平成26年7月期　中間決算短信（平成25年7月11日～平成26年1月10日）

平成26年2月20日

ファンド名	TOPIX連動型上場投資信託		
コード番号	(1306)	上場取引所	東証
連動対象指標	東証株価指数(TOPIX)	売買単位	10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兼執行役会長兼社長	岩崎　俊博	
問合せ先責任者	投信ﾃﾞｨｽｸﾛｰｼﾞｬｰ部長	森保 一美	TEL (03)-3241-9511
半期報告書提出予定日	平成26年3月27日		

Ⅰ ファンドの運用状況

1. 平成26年1月中間期の運用状況（平成25年7月11日～平成26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26年1月中間期	1,530,248	(98.3)	26,598	(1.7)	1,556,846	(100)
平成25年7月期	1,300,895	(98.3)	21,969	(1.7)	1,322,864	(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26年1月中間期	1,093,356	120,971	38,921	1,175,406

(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26年1月中間期	1,667,769	110,923	1,556,846	132,452
平成25年7月期	1,459,570	136,705	1,322,864	120,991

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　中間財務諸表等
TOPIX 連動型上場投資信託

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第 12 期 （平成 25 年 7 月 10 日現在）	第 13 期中間計算期間末 （平成 26 年 1 月 10 日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	153,910,399,815	127,409,651,519
株式	1,300,895,613,590	1,530,248,234,750
派生商品評価勘定	2,031,099,420	919,946,536
未収入金	1,685,460,858	134,585,800
未収配当金	1,032,707,810	1,258,745,486
未収利息	91,823	55,532
その他未収収益	15,178,365	15,976,461
預有価証券	－	7,782,483,760
流動資産合計	1,459,570,551,681	1,667,769,679,844
資産合計	1,459,570,551,681	1,667,769,679,844
負債の部		
流動負債		
前受金	1,921,440,000	89,659,000
未払金	－	134,524,511
未払収益分配金	21,211,111,696	－
未払解約金	－	7,782,483,760
未払受託者報酬	286,560,829	330,231,266
未払委託者報酬	532,132,030	626,538,334
未払利息	1,295,707	1,096,583
有価証券貸借取引受入金	112,498,894,805	101,797,318,579
その他未払費用	254,268,476	161,452,017
流動負債合計	136,705,703,543	110,923,304,050
負債合計	136,705,703,543	110,923,304,050
純資産の部		
元本等		
元本	1,366,695,341,250	1,469,257,928,750
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△43,830,493,112	87,588,447,044
（分配準備積立金）	95,117,363	95,117,363
元本等合計	1,322,864,848,138	1,556,846,375,794
純資産合計	1,322,864,848,138	1,556,846,375,794
負債純資産合計	1,459,570,551,681	1,667,769,679,844

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 12 期中間計算期間 自　平成 24 年 7 月 11 日 至　平成 25 年 1 月 10 日	第 13 期中間計算期間 自　平成 25 年 7 月 11 日 至　平成 26 年 1 月 10 日
営業収益		
受取配当金	9,444,648,759	11,504,289,126

受取利息	46,740,113	45,706,777
有価証券売買等損益	145,971,234,582	123,945,773,696
派生商品取引等損益	3,625,259,272	2,081,455,504
その他収益	211,556,533	286,591,052
営業収益合計	159,299,439,259	137,863,816,155
営業費用		
支払利息	20,644,538	21,348,468
受託者報酬	208,894,003	330,231,266
委託者報酬	386,769,431	626,538,334
その他費用	116,122,151	159,045,988
営業費用合計	732,430,123	1,137,164,056
営業利益又は営業損失（△）	158,567,009,136	136,726,652,099
経常利益又は経常損失（△）	158,567,009,136	136,726,652,099
中間純利益又は中間純損失（△）	158,567,009,136	136,726,652,099
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（△）	△500,424,639,684	△43,830,493,112
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,915,575,159	561,359,270
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,915,575,159	561,359,270
剰余金減少額又は欠損金増加額	46,147,909,397	5,869,071,213
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	46,147,909,397	5,869,071,213
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△375,089,964,786	87,588,447,044

（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った場合、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額等は、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25年７月11日から平成26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12期 平成25年７月10日現在	第13期中間計算期間末 平成26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	１．中間計算期間の末日における受益権の総数

1,093,356,273口	1,175,406,343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　43,830,493,112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	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　1,209.91円	1口当たり純資産額　1,324.52円
(100口当たり純資産額)　(120,991円)	(100口当たり純資産額)　(132,452円)
4．有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	3．有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券
109,016,877,590円	96,840,572,210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12期 平成25年7月10日現在	第13期中間計算期間末 平成26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。 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。	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。 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12期 自 平成24年7月11日 至 平成25年7月10日		第13期中間計算期間 自 平成25年7月11日 至 平成26年1月10日	
期首元本額	1,287,327,436,250円	期首元本額	1,366,695,341,250円
期中追加設定元本額	311,206,500,000円	期中追加設定元本額	151,214,875,000円
期中一部交換元本額	231,838,595,000円	期中一部交換元本額	48,652,287,500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12期(平成25年7月10日現在)				第13期中間計算期間末(平成26年1月10日現在)			
	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引								
株価指数先物取引								
買建	19,334,301,000	－	21,366,450,000	2,031,099,420	25,432,721,000	－	26,353,860,000	919,946,536
合計	19,334,301,000	－	21,366,450,000	2,031,099,420	25,432,721,000	－	26,353,860,000	919,946,536

(注)時価の算定方法

1先物取引

国内先物取引について

先物取引の評価においては、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。