

2018年7月期（2017年7月16日～2018年7月15日）決算短信

2018年8月24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	商品企画部長	増田 真一	TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日	2018年9月27日
分配金支払開始日	2018年8月23日

ファンドの運用状況

1. 2018年7月期の運用状況（2017年7月16日～2018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	%
2018年7月期	2,777	(99.6)	11	(0.4)	2,788	(100)
2017年7月期	2,531	(99.7)	6	(0.3)	2,538	(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()	設定口数()	交換口数()	当計算期間末 発行済口数 (+ -)
	千口	千口	千口	千口
2018年7月期	1,141	0	0	1,141
2017年7月期	1,141	0	0	1,141

(3)基準価額

	総資産 ()	負債 ()	純資産 ((-))	100口当り基準価額 ((/ 当計算期間末発行済口数) × 100)
	百万円	百万円	百万円	円
2018年7月期	2,830	42	2,788	244,373
2017年7月期	2,572	34	2,538	222,459

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
2018年7月期	3,430.00
2017年7月期	2,790.00

2. 会計方針の変更

会計基準等の改正に伴う変更
以外の変更

有 無
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15期 (2017年7月15日現在)	第16期 (2018年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	37,786,999	49,635,744
株式	2,531,492,900	2,777,161,900
未収配当金	3,630,000	4,079,260
流動資産合計	2,572,909,899	2,830,876,904
資産合計	2,572,909,899	2,830,876,904
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	31,833,983	39,136,402
未払受託者報酬	888,306	1,083,044
未払委託者報酬	1,903,472	2,320,721
未払利息	92	280
その他未払費用	25,321	30,884
流動負債合計	34,651,174	42,571,331
負債合計	34,651,174	42,571,331
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(△)	392,032,082	642,078,930
(分配準備積立金)	48,298	85,344
元本等合計	2,538,258,725	2,788,305,573
純資産合計	2,538,258,725	2,788,305,573
負債純資産合計	2,572,909,899	2,830,876,904

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期 自 2016年7月16日 至 2017年7月15日	第16期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日
営業収益		
受取配当金	37,168,618	45,990,245
有価証券売買等損益	701,038,662	250,009,802
その他収益	1,008	1,050
営業収益合計	738,208,288	296,001,097
営業費用		
支払利息	9,464	13,453
受託者報酬	1,660,069	2,145,611
委託者報酬	3,557,197	4,597,598

その他費用	82,988	61,185
営業費用合計	5,309,718	6,817,847
営業利益又は営業損失(△)	732,898,570	289,183,250
経常利益又は経常損失(△)	732,898,570	289,183,250
当期純利益又は当期純損失(△)	732,898,570	289,183,250
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(△)	△309,032,505	392,032,082
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	31,833,983	39,136,402
期末剰余金又は期末欠損金(△)	392,032,082	642,078,930

(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 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。
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、2017年7月16日から2018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15期 2017年7月15日現在	第16期 2018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. 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 2,224.59円 (100口当たり純資産額) (222,459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 1口当たり純資産額 2,443.73円 (100口当たり純資産額) (244,373円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自2016年7月16日 至2017年7月15日	第16期 自2017年7月16日 至2018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>37,160,162円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>22,373円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>37,182,535円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>5,300,254円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>31,882,281円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>31,833,983円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>48,298円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,141,003口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	37,160,162円	分配準備積立金	B	22,373円	配当等収益合計額	C=A+B	37,182,535円	経費	D	5,300,254円	収益分配可能額	E=C-D	31,882,281円	収益分配金	F	31,833,983円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	48,298円	口数	H	1,141,003口	<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>45,977,842円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>48,298円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>46,026,140円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>6,804,394円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>39,221,746円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>39,136,402円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>85,344円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,141,003口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	45,977,842円	分配準備積立金	B	48,298円	配当等収益合計額	C=A+B	46,026,140円	経費	D	6,804,394円	収益分配可能額	E=C-D	39,221,746円	収益分配金	F	39,136,402円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	85,344円	口数	H	1,141,003口
項目																																																							
当期配当等収益額	A	37,160,162円																																																					
分配準備積立金	B	22,373円																																																					
配当等収益合計額	C=A+B	37,182,535円																																																					
経費	D	5,300,254円																																																					
収益分配可能額	E=C-D	31,882,281円																																																					
収益分配金	F	31,833,983円																																																					
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	48,298円																																																					
口数	H	1,141,003口																																																					
項目																																																							
当期配当等収益額	A	45,977,842円																																																					
分配準備積立金	B	48,298円																																																					
配当等収益合計額	C=A+B	46,026,140円																																																					
経費	D	6,804,394円																																																					
収益分配可能額	E=C-D	39,221,746円																																																					
収益分配金	F	39,136,402円																																																					
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	85,344円																																																					
口数	H	1,141,003口																																																					

100口当たり分配金	I=F/H×100	2,790円	100口当たり分配金	I=F/H×100	3,430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15期 自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日	第16期 自 2017年 7月 16日 至 2018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15期 2017年 7月 15日現在	第16期 2018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15期 自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日	第16期 自 2017年 7月 16日 至 2018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15期	第16期

自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日		自 2017年 7月 16日 至 2018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15期 自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日	第16期 自 2017年 7月 16日 至 2018年 7月 15日
	損益に含まれた評価差額 (円)	損益に含まれた評価差額 (円)
株式	697,162,102	236,741,552
合計	697,162,102	236,741,552

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(2018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	日清紡ホールディングス	5,000	1,178.00	5,890,000	
		イビデン	5,000	1,761.00	8,805,000	
		コニカミノルタ	19,100	980.00	18,718,000	
		ブラザー工業	10,000	2,158.00	21,580,000	
		ミネベアミツミ	15,200	1,909.00	29,016,800	
		日立製作所	196,000	787.70	154,389,200	
		三菱電機	81,800	1,454.00	118,937,200	
		富士電機	25,000	822.00	20,550,000	
		東洋電機製造	300	1,626.00	487,800	
		安川電機	9,500	3,890.00	36,955,000	
		シンフォニアテクノロジー	5,000	388.00	1,940,000	
		明電舎	7,000	393.00	2,751,000	
		オリジン電気	200	2,141.00	428,200	
		山洋電気	400	7,390.00	2,956,000	
		デンヨー	800	1,651.00	1,320,800	
		東芝テック	6,000	650.00	3,900,000	
		芝浦メカトロニクス	1,000	367.00	367,000	
マブチモーター	2,300	5,220.00	12,006,000			

日本電産	9,800	17,035.00	166,943,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	300	2,496.00	748,800
トレックス・セミコンダクター	200	1,443.00	288,600
東光高岳	400	1,892.00	756,800
ダブル・スコープ	1,200	1,424.00	1,708,800
宮越ホールディングス	300	1,249.00	374,700
ダイヘン	4,000	667.00	2,668,000
田淵電機	1,100	145.00	159,500
ヤーマン	1,200	1,819.00	2,182,800
JVCケンウッド	6,000	302.00	1,812,000
ミマキエンジニアリング	700	856.00	599,200
第一精工	400	1,726.00	690,400
日新電機	1,900	970.00	1,843,000
大崎電気工業	1,800	838.00	1,508,400
オムロン	8,700	5,090.00	44,283,000
日東工業	1,300	2,055.00	2,671,500
I D E C	1,000	2,444.00	2,444,000
不二電機工業	100	1,413.00	141,300
ジーエス・ユアサコーポレーション	15,000	498.00	7,470,000
サクサホールディングス	200	2,254.00	450,800
メルコホールディングス	400	4,130.00	1,652,000
テクノメディカ	200	1,980.00	396,000
日本電気	10,600	2,939.00	31,153,400
富士通	84,000	725.70	60,958,800
沖電気工業	3,300	1,241.00	4,095,300
岩崎通信機	400	813.00	325,200
電気興業	500	3,175.00	1,587,500
サンケン電気	5,000	625.00	3,125,000
ナカヨ	200	1,700.00	340,000
アイホン	500	1,698.00	849,000
ルネサスエレクトロニクス	4,200	1,022.00	4,292,400
セイコーエプソン	12,200	1,945.00	23,729,000
ワコム	6,300	580.00	3,654,000
アルバック	1,900	4,280.00	8,132,000
アクセル	300	818.00	245,400

E I Z O	800	5,050.00	4,040,000
ジャパンディスプレイ	16,800	133.00	2,234,400
日本信号	2,300	1,048.00	2,410,400
京三製作所	1,900	711.00	1,350,900
能美防災	1,100	2,230.00	2,453,000
ホーチキ	600	2,089.00	1,253,400
星和電機	300	518.00	155,400
エレコム	700	2,614.00	1,829,800
パナソニック	93,400	1,427.50	133,328,500
シャープ	7,600	2,695.00	20,482,000
アンリツ	6,000	1,504.00	9,024,000
富士通ゼネラル	2,500	1,730.00	4,325,000
ソニー	54,700	5,978.00	326,996,600
TDK	4,300	11,760.00	50,568,000
帝国通信工業	400	1,244.00	497,600
タムラ製作所	3,200	728.00	2,329,600
アルプス電気	7,000	3,090.00	21,630,000
池上通信機	3,000	147.00	441,000
パイオニア	13,600	146.00	1,985,600
日本電波工業	700	515.00	360,500
鈴木	400	884.00	353,600
日本トリム	200	4,820.00	964,000
ローランド ディー. ジー.	400	2,362.00	944,800
フォスター電機	1,000	1,556.00	1,556,000
クラリオン	4,000	301.00	1,204,000
SMK	2,000	364.00	728,000
ヨコオ	500	1,875.00	937,500
ティアック	6,000	41.00	246,000
ホシデン	2,100	898.00	1,885,800
ヒロセ電機	1,400	13,610.00	19,054,000
日本航空電子工業	2,000	1,778.00	3,556,000
TOA	900	1,184.00	1,065,600
マクセルホールディングス	1,600	1,801.00	2,881,600
古野電気	1,000	964.00	964,000
ユニデンホールディングス	2,000	319.00	638,000
アルパイン	1,900	2,458.00	4,670,200

スミダコーポレーション	800	1,291.00	1,032,800
アイコム	500	2,688.00	1,344,000
リオン	300	2,528.00	758,400
本多通信工業	600	911.00	546,600
船井電機	800	646.00	516,800
横河電機	8,200	1,977.00	16,211,400
新電元工業	300	5,320.00	1,596,000
アズビル	2,500	4,860.00	12,150,000
東亜ディーケーケー	400	1,037.00	414,800
日本光電工業	3,400	3,190.00	10,846,000
チノー	300	1,562.00	468,600
共和電業	900	405.00	364,500
日本電子材料	300	726.00	217,800
堀場製作所	1,600	7,320.00	11,712,000
アドバンテスト	4,600	2,420.00	11,132,000
小野測器	300	773.00	231,900
エスペック	700	2,207.00	1,544,900
キーエンス	4,000	61,040.00	244,160,000
日置電機	400	4,735.00	1,894,000
シスメックス	6,400	10,810.00	69,184,000
日本マイクロニクス	1,300	971.00	1,262,300
メガチップス	600	2,757.00	1,654,200
OBARA GROUP	500	5,940.00	2,970,000
澤藤電機	100	2,092.00	209,200
コーセル	1,100	1,348.00	1,482,800
イリソ電子工業	700	6,570.00	4,599,000
新日本無線	500	762.00	381,000
オプテックスグループ	1,400	3,230.00	4,522,000
千代田インテグレ	400	2,399.00	959,600
アイ・オー・データ機器	300	1,193.00	357,900
レーザーテック	1,700	3,110.00	5,287,000
スタンレー電気	6,200	3,665.00	22,723,000
岩崎電気	300	1,547.00	464,100
ウシオ電機	5,000	1,419.00	7,095,000
岡谷電機産業	600	490.00	294,000
ヘリオス テクノ ホールディング	700	705.00	493,500

日本セラミック	800	2,887.00	2,309,600
遠藤照明	400	817.00	326,800
古河電池	600	849.00	509,400
双信電機	400	496.00	198,400
山一電機	600	1,426.00	855,600
図研	500	1,642.00	821,000
日本電子	3,000	1,108.00	3,324,000
カシオ計算機	6,600	1,817.00	11,992,200
ファナック	7,800	22,065.00	172,107,000
日本シイエムケイ	1,400	699.00	978,600
エンプラス	400	3,155.00	1,262,000
大真空	300	1,207.00	362,100
ローム	3,700	9,640.00	35,668,000
浜松ホトニクス	5,900	4,920.00	29,028,000
三井ハイテック	1,100	1,428.00	1,570,800
新光電気工業	3,100	1,040.00	3,224,000
京セラ	13,400	6,268.00	83,991,200
太陽誘電	3,700	3,465.00	12,820,500
村田製作所	8,600	19,665.00	169,119,000
ユーシン	1,200	716.00	859,200
双葉電子工業	1,300	1,983.00	2,577,900
北陸電気工業	300	1,202.00	360,600
ニチコン	2,600	1,370.00	3,562,000
日本ケミコン	700	4,380.00	3,066,000
KOA	1,100	2,836.00	3,119,600
市光工業	1,200	1,380.00	1,656,000
小糸製作所	4,900	7,220.00	35,378,000
ミツバ	1,500	869.00	1,303,500
SCREENホールディングス	1,500	7,790.00	11,685,000
キャノン電子	700	2,227.00	1,558,900
キャノン	44,000	3,542.00	155,848,000
リコー	24,600	1,010.00	24,846,000
象印マホービン	1,500	1,374.00	2,061,000
MUTOHホールディングス	100	2,310.00	231,000
東京エレクトロン	5,500	18,705.00	102,877,500
小計	銘柄数：160		2,777,161,900

	組入時価比率：99.6%		100.0%
合計			2,777,161,900

(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(2018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。