

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 金融(除く銀行)(TOPIX-17)上場投信
 コード番号 (1632)
 連動対象指標 TOPIX-17 金融(除く銀行)
 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	787	(99.8)	1	(0.2)	788	(100)
平成27年7月期	317	(99.5)	1	(0.5)	319	(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	22	129	69	82
平成27年7月期	65	0	43	22

(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	807	18	788	95,993
平成27年7月期	335	16	319	144,576

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成28年7月期	2,160.00
平成27年7月期	6,960.00

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 金融（除く銀行）(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	4,625,509	3,378,595
株式	317,838,070	787,328,060
未収入金	13,448,900	17,137,090
未収利息	8	-
流動資産合計	335,912,487	807,843,745
資産合計	335,912,487	807,843,745
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	15,380,208	17,752,608
未払受託者報酬	153,099	164,675
未払委託者報酬	826,684	889,165
未払利息	-	4
その他未払費用	67,509	85,946
流動負債合計	16,427,500	18,892,398
負債合計	16,427,500	18,892,398
純資産の部		
元本等		
元本	319,603,374	1,188,685,044
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△118,387	△399,733,697
(分配準備積立金)	14,393	27,648
元本等合計	319,484,987	788,951,347
純資産合計	319,484,987	788,951,347
負債純資産合計	335,912,487	807,843,745

(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	17,851,870	19,667,315
受取利息	3,592	2,475
有価証券売買等損益	205,480,477	△127,047,652
その他収益	1,407	805
営業収益合計	223,337,346	△107,377,057
営業費用		
支払利息	-	713
受託者報酬	349,372	270,018

委託者報酬	1,886,488	1,457,953
その他費用	248,218	176,048
営業費用合計	2,484,078	1,904,732
営業利益又は営業損失（△）	220,853,268	△109,281,789
経常利益又は経常損失（△）	220,853,268	△109,281,789
当期純利益又は当期純損失（△）	220,853,268	△109,281,789
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（△）	△234,334,922	△118,387
剰余金増加額又は欠損金減少額	28,743,475	149,779,690
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	28,743,475	149,779,690
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	422,360,603
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	422,360,603
分配金	15,380,208	17,752,608
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△118,387	△399,733,697

(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 22,098 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 82,188 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 118,387 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 399,733,697 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 14,457.6 円 (10 口当たり純資産額) (144,576 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 9,599.3 円 (10 口当たり純資産額) (95,993 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>17,856,869 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	17,856,869 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>19,669,882 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	19,669,882 円
項目													
当期配当等収益額	A	17,856,869 円											
項目													
当期配当等収益額	A	19,669,882 円											

分配準備積立金	B	21,810円
配当等収益合計額	C=A+B	17,878,679円
経費	D	2,484,078円
収益分配可能額	E=C-D	15,394,601円
収益分配金	F	15,380,208円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	14,393円
口数	H	22,098口
10口当たり分配金	I=F/H×10	6,960円

分配準備積立金	B	14,393円
配当等収益合計額	C=A+B	19,684,275円
経費	D	1,904,019円
収益分配可能額	E=C-D	17,780,256円
収益分配金	F	17,752,608円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,648円
口数	H	82,188口
10口当たり分配金	I=F/H×10	2,160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。</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>

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)

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 942,597,099円	期首元本額 319,603,374円
期中追加設定元本額 0円	期中追加設定元本額 1,876,863,510円
期中一部交換元本額 622,993,725円	期中一部交換元本額 1,007,781,840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	70,050,225	△81,501,191
合計	70,050,225	△81,501,191

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	F P G	3,200	1,110.00	3,552,000	
		S B I ホールディングス	10,700	1,097.00	11,737,900	
		日本アジア投資	600	314.00	188,400	
		ジャフコ	1,500	2,886.00	4,329,000	
		大和証券グループ本社	83,000	612.90	50,870,700	
		野村ホールディングス	171,200	422.00	72,246,400	
		岡三証券グループ	8,000	517.00	4,136,000	
		丸三証券	2,600	887.00	2,306,200	
		東洋証券	3,000	201.00	603,000	
		東海東京フィナンシャル・ホールデ	10,200	494.00	5,038,800	

インクス				
光世証券	2,000	121.00	242,000	
水戸証券	2,800	244.00	683,200	
いちよし証券	2,000	791.00	1,582,000	
松井証券	4,400	920.00	4,048,000	
だいこう証券ビジネス	400	604.00	241,600	
マネックスグループ	10,300	249.00	2,564,700	
カブドットコム証券	7,600	341.00	2,591,600	
極東証券	1,200	1,176.00	1,411,200	
岩井コスモホールディングス	800	921.00	736,800	
藍澤証券	1,700	550.00	935,000	
マネースクウェアHD	300	872.00	261,600	
マネーパートナーズグループ	800	509.00	407,200	
小林洋行	300	285.00	85,500	
かんぽ生命保険	3,600	2,093.00	7,534,800	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	19,800	3,021.00	59,815,800	
アニコム ホールディングス	600	2,679.00	1,607,400	
MS&ADインシュアランスグループホール	26,600	2,790.00	74,214,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	8,500	1,219.00	10,361,500	
第一生命保険	57,000	1,252.50	71,392,500	
東京海上ホールディングス	36,000	3,808.00	137,088,000	
T&Dホールディングス	32,400	990.90	32,105,160	
全国保証	2,300	4,025.00	9,257,500	
クレディセゾン	6,700	1,778.00	11,912,600	
アクリーティブ	700	381.00	266,700	
芙蓉総合リース	1,000	4,555.00	4,555,000	
興銀リース	1,700	1,933.00	3,286,100	
東京センチュリーリース	2,100	3,545.00	7,444,500	
日本証券金融	3,900	416.00	1,622,400	
アイフル	14,900	324.00	4,827,600	
ポケットカード	900	518.00	466,200	
リコーリース	700	2,708.00	1,895,600	
イオンフィナンシャルサービス	5,800	2,383.00	13,821,400	
アコム	17,900	516.00	9,236,400	
ジャックス	5,000	497.00	2,485,000	

	オリエントコーポレーション	38,500	198.00	7,623,000	
	日立キャピタル	2,100	2,072.00	4,351,200	
	アプラスフィナンシャル	4,300	97.00	417,100	
	オリックス	63,000	1,460.00	91,980,000	
	三菱UFJリース	22,600	404.00	9,130,400	
	日本取引所グループ	26,100	1,379.00	35,991,900	
	イー・ギャランティ	300	3,225.00	967,500	
	アサックス	200	1,406.00	281,200	
	NECキャピタルソリューション	400	1,477.00	590,800	
	小計 銘柄数：53			787,328,060	
	組入時価比率：99.8%			100.0%	
	合計			787,328,060	

(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。