

## 平成24年7月期（平成23年7月11日～平成24年7月10日）決算短信

平成24年8月17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17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11日～平成24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24年7月期	7,057	(99.8)	12	(0.2)	7,069	(100)
平成23年7月期	8,162	(99.8)	13	(0.2)	8,176	(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	46,534	0	0	46,534
平成23年7月期	61,225	0	14,690	46,534

## (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24年7月期	7,222	152	7,069	15,192
平成23年7月期	8,338	161	8,176	17,570

## (4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成24年7月期	262.20
平成23年7月期	282.10

## 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 17 期 平成 23 年 7 月 10 日現在	第 18 期 平成 24 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	166,409,725	156,839,820
株式	8,162,448,910	7,057,390,140
未収配当金	9,154,050	8,219,550
未収利息	1,230	405
流動資産合計	8,338,013,915	7,222,449,915
資産合計	8,338,013,915	7,222,449,915
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	131,275,226	122,014,762
未払受託者報酬	5,863,676	5,879,903
未払委託者報酬	24,627,429	24,695,915
その他未払費用	117,164	117,572
流動負債合計	161,883,495	152,708,152
負債合計	161,883,495	152,708,152
純資産の部		
元本等		
元本	11,261,469,274	11,261,469,274
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,085,338,854	4,191,727,511
(分配準備積立金)	9,176,641	8,243,306
元本等合計	8,176,130,420	7,069,741,763
純資産合計	8,176,130,420	7,069,741,763
負債純資産合計	8,338,013,915	7,222,449,915

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

期別 科目	第 17 期	第 18 期
	自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 日	自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	199,666,973	182,590,419
受取利息	65,641	53,897
有価証券売買等損益	140,685,763	1,105,455,322
その他収益	194,851	161,190
営業収益合計	340,613,228	922,649,816
営業費用		
受託者報酬	13,164,277	11,824,426
委託者報酬	55,289,872	49,663,208
その他費用	263,110	236,445
営業費用合計	68,717,259	61,724,079
営業利益	271,895,969	984,373,895
経常利益	271,895,969	984,373,895
当期純利益	271,895,969	984,373,895
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( )	4,232,361,405	3,085,338,854
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	131,275,226	122,014,762
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,085,338,854	4,191,727,511

## (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	(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 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。
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。
4 その他	当ファンドの計算期間は、平成 23 年 7 月 11 日から平成 24 年 7 月 10 日までとなっております。

## (追加情報)

第 18 期 自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 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 17 期 平成 23 年 7 月 10 日現在	第 18 期 平成 24 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 46,534,997 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 3,085,338,854 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 4,191,727,511 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)	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 151.92 円 (100 口当たり純資産額 15,192 円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 17 期 自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 日	第 18 期 自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 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 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。	1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 130,258,068 円 (100 口当たり 279 円 91 銭)のうち、122,014,762 円 (100 口当たり 262 円 20 銭)を分配金額としております。																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>199,927,465 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>9,241,661 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C = A + B</td> <td>209,169,126 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>68,717,259 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E = C - D</td> <td>140,451,867 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>131,275,226 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G = E - F</td> <td>9,176,641 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>46,534,997 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td>I = F / H × 100</td> <td>282 円 10 銭</td> </tr> </tbody> </table>	項目			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	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>182,805,506 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>9,176,641 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C = A + B</td> <td>191,982,147 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>61,724,079 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E = C - D</td> <td>130,258,068 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>122,014,762 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G = E - F</td> <td>8,243,306 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>46,534,997 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td>I = F / H × 100</td> <td>262 円 20 銭</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	182,805,506 円	分配準備積立金	B	9,176,641 円	配当等収益合計額	C = A + B	191,982,147 円	経費	D	61,724,079 円	収益分配可能額	E = C - D	130,258,068 円	収益分配金	F	122,014,762 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	8,243,306 円	口数	H	46,534,997 口	100 口当たり分配金	I = F / H × 100	262 円 20 銭
項目																																																													
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																																																													
当期配当等収益額	A	182,805,506 円																																																											
分配準備積立金	B	9,176,641 円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	191,982,147 円																																																											
経費	D	61,724,079 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	130,258,068 円																																																											
収益分配金	F	122,014,762 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	8,243,306 円																																																											
口数	H	46,534,997 口																																																											
100 口当たり分配金	I = F / H × 100	262 円 20 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 17 期 自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 日	第 18 期 自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 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なっております。 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なっております。 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なっております。 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なっております。</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 17 期 平成 23 年 7 月 10 日現在	第 18 期 平成 24 年 7 月 10 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。 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 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 同左</p>

## (関連当事者との取引に関する注記)

第 17 期 自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 日	第 18 期 自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 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。	

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

第 17 期 自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 日	第 18 期 自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 日
期首元本額 14,816,526,956 円	期首元本額 11,261,469,274 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 3,555,057,682 円	期中一部交換元本額 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第 17 期 自 平成 22 年 7 月 11 日 至 平成 23 年 7 月 10 日	第 18 期 自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 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	150,279,205	1,094,441,562
合計	150,279,205	1,094,441,562

## 3 デリバティブ取引関係

第 17 期(平成 23 年 7 月 10 日現在)

該当事項はございません。

第 18 期(平成 24 年 7 月 10 日現在)

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 24 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	10,400	207.00	2,152,800	
	マルハニチロホールディングス	19,000	126.00	2,394,000	
	サカタのタネ	1,800	1,077.00	1,938,600	
	ホクト	1,300	1,578.00	2,051,400	
	国際石油開発帝石	138	447,000.00	61,686,000	
	コムシスホールディングス	5,500	952.00	5,236,000	
	大成建設	43,000	222.00	9,546,000	
	大林組	27,000	360.00	9,720,000	
	清水建設	30,000	271.00	8,130,000	
	鹿島建設	40,000	232.00	9,280,000	
	西松建設	10,000	146.00	1,460,000	
	前田建設工業	7,000	374.00	2,618,000	
	奥村組	9,000	272.00	2,448,000	
	戸田建設	12,000	245.00	2,940,000	
	大東建託	3,000	7,620.00	22,860,000	
	N I P P O	4,000	911.00	3,644,000	
	前田道路	4,000	1,051.00	4,204,000	
	住友林業	6,700	713.00	4,777,100	
	パナホーム	6,000	501.00	3,006,000	
	大和ハウス工業	23,000	1,109.00	25,507,000	
	積水ハウス	25,000	762.00	19,050,000	
	中電工	2,500	804.00	2,010,000	
	関電工	8,000	369.00	2,952,000	
九電工	3,000	487.00	1,461,000		
日揮	10,000	2,372.00	23,720,000		
高砂熱学工業	3,200	613.00	1,961,600		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	日清製粉グループ本社	9,500	941.00	8,939,500	
	山崎製パン	8,000	1,021.00	8,168,000	
	森永乳業	10,000	311.00	3,110,000	
	ヤクルト本社	6,600	3,115.00	20,559,000	
	明治ホールディングス	2,900	3,605.00	10,454,500	
	雪印メグミルク	2,700	1,385.00	3,739,500	
	日本ハム	9,000	1,082.00	9,738,000	
	伊藤ハム	9,000	334.00	3,006,000	
	サッポロホールディングス	15,000	254.00	3,810,000	
	アサヒグループホールディングス	18,200	1,736.00	31,595,200	
	キリンホールディングス	36,000	932.00	33,552,000	
	宝ホールディングス	8,000	512.00	4,096,000	
	伊藤園	3,400	1,496.00	5,086,400	
	キッコーマン	8,000	1,000.00	8,000,000	
	味の素	26,000	1,086.00	28,236,000	
	キューピー	5,800	1,183.00	6,861,400	
	ハウス食品	4,000	1,350.00	5,400,000	
	ニチレイ	12,000	397.00	4,764,000	
	日清食品ホールディングス	4,400	3,060.00	13,464,000	
	日本たばこ産業	37,600	2,297.00	86,367,200	
	東洋紡績	34,000	105.00	3,570,000	
	日清紡ホールディングス	7,000	592.00	4,144,000	
	帝人	37,000	229.00	8,473,000	
	東レ	61,000	530.00	32,330,000	
	ワコールホールディングス	5,000	924.00	4,620,000	
	オンワードホールディングス	7,000	607.00	4,249,000	
	王子製紙	40,000	296.00	11,840,000	
	日本製紙グループ本社	4,400	1,180.00	5,192,000	
	レンゴー	10,000	477.00	4,770,000	
	クラレ	14,400	986.00	14,198,400	
	旭化成	53,000	428.00	22,684,000	
	住友化学	62,000	233.00	14,446,000	
	電気化学工業	18,000	271.00	4,878,000	
	信越化学工業	16,300	4,325.00	70,497,500	
	大陽日酸	15,000	460.00	6,900,000	
	日本触媒	8,000	967.00	7,736,000	
	カネカ	13,000	432.00	5,616,000	
	三菱瓦斯化学	18,000	456.00	8,208,000	
	三井化学	38,000	201.00	7,638,000	
	東京応化工業	1,800	1,722.00	3,099,600	
	三菱ケミカルホールディングス	56,500	364.00	20,566,000	
	ダイセル	14,000	498.00	6,972,000	
	積水化学工業	20,000	716.00	14,320,000	
	宇部興産	38,000	181.00	6,878,000	
	日立化成工業	7,800	1,232.00	9,609,600	
	花王	19,800	2,200.00	43,560,000	
	日本ペイント	10,000	653.00	6,530,000	
	D I C	35,000	141.00	4,935,000	
	東洋インキ S C ホールディングス	11,000	287.00	3,157,000	
	富士フイルムホールディングス	19,400	1,442.00	27,974,800	
	資生堂	15,100	1,234.00	18,633,400	
	ライオン	11,000	437.00	4,807,000	
	日東電工	6,500	3,480.00	22,620,000	
	ユニ・チャーム	7,800	4,465.00	34,827,000	
	協和発酵キリン	22,000	839.00	18,458,000	
	武田薬品工業	29,700	3,610.00	107,217,000	
	アステラス製薬	17,600	3,600.00	63,360,000	
	塩野義製薬	13,200	1,108.00	14,625,600	
	田辺三菱製薬	21,100	1,182.00	24,940,200	
	中外製薬	21,100	1,508.00	31,818,800	
	エーザイ	11,200	3,475.00	38,920,000	
	第一三共	26,700	1,382.00	36,899,400	
	大正製薬ホールディングス	3,400	6,430.00	21,862,000	
	昭和シェル石油	14,200	462.00	6,560,400	
	東燃ゼネラル石油	21,000	699.00	14,679,000	
	J Xホールディングス	93,900	395.00	37,090,500	
	横浜ゴム	13,000	567.00	7,371,000	
	ブリヂストン	30,600	1,818.00	55,630,800	
	住友ゴム工業	9,900	1,000.00	9,900,000	
	旭硝子	45,000	519.00	23,355,000	
	日本板硝子	34,000	78.00	2,652,000	

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	19,000	447.00	8,493,000	
	太平洋セメント	47,000	175.00	8,225,000	
	TOTO	14,000	592.00	8,288,000	
	日本碍子	13,000	876.00	11,388,000	
	新日本製鐵	256,000	169.00	43,264,000	
	住友金属工業	181,000	123.00	22,263,000	
	神戸製鋼所	117,000	88.00	10,296,000	
	日新製鋼	37,000	100.00	3,700,000	
	ジェイ エフ イー ホールディングス	23,100	1,187.00	27,419,700	
	日本軽金属	21,000	96.00	2,016,000	
	三井金属鉱業	22,000	169.00	3,718,000	
	三菱マテリアル	49,000	221.00	10,829,000	
	住友金属鉱山	22,000	891.00	19,602,000	
	DOW Aホールディングス	12,000	499.00	5,988,000	
	古河機械金属	15,000	71.00	1,065,000	
	古河電気工業	27,000	179.00	4,833,000	
	住友電気工業	29,900	959.00	28,674,100	
	フジクラ	14,000	224.00	3,136,000	
	日立電線	14,000	165.00	2,310,000	
	SUMCO	9,700	671.00	6,508,700	
	東洋製罐	8,100	969.00	7,848,900	
	三和ホールディングス	10,000	329.00	3,290,000	
	LIXILグループ	11,800	1,717.00	20,260,600	
	オークマ	6,000	491.00	2,946,000	
	アマダ	15,000	443.00	6,645,000	
	SMC	2,700	13,260.00	35,802,000	
	小松製作所	37,000	1,818.00	67,266,000	
	住友重機械工業	23,000	339.00	7,797,000	
	日立建機	8,100	1,371.00	11,105,100	
	クボタ	48,000	730.00	35,040,000	
	小森コーポレーション	2,600	563.00	1,463,800	
	荏原製作所	16,000	305.00	4,880,000	
	ダイキン工業	11,000	2,173.00	23,903,000	
	栗田工業	5,000	1,860.00	9,300,000	
	椿本チエイン	7,000	453.00	3,171,000	
	ダイフク	4,500	474.00	2,133,000	
	平和	3,800	1,515.00	5,757,000	
	アマノ	3,100	670.00	2,077,000	
	セガサミーホールディングス	10,000	1,659.00	16,590,000	
	日本精工	21,000	496.00	10,416,000	
	NTN	20,000	233.00	4,660,000	
	ジェイテクト	12,900	767.00	9,894,300	
	不二越	9,000	290.00	2,610,000	
	三菱重工業	127,000	316.00	40,132,000	
	IHI	55,000	168.00	9,240,000	
	コニカミノルタホールディングス	20,000	601.00	12,020,000	
	ブラザー工業	10,400	862.00	8,964,800	
	ミネベア	15,000	297.00	4,455,000	
	日立製作所	174,000	474.00	82,476,000	
	東芝	159,000	290.00	46,110,000	
	三菱電機	81,000	622.00	50,382,000	
富士電機	28,000	179.00	5,012,000		
日本電気	98,000	112.00	10,976,000		
富士通	78,000	361.00	28,158,000		
パナソニック	92,300	610.00	56,303,000		
シャープ	42,000	362.00	15,204,000		
ソニー	37,800	1,046.00	39,538,800		
TDK	4,900	3,195.00	15,655,500		
ファナック	9,000	12,550.00	112,950,000		
京セラ	7,200	6,670.00	48,024,000		
村田製作所	8,500	4,055.00	34,467,500		
キヤノン	50,200	3,045.00	152,859,000		
リコー	28,000	615.00	17,220,000		
東京エレクトロン	6,800	3,490.00	23,732,000		
豊田自動織機	12,300	2,208.00	27,158,400		
デンソー	33,300	2,592.00	86,313,600		
三井造船	31,000	114.00	3,534,000		
川崎重工業	63,000	206.00	12,978,000		
日本車輛製造	6,000	276.00	1,656,000		
日産自動車	170,100	719.00	122,301,900		
トヨタ自動車	129,700	3,095.00	401,421,500		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	新明和工業	4,000	383.00	1,532,000	
	トビー工業	9,000	221.00	1,989,000	
	本田技研工業	68,200	2,577.00	175,751,400	
	シマノ	3,500	5,070.00	17,745,000	
	テルモ	7,100	3,320.00	23,572,000	
	島津製作所	11,000	647.00	7,117,000	
	ニコン	15,100	2,336.00	35,273,600	
	オリンパス	10,200	1,283.00	13,086,600	
	H O Y A	16,400	1,750.00	28,700,000	
	シチズンホールディングス	13,200	452.00	5,966,400	
	バンダイナムコホールディングス	8,400	1,095.00	9,198,000	
	トッパン・フォームズ	4,300	686.00	2,949,800	
	凸版印刷	26,000	531.00	13,806,000	
	大日本印刷	26,000	638.00	16,588,000	
	日本写真印刷	1,700	894.00	1,519,800	
	アシックス	7,500	937.00	7,027,500	
	ヤマハ	7,400	769.00	5,690,600	
	任天堂	5,300	9,250.00	49,025,000	
	タカラスタンダード	6,000	618.00	3,708,000	
	コクヨ	4,800	602.00	2,889,600	
	岡村製作所	4,000	577.00	2,308,000	
	東京電力	60,500	152.00	9,196,000	
	中部電力	28,500	1,272.00	36,252,000	
	関西電力	35,300	914.00	32,264,200	
	東北電力	18,900	764.00	14,439,600	
	九州電力	17,800	913.00	16,251,400	
	東京瓦斯	97,000	408.00	39,576,000	
	大阪瓦斯	78,000	338.00	26,364,000	
	東武鉄道	40,000	419.00	16,760,000	
	東京急行電鉄	48,000	377.00	18,096,000	
	小田急電鉄	28,000	795.00	22,260,000	
	東日本旅客鉄道	15,100	5,050.00	76,255,000	
	西日本旅客鉄道	7,500	3,415.00	25,612,500	
	東海旅客鉄道	78	639,000.00	49,842,000	
	近畿日本鉄道	64,000	312.00	19,968,000	
	阪急阪神ホールディングス	48,000	410.00	19,680,000	
	日本通運	40,000	327.00	13,080,000	
	ヤマトホールディングス	17,600	1,279.00	22,510,400	
	福山通運	10,000	444.00	4,440,000	
	セイノーホールディングス	8,000	532.00	4,256,000	
	日本郵船	64,000	203.00	12,992,000	
	商船三井	45,000	267.00	12,015,000	
	全日本空輸	95,000	197.00	18,715,000	
	三菱倉庫	7,000	823.00	5,761,000	
	三井倉庫	5,000	286.00	1,430,000	
	住友倉庫	7,000	378.00	2,646,000	
	上組	10,000	643.00	6,430,000	
郵船ロジスティクス	1,600	1,067.00	1,707,200		
I Tホールディングス	3,300	893.00	2,946,900		
野村総合研究所	8,500	1,744.00	14,824,000		
オービック	370	15,590.00	5,768,300		
ヤフー	2,190	26,720.00	58,516,800		
トレンドマイクロ	5,300	2,267.00	12,015,100		
日本オラクル	4,800	3,370.00	16,176,000		
伊藤忠テクノソリューションズ	2,400	3,960.00	9,504,000		
大塚商会	1,200	6,820.00	8,184,000		
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,700	1,202.00	2,043,400		
日本コニシス	4,100	560.00	2,296,000		
日本電信電話	33,600	3,735.00	125,496,000		
K D D I	169	536,000.00	90,584,000		
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1,642	133,000.00	218,386,000		
東宝	7,100	1,352.00	9,599,200		
エヌ・ティ・ティ・データ	106	240,500.00	25,493,000		
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,300	1,280.00	5,504,000		
富士ソフト	1,300	1,312.00	1,705,600		
コナミ	5,400	1,730.00	9,342,000		
ソフトバンク	41,700	2,924.00	121,930,800		
双日	47,100	130.00	6,123,000		
伊藤忠商事	59,600	846.00	50,421,600		
丸紅	65,000	531.00	34,515,000		
豊田通商	13,300	1,529.00	20,335,700		
三井物産	68,800	1,196.00	82,284,800		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	住友商事	47,100	1,114.00	52,469,400	
	三菱商事	62,200	1,623.00	100,950,600	
	キャノンマーケティングジャパン	5,700	1,005.00	5,728,500	
	岩谷産業	9,000	318.00	2,862,000	
	サンリオ	3,400	2,734.00	9,295,600	
	スズケン	3,500	2,722.00	9,527,000	
	ローソン	3,800	5,520.00	20,976,000	
	エービーシー・マート	2,800	3,075.00	8,610,000	
	J・フロント リテイリング	20,000	417.00	8,340,000	
	三越伊勢丹ホールディングス	14,900	841.00	12,530,900	
	セブン&アイ・ホールディングス	33,400	2,476.00	82,698,400	
	良品計画	1,100	4,465.00	4,911,500	
	ファミリーマート	3,700	3,655.00	13,523,500	
	しまむら	1,400	9,260.00	12,964,000	
	高島屋	12,000	605.00	7,260,000	
	エイチ・ツー・オー リテイリング	8,000	766.00	6,128,000	
	丸井グループ	12,000	606.00	7,272,000	
	イオン	30,100	978.00	29,437,800	
	ユニー	7,500	905.00	6,787,500	
	イズミ	3,000	1,643.00	4,929,000	
	ヤマダ電機	3,640	3,600.00	13,104,000	
	ニトリホールディングス	2,150	7,480.00	16,082,000	
	ファーストリテイリング	4,000	15,380.00	61,520,000	
	サンドラッグ	2,500	2,696.00	6,740,000	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	532,600	383.00	203,985,800	
	りそなホールディングス	73,200	323.00	23,643,600	
	三井住友トラスト・ホールディングス	156,000	237.00	36,972,000	
	三井住友フィナンシャルグループ	53,200	2,577.00	137,096,400	
	千葉銀行	34,000	475.00	16,150,000	
	横浜銀行	51,000	372.00	18,972,000	
	常陽銀行	30,000	357.00	10,710,000	
	ふくおかフィナンシャルグループ	32,000	296.00	9,472,000	
	静岡銀行	25,000	836.00	20,900,000	
	みずほフィナンシャルグループ	904,900	129.00	116,732,100	
	大和証券グループ本社	66,000	274.00	18,084,000	
	野村ホールディングス	143,800	272.00	39,113,600	
	NK S Jホールディングス	15,600	1,610.00	25,116,000	
	MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	23,800	1,378.00	32,796,400	
	東京海上ホールディングス	29,000	1,922.00	55,738,000	
	クレディセゾン	7,000	1,697.00	11,879,000	
	アイフル	9,050	155.00	1,402,750	
	イオンクレジットサービス	5,400	1,394.00	7,527,600	
	アコム	6,010	1,569.00	9,429,690	
	日立キャピタル	4,700	1,285.00	6,039,500	
	オリックス	4,150	7,250.00	30,087,500	
	三菱UFJリース	3,370	3,200.00	10,784,000	
	三井不動産	33,000	1,473.00	48,609,000	
	三菱地所	52,000	1,382.00	71,864,000	
	住友不動産	18,000	1,858.00	33,444,000	
	レオパレス 2 1	6,600	260.00	1,716,000	
イオンモール	6,800	1,775.00	12,070,000		
エヌ・ティ・ティ都市開発	124	62,600.00	7,762,400		
ディー・エヌ・エー	5,700	2,271.00	12,944,700		
電通	10,500	2,342.00	24,591,000		
オリエンタルランド	3,400	9,090.00	30,906,000		
ユー・エス・エス	1,180	8,410.00	9,923,800		
東京ドーム	7,000	233.00	1,631,000		
トランス・コスモス	1,800	1,038.00	1,868,400		
セコム	8,800	3,735.00	32,868,000		
ベネッセホールディングス	3,900	3,600.00	14,040,000		
計	銘柄数：300			7,057,390,140	
	組入時価比率：99.8%			100.0%	
合計				7,057,390,140	

(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 24 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。