



2022年7月期 (2021年7月16日～2022年7月15日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2022 (July 16, 2021 – July 15, 2022)

2022年8月24日  
 August 24, 2022

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 長坂 智 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: Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team

有価証券報告書提出予定日 2022年9月28日  
 分配金支払開始日 2022年8月23日  
 Scheduled date of submission of securities report: September 28, 2022  
 Date of commencing dividend payment: August 23, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2022年7月期の運用状況 (2021年7月16日～2022年7月15日)

Management Status for Year ended July 2022 (from July 16, 2021 to July 15, 2022)

(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.	%
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	55,615	(99.9)	48	(0.1)	55,663	(100.0)
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	42,308	(100.0)	13	(0.0)	42,321	(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
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	295,386	138,851	83,251	350,986
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	130,595	324,399	159,608	295,386

(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
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	57,883	2,219	55,663	15,859
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	43,557	1,235	42,321	14,328

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	613
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	403

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19期 (2021年7月15日現在) 19th Fiscal Year As of July 15, 2021	第20期 (2022年7月15日現在) 20th Fiscal Year As of July 15, 2022
	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	1,242,645,040	2,259,324,368
株式 Stocks	42,308,509,930	55,615,626,650
未収配当金 Accrued dividends receivable	5,923,200	8,724,800
流動資産合計 Total current assets	43,557,078,170	57,883,675,818
資産合計 Total assets	43,557,078,170	57,883,675,818
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	1,190,408,425	2,151,547,766
未払受託者報酬 Trustee fees payable	14,155,869	22,865,638
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	24,267,146	39,198,174
未払利息 Accrued interest expenses	1,156	651
その他未払費用 Other accrued expenses	6,274,761	6,141,171
流動負債合計 Total current liabilities	1,235,107,357	2,219,753,400
負債合計 Total liabilities	1,235,107,357	2,219,753,400
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	59,077,341,200	70,197,317,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△16,755,370,387	△14,533,394,582

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	2,911,232	824,117
元本等合計 Total principal and other	42,321,970,813	55,663,922,418
純資産合計 Total net assets	42,321,970,813	55,663,922,418
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	43,557,078,170	57,883,675,818

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	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	第20期 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 20th Fiscal Year From July 16, 2021 to July 15, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	1,262,846,500	2,273,411,900
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	3,937,813,821	4,210,661,227
その他収益 Other revenue	10,311	16,267
営業収益合計 Total operating revenue	5,200,670,632	6,484,089,394
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	96,922	131,648
受託者報酬 Trustee fees	22,564,397	40,469,787
委託者報酬 Investment trust management fees	39,839,989	69,376,651
その他費用 Other expenses	7,678,718	13,989,430
営業費用合計 Total operating expenses	70,180,026	123,967,516
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	5,130,490,606	6,360,121,878
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	5,130,490,606	6,360,121,878
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	5,130,490,606	6,360,121,878
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	△10,588,663,222	△16,755,370,387
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,060,301,900	3,174,325,240

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	11,060,301,900	3,174,325,240
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	21,167,091,246	5,160,923,547
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	21,167,091,246	5,160,923,547
分配金 Dividends	1,190,408,425	2,151,547,766
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△16,755,370,387	△14,533,394,582

(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、2021 年 7 月 16 日から 2022 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 19 期 2021 年 7 月 15 日現在	第 20 期 2022 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 295,386,706 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 350,986,585 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 16,755,370,387 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 14,533,394,582 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)	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 158.59 円 (100 口当たり純資産額) (15,859 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 19 期 自 2020 年 7 月 16 日 至 2021 年 7 月 15 日	第 20 期 自 2021 年 7 月 16 日 至 2022 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 1,262,759,889 円	当期配当等収益額 A 2,273,296,519 円

分配準備積立金	B	642,872 円	分配準備積立金	B	2,911,232 円
配当等収益合計額	C=A+B	1,263,402,761 円	配当等収益合計額	C=A+B	2,276,207,751 円
経費	D	70,083,104 円	経費	D	123,835,868 円
収益分配可能額	E=C-D	1,193,319,657 円	収益分配可能額	E=C-D	2,152,371,883 円
収益分配金	F	1,190,408,425 円	収益分配金	F	2,151,547,766 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,911,232 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	824,117 円
口数	H	295,386,706 口	口数	H	350,986,585 口
100口当たり分配金	I=F/H×100	403 円	100口当たり分配金	I=F/H×100	613 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19期 自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	第20期 自 2021年7月16日 至 2022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19期 2021年7月15日現在	第20期 2022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19期 自2020年7月16日 至2021年7月15日	第20期 自2021年7月16日 至2022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19期 自2020年7月16日 至2021年7月15日	第20期 自2021年7月16日 至2022年7月15日
期首元本額 26,119,096,000 円	期首元本額 59,077,341,200 円
期中追加設定元本額 64,879,980,000 円	期中追加設定元本額 27,770,280,000 円
期中一部交換元本額 31,921,734,800 円	期中一部交換元本額 16,650,304,200 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第19期 自2020年7月16日 至2021年7月15日	第20期 自2021年7月16日 至2022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	2,973,141,055	3,116,328,690
合計	2,973,141,055	3,116,328,690

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(2022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	13,400	485.00	6,499,000	
		じもとホールディングス	28,900	566.00	16,357,400	
		めぶきフィナンシャルグループ	1,787,200	257.00	459,310,400	
		東京きらぼしフィナンシャルグループ	49,900	2,180.00	108,782,000	
		九州フィナンシャルグループ	760,200	378.00	287,355,600	
		ゆうちょ銀行	1,025,100	1,059.00	1,085,580,900	
		富山第一銀行	96,800	430.00	41,624,000	
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,150,600	425.00	914,005,000	
		西日本フィナンシャルホールディングス	228,300	722.00	164,832,600	
		三十三フィナンシャルグループ	34,900	1,409.00	49,174,100	
		第四北越フィナンシャルグループ	61,400	2,469.00	151,596,600	

ひろぎんホールディングス	554,900	602.00	334,049,800
おきなわフィナンシャルグループ	36,700	2,099.00	77,033,300
十六フィナンシャルグループ	50,800	2,361.00	119,938,800
北國フィナンシャルホールディングス	35,800	4,325.00	154,835,000
プロクレアホールディングス	43,800	2,051.00	89,833,800
新生銀行	283,000	1,949.00	551,567,000
あおぞら銀行	242,500	2,646.00	641,655,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	25,427,100	700.80	17,819,311,680
りそなホールディングス	4,596,400	493.30	2,267,404,120
三井住友トラスト・ホールディングス	718,200	4,113.00	2,953,956,600
三井住友フィナンシャルグループ	2,819,600	3,992.00	11,255,843,200
千葉銀行	1,226,400	698.00	856,027,200
群馬銀行	699,100	363.00	253,773,300
武蔵野銀行	55,800	1,748.00	97,538,400
千葉興業銀行	93,800	250.00	23,450,000
筑波銀行	169,300	192.00	32,505,600
七十七銀行	114,900	1,688.00	193,951,200
秋田銀行	26,200	1,661.00	43,518,200
山形銀行	39,800	892.00	35,501,600
岩手銀行	26,800	1,929.00	51,697,200
東邦銀行	310,600	206.00	63,983,600
東北銀行	19,900	963.00	19,163,700
ふくおかフィナンシャルグループ	313,400	2,238.00	701,389,200
静岡銀行	895,000	782.00	699,890,000
スルガ銀行	380,700	363.00	138,194,100
八十二銀行	806,000	483.00	389,298,000
山梨中央銀行	43,400	1,109.00	48,130,600
大垣共立銀行	74,200	1,704.00	126,436,800
福井銀行	34,600	1,351.00	46,744,600
清水銀行	15,100	1,448.00	21,864,800
富山銀行	6,500	1,759.00	11,433,500
滋賀銀行	70,700	2,547.00	180,072,900
南都銀行	58,900	1,986.00	116,975,400
百五銀行	365,000	319.00	116,435,000



京都銀行	134,800	5,430.00	731,964,000
紀陽銀行	129,000	1,367.00	176,343,000
ほくほくフィナンシャルグループ	246,300	815.00	200,734,500
山陰合同銀行	241,400	636.00	153,530,400
中国銀行	305,600	938.00	286,652,800
鳥取銀行	13,400	1,142.00	15,302,800
伊予銀行	486,600	613.00	298,285,800
百十四銀行	39,800	1,648.00	65,590,400
四国銀行	57,500	837.00	48,127,500
阿波銀行	57,900	1,996.00	115,568,400
大分銀行	23,600	1,877.00	44,297,200
宮崎銀行	23,800	2,059.00	49,004,200
佐賀銀行	23,100	1,476.00	34,095,600
琉球銀行	94,500	797.00	75,316,500
セブン銀行	1,289,900	256.00	330,214,400
みずほフィナンシャルグループ	5,208,300	1,538.50	8,012,969,550
高知銀行	13,300	680.00	9,044,000
山口フィナンシャルグループ	433,900	720.00	312,408,000
長野銀行	12,900	1,230.00	15,867,000
名古屋銀行	26,700	2,929.00	78,204,300
北洋銀行	545,600	220.00	120,032,000
愛知銀行	14,000	5,110.00	71,540,000
中京銀行	13,000	1,669.00	21,697,000
大光銀行	12,600	1,305.00	16,443,000
愛媛銀行	56,900	883.00	50,242,700
トマト銀行	12,800	1,003.00	12,838,400
京葉銀行	180,900	458.00	82,852,200
栃木銀行	195,100	265.00	51,701,500
北日本銀行	12,300	1,647.00	20,258,100
東和銀行	71,100	513.00	36,474,300
福島銀行	45,600	211.00	9,621,600
大東銀行	19,500	636.00	12,402,000
トモニホールディングス	313,200	305.00	95,526,000
フィデアホールディングス	39,500	1,281.00	50,599,500
池田泉州ホールディングス	461,400	198.00	91,357,200

	小計	銘柄数 : 80 組入時価比率 : 99.9%			55,615,626,650	100.0%
	合計				55,615,626,650	

(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 (2022 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。