

平成23年7月期（平成22年7月11日～平成23年7月10日）決算短信

平成23年8月19日

上場取引所 東京・大阪・名古屋
福岡・札幌

ファンド名 日経300株価指数連動型上場投資信託
 コード番号 (1319)
 連動対象指標 日経300指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 1000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18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11日～平成23年7月10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	8,162	(99.8)	13	(0.2)	8,176	(100)
平成22年7月期	10,568	(99.9)	15	(0.1)	10,584	(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	61,225	0	14,690	46,534
平成22年7月期	61,225	0	0	61,225

(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23年7月期	8,338	161	8,176	17,570
平成22年7月期	10,751	167	10,584	17,287

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成23年7月期	282.10
平成22年7月期	207.00

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 300 株価指数連動型上場投資信託】

(1) 【貸借対照表】

期別	第 16 期 平成 22 年 7 月 10 日現在	第 17 期 平成 23 年 7 月 10 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	173,279,682	166,409,725
株式	10,568,662,050	8,162,448,910
未収配当金	9,230,100	9,154,050
未収利息	1,024	1,230
流動資産合計	10,751,172,856	8,338,013,915
資産合計	10,751,172,856	8,338,013,915
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	126,736,408	131,275,226
未払受託者報酬	7,714,762	5,863,676
未払委託者報酬	32,401,897	24,627,429
その他未払費用	154,238	117,164
流動負債合計	167,007,305	161,883,495
負債合計	167,007,305	161,883,495
純資産の部		
元本等		
元本	14,816,526,956	11,261,469,274
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,232,361,405	3,085,338,854
(分配準備積立金)	9,241,661	9,176,641
元本等合計	10,584,165,551	8,176,130,420
純資産合計	10,584,165,551	8,176,130,420
負債純資産合計	10,751,172,856	8,338,013,915

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第 16 期	第 17 期
		自 平成 21 年 7 月 11 日 至 平成 22 年 7 月 10 日	自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		207,789,216	199,666,973
受取利息		77,406	65,641
有価証券売買等損益		44,584,224	140,685,763
その他収益		279,284	194,851
営業収益合計		163,561,682	340,613,228
営業費用			
受託者報酬		15,557,392	13,164,277
委託者報酬		65,340,843	55,289,872
その他費用		311,038	263,110
営業費用合計		81,209,273	68,717,259
営業利益		82,352,409	271,895,969
経常利益		82,352,409	271,895,969
当期純利益		82,352,409	271,895,969
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()		4,187,977,406	4,232,361,405
剰余金増加額又は欠損金減少額			1,006,401,808
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額			1,006,401,808
剰余金減少額又は欠損金増加額			
分配金		126,736,408	131,275,226
期末剰余金又は期末欠損金()		4,232,361,405	3,085,338,854

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 21 年 7 月 11 日 至 平成 22 年 7 月 10 日	自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 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。	(1) 株式 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 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 同左
3 その他	当ファンドの計算期間は、平成 21 年 7 月 11 日から平成 22 年 7 月 10 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 11 日から平成 23 年 7 月 10 日ま でとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 16 期 平成 22 年 7 月 10 日現在	第 17 期 平成 23 年 7 月 10 日現在
1 計算期間の末日における受益権の総数 61,225,318 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 46,534,997 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 4,232,361,405 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 3,085,338,854 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 172.87 円 (100 口当たり純資産額 17,287 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 175.70 円 (100 口当たり純資産額 17,570 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 16 期 自 平成 21 年 7 月 11 日 至 平成 22 年 7 月 10 日	第 17 期 自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 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 135,978,069 円 (100 口当たり 222 円 09 銭)のうち、126,736,408 円 (100 口当たり 207 円 00 銭)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 140,451,867 円 (100 口当たり 301 円 81 銭)のうち、131,275,226 円 (100 口当たり 282 円 10 銭)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: right;">208,145,906 円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">208,145,906 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">9,041,436 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">217,187,342 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">81,209,273 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">135,978,069 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">126,736,408 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">9,241,661 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">61,225,318 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I = F / H × 100</td> <td style="text-align: right;">207 円 00 銭</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	208,145,906 円	当期配当等収益額	A	208,145,906 円	分配準備積立金	B	9,041,436 円	配当等収益合計額	C = A + B	217,187,342 円	経費	D	81,209,273 円	収益分配可能額	E = C - D	135,978,069 円	収益分配金	F	126,736,408 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	9,241,661 円	口数	H	61,225,318 口	100 口当たり分配金	I = F / H × 100	207 円 00 銭	<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: right;">199,927,465 円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">199,927,465 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">9,241,661 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">209,169,126 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">68,717,259 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">140,451,867 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">131,275,226 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">9,176,641 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">46,534,997 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I = F / H × 100</td> <td style="text-align: right;">282 円 10 銭</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	199,927,465 円	当期配当等収益額	A	199,927,465 円	分配準備積立金	B	9,241,661 円	配当等収益合計額	C = A + B	209,169,126 円	経費	D	68,717,259 円	収益分配可能額	E = C - D	140,451,867 円	収益分配金	F	131,275,226 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	9,176,641 円	口数	H	46,534,997 口	100 口当たり分配金	I = F / H × 100	282 円 10 銭
項目	A	208,145,906 円																																																											
当期配当等収益額	A	208,145,906 円																																																											
分配準備積立金	B	9,041,436 円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	217,187,342 円																																																											
経費	D	81,209,273 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	135,978,069 円																																																											
収益分配金	F	126,736,408 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	9,241,661 円																																																											
口数	H	61,225,318 口																																																											
100 口当たり分配金	I = F / H × 100	207 円 00 銭																																																											
項目	A	199,927,465 円																																																											
当期配当等収益額	A	199,927,465 円																																																											
分配準備積立金	B	9,241,661 円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	209,169,126 円																																																											
経費	D	68,717,259 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	140,451,867 円																																																											
収益分配金	F	131,275,226 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	9,176,641 円																																																											
口数	H	46,534,997 口																																																											
100 口当たり分配金	I = F / H × 100	282 円 10 銭																																																											

(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 16 期 自 平成 21 年 7 月 11 日 至 平成 22 年 7 月 10 日	第 17 期 自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 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、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>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。</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 16 期 平成 22 年 7 月 10 日現在	第 17 期 平成 23 年 7 月 10 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。 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 16 期 自 平成 21 年 7 月 11 日 至 平成 22 年 7 月 10 日	第 17 期 自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 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 16 期 自 平成 21 年 7 月 11 日 至 平成 22 年 7 月 10 日	第 17 期 自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 日
期首元本額 14,816,526,956 円	期首元本額 14,816,526,956 円
期中追加設定元本額 円	期中追加設定元本額 円
期中一部交換元本額 円	期中一部交換元本額 3,555,057,682 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第 16 期 自 平成 21 年 7 月 11 日 至 平成 22 年 7 月 10 日	第 17 期 自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 日
種類	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	66,409,433	150,279,205
合計	66,409,433	150,279,205

3 デリバティブ取引関係

第 16 期(自 平成 21 年 7 月 11 日 至 平成 22 年 7 月 10 日)

該当事項はございません。

第 17 期(自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 日)

該当事項はございません。

(4)【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1)株式

(平成 23 年 7 月 10 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	10,500	269.00	2,824,500	
	マルハニチロホールディングス	19,000	129.00	2,451,000	
	サカタのタネ	1,800	1,193.00	2,147,400	
	ホクト	1,300	1,787.00	2,323,100	
	国際石油開発帝石	138	612,000.00	84,456,000	
	コムシスホールディングス	5,500	812.00	4,466,000	
	大成建設	43,000	189.00	8,127,000	
	大林組	27,000	358.00	9,666,000	
	清水建設	30,000	343.00	10,290,000	
	鹿島建設	40,000	245.00	9,800,000	
	西松建設	11,000	123.00	1,353,000	
	前田建設工業	7,000	255.00	1,785,000	
	奥村組	9,000	290.00	2,610,000	
	戸田建設	12,000	296.00	3,552,000	
	大東建託	3,000	7,220.00	21,660,000	
	N I P P O	5,000	660.00	3,300,000	
	前田道路	4,000	796.00	3,184,000	
	住友林業	6,700	740.00	4,958,000	
	パナホーム	6,000	540.00	3,240,000	
	大和ハウス工業	23,000	1,037.00	23,851,000	
	積水ハウス	26,000	756.00	19,656,000	
	中電工	2,500	917.00	2,292,500	
	関電工	8,000	390.00	3,120,000	
	九電工	3,000	529.00	1,587,000	
	日揮	10,000	2,310.00	23,100,000	
	高砂熱学工業	3,200	645.00	2,064,000	
	日清製粉グループ本社	9,500	1,009.00	9,585,500	
	山崎製パン	8,000	1,076.00	8,608,000	
	森永乳業	10,000	352.00	3,520,000	
	ヤクルト本社	6,700	2,354.00	15,771,800	
	明治ホールディングス	2,900	3,450.00	10,005,000	
	雪印メグミルク	2,700	1,538.00	4,152,600	
	日本ハム	9,000	1,156.00	10,404,000	
	伊藤ハム	9,000	318.00	2,862,000	
	サッポロホールディングス	15,000	333.00	4,995,000	
	アサヒグループホールディングス	18,300	1,632.00	29,865,600	
	キリンホールディングス	36,000	1,138.00	40,968,000	
	宝ホールディングス	8,000	427.00	3,416,000	
	伊藤園	3,400	1,444.00	4,909,600	
	キッコーマン	8,000	867.00	6,936,000	
	味の素	26,000	990.00	25,740,000	
	キューピー	5,900	1,047.00	6,177,300	
	ハウス食品	4,000	1,378.00	5,512,000	
	ニチレイ	12,000	354.00	4,248,000	
日清食品ホールディングス	4,400	2,945.00	12,958,000		
日本たばこ産業	189	324,000.00	61,236,000		
東洋紡績	34,000	120.00	4,080,000		
日清紡ホールディングス	7,000	797.00	5,579,000		
帝人	37,000	360.00	13,320,000		
東レ	62,000	615.00	38,130,000		
ワコールホールディングス	5,000	1,015.00	5,075,000		
オンワードホールディングス	7,000	691.00	4,837,000		
王子製紙	40,000	411.00	16,440,000		
日本製紙グループ本社	4,400	1,919.00	8,443,600		
レンゴー	10,000	545.00	5,450,000		
クラレ	14,500	1,219.00	17,675,500		
旭化成	53,000	550.00	29,150,000		
住友化学	63,000	410.00	25,830,000		
電気化学工業	19,000	400.00	7,600,000		
信越化学工業	16,300	4,380.00	71,394,000		
大陽日酸	15,000	641.00	9,615,000		
日本触媒	8,000	1,021.00	8,168,000		
カネカ	13,000	538.00	6,994,000		
三菱瓦斯化学	18,000	590.00	10,620,000		
三井化学	39,000	294.00	11,466,000		
東京応化工業	1,800	1,760.00	3,168,000		
三菱ケミカルホールディングス	57,000	585.00	33,345,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	ダイセル化学工業	14,000	555.00	7,770,000	
	積水化学工業	20,000	701.00	14,020,000	
	宇部興産	38,000	266.00	10,108,000	
	日立化成工業	7,900	1,654.00	13,066,600	
	花王	19,900	2,156.00	42,904,400	
	日本ペイント	10,000	650.00	6,500,000	
	D I C	35,000	192.00	6,720,000	
	東洋インキ S Cホールディングス	11,000	383.00	4,213,000	
	富士フイルムホールディングス	19,500	2,515.00	49,042,500	
	資生堂	15,100	1,539.00	23,238,900	
	ライオン	11,000	446.00	4,906,000	
	日東電工	6,600	4,190.00	27,654,000	
	ユニ・チャーム	7,800	3,530.00	27,534,000	
	協和発酵キリン	22,000	822.00	18,084,000	
	武田薬品工業	29,900	3,740.00	111,826,000	
	アステラス製薬	17,700	3,135.00	55,489,500	
	塩野義製薬	13,300	1,366.00	18,167,800	
	中外製薬	21,200	1,357.00	28,768,400	
	エーザイ	11,200	3,140.00	35,168,000	
	大正製薬	11,000	1,805.00	19,855,000	
	第一三共	26,800	1,617.00	43,335,600	
	昭和シェル石油	14,300	769.00	10,996,700	
	東燃ゼネラル石油	21,000	1,000.00	21,000,000	
	J Xホールディングス	94,400	551.00	52,014,400	
	横浜ゴム	13,000	477.00	6,201,000	
	ブリヂストン	30,700	1,954.00	59,987,800	
	住友ゴム工業	9,900	1,029.00	10,187,100	
	旭硝子	45,000	962.00	43,290,000	
	日本板硝子	34,000	254.00	8,636,000	
	日本電気硝子	19,000	1,092.00	20,748,000	
	太平洋セメント	36,000	163.00	5,868,000	
	T O T O	14,000	631.00	8,834,000	
	日本碍子	13,000	1,474.00	19,162,000	
	新日本製鐵	257,000	267.00	68,619,000	
	住友金属工業	182,000	184.00	33,488,000	
	神戸製鋼所	118,000	185.00	21,830,000	
	日新製鋼	38,000	157.00	5,966,000	
	ジェイ エフ イー ホールディングス	23,200	2,198.00	50,993,600	
	日本軽金属	21,000	168.00	3,528,000	
	三井金属鉱業	22,000	282.00	6,204,000	
	三菱マテリアル	50,000	257.00	12,850,000	
	住友金属鉱山	22,000	1,347.00	29,634,000	
	D O W Aホールディングス	12,000	529.00	6,348,000	
	古河機械金属	15,000	84.00	1,260,000	
	古河電気工業	27,000	332.00	8,964,000	
	住友電気工業	30,000	1,217.00	36,510,000	
	フジクラ	14,000	386.00	5,404,000	
	日立電線	14,000	204.00	2,856,000	
	S U M C O	9,700	1,407.00	13,647,900	
	東洋製罐	8,200	1,398.00	11,463,600	
	三和ホールディングス	10,000	289.00	2,890,000	
	住生活グループ	11,800	2,014.00	23,765,200	
	オークマ	6,000	823.00	4,938,000	
	アマダ	15,000	644.00	9,660,000	
	S M C	2,700	14,820.00	40,014,000	
	小松製作所	37,800	2,543.00	96,125,400	
	住友重機械工業	23,000	553.00	12,719,000	
	日立建機	8,100	1,806.00	14,628,600	
	クボタ	49,000	757.00	37,093,000	
	小森コーポレーション	2,600	727.00	1,890,200	
	荏原製作所	16,000	484.00	7,744,000	
	ダイキン工業	11,100	2,913.00	32,334,300	
	栗田工業	5,000	2,382.00	11,910,000	
	橋本チエイン	7,000	501.00	3,507,000	
	ダイフク	4,500	536.00	2,412,000	
	平和	3,800	1,310.00	4,978,000	
	アマノ	3,100	755.00	2,340,500	
	セガサミーホールディングス	10,100	1,666.00	16,826,600	
	日本精工	21,000	802.00	16,842,000	
	N T N	20,000	469.00	9,380,000	
	ジェイテクト	12,900	1,192.00	15,376,800	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	不二越	9,000	508.00	4,572,000	
	三菱重工業	128,000	384.00	49,152,000	
	I H I	55,000	212.00	11,660,000	
	コニカミノルタホールディングス	20,000	688.00	13,760,000	
	ブラザー工業	10,500	1,232.00	12,936,000	
	ミネベア	15,000	438.00	6,570,000	
	日立製作所	171,000	483.00	82,593,000	
	東芝	160,000	424.00	67,840,000	
	三菱電機	81,000	943.00	76,383,000	
	富士電機	28,000	260.00	7,280,000	
	日本電気	98,000	190.00	18,620,000	
	富士通	78,000	483.00	37,674,000	
	パナソニック	92,800	1,009.00	93,635,200	
	シャープ	42,000	756.00	31,752,000	
	ソニー	38,000	2,207.00	83,866,000	
	T D K	4,900	4,530.00	22,197,000	
	ファナック	9,100	14,200.00	129,220,000	
	京セラ	7,200	8,480.00	61,056,000	
	村田製作所	8,500	5,420.00	46,070,000	
	キヤノン	50,400	3,920.00	197,568,000	
	リコー	28,000	926.00	25,928,000	
	東京エレクトロン	6,800	4,565.00	31,042,000	
	豊田自動織機	12,300	2,690.00	33,087,000	
	デンソー	33,400	2,923.00	97,628,200	
	三井造船	31,000	177.00	5,487,000	
	川崎重工業	63,000	317.00	19,971,000	
	日本車輛製造	6,000	358.00	2,148,000	
	日産自動車	170,900	870.00	148,683,000	
	トヨタ自動車	130,400	3,445.00	449,228,000	
	新明和工業	5,000	328.00	1,640,000	
	トビー工業	9,000	225.00	2,025,000	
	本田技研工業	68,500	3,260.00	223,310,000	
	シマノ	3,500	4,375.00	15,312,500	
	テルモ	8,000	4,465.00	35,720,000	
	島津製作所	11,000	733.00	8,063,000	
	ニコン	15,200	1,925.00	29,260,000	
	オリンパス	10,300	2,743.00	28,252,900	
	H O Y A	16,400	1,885.00	30,914,000	
	シチズンホールディングス	13,200	491.00	6,481,200	
	パンダイナムコホールディングス	9,100	980.00	8,918,000	
	トッパン・フォームズ	4,300	663.00	2,850,900	
	凸版印刷	26,000	643.00	16,718,000	
	大日本印刷	26,000	949.00	24,674,000	
	日本写真印刷	1,700	1,557.00	2,646,900	
	アシックス	7,600	1,198.00	9,104,800	
	ヤマハ	7,500	949.00	7,117,500	
	任天堂	5,400	16,470.00	88,938,000	
	タカラスタンダード	6,000	613.00	3,678,000	
	コクヨ	4,900	605.00	2,964,500	
	岡村製作所	4,000	539.00	2,156,000	
	東京電力	60,800	411.00	24,988,800	
	中部電力	28,700	1,469.00	42,160,300	
	関西電力	35,500	1,475.00	52,362,500	
	東北電力	19,000	1,114.00	21,166,000	
	九州電力	17,900	1,367.00	24,469,300	
	東京瓦斯	101,000	376.00	37,976,000	
	大阪瓦斯	79,000	316.00	24,964,000	
	東武鉄道	41,000	345.00	14,145,000	
	東京急行電鉄	48,000	345.00	16,560,000	
	小田急電鉄	28,000	655.00	18,340,000	
	東日本旅客鉄道	15,100	4,815.00	72,706,500	
	西日本旅客鉄道	7,600	3,260.00	24,776,000	
	東海旅客鉄道	81	643,000.00	52,083,000	
	近畿日本鉄道	65,000	261.00	16,965,000	
	阪急阪神ホールディングス	48,000	326.00	15,648,000	
	日本通運	40,000	337.00	13,480,000	
	ヤマトホールディングス	17,700	1,321.00	23,381,700	
	福山通運	11,000	474.00	5,214,000	
	セイノーホールディングス	8,000	621.00	4,968,000	
	日本郵船	64,000	306.00	19,584,000	
	商船三井	46,000	446.00	20,516,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	全日本空輸	95,000	270.00	25,650,000	
	三菱倉庫	7,000	935.00	6,545,000	
	三井倉庫	5,000	324.00	1,620,000	
	住友倉庫	7,000	382.00	2,674,000	
	上組	10,000	763.00	7,630,000	
	郵船ロジスティクス	1,600	1,362.00	2,179,200	
	I Tホールディングス	3,300	780.00	2,574,000	
	野村総合研究所	8,500	1,871.00	15,903,500	
	オービック	380	16,070.00	6,106,600	
	ヤフー	2,200	27,970.00	61,534,000	
	トレンドマイクロ	5,300	2,639.00	13,986,700	
	日本オラクル	4,800	2,769.00	13,291,200	
	伊藤忠テクノソリューションズ	2,400	3,000.00	7,200,000	
	大塚商会	1,200	5,280.00	6,336,000	
	エイベックス・グループ・ホールディングス	1,700	1,084.00	1,842,800	
	日本ユニシス	4,100	489.00	2,004,900	
	日本電信電話	34,700	3,885.00	134,809,500	
	K D D I	170	573,000.00	97,410,000	
	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1,651	144,200.00	238,074,200	
	東宝	7,100	1,365.00	9,691,500	
	エヌ・ティ・ティ・データ	106	282,300.00	29,923,800	
	スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,400	1,490.00	6,556,000	
	C S K	6,600	328.00	2,164,800	
	富士ソフト	1,400	1,225.00	1,715,000	
	コナミ	5,400	1,989.00	10,740,600	
	ソフトバンク	41,200	3,110.00	128,132,000	
	双日	47,300	157.00	7,426,100	
	伊藤忠商事	59,900	880.00	52,712,000	
	丸紅	66,000	571.00	37,686,000	
	豊田通商	13,400	1,431.00	19,175,400	
	三井物産	69,200	1,434.00	99,232,800	
	住友商事	47,300	1,117.00	52,834,100	
	三菱商事	62,500	2,099.00	131,187,500	
	キャノンマーケティングジャパン	5,700	943.00	5,375,100	
	岩谷産業	10,000	288.00	2,880,000	
	サンリオ	3,400	3,040.00	10,336,000	
	スズケン	3,600	1,991.00	7,167,600	
	ローソン	3,800	4,190.00	15,922,000	
	エービーシー・マート	2,800	3,215.00	9,002,000	
	J・フロント リテイリング	20,000	371.00	7,420,000	
	三越伊勢丹ホールディングス	14,900	808.00	12,039,200	
	セブン&アイ・ホールディングス	33,500	2,247.00	75,274,500	
	良品計画	1,100	3,915.00	4,306,500	
	ファミリーマート	3,700	2,956.00	10,937,200	
	しまむら	1,400	7,710.00	10,794,000	
	高島屋	13,000	578.00	7,514,000	
	エイチ・ツー・オー リテイリング	8,000	632.00	5,056,000	
	丸井グループ	12,000	630.00	7,560,000	
	イオン	30,300	983.00	29,784,900	
	ユニー	7,500	785.00	5,887,500	
	イズミ	3,600	1,225.00	4,410,000	
	ヤマダ電機	3,650	6,830.00	24,929,500	
	ニトリホールディングス	2,150	7,660.00	16,469,000	
	ファーストリテイリング	4,000	13,290.00	53,160,000	
	サンドラッグ	2,500	2,535.00	6,337,500	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	535,100	415.00	222,066,500	
	りそなホールディングス	73,500	412.00	30,282,000	
	三井住友トラスト・ホールディングス	157,000	298.00	46,786,000	
	三井住友フィナンシャルグループ	53,500	2,569.00	137,441,500	
	千葉銀行	34,000	512.00	17,408,000	
	横浜銀行	51,000	410.00	20,910,000	
	静岡銀行	26,000	758.00	19,708,000	
	みずほ信託銀行	190,000	74.00	14,060,000	
	みずほフィナンシャルグループ	823,900	135.00	111,226,500	
	大和証券グループ本社	66,000	357.00	23,562,000	
	野村ホールディングス	144,500	404.00	58,378,000	
	みずほ証券	62,000	199.00	12,338,000	
	N K S Jホールディングス	63,000	538.00	33,894,000	
	M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	23,900	1,984.00	47,417,600	
	東京海上ホールディングス	30,400	2,380.00	72,352,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	クレディセゾン	7,000	1,373.00	9,611,000		
	アイフル	9,100	132.00	1,201,200		
	イオンクレジットサービス	5,900	1,133.00	6,684,700		
	アコム	6,040	1,369.00	8,268,760		
	プロミス	5,100	721.00	3,677,100		
	日立キャピタル	4,700	1,146.00	5,386,200		
	オリックス	4,170	8,180.00	34,110,600		
	三菱UFJリース	3,390	3,255.00	11,034,450		
	三井不動産	33,000	1,462.00	48,246,000		
	三菱地所	53,000	1,488.00	78,864,000		
	住友不動産	18,000	1,907.00	34,326,000		
	レオパレス 2 1	6,600	123.00	811,800		
	イオンモール	6,800	1,983.00	13,484,400		
	エヌ・ティ・ティ都市開発	124	71,100.00	8,816,400		
	電通	10,500	2,452.00	25,746,000		
	オリエンタルランド	3,400	7,150.00	24,310,000		
	ユー・エス・エス	1,180	6,320.00	7,457,600		
	東京ドーム	7,000	164.00	1,148,000		
	トランス・コスモス	1,800	881.00	1,585,800		
	セコム	8,800	3,900.00	34,320,000		
	ベネッセホールディングス	3,900	3,400.00	13,260,000		
	計	銘柄数：300			8,162,448,910	
		組入時価比率：99.8%			100%	
	合計				8,162,448,910	

(注) 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 23 年 7 月 10 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

該当事項はございません。