

平成25年7月期（平成24年7月9日～平成25年7月8日）決算短信

平成25年8月20日

上場取引所 東証

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25年9月26日
 分配金支払開始予定日 平成25年8月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成25年7月期の運用状況（平成24年7月9日～平成25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25年7月期	1,441,236	(98.4)	22,802	(1.6)	1,464,038	(100)
平成24年7月期	795,449	(98.5)	11,841	(1.5)	807,290	(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25年7月期	88,694	33,596	19,911	102,380
平成24年7月期	63,954	45,194	20,454	88,694

(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25年7月期	1,572,493	108,454	1,464,038	143,000
平成24年7月期	882,788	75,497	807,290	91,019

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成25年7月期	1,870.00
平成24年7月期	1,460.00

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 11 期 平成 24 年 7 月 8 日現在	第 12 期 平成 25 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	84,468,270,536	126,639,258,036
株式	795,449,172,520	1,441,236,290,500
派生商品評価勘定	974,929,900	1,631,927,904
未収入金	1,017,665,700	1,717,952,400
未収配当金	864,700,000	1,253,161,000
未収利息	496,935	85,917
その他未収収益	13,130,568	14,376,981
流動資産合計	882,788,366,159	1,572,493,052,738
資産合計	882,788,366,159	1,572,493,052,738
負債の部		
流動負債		
前受金	1,412,540,000	1,530,674,000
未払収益分配金	12,949,402,110	19,145,081,505
未払受託者報酬	267,512,528	419,008,211
未払委託者報酬	574,767,440	1,023,721,813
未払利息	3,199,216	3,686,742
有価証券貸借取引受入金	60,282,798,555	86,319,049,950
その他未払費用	7,657,029	13,115,662
流動負債合計	75,497,876,878	108,454,337,883
負債合計	75,497,876,878	108,454,337,883
純資産の部		
元本等		
元本	1,091,563,642,245	1,259,992,075,305
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	284,273,152,964	204,046,639,550
(分配準備積立金)	913,147,985	64,632,971
元本等合計	807,290,489,281	1,464,038,714,855
純資産合計	807,290,489,281	1,464,038,714,855
負債純資産合計	882,788,366,159	1,572,493,052,738

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第 11 期	第 12 期
		自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 7 月 8 日	自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		14,770,939,036	20,550,694,628
受取利息		50,126,108	83,393,267
有価証券売買等損益		58,040,223,469	503,505,227,349
派生商品取引等損益		67,139,240	12,149,067,872
その他収益		88,165,877	175,683,973
営業収益合計		43,063,853,208	536,464,067,089
営業費用			
支払利息		21,896,064	35,038,136
受託者報酬		503,724,671	733,748,497
委託者報酬		1,080,936,245	1,717,629,882
その他費用		18,647,413	26,788,862
営業費用合計		1,625,204,393	2,513,205,377
営業利益		44,689,057,601	533,950,861,712
経常利益		44,689,057,601	533,950,861,712
当期純利益		44,689,057,601	533,950,861,712
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()		135,126,717,960	284,273,152,964
剰余金増加額又は欠損金減少額		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		54,577,454,439	
剰余金減少額又は欠損金増加額		146,085,429,732	26,485,987,693
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額			5,606,968,640
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		146,085,429,732	20,879,019,053
分配金		12,949,402,110	19,145,081,505
期末剰余金又は期末欠損金()		284,273,152,964	204,046,639,550

(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) 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 24 年 7 月 9 日から平成 25 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 11 期 平成 24 年 7 月 8 日現在	第 12 期 平成 25 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 88,694,535 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 102,380,115 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 284,273,152,964 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 9,101.9 円 (10 口当たり純資産額 91,019 円)	2 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 14,300.0 円 (10 口当たり純資産額 143,000 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 57,140,579,900 円	3 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 82,631,909,300 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 7 月 8 日	第 12 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 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 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。	1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 19,209,714,476 円(10 口当たり 1,876 円)のうち、19,145,081,505 円(10 口当たり 1,870 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: right;">14,887,334,957 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;">14,887,334,957 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;">578,523,467 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;">15,465,858,424 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">1,603,308,329 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;">13,862,550,095 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">12,949,402,110 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;">913,147,985 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">88,694,535 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I = F / H × 10</td> <td style="text-align: right;">1,460 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	14,887,334,957 円	当期配当等収益額	A	14,887,334,957 円	分配準備積立金	B	578,523,467 円	配当等収益合計額	C = A + B	15,465,858,424 円	経費	D	1,603,308,329 円	収益分配可能額	E = C - D	13,862,550,095 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	913,147,985 円	口数	H	88,694,535 口	10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,460 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: right;">20,774,733,732 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;">20,774,733,732 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;">913,147,985 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;">21,687,881,717 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">2,478,167,241 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;">19,209,714,476 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">19,145,081,505 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;">64,632,971 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">102,380,115 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I = F / H × 10</td> <td style="text-align: right;">1,870 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	20,774,733,732 円	当期配当等収益額	A	20,774,733,732 円	分配準備積立金	B	913,147,985 円	配当等収益合計額	C = A + B	21,687,881,717 円	経費	D	2,478,167,241 円	収益分配可能額	E = C - D	19,209,714,476 円	収益分配金	F	19,145,081,505 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	64,632,971 円	口数	H	102,380,115 口	10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,870 円
項目	A	14,887,334,957 円																																																											
当期配当等収益額	A	14,887,334,957 円																																																											
分配準備積立金	B	578,523,467 円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	15,465,858,424 円																																																											
経費	D	1,603,308,329 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	13,862,550,095 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	913,147,985 円																																																											
口数	H	88,694,535 口																																																											
10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,460 円																																																											
項目	A	20,774,733,732 円																																																											
当期配当等収益額	A	20,774,733,732 円																																																											
分配準備積立金	B	913,147,985 円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	21,687,881,717 円																																																											
経費	D	2,478,167,241 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	19,209,714,476 円																																																											
収益分配金	F	19,145,081,505 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	64,632,971 円																																																											
口数	H	102,380,115 口																																																											
10 口当たり分配金	I = F / H × 10	1,870 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

<p style="text-align: center;">第 11 期</p> <p style="text-align: center;">自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 7 月 8 日</p>	<p style="text-align: center;">第 12 期</p> <p style="text-align: center;">自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日</p>
<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 11 期 平成 24 年 7 月 8 日現在	第 12 期 平成 25 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 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 7 月 8 日	第 12 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 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 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 7 月 8 日	第 12 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 年 7 月 8 日
期首元本額 787,092,363,564 円	期首元本額 1,091,563,642,245 円
期中追加設定元本額 556,209,203,780 円	期中追加設定元本額 413,473,110,060 円
期中一部交換元本額 251,737,925,099 円	期中一部交換元本額 245,044,677,000 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第 11 期 自 平成 23 年 7 月 9 日 至 平成 24 年 7 月 8 日	第 12 期 自 平成 24 年 7 月 9 日 至 平成 25 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	48,854,927,135	440,847,476,980
合計	48,854,927,135	440,847,476,980

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 11 期(平成 24 年 7 月 8 日現在)			第 12 期(平成 25 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	10,479,670,000	11,455,400,000	974,929,900	20,814,336,000	22,447,200,000	1,631,927,904
合計	10,479,670,000	11,455,400,000	974,929,900	20,814,336,000	22,447,200,000	1,631,927,904

(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 25 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	4,090,000	201.00	822,090,000	貸付株式数	171,100	
	マルハニチロホールディングス	4,090,000	199.00	813,910,000			
	国際石油開発帝石	4,090	446,500.00	1,826,185,000			
	コムシスホールディングス	4,090,000	1,281.00	5,239,290,000			
	大成建設	4,090,000	385.00	1,574,650,000	貸付株式数	2,516,000	
	大林組	4,090,000	554.00	2,265,860,000			
	清水建設	4,090,000	415.00	1,697,350,000	貸付株式数	154,000	
	鹿島建設	4,090,000	357.00	1,460,130,000			
	大和ハウス工業	4,090,000	1,780.00	7,280,200,000	貸付株式数	262,000	
	積水ハウス	4,090,000	1,409.00	5,762,810,000	貸付株式数	457,000	(231,000)
	日揮	4,090,000	3,650.00	14,928,500,000	貸付株式数	26,000	
	千代田化工建設	4,090,000	1,206.00	4,932,540,000			
	日清製粉グループ本社	4,090,000	1,184.00	4,842,560,000			
	明治ホールディングス	409,000	4,790.00	1,959,110,000			
	日本ハム	4,090,000	1,574.00	6,437,660,000	貸付株式数	67,000	
	サッポロホールディングス	4,090,000	386.00	1,578,740,000			
	アサヒグループホールディングス	4,090,000	2,564.00	10,486,760,000	貸付株式数	130,500	(130,500)
	キリンホールディングス	4,090,000	1,547.00	6,327,230,000			
	宝ホールディングス	4,090,000	914.00	3,738,260,000			
	キッコーマン	4,090,000	1,686.00	6,895,740,000	貸付株式数	10,000	
	味の素	4,090,000	1,399.00	5,721,910,000			
	ニチレイ	4,090,000	516.00	2,110,440,000			
	日本たばこ産業	4,090,000	3,665.00	14,989,850,000			
	東洋紡	4,090,000	154.00	629,860,000	貸付株式数	2,573,000	
	ユニチカ	4,090,000	54.00	220,860,000			
	日清紡ホールディングス	4,090,000	765.00	3,128,850,000			
	帝人	4,090,000	216.00	883,440,000			
	東レ	4,090,000	654.00	2,674,860,000	貸付株式数	183,000	
	王子ホールディングス	4,090,000	420.00	1,717,800,000	貸付株式数	2,643,000	(855,000)
	日本製紙	409,000	1,443.00	590,187,000	貸付株式数	231,100	(150,100)
	三菱製紙	4,090,000	95.00	388,550,000			
	北越紀州製紙	4,090,000	427.00	1,746,430,000	貸付株式数	2,346,500	(1,426,000)
	クラレ	4,090,000	1,415.00	5,787,350,000			
	旭化成	4,090,000	650.00	2,658,500,000			
	昭和電工	4,090,000	138.00	564,420,000	貸付株式数	2,683,000	
	住友化学	4,090,000	328.00	1,341,520,000			
	日産化学工業	4,090,000	1,424.00	5,824,160,000			
	日本曹達	4,090,000	511.00	2,089,990,000			
	東ソー	4,090,000	365.00	1,492,850,000	貸付株式数	147,000	
	トクヤマ	4,090,000	327.00	1,337,430,000	貸付株式数	712,000	
	電気化学工業	4,090,000	355.00	1,451,950,000			
	信越化学工業	4,090,000	6,770.00	27,689,300,000			
	三井化学	4,090,000	231.00	944,790,000	貸付株式数	2,665,000	(42,000)
	三菱ケミカルホールディングス	2,045,000	480.00	981,600,000	貸付株式数	227,500	
	宇部興産	4,090,000	191.00	781,190,000	貸付株式数	284,000	
	日本化薬	4,090,000	1,278.00	5,227,020,000			
	花王	4,090,000	3,330.00	13,619,700,000			
	富士フイルムホールディングス	4,090,000	2,259.00	9,239,310,000			
	資生堂	4,090,000	1,458.00	5,963,220,000			
	協和発酵キリン	4,090,000	1,111.00	4,543,990,000			
	武田薬品工業	4,090,000	4,610.00	18,854,900,000	貸付株式数	16,500	(16,500)
	アステラス製薬	4,090,000	5,470.00	22,372,300,000			
	大日本住友製薬	4,090,000	1,343.00	5,492,870,000	貸付株式数	1,078,100	
	塩野義製薬	4,090,000	2,067.00	8,454,030,000			
	中外製薬	4,090,000	2,047.00	8,372,230,000			
	エーザイ	4,090,000	4,120.00	16,850,800,000	貸付株式数	242,500	
	第一三共	4,090,000	1,703.00	6,965,270,000	貸付株式数	131,800	
	昭和シェル石油	4,090,000	849.00	3,472,410,000			
	JXホールディングス	4,090,000	488.00	1,995,920,000			
	横浜ゴム	4,090,000	1,028.00	4,204,520,000			
	ブリヂストン	4,090,000	3,625.00	14,826,250,000	貸付株式数	100,600	(62,900)
	日東紡績	4,090,000	333.00	1,361,970,000	貸付株式数	22,000	
	旭硝子	4,090,000	651.00	2,662,590,000	貸付株式数	340,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考		
			単価	金額			
日本円	日本板硝子	4,090,000	101.00	413,090,000	貸付株式数	2,732,000	
	日本電気硝子	6,135,000	484.00	2,969,340,000	貸付株式数	2,590,000	
	住友大阪セメント	4,090,000	318.00	1,300,620,000			
	太平洋セメント	4,090,000	335.00	1,370,150,000	貸付株式数	511,000	
	東海カーボン	4,090,000	271.00	1,108,390,000			
	TOTO	4,090,000	1,005.00	4,110,450,000	貸付株式数	81,000	
	日本碍子	4,090,000	1,320.00	5,398,800,000			
	新日鐵住金	4,090,000	282.00	1,153,380,000			
	神戸製鋼所	4,090,000	140.00	572,600,000	貸付株式数	2,152,000	(1,153,000)
	ジェイ エフ イー ホールディングス	409,000	2,290.00	936,610,000			
	日新製鋼ホールディングス	409,000	817.00	334,153,000			
	大平洋金属	4,090,000	449.00	1,836,410,000	貸付株式数	390,000	
	日本軽金属ホールディングス	4,090,000	127.00	519,430,000			
	三井金属鉱業	4,090,000	229.00	936,610,000			
	東邦亜鉛	4,090,000	283.00	1,157,470,000	貸付株式数	427,000	
	三菱マテリアル	4,090,000	342.00	1,398,780,000			
	住友金属鉱山	4,090,000	1,170.00	4,785,300,000			
	DOWAホールディングス	4,090,000	978.00	4,000,020,000	貸付株式数	39,000	
	古河機械金属	4,090,000	187.00	764,830,000	貸付株式数	2,504,000	
	古河電気工業	4,090,000	236.00	965,240,000	貸付株式数	1,060,000	
	住友電気工業	4,090,000	1,301.00	5,321,090,000			
	フジクラ	4,090,000	357.00	1,460,130,000	貸付株式数	326,000	
	SUMCO	409,000	1,136.00	464,624,000	貸付株式数	104,600	
	東洋製罐グループホールディングス	4,090,000	1,584.00	6,478,560,000			
	日本製鋼所	4,090,000	583.00	2,384,470,000	貸付株式数	25,000	
	オークマ	4,090,000	750.00	3,067,500,000			
	アマダ	4,090,000	702.00	2,871,180,000			
	小松製作所	4,090,000	2,257.00	9,231,130,000	貸付株式数	637,700	
	住友重機械工業	4,090,000	449.00	1,836,410,000			
	日立建機	4,090,000	2,022.00	8,269,980,000	貸付株式数	105,600	
	クボタ	4,090,000	1,515.00	6,196,350,000			
	荏原製作所	4,090,000	538.00	2,200,420,000	貸付株式数	69,000	
	ダイキン工業	4,090,000	4,295.00	17,566,550,000	貸付株式数	370,200	
	日本精工	4,090,000	975.00	3,987,750,000			
	NTN	4,090,000	337.00	1,378,330,000	貸付株式数	361,000	
	ジェイテクト	4,090,000	1,169.00	4,781,210,000			
	日立造船	4,090,000	145.00	593,050,000			
	三菱重工業	4,090,000	608.00	2,486,720,000			
	IHI	4,090,000	419.00	1,713,710,000	貸付株式数	925,000	
	コニカミノルタ	4,090,000	771.00	3,153,390,000	貸付株式数	255,000	
	ミネベア	4,090,000	373.00	1,525,570,000	貸付株式数	2,643,000	(62,000)
	日立製作所	4,090,000	674.00	2,756,660,000			
	東芝	4,090,000	482.00	1,971,380,000			
	三菱電機	4,090,000	1,033.00	4,224,970,000			
	富士電機	4,090,000	370.00	1,513,300,000			
	安川電機	4,090,000	1,267.00	5,182,030,000	貸付株式数	1,787,000	
	明電舎	4,090,000	339.00	1,386,510,000			
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,090,000	425.00	1,738,250,000	貸付株式数	1,753,000		
日本電気	4,090,000	229.00	936,610,000				
富士通	4,090,000	421.00	1,721,890,000				
沖電気工業	4,090,000	208.00	850,720,000	貸付株式数	449,000		
パナソニック	4,090,000	818.00	3,345,620,000	貸付株式数	1,450,300	(91,900)	
シャープ	4,090,000	430.00	1,758,700,000	貸付株式数	2,538,000	(738,000)	
ソニー	4,090,000	2,152.00	8,801,680,000	貸付株式数	2,685,300	(91,200)	
TDK	4,090,000	3,580.00	14,642,200,000	貸付株式数	2,341,900		
ミツミ電機	4,090,000	692.00	2,830,280,000				
アルプス電気	4,090,000	769.00	3,145,210,000	貸付株式数	228,000		
パイオニア	4,090,000	206.00	842,540,000	貸付株式数	2,748,300	(14,600)	
横河電機	4,090,000	1,224.00	5,006,160,000				
アドバンテスト	8,180,000	1,650.00	13,497,000,000	貸付株式数	2,490,300		
カシオ計算機	4,090,000	890.00	3,640,100,000	貸付株式数	2,454,800		
ファナック	4,090,000	14,540.00	59,468,600,000				
京セラ	4,090,000	10,450.00	42,740,500,000				
太陽誘電	4,090,000	1,542.00	6,306,780,000				
大日本スクリーン製造	4,090,000	562.00	2,298,580,000	貸付株式数	1,740,000		
キヤノン	6,135,000	3,330.00	20,429,550,000				
リコー	4,090,000	1,181.00	4,830,290,000	貸付株式数	2,258,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考		
			単価	金額			
日本円	東京エレクトロン	4,090,000	4,830.00	19,754,700,000			
	デンソー	4,090,000	4,700.00	19,223,000,000			
	三井造船	4,090,000	161.00	658,490,000	貸付株式数	2,481,000	
	川崎重工業	4,090,000	336.00	1,374,240,000			
	日産自動車	4,090,000	1,048.00	4,286,320,000	貸付株式数	179,300	
	いすゞ自動車	4,090,000	764.00	3,124,760,000	貸付株式数	64,000	(64,000)
	トヨタ自動車	4,090,000	6,250.00	25,562,500,000			
	日野自動車	4,090,000	1,579.00	6,458,110,000			
	三菱自動車工業	4,090,000	147.00	601,230,000	貸付株式数	2,740,000	(2,029,000)
	マツダ	4,090,000	430.00	1,758,700,000	貸付株式数	285,000	
	本田技研工業	8,180,000	3,760.00	30,756,800,000			
	スズキ	4,090,000	2,432.00	9,946,880,000			
	富士重工業	4,090,000	2,575.00	10,531,750,000			
	テルモ	4,090,000	5,090.00	20,818,100,000			
	ニコン	4,090,000	2,334.00	9,546,060,000	貸付株式数	366,200	
	オリンパス	4,090,000	3,095.00	12,658,550,000			
	シチズンホールディングス	4,090,000	559.00	2,286,310,000			
	凸版印刷	4,090,000	698.00	2,854,820,000	貸付株式数	17,000	
	大日本印刷	4,090,000	917.00	3,750,530,000	貸付株式数	2,184,000	(2,184,000)
	ヤマハ	4,090,000	1,171.00	4,789,390,000			
	東京電力	409,000	628.00	256,852,000	貸付株式数	262,900	
	中部電力	409,000	1,443.00	590,187,000			
	関西電力	409,000	1,404.00	574,236,000			
	東京瓦斯	4,090,000	545.00	2,229,050,000			
	大阪瓦斯	4,090,000	416.00	1,701,440,000	貸付株式数	42,000	
	東武鉄道	4,090,000	525.00	2,147,250,000	貸付株式数	64,000	
	東京急行電鉄	4,090,000	673.00	2,752,570,000			
	小田急電鉄	4,090,000	983.00	4,020,470,000	貸付株式数	2,406,000	(230,000)
	京王電鉄	4,090,000	691.00	2,826,190,000	貸付株式数	25,000	
	京成電鉄	4,090,000	952.00	3,893,680,000			
	東日本旅客鉄道	409,000	8,050.00	3,292,450,000			
	西日本旅客鉄道	409,000	4,330.00	1,770,970,000			
	東海旅客鉄道	409,000	12,570.00	5,141,130,000			
	日本通運	4,090,000	488.00	1,995,920,000			
	ヤマトホールディングス	4,090,000	2,185.00	8,936,650,000	貸付株式数	765,000	
	日本郵船	4,090,000	277.00	1,132,930,000	貸付株式数	48,000	
	商船三井	4,090,000	401.00	1,640,090,000	貸付株式数	2,341,000	
	川崎汽船	4,090,000	208.00	850,720,000	貸付株式数	1,446,000	
	ANAホールディングス	4,090,000	215.00	879,350,000	貸付株式数	2,731,000	(554,000)
	三菱倉庫	4,090,000	1,428.00	5,840,520,000			
	ヤフー	16,360	51,100.00	835,996,000	貸付株式数	4,462	
	トレンドマイクロ	4,090,000	3,205.00	13,108,450,000	貸付株式数	900,200	
	スカパーJSATホールディングス	4,090	46,600.00	190,594,000			
	日本電信電話	409,000	5,150.00	2,106,350,000			
	KDDI	8,180,000	4,995.00	40,859,100,000	貸付株式数	1,841,500	(454,900)
	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	4,090	154,500.00	631,905,000			
	東宝	409,000	2,117.00	865,853,000			
エヌ・ティ・ティ・データ	40,900	359,000.00	14,683,100,000				
コナミ	4,090,000	2,039.00	8,339,510,000	貸付株式数	464,100		
ソフトバンク	12,269,900	5,680.00	69,693,032,000				
双日	409,000	178.00	72,802,000				
伊藤忠商事	4,090,000	1,189.00	4,863,010,000	貸付株式数	257,600		
丸紅	4,090,000	702.00	2,871,180,000	貸付株式数	727,000		
豊田通商	4,090,000	2,767.00	11,317,030,000				
三井物産	4,090,000	1,292.00	5,284,280,000	貸付株式数	2,600		
住友商事	4,090,000	1,300.00	5,317,000,000				
三菱商事	4,090,000	1,775.00	7,259,750,000	貸付株式数	179,600	(179,600)	
J・フロント リテイリング	4,090,000	813.00	3,325,170,000				
三越伊勢丹ホールディングス	4,090,000	1,406.00	5,750,540,000				
セブン&アイ・ホールディングス	4,090,000	3,775.00	15,439,750,000				
高島屋	4,090,000	1,046.00	4,278,140,000	貸付株式数	336,000		
丸井グループ	4,090,000	993.00	4,061,370,000				
イオン	4,090,000	1,356.00	5,546,040,000	貸付株式数	648,300	(229,000)	
ユニーグループ・ホールディングス	4,090,000	631.00	2,580,790,000	貸付株式数	214,400		
ファーストリテイリング	4,090,000	36,800.00	150,512,000,000	貸付株式数	45,300	(45,300)	
新生銀行	4,090,000	238.00	973,420,000				
あおぞら銀行	4,090,000	317.00	1,296,530,000	貸付株式数	2,352,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考		
			単価	金額			
日本円	三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,090,000	638.00	2,609,420,000			
	りそなホールディングス	409,000	494.00	202,046,000	貸付株式数	66,600	(66,600)
	三井住友トラスト・ホールディングス	4,090,000	481.00	1,967,290,000			
	三井住友フィナンシャルグループ	409,000	4,670.00	1,910,030,000			
	千葉銀行	4,090,000	707.00	2,891,630,000			
	横浜銀行	4,090,000	536.00	2,192,240,000			
	ふくおかフィナンシャルグループ	4,090,000	434.00	1,775,060,000			
	静岡銀行	4,090,000	1,103.00	4,511,270,000			
	みずほフィナンシャルグループ	4,090,000	210.00	858,900,000			
	大和証券グループ本社	4,090,000	889.00	3,636,010,000			
	野村ホールディングス	4,090,000	789.00	3,227,010,000			
	松井証券	4,090,000	974.00	3,983,660,000			
	NK S J ホールディングス	1,022,500	2,483.00	2,538,867,500			
	M S & A D インシュアランスグループホールディングス	1,227,000	2,758.00	3,384,066,000			
	ソニーフィナンシャルホールディングス	818,000	1,627.00	1,330,886,000			
	第一生命保険	4,090	151,700.00	620,453,000			
	東京海上ホールディングス	2,045,000	3,360.00	6,871,200,000			
	T & D ホールディングス	818,000	1,382.00	1,130,476,000			
	クレディセゾン	4,090,000	2,499.00	10,220,910,000			
	三井不動産	4,090,000	3,080.00	12,597,200,000			
	三菱地所	4,090,000	2,742.00	11,214,780,000			
	平和不動産	818,000	1,800.00	1,472,400,000			
	東京建物	4,090,000	878.00	3,591,020,000	貸付株式数	72,000	
	東急不動産	4,090,000	1,020.00	4,171,800,000			
	住友不動産	4,090,000	4,220.00	17,259,800,000			
	電通	4,090,000	3,140.00	12,842,600,000	貸付株式数	1,638,700	(424,700)
	東京ドーム	4,090,000	679.00	2,777,110,000	貸付株式数	40,000	
	セコム	4,090,000	5,430.00	22,208,700,000			
計	銘柄数：225			1,441,236,290,500			
	組入時価比率：98.4%			100.0%			
合計				1,441,236,290,500			

(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 25 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。