

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 食品(TOPIX-17)上場投信
 コード番号 (1617)
 連動対象指標 TOPIX-17 食品
 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	813	(99.3)	6	(0.7)	819	(100)
平成28年7月期	1,339	(99.3)	8	(0.7)	1,348	(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	45	0	19	25
平成28年7月期	25	20	0	45

(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29年7月期	831	12	819	321,082
平成28年7月期	1,363	15	1,348	296,810

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成29年7月期	4,340.00
平成28年7月期	2,990.00

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 食品 (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	3,670,020	3,263,623
株式	1,339,913,900	813,216,150
未収入金	12,248,300	10,466,000
未収配当金	8,081,600	4,904,450
流動資産合計	1,363,913,820	831,850,223
資産合計	1,363,913,820	831,850,223
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	13,586,560	11,074,378
未払受託者報酬	234,712	212,972
未払委託者報酬	1,267,378	1,149,964
未払利息	4	8
その他未払費用	122,024	107,784
流動負債合計	15,210,678	12,545,106
負債合計	15,210,678	12,545,106
純資産の部		
元本等		
元本	811,240,320	455,555,001
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	537,462,822	363,750,116
(分配準備積立金)	35,456	10,154
元本等合計	1,348,703,142	819,305,117
純資産合計	1,348,703,142	819,305,117
負債純資産合計	1,363,913,820	831,850,223

(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	16,663,050	14,241,000
受取利息	1,898	-
有価証券売買等損益	△27,912,577	22,727,277
その他収益	1,966	2,102
営業収益合計	△11,245,663	36,970,379
営業費用		
支払利息	699	1,495
受託者報酬	437,652	454,152
委託者報酬	2,363,201	2,452,313

その他費用	260,301	286,066
営業費用合計	3,061,853	3,194,026
営業利益又は営業損失(△)	△14,307,516	33,776,353
経常利益又は経常損失(△)	△14,307,516	33,776,353
当期純利益又は当期純損失(△)	△14,307,516	33,776,353
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(△)	311,312,898	537,462,822
剰余金増加額又は欠損金減少額	254,044,000	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	254,044,000	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	196,414,681
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	196,414,681
分配金	13,586,560	11,074,378
期末剰余金又は期末欠損金(△)	537,462,822	363,750,116

(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 45,440 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 25,517 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 29,681.0 円 (10 口当たり純資産額) (296,810 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 32,108.2 円 (10 口当たり純資産額) (321,082 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>16,666,215 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>16,955 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>16,683,170 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,061,154 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>13,622,016 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>13,586,560 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	16,666,215 円	分配準備積立金	B	16,955 円	配当等収益合計額	C=A+B	16,683,170 円	経費	D	3,061,154 円	収益分配可能額	E=C-D	13,622,016 円	収益分配金	F	13,586,560 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>14,241,607 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>35,456 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>14,277,063 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,192,531 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>11,084,532 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>11,074,378 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	14,241,607 円	分配準備積立金	B	35,456 円	配当等収益合計額	C=A+B	14,277,063 円	経費	D	3,192,531 円	収益分配可能額	E=C-D	11,084,532 円	収益分配金	F	11,074,378 円
項目																																											
当期配当等収益額	A	16,666,215 円																																									
分配準備積立金	B	16,955 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	16,683,170 円																																									
経費	D	3,061,154 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	13,622,016 円																																									
収益分配金	F	13,586,560 円																																									
項目																																											
当期配当等収益額	A	14,241,607 円																																									
分配準備積立金	B	35,456 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	14,277,063 円																																									
経費	D	3,192,531 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	11,084,532 円																																									
収益分配金	F	11,074,378 円																																									

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	35,456 円
口数	H	45,440 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,990 円

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	10,154 円
口数	H	25,517 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	4,340 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 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 454,180,320 円	期首元本額 811,240,320 円
期中追加設定元本額 357,060,000 円	期中追加設定元本額 0 円
期中一部交換元本額 0 円	期中一部交換元本額 355,685,319 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	△28,342,185	59,382,047
合計	△28,342,185	59,382,047

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	極洋	300	3,075.00	922,500	
		日本水産	10,700	632.00	6,762,400	
		マルハニチロ	1,600	2,929.00	4,686,400	
		カネコ種苗	300	1,491.00	447,300	
		サカタのタネ	1,200	3,500.00	4,200,000	
		ホクト	800	1,962.00	1,569,600	
		ホクリヨウ	100	1,002.00	100,200	
		日本製粉	2,500	1,778.00	4,445,000	
		日清製粉グループ本社	9,000	1,806.00	16,254,000	
		日東富士製粉	100	3,920.00	392,000	
		昭和産業	3,000	596.00	1,788,000	
		鳥越製粉	700	801.00	560,700	
		中部飼料	900	1,436.00	1,292,400	

フィード・ワン	5,000	223.00	1,115,000
東洋精糖	1,000	117.00	117,000
日本甜菜製糖	400	2,114.00	845,600
三井製糖	600	3,185.00	1,911,000
塩水港精糖	900	244.00	219,600
日新製糖	300	1,890.00	567,000
森永製菓	1,600	6,490.00	10,384,000
中村屋	200	5,090.00	1,018,000
江崎グリコ	2,100	6,130.00	12,873,000
名糖産業	400	1,439.00	575,600
不二家	500	2,513.00	1,256,500
山崎製パン	6,000	2,234.00	13,404,000
第一屋製パン	100	1,220.00	122,000
モロゾフ	1,000	671.00	671,000
亀田製菓	500	5,590.00	2,795,000
寿スピリッツ	800	3,780.00	3,024,000
カルビー	3,400	4,365.00	14,841,000
森永乳業	7,000	832.00	5,824,000
六甲バター	400	2,613.00	1,045,200
ヤクルト本社	4,400	7,810.00	34,364,000
明治ホールディングス	4,900	8,920.00	43,708,000
雪印メグミルク	1,800	3,195.00	5,751,000
プリマハム	5,000	690.00	3,450,000
日本ハム	6,000	3,315.00	19,890,000
林兼産業	300	847.00	254,100
丸大食品	4,000	522.00	2,088,000
S F o o d s	400	4,320.00	1,728,000
伊藤ハム米久ホールディングス	4,800	1,022.00	4,905,600
サッポロホールディングス	2,700	3,010.00	8,127,000
アサヒグループホールディングス	15,500	4,376.00	67,828,000
キリンホールディングス	35,500	2,345.50	83,265,250
宝ホールディングス	6,000	1,159.00	6,954,000
オエノンホールディングス	2,100	286.00	600,600
養命酒製造	300	2,105.00	631,500
コカ・コーラボトラーズジャパン	5,200	3,320.00	17,264,000
サントリー食品インターナショナル	5,600	5,290.00	29,624,000

ダイドーグループホールディングス	400	5,610.00	2,244,000
伊藤園	2,400	4,145.00	9,948,000
キーコーヒー	700	2,189.00	1,532,300
ユニカフェ	200	993.00	198,600
ジャパンフーズ	100	1,380.00	138,000
日清オイリオグループ	5,000	644.00	3,220,000
不二製油グループ本社	2,200	2,575.00	5,665,000
かどや製油	100	5,240.00	524,000
J-オイルミルズ	400	3,875.00	1,550,000
キッコーマン	5,800	3,540.00	20,532,000
味の素	17,000	2,438.50	41,454,500
キューピー	4,200	2,826.00	11,869,200
ハウス食品グループ本社	3,100	2,873.00	8,906,300
カゴメ	3,000	3,385.00	10,155,000
焼津水産化学工業	400	1,186.00	474,400
アリアケジャパン	700	7,740.00	5,418,000
ピエトロ	100	1,642.00	164,200
エバラ食品工業	200	2,077.00	415,400
ニチレイ	3,800	3,210.00	12,198,000
東洋水産	4,100	4,250.00	17,425,000
イートアンド	100	2,304.00	230,400
大冷	100	1,823.00	182,300
日清食品ホールディングス	3,200	7,170.00	22,944,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,382.00	1,382,000
一正蒲鉾	300	1,303.00	390,900
フジッコ	800	2,588.00	2,070,400
ロック・フィールド	800	1,822.00	1,457,600
日本たばこ産業	45,700	3,837.00	175,350,900
ケンコーマヨネーズ	400	3,225.00	1,290,000
わらべや日洋ホールディングス	500	2,951.00	1,475,500
なとり	400	2,058.00	823,200
イフジ産業	100	753.00	75,300
北の達人コーポレーション	400	900.00	360,000
ユーグレナ	2,900	1,172.00	3,398,800
ミヨシ油脂	300	1,423.00	426,900
理研ビタミン	200	4,320.00	864,000

	小計	銘柄数 : 85 組入時価比率 : 99.3%			813,216,150 100.0%
	合計				813,216,150

(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。