平成25年8月期 （平成25年2月11日～平成25年8月10日） 決算短信

平成25年9月20日

上場取引所　　東証

ファンド名	NEXT FUNDS 東証REIT指数連動型上場投信		
コード番号	(1343)		
連動対象指標	東証REIT指数		
主要投資資産	投資証券		
売買単位	10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

有価証券報告書提出予定日	平成25年10月30日
分配金支払開始日	平成25年9月18日

Ⅰ ファンドの運用状況

1. 平成25年8月期の運用状況（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月期	45,167	(98.0)	901	(2.0)	46,069	(100)
平成25年2月期	21,991	(98.0)	454	(2.0)	22,445	(100)

(2)設定・交換実績　　（千口未満切捨て）

	前特定期間末発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当特定期間末発行済口数(①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成25年8月期	17,138	16,965	1,568	32,535
平成25年2月期	15,284	4,594	2,740	17,138

(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/当特定期間末発行済口数)× 100)
	百万円	百万円	百万円	円
平成25年8月期	46,478	409	46,069	141,596
平成25年2月期	22,690	244	22,445	130,968

(4)分配金

	100 口当り分配金
	円
平成25年8月期	1,120.00
平成25年2月期	930.00

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

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 (平成 25 年 2 月 10 日現在)	当期 (平成 25 年 8 月 10 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	235,514,915	482,340,066
投資証券	21,991,214,270	45,167,918,400
派生商品評価勘定	73,769,409	34,268,761
未収入金	161,687,950	365,747,027
未収配当金	227,920,391	402,528,056
未収利息	1,752	2,050
差入委託証拠金	-	25,766,100
流動資産合計	22,690,108,687	46,478,570,460
資産合計	22,690,108,687	46,478,570,460
負債の部		
流動負債		
前受金	66,294,900	-
未払収益分配金	159,385,074	364,396,961
未払受託者報酬	2,477,418	5,596,672
未払委託者報酬	13,378,016	30,221,976
その他未払費用	3,006,933	9,329,070
流動負債合計	244,542,341	409,544,679
負債合計	244,542,341	409,544,679
純資産の部		
元本等		
元本	20,188,776,040	38,326,751,854
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,256,790,306	7,742,273,927
（分配準備積立金）	228,532,338	956,727
元本等合計	22,445,566,346	46,069,025,781
純資産合計	22,445,566,346	46,069,025,781
負債純資産合計	22,690,108,687	46,478,570,460

（2）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　平成 24 年 8 月 11 日 至　平成 25 年 2 月 10 日	当期 自　平成 25 年 2 月 11 日 至　平成 25 年 8 月 10 日
営業収益		
受取配当金	420,789,506	646,737,320
受取利息	103,070	213,902
有価証券売買等損益	4,634,907,548	109,762,128
派生商品取引等損益	106,283,871	49,649,017
営業収益合計	5,162,083,995	806,362,367
営業費用		

受託者報酬	4,504,306	9,653,000
委託者報酬	24,323,198	52,126,134
その他費用	3,384,619	8,236,215
営業費用合計	32,212,123	70,015,349
営業利益	5,129,871,872	736,347,018
経常利益	5,129,871,872	736,347,018
当期純利益	5,129,871,872	736,347,018
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△2,840,764,251	2,256,790,306
剰余金増加額又は欠損金減少額	289,438,029	6,205,988,601
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	218,643,462	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	70,794,567	6,205,988,601
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	652,340,514
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	652,340,514
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	321,755,344	804,511,484
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,256,790,306	7,742,273,927

（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	投資証券 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、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。 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	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。 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った場合、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	当該財務諸表の特定期間は、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。

（貸借対照表に関する注記）

前期 平成 25 年 2 月 10 日現在	当期 平成 25 年 8 月 10 日現在
1.　特定期間の末日における受益権の総数 17,138,180 口	1.　特定期間の末日における受益権の総数 32,535,443 口
2.　特定期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	2.　特定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　1,309.68 円	1 口当たり純資産額　1,415.96 円
(100 口当たり純資産額)　(130,968 円)	(100 口当たり純資産額)　(141,596 円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

<table>
<tr><th>前期
自 平成 24 年 8 月 11 日
至 平成 25 年 2 月 10 日</th><th>当期
自 平成 25 年 2 月 11 日
至 平成 25 年 8 月 10 日</th></tr>
<tr><td>１.分配金の計算過程
平成 24 年 8 月 11 日から平成 24 年 11 月 10 日まで
<table>
<tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr>
<tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>190,973,708 円</td></tr>
<tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>161,607,229 円</td></tr>
<tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>352,580,937 円</td></tr>
<tr><td>経費</td><td>D</td><td>14,469,050 円</td></tr>
<tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>338,111,887 円</td></tr>
<tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>162,370,270 円</td></tr>
<tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>175,741,617 円</td></tr>
<tr><td>口数</td><td>H</td><td>15,317,950 口</td></tr>
<tr><td>100 口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,060 円</td></tr>
</table>
平成 24 年 11 月 11 日から平成 25 年 2 月 10 日まで
<table>
<tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr>
<tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>229,918,868 円</td></tr>
<tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>175,741,617 円</td></tr>
<tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>405,660,485 円</td></tr>
<tr><td>経費</td><td>D</td><td>17,743,073 円</td></tr>
<tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>387,917,412 円</td></tr>
<tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>159,385,074 円</td></tr>
<tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>228,532,338 円</td></tr>
<tr><td>口数</td><td>H</td><td>17,138,180 口</td></tr>
<tr><td>100 口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>930 円</td></tr>
</table>
２．その他費用
その他費用のうち 2,641,593 円は、対象指数についての商標使用料であります。</td><td>１.分配金の計算過程
平成 25 年 2 月 11 日から平成 25 年 5 月 10 日まで
<table>
<tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr>
<tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>242,251,217 円</td></tr>
<tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>228,532,338 円</td></tr>
<tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>470,783,555 円</td></tr>
<tr><td>経費</td><td>D</td><td>30,031,778 円</td></tr>
<tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>440,751,777 円</td></tr>
<tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>440,114,523 円</td></tr>
<tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>637,254 円</td></tr>
<tr><td>口数</td><td>H</td><td>23,535,536 口</td></tr>
<tr><td>100 口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,870 円</td></tr>
</table>
平成 25 年 5 月 11 日から平成 25 年 8 月 10 日まで
<table>
<tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr>
<tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>404,700,005 円</td></tr>
<tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>637,254 円</td></tr>
<tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>405,337,259 円</td></tr>
<tr><td>経費</td><td>D</td><td>39,983,571 円</td></tr>
<tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>365,353,688 円</td></tr>
<tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>364,396,961 円</td></tr>
<tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>956,727 円</td></tr>
<tr><td>口数</td><td>H</td><td>32,535,443 口</td></tr>
<tr><td>100 口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,120 円</td></tr>
</table>
２．その他費用
その他費用のうち 5,368,768 円は、対象指数についての商標使用料であります。</td></tr>
</table>

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

前期 自 平成 24 年 8 月 11 日 至 平成 25 年 2 月 10 日	当期 自 平成 25 年 2 月 11 日 至 平成 25 年 8 月 10 日
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。	1.金融商品に対する取組方針 同左
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、デリバティブ取引、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、REIT の価格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。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、REIT 指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする REIT 指数等に係る価格変動リスクを有しております。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	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なっております。 ○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なっております。 ○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なっております。 ○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なっております。	同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

前期 平成 25 年 2 月 10 日現在	当期 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。 2．時価の算定方法 投資証券 （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。 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 3 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。	1．貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2．時価の算定方法 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

前期 自 平成 24 年 8 月 11 日 至 平成 25 年 2 月 10 日	当期 自 平成 25 年 2 月 11 日 至 平成 25 年 8 月 10 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

前期 自 平成 24 年 8 月 11 日 至 平成 25 年 2 月 10 日		当期 自 平成 25 年 2 月 11 日 至 平成 25 年 8 月 10 日	
期首元本額	18,005,051,472 円	期首元本額	20,188,776,040 円
期中追加設定元本額	5,412,085,400 円	期中追加設定元本額	19,985,830,200 円
期中一部交換元本額	3,228,360,832 円	期中一部交換元本額	1,847,854,386 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 平成 24 年 8 月 11 日 至 平成 25 年 2 月 10 日	当期 自 平成 25 年 2 月 11 日 至 平成 25 年 8 月 10 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）
投資証券	3,002,901,068	△3,681,314,880
合計	3,002,901,068	△3,681,314,880

3 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	前期(平成 25 年 2 月 10 日現在)				当期(平成 25 年 8 月 10 日現在)			
	契約額等（円）	うち 1 年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち 1 年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 REIT 指数先物取引								
買建	368,174,100	－	441,966,000	73,769,409	841,689,600	－	875,999,500	34,268,761
合計	368,174,100	－	441,966,000	73,769,409	841,689,600	－	875,999,500	34,268,761

（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。

（4）【附属明細表】

第 1　有価証券明細表

(1)株式(平成 25 年 8 月 10 日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(平成 25 年 8 月 10 日現在)

（単位:円）

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	日本円	日本アコモデーションファンド投資法人　投資証券	1,648	1,092,624,000	
		ＭＩＤリート投資法人　投資証券	1,312	297,692,800	
		森ヒルズリート投資法人　投資証券	1,819	996,812,000	
		野村不動産レジデンシャル投資法人投資証券	1,078	525,525,000	
		産業ファンド投資法人　投資証券	1,117	1,003,066,000	
		大和ハウスリート投資法人　投資証券	875	606,375,000	
		アドバンス・レジデンス投資法人投資証券	8,856	1,727,805,600	
		ケネディクス・レジデンシャル投資法人　投資証券	1,717	354,045,400	
		アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券	1,466	1,039,394,000	
		ＧＬＰ投資法人　投資証券	13,125	1,282,312,500	
		コンフォリア・レジデンシャル投資法人　投資証券	481	296,777,000	
		日本プロロジスリート投資法人　投資証券	1,992	1,721,088,000	
		野村不動産マスターファンド投資法	11,894	1,162,043,800	

		人　投資証券			
		日本ビルファンド投資法人　投資証券	4,942	5,510,330,000	
		ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券	4,244	4,647,180,000	
		日本リテールファンド投資法人　投資証券	14,850	2,900,205,000	
		オリックス不動産投資法人　投資証券	11,364	1,277,313,600	
		日本プライムリアルティ投資法人　投資証券	5,892	1,620,889,200	
		プレミア投資法人　投資証券	1,405	543,032,500	
		東急リアル・エステート投資法人　投資証券	1,210	607,420,000	
		グローバル・ワン不動産投資法人　投資証券	692	381,292,000	
		野村不動産オフィスファンド投資法人　投資証券	2,661	1,109,637,000	
		ユナイテッド・アーバン投資法人　投資証券	16,931	2,160,395,600	
		森トラスト総合リート投資法人　投資証券	1,728	1,544,832,000	
		インヴィンシブル投資法人　投資証券	9,630	134,627,400	
		フロンティア不動産投資法人　投資証券	1,771	1,537,228,000	
		平和不動産リート投資法人　投資証券	5,681	394,829,500	
		日本ロジスティクスファンド投資法人　投資証券	1,057	924,875,000	
		福岡リート投資法人　投資証券	986	749,360,000	
		ケネディクス不動産投資法人　投資証券	2,047	819,823,500	
		積水ハウス・ＳＩ投資法人　投資証券	1,140	530,100,000	
		いちご不動産投資法人　投資証券	6,663	405,110,400	
		大和証券オフィス投資法人　投資証券	2,827	1,058,711,500	
		阪急リート投資法人　投資証券	751	365,737,000	
		スターツプロシード投資法人　投資証券	1,035	175,225,500	
		トップリート投資法人　投資証券	1,107	477,670,500	
		大和ハウス・レジデンシャル投資法人　投資証券	2,513	964,992,000	
		ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券	18,722	731,094,100	
		日本賃貸住宅投資法人　投資証券	9,505	638,736,000	

		ジャパンエクセレント投資法人　投資証券	1,607	851,710,000	
	小計	銘柄数：40	180,341	45,167,918,400	
		組入時価比率：98.0%		100.0%	
合計				45,167,918,400	

(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。

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

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。