

平成28年7月期（平成27年7月16日～平成28年7月15日）決算短信

平成28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 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成28年9月28日
 分配金支払開始日 平成28年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年7月期の運用状況（平成27年7月16日～平成28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28年7月期	2,141	(99.3)	14	(0.7)	2,155	(100)
平成27年7月期	2,019	(99.4)	11	(0.6)	2,030	(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28年7月期	81	219	179	122
平成27年7月期	239	479	637	81

(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28年7月期	2,254	98	2,155	176,426
平成27年7月期	2,131	100	2,030	248,782

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成28年7月期	7,430.00
平成27年7月期	11,290.00

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8期 (平成27年7月15日現在)	第9期 (平成28年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,169,162	8,859,211
株式	2,019,219,450	2,141,246,050
未収入金	93,243,100	92,270,500
未収配当金	10,736,600	11,705,550
未収利息	15	-
流動資産合計	2,131,368,327	2,254,081,311
資産合計	2,131,368,327	2,254,081,311
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	92,164,786	90,780,483
未払受託者報酬	1,204,543	1,120,532
未払委託者報酬	6,504,443	6,050,793
未払利息	-	11
その他未払費用	584,265	536,010
流動負債合計	100,458,037	98,487,829
負債合計	100,458,037	98,487,829
純資産の部		
元本等		
元本	1,203,693,330	1,801,558,845
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	827,216,960	354,034,637
(分配準備積立金)	39,067	51,340
元本等合計	2,030,910,290	2,155,593,482
純資産合計	2,030,910,290	2,155,593,482
負債純資産合計	2,131,368,327	2,254,081,311

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 平成26年7月16日 至 平成27年7月15日	第9期 自 平成27年7月16日 至 平成28年7月15日
営業収益		
受取配当金	110,011,816	104,865,199
受取利息	10,738	5,446
有価証券売買等損益	1,115,805,181	△1,790,450,634
その他収益	357	1,123
営業収益合計	1,225,828,092	△1,685,578,866
営業費用		
支払利息	-	2,443

受託者報酬	2,549,680	1,970,958
委託者報酬	13,768,128	10,643,021
その他費用	1,676,794	1,462,590
営業費用合計	17,994,602	14,079,012
営業利益又は営業損失(△)	1,207,833,490	△1,699,657,878
経常利益又は経常損失(△)	1,207,833,490	△1,699,657,878
当期純利益又は当期純損失(△)	1,207,833,490	△1,699,657,878
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(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	1,287,023,517	827,216,960
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,752,760,459	1,962,888,913
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,752,760,459	1,962,888,913
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,328,235,720	645,632,875
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,328,235,720	645,632,875
分配金	92,164,786	90,780,483
期末剰余金又は期末欠損金(△)	827,216,960	354,034,637

(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、平成27年7月16日から平成28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8期 平成27年7月15日現在	第9期 平成28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 81,634口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 122,181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 24,878.2円 (10口当たり純資産額) (248,782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 17,642.6円 (10口当たり純資産額) (176,426円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自平成26年7月16日 至平成27年7月15日	第9期 自平成27年7月16日 至平成28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>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> </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	<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>104,869,325円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>39,067円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>104,908,392円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>14,076,569円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	104,869,325円	分配準備積立金	B	39,067円	配当等収益合計額	C=A+B	104,908,392円	経費	D	14,076,569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																													
項目																															
当期配当等収益額	A	104,869,325円																													
分配準備積立金	B	39,067円																													
配当等収益合計額	C=A+B	104,908,392円																													
経費	D	14,076,569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	39,067 円
口数	H	81,634 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	11,290 円

収益分配可能額	E=C-D	90,831,823 円
収益分配金	F	90,780,483 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	51,340 円
口数	H	122,181 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	7,430 円

2. 追加情報

平成 28 年 1 月 29 日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(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 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 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 8 期 平成 27 年 7 月 15 日現在	第 9 期 平成 28 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8期 自平成26年7月16日 至平成27年7月15日	第9期 自平成27年7月16日 至平成28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8期 自平成26年7月16日 至平成27年7月15日	第9期 自平成27年7月16日 至平成28年7月15日
期首元本額 3,531,692,910円	期首元本額 1,203,693,330円
期中追加設定元本額 7,073,766,300円	期中追加設定元本額 3,239,034,150円
期中一部交換元本額 9,401,765,880円	期中一部交換元本額 2,641,168,635円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第8期 自平成26年7月16日 至平成27年7月15日	第9期 自平成27年7月16日 至平成28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	△14,014,101	△673,682,134
合計	△14,014,101	△673,682,134

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28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	6,800	1,387.00	9,431,600	
		東洋ゴム工業	5,100	1,223.00	6,237,300	
		ブリヂストン	37,800	3,539.00	133,774,200	
		住友ゴム工業	10,500	1,466.00	15,393,000	
		藤倉ゴム工業	900	485.00	436,500	
		オカモト	3,000	1,060.00	3,180,000	
		フコク	400	772.00	308,800	
		ニッタ	1,200	2,527.00	3,032,400	
		住友理工	2,400	884.00	2,121,600	
		三ツ星ベルト	3,000	849.00	2,547,000	
		バンドー化学	4,000	520.00	2,080,000	
		トヨタ紡織	3,700	2,193.00	8,114,100	

鬼怒川ゴム工業	2,000	776.00	1,552,000
ユニプレス	2,200	1,726.00	3,797,200
豊田自動織機	9,700	4,410.00	42,777,000
モリタホールディングス	1,900	1,422.00	2,701,800
三櫻工業	1,400	553.00	774,200
デンソー	26,400	3,880.00	102,432,000
東海理化電機製作所	3,100	1,614.00	5,003,400
三井造船	41,000	152.00	6,232,000
川崎重工業	83,000	284.00	23,572,000
名村造船所	3,200	553.00	1,769,600
サノヤスホールディングス	1,300	437.00	568,100
日本車輛製造	4,000	282.00	1,128,000
ニチユ三菱フォークリフト	1,200	612.00	734,400
近畿車輛	2,000	259.00	518,000
日産自動車	149,300	1,043.00	155,719,900
いすゞ自動車	31,000	1,308.50	40,563,500
トヨタ自動車	133,000	5,759.00	765,947,000
日野自動車	15,300	1,068.00	16,340,400
三菱自動車工業	42,500	501.00	21,292,500
エフテック	600	946.00	567,600
レシップホールディングス	400	803.00	321,200
GMB	200	941.00	188,200
ファルテック	200	1,186.00	237,200
武蔵精密工業	1,100	2,056.00	2,261,600
日産車体	5,200	1,089.00	5,662,800
新明和工業	5,000	708.00	3,540,000
極東開発工業	2,100	1,030.00	2,163,000
日信工業	2,400	1,398.00	3,355,200
トピー工業	9,000	221.00	1,989,000
ティラド	4,000	187.00	748,000
曙ブレーキ工業	5,400	207.00	1,117,800
タチエス	1,700	1,637.00	2,782,900
NOK	5,200	1,790.00	9,308,000
フタバ産業	3,300	509.00	1,679,700
KYB	12,000	368.00	4,416,000
大同メタル工業	1,500	1,132.00	1,698,000

プレス工業	5,700	363.00	2,069,100	
ミクニ	1,400	305.00	427,000	
カルソニックカンセイ	8,000	827.00	6,616,000	
太平洋工業	2,400	1,075.00	2,580,000	
ケーヒン	2,500	1,620.00	4,050,000	
河西工業	1,300	1,001.00	1,301,300	
アイシン精機	11,000	4,295.00	47,245,000	
富士機工	1,200	345.00	414,000	
マツダ	33,900	1,499.50	50,833,050	
ダイハツ工業	12,800	1,495.00	19,136,000	
今仙電機製作所	1,000	904.00	904,000	
本田技研工業	96,300	2,800.00	269,640,000	
スズキ	19,600	3,089.00	60,544,400	
富士重工業	33,800	3,943.00	133,273,400	
安永	400	482.00	192,800	
ヤマハ発動機	15,100	1,740.00	26,274,000	
ショーワ	2,800	621.00	1,738,800	
TBK	1,300	376.00	488,800	
エクセディ	1,500	2,274.00	3,411,000	
豊田合成	3,900	1,960.00	7,644,000	
愛三工業	1,900	730.00	1,387,000	
盟和産業	200	1,015.00	203,000	
ヨロズ	1,000	1,549.00	1,549,000	
エフ・シー・シー	1,700	1,895.00	3,221,500	
シマノ	4,300	15,230.00	65,489,000	
タカタ	1,900	394.00	748,600	
テイ・エス テック	2,500	2,598.00	6,495,000	
ジャムコ	600	2,091.00	1,254,600	
小計	銘柄数：76		2,141,246,050	
	組入時価比率：99.3%		100.0%	
合計			2,141,246,050	

(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28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。