



2020年7月期 (2019年7月16日～2020年7月15日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2020 (July 16, 2019 - July 15, 2020)

2020年8月26日  
 August 26, 2020

上場取引所 東証  
 Listed Exchange TSE

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 兼代表取締役社長 中川 順子  
 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-17 AUTOMOBILES & TRANSPORTATION EQUIPMENT ETF  
 Code: 1622  
 Underlying index: TOPIX-17 AUTOMOBILES & TRANSPORTATION EQUIPMENT  
 Primary invested assets: Stocks  
 Trading unit: 1 unit  
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>  
 Representative: Junko Nakagawa, 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 2020年9月29日  
 分配金支払開始日 2020年8月21日  
 Scheduled date of submission of securities report: September 29, 2020  
 Date of commencing dividend payment: August 21, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年7月期の運用状況 (2019年7月16日～2020年7月15日)

Management Status for Year ended July 2020 (from July 16, 2019 to July 15, 2020)

(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.	%
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	1,146	(99.5)	6	(0.5)	1,153	(100.0)
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	6,357	(99.6)	25	(0.4)	6,382	(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
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	334	0	268	66
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	444	4	114	334

(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))	10口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×10) Net Asset Value per 10 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×10)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	1,205	51	1,153	173,278
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	6,597	214	6,382	190,655

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	7,460
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	6,040

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12期 (2019年7月15日現在) 12th Fiscal Year As of July 15, 2019	第13期 (2020年7月15日現在) 13th Fiscal Year As of July 15, 2020
	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	18,932,089	4,411,264
株式 Stocks	6,357,517,620	1,146,993,290
未収入金 Accounts receivable - other	200,141,040	50,119,080
未収配当金 Accrued dividends receivable	21,046,350	3,593,200
流動資産合計 Total current assets	6,597,637,099	1,205,116,834
資産合計 Total assets	6,597,637,099	1,205,116,834
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	202,211,952	49,650,030
未払受託者報酬 Trustee fee payable	1,816,412	322,079
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	9,808,548	1,739,186
未払利息 Accrued interest expenses	161	2
その他未払費用 Other accrued expenses	896,207	157,026
流動負債合計 Total current liabilities	214,733,280	51,868,323
負債合計 Total liabilities	214,733,280	51,868,323
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	4,936,449,060	981,353,475
剰余金 Surplus		

期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	1,446,454,759	171,895,036
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	235,235	11,914
元本等合計 Total principal and other	6,382,903,819	1,153,248,511
純資産合計 Total net assets	6,382,903,819	1,153,248,511
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	6,597,637,099	1,205,116,834

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

(単位:円) (Unit: JPY)

	第12期 自 2018年7月16日 至 2019年7月15日 12th Fiscal Year From July 16, 2018 to July 15, 2019	第13期 自 2019年7月16日 至 2020年7月15日 13th Fiscal Year From July 16, 2019 to July 15, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	230,261,250	57,899,900
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△924,680,210	△154,654,637
その他収益 Other revenue	1,584	1,506
営業収益合計 Total operating revenue	△694,417,376	△96,753,231
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	27,961	11,814
受託者報酬 Trustee fee	3,986,695	1,198,756
委託者報酬 Investment trust management fee	21,528,006	6,473,175
その他費用 Other expenses	2,462,545	790,952
営業費用合計 Total operating expenses	28,005,207	8,474,697
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△722,422,583	△105,227,928
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△722,422,583	△105,227,928
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△722,422,583	△105,227,928
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(△)	3,116,626,695	1,446,454,759

Surplus (deficit) at beginning of period		
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	30,723,114	-
当期追加信託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 additional subscriptions for period	30,723,114	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	776,260,515	1,119,681,765
当期一部交換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 partial exchange	776,260,515	1,119,681,765
分配金 Dividends	202,211,952	49,650,030
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	1,446,454,759	171,895,036

(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、2019年7月16日から2020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12期 2019年7月15日現在	第13期 2020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 334,788 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 66,555 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 19,065.5 円 (10口当たり純資産額) (190,655 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 17,327.8 円 (10口当たり純資産額) (173,278 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自2018年7月16日 至2019年7月15日			第13期 自2019年7月16日 至2020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 230,234,873 円		当期配当等収益額	A 57,889,592 円
	分配準備積立金	B 189,560 円		分配準備積立金	B 235,235 円
	配当等収益合計額	C=A+B 230,424,433 円		配当等収益合計額	C=A+B 58,124,827 円
	経費	D 27,977,246 円		経費	D 8,462,883 円

収益分配可能額	E=C-D	202,447,187円	収益分配可能額	E=C-D	49,661,944円
収益分配金	F	202,211,952円	収益分配金	F	49,650,030円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	235,235円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,914円
口数	H	334,788口	口数	H	66,555口
10口当たり分配金	I=F/H×10	6,040円	10口当たり分配金	I=F/H×10	7,460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12期 自 2018年 7月 16日 至 2019年 7月 15日	第13期 自 2019年 7月 16日 至 2020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12期 2019年 7月 15日現在	第13期 2020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12期 自 2018年 7月 16日 至 2019年 7月 15日	第13期 自 2019年 7月 16日 至 2020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	同左

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12期 自 2018年 7月 16日 至 2019年 7月 15日		第13期 自 2019年 7月 16日 至 2020年 7月 15日	
期首元本額	6,551,660,595円	期首元本額	4,936,449,060円
期中追加設定元本額	73,430,100円	期中追加設定元本額	0円
期中一部交換元本額	1,688,641,635円	期中一部交換元本額	3,955,095,585円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第12期 自 2018年 7月 16日 至 2019年 7月 15日	第13期 自 2019年 7月 16日 至 2020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	△847,963,991	△95,140,437
合計	△847,963,991	△95,140,437

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(2020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	3,800	1,574.00	5,981,200	
		TOYO TIRE	3,700	1,520.00	5,624,000	
		ブリヂストン	18,700	3,528.00	65,973,600	
		住友ゴム工業	5,800	991.00	5,747,800	
		藤倉コンポジット	600	376.00	225,600	
		オカモト	400	4,065.00	1,626,000	
		フコク	300	681.00	204,300	
		ニッタ	700	2,512.00	1,758,400	
		住友理工	1,300	621.00	807,300	
		三ツ星ベルト	900	1,811.00	1,629,900	
		バンドー化学	1,100	670.00	737,000	
		トヨタ紡織	1,900	1,464.00	2,781,600	
		芦森工業	100	991.00	99,100	
		ユニプレス	1,300	950.00	1,235,000	
		豊田自動織機	5,300	5,920.00	31,376,000	

モリタホールディングス	1,100	1,866.00	2,052,600
三櫻工業	800	674.00	539,200
デンソー	14,300	4,296.00	61,432,800
東海理化電機製作所	1,700	1,546.00	2,628,200
三井E&Sホールディングス	2,300	444.00	1,021,200
川崎重工業	5,100	1,625.00	8,287,500
名村造船所	2,100	158.00	331,800
サノヤスホールディングス	800	158.00	126,400
日本車輛製造	200	2,529.00	505,800
三菱ロジスネクスト	900	1,011.00	909,900
近畿車輛	100	1,202.00	120,200
日産自動車	76,600	418.60	32,064,760
いすゞ自動車	18,800	993.60	18,679,680
トヨタ自動車	72,500	6,835.00	495,537,500
日野自動車	8,100	753.00	6,099,300
三菱自動車工業	24,000	283.00	6,792,000
エフテック	500	497.00	248,500
レシップホールディングス	300	540.00	162,000
GMB	100	605.00	60,500
ファルテック	100	677.00	67,700
武蔵精密工業	1,400	897.00	1,255,800
日産車体	1,300	914.00	1,188,200
新明和工業	1,700	1,034.00	1,757,800
極東開発工業	1,200	1,384.00	1,660,800
日信工業	1,300	2,202.00	2,862,600
トピー工業	500	1,239.00	619,500
ティラド	200	1,330.00	266,000
曙ブレーキ工業	3,600	180.00	648,000
タチエス	1,100	972.00	1,069,200
NOK	3,500	1,352.00	4,732,000
フタバ産業	1,800	464.00	835,200
KYB	700	2,018.00	1,412,600
大同メタル工業	1,200	558.00	669,600
プレス工業	3,200	320.00	1,024,000
ミクニ	800	268.00	214,400

	太平洋工業	1,400	960.00	1,344,000
	ケーヒン	1,500	2,541.00	3,811,500
	河西工業	900	456.00	410,400
	アイシン精機	5,300	3,210.00	17,013,000
	マツダ	19,100	705.00	13,465,500
	今仙電機製作所	600	733.00	439,800
	本田技研工業	51,100	2,845.50	145,405,050
	スズキ	12,900	3,950.00	50,955,000
	SUBARU	20,200	2,275.50	45,965,100
	安永	300	1,035.00	310,500
	ヤマハ発動機	8,500	1,737.00	14,764,500
	ショーワ	1,500	2,250.00	3,375,000
	TBK	800	451.00	360,800
	エクセディ	900	1,553.00	1,397,700
	豊田合成	2,100	2,207.00	4,634,700
	愛三工業	1,000	536.00	536,000
	盟和産業	100	886.00	88,600
	日本プラスト	500	440.00	220,000
	ヨロズ	600	1,092.00	655,200
	エフ・シー・シー	1,100	1,844.00	2,028,400
	シマノ	2,400	21,420.00	51,408,000
	テイ・エス テック	1,500	2,995.00	4,492,500
	ジャムコ	300	740.00	222,000
	小計 銘柄数 : 73			1,146,993,290
	組入時価比率 : 99.5%			100.0%
	合計			1,146,993,290

(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(2020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。