

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 小売(TOPIX-17)上場投信  
 コード番号 ( 1630 )  
 連動対象指標 TOPIX-17 小売  
 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	573	(99.7)	1	(0.3)	574	(100)
平成28年7月期	518	(99.7)	1	(0.3)	519	(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	30	0	0	30
平成28年7月期	30	39	39	30

(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	582	7	574	189,765
平成28年7月期	526	7	519	171,488

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成29年7月期	2,150.00
平成28年7月期	2,140.00

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 小売(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)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,281,552	3,310,403
株式	518,088,800	573,239,600
未収入金	6,188,700	5,451,800
未収配当金	325,875	353,450
流動資産合計	526,884,927	582,355,253
資産合計	526,884,927	582,355,253
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	6,481,846	6,512,135
未払受託者報酬	142,406	154,054
未払委託者報酬	768,902	831,846
未払利息	3	8
その他未払費用	70,932	77,507
流動負債合計	7,464,089	7,575,550
負債合計	7,464,089	7,575,550
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	297,862,026	297,862,026
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	221,558,812	276,917,677
(分配準備積立金)	23,348	5,467
元本等合計	519,420,838	574,779,703
純資産合計	519,420,838	574,779,703
負債純資産合計	526,884,927	582,355,253

## (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
<b>営業収益</b>		
受取配当金	8,933,989	8,575,005
受取利息	2,176	-
有価証券売買等損益	△40,605,904	55,376,746
その他収益	36,770	27,749
営業収益合計	△31,632,969	63,979,500
<b>営業費用</b>		
支払利息	378	978
受託者報酬	354,066	298,421

委託者報酬	1,911,816	1,611,366
その他費用	219,233	197,735
営業費用合計	2,485,493	2,108,500
営業利益又は営業損失(△)	△34,118,462	61,871,000
経常利益又は経常損失(△)	△34,118,462	61,871,000
当期純利益又は当期純損失(△)	△34,118,462	61,871,000
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(△)	313,894,728	221,558,812
剰余金増加額又は欠損金減少額	350,440,368	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	350,440,368	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	402,175,976	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	402,175,976	-
分配金	6,481,846	6,512,135
期末剰余金又は期末欠損金(△)	221,558,812	276,917,677

## (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 30,289 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 30,289 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 17,148.8 円 (10 口当たり純資産額) (171,488 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 18,976.5 円 (10 口当たり純資産額) (189,765 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>8,972,557 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>17,752 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>8,990,309 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,485,115 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>6,505,194 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	8,972,557 円	分配準備積立金	B	17,752 円	配当等収益合計額	C=A+B	8,990,309 円	経費	D	2,485,115 円	収益分配可能額	E=C-D	6,505,194 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>8,601,776 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>23,348 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>8,625,124 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,107,522 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>6,517,602 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	8,601,776 円	分配準備積立金	B	23,348 円	配当等収益合計額	C=A+B	8,625,124 円	経費	D	2,107,522 円	収益分配可能額	E=C-D	6,517,602 円
項目																																					
当期配当等収益額	A	8,972,557 円																																			
分配準備積立金	B	17,752 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	8,990,309 円																																			
経費	D	2,485,115 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	6,505,194 円																																			
項目																																					
当期配当等収益額	A	8,601,776 円																																			
分配準備積立金	B	23,348 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	8,625,124 円																																			
経費	D	2,107,522 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	6,517,602 円																																			

収益分配金	F	6,481,846 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	23,348 円
口数	H	30,289 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,140 円

収益分配金	F	6,512,135 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,467 円
口数	H	30,289 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,150 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 296,347,590 円	期首元本額 297,862,026 円
期中追加設定元本額 393,261,660 円	期中追加設定元本額 0 円
期中一部交換元本額 391,747,224 円	期中一部交換元本額 0 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	△59,061,597	54,429,291
合計	△59,061,597	54,429,291

## 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	ローソン	1,600	7,380.00	11,808,000	
		サンエー	400	4,765.00	1,906,000	
		カワチ薬品	400	2,780.00	1,112,000	
		エービーシー・マート	900	6,310.00	5,679,000	
		ハードオフコーポレーション	200	1,122.00	224,400	
		アスクル	500	3,555.00	1,777,500	
		ゲオホールディングス	900	1,202.00	1,081,800	
		アダストリア	800	2,746.00	2,196,800	
		ジーフット	300	799.00	239,700	
		シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	750.00	75,000	
		くらコーポレーション	300	5,410.00	1,623,000	
		キャンドウ	300	1,683.00	504,900	
		パルグループホールディングス	300	3,170.00	951,000	

エディオン	2,000	992.00	1,984,000
サーラコーポレーション	700	837.00	585,900
ワッツ	200	1,287.00	257,400
ハローズ	200	2,346.00	469,200
あみやき亭	100	4,205.00	420,500
ひらまつ	700	641.00	448,700
ゲンキー	200	3,200.00	640,000
大黒天物産	100	5,700.00	570,000
ハニーズホールディングス	500	1,305.00	652,500
ファーマライズホールディングス	100	535.00	53,500
アルペン	400	2,021.00	808,400
クオール	600	1,738.00	1,042,800
ジーンズ	400	6,160.00	2,464,000
ビックカメラ	3,000	1,151.00	3,453,000
DCMホールディングス	3,200	961.00	3,075,200
MonotaRO	1,900	3,610.00	6,859,000
東京一番フーズ	100	577.00	57,700
ダイヤモンドダイニング	100	2,290.00	229,000
きちり	100	668.00	66,800
アークランドサービスホールディングス	400	1,889.00	755,600
J. フロント リテイリング	6,600	1,607.00	10,606,200
ドトール・日レスホールディングス	900	2,436.00	2,192,400
マツモトキヨシホールディングス	1,000	6,570.00	6,570,000
ブロンコビリー	300	2,643.00	792,900
スタートトゥデイ	4,800	2,705.00	12,984,000
トレジャー・ファクトリー	100	803.00	80,300
物語コーポレーション	100	5,530.00	553,000
ココカラファイン	500	5,480.00	2,740,000
三越伊勢丹ホールディングス	10,400	1,101.00	11,450,400
Hamee	200	1,629.00	325,800
ウエルシアホールディングス	1,400	4,115.00	5,761,000
クリエイトSDホールディングス	800	2,902.00	2,321,600
丸善CHIホールディングス	600	359.00	215,400
ミサワ	100	454.00	45,400
ティーライフ	100	1,674.00	167,400

エー・ピーカンパニー	100	888.00	88,800
チムニー	200	2,811.00	562,200
シュッピン	200	2,050.00	410,000
ネクステージ	200	1,851.00	370,200
ジョイフル本田	800	3,090.00	2,472,000
鳥貴族	200	2,607.00	521,400
キリン堂ホールディングス	200	1,114.00	222,800
ホットランド	200	1,427.00	285,400
すかいらく	2,300	1,671.00	3,843,300
綿半ホールディングス	200	2,439.00	487,800
ヨシックス	100	1,673.00	167,300
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	1,700	1,101.00	1,871,700
ブックオフコーポレーション	300	790.00	237,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	797.00	159,400
B E E N O S	100	1,420.00	142,000
あさひ	400	1,310.00	524,000
日本調剤	200	3,630.00	726,000
コスモス薬品	300	23,200.00	6,960,000
トーエル	300	900.00	270,000
一六堂	100	408.00	40,800
オンリー	100	832.00	83,200
セブン&アイ・ホールディングス	21,900	4,520.00	98,988,000
薬王堂	300	2,959.00	887,700
クリエイト・レストランツ・ホールディング	1,400	1,073.00	1,502,200
ツルハホールディングス	1,000	11,770.00	11,770,000
サンマルクホールディングス	300	3,360.00	1,008,000
フェリシモ	100	1,192.00	119,200
トリドールホールディングス	600	2,945.00	1,767,000
TOKYO BASE	100	4,695.00	469,500
サツドラホールディングス	100	1,978.00	197,800
ダイユー・リックホールディングス	200	823.00	164,600
パロックジャパンリミテッド	400	1,180.00	472,000
クスリのアオキホールディングス	400	5,620.00	2,248,000
スシローグローバルホールディングス	500	3,320.00	1,660,000

LIXILビバ	500	1,964.00	982,000
メディカルシステムネットワーク	600	493.00	295,800
総合メディカル	300	4,805.00	1,441,500
はるやまホールディングス	200	991.00	198,200
ノジマ	800	1,729.00	1,383,200
カッパ・クリエイト	700	1,270.00	889,000
ライトオン	400	989.00	395,600
ジーンズメイト	200	666.00	133,200
良品計画	700	27,390.00	19,173,000
三城ホールディングス	600	458.00	274,800
アドヴァン	500	1,126.00	563,000
アルビス	100	4,710.00	471,000
コナカ	700	596.00	417,200
ハウス オブ ローゼ	100	1,556.00	155,600
G-7ホールディングス	200	2,158.00	431,600
イオン北海道	500	610.00	305,000
コジマ	900	328.00	295,200
ヒマラヤ	100	870.00	87,000
コーナン商事	700	2,052.00	1,436,400
エコス	200	1,150.00	230,000
ワタミ	600	1,333.00	799,800
マルシェ	100	829.00	82,900
ドンキホーテホールディングス	3,400	4,065.00	13,821,000
西松屋チェーン	900	1,175.00	1,057,500
ゼンショーホールディングス	2,700	2,025.00	5,467,500
幸楽苑ホールディングス	300	1,800.00	540,000
ハークスレイ	100	1,125.00	112,500
サイゼリヤ	800	3,365.00	2,692,000
VTホールディングス	1,800	551.00	991,800
魚力	200	1,235.00	247,000
ポプラ	100	606.00	60,600
フジ・コーポレーション	100	1,998.00	199,800
ユナイテッドアローズ	700	3,400.00	2,380,000
ハイデイ日高	600	2,894.00	1,736,400
京都きもの友禅	300	931.00	279,300
コロワイド	1,700	1,893.00	3,218,100

ピーシーデポコーポレーション	700	600.00	420,000
巻番屋	400	3,810.00	1,524,000
トップカルチャー	200	495.00	99,000
P L A N T	100	1,231.00	123,100
スギホールディングス	1,100	5,570.00	6,127,000
ヴィア・ホールディングス	400	969.00	387,600
スクロール	800	370.00	296,000
ヨンドシーホールディングス	500	2,630.00	1,315,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2,300	6,260.00	14,398,000
木曾路	600	2,716.00	1,629,600
サトレストランシステムズ	600	911.00	546,600
千趣会	900	794.00	714,600
タカキュー	400	197.00	78,800
ケーヨー	900	828.00	745,200
上新電機	1,000	1,486.00	1,486,000
日本瓦斯	1,000	3,560.00	3,560,000
ロイヤルホールディングス	900	2,611.00	2,349,900
いなげや	600	1,752.00	1,051,200
島忠	1,400	2,675.00	3,745,000
チヨダ	600	3,010.00	1,806,000
ライフコーポレーション	400	2,939.00	1,175,600
リンガーハット	600	2,560.00	1,536,000
M r M a x	700	521.00	364,700
テンアライド	500	400.00	200,000
A O K I ホールディングス	1,000	1,423.00	1,423,000
オークワ	1,000	1,242.00	1,242,000
コメリ	800	2,873.00	2,298,400
青山商事	1,100	4,000.00	4,400,000
しまむら	600	13,470.00	8,082,000
はせがわ	300	478.00	143,400
高島屋	9,000	1,015.00	9,135,000
松屋	1,100	966.00	1,062,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,700	1,926.00	5,200,200
近鉄百貨店	2,000	369.00	738,000
パルコ	500	1,296.00	648,000

丸井グループ	5,500	1,546.00	8,503,000
アクシアル リテイリング	400	4,195.00	1,678,000
井筒屋	300	425.00	127,500
イオン	21,500	1,722.00	37,023,000
イズミ	900	5,790.00	5,211,000
東武ストア	100	3,085.00	308,500
平和堂	1,100	2,293.00	2,522,300
フジ	600	2,715.00	1,629,000
ヤオコー	600	4,750.00	2,850,000
ゼビオホールディングス	700	2,045.00	1,431,500
ケーズホールディングス	2,200	2,139.00	4,705,800
O l y m p i c グループ	300	586.00	175,800
日産東京販売ホールディングス	800	423.00	338,400
アインホールディングス	700	8,320.00	5,824,000
元気寿司	100	2,294.00	229,400
ヤマダ電機	17,900	558.00	9,988,200
アークランドサカモト	900	1,507.00	1,356,300
ニトリホールディングス	2,300	14,810.00	34,063,000
愛眼	400	214.00	85,600
ケーユーホールディングス	300	993.00	297,900
吉野家ホールディングス	1,800	1,993.00	3,587,400
松屋フーズ	300	4,145.00	1,243,500
サガミチェーン	700	1,397.00	977,900
関西スーパーマーケット	400	1,525.00	610,000
王将フードサービス	400	4,320.00	1,728,000
プレナス	600	2,582.00	1,549,200
ミニストップ	400	2,424.00	969,600
アークス	1,000	2,358.00	2,358,000
バローホールディングス	1,100	2,500.00	2,750,000
ベルク	200	4,985.00	997,000
大庄	300	1,784.00	535,200
ファーストリテイリング	900	34,570.00	31,113,000
サンドラッグ	2,000	4,120.00	8,240,000
サックスパー ホールディングス	500	1,222.00	611,000
ヤマザワ	100	1,776.00	177,600
やまや	100	1,604.00	160,400

	ベルーナ	1,100	1,282.00	1,410,200	
	小計			573,239,600	
	銘柄数：190			100.0%	
	組入時価比率：99.7%				
	合計			573,239,600	

(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。