

平成29年7月期 中間決算短信（平成28年7月9日～平成29年1月8日）

平成29年2月17日

ファンド名	上海株式指数・上証50連動型上場投資信託		上場取引所	東証
コード番号	(1309)		売買単位	1口
連動対象指標	上証50指数			
主要投資資産	投資信託証券			
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29年3月29日			

I ファンドの運用状況

1. 平成29年1月中間期の運用状況（平成28年7月9日～平成29年1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 (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29年1月中間期	5,005	(99.7)	13	(0.3)	5,018	(100)
平成28年7月期	4,701	(99.3)	32	(0.7)	4,734	(100)

(2)設定・解約実績 (千口未満切捨て)

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	解約口数(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29年1月中間期	191	0	20	171

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1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)×1)
	百万円	百万円	百万円	円
平成29年1月中間期	5,042	23	5,018	29,281
平成28年7月期	4,757	23	4,734	24,737

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

上海株式指数・上証50連動型上場投資信託

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (平成28年7月8日現在)	第10期中間計算期間末 (平成29年1月8日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	56,247,239	37,060,656
投資信託受益証券	3,857,519,794	4,028,378,400
親投資信託受益証券	843,822,742	976,759,442
流動資産合計	4,757,589,775	5,042,198,498
資産合計	4,757,589,775	5,042,198,498
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,407,282	1,373,137
未払委託者報酬	20,546,303	20,047,815
未払利息	85	147
その他未払費用	1,382,917	2,389,592
流動負債合計	23,336,587	23,810,691
負債合計	23,336,587	23,810,691
純資産の部		
元本等		
元本	13,293,219,330	11,904,059,330
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△8,558,966,142	△6,885,671,523
元本等合計	4,734,253,188	5,018,387,807
純資産合計	4,734,253,188	5,018,387,807
負債純資産合計	4,757,589,775	5,042,198,498

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期中間計算期間 自 平成27年7月9日 至 平成28年1月8日	第10期中間計算期間 自 平成28年7月9日 至 平成29年1月8日
営業収益		
受取利息	17,654	-
有価証券売買等損益	△2,621,464,369	910,798,248
営業収益合計	△2,621,446,715	910,798,248
営業費用		
支払利息	-	9,171
受託者報酬	2,013,948	1,373,137
委託者報酬	29,403,574	20,047,815
その他費用	1,920,654	1,353,506
営業費用合計	33,338,176	22,783,629

営業利益又は営業損失 (△)	△2,654,784,891	888,014,619
経常利益又は経常損失 (△)	△2,654,784,891	888,014,619
中間純利益又は中間純損失 (△)	△2,654,784,891	888,014,619
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約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 (△)	△6,472,943,466	△8,558,966,142
剰余金増加額又は欠損金減少額	679,475,000	785,280,000
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	679,475,000	785,280,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△8,448,253,357	△6,885,671,523

(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	投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	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る場合、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 28 年 7 月 9 日から平成 29 年 1 月 8 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 9 期 平成 28 年 7 月 8 日現在	第 10 期中間計算期間末 平成 29 年 1 月 8 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 191,385 口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 171,385 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 8,558,966,142 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 6,885,671,523 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 24,737 円	3. 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 29,281 円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 9 期中間計算期間 自平成 27 年 7 月 9 日 至平成 28 年 1 月 8 日	第 10 期中間計算期間 自平成 28 年 7 月 9 日 至平成 29 年 1 月 8 日
該当事項はありません。	1. 追加情報 平成 28 年 1 月 29 日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(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 9 期 平成 28 年 7 月 8 日現在	第 10 期中間計算期間末 平成 29 年 1 月 8 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 投資信託受益証券 (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。 親投資信託受益証券 (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。 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. 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。</p> <p>2. 時価の算定方法 投資信託受益証券 (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。 親投資信託受益証券 (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。 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>
--	---

(その他の注記)

1 元本の移動

第9期 自平成27年7月9日 至平成28年7月8日		第10期中間計算期間 自平成28年7月9日 至平成29年1月8日	
期首元本額	16,418,829,330円	期首元本額	13,293,219,330円
期中追加設定元本額	0円	期中追加設定元本額	0円
期中一部解約元本額	3,125,610,000円	期中一部解約元本額	1,389,160,000円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。