

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 小売(TOPIX-17)上場投信
 コード番号 (1630)
 連動対象指標 TOPIX-17 小売
 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	518	(99.7)	1	(0.3)	519	(100)
平成27年7月期	609	(99.8)	1	(0.2)	610	(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	30	39	39	30
平成27年7月期	348	19	337	30

(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	526	7	519	171,488
平成27年7月期	644	33	610	202,503

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成28年7月期	2,140.00
平成27年7月期	10,910.00

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 小売(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	3,423,347	2,281,552
株式	609,155,800	518,088,800
未収入金	31,295,500	6,188,700
未収配当金	294,360	325,875
未収利息	6	-
流動資産合計	644,169,013	526,884,927
資産合計	644,169,013	526,884,927
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	32,877,285	6,481,846
未払受託者報酬	151,845	142,406
未払委託者報酬	819,903	768,902
未払利息	-	3
その他未払費用	77,662	70,932
流動負債合計	33,926,695	7,464,089
負債合計	33,926,695	7,464,089
純資産の部		
元本等		
元本	296,347,590	297,862,026
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	313,894,728	221,558,812
(分配準備積立金)	17,752	23,348
元本等合計	610,242,318	519,420,838
純資産合計	610,242,318	519,420,838
負債純資産合計	644,169,013	526,884,927

(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	40,137,841	8,933,989
受取利息	6,122	2,176
有価証券売買等損益	420,118,727	△40,605,904
その他収益	154,441	36,770
営業収益合計	460,417,131	△31,632,969
営業費用		
支払利息	-	378

受託者報酬	1,093,904	354,066
委託者報酬	5,906,954	1,911,816
その他費用	494,886	219,233
営業費用合計	7,495,744	2,485,493
営業利益又は営業損失(△)	452,921,387	△34,118,462
経常利益又は経常損失(△)	452,921,387	△34,118,462
当期純利益又は当期純損失(△)	452,921,387	△34,118,462
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(△)	1,623,538,270	313,894,728
剰余金増加額又は欠損金減少額	88,357,554	350,440,368
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	88,357,554	350,440,368
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,818,045,198	402,175,976
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,818,045,198	402,175,976
分配金	32,877,285	6,481,846
期末剰余金又は期末欠損金(△)	313,894,728	221,558,812

(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 30,135 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 30,289 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 20,250.3 円 (10 口当たり純資産額) (202,503 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 17,148.8 円 (10 口当たり純資産額) (171,488 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>40,298,404 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>92,377 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>40,390,781 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>7,495,744 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	40,298,404 円	分配準備積立金	B	92,377 円	配当等収益合計額	C=A+B	40,390,781 円	経費	D	7,495,744 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>8,972,557 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>17,752 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>8,990,309 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,485,115 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	8,972,557 円	分配準備積立金	B	17,752 円	配当等収益合計額	C=A+B	8,990,309 円	経費	D	2,485,115 円
項目																															
当期配当等収益額	A	40,298,404 円																													
分配準備積立金	B	92,377 円																													
配当等収益合計額	C=A+B	40,390,781 円																													
経費	D	7,495,744 円																													
項目																															
当期配当等収益額	A	8,972,557 円																													
分配準備積立金	B	17,752 円																													
配当等収益合計額	C=A+B	8,990,309 円																													
経費	D	2,485,115 円																													

収益分配可能額	E=C-D	32,895,037 円
収益分配金	F	32,877,285 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	17,752 円
口数	H	30,135 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	10,910 円

収益分配可能額	E=C-D	6,505,194 円
収益分配金	F	6,481,846 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	23,348 円
口数	H	30,289 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,140 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。</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</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>

ります。

(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 3,422,310,672円	期首元本額 296,347,590円
期中追加設定元本額 196,483,320円	期中追加設定元本額 393,261,660円
期中一部交換元本額 3,322,446,402円	期中一部交換元本額 391,747,224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	189,264,592	△59,061,597
合計	189,264,592	△59,061,597

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	ローソン	2,000	7,860.00	15,720,000	
		サンエー	400	5,130.00	2,052,000	
		ダイユーエイト	100	654.00	65,400	
		カワチ薬品	400	2,320.00	928,000	
		エービーシー・マート	700	6,630.00	4,641,000	
		ハードオフコーポレーション	300	1,232.00	369,600	
		アスクル	600	3,700.00	2,220,000	
		ゲオホールディングス	900	1,454.00	1,308,600	
		アダストリア	1,000	3,175.00	3,175,000	
		ジーフット	300	719.00	215,700	
		シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	72.00	72,000	
		くらコーポレーション	300	5,660.00	1,698,000	

キャンドウ	300	1,740.00	522,000
パル	300	2,315.00	694,500
エディオン	2,300	864.00	1,987,200
サーラコーポレーション	700	594.00	415,800
ワッツ	200	977.00	195,400
ハローズ	200	2,003.00	400,600
あみやき亭	100	4,000.00	400,000
ひらまつ	700	640.00	448,000
ゲンキー	100	3,930.00	393,000
サッポロドラッグストア	100	2,108.00	210,800
大黒天物産	100	4,635.00	463,500
ハニーズ	500	1,385.00	692,500
ファーマライズホールディングス	100	493.00	49,300
アルペン	500	1,687.00	843,500
クオール	500	1,331.00	665,500
ジェイアイエヌ	400	4,150.00	1,660,000
ビックカメラ	3,100	926.00	2,870,600
DCMホールディングス	2,600	904.00	2,350,400
Monotaro	1,900	3,200.00	6,080,000
東京一番フーズ	100	531.00	53,100
ダイヤモンドダイニング	100	1,017.00	101,700
きちり	100	608.00	60,800
アークランドサービスホールディングス	200	2,862.00	572,400
J. フロント リテイリング	6,700	1,115.00	7,470,500
ドトール・日レスホールディングス	900	1,960.00	1,764,000
マツモトキヨシホールディングス	1,100	4,920.00	5,412,000
broncoピリー	300	3,335.00	1,000,500
スタートトゥデイ	1,600	5,100.00	8,160,000
トレジャー・ファクトリー	200	989.00	197,800
物語コーポレーション	100	5,190.00	519,000
ココカラファイン	600	4,895.00	2,937,000
三越伊勢丹ホールディングス	10,600	1,000.00	10,600,000
ウエルシアホールディングス	500	6,740.00	3,370,000
クリエイトSDホールディングス	800	2,681.00	2,144,800
丸善CHIホールディングス	600	379.00	227,400

ミサワ	100	438.00	43,800
エー・ピーカンパニー	100	849.00	84,900
チムニー	100	2,872.00	287,200
シュッピン	200	1,020.00	204,000
ネクステージ	100	855.00	85,500
ジョイフル本田	900	2,448.00	2,203,200
鳥貴族	100	2,026.00	202,600
麒麟堂ホールディングス	200	828.00	165,600
ホットランド	200	920.00	184,000
すかいらく	1,600	1,357.00	2,171,200
綿半ホールディングス	200	1,490.00	298,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	1,800	992.00	1,785,600
ブックオフコーポレーション	300	824.00	247,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	892.00	178,400
あさひ	400	1,502.00	600,800
日本調剤	100	4,575.00	457,500
コスモス薬品	300	21,150.00	6,345,000
トーエル	300	798.00	239,400
一六堂	100	406.00	40,600
セブン&アイ・ホールディングス	22,300	4,500.00	100,350,000
薬王堂	100	5,790.00	579,000
クリエイト・レストランツ・ホールディング	1,400	1,075.00	1,505,000
ツルハホールディングス	1,200	11,700.00	14,040,000
サンマルクホールディングス	400	3,130.00	1,252,000
フェリシモ	200	1,010.00	202,000
トリドール	700	2,960.00	2,072,000
クスリのアオキ	500	4,840.00	2,420,000
メディカルシステムネットワーク	600	504.00	302,400
総合メディカル	300	3,940.00	1,182,000
はるやま商事	200	748.00	149,600
カッパ・クリエイト	700	1,320.00	924,000
ライトオン	400	1,281.00	512,400
ジーンズメイト	200	173.00	34,600
良品計画	600	22,690.00	13,614,000
三城ホールディングス	700	420.00	294,000

アルビス	100	2,135.00	213,500
コナカ	700	513.00	359,100
ハウス オブ ローゼ	100	1,404.00	140,400
G-7ホールディングス	200	1,227.00	245,400
イオン北海道	400	516.00	206,400
コジマ	800	241.00	192,800
ヒマラヤ	200	916.00	183,200
コーナン商事	800	2,002.00	1,601,600
エコス	200	1,253.00	250,600
ワタミ	600	1,045.00	627,000
マルシェ	100	819.00	81,900
ドンキホーテホールディングス	3,400	3,895.00	13,243,000
西松屋チェーン	1,100	1,462.00	1,608,200
ゼンショーホールディングス	2,700	1,534.00	4,141,800
幸楽苑ホールディングス	300	1,546.00	463,800
ハークスレイ	100	983.00	98,300
サイゼリヤ	900	2,269.00	2,042,100
V Tホールディングス	1,800	521.00	937,800
魚力	200	1,394.00	278,800
ポプラ	100	494.00	49,400
ユナイテッドアローズ	800	3,025.00	2,420,000
ハイデイ日高	500	2,597.00	1,298,500
京都きもの友禅	400	827.00	330,800
コロワイド	1,800	1,881.00	3,385,800
ピーシーデポコーポレーション	600	1,398.00	838,800
荻番屋	500	3,440.00	1,720,000
トップカルチャー	200	458.00	91,600
P L A N T	100	1,179.00	117,900
スギホールディングス	1,000	5,190.00	5,190,000
スクロール	800	385.00	308,000
ヨンドシーホールディングス	400	2,071.00	828,400
ファミリーマート	1,600	6,090.00	9,744,000
木曾路	700	2,344.00	1,640,800
サトレストラシテムズ	600	815.00	489,000
千趣会	1,100	711.00	782,100
タカキュー	400	176.00	70,400

ケーヨー	900	532.00	478,800
上新電機	1,000	895.00	895,000
日本瓦斯	800	2,322.00	1,857,600
ベスト電器	1,700	104.00	176,800
ロイヤルホールディングス	900	1,901.00	1,710,900
いなげや	600	1,443.00	865,800
島忠	1,400	2,264.00	3,169,600
チヨダ	600	2,299.00	1,379,400
ライフコーポレーション	300	3,135.00	940,500
リンガーハット	500	2,422.00	1,211,000
MrMax	500	290.00	145,000
テンアライド	500	365.00	182,500
AOKIホールディングス	1,200	1,099.00	1,318,800
オークワ	1,000	1,021.00	1,021,000
コメリ	800	2,669.00	2,135,200
青山商事	1,000	3,675.00	3,675,000
しまむら	600	14,710.00	8,826,000
はせがわ	200	425.00	85,000
高島屋	8,000	784.00	6,272,000
松屋	1,100	716.00	787,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,700	1,373.00	3,707,100
近鉄百貨店	2,000	338.00	676,000
丸栄	1,000	83.00	83,000
ニッセンホールディングス	800	93.00	74,400
パルコ	500	865.00	432,500
丸井グループ	6,500	1,500.00	9,750,000
アクシアル リテイリング	400	3,640.00	1,456,000
井筒屋	3,000	47.00	141,000
イオン	22,000	1,498.00	32,956,000
ユニーグループ・ホールディングス	5,100	836.00	4,263,600
イズミ	1,100	4,170.00	4,587,000
東武ストア	1,000	296.00	296,000
平和堂	1,100	2,025.00	2,227,500
フジ	600	2,428.00	1,456,800
ヤオコー	600	4,680.00	2,808,000
ゼビオホールディングス	700	1,469.00	1,028,300

ケーズホールディングス	2,300	1,983.00	4,560,900	
O l y m p i c グループ	300	528.00	158,400	
日産東京販売ホールディングス	900	223.00	200,700	
アインホールディングス	600	6,820.00	4,092,000	
元気寿司	100	2,095.00	209,500	
ヤマダ電機	16,200	544.00	8,812,800	
アークランドサカモト	900	1,172.00	1,054,800	
ニトリホールディングス	2,300	12,670.00	29,141,000	
愛眼	400	208.00	83,200	
ケーユーホールディングス	300	756.00	226,800	
吉野家ホールディングス	2,000	1,423.00	2,846,000	
松屋フーズ	300	2,808.00	842,400	
サガミチェーン	700	1,207.00	844,900	
関西スーパーマーケット	400	1,027.00	410,800	
王将フードサービス	400	3,870.00	1,548,000	
プレナス	600	1,701.00	1,020,600	
ミニストップ	400	1,707.00	682,800	
アークス	1,000	2,693.00	2,693,000	
バローホールディングス	1,100	2,825.00	3,107,500	
ベルク	300	4,135.00	1,240,500	
大庄	300	1,518.00	455,400	
ファーストリテイリング	900	32,660.00	29,394,000	
サンドラッグ	1,100	8,960.00	9,856,000	
サックスパー ホールディングス	500	1,019.00	509,500	
ヤマザワ	100	1,665.00	166,500	
やまや	100	1,679.00	167,900	
ベルーナ	1,300	622.00	808,600	
小計	銘柄数 : 181		518,088,800	
	組入時価比率 : 99.7%		100.0%	
合計			518,088,800	

(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。