

平成28年7月期（平成27年7月16日～平成28年7月15日）決算短信

平成28年8月24日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS 素材・化学(TOPIX-17)上場投信
 コード番号 (1620)
 連動対象指標 TOPIX-17 素材・化学
 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28年9月28日
 分配金支払開始日 平成28年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年7月期の運用状況（平成27年7月16日～平成28年7月15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28年7月期	779	(99.6)	3	(0.4)	782	(100)
平成27年7月期	898	(99.6)	3	(0.4)	901	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成28年7月期	46	0	0	46
平成27年7月期	46	0	0	46

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数) × 10
	百万円	百万円	百万円	円
平成28年7月期	795	13	782	169,121
平成27年7月期	913	11	901	194,881

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成28年7月期	2,510.00
平成27年7月期	2,090.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更
 ② ①以外の変更

有 無
 有 無

II 財務諸表等

NEXT FUNDS 素材・化学(TOPIX-17)上場投信

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (平成27年7月15日現在)	第9期 (平成28年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,091,407	5,252,414
株式	898,674,100	779,711,020
未収入金	9,363,600	9,407,400
未収配当金	1,123,300	1,424,500
未収利息	7	-
流動資産合計	913,252,414	795,795,334
資産合計	913,252,414	795,795,334
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,672,938	11,616,782
未払受託者報酬	236,477	210,516
未払委託者報酬	1,276,933	1,136,708
未払利息	-	7
その他未払費用	119,466	105,062
流動負債合計	11,305,814	13,069,075
負債合計	11,305,814	13,069,075
純資産の部		
元本等		
元本	608,562,018	608,562,018
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	293,384,582	174,164,241
(分配準備積立金)	32,571	41,553
元本等合計	901,946,600	782,726,259
純資産合計	901,946,600	782,726,259
負債純資産合計	913,252,414	795,795,334

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	第9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日
営業収益		
受取配当金	12,805,750	14,770,980
受取利息	4,042	1,853
有価証券売買等損益	247,215,905	△119,229,323
その他収益	1,285	1,549
営業収益合計	260,026,982	△104,454,941
営業費用		
支払利息	-	618

受託者報酬	431,166	446,928
委託者報酬	2,328,198	2,413,256
その他費用	350,538	287,816
営業費用合計	3,109,902	3,148,618
営業利益又は営業損失(△)	256,917,080	△107,603,559
経常利益又は経常損失(△)	256,917,080	△107,603,559
当期純利益又は当期純損失(△)	256,917,080	△107,603,559
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(△)	46,140,440	293,384,582
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	9,672,938	11,616,782
期末剰余金又は期末欠損金(△)	293,384,582	174,164,241

(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	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成 27 年 7 月 16 日から平成 28 年 7 月 15 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 8 期 平成 27 年 7 月 15 日現在	第 9 期 平成 28 年 7 月 15 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 46,282 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 46,282 口
2. 計算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 19,488.1 円 (10 口当たり純資産額) (194,881 円)	2. 計算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 16,912.1 円 (10 口当たり純資産額) (169,121 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日																																																
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																
<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>12,811,077 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>4,334 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>12,815,411 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,109,902 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>9,705,509 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>9,672,938 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>32,571 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	12,811,077 円	分配準備積立金	B	4,334 円	配当等収益合計額	C=A+B	12,815,411 円	経費	D	3,109,902 円	収益分配可能額	E=C-D	9,705,509 円	収益分配金	F	9,672,938 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	32,571 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>14,773,764 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>32,571 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>14,806,335 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,148,000 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>11,658,335 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>11,616,782 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>41,553 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	14,773,764 円	分配準備積立金	B	32,571 円	配当等収益合計額	C=A+B	14,806,335 円	経費	D	3,148,000 円	収益分配可能額	E=C-D	11,658,335 円	収益分配金	F	11,616,782 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	41,553 円
項目																																																	
当期配当等収益額	A	12,811,077 円																																															
分配準備積立金	B	4,334 円																																															
配当等収益合計額	C=A+B	12,815,411 円																																															
経費	D	3,109,902 円																																															
収益分配可能額	E=C-D	9,705,509 円																																															
収益分配金	F	9,672,938 円																																															
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	32,571 円																																															
項目																																																	
当期配当等収益額	A	14,773,764 円																																															
分配準備積立金	B	32,571 円																																															
配当等収益合計額	C=A+B	14,806,335 円																																															
経費	D	3,148,000 円																																															
収益分配可能額	E=C-D	11,658,335 円																																															
収益分配金	F	11,616,782 円																																															
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	41,553 円																																															

口数	H	46,282 口
10 口当たり分配金	$I=F/H \times 10$	2,090 円

口数	H	46,282 口
10 口当たり分配金	$I=F/H \times 10$	2,510 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。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 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

第 8 期 平成 27 年 7 月 15 日現在	第 9 期 平成 28 年 7 月 15 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 (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。</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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日

至 平成27年7月15日	至 平成28年7月15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

第8期 自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	第9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日
期首元本額 608,562,018円	期首元本額 608,562,018円
期中追加設定元本額 0円	期中追加設定元本額 0円
期中一部交換元本額 0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	第8期 自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	第9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15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	244,100,030	△116,509,038
合計	244,100,030	△116,509,038

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28年7月15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	片倉工業	700	1,250.00	875,000	
		グンゼ	5,000	289.00	1,445,000	
		東洋紡	23,000	199.00	4,577,000	
		ユニチカ	17,000	59.00	1,003,000	
		富士紡ホールディングス	3,000	271.00	813,000	
		倉敷紡績	6,000	189.00	1,134,000	
		シキボウ	4,000	105.00	420,000	
		日本毛織	1,800	702.00	1,263,600	
		大東紡織	1,000	63.00	63,000	
		トーア紡コーポレーション	200	470.00	94,000	
		ダイドーリミテッド	600	440.00	264,000	
		帝国繊維	600	1,333.00	799,800	
		帝人	24,000	388.00	9,312,000	
		東レ	42,000	952.60	40,009,200	

サカイオーベックス	2,000	146.00	292,000
住江織物	1,000	193.00	193,000
日本フェルト	300	464.00	139,200
日東製網	1,000	161.00	161,000
芦森工業	1,000	168.00	168,000
アツギ	4,000	107.00	428,000
ダイニック	1,000	155.00	155,000
セーレン	1,400	1,015.00	1,421,000
東海染工	1,000	120.00	120,000
小松精練	900	694.00	624,600
ワコールホールディングス	3,000	1,122.00	3,366,000
ホギメディカル	400	7,180.00	2,872,000
レナウン	1,600	107.00	171,200
クラウディア	100	498.00	49,800
T S I ホールディングス	2,600	629.00	1,635,400
三陽商会	3,000	202.00	606,000
ナイガイ	2,000	43.00	86,000
オンワードホールディングス	4,000	674.00	2,696,000
ルック	1,000	134.00	134,000
キムラタン	24,000	7.00	168,000
ゴールドウイン	200	4,925.00	985,000
デサント	1,300	1,143.00	1,485,900
キング	300	350.00	105,000
ヤマトインターナショナル	400	389.00	155,600
特種東海製紙	3,000	377.00	1,131,000
王子ホールディングス	23,000	421.00	9,683,000
日本製紙	3,000	1,803.00	5,409,000
三菱製紙	9,000	68.00	612,000
北越紀州製紙	3,600	726.00	2,613,600
中越パルプ工業	2,000	213.00	426,000
巴川製紙所	1,000	176.00	176,000
大王製紙	2,600	1,163.00	3,023,800
レンゴー	5,000	668.00	3,340,000
トーモク	2,000	299.00	598,000
ザ・パック	400	2,858.00	1,143,200
クラレ	9,100	1,305.00	11,875,500

旭化成	36,000	765.20	27,547,200
共和レザー	400	812.00	324,800
昭和電工	3,800	1,021.00	3,879,800
住友化学	43,000	451.00	19,393,000
日本化成	1,000	105.00	105,000
住友精化	1,000	641.00	641,000
日産化学工業	3,500	3,205.00	11,217,500
ラサ工業	2,000	97.00	194,000
クレハ	4,000	392.00	1,568,000
テイカ	1,000	495.00	495,000
石原産業	10,000	65.00	650,000
片倉コープアグリ	1,000	199.00	199,000
日東エフシー	300	870.00	261,000
日本曹達	4,000	451.00	1,804,000
東ソー	16,000	513.00	8,208,000
トクヤマ	10,000	289.00	2,890,000
セントラル硝子	6,000	464.00	2,784,000
東亜合成	3,600	1,044.00	3,758,400
大阪ソーダ	2,000	430.00	860,000
関東電化工業	1,000	1,064.00	1,064,000
デンカ	12,000	460.00	5,520,000
信越化学工業	10,400	6,443.00	67,007,200
日本カーバイド工業	2,000	143.00	286,000
堺化学工業	2,000	283.00	566,000
エア・ウォーター	5,000	1,629.00	8,145,000
大陽日酸	4,400	978.00	4,303,200
日本化学工業	2,000	216.00	432,000
日本パーカライジング	3,000	1,251.00	3,753,000
高圧ガス工業	1,000	654.00	654,000
チタン工業	1,000	171.00	171,000
四国化成工業	1,000	867.00	867,000
戸田工業	1,000	280.00	280,000
ステラ ケミファ	300	3,485.00	1,045,500
保土谷化学工業	2,000	272.00	544,000
日本触媒	800	6,310.00	5,048,000
大日精化工業	2,000	448.00	896,000

カネカ	8,000	763.00	6,104,000
三菱瓦斯化学	10,000	578.00	5,780,000
三井化学	25,000	392.00	9,800,000
J S R	5,400	1,492.00	8,056,800
東京応化工業	1,200	2,776.00	3,331,200
大阪有機化学工業	400	584.00	233,600
三菱ケミカルホールディングス	38,700	527.10	20,398,770
日本合成化学工業	1,000	579.00	579,000
ダイセル	7,800	1,137.00	8,868,600
住友ベークライト	5,000	494.00	2,470,000
積水化学工業	13,100	1,457.00	19,086,700
日本ゼオン	5,000	719.00	3,595,000
アイカ工業	1,700	2,445.00	4,156,500
宇部興産	31,000	182.00	5,642,000
積水樹脂	900	1,677.00	1,509,300
タキロン	1,000	493.00	493,000
旭有機材	2,000	193.00	386,000
日立化成	2,900	2,052.00	5,950,800
ニチバン	1,000	784.00	784,000
リケンテクノス	1,200	440.00	528,000
大倉工業	1,000	278.00	278,000
積水化成成品工業	1,000	320.00	320,000
群栄化学工業	2,000	300.00	600,000
タイガースポリマー	300	514.00	154,200
ミライアル	200	734.00	146,800
ダイキアクシス	100	843.00	84,300
ダイキョーニシカラ	700	1,292.00	904,400
日本化薬	4,000	985.00	3,940,000
カーリットホールディングス	500	477.00	238,500
日本精化	500	793.00	396,500
扶桑化学工業	400	1,630.00	652,000
ADEKA	2,800	1,315.00	3,682,000
日油	4,000	856.00	3,424,000
新日本理化	900	140.00	126,000
ハリマ化成グループ	500	518.00	259,000
花王	15,500	5,968.00	92,504,000

第一工業製薬	1,000	344.00	344,000
ニイタカ	100	1,337.00	133,700
三洋化成工業	2,000	861.00	1,722,000
大日本塗料	3,000	194.00	582,000
日本ペイントホールディングス	4,500	2,764.00	12,438,000
関西ペイント	6,500	2,114.00	13,741,000
中国塗料	2,000	683.00	1,366,000
日本特殊塗料	400	1,071.00	428,400
藤倉化成	800	592.00	473,600
太陽ホールディングス	400	3,460.00	1,384,000
D I C	2,300	2,377.00	5,467,100
サカタインクス	1,200	1,301.00	1,561,200
東洋インキSCホールディングス	6,000	454.00	2,724,000
T&K TOKA	400	891.00	356,400
富士フイルムホールディングス	13,200	4,037.00	53,288,400
資生堂	11,000	2,885.00	31,735,000
ライオン	7,000	1,571.00	10,997,000
高砂香料工業	400	2,726.00	1,090,400
マンダム	500	4,860.00	2,430,000
ミルボン	300	4,695.00	1,408,500
ファンケル	1,300	1,470.00	1,911,000
コーセー	900	9,000.00	8,100,000
コタ	200	1,120.00	224,000
シーズ・ホールディングス	700	2,546.00	1,782,200
シーボン	100	2,062.00	206,200
ポーラ・オルビスホールディングス	600	10,230.00	6,138,000
ノエビアホールディングス	400	3,225.00	1,290,000
アジュバンコスメジャパン	100	911.00	91,100
エステー	400	1,170.00	468,000
アグロ カネショウ	200	1,060.00	212,000
コニシ	900	1,322.00	1,189,800
長谷川香料	700	1,839.00	1,287,300
星光PMC	300	1,010.00	303,000
小林製薬	1,700	4,490.00	7,633,000
荒川化学工業	500	972.00	486,000
メック	400	873.00	349,200

日本高純度化学	200	2,085.00	417,000
タカラバイオ	1,200	1,299.00	1,558,800
JCU	200	3,280.00	656,000
新田ゼラチン	400	767.00	306,800
OATアグリオ	100	1,272.00	127,200
デクセリアルズ	1,700	766.00	1,302,200
アース製薬	400	5,000.00	2,000,000
イハラケミカル工業	900	1,069.00	962,100
北興化学工業	1,000	287.00	287,000
大成ラミック	200	2,869.00	573,800
クミアイ化学工業	1,200	642.00	770,400
日本農薬	1,300	510.00	663,000
アキレス	5,000	140.00	700,000
有沢製作所	900	550.00	495,000
日東電工	4,500	6,871.00	30,919,500
レック	200	1,886.00	377,200
きもと	900	173.00	155,700
藤森工業	500	2,141.00	1,070,500
前澤化成工業	400	1,032.00	412,800
JSP	400	2,145.00	858,000
エフピコ	500	5,390.00	2,695,000
天馬	400	1,699.00	679,600
信越ポリマー	1,100	634.00	697,400
東リ	1,000	316.00	316,000
ニフコ	1,100	5,610.00	6,171,000
日本バルカー工業	2,000	264.00	528,000
ユニ・チャーム	11,700	2,181.50	25,523,550
小計	銘柄数：185		779,711,020
	組入時価比率：99.6%		100.0%
合計			779,711,020

(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28年7月15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。