

平成23年7月期 中間決算短信（平成22年7月9日～平成23年1月8日）

平成23年2月15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

半期報告書提出予定日 平成23年3月31日

I ファンドの運用状況

1. 平成23年1月中間期の運用状況（平成22年7月9日～平成23年1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23年1月中間期	535,824	(99.2)	4,480	(0.8)	540,305	(100)
平成22年1月中間期	562,572	(99.2)	4,536	(0.8)	567,108	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成23年1月中間期	56,096	19,561	24,883	50,774
平成22年1月中間期	56,920	30,360	35,220	52,060

(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/当中間計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
平成23年1月中間期	562,551	22,246	540,305	106,412
平成22年1月中間期	591,119	24,010	567,108	108,933

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 中間財務諸表等

【日経 225 連動型上場投資信託】

(1) 【中間貸借対照表】

期別	第 9 期中間計算期間末 平成 22 年 1 月 8 日現在	第 10 期中間計算期間末 平成 23 年 1 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	24,477,849,442	23,470,715,191
株式	562,572,092,900	535,824,584,400
派生商品評価勘定	4,245,590	4,911,810
未収配当金	640,004,000	668,557,000
未収利息	13,405	77,651
その他未収収益	1,810,201	1,168,198
預有価証券	3,423,770,610	2,581,594,000
流動資産合計	591,119,786,148	562,551,608,250
資産合計	591,119,786,148	562,551,608,250
負債の部		
流動負債		
前受金	750,000	500,000
未払解約金	3,423,770,610	2,581,594,000
未払受託者報酬	221,656,953	189,720,445
未払委託者報酬	475,157,523	406,543,745
未払利息	299,868	251,985
有価証券貸借取引受入金	19,882,943,251	19,062,325,905
その他未払費用	6,334,618	5,420,529
流動負債合計	24,010,912,823	22,246,356,609
負債合計	24,010,912,823	22,246,356,609
純資産の部		
元本等		
元本	640,707,736,624	624,886,275,862
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△73,598,863,299	△84,581,024,221
(分配準備積立金)	459,342,346	454,933,291
元本等合計	567,108,873,325	540,305,251,641
純資産合計	567,108,873,325	540,305,251,641
負債純資産合計	591,119,786,148	562,551,608,250

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

期別	第 9 期中間計算期間 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 日	第 10 期中間計算期間 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 1 月 8 日
科目	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	4,625,794,360	4,450,699,660
受取利息	18,033,451	11,873,501
有価証券売買等損益	66,736,474,398	55,879,771,619
派生商品取引等損益	2,176,330	16,771,210
その他収益	65,773,340	34,411,868
営業収益合計	71,448,251,879	60,393,527,858
営業費用		
支払利息	10,837,734	6,403,246
受託者報酬	221,656,953	189,720,445
委託者報酬	475,157,523	406,543,745
その他費用	10,758,406	10,175,357
営業費用合計	718,410,616	612,842,793
営業利益	70,729,841,263	59,780,685,065
経常利益	70,729,841,263	59,780,685,065
中間純利益	70,729,841,263	59,780,685,065
一部交換に伴う中間純利益金額の分配額	—	—
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△162,511,409,680	△154,119,605,573
剰余金増加額又は欠損金減少額	78,340,249,788	64,276,975,147
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	78,340,249,788	64,276,975,147
剰余金減少額又は欠損金増加額	60,157,544,670	54,519,078,860
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	60,157,544,670	54,519,078,860
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△73,598,863,299	△84,581,024,221

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 9 期中間計算期間 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 日	第 10 期中間計算期間 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 1 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 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。 なお、当該中間計算期間は、平成 21 年 7 月 9 日から平成 22 年 1 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 22 年 7 月 9 日から平成 23 年 7 月 8 日までとなっております。 なお、当該中間計算期間は、平成 22 年 7 月 9 日から平成 23 年 1 月 8 日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第 9 期中間計算期間末 平成 22 年 1 月 8 日現在	第 10 期中間計算期間末 平成 23 年 1 月 8 日現在
1 中間計算期間の末日における受益権の総数 52,060,432 口	1 中間計算期間の末日における受益権の総数 50,774,866 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 73,598,863,299 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 84,581,024,221 円
3 中間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 10,893.3 円 (10 口当たり純資産額 108,933 円)	3 中間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 10,641.2 円 (10 口当たり純資産額 106,412 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 19,175,243,950 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 18,427,981,100 円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第 9 期中間計算期間末 平成 22 年 1 月 8 日現在	第 10 期中間計算期間末 平成 23 年 1 月 8 日現在
—	<p>1 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間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 2 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> <p>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。 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>

(その他の注記)

1 元本の移動

第 9 期中間計算期間 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 日	第 10 期中間計算期間 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 1 月 8 日
期首元本額 700,522,267,252 円	期首元本額 690,384,634,449 円
期中追加設定元本額 373,649,257,970 円	期中追加設定元本額 240,743,626,640 円
期中一部交換元本額 433,463,788,598 円	期中一部交換元本額 306,241,985,227 円

2 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 9 期中間計算期間末(平成 22 年 1 月 8 日現在)				第 10 期中間計算期間末(平成 23 年 1 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	71,420,000	—	75,670,000	4,245,590	132,230,000	—	137,150,000	4,911,810
合計	71,420,000	—	75,670,000	4,245,590	132,230,000	—	137,150,000	4,911,810

(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。