

2018年7月期 (2017年7月16日 ~ 2018年7月15日) 決算短信

2018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 増田 真一 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 2018年9月26日
 分配金支払開始日 2018年8月23日

ファンドの運用状況

1. 2018年7月期の運用状況 (2017年7月16日 ~ 2018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	%
2018年7月期	9,636	(99.7)	31	(0.3)	9,668	(100)
2017年7月期	6,811	(99.7)	22	(0.3)	6,833	(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
2018年7月期	323	259	138	444
2017年7月期	122	339	138	323

(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
2018年7月期	9,872	204	9,668	217,592
2017年7月期	6,990	157	6,833	211,403

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
2018年7月期	4,240.00
2017年7月期	4,430.00

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10期 (2017年7月15日現在)	第11期 (2018年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,112,746	57,266,409
株式	6,811,028,350	9,636,820,100
未収入金	141,315,550	150,316,610
未収配当金	17,774,350	27,912,800
流動資産合計	6,990,230,996	9,872,315,919
資産合計	6,990,230,996	9,872,315,919
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	143,190,004	188,396,344
未払受託者報酬	2,015,349	2,265,899
未払委託者報酬	10,882,823	12,235,775
未払利息	48	322
その他未払費用	998,837	1,130,289
流動負債合計	157,087,061	204,028,629
負債合計	157,087,061	204,028,629
純資産の部		
元本等		
元本	4,765,996,860	6,551,660,595
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,067,147,075	3,116,626,695
(分配準備積立金)	39,954	189,560
元本等合計	6,833,143,935	9,668,287,290
純資産合計	6,833,143,935	9,668,287,290
負債純資産合計	6,990,230,996	9,872,315,919

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期 自 2016年7月16日 至 2017年7月15日	第11期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日
営業収益		
受取配当金	163,765,348	217,561,898
有価証券売買等損益	205,083,557	△184,618,519
その他収益	1,048	1,719
営業収益合計	368,849,953	32,945,098
営業費用		
支払利息	7,888	17,610
受託者報酬	2,862,464	4,114,605
委託者報酬	15,457,216	22,218,744
その他費用	2,260,210	2,666,708

営業費用合計	20,587,778	29,017,667
営業利益又は営業損失(△)	348,262,175	3,927,431
経常利益又は経常損失(△)	348,262,175	3,927,431
当期純利益又は当期純損失(△)	348,262,175	3,927,431
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(△)	354,034,637	2,067,147,075
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,285,769,422	2,326,138,018
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,285,769,422	2,326,138,018
剰余金減少額又は欠損金増加額	777,729,155	1,092,189,485
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	777,729,155	1,092,189,485
分配金	143,190,004	188,396,344
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,067,147,075	3,116,626,695

(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、2017年7月16日から2018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10期 2017年7月15日現在	第11期 2018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 323,228口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 444,331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 21,140.3円 (10口当たり純資産額) (211,403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 21,759.2円 (10口当たり純資産額) (217,592円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自2016年7月16日 至2017年7月15日	第11期 自2017年7月16日 至2018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>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	<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>217,546,007円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>39,954円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>217,585,961円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>29,000,057円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>188,585,904円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	217,546,007円	分配準備積立金	B	39,954円	配当等収益合計額	C=A+B	217,585,961円	経費	D	29,000,057円	収益分配可能額	E=C-D	188,585,904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																																			
項目																																					
当期配当等収益額	A	217,546,007円																																			
分配準備積立金	B	39,954円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	217,585,961円																																			
経費	D	29,000,057円																																			
収益分配可能額	E=C-D	188,585,904円																																			

収益分配金	F	143,190,004円	収益分配金	F	188,396,344円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	39,954円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	189,560円
口数	H	323,228口	口数	H	444,331口
10口当たり分配金	I=F/H×10	4,430円	10口当たり分配金	I=F/H×10	4,240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10期 自 2016年7月16日 至 2017年7月15日	第11期 自 2017年7月16日 至 2018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10期 2017年7月15日現在	第11期 2018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10期 自 2016年7月16日 至 2017年7月15日	第11期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日
<p>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。</p>	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

	第10期 自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日	第11期 自 2017年 7月 16日 至 2018年 7月 15日
期首元本額	1,801,558,845円	4,765,996,860円
期中追加設定元本額	5,008,139,250円	3,832,520,400円
期中一部交換元本額	2,043,701,235円	2,046,856,665円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第10期 自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日	第11期 自 2017年 7月 16日 至 2018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	200,075,739	△297,832,152
合計	200,075,739	△297,832,152

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(2018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	24,000	2,255.00	54,120,000	
		東洋ゴム工業	24,600	1,615.00	39,729,000	
		ブリヂストン	137,200	4,096.00	561,971,200	
		住友ゴム工業	42,700	1,730.00	73,871,000	
		藤倉ゴム工業	3,600	592.00	2,131,200	
		オカモト	14,000	1,224.00	17,136,000	
		フコク	1,800	941.00	1,693,800	
		ニッタ	4,300	4,115.00	17,694,500	
		住友理工	8,000	1,128.00	9,024,000	
		三ツ星ベルト	10,000	1,404.00	14,040,000	
		バンドー化学	7,900	1,175.00	9,282,500	
		トヨタ紡織	12,100	2,046.00	24,756,600	
		芦森工業	900	2,259.00	2,033,100	
		ユニプレス	8,000	2,141.00	17,128,000	
		豊田自動織機	33,500	5,990.00	200,665,000	
		モリタホールディングス	6,600	2,145.00	14,157,000	
三櫻工業	5,300	681.00	3,609,300			

デンソー	92,000	5,354.00	492,568,000
東海理化電機製作所	10,900	2,008.00	21,887,200
三井E&Sホールディングス	15,000	1,459.00	21,885,000
川崎重工業	32,300	3,210.00	103,683,000
名村造船所	12,400	486.00	6,026,400
サノヤスホールディングス	5,000	222.00	1,110,000
日本車輛製造	15,000	265.00	3,975,000
三菱ロジスネクスト	4,900	1,224.00	5,997,600
近畿車輛	600	2,290.00	1,374,000
日産自動車	488,800	1,028.50	502,730,800
いすゞ自動車	120,100	1,447.50	173,844,750
トヨタ自動車	503,900	7,278.00	3,667,384,200
日野自動車	59,200	1,190.00	70,448,000
三菱自動車工業	153,400	882.00	135,298,800
エフテック	2,600	1,302.00	3,385,200
レシップホールディングス	1,500	821.00	1,231,500
GMB	700	1,368.00	957,600
ファルテック	700	1,135.00	794,500
武蔵精密工業	4,400	3,595.00	15,818,000
日産車体	16,200	982.00	15,908,400
新明和工業	18,000	1,288.00	23,184,000
極東開発工業	7,700	1,787.00	13,759,900
日信工業	8,400	1,905.00	16,002,000
トピー工業	3,400	2,868.00	9,751,200
ティラド	1,500	3,200.00	4,800,000
曙ブレーキ工業	19,300	253.00	4,882,900
タチエス	7,000	1,852.00	12,964,000
NOK	22,300	2,099.00	46,807,700
フタバ産業	12,700	702.00	8,915,400
KYB	4,300	4,920.00	21,156,000
大同メタル工業	5,200	1,095.00	5,694,000
プレス工業	22,000	658.00	14,476,000
ミクニ	5,300	583.00	3,089,900
太平洋工業	8,700	1,626.00	14,146,200
ケーヒン	9,500	2,138.00	20,311,000
河西工業	5,100	1,335.00	6,808,500

	アイシン精機	34,100	5,060.00	172,546,000	
	マツダ	130,100	1,327.50	172,707,750	
	今仙電機製作所	3,800	1,143.00	4,343,400	
	本田技研工業	373,000	3,292.00	1,227,916,000	
	スズキ	82,100	6,268.00	514,602,800	
	S U B A R U	128,700	3,125.00	402,187,500	
	安永	2,000	1,638.00	3,276,000	
	ヤマハ発動機	58,500	2,888.00	168,948,000	
	ショーワ	10,800	1,818.00	19,634,400	
	T B K	4,900	481.00	2,356,900	
	エクセディ	5,000	3,490.00	17,450,000	
	豊田合成	15,100	2,657.00	40,120,700	
	愛三工業	7,300	916.00	6,686,800	
	盟和産業	600	1,262.00	757,200	
	日本プラスト	2,200	971.00	2,136,200	
	ヨロズ	4,200	1,655.00	6,951,000	
	エフ・シー・シー	6,800	3,140.00	21,352,000	
	シマノ	16,700	16,090.00	268,703,000	
	テイ・エス テック	9,600	4,485.00	43,056,000	
	ジャムコ	2,100	2,376.00	4,989,600	
	小計	銘柄数：73		9,636,820,100	
		組入時価比率：99.7%		100.0%	
	合計			9,636,820,100	

(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(2018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。