

## 平成29年7月期 中間決算短信（平成28年7月11日～平成29年1月10日）

平成29年2月21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	<a href="http://www.nomura-am.co.jp">http://www.nomura-am.co.jp</a>			
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11日～平成29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29年1月中間期	3,985,311	(98.3)	67,357	(1.7)	4,052,669	(100)
平成28年7月期	2,463,057	(99.0)	23,816	(1.0)	2,486,874	(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29年1月中間期	2,023,750	712,914	174,461	2,562,203

(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29年1月中間期	4,653,627	600,958	4,052,669	158,171
平成28年7月期	2,977,266	490,391	2,486,874	122,884

## 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 15 期 (平成 28 年 7 月 10 日現在)	第 16 期中間計算期間末 (平成 29 年 1 月 10 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	500,442,520,594	659,442,835,650
株式	2,463,057,774,650	3,985,311,549,456
派生商品評価勘定	-	3,144,140,930
未収入金	-	561,878,280
未収配当金	3,713,373,865	4,649,790,286
未収利息	12,612,017	16,024,044
その他未収収益	32,358,586	501,620,477
差入委託証拠金	10,007,439,940	-
流動資産合計	2,977,266,079,652	4,653,627,839,123
資産合計		
	2,977,266,079,652	4,653,627,839,123
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,947,605,210	-
前受金	-	582,702,600
未払金	5,094,766,880	863,834,980
未払収益分配金	55,248,392,908	-
未払受託者報酬	653,684,863	815,317,439
未払委託者報酬	1,230,704,506	1,512,055,964
未払利息	2,289,421	864,502
有価証券貸借取引受入金	425,742,401,489	596,896,613,090
その他未払費用	472,073,834	287,354,572
流動負債合計	490,391,919,111	600,958,743,147
負債合計		
	490,391,919,111	600,958,743,147
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,529,688,320,000	3,202,754,853,750
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△42,814,159,459	849,914,242,226
(分配準備積立金)	176,650,519	176,650,519
元本等合計	2,486,874,160,541	4,052,669,095,976
純資産合計		
	2,486,874,160,541	4,052,669,095,976
負債純資産合計		
	2,977,266,079,652	4,653,627,839,123

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 15 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	第 16 期中間計算期間 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 1 月 10 日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	26,192,821,020	30,443,019,767

受取利息	70,361,439	-
有価証券売買等損益	△249,427,516,647	753,463,518,838
派生商品取引等損益	△2,403,892,595	11,290,928,572
その他収益	512,704,000	2,465,407,207
営業収益合計	△225,055,522,783	797,662,874,384
営業費用		
支払利息	37,843,414	△133,165,812
受託者報酬	669,504,477	815,317,439
委託者報酬	1,284,222,309	1,512,055,964
その他費用	255,562,547	281,316,087
営業費用合計	2,247,132,747	2,475,523,678
営業利益又は営業損失(△)	△227,302,655,530	795,187,350,706
経常利益又は経常損失(△)	△227,302,655,530	795,187,350,706
中間純利益又は中間純損失(△)	△227,302,655,530	795,187,350,706
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(△)	598,683,593,514	△42,814,159,459
剰余金増加額又は欠損金減少額	132,812,372,269	124,499,671,459
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	132,812,372,269	124,499,671,459
剰余金減少額又は欠損金増加額	64,835,870,080	26,958,620,480
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	64,835,870,080	26,958,620,480
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	439,357,440,173	849,914,242,226

(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。 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	当ファンドの中間計算期間は、平成28年7月11日から平成29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15期 平成28年7月10日現在	第16期中間計算期間末 平成29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 2,023,750,656 口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 2,562,203,883 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 42,814,159,459 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 1,228.84 円 (100 口当たり純資産額) (122,884 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 1,581.71 円 (100 口当たり純資産額) (158,171 円)
4. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 396,831,625,160 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 564,169,217,360 円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 15 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	第 16 期中間計算期間 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 1 月 10 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 15 期 平成 28 年 7 月 10 日現在	第 16 期中間計算期間末 平成 29 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。 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。	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。 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 15 期 自 平成 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	第 16 期中間計算期間 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 1 月 10 日
期首元本額 2,068,490,575,000 円	期首元本額 2,529,688,320,000 円
期中追加設定元本額 1,033,445,000,000 円	期中追加設定元本額 891,143,625,000 円
期中一部交換元本額 572,247,255,000 円	期中一部交換元本額 218,077,091,250 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 15 期(平成 28 年 7 月 10 日現在)			第 16 期中間計算期間末(平成 29 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	25,500,609,940	—	23,553,950,000	△1,947,605,210	63,897,097,400	—	67,043,350,000	3,144,140,930
合計	25,500,609,940	—	23,553,950,000	△1,947,605,210	63,897,097,400	—	67,043,350,000	3,144,140,930

(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。