

平成22年7月期 中間決算短信 (平成21年7月9日～平成22年1月8日)

平成22年2月18日

上場取引所 大証

ファンド名 NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS連動型上場投信
 コード番号 (1324)
 連動対象指標 RTS指数
 主要投資資産 社債券
 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 執行役社長 吉川 淳
 問合せ先責任者 投信ディスクロージャー部 石渡 寛利 TEL (03)-3241-9511

半期報告書提出予定日 平成22年3月31日

I ファンドの運用状況

1. 平成22年1月中間期の運用状況 (平成21年7月9日～平成22年1月8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22年1月中間期 | 2,441 | (98.7) | 31 | (1.3) | 2,473 | (100) |
| 平成21年1月中間期 | 963 | (92.5) | 77 | (7.5) | 1,041 | (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) | 当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③) |
|------------|--------------------|---------|---------|------------------------------|
| | 千口 | 千口 | 千口 | 千口 |
| 平成22年1月中間期 | 20,000 | 4,000 | 7,325 | 16,674 |
| 平成21年1月中間期 | - | 20,000 | 0 | 20,000 |

(3)基準価額

| | 総資産 (①) | 負債 (②) | 純資産 (③(①-②)) | 100口当り基準価額 (③/当中間計算期間末発行済口数)×100 |
|------------|------------|-----------|-----------------|-------------------------------------|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 円 |
| 平成22年1月中間期 | 2,488 | 14 | 2,473 | 14,833 |
| 平成21年1月中間期 | 1,053 | 12 | 1,041 | 5,205 |

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更
 ② ①以外の変更

有~~無~~
 有~~無~~

II 中間財務諸表等

【NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS 連動型上場投信】

(1) 【中間貸借対照表】

| 科目 | 期別 | 第 1 期中間計算期間末 平成 21 年 1 月 24 日現在 | 第 2 期中間計算期間末 平成 22 年 1 月 8 日現在 |
|-----------------|----|------------------------------------|-----------------------------------|
| | | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 90,248,106 | 45,732,969 |
| 社債券 | | 963,235,000 | 2,441,419,000 |
| 未収利息 | | 572 | 131 |
| その他未収収益 | | | 891,497 |
| 流動資産合計 | | 1,053,483,678 | 2,488,043,597 |
| 資産合計 | | 1,053,483,678 | 2,488,043,597 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払受託者報酬 | | 615,008 | 747,414 |
| 未払委託者報酬 | | 11,070,152 | 13,453,476 |
| その他未払費用 | | 706,813 | 548,382 |
| 流動負債合計 | | 12,391,973 | 14,749,272 |
| 負債合計 | | 12,391,973 | 14,749,272 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 4,600,000,000 | 3,835,054,270 |
| 剰余金 | | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | | 3,558,908,295 | 1,361,759,945 |
| 元本等合計 | | 1,041,091,705 | 2,473,294,325 |
| 純資産合計 | | 1,041,091,705 | 2,473,294,325 |
| 負債純資産合計 | | 1,053,483,678 | 2,488,043,597 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

| 科目 | 期別 | 第 1 期中間計算期間 自 平成 20 年 7 月 25 日 至 平成 21 年 1 月 24 日 | 第 2 期中間計算期間 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 日 |
|-----------------------------|----|---|---|
| | | 金額(円) | 金額(円) |
| 営業収益 | | | |
| 受取利息 | | 829,973 | 45,094 |
| 有価証券売買等損益 | | 3,545,815,000 | 1,149,661,000 |
| その他収益 | | | 891,497 |
| 営業収益合計 | | 3,544,985,027 | 1,150,597,591 |
| 営業費用 | | | |
| 受託者報酬 | | 615,008 | 747,414 |
| 委託者報酬 | | 11,070,152 | 13,453,476 |
| その他費用 | | 2,238,108 | 1,022,041 |
| 営業費用合計 | | 13,923,268 | 15,222,931 |
| 営業利益 | | 3,558,908,295 | 1,135,374,660 |
| 経常利益 | | 3,558,908,295 | 1,135,374,660 |
| 中間純利益 | | 3,558,908,295 | 1,135,374,660 |
| 一部交換に伴う中間純利益金額の分配額 | | | |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | | | 2,637,683,335 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | | 683,428,730 |
| 中間一部交換に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額 | | | 683,428,730 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | | 542,880,000 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額 | | | 542,880,000 |
| 分配金 | | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | | 3,558,908,295 | 1,361,759,945 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 第 1 期中間計算期間 自 平成 20 年 7 月 25 日 至 平成 21 年 1 月 24 日 | 第 2 期中間計算期間 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 日 |
|-------------------|---|---|
| 1 運用資産の評価基準及び評価方法 | (1) 社債券 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、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 | (1) 社債券 同左 |
| 2 費用・収益の計上基準 | (1) 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。 | (1) 有価証券売買等損益の計上基準 同左 |
| 3 その他 | 当ファンドの計算期間は、平成 20 年 7 月 25 日(設定日)から平成 21 年 7 月 8 日までとなっております。 なお、当該中間計算期間は、平成 20 年 7 月 25 日から平成 21 年 1 月 24 日までとなっております。 | 当ファンドの計算期間は、平成 21 年 7 月 9 日から平成 22 年 7 月 8 日までとなっております。 なお、当該中間計算期間は、平成 21 年 7 月 9 日から平成 22 年 1 月 8 日までとなっております。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 第 1 期中間計算期間末 平成 21 年 1 月 24 日現在 | 第 2 期中間計算期間末 平成 22 年 1 月 8 日現在 |
|---|---|
| 1 中間計算期間の末日における受益権の総数 20,000,000 口 | 1 中間計算期間の末日における受益権の総数 16,674,149 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 3,558,908,295 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 1,361,759,945 円 |
| 3 中間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 52.05 円 (100 口当たり純資産額 5,205 円) | 3 中間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 148.33 円 (100 口当たり純資産額 14,833 円) |

(その他の注記)

1 元本の移動

| 第 1 期中間計算期間 自 平成 20 年 7 月 25 日 至 平成 21 年 1 月 24 日 | 第 2 期中間計算期間 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 日 |
|---|---|
| 期首元本額 円 | 期首元本額 4,600,000,000 円 |
| 期中追加設定元本額 4,600,000,000 円 | 期中追加設定元本額 920,000,000 円 |
| 期中一部交換元本額 円 | 期中一部交換元本額 1,684,945,730 円 |

2 売買目的有価証券の中間貸借対照表計上額等

第 1 期中間計算期間(自 平成 20 年 7 月 25 日 至 平成 21 年 1 月 24 日)

該当事項はございません。

第 2 期中間計算期間(自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 日)

該当事項はございません。

3 デリバティブ取引関係

第 1 期中間計算期間末(平成 21 年 1 月 24 日現在)

該当事項はございません。

第 2 期中間計算期間末(平成 22 年 1 月 8 日現在)

該当事項はございません。