

平成28年7月期 中間決算短信（平成27年7月11日～平成28年1月10日）

平成28年2月22日

| | | | | |
|------------|---|-------|--------------------|---------|
| ファンド名 | 日経300株価指数連動型上場投資信託 | | 上場取引所 | 東京・名古屋・ |
| コード番号 | (1319) | | | 福岡・札幌 |
| 連動対象指標 | 日経300指数 | | 売買単位 | 1000口 |
| 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 | 商品企画部長 | 渡部 昭裕 | TEL (03)-3241-9511 | |
| 半期報告書提出予定日 | 平成28年3月30日 | | | |

I ファンドの運用状況

1. 平成28年1月中間期の運用状況（平成27年7月11日～平成28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28年1月中間期 | 9,920 | (98.8) | 120 | (1.2) | 10,040 | (100) |
| 平成27年7月期 | 14,766 | (99.9) | 17 | (0.1) | 14,783 | (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28年1月中間期 | 46,534 | 0 | 11,902 | 34,632 |

(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28年1月中間期 | 10,068 | 27 | 10,040 | 28,992 |
| 平成27年7月期 | 15,018 | 234 | 14,783 | 31,769 |

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

日経 300 株価指数連動型上場投資信託

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第 21 期 (平成 27 年 7 月 10 日現在) | 第 22 期中間計算期間末 (平成 28 年 1 月 10 日現在) |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 221,495,237 | 134,757,984 |
| 株式 | 14,766,206,740 | 9,920,071,150 |
| 未収入金 | 15,228,730 | - |
| 未収配当金 | 15,487,940 | 13,694,950 |
| 未収利息 | 350 | 678 |
| 流動資産合計 | 15,018,418,997 | 10,068,524,762 |
| 資産合計 | 15,018,418,997 | 10,068,524,762 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 203,357,936 | - |
| 未払受託者報酬 | 6,031,253 | 5,357,974 |
| 未払委託者報酬 | 25,331,008 | 22,503,331 |
| その他未払費用 | 120,573 | 107,082 |
| 流動負債合計 | 234,840,770 | 27,968,387 |
| 負債合計 | 234,840,770 | 27,968,387 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 11,261,469,274 | 8,380,987,318 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金(△) | 3,522,108,953 | 1,659,569,057 |
| (分配準備積立金) | 37,653 | 37,653 |
| 元本等合計 | 14,783,578,227 | 10,040,556,375 |
| 純資産合計 | 14,783,578,227 | 10,040,556,375 |
| 負債純資産合計 | 15,018,418,997 | 10,068,524,762 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第 21 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 | 第 22 期中間計算期間 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 1 月 10 日 |
|-------------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 116,794,361 | 130,722,872 |
| 受取利息 | 18,017 | 21,779 |
| 有価証券売買等損益 | 1,121,729,320 | △1,215,147,821 |
| その他収益 | 37,906 | 65,732 |
| 営業収益合計 | 1,238,579,604 | △1,084,337,438 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 6,131,214 | 5,357,974 |
| 委託者報酬 | 25,750,863 | 22,503,331 |

| | | |
|--|------------------|-------------------|
| その他費用 | 122, 581 | 107, 097 |
| 営業費用合計 | 32, 004, 658 | 27, 968, 402 |
| 営業利益又は営業損失 (△) | 1, 206, 574, 946 | △1, 112, 305, 840 |
| 経常利益又は経常損失 (△) | 1, 206, 574, 946 | △1, 112, 305, 840 |
| 中間純利益又は中間純損失 (△) | 1, 206, 574, 946 | △1, 112, 305, 840 |
| 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 (△) | 460, 917, 459 | 3, 522, 108, 953 |
| 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 | - | 750, 234, 056 |
| 中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 750, 234, 056 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金 (△) | 1, 667, 492, 405 | 1, 659, 569, 057 |

(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 | 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。 |
| 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。 |
| 4. その他 | 当ファンドの中間計算期間は、平成 27 年 7 月 11 日から平成 28 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 21 期 平成 27 年 7 月 10 日現在 | 第 22 期中間計算期間末 平成 28 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 46, 534, 997 口 | 1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 34, 632, 179 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 317.69 円 (100 口当たり純資産額) (31, 769 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 289.92 円 (100 口当たり純資産額) (28, 992 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 21 期 平成 27 年 7 月 10 日現在 | 第 22 期中間計算期間末 平成 28 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 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。 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 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。 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。

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21期 自平成26年7月11日 至平成27年7月10日 | | 第22期中間計算期間 自平成27年7月11日 至平成28年1月10日 | |
|------------------------------------|-----------------|--|-----------------|
| 期首元本額 | 11,261,469,274円 | 期首元本額 | 11,261,469,274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 | 0円 | 期中一部交換元本額 | 2,880,481,956円 |

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。