

平成22年7月期（平成21年7月9日～平成22年7月8日）決算短信

平成22年8月17日

上場取引所 大証

ファンド名 日経225連動型上場投資信託  
 コード番号 ( 1321 )  
 連動対象指標 日経平均株価  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 1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 執行役社長 吉川 淳  
 問合せ先責任者 投信ディスクロージャー部 新村 浩久 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成22年9月30日  
 分配金支払開始予定日 平成22年8月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成22年7月期の運用状況（平成21年7月9日～平成22年7月8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22年7月期	535,750	(99.9)	514	(0.1)	536,265	(100)
平成21年7月期	537,491	(99.9)	519	(0.1)	538,010	(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22年7月期	56,920	59,848	60,672	56,096
平成21年7月期	55,954	31,687	30,721	56,920

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10
	百万円	百万円	百万円	円
平成22年7月期	570,260	33,995	536,265	95,596
平成21年7月期	580,205	42,194	538,010	94,519

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成22年7月期	1,530.00
平成21年7月期	2,060.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更  
 ② ①以外の変更

有(無)  
 有(無)

## II 財務諸表等

## 【日経 225 連動型上場投資信託】

## (1) 【貸借対照表】

期別	第 8 期 平成 21 年 7 月 8 日現在	第 9 期 平成 22 年 7 月 8 日現在
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	42,269,008,383	34,058,247,572
株式	537,491,430,840	535,750,101,250
未収配当金	423,017,000	439,391,500
未収利息	37,581	27,736
その他未収収益	19,249,000	8,014,767
差入委託証拠金	2,940,000	4,770,000
流動資産合計	580,205,682,804	570,260,552,825
資産合計	580,205,682,804	570,260,552,825
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,803,780	1,573,150
未払収益分配金	11,725,651,016	8,582,826,771
未払受託者報酬	204,878,664	203,994,297
未払委託者報酬	439,025,657	437,346,729
未払利息	2,853,098	1,845,737
有価証券貸借取引受入金	29,814,759,397	24,762,106,950
その他未払費用	5,853,620	5,830,315
流動負債合計	42,194,825,232	33,995,523,949
負債合計	42,194,825,232	33,995,523,949
純資産の部		
元本等		
元本	700,522,267,252	690,384,634,449
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	162,511,409,680	154,119,605,573
(分配準備積立金)	459,342,346	454,933,291
元本等合計	538,010,857,572	536,265,028,876
純資産合計	538,010,857,572	536,265,028,876
負債純資産合計	580,205,682,804	570,260,552,825

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第 8 期	第 9 期
		自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 7 月 8 日	自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		12,875,162,450	9,814,239,140
受取利息		97,044,352	30,926,019
有価証券売買等損益		243,744,107,945	6,103,343,441
派生商品取引等損益		93,608,980	2,109,500
その他収益		170,018,680	105,409,921
営業収益合計		230,695,491,443	16,051,809,021
営業費用			
支払利息		73,918,433	17,413,141
受託者報酬		451,017,380	425,651,250
委託者報酬		967,439,135	912,504,252
その他費用		15,912,837	16,588,721
営業費用合計		1,508,287,785	1,372,157,364
営業利益		232,203,779,228	14,679,651,657
経常利益		232,203,779,228	14,679,651,657
当期純利益		232,203,779,228	14,679,651,657
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額			-
期首剰余金又は期首欠損金( )		45,647,744,079	162,511,409,680
剰余金増加額又は欠損金減少額		98,614,886,875	106,245,478,093
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額		98,614,886,875	106,245,478,093
剰余金減少額又は欠損金増加額		62,844,610,390	103,950,498,872
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額		62,844,610,390	103,950,498,872
分配金		11,725,651,016	8,582,826,771
期末剰余金又は期末欠損金( )		162,511,409,680	154,119,605,573

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 8 期 自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 7 月 8 日	第 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日
1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 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、市場価額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) 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。	(1) 株式 同左 (2) 先物取引 同左
2 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 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。 (2) 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	(1) 受取配当金の計上基準 同左 (2) 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益の計上基準 同左
3 その他	当ファンドの計算期間は、平成 20 年 7 月 9 日から平成 21 年 7 月 8 日までとなっております。	当ファンドの計算期間は、平成 21 年 7 月 9 日から平成 22 年 7 月 8 日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第 8 期 平成 21 年 7 月 8 日現在	第 9 期 平成 22 年 7 月 8 日現在
1 計算期間の末日における受益権の総数 56,920,636 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 56,096,907 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 162,511,409,680 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 154,119,605,573 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 9,451.9 円 (10 口当たり純資産額 94,519 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 9,559.6 円 (10 口当たり純資産額 95,596 円)
4 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 27,257,707,320 円	4 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 24,123,152,000 円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 8 期 自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 7 月 8 日			第 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日		
1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 12,184,993,362 円(10 口当たり 2,140 円)のうち、11,725,651,016 円(10 口当たり 2,060 円)を分配金額としております。			1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 9,037,760,062 円(10 口当たり 1,611 円)のうち、8,582,826,771 円(10 口当たり 1,530 円)を分配金額としております。		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	13,068,307,049 円	当期配当等収益額	A	9,933,161,939 円
分配準備積立金	B	551,055,665 円	分配準備積立金	B	459,342,346 円
配当等収益合計額	C = A + B	13,619,362,714 円	配当等収益合計額	C = A + B	10,392,504,285 円
経費	D	1,434,369,352 円	経費	D	1,354,744,223 円
収益分配可能額	E = C - D	12,184,993,362 円	収益分配可能額	E = C - D	9,037,760,062 円
収益分配金	F	11,725,651,016 円	収益分配金	F	8,582,826,771 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	459,342,346 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	454,933,291 円
口数	H	56,920,636 口	口数	H	56,096,907 口
10 口当たり分配金	I = F / H × 10	2,060 円	10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,530 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 8 期 自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 7 月 8 日		第 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 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。	
		2 金融商品の内容及び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。 また、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。	

	<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なっております。          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なっております。          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。</p> <p>4 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。          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。</p>
--	--

(2)金融商品の時価等に関する事項

第 8 期 平成 21 年 7 月 8 日現在	第 9 期 平成 22 年 7 月 8 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。          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。          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>

## (関連当事者との取引に関する注記)

第 8 期 自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 7 月 8 日	第 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 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 8 期 自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 7 月 8 日	第 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日
期首元本額 688,634,259,067 円	期首元本額 700,522,267,252 円
期中追加設定元本額 389,980,154,690 円	期中追加設定元本額 736,559,796,950 円
期中一部交換元本額 378,092,146,505 円	期中一部交換元本額 746,697,429,753 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券の貸借対照表計上額等

種類	第 8 期 自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 7 月 8 日	
	貸借対照表計上額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
株式	537,491,430,840	137,450,679,466
合計	537,491,430,840	137,450,679,466

## 売買目的有価証券

種類	第 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日
	損益に含まれた評価差額(円)
株式	31,513,835,263
合計	31,513,835,263

## 3 デリバティブ取引関係

## (1) 取引の状況に関する事項

第 8 期 自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 7 月 8 日	第 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日
<p>1 取引の内容 当ファンドが利用しているデリバティブ取引は株価指数先物取引であります。</p> <p>2 取引に対する取組みと利用目的 当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款及びデリバティブ取引に関する社内規定に従って行なわれております。</p> <p>3 取引に係るリスクの内容 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。 当ファンドにおいて、有価証券の価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行なう場合には、当該取引の対象とする有価証券の時価総額の範囲内とし、当該デリバティブ取引における価格変動リスクはヘッジ対象有価証券の価格変動リスクと減殺されており、信託財産の損益への影響は限定的であります。 また、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する目的でデリバティブ取引を行なう場合は、当該デリバティブ取引の建玉の合計額を、当該取引時点でのファンドで規定されている対象とする有価証券の組入可能額の範囲内としております。</p> <p>4 取引に係るリスク管理体制 デリバティブ取引については、運用部署及び取引執行部署から独立した部署が、取引の性格、取引状況及びポジションの状況等を商品性格や投資方針に基づいて管理しております。また、関連部署のメンバーによって構成された委員会において、社内規定やリスク管理状況に関する審議・決定を行ない、マネジメントに報告しています。</p>	

## (2) 取引の時価等に関する事項

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第 8 期(平成 21 年 7 月 8 日現在)				第 9 期(平成 22 年 7 月 8 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								
先物取引								
株価指数先物取引								
買建	58,260,000		56,460,000	1,803,780	49,270,000		47,700,000	1,573,150
合計	58,260,000		56,460,000	1,803,780	49,270,000		47,700,000	1,573,150

(注)時価の算定方法

先物取引

先物取引の評価においては、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

(平成 22 年 7 月 8 日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	日本水産	2,275,000	302.00	687,050,000		
	マルハニチロホールディングス	2,275,000	142.00	323,050,000		
	国際石油開発帝石	2,275	476,000.00	1,082,900,000	貸付株式数	1,296 (419)
	コムシスホールディングス	2,275,000	792.00	1,801,800,000	貸付株式数	110,800
	大成建設	2,275,000	183.00	416,325,000		
	大林組	2,275,000	356.00	809,900,000	貸付株式数	739,000 (141,000)
	清水建設	2,275,000	319.00	725,725,000		
	鹿島建設	2,275,000	212.00	482,300,000	貸付株式数	441,000 (441,000)
	大和ハウス工業	2,275,000	814.00	1,851,850,000		
	積水ハウス	2,275,000	780.00	1,774,500,000		
	日揮	2,275,000	1,386.00	3,153,150,000		
	千代田化工建設	2,275,000	648.00	1,474,200,000		
	日清製粉グループ本社	2,275,000	1,035.00	2,354,625,000		
	明治ホールディングス	227,500	3,765.00	856,537,500	貸付株式数	37,100
	日本ハム	2,275,000	1,132.00	2,575,300,000		
	サッポロホールディングス	2,275,000	392.00	891,800,000		
	アサヒビール	2,275,000	1,514.00	3,444,350,000		
	キリンホールディングス	2,275,000	1,147.00	2,609,425,000	貸付株式数	232,000 (232,000)
	宝ホールディングス	2,275,000	453.00	1,030,575,000	貸付株式数	27,000
	キッコーマン	2,275,000	936.00	2,129,400,000	貸付株式数	34,000 (34,000)
	味の素	2,275,000	827.00	1,881,425,000		
	ニチレイ	2,275,000	385.00	875,875,000		
	日本たばこ産業	11,375	278,200.00	3,164,525,000		
	東洋紡績	2,275,000	152.00	345,800,000		
	ユニチカ	2,275,000	78.00	177,450,000		
	日清紡ホールディングス	2,275,000	886.00	2,015,650,000		
	帝人	2,275,000	277.00	630,175,000		
	東レ	2,275,000	444.00	1,010,100,000		
	三菱レイヨン	2,275,000	339.00	771,225,000	貸付株式数	146,000 (146,000)
	王子製紙	2,275,000	440.00	1,001,000,000		
	三菱製紙	2,275,000	106.00	241,150,000		
	北越紀州製紙	2,275,000	447.00	1,016,925,000	貸付株式数	117,500
	日本製紙グループ本社	227,500	2,450.00	557,375,000		
	クラレ	2,275,000	1,079.00	2,454,725,000		
	旭化成	2,275,000	474.00	1,078,350,000		
	昭和電工	2,275,000	168.00	382,200,000		
	住友化学	2,275,000	374.00	850,850,000		
	日産化学工業	2,275,000	1,029.00	2,340,975,000		
	日本曹達	2,275,000	307.00	698,425,000		
	東ソー	2,275,000	241.00	548,275,000		
	電気化学工業	2,275,000	438.00	996,450,000		
	信越化学工業	2,275,000	4,275.00	9,725,625,000		
	三井化学	2,275,000	261.00	593,775,000		
	三菱ケミカルホールディングス	1,137,500	432.00	491,400,000		
	宇部興産	2,275,000	219.00	498,225,000		
	日本化薬	2,275,000	808.00	1,838,200,000		
	花王	2,275,000	2,095.00	4,766,125,000		
	富士フイルムホールディングス	2,275,000	2,711.00	6,167,525,000	貸付株式数	430,300 (430,300)
	資生堂	2,275,000	1,977.00	4,497,675,000		
	協和発酵キリン	2,275,000	873.00	1,986,075,000		
	武田薬品工業	2,275,000	3,990.00	9,077,250,000	貸付株式数	288,100
	アステラス製薬	2,275,000	3,005.00	6,836,375,000		
	大日本住友製薬	2,275,000	667.00	1,517,425,000		
	塩野義製薬	2,275,000	1,874.00	4,263,350,000		
	中外製薬	2,275,000	1,605.00	3,651,375,000		
	エーザイ	2,275,000	2,958.00	6,729,450,000		
	第一三共	2,275,000	1,624.00	3,694,600,000		
	昭和シェル石油	2,275,000	646.00	1,469,650,000		
	JXホールディングス	2,275,000	489.00	1,112,475,000		
	横浜ゴム	2,275,000	433.00	985,075,000		
	ブリヂストン	2,275,000	1,497.00	3,405,675,000		
	日東紡績	2,275,000	193.00	439,075,000	貸付株式数	83,000
	旭硝子	2,275,000	865.00	1,967,875,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	日本板硝子	2,275,000	222.00	505,050,000	貸付株式数	925,000
	住友大阪セメント	2,275,000	173.00	393,575,000		
	太平洋セメント	2,275,000	120.00	273,000,000		
	東海カーボン	2,275,000	435.00	989,625,000		
	TOTO	2,275,000	585.00	1,330,875,000		
	日本碍子	2,275,000	1,395.00	3,173,625,000		
	新日本製鐵	2,275,000	301.00	684,775,000		
	住友金属工業	2,275,000	209.00	475,475,000		
	神戸製鋼所	2,275,000	179.00	407,225,000		
	日新製鋼	2,275,000	148.00	336,700,000		
	ジェイ エフ イー ホールディングス	227,500	2,779.00	632,222,500		
	大平洋金属	2,275,000	604.00	1,374,100,000	貸付株式数	1,169,000
	日本軽金属	2,275,000	119.00	270,725,000		
	三井金属鉱業	2,275,000	238.00	541,450,000		
	東邦亜鉛	2,275,000	316.00	718,900,000		
	三菱マテリアル	2,275,000	235.00	534,625,000		
	住友金属鉱山	2,275,000	1,127.00	2,563,925,000		
	DOWAホールディングス	2,275,000	427.00	971,425,000	貸付株式数	33,000
	古河機械金属	2,275,000	95.00	216,125,000	貸付株式数	15,000
	古河電気工業	2,275,000	396.00	900,900,000		
	住友電気工業	2,275,000	1,050.00	2,388,750,000		
	フジクラ	2,275,000	381.00	866,775,000		
	SUMCO	227,500	1,586.00	360,815,000	貸付株式数	85,800
	東洋製罐	2,275,000	1,352.00	3,075,800,000		
	日本製鋼所	2,275,000	825.00	1,876,875,000	貸付株式数	1,172,000
	オークマ	2,275,000	550.00	1,251,250,000	貸付株式数	200,000
	小松製作所	2,275,000	1,691.00	3,847,025,000		
	住友重機械工業	2,275,000	543.00	1,235,325,000		
	日立建機	2,275,000	1,705.00	3,878,875,000	貸付株式数	1,203,600
	クボタ	2,275,000	685.00	1,558,375,000		
	荏原製作所	2,275,000	377.00	857,675,000	貸付株式数	16,000
	ダイキン工業	2,275,000	2,957.00	6,727,175,000		
	日本精工	2,275,000	620.00	1,410,500,000		
	NTN	2,275,000	372.00	846,300,000		
	ジェイテクト	2,275,000	856.00	1,947,400,000		
	日立造船	2,275,000	121.00	275,275,000	貸付株式数	1,274,000 (574,000)
	三菱重工業	2,275,000	317.00	721,175,000		
	IHI	2,275,000	148.00	336,700,000	貸付株式数	210,000
	コニカミノルタホールディングス	2,275,000	893.00	2,031,575,000		
	ミネベア	2,275,000	495.00	1,126,125,000		
	日立製作所	2,275,000	338.00	768,950,000		
	東芝	2,275,000	457.00	1,039,675,000		
	三菱電機	2,275,000	747.00	1,699,425,000		
	富士電機ホールディングス	2,275,000	250.00	568,750,000		
	明電舎	2,275,000	302.00	687,050,000	貸付株式数	1,292,000 (121,000)
	ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,275,000	574.00	1,305,850,000	貸付株式数	1,290,000 (1,022,000)
	日本電気	2,275,000	237.00	539,175,000		
	富士通	2,275,000	566.00	1,287,650,000		
	沖電気工業	2,275,000	77.00	175,175,000	貸付株式数	324,000
	パナソニック	2,275,000	1,178.00	2,679,950,000	貸付株式数	177,200
	シャープ	2,275,000	970.00	2,206,750,000	貸付株式数	382,000
	ソニー	2,275,000	2,423.00	5,512,325,000	貸付株式数	150,400
	TDK	2,275,000	5,020.00	11,420,500,000	貸付株式数	516,500
	三洋電機	2,275,000	119.00	270,725,000	貸付株式数	690,000
	ミツミ電機	2,275,000	1,508.00	3,430,700,000		
	アルプス電気	2,275,000	735.00	1,672,125,000		
	パイオニア	2,275,000	304.00	691,600,000		
	クラリオン	2,275,000	173.00	393,575,000	貸付株式数	1,290,000 (113,000)
	横河電機	2,275,000	569.00	1,294,475,000		
	アドバンテスト	4,550,000	1,881.00	8,558,550,000		
	カシオ計算機	2,275,000	570.00	1,296,750,000	貸付株式数	804,500
	ファナック	2,275,000	10,470.00	23,819,250,000		
	京セラ	2,275,000	7,420.00	16,880,500,000		
	太陽誘電	2,275,000	1,141.00	2,595,775,000		
	パナソニック電工	2,275,000	916.00	2,083,900,000		
	キヤノン	3,412,500	3,445.00	11,756,062,500	貸付株式数	14,700
	リコー	2,275,000	1,184.00	2,693,600,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	東京エレクトロン	2,275,000	4,900.00	11,147,500,000		
	デンソー	2,275,000	2,556.00	5,814,900,000		
	三井造船	2,275,000	195.00	443,625,000	貸付株式数	1,285,000 (1,006,000)
	川崎重工業	2,275,000	219.00	498,225,000		
	日産自動車	2,275,000	650.00	1,478,750,000		
	いすゞ自動車	2,275,000	266.00	605,150,000		
	トヨタ自動車	2,275,000	3,130.00	7,120,750,000	貸付株式数	280,000
	日野自動車	2,275,000	425.00	966,875,000		
	三菱自動車工業	2,275,000	116.00	263,900,000	貸付株式数	1,296,000 (769,000)
	マツダ	2,275,000	212.00	482,300,000		
	本田技研工業	4,550,000	2,616.00	11,902,800,000		
	スズキ	2,275,000	1,830.00	4,163,250,000		
	富士重工業	2,275,000	487.00	1,107,925,000		
	テルモ	2,275,000	4,375.00	9,953,125,000		
	ニコン	2,275,000	1,611.00	3,665,025,000		
	オリンパス	2,275,000	2,210.00	5,027,750,000		
	シチズンホールディングス	2,275,000	560.00	1,274,000,000		
	凸版印刷	2,275,000	737.00	1,676,675,000		
	大日本印刷	2,275,000	1,052.00	2,393,300,000		
	ヤマハ	2,275,000	939.00	2,136,225,000		
	東京電力	227,500	2,450.00	557,375,000		
	中部電力	227,500	2,242.00	510,055,000		
	関西電力	227,500	2,164.00	492,310,000		
	東京瓦斯	2,275,000	403.00	916,825,000		
	大阪瓦斯	2,275,000	326.00	741,650,000		
	東武鉄道	2,275,000	498.00	1,132,950,000	貸付株式数	1,032,000
	東京急行電鉄	2,275,000	378.00	859,950,000		
	小田急電鉄	2,275,000	782.00	1,779,050,000	貸付株式数	1,115,000 (1,044,000)
	京王電鉄	2,275,000	593.00	1,349,075,000	貸付株式数	170,000
	京成電鉄	2,275,000	547.00	1,244,425,000		
	東日本旅客鉄道	227,500	6,040.00	1,374,100,000		
	西日本旅客鉄道	2,275	329,000.00	748,475,000		
	東海旅客鉄道	2,275	748,000.00	1,701,700,000		
	日本通運	2,275,000	391.00	889,525,000		
	ヤマトホールディングス	2,275,000	1,148.00	2,611,700,000		
	日本郵船	2,275,000	327.00	743,925,000		
	商船三井	2,275,000	585.00	1,330,875,000		
	川崎汽船	2,275,000	359.00	816,725,000		
	全日本空輸	2,275,000	294.00	668,850,000	貸付株式数	302,000
	三菱倉庫	2,275,000	983.00	2,236,325,000	貸付株式数	260,000 (260,000)
	ヤフー	9,100	36,350.00	330,785,000	貸付株式数	284
	トレンドマイクロ	2,275,000	2,485.00	5,653,375,000		
	スカパーJ S A Tホールディングス	2,275	31,350.00	71,321,250	貸付株式数	1,288
	日本電信電話	227,500	3,770.00	857,675,000		
	K D D I	22,750	444,000.00	10,101,000,000		
	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	2,275	140,700.00	320,092,500		
	東宝	227,500	1,539.00	350,122,500		
	エヌ・ティ・ティ・データ	22,750	334,500.00	7,609,875,000		
	C S Kホールディングス	2,275,000	365.00	830,375,000	貸付株式数	1,283,200 (34,400)
	コナミ	2,275,000	1,391.00	3,164,525,000	貸付株式数	4,800
	ソフトバンク	6,825,000	2,370.00	16,175,250,000	貸付株式数	1,403,200 (1,403,200)
	双日	227,500	144.00	32,760,000		
	伊藤忠商事	2,275,000	709.00	1,612,975,000		
	丸紅	2,275,000	468.00	1,064,700,000		
	豊田通商	2,275,000	1,282.00	2,916,550,000		
	三井物産	2,275,000	1,114.00	2,534,350,000		
	住友商事	2,275,000	936.00	2,129,400,000		
	三菱商事	2,275,000	1,951.00	4,438,525,000		
	J . フロント リテイリング	2,275,000	429.00	975,975,000		
	三越伊勢丹ホールディングス	2,275,000	867.00	1,972,425,000		
	セブン&アイ・ホールディングス	2,275,000	2,069.00	4,706,975,000	貸付株式数	279,600
	高島屋	2,275,000	718.00	1,633,450,000	貸付株式数	1,221,000
	丸井グループ	2,275,000	647.00	1,471,925,000		
	イオン	2,275,000	946.00	2,152,150,000	貸付株式数	837,100 (526,900)
	ユニー	2,275,000	677.00	1,540,175,000		
	ファーストリテイリング	2,275,000	12,720.00	28,938,000,000		
	新生銀行	2,275,000	74.00	168,350,000	貸付株式数	1,263,000 (104,000)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,275,000	428.00	973,700,000		
	りそなホールディングス	227,500	1,091.00	248,202,500		
	中央三井トラスト・ホールディングス	2,275,000	333.00	757,575,000		
	三井住友フィナンシャルグループ	227,500	2,679.00	609,472,500		
	千葉銀行	2,275,000	562.00	1,278,550,000		
	横浜銀行	2,275,000	430.00	978,250,000		
	ふくおかフィナンシャルグループ	2,275,000	387.00	880,425,000		
	静岡銀行	2,275,000	783.00	1,781,325,000		
	住友信託銀行	2,275,000	489.00	1,112,475,000		
	みずほ信託銀行	2,275,000	76.00	172,900,000	貸付株式数	851,000 (191,000)
	みずほフィナンシャルグループ	2,275,000	141.00	320,775,000	貸付株式数	1,295,400 (5,300)
	大和証券グループ本社	2,275,000	397.00	903,175,000		
	野村ホールディングス	2,275,000	488.00	1,110,200,000		
	みずほ証券	2,275,000	207.00	470,925,000		
	松井証券	2,275,000	526.00	1,196,650,000	貸付株式数	260,800 (191,800)
	NK S Jホールディングス	2,275,000	552.00	1,255,800,000		
	M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	682,500	1,945.00	1,327,462,500		
	東京海上ホールディングス	1,137,500	2,457.00	2,794,837,500		
	T & Dホールディングス	227,500	1,947.00	442,942,500		
	クレディセゾン	2,275,000	1,003.00	2,281,825,000		
	三井不動産	2,275,000	1,326.00	3,016,650,000		
	三菱地所	2,275,000	1,289.00	2,932,475,000		
	平和不動産	2,275,000	209.00	475,475,000		
	東急不動産	2,275,000	318.00	723,450,000	貸付株式数	171,000 (171,000)
	住友不動産	2,275,000	1,550.00	3,526,250,000		
電通	2,275,000	2,332.00	5,305,300,000	貸付株式数	235,400	
東京ドーム	2,275,000	227.00	516,425,000			
セコム	2,275,000	4,090.00	9,304,750,000			
計	銘柄数：225			535,750,101,250		
	組入時価比率：99.9%			100%		
合計				535,750,101,250		

(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 貸付株式の( )内は、委託者の利害関係人である野村證券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2)株式以外の有価証券(平成 22 年 7 月 8 日現在)  
該当事項はございません。

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。