

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 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 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	6,471	(99.8)	10	(0.2)	6,482	(100)
2017年7月期	2,365	(99.9)	3	(0.1)	2,368	(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	71	179	59	191
2017年7月期	31	99	59	71

(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	6,570	88	6,482	337,809
2017年7月期	2,418	49	2,368	330,397

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
2018年7月期	4,030.00
2017年7月期	6,140.00

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	16,023,860	59,672,521
株式	2,365,470,600	6,471,229,500
未収入金	34,498,100	30,629,000
未収配当金	2,204,000	9,228,150
流動資産合計	2,418,196,560	6,570,759,171
資産合計	2,418,196,560	6,570,759,171
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	44,015,204	77,330,058
未払受託者報酬	831,265	1,642,661
未払委託者報酬	4,488,763	8,870,310
未払利息	38	337
その他未払費用	374,217	831,143
流動負債合計	49,709,487	88,674,509
負債合計	49,709,487	88,674,509
純資産の部		
元本等		
元本	1,510,997,508	4,044,573,108
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	857,489,565	2,437,511,554
(分配準備積立金)	42,486	63,367
元本等合計	2,368,487,073	6,482,084,662
純資産合計	2,368,487,073	6,482,084,662
負債純資産合計	2,418,196,560	6,570,759,171

(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	52,757,275	95,689,810
有価証券売買等損益	425,534,792	△270,849,740
その他収益	1,819	12,909
営業収益合計	478,293,886	△175,147,021
営業費用		
支払利息	2,959	7,255
受託者報酬	1,207,049	2,571,529
委託者報酬	6,517,971	13,886,144
その他費用	975,873	1,886,852

営業費用合計	8,703,852	18,351,780
営業利益又は営業損失(△)	469,590,034	△193,498,801
経常利益又は経常損失(△)	469,590,034	△193,498,801
当期純利益又は当期純損失(△)	469,590,034	△193,498,801
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(△)	108,616,366	857,489,565
剰余金増加額又は欠損金減少額	921,209,011	2,939,955,978
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	2,939,955,978
剰余金減少額又は欠損金増加額	597,910,642	1,089,105,130
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	597,910,642	1,089,105,130
分配金	44,015,204	77,330,058
期末剰余金又は期末欠損金(△)	857,489,565	2,437,511,554

(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 71,686口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 191,886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 33,039.7円 (10口当たり純資産額) (330,397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 33,780.9円 (10口当たり純資産額) (337,809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>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	<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>95,695,464円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>42,486円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>95,737,950円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>18,344,525円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>77,393,425円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	95,695,464円	分配準備積立金	B	42,486円	配当等収益合計額	C=A+B	95,737,950円	経費	D	18,344,525円	収益分配可能額	E=C-D	77,393,425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																																			
項目																																					
当期配当等収益額	A	95,695,464円																																			
分配準備積立金	B	42,486円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	95,737,950円																																			
経費	D	18,344,525円																																			
収益分配可能額	E=C-D	77,393,425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

収益分配金	F	77,330,058円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	63,367円
口数	H	191,886口
10口当たり分配金	I=F/H×10	4,030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 至 2017年7月15日	第11期 自 2017年7月16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	656,094,906円	期首元本額	1,510,997,508円
期中追加設定元本額	2,107,167,660円	期中追加設定元本額	3,790,667,520円
期中一部交換元本額	1,252,265,058円	期中一部交換元本額	1,257,091,920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	305,816,878	△549,791,131
合計	305,816,878	△549,791,131

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	日本ドライケミカル	700	2,339.00	1,637,300	
		日本製鋼所	16,600	2,770.00	45,982,000	
		三浦工業	22,000	2,760.00	60,720,000	
		タクマ	17,200	1,277.00	21,964,400	
		ツガミ	13,000	1,005.00	13,065,000	
		オークマ	5,900	6,050.00	35,695,000	
		東芝機械	29,000	537.00	15,573,000	
		アマダホールディングス	78,300	1,066.00	83,467,800	
		アイダエンジニアリング	12,900	1,053.00	13,583,700	
		滝澤鉄工所	1,600	1,693.00	2,708,800	
		F U J I	15,200	1,958.00	29,761,600	
		牧野フライス製作所	26,000	853.00	22,178,000	
		オーエスジー	23,400	2,359.00	55,200,600	
		ダイジェット工業	600	1,769.00	1,061,400	
		旭ダイヤモンド工業	15,100	789.00	11,913,900	
		DMG森精機	28,100	1,584.00	44,510,400	
		ソディック	11,100	983.00	10,911,300	

ディスコ	6,900	20,300.00	140,070,000
日東工器	3,100	2,637.00	8,174,700
日進工具	1,300	2,880.00	3,744,000
パンチ工業	4,200	1,004.00	4,216,800
富士ダイス	2,500	854.00	2,135,000
豊和工業	2,800	906.00	2,536,800
OKK	1,900	1,096.00	2,082,400
石川製作所	1,300	1,764.00	2,293,200
東洋機械金属	4,000	688.00	2,752,000
津田駒工業	1,200	1,988.00	2,385,600
エンシュウ	13,000	136.00	1,768,000
島精機製作所	6,400	5,800.00	37,120,000
オプトラン	4,900	4,440.00	21,756,000
NCホールディングス	1,600	723.00	1,156,800
フリーー	3,600	924.00	3,326,400
ヤマシンフィルタ	7,700	1,079.00	8,308,300
日阪製作所	7,300	1,022.00	7,460,600
やまびこ	9,800	1,351.00	13,239,800
平田機工	1,900	7,300.00	13,870,000
ペガサスミシン製造	4,700	945.00	4,441,500
ナブテスコ	27,900	3,445.00	96,115,500
三井海洋開発	5,400	2,856.00	15,422,400
レオン自動機	4,500	1,799.00	8,095,500
SMC	16,100	37,470.00	603,267,000
新川	4,200	843.00	3,540,600
ホソカワミクロン	1,800	6,630.00	11,934,000
ユニオンツール	2,300	3,665.00	8,429,500
オイレス工業	6,600	2,115.00	13,959,000
日精エー・エス・ビー機械	1,500	5,840.00	8,760,000
サトーホールディングス	6,700	3,235.00	21,674,500
技研製作所	3,500	2,228.00	7,798,000
日本エアータック	1,700	807.00	1,371,900
カワタ	1,000	1,662.00	1,662,000
日精樹脂工業	4,300	1,267.00	5,448,100
オカダアイオン	1,700	1,581.00	2,687,700
ワイエイシイホールディングス	1,700	868.00	1,475,600

小松製作所	247,800	3,177.00	787,260,600
住友重機械工業	29,400	3,755.00	110,397,000
日立建機	24,000	3,585.00	86,040,000
日工	1,400	2,499.00	3,498,600
巴工業	2,200	2,333.00	5,132,600
井関農機	5,100	1,916.00	9,771,600
TOWA	4,000	1,073.00	4,292,000
丸山製作所	1,100	1,732.00	1,905,200
北川鉄工所	2,500	2,511.00	6,277,500
ローツェ	2,500	2,227.00	5,567,500
タカキタ	1,800	657.00	1,182,600
クボタ	275,300	1,799.00	495,264,700
荏原実業	1,500	2,255.00	3,382,500
三菱化工機	1,800	1,988.00	3,578,400
月島機械	10,200	1,487.00	15,167,400
帝国電機製作所	3,600	1,344.00	4,838,400
東京機械製作所	2,000	422.00	844,000
新東工業	12,200	986.00	12,029,200
澁谷工業	4,500	3,440.00	15,480,000
アイチ コーポレーション	8,900	656.00	5,838,400
小森コーポレーション	12,900	1,324.00	17,079,600
鶴見製作所	4,300	1,896.00	8,152,800
住友精密工業	8,000	351.00	2,808,000
酒井重工業	1,000	3,450.00	3,450,000
荏原製作所	21,100	3,475.00	73,322,500
石井鐵工所	800	1,895.00	1,516,000
西島製作所	5,200	983.00	5,111,600
北越工業	5,800	1,020.00	5,916,000
ダイキン工業	70,000	12,865.00	900,550,000
オルガノ	1,800	2,949.00	5,308,200
トーヨーカネツ	2,100	3,900.00	8,190,000
栗田工業	27,800	3,050.00	84,790,000
椿本チエイン	30,000	935.00	28,050,000
大同工業	2,000	1,184.00	2,368,000
木村化工機	4,300	430.00	1,849,000
アネスト岩田	8,600	1,142.00	9,821,200

ダイフク	26,100	4,750.00	123,975,000
サムコ	1,400	1,277.00	1,787,800
加藤製作所	2,400	2,815.00	6,756,000
油研工業	1,000	2,418.00	2,418,000
タダノ	24,800	1,366.00	33,876,800
フジテック	15,800	1,422.00	22,467,600
CKD	14,300	1,767.00	25,268,100
キトー	3,900	2,045.00	7,975,500
平和	15,900	2,587.00	41,133,300
理想科学工業	5,100	2,280.00	11,628,000
SANKYO	12,800	4,330.00	55,424,000
日本金銭機械	4,700	1,159.00	5,447,300
マースエンジニアリング	3,300	2,459.00	8,114,700
福島工業	3,200	5,010.00	16,032,000
オーイズミ	2,200	532.00	1,170,400
ダイコク電機	2,400	1,735.00	4,164,000
竹内製作所	8,600	2,693.00	23,159,800
アマノ	15,900	2,549.00	40,529,100
JUKI	7,600	1,087.00	8,261,200
サンデンホールディングス	6,300	1,306.00	8,227,800
蛇の目ミシン工業	4,700	685.00	3,219,500
マックス	7,900	1,350.00	10,665,000
グローリー	15,300	3,080.00	47,124,000
新晃工業	5,200	1,835.00	9,542,000
大和冷機工業	8,200	1,231.00	10,094,200
セガサミーホールディングス	50,900	1,862.00	94,775,800
日本ピストンリング	1,900	2,166.00	4,115,400
リケン	2,400	5,510.00	13,224,000
T P R	5,800	2,654.00	15,393,200
ツバキ・ナカシマ	5,200	2,552.00	13,270,400
ホシザキ	16,200	11,000.00	178,200,000
大豊工業	4,200	1,186.00	4,981,200
日本精工	105,400	1,169.00	123,212,600
NTN	118,800	455.00	54,054,000
ジェイテクト	54,700	1,487.00	81,338,900
不二越	4,800	4,915.00	23,592,000

	日本トムソン	16,400	886.00	14,530,400	
	T H K	32,000	3,185.00	101,920,000	
	ユーシン精機	4,500	1,170.00	5,265,000	
	前澤給装工業	2,000	2,008.00	4,016,000	
	イーグル工業	6,300	1,754.00	11,050,200	
	前澤工業	3,800	428.00	1,626,400	
	日本ピラー工業	5,200	1,424.00	7,404,800	
	キッツ	20,800	882.00	18,345,600	
	マキタ	66,900	5,030.00	336,507,000	
	日立造船	40,700	514.00	20,919,800	
	三菱重工業	86,000	4,047.00	348,042,000	
	I H I	39,400	3,825.00	150,705,000	
	スター精密	8,200	1,931.00	15,834,200	
	小計 銘柄数 : 138			6,471,229,500	
	組入時価比率 : 99.8%			100.0%	
	合計			6,471,229,500	

(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。