

## 平成24年7月期（平成23年7月16日～平成24年7月15日）決算短信

平成24年8月23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兼執行役会長兼社長 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24年9月26日  
 分配金支払開始予定日 平成24年8月23日

## I ファンドの運用状況

## 1. 平成24年7月期の運用状況（平成23年7月16日～平成24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24年7月期	401	(99.4)	2	(0.6)	403	(100)
平成23年7月期	475	(99.7)	1	(0.3)	477	(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24年7月期	38	0	0	38
平成23年7月期	78	0	39	38

## (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24年7月期	410	6	403	105,239
平成23年7月期	483	5	477	124,325

## (4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成24年7月期	1,590.00
平成23年7月期	1,310.00

## 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 4 期 平成 23 年 7 月 15 日現在	第 5 期 平成 24 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	3,998,510	3,792,042
株式	475,928,800	401,717,100
未収入金	2,544,700	4,466,800
未収配当金	653,350	904,000
未収利息	9	28
流動資産合計	483,125,369	410,879,970
資産合計	483,125,369	410,879,970
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,028,697	6,103,533
未払受託者報酬	123,549	115,501
未払委託者報酬	667,101	623,649
その他未払費用	60,577	57,140
流動負債合計	5,879,924	6,899,823
負債合計	5,879,924	6,899,823
純資産の部		
元本等		
元本	566,016,315	566,016,315
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	88,770,870	162,036,168
(分配準備積立金)	671,817	942,083
元本等合計	477,245,445	403,980,147
純資産合計	477,245,445	403,980,147
負債純資産合計	483,125,369	410,879,970

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第 4 期	第 5 期
		自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 年 7 月 15 日	自 平成 23 年 7 月 16 日 至 平成 24 年 7 月 15 日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		6,848,800	7,912,750
受取利息		2,209	1,565
有価証券売買等損益		53,462,291	73,535,564
その他収益		113	38
営業収益合計		60,313,413	65,621,211
営業費用			
受託者報酬		239,302	218,753
委託者報酬		1,292,113	1,181,163
その他費用		179,119	140,638
営業費用合計		1,710,534	1,540,554
営業利益		58,602,879	67,161,765
経常利益		58,602,879	67,161,765
当期純利益		58,602,879	67,161,765
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( )		290,662,482	88,770,870
剰余金増加額又は欠損金減少額		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		148,317,430	
剰余金減少額又は欠損金増加額			
分配金		5,028,697	6,103,533
期末剰余金又は期末欠損金( )		88,770,870	162,036,168

## (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	(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	(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。
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った場合、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、平成 23 年 7 月 16 日から平成 24 年 7 月 15 日までと なっております。

## (追加情報)

第 5 期 自 平成 23 年 7 月 16 日 至 平成 24 年 7 月 15 日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会 計基準」(企業会計基準第 24 号 平成 21 年 12 月 4 日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準 の適用指針」(企業会計基準適用指針第 24 号 平成 21 年 12 月 4 日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

第 4 期 平成 23 年 7 月 15 日現在	第 5 期 平成 24 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 38,387 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 88,770,870 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 162,036,168 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)	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 10,523.9 円 (10 口当たり純資産額 105,239 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 4 期 自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 年 7 月 15 日	第 5 期 自 平成 23 年 7 月 16 日 至 平成 24 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 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。	1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 7,045,616 円(10 口当たり 1,835 円)のうち、6,103,533 円(10 口当たり 1,590 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: right;">円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">6,851,122</td> <td style="text-align: right;">円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">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: center;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">7,411,048 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">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: center;">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: center;">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: center;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">671,817 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">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: center;">I = F / H × 10</td> <td style="text-align: right;">1,310 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	円	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	<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: right;">円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">7,914,353</td> <td style="text-align: right;">円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">671,817 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">8,586,170 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">1,540,554 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">7,045,616 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">6,103,533 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">942,083 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">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: center;">I = F / H × 10</td> <td style="text-align: right;">1,590 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	円	当期配当等収益額	7,914,353	円	分配準備積立金	B	671,817 円	配当等収益合計額	C = A + B	8,586,170 円	経費	D	1,540,554 円	収益分配可能額	E = C - D	7,045,616 円	収益分配金	F	6,103,533 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	942,083 円	口数	H	38,387 口	10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,590 円
項目	A	円																																																											
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	円																																																											
当期配当等収益額	7,914,353	円																																																											
分配準備積立金	B	671,817 円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	8,586,170 円																																																											
経費	D	1,540,554 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	7,045,616 円																																																											
収益分配金	F	6,103,533 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	942,083 円																																																											
口数	H	38,387 口																																																											
10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,590 円																																																											
2 その他費用 その他費用のうち 109,955 円は、対象指数についての商標使用料であります。	2 その他費用 その他費用のうち 100,500 円は、対象指数についての商標使用料であります。																																																												

(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 4 期 自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 年 7 月 15 日	第 5 期 自 平成 23 年 7 月 16 日 至 平成 24 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なっております。 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なっております。 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なっております。 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なっております。</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 4 期 平成 23 年 7 月 15 日現在	第 5 期 平成 24 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4期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第5期 自 平成23年7月16日 至 平成24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4期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第5期 自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日
期首元本額 1,155,727,845 円	期首元本額 566,016,315 円
期中追加設定元本額 円	期中追加設定元本額 円
期中一部交換元本額 589,711,530 円	期中一部交換元本額 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

	第4期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第5期 自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日
種類	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	53,715,038	71,233,876
合計	53,715,038	71,233,876

## 3 デリバティブ取引関係

第4期(平成23年7月15日現在)

該当事項はございません。

第5期(平成24年7月15日現在)

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24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	5,000	548.00	2,740,000	
	東洋ゴム工業	3,000	235.00	705,000	
	ブリヂストン	11,800	1,776.00	20,956,800	
	住友ゴム工業	2,900	963.00	2,792,700	
	藤倉ゴム工業	200	276.00	55,200	
	オカモト	1,000	321.00	321,000	
	フコク	200	778.00	155,600	
	ニッタ	400	1,212.00	484,800	
	東海ゴム工業	700	843.00	590,100	
	三ツ星ベルト	1,000	425.00	425,000	
	バンドー化学	1,000	302.00	302,000	
	トヨタ紡織	1,300	909.00	1,181,700	
	鬼怒川ゴム工業	1,000	493.00	493,000	
	ユニプレス	600	1,938.00	1,162,800	
	豊田自動織機	3,300	2,159.00	7,124,700	
	モリタホールディングス	1,000	573.00	573,000	
	三櫻工業	500	646.00	323,000	
	デンソー	8,900	2,506.00	22,303,400	
	東海理化電機製作所	800	1,214.00	971,200	
	三井造船	14,000	105.00	1,470,000	
佐世保重工業	2,000	89.00	178,000		
川崎重工業	26,000	193.00	5,018,000		
日本車輛製造	1,000	265.00	265,000		
近畿車輛	1,000	279.00	279,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	日産自動車	45,800	711.00	32,563,800	
	いすゞ自動車	23,000	397.00	9,131,000	
	トヨタ自動車	46,600	3,010.00	140,266,000	
	日野自動車	5,000	550.00	2,750,000	
	三菱自動車工業	80,000	75.00	6,000,000	
	エフテック	100	1,308.00	130,800	
	武蔵精密工業	300	1,388.00	416,400	
	日産車体	1,000	826.00	826,000	
	新明和工業	2,000	384.00	768,000	
	極東開発工業	600	704.00	422,400	
	日信工業	700	1,003.00	702,100	
	トビー工業	3,000	214.00	642,000	
	ティラド	1,000	250.00	250,000	
	曙ブレーキ工業	1,800	347.00	624,600	
	タチエス	500	1,349.00	674,500	
	NOK	1,700	1,546.00	2,628,200	
	フタバ産業	1,000	389.00	389,000	
	カヤバ工業	2,000	313.00	626,000	
	シロキ工業	1,000	206.00	206,000	
	大同メタル工業	1,000	756.00	756,000	
	プレス工業	2,000	354.00	708,000	
	カルソニックカンセイ	2,000	398.00	796,000	
	太平洋工業	700	489.00	342,300	
	ケーヒン	700	1,042.00	729,400	
	アイシン精機	3,000	2,439.00	7,317,000	
	マツダ	48,000	95.00	4,560,000	
	ダイハツ工業	3,000	1,386.00	4,158,000	
	今仙電機製作所	300	1,051.00	315,300	
	本田技研工業	30,400	2,488.00	75,635,200	
	スズキ	7,500	1,529.00	11,467,500	
	富士重工業	11,000	612.00	6,732,000	
	ヤマハ発動機	5,900	704.00	4,153,600	
	ショーワ	800	616.00	492,800	
	エクセディ	500	1,618.00	809,000	
	豊田合成	1,000	1,658.00	1,658,000	
	愛三工業	400	658.00	263,200	
	ヨロズ	200	1,206.00	241,200	
	エフ・シー・シー	600	1,223.00	733,800	
	シマノ	1,300	5,150.00	6,695,000	
	タカタ	700	1,554.00	1,087,800	
	テイ・エス テック	800	1,314.00	1,051,200	
	日本電産トーソク	200	635.00	127,000	
計	銘柄数：66			401,717,100	
	組入時価比率：99.4%			100.0%	
合計				401,717,100	

(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24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。