

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 機械 (TOPIX-17) 上場投信
 コード番号 (1624)
 連動対象指標 TOPIX-17 機械
 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	761	(99.6)	3	(0.4)	764	(100)
平成27年7月期	2,236	(99.9)	2	(0.1)	2,238	(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	70	0	39	31
平成27年7月期	70	239	238	70

(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	788	23	764	245,675
平成27年7月期	2,307	69	2,238	315,975

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成28年7月期	7,080.00
平成27年7月期	8,790.00

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 機械 (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	19,706,289	4,644,261
株式	2,236,082,850	761,660,050
未収入金	51,483,100	20,885,050
未収配当金	514,100	980,300
未収利息	37	-
流動資産合計	2,307,786,376	788,169,661
資産合計	2,307,786,376	788,169,661
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	62,266,602	22,037,916
未払受託者報酬	1,049,755	205,851
未払委託者報酬	5,668,617	1,111,529
未払利息	-	6
その他未払費用	498,981	103,087
流動負債合計	69,483,955	23,458,389
負債合計	69,483,955	23,458,389
純資産の部		
元本等		
元本	1,493,123,364	656,094,906
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	745,179,057	108,616,366
(分配準備積立金)	29,719	2,448
元本等合計	2,238,302,421	764,711,272
純資産合計	2,238,302,421	764,711,272
負債純資産合計	2,307,786,376	788,169,661

(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	73,711,175	26,399,350
受取利息	5,387	3,783
有価証券売買等損益	566,931,256	△317,879,428
その他収益	1,194	5,619
営業収益合計	640,649,012	△291,470,676
営業費用		
支払利息	-	562
受託者報酬	1,615,017	638,712

委託者報酬	8,720,973	3,448,911
その他費用	1,092,904	309,922
営業費用合計	11,428,894	4,398,107
営業利益又は営業損失 (△)	629,220,118	△295,868,783
経常利益又は経常損失 (△)	629,220,118	△295,868,783
当期純利益又は当期純損失 (△)	629,220,118	△295,868,783
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 (△)	420,101,185	745,179,057
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,066,609,204	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,066,609,204	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,308,484,848	318,655,992
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,308,484,848	318,655,992
分配金	62,266,602	22,037,916
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	745,179,057	108,616,366

(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 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 70,838 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 31,127 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 31,597.5 円 (10 口当たり純資産額) (315,975 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 24,567.5 円 (10 口当たり純資産額) (245,675 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>73,717,756 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>7,459 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>73,725,215 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>11,428,894 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>62,296,321 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	73,717,756 円	分配準備積立金	B	7,459 円	配当等収益合計額	C=A+B	73,725,215 円	経費	D	11,428,894 円	収益分配可能額	E=C-D	62,296,321 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>26,408,190 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>29,719 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>26,437,909 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>4,397,545 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>22,040,364 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	26,408,190 円	分配準備積立金	B	29,719 円	配当等収益合計額	C=A+B	26,437,909 円	経費	D	4,397,545 円	収益分配可能額	E=C-D	22,040,364 円
項目																																					
当期配当等収益額	A	73,717,756 円																																			
分配準備積立金	B	7,459 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	73,725,215 円																																			
経費	D	11,428,894 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	62,296,321 円																																			
項目																																					
当期配当等収益額	A	26,408,190 円																																			
分配準備積立金	B	29,719 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	26,437,909 円																																			
経費	D	4,397,545 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	22,040,364 円																																			

収益分配金	F	62,266,602円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	29,719円
口数	H	70,838口
10口当たり分配金	I=F/H×10	8,790円

収益分配金	F	22,037,916円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,448円
口数	H	31,127口
10口当たり分配金	I=F/H×10	7,080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。 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 1,486,884,276円	期首元本額 1,493,123,364円
期中追加設定元本額 5,039,328,240円	期中追加設定元本額 0円
期中一部交換元本額 5,033,089,152円	期中一部交換元本額 837,028,458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	184,220,192	△201,764,515
合計	184,220,192	△201,764,515

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	日本ドライケミカル	100	2,127.00	212,700	
		日本製鋼所	14,000	447.00	6,258,000	
		三浦工業	3,800	2,276.00	8,648,800	
		タクマ	3,000	852.00	2,556,000	
		ツガミ	2,000	451.00	902,000	
		オークマ	6,000	754.00	4,524,000	
		東芝機械	5,000	340.00	1,700,000	
		アマダホールディングス	12,500	1,086.00	13,575,000	
		アイダエンジニアリング	2,200	883.00	1,942,600	
		滝澤鉄工所	3,000	125.00	375,000	
		富士機械製造	2,800	1,006.00	2,816,800	
		牧野フライス製作所	4,000	582.00	2,328,000	

オーエスジー	3,900	1,722.00	6,715,800
ダイジェット工業	1,000	135.00	135,000
旭ダイヤモンド工業	2,300	801.00	1,842,300
DMG森精機	4,700	1,130.00	5,311,000
ソディック	2,200	816.00	1,795,200
ディスコ	1,100	9,930.00	10,923,000
日東工器	500	2,166.00	1,083,000
パンチ工業	300	794.00	238,200
豊和工業	500	540.00	270,000
OKK	3,000	103.00	309,000
石川製作所	2,000	72.00	144,000
東洋機械金属	600	375.00	225,000
津田駒工業	2,000	122.00	244,000
エンシュウ	2,000	61.00	122,000
島精機製作所	1,200	1,990.00	2,388,000
NCホールディングス	300	1,008.00	302,400
フリー	200	2,702.00	540,400
ヤマシンフィルタ	200	453.00	90,600
日阪製作所	1,100	895.00	984,500
やまびこ	1,600	787.00	1,259,200
ペガサスミシン製造	900	473.00	425,700
ナブテスコ	4,400	2,639.00	11,611,600
三井海洋開発	1,000	1,629.00	1,629,000
レオン自動機	700	620.00	434,000
SMC	2,600	25,875.00	67,275,000
新川	800	508.00	406,400
ホソカワミクロン	1,000	545.00	545,000
ユニオンツール	400	2,923.00	1,169,200
オイレス工業	1,100	1,796.00	1,975,600
日精エー・エス・ビー機械	300	1,776.00	532,800
サトーホールディングス	1,200	2,299.00	2,758,800
日本エアータック	300	623.00	186,900
日精樹脂工業	600	655.00	393,000
オカダアイヨン	200	759.00	151,800
ワイエイシイ	300	1,519.00	455,700
小松製作所	41,900	1,995.00	83,590,500

住友重機械工業	25,000	478.00	11,950,000
日立建機	3,800	1,597.00	6,068,600
日工	1,000	307.00	307,000
巴工業	300	1,534.00	460,200
井関農機	9,000	231.00	2,079,000
TOWA	800	1,154.00	923,200
丸山製作所	2,000	169.00	338,000
北川鉄工所	4,000	173.00	692,000
タカキタ	300	537.00	161,100
クボタ	41,100	1,495.50	61,465,050
荏原実業	300	1,197.00	359,100
三菱化工機	3,000	195.00	585,000
月島機械	1,600	1,020.00	1,632,000
帝国電機製作所	600	832.00	499,200
東京機械製作所	3,000	40.00	120,000
新東工業	1,900	802.00	1,523,800
澁谷工業	700	1,860.00	1,302,000
アイチ コーポレーション	1,200	729.00	874,800
小森コーポレーション	2,100	1,301.00	2,732,100
鶴見製作所	600	1,355.00	813,000
住友精密工業	1,000	315.00	315,000
酒井重工業	2,000	173.00	346,000
荏原製作所	19,000	578.00	10,982,000
石井鐵工所	1,000	156.00	156,000
西島製作所	900	1,157.00	1,041,300
北越工業	900	602.00	541,800
ダイキン工業	11,900	9,067.00	107,897,300
オルガノ	1,000	398.00	398,000
トーヨーカネツ	4,000	207.00	828,000
栗田工業	5,100	2,299.00	11,724,900
椿本チエイン	5,000	686.00	3,430,000
大同工業	2,000	196.00	392,000
木村化工機	700	301.00	210,700
アネスト岩田	1,400	976.00	1,366,400
ダイフク	4,400	1,967.00	8,654,800
サムコ	200	853.00	170,600

加藤製作所	2,000	437.00	874,000
油研工業	2,000	172.00	344,000
タダノ	3,900	930.00	3,627,000
フジテック	2,400	966.00	2,318,400
CKD	2,300	907.00	2,086,100
キトー	1,000	849.00	849,000
平和	2,500	2,116.00	5,290,000
理想科学工業	900	1,433.00	1,289,700
SANKYO	2,300	3,870.00	8,901,000
日本金銭機械	800	910.00	728,000
マースエンジニアリング	500	2,127.00	1,063,500
福島工業	500	3,315.00	1,657,500
オーイズミ	300	422.00	126,600
ダイコク電機	300	1,508.00	452,400
竹内製作所	1,600	1,414.00	2,262,400
アマノ	2,500	1,828.00	4,570,000
JUKI	1,200	906.00	1,087,200
サンデンホールディングス	5,000	286.00	1,430,000
蛇の目マシン工業	800	563.00	450,400
マックス	1,000	1,201.00	1,201,000
グローリー	2,800	3,045.00	8,526,000
新晃工業	600	1,222.00	733,200
大和冷機工業	1,300	947.00	1,231,100
セガサミーホールディングス	8,800	1,167.00	10,269,600
日本ピストンリング	300	1,440.00	432,000
リケン	4,000	351.00	1,404,000
TPR	1,000	2,130.00	2,130,000
ツバキ・ナカシマ	1,000	1,208.00	1,208,000
ホシザキ	1,800	9,320.00	16,776,000
大豊工業	700	1,138.00	796,600
日本精工	16,800	877.00	14,733,600
NTN	20,000	296.00	5,920,000
ジェイテクト	8,700	1,292.00	11,240,400
不二越	8,000	320.00	2,560,000
日本トムソン	2,800	330.00	924,000
THK	5,400	1,921.00	10,373,400

	ユーシン精機	300	1,807.00	542,100	
	前澤給装工業	300	1,351.00	405,300	
	イーグル工業	1,000	1,282.00	1,282,000	
	前澤工業	600	281.00	168,600	
	日本ピラー工業	800	1,035.00	828,000	
	キット	3,600	528.00	1,900,800	
	日立工機	2,200	652.00	1,434,400	
	マキタ	5,300	6,760.00	35,828,000	
	日立造船	6,500	525.00	3,412,500	
	三菱重工業	146,000	471.80	68,882,800	
	I H I	63,000	309.00	19,467,000	
	小計 銘柄数：131			761,660,050	
	組入時価比率：99.6%			100.0%	
	合計			761,660,050	

(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。