

平成26年7月期（平成25年7月16日～平成26年7月15日）決算短信

平成26年8月27日

上場取引所

東証

ファンド名 TOPIX Core 30連動型上場投資信託  
 コード番号 ( 1311 )  
 連動対象指標 TOPIX Core 30  
 主要投資資産 株式  
 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兼執行役社長 渡邊 国夫  
 問合せ先責任者 投信ディスプレイ部長 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 平成26年8月22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16日～平成26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26年7月期	8,814	(98.5)	135	(1.5)	8,950	(100)
平成25年7月期	9,218	(98.2)	171	(1.8)	9,390	(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26年7月期	14,543	999	1,938	13,603
平成25年7月期	23,033	0	8,489	14,543

(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	9,131	181	8,950	65,793
平成25年7月期	9,628	237	9,390	64,568

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成26年7月期	1,260.00
平成25年7月期	1,550.00

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

## TOPIX Core 30 連動型上場投資信託

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 11 期 (平成 25 年 7 月 15 日現在)	第 12 期 (平成 26 年 7 月 15 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	375,753,723	299,489,599
株式	9,218,431,700	8,814,835,400
派生商品評価勘定	10,214,183	2,583,800
未収入金	13,970,944	3,656,666
未収配当金	9,975,300	7,873,600
未収利息	3,285	540
差入委託証拠金	-	2,742,000
流動資産合計	9,628,349,135	9,131,181,605
資産合計	9,628,349,135	9,131,181,605
負債の部		
流動負債		
前受金	2,152,500	-
未払収益分配金	225,421,677	171,402,336
未払受託者報酬	3,286,960	3,060,937
未払委託者報酬	7,043,428	6,559,073
その他未払費用	93,846	87,395
流動負債合計	237,998,411	181,109,741
負債合計	237,998,411	181,109,741
純資産の部		
元本等		
元本	11,576,493,864	10,828,274,560
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△2,186,143,140	△1,878,202,696
(分配準備積立金)	1,253,930	1,249,336
元本等合計	9,390,350,724	8,950,071,864
純資産合計	9,390,350,724	8,950,071,864
負債純資産合計	9,628,349,135	9,131,181,605

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日
営業収益		
受取配当金	234,622,560	191,141,476
受取利息	243,445	135,465
有価証券売買等損益	4,572,582,630	111,544,397
派生商品取引等損益	160,078,357	16,098,107
その他収益	17,736	19,647
営業収益合計	4,967,544,728	318,939,092

## 営業費用

受託者報酬	6,764,259	6,274,490
委託者報酬	14,494,727	13,445,198
その他費用	193,147	179,158
営業費用合計	21,452,133	19,898,846
営業利益又は営業損失(△)	4,946,092,595	299,040,246
経常利益又は経常損失(△)	4,946,092,595	299,040,246
当期純利益又は当期純損失(△)	4,946,092,595	299,040,246
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(△)	△9,316,887,534	△2,186,143,140
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,410,073,476	319,191,804
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,410,073,476	319,191,804
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	138,889,270
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	138,889,270
分配金	225,421,677	171,402,336
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△2,186,143,140	△1,878,202,696

## (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。 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	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 16 日から平成 26 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 11 期 平成 25 年 7 月 15 日現在	第 12 期 平成 26 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 14,543,334 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 13,603,360 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 2,186,143,140 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 1,878,202,696 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 1 口当たり純資産額 645.68 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 1 口当たり純資産額 657.93 円

(100 口当たり純資産額)

(64,568 円)

(100 口当たり純資産額)

(65,793 円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日			第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	234,883,741 円	当期配当等収益額	A	191,296,588 円
分配準備積立金	B	13,243,999 円	分配準備積立金	B	1,253,930 円
配当等収益合計額	C=A+B	248,127,740 円	配当等収益合計額	C=A+B	192,550,518 円
経費	D	21,452,133 円	経費	D	19,898,846 円
収益分配可能額	E=C-D	226,675,607 円	収益分配可能額	E=C-D	172,651,672 円
収益分配金	F	225,421,677 円	収益分配金	F	171,402,336 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,253,930 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,249,336 円
口数	H	14,543,334 口	口数	H	13,603,360 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,550 円	100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,260 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 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日		第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 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、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。 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、株価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、対象とする株価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	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。 ○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っております。	3. 金融商品に係るリスク管理体制	同左

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

第 11 期 平成 25 年 7 月 15 日現在	第 12 期 平成 26 年 7 月 15 日現在
------------------------------	------------------------------

<p>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。</p> <p>2. 時価の算定方法 株式 (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。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>
--	---

## (関連当事者との取引に関する注記)

<p>第 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日</p>	<p>第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日</p>
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

<p>第 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日</p>	<p>第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日</p>
期首元本額 18,334,518,740 円	期首元本額 11,576,493,864 円
期中追加設定元本額 0 円	期中追加設定元本額 795,204,000 円
期中一部交換元本額 6,758,024,876 円	期中一部交換元本額 1,543,423,304 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 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	3,561,907,362	170,958,508
合計	3,561,907,362	170,958,508

## 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	第 11 期(平成 25 年 7 月 15 日現在)				第 12 期(平成 26 年 7 月 15 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								
株価指数先物取引								
買建	155,918,000	—	166,148,500	10,214,183	128,100,000	—	130,700,000	2,583,800
合計	155,918,000	—	166,148,500	10,214,183	128,100,000	—	130,700,000	2,583,800

(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 26 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	日本たばこ産業	85,100	3,792.00	322,699,200	
		信越化学工業	25,700	6,260.00	160,882,000	
		武田薬品工業	53,800	4,726.00	254,258,800	
		アステラス製薬	163,400	1,380.00	225,492,000	
		新日鐵住金	606,000	311.00	188,466,000	
		小松製作所	66,900	2,321.00	155,274,900	
		日立製作所	330,000	768.00	253,440,000	
		パナソニック	156,600	1,225.00	191,835,000	
		ソニー	75,600	1,675.00	126,630,000	
		ファナック	15,300	17,370.00	265,761,000	
		キヤノン	79,400	3,374.00	267,895,600	
		デンソー	33,900	4,800.00	162,720,000	
		日産自動車	192,300	991.00	190,569,300	
		トヨタ自動車	190,700	6,023.00	1,148,586,100	
		本田技研工業	123,300	3,607.00	444,743,100	
		東日本旅客鉄道	25,200	8,139.00	205,102,800	
		日本電信電話	53,100	6,792.00	360,655,200	
		KDDI	42,000	6,316.00	265,272,000	
		NTTドコモ	111,400	1,775.00	197,735,000	
		ソフトバンク	66,400	7,692.00	510,748,800	
		三井物産	122,300	1,642.00	200,816,600	
		三菱商事	105,500	2,134.00	225,137,000	
		セブン&アイ・ホールディングス	56,600	4,395.00	248,757,000	
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,024,500	606.00	620,847,000	
		三井住友フィナンシャルグループ	102,300	4,137.00	423,215,100	
		みずほフィナンシャルグループ	1,755,800	201.00	352,915,800	
野村ホールディングス	276,500	669.00	184,978,500			
東京海上ホールディングス	52,400	3,309.00	173,391,600			

	三井不動産	71,000	3,460.00	245,660,000	
	三菱地所	95,000	2,530.00	240,350,000	
	小計 銘柄数：30			8,814,835,400	
	組入時価比率：98.5%			100.0%	
合計				8,814,835,400	

(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。

(2) 株式以外の有価証券(平成 26 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

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。