000
日本電気硝子	614,000	525.00	322,350,000
住友金属鉱山	239,000	1,313.00	313,807,000
小松製作所	151,500	2,207.00	334,360,500
日立建機	157,200	1,992.00	313,142,400
SANKYO	69,900	4,265.00	298,123,500
コニカミノルタ	371,800	955.00	355,069,000
ブラザー工業	300,200	1,448.00	434,689,600
キヤノン	102,700	3,200.00	328,640,000
日産自動車	358,700	939.00	336,819,300
日野自動車	240,900	1,519.00	365,927,100
ダイハツ工業	176,800	1,767.00	312,405,600
本田技研工業	81,800	3,571.00	292,107,800
HOYA	124,400	3,121.00	388,252,400
凸版印刷	421,000	721.00	303,541,000
大日本印刷	319,000	970.00	309,430,000
北陸電力	232,200	1,268.00	294,429,600

電源開発	102,700	2,879.00	295,673,300
西日本旅客鉄道	72,800	4,135.00	301,028,000
日本通運	657,000	509.00	334,413,000
日本航空	57,700	5,120.00	295,424,000
フジ・メディア・ホールディングス	165,100	1,770.00	292,227,000
日本電信電話	61,900	5,408.00	334,755,200
KDDI	57,800	5,588.00	322,986,400
NTTドコモ	204,500	1,584.00	323,928,000
双日	1,702,900	173.00	294,601,700
伊藤忠商事	259,400	1,166.00	302,460,400
丸紅	424,000	689.00	292,136,000
三井物産	234,400	1,468.00	344,099,200
住友商事	256,100	1,325.00	339,332,500
三菱商事	161,200	1,881.00	303,217,200
あおぞら銀行	1,111,000	299.00	332,189,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	520,900	569.00	296,392,100
りそなホールディングス	632,200	500.00	316,100,000
三井住友トラスト・ホールディングス	675,000	457.00	308,475,000
三井住友フィナンシャルグループ	67,800	4,403.00	298,523,400
横浜銀行	584,000	515.00	300,760,000
ふくおかフィナンシャルグループ	726,000	427.00	310,002,000
セブン銀行	905,000	397.00	359,285,000
みずほフィナンシャルグループ	1,545,200	205.00	316,766,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	398,400	839.00	334,257,600
ディー・エヌ・エー	172,100	1,833.00	315,459,300
ユー・エス・エス	220,600	1,463.00	322,737,800
ベネッセホールディングス	85,500	4,015.00	343,282,500
小計 銘柄数：70			22,439,592,900
組入時価比率：99.9%			100.0%
合計			22,439,592,900

(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 4 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。