



2019年7月期 (2018年7月16日～2019年7月15日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2019 (July 16, 2018 - July 15, 2019)

2019年8月26日  
 August 26, 2019

上場取引所 東証  
 Listed Exchange TSE

ファンド名	TOPIX Core 30連動型上場投資信託		
コード番号	( 1311 )		
連動対象指標	TOPIX Core 30		
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	<a href="http://www.nomura-am.co.jp">http://www.nomura-am.co.jp</a>
代表者名	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
Fund name:	TOPIX Core 30 Exchange Traded Fund		
Code:	1311		
Underlying index:	TOPIX Core30		
Primary invested assets:	Stocks		
Trading unit:	10 units		
Management co.:	Nomura Asset Management Co., Ltd.	URL	<a href="http://www.nomura-am.co.jp">http://www.nomura-am.co.jp</a>
Representative:	Junko Nakagawa, President & CEO		
Contact person:	Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.		

有価証券報告書提出予定日 2019年9月26日  
 分配金支払開始日 2019年8月23日  
 Scheduled date of submission of securities report: September 26, 2019  
 Date of commencing dividend payment: August 23, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年7月期の運用状況 (2018年7月16日～2019年7月15日)

Management Status for Year ended July 2019 (from July 16, 2018 to July 15, 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7月期 FY ended Jul. 2019	1,868	(98.6)	27	(1.4)	1,895	(100.0)
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	4,990	(99.0)	52	(1.0)	5,042	(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)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	6,536	0	3,898	2,638
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	5,122	2,188	773	6,536

(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/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	1,968	73	1,895	71,851
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	5,138	95	5,042	77,147

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	2,680
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	1,360

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 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit: JPY)

	第16期 (2018年7月15日現在) 16th Fiscal Year As of July 15, 2018	第17期 (2019年7月15日現在) 17th Fiscal Year As of July 15, 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	134,431,256	94,865,512
株式 Stocks	4,990,711,530	1,868,111,920
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	107,216	693,712
未収入金 Accounts receivable - other	-	1,682,072
未収配当金 Accrued dividends receivable	6,566,300	3,261,900
差入委託証拠金 Customers' margin	6,387,920	197,200
流動資産合計 Total current assets	5,138,204,222	1,968,812,316
資産合計 Total assets	5,138,204,222	1,968,812,316
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	398,048	-
未払金 Accounts payable - other	1,319,948	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	88,898,480	70,699,713
未払受託者報酬 Trustee fee payable	1,507,487	836,271
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	3,230,271	1,791,961
未払利息 Accrued interest expenses	760	810
その他未払費用 Other accrued expenses	43,004	23,840
流動負債合計 Total current liabilities	95,397,998	73,352,595
負債合計 Total liabilities	95,397,998	73,352,595

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	5,203,175,788	2,099,887,004
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△160,369,564	△204,427,283
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	596,222	71,599
元本等合計 Total principal and other	5,042,806,224	1,895,459,721
純資産合計 Total net assets	5,042,806,224	1,895,459,721
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	5,138,204,222	1,968,812,316

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第16期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日 16th Fiscal Year From July 16, 2017 to July 15, 2018	第17期 自 2018年7月16日 至 2019年7月15日 17th Fiscal Year From July 16, 2018 to July 15, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	98,843,595	76,976,578
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	165,040,384	△200,782,504
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	3,079,400	△5,075,196
その他収益 Other revenue	10,234	4,990
営業収益合計 Total operating revenue	266,973,613	△128,876,132
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	45,001	55,040
受託者報酬 Trustee fee	3,020,877	2,128,896
委託者報酬 Investment trust management fee	6,473,191	4,561,808
その他費用 Other expenses	86,200	60,734
営業費用合計 Total operating expenses	9,625,269	6,806,478
営業利益又は営業損失 (△)	257,348,344	△135,682,610

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	257,348,344	△135,682,610
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	257,348,344	△135,682,610
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 (△) 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	△299,839,250	△160,369,564
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	19,486,904	162,324,604
当期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	19,486,904	162,324,604
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	48,467,082	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from additional subscriptions for period	48,467,082	-
分配金 Dividends	88,898,480	70,699,713
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△160,369,564	△204,427,283

(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。 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	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年7月16日から2019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16期	第17期
------	------

2018年7月15日現在	2019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 6,536,653口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,638,049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 160,369,564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 204,427,283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 771.47円 (100口当たり純資産額) (77,147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 718.51円 (100口当たり純資産額) (71,851円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自2017年7月16日 至2018年7月15日	第17期 自2018年7月16日 至2019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>98,808,828円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>266,142円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>99,074,970円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>9,580,268円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>89,494,702円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>88,898,480円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>596,222円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>6,536,653口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1,360円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	98,808,828円	分配準備積立金	B	266,142円	配当等収益合計額	C=A+B	99,074,970円	経費	D	9,580,268円	収益分配可能額	E=C-D	89,494,702円	収益分配金	F	88,898,480円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	596,222円	口数	H	6,536,653口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,360円	<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>76,926,528円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>596,222円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>77,522,750円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>6,751,438円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>70,771,312円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>70,699,713円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>71,599円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>2,638,049口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>2,680円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	76,926,528円	分配準備積立金	B	596,222円	配当等収益合計額	C=A+B	77,522,750円	経費	D	6,751,438円	収益分配可能額	E=C-D	70,771,312円	収益分配金	F	70,699,713円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	71,599円	口数	H	2,638,049口	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,680円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	98,808,828円																																																											
分配準備積立金	B	266,142円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	99,074,970円																																																											
経費	D	9,580,268円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	89,494,702円																																																											
収益分配金	F	88,898,480円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	596,222円																																																											
口数	H	6,536,653口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,360円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	76,926,528円																																																											
分配準備積立金	B	596,222円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	77,522,750円																																																											
経費	D	6,751,438円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	70,771,312円																																																											
収益分配金	F	70,699,713円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	71,599円																																																											
口数	H	2,638,049口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,680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16期 自2017年7月16日 至2018年7月15日	第17期 自2018年7月16日 至2019年7月15日
1. 金融商品に対する取組方針 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。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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。 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。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制 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。 ○市場リスクの管理 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。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

○信用リスクの管理  
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なっております。

○流動性リスクの管理  
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なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第16期 2018年7月15日現在	第17期 2019年7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ん。</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。</p> <p>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3 デリバティブ取引関係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 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 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第16期 自2017年7月16日 至2018年7月15日	第17期 自2018年7月16日 至2019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16期 自2017年7月16日 至2018年7月15日	第17期 自2018年7月16日 至2019年7月15日
期首元本額 4,077,459,852円	期首元本額 5,203,175,788円
期中追加設定元本額 1,741,727,600円	期中追加設定元本額 0円
期中一部交換元本額 616,011,664円	期中一部交換元本額 3,103,288,784円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第16期 自2017年7月16日 至2018年7月15日	第17期 自2018年7月16日 至2019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	143,121,955	△100,875,965
合計	143,121,955	△100,875,965

3 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16期(2018年7月15日現在)			第17期(2019年7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	49,787,920	—	49,504,000	△290,832	25,528,400	—	26,226,000	693,712
合計	49,787,920	—	49,504,000	△290,832	25,528,400	—	26,226,000	693,712

(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。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019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	日本たばこ産業	14,900	2,458.50	36,631,650	
		信越化学工業	4,500	9,739.00	43,825,500	
		花王	6,300	8,302.00	52,302,600	
		武田薬品工業	22,500	3,900.00	87,750,000	
		アステラス製薬	22,700	1,550.50	35,196,350	
		日立製作所	11,600	4,035.00	46,806,000	
		パナソニック	29,500	929.90	27,432,050	
		ソニー	17,300	6,049.00	104,647,700	
		キーエンス	1,300	63,610.00	82,693,000	
		ファナック	2,500	19,215.00	48,037,500	
		村田製作所	8,100	4,807.00	38,936,700	
		キヤノン	13,900	3,215.00	44,688,500	
		トヨタ自動車	28,700	6,910.00	198,317,000	
		本田技研工業	21,800	2,847.00	62,064,600	
		任天堂	1,500	41,650.00	62,475,000	
		東日本旅客鉄道	4,600	10,210.00	46,966,000	
		東海旅客鉄道	2,300	22,015.00	50,634,500	
		日本電信電話	17,300	5,162.00	89,302,600	
		KDDI	20,700	2,876.00	59,533,200	
		NTTドコモ	16,000	2,615.00	41,840,000	
ソフトバンクグループ	21,000	5,254.00	110,334,000			



	三井物産	20,900	1,815.50	37,943,950	
	三菱商事	17,800	2,952.50	52,554,500	
	セブン&アイ・ホールディングス	10,600	3,867.00	40,990,200	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	175,100	527.60	92,382,760	
	三井住友フィナンシャルグループ	17,900	3,840.00	68,736,000	
	みずほフィナンシャルグループ	345,600	159.10	54,984,960	
	東京海上ホールディングス	9,100	5,630.00	51,233,000	
	三菱地所	17,800	2,044.50	36,392,100	
	リクルートホールディングス	17,600	3,550.00	62,480,000	
	小計 銘柄数：30			1,868,111,920	
	組入時価比率：98.6%			100.0%	
	合計			1,868,111,920	

(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(2019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

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。