

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 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29年9月27日  
 分配金支払開始日 平成29年8月23日

I 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	459	(99.8)	1	(0.2)	460	(100)
平成28年7月期	787	(99.8)	1	(0.2)	788	(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29年7月期	82	9	56	35
平成28年7月期	22	129	69	82

(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 (③/③/当計算期間末発行済口数)×10
	百万円	百万円	百万円	円
平成29年7月期	472	12	460	129,497
平成28年7月期	807	18	788	95,993

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成29年7月期	3,130.00
平成28年7月期	2,160.00

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 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	3,378,595	2,372,444
株式	787,328,060	459,616,680
未収入金	17,137,090	10,841,540
流動資産合計	807,843,745	472,830,664
資産合計	807,843,745	472,830,664
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	17,752,608	11,136,853
未払受託者報酬	164,675	134,572
未払委託者報酬	889,165	726,644
未払利息	4	4
その他未払費用	85,946	69,004
流動負債合計	18,892,398	12,067,077
負債合計	18,892,398	12,067,077
純資産の部		
元本等		
元本	1,188,685,044	514,608,003
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△399,733,697	△53,844,416
(分配準備積立金)	27,648	35,279
元本等合計	788,951,347	460,763,587
純資産合計	788,951,347	460,763,587
負債純資産合計	807,843,745	472,830,664

## (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	19,667,315	13,078,250
受取利息	2,475	-
有価証券売買等損益	△127,047,652	155,589,562
その他収益	805	613
営業収益合計	△107,377,057	168,668,425
営業費用		
支払利息	713	1,302
受託者報酬	270,018	276,752
委託者報酬	1,457,953	1,494,346

その他費用	176,048	161,979
営業費用合計	1,904,732	1,934,379
営業利益又は営業損失（△）	△109,281,789	166,734,046
経常利益又は経常損失（△）	△109,281,789	166,734,046
当期純利益又は当期純損失（△）	△109,281,789	166,734,046
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（△）	△118,387	△399,733,697
剰余金増加額又は欠損金減少額	149,779,690	208,640,121
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	149,779,690	208,640,121
剰余金減少額又は欠損金増加額	422,360,603	18,348,033
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	18,348,033
分配金	17,752,608	11,136,853
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△399,733,697	△53,844,416

## (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 82,188 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 35,581 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 399,733,697 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 53,844,416 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)	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 12,949.7 円 (10 口当たり純資産額) (129,497 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>19,669,882 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>14,393 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	19,669,882 円	分配準備積立金	B	14,393 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>13,077,561 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>27,648 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	13,077,561 円	分配準備積立金	B	27,648 円
項目																			
当期配当等収益額	A	19,669,882 円																	
分配準備積立金	B	14,393 円																	
項目																			
当期配当等収益額	A	13,077,561 円																	
分配準備積立金	B	27,648 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

配当等収益合計額	C=A+B	13,105,209円
経費	D	1,933,077円
収益分配可能額	E=C-D	11,172,132円
収益分配金	F	11,136,853円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	35,279円
口数	H	35,581口
10口当たり分配金	I=F/H×10	3,130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</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>

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
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 319,603,374円	期首元本額 1,188,685,044円
期中追加設定元本額 1,876,863,510円	期中追加設定元本額 142,026,660円
期中一部交換元本額 1,007,781,840円	期中一部交換元本額 816,103,701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	△81,501,191	91,646,201
合計	△81,501,191	91,646,201

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	F P G	1,400	1,202.00	1,682,800	
		S B I ホールディングス	4,400	1,527.00	6,718,800	
		日本アジア投資	400	431.00	172,400	
		ジャフコ	600	4,575.00	2,745,000	
		大和証券グループ本社	35,000	664.90	23,271,500	
		野村ホールディングス	79,400	667.20	52,975,680	
		岡三証券グループ	3,000	734.00	2,202,000	
		丸三証券	1,200	912.00	1,094,400	
		東洋証券	1,000	252.00	252,000	
		東海東京フィナンシャル・ホールディングス	4,500	634.00	2,853,000	

光世証券	1,000	160.00	160,000
水戸証券	1,200	307.00	368,400
いちよし証券	900	926.00	833,400
松井証券	2,200	919.00	2,021,800
だいこう証券ビジネス	200	613.00	122,600
マネックスグループ	4,100	304.00	1,246,400
カブドットコム証券	2,900	380.00	1,102,000
極東証券	500	1,524.00	762,000
岩井コスモホールディングス	400	1,256.00	502,400
藍澤証券	700	677.00	473,900
マネーパートナーズグループ	500	502.00	251,000
小林洋行	100	274.00	27,400
かんぽ生命保険	1,500	2,501.00	3,751,500
SOMPOホールディングス	8,100	4,429.00	35,874,900
アニコムホールディングス	300	2,657.00	797,100
MS&ADインシュアランスグループホール	11,600	3,872.00	44,915,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	3,700	1,995.00	7,381,500
第一生命ホールディングス	23,400	2,025.50	47,396,700
東京海上ホールディングス	15,700	4,750.00	74,575,000
T&Dホールディングス	14,200	1,701.50	24,161,300
アドバンスクリエイト	100	1,962.00	196,200
全国保証	1,100	4,795.00	5,274,500
クレディセゾン	2,900	2,174.00	6,304,600
アクリーティブ	300	383.00	114,900
芙蓉総合リース	400	6,470.00	2,588,000
興銀リース	700	2,644.00	1,850,800
東京センチュリー	800	4,725.00	3,780,000
日本証券金融	1,700	557.00	946,900
アイフル	6,500	390.00	2,535,000
ポケットカード	300	761.00	228,300
リコーリース	300	3,885.00	1,165,500
イオンフィナンシャルサービス	2,500	2,361.00	5,902,500
アコム	7,800	496.00	3,868,800
ジャックス	2,000	521.00	1,042,000
オリエントコーポレーション	8,400	190.00	1,596,000

	日立キャピタル	900	2,705.00	2,434,500	
	アプラスフィナンシャル	1,900	109.00	207,100	
	オリックス	27,500	1,753.00	48,207,500	
	三菱UFJリース	9,900	603.00	5,969,700	
	日本取引所グループ	12,100	1,977.00	23,921,700	
	イー・ギャランティ	100	2,670.00	267,000	
	アサックス	100	1,665.00	166,500	
	NECキャピタルソリューション	200	1,783.00	356,600	
	小計			459,616,680	
	銘柄数：53				
	組入時価比率：99.8%			100.0%	
	合計			459,616,680	

(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。