

平成28年7月期（平成27年7月16日～平成28年7月15日）決算短信

平成28年8月24日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS 食品(TOPIX-17) 上場投信
 コード番号 (1617)
 連動対象指標 TOPIX-17 食品
 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28年9月28日
 分配金支払開始日 平成28年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年7月期の運用状況（平成27年7月16日～平成28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28年7月期	1,339	(99.3)	8	(0.7)	1,348	(100)
平成27年7月期	760	(99.4)	4	(0.6)	765	(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28年7月期	25	20	0	45
平成27年7月期	25	79	79	25

(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28年7月期	1,363	15	1,348	296,810
平成27年7月期	778	12	765	300,901

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成28年7月期	2,990.00
平成27年7月期	4,000.00

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 食品(TOPIX-17)上場投信

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (平成27年7月15日現在)	第9期 (平成28年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,715,484	3,670,020
株式	760,835,250	1,339,913,900
未収入金	9,354,950	12,248,300
未収配当金	4,122,550	8,081,600
未収利息	7	-
流動資産合計	778,028,241	1,363,913,820
資産合計	778,028,241	1,363,913,820
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,176,000	13,586,560
未払受託者報酬	338,480	234,712
未払委託者報酬	1,827,736	1,267,378
未払利息	-	4
その他未払費用	192,807	122,024
流動負債合計	12,535,023	15,210,678
負債合計	12,535,023	15,210,678
純資産の部		
元本等		
元本	454,180,320	811,240,320
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	311,312,898	537,462,822
(分配準備積立金)	16,955	35,456
元本等合計	765,493,218	1,348,703,142
純資産合計	765,493,218	1,348,703,142
負債純資産合計	778,028,241	1,363,913,820

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	第9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日
営業収益		
受取配当金	13,717,700	16,663,050
受取利息	3,122	1,898
有価証券売買等損益	331,754,595	△27,912,577
その他収益	4,089	1,966
営業収益合計	345,479,506	△11,245,663
営業費用		
支払利息	-	699
受託者報酬	500,421	437,652

委託者報酬	2,702,178	2,363,201
その他費用	342,451	260,301
営業費用合計	3,545,050	3,061,853
営業利益又は営業損失(△)	341,934,456	△14,307,516
経常利益又は経常損失(△)	341,934,456	△14,307,516
当期純利益又は当期純損失(△)	341,934,456	△14,307,516
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(△)	115,255,433	311,312,898
剰余金増加額又は欠損金減少額	834,982,656	254,044,000
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	834,982,656	254,044,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	970,683,647	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	970,683,647	-
分配金	10,176,000	13,586,560
期末剰余金又は期末欠損金(△)	311,312,898	537,462,822

(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 27 年 7 月 16 日から平成 28 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 8 期 平成 27 年 7 月 15 日現在	第 9 期 平成 28 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 25,440 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 45,440 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 30,090.1 円 (10 口当たり純資産額) (300,901 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 29,681.0 円 (10 口当たり純資産額) (296,810 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 8 期 自平成 26 年 7 月 16 日 至平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自平成 27 年 7 月 16 日 至平成 28 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>13,724,911 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>13,094 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>13,738,005 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,545,050 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>10,192,955 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	13,724,911 円	分配準備積立金	B	13,094 円	配当等収益合計額	C=A+B	13,738,005 円	経費	D	3,545,050 円	収益分配可能額	E=C-D	10,192,955 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>16,666,215 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>16,955 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>16,683,170 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,061,154 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>13,622,016 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	16,666,215 円	分配準備積立金	B	16,955 円	配当等収益合計額	C=A+B	16,683,170 円	経費	D	3,061,154 円	収益分配可能額	E=C-D	13,622,016 円
項目																																					
当期配当等収益額	A	13,724,911 円																																			
分配準備積立金	B	13,094 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	13,738,005 円																																			
経費	D	3,545,050 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	10,192,955 円																																			
項目																																					
当期配当等収益額	A	16,666,215 円																																			
分配準備積立金	B	16,955 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	16,683,170 円																																			
経費	D	3,061,154 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	13,622,016 円																																			

収益分配金	F	10,176,000 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	16,955 円
口数	H	25,440 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	4,000 円

収益分配金	F	13,586,560 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	35,456 円
口数	H	45,440 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,990 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。

(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 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 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 8 期 平成 27 年 7 月 15 日現在	第 9 期 平成 28 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。 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 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第8期 自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	第9期 自 平成27年7月16日 至 平成28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。	

(その他の注記)

1 元本の移動

第8期 自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	第9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日		
期首元本額	457,233,183円	期首元本額	454,180,320円
期中追加設定元本額	1,422,527,040円	期中追加設定元本額	357,060,000円
期中一部交換元本額	1,425,579,903円	期中一部交換元本額	0円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第8期 自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	第9期 自 平成27年7月16日 至 平成28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	85,274,436	△28,342,185
合計	85,274,436	△28,342,185

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28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	極洋	6,000	263.00	1,578,000	
		日本水産	16,800	504.00	8,467,200	
		マルハニチロ	3,000	2,622.00	7,866,000	
		カネコ種苗	500	1,489.00	744,500	
		サカタのタネ	2,100	2,382.00	5,002,200	
		ホクト	1,500	1,921.00	2,881,500	
		ホクリヨウ	200	851.00	170,200	
		日本製粉	9,000	784.00	7,056,000	
		日清製粉グループ本社	15,900	1,693.00	26,918,700	
		日東富士製粉	1,000	335.00	335,000	
		昭和産業	6,000	477.00	2,862,000	
		鳥越製粉	1,200	685.00	822,000	
		中部飼料	1,300	710.00	923,000	

フィード・ワン	8,700	117.00	1,017,900
東洋精糖	2,000	103.00	206,000
日本甜菜製糖	7,000	188.00	1,316,000
三井製糖	6,000	485.00	2,910,000
塩水港精糖	1,600	224.00	358,400
日新製糖	600	1,382.00	829,200
森永製菓	13,000	651.00	8,463,000
中村屋	3,000	465.00	1,395,000
江崎グリコ	3,400	6,090.00	20,706,000
名糖産業	600	1,318.00	790,800
不二家	8,000	199.00	1,592,000
山崎製パン	10,600	2,841.00	30,114,600
第一屋製パン	2,000	122.00	244,000
モロゾフ	2,000	423.00	846,000
亀田製菓	800	5,780.00	4,624,000
寿スピリッツ	1,000	3,155.00	3,155,000
カルビー	5,400	4,410.00	23,814,000
森永乳業	13,000	724.00	9,412,000
六甲バター	600	2,250.00	1,350,000
ヤクルト本社	7,800	5,130.00	40,014,000
明治ホールディングス	8,600	10,550.00	90,730,000
雪印メグミルク	3,400	3,425.00	11,645,000
プリマハム	9,000	309.00	2,781,000
日本ハム	11,000	2,539.00	27,929,000
林兼産業	5,000	88.00	440,000
丸大食品	7,000	494.00	3,458,000
S F o o d s	900	2,782.00	2,503,800
伊藤ハム米久ホールディングス	8,700	999.00	8,691,300
サッポロホールディングス	4,400	2,951.00	12,984,400
アサヒグループホールディングス	27,300	3,403.00	92,901,900
キリンホールディングス	58,900	1,742.00	102,603,800
宝ホールディングス	10,500	945.00	9,922,500
オエノンホールディングス	4,000	202.00	808,000
養命酒製造	400	1,759.00	703,600
コカ・コーラウエスト	4,900	2,899.00	14,205,100
コカ・コーライーストジャパン	5,100	2,015.00	10,276,500

サントリー食品インターナショナル	10,000	4,635.00	46,350,000	
ダイドードリンコ	700	5,400.00	3,780,000	
伊藤園	4,300	3,845.00	16,533,500	
キーコーヒー	1,300	1,909.00	2,481,700	
ユニカフェ	400	878.00	351,200	
ジャパンフーズ	200	1,169.00	233,800	
日清オイリオグループ	8,000	492.00	3,936,000	
不二製油グループ本社	3,900	2,090.00	8,151,000	
かどや製油	100	2,995.00	299,500	
J-オイルミルズ	6,000	353.00	2,118,000	
キッコーマン	11,000	3,785.00	41,635,000	
味の素	30,600	2,513.00	76,897,800	
キューピー	7,400	3,250.00	24,050,000	
ハウス食品グループ本社	5,000	2,389.00	11,945,000	
カゴメ	5,200	2,657.00	13,816,400	
焼津水産化学工業	700	996.00	697,200	
アリアケジャパン	1,200	5,560.00	6,672,000	
ピエトロ	100	1,648.00	164,800	
エバラ食品工業	300	1,881.00	564,300	
ニチレイ	15,000	923.00	13,845,000	
東洋水産	7,100	4,260.00	30,246,000	
イトアンド	200	2,018.00	403,600	
日清食品ホールディングス	6,200	5,530.00	34,286,000	
永谷園ホールディングス	1,000	1,225.00	1,225,000	
一正蒲鉾	500	1,077.00	538,500	
フジッコ	1,400	2,877.00	4,027,800	
ロック・フィールド	1,500	1,607.00	2,410,500	
日本たばこ産業	86,000	4,270.00	367,220,000	
ケンコーマヨネーズ	500	3,165.00	1,582,500	
わらべや日洋	800	2,188.00	1,750,400	
なとり	700	1,550.00	1,085,000	
北の達人コーポレーション	300	476.00	142,800	
ユーグレナ	4,700	1,395.00	6,556,500	
ミヨシ油脂	5,000	121.00	605,000	
理研ビタミン	400	4,860.00	1,944,000	
小計	銘柄数：84		1,339,913,900	

	組入時価比率：99.3%			100.0%
合計				1,339,913,900

(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 28 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。