

平成28年7月期 中間決算短信（平成27年7月9日～平成28年1月8日）

平成28年2月18日

ファンド名	日経225連動型上場投資信託		上場取引所	東証
コード番号	(1321)		売買単位	1口
連動対象指標	日経平均株価			
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9日～平成28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28年1月中間期	3,001,092	(98.3)	52,435	(1.7)	3,053,528	(100)
平成27年7月期	2,996,550	(98.8)	35,510	(1.2)	3,032,061	(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	150,930	40,818	23,526	168,222

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10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)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
平成28年1月中間期	3,356,075	302,547	3,053,528	181,517
平成27年7月期	3,175,011	142,950	3,032,061	200,891

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 225 連動型上場投資信託

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 14 期 (平成 27 年 7 月 8 日現在)	第 15 期中間計算期間末 (平成 28 年 1 月 8 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	173,368,705,935	342,630,534,396
株式	2,996,550,949,800	3,001,092,508,400
未収配当金	2,799,624,000	4,414,880,000
未収利息	139,762	413,727
その他未収収益	11,110,681	7,345,861
差入委託証拠金	2,281,060,000	7,930,210,000
流動資産合計	3,175,011,590,178	3,356,075,892,384
資産合計	3,175,011,590,178	3,356,075,892,384
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,404,259,454	5,856,962,242
未払金	1,002,945,580	88,845,580
未払収益分配金	34,713,986,250	-
未払受託者報酬	798,291,238	883,816,454
未払委託者報酬	2,487,714,614	2,857,337,919
未払利息	2,853,334	1,966,139
有価証券貸借取引受入金	102,510,402,277	292,824,814,778
その他未払費用	29,872,718	34,010,433
流動負債合計	142,950,325,465	302,547,753,545
負債合計	142,950,325,465	302,547,753,545
純資産の部		
元本等		
元本	1,857,500,125,125	2,070,311,366,127
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	1,174,561,139,588	983,216,772,712
(分配準備積立金)	102,780,340	102,780,340
元本等合計	3,032,061,264,713	3,053,528,138,839
純資産合計	3,032,061,264,713	3,053,528,138,839
負債純資産合計	3,175,011,590,178	3,356,075,892,384

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 14 期中間計算期間 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 1 月 8 日	第 15 期中間計算期間 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 1 月 8 日
営業収益		
受取配当金	16,659,609,960	26,014,612,160

受取利息	27,327,453	57,204,879
有価証券売買等損益	241,339,272,580	△324,607,759,875
派生商品取引等損益	3,887,919,242	△3,525,511,130
その他収益	47,463,045	113,245,794
営業収益合計	261,961,592,280	△301,948,208,172
営業費用		
支払利息	13,095,531	28,235,954
受託者報酬	657,338,745	883,816,454
委託者報酬	1,841,671,692	2,857,337,919
その他費用	26,664,239	37,235,737
営業費用合計	2,538,770,207	3,806,626,064
営業利益又は営業損失(△)	259,422,822,073	△305,754,834,236
経常利益又は経常損失(△)	259,422,822,073	△305,754,834,236
中間純利益又は中間純損失(△)	259,422,822,073	△305,754,834,236
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(△)	399,439,453,090	1,174,561,139,588
剰余金増加額又は欠損金減少額	154,935,924,509	279,279,869,792
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	154,935,924,509	279,279,869,792
剰余金減少額又は欠損金増加額	111,189,765,963	164,869,402,432
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	111,189,765,963	164,869,402,432
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	702,608,433,709	983,216,772,712

(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。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
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。 派生商品取引等損益 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。 また、デリバティブ取引に関する契約等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの中間計算期間は、平成 27 年 7 月 9 日から平成 28 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 14 期 平成 27 年 7 月 8 日現在	第 15 期中間計算期間末 平成 28 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	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数

150,930,375 円	168,222,261 円
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	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 20,089.1 円 (10 口当たり純資産額) (200,891 円)	1 口当たり純資産額 18,151.7 円 (10 口当たり純資産額) (181,517 円)
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 95,367,448,310 円	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 270,185,234,470 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 14 期 平成 27 年 7 月 8 日現在	第 15 期中間計算期間末 平成 28 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。	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。	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。
派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の 2 デリバティブ取引関係に記載しております。	派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の 2 デリバティブ取引関係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。	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)

1 元本の移動

第 14 期 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 7 月 8 日	第 15 期中間計算期間 自 平成 27 年 7 月 9 日 至 平成 28 年 1 月 8 日
期首元本額 1,517,136,243,978 円	期首元本額 1,857,500,125,125 円
期中追加設定元本額 795,701,454,660 円	期中追加設定元本額 502,352,171,870 円
期中一部交換元本額 455,337,573,513 円	期中一部交換元本額 289,540,930,868 円

2 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第 14 期(平成 27 年 7 月 8 日現在)				第 15 期中間計算期間末(平成 28 年 1 月 8 日現在)			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1 年 超				うち 1 年 超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	36,575,130,000	—	35,171,740,000	△1,404,259,454	57,987,960,000	—	52,132,430,000	△5,856,962,242
合計	36,575,130,000	—	35,171,740,000	△1,404,259,454	57,987,960,000	—	52,132,430,000	△5,856,962,242

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。