

平成26年2月期 中間決算短信（平成25年2月11日～平成25年8月10日）

平成25年9月20日

ファンド名	NEXT FUNDS 日経・東商取白金指数連動型上場投信		
コード番号	( 1682 )	上場取引所	東証
連動対象指標	日経・東商取白金指数	売買単位	100口
主要投資資産	社債券		
管理会社	野村アセットマネジメント株式会社		
U R L	<a href="http://www.nomura-am.co.jp">http://www.nomura-am.co.jp</a>		
代表者	CEO兼執行役会長兼社長	岩崎 俊博	
問合せ先責任者	投信ディスクロージャー部長	森保 一美	TEL (03)-3241-9511
半期報告書提出予定日	平成25年10月30日		

I ファンドの運用状況

1. 平成25年8月中間期の運用状況（平成25年2月11日～平成25年8月10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25年8月中間期	0	-	510	(100)	510	(100)
平成25年2月期	0	-	572	(100)	572	(100)

(2)設定・解約実績 (千口未満切捨て)

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	解約口数(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25年8月中間期	1,940	0	0	1,940

(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(前計算期末) 発行済口数)×100)
	百万円	百万円	百万円	円
平成25年8月中間期	511	1	510	26,304
平成25年2月期	574	1	572	29,528

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

## ( 1 )【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第 3 期 (平成 25 年 2 月 10 日現在)	第 4 期中間計算期間末 (平成 25 年 8 月 10 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	69,087,948	67,796,482
派生商品評価勘定	99,430,000	53,670,500
現先取引勘定	379,768,200	319,943,960
未収利息	2,385	616
差入委託証拠金	25,821,650	70,205,100
流動資産合計	574,110,183	511,616,658
資産合計	574,110,183	511,616,658
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	124,543	135,450
未払委託者報酬	996,279	1,083,544
その他未払費用	146,906	97,938
流動負債合計	1,267,728	1,316,932
負債合計	1,267,728	1,316,932
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	500,520,000	500,520,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	72,322,455	9,779,726
元本等合計	572,842,455	510,299,726
純資産合計	572,842,455	510,299,726
負債純資産合計	574,110,183	511,616,658

## ( 2 )【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第 3 期中間計算期間 自 平成 24 年 2 月 11 日 至 平成 24 年 8 月 10 日	第 4 期中間計算期間 自 平成 25 年 2 月 11 日 至 平成 25 年 8 月 10 日
<b>営業収益</b>		
受取利息	147,575	146,733
派生商品取引等損益	65,887,400	61,376,050
営業収益合計	65,739,825	61,229,317
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	115,381	135,450
委託者報酬	922,919	1,083,544
その他費用	76,628	94,418
営業費用合計	1,114,928	1,313,412
営業利益	66,854,753	62,542,729
経常利益	66,854,753	62,542,729
中間純利益	66,854,753	62,542,729

一部解約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 ( )	38,525,186	72,322,455
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	105,379,939	9,779,726

( 3 )【中間注記表】

( 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	先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	派生商品取引等損益 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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	現先取引 現先取引の会計処理については、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準委員会 平成 20 年 3 月 10 日)の規定によっております。 計算期間 当ファンドの中間計算期間は、平成 25 年 2 月 11 日から平成 25 年 8 月 10 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 3 期 平成 25 年 2 月 10 日現在	第 4 期中間計算期間末 平成 25 年 8 月 10 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,940,000 口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,940,000 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 295.28 円 (100 口当たり純資産額) (29,528 円)	2. 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 263.04 円 (100 口当たり純資産額) (26,304 円)

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

第 3 期 平成 25 年 2 月 10 日現在	第 4 期中間計算期間末 平成 25 年 8 月 10 日現在
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。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の 2 デリバティブ取引関係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	2. 時価の算定方法 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の 2 デリバティブ取引関係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

NEXT FUNDS 日経・東商取白金指数連動型上場投信(1682) 平成 26 年 2 月期 中間決算短信

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。

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。

(その他の注記)

1 元本の移動

第 3 期 自 平成 24 年 2 月 11 日 至 平成 25 年 2 月 10 日		第 4 期中間計算期間 自 平成 25 年 2 月 11 日 至 平成 25 年 8 月 10 日	
期首元本額	500,520,000 円	期首元本額	500,520,000 円
期中追加設定元本額	0 円	期中追加設定元本額	0 円
期中一部解約元本額	0 円	期中一部解約元本額	0 円

2 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第 3 期(平成 25 年 2 月 10 日現在)				第 4 期中間計算期間末(平成 25 年 8 月 10 日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち 1 年超				うち 1 年超		
市場取引								
先物取引								
商品先物取引								
買建	473,844,000	-	573,274,000	99,430,000	457,609,500	-	511,280,000	53,670,500
合計	473,844,000	-	573,274,000	99,430,000	457,609,500	-	511,280,000	53,670,500

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物取引の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。