

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 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	2,365	(99.9)	3	(0.1)	2,368	(100)
平成28年7月期	761	(99.6)	3	(0.4)	764	(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	31	99	59	71
平成28年7月期	70	0	39	31

(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	2,418	49	2,368	330,397
平成28年7月期	788	23	764	245,675

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成29年7月期	6,140.00
平成28年7月期	7,080.00

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 機械 (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	4,644,261	16,023,860
株式	761,660,050	2,365,470,600
未収入金	20,885,050	34,498,100
未収配当金	980,300	2,204,000
流動資産合計	788,169,661	2,418,196,560
資産合計	788,169,661	2,418,196,560
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	22,037,916	44,015,204
未払受託者報酬	205,851	831,265
未払委託者報酬	1,111,529	4,488,763
未払利息	6	38
その他未払費用	103,087	374,217
流動負債合計	23,458,389	49,709,487
負債合計	23,458,389	49,709,487
純資産の部		
元本等		
元本	656,094,906	1,510,997,508
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	108,616,366	857,489,565
(分配準備積立金)	2,448	42,486
元本等合計	764,711,272	2,368,487,073
純資産合計	764,711,272	2,368,487,073
負債純資産合計	788,169,661	2,418,196,560

(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	26,399,350	52,757,275
受取利息	3,783	-
有価証券売買等損益	△317,879,428	425,534,792
その他収益	5,619	1,819
営業収益合計	△291,470,676	478,293,886
営業費用		
支払利息	562	2,959
受託者報酬	638,712	1,207,049

委託者報酬	3,448,911	6,517,971
その他費用	309,922	975,873
営業費用合計	4,398,107	8,703,852
営業利益又は営業損失 (△)	△295,868,783	469,590,034
経常利益又は経常損失 (△)	△295,868,783	469,590,034
当期純利益又は当期純損失 (△)	△295,868,783	469,590,034
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 (△)	745,179,057	108,616,366
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	921,209,011
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	921,209,011
剰余金減少額又は欠損金増加額	318,655,992	597,910,642
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	318,655,992	597,910,642
分配金	22,037,916	44,015,204
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	108,616,366	857,489,565

(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る場合、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 31,127 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 71,686 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 24,567.5 円 (10 口当たり純資産額) (245,675 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 33,039.7 円 (10 口当たり純資産額) (330,397 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>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	<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>52,756,135 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>2,448 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>52,758,583 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>8,700,893 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>44,057,690 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	52,756,135 円	分配準備積立金	B	2,448 円	配当等収益合計額	C=A+B	52,758,583 円	経費	D	8,700,893 円	収益分配可能額	E=C-D	44,057,690 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																																			
項目																																					
当期配当等収益額	A	52,756,135 円																																			
分配準備積立金	B	2,448 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	52,758,583 円																																			
経費	D	8,700,893 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	44,057,690 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

収益分配金	F	44,015,204 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	42,486 円
口数	H	71,686 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	6,140 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。	

(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 1,493,123,364 円	期首元本額 656,094,906 円
期中追加設定元本額 0 円	期中追加設定元本額 2,107,167,660 円
期中一部交換元本額 837,028,458 円	期中一部交換元本額 1,252,265,058 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	△201,764,515	305,816,878
合計	△201,764,515	305,816,878

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	日本ドライケミカル	300	2,371.00	711,300	
		日本製鋼所	6,600	1,883.00	12,427,800	
		三浦工業	8,200	2,149.00	17,621,800	
		タクマ	6,400	1,124.00	7,193,600	
		ツガミ	5,000	855.00	4,275,000	
		オークマ	13,000	1,092.00	14,196,000	
		東芝機械	12,000	518.00	6,216,000	
		アマダホールディングス	27,100	1,318.00	35,717,800	
		アイダエンジニアリング	5,700	1,108.00	6,315,600	
		滝澤鉄工所	6,000	187.00	1,122,000	
		富士機械製造	6,100	1,767.00	10,778,700	
		牧野フライス製作所	10,000	979.00	9,790,000	
		オーエスジー	9,200	2,438.00	22,429,600	

ダイジェット工業	2,000	178.00	356,000
旭ダイヤモンド工業	5,600	877.00	4,911,200
DMG森精機	11,600	1,918.00	22,248,800
ソディック	5,100	1,341.00	6,839,100
ディスコ	2,400	19,050.00	45,720,000
日東工器	1,200	2,598.00	3,117,600
パンチ工業	700	1,282.00	897,400
富士ダイス	700	759.00	531,300
豊和工業	1,100	791.00	870,100
OKK	7,000	142.00	994,000
石川製作所	500	1,120.00	560,000
東洋機械金属	1,400	789.00	1,104,600
津田駒工業	4,000	188.00	752,000
エンシュウ	5,000	150.00	750,000
島精機製作所	2,600	5,850.00	15,210,000
NCホールディングス	700	870.00	609,000
フリーー	1,200	1,309.00	1,570,800
ヤマシンフィルタ	500	2,232.00	1,116,000
日阪製作所	2,700	1,002.00	2,705,400
やまびこ	3,700	1,364.00	5,046,800
ペガサスマシン製造	1,900	717.00	1,362,300
ナブテスコ	10,400	3,440.00	35,776,000
三井海洋開発	2,000	2,613.00	5,226,000
レオン自動機	1,700	1,234.00	2,097,800
SMC	6,000	35,280.00	211,680,000
新川	1,700	745.00	1,266,500
ホソカワミクロン	700	5,300.00	3,710,000
ユニオンツール	900	3,290.00	2,961,000
オイレス工業	2,500	2,022.00	5,055,000
日精エー・エス・ビー機械	600	3,865.00	2,319,000
サトーホールディングス	2,500	2,668.00	6,670,000
日本エアータック	600	850.00	510,000
日精樹脂工業	1,600	1,164.00	1,862,400
オカダアイヨン	600	1,398.00	838,800
ワイエイシイホールディングス	700	1,362.00	953,400
小松製作所	92,700	2,954.00	273,835,800

住友重機械工業	59,000	797.00	47,023,000
日立建機	9,000	2,934.00	26,406,000
日工	600	2,238.00	1,342,800
巴工業	800	1,814.00	1,451,200
井関農機	2,100	2,319.00	4,869,900
TOWA	1,600	1,781.00	2,849,600
丸山製作所	400	1,781.00	712,400
北川鉄工所	900	2,452.00	2,206,800
ローツェ	900	2,506.00	2,255,400
タカキタ	700	537.00	375,900
クボタ	96,200	1,928.00	185,473,600
荏原実業	600	1,504.00	902,400
三菱化工機	7,000	255.00	1,785,000
月島機械	3,800	1,275.00	4,845,000
帝国電機製作所	1,500	1,146.00	1,719,000
東京機械製作所	8,000	75.00	600,000
新東工業	4,600	1,176.00	5,409,600
澁谷工業	1,700	3,420.00	5,814,000
アイチ コーポレーション	2,800	790.00	2,212,000
小森コーポレーション	4,800	1,427.00	6,849,600
鶴見製作所	1,500	1,871.00	2,806,500
住友精密工業	3,000	353.00	1,059,000
酒井重工業	4,000	344.00	1,376,000
荏原製作所	9,100	3,380.00	30,758,000
石井鐵工所	300	1,678.00	503,400
西島製作所	2,000	1,159.00	2,318,000
北越工業	2,200	1,116.00	2,455,200
ダイキン工業	26,200	11,820.00	309,684,000
オルガノ	4,000	567.00	2,268,000
トーヨーカネツ	9,000	340.00	3,060,000
栗田工業	11,100	3,115.00	34,576,500
椿本チエイン	11,000	1,013.00	11,143,000
大同工業	4,000	318.00	1,272,000
木村化工機	1,700	378.00	642,600
アネスト岩田	3,500	1,032.00	3,612,000
ダイフク	9,600	3,520.00	33,792,000

サムコ	500	950.00	475,000
加藤製作所	1,100	3,425.00	3,767,500
油研工業	4,000	230.00	920,000
タダノ	10,000	1,407.00	14,070,000
フジテック	5,600	1,515.00	8,484,000
CKD	5,800	1,987.00	11,524,600
キトー	2,400	1,221.00	2,930,400
平和	6,000	2,416.00	14,496,000
理想科学工業	1,900	2,250.00	4,275,000
SANKYO	5,300	3,650.00	19,345,000
日本金銭機械	1,800	1,205.00	2,169,000
マースエンジニアリング	1,100	2,360.00	2,596,000
福島工業	1,200	4,795.00	5,754,000
オーイズミ	800	605.00	484,000
ダイコク電機	800	1,685.00	1,348,000
竹内製作所	3,500	2,134.00	7,469,000
アマノ	5,900	2,465.00	14,543,500
JUKI	3,000	1,694.00	5,082,000
サンデンホールディングス	12,000	344.00	4,128,000
蛇の目ミシン工業	1,900	896.00	1,702,400
マックス	3,000	1,590.00	4,770,000
グローリー	6,100	3,795.00	23,149,500
新晃工業	1,800	1,759.00	3,166,200
大和冷機工業	3,100	1,274.00	3,949,400
セガサミーホールディングス	19,100	1,471.00	28,096,100
日本ピストンリング	700	2,251.00	1,575,700
リケン	900	5,350.00	4,815,000
TPR	2,100	3,620.00	7,602,000
ツバキ・ナカシマ	2,200	2,352.00	5,174,400
ホンザキ	5,600	10,380.00	58,128,000
大豊工業	1,600	1,453.00	2,324,800
日本精工	39,400	1,524.00	60,045,600
NTN	44,000	540.00	23,760,000
ジェイテクト	20,500	1,705.00	34,952,500
不二越	19,000	635.00	12,065,000
日本トムソン	6,100	610.00	3,721,000

	THK	13,600	3,295.00	44,812,000	
	ユーシン精機	900	2,672.00	2,404,800	
	前澤給装工業	700	1,588.00	1,111,600	
	イーグル工業	2,100	1,929.00	4,050,900	
	前澤工業	1,300	328.00	426,400	
	日本ピラー工業	1,900	1,726.00	3,279,400	
	キット	9,200	1,011.00	9,301,200	
	マキタ	25,000	4,365.00	109,125,000	
	日立造船	15,200	556.00	8,451,200	
	三菱重工業	322,000	460.80	148,377,600	
	I H I	148,000	388.00	57,424,000	
	スター精密	3,400	1,938.00	6,589,200	
	小計	銘柄数 : 133		2,365,470,600	
		組入時価比率 : 99.9%		100.0%	
	合計			2,365,470,600	

(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。