

2018年4月期（2017年10月8日～2018年4月7日）決算短信

2018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	増田 真一	TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日	2018年6月27日
分配金支払開始日	2018年5月16日

ファンドの運用状況

1. 2018年4月期の運用状況（2017年10月8日～2018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	%
2018年4月期	88,411	(99.9)	81	(0.1)	88,493	(100)
2017年10月期	94,637	(99.9)	112	(0.1)	94,750	(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()	設定口数()	交換口数()	当特定期間末 発行済口数 (+ -)
	千口	千口	千口	千口
2018年4月期	3,821	599	868	3,552
2017年10月期	4,026	479	683	3,821

(3)基準価額

	総資産 ()	負債 ()	純資産 ((-))	1口当り基準価額 ((/ 当特定期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
2018年4月期	89,791	1,298	88,493	24,913
2017年10月期	95,782	1,031	94,750	24,793

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
2018年4月期	343.00
2017年10月期	248.00

2. 会計方針の変更

会計基準等の改正に伴う変更
以外の変更

有(無)
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 (2017年10月7日現在)	当期 (2018年4月7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	118,977,722	76,146,719
株式	94,637,565,680	88,411,584,680
未収入金	-	8,512,670
未収配当金	1,025,532,000	1,295,266,050
流動資産合計	95,782,075,402	89,791,510,119
資産合計	95,782,075,402	89,791,510,119
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	947,759,528	1,218,379,561
未払受託者報酬	11,878,767	11,911,932
未払委託者報酬	64,145,310	64,324,375
未払利息	252	250
その他未払費用	8,070,097	3,392,142
流動負債合計	1,031,853,954	1,298,008,260
負債合計	1,031,853,954	1,298,008,260
純資産の部		
元本等		
元本	57,320,343,389	53,278,352,873
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	37,429,878,059	35,215,148,986
(分配準備積立金)	2,282,131	486,491
元本等合計	94,750,221,448	88,493,501,859
純資産合計	94,750,221,448	88,493,501,859
負債純資産合計	95,782,075,402	89,791,510,119

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2017年4月8日 至 2017年10月7日	当期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7日
営業収益		
受取配当金	1,247,203,025	1,500,704,750
有価証券売買等損益	9,702,828,621	652,704,836
その他収益	1,205,246	1,391,090
営業収益合計	10,951,236,892	2,154,800,676
営業費用		
支払利息	29,513	23,751
受託者報酬	23,424,651	23,985,872
委託者報酬	126,493,045	129,523,606
その他費用	8,412,452	12,029,172

営業費用合計	158,359,661	165,562,401
営業利益又は営業損失(△)	10,792,877,231	1,989,238,275
経常利益又は経常損失(△)	10,792,877,231	1,989,238,275
当期純利益又は当期純損失(△)	10,792,877,231	1,989,238,275
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(△)	29,280,850,141	37,429,878,059
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,091,284,182	6,559,926,348
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,091,284,182	6,559,926,348
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,643,345,327	9,425,564,617
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,643,345,327	9,425,564,617
分配金	1,091,788,168	1,338,329,079
期末剰余金又は期末欠損金(△)	37,429,878,059	35,215,148,986

(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、2017年10月8日から2018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 2017年10月7日現在	当期 2018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 3,821,611 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,552,127 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 24,793 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 24,913 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2017年4月8日 至 2017年10月7日	当期 自 2017年10月8日 至 2018年4月7日																																																
1. 分配金の計算過程 2017年4月8日から2017年7月7日まで	1. 分配金の計算過程 2017年10月8日から2018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>220,027,621 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>4,021,689 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>224,049,310 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>78,396,422 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>145,652,888 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>144,028,640 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>1,624,248 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	220,027,621 円	分配準備積立金	B	4,021,689 円	配当等収益合計額	C=A+B	224,049,310 円	経費	D	78,396,422 円	収益分配可能額	E=C-D	145,652,888 円	収益分配金	F	144,028,640 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,624,248 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>202,381,825 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,282,131 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>204,663,956 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>81,981,921 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>122,682,035 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>119,949,518 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>2,732,517 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	202,381,825 円	分配準備積立金	B	2,282,131 円	配当等収益合計額	C=A+B	204,663,956 円	経費	D	81,981,921 円	収益分配可能額	E=C-D	122,682,035 円	収益分配金	F	119,949,518 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,732,517 円
項目																																																	
当期配当等収益額	A	220,027,621 円																																															
分配準備積立金	B	4,021,689 円																																															
配当等収益合計額	C=A+B	224,049,310 円																																															
経費	D	78,396,422 円																																															
収益分配可能額	E=C-D	145,652,888 円																																															
収益分配金	F	144,028,640 円																																															
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,624,248 円																																															
項目																																																	
当期配当等収益額	A	202,381,825 円																																															
分配準備積立金	B	2,282,131 円																																															
配当等収益合計額	C=A+B	204,663,956 円																																															
経費	D	81,981,921 円																																															
収益分配可能額	E=C-D	122,682,035 円																																															
収益分配金	F	119,949,518 円																																															
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,732,517 円																																															

口数	H	3,600,716 口
1 口当たり分配金	I=F/H	40 円

2017 年 7 月 8 日から 2017 年 10 月 7 日まで

項目		
当期配当等収益額	A	1,028,351,137 円
分配準備積立金	B	1,624,248 円
配当等収益合計額	C=A+B	1,029,975,385 円
経費	D	79,933,726 円
収益分配可能額	E=C-D	950,041,659 円
収益分配金	F	947,759,528 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,282,131 円
口数	H	3,821,611 口
1 口当たり分配金	I=F/H	248 円

口数	H	3,527,927 口
1 口当たり分配金	I=F/H	34 円

2018 年 1 月 8 日から 2018 年 4 月 7 日まで

項目		
当期配当等収益額	A	1,299,690,264 円
分配準備積立金	B	2,732,517 円
配当等収益合計額	C=A+B	1,302,422,781 円
経費	D	83,556,729 円
収益分配可能額	E=C-D	1,218,866,052 円
収益分配金	F	1,218,379,561 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	486,491 円
口数	H	3,552,127 口
1 口当たり分配金	I=F/H	343 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 2017 年 4 月 8 日 至 2017 年 10 月 7 日	当期 自 2017 年 10 月 8 日 至 2018 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 2017 年 10 月 7 日現在	当期 2018 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)に記載しております。</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>

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 2017 年 4 月 8 日 至 2017 年 10 月 7 日	当期 自 2017 年 10 月 8 日 至 2018 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 2017 年 4 月 8 日 至 2017 年 10 月 7 日	当期 自 2017 年 10 月 8 日 至 2018 年 4 月 7 日
期首元本額 60,388,523,830 円	期首元本額 57,320,343,389 円
期中追加設定元本額 7,190,040,632 円	期中追加設定元本額 8,984,895,967 円
期中一部交換元本額 10,258,221,073 円	期中一部交換元本額 13,026,886,483 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2017 年 4 月 8 日 至 2017 年 10 月 7 日	当期 自 2017 年 10 月 8 日 至 2018 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	2,665,543,852	△8,110,875,140
合計	2,665,543,852	△8,110,875,140

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(2018 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	65,600	19,325.00	1,267,720,000	
		大和ハウス工業	309,000	4,057.00	1,253,613,000	
		日本たばこ産業	348,100	3,014.00	1,049,173,400	
		帝人	537,700	1,971.00	1,059,806,700	
		住友化学	1,566,000	603.00	944,298,000	
		デンカ	347,500	3,720.00	1,292,700,000	
		J S R	591,000	2,334.00	1,379,394,000	
		三菱ケミカルホールディングス	1,094,500	994.70	1,088,699,150	
		ダイセル	1,031,700	1,161.00	1,197,803,700	
		D I C	320,300	3,590.00	1,149,877,000	

アステラス製薬	894,100	1,610.00	1,439,501,000
田辺三菱製薬	537,500	2,105.00	1,131,437,500
エーザイ	205,600	6,966.00	1,432,209,600
第一三共	495,600	3,732.00	1,849,579,200
横浜ゴム	519,900	2,507.00	1,303,389,300
ブリヂストン	237,700	4,704.00	1,118,140,800
住友ゴム工業	619,900	1,996.00	1,237,320,400
アマダホールディングス	915,400	1,259.00	1,152,488,600
セガサミーホールディングス	905,400	1,660.00	1,502,964,000
日本精工	784,700	1,365.00	1,071,115,500
三菱重工業	301,300	3,975.00	1,197,667,500
コニカミノルタ	1,218,800	898.00	1,094,482,400
セイコーエプソン	485,600	1,888.00	916,812,800
ヒロセ電機	80,205	14,670.00	1,176,607,350
カシオ計算機	783,400	1,601.00	1,254,223,400
キヤノン	302,200	3,826.00	1,156,217,200
東京エレクトロン	58,800	19,600.00	1,152,480,000
日産自動車	1,189,900	1,115.50	1,327,333,450
トヨタ自動車	183,500	6,728.00	1,234,588,000
本田技研工業	347,000	3,681.00	1,277,307,000
SUBARU	359,500	3,590.00	1,290,605,000
大日本印刷	470,000	2,259.00	1,061,730,000
中国電力	1,005,200	1,302.00	1,308,770,400
東北電力	857,600	1,425.00	1,222,080,000
電源開発	392,600	2,725.00	1,069,835,000
日本航空	322,600	4,312.00	1,391,051,200
フジ・メディア・ホールディングス	771,500	1,803.00	1,391,014,500
トレンドマイクロ	216,800	6,290.00	1,363,672,000
日本電信電話	230,700	5,129.00	1,183,260,300
KDDI	423,900	2,770.00	1,174,203,000
NTTドコモ	472,400	2,806.00	1,325,554,400
双日	4,020,900	335.00	1,347,001,500
伊藤忠商事	662,800	2,062.00	1,366,693,600
丸紅	1,697,200	764.80	1,298,018,560
三井物産	764,900	1,794.00	1,372,230,600
ヤマダ電機	2,185,400	650.00	1,420,510,000

めぶきフィナンシャルグループ	2,784,300	404.00	1,124,857,200	
ゆうちょ銀行	939,300	1,421.00	1,334,745,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,263,500	587.00	1,328,674,500	
あおぞら銀行	297,700	4,225.00	1,257,782,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,750,300	692.80	1,212,607,840	
りそなホールディングス	2,175,400	557.00	1,211,697,800	
三井住友トラスト・ホールディングス	301,700	4,303.00	1,298,215,100	
三井住友フィナンシャルグループ	293,700	4,432.00	1,301,678,400	
みずほフィナンシャルグループ	6,508,200	190.60	1,240,462,920	
SBIホールディングス	772,400	2,579.00	1,992,019,600	
大和証券グループ本社	1,818,000	666.50	1,211,697,000	
野村ホールディングス	1,969,700	616.30	1,213,926,110	
MS&ADインシュアランスグループホール	348,800	3,422.00	1,193,593,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	729,700	1,953.00	1,425,104,100	
東京海上ホールディングス	274,000	4,815.00	1,319,310,000	
イオンフィナンシャルサービス	551,600	2,405.00	1,326,598,000	
オリックス	670,800	1,852.00	1,242,321,600	
三菱UFJリース	2,181,800	624.00	1,361,443,200	
日本取引所グループ	655,600	1,974.00	1,294,154,400	
野村不動産ホールディングス	536,200	2,521.00	1,351,760,200	
飯田グループホールディングス	609,400	2,017.00	1,229,159,800	
みらかホールディングス	252,100	4,325.00	1,090,332,500	
日本郵政	1,017,500	1,290.00	1,312,575,000	
ベネッセホールディングス	319,200	3,890.00	1,241,688,000	
小計 銘柄数 : 70			88,411,584,680	
組入時価比率 : 99.9%			100.0%	
合計			88,411,584,680	

(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(2018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。