

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 銀行(TOPIX-17)上場投信
 コード番号 (1631)
 連動対象指標 TOPIX-17 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	1,406	(99.7)	3	(0.3)	1,409	(100)
平成27年7月期	1,467	(99.8)	3	(0.2)	1,471	(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	104	179	118	165
平成27年7月期	133	30	59	104

(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	1,449	39	1,409	85,406
平成27年7月期	1,498	27	1,471	141,239

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成28年7月期	2,230.00
平成27年7月期	2,380.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更
 ② ①以外の変更

有 無
 有 無

Ⅱ 財務諸表等

NEXT FUNDS 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	6,765,892	4,305,782
株式	1,467,677,060	1,406,365,360
未収入金	23,611,690	38,230,180
未収配当金	168,000	244,000
未収利息	12	-
流動資産合計	1,498,222,654	1,449,145,322
資産合計	1,498,222,654	1,449,145,322
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	24,789,842	36,815,293
未払受託者報酬	332,513	340,787
未払委託者報酬	1,795,533	1,840,169
未払利息	-	5
その他未払費用	169,418	173,805
流動負債合計	27,087,306	39,170,059
負債合計	27,087,306	39,170,059
純資産の部		
元本等		
元本	1,615,089,454	2,559,901,046
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△143,954,106	△1,149,925,783
(分配準備積立金)	10,840	155,222
元本等合計	1,471,135,348	1,409,975,263
純資産合計	1,471,135,348	1,409,975,263
負債純資産合計	1,498,222,654	1,449,145,322

(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	29,752,025	42,025,875
受取利息	4,775	2,145
有価証券売買等損益	396,480,882	△558,305,778
その他収益	357	125
営業収益合計	426,238,039	△516,277,633
営業費用		
支払利息	-	1,358

受託者報酬	704,912	717,497
委託者報酬	3,806,452	3,874,346
その他費用	476,669	475,269
営業費用合計	4,988,033	5,068,470
営業利益又は営業損失(△)	421,250,006	△521,346,103
経常利益又は経常損失(△)	421,250,006	△521,346,103
当期純利益又は当期純損失(△)	421,250,006	△521,346,103
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(△)	△681,932,508	△143,954,106
剰余金増加額又は欠損金減少額	198,704,238	622,925,348
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	198,704,238	622,925,348
剰余金減少額又は欠損金増加額	57,186,000	1,070,735,629
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	57,186,000	1,070,735,629
分配金	24,789,842	36,815,293
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△143,954,106	△1,149,925,783

(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 104,159 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 165,091 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 143,954,106 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 1,149,925,783 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 14,123.9 円 (10 口当たり純資産額) (141,239 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 8,540.6 円 (10 口当たり純資産額) (85,406 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
項目	項目

当期配当等収益額	A	29,757,157円
分配準備積立金	B	31,558円
配当等収益合計額	C=A+B	29,788,715円
経費	D	4,988,033円
収益分配可能額	E=C-D	24,800,682円
収益分配金	F	24,789,842円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	10,840円
口数	H	104,159口
10口当たり分配金	I=F/H×10	2,380円

当期配当等収益額	A	42,026,787円
分配準備積立金	B	10,840円
配当等収益合計額	C=A+B	42,037,627円
経費	D	5,067,112円
収益分配可能額	E=C-D	36,970,515円
収益分配金	F	36,815,293円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	155,222円
口数	H	165,091口
10口当たり分配金	I=F/H×10	2,230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</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>

(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。

(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 2,069,926,952円	期首元本額 1,615,089,454円
期中追加設定元本額 465,180,000円	期中追加設定元本額 2,788,443,980円
期中一部交換元本額 920,017,498円	期中一部交換元本額 1,843,632,388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	292,230,090	△284,816,326
合計	292,230,090	△284,816,326

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	島根銀行	200	1,218.00	243,600	
		じもとホールディングス	6,900	156.00	1,076,400	
		足利ホールディングス	7,000	342.00	2,394,000	
		東京TYフィナンシャルグループ	1,300	2,474.00	3,216,200	
		九州フィナンシャルグループ	14,600	569.00	8,307,400	
		ゆうちょ銀行	24,500	1,214.00	29,743,000	
		富山第一銀行	2,400	495.00	1,188,000	
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	66,500	439.70	29,240,050	

新生銀行	83,000	158.00	13,114,000
あおぞら銀行	60,000	378.00	22,680,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	766,200	518.80	397,504,560
りそなホールディングス	111,700	407.90	45,562,430
三井住友トラスト・ホールディングス	199,000	362.50	72,137,500
三井住友フィナンシャルグループ	76,500	3,233.00	247,324,500
第四銀行	12,000	362.00	4,344,000
北越銀行	10,000	197.00	1,970,000
西日本シティ銀行	31,000	197.00	6,107,000
千葉銀行	37,000	512.00	18,944,000
常陽銀行	35,000	406.00	14,210,000
群馬銀行	21,000	409.00	8,589,000
武蔵野銀行	1,500	2,509.00	3,763,500
千葉興業銀行	2,600	414.00	1,076,400
筑波銀行	4,000	309.00	1,236,000
七十七銀行	15,000	378.00	5,670,000
青森銀行	7,000	311.00	2,177,000
秋田銀行	6,000	339.00	2,034,000
山形銀行	5,000	436.00	2,180,000
岩手銀行	700	4,290.00	3,003,000
東邦銀行	9,000	359.00	3,231,000
東北銀行	5,000	147.00	735,000
みちのく銀行	5,000	191.00	955,000
ふくおかフィナンシャルグループ	41,000	372.00	15,252,000
静岡銀行	28,000	767.00	21,476,000
十六銀行	12,000	286.00	3,432,000
スルガ銀行	9,100	2,417.00	21,994,700
八十二銀行	17,300	485.00	8,390,500
山梨中央銀行	6,000	409.00	2,454,000
大垣共立銀行	13,000	315.00	4,095,000
福井銀行	8,000	246.00	1,968,000
北國銀行	10,000	304.00	3,040,000
清水銀行	300	2,522.00	756,600
富山銀行	200	3,680.00	736,000
滋賀銀行	9,000	482.00	4,338,000

南都銀行	9,000	356.00	3,204,000
百五銀行	9,000	389.00	3,501,000
京都銀行	18,000	814.00	14,652,000
紀陽銀行	3,700	1,451.00	5,368,700
三重銀行	4,000	191.00	764,000
ほくほくフィナンシャルグループ	65,000	132.00	8,580,000
広島銀行	28,000	376.00	10,528,000
山陰合同銀行	5,700	731.00	4,166,700
中国銀行	6,800	1,128.00	7,670,400
鳥取銀行	3,000	169.00	507,000
伊予銀行	10,200	660.00	6,732,000
百十四銀行	10,000	339.00	3,390,000
四国銀行	7,000	210.00	1,470,000
阿波銀行	8,000	599.00	4,792,000
大分銀行	5,000	321.00	1,605,000
宮崎銀行	6,000	262.00	1,572,000
佐賀銀行	6,000	245.00	1,470,000
十八銀行	6,000	271.00	1,626,000
沖縄銀行	840	3,265.00	2,742,600
琉球銀行	2,000	1,127.00	2,254,000
セブン銀行	35,800	337.00	12,064,600
みずほフィナンシャルグループ	1,354,400	163.80	221,850,720
高知銀行	4,000	107.00	428,000
山口フィナンシャルグループ	9,000	1,000.00	9,000,000
長野銀行	3,000	202.00	606,000
名古屋銀行	8,000	338.00	2,704,000
北洋銀行	14,400	314.00	4,521,600
愛知銀行	300	4,675.00	1,402,500
第三銀行	5,000	171.00	855,000
中京銀行	4,000	243.00	972,000
大光銀行	3,000	195.00	585,000
愛媛銀行	6,000	239.00	1,434,000
トマト銀行	4,000	148.00	592,000
みなの銀行	9,000	170.00	1,530,000
京葉銀行	8,000	434.00	3,472,000
関西アーバン銀行	1,300	1,003.00	1,303,900

	栃木銀行	5,000	382.00	1,910,000	
	北日本銀行	300	2,770.00	831,000	
	東和銀行	18,000	85.00	1,530,000	
	福島銀行	12,000	92.00	1,104,000	
	大東銀行	6,000	196.00	1,176,000	
	トモニホールディングス	7,300	361.00	2,635,300	
	フィデアホールディングス	7,800	145.00	1,131,000	
	池田泉州ホールディングス	10,100	420.00	4,242,000	
	小計	銘柄数：87		1,406,365,360	
		組入時価比率：99.7%		100.0%	
	合計			1,406,365,360	

(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。