



2021年7月期 (2020年7月16日～2021年7月15日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2021 (July 16, 2020 – July 15, 2021)

2021年8月25日
 August 25, 2021

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 東証銀行業株価指数連動型上場投信
 コード番号 (1615)
 連動対象指標 東証銀行業株価指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 100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 兼代表取締役社長 小池 広靖
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 山中 淳 TEL 0120-753104

Fund name: NEXT FUNDS TOPIX Banks Exchange Traded Fund
 Code: 1615
 Underlying index: TOPIX Banks Index
 Primary invested assets: Stocks
 Trading unit: 100 units
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Hiroyasu Koike, President & CEO
 Contact person: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2021年9月29日
 分配金支払開始日 2021年8月23日
 Scheduled date of submission of securities report: September 29, 2021
 Date of commencing dividend payment: August 23, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021年7月期の運用状況 (2020年7月16日～2021年7月15日)

Management Status for Year ended July 2021 (from July 16, 2020 to July 15, 2021)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

Assets (fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

	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)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	42,308	(100.0)	13	(0.0)	42,321	(100.0)
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	15,497	(99.8)	33	(0.2)	15,530	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	130,595	324,399	159,608	295,386
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	173,132	24,964	67,502	130,595

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	100口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	43,557	1,235	42,321	14,328
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	16,307	777	15,530	11,892

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	403
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	580

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無
 Changes other than those in ① No

II 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit: JPY)

	第18期 (2020年7月15日現在) 18th Fiscal Year As of July 15, 2020	第19期 (2021年7月15日現在) 19th Fiscal Year As of July 15, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
コール・ローン Call loans	807,652,511	1,242,645,040
株式 Stocks	15,497,317,660	42,308,509,930
未収配当金 Accrued dividends receivable	2,531,500	5,923,200
流動資産合計 Total current assets	16,307,501,671	43,557,078,170
資産合計 Total assets	16,307,501,671	43,557,078,170
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	757,453,784	1,190,408,425
未払受託者報酬 Trustee fees payable	6,184,858	14,155,869
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	13,253,189	24,267,146
未払利息 Accrued interest expenses	416	1,156
その他未払費用 Other accrued expenses	176,646	6,274,761
流動負債合計 Total current liabilities	777,068,893	1,235,107,357
負債合計 Total liabilities	777,068,893	1,235,107,357
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	26,119,096,000	59,077,341,200
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△10,588,663,222	△16,755,370,387

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	642, 872	2, 911, 232
元本等合計 Total principal and other	15, 530, 432, 778	42, 321, 970, 813
純資産合計 Total net assets	15, 530, 432, 778	42, 321, 970, 813
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	16, 307, 501, 671	43, 557, 078, 170

(2) 【損益及び剰余金計算書】 Statement of Income and Retained Earnings

(単位：円) (Unit：JPY)

	第18期 自 2019年7月16日 至 2020年7月15日 18th Fiscal Year From July 16, 2019 to July 15, 2020	第19期 自 2020年7月16日 至 2021年7月15日 19th Fiscal Year From July 16, 2020 to July 15, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	805, 130, 050	1, 262, 846, 500
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△3, 795, 824, 521	3, 937, 813, 821
その他収益 Other revenue	11, 552	10, 311
営業収益合計 Total operating revenue	△2, 990, 682, 919	5, 200, 670, 632
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	189, 591	96, 922
受託者報酬 Trustee fees	14, 857, 940	22, 564, 397
委託者報酬 Investment trust management fees	31, 838, 294	39, 839, 989
その他費用 Other expenses	424, 452	7, 678, 718
営業費用合計 Total operating expenses	47, 310, 277	70, 180, 026
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△3, 037, 993, 196	5, 130, 490, 606
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△3, 037, 993, 196	5, 130, 490, 606
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△3, 037, 993, 196	5, 130, 490, 606
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 (△) Distribution of profit loss from partial exchange	-	-
期首剰余金又は期首欠損金 (△) Surplus (deficit) at beginning of period	△9, 731, 818, 384	△10, 588, 663, 222
剰余金増加額又は欠損金減少額	4, 575, 557, 260	11, 060, 301, 900

Increase in surplus or decrease in deficit		
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from partial exchange	4,575,557,260	11,060,301,900
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	1,636,955,118	21,167,091,246
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from additional subscriptions for period	1,636,955,118	21,167,091,246
分配金 Dividends	757,453,784	1,190,408,425
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△10,588,663,222	△16,755,370,387

(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、2020年7月16日から2021年7月15日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第18期 2020年7月15日現在	第19期 2021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 130,595,480 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 295,386,706 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 10,588,663,222 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 16,755,370,387 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 118.92 円 (100口当たり純資産額) (11,892 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 143.28 円 (100口当たり純資産額) (14,328 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自2019年7月16日 至2020年7月15日	第19期 自2020年7月16日 至2021年7月15日
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程
項目	項目

当期配当等収益額	A	804,952,011円
分配準備積立金	B	265,331円
配当等収益合計額	C=A+B	805,217,342円
経費	D	47,120,686円
収益分配可能額	E=C-D	758,096,656円
収益分配金	F	757,453,784円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	642,872円
口数	H	130,595,480口
100口当たり分配金	I=F/H×100	580円

当期配当等収益額	A	1,262,759,889円
分配準備積立金	B	642,872円
配当等収益合計額	C=A+B	1,263,402,761円
経費	D	70,083,104円
収益分配可能額	E=C-D	1,193,319,657円
収益分配金	F	1,190,408,425円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,911,232円
口数	H	295,386,706口
100口当たり分配金	I=F/H×100	403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18期 自 2019年7月16日 至 2020年7月15日	第19期 自 2020年7月16日 至 2021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18期 2020年7月15日現在	第19期 2021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</p> <p>(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</p> <p>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18期 自 2019年 7月 16日 至 2020年 7月 15日	第19期 自 2020年 7月 16日 至 2021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18期 自 2019年 7月 16日 至 2020年 7月 15日	第19期 自 2020年 7月 16日 至 2021年 7月 15日
期首元本額 34,626,581,200円	期首元本額 26,119,096,000円
期中追加設定元本額 4,992,980,000円	期中追加設定元本額 64,879,980,000円
期中一部交換元本額 13,500,465,200円	期中一部交換元本額 31,921,734,800円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第18期 自 2019年 7月 16日 至 2020年 7月 15日	第19期 自 2020年 7月 16日 至 2021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	△2,827,436,131	2,973,141,055
合計	△2,827,436,131	2,973,141,055

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(2021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	島根銀行	10,900	614.00	6,692,600	
		じもとホールディングス	21,700	641.00	13,909,700	
		めぶきフィナンシャルグループ	1,665,000	237.00	394,605,000	
		東京きらぼしフィナンシャルグループ	40,100	1,574.00	63,117,400	
		九州フィナンシャルグループ	654,400	391.00	255,870,400	
		ゆうちょ銀行	907,900	940.00	853,426,000	
		富山第一銀行	76,500	273.00	20,884,500	
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,952,200	402.00	784,784,400	
		西日本フィナンシャルホールディングス	209,200	629.00	131,586,800	
		三十三フィナンシャルグループ	27,700	1,409.00	39,029,300	

第四北越フィナンシャルグループ	52,200	2,466.00	128,725,200
ひろぎんホールディングス	472,500	585.00	276,412,500
新生銀行	261,300	1,457.00	380,714,100
あおぞら銀行	191,000	2,480.00	473,680,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	21,919,800	589.60	12,923,914,080
りそなホールディングス	3,698,000	420.30	1,554,269,400
三井住友トラスト・ホールディングス	605,700	3,556.00	2,153,869,200
三井住友フィナンシャルグループ	2,217,500	3,748.00	8,311,190,000
千葉銀行	1,069,300	652.00	697,183,600
群馬銀行	659,500	348.00	229,506,000
武蔵野銀行	47,800	1,678.00	80,208,400
千葉興業銀行	81,600	253.00	20,644,800
筑波銀行	133,300	169.00	22,527,700
七十七銀行	100,400	1,170.00	117,468,000
青森銀行	24,900	2,033.00	50,621,700
秋田銀行	19,300	1,419.00	27,386,700
山形銀行	35,900	872.00	31,304,800
岩手銀行	21,100	1,720.00	36,292,000
東邦銀行	286,500	211.00	60,451,500
東北銀行	15,500	998.00	15,469,000
みちのく銀行	20,700	914.00	18,919,800
ふくおかフィナンシャルグループ	289,200	1,892.00	547,166,400
静岡銀行	780,300	841.00	656,232,300
十六銀行	40,000	1,954.00	78,160,000
スルガ銀行	281,100	329.00	92,481,900
八十二銀行	721,700	358.00	258,368,600
山梨中央銀行	37,100	829.00	30,755,900
大垣共立銀行	63,200	1,889.00	119,384,800
福井銀行	27,400	1,411.00	38,661,400
北國銀行	29,800	2,123.00	63,265,400
清水銀行	13,100	1,520.00	19,912,000
富山銀行	6,100	2,210.00	13,481,000
滋賀銀行	64,200	1,969.00	126,409,800
南都銀行	46,800	1,874.00	87,703,200

百五銀行	288,400	306.00	88,250,400
京都銀行	114,700	4,910.00	563,177,000
紀陽銀行	113,500	1,517.00	172,179,500
ほくほくフィナンシャルグループ	213,200	813.00	173,331,600
山陰合同銀行	201,900	555.00	112,054,500
中国銀行	275,900	857.00	236,446,300
鳥取銀行	10,100	1,109.00	11,200,900
伊予銀行	424,600	542.00	230,133,200
百十四銀行	34,000	1,512.00	51,408,000
四国銀行	45,600	717.00	32,695,200
阿波銀行	49,200	2,036.00	100,171,200
大分銀行	18,500	1,702.00	31,487,000
宮崎銀行	20,100	2,007.00	40,340,700
佐賀銀行	18,300	1,375.00	25,162,500
沖縄銀行	29,300	2,520.00	73,836,000
琉球銀行	69,400	722.00	50,106,800
セブン銀行	1,070,500	241.00	257,990,500
みずほフィナンシャルグループ	4,354,300	1,579.50	6,877,616,850
高知銀行	11,500	800.00	9,200,000
山口フィナンシャルグループ	400,000	614.00	245,600,000
長野銀行	10,400	1,092.00	11,356,800
名古屋銀行	25,800	2,533.00	65,351,400
北洋銀行	483,100	242.00	116,910,200
愛知銀行	10,600	2,865.00	30,369,000
中京銀行	11,400	1,460.00	16,644,000
大光銀行	10,900	1,325.00	14,442,500
愛媛銀行	44,900	771.00	34,617,900
トマト銀行	12,200	1,030.00	12,566,000
京葉銀行	136,700	412.00	56,320,400
栃木銀行	154,700	171.00	26,453,700
北日本銀行	9,900	1,603.00	15,869,700
東和銀行	56,300	504.00	28,375,200
福島銀行	36,600	238.00	8,710,800
大東銀行	15,500	620.00	9,610,000
トモニホールディングス	247,800	304.00	75,331,200

	フィデアホールディングス	311,100	122.00	37,954,200	
	池田泉州ホールディングス	368,500	159.00	58,591,500	
	小計 銘柄数：81			42,308,509,930	
	組入時価比率：100.0%			100.0%	
	合計			42,308,509,930	

(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(2021 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。