

平成29年7月期（平成28年7月16日～平成29年7月15日）決算短信

平成29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 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成29年9月28日  
 分配金支払開始日 平成29年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成29年7月期の運用状況（平成28年7月16日～平成29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	%
平成29年7月期	2,531	(99.7)	6	(0.3)	2,538	(100)
平成28年7月期	1,833	(99.8)	3	(0.2)	1,837	(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(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成29年7月期	1,141	0	0	1,141
平成28年7月期	1,141	0	0	1,141

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	100口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数) × 100
	百万円	百万円	百万円	円
平成29年7月期	2,572	34	2,538	222,459
平成28年7月期	1,871	34	1,837	161,016

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成29年7月期	2,790.00
平成28年7月期	2,790.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有  無   
 ② ①以外の変更 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 14 期 (平成 28 年 7 月 15 日現在)	第 15 期 (平成 29 年 7 月 15 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	34,139,089	37,786,999
株式	1,833,426,740	2,531,492,900
未収配当金	3,636,600	3,630,000
流動資産合計	1,871,202,429	2,572,909,899
資産合計	1,871,202,429	2,572,909,899
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	31,833,983	31,833,983
未払受託者報酬	685,618	888,306
未払委託者報酬	1,469,116	1,903,472
未払利息	45	92
その他未払費用	19,529	25,321
流動負債合計	34,008,291	34,651,174
負債合計	34,008,291	34,651,174
<b>純資産の部</b>		
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 (△)	△309,032,505	392,032,082
(分配準備積立金)	22,373	48,298
元本等合計	1,837,194,138	2,538,258,725
純資産合計	1,837,194,138	2,538,258,725
負債純資産合計	1,871,202,429	2,572,909,899

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 年 7 月 15 日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	36,613,525	37,168,618
受取利息	4,844	-
有価証券売買等損益	△573,494,367	701,038,662
その他収益	975	1,008
営業収益合計	△536,875,023	738,208,288
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,330	9,464
受託者報酬	1,509,698	1,660,069

委託者報酬	3,234,940	3,557,197
その他費用	43,014	82,988
営業費用合計	4,790,982	5,309,718
営業利益又は営業損失(△)	△541,666,005	732,898,570
経常利益又は経常損失(△)	△541,666,005	732,898,570
当期純利益又は当期純損失(△)	△541,666,005	732,898,570
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(△)	264,467,483	△309,032,505
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	31,833,983
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△309,032,505	392,032,082

## (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 受取配当金は、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。 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、平成 28 年 7 月 16 日から平成 29 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 14 期 平成 28 年 7 月 15 日現在	第 15 期 平成 29 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. 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 309,032,505 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 1,610.16 円 (100 口当たり純資産額) (161,016 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 2,224.59 円 (100 口当たり純資産額) (222,459 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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>36,616,014 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>27,994 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>36,644,008 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>4,787,652 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>31,856,356 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	36,616,014 円	分配準備積立金	B	27,994 円	配当等収益合計額	C=A+B	36,644,008 円	経費	D	4,787,652 円	収益分配可能額	E=C-D	31,856,356 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>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> </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
項目																																					
当期配当等収益額	A	36,616,014 円																																			
分配準備積立金	B	27,994 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	36,644,008 円																																			
経費	D	4,787,652 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	31,856,356 円																																			
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	22,373 円
口数	H	1,141,003 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	2,790 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
100 口当たり分配金	I=F/H×100	2,790 円

## 2. 追加情報

平成 28 年 1 月 29 日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

## (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 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 年 7 月 15 日
<p>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。</p> <p>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、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。</p> <p>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。 ○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っております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 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 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

第 14 期 平成 28 年 7 月 15 日現在	第 15 期 平成 29 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。 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 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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。	

(その他の注記)

## 1 元本の移動

第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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	△565,488,560	697,162,102
合計	△565,488,560	697,162,102

## 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(平成 29 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	4,500	1,150.00	5,175,000	
		イビデン	5,600	1,977.00	11,071,200	
		ユニカミノルタ	18,800	953.00	17,916,400	
		ブラザー工業	9,800	2,791.00	27,351,800	
		ミネベアミツミ	14,600	1,898.00	27,710,800	
		日立製作所	193,000	724.10	139,751,300	
		東芝	180,000	231.60	41,688,000	
		三菱電機	85,800	1,656.00	142,084,800	
		富士電機	24,000	610.00	14,640,000	
		東洋電機製造	300	1,796.00	538,800	
		安川電機	9,300	2,473.00	22,998,900	
		シンフォニアテクノロジー	5,000	447.00	2,235,000	
		明電舎	7,000	396.00	2,772,000	

オリジン電気	1,000	313.00	313,000
山洋電気	2,000	1,122.00	2,244,000
デンヨー	700	1,962.00	1,373,400
東芝テック	5,000	611.00	3,055,000
芝浦メカトロニクス	1,000	330.00	330,000
マブチモーター	2,200	5,730.00	12,606,000
日本電産	10,400	11,550.00	120,120,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	300	1,773.00	531,900
東光高岳	400	1,694.00	677,600
ダブル・スコープ	800	2,170.00	1,736,000
宮越ホールディングス	300	459.00	137,700
ダイヘン	4,000	943.00	3,772,000
田淵電機	1,200	351.00	421,200
ヤーマン	100	8,200.00	820,000
JVCケンウッド	5,900	324.00	1,911,600
ミマキエンジニアリング	700	868.00	607,600
第一精工	400	2,219.00	887,600
日新電機	1,600	1,209.00	1,934,400
大崎電気工業	2,000	912.00	1,824,000
オムロン	8,500	5,080.00	43,180,000
日東工業	1,200	1,784.00	2,140,800
I D E C	1,000	1,479.00	1,479,000
不二電機工業	100	1,396.00	139,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	15,000	504.00	7,560,000
サクサホールディングス	2,000	226.00	452,000
メルコホールディングス	400	3,350.00	1,340,000
テクノメディカ	200	1,925.00	385,000
日本電気	111,000	297.00	32,967,000
富士通	78,000	838.00	65,364,000
沖電気工業	3,500	1,677.00	5,869,500
岩崎通信機	4,000	87.00	348,000
電気興業	2,000	557.00	1,114,000
サンケン電気	5,000	541.00	2,705,000
ナカヨ	1,000	383.00	383,000
アイホン	500	1,991.00	995,500

ルネサスエレクトロニクス	4,200	1,013.00	4,254,600
セイコーエプソン	12,000	2,685.00	32,220,000
ワコム	6,200	375.00	2,325,000
アルバック	1,400	5,660.00	7,924,000
アクセル	300	801.00	240,300
E I Z O	800	4,290.00	3,432,000
ジャパンディスプレイ	15,000	199.00	2,985,000
日本信号	2,200	1,099.00	2,417,800
京三製作所	2,000	598.00	1,196,000
能美防災	900	1,657.00	1,491,300
ホーチキ	600	1,859.00	1,115,400
エレコム	700	2,375.00	1,662,500
日本無線	500	1,455.00	727,500
パナソニック	92,300	1,527.00	140,942,100
アンリツ	5,900	996.00	5,876,400
富士通ゼネラル	2,700	2,558.00	6,906,600
日立国際電気	2,100	2,669.00	5,604,900
ソニー	56,800	4,499.00	255,543,200
TDK	4,500	7,610.00	34,245,000
帝国通信工業	2,000	216.00	432,000
タムラ製作所	3,000	533.00	1,599,000
アルプス電気	7,400	3,295.00	24,383,000
池上通信機	3,000	163.00	489,000
パイオニア	12,100	213.00	2,577,300
日本電波工業	800	908.00	726,400
鈴木	300	718.00	215,400
日本トリム	200	4,470.00	894,000
ローランド ディー. ジー.	400	2,732.00	1,092,800
フォスター電機	900	1,978.00	1,780,200
クラリオン	4,000	425.00	1,700,000
SMK	2,000	434.00	868,000
ヨコオ	600	1,428.00	856,800
ティアック	6,000	49.00	294,000
ホンデン	2,400	1,216.00	2,918,400
ヒロセ電機	1,300	16,030.00	20,839,000
日本航空電子工業	2,000	1,665.00	3,330,000

TOA	900	1,112.00	1,000,800
日立マクセル	1,200	2,371.00	2,845,200
古野電気	1,000	635.00	635,000
ユニデンホールディングス	2,000	275.00	550,000
アルパイン	1,900	1,697.00	3,224,300
スミダコーポレーション	700	2,125.00	1,487,500
アイコム	400	2,591.00	1,036,400
リオン	300	1,811.00	543,300
本多通信工業	300	1,715.00	514,500
船井電機	900	1,048.00	943,200
横河電機	8,700	1,862.00	16,199,400
新電元工業	3,000	606.00	1,818,000
アズビル	2,400	4,350.00	10,440,000
東亜ディーケーケー	400	712.00	284,800
日本光電工業	3,400	2,710.00	9,214,000
チノー	300	1,264.00	379,200
共和電業	900	455.00	409,500
日本電子材料	300	711.00	213,300
堀場製作所	1,600	7,040.00	11,264,000
アドバンテスト	5,500	1,970.00	10,835,000
小野測器	400	755.00	302,000
エスペック	700	1,722.00	1,205,400
キーエンス	3,600	49,940.00	179,784,000
日置電機	400	2,230.00	892,000
シスメックス	6,300	6,360.00	40,068,000
日本マイクロニクス	1,400	1,144.00	1,601,600
メガチップス	700	2,728.00	1,909,600
OBARA GROUP	500	6,160.00	3,080,000
コーセル	1,100	1,390.00	1,529,000
イリソ電子工業	300	9,290.00	2,787,000
新日本無線	700	689.00	482,300
オプテックスグループ	600	3,655.00	2,193,000
千代田インテグレ	400	2,226.00	890,400
アイ・オー・データ機器	300	1,190.00	357,000
レーザーテック	1,800	1,637.00	2,946,600
スタンレー電気	5,700	3,730.00	21,261,000



岩崎電気	3,000	212.00	636,000
ウシオ電機	4,900	1,420.00	6,958,000
岡谷電機産業	400	399.00	159,600
ヘリオス テクノ ホールディング	700	824.00	576,800
日本セラミック	700	2,720.00	1,904,000
遠藤照明	400	1,166.00	466,400
古河電池	1,000	830.00	830,000
双信電機	400	303.00	121,200
山一電機	800	1,780.00	1,424,000
図研	500	1,491.00	745,500
日本電子	3,000	637.00	1,911,000
カシオ計算機	6,500	1,761.00	11,446,500
ファナック	8,100	22,435.00	181,723,500
日本シイエムケイ	1,700	989.00	1,681,300
エンプラス	400	3,560.00	1,424,000
大真空	300	1,870.00	561,000
ローム	3,900	9,240.00	36,036,000
浜松ホトニクス	5,900	3,495.00	20,620,500
三井ハイテック	1,100	1,744.00	1,918,400
新光電気工業	3,000	983.00	2,949,000
京セラ	13,200	6,400.00	84,480,000
太陽誘電	3,900	1,800.00	7,020,000
村田製作所	8,400	17,000.00	142,800,000
ユーシン	1,100	798.00	877,800
双葉電子工業	1,300	2,032.00	2,641,600
北陸電気工業	3,000	149.00	447,000
ニチコン	2,500	1,169.00	2,922,500
日本ケミコン	7,000	448.00	3,136,000
KOA	1,100	2,233.00	2,456,300
市光工業	2,000	885.00	1,770,000
小糸製作所	4,800	5,980.00	28,704,000
ミツバ	1,500	2,120.00	3,180,000
SCREENホールディングス	1,600	7,520.00	12,032,000
キヤノン電子	700	2,258.00	1,580,600
キヤノン	43,300	3,790.00	164,107,000
リコー	24,200	1,004.00	24,296,800

	MUTOHホールディングス	1,000	252.00	252,000	
	東京エレクトロン	5,400	15,890.00	85,806,000	
	小計 銘柄数：158			2,531,492,900	
	組入時価比率：99.7%			100.0%	
	合計			2,531,492,900	

(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(平成 29 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。