

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 金融(除く銀行)(TOPIX - 17)上場投信
 コード番号 (1632)
 連動対象指標 TOPIX-17 金融(除く銀行)
 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	341	(99.6)	1	(0.4)	342	(100)
2017年7月期	459	(99.8)	1	(0.2)	460	(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	35	0	8	26
2017年7月期	82	9	56	35

(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	356	13	342	128,275
2017年7月期	472	12	460	129,497

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
2018年7月期	4,740.00
2017年7月期	3,130.00

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 金融（除く銀行）(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	2,372,444	3,731,510
株式	459,616,680	341,306,890
未収入金	10,841,540	10,986,870
流動資産合計	472,830,664	356,025,270
資産合計	472,830,664	356,025,270
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	11,136,853	12,657,222
未払受託者報酬	134,572	121,398
未払委託者報酬	726,644	655,456
未払利息	4	21
その他未払費用	69,004	59,113
流動負債合計	12,067,077	13,493,210
負債合計	12,067,077	13,493,210
純資産の部		
元本等		
元本	514,608,003	386,205,489
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△53,844,416	△43,673,429
(分配準備積立金)	35,279	20,961
元本等合計	460,763,587	342,532,060
純資産合計	460,763,587	342,532,060
負債純資産合計	472,830,664	356,025,270

(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	13,078,250	14,395,390
有価証券売買等損益	155,589,562	8,065,641
その他収益	613	313
営業収益合計	168,668,425	22,461,344
営業費用		
支払利息	1,302	1,345
受託者報酬	276,752	248,676
委託者報酬	1,494,346	1,342,721
その他費用	161,979	160,057
営業費用合計	1,934,379	1,752,799

営業利益又は営業損失(△)	166,734,046	20,708,545
経常利益又は経常損失(△)	166,734,046	20,708,545
当期純利益又は当期純損失(△)	166,734,046	20,708,545
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(△)	△399,733,697	△53,844,416
剰余金増加額又は欠損金減少額	208,640,121	2,119,664
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	208,640,121	2,119,664
剰余金減少額又は欠損金増加額	18,348,033	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	18,348,033	-
分配金	11,136,853	12,657,222
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△53,844,416	△43,673,429

(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 35,581口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 26,703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 53,844,416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 43,673,429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 12,949.7円 (10口当たり純資産額) (129,497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 12,827.5円 (10口当たり純資産額) (128,275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>13,077,561円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>27,648円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>13,105,209円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	13,077,561円	分配準備積立金	B	27,648円	配当等収益合計額	C=A+B	13,105,209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>14,394,358円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>35,279円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>14,429,637円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	14,394,358円	分配準備積立金	B	35,279円	配当等収益合計額	C=A+B	14,429,637円
項目																									
当期配当等収益額	A	13,077,561円																							
分配準備積立金	B	27,648円																							
配当等収益合計額	C=A+B	13,105,209円																							
項目																									
当期配当等収益額	A	14,394,358円																							
分配準備積立金	B	35,279円																							
配当等収益合計額	C=A+B	14,429,637円																							

経費	D	1,933,077 円	経費	D	1,751,454 円
収益分配可能額	E=C-D	11,172,132 円	収益分配可能額	E=C-D	12,678,183 円
収益分配金	F	11,136,853 円	収益分配金	F	12,657,222 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	35,279 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	20,961 円
口数	H	35,581 口	口数	H	26,703 口
10口当たり分配金	I=F/H×10	3,130 円	10口当たり分配金	I=F/H×10	4,740 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なっております。</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なっております。</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なっております。</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なっております。</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 (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 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	1,188,685,044 円	514,608,003 円
期中追加設定元本額	142,026,660 円	0 円
期中一部交換元本額	816,103,701 円	128,402,514 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	91,646,201	△1,299,774
合計	91,646,201	△1,299,774

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	F P G	1,000	1,301.00	1,301,000	
		マーキュリアインベストメント	100	1,032.00	103,200	
		S B I ホールディングス	3,500	2,719.00	9,516,500	
		日本アジア投資	300	332.00	99,600	
		ジャフコ	400	4,155.00	1,662,000	
		大和証券グループ本社	26,500	655.60	17,373,400	
		野村ホールディングス	53,300	542.30	28,904,590	
		岡三証券グループ	3,000	521.00	1,563,000	
		丸三証券	1,000	995.00	995,000	
		東洋証券	1,000	254.00	254,000	
		東海東京フィナンシャル・ホールディングス	3,400	697.00	2,369,800	
		光世証券	100	1,236.00	123,600	
		水戸証券	900	392.00	352,800	
		いちよし証券	600	1,149.00	689,400	

松井証券	1,500	1,056.00	1,584,000
だいこう証券ビジネス	200	556.00	111,200
マネックスグループ	3,200	592.00	1,894,400
カブドットコム証券	2,000	366.00	732,000
極東証券	400	1,432.00	572,800
岩井コスモホールディングス	300	1,424.00	427,200
藍澤証券	600	784.00	470,400
マネーパートナーズグループ	400	379.00	151,600
小林洋行	100	285.00	28,500
かんぽ生命保険	1,200	2,286.00	2,743,200
SOMP Oホールディングス	6,100	4,471.00	27,273,100
アニコム ホールディングス	200	4,105.00	821,000
MS & ADインシュアランスグループホール	8,100	3,395.00	27,499,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,500	2,091.00	5,227,500
第一生命ホールディングス	17,500	1,992.00	34,860,000
東京海上ホールディングス	11,700	5,266.00	61,612,200
アドバンテッジリスクマネジメント	100	1,142.00	114,200
T & Dホールディングス	9,600	1,607.00	15,427,200
アドバンスクリエイト	100	2,213.00	221,300
全国保証	900	4,985.00	4,486,500
ジェイリース	100	754.00	75,400
イントラスト	100	749.00	74,900
アルヒ	400	2,249.00	899,600
クレディセゾン	2,400	1,655.00	3,972,000
アクリーティブ	200	251.00	50,200
芙蓉総合リース	400	7,050.00	2,820,000
興銀リース	600	2,693.00	1,615,800
東京センチュリー	600	5,770.00	3,462,000
日本証券金融	1,300	571.00	742,300
アイフル	5,200	349.00	1,814,800
リコーリース	200	3,435.00	687,000
イオンフィナンシャルサービス	2,200	2,252.00	4,954,400
アコム	6,200	415.00	2,573,000
ジャックス	400	2,264.00	905,600
オリエントコーポレーション	6,700	146.00	978,200

	日立キャピタル	900	2,815.00	2,533,500	
	アプラスフィナンシャル	1,500	104.00	156,000	
	オリックス	20,700	1,818.00	37,632,600	
	三菱UFJリース	7,900	655.00	5,174,500	
	九州リースサービス	100	741.00	74,100	
	日本取引所グループ	8,900	2,011.00	17,897,900	
	イー・ギャランティ	200	2,017.00	403,400	
	アサックス	100	632.00	63,200	
	NECキャピタルソリューション	100	1,808.00	180,800	
	小計 銘柄数：58			341,306,890	
	組入時価比率：99.6%			100.0%	
	合計			341,306,890	

(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。