

平成29年7月期（平成28年7月16日～平成29年7月15日）決算短信

平成29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29年9月27日
 分配金支払開始日 平成29年8月23日

ファンドの運用状況

1. 平成29年7月期の運用状況（平成28年7月16日～平成29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29年7月期	6,811	(99.7)	22	(0.3)	6,833	(100)
平成28年7月期	2,141	(99.3)	14	(0.7)	2,155	(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
平成29年7月期	122	339	138	323
平成28年7月期	81	219	179	122

(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
平成29年7月期	6,990	157	6,833	211,403
平成28年7月期	2,254	98	2,155	176,426

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成29年7月期	4,430.00
平成28年7月期	7,430.00

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 自動車・輸送機(TOPIX-17)上場投信

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (平成28年7月15日現在)	第10期 (平成29年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,859,211	20,112,746
株式	2,141,246,050	6,811,028,350
未収入金	92,270,500	141,315,550
未収配当金	11,705,550	17,774,350
流動資産合計	2,254,081,311	6,990,230,996
資産合計	2,254,081,311	6,990,230,996
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	90,780,483	143,190,004
未払受託者報酬	1,120,532	2,015,349
未払委託者報酬	6,050,793	10,882,823
未払利息	11	48
その他未払費用	536,010	998,837
流動負債合計	98,487,829	157,087,061
負債合計	98,487,829	157,087,061
純資産の部		
元本等		
元本	1,801,558,845	4,765,996,860
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	354,034,637	2,067,147,075
(分配準備積立金)	51,340	39,954
元本等合計	2,155,593,482	6,833,143,935
純資産合計	2,155,593,482	6,833,143,935
負債純資産合計	2,254,081,311	6,990,230,996

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	第10期 自 平成28年7月16日 至 平成29年7月15日
営業収益		
受取配当金	104,865,199	163,765,348
受取利息	5,446	-
有価証券売買等損益	△1,790,450,634	205,083,557
その他収益	1,123	1,048
営業収益合計	△1,685,578,866	368,849,953
営業費用		
支払利息	2,443	7,888
受託者報酬	1,970,958	2,862,464

委託者報酬	10,643,021	15,457,216
その他費用	1,462,590	2,260,210
営業費用合計	14,079,012	20,587,778
営業利益又は営業損失(△)	△1,699,657,878	348,262,175
経常利益又は経常損失(△)	△1,699,657,878	348,262,175
当期純利益又は当期純損失(△)	△1,699,657,878	348,262,175
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(△)	827,216,960	354,034,637
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,962,888,913	2,285,769,422
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,962,888,913	2,285,769,422
剰余金減少額又は欠損金増加額	645,632,875	777,729,155
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	645,632,875	777,729,155
分配金	90,780,483	143,190,004
期末剰余金又は期末欠損金(△)	354,034,637	2,067,147,075

(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 28 年 7 月 16 日から平成 29 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 9 期 平成 28 年 7 月 15 日現在	第 10 期 平成 29 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 122,181 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 323,228 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 17,642.6 円 (10 口当たり純資産額) (176,426 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 21,140.3 円 (10 口当たり純資産額) (211,403 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 10 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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>104,869,325 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>39,067 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>104,908,392 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>14,076,569 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>90,831,823 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	104,869,325 円	分配準備積立金	B	39,067 円	配当等収益合計額	C=A+B	104,908,392 円	経費	D	14,076,569 円	収益分配可能額	E=C-D	90,831,823 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>163,758,508 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>51,340 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>163,809,848 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>20,579,890 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>143,229,958 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	163,758,508 円	分配準備積立金	B	51,340 円	配当等収益合計額	C=A+B	163,809,848 円	経費	D	20,579,890 円	収益分配可能額	E=C-D	143,229,958 円
項目																																					
当期配当等収益額	A	104,869,325 円																																			
分配準備積立金	B	39,067 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	104,908,392 円																																			
経費	D	14,076,569 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	90,831,823 円																																			
項目																																					
当期配当等収益額	A	163,758,508 円																																			
分配準備積立金	B	51,340 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	163,809,848 円																																			
経費	D	20,579,890 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	143,229,958 円																																			

収益分配金	F	90,780,483 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	51,340 円
口数	H	122,181 口
10口当たり分配金	I=F/H×10	7,430 円

収益分配金	F	143,190,004 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	39,954 円
口数	H	323,228 口
10口当たり分配金	I=F/H×10	4,430 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9期 自平成27年7月16日 至平成28年7月15日	第10期 自平成28年7月16日 至平成29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9期 平成28年7月15日現在	第10期 平成29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9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	第10期 自 平成28年7月16日 至 平成29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9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	第10期 自 平成28年7月16日 至 平成29年7月15日		
期首元本額	1,203,693,330円	期首元本額	1,801,558,845円
期中追加設定元本額	3,239,034,150円	期中追加設定元本額	5,008,139,250円
期中一部交換元本額	2,641,168,635円	期中一部交換元本額	2,043,701,235円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日	第10期 自 平成28年7月16日 至 平成29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	△673,682,134	200,075,739
合計	△673,682,134	200,075,739

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29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	横浜ゴム	18,700	2,314.00	43,271,800	
		東洋ゴム工業	16,300	2,381.00	38,810,300	
		ブリヂストン	104,400	4,885.00	509,994,000	
		住友ゴム工業	29,000	1,999.00	57,971,000	
		藤倉ゴム工業	2,600	720.00	1,872,000	
		オカモト	9,000	1,327.00	11,943,000	
		フコク	1,300	1,045.00	1,358,500	
		ニッタ	2,800	3,565.00	9,982,000	
		住友理工	5,700	1,183.00	6,743,100	
		三ツ星ベルト	7,000	1,242.00	8,694,000	
		バンドー化学	5,600	1,095.00	6,132,000	
		トヨタ紡織	10,300	2,335.00	24,050,500	
		芦森工業	7,000	347.00	2,429,000	

ユニプレス	5,700	2,751.00	15,680,700
豊田自動織機	26,900	6,470.00	174,043,000
モリタホールディングス	5,200	1,740.00	9,048,000
三櫻工業	3,700	810.00	2,997,000
デンソー	72,900	4,897.00	356,991,300
東海理化電機製作所	7,800	2,184.00	17,035,200
三井造船	107,000	162.00	17,334,000
川崎重工業	230,000	351.00	80,730,000
名村造船所	8,900	672.00	5,980,800
サノヤスホールディングス	3,600	269.00	968,400
日本車輛製造	11,000	286.00	3,146,000
ニチユ三菱フォークリフト	3,500	786.00	2,751,000
近畿車輛	400	2,538.00	1,015,200
日産自動車	348,500	1,150.50	400,949,250
いすゞ自動車	85,600	1,437.50	123,050,000
トヨタ自動車	359,300	6,258.00	2,248,499,400
日野自動車	42,200	1,264.00	53,340,800
三菱自動車工業	108,300	752.00	81,441,600
エフテック	1,700	1,424.00	2,420,800
レシップホールディングス	1,000	908.00	908,000
GMB	500	1,200.00	600,000
ファルテック	500	1,434.00	717,000
武蔵精密工業	3,400	3,235.00	10,999,000
日産車体	13,000	1,134.00	14,742,000
新明和工業	11,900	962.00	11,447,800
極東開発工業	5,900	1,847.00	10,897,300
日信工業	6,600	1,869.00	12,335,400
トピー工業	2,400	3,410.00	8,184,000
ティラド	11,000	350.00	3,850,000
曙ブレーキ工業	13,700	384.00	5,260,800
タチエス	5,000	2,088.00	10,440,000
NOK	14,300	2,486.00	35,549,800
フタバ産業	9,000	1,007.00	9,063,000
KYB	33,000	612.00	20,196,000
大同メタル工業	3,700	1,017.00	3,762,900
プレス工業	15,700	525.00	8,242,500

	ミクニ	3,700	493.00	1,824,100	
	太平洋工業	6,700	1,557.00	10,431,900	
	ケーヒン	6,800	1,654.00	11,247,200	
	河西工業	4,000	1,445.00	5,780,000	
	アイシン精機	27,000	6,210.00	167,670,000	
	富士機工	2,900	737.00	2,137,300	
	マツダ	93,600	1,608.00	150,508,800	
	今仙電機製作所	2,700	1,277.00	3,447,900	
	本田技研工業	265,900	3,134.00	833,330,600	
	スズキ	58,600	5,452.00	319,487,200	
	SUBARU	91,700	4,141.00	379,729,700	
	安永	1,400	1,529.00	2,140,600	
	ヤマハ発動機	41,700	2,909.00	121,305,300	
	ショーワ	7,700	1,158.00	8,916,600	
	T B K	3,800	515.00	1,957,000	
	エクセディ	4,000	3,245.00	12,980,000	
	豊田合成	9,500	2,756.00	26,182,000	
	愛三工業	5,200	932.00	4,846,400	
	盟和産業	400	1,241.00	496,400	
	ヨロズ	2,800	1,868.00	5,230,400	
	エフ・シー・シー	4,800	2,349.00	11,275,200	
	シマノ	11,900	18,020.00	214,438,000	
	テイ・エス テック	6,900	3,365.00	23,218,500	
	ジャムコ	1,700	2,693.00	4,578,100	
	小計	銘柄数 : 73		6,811,028,350	
		組入時価比率 : 99.7%		100.0%	
	合計			6,811,028,350	

(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 29 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。