

平成24年7月期 中間決算短信（平成23年7月9日～平成24年1月8日）

平成24年2月16日

ファンド名	日経225連動型上場投資信託	上場取引所	大証
コード番号	(1321)	売買単位	1口
連動対象指標	日経平均株価		
主要投資資産	株式		
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	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	
半期報告書提出予定日	平成24年3月29日		

I ファンドの運用状況

1. 平成24年1月中間期の運用状況（平成23年7月9日～平成24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24年1月中間期	643,921	(98.4)	10,238	(1.6)	654,159	(100)
平成23年7月期	651,207	(99.9)	757	(0.1)	651,965	(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24年1月中間期	63,954	21,413	8,555	76,812

(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(前計算期末) 発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
平成24年1月中間期	689,545	35,385	654,159	85,164
平成23年7月期	684,228	32,262	651,965	101,942

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 10 期 平成 23 年 7 月 8 日現在	第 11 期中間計算期間末 平成 24 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	32,481,802,085	42,226,534,136
株式	651,207,646,640	643,921,200,860
派生商品評価勘定	12,099,290	5,905,500
未収入金		429,527,488
未収配当金	525,900,000	989,478,000
未収利息	24,229	242,312
その他未収収益	850,460	8,782,130
差入委託証拠金		269,980,000
預有価証券		1,693,457,920
流動資産合計	684,228,322,704	689,545,108,346
資産合計	684,228,322,704	689,545,108,346
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		95,984,000
前受金	550,000	
未払収益分配金	8,825,769,576	
未払解約金		1,693,457,920
未払受託者報酬	201,252,326	236,212,143
未払委託者報酬	431,254,924	506,168,805
未払利息	269,689	2,932,449
有価証券貸借取引受入金	22,797,830,580	32,843,713,643
その他未払費用	5,750,005	6,748,856
流動負債合計	32,262,677,100	35,385,217,816
負債合計	32,262,677,100	35,385,217,816
純資産の部		
元本等		
元本	787,092,363,564	945,327,831,549
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	135,126,717,960	291,167,941,019
(分配準備積立金)	578,523,467	578,523,467
元本等合計	651,965,645,604	654,159,890,530
純資産合計	651,965,645,604	654,159,890,530
負債純資産合計	684,228,322,704	689,545,108,346

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

期別	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	第 11 期中間計算期間 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 1 月 8 日
科目	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	4,450,699,660	6,292,887,300
受取利息	11,873,501	21,363,992
有価証券売買等損益	55,879,771,619	112,855,939,150
派生商品取引等損益	16,771,210	72,090,760
その他収益	34,411,868	36,275,010
営業収益合計	60,393,527,858	106,577,503,608
営業費用		
支払利息	6,403,246	10,366,688
受託者報酬	189,720,445	236,212,143
委託者報酬	406,543,745	506,168,805
その他費用	10,175,357	10,990,384
営業費用合計	612,842,793	763,738,020
営業利益	59,780,685,065	107,341,241,628
経常利益	59,780,685,065	107,341,241,628
中間純利益	59,780,685,065	107,341,241,628
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()	154,119,605,573	135,126,717,960
剰余金増加額又は欠損金減少額	64,276,975,147	23,770,383,805
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	64,276,975,147	23,770,383,805
剰余金減少額又は欠損金増加額	54,519,078,860	72,470,365,236
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	54,519,078,860	72,470,365,236
分配金		
中間剰余金又は中間欠損金()	84,581,024,221	291,167,941,019

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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、市場価格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。
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。
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。
4 その他	当ファンドの計算期間は、平成 23 年 7 月 9 日から平成 24 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 23 年 7 月 9 日から平成 24 年 1 月 8 日までとなっております。

(追加情報)

第 11 期中間計算期間 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 1 月 8 日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第 24 号 平成 21 年 12 月 4 日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第 24 号 平成 21 年 12 月 4 日)を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第 10 期 平成 23 年 7 月 8 日現在	第 11 期中間計算期間末 平成 24 年 1 月 8 日現在
1 計算期間の末日における受益権の総数 63,954,852 口	1 中間計算期間の末日における受益権の総数 76,812,207 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 135,126,717,960 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 291,167,941,019 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)	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 8,516.4 円 (10 口当たり純資産額 85,164 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	4 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 30,886,993,040 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 10 期 平成 23 年 7 月 8 日現在	第 11 期中間計算期間末 平成 24 年 1 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 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>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>

(その他の注記)

1 元本の移動

第 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 月 8 日		第 11 期中間計算期間 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 1 月 8 日	
期首元本額	690,384,634,449 円	期首元本額	787,092,363,564 円
期中追加設定元本額	478,353,152,660 円	期中追加設定元本額	263,532,129,330 円
期中一部交換元本額	381,645,423,545 円	期中一部交換元本額	105,296,661,345 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 10 期(平成 23 年 7 月 8 日現在)			第 11 期中間計算期間末(平成 24 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)
市場取引						
先物取引						
株価指数先物取引						
買建	160,610,000	172,720,000	12,099,290	8,059,980,000	7,970,500,000	90,078,500
合計	160,610,000	172,720,000	12,099,290	8,059,980,000	7,970,500,000	90,078,500

(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。