

平成27年10月期（平成27年4月8日～平成27年10月7日）決算短信

平成27年11月18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27年12月24日
 分配金支払開始日 平成27年11月13日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年10月期の運用状況（平成27年4月8日～平成27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27年10月期	48,028	(99.9)	42	(0.1)	48,071	(100)
平成27年4月期	43,487	(99.9)	38	(0.1)	43,526	(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27年10月期	1,921	638	358	2,201
平成27年4月期	1,299	1,018	396	1,921

(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27年10月期	48,540	469	48,071	21,835
平成27年4月期	43,965	438	43,526	22,655

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成27年10月期	193.00
平成27年4月期	211.00

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 27 年 4 月 7 日現在)	当期 (平成 27 年 10 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	44,414,012	41,201,932
株式	43,487,966,990	48,028,633,430
未収入金	-	3,162,000
未収配当金	433,058,800	467,220,100
未収利息	68	79
流動資産合計	43,965,439,870	48,540,217,541
資産合計	43,965,439,870	48,540,217,541
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	405,387,970	424,904,361
未払受託者報酬	4,990,517	6,284,805
未払委託者報酬	26,948,743	33,937,896
その他未払費用	1,448,294	4,055,289
流動負債合計	438,775,524	469,182,351
負債合計	438,775,524	469,182,351
純資産の部		
元本等		
元本	28,817,128,730	33,021,453,423
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	14,709,535,616	15,049,581,767
(分配準備積立金)	762,687	623,466
元本等合計	43,526,664,346	48,071,035,190
純資産合計	43,526,664,346	48,071,035,190
負債純資産合計	43,965,439,870	48,540,217,541

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日	当期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日
営業収益		
受取配当金	542,786,200	585,122,600
受取利息	8,004	11,277
有価証券売買等損益	7,271,753,580	△1,797,664,510
その他収益	267,520	816,224
営業収益合計	7,814,815,304	△1,211,714,409
営業費用		
受託者報酬	8,953,058	11,723,467

委託者報酬	48,346,429	63,306,647
その他費用	4,757,759	4,268,298
営業費用合計	62,057,246	79,298,412
営業利益又は営業損失 (△)	7,752,758,058	△1,291,012,821
経常利益又は経常損失 (△)	7,752,758,058	△1,291,012,821
当期純利益又は当期純損失 (△)	7,752,758,058	△1,291,012,821
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 (△)	4,734,997,890	14,709,535,616
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,730,323,677	5,060,490,117
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,730,323,677	5,060,490,117
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,027,098,089	2,922,640,235
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,027,098,089	2,922,640,235
分配金	481,445,920	506,790,910
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	14,709,535,616	15,049,581,767

(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 27 年 4 月 8 日から平成 27 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 27 年 4 月 7 日現在	当期 平成 27 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 1,921,270 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 2,201,577 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 22,655 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 21,835 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自平成 26 年 10 月 8 日 至平成 27 年 4 月 7 日	当期 自平成 27 年 4 月 8 日 至平成 27 年 10 月 7 日																																				
1. 分配金の計算過程 平成 26 年 10 月 8 日から平成 27 年 1 月 7 日まで	1. 分配金の計算過程 平成 27 年 4 月 8 日から平成 27 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>102,476,342 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>1,204,129 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>103,680,471 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>26,905,522 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>76,774,949 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	102,476,342 円	分配準備積立金	B	1,204,129 円	配当等収益合計額	C=A+B	103,680,471 円	経費	D	26,905,522 円	収益分配可能額	E=C-D	76,774,949 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>118,229,633 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>762,687 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>118,992,320 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>36,928,394 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>82,063,926 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	118,229,633 円	分配準備積立金	B	762,687 円	配当等収益合計額	C=A+B	118,992,320 円	経費	D	36,928,394 円	収益分配可能額	E=C-D	82,063,926 円
項目																																					
当期配当等収益額	A	102,476,342 円																																			
分配準備積立金	B	1,204,129 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	103,680,471 円																																			
経費	D	26,905,522 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	76,774,949 円																																			
項目																																					
当期配当等収益額	A	118,229,633 円																																			
分配準備積立金	B	762,687 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	118,992,320 円																																			
経費	D	36,928,394 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	82,063,926 円																																			

収益分配金	F	76,057,950 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	716,999 円
口数	H	1,521,159 口
1 口当たり分配金	I=F/H	50 円

平成 27 年 1 月 8 日から平成 27 年 4 月 7 日まで

項目		
当期配当等収益額	A	440,585,382 円
分配準備積立金	B	716,999 円
配当等収益合計額	C=A+B	441,302,381 円
経費	D	35,151,724 円
収益分配可能額	E=C-D	406,150,657 円
収益分配金	F	405,387,970 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	762,687 円
口数	H	1,921,270 口
1 口当たり分配金	I=F/H	211 円

収益分配金	F	81,886,549 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	177,377 円
口数	H	1,742,267 口
1 口当たり分配金	I=F/H	47 円

平成 27 年 7 月 8 日から平成 27 年 10 月 7 日まで

項目		
当期配当等収益額	A	467,720,468 円
分配準備積立金	B	177,377 円
配当等収益合計額	C=A+B	467,897,845 円
経費	D	42,370,018 円
収益分配可能額	E=C-D	425,527,827 円
収益分配金	F	424,904,361 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	623,466 円
口数	H	2,201,577 口
1 口当たり分配金	I=F/H	193 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 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日	当期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 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 27 年 4 月 7 日現在	当期 平成 27 年 10 月 7 日現在
<p>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。</p> <p>2. 時価の算定方法 株式</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 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 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日	当期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 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 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日	当期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日
期首元本額 19,495,850,190 円	期首元本額 28,817,128,730 円
期中追加設定元本額 15,275,866,541 円	期中追加設定元本額 9,576,591,518 円
期中一部交換元本額 5,954,588,001 円	期中一部交換元本額 5,372,266,825 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日	当期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 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	5,416,152,226	△3,329,858,684
合計	5,416,152,226	△3,329,858,684

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 27 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	44,000	12,655.00	556,820,000	
		大和ハウス工業	276,900	3,033.00	839,837,700	
		キリンホールディングス	426,800	1,597.50	681,813,000	
		日本たばこ産業	156,600	3,994.00	625,460,400	
		王子ホールディングス	1,523,000	558.00	849,834,000	
		クラレ	462,400	1,510.00	698,224,000	
		住友化学	1,546,000	690.00	1,066,740,000	
		三菱ケミカルホールディングス	1,077,300	692.20	745,707,060	
		協和発酵キリン	478,000	1,762.00	842,236,000	

武田薬品工業	125,000	5,486.00	685,750,000
田辺三菱製薬	348,000	2,086.00	725,928,000
エーザイ	141,400	6,887.00	973,821,800
第一三共	358,100	2,156.50	772,242,650
大塚ホールディングス	155,700	3,832.00	596,642,400
昭和シェル石油	642,400	1,031.00	662,314,400
東燃ゼネラル石油	623,000	1,261.00	785,603,000
J Xホールディングス	1,331,500	477.60	635,924,400
横浜ゴム	297,100	2,218.00	658,967,800
ブリヂストン	159,200	4,257.00	677,714,400
住友ゴム工業	372,900	1,715.00	639,523,500
旭硝子	1,050,000	733.00	769,650,000
日本電気硝子	1,185,000	589.00	697,965,000
三菱マテリアル	1,776,000	404.00	717,504,000
住友金属鉱山	399,000	1,523.00	607,677,000
L I X I Lグループ	262,300	2,554.00	669,914,200
アマダホールディングス	607,200	1,044.00	633,916,800
小松製作所	222,900	1,898.00	423,064,200
日立建機	254,800	1,798.00	458,130,400
SANKYO	156,200	4,405.00	688,061,000
セガサミーホールディングス	362,900	1,248.00	452,899,200
キヤノン	172,300	3,586.00	617,867,800
日産自動車	585,300	1,173.00	686,556,900
トヨタ自動車	90,700	7,351.00	666,735,700
日野自動車	380,900	1,315.00	500,883,500
アイシン精機	156,800	4,425.00	693,840,000
ダイハツ工業	384,000	1,555.00	597,120,000
本田技研工業	169,700	3,862.00	655,381,400
ニコン	398,000	1,547.00	615,706,000
HOYA	152,600	4,499.00	686,547,400
シチズンホールディングス	802,400	873.00	700,495,200
凸版印刷	825,000	998.00	823,350,000
大日本印刷	577,000	1,185.00	683,745,000
西日本旅客鉄道	112,300	8,056.00	904,688,800
日本通運	1,187,000	586.00	695,582,000
日本航空	196,800	4,325.00	851,160,000

フジ・メディア・ホールディングス	407,400	1,474.00	600,507,600	
トレンドマイクロ	165,000	4,190.00	691,350,000	
日本電信電話	186,200	4,337.00	807,549,400	
KDDI	249,800	2,768.00	691,446,400	
NTTドコモ	338,100	2,130.50	720,322,050	
双日	3,540,800	253.00	895,822,400	
伊藤忠商事	439,600	1,418.00	623,352,800	
丸紅	829,500	643.50	533,783,250	
三井物産	368,500	1,483.50	546,669,750	
住友商事	496,300	1,235.50	613,178,650	
三菱商事	267,000	2,219.00	592,473,000	
あおぞら銀行	1,558,000	415.00	646,570,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	965,300	773.20	746,369,960	
りそなホールディングス	928,200	642.00	595,904,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,294,000	459.70	594,851,800	
三井住友フィナンシャルグループ	136,500	4,820.00	657,930,000	
横浜銀行	933,000	734.30	685,101,900	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,043,000	593.00	618,499,000	
みずほフィナンシャルグループ	2,997,100	236.60	709,113,860	
ソニーフィナンシャルホールディングス	341,000	2,073.00	706,893,000	
東京海上ホールディングス	170,000	4,617.00	784,890,000	
イオンフィナンシャルサービス	272,700	2,566.00	699,748,200	
野村不動産ホールディングス	319,000	2,439.00	778,041,000	
ユー・エス・エス	351,000	2,085.00	731,835,000	
ベネッセホールディングス	169,900	3,160.00	536,884,000	
小計	銘柄数：70		48,028,633,430	
	組入時価比率：99.9%		100.0%	
合計			48,028,633,430	

(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 27 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。