

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 運輸・物流 (TOPIX-17) 上場投信
 コード番号 (1628)
 連動対象指標 TOPIX-17 運輸・物流
 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	490	(99.8)	0	(0.2)	491	(100)
平成28年7月期	769	(99.7)	1	(0.3)	770	(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	49	19	39	28
平成28年7月期	28	119	99	49

(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	496	5	491	169,813
平成28年7月期	776	5	770	157,333

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成29年7月期	1,470.00
平成28年7月期	770.00

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 運輸・物流(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	3,037,343	2,944,948
株式	769,026,600	490,952,750
未収入金	4,086,452	2,941,530
未収配当金	7,900	3,500
流動資産合計	776,158,295	496,842,728
資産合計	776,158,295	496,842,728
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,773,231	4,256,385
未払受託者報酬	202,026	129,284
未払委託者報酬	1,090,874	698,069
未払利息	4	6
その他未払費用	111,571	64,620
流動負債合計	5,177,706	5,148,364
負債合計	5,177,706	5,148,364
純資産の部		
元本等		
元本	689,766,228	407,570,580
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	81,214,361	84,123,784
(分配準備積立金)	30,666	22,723
元本等合計	770,980,589	491,694,364
純資産合計	770,980,589	491,694,364
負債純資産合計	776,158,295	496,842,728

(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	6,197,275	5,962,750
受取利息	1,198	-
有価証券売買等損益	△126,025,815	31,436,768
その他収益	147,967	150,797
営業収益合計	△119,679,375	37,550,315
営業費用		
支払利息	459	670
受託者報酬	367,970	265,990

委託者報酬	1,986,885	1,436,218
その他費用	213,444	162,227
営業費用合計	2,568,758	1,865,105
営業利益又は営業損失(△)	△122,248,133	35,685,210
経常利益又は経常損失(△)	△122,248,133	35,685,210
当期純利益又は当期純損失(△)	△122,248,133	35,685,210
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(△)	120,617,165	81,214,361
剰余金増加額又は欠損金減少額	329,442,994	14,272,680
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	329,442,994	14,272,680
剰余金減少額又は欠損金増加額	242,824,434	42,792,082
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	242,824,434	42,792,082
分配金	3,773,231	4,256,385
期末剰余金又は期末欠損金(△)	81,214,361	84,123,784

(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 49,003 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 28,955 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 15,733.3 円 (10 口当たり純資産額) (157,333 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 16,981.3 円 (10 口当たり純資産額) (169,813 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>6,345,981 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>26,215 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>6,372,196 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,568,299 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>3,803,897 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	6,345,981 円	分配準備積立金	B	26,215 円	配当等収益合計額	C=A+B	6,372,196 円	経費	D	2,568,299 円	収益分配可能額	E=C-D	3,803,897 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>6,112,877 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>30,666 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>6,143,543 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,864,435 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>4,279,108 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	6,112,877 円	分配準備積立金	B	30,666 円	配当等収益合計額	C=A+B	6,143,543 円	経費	D	1,864,435 円	収益分配可能額	E=C-D	4,279,108 円
項目																																					
当期配当等収益額	A	6,345,981 円																																			
分配準備積立金	B	26,215 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	6,372,196 円																																			
経費	D	2,568,299 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	3,803,897 円																																			
項目																																					
当期配当等収益額	A	6,112,877 円																																			
分配準備積立金	B	30,666 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	6,143,543 円																																			
経費	D	1,864,435 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	4,279,108 円																																			

収益分配金	F	3,773,231 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	30,666 円
口数	H	49,003 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	770 円

収益分配金	F	4,256,385 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	22,723 円
口数	H	28,955 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	1,470 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 407,697,264 円	期首元本額 689,766,228 円
期中追加設定元本額 1,685,319,480 円	期中追加設定元本額 280,393,920 円
期中一部交換元本額 1,403,250,516 円	期中一部交換元本額 562,589,568 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	△37,155,114	46,446,722
合計	△37,155,114	46,446,722

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	SBSホールディングス	400	847.00	338,800	
		東武鉄道	22,000	604.00	13,288,000	
		相鉄ホールディングス	6,000	551.00	3,306,000	
		東京急行電鉄	22,000	832.00	18,304,000	
		京浜急行電鉄	11,000	1,316.00	14,476,000	
		小田急電鉄	6,500	2,208.00	14,352,000	
		京王電鉄	11,000	924.00	10,164,000	
		京成電鉄	3,000	2,974.00	8,922,000	
		富士急行	1,000	1,168.00	1,168,000	
		新京成電鉄	1,000	415.00	415,000	
		東日本旅客鉄道	7,900	10,715.00	84,648,500	
		西日本旅客鉄道	3,900	8,029.00	31,313,100	
		東海旅客鉄道	3,400	17,915.00	60,911,000	

西武ホールディングス	5,600	1,998.00	11,188,800
鴻池運輸	600	1,516.00	909,600
西日本鉄道	5,000	493.00	2,465,000
ハマキョウレックス	300	2,749.00	824,700
サカイ引越センター	200	4,300.00	860,000
近鉄グループホールディングス	41,000	428.00	17,548,000
阪急阪神ホールディングス	5,100	4,045.00	20,629,500
南海電気鉄道	9,000	566.00	5,094,000
京阪ホールディングス	9,000	706.00	6,354,000
神戸電鉄	1,000	396.00	396,000
名古屋鉄道	15,000	514.00	7,710,000
山陽電気鉄道	1,000	562.00	562,000
日本通運	15,000	699.00	10,485,000
ヤマトホールディングス	7,300	2,203.50	16,085,550
山九	5,000	743.00	3,715,000
丸運	200	286.00	57,200
丸全昭和運輸	1,000	463.00	463,000
センコーグループホールディングス	1,900	742.00	1,409,800
トナミホールディングス	1,000	441.00	441,000
ニッコンホールディングス	1,400	2,543.00	3,560,200
福山通運	2,000	720.00	1,440,000
セイノーホールディングス	2,900	1,483.00	4,300,700
日立物流	800	2,492.00	1,993,600
丸和運輸機関	100	3,970.00	397,000
C&F ロジホールディングス	400	1,317.00	526,800
九州旅客鉄道	4,000	3,645.00	14,580,000
日本郵船	34,000	216.00	7,344,000
商船三井	21,000	353.00	7,413,000
川崎汽船	15,000	283.00	4,245,000
N S ユナイテッド海運	2,000	233.00	466,000
明治海運	400	409.00	163,600
飯野海運	2,100	505.00	1,060,500
乾汽船	300	843.00	252,900
日本航空	7,100	3,616.00	25,673,600
ANAホールディングス	75,000	394.00	29,550,000
トランコム	100	5,510.00	551,000

日新	2,000	534.00	1,068,000	
三菱倉庫	3,000	1,447.00	4,341,000	
三井倉庫ホールディングス	2,000	308.00	616,000	
住友倉庫	3,000	708.00	2,124,000	
澁澤倉庫	1,000	374.00	374,000	
東陽倉庫	700	298.00	208,600	
日本トランスシティ	1,000	456.00	456,000	
ケイヒン	1,000	163.00	163,000	
中央倉庫	200	1,065.00	213,000	
安田倉庫	300	760.00	228,000	
東洋埠頭	1,000	189.00	189,000	
宇徳	300	461.00	138,300	
上組	5,000	1,180.00	5,900,000	
サンリツ	100	735.00	73,500	
キムラユニティー	100	1,159.00	115,900	
キューソー流通システム	100	2,758.00	275,800	
郵船ロジスティクス	400	1,011.00	404,400	
近鉄エクスプレス	700	1,897.00	1,327,900	
東海運	200	427.00	85,400	
エーアイテイー	200	1,005.00	201,000	
内外トランスライン	100	1,275.00	127,500	
小計	銘柄数 : 70		490,952,750	
	組入時価比率 : 99.8%		100.0%	
合計			490,952,750	

(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。