

平成26年7月期（平成25年7月9日～平成26年7月8日）決算短信

平成26年8月19日

上場取引所

東証

ファンド名 NEXT FUNDS ブラジル株式指数・ボベスパ連動型上場投信  
 コード番号 ( 1325 )  
 連動対象指標 ボベスパ指数  
 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兼執行役社長 渡邊 国夫  
 問合せ先責任者 投信ディスプレイージャー部長 村山 治子 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成26年9月25日  
 分配金支払開始日 -

I ファンドの運用状況

1. 平成26年7月期の運用状況（平成25年7月9日～平成26年7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<br>(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26年7月期 | 5,604  | (98.8) | 66                      | (1.2) | 5,671   | (100) |
| 平成25年7月期 | 5,482  | (99.1) | 52                      | (0.9) | 5,535   | (100) |

(2)設定・解約実績 (千口未満切捨て)

|          | 前計算期間末<br>発行済口数(①) | 設定口数(②) | 解約口数(③) | 当計算期間末<br>発行済口数<br>(①+②-③) |
|----------|--------------------|---------|---------|----------------------------|
|          | 千口                 | 千口      | 千口      | 千口                         |
| 平成26年7月期 | 31,290             | 0       | 4,010   | 27,279                     |
| 平成25年7月期 | 35,129             | 0       | 3,838   | 31,290                     |

(3)基準価額

|          | 総資産<br>(①) | 負債<br>(②) | 純資産<br>(③(①-②)) | 100口当り基準価額<br>(③/当計算期間末発行済口数) × 100 |
|----------|------------|-----------|-----------------|-------------------------------------|
|          | 百万円        | 百万円       | 百万円             | 円                                   |
| 平成26年7月期 | 5,704      | 32        | 5,671           | 20,790                              |
| 平成25年7月期 | 5,578      | 42        | 5,535           | 17,690                              |

(4)分配金

|          | 100口当り分配金 |
|----------|-----------|
|          | 円         |
| 平成26年7月期 | 0.00      |
| 平成25年7月期 | 0.00      |

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 財務諸表等

## NEXT FUNDS ブラジル株式指数・ボベスパ連動型上場投信

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

|                  | 第 5 期<br>(平成 25 年 7 月 8 日現在) | 第 6 期<br>(平成 26 年 7 月 8 日現在) |
|------------------|------------------------------|------------------------------|
| 資産の部             |                              |                              |
| 流動資産             |                              |                              |
| 預金               | -                            | 42,334,458                   |
| コール・ローン          | 95,521,286                   | 34,731,806                   |
| 株式               | -                            | 5,604,744,187                |
| 社債券              | 5,482,721,400                | -                            |
| 未収配当金            | -                            | 22,503,918                   |
| 未収利息             | 203                          | 62                           |
| 流動資産合計           | 5,578,242,889                | 5,704,314,431                |
| 資産合計             | 5,578,242,889                | 5,704,314,431                |
| 負債の部             |                              |                              |
| 流動負債             |                              |                              |
| 未払受託者報酬          | 2,041,709                    | 1,552,286                    |
| 未払委託者報酬          | 36,750,647                   | 27,940,955                   |
| その他未払費用          | 4,148,566                    | 3,308,737                    |
| 流動負債合計           | 42,940,922                   | 32,801,978                   |
| 負債合計             | 42,940,922                   | 32,801,978                   |
| 純資産の部            |                              |                              |
| 元本等              |                              |                              |
| 元本               | 12,766,326,528               | 11,130,001,728               |
| 剰余金              |                              |                              |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) | △7,231,024,561               | △5,458,489,275               |
| 元本等合計            | 5,535,301,967                | 5,671,512,453                |
| 純資産合計            | 5,535,301,967                | 5,671,512,453                |
| 負債純資産合計          | 5,578,242,889                | 5,704,314,431                |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|  | 第 5 期                                  |                | 第 6 期                                  |                |
|--|--|----------------|--|----------------|
|  | 自 平成 24 年 7 月 9 日<br>至 平成 25 年 7 月 8 日 |                | 自 平成 25 年 7 月 9 日<br>至 平成 26 年 7 月 8 日 |                |
| 営業収益                                       |  |                |  |                |
| 受取配当金                                      |  | -              |  | 85,783,646     |
| 受取利息                                       |  | 75,807         |  | 42,050         |
| 有価証券売買等損益                                  |  | △468,908,400   |  | 985,599,290    |
| 為替差損益                                      |  | -              |  | △57,338,395    |
| その他収益                                      |  | 4,006,506      |  | 3,534,650      |
| 営業収益合計                                     |  | △464,826,087   |  | 1,017,621,241  |
| 営業費用                                       |  |                |  |                |
| 受託者報酬                                      |  | 3,944,198      |  | 3,187,911      |
| 委託者報酬                                      |  | 70,995,406     |  | 57,382,149     |
| その他費用                                      |  | 5,310,069      |  | 4,319,677      |
| 営業費用合計                                     |  | 80,249,673     |  | 64,889,737     |
| 営業利益又は営業損失 (△)                             |  | △545,075,760   |  | 952,731,504    |
| 経常利益又は経常損失 (△)                             |  | △545,075,760   |  | 952,731,504    |
| 当期純利益又は当期純損失 (△)                           |  | △545,075,760   |  | 952,731,504    |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約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 (△)                           |  | △7,323,913,585 |  | △7,231,024,561 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                             |  | 637,964,784    |  | 819,803,782    |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                    |  | -              |  | 819,803,782    |
| 当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                    |  | 637,964,784    |  | -              |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                             |  | -              |  | -              |
| 分配金  |  | -              |  | -              |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△)                           |  | △7,231,024,561 |  | △5,458,489,275 |

## (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<br>原則として時価で評価しております。<br>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。<br>社債券<br>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。 |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。  |
| 3. 費用・収益の計上基準          | 受取配当金<br>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。<br>有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>為替差損益<br>約定日基準で計上しております。  |
| 4. 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   |

|        |   |
|--------|---|
| 5. その他 | 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。<br>当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成 25 年 7 月 9 日から平成 26 年 7 月 8 日までとなっております。 |
|--------|---|

## (追加情報)

|  |
|--|
| <b>第 6 期</b><br>自 平成 25 年 7 月 9 日<br>至 平成 26 年 7 月 8 日   |
| 当ファンドの運用方法を、対象株価指数に採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式（DR（預託証書）を含みます。）等に直接投資できるよう主要投資対象を変更するとともに、交換請求制を廃止し、金銭解約型とする旨の信託約款の変更を行ない、平成 26 年 4 月 10 日より適用しております。 |

## (貸借対照表に関する注記)

| 第 5 期<br>平成 25 年 7 月 8 日現在   | 第 6 期<br>平成 26 年 7 月 8 日現在   |
|--|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>31,290,016 口   | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>27,279,416 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<br><br>元本の欠損 7,231,024,561 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<br><br>元本の欠損 5,458,489,275 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<br>1 口当たり純資産額 176.90 円<br>(100 口当たり純資産額) (17,690 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<br>1 口当たり純資産額 207.90 円<br>(100 口当たり純資産額) (20,790 円) |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第 5 期<br>自 平成 24 年 7 月 9 日<br>至 平成 25 年 7 月 8 日   | 第 6 期<br>自 平成 25 年 7 月 9 日<br>至 平成 26 年 7 月 8 日 |                |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
|---|---|----------------|--|----------|---|-------------|---------|---|----------------|----------|-------|----------------|----|---|--------------|---------|-------|-----|-------|---|-----|----------------|-------|----------------|----|---|--------------|-------------|-----------|-----|--|----|--|--|----------|---|--------------|---------|---|----------------|----------|-------|----------------|----|---|--------------|---------|-------|-----|-------|---|-----|----------------|-------|----------------|----|---|--------------|-------------|-----------|-----|
| 1. 分配金の計算過程   | 1. 分配金の計算過程                                     |                |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| <table border="1" style="width: 100%;"> <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>4,082,313 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>△395,074,573 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>△390,992,260 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>80,249,673 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>0 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>0 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>△471,241,933 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>31,290,016 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>0 円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目  |                |  | 当期配当等収益額 | A | 4,082,313 円 | 分配準備積立金 | B | △395,074,573 円 | 配当等収益合計額 | C=A+B | △390,992,260 円 | 経費 | D | 80,249,673 円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 0 円 | 収益分配金 | F | 0 円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | △471,241,933 円 | 口数 | H | 31,290,016 口 | 100 口当たり分配金 | I=F/H×100 | 0 円 | <table border="1" style="width: 100%;"> <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>89,360,346 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>△471,241,933 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>△381,881,587 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>64,889,737 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>0 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>0 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>△446,771,324 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>27,279,416 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>0 円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 |  |  | 当期配当等収益額 | A | 89,360,346 円 | 分配準備積立金 | B | △471,241,933 円 | 配当等収益合計額 | C=A+B | △381,881,587 円 | 経費 | D | 64,889,737 円 | 収益分配可能額 | E=C-D | 0 円 | 収益分配金 | F | 0 円 | 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | △446,771,324 円 | 口数 | H | 27,279,416 口 | 100 口当たり分配金 | I=F/H×100 | 0 円 |
| 項目  |   |                |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 当期配当等収益額  | A   | 4,082,313 円    |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 分配準備積立金   | B   | △395,074,573 円 |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 配当等収益合計額  | C=A+B   | △390,992,260 円 |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 経費  | D   | 80,249,673 円   |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 収益分配可能額   | E=C-D   | 0 円            |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 収益分配金   | F   | 0 円            |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 次期繰越金(分配準備積立金)  | G=E-F   | △471,241,933 円 |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 口数  | H   | 31,290,016 口   |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 100 口当たり分配金   | I=F/H×100                                       | 0 円            |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 項目  |   |                |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 当期配当等収益額  | A   | 89,360,346 円   |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 分配準備積立金   | B   | △471,241,933 円 |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 配当等収益合計額  | C=A+B   | △381,881,587 円 |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 経費  | D   | 64,889,737 円   |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 収益分配可能額   | E=C-D   | 0 円            |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 収益分配金   | F   | 0 円            |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 次期繰越金(分配準備積立金)  | G=E-F   | △446,771,324 円 |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 口数  | H   | 27,279,416 口   |  |          |   |             |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |  |    |  |  |          |   |              |         |   |                |          |       |                |    |   |              |         |       |     |       |   |     |                |       |                |    |   |              |             |           |     |
| 100 口当たり分配金   | I=F/H×100                                       | 0 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 5 期<br>自 平成 24 年 7 月 9 日<br>至 平成 25 年 7 月 8 日   | 第 6 期<br>自 平成 25 年 7 月 9 日<br>至 平成 26 年 7 月 8 日  |
|---|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針<br>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。<br>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク<br>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。<br>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。<br>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リス | 1. 金融商品に対する取組方針<br>同左<br>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク<br>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。<br>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。<br>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リス |

|   |                            |
|---|----------------------------|
| 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。  | ク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制<br>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なっております。   | 3. 金融商品に係るリスク管理体制<br>同左    |
| ○市場リスクの管理<br>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なっております。                  |                            |
| ○信用リスクの管理<br>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なっております。 |                            |
| ○流動性リスクの管理<br>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なっております。                   |                            |

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

| 第 5 期<br>平成 25 年 7 月 8 日現在  | 第 6 期<br>平成 26 年 7 月 8 日現在   |
|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>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. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>同左   |
| 2. 時価の算定方法<br>社債券<br>(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。<br>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。 | 2. 時価の算定方法<br>株式<br>(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。<br>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。 |

## (関連当事者との取引に関する注記)

| 第 5 期<br>自 平成 24 年 7 月 9 日<br>至 平成 25 年 7 月 8 日                       | 第 6 期<br>自 平成 25 年 7 月 9 日<br>至 平成 26 年 7 月 8 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 5 期<br>自 平成 24 年 7 月 9 日<br>至 平成 25 年 7 月 8 日 | 第 6 期<br>自 平成 25 年 7 月 9 日<br>至 平成 26 年 7 月 8 日 |
|---|---|
| 期首元本額 14,332,637,712 円                          | 期首元本額 12,766,326,528 円                          |
| 期中追加設定元本額 0 円                                   | 期中追加設定元本額 0 円                                   |
| 期中一部交換元本額 1,566,311,184 円                       | 期中一部解約元本額 1,636,324,800 円                       |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類  | 第5期<br>自 平成 24 年 7 月 9 日<br>至 平成 25 年 7 月 8 日 | 第6期<br>自 平成 25 年 7 月 9 日<br>至 平成 26 年 7 月 8 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  | 0   | 159,482,665                                   |
| 社債券 | △1,324,188,600                                | 0   |
| 合計  | △1,324,188,600                                | 159,482,665                                   |

## 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 26 年 7 月 8 日現在)

| 種類                  | 通貨     | 銘柄                              | 株式数        | 評価額   |              | 備考 |
|---------------------|--------|---------------------------------|------------|-------|--------------|----|
|                     |        |                                 |            | 単価    | 金額           |    |
| 株式                  | レアル    | COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO   | 13,920     | 39.48 | 549,561.60   |    |
|                     |        | PETROBRAS - PETROLEO BRAS       | 358,900    | 16.11 | 5,781,879.00 |    |
|                     |        | PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR      | 534,900    | 17.28 | 9,243,072.00 |    |
|                     |        | ULTRAPAR PARTICIPACOES          | 43,720     | 51.86 | 2,267,319.20 |    |
|                     |        | BRASKEM SA-PREF A               | 35,100     | 14.57 | 511,407.00   |    |
|                     |        | KLABIN SA-UNIT                  | 60,144     | 11.51 | 692,257.44   |    |
|                     |        | BRADSPAR SA -PREF               | 29,510     | 21.11 | 622,956.10   |    |
|                     |        | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA     | 92,980     | 10.43 | 969,781.40   |    |
|                     |        | GERDAU SA PFD NPV               | 114,820    | 13.91 | 1,597,146.20 |    |
|                     |        | METALURGICA GERDAU SA-PREF      | 36,750     | 16.89 | 620,707.50   |    |
|                     |        | MMX MINERACAO E METALICOS SA    | 9,760      | 1.83  | 17,860.80    |    |
|                     |        | USINAS SIDER MINAS GER-PF A     | 63,810     | 8.45  | 539,194.50   |    |
|                     |        | VALE SA                         | 167,290    | 30.80 | 5,152,532.00 |    |
|                     |        | VALE SA-PREF A                  | 248,960    | 27.66 | 6,886,233.60 |    |
|                     |        | DURATEX SA                      | 33,680     | 8.86  | 298,404.80   |    |
|                     |        | FIBRIA CELULOSE SA              | 29,490     | 23.05 | 679,744.50   |    |
|                     |        | SUZANO PAPEL E CELULOSE SA-PREF | 61,180     | 8.82  | 539,607.60   |    |
|                     |        | EMBRAER SA                      | 96,580     | 21.23 | 2,050,393.40 |    |
|                     |        | GOL LINHAS AEREAS - PREF        | 14,210     | 12.01 | 170,662.10   |    |
|                     |        | ALL AMERICA LATINA LOGISTICA    | 57,390     | 7.93  | 455,102.70   |    |
| LOCALIZA RENT A CAR | 19,780 | 36.45                           | 720,981.00 |       |              |    |

|                               |         |        |               |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|
| CCR SA                        | 113,900 | 18.29  | 2,083,231.00  |
| ECORODOVIAS INFRA E LOG SA    | 28,210  | 15.14  | 427,099.40    |
| BROOKFIELD INCORPORACOES SA   | 38,390  | 1.45   | 55,665.50     |
| CYRELA BRAZIL REALTY          | 23,670  | 13.77  | 325,935.90    |
| EVEN CONSTRUTORA E INCORPORA  | 30,300  | 6.49   | 196,647.00    |
| GAFISA SA                     | 43,570  | 3.46   | 150,752.20    |
| MRV ENGENHARIA                | 42,920  | 7.28   | 312,457.60    |
| PDG REALTY SA                 | 184,150 | 1.47   | 270,700.50    |
| ROSSI RESIDENCIAL SA          | 51,410  | 1.63   | 83,798.30     |
| LOJAS AMERICANAS S. A. (PREF) | 56,732  | 14.28  | 810,132.96    |
| LOJAS RENNEN S. A.            | 16,330  | 71.20  | 1,162,696.00  |
| CIA HERING                    | 16,920  | 21.50  | 363,780.00    |
| CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF  | 21,100  | 105.26 | 2,220,986.00  |
| AMBEV SA                      | 437,390 | 16.09  | 7,037,605.10  |
| BRF SA                        | 82,730  | 54.25  | 4,488,102.50  |
| JBS SA                        | 211,510 | 7.73   | 1,634,972.30  |
| MARFRIG GLOBAL FOODS SA       | 49,140  | 5.85   | 287,469.00    |
| SOUZA CRUZ SA                 | 49,870  | 22.69  | 1,131,550.30  |
| HYPERMARCAS S. A              | 44,120  | 19.11  | 843,133.20    |
| NATURA COSMETICOS SA          | 22,290  | 38.00  | 847,020.00    |
| QUALICORP SA                  | 25,740  | 26.88  | 691,891.20    |
| BANCO BRADESCO S. A.          | 60,170  | 32.92  | 1,980,796.40  |
| BANCO BRADESCO SA - PREF      | 269,230 | 32.40  | 8,723,052.00  |
| BANCO DO BRASIL SA            | 115,140 | 24.87  | 2,863,531.80  |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) SA   | 122,280 | 15.29  | 1,869,661.20  |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA      | 353,992 | 31.90  | 11,292,344.80 |
| ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR  | 406,640 | 8.68   | 3,529,635.20  |
| BM&F BOVESPA SA               | 245,600 | 11.40  | 2,799,840.00  |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES   | 89,340  | 32.70  | 2,921,418.00  |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA     | 56,880  | 18.50  | 1,052,280.00  |
| BR PROPERTIES SA              | 39,200  | 13.30  | 521,360.00    |
| CIELO SA                      | 88,080  | 45.37  | 3,996,189.60  |
| OI SA PREFERENCE              | 387,200 | 1.76   | 681,472.00    |
| TELEFONICA BRASIL-PREF        | 34,520  | 44.31  | 1,529,581.20  |
| TIM PARTICIPACOES SA          | 106,280 | 12.28  | 1,305,118.40  |

|  |  |         |       |                 |  |
|--|--|---------|-------|-----------------|--|
|  | CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B | 28,560  | 10.59 | 302,450.40      |  |
|  | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER           | 31,390  | 6.38  | 200,268.20      |  |
|  | CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF       | 100,270 | 16.93 | 1,697,571.10    |  |
|  | CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB           | 13,200  | 33.13 | 437,316.00      |  |
|  | CPFL ENERGIA SA                        | 38,600  | 20.05 | 773,930.00      |  |
|  | EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA            | 32,940  | 10.71 | 352,787.40      |  |
|  | ELETROPAULO METROPOLI-PREF             | 13,210  | 10.41 | 137,516.10      |  |
|  | LIGHT SA                               | 13,830  | 21.47 | 296,930.10      |  |
|  | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP            | 44,840  | 23.67 | 1,061,362.80    |  |
|  | CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO           | 33,350  | 31.30 | 1,043,855.00    |  |
|  | ESTACIO PARTICIPACOES SA               | 38,550  | 29.65 | 1,143,007.50    |  |
|  | KROTON EDUCACIONAL SA                  | 44,943  | 59.25 | 2,662,872.75    |  |
|  | CIA ENERGETICA DE SP-PREF B            | 24,180  | 29.41 | 711,133.80      |  |
|  | TRACTEBEL ENERGIA SA                   | 26,870  | 33.82 | 908,743.40      |  |
|  | 小計 銘柄数 : 70                            |         |       | 122,588,455.55  |  |
|  |  |         |       | (5,604,744,187) |  |
|  | 組入時価比率 : 98.8%                         |         |       | 100.0%          |  |
|  | 合計                                     |         |       | 5,604,744,187   |  |
|  |  |         |       | (5,604,744,187) |  |

(注 1) 外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額 (単位:円) であります。

(注 2) 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注 3) 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 26 年 7 月 8 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。