

平成24年7月期（平成23年7月9日～平成24年7月8日）決算短信

平成24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兼執行役会長兼社長 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24年9月27日
 分配金支払開始予定日 平成24年8月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成24年7月期の運用状況（平成23年7月9日～平成24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24年7月期	795,449	(98.5)	11,841	(1.5)	807,290	(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7月期	63,954	45,194	20,454	88,694
平成23年7月期	56,096	38,868	31,010	63,954

(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24年7月期	882,788	75,497	807,290	91,019
平成23年7月期	684,228	32,262	651,965	101,942

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成24年7月期	1,460.00
平成23年7月期	1,380.00

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 10 期	第 11 期
	平成 23 年 7 月 8 日現在	平成 24 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	32,481,802,085	84,468,270,536
株式	651,207,646,640	795,449,172,520
派生商品評価勘定	12,099,290	974,929,900
未収入金		1,017,665,700
未収配当金	525,900,000	864,700,000
未収利息	24,229	496,935
その他未収収益	850,460	13,130,568
流動資産合計	684,228,322,704	882,788,366,159
資産合計	684,228,322,704	882,788,366,159
負債の部		
流動負債		
前受金	550,000	1,412,540,000
未払収益分配金	8,825,769,576	12,949,402,110
未払受託者報酬	201,252,326	267,512,528
未払委託者報酬	431,254,924	574,767,440
未払利息	269,689	3,199,216
有価証券貸借取引受入金	22,797,830,580	60,282,798,555
その他未払費用	5,750,005	7,657,029
流動負債合計	32,262,677,100	75,497,876,878
負債合計	32,262,677,100	75,497,876,878
純資産の部		
元本等		
元本	787,092,363,564	1,091,563,642,245
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	135,126,717,960	284,273,152,964
(分配準備積立金)	578,523,467	913,147,985
元本等合計	651,965,645,604	807,290,489,281
純資産合計	651,965,645,604	807,290,489,281
負債純資産合計	684,228,322,704	882,788,366,159

(2) 【損益及び剰余金計算書】

期別	第 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 月 8 日	第 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 7 月 8 日
科目	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	10,121,359,868	14,770,939,036
受取利息	24,332,241	50,126,108
有価証券売買等損益	39,894,728,589	58,040,223,469
派生商品取引等損益	16,999,160	67,139,240
その他収益	60,848,024	88,165,877
営業収益合計	50,118,267,882	43,063,853,208
営業費用		
支払利息	12,483,579	21,896,064
受託者報酬	390,972,771	503,724,671
委託者報酬	837,798,669	1,080,936,245
その他費用	15,925,362	18,647,413
営業費用合計	1,257,180,381	1,625,204,393
営業利益	48,861,087,501	44,689,057,601
経常利益	48,861,087,501	44,689,057,601
当期純利益	48,861,087,501	44,689,057,601
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()	154,119,605,573	135,126,717,960
剰余金増加額又は欠損金減少額	80,672,636,545	54,577,454,439
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	80,672,636,545	54,577,454,439
剰余金減少額又は欠損金増加額	101,715,066,857	146,085,429,732
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	101,715,066,857	146,085,429,732
分配金	8,825,769,576	12,949,402,110
期末剰余金又は期末欠損金()	135,126,717,960	284,273,152,964

(3) 【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	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
2 費用・収益の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>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>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>
4 その他	<p>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。</p>

(追加情報)

第 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 7 月 8 日
当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。

(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 平成 24 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 <div style="text-align: right;">63,954,852 口</div>	1 計算期間の末日における受益権の総数 <div style="text-align: right;">88,694,535 口</div>
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 <div style="text-align: right;">135,126,717,960 円</div>	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 <div style="text-align: right;">284,273,152,964 円</div>
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 <div style="text-align: right;">10,194.2 円</div> (10 口当たり純資産額 <div style="text-align: right;">101,942 円</div>)	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 <div style="text-align: right;">9,101.9 円</div> (10 口当たり純資産額 <div style="text-align: right;">91,019 円</div>)
4 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 <div style="text-align: right;">21,806,765,100 円</div>	4 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 <div style="text-align: right;">57,140,579,900 円</div>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 月 8 日			第 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 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 9,404,293,043 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。			1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 13,862,550,095 円(10 口当たり 1,562 円)のうち、12,949,402,110 円 (10 口当たり 1,460 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	10,194,056,554 円	当期配当等収益額	A	14,887,334,957 円
分配準備積立金	B	454,933,291 円	分配準備積立金	B	578,523,467 円
配当等収益合計額	C = A + B	10,648,989,845 円	配当等収益合計額	C = A + B	15,465,858,424 円
経費	D	1,244,696,802 円	経費	D	1,603,308,329 円
収益分配可能額	E = C - D	9,404,293,043 円	収益分配可能額	E = C - D	13,862,550,095 円
収益分配金	F	8,825,769,576 円	収益分配金	F	12,949,402,110 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	578,523,467 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	913,147,985 円
口数	H	63,954,852 口	口数	H	88,694,535 口
10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,380 円	10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,460 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 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 月 8 日	第 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 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>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>

(2)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 平成 24 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 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 月 8 日	第 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 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 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 月 8 日	第 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 7 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 556,209,203,780 円
期中一部交換元本額 381,645,423,545 円	期中一部交換元本額 251,737,925,099 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第 10 期 自 平成 22 年 7 月 9 日 至 平成 23 年 7 月 8 日	第 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 7 月 8 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	36,597,829,862	48,854,927,135
合計	36,597,829,862	48,854,927,135

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 10 期(平成 23 年 7 月 8 日現在)			第 11 期(平成 24 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	160,610,000	172,720,000	12,099,290	10,479,670,000	11,455,400,000	974,929,900
合計	160,610,000	172,720,000	12,099,290	10,479,670,000	11,455,400,000	974,929,900

(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 24 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	3,532,000	209.00	738,188,000	貸付株式数	246,600
	マルハニチロホールディングス	3,532,000	124.00	437,968,000		
	国際石油開発帝石	3,532	453,000.00	1,599,996,000	貸付株式数	112 (112)
	コムシスホールディングス	3,532,000	936.00	3,305,952,000		
	大成建設	3,532,000	217.00	766,444,000	貸付株式数	17,000
	大林組	3,532,000	354.00	1,250,328,000		
	清水建設	3,532,000	268.00	946,576,000		
	鹿島建設	3,532,000	227.00	801,764,000	貸付株式数	72,000
	大和ハウス工業	3,532,000	1,121.00	3,959,372,000		
	積水ハウス	3,532,000	761.00	2,687,852,000		
	日揮	3,532,000	2,381.00	8,409,692,000	貸付株式数	28,000
	千代田化工建設	3,532,000	1,001.00	3,535,532,000		
	日清製粉グループ本社	3,532,000	934.00	3,298,888,000	貸付株式数	585,000
	明治ホールディングス	353,200	3,585.00	1,266,222,000	貸付株式数	6,100
	日本ハム	3,532,000	1,071.00	3,782,772,000		
	サッポロホールディングス	3,532,000	252.00	890,064,000	貸付株式数	655,000
	アサヒグループホールディングス	3,532,000	1,703.00	6,014,996,000		
	麒麟ホールディングス	3,532,000	923.00	3,260,036,000		
	宝ホールディングス	3,532,000	510.00	1,801,320,000	貸付株式数	602,000 (262,000)
	キッコーマン	3,532,000	991.00	3,500,212,000	貸付株式数	146,000
	味の素	3,532,000	1,069.00	3,775,708,000		
	ニチレイ	3,532,000	395.00	1,395,140,000	貸付株式数	3,000
	日本たばこ産業	3,532,000	2,353.00	8,310,796,000	貸付株式数	43,900
	東洋紡績	3,532,000	106.00	374,392,000		
	ユニチカ	3,532,000	43.00	151,876,000		
	日清紡ホールディングス	3,532,000	604.00	2,133,328,000		
	帝人	3,532,000	239.00	844,148,000	貸付株式数	35,000
	東レ	3,532,000	546.00	1,928,472,000	貸付株式数	233,000
	王子製紙	3,532,000	296.00	1,045,472,000	貸付株式数	30,000
	三菱製紙	3,532,000	79.00	279,028,000	貸付株式数	19,000
	北越紀州製紙	3,532,000	416.00	1,469,312,000	貸付株式数	283,500
	日本製紙グループ本社	353,200	1,192.00	421,014,400	貸付株式数	236,900 (154,200)
	クラレ	3,532,000	1,021.00	3,606,172,000		
	旭化成	3,532,000	429.00	1,515,228,000	貸付株式数	71,000
	昭和電工	3,532,000	162.00	572,184,000	貸付株式数	2,366,000
	住友化学	3,532,000	242.00	854,744,000	貸付株式数	487,000
	日産化学工業	3,532,000	792.00	2,797,344,000		
	日本曹達	3,532,000	319.00	1,126,708,000	貸付株式数	137,000
	東ソー	3,532,000	213.00	752,316,000		
	電気化学工業	3,532,000	277.00	978,364,000	貸付株式数	208,000
	信越化学工業	3,532,000	4,365.00	15,417,180,000		
	三井化学	3,532,000	206.00	727,592,000		
	三菱ケミカルホールディングス	1,766,000	376.00	664,016,000	貸付株式数	130,500
	宇部興産	3,532,000	183.00	646,356,000		
	日本化薬	3,532,000	764.00	2,698,448,000		
	花王	3,532,000	2,182.00	7,706,824,000	貸付株式数	11,400
	富士フイルムホールディングス	3,532,000	1,487.00	5,252,084,000		
	資生堂	3,532,000	1,234.00	4,358,488,000	貸付株式数	120,000 (120,000)
	協和発酵キリン	3,532,000	830.00	2,931,560,000		
	武田薬品工業	3,532,000	3,595.00	12,697,540,000		
	アステラス製薬	3,532,000	3,505.00	12,379,660,000	貸付株式数	5,600
	大日本住友製薬	3,532,000	811.00	2,864,452,000	貸付株式数	97,100
	塩野義製薬	3,532,000	1,092.00	3,856,944,000	貸付株式数	808,700
	中外製薬	3,532,000	1,493.00	5,273,276,000		
	エーザイ	3,532,000	3,465.00	12,238,380,000	貸付株式数	924,900
	第一三共	3,532,000	1,373.00	4,849,436,000	貸付株式数	178,000
	昭和シェル石油	3,532,000	464.00	1,638,848,000		
	JXホールディングス	3,532,000	391.00	1,381,012,000		
	横浜ゴム	3,532,000	596.00	2,105,072,000		
	ブリヂストン	3,532,000	1,856.00	6,555,392,000		
	日東紡績	3,532,000	261.00	921,852,000	貸付株式数	1,515,000 (635,000)
	旭硝子	3,532,000	533.00	1,882,556,000		
	日本板硝子	3,532,000	82.00	289,624,000	貸付株式数	2,341,000 (66,000)

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	5,298,000	459.00	2,431,782,000		
	住友大阪セメント	3,532,000	257.00	907,724,000	貸付株式数	13,000
	太平洋セメント	3,532,000	179.00	632,228,000	貸付株式数	682,000
	東海カーボン	3,532,000	346.00	1,222,072,000		
	TOTO	3,532,000	586.00	2,069,752,000	貸付株式数	122,000
	日本碍子	3,532,000	907.00	3,203,524,000		
	新日本製鐵	3,532,000	175.00	618,100,000	貸付株式数	174,000 (174,000)
	住友金属工業	3,532,000	127.00	448,564,000		
	神戸製鋼所	3,532,000	91.00	321,412,000	貸付株式数	160,000
	日新製鋼	3,532,000	103.00	363,796,000	貸付株式数	15,000
	ジェイ エフ イー ホールディングス	353,200	1,221.00	431,257,200	貸付株式数	181,200
	大平洋金属	3,532,000	325.00	1,147,900,000	貸付株式数	1,233,000
	日本軽金属	3,532,000	99.00	349,668,000		
	三井金属鉱業	3,532,000	174.00	614,568,000		
	東邦亜鉛	3,532,000	311.00	1,098,452,000	貸付株式数	60,000 (55,000)
	三菱マテリアル	3,532,000	232.00	819,424,000	貸付株式数	69,000
	住友金属鉱山	3,532,000	904.00	3,192,928,000		
	DOWAホールディングス	3,532,000	506.00	1,787,192,000	貸付株式数	1,449,000
	古河機械金属	3,532,000	72.00	254,304,000	貸付株式数	582,000
	古河電気工業	3,532,000	189.00	667,548,000		
	住友電気工業	3,532,000	992.00	3,503,744,000		
	フジクラ	3,532,000	233.00	822,956,000		
	SUMCO	353,200	713.00	251,831,600	貸付株式数	190,000 (88,300)
	東洋製罐	3,532,000	981.00	3,464,892,000		
	日本製鋼所	3,532,000	447.00	1,578,804,000	貸付株式数	223,000
	オークマ	3,532,000	532.00	1,879,024,000		
	アマダ	3,532,000	461.00	1,628,252,000		
	小松製作所	3,532,000	1,961.00	6,926,252,000	貸付株式数	1,624,700
	住友重機械工業	3,532,000	359.00	1,267,988,000		
	日立建機	3,532,000	1,475.00	5,209,700,000	貸付株式数	2,151,200 (49,500)
	クボタ	3,532,000	743.00	2,624,276,000	貸付株式数	311,000
	荏原製作所	3,532,000	320.00	1,130,240,000		
	ダイキン工業	3,532,000	2,205.00	7,788,060,000		
	日本精工	3,532,000	522.00	1,843,704,000		
	NTN	3,532,000	239.00	844,148,000	貸付株式数	128,000
	ジェイテクト	3,532,000	806.00	2,846,792,000		
	日立造船	3,532,000	106.00	374,392,000	貸付株式数	8,500
	三菱重工業	3,532,000	325.00	1,147,900,000		
	IHI	3,532,000	172.00	607,504,000		
	コニカミノルタホールディングス	3,532,000	625.00	2,207,500,000		
	ミネベア	3,532,000	311.00	1,098,452,000	貸付株式数	966,000
	日立製作所	3,532,000	494.00	1,744,808,000	貸付株式数	7,000
	東芝	3,532,000	299.00	1,056,068,000	貸付株式数	47,000
	三菱電機	3,532,000	644.00	2,274,608,000		
	富士電機	3,532,000	192.00	678,144,000	貸付株式数	23,000
	安川電機	3,532,000	587.00	2,073,284,000	貸付株式数	1,570,000
	明電舎	3,532,000	293.00	1,034,876,000	貸付株式数	1,352,000 (35,000)
	ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,532,000	343.00	1,211,476,000	貸付株式数	2,387,000 (1,972,000)
	日本電気	3,532,000	116.00	409,712,000	貸付株式数	2,366,000
	富士通	3,532,000	370.00	1,306,840,000		
	沖電気工業	3,532,000	125.00	441,500,000	貸付株式数	88,000 (88,000)
	パナソニック	3,532,000	622.00	2,196,904,000	貸付株式数	411,900
	シャープ	3,532,000	376.00	1,328,032,000	貸付株式数	2,366,000
	ソニー	3,532,000	1,095.00	3,867,540,000		
	TDK	3,532,000	3,205.00	11,320,060,000	貸付株式数	2,374,500
	ミツミ電機	3,532,000	531.00	1,875,492,000		
	アルプス電気	3,532,000	562.00	1,984,984,000		
	パイオニア	3,532,000	278.00	981,896,000	貸付株式数	2,387,800 (33,500)
	横河電機	3,532,000	822.00	2,903,304,000		
	アドバンテスト	7,064,000	1,239.00	8,752,296,000	貸付株式数	3,733,000 (518,900)
	カシオ計算機	3,532,000	511.00	1,804,852,000	貸付株式数	2,387,800 (114,900)
	ファナック	3,532,000	13,220.00	46,693,040,000		
	京セラ	3,532,000	6,810.00	24,052,920,000		
	太陽誘電	3,532,000	772.00	2,726,704,000	貸付株式数	2,328,100 (971,000)
	大日本スクリーン製造	3,532,000	574.00	2,027,368,000	貸付株式数	608,000
	キヤノン	5,298,000	3,120.00	16,529,760,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	リコー	3,532,000	660.00	2,331,120,000	貸付株式数	2,374,000
	東京エレクトロン	3,532,000	3,685.00	13,015,420,000		
	デンソー	3,532,000	2,675.00	9,448,100,000		
	三井造船	3,532,000	114.00	402,648,000	貸付株式数	1,900,000
	川崎重工業	3,532,000	220.00	777,040,000		
	日産自動車	3,532,000	746.00	2,634,872,000		
	いすゞ自動車	3,532,000	430.00	1,518,760,000		
	トヨタ自動車	3,532,000	3,215.00	11,355,380,000		
	日野自動車	3,532,000	599.00	2,115,668,000	貸付株式数	2,366,000
	三菱自動車工業	3,532,000	79.00	279,028,000	貸付株式数	2,186,000
	マツダ	3,532,000	104.00	367,328,000	貸付株式数	347,000
	本田技研工業	7,064,000	2,706.00	19,115,184,000		
	スズキ	3,532,000	1,628.00	5,750,096,000		
	富士重工業	3,532,000	657.00	2,320,524,000		
	テルモ	3,532,000	3,280.00	11,584,960,000	貸付株式数	17,100
	ニコン	3,532,000	2,579.00	9,109,028,000	貸付株式数	500
	オリンパス	3,532,000	1,291.00	4,559,812,000	貸付株式数	2,363,000 (433,100)
	シチズンホールディングス	3,532,000	468.00	1,652,976,000		
	凸版印刷	3,532,000	536.00	1,893,152,000	貸付株式数	336,000
	大日本印刷	3,532,000	627.00	2,214,564,000		
	ヤマハ	3,532,000	786.00	2,776,152,000		
	東京電力	353,200	153.00	54,039,600	貸付株式数	215,800 (215,800)
	中部電力	353,200	1,270.00	448,564,000		
	関西電力	353,200	906.00	319,999,200		
	東京瓦斯	3,532,000	411.00	1,451,652,000	貸付株式数	62,000
	大阪瓦斯	3,532,000	335.00	1,183,220,000		
	東武鉄道	3,532,000	417.00	1,472,844,000	貸付株式数	72,000
	東京急行電鉄	3,532,000	375.00	1,324,500,000		
	小田急電鉄	3,532,000	790.00	2,790,280,000	貸付株式数	2,374,000 (763,000)
	京王電鉄	3,532,000	570.00	2,013,240,000		
	京成電鉄	3,532,000	681.00	2,405,292,000		
	東日本旅客鉄道	353,200	5,020.00	1,773,064,000		
	西日本旅客鉄道	353,200	3,315.00	1,170,858,000		
	東海旅客鉄道	3,532	631,000.00	2,228,692,000		
	日本通運	3,532,000	328.00	1,158,496,000		
	ヤマトホールディングス	3,532,000	1,276.00	4,506,832,000		
	日本郵船	3,532,000	209.00	738,188,000		
	商船三井	3,532,000	281.00	992,492,000	貸付株式数	1,120,000
	川崎汽船	3,532,000	131.00	462,692,000	貸付株式数	2,385,000 (201,000)
	全日本空輸	3,532,000	196.00	692,272,000	貸付株式数	2,388,000 (573,000)
	三菱倉庫	3,532,000	828.00	2,924,496,000	貸付株式数	30,000
	ヤフー	14,128	26,140.00	369,305,920		
	トレンドマイクロ	3,532,000	2,287.00	8,077,684,000	貸付株式数	895,300
	スカパーJ S A Tホールディングス	3,532	35,250.00	124,503,000	貸付株式数	64
	日本電信電話	353,200	3,765.00	1,329,798,000		
	K D D I	35,320	528,000.00	18,648,960,000	貸付株式数	227
	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	3,532	132,100.00	466,577,200		
	東宝	353,200	1,318.00	465,517,600		
	エヌ・ティ・ティ・データ	35,320	239,300.00	8,452,076,000	貸付株式数	848
	コナミ	3,532,000	1,756.00	6,202,192,000	貸付株式数	39,700
	ソフトバンク	10,596,000	2,885.00	30,569,460,000		
	双日	353,200	130.00	45,916,000		
	伊藤忠商事	3,532,000	865.00	3,055,180,000		
	丸紅	3,532,000	548.00	1,935,536,000		
	豊田通商	3,532,000	1,567.00	5,534,644,000		
	三井物産	3,532,000	1,221.00	4,312,572,000		
	住友商事	3,532,000	1,128.00	3,984,096,000		
	三菱商事	3,532,000	1,655.00	5,845,460,000		
	J . フロント リテイリング	3,532,000	408.00	1,441,056,000	貸付株式数	122,000
	三越伊勢丹ホールディングス	3,532,000	841.00	2,970,412,000	貸付株式数	118,000
	セブン&アイ・ホールディングス	3,532,000	2,457.00	8,678,124,000		
	高島屋	3,532,000	610.00	2,154,520,000	貸付株式数	47,000
	丸井グループ	3,532,000	598.00	2,112,136,000		
	イオン	3,532,000	980.00	3,461,360,000	貸付株式数	1,742,400 (1,022,700)
	ユニー	3,532,000	907.00	3,203,524,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	ファーストリテイリング	3,532,000	15,790.00	55,770,280,000	貸付株式数	303,400
	新生銀行	3,532,000	99.00	349,668,000	貸付株式数	288,000
	あおぞら銀行	3,532,000	193.00	681,676,000	貸付株式数	2,303,000
	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	3,532,000	394.00	1,391,608,000		
	りそなホールディングス	353,200	335.00	118,322,000		
	三井住友トラスト・ホールディングス	3,532,000	247.00	872,404,000		
	三井住友フィナンシャルグループ	353,200	2,647.00	934,920,400		
	千葉銀行	3,532,000	476.00	1,681,232,000		
	横浜銀行	3,532,000	372.00	1,313,904,000		
	ふくおかフィナンシャルグループ	3,532,000	305.00	1,077,260,000		
	静岡銀行	3,532,000	825.00	2,913,900,000		
	みずほフィナンシャルグループ	3,532,000	133.00	469,756,000		
	大和証券グループ本社	3,532,000	291.00	1,027,812,000		
	野村ホールディングス	3,532,000	288.00	1,017,216,000		
	松井証券	3,532,000	463.00	1,635,316,000	貸付株式数	2,184,500 (762,000)
	N K S J ホールディングス	883,000	1,674.00	1,478,142,000		
	M S & A D インシュアランスグループホールディングス	1,059,600	1,443.00	1,529,002,800		
	ソニーフィナンシャルホールディングス	706,400	1,291.00	911,962,400		
	第一生命保険	3,532	90,000.00	317,880,000		
	東京海上ホールディングス	1,766,000	2,003.00	3,537,298,000		
	T & D ホールディングス	706,400	853.00	602,559,200		
	クレディセゾン	3,532,000	1,726.00	6,096,232,000		
	三井不動産	3,532,000	1,501.00	5,301,532,000	貸付株式数	100,000 (100,000)
	三菱地所	3,532,000	1,397.00	4,934,204,000		
	平和不動産	3,532,000	183.00	646,356,000		
	東京建物	3,532,000	283.00	999,556,000		
	東急不動産	3,532,000	391.00	1,381,012,000	貸付株式数	53,000
	住友不動産	3,532,000	1,902.00	6,717,864,000		
	電通	3,532,000	2,356.00	8,321,392,000		
	東京ドーム	3,532,000	237.00	837,084,000		
	セコム	3,532,000	3,675.00	12,980,100,000		
計	銘柄数：225			795,449,172,520		
	組入時価比率：98.5%			100.0%		
合計				795,449,172,520		

(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 24 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。