

平成29年7月期（平成28年7月16日～平成29年7月15日）決算短信

平成29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29年9月27日
 分配金支払開始日 平成29年8月23日

ファンドの運用状況

1. 平成29年7月期の運用状況（平成28年7月16日～平成29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29年7月期	6,707	(99.8)	11	(0.2)	6,719	(100)
平成28年7月期	779	(99.6)	3	(0.4)	782	(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()	設定口数()	交換口数()	当計算期間末 発行済口数 (+ -)
	千口	千口	千口	千口
平成29年7月期	46	239	0	285
平成28年7月期	46	0	0	46

(3)基準価額

	総資産 ()	負債 ()	純資産 ((-))	10口当り基準価額 ((/ 当計算期間末発行済口数) × 10)
	百万円	百万円	百万円	円
平成29年7月期	6,759	40	6,719	234,967
平成28年7月期	795	13	782	169,121

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成29年7月期	1,100.00
平成28年7月期	2,510.00

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 素材・化学 (TOPIX-17) 上場投信

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 9 期 (平成 28 年 7 月 15 日現在)	第 10 期 (平成 29 年 7 月 15 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,252,414	17,330,597
株式	779,711,020	6,707,309,410
未収入金	9,407,400	23,621,330
未収配当金	1,424,500	10,991,100
流動資産合計	795,795,334	6,759,252,437
資産合計	795,795,334	6,759,252,437
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	11,616,782	31,455,820
未払受託者報酬	210,516	1,238,974
未払委託者報酬	1,136,708	6,690,412
未払利息	7	42
その他未払費用	105,062	697,472
流動負債合計	13,069,075	40,082,720
負債合計	13,069,075	40,082,720
純資産の部		
元本等		
元本	608,562,018	3,760,114,338
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	174,164,241	2,959,055,379
(分配準備積立金)	41,553	265,529
元本等合計	782,726,259	6,719,169,717
純資産合計	782,726,259	6,719,169,717
負債純資産合計	795,795,334	6,759,252,437

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 10 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 年 7 月 15 日
営業収益		
受取配当金	14,770,980	42,696,080
受取利息	1,853	-
有価証券売買等損益	△119,229,323	984,158,916
その他収益	1,549	2,607
営業収益合計	△104,454,941	1,026,857,603
営業費用		
支払利息	618	2,411
受託者報酬	446,928	1,552,247

委託者報酬	2,413,256	8,381,991
その他費用	287,816	1,082,242
営業費用合計	3,148,618	11,018,891
営業利益又は営業損失(△)	△107,603,559	1,015,838,712
経常利益又は経常損失(△)	△107,603,559	1,015,838,712
当期純利益又は当期純損失(△)	△107,603,559	1,015,838,712
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(△)	293,384,582	174,164,241
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,800,508,246
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,800,508,246
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	11,616,782	31,455,820
期末剰余金又は期末欠損金(△)	174,164,241	2,959,055,379

(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 28 年 7 月 16 日から平成 29 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 9 期 平成 28 年 7 月 15 日現在	第 10 期 平成 29 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 285,962 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 16,912.1 円 (10 口当たり純資産額) (169,121 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 23,496.7 円 (10 口当たり純資産額) (234,967 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 10 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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>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	<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>42,696,276 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>41,553 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>42,737,829 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>11,016,480 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>31,721,349 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>31,455,820 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>265,529 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	42,696,276 円	分配準備積立金	B	41,553 円	配当等収益合計額	C=A+B	42,737,829 円	経費	D	11,016,480 円	収益分配可能額	E=C-D	31,721,349 円	収益分配金	F	31,455,820 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	265,529 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																																															
項目																																																	
当期配当等収益額	A	42,696,276 円																																															
分配準備積立金	B	41,553 円																																															
配当等収益合計額	C=A+B	42,737,829 円																																															
経費	D	11,016,480 円																																															
収益分配可能額	E=C-D	31,721,349 円																																															
収益分配金	F	31,455,820 円																																															
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	265,529 円																																															

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

口数	H	285,962 口
10口当たり分配金	$I=F/H \times 10$	1,100 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9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	第10期 自 平成28年7月16日 至 平成29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9期 平成28年7月15日現在	第10期 平成29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9期 自 平成27年7月16日	第10期 自 平成28年7月16日

至平成28年7月15日	至平成29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9期 自平成27年7月16日 至平成28年7月15日	第10期 自平成28年7月16日 至平成29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 3,151,552,320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9期 自平成27年7月16日 至平成28年7月15日	第10期 自平成28年7月16日 至平成29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	△116,509,038	976,473,888
合計	△116,509,038	976,473,888

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29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	4,600	1,287.00	5,920,200	
		グンゼ	27,000	410.00	11,070,000	
		東洋紡	146,000	215.00	31,390,000	
		ユニチカ	101,000	81.00	8,181,000	
		富士紡ホールディングス	1,800	3,345.00	6,021,000	
		倉敷紡績	37,000	279.00	10,323,000	
		シキボウ	20,000	150.00	3,000,000	
		日本毛織	10,400	945.00	9,828,000	
		ダイトウボウ	5,000	77.00	385,000	
		トーア紡コーポレーション	1,600	556.00	889,600	
		ダイドーリミテッド	4,100	440.00	1,804,000	
		帝国繊維	3,900	1,990.00	7,761,000	
		帝人	30,100	2,254.00	67,845,400	
		東レ	267,100	971.10	259,380,810	

サカイオーベックス	900	1,811.00	1,629,900
住江織物	10,000	277.00	2,770,000
日本フェルト	2,100	508.00	1,066,800
イチカワ	2,000	313.00	626,000
日東製網	400	1,891.00	756,400
アツギ	30,000	123.00	3,690,000
ダイニック	7,000	191.00	1,337,000
セーレン	9,200	1,807.00	16,624,400
ソトー	1,400	1,149.00	1,608,600
東海染工	5,000	137.00	685,000
小松精練	5,200	709.00	3,686,800
ワコールホールディングス	22,000	1,509.00	33,198,000
ホギメディカル	2,300	7,750.00	17,825,000
レナウン	10,000	168.00	1,680,000
クラウディア	800	663.00	530,400
T S I ホールディングス	15,200	772.00	11,734,400
三陽商会	1,900	1,763.00	3,349,700
ナイガイ	13,000	68.00	884,000
オンワードホールディングス	24,000	798.00	19,152,000
ルック	7,000	273.00	1,911,000
キムラタン	155,000	7.00	1,085,000
ゴールドウイン	1,600	6,790.00	10,864,000
デサント	8,400	1,576.00	13,238,400
キング	1,800	416.00	748,800
ヤマトインターナショナル	2,400	440.00	1,056,000
特種東海製紙	2,100	4,025.00	8,452,500
王子ホールディングス	144,000	586.00	84,384,000
日本製紙	16,500	2,286.00	37,719,000
三菱製紙	5,200	772.00	4,014,400
北越紀州製紙	20,600	835.00	17,201,000
中越パルプ工業	15,000	228.00	3,420,000
巴川製紙所	6,000	243.00	1,458,000
大王製紙	14,700	1,470.00	21,609,000
阿波製紙	900	638.00	574,200
レンゴー	35,500	643.00	22,826,500
トーモク	12,000	393.00	4,716,000

ザ・パック	2,600	3,600.00	9,360,000
クラレ	62,000	2,164.00	134,168,000
旭化成	230,000	1,244.00	286,120,000
共和レザー	2,100	963.00	2,022,300
昭和電工	24,500	2,907.00	71,221,500
住友化学	271,000	656.00	177,776,000
住友精化	1,500	5,550.00	8,325,000
日産化学工業	19,900	3,795.00	75,520,500
ラサ工業	14,000	147.00	2,058,000
クレハ	2,800	5,500.00	15,400,000
多木化学	500	4,515.00	2,257,500
テイカ	6,000	991.00	5,946,000
石原産業	6,600	1,172.00	7,735,200
片倉コープアグリ	5,000	264.00	1,320,000
日東エフシー	2,200	947.00	2,083,400
日本曹達	22,000	621.00	13,662,000
東ソー	106,000	1,280.00	135,680,000
トクヤマ	57,000	559.00	31,863,000
セントラル硝子	38,000	490.00	18,620,000
東亜合成	23,000	1,424.00	32,752,000
大阪ソーダ	16,000	558.00	8,928,000
関東電化工業	7,500	1,035.00	7,762,500
デンカ	72,000	611.00	43,992,000
信越化学工業	66,000	10,175.00	671,550,000
日本カーバイド工業	13,000	187.00	2,431,000
堺化学工業	14,000	443.00	6,202,000
エア・ウォーター	30,400	2,112.00	64,204,800
大陽日酸	28,400	1,263.00	35,869,200
日本化学工業	14,000	242.00	3,388,000
日本パーカライジング	18,800	1,628.00	30,606,400
高圧ガス工業	5,500	824.00	4,532,000
チタン工業	4,000	198.00	792,000
四国化成工業	5,000	1,378.00	6,890,000
戸田工業	7,000	320.00	2,240,000
ステラ ケミファ	1,800	3,005.00	5,409,000
保土谷化学工業	1,300	4,645.00	6,038,500

日本触媒	5,800	7,350.00	42,630,000
大日精化工業	15,000	953.00	14,295,000
カネカ	50,000	894.00	44,700,000
三菱瓦斯化学	34,300	2,547.00	87,362,100
三井化学	167,000	632.00	105,544,000
J S R	37,000	2,030.00	75,110,000
東京応化工業	6,900	3,735.00	25,771,500
大阪有機化学工業	2,400	1,321.00	3,170,400
三菱ケミカルホールディングス	248,000	987.10	244,800,800
KHネオケム	6,000	2,135.00	12,810,000
ダイセル	49,700	1,475.00	73,307,500
住友ベークライト	32,000	854.00	27,328,000
積水化学工業	81,900	2,015.00	165,028,500
日本ゼオン	31,000	1,272.00	39,432,000
アイカ工業	11,800	3,475.00	41,005,000
宇部興産	185,000	306.00	56,610,000
積水樹脂	5,700	2,040.00	11,628,000
タキロンシーアイ	8,000	593.00	4,744,000
旭有機材	12,000	257.00	3,084,000
日立化成	20,500	3,345.00	68,572,500
ニチバン	4,000	997.00	3,988,000
リケンテクノス	7,900	634.00	5,008,600
大倉工業	9,000	665.00	5,985,000
積水化成成品工業	5,100	967.00	4,931,700
群栄化学工業	900	3,700.00	3,330,000
タイガースポリマー	1,800	759.00	1,366,200
ミライアル	1,300	1,071.00	1,392,300
ダイキアクシス	1,200	981.00	1,177,200
ダイキョーニシカワ	6,500	1,600.00	10,400,000
日本化薬	24,000	1,634.00	39,216,000
カーリットホールディングス	3,400	620.00	2,108,000
日本精化	3,000	1,034.00	3,102,000
扶桑化学工業	2,600	3,490.00	9,074,000
ADEKA	15,800	1,695.00	26,781,000
日油	28,000	1,506.00	42,168,000
新日本理化	5,800	161.00	933,800

ハリマ化成グループ	3,100	1,055.00	3,270,500
花王	91,800	6,740.00	618,732,000
第一工業製薬	8,000	540.00	4,320,000
日華化学	1,200	1,188.00	1,425,600
ニイタカ	500	1,752.00	876,000
三洋化成工業	2,300	5,320.00	12,236,000
有機合成薬品工業	2,400	289.00	693,600
大日本塗料	21,000	309.00	6,489,000
日本ペイントホールディングス	28,400	4,335.00	123,114,000
関西ペイント	38,700	2,622.00	101,471,400
神東塗料	3,000	213.00	639,000
中国塗料	10,600	860.00	9,116,000
日本特殊塗料	2,600	1,874.00	4,872,400
藤倉化成	5,000	642.00	3,210,000
太陽ホールディングス	3,000	5,020.00	15,060,000
D I C	14,500	4,150.00	60,175,000
サカティンクス	7,500	1,887.00	14,152,500
東洋インキS Cホールディングス	36,000	589.00	21,204,000
T & K TOKA	2,700	1,161.00	3,134,700
富士フイルムホールディングス	73,000	4,133.00	301,709,000
資生堂	69,800	3,891.00	271,591,800
ライオン	45,700	2,319.00	105,978,300
高砂香料工業	2,400	4,335.00	10,404,000
マンダム	3,700	6,260.00	23,162,000
ミルボン	2,000	6,370.00	12,740,000
ファンケル	7,800	2,074.00	16,177,200
コーセー	6,000	11,910.00	71,460,000
コタ	1,500	1,212.00	1,818,000
シーズ・ホールディングス	4,800	3,980.00	19,104,000
シーボン	400	2,471.00	988,400
ポーラ・オルビスホールディングス	15,000	2,928.00	43,920,000
ノエビアホールディングス	2,300	5,600.00	12,880,000
アジュバンコスメジャパン	700	952.00	666,400
エステー	2,500	2,713.00	6,782,500
アグロ カネショウ	1,400	1,551.00	2,171,400
コニシ	5,800	1,627.00	9,436,600

長谷川香料	4,700	2,297.00	10,795,900	
星光PMC	2,000	1,334.00	2,668,000	
小林製薬	9,900	6,800.00	67,320,000	
荒川化学工業	3,200	1,940.00	6,208,000	
メック	2,800	1,373.00	3,844,400	
日本高純度化学	1,000	2,465.00	2,465,000	
タカラバイオ	10,500	1,590.00	16,695,000	
JCU	2,300	4,060.00	9,338,000	
新田ゼラチン	2,200	764.00	1,680,800	
OATアグリオ	400	1,639.00	655,600	
デクセリアルズ	9,700	1,128.00	10,941,600	
アース製薬	2,600	6,170.00	16,042,000	
北興化学工業	3,600	564.00	2,030,400	
大成ラミック	1,100	2,892.00	3,181,200	
クミアイ化学工業	15,600	641.00	9,999,600	
日本農薬	9,200	674.00	6,200,800	
アキレス	3,000	1,949.00	5,847,000	
有沢製作所	6,200	914.00	5,666,800	
日東電工	26,500	9,824.00	260,336,000	
レック	2,300	2,718.00	6,251,400	
きもと	6,600	265.00	1,749,000	
藤森工業	2,700	3,345.00	9,031,500	
前澤化成工業	2,400	1,237.00	2,968,800	
JSP	1,700	3,245.00	5,516,500	
エフピコ	3,300	6,000.00	19,800,000	
天馬	2,400	2,129.00	5,109,600	
信越ポリマー	7,200	903.00	6,501,600	
東リ	8,800	367.00	3,229,600	
ニフコ	6,500	6,330.00	41,145,000	
日本バルカー工業	2,900	2,486.00	7,209,400	
ユニ・チャーム	74,500	2,915.00	217,167,500	
小計	銘柄数：189		6,707,309,410	
	組入時価比率：99.8%		100.0%	
合計			6,707,309,410	

(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 29 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。