

平成27年4月期（平成26年10月8日～平成27年4月7日）決算短信

平成27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 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6月30日
 分配金支払開始日 平成27年5月15日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年4月期の運用状況（平成26年10月8日～平成27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27年4月期	43,487	(99.9)	38	(0.1)	43,526	(100)
平成26年10月期	24,209	(99.9)	21	(0.1)	24,230	(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4月期	1,299	1,018	396	1,921
平成26年10月期	1,297	459	456	1,299

(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4月期	43,965	438	43,526	22,655
平成26年10月期	24,482	252	24,230	18,642

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成27年4月期	211.00
平成26年10月期	179.00

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 10 月 7 日現在)	当期 (平成 27 年 4 月 7 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,047,641	44,414,012
株式	24,209,256,340	43,487,966,990
未収配当金	250,563,975	433,058,800
未収利息	36	68
流動資産合計	24,482,867,992	43,965,439,870
資産合計	24,482,867,992	43,965,439,870
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	232,665,990	405,387,970
未払受託者報酬	2,726,022	4,990,517
未払委託者報酬	14,720,499	26,948,743
その他未払費用	1,907,401	1,448,294
流動負債合計	252,019,912	438,775,524
負債合計	252,019,912	438,775,524
純資産の部		
元本等		
元本	19,495,850,190	28,817,128,730
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	4,734,997,890	14,709,535,616
(分配準備積立金)	1,204,129	762,687
元本等合計	24,230,848,080	43,526,664,346
純資産合計	24,230,848,080	43,526,664,346
負債純資産合計	24,482,867,992	43,965,439,870

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日	当期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日
営業収益		
受取配当金	297,387,255	542,786,200
受取利息	6,620	8,004
有価証券売買等損益	1,438,320,296	7,271,753,580
その他収益	358,936	267,520
営業収益合計	1,736,073,107	7,814,815,304
営業費用		
受託者報酬	5,623,506	8,953,058
委託者報酬	30,366,891	48,346,429

その他費用	2, 117, 149	4, 757, 759
営業費用合計	38, 107, 546	62, 057, 246
営業利益又は営業損失 (△)	1, 697, 965, 561	7, 752, 758, 058
経常利益又は経常損失 (△)	1, 697, 965, 561	7, 752, 758, 058
当期純利益又は当期純損失 (△)	1, 697, 965, 561	7, 752, 758, 058
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 (△)	3, 018, 071, 420	4, 734, 997, 890
剰余金増加額又は欠損金減少額	1, 707, 003, 419	4, 730, 323, 677
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1, 707, 003, 419	4, 730, 323, 677
剰余金減少額又は欠損金増加額	1, 428, 330, 592	2, 027, 098, 089
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1, 428, 330, 592	2, 027, 098, 089
分配金	259, 711, 918	481, 445, 920
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	4, 734, 997, 890	14, 709, 535, 616

(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 10 月 8 日から平成 27 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 26 年 10 月 7 日現在	当期 平成 27 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, 299, 810 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 1, 921, 270 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 18, 642 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 22, 655 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日	当期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日																																										
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	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																																										
<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	<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> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>76, 057, 950 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	収益分配金	F	76, 057, 950 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																																									
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																																									
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	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

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

(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 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日	当期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 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なっております。</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なっております。</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なっております。</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なっております。</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 10 月 7 日現在	当期 平成 27 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 (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)

<p>前期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日</p>	<p>当期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日</p>
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

<p>前期 自 平成 26 年 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日</p>	<p>当期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 年 4 月 7 日</p>
期首元本額 19,454,272,962 円	期首元本額 19,495,850,190 円
期中追加設定元本額 6,889,100,696 円	期中追加設定元本額 15,275,866,541 円
期中一部交換元本額 6,847,523,468 円	期中一部交換元本額 5,954,588,001 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 4 月 8 日 至 平成 26 年 10 月 7 日	当期 自 平成 26 年 10 月 8 日 至 平成 27 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	△59,890,648	5,416,152,226
合計	△59,890,648	5,416,152,226

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 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	38,400	13,995.00	537,408,000	
		大和ハウス工業	241,600	2,475.00	597,960,000	
		麒麟ホールディングス	372,400	1,615.00	601,426,000	
		日本たばこ産業	136,600	3,893.50	531,852,100	
		王子ホールディングス	1,329,000	524.00	696,396,000	
		クラレ	403,500	1,659.00	669,406,500	
		住友化学	1,349,000	633.00	853,917,000	
		三菱ケミカルホールディングス	940,100	729.00	685,332,900	
		協和発酵キリン	417,000	1,661.00	692,637,000	

武田薬品工業	109,100	5,949.00	649,035,900
田辺三菱製薬	303,700	2,024.00	614,688,800
エーザイ	123,400	8,438.00	1,041,249,200
第一三共	312,500	1,887.00	589,687,500
大塚ホールディングス	135,900	3,807.00	517,371,300
昭和シェル石油	560,600	1,096.00	614,417,600
東燃ゼネラル石油	543,000	1,065.00	578,295,000
J Xホールディングス	1,161,900	482.50	560,616,750
横浜ゴム	519,000	1,232.00	639,408,000
ブリヂストン	138,900	5,060.00	702,834,000
住友ゴム工業	325,500	2,220.00	722,610,000
旭硝子	916,000	779.00	713,564,000
日本電気硝子	1,034,000	575.00	594,550,000
三菱マテリアル	1,549,000	410.00	635,090,000
住友金属鉱山	348,000	1,787.50	622,050,000
L I X I Lグループ	228,900	2,725.00	623,752,500
アマダホールディングス	529,900	1,189.00	630,051,100
小松製作所	194,500	2,504.00	487,028,000
日立建機	222,400	2,140.00	475,936,000
SANKYO	136,300	4,410.00	601,083,000
セガサミーホールディングス	316,700	1,802.00	570,693,400
キヤノン	150,400	4,460.00	670,784,000
日産自動車	510,800	1,223.50	624,963,800
トヨタ自動車	79,200	8,410.00	666,072,000
日野自動車	332,400	1,659.00	551,451,600
アイシン精機	136,800	4,455.00	609,444,000
ダイハツ工業	335,100	1,827.00	612,227,700
本田技研工業	148,100	4,046.50	599,286,650
ニコン	347,400	1,677.00	582,589,800
HOYA	133,100	4,947.00	658,445,700
シチズンホールディングス	700,200	940.00	658,188,000
凸版印刷	720,000	952.00	685,440,000
大日本印刷	503,000	1,201.00	604,103,000
西日本旅客鉄道	98,000	6,569.00	643,762,000
日本通運	1,036,000	703.00	728,308,000
日本航空	171,700	3,665.00	629,280,500

	フジ・メディア・ホールディングス	355,500	1,740.00	618,570,000	
	トレンドマイクロ	144,000	4,075.00	586,800,000	
	日本電信電話	81,200	7,643.00	620,611,600	
	KDD I	218,000	2,840.50	619,229,000	
	NTTドコモ	295,000	2,165.50	638,822,500	
	双日	3,089,900	204.00	630,339,600	
	伊藤忠商事	383,600	1,325.00	508,270,000	
	丸紅	723,900	703.10	508,974,090	
	三井物産	321,600	1,603.50	515,685,600	
	住友商事	433,100	1,317.50	570,609,250	
	三菱商事	233,000	2,453.50	571,665,500	
	あおぞら銀行	1,359,000	423.00	574,857,000	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	842,400	788.00	663,811,200	
	りそなホールディングス	810,000	610.00	494,100,000	
	三井住友トラスト・ホールディングス	1,129,000	502.00	566,758,000	
	三井住友フィナンシャルグループ	119,100	4,676.50	556,971,150	
	横浜銀行	814,000	736.90	599,836,600	
	ふくおかフィナンシャルグループ	910,000	637.00	579,670,000	
	みずほフィナンシャルグループ	2,615,500	215.00	562,332,500	
	ソニーフィナンシャルホールディングス	297,600	2,075.00	617,520,000	
	東京海上ホールディングス	148,400	4,770.00	707,868,000	
	イオンフィナンシャルサービス	238,000	3,055.00	727,090,000	
	野村不動産ホールディングス	278,400	2,338.00	650,899,200	
	ユー・エス・エス	306,300	2,163.00	662,526,900	
	ベネッセホールディングス	148,200	3,775.00	559,455,000	
	小計 銘柄数：70			43,487,966,990	
	組入時価比率：99.9%			100.0%	
	合計			43,487,966,990	

(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 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。