

平成26年7月期（平成25年7月9日～平成26年7月8日）決算短信

平成26年8月19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 投信ディスプレイ部長 村山 治子 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成26年9月25日
 分配金支払開始日 -

I ファンドの運用状況

1. 平成26年7月期の運用状況（平成25年7月9日～平成26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	%
平成26年7月期	8,520	(99.5)	38	(0.5)	8,559	(100)
平成25年7月期	10,231	(99.8)	21	(0.2)	10,252	(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
平成26年7月期	537	0	80	457
平成25年7月期	734	0	196	537

(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
平成26年7月期	8,599	40	8,559	18,715
平成25年7月期	10,314	61	10,252	19,079

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成26年7月期	0.00
平成25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6期 (平成25年7月8日現在)	第7期 (平成26年7月8日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	82,898,353	78,948,852
投資信託受益証券	7,781,792,460	7,400,838,390
親投資信託受益証券	2,449,826,444	1,120,145,768
未収利息	176	143
流動資産合計	10,314,517,433	8,599,933,153
資産合計	10,314,517,433	8,599,933,153
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	3,628,102	2,423,552
未払委託者報酬	54,531,077	35,383,730
その他未払費用	3,604,364	2,381,042
流動負債合計	61,763,543	40,188,324
負債合計	61,763,543	40,188,324
純資産の部		
元本等		
元本	37,325,687,330	31,769,047,330
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△27,072,933,440	△23,209,302,501
元本等合計	10,252,753,890	8,559,744,829
純資産合計	10,252,753,890	8,559,744,829
負債純資産合計	10,314,517,433	8,599,933,153

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 6 期		第 7 期	
	自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日		自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日	
営業収益				
受取利息		180,254		34,229
有価証券売買等損益		1,619,246,974		△67,897,416
その他収益		7,926,491		-
営業収益合計		1,627,353,719		△67,863,187
営業費用				
受託者報酬		6,859,837		5,139,259
委託者報酬		112,702,272		75,033,007
その他費用		7,572,415		4,573,608
営業費用合計		127,134,524		84,745,874
営業利益又は営業損失 (△)		1,500,219,195		△152,609,061
経常利益又は経常損失 (△)		1,500,219,195		△152,609,061
当期純利益又は当期純損失 (△)		1,500,219,195		△152,609,061
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 (△)		△38,105,962,345		△27,072,933,440
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,532,809,710		4,016,240,000
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,630,500,000		4,016,240,000
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		902,309,710		-
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 (△)		△27,072,933,440		△23,209,302,501

(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 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 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	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成 25 年 7 月 9 日から平成 26 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 6 期 平成 25 年 7 月 8 日現在	第 7 期 平成 26 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 537,385 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 457,385 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 27,072,933,440 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 23,209,302,501 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 19,079 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 18,715 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 6 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日	第 7 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 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>8,106,745 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>△1,036,457,405 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>△1,028,350,660 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>127,134,524 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>△1,155,485,184 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>537,385 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	8,106,745 円	分配準備積立金	B	△1,036,457,405 円	配当等収益合計額	C=A+B	△1,028,350,660 円	経費	D	127,134,524 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	△1,155,485,184 円	口数	H	537,385 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>34,229 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>△1,155,475,521 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>△1,155,441,292 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>84,745,874 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>△1,240,187,166 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>457,385 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	34,229 円	分配準備積立金	B	△1,155,475,521 円	配当等収益合計額	C=A+B	△1,155,441,292 円	経費	D	84,745,874 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	△1,240,187,166 円	口数	H	457,385 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	8,106,745 円																																																											
分配準備積立金	B	△1,036,457,405 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	△1,028,350,660 円																																																											
経費	D	127,134,524 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	△1,155,485,184 円																																																											
口数	H	537,385 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	34,229 円																																																											
分配準備積立金	B	△1,155,475,521 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	△1,155,441,292 円																																																											
経費	D	84,745,874 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	△1,240,187,166 円																																																											
口数	H	457,385 口																																																											
1 口当たり分配金	I=F/H	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 6 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日	第 7 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日
1. 金融商品に対する取組方針 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。	1. 金融商品に対する取組方針 同左

<p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 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。 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。 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 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なっております。 ○市場リスクの管理 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なっております。 ○信用リスクの管理 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なっております。 ○流動性リスクの管理 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なっております。</p>	<p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>
--	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 6 期 平成 25 年 7 月 8 日現在	第 7 期 平成 26 年 7 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. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第 6 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日	第 7 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 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 6 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日	第 7 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日
期首元本額 51,008,566,040 円	期首元本額 37,325,687,330 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 13,682,878,710 円	期中一部解約元本額 5,556,640,000 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第6期 自平成24年7月9日 至平成25年7月8日	第7期 自平成25年7月9日 至平成26年7月8日
	損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	△1,279,501,845	59,966,280
親投資信託受益証券	△539,954,426	△114,017,797
合計	△1,819,456,271	△54,051,517

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(平成26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(平成26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・ファンドーチャイナA シェアーズ・インデックス・ファンド		7,400,838,390	
	小計	銘柄数:1 組入時価比率:86.5%		7,400,838,390 86.9%	
	合計			7,400,838,390	
親投資信託受益証券	日本円	上証50指数マザーファンド		1,120,145,768	
	小計	銘柄数:1 組入時価比率:13.1%		1,120,145,768 13.1%	
	合計			1,120,145,768	
合計				8,520,984,158	

(注1)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。