

2018年7月期（2017年7月9日～2018年7月8日）決算短信

2018年8月17日

上場取引所 東証

ファンド名	上海株式指数・上証50連動型上場投資信託		
コード番号	(1309)		
連動対象指標	上証50指数		
主要投資資産	投資信託証券		
売買単位	1口		
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	
代表者名	CEO兼執行役社長	渡邊 国夫	
問合せ先責任者	商品企画部長	増田 真一	TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 2018年9月27日
 分配金支払開始日 -

I ファンドの運用状況

1. 2018年7月期の運用状況（2017年7月9日～2018年7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	%
2018年7月期	4,464	(99.8)	6	(0.2)	4,471	(100)
2017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(①)	設定口数(②)	解約口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2018年7月期	171	0	20	151
2017年7月期	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/当計算期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
2018年7月期	4,494	23	4,471	29,535
2017年7月期	5,486	22	5,464	31,885

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
2018年7月期	0.00
2017年7月期	0.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有 無
 ② ①以外の変更 有 無

II 財務諸表等

上海株式指数・上証 50 連動型上場投資信託

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 10 期 (2017 年 7 月 8 日現在)	第 11 期 (2018 年 7 月 8 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,818,540	30,580,966
投資信託受益証券	4,433,720,780	4,464,274,203
親投資信託受益証券	1,028,274,919	9,999
流動資産合計	5,486,814,239	4,494,865,168
資産合計	5,486,814,239	4,494,865,168
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,343,939	1,433,322
未払委託者報酬	19,621,373	20,926,441
未払利息	68	186
その他未払費用	1,303,156	1,393,285
流動負債合計	22,268,536	23,753,234
負債合計	22,268,536	23,753,234
純資産の部		
元本等		
元本	11,904,059,330	10,514,899,330
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△6,439,513,627	△6,043,787,396
元本等合計	5,464,545,703	4,471,111,934
純資産合計	5,464,545,703	4,471,111,934
負債純資産合計	5,486,814,239	4,494,865,168

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 10 期 自 2016 年 7 月 9 日 至 2017 年 7 月 8 日	第 11 期 自 2017 年 7 月 9 日 至 2018 年 7 月 8 日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,379,167,860	△270,303,081
営業収益合計	1,379,167,860	△270,303,081
営業費用		
支払利息	13,709	17,429
受託者報酬	2,717,076	2,928,704
委託者報酬	39,669,188	42,758,903
その他費用	2,595,372	2,725,652
営業費用合計	44,995,345	48,430,688
営業利益又は営業損失 (△)	1,334,172,515	△318,733,769
経常利益又は経常損失 (△)	1,334,172,515	△318,733,769
当期純利益又は当期純損失 (△)	1,334,172,515	△318,733,769

一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期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
当期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	-	-
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△6,439,513,627	△6,043,787,396

(3)【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	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2017年7月9日から2018年7月8日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第10期 2017年7月8日現在	第11期 2018年7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. 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 6,043,787,396 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. 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 29,535 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自2016年7月9日 至2017年7月8日	第11期 自2017年7月9日 至2018年7月8日																																																															
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																															
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>△13,709 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>△1,389,257,667 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>△1,389,271,376 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>44,981,636 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>0 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>0 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>△1,434,253,012 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>171,385 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>0 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	△13,709 円	分配準備積立金	B	△1,389,257,667 円	配当等収益合計額	C=A+B	△1,389,271,376 円	経費	D	44,981,636 円	収益分配可能額	E=C-D	0 円	収益分配金	F	0 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	△1,434,253,012 円	口数	H	171,385 口	1口当たり分配金	I=F/H	0 円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>△17,429 円</td> </tr> <tr> <td>親ファンドの配当等収益額</td> <td>B</td> <td>△2,135 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>C</td> <td>△1,434,257,524 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>△1,434,277,088 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>48,413,259 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>F=D-E</td> <td>0 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>G</td> <td>0 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>△1,482,690,347 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>I</td> <td>151,385 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>J=G/I×1</td> <td>0 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	△17,429 円	親ファンドの配当等収益額	B	△2,135 円	分配準備積立金	C	△1,434,257,524 円	配当等収益合計額	D=A+B+C	△1,434,277,088 円	経費	E	48,413,259 円	収益分配可能額	F=D-E	0 円	収益分配金	G	0 円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	△1,482,690,347 円	口数	I	151,385 口	1口当たり分配金	J=G/I×1	0 円
項目																																																																
当期配当等収益額	A	△13,709 円																																																														
分配準備積立金	B	△1,389,257,667 円																																																														
配当等収益合計額	C=A+B	△1,389,271,376 円																																																														
経費	D	44,981,636 円																																																														
収益分配可能額	E=C-D	0 円																																																														
収益分配金	F	0 円																																																														
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	△1,434,253,012 円																																																														
口数	H	171,385 口																																																														
1口当たり分配金	I=F/H	0 円																																																														
項目																																																																
当期配当等収益額	A	△17,429 円																																																														
親ファンドの配当等収益額	B	△2,135 円																																																														
分配準備積立金	C	△1,434,257,524 円																																																														
配当等収益合計額	D=A+B+C	△1,434,277,088 円																																																														
経費	E	48,413,259 円																																																														
収益分配可能額	F=D-E	0 円																																																														
収益分配金	G	0 円																																																														
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	△1,482,690,347 円																																																														
口数	I	151,385 口																																																														
1口当たり分配金	J=G/I×1	0 円																																																														

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第 10 期 自 2016 年 7 月 9 日 至 2017 年 7 月 8 日	第 11 期 自 2017 年 7 月 9 日 至 2018 年 7 月 8 日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 10 期 2017 年 7 月 8 日現在	第 11 期 2018 年 7 月 8 日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第 10 期 自 2016 年 7 月 9 日 至 2017 年 7 月 8 日	第 11 期 自 2017 年 7 月 9 日 至 2018 年 7 月 8 日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

	第 10 期 自 2016 年 7 月 9 日 至 2017 年 7 月 8 日	第 11 期 自 2017 年 7 月 9 日 至 2018 年 7 月 8 日
期首元本額	13,293,219,330 円	11,904,059,330 円
期中追加設定元本額	0 円	0 円
期中一部解約元本額	1,389,160,000 円	1,389,160,000 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 10 期 自 2016 年 7 月 9 日 至 2017 年 7 月 8 日	第 11 期 自 2017 年 7 月 9 日 至 2018 年 7 月 8 日
	損益に含まれた評価差額 (円)	損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	1,071,254,731	△351,214,157
親投資信託受益証券	191,792,299	△1
合計	1,263,047,030	△351,214,158

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式(2018 年 7 月 8 日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2018 年 7 月 8 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	日本円	ニュー・ノムラ・チャイナ・インベストメント・ファンド-チャイナA シェアーズ・インデックス・ファンド	291,573	4,464,274,203	
	小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 99.8%	291,573	4,464,274,203 100.0%	
	合計			4,464,274,203	
親投資信託受益証券	日本円	野村マネーポートフォリオ マザー ファンド	9,938	9,999	
	小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 0.0%	9,938	9,999 0.0%	
	合計			9,999	
合計				4,464,284,202	

(注 1) 投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注 2) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第 2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。