

平成27年7月期（平成26年7月16日～平成27年7月15日）決算短信

平成27年8月26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27年9月29日
 分配金支払開始日 平成27年8月21日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年7月期の運用状況（平成26年7月16日～平成27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27年7月期	2,019	(99.4)	11	(0.6)	2,030	(100)
平成26年7月期	4,808	(99.8)	10	(0.2)	4,818	(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27年7月期	239	479	637	81
平成26年7月期	218	419	398	239

(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27年7月期	2,131	100	2,030	248,782
平成26年7月期	4,929	111	4,818	201,184

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成27年7月期	11,290.00
平成26年7月期	4,260.00

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 自動車・輸送機(TOPIX-17)上場投信

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (平成26年7月15日現在)	第8期 (平成27年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,262,982	8,169,162
株式	4,808,078,900	2,019,219,450
未収入金	101,175,900	93,243,100
未収配当金	9,269,950	10,736,600
未収利息	20	15
流動資産合計	4,929,787,752	2,131,368,327
資産合計	4,929,787,752	2,131,368,327
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	102,034,668	92,164,786
未払受託者報酬	1,308,086	1,204,543
未払委託者報酬	7,063,617	6,504,443
その他未払費用	664,954	584,265
流動負債合計	111,071,325	100,458,037
負債合計	111,071,325	100,458,037
純資産の部		
元本等		
元本	3,531,692,910	1,203,693,330
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,287,023,517	827,216,960
(分配準備積立金)	175,544	39,067
元本等合計	4,818,716,427	2,030,910,290
純資産合計	4,818,716,427	2,030,910,290
負債純資産合計	4,929,787,752	2,131,368,327

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 自平成25年7月16日 至平成26年7月15日	第8期 自平成26年7月16日 至平成27年7月15日
営業収益		
受取配当金	121,085,250	110,011,816
受取利息	8,551	10,738
有価証券売買等損益	109,111,084	1,115,805,181
その他収益	93	357
営業収益合計	230,204,978	1,225,828,092
営業費用		
受託者報酬	2,655,398	2,549,680
委託者報酬	14,339,056	13,768,128

その他費用	2,016,320	1,676,794
営業費用合計	19,010,774	17,994,602
営業利益又は営業損失(△)	211,194,204	1,207,833,490
経常利益又は経常損失(△)	211,194,204	1,207,833,490
当期純利益又は当期純損失(△)	211,194,204	1,207,833,490
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(△)	1,262,587,985	1,287,023,517
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,325,882,271	4,752,760,459
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,325,882,271	4,752,760,459
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,410,606,275	6,328,235,720
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,410,606,275	6,328,235,720
分配金	102,034,668	92,164,786
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,287,023,517	827,216,960

(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、信託約款の規定により、平成26年7月16日から平成27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7期 平成26年7月15日現在	第8期 平成27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 239,518口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 81,634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 20,118.4円 (10口当たり純資産額) (201,184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 24,878.2円 (10口当たり純資産額) (248,782円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自平成25年7月16日 至平成26年7月15日	第8期 自平成26年7月16日 至平成27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>121,093,894円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>127,092円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>121,220,986円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>19,010,774円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>102,210,212円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>102,034,668円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	121,093,894円	分配準備積立金	B	127,092円	配当等収益合計額	C=A+B	121,220,986円	経費	D	19,010,774円	収益分配可能額	E=C-D	102,210,212円	収益分配金	F	102,034,668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>110,022,911円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>175,544円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>110,198,455円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>17,994,602円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>92,203,853円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>92,164,786円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	110,022,911円	分配準備積立金	B	175,544円	配当等収益合計額	C=A+B	110,198,455円	経費	D	17,994,602円	収益分配可能額	E=C-D	92,203,853円	収益分配金	F	92,164,786円
項目																																											
当期配当等収益額	A	121,093,894円																																									
分配準備積立金	B	127,092円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	121,220,986円																																									
経費	D	19,010,774円																																									
収益分配可能額	E=C-D	102,210,212円																																									
収益分配金	F	102,034,668円																																									
項目																																											
当期配当等収益額	A	110,022,911円																																									
分配準備積立金	B	175,544円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	110,198,455円																																									
経費	D	17,994,602円																																									
収益分配可能額	E=C-D	92,203,853円																																									
収益分配金	F	92,164,786円																																									

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	175,544 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	39,067 円
口数	H	239,518 口	口数	H	81,634 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	4,260 円	10 口当たり分配金	I=F/H×10	11,290 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 7 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 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 7 期 平成 26 年 7 月 15 日現在	第 8 期 平成 27 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 7 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 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7期 自平成25年7月16日 至平成26年7月15日	第8期 自平成26年7月16日 至平成27年7月15日
期首元本額	3,218,140,485円	3,531,692,910円
期中追加設定元本額	6,183,905,550円	7,073,766,300円
期中一部交換元本額	5,870,353,125円	9,401,765,880円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第7期 自平成25年7月16日 至平成26年7月15日	第8期 自平成26年7月16日 至平成27年7月15日
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	△18,999,780	△14,014,101
合計	△18,999,780	△14,014,101

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27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	4,100	2,406.00	9,864,600	
		東洋ゴム工業	3,300	2,623.00	8,655,900	
		ブリヂストン	23,000	4,603.50	105,880,500	
		住友ゴム工業	5,700	1,844.00	10,510,800	
		藤倉ゴム工業	600	698.00	418,800	
		オカモト	3,000	534.00	1,602,000	
		フコク	300	1,173.00	351,900	
		ニッタ	700	3,285.00	2,299,500	
		住友理工	1,400	960.00	1,344,000	
		三ツ星ベルト	2,000	948.00	1,896,000	
		バンダー化学	3,000	517.00	1,551,000	
		トヨタ紡織	2,400	2,087.00	5,008,800	
		鬼怒川ゴム工業	2,000	657.00	1,314,000	
		ユニプレス	1,300	2,404.00	3,125,200	
		豊田自動織機	6,400	6,840.00	43,776,000	
		モリタホールディングス	1,200	1,208.00	1,449,600	
三櫻工業	900	829.00	746,100			

デンソー	17,300	5,977.00	103,402,100
東海理化電機製作所	1,800	2,957.00	5,322,600
三井造船	27,000	217.00	5,859,000
川崎重工業	51,000	563.00	28,713,000
名村造船所	1,900	1,039.00	1,974,100
サノヤスホールディングス	800	249.00	199,200
日本車輛製造	3,000	341.00	1,023,000
ニチュ三菱フォークリフト	800	575.00	460,000
近畿車輛	1,000	352.00	352,000
日産自動車	98,200	1,221.00	119,902,200
いすゞ自動車	22,100	1,606.50	35,503,650
トヨタ自動車	96,500	8,273.00	798,344,500
日野自動車	10,000	1,444.00	14,440,000
三菱自動車工業	25,600	1,051.00	26,905,600
エフテック	400	1,230.00	492,000
レシップホールディングス	200	899.00	179,800
GMB	100	1,262.00	126,200
ファルテック	100	1,522.00	152,200
武蔵精密工業	700	2,210.00	1,547,000
日産車体	3,100	1,691.00	5,242,100
新明和工業	3,000	1,112.00	3,336,000
極東開発工業	1,300	1,298.00	1,687,400
日信工業	1,300	2,032.00	2,641,600
トピー工業	6,000	308.00	1,848,000
ティラド	3,000	235.00	705,000
曙ブレーキ工業	3,000	392.00	1,176,000
タチエス	1,100	1,734.00	1,907,400
NOK	3,400	3,755.00	12,767,000
フタバ産業	2,100	561.00	1,178,100
カヤバ工業	8,000	416.00	3,328,000
シロキ工業	2,000	358.00	716,000
大同メタル工業	1,000	1,194.00	1,194,000
プレス工業	3,500	553.00	1,935,500
ミクニ	700	554.00	387,800
カルソニックカンセイ	5,000	847.00	4,235,000
太平洋工業	1,400	1,172.00	1,640,800

ケーヒン	1,600	1,642.00	2,627,200	
河西工業	900	1,398.00	1,258,200	
アイシン精機	6,400	5,010.00	32,064,000	
富士機工	800	675.00	540,000	
マツダ	20,800	2,441.50	50,783,200	
ダイハツ工業	8,400	1,730.00	14,532,000	
今仙電機製作所	600	1,254.00	752,400	
本田技研工業	63,000	3,996.50	251,779,500	
スズキ	14,600	4,094.00	59,772,400	
富士重工業	23,800	4,546.00	108,194,800	
安永	200	578.00	115,600	
ヤマハ発動機	10,600	2,739.00	29,033,400	
ショーワ	1,700	1,172.00	1,992,400	
TBK	900	550.00	495,000	
エクセディ	1,000	3,015.00	3,015,000	
豊田合成	2,300	2,793.00	6,423,900	
愛三工業	1,100	1,168.00	1,284,800	
盟和産業	1,000	144.00	144,000	
ヨロズ	700	2,654.00	1,857,800	
エフ・シー・シー	1,000	1,892.00	1,892,000	
シマノ	3,000	17,500.00	52,500,000	
タカタ	1,300	1,231.00	1,600,300	
テイ・エス テック	1,500	3,210.00	4,815,000	
ジャムコ	300	3,760.00	1,128,000	
小計	銘柄数：77		2,019,219,450	
	組入時価比率：99.4%		100.0%	
合計			2,019,219,450	

(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27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。