

平成29年4月期（平成28年10月8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 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28年10月8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	89,593	(99.9)	75	(0.1)	89,669	(100)
平成28年10月期	68,031	(99.9)	67	(0.1)	68,098	(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	3,432	1,618	1,024	4,026
平成28年10月期	3,122	978	669	3,432

(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	90,879	1,209	89,669	22,272
平成28年10月期	68,894	796	68,098	19,839

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成29年4月期	283.00
平成28年10月期	215.00

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 28 年 10 月 7 日現在)	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	70,517,110	87,224,251
株式	68,031,017,190	89,593,976,910
未収配当金	793,361,400	1,198,010,030
流動資産合計	68,894,895,700	90,879,211,191
資産合計	68,894,895,700	90,879,211,191
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	737,992,445	1,139,406,110
未払受託者報酬	8,241,051	10,521,789
未払委託者報酬	44,501,635	56,817,635
未払利息	58	96
その他未払費用	5,476,156	3,091,590
流動負債合計	796,211,345	1,209,837,220
負債合計	796,211,345	1,209,837,220
純資産の部		
元本等		
元本	51,484,412,477	60,388,523,830
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	16,614,271,878	29,280,850,141
(分配準備積立金)	2,088,369	4,021,689
元本等合計	68,098,684,355	89,669,373,971
純資産合計	68,098,684,355	89,669,373,971
負債純資産合計	68,894,895,700	90,879,211,191

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	当期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日
営業収益		
受取配当金	964,718,225	1,373,802,130
有価証券売買等損益	4,801,565,645	5,285,139,998
その他収益	791,176	908,730
営業収益合計	5,767,075,046	6,659,850,858
営業費用		
支払利息	16,961	18,135
受託者報酬	15,865,453	18,888,284
委託者報酬	85,673,392	101,996,673

その他費用	5,870,485	8,817,296
営業費用合計	107,426,291	129,720,388
営業利益又は営業損失(△)	5,659,648,755	6,530,130,470
経常利益又は経常損失(△)	5,659,648,755	6,530,130,470
当期純利益又は当期純損失(△)	5,659,648,755	6,530,130,470
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(△)	11,141,522,149	16,614,271,878
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,827,657,271	13,622,851,671
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,827,657,271	13,622,851,671
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,157,142,988	6,243,346,726
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,157,142,988	6,243,346,726
分配金	857,413,309	1,243,057,152
期末剰余金又は期末欠損金(△)	16,614,271,878	29,280,850,141

## (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 28 年 10 月 8 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)

前期 平成 28 年 10 月 7 日現在	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 3,432,523 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 4,026,170 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 19,839 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 22,272 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自平成 28 年 4 月 8 日 至平成 28 年 10 月 7 日	当期 自平成 28 年 10 月 8 日 至平成 29 年 4 月 7 日																																										
1. 分配金の計算過程 平成 28 年 4 月 8 日から平成 28 年 7 月 7 日まで	1. 分配金の計算過程 平成 28 年 10 月 8 日から平成 29 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>172,091,944 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>1,418,568 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>173,510,512 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>51,769,591 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>121,740,921 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>119,420,864 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	172,091,944 円	分配準備積立金	B	1,418,568 円	配当等収益合計額	C=A+B	173,510,512 円	経費	D	51,769,591 円	収益分配可能額	E=C-D	121,740,921 円	収益分配金	F	119,420,864 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>160,180,248 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,088,369 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>162,268,617 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>56,808,377 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>105,460,240 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>103,651,042 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	160,180,248 円	分配準備積立金	B	2,088,369 円	配当等収益合計額	C=A+B	162,268,617 円	経費	D	56,808,377 円	収益分配可能額	E=C-D	105,460,240 円	収益分配金	F	103,651,042 円
項目																																											
当期配当等収益額	A	172,091,944 円																																									
分配準備積立金	B	1,418,568 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	173,510,512 円																																									
経費	D	51,769,591 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	121,740,921 円																																									
収益分配金	F	119,420,864 円																																									
項目																																											
当期配当等収益額	A	160,180,248 円																																									
分配準備積立金	B	2,088,369 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	162,268,617 円																																									
経費	D	56,808,377 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	105,460,240 円																																									
収益分配金	F	103,651,042 円																																									

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,320,057 円
口数	H	2,912,704 口
1 口当たり分配金	I=F/H	41 円

平成 28 年 7 月 8 日から平成 28 年 10 月 7 日まで

項目		
当期配当等収益額	A	793,400,496 円
分配準備積立金	B	2,320,057 円
配当等収益合計額	C=A+B	795,720,553 円
経費	D	55,639,739 円
収益分配可能額	E=C-D	740,080,814 円
収益分配金	F	737,992,445 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,088,369 円
口数	H	3,432,523 口
1 口当たり分配金	I=F/H	215 円

## 2. 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。

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,809,198 円
口数	H	2,727,659 口
1 口当たり分配金	I=F/H	38 円

平成 29 年 1 月 8 日から平成 29 年 4 月 7 日まで

項目		
当期配当等収益額	A	1,214,512,477 円
分配準備積立金	B	1,809,198 円
配当等収益合計額	C=A+B	1,216,321,675 円
経費	D	72,893,876 円
収益分配可能額	E=C-D	1,143,427,799 円
収益分配金	F	1,139,406,110 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,021,689 円
口数	H	4,026,170 口
1 口当たり分配金	I=F/H	283 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 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	当期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 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 28 年 10 月 7 日現在	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	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。	同左
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。	2. 時価の算定方法 同左

## (関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	当期 自 平成 28 年 10 月 8 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。	同左

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

前期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	当期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 年 4 月 7 日
期首元本額 46,837,512,291 円	期首元本額 51,484,412,477 円
期中追加設定元本額 14,682,851,078 円	期中追加設定元本額 24,271,126,817 円
期中一部交換元本額 10,035,950,892 円	期中一部交換元本額 15,367,015,464 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 平成 28 年 4 月 8 日 至 平成 28 年 10 月 7 日	当期 自 平成 28 年 10 月 8 日 至 平成 29 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	7,559,561,323	△5,205,614,027
合計	7,559,561,323	△5,205,614,027

## 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	大東建託	66,200	15,405.00	1,019,811,000	
		大和ハウス工業	403,600	3,175.00	1,281,430,000	
		日本たばこ産業	291,500	3,689.00	1,075,343,500	
		クラレ	736,500	1,673.00	1,232,164,500	
		住友化学	2,395,000	595.00	1,425,025,000	
		デンカ	2,472,000	552.00	1,364,544,000	

J S R	746,100	1,871.00	1,395,953,100
宇部興産	5,383,000	251.00	1,351,133,000
D I C	364,000	3,915.00	1,425,060,000
田辺三菱製薬	570,500	2,350.00	1,340,675,000
エーザイ	180,600	5,776.00	1,043,145,600
第一三共	504,200	2,469.00	1,244,869,800
横浜ゴム	631,500	2,108.00	1,331,202,000
ブリヂストン	293,000	4,488.00	1,314,984,000
住友ゴム工業	659,400	1,889.00	1,245,606,600
旭硝子	1,620,000	883.00	1,430,460,000
日本電気硝子	2,039,000	647.00	1,319,233,000
アマダホールディングス	974,600	1,284.00	1,251,386,400
小松製作所	508,000	2,852.50	1,449,070,000
住友重機械工業	1,952,000	755.00	1,473,760,000
セガサミーホールディングス	702,800	1,478.00	1,038,738,400
日本精工	1,022,100	1,486.00	1,518,840,600
三菱重工業	2,693,000	440.80	1,187,074,400
コニカミノルタ	1,238,600	953.00	1,180,385,800
セイコーエプソン	535,000	2,304.00	1,232,640,000
カシオ計算機	870,000	1,525.00	1,326,750,000
キヤノン	388,100	3,465.00	1,344,766,500
リコー	1,355,200	889.00	1,204,772,800
東京エレクトロン	120,200	12,100.00	1,454,420,000
日産自動車	1,112,400	1,010.50	1,124,080,200
トヨタ自動車	195,400	5,832.00	1,139,572,800
本田技研工業	388,100	3,157.00	1,225,231,700
S U B A R U	292,800	3,941.00	1,153,924,800
大日本印刷	1,102,000	1,206.00	1,329,012,000
北陸電力	986,200	1,047.00	1,032,551,400
電源開発	505,900	2,520.00	1,274,868,000
日本航空	365,500	3,380.00	1,235,390,000
フジ・メディア・ホールディングス	777,300	1,587.00	1,233,575,100
トレンドマイクロ	324,500	4,875.00	1,581,937,500
日本電信電話	255,100	4,890.00	1,247,439,000
K D D I	387,200	2,898.00	1,122,105,600
N T T ドコモ	456,400	2,634.00	1,202,157,600

双日	4,298,300	272.00	1,169,137,600	
伊藤忠商事	837,200	1,572.00	1,316,078,400	
丸紅	2,130,100	682.30	1,453,367,230	
三井物産	818,100	1,616.50	1,322,458,650	
ヤマダ電機	2,083,100	552.00	1,149,871,200	
めぶきフィナンシャルグループ	3,080,000	420.00	1,293,600,000	
ゆうちょ銀行	948,900	1,353.00	1,283,861,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,380,500	499.40	1,188,821,700	
あおぞら銀行	3,329,000	388.00	1,291,652,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,161,200	667.70	1,443,033,240	
りそなホールディングス	2,524,000	557.30	1,406,625,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	327,800	3,713.00	1,217,121,400	
三井住友フィナンシャルグループ	322,400	3,893.00	1,255,103,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	2,589,000	471.00	1,219,419,000	
みずほフィナンシャルグループ	6,556,300	193.90	1,271,266,570	
SBIホールディングス	938,800	1,503.00	1,411,016,400	
大和証券グループ本社	1,920,000	663.40	1,273,728,000	
野村ホールディングス	2,236,800	658.90	1,473,827,520	
MS&ADインシュアランスグループホール	379,100	3,500.00	1,326,850,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	812,900	1,723.00	1,400,626,700	
東京海上ホールディングス	284,400	4,539.00	1,290,891,600	
イオンフィナンシャルサービス	639,300	2,138.00	1,366,823,400	
オリックス	713,900	1,670.00	1,192,213,000	
日本取引所グループ	767,400	1,571.00	1,205,585,400	
野村不動産ホールディングス	667,000	1,748.00	1,165,916,000	
ユー・エス・エス	665,500	1,870.00	1,244,485,000	
日本郵政	892,300	1,357.00	1,210,851,100	
ベネッセホールディングス	392,600	3,425.00	1,344,655,000	
小計 銘柄数：70			89,593,976,910	
組入時価比率：99.9%			100.0%	
合計			89,593,976,910	

(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。