

2018年7月期 (2017年7月16日 ~ 2018年7月15日) 決算短信

2018年8月24日

上場取引所 東証

ファンド名	NEXT FUNDS 鉄鋼・非鉄(TOPIX - 17) 上場投信		
コード番号	(1623)		
連動対象指標	TOPIX-17 鉄鋼・非鉄		
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	増田 真一	TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日	2018年9月26日
分配金支払開始日	2018年8月23日

ファンドの運用状況

1. 2018年7月期の運用状況 (2017年7月16日 ~ 2018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	%
2018年7月期	1,693	(99.9)	1	(0.1)	1,694	(100)
2017年7月期	278	(99.4)	1	(0.6)	280	(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
2018年7月期	14	109	29	94
2017年7月期	41	199	226	14

(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
2018年7月期	1,701	6	1,694	179,624
2017年7月期	338	58	280	194,764

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
2018年7月期	490.00
2017年7月期	37,670.00

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 鉄鋼・非鉄(TOPIX-17)上場投信

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第10期 (2017年7月15日現在)	第11期 (2018年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,445,174	3,503,041
株式	278,428,400	1,693,384,100
未収入金	54,664,100	4,049,550
未収配当金	2,300	124,300
流動資産合計	338,539,974	1,701,060,991
資産合計	338,539,974	1,701,060,991
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	54,184,528	4,622,758
未払受託者報酬	624,646	261,331
未払委託者報酬	3,373,001	1,411,144
未払利息	12	19
その他未払費用	209,653	157,651
流動負債合計	58,391,840	6,452,903
負債合計	58,391,840	6,452,903
純資産の部		
元本等		
元本	445,429,328	2,921,488,714
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△165,281,194	△1,226,880,626
(分配準備積立金)	9,846	83,080
元本等合計	280,148,134	1,694,608,088
純資産合計	280,148,134	1,694,608,088
負債純資産合計	338,539,974	1,701,060,991

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期 自 2016年7月16日 至 2017年7月15日	第11期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日
営業収益		
受取配当金	61,114,500	7,211,550
有価証券売買等損益	△22,197,535	△176,179,599
その他収益	942	1,343
営業収益合計	38,917,907	△168,966,706
営業費用		
支払利息	2,076	2,439
受託者報酬	954,907	345,966
委託者報酬	5,156,320	1,868,105
その他費用	828,719	300,391

営業費用合計	6,942,022	2,516,901
営業利益又は営業損失(△)	31,975,885	△171,483,607
経常利益又は経常損失(△)	31,975,885	△171,483,607
当期純利益又は当期純損失(△)	31,975,885	△171,483,607
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(△)	△591,244,681	△165,281,194
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,434,217,535	325,360,254
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,434,217,535	325,360,254
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,986,045,405	1,210,853,321
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,986,045,405	1,210,853,321
分配金	54,184,528	4,622,758
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△165,281,194	△1,226,880,626

(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 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。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配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、2017年7月16日から2018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10期 2017年7月15日現在	第11期 2018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 14,384口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 94,342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 165,281,194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 1,226,880,626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 19,476.4円 (10口当たり純資産額) (194,764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 17,962.4円 (10口当たり純資産額) (179,624円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自2016年7月16日 至2017年7月15日	第11期 自2017年7月16日 至2018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>61,113,366円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>20,954円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	61,113,366円	分配準備積立金	B	20,954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>7,210,454円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>9,846円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	7,210,454円	分配準備積立金	B	9,846円
項目																			
当期配当等収益額	A	61,113,366円																	
分配準備積立金	B	20,954円																	
項目																			
当期配当等収益額	A	7,210,454円																	
分配準備積立金	B	9,846円																	

配当等収益合計額	C=A+B	61,134,320円	配当等収益合計額	C=A+B	7,220,300円
経費	D	6,939,946円	経費	D	2,514,462円
収益分配可能額	E=C-D	54,194,374円	収益分配可能額	E=C-D	4,705,838円
収益分配金	F	54,184,528円	収益分配金	F	4,622,758円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9,846円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	83,080円
口数	H	14,384口	口数	H	94,342口
10口当たり分配金	I=F/H×10	37,670円	10口当たり分配金	I=F/H×10	490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10期 自 2016年7月16日 至 2017年7月15日	第11期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第10期 2017年7月15日現在	第11期 2018年7月15日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>株式</p> <p>(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>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第10期 自 2016年7月16日	第11期 自 2017年7月16日

至 2017年 7月 15日	至 2018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10期 自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日	第11期 自 2017年 7月 16日 至 2018年 7月 15日
期首元本額 1,283,241,513円	期首元本額 445,429,328円
期中追加設定元本額 6,185,658,250円	期中追加設定元本額 3,400,795,940円
期中一部交換元本額 7,023,470,435円	期中一部交換元本額 924,736,554円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第10期 自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日	第11期 自 2017年 7月 16日 至 2018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	18,675,378	△184,928,305
合計	18,675,378	△184,928,305

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(2018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	新日鐵住金	165,600	2,120.00	351,072,000	
		神戸製鋼所	67,700	1,016.00	68,783,200	
		中山製鋼所	5,100	634.00	3,233,400	
		合同製鐵	2,000	2,202.00	4,404,000	
		ジェイ エフ イー ホールディングス	99,900	2,112.50	211,038,750	
		日新製鋼	10,200	1,492.00	15,218,400	
		東京製鐵	19,800	985.00	19,503,000	
		共英製鋼	4,200	1,945.00	8,169,000	
		大和工業	7,900	3,345.00	26,425,500	
		東京鐵鋼	1,500	1,557.00	2,335,500	
		大阪製鐵	2,500	1,974.00	4,935,000	
		淀川製鋼所	5,400	2,838.00	15,325,200	
		丸一鋼管	13,100	3,660.00	47,946,000	
		モリ工業	1,200	2,974.00	3,568,800	

大同特殊鋼	6,600	4,900.00	32,340,000
日本高周波鋼業	1,400	767.00	1,073,800
日本冶金工業	30,600	311.00	9,516,600
山陽特殊製鋼	4,300	2,807.00	12,070,100
愛知製鋼	2,100	4,075.00	8,557,500
日立金属	39,900	1,119.00	44,648,100
日本金属	900	1,941.00	1,746,900
大平洋金属	2,300	3,330.00	7,659,000
新日本電工	22,200	309.00	6,859,800
栗本鐵工所	1,900	2,033.00	3,862,700
虹技	500	1,830.00	915,000
日本鑄鉄管	4,000	163.00	652,000
三菱製鋼	2,700	2,184.00	5,896,800
日亜鋼業	5,400	335.00	1,809,000
日本精線	600	4,105.00	2,463,000
シンニッタン	5,800	429.00	2,488,200
新家工業	800	1,972.00	1,577,600
大紀アルミニウム工業所	6,100	662.00	4,038,200
日本軽金属ホールディングス	108,000	241.00	26,028,000
三井金属鉱業	10,000	4,235.00	42,350,000
東邦亜鉛	2,100	3,850.00	8,085,000
三菱マテリアル	24,400	2,954.00	72,077,600
住友金属鉱山	47,300	4,029.00	190,571,700
DOWAホールディングス	9,400	3,375.00	31,725,000
古河機械金属	6,100	1,629.00	9,936,900
エス・サイエンス	17,500	69.00	1,207,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,800	1,552.00	5,897,600
東邦チタニウム	6,600	1,027.00	6,778,200
UACJ	5,600	2,335.00	13,076,000
CKサンエツ	700	3,390.00	2,373,000
古河電気工業	12,300	3,720.00	45,756,000
住友電気工業	138,300	1,674.50	231,583,350
フジクラ	44,700	685.00	30,619,500
昭和電線ホールディングス	4,700	667.00	3,134,900
東京特殊電線	500	2,661.00	1,330,500
タツタ電線	7,300	559.00	4,080,700

	カナレ電気	600	2,089.00	1,253,400	
	平河ヒューテック	1,800	1,312.00	2,361,600	
	リョービ	4,600	3,475.00	15,985,000	
	アーレスティ	4,500	942.00	4,239,000	
	アサヒホールディングス	6,300	2,032.00	12,801,600	
	小計 銘柄数：55			1,693,384,100	
	組入時価比率：99.9%			100.0%	
	合計			1,693,384,100	

(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(2018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。