

平成23年7月期（平成22年7月16日～平成23年7月15日）決算短信

平成23年8月24日

上場取引所

東証

ファンド名 NEXT FUNDS 自動車・輸送機(TOPIX-17)上場投信
 コード番号 (1622)
 連動対象指標 TOPIX-17 自動車・輸送機
 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兼執行役会長 岩崎 俊博
 問合せ先責任者 投信ディスクロージャー部長 森保 一美 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成23年9月28日
 分配金支払開始予定日 平成23年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成23年7月期の運用状況（平成22年7月16日～平成23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23年7月期	475	(99.7)	1	(0.3)	477	(100)
平成22年7月期	862	(99.7)	2	(0.3)	865	(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23年7月期	78	0	39	38
平成22年7月期	276	79	278	78

(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23年7月期	483	5	477	124,325
平成22年7月期	886	21	865	110,367

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成23年7月期	1,310.00
平成22年7月期	2,490.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更
 ② ①以外の変更

有 無
 有 無

II 財務諸表等

【NEXT FUNDS 自動車・輸送機(TOPIX - 17)上場投信】

(1) 【貸借対照表】

期別	第 3 期 平成 22 年 7 月 15 日現在	第 4 期 平成 23 年 7 月 15 日現在
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,368,411	3,998,510
株式	862,476,200	475,928,800
未収入金	19,123,000	2,544,700
未収配当金	523,750	653,350
未収利息	12	9
流動資産合計	886,491,373	483,125,369
資産合計	886,491,373	483,125,369
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	19,516,869	5,028,697
未払受託者報酬	280,088	123,549
未払委託者報酬	1,512,404	667,101
その他未払費用	116,649	60,577
流動負債合計	21,426,010	5,879,924
負債合計	21,426,010	5,879,924
純資産の部		
元本等		
元本	1,155,727,845	566,016,315
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	290,662,482	88,770,870
(分配準備積立金)	559,926	671,817
元本等合計	865,065,363	477,245,445
純資産合計	865,065,363	477,245,445
負債純資産合計	886,491,373	483,125,369

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第3期	第4期
		自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		24,204,700	6,848,800
受取利息		9,304	2,209
有価証券売買等損益		356,872,085	53,462,291
その他収益		205	113
営業収益合計		381,086,294	60,313,413
営業費用			
受託者報酬		1,053,391	239,302
委託者報酬		5,688,169	1,292,113
その他費用		615,960	179,119
営業費用合計		7,357,520	1,710,534
営業利益		373,728,774	58,602,879
経常利益		373,728,774	58,602,879
当期純利益		373,728,774	58,602,879
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額			
期首剰余金又は期首欠損金()		1,050,653,450	290,662,482
剰余金増加額又は欠損金減少額		629,967,055	148,317,430
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額		629,967,055	148,317,430
剰余金減少額又は欠損金増加額		224,187,992	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額		224,187,992	
分配金		19,516,869	5,028,697
期末剰余金又は期末欠損金()		290,662,482	88,770,870

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第3期	第4期
	自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日
1 運用資産の評価基準 及び評価方法	(1) 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、市場価額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。	(1) 株式 同左
2 費用・収益の計上基準	(1) 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。 (2) 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	(1) 受取配当金 同左 (2) 有価証券売買等損益 同左
3 その他	当ファンドの計算期間は、平成21年7月16日から平成22年7月15日までとなっております。	当ファンドの計算期間は、平成22年7月16日から平成23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 3 期 平成 22 年 7 月 15 日現在	第 4 期 平成 23 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 78,381 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 38,387 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 290,662,482 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 88,770,870 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 11,036.7 円 (10 口当たり純資産額 110,367 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 12,432.5 円 (10 口当たり純資産額 124,325 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 3 期 自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 年 7 月 15 日	第 4 期 自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 年 7 月 15 日																																																												
1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 20,076,795 円(10 口当たり 2,561 円)のうち、19,516,869 円(10 口当たり 2,490 円)を分配金額としております。	1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 5,700,514 円(10 口当たり 1,485 円)のうち、5,028,697 円(10 口当たり 1,310 円)を分配金額としております。																																																												
<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: center;">B</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: right;">24,214,209 円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: right;">3,220,106 円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: right;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">27,434,315 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: right;">D</td> <td style="text-align: right;">7,357,520 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: right;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">20,076,795 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: right;">F</td> <td style="text-align: right;">19,516,869 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: right;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">559,926 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: right;">H</td> <td style="text-align: right;">78,381 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td style="text-align: right;">I = F / H × 10</td> <td style="text-align: right;">2,490 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	B	当期配当等収益額	24,214,209 円		分配準備積立金	3,220,106 円		配当等収益合計額	C = A + B	27,434,315 円	経費	D	7,357,520 円	収益分配可能額	E = C - D	20,076,795 円	収益分配金	F	19,516,869 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	559,926 円	口数	H	78,381 口	10 口当たり分配金	I = F / H × 10	2,490 円	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: center;">B</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: right;">6,851,122 円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: right;">B</td> <td style="text-align: right;">559,926 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: right;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">7,411,048 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: right;">D</td> <td style="text-align: right;">1,710,534 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: right;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">5,700,514 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: right;">F</td> <td style="text-align: right;">5,028,697 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: right;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">671,817 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: right;">H</td> <td style="text-align: right;">38,387 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td style="text-align: right;">I = F / H × 10</td> <td style="text-align: right;">1,310 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	B	当期配当等収益額	6,851,122 円		分配準備積立金	B	559,926 円	配当等収益合計額	C = A + B	7,411,048 円	経費	D	1,710,534 円	収益分配可能額	E = C - D	5,700,514 円	収益分配金	F	5,028,697 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	671,817 円	口数	H	38,387 口	10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,310 円
項目	A	B																																																											
当期配当等収益額	24,214,209 円																																																												
分配準備積立金	3,220,106 円																																																												
配当等収益合計額	C = A + B	27,434,315 円																																																											
経費	D	7,357,520 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	20,076,795 円																																																											
収益分配金	F	19,516,869 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	559,926 円																																																											
口数	H	78,381 口																																																											
10 口当たり分配金	I = F / H × 10	2,490 円																																																											
項目	A	B																																																											
当期配当等収益額	6,851,122 円																																																												
分配準備積立金	B	559,926 円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	7,411,048 円																																																											
経費	D	1,710,534 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	5,700,514 円																																																											
収益分配金	F	5,028,697 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	671,817 円																																																											
口数	H	38,387 口																																																											
10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,310 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3期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	第4期 自 平成22年7月16日 至 平成23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>4 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った場合、当該価額が異なることもあります。</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> <p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第 3 期 平成 22 年 7 月 15 日現在	第 4 期 平成 23 年 7 月 15 日現在
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。	1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。	2 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 3 期 自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 年 7 月 15 日	第 4 期 自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 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 3 期 自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 年 7 月 15 日	第 4 期 自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 年 7 月 15 日
期首元本額 4,082,300,700 円	期首元本額 1,155,727,845 円
期中追加設定元本額 1,178,715,300 円	期中追加設定元本額 円
期中一部交換元本額 4,105,288,155 円	期中一部交換元本額 589,711,530 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第 3 期 自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 年 7 月 15 日	第 4 期 自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 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)
種類		
株式	3,190,509	53,715,038
合計	3,190,509	53,715,038

3 デリバティブ取引関係

第 3 期(自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 年 7 月 15 日)

該当事項はございません。

第 4 期(自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 年 7 月 15 日)

該当事項はございません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

(平成23年7月15日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	横浜ゴム	4,000	483.00	1,932,000	
	東洋ゴム工業	3,000	209.00	627,000	
	ブリヂストン	12,000	1,941.00	23,292,000	
	住友ゴム工業	2,700	1,026.00	2,770,200	
	藤倉ゴム工業	200	316.00	63,200	
	オカモト	1,000	323.00	323,000	
	フコク	200	763.00	152,600	
	ニッタ	300	1,650.00	495,000	
	東海ゴム工業	600	1,067.00	640,200	
	三ツ星ベルト	1,000	437.00	437,000	
	バンドー化学	1,000	356.00	356,000	
	トヨタ紡織	1,300	1,329.00	1,727,700	
	鬼怒川ゴム工業	1,000	660.00	660,000	
	ユニプレス	500	2,277.00	1,138,500	
	豊田自動織機	3,300	2,646.00	8,731,800	
	モリタホールディングス	1,000	489.00	489,000	
	三櫻工業	400	750.00	300,000	
	デンソー	8,000	2,870.00	22,960,000	
	東海理化電機製作所	900	1,553.00	1,397,700	
	三井造船	14,000	172.00	2,408,000	
	佐世保重工業	2,000	145.00	290,000	
	川崎重工業	28,000	310.00	8,680,000	
	日本車輛製造	1,000	350.00	350,000	
	近畿車輛	1,000	308.00	308,000	
	日産自動車	46,300	848.00	39,262,400	
	いすゞ自動車	21,000	389.00	8,169,000	
	トヨタ自動車	47,000	3,330.00	156,510,000	
	日野自動車	5,000	477.00	2,385,000	
	三菱自動車工業	76,000	104.00	7,904,000	
	エフテック	100	1,255.00	125,500	
	武蔵精密工業	400	2,158.00	863,200	
	トヨタ車体	700	1,480.00	1,036,000	
	日産車体	1,000	639.00	639,000	
	関東自動車工業	600	829.00	497,400	
	新明和工業	2,000	326.00	652,000	
	極東開発工業	700	451.00	315,700	
	日信工業	700	1,478.00	1,034,600	
	トビー工業	3,000	223.00	669,000	
	ティラド	1,000	382.00	382,000	
	曙ブレーキ工業	1,700	434.00	737,800	
	タチエス	500	1,523.00	761,500	
NOK	1,800	1,346.00	2,422,800		
フタバ産業	1,000	634.00	634,000		
カヤバ工業	2,000	603.00	1,206,000		
シロキ工業	1,000	275.00	275,000		
大同メタル工業	1,000	851.00	851,000		
プレス工業	2,000	425.00	850,000		
カルソニックカンセイ	2,000	528.00	1,056,000		
太平洋工業	1,000	437.00	437,000		
ケーヒン	800	1,749.00	1,399,200		
アイシン精機	3,000	3,060.00	9,180,000		
マツダ	28,000	215.00	6,020,000		
ダイハツ工業	4,000	1,321.00	5,284,000		
愛知機械工業	1,000	313.00	313,000		
今仙電機製作所	200	1,139.00	227,800		
本田技研工業	30,900	3,210.00	99,189,000		
スズキ	7,700	1,827.00	14,067,900		
富士重工業	12,000	631.00	7,572,000		
ヤマハ発動機	5,600	1,486.00	8,321,600		
ショーワ	800	557.00	445,600		
エクセディ	400	2,858.00	1,143,200		
豊田合成	1,000	1,762.00	1,762,000		
愛三工業	400	811.00	324,400		
ヨロズ	200	1,927.00	385,400		
エフ・シー・シー	500	1,929.00	964,500		
シマノ	1,500	4,290.00	6,435,000		
タカタ	600	2,387.00	1,432,200		
ティ・エス テック	700	1,528.00	1,069,600		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	日本電産トーソク	200	938.00	187,600	
計	銘柄数：69			475,928,800	
	組入時価比率：99.7%			100%	
合計				475,928,800	

(注) 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 23 年 7 月 15 日現在)

該当事項はございません。

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

該当事項はございません。