

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 鉄鋼・非鉄(TOPIX-17)上場投信
 コード番号 (1623)
 連動対象指標 TOPIX-17 鉄鋼・非鉄
 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	689	(99.7)	2	(0.3)	691	(100)
平成27年7月期	260	(99.7)	0	(0.3)	261	(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	11	69	39	41
平成27年7月期	51	119	159	11

(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	697	5	691	166,992
平成27年7月期	270	9	261	231,540

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成28年7月期	1,130.00
平成27年7月期	6,290.00

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 鉄鋼・非鉄(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	3,105,440	2,917,053
株式	260,763,850	689,582,100
未収入金	7,097,350	4,860,900
未収配当金	1,800	2,200
未収利息	5	-
流動資産合計	270,968,445	697,362,253
資産合計	270,968,445	697,362,253
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	7,105,184	4,682,607
未払受託者報酬	332,502	99,952
未払委託者報酬	1,795,463	539,692
未払利息	-	3
その他未払費用	187,937	43,167
流動負債合計	9,421,086	5,365,421
負債合計	9,421,086	5,365,421
純資産の部		
元本等		
元本	349,803,232	1,283,241,513
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△88,255,873	△591,244,681
(分配準備積立金)	3,695	20,954
元本等合計	261,547,359	691,996,832
純資産合計	261,547,359	691,996,832
負債純資産合計	270,968,445	697,362,253

(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	11,634,850	5,977,000
受取利息	2,084	706
有価証券売買等損益	331,293,078	△28,100,392
その他収益	718	227
営業収益合計	342,930,730	△22,122,459
営業費用		
支払利息	-	273
受託者報酬	633,717	182,546

委託者報酬	3,421,976	985,603
その他費用	509,246	109,645
営業費用合計	4,564,939	1,278,067
営業利益又は営業損失(△)	338,365,791	△23,400,526
経常利益又は経常損失(△)	338,365,791	△23,400,526
当期純利益又は当期純損失(△)	338,365,791	△23,400,526
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(△)	△481,328,432	△88,255,873
剰余金増加額又は欠損金減少額	860,811,740	482,044,509
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	860,811,740	482,044,509
剰余金減少額又は欠損金増加額	798,999,788	956,950,184
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	798,999,788	956,950,184
分配金	7,105,184	4,682,607
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△88,255,873	△591,244,681

(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る場合、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 11,296 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 41,439 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 88,255,873 円	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 591,244,681 円
3. 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 23,154.0 円 (10 口当たり純資産額) (231,540 円)	3. 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 16,699.2 円 (10 口当たり純資産額) (166,992 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>11,637,652 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	11,637,652 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>5,977,660 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	5,977,660 円
項目													
当期配当等収益額	A	11,637,652 円											
項目													
当期配当等収益額	A	5,977,660 円											

分配準備積立金	B	36,166 円
配当等収益合計額	C=A+B	11,673,818 円
経費	D	4,564,939 円
収益分配可能額	E=C-D	7,108,879 円
収益分配金	F	7,105,184 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,695 円
口数	H	11,296 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	6,290 円

分配準備積立金	B	3,695 円
配当等収益合計額	C=A+B	5,981,355 円
経費	D	1,277,794 円
収益分配可能額	E=C-D	4,703,561 円
収益分配金	F	4,682,607 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	20,954 円
口数	H	41,439 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	1,130 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</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>

<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)

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
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 1,592,508,942 円	期首元本額 349,803,232 円
期中追加設定元本額 3,704,891,880 円	期中追加設定元本額 2,163,664,290 円
期中一部交換元本額 4,947,597,590 円	期中一部交換元本額 1,230,226,009 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	△3,195,968	12,878,936
合計	△3,195,968	12,878,936

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	新日鐵住金	79,900	2,167.00	173,143,300	
		神戸製鋼所	326,000	94.00	30,644,000	
		中山製鋼所	20,000	52.00	1,040,000	
		合同製鐵	10,000	168.00	1,680,000	
		ジェイ エフ イー ホールディングス	48,400	1,515.50	73,350,200	
		日新製鋼	8,100	1,360.00	11,016,000	
		東京製鐵	9,800	649.00	6,360,200	
		共英製鋼	1,900	1,755.00	3,334,500	
		大和工業	3,900	2,578.00	10,054,200	

東京鐵鋼	4,000	377.00	1,508,000
大阪製鐵	1,100	1,850.00	2,035,000
淀川製鋼所	2,600	2,611.00	6,788,600
東洋鋼鈑	4,200	254.00	1,066,800
丸一鋼管	5,900	3,750.00	22,125,000
モリ工業	3,000	294.00	882,000
大同特殊鋼	30,000	404.00	12,120,000
日本高周波鋼業	7,000	70.00	490,000
日本冶金工業	13,000	132.00	1,716,000
山陽特殊製鋼	11,000	526.00	5,786,000
愛知製鋼	10,000	496.00	4,960,000
日立金属	20,300	1,114.00	22,614,200
日本金属	5,000	96.00	480,000
大平洋金属	12,000	302.00	3,624,000
新日本電工	10,000	164.00	1,640,000
栗本鐵工所	8,000	162.00	1,296,000
虹技	2,000	157.00	314,000
日本鑄鐵管	2,000	134.00	268,000
三菱製鋼	12,000	169.00	2,028,000
日亜鋼業	2,400	226.00	542,400
日本精線	1,000	407.00	407,000
シンニッタン	1,600	545.00	872,000
新家工業	3,000	130.00	390,000
大紀アルミニウム工業所	3,000	307.00	921,000
日本輕金属ホールディングス	40,100	231.00	9,263,100
三井金属鈹業	45,000	201.00	9,045,000
東邦亜鉛	9,000	373.00	3,357,000
三菱マテリアル	111,000	281.00	31,191,000
住友金属鈹山	49,000	1,201.00	58,849,000
DOWAホールディングス	23,000	585.00	13,455,000
古河機械金属	28,000	153.00	4,284,000
エス・サイエンス	8,000	32.00	256,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,700	1,341.00	2,279,700
東邦チタニウム	3,000	723.00	2,169,000
UACJ	25,000	273.00	6,825,000
古河電気工業	56,000	257.00	14,392,000

	住友電気工業	70,900	1,426.00	101,103,400	
	フジクラ	25,000	493.00	12,325,000	
	昭和電線ホールディングス	21,000	59.00	1,239,000	
	東京特殊電線	300	735.00	220,500	
	タツタ電線	3,700	303.00	1,121,100	
	沖電線	2,000	187.00	374,000	
	カナレ電気	300	1,875.00	562,500	
	平河ヒューテック	800	887.00	709,600	
	リョービ	11,000	451.00	4,961,000	
	アーレステイ	2,100	753.00	1,581,300	
	アサヒホールディングス	2,700	1,675.00	4,522,500	
	小計 銘柄数：56			689,582,100	
	組入時価比率：99.7%			100.0%	
	合計			689,582,100	

(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。