

平成23年7月期（平成22年7月9日～平成23年7月8日）決算短信

平成23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 CEO兼執行役会長 岩崎 俊博
 問合せ先責任者 投信ディスクロージャー部長 森保 一美 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成23年9月29日
 分配金支払開始予定日 平成23年8月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成23年7月期の運用状況（平成22年7月9日～平成23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23年7月期	651,207	(99.9)	757	(0.1)	651,965	(100)
平成22年7月期	535,750	(99.9)	514	(0.1)	536,265	(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23年7月期	56,096	38,868	31,010	63,954
平成22年7月期	56,920	59,848	60,672	56,096

(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23年7月期	684,228	32,262	651,965	101,942
平成22年7月期	570,260	33,995	536,265	95,596

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成23年7月期	1,380.00
平成22年7月期	1,530.00

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 9 期 平成 22 年 7 月 8 日現在	第 10 期 平成 23 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	34,058,247,572	32,481,802,085
株式	535,750,101,250	651,207,646,640
派生商品評価勘定		12,099,290
未収配当金	439,391,500	525,900,000
未収利息	27,736	24,229
その他未収収益	8,014,767	850,460
差入委託証拠金	4,770,000	
流動資産合計	570,260,552,825	684,228,322,704
資産合計	570,260,552,825	684,228,322,704
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,573,150	
前受金		550,000
未払収益分配金	8,582,826,771	8,825,769,576
未払受託者報酬	203,994,297	201,252,326
未払委託者報酬	437,346,729	431,254,924
未払利息	1,845,737	269,689
有価証券貸借取引受入金	24,762,106,950	22,797,830,580
その他未払費用	5,830,315	5,750,005
流動負債合計	33,995,523,949	32,262,677,100
負債合計	33,995,523,949	32,262,677,100
純資産の部		
元本等		
元本	690,384,634,449	787,092,363,564
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金() (分配準備積立金)	154,119,605,573 454,933,291	135,126,717,960 578,523,467
元本等合計	536,265,028,876	651,965,645,604
純資産合計	536,265,028,876	651,965,645,604
負債純資産合計	570,260,552,825	684,228,322,704

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第 9 期	第 10 期
		自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日	自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 月 8 日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		9,814,239,140	10,121,359,868
受取利息		30,926,019	24,332,241
有価証券売買等損益		6,103,343,441	39,894,728,589
派生商品取引等損益		2,109,500	16,999,160
その他収益		105,409,921	60,848,024
営業収益合計		16,051,809,021	50,118,267,882
営業費用			
支払利息		17,413,141	12,483,579
受託者報酬		425,651,250	390,972,771
委託者報酬		912,504,252	837,798,669
その他費用		16,588,721	15,925,362
営業費用合計		1,372,157,364	1,257,180,381
営業利益		14,679,651,657	48,861,087,501
経常利益		14,679,651,657	48,861,087,501
当期純利益		14,679,651,657	48,861,087,501
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()		162,511,409,680	154,119,605,573
剰余金増加額又は欠損金減少額		106,245,478,093	80,672,636,545
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額		106,245,478,093	80,672,636,545
剰余金減少額又は欠損金増加額		103,950,498,872	101,715,066,857
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額		103,950,498,872	101,715,066,857
分配金		8,582,826,771	8,825,769,576
期末剰余金又は期末欠損金()		154,119,605,573	135,126,717,960

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日	第 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 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 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 約定日基準で計上しております。	(1) 受取配当金 同左 (2) 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 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。	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。

(貸借対照表に関する注記)

第 9 期 平成 22 年 7 月 8 日現在	第 10 期 平成 23 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 56,096,907 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 63,954,852 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 154,119,605,573 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 135,126,717,960 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)	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 10,194.2 円 (10 口当たり純資産額 101,942 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	4 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 21,806,765,100 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日	第 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 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 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。	1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 9,404,293,043 円 (10 口当たり 1,470 円)のうち、8,825,769,576 円 (10 口当たり 1,380 円)を分配金額としております。																																																												
<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: center;">B</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: right;">9,933,161,939 円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: right;">459,342,346 円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: right;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">10,392,504,285 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: right;">D</td> <td style="text-align: right;">1,354,744,223 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: right;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">9,037,760,062 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: right;">F</td> <td style="text-align: right;">8,582,826,771 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: right;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">454,933,291 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: right;">H</td> <td style="text-align: right;">56,096,907 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td style="text-align: right;">I = F / H × 10</td> <td style="text-align: right;">1,530 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	B	当期配当等収益額	9,933,161,939 円		分配準備積立金	459,342,346 円		配当等収益合計額	C = A + B	10,392,504,285 円	経費	D	1,354,744,223 円	収益分配可能額	E = C - D	9,037,760,062 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	454,933,291 円	口数	H	56,096,907 口	10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,530 円	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: center;">B</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: right;">10,194,056,554 円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: right;">454,933,291 円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: right;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">10,648,989,845 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: right;">D</td> <td style="text-align: right;">1,244,696,802 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: right;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">9,404,293,043 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: right;">F</td> <td style="text-align: right;">8,825,769,576 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: right;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">578,523,467 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: right;">H</td> <td style="text-align: right;">63,954,852 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td style="text-align: right;">I = F / H × 10</td> <td style="text-align: right;">1,380 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	B	当期配当等収益額	10,194,056,554 円		分配準備積立金	454,933,291 円		配当等収益合計額	C = A + B	10,648,989,845 円	経費	D	1,244,696,802 円	収益分配可能額	E = C - D	9,404,293,043 円	収益分配金	F	8,825,769,576 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	578,523,467 円	口数	H	63,954,852 口	10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,380 円
項目	A	B																																																											
当期配当等収益額	9,933,161,939 円																																																												
分配準備積立金	459,342,346 円																																																												
配当等収益合計額	C = A + B	10,392,504,285 円																																																											
経費	D	1,354,744,223 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	9,037,760,062 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	454,933,291 円																																																											
口数	H	56,096,907 口																																																											
10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,530 円																																																											
項目	A	B																																																											
当期配当等収益額	10,194,056,554 円																																																												
分配準備積立金	454,933,291 円																																																												
配当等収益合計額	C = A + B	10,648,989,845 円																																																											
経費	D	1,244,696,802 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	9,404,293,043 円																																																											
収益分配金	F	8,825,769,576 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	578,523,467 円																																																											
口数	H	63,954,852 口																																																											
10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,380 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 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日	第 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 月 8 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> <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>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>	<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> <p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第 9 期 平成 22 年 7 月 8 日現在	第 10 期 平成 23 年 7 月 8 日現在
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。	1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。	2 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日	第 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 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 9 期 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 7 月 8 日	第 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 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 736,559,796,950 円	期中追加設定元本額 478,353,152,660 円
期中一部交換元本額 746,697,429,753 円	期中一部交換元本額 381,645,423,545 円

2 有価証券関係
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	第 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 月 8 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	31,513,835,263	36,597,829,862
合計	31,513,835,263	36,597,829,862

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 9 期(平成 22 年 7 月 8 日現在)			第 10 期(平成 23 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)
市場取引						
先物取引						
株価指数先物取引						
買建	49,270,000	47,700,000	1,573,150	160,610,000	172,720,000	12,099,290
合計	49,270,000	47,700,000	1,573,150	160,610,000	172,720,000	12,099,290

(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 23 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	2,578,000	269.00	693,482,000		
	マルハニチロホールディングス	2,578,000	129.00	332,562,000	貸付株式数	766,000 (733,000)
	国際石油開発帝石	2,578	612,000.00	1,577,736,000		
	コムシスホールディングス	2,578,000	812.00	2,093,336,000	貸付株式数	137,900 (137,900)
	大成建設	2,578,000	189.00	487,242,000		
	大林組	2,578,000	358.00	922,924,000		
	清水建設	2,578,000	343.00	884,254,000		
	鹿島建設	2,578,000	245.00	631,610,000	貸付株式数	1,269,000
	大和ハウス工業	2,578,000	1,037.00	2,673,386,000		
	積水ハウス	2,578,000	756.00	1,948,968,000	貸付株式数	152,000
	日揮	2,578,000	2,310.00	5,955,180,000		
	千代田化工建設	2,578,000	963.00	2,482,614,000		
	日清製粉グループ本社	2,578,000	1,009.00	2,601,202,000		
	明治ホールディングス	257,800	3,450.00	889,410,000		
	日本ハム	2,578,000	1,156.00	2,980,168,000		
	サッポロホールディングス	2,578,000	333.00	858,474,000	貸付株式数	1,299,000
	アサヒグループホールディングス	2,578,000	1,632.00	4,207,296,000	貸付株式数	51,600
	キリンホールディングス	2,578,000	1,138.00	2,933,764,000		
	宝ホールディングス	2,578,000	427.00	1,100,806,000	貸付株式数	343,000 (343,000)
	キッコーマン	2,578,000	867.00	2,235,126,000		
	味の素	2,578,000	990.00	2,552,220,000		
	ニチレイ	2,578,000	354.00	912,612,000		
	日本たばこ産業	12,890	324,000.00	4,176,360,000		
	東洋紡績	2,578,000	120.00	309,360,000		
	ユニチカ	2,578,000	60.00	154,680,000	貸付株式数	1,333,000 (1,333,000)
	日清紡ホールディングス	2,578,000	797.00	2,054,666,000		
	帝人	2,578,000	360.00	928,080,000		
	東レ	2,578,000	615.00	1,585,470,000		
	王子製紙	2,578,000	411.00	1,059,558,000		
	三菱製紙	2,578,000	88.00	226,864,000	貸付株式数	13,000
	北越紀州製紙	2,578,000	521.00	1,343,138,000		
	日本製紙グループ本社	257,800	1,919.00	494,718,200		
	クラレ	2,578,000	1,219.00	3,142,582,000		
	旭化成	2,578,000	550.00	1,417,900,000		
	昭和電工	2,578,000	170.00	438,260,000		
	住友化学	2,578,000	410.00	1,056,980,000		
	日産化学工業	2,578,000	916.00	2,361,448,000		
	日本書達	2,578,000	355.00	915,190,000		
	東ソー	2,578,000	338.00	871,364,000	貸付株式数	122,000
	電気化学工業	2,578,000	400.00	1,031,200,000		
	信越化学工業	2,578,000	4,380.00	11,291,640,000		
	三井化学	2,578,000	294.00	757,932,000		
	三菱ケミカルホールディングス	1,289,000	585.00	754,065,000		
	宇部興産	2,578,000	266.00	685,748,000		
	日本化薬	2,578,000	869.00	2,240,282,000		
	花王	2,578,000	2,156.00	5,558,168,000		
	富士フイルムホールディングス	2,578,000	2,515.00	6,483,670,000		
	資生堂	2,578,000	1,539.00	3,967,542,000		
	協和発酵キリン	2,578,000	822.00	2,119,116,000		
	武田薬品工業	2,578,000	3,740.00	9,641,720,000		
	アステラス製薬	2,578,000	3,135.00	8,082,030,000		
	大日本住友製薬	2,578,000	780.00	2,010,840,000	貸付株式数	76,800
	塩野義製薬	2,578,000	1,366.00	3,521,548,000		
	中外製薬	2,578,000	1,357.00	3,498,346,000		
	エーザイ	2,578,000	3,140.00	8,094,920,000	貸付株式数	874,200 (22,400)
	第一三共	2,578,000	1,617.00	4,168,626,000		
	昭和シェル石油	2,578,000	769.00	1,982,482,000		
	JXホールディングス	2,578,000	551.00	1,420,478,000		
	横浜ゴム	2,578,000	477.00	1,229,706,000		
	ブリヂストン	2,578,000	1,954.00	5,037,412,000		
	日東紡績	2,578,000	200.00	515,600,000	貸付株式数	62,000
	旭硝子	2,578,000	962.00	2,480,036,000		
	日本板硝子	2,578,000	254.00	654,812,000	貸付株式数	203,000

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	日本電気硝子	3,867,000	1,092.00	4,222,764,000		
	住友大阪セメント	2,578,000	224.00	577,472,000		
	太平洋セメント	2,578,000	163.00	420,214,000	貸付株式数	1,333,000 (768,000)
	東海カーボン	2,578,000	447.00	1,152,366,000		
	TOTO	2,578,000	631.00	1,626,718,000	貸付株式数	625,000
	日本碍子	2,578,000	1,474.00	3,799,972,000		
	新日本製鐵	2,578,000	267.00	688,326,000		
	住友金属工業	2,578,000	184.00	474,352,000		
	神戸製鋼所	2,578,000	185.00	476,930,000		
	日新製鋼	2,578,000	157.00	404,746,000	貸付株式数	196,000
	ジェイ エフ イー ホールディングス	257,800	2,198.00	566,644,400		
	大平洋金属	2,578,000	618.00	1,593,204,000		
	日本軽金属	2,578,000	168.00	433,104,000	貸付株式数	32,000
	三井金属鉱業	2,578,000	282.00	726,996,000	貸付株式数	112,000
	東邦亜鉛	2,578,000	396.00	1,020,888,000	貸付株式数	632,000 (454,000)
	三菱マテリアル	2,578,000	257.00	662,546,000		
	住友金属鉱山	2,578,000	1,347.00	3,472,566,000		
	DOWAホールディングス	2,578,000	529.00	1,363,762,000	貸付株式数	353,000 (125,000)
	古河機械金属	2,578,000	84.00	216,552,000		
	古河電気工業	2,578,000	332.00	855,896,000	貸付株式数	131,000
	住友電気工業	2,578,000	1,217.00	3,137,426,000		
	フジクラ	2,578,000	386.00	995,108,000	貸付株式数	321,000
	SUMCO	257,800	1,407.00	362,724,600	貸付株式数	131,100
	東洋製罐	2,578,000	1,398.00	3,604,044,000		
	日本製鋼所	2,578,000	585.00	1,508,130,000	貸付株式数	231,000
	オクマ	2,578,000	823.00	2,121,694,000	貸付株式数	437,000 (247,000)
	小松製作所	2,578,000	2,543.00	6,555,854,000	貸付株式数	1,244,800
	住友重機械工業	2,578,000	553.00	1,425,634,000		
	日立建機	2,578,000	1,806.00	4,655,868,000	貸付株式数	1,322,000 (1,800)
	クボタ	2,578,000	757.00	1,951,546,000		
	荏原製作所	2,578,000	484.00	1,247,752,000	貸付株式数	39,000
	ダイキン工業	2,578,000	2,913.00	7,509,714,000		
	日本精工	2,578,000	802.00	2,067,556,000		
	NTN	2,578,000	469.00	1,209,082,000		
	ジェイテクト	2,578,000	1,192.00	3,072,976,000		
	日立造船	2,578,000	127.00	327,406,000	貸付株式数	880,500
	三菱重工業	2,578,000	384.00	989,952,000	貸付株式数	221,000 (221,000)
	IHI	2,578,000	212.00	546,536,000		
	コニカミノルタホールディングス	2,578,000	688.00	1,773,664,000		
	ミネベア	2,578,000	438.00	1,129,164,000		
	日立製作所	2,578,000	483.00	1,245,174,000		
	東芝	2,578,000	424.00	1,093,072,000		
	三菱電機	2,578,000	943.00	2,431,054,000		
	富士電機	2,578,000	260.00	670,280,000	貸付株式数	117,000
	安川電機	2,578,000	909.00	2,343,402,000		
	明電舎	2,578,000	357.00	920,346,000	貸付株式数	1,297,000
	ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,578,000	556.00	1,433,368,000	貸付株式数	1,309,000 (444,000)
	日本電気	2,578,000	190.00	489,820,000		
	富士通	2,578,000	483.00	1,245,174,000		
	沖電気工業	2,578,000	82.00	211,396,000		
	パナソニック	2,578,000	1,009.00	2,601,202,000		
	シャープ	2,578,000	756.00	1,948,968,000		
	ソニー	2,578,000	2,207.00	5,689,646,000		
	TDK	2,578,000	4,530.00	11,678,340,000		
	ミツミ電機	2,578,000	860.00	2,217,080,000		
	アルプス電気	2,578,000	848.00	2,186,144,000		
	パイオニア	2,578,000	387.00	997,686,000		
	横河電機	2,578,000	722.00	1,861,316,000		
	アドバンテスト	5,156,000	1,570.00	8,094,920,000	貸付株式数	340,600
	カシオ計算機	2,578,000	586.00	1,510,708,000	貸付株式数	510,100 (33,000)
	ファナック	2,578,000	14,200.00	36,607,600,000		
	京セラ	2,578,000	8,480.00	21,861,440,000		
	太陽誘電	2,578,000	1,071.00	2,761,038,000	貸付株式数	338,000
	大日本スクリーン製造	2,578,000	713.00	1,838,114,000		
	キヤノン	3,867,000	3,920.00	15,158,640,000	貸付株式数	181,000
	リコー	2,578,000	926.00	2,387,228,000		
	東京エレクトロン	2,578,000	4,565.00	11,768,570,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	デンソー	2,578,000	2,923.00	7,535,494,000		
	三井造船	2,578,000	177.00	456,306,000	貸付株式数	987,000 (973,000)
	川崎重工業	2,578,000	317.00	817,226,000	貸付株式数	222,000
	日産自動車	2,578,000	870.00	2,242,860,000		
	いすゞ自動車	2,578,000	388.00	1,000,264,000		
	トヨタ自動車	2,578,000	3,445.00	8,881,210,000		
	日野自動車	2,578,000	477.00	1,229,706,000	貸付株式数	25,000
	三菱自動車工業	2,578,000	106.00	273,268,000	貸付株式数	557,000
	マツダ	2,578,000	222.00	572,316,000	貸付株式数	135,000
	本田技研工業	5,156,000	3,260.00	16,808,560,000		
	スズキ	2,578,000	1,871.00	4,823,438,000		
	富士重工業	2,578,000	640.00	1,649,920,000		
	テルモ	2,578,000	4,465.00	11,510,770,000		
	ニコン	2,578,000	1,925.00	4,962,650,000	貸付株式数	117,400
	オリンパス	2,578,000	2,743.00	7,071,454,000	貸付株式数	102,400 (28,700)
	シチズンホールディングス	2,578,000	491.00	1,265,798,000		
	凸版印刷	2,578,000	643.00	1,657,654,000		
	大日本印刷	2,578,000	949.00	2,446,522,000		
	ヤマハ	2,578,000	949.00	2,446,522,000		
	東京電力	257,800	411.00	105,955,800	貸付株式数	131,300 (200)
	中部電力	257,800	1,469.00	378,708,200		
	関西電力	257,800	1,475.00	380,255,000		
	東京瓦斯	2,578,000	376.00	969,328,000		
	大阪瓦斯	2,578,000	316.00	814,648,000		
	東武鉄道	2,578,000	345.00	889,410,000	貸付株式数	1,244,000
	東京急行電鉄	2,578,000	345.00	889,410,000		
	小田急電鉄	2,578,000	655.00	1,688,590,000	貸付株式数	1,304,000 (979,000)
	京王電鉄	2,578,000	464.00	1,196,192,000		
	京成電鉄	2,578,000	489.00	1,260,642,000		
	東日本旅客鉄道	257,800	4,815.00	1,241,307,000		
	西日本旅客鉄道	257,800	3,260.00	840,428,000		
	東海旅客鉄道	2,578	643,000.00	1,657,654,000		
	日本通運	2,578,000	337.00	868,786,000		
	ヤマトホールディングス	2,578,000	1,321.00	3,405,538,000		
	日本郵船	2,578,000	306.00	788,868,000	貸付株式数	250,000
	商船三井	2,578,000	446.00	1,149,788,000		
	川崎汽船	2,578,000	289.00	745,042,000	貸付株式数	205,000
	全日本空輸	2,578,000	270.00	696,060,000	貸付株式数	1,299,000 (136,000)
	三菱倉庫	2,578,000	935.00	2,410,430,000	貸付株式数	433,000 (433,000)
	ヤフー	10,312	27,970.00	288,426,640		
	トレンドマイクロ	2,578,000	2,639.00	6,803,342,000	貸付株式数	46,900
	スカパーJ S A Tホールディングス	2,578	34,400.00	88,683,200	貸付株式数	855
	日本電信電話	257,800	3,885.00	1,001,553,000		
	K D D I	25,780	573,000.00	14,771,940,000		
	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	2,578	144,200.00	371,747,600		
	東宝	257,800	1,365.00	351,897,000	貸付株式数	300
	エヌ・ティ・ティ・データ	25,780	282,300.00	7,277,694,000		
	C S K	2,578,000	328.00	845,584,000	貸付株式数	539,900
	コナミ	2,578,000	1,989.00	5,127,642,000		
	ソフトバンク	7,734,000	3,110.00	24,052,740,000	貸付株式数	24,400
	双日	257,800	157.00	40,474,600		
	伊藤忠商事	2,578,000	880.00	2,268,640,000		
	丸紅	2,578,000	571.00	1,472,038,000		
	豊田通商	2,578,000	1,431.00	3,689,118,000		
	三井物産	2,578,000	1,434.00	3,696,852,000		
	住友商事	2,578,000	1,117.00	2,879,626,000		
	三菱商事	2,578,000	2,099.00	5,411,222,000		
	J . フロント リテイリング	2,578,000	371.00	956,438,000		
	三越伊勢丹ホールディングス	2,578,000	808.00	2,083,024,000	貸付株式数	195,600 (195,600)
	セブン&アイ・ホールディングス	2,578,000	2,247.00	5,792,766,000		
	高島屋	2,578,000	578.00	1,490,084,000	貸付株式数	994,000
	丸井グループ	2,578,000	630.00	1,624,140,000		
	イオン	2,578,000	983.00	2,534,174,000	貸付株式数	1,333,800 (730,900)
	ユニー	2,578,000	785.00	2,023,730,000		
	ファーストリテイリング	2,578,000	13,290.00	34,261,620,000	貸付株式数	19,300
	新生銀行	2,578,000	87.00	224,286,000	貸付株式数	1,285,000
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,578,000	415.00	1,069,870,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	りそなホールディングス	257,800	412.00	106,213,600		
	三井住友トラスト・ホールディングス	2,578,000	298.00	768,244,000		
	三井住友フィナンシャルグループ	257,800	2,569.00	662,288,200		
	千葉銀行	2,578,000	512.00	1,319,936,000		
	横浜銀行	2,578,000	410.00	1,056,980,000		
	ふくおかフィナンシャルグループ	2,578,000	352.00	907,456,000		
	静岡銀行	2,578,000	758.00	1,954,124,000		
	みずほ信託銀行	2,578,000	74.00	190,772,000	貸付株式数	191,000 (191,000)
	みずほフィナンシャルグループ	2,578,000	135.00	348,030,000		
	大和証券グループ本社	2,578,000	357.00	920,346,000	貸付株式数	1,333,000
	野村ホールディングス	2,578,000	404.00	1,041,512,000		
	みずほ証券	2,578,000	199.00	513,022,000		
	松井証券	2,578,000	413.00	1,064,714,000	貸付株式数	572,800 (251,800)
	NK S Jホールディングス	2,578,000	538.00	1,386,964,000		
	M S & A D インシュアランスグループホールディングス	773,400	1,984.00	1,534,425,600		
	第一生命保険	2,578	122,000.00	314,516,000		
	東京海上ホールディングス	1,289,000	2,380.00	3,067,820,000		
	T & Dホールディングス	257,800	2,035.00	524,623,000		
	クレディセゾン	2,578,000	1,373.00	3,539,594,000		
	三井不動産	2,578,000	1,462.00	3,769,036,000		
	三菱地所	2,578,000	1,488.00	3,836,064,000		
	平和不動産	2,578,000	190.00	489,820,000		
	東京建物	2,578,000	313.00	806,914,000		
	東急不動産	2,578,000	358.00	922,924,000		
	住友不動産	2,578,000	1,907.00	4,916,246,000		
	電通	2,578,000	2,452.00	6,321,256,000		
	東京ドーム	2,578,000	164.00	422,792,000	貸付株式数	189,000
セコム	2,578,000	3,900.00	10,054,200,000			
計	銘柄数 : 225			651,207,646,640		
	組入時価比率 : 99.9%			100%		
合計				651,207,646,640		

(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証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 23 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。