

2022年7月期（2022年1月9日～2022年7月8日）決算短信  
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2022 (January 9, 2022 – July 8, 2022)

2022年8月19日  
上場取引所 東証  
Aug. 19, 2022  
Listed Exchange: TSE

ファンド名 上場インデックスファンド MSCI 日本株高配当低ボラティリティ  
コード番号 1399  
連動対象指標 MSCI ジャパン IMI カスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数  
主要投資資産 株式  
売買単位 10口  
管理会社 日興アセットマネジメント株式会社 URL [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)  
代表者名 代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ  
問合せ先責任者 ETF ビジネス開発部 花村 憲治 TEL (03)6447-6449  
Fund name: Listed Index Fund MSCI Japan Equity High Dividend Low Volatility  
Code: 1399  
Underlying Index: MSCI Japan IMI Custom Liquidity and Yield Low Volatility Index  
Primary invested assets: Stocks  
Trading unit: 10 units  
Management co.: Nikko Asset Management Co., Ltd. URL [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)  
Representative: Stefanie Drews Representative Director, President and COO  
Contact person: Kenji Hanamura, ETF Business Development Department TEL +81-3-6447-6449

有価証券報告書提出予定日 2022年10月7日  
分配金支払開始日 2022年8月16日  
Scheduled date of submission of securities report: Oct. 7, 2022  
Scheduled date of commencing dividend payment: Aug. 16, 2022

## I ファンドの運用状況

### I Fund Management

1. 2022年7月期の運用状況（2022年1月9日～2022年7月8日）  
I. Management Status for Year ended July 2022 (January 9, 2022 – July 8, 2022)

(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）	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
	JPY mil.	%	JPY mil.	%	JPY mil.	%
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	2,169	(99.2)	17	(0.8)	2,187	(100.0)
2022年1月期 FY ended Jan. 2022	2,114	(99.8)	4	(0.2)	2,118	(100.0)

## (2) 設定・交換実績

## (2) Creation and Exchange

	前特定期間末発行済口数 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)	当特定期間末発行済口数 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
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	1,360	0	0	1,360
2022年1月期 FY ended Jan. 2022	1,424	0	64	1,360

## (3) 基準価額

## (3) Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当特定期間末発行済口数)×10 Net Asset Value per 10 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×10)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	2,196	9	2,187	16,071.8
2022年1月期 FY ended Jan. 2022	2,128	9	2,118	15,568.2

## (4) 分配金

## (4) Dividend Payment

	10口当たり分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	45
2022年1月期 FY ended Jan. 2022	32

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

\* Dividend per Trading Unit

## 2. 会計方針の変更

## 2. Change in Accounting Policies

- |                                                               |   |    |
|---------------------------------------------------------------|---|----|
| ① 会計基準等の改正に伴う変更                                               | 無 |    |
| ① Changes accompanying revision to accounting standards, etc. | 無 | No |
| ② ①以外の変更                                                      | 無 |    |
| ② Changes other than those in ①                               | 無 | No |