

平成28年7月期 中間決算短信（平成27年7月11日～平成28年1月10日）

平成28年2月22日

ファンド名	日経300株価指数連動型上場投資信託		上場取引所	東京・名古屋・
コード番号	(1319)			福岡・札幌
連動対象指標	日経300指数		売買単位	1000口
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	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28年3月30日			

I ファンドの運用状況

1. 平成28年1月中間期の運用状況（平成27年7月11日～平成28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28年1月中間期	9,920	(98.8)	120	(1.2)	10,040	(100)
平成27年7月期	14,766	(99.9)	17	(0.1)	14,783	(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28年1月中間期	46,534	0	11,902	34,632

(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28年1月中間期	10,068	27	10,040	28,992
平成27年7月期	15,018	234	14,783	31,769

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

日経 300 株価指数連動型上場投資信託

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 21 期 (平成 27 年 7 月 10 日現在)	第 22 期中間計算期間末 (平成 28 年 1 月 10 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	221,495,237	134,757,984
株式	14,766,206,740	9,920,071,150
未収入金	15,228,730	-
未収配当金	15,487,940	13,694,950
未収利息	350	678
流動資産合計	15,018,418,997	10,068,524,762
資産合計	15,018,418,997	10,068,524,762
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	203,357,936	-
未払受託者報酬	6,031,253	5,357,974
未払委託者報酬	25,331,008	22,503,331
その他未払費用	120,573	107,082
流動負債合計	234,840,770	27,968,387
負債合計	234,840,770	27,968,387
純資産の部		
元本等		
元本	11,261,469,274	8,380,987,318
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	3,522,108,953	1,659,569,057
(分配準備積立金)	37,653	37,653
元本等合計	14,783,578,227	10,040,556,375
純資産合計	14,783,578,227	10,040,556,375
負債純資産合計	15,018,418,997	10,068,524,762

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 21 期中間計算期間 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 1 月 10 日	第 22 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
営業収益		
受取配当金	116,794,361	130,722,872
受取利息	18,017	21,779
有価証券売買等損益	1,121,729,320	△1,215,147,821
その他収益	37,906	65,732
営業収益合計	1,238,579,604	△1,084,337,438
営業費用		
受託者報酬	6,131,214	5,357,974
委託者報酬	25,750,863	22,503,331

その他費用	122, 581	107, 097
営業費用合計	32, 004, 658	27, 968, 402
営業利益又は営業損失 (△)	1, 206, 574, 946	△1, 112, 305, 840
経常利益又は経常損失 (△)	1, 206, 574, 946	△1, 112, 305, 840
中間純利益又は中間純損失 (△)	1, 206, 574, 946	△1, 112, 305, 840
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 (△)	460, 917, 459	3, 522, 108, 953
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	-	750, 234, 056
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	750, 234, 056
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	1, 667, 492, 405	1, 659, 569, 057

(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。
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	当ファンドの中間計算期間は、平成 27 年 7 月 11 日から平成 28 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 21 期 平成 27 年 7 月 10 日現在	第 22 期中間計算期間末 平成 28 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 46, 534, 997 口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 34, 632, 179 口
2. 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 317.69 円 (100 口当たり純資産額) (31, 769 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 289.92 円 (100 口当たり純資産額) (28, 992 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

第 21 期 平成 27 年 7 月 10 日現在	第 22 期中間計算期間末 平成 28 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。	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。 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	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。 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。

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21期 自平成26年7月11日 至平成27年7月10日		第22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	
期首元本額	11,261,469,274円	期首元本額	11,261,469,274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	2,880,481,956円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。