



2020年7月期 (2019年7月16日～2020年7月15日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2020 (July 16, 2019 – July 15, 2020)

2020年8月26日
 August 26, 2020

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 <http://www.nomura-am.co.jp>
 代表者名 CEO 兼代表取締役社長 中川 順子
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 山中 淳 TEL 0120-753104

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 <http://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Junko Nakagawa, President & CEO
 Contact person: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2020年9月30日
 分配金支払開始日 2020年8月21日
 Scheduled date of submission of securities report: September 30, 2020
 Date of commencing dividend payment: August 21, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

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

Management Status for Year ended July 2020 (from July 16, 2019 to July 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7月期 FY ended Jul. 2020	1,643	(98.1)	31	(1.9)	1,674	(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
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,638	2,599	2,928	2,309
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	6,536	0	3,898	2,638

(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
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	1,747	72	1,674	72,518
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	1,968	73	1,895	71,851

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,920
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	2,680

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17期 (2019年7月15日現在) 17th Fiscal Year As of July 15, 2019	第18期 (2020年7月15日現在) 18th Fiscal Year As of July 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	95,068,031
株式 Stocks	1,868,111,920	1,643,302,530
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	693,712	84,600
未収入金 Accounts receivable - other	1,682,072	-
未収配当金 Accrued dividends receivable	3,261,900	2,831,800
差入委託証拠金 Customers' margin	197,200	6,113,360
流動資産合計 Total current assets	1,968,812,316	1,747,400,321
資産合計 Total assets	1,968,812,316	1,747,400,321
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	-	433,580
未払金 Accounts payable - other	-	1,182,600
未払収益分配金 Unpaid dividends	70,699,713	67,437,925
未払受託者報酬 Trustee fee payable	836,271	1,116,051
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	1,791,961	2,391,468
未払利息 Accrued interest expenses	810	48
その他未払費用 Other accrued expenses	23,840	31,826
流動負債合計 Total current liabilities	73,352,595	72,593,498
負債合計 Total liabilities	73,352,595	72,593,498

純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	2,099,887,004	1,838,376,328
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△204,427,283	△163,569,505
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	71,599	83,999
元本等合計 Total principal and other	1,895,459,721	1,674,806,823
純資産合計 Total net assets	1,895,459,721	1,674,806,823
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	1,968,812,316	1,747,400,321

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	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	第18期 自 2019年7月16日 至 2020年7月15日 18th Fiscal Year From July 16, 2019 to July 15, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	76,976,578	73,259,745
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△200,782,504	△12,917,888
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△5,075,196	6,799,300
その他収益 Other revenue	4,990	7,814
営業収益合計 Total operating revenue	△128,876,132	67,148,971
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	55,040	19,429
受託者報酬 Trustee fee	2,128,896	1,828,211
委託者報酬 Investment trust management fee	4,561,808	3,917,462
その他費用 Other expenses	60,734	52,132
営業費用合計 Total operating expenses	6,806,478	5,817,234
営業利益又は営業損失 (△)	△135,682,610	61,331,737

Operating profit (loss)		
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△135,682,610	61,331,737
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△135,682,610	61,331,737
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	△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	162,324,604	84,240,796
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	162,324,604	84,240,796
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	-	37,276,830
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	-	37,276,830
分配金 Dividends	70,699,713	67,437,925
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△204,427,283	△163,569,505

(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、2019年7月16日から2020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17期	第18期
------	------

2019年7月15日現在	2020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 2,638,049口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,309,518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. 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 163,569,505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)	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 725.18円 (100口当たり純資産額) (72,518円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自2018年7月16日 至2019年7月15日	第18期 自2019年7月16日 至2020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>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	<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>73,248,130円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>71,599円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>73,319,729円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>5,797,805円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>67,521,924円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>67,437,925円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>83,999円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>2,309,518口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>2,920円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	73,248,130円	分配準備積立金	B	71,599円	配当等収益合計額	C=A+B	73,319,729円	経費	D	5,797,805円	収益分配可能額	E=C-D	67,521,924円	収益分配金	F	67,437,925円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	83,999円	口数	H	2,309,518口	100口当たり分配金	I=F/H×100	2,920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																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	73,248,130円																																																											
分配準備積立金	B	71,599円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	73,319,729円																																																											
経費	D	5,797,805円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	67,521,924円																																																											
収益分配金	F	67,437,925円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	83,999円																																																											
口数	H	2,309,518口																																																											
100口当たり分配金	I=F/H×100	2,920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17期 自2018年7月16日 至2019年7月15日	第18期 自2019年7月16日 至2020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

<p>○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。</p> <p>○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。</p>	
---	--

(2) 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 2020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17期 自2018年7月16日 至2019年7月15日	第18期 自2019年7月16日 至2020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17期 自2018年7月16日 至2019年7月15日	第18期 自2019年7月16日 至2020年7月15日
期首元本額 5,203,175,788円	期首元本額 2,099,887,004円
期中追加設定元本額 0円	期中追加設定元本額 2,069,202,000円
期中一部交換元本額 3,103,288,784円	期中一部交換元本額 2,330,712,676円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第17期 自2018年7月16日 至2019年7月15日	第18期 自2019年7月16日 至2020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	△100,875,965	△29,045,654
合計	△100,875,965	△29,045,654

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17期(2019年7月15日現在)			第18期(2020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	25,528,400	—	26,226,000	693,712	31,592,360	—	31,248,000	△348,980
合計	25,528,400	—	26,226,000	693,712	31,592,360	—	31,248,000	△348,980

(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(2020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	13,000	1,957.00	25,441,000	
		信越化学工業	3,800	13,280.00	50,464,000	
		花王	5,400	8,614.00	46,515,600	
		武田薬品工業	18,700	3,723.00	69,620,100	
		アステラス製薬	19,400	1,759.50	34,134,300	
		第一三共	6,400	8,570.00	54,848,000	
		日立製作所	10,800	3,453.00	37,292,400	
		ソニー	14,000	8,126.00	113,764,000	
		キーエンス	2,000	45,850.00	91,700,000	
		ファナック	2,100	21,070.00	44,247,000	
		村田製作所	6,600	6,618.00	43,678,800	
		キャノン	12,100	2,161.50	26,154,150	
		トヨタ自動車	25,000	6,835.00	170,875,000	
		本田技研工業	17,700	2,845.50	50,365,350	
		任天堂	1,400	48,710.00	68,194,000	
		東日本旅客鉄道	3,900	7,325.00	28,567,500	
		東海旅客鉄道	1,900	15,495.00	29,440,500	
		日本電信電話	29,400	2,580.50	75,866,700	
		KDDI	16,000	3,344.00	53,504,000	
		NTTドコモ	15,700	2,985.00	46,864,500	
ソフトバンクグループ	17,500	6,497.00	113,697,500			

	三井物産	19,100	1,655.00	31,610,500	
	三菱商事	14,500	2,309.50	33,487,750	
	セブン&アイ・ホールディングス	8,600	3,550.00	30,530,000	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	151,300	424.60	64,241,980	
	三井住友フィナンシャルグループ	15,300	3,087.00	47,231,100	
	みずほフィナンシャルグループ	300,500	136.60	41,048,300	
	東京海上ホールディングス	7,800	4,813.00	37,541,400	
	三菱地所	15,500	1,616.00	25,048,000	
	リクルートホールディングス	15,300	3,747.00	57,329,100	
	小計 銘柄数：30			1,643,302,530	
	組入時価比率：98.1%			100.0%	
	合計			1,643,302,530	

(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(2020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。