

平成30年7月期 中間決算短信 (平成29年7月9日 ~ 平成30年1月8日)

平成30年2月19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	投資証券		
管理会社	野村アセットマネジメント株式会社		
U R L	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30年3月29日		

ファンドの運用状況

1. 平成30年1月中間期の運用状況 (平成29年7月9日 ~ 平成30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30年1月中間期	5,696	(99.9)	8	(0.1)	5,705	(100)
平成29年7月期	5,461	(100.0)	2	(0.0)	5,464	(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()	設定口数()	解約口数()	当中間計算期間末 発行済口数 (+ -)
	千口	千口	千口	千口
平成30年1月中間期	171	0	20	151

(3)基準価額

	総資産 ()	負債 ()	純資産 ((-))	1口当り基準価額 ((/ 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30年1月中間期	5,730	25	5,705	37,686
平成29年7月期	5,486	22	5,464	31,885

2. 会計方針の変更

会計基準等の改正に伴う変更
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10期 (平成29年7月8日現在)	第11期中間計算期間末 (平成30年1月8日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,818,540	33,927,520
投資信託受益証券	4,433,720,780	4,494,321,093
親投資信託受益証券	1,028,274,919	1,202,599,354
流動資産合計	5,486,814,239	5,730,847,967
資産合計	5,486,814,239	5,730,847,967
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,343,939	1,495,382
未払委託者報酬	19,621,373	21,832,462
未払利息	68	138
その他未払費用	1,303,156	2,440,348
流動負債合計	22,268,536	25,768,330
負債合計	22,268,536	25,768,330
純資産の部		
元本等		
元本	11,904,059,330	10,514,899,330
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△6,439,513,627	△4,809,819,693
元本等合計	5,464,545,703	5,705,079,637
純資産合計	5,464,545,703	5,705,079,637
負債純資産合計	5,486,814,239	5,730,847,967

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	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	第11期中間計算期間 自平成29年7月9日 至平成30年1月8日
営業収益		
有価証券売買等損益	910,798,248	939,961,339
営業収益合計	910,798,248	939,961,339
営業費用		
支払利息	9,171	9,376
受託者報酬	1,373,137	1,495,382
委託者報酬	20,047,815	21,832,462
その他費用	1,353,506	1,390,185
営業費用合計	22,783,629	24,727,405
営業利益又は営業損失(△)	888,014,619	915,233,934
経常利益又は経常損失(△)	888,014,619	915,233,934

中間純利益又は中間純損失 (△)	888, 014, 619	915, 233, 934
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 (△)	△8, 558, 966, 142	△6, 439, 513, 627
剰余金増加額又は欠損金減少額	785, 280, 000	714, 460, 000
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	785, 280, 000	714, 460, 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 (△)	△6, 885, 671, 523	△4, 809, 819, 693

(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 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。 市場価格のない有価証券については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 29 年 7 月 9 日から平成 30 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 10 期 平成 29 年 7 月 8 日現在	第 11 期中間計算期間末 平成 30 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 171, 385 口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 151, 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 6, 439, 513, 627 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 4, 809, 819, 693 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 31, 885 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 37, 686 円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

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	第 11 期中間計算期間 自 平成 29 年 7 月 9 日 至 平成 30 年 1 月 8 日
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。	該当事項はありません。

(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 10 期 平成 29 年 7 月 8 日現在	第 11 期中間計算期間末 平成 30 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10期 自平成28年7月9日 至平成29年7月8日		第11期中間計算期間 自平成29年7月9日 至平成30年1月8日
期首元本額	13,293,219,330円	期首元本額	11,904,059,330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	1,389,160,000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。

(参考)

当ファンドは「上証50指数マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

上証50指数マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成30年1月8日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,715,537
社債券	1,197,924,000
流動資産合計	1,202,639,537
資産合計	1,202,639,537
負債の部	
流動負債	
未払利息	4
流動負債合計	4
負債合計	4
純資産の部	
元本等	
元本	942,549,851
剰余金	

期末剰余金又は期末欠損金(△)	260,089,682
元本等合計	1,202,639,533
純資産合計	1,202,639,533
負債純資産合計	1,202,639,537

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	社債券 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、価格情報会社の提供する価額等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った場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

平成30年1月8日現在	
1. 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	1.2759円
(10,000口当たり純資産額)	(12,759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

平成30年1月8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	
社債券	
(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。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成30年1月8日現在	
期首	平成29年7月9日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	944,324,474円
同期中における追加設定元本額	0円
同期中における一部解約元本額	1,774,623円
期末元本額	942,549,851円
期末元本額の内訳*	
上海株式指数・上証50連動型上場投資信託	942,549,851円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額