

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 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	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	12,619	(99.8)	22	(0.2)	12,642	(100)
2017年7月期	5,388	(99.9)	6	(0.1)	5,395	(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	481	1,438	679	1,240
2017年7月期	165	1,379	1,062	481

(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	13,075	432	12,642	101,931
2017年7月期	5,534	139	5,395	112,021

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
2018年7月期	3,230.00
2017年7月期	2,600.00

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 銀行(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	19,483,145	52,975,003
株式	5,388,691,420	12,619,518,720
未収入金	125,802,800	400,773,610
未収配当金	728,000	1,840,000
流動資産合計	5,534,705,365	13,075,107,333
資産合計	5,534,705,365	13,075,107,333
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	125,226,660	400,611,409
未払受託者報酬	2,048,964	4,663,805
未払委託者報酬	11,064,368	25,184,477
未払利息	48	298
その他未払費用	968,446	2,259,827
流動負債合計	139,308,486	432,719,816
負債合計	139,308,486	432,719,816
純資産の部		
元本等		
元本	7,468,325,346	19,231,828,198
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△2,072,928,467	△6,589,440,681
(分配準備積立金)	310,228	930,684
元本等合計	5,395,396,879	12,642,387,517
純資産合計	5,395,396,879	12,642,387,517
負債純資産合計	5,534,705,365	13,075,107,333

(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	149,003,625	454,021,300
有価証券売買等損益	1,272,327,038	△1,620,620,167
その他収益	454	2,701
営業収益合計	1,421,331,117	△1,166,596,166
営業費用		
支払利息	7,055	23,425
受託者報酬	3,256,411	7,411,235
委託者報酬	17,584,494	40,020,553
その他費用	2,774,453	5,336,923

営業費用合計	23,622,413	52,792,136
営業利益又は営業損失(△)	1,397,708,704	△1,219,388,302
経常利益又は経常損失(△)	1,397,708,704	△1,219,388,302
当期純利益又は当期純損失(△)	1,397,708,704	△1,219,388,302
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(△)	△1,149,925,783	△2,072,928,467
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,635,104,960	2,808,689,498
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,635,104,960	2,808,689,498
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,830,589,688	5,705,202,001
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,830,589,688	5,705,202,001
分配金	125,226,660	400,611,409
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△2,072,928,467	△6,589,440,681

(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 481,641口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,240,283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 2,072,928,467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 6,589,440,681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)	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 10,193.1円 (10口当たり純資産額) (101,931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>148,997,024円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>155,222円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	148,997,024円	分配準備積立金	B	155,222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>454,000,576円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>310,228円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	454,000,576円	分配準備積立金	B	310,228円
項目																			
当期配当等収益額	A	148,997,024円																	
分配準備積立金	B	155,222円																	
項目																			
当期配当等収益額	A	454,000,576円																	
分配準備積立金	B	310,228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

配当等収益合計額	C=A+B	454,310,804円
経費	D	52,768,711円
収益分配可能額	E=C-D	401,542,093円
収益分配金	F	400,611,409円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	930,684円
口数	H	1,240,283口
10口当たり分配金	I=F/H×10	3,230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 2,559,901,046 円	期首元本額 7,468,325,346 円
期中追加設定元本額 21,389,596,640 円	期中追加設定元本額 22,301,039,320 円
期中一部交換元本額 16,481,172,340 円	期中一部交換元本額 10,537,536,468 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	365,746,324	△1,411,077,007
合計	365,746,324	△1,411,077,007

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	島根銀行	1,600	1,228.00	1,964,800	
		じもとホールディングス	51,400	148.00	7,607,200	
		めぶきフィナンシャルグループ	395,300	364.00	143,889,200	
		東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,300	2,302.00	23,710,600	
		九州フィナンシャルグループ	124,800	514.00	64,147,200	
		ゆうちょ銀行	215,500	1,270.00	273,685,000	
		富山第一銀行	19,300	454.00	8,762,200	
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	454,200	504.00	228,916,800	
		西日本フィナンシャルホールディングス	48,700	1,247.00	60,728,900	
		関西みらいフィナンシャルグループ	33,300	868.00	28,904,400	
		三十三フィナンシャルグループ	6,400	1,928.00	12,339,200	
		新生銀行	62,000	1,669.00	103,478,000	
		あおぞら銀行	45,300	4,185.00	189,580,500	

三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,325,400	638.30	3,399,202,820
りそなホールディングス	834,800	598.80	499,878,240
三井住友トラスト・ホールディングス	149,500	4,424.00	661,388,000
三井住友フィナンシャルグループ	575,800	4,287.00	2,468,454,600
第四銀行	9,300	4,265.00	39,664,500
北越銀行	7,600	2,133.00	16,210,800
千葉銀行	269,400	724.00	195,045,600
群馬銀行	154,500	565.00	87,292,500
武蔵野銀行	12,100	3,070.00	37,147,000
千葉興業銀行	20,900	443.00	9,258,700
筑波銀行	31,600	242.00	7,647,200
七十七銀行	23,900	2,391.00	57,144,900
青森銀行	5,900	3,135.00	18,496,500
秋田銀行	4,900	2,966.00	14,533,400
山形銀行	8,500	2,285.00	19,422,500
岩手銀行	5,300	4,210.00	22,313,000
東邦銀行	68,000	401.00	27,268,000
東北銀行	3,900	1,350.00	5,265,000
みちのく銀行	4,900	1,741.00	8,530,900
ふくおかフィナンシャルグループ	309,000	549.00	169,641,000
静岡銀行	191,500	961.00	184,031,500
十六銀行	10,200	2,690.00	27,438,000
スルガ銀行	77,800	959.00	74,610,200
八十二銀行	137,700	450.00	61,965,000
山梨中央銀行	47,000	389.00	18,283,000
大垣共立銀行	12,000	2,739.00	32,868,000
福井銀行	6,500	2,293.00	14,904,500
北國銀行	8,600	4,285.00	36,851,000
清水銀行	3,100	2,007.00	6,221,700
富山銀行	1,500	4,030.00	6,045,000
滋賀銀行	72,000	574.00	41,328,000
南都銀行	8,900	2,696.00	23,994,400
百五銀行	73,000	427.00	31,171,000
京都銀行	29,100	4,990.00	145,209,000
紀陽銀行	28,600	1,791.00	51,222,600

ほくほくフィナンシャルグループ	50,600	1,456.00	73,673,600
広島銀行	112,300	699.00	78,497,700
山陰合同銀行	45,100	965.00	43,521,500
中国銀行	52,600	1,108.00	58,280,800
鳥取銀行	2,400	1,632.00	3,916,800
伊予銀行	108,500	708.00	76,818,000
百十四銀行	81,000	331.00	26,811,000
四国銀行	11,700	1,257.00	14,706,900
阿波銀行	61,000	667.00	40,687,000
大分銀行	4,400	3,835.00	16,874,000
宮崎銀行	5,100	3,105.00	15,835,500
佐賀銀行	4,600	2,320.00	10,672,000
十八銀行	47,000	276.00	12,972,000
沖縄銀行	7,400	3,955.00	29,267,000
琉球銀行	14,800	1,632.00	24,153,600
セブン銀行	285,300	338.00	96,431,400
みずほフィナンシャルグループ	10,336,400	188.90	1,952,545,960
高知銀行	2,800	1,079.00	3,021,200
山口フィナンシャルグループ	94,900	1,221.00	115,872,900
長野銀行	2,500	1,792.00	4,480,000
名古屋銀行	6,100	3,930.00	23,973,000
北洋銀行	114,700	374.00	42,897,800
愛知銀行	2,600	4,755.00	12,363,000
中京銀行	3,100	2,330.00	7,223,000
大光銀行	2,600	2,055.00	5,343,000
愛媛銀行	10,600	1,240.00	13,144,000
トマト銀行	2,900	1,413.00	4,097,700
京葉銀行	67,000	460.00	30,820,000
栃木銀行	39,400	367.00	14,459,800
北日本銀行	2,400	2,497.00	5,992,800
東和銀行	13,400	1,045.00	14,003,000
福島銀行	7,200	621.00	4,471,200
大東銀行	3,600	1,119.00	4,028,400
トモニホールディングス	62,700	448.00	28,089,600
フィデアホールディングス	73,900	162.00	11,971,800
池田泉州ホールディングス	80,700	371.00	29,939,700

	小計	銘柄数：84 組入時価比率：99.8%			12,619,518,720	
					100.0%	
	合計				12,619,518,720	

(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。