



2019年7月期 中間決算短信 (2018年7月9日～2019年1月8日)
Semi-annual Earnings Report for Fiscal Year ending July 2019 (July 9, 2018 - January 8, 2019)

2019年2月19日
February 19, 2019

ファンド名 上海株式指数・上証50連動型上場投資信託
コード番号 (1309) 上場取引所 東証
連動対象指標 上証50指数 売買単位 1口
主要投資資産 投資信託証券
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 増田 真一 TEL(03)-3241-9511
半期報告書提出予定日 2019年3月27日

Fund name: SSE50 Index Linked Exchange Traded Fund
Code: 1309 Listed Exchange:TSE
Underlying index: SSE50 Index Trading unit: 1 unit
Primary invested assets: Funds
Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd.
URL: http://www.nomura-am.co.jp
Representative: Kunio Watanabe, President & CEO
Contact person: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.
Scheduled date of submission of semi-annual securities report: March 27, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年1月中間期の運用状況 (2018年7月9日～2019年1月8日)

Management Status for Half-Year ended January 2019 (July 9, 2018 - January 8, 2019)

(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.	%
2019年1月中間期 HY ended Jan. 2019	4,124	(99.8)	6	(0.2)	4,131	(100.0)
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	4,464	(99.8)	6	(0.2)	4,471	(100.0)

(2) 設定・解約実績

(千口未満切捨て)

Creation and Redemption

(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)	解約口数 No. of Units Redeemed (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
2019年1月中間期 HY ended Jan. 2019	151	0	0	151

(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))	1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)×1) Net Asset Value per 1 unit ((③/No. of Issued Units at End of Semi-annual Period(Previous Fiscal Period))×1)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2019年1月中間期 HY ended Jan. 2019	4,152	21	4,131	27,289
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	4,494	23	4,471	29,535

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11期 (2018年7月8日現在) 11th Fiscal Year As of July 8, 2018	第12期中間計算期間末 (2019年1月8日現在) 12th Semi-annual Period As of January 8, 2019
	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	30,580,966	22,958,182
投資信託受益証券 Security investment trust beneficiary securities	4,464,274,203	4,124,694,070
親投資信託受益証券 Parents trust beneficiary securities	9,999	9,997
未収入金 Accounts receivable - other	-	5,001,920
流動資産合計 Total current assets	4,494,865,168	4,152,664,169
資産合計 Total assets	4,494,865,168	4,152,664,169
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払受託者報酬 Trustee fee payable	1,433,322	1,235,680
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	20,926,441	18,040,809
未払利息 Accrued interest expenses	186	48
その他未払費用 Other accrued expenses	1,393,285	2,269,002
流動負債合計 Total current liabilities	23,753,234	21,545,539
負債合計 Total liabilities	23,753,234	21,545,539
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	10,514,899,330	10,514,899,330
剰余金 Surplus		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△6,043,787,396	△6,383,780,700

Balance at end of current period		
元本等合計 Total principal and other	4,471,111,934	4,131,118,630
純資産合計 Total net assets	4,471,111,934	4,131,118,630
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	4,494,865,168	4,152,664,169

(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11期中間計算期間 自 2017年7月9日 至 2018年1月8日 11th Semi-annual Period From July 9, 2017 to January 8, 2018	第12期中間計算期間 自 2018年7月9日 至 2019年1月8日 12th Semi-annual Period From July 9, 2018 to January 8, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	939,961,339	△319,553,080
営業収益合計 Total operating revenue	939,961,339	△319,553,080
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	9,376	5,322
受託者報酬 Trustee fee	1,495,382	1,235,680
委託者報酬 Investment trust management fee	21,832,462	18,040,809
その他費用 Other expenses	1,390,185	1,158,413
営業費用合計 Total operating expenses	24,727,405	20,440,224
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	915,233,934	△339,993,304
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	915,233,934	△339,993,304
中間純利益又は中間純損失 (△) Profit (loss)	915,233,934	△339,993,304
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△) Distribution of profit loss from partial redemptions	-	-
期首剰余金又は期首欠損金 (△) Surplus (deficit) at beginning of period	△6,439,513,627	△6,043,787,396
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	714,460,000	-
中間一部解約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 redemptions	714,460,000	-

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 current period	△4,809,819,693	△6,383,780,700

(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	投資信託受益証券 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。 市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 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る場合、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、2018年7月9日から2019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11期 2018年7月8日現在	第12期中間計算期間末 2019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 151,385口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 151,385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 6,043,787,396円	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 6,383,780,700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 1口当たり純資産額 29,535円	3. 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 27,289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11期 2018年7月8日現在	第12期中間計算期間末 2019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 投資信託受益証券 (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。 親投資信託受益証券 (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。	2. 時価の算定方法 投資信託受益証券 (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。 親投資信託受益証券 (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。

(その他の注記)

1 元本の移動

第11期 自 2017年7月9日 至 2018年7月8日		第12期中間計算期間 自 2018年7月9日 至 2019年1月8日	
期首元本額	11,904,059,330 円	期首元本額	10,514,899,330 円
期中追加設定元本額	0 円	期中追加設定元本額	0 円
期中一部解約元本額	1,389,160,000 円	期中一部解約元本額	0 円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。