

平成26年7月期（平成25年7月16日～平成26年7月15日）決算短信

平成26年8月27日

上場取引所 東証

ファンド名 東証電気機器株価指数連動型上場投資信託  
 コード番号 ( 1613 )  
 連動対象指標 東証電気機器株価指数  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 10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 投信ディスクロージャー部長 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 平成26年8月22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16日～平成26年7月15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	1,864	(99.6)	7	(0.4)	1,871	(100)
平成25年7月期	1,572	(99.7)	4	(0.3)	1,576	(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	1,141	0	0	1,141
平成25年7月期	1,141	0	0	1,141

(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/当計算期間末発行済口数) × 100
	百万円	百万円	百万円	円
平成26年7月期	1,896	24	1,871	164,022
平成25年7月期	1,601	25	1,576	138,186

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成26年7月期	1,980.00
平成25年7月期	2,070.00

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

## 東証電気機器株価指数連動型上場投資信託

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (平成25年7月15日現在)	第12期 (平成26年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,980,601	28,673,689
株式	1,572,409,700	1,864,161,600
未収入金	2,096,004	-
未収配当金	3,504,500	3,337,200
未収利息	209	51
流動資産合計	1,601,991,014	1,896,172,540
資産合計	1,601,991,014	1,896,172,540
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	23,618,762	22,591,859
未払受託者報酬	525,575	658,096
未払委託者報酬	1,126,162	1,410,138
その他未払費用	14,953	18,736
流動負債合計	25,285,452	24,678,829
負債合計	25,285,452	24,678,829
純資産の部		
元本等		
元本	2,146,226,643	2,146,226,643
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△569,521,081	△274,732,932
(分配準備積立金)	99,104	8,021
元本等合計	1,576,705,562	1,871,493,711
純資産合計	1,576,705,562	1,871,493,711
負債純資産合計	1,601,991,014	1,896,172,540

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 自 平成24年7月16日 至 平成25年7月15日	第12期 自 平成25年7月16日 至 平成26年7月15日
営業収益		
受取配当金	23,322,848	26,472,696
受取利息	11,017	8,991
有価証券売買等損益	531,503,587	294,879,232
その他収益	913	549
営業収益合計	554,838,365	321,361,468
営業費用		
受託者報酬	916,212	1,255,500
委託者報酬	1,963,193	2,690,217
その他費用	26,063	35,743

営業費用合計	2,905,468	3,981,460
営業利益又は営業損失(△)	551,932,897	317,380,008
経常利益又は経常損失(△)	551,932,897	317,380,008
当期純利益又は当期純損失(△)	551,932,897	317,380,008
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換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(△)	△1,097,835,216	△569,521,081
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	23,618,762	22,591,859
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△569,521,081	△274,732,932

## (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	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。
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。
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 16 日から平成 26 年 7 月 15 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 11 期 平成 25 年 7 月 15 日現在	第 12 期 平成 26 年 7 月 15 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,141,003 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,141,003 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 569,521,081 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 274,732,932 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 1,381.86 円 (100 口当たり純資産額) (138,186 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 1,640.22 円 (100 口当たり純資産額) (164,022 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 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>23,334,778 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>3,288,556 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>26,623,334 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,905,468 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>23,717,866 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>23,618,762 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	23,334,778 円	分配準備積立金	B	3,288,556 円	配当等収益合計額	C=A+B	26,623,334 円	経費	D	2,905,468 円	収益分配可能額	E=C-D	23,717,866 円	収益分配金	F	23,618,762 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>26,482,236 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>99,104 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>26,581,340 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,981,460 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>22,599,880 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>22,591,859 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	26,482,236 円	分配準備積立金	B	99,104 円	配当等収益合計額	C=A+B	26,581,340 円	経費	D	3,981,460 円	収益分配可能額	E=C-D	22,599,880 円	収益分配金	F	22,591,859 円
項目																																											
当期配当等収益額	A	23,334,778 円																																									
分配準備積立金	B	3,288,556 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	26,623,334 円																																									
経費	D	2,905,468 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	23,717,866 円																																									
収益分配金	F	23,618,762 円																																									
項目																																											
当期配当等収益額	A	26,482,236 円																																									
分配準備積立金	B	99,104 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	26,581,340 円																																									
経費	D	3,981,460 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	22,599,880 円																																									
収益分配金	F	22,591,859 円																																									

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	99,104 円
口数	H	1,141,003 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	2,070 円

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,021 円
口数	H	1,141,003 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,980 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 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 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 11 期 平成 25 年 7 月 15 日現在	第 12 期 平成 26 年 7 月 15 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>株式</p> <p>(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</p> <p>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 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 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11期 自平成24年7月16日 至平成25年7月15日		第12期 自平成25年7月16日 至平成26年7月15日	
期首元本額	2,146,226,643円	期首元本額	2,146,226,643円
期中追加設定元本額	0円	期中追加設定元本額	0円
期中一部交換元本額	0円	期中一部交換元本額	0円

## 2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第11期 自平成24年7月16日 至平成25年7月15日	第12期 自平成25年7月16日 至平成26年7月15日
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	529,741,247	295,109,229
合計	529,741,247	295,109,229

## 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15日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	イビデン	4,900	2,054.00	10,064,600	
		コニカミノルタ	21,400	1,025.00	21,935,000	
		ブラザー工業	10,500	1,808.00	18,984,000	
		ミネベア	11,000	1,214.00	13,354,000	
		日立製作所	195,000	768.00	149,760,000	
		東芝	160,000	482.00	77,120,000	
		三菱電機	81,000	1,297.00	105,057,000	
		富士電機	23,000	510.00	11,730,000	
		東洋電機製造	2,000	422.00	844,000	
		安川電機	8,900	1,291.00	11,489,900	
		シンフォニアテクノロジー	5,000	167.00	835,000	
		明電舎	7,000	431.00	3,017,000	
		オリジン電気	1,000	345.00	345,000	
		山洋電気	2,000	770.00	1,540,000	
		デンヨー	800	1,602.00	1,281,600	
		東芝テック	5,000	723.00	3,615,000	

芝浦メカトロニクス	1,000	325.00	325,000
マブチモーター	1,100	8,350.00	9,185,000
日本電産	8,800	6,510.00	57,288,000
東光高岳	500	1,454.00	727,000
宮越ホールディングス	300	409.00	122,700
ダイヘン	5,000	454.00	2,270,000
ヤーマン	100	1,327.00	132,700
JVCケンウッド	5,600	226.00	1,265,600
第一精工	300	1,834.00	550,200
日新電機	2,000	645.00	1,290,000
大崎電気工業	1,000	578.00	578,000
オムロン	9,200	4,285.00	39,422,000
日東工業	1,200	2,173.00	2,607,600
I D E C	1,100	901.00	991,100
ジーエス・ユアサ コーポレーション	16,000	692.00	11,072,000
サクサホールディングス	2,000	170.00	340,000
メルコホールディングス	400	2,136.00	854,400
テクノメディカ	200	2,380.00	476,000
日本電気	112,000	374.00	41,888,000
富士通	78,000	770.00	60,060,000
沖電気工業	32,000	217.00	6,944,000
岩崎通信機	4,000	98.00	392,000
電気興業	2,000	672.00	1,344,000
サンケン電気	4,000	831.00	3,324,000
ナカヨ通信機	1,000	413.00	413,000
アイホン	500	2,008.00	1,004,000
ルネサスエレクトロニクス	4,200	766.00	3,217,200
セイコーエプソン	5,500	4,310.00	23,705,000
ワコム	6,400	566.00	3,622,400
アルバック	1,500	2,099.00	3,148,500
アクセル	400	1,464.00	585,600
ピクセラ	300	143.00	42,900
E I Z O	700	2,744.00	1,920,800
ジャパンディスプレイ	13,600	633.00	8,608,800
日本信号	2,200	972.00	2,138,400

京三製作所	2,000	368.00	736,000
能美防災	1,000	1,606.00	1,606,000
ホーチキ	1,000	915.00	915,000
エレコム	300	2,624.00	787,200
日本無線	2,000	455.00	910,000
パナソニック	92,700	1,225.00	113,557,500
シャープ	59,000	325.00	19,175,000
アンリツ	4,700	1,106.00	5,198,200
富士通ゼネラル	2,000	1,231.00	2,462,000
日立国際電気	2,000	1,551.00	3,102,000
ソニー	44,700	1,675.00	74,872,500
TDK	4,900	4,935.00	24,181,500
帝国通信工業	2,000	185.00	370,000
ミツミ電機	3,100	750.00	2,325,000
タムラ製作所	3,000	401.00	1,203,000
アルプス電気	5,900	1,424.00	8,401,600
池上通信機	3,000	129.00	387,000
パイオニア	11,300	265.00	2,994,500
日本電波工業	700	1,015.00	710,500
日本トリム	200	3,895.00	779,000
ローランド ディー. ジー.	400	3,930.00	1,572,000
フォスター電機	800	1,282.00	1,025,600
クラリオン	5,000	321.00	1,605,000
SMK	2,000	419.00	838,000
ヨコオ	700	539.00	377,300
東光	2,000	296.00	592,000
ティアック	4,000	66.00	264,000
ホシデン	2,400	637.00	1,528,800
ヒロセ電機	1,400	14,740.00	20,636,000
日本航空電子工業	2,000	2,417.00	4,834,000
TOA	900	1,282.00	1,153,800
日立マクセル	1,400	1,793.00	2,510,200
古野電気	1,000	729.00	729,000
ユニデン	3,000	259.00	777,000
アルパイン	1,800	1,570.00	2,826,000

スミダコーポレーション	700	707.00	494,900
アイコム	400	2,449.00	979,600
リオン	200	1,521.00	304,200
船井電機	800	1,093.00	874,400
横河電機	8,800	1,274.00	11,211,200
新電元工業	3,000	577.00	1,731,000
アズビル	2,500	2,546.00	6,365,000
東亜ディーケーケー	300	533.00	159,900
日本光電工業	1,700	5,210.00	8,857,000
チノー	1,000	310.00	310,000
共和電業	1,000	550.00	550,000
日本電子材料	300	495.00	148,500
堀場製作所	1,500	3,665.00	5,497,500
アドバンテスト	5,500	1,232.00	6,776,000
小野測器	500	1,021.00	510,500
エスペック	800	892.00	713,600
パナソニック デバイスSUNX	700	506.00	354,200
キーエンス	1,800	42,975.00	77,355,000
日置電機	400	1,727.00	690,800
シスメックス	6,800	3,750.00	25,500,000
メガチップス	700	1,485.00	1,039,500
OBARA GROUP	500	4,650.00	2,325,000
日本電産コパル電子	800	896.00	716,800
コーセル	1,200	1,319.00	1,582,800
新日本無線	1,000	434.00	434,000
オプテックス	500	2,266.00	1,133,000
千代田インテグレ	400	1,527.00	610,800
レーザーテック	800	982.00	785,600
スタンレー電気	5,800	2,644.00	15,335,200
岩崎電気	3,000	245.00	735,000
ウシオ電機	4,900	1,257.00	6,159,300
岡谷電機産業	400	380.00	152,000
ヘリオス テクノ ホールディング	700	322.00	225,400
日本セラミック	500	1,671.00	835,500
遠藤照明	400	1,457.00	582,800



日本デジタル研究所	600	1,813.00	1,087,800
古河電池	1,000	704.00	704,000
双信電機	400	381.00	152,400
山一電機	900	653.00	587,700
図研	500	1,030.00	515,000
日本電子	3,000	461.00	1,383,000
カンオ計算機	8,400	1,602.00	13,456,800
ファナック	9,100	17,370.00	158,067,000
日本シイエムケイ	1,900	279.00	530,100
エンプラス	300	7,930.00	2,379,000
大真空	1,000	387.00	387,000
ローム	4,300	5,800.00	24,940,000
浜松ホトニクス	3,400	4,930.00	16,762,000
三井ハイテック	1,100	725.00	797,500
新光電気工業	2,700	912.00	2,462,400
京セラ	14,300	4,917.00	70,313,100
太陽誘電	3,900	1,113.00	4,340,700
村田製作所	8,500	9,709.00	82,526,500
ユーシン	1,100	593.00	652,300
双葉電子工業	1,500	1,669.00	2,503,500
北陸電気工業	3,000	190.00	570,000
ニチコン	2,600	783.00	2,035,800
日本ケミコン	6,000	273.00	1,638,000
KOA	1,000	1,005.00	1,005,000
市光工業	2,000	170.00	340,000
小糸製作所	4,500	2,741.00	12,334,500
ミツバ	1,500	1,813.00	2,719,500
スター精密	1,500	1,450.00	2,175,000
大日本スクリーン製造	8,000	495.00	3,960,000
キヤノン電子	700	1,921.00	1,344,700
キヤノン	47,000	3,374.00	158,578,000
リコー	24,400	1,181.00	28,816,400
MUTOHホールディングス	1,000	519.00	519,000
東京エレクトロン	7,300	7,229.00	52,771,700
小計 銘柄数：155			1,864,161,600

	組入時価比率：99.6%			100.0%
合計				1,864,161,600

(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。

(2) 株式以外の有価証券(平成 26 年 7 月 15 日現在)

該当事項はありません。

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。