

平成29年4月期（平成29年2月10日～平成29年4月7日）決算短信

平成29年5月17日

上場取引所 東証

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 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成29年6月29日
 分配金支払開始日 平成29年5月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成29年4月期の運用状況（平成29年2月10日～平成29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29年4月期	5,271	(99.9)	5	(0.1)	5,276	(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29年4月期	-	154	0	154
-	-	-	-	-

(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29年4月期	5,347	70	5,276	34,069
-	-	-	-	-

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成29年4月期	443.00
-	-

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 日経平均高配当株 50 指数連動型上場投信

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

当期
(平成 29 年 4 月 7 日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,332,936
株式	5,271,397,840
未収配当金	71,991,200
流動資産合計	5,347,721,976
資産合計	5,347,721,976
負債の部	
流動負債	
未払収益分配金	68,616,270
未払受託者報酬	324,499
未払委託者報酬	1,492,682
未払利息	4
その他未払費用	386,097
流動負債合計	70,819,552
負債合計	70,819,552
純資産の部	
元本等	
元本	5,401,788,750
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△124,886,326
(分配準備積立金)	45,127
元本等合計	5,276,902,424
純資産合計	5,276,902,424
負債純資産合計	5,347,721,976

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当期
自 平成 29 年 2 月 10 日
至 平成 29 年 4 月 7 日

営業収益	
受取配当金	71,991,200
有価証券売買等損益	△155,047,841
営業収益合計	△83,056,641
営業費用	
支払利息	1,057
受託者報酬	324,499
委託者報酬	1,492,682

その他費用	1,511,565
営業費用合計	3,329,803
営業利益又は営業損失(△)	△86,386,444
経常利益又は経常損失(△)	△86,386,444
当期純利益又は当期純損失(△)	△86,386,444
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(△)	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	30,116,388
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	30,116,388
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	68,616,270
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△124,886,326

(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 29 年 2 月 10 日から平成 29 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)

当期 平成 29 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	154,890 口
2. 投資信託財産計算規則第 55 条の 6 第 1 項第 10 号に規定する額	
元本の欠損	124,886,326 円
3. 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	34,069 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

当期 自 平成 29 年 2 月 10 日 至 平成 29 年 4 月 7 日		
1. 分配金の計算過程		
平成 29 年 2 月 10 日から平成 29 年 4 月 7 日まで		
項目	項目	
当期配当等収益額	A	71,990,143 円
分配準備積立金	B	0 円
配当等収益合計額	C=A+B	71,990,143 円
経費	D	3,328,746 円
収益分配可能額	E=C-D	68,661,397 円

収益分配金	F	68,616,270 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	45,127 円
口数	H	154,890 口
1 口当たり分配金	I=F/H	443 円

2. その他費用

その他費用のうち 850,123 円は上場に係る費用、648,479 円は対象指数についての商標使用料であります。

3. 追加情報

平成 28 年 1 月 29 日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

当期 自 平成 29 年 2 月 10 日 至 平成 29 年 4 月 7 日
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。
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。
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なっております。
○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なっております。
○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なっております。
○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なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

当期 平成 29 年 4 月 7 日現在
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。
2. 時価の算定方法 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。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期 自 平成 29 年 2 月 10 日 至 平成 29 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。

(その他の注記)

1 元本の移動

当期 自 平成 29 年 2 月 10 日 至 平成 29 年 4 月 7 日	期首元本額 ー円 期中追加設定元本額 5,401,788,750 円
---	---------------------------------------

期中一部交換元本額

0 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	当期 自 平成 29 年 2 月 10 日 至 平成 29 年 4 月 7 日	
	損益に含まれた評価差額 (円)	
株式		△155,162,601
合計		△155,162,601

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 29 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	積水ハウス	51,200	1,789.00	91,596,800	
		日本たばこ産業	26,000	3,689.00	95,914,000	
		日本製紙	12,600	2,000.00	25,200,000	
		デンカ	47,000	552.00	25,944,000	
		三菱ケミカルホールディングス	118,700	836.60	99,304,420	
		宇部興産	219,000	251.00	54,969,000	
		武田薬品工業	30,800	5,230.00	161,084,000	
		昭和シェル石油	23,700	1,111.00	26,330,700	
		J X T Gホールディングス	269,000	537.90	144,695,100	
		横浜ゴム	14,100	2,108.00	29,722,800	
		ブリヂストン	37,600	4,488.00	168,748,800	
		日本電気硝子	88,000	647.00	56,936,000	
		日新製鋼	15,900	1,431.00	22,752,900	
		三井金属鉱業	249,000	350.00	87,150,000	
		古河機械金属	127,000	198.00	25,146,000	
		アマダホールディングス	44,300	1,284.00	56,881,200	
		小松製作所	50,000	2,852.50	142,625,000	
		日本精工	92,500	1,486.00	137,455,000	
		N T N	128,000	542.00	69,376,000	
		コニカミノルタ	51,700	953.00	49,270,100	
沖電気工業	14,800	1,604.00	23,739,200			

キヤノン	57,300	3,465.00	198,544,500	
リコー	114,000	889.00	101,346,000	
東京エレクトロン	15,200	12,100.00	183,920,000	
川崎重工業	264,000	328.00	86,592,000	
日産自動車	149,400	1,010.50	150,968,700	
日野自動車	39,000	1,290.00	50,310,000	
S U B A R U	32,900	3,941.00	129,658,900	
トレンドマイクロ	16,800	4,875.00	81,900,000	
スカパー J S A Tホールディングス	43,600	488.00	21,276,800	
N T T ドコモ	40,800	2,634.00	107,467,200	
双日	307,400	272.00	83,612,800	
伊藤忠商事	112,000	1,572.00	176,064,000	
丸紅	210,900	682.30	143,897,070	
三井物産	110,600	1,616.50	178,784,900	
住友商事	121,800	1,487.50	181,177,500	
三菱商事	61,200	2,447.00	149,756,400	
あおぞら銀行	306,000	388.00	118,728,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	231,600	667.70	154,639,320	
りそなホールディングス	337,100	557.30	187,865,830	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,600	3,713.00	102,478,800	
三井住友フィナンシャルグループ	45,200	3,893.00	175,963,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	125,000	471.00	58,875,000	
みずほフィナンシャルグループ	973,000	193.90	188,664,700	
大和証券グループ本社	181,000	663.40	120,075,400	
野村ホールディングス	239,000	658.90	157,477,100	
松井証券	35,600	873.00	31,078,800	
MS & ADインシュアランスグループホール	31,500	3,500.00	110,250,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	47,200	1,723.00	81,325,600	
東京海上ホールディングス	36,100	4,539.00	163,857,900	
小計 銘柄数 : 50			5,271,397,840	
組入時価比率 : 99.9%			100.0%	
合計			5,271,397,840	

(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 29 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。