

平成27年7月期 中間決算短信（平成26年7月11日～平成27年1月10日）

平成27年2月20日

ファンド名	TOPIX連動型上場投資信託		上場取引所	東証
コード番号	(1306)		売買単位	10口
連動対象指標	東証株価指数(TOPIX)			
主要投資資産	株式			
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	CEO兼執行役社長	渡邊 国夫		
問合せ先責任者	投信ディスクローシャー部長	村山 治子	TEL (03)-3241-9511	
半期報告書提出予定日	平成27年3月26日			

I ファンドの運用状況

1. 平成27年1月中間期の運用状況（平成26年7月11日～平成27年1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27年1月中間期	1,915,472	(98.1)	36,763	(1.9)	1,952,235	(100)
平成26年7月期	1,639,499	(98.6)	23,226	(1.4)	1,662,725	(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27年1月中間期	1,301,222	273,928	192,739	1,382,411

(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27年1月中間期	2,107,001	154,765	1,952,235	141,220
平成26年7月期	1,828,654	165,928	1,662,725	127,782

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

T O P I X 連動型上場投資信託

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 13 期 (平成 26 年 7 月 10 日現在)	第 14 期中間計算期間末 (平成 27 年 1 月 10 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	186,860,710,083	186,775,718,035
株式	1,639,499,123,300	1,915,472,672,620
派生商品評価勘定	444,145,734	-
未収入金	522,572,508	237,864,835
未収配当金	1,310,094,435	2,196,000,403
未収利息	84,179	282,386
その他未収収益	17,394,720	18,203,485
差入委託証拠金	-	2,300,921,000
流動資産合計	1,828,654,124,959	2,107,001,662,764
資産合計		
	1,828,654,124,959	2,107,001,662,764
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,648,406	951,576,029
前受金	36,778,000	-
未払金	254,137	275,326,940
未払収益分配金	26,805,186,054	-
未払受託者報酬	366,178,779	438,826,532
未払委託者報酬	696,381,328	838,187,115
未払利息	1,439,181	1,288,056
有価証券貸借取引受入金	137,708,140,815	152,065,024,250
その他未払費用	311,961,284	195,594,142
流動負債合計	165,928,967,984	154,765,823,064
負債合計		
	165,928,967,984	154,765,823,064
純資産の部		
元本等		
元本	1,626,528,280,000	1,728,014,105,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	36,196,876,975	224,221,734,700
(分配準備積立金)	45,164,638	45,164,638
元本等合計	1,662,725,156,975	1,952,235,839,700
純資産合計		
	1,662,725,156,975	1,952,235,839,700
負債純資産合計		
	1,828,654,124,959	2,107,001,662,764

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 13 期中間計算期間 自 平成 25 年 7 月 11 日 至 平成 26 年 1 月 10 日	第 14 期中間計算期間 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 1 月 10 日
営業収益		
受取配当金	11,504,289,126	16,592,019,069

受取利息	45,706,777	41,586,563
有価証券売買等損益	123,945,773,696	169,454,367,853
派生商品取引等損益	2,081,455,504	2,796,127,338
その他収益	286,591,052	341,589,293
営業収益合計	137,863,816,155	189,225,690,116
営業費用		
支払利息	21,348,468	24,563,023
受託者報酬	330,231,266	438,826,532
委託者報酬	626,538,334	838,187,115
その他費用	159,045,988	191,698,116
営業費用合計	1,137,164,056	1,493,274,786
営業利益又は営業損失(△)	136,726,652,099	187,732,415,330
経常利益又は経常損失(△)	136,726,652,099	187,732,415,330
中間純利益又は中間純損失(△)	136,726,652,099	187,732,415,330
一部交換に伴う中間純利益金額の分配額又は一部交換に伴う中間純損失金額の分配額(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△43,830,493,112	36,196,876,975
剰余金増加額又は欠損金減少額	561,359,270	27,013,216,805
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	561,359,270	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	27,013,216,805
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,869,071,213	26,720,774,410
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	26,720,774,410
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,869,071,213	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	87,588,447,044	224,221,734,700

(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	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。
2. 費用・収益の計上基準	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。 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	当ファンドの中間計算期間は、平成26年7月11日から平成27年1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13期 平成26年7月10日現在	第14期中間計算期間末 平成27年1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,301,222,624口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,382,411,284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 1,277.82円 (100口当たり純資産額) (127,782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 1,412.20円 (100口当たり純資産額) (141,220円)
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 129,090,163,600円	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 146,646,087,810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13期 平成26年7月10日現在	第14期中間計算期間末 平成27年1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ぬ。	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ぬ。
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 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13期 自平成25年7月11日 至平成26年7月10日	第14期中間計算期間 自平成26年7月11日 至平成27年1月10日
期首元本額 1,366,695,341,250円	期首元本額 1,626,528,280,000円
期中追加設定元本額 386,157,500,000円	期中追加設定元本額 342,410,750,000円
期中一部交換元本額 126,324,561,250円	期中一部交換元本額 240,924,925,000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13期(平成26年7月10日現在)				第14期中間計算期間末(平成27年1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								
株価指数先物取引								
買建	22,686,365,000	—	23,129,000,000	441,497,328	37,532,621,000	—	36,582,690,000	△951,576,029
合計	22,686,365,000	—	23,129,000,000	441,497,328	37,532,621,000	—	36,582,690,000	△951,576,029

(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。