

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 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	5,388	(99.9)	6	(0.1)	5,395	(100)
平成28年7月期	1,406	(99.7)	3	(0.3)	1,409	(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	165	1,379	1,062	481
平成28年7月期	104	179	118	165

(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	5,534	139	5,395	112,021
平成28年7月期	1,449	39	1,409	85,406

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成29年7月期	2,600.00
平成28年7月期	2,230.00

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 銀行(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	4,305,782	19,483,145
株式	1,406,365,360	5,388,691,420
未収入金	38,230,180	125,802,800
未収配当金	244,000	728,000
流動資産合計	1,449,145,322	5,534,705,365
資産合計	1,449,145,322	5,534,705,365
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	36,815,293	125,226,660
未払受託者報酬	340,787	2,048,964
未払委託者報酬	1,840,169	11,064,368
未払利息	5	48
その他未払費用	173,805	968,446
流動負債合計	39,170,059	139,308,486
負債合計	39,170,059	139,308,486
純資産の部		
元本等		
元本	2,559,901,046	7,468,325,346
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,149,925,783	△2,072,928,467
(分配準備積立金)	155,222	310,228
元本等合計	1,409,975,263	5,395,396,879
純資産合計	1,409,975,263	5,395,396,879
負債純資産合計	1,449,145,322	5,534,705,365

(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	42,025,875	149,003,625
受取利息	2,145	-
有価証券売買等損益	△558,305,778	1,272,327,038
その他収益	125	454
営業収益合計	△516,277,633	1,421,331,117
営業費用		
支払利息	1,358	7,055
受託者報酬	717,497	3,256,411

委託者報酬	3,874,346	17,584,494
その他費用	475,269	2,774,453
営業費用合計	5,068,470	23,622,413
営業利益又は営業損失(△)	△521,346,103	1,397,708,704
経常利益又は経常損失(△)	△521,346,103	1,397,708,704
当期純利益又は当期純損失(△)	△521,346,103	1,397,708,704
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(△)	△143,954,106	△1,149,925,783
剰余金増加額又は欠損金減少額	622,925,348	4,635,104,960
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	622,925,348	4,635,104,960
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,070,735,629	6,830,589,688
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,070,735,629	6,830,589,688
分配金	36,815,293	125,226,660
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,149,925,783	△2,072,928,467

(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 165,091 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 481,641 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 1,149,925,783 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 2,072,928,467 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)	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 11,202.1 円 (10 口当たり純資産額) (112,021 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>42,026,787 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	42,026,787 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>148,997,024 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	148,997,024 円
項目													
当期配当等収益額	A	42,026,787 円											
項目													
当期配当等収益額	A	148,997,024 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。

分配準備積立金	B	155,222 円
配当等収益合計額	C=A+B	149,152,246 円
経費	D	23,615,358 円
収益分配可能額	E=C-D	125,536,888 円
収益分配金	F	125,226,660 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	310,228 円
口数	H	481,641 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,600 円

(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。</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>

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 1,615,089,454円	期首元本額 2,559,901,046円
期中追加設定元本額 2,788,443,980円	期中追加設定元本額 21,389,596,640円
期中一部交換元本額 1,843,632,388円	期中一部交換元本額 16,481,172,340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	△284,816,326	365,746,324
合計	△284,816,326	365,746,324

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	島根銀行	600	1,326.00	795,600	
		じもとホールディングス	20,400	199.00	4,059,600	
		めぶきフィナンシャルグループ	137,200	425.00	58,310,000	
		東京TYフィナンシャルグループ	4,100	3,075.00	12,607,500	
		九州フィナンシャルグループ	46,600	724.00	33,738,400	
		ゆうちょ銀行	80,500	1,454.00	117,047,000	
		富山第一銀行	7,200	513.00	3,693,600	
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	184,300	564.00	103,945,200	
		西日本フィナンシャルホールディングス	19,300	1,239.00	23,912,700	

新生銀行	271,000	189.00	51,219,000
あおぞら銀行	180,000	431.00	77,580,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,155,300	731.80	1,577,248,540
りそなホールディングス	332,700	590.40	196,426,080
三井住友トラスト・ホールディングス	59,400	3,955.00	234,927,000
三井住友フィナンシャルグループ	227,800	4,293.00	977,945,400
第四銀行	35,000	517.00	18,095,000
北越銀行	3,100	2,636.00	8,171,600
千葉銀行	110,000	809.00	88,990,000
群馬銀行	63,200	661.00	41,775,200
武蔵野銀行	4,500	3,400.00	15,300,000
千葉興業銀行	7,800	582.00	4,539,600
筑波銀行	11,800	332.00	3,917,600
七十七銀行	45,000	557.00	25,065,000
青森銀行	22,000	388.00	8,536,000
秋田銀行	18,000	319.00	5,742,000
山形銀行	16,000	496.00	7,936,000
岩手銀行	1,900	4,495.00	8,540,500
東邦銀行	25,000	391.00	9,775,000
東北銀行	14,000	152.00	2,128,000
みちのく銀行	17,000	185.00	3,145,000
ふくおかフィナンシャルグループ	115,000	531.00	61,065,000
静岡銀行	75,000	1,017.00	76,275,000
十六銀行	38,000	363.00	13,794,000
スルガ銀行	29,100	2,779.00	80,868,900
八十二銀行	54,900	732.00	40,186,800
山梨中央銀行	18,000	458.00	8,244,000
大垣共立銀行	44,000	319.00	14,036,000
福井銀行	24,000	271.00	6,504,000
北國銀行	30,000	430.00	12,900,000
清水銀行	1,000	3,605.00	3,605,000
富山銀行	500	4,130.00	2,065,000
滋賀銀行	27,000	586.00	15,822,000
南都銀行	3,200	3,200.00	10,240,000
百五銀行	26,000	454.00	11,804,000

京都銀行	51,000	1,064.00	54,264,000
紀陽銀行	10,700	1,961.00	20,982,700
三重銀行	1,300	2,482.00	3,226,600
ほくほくフィナンシャルグループ	18,900	1,811.00	34,227,900
広島銀行	84,000	475.00	39,900,000
山陰合同銀行	16,900	908.00	15,345,200
中国銀行	20,200	1,666.00	33,653,200
鳥取銀行	900	1,700.00	1,530,000
伊予銀行	40,600	930.00	37,758,000
百十四銀行	31,000	363.00	11,253,000
四国銀行	22,000	298.00	6,556,000
阿波銀行	24,000	743.00	17,832,000
大分銀行	16,000	422.00	6,752,000
宮崎銀行	19,000	367.00	6,973,000
佐賀銀行	17,000	263.00	4,471,000
十八銀行	17,000	304.00	5,168,000
沖縄銀行	2,800	4,495.00	12,586,000
琉球銀行	5,900	1,601.00	9,445,900
セブン銀行	106,600	419.00	44,665,400
みずほフィナンシャルグループ	3,862,200	201.00	776,302,200
高知銀行	10,000	125.00	1,250,000
山口フィナンシャルグループ	27,000	1,369.00	36,963,000
長野銀行	900	1,978.00	1,780,200
名古屋銀行	2,300	4,145.00	9,533,500
北洋銀行	46,400	386.00	17,910,400
愛知銀行	1,000	6,170.00	6,170,000
第三銀行	1,600	1,713.00	2,740,800
中京銀行	1,200	2,307.00	2,768,400
大光銀行	10,000	236.00	2,360,000
愛媛銀行	3,600	1,398.00	5,032,800
トマト銀行	1,100	1,550.00	1,705,000
みなの銀行	2,600	2,111.00	5,488,600
京葉銀行	23,000	478.00	10,994,000
関西アーバン銀行	4,000	1,337.00	5,348,000
栃木銀行	15,700	463.00	7,269,100
北日本銀行	900	3,175.00	2,857,500

	東和銀行	53,000	124.00	6,572,000	
	福島銀行	31,000	88.00	2,728,000	
	大東銀行	15,000	165.00	2,475,000	
	トモニホールディングス	23,400	532.00	12,448,800	
	フィデアホールディングス	27,600	183.00	5,050,800	
	池田泉州ホールディングス	30,200	458.00	13,831,600	
	小計	銘柄数：86		5,388,691,420	
		組入時価比率：99.9%		100.0%	
	合計			5,388,691,420	

(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。