



2020年7月期 中間決算短信 (2019年7月16日～2020年1月15日)
 Semi-annual Earnings Report for Fiscal Year ending July 2020 (July 16, 2019 - January 15, 2020)

2020年2月26日
 February 26, 2020

ファンド名 TOPIX Core 30連動型上場投資信託
 コード番号 (1311) 上場取引所 東証
 連動対象指標 TOPIX Core 30 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 兼代表取締役社長 中川 順子
 問合せ先責任者 商品企画部長 増田 真一 TEL(03)-3241-9511
 半期報告書提出予定日 2020年3月25日

Fund name: TOPIX Core 30 Exchange Traded Fund
 Code: 1311 Listed Exchange:TSE
 Underlying index: TOPIX Core30 Trading unit: 10 units
 Primary invested assets: Stocks
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd.
 URL: http://www.nomura-am.co.jp
 Representative: Junko Nakagawa, President & CEO
 Contact person: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.
 Scheduled date of submission of semi-annual securities report: March 25, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年1月中間期の運用状況 (2019年7月16日～2020年1月15日)

Management Status for Half-Year ended January 2020 (July 16, 2019 - January 15, 2020)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

Assets (fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

	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)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	% %	百万円 JPY mil.	% %	百万円 JPY mil.	% %
2020年1月中間期 HY ended Jan. 2020	1,903	(97.3)	52	(2.7)	1,955	(100.0)
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	1,868	(98.6)	27	(1.4)	1,895	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当中間計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Semi-annual Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2020年1月中間期 HY ended Jan. 2020	2,638	0	196	2,441

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (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) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Semi-annual Period(Previous Fiscal Period))×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2020年1月中間期 HY ended Jan. 2020	1,958	2	1,955	80,106
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	1,968	73	1,895	71,851

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無
 Changes other than those in ① No

II 中間財務諸表等 Semi-annual Financial Statements

(1) 【中間貸借対照表】 Semi-annual Balance Sheet

(単位：円) (Unit：JPY)

	第17期 (2019年7月15日現在) 17th Fiscal Year As of July 15, 2019	第18期中間計算期間末 (2020年1月15日現在) 18th Semi-annual Period As of January 15, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
コール・ローン Call loans	94,865,512	50,271,635
株式 Stocks	1,868,111,920	1,903,767,210
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	693,712	773,760
未収入金 Accounts receivable - other	1,682,072	-
未収配当金 Accrued dividends receivable	3,261,900	2,999,200
差入委託証拠金 Customers' margin	197,200	275,200
流動資産合計 Total current assets	1,968,812,316	1,958,087,005
資産合計 Total assets	1,968,812,316	1,958,087,005
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	70,699,713	-
未払受託者報酬 Trustee fee payable	836,271	712,160
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	1,791,961	1,525,994
未払利息 Accrued interest expenses	810	30
その他未払費用 Other accrued expenses	23,840	20,290
流動負債合計 Total current liabilities	73,352,595	2,258,474
負債合計 Total liabilities	73,352,595	2,258,474
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		

元本 Principal	2,099,887,004	1,943,475,392
剰余金 Surplus		
中間剰余金又は中間欠損金 (△) Balance at end of period	△204,427,283	12,353,139
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	71,599	71,599
元本等合計 Total principal and other	1,895,459,721	1,955,828,531
純資産合計 Total net assets	1,895,459,721	1,955,828,531
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	1,968,812,316	1,958,087,005

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】 Semi-annual Statement of Income and Retained Earnings

(単位：円) (Unit：JPY)

	第17期中間計算期間 自 2018年7月16日 至 2019年1月15日 17th Semi-annual Period From July 16, 2018 to January 15, 2019	第18期中間計算期間 自 2019年7月16日 至 2020年1月15日 18th Semi-annual Period From July 16, 2019 to January 15, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	47,773,036	24,396,055
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△292,957,375	170,768,380
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△9,893,566	4,965,760
その他収益 Other revenue	5	2
営業収益合計 Total operating revenue	△255,077,900	200,130,197
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	27,494	10,167
受託者報酬 Trustee fee	1,292,625	712,160
委託者報酬 Investment trust management fee	2,769,847	1,525,994
その他費用 Other expenses	36,894	20,306
営業費用合計 Total operating expenses	4,126,860	2,268,627
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△259,204,760	197,861,570
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△259,204,760	197,861,570
中間純利益又は中間純損失 (△)	△259,204,760	197,861,570

Profit (loss)		
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 (△) Distribution of profit loss from partial exchange		
期首剰余金又は期首欠損金 (△) Surplus (deficit) at beginning of period	△160,369,564	△204,427,283
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	35,916,790	18,918,852
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from partial exchange	35,916,790	18,918,852
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit		
分配金 Dividends		
中間剰余金又は中間欠損金 (△) Balance at end of period	△383,657,534	12,353,139

(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 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。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配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、2019年7月16日から2020年1月15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17期 2019年7月15日現在	第18期中間計算期間末 2020年1月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,638,049 口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 2,441,552 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 204,427,283 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
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	

	額	
1口当たり純資産額	718.51円	1口当たり純資産額
(100口当たり純資産額)	(71,851円)	(100口当たり純資産額)
		801.06円 (80,106円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(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17期 2019年7月15日現在	第18期中間計算期間末 2020年1月15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</p> <p>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。</p>	<p>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</p> <p>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。</p>

(その他の注記)

1 元本の移動

第17期 自2018年7月16日 至2019年7月15日	第18期中間計算期間 自2019年7月16日 至2020年1月15日
期首元本額	5,203,175,788円
期中追加設定元本額	0円
期中一部交換元本額	3,103,288,784円
期首元本額	2,099,887,004円
期中追加設定元本額	0円
期中一部交換元本額	156,411,612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17期(2019年7月15日現在)				第18期中間計算期間末(2020年1月15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	25,528,400	-	26,226,000	693,712	50,547,200	-	51,328,000	773,760
合計	25,528,400	-	26,226,000	693,712	50,547,200	-	51,328,000	773,760

(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。