

平成22年7月期 中間決算短信 (平成21年7月9日～平成22年1月8日)

平成22年2月18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 執行役社長 吉川 淳
 問合せ先責任者 投信ディスクロージャー部 石渡 寛利 TEL (03)-3241-9511

半期報告書提出予定日 平成22年3月31日

I ファンドの運用状況

1. 平成22年1月中間期の運用状況 (平成21年7月9日～平成22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22年1月中間期	562,572	(99.2)	4,536	(0.8)	567,108	(100)
平成21年1月中間期	598,888	(98.9)	6,579	(1.1)	605,467	(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22年1月中間期	56,920	30,360	35,220	52,060
平成21年1月中間期	55,954	20,210	9,115	67,050

(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/当中間計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
平成22年1月中間期	591,119	24,010	567,108	108,933
平成21年1月中間期	652,056	46,588	605,467	90,300

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 8 期中間計算期間末 平成 21 年 1 月 8 日現在	第 9 期中間計算期間末 平成 22 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	52,273,582,156	24,477,849,442
株式	598,888,165,950	562,572,092,900
派生商品評価勘定	979,370	4,245,590
未収配当金	872,830,000	640,004,000
未収利息	19,463	13,405
その他未収収益	20,592,356	1,810,201
預有価証券		3,423,770,610
流動資産合計	652,056,169,295	591,119,786,148
資産合計	652,056,169,295	591,119,786,148
負債の部		
流動負債		
前受金	240,000	750,000
未払金	48,150,000	
未払解約金		3,423,770,610
未払受託者報酬	246,138,716	221,656,953
未払委託者報酬	528,413,478	475,157,523
未払利息	8,118,944	299,868
有価証券貸借取引受入金	45,750,855,779	19,882,943,251
その他未払費用	7,041,321	6,334,618
流動負債合計	46,588,958,238	24,010,912,823
負債合計	46,588,958,238	24,010,912,823
純資産の部		
元本等		
元本	825,187,574,434	640,707,736,624
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	219,720,363,377	73,598,863,299
(分配準備積立金)	551,055,665	459,342,346
元本等合計	605,467,211,057	567,108,873,325
純資産合計	605,467,211,057	567,108,873,325
負債純資産合計	652,056,169,295	591,119,786,148

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

期別	第 8 期中間計算期間 自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 1 月 8 日	第 9 期中間計算期間 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 日
科目	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,709,922,360	4,625,794,360
受取利息	73,723,092	18,033,451
有価証券売買等損益	277,970,362,112	66,736,474,398
派生商品取引等損益	88,590,320	2,176,330
その他収益	80,080,902	65,773,340
営業収益合計	271,195,226,078	71,448,251,879
営業費用		
支払利息	58,924,012	10,837,734
受託者報酬	246,138,716	221,656,953
委託者報酬	528,413,478	475,157,523
その他費用	10,059,217	10,758,406
営業費用合計	843,535,423	718,410,616
営業利益	272,038,761,501	70,729,841,263
経常利益	272,038,761,501	70,729,841,263
中間純利益	272,038,761,501	70,729,841,263
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()	45,647,744,079	162,511,409,680
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,295,626,253	78,340,249,788
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	22,295,626,253	78,340,249,788
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,624,972,208	60,157,544,670
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	15,624,972,208	60,157,544,670
分配金		
中間剰余金又は中間欠損金()	219,720,363,377	73,598,863,299

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 8 期中間計算期間 自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 1 月 8 日	第 9 期中間計算期間 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 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。 (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。	(1) 株式 同左 (2) 先物取引 同左
2 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 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の計上基準 約定日基準で計上しております。	(1) 受取配当金の計上基準 同左 (2) 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益の計上基準 同左
3 その他	当ファンドの計算期間は、平成 20 年 7 月 9 日から平成 21 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 20 年 7 月 9 日から平成 21 年 1 月 8 日までとなっております。	当ファンドの計算期間は、平成 21 年 7 月 9 日から平成 22 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 21 年 7 月 9 日から平成 22 年 1 月 8 日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第 8 期中間計算期間末 平成 21 年 1 月 8 日現在	第 9 期中間計算期間末 平成 22 年 1 月 8 日現在
1 中間計算期間の末日における受益権の総数 67,050,262 口	1 中間計算期間の末日における受益権の総数 52,060,432 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 219,720,363,377 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 73,598,863,299 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 9,030.0 円 (10 口当たり純資産額 90,300 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 10,893.3 円 (10 口当たり純資産額 108,933 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 42,841,386,900 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 19,175,243,950 円

(その他の注記)

1 元本の移動

第 8 期中間計算期間 自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 1 月 8 日		第 9 期中間計算期間 自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 日	
期首元本額	688,634,259,067 円	期首元本額	700,522,267,252 円
期中追加設定元本額	248,732,592,620 円	期中追加設定元本額	373,649,257,970 円
期中一部交換元本額	112,179,277,253 円	期中一部交換元本額	433,463,788,598 円

2 売買目的有価証券の中間貸借対照表計上額等

第 8 期中間計算期間(自 平成 20 年 7 月 9 日 至 平成 21 年 1 月 8 日)

該当事項はございません。

第 9 期中間計算期間(自 平成 21 年 7 月 9 日 至 平成 22 年 1 月 8 日)

該当事項はございません。

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 8 期中間計算期間末(平成 21 年 1 月 8 日現在)				第 9 期中間計算期間末(平成 22 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)
		うち 1 年超				うち 1 年超		
市場取引								
先物取引								
株価指数先物取引								
買建	7,890,000		8,870,000	979,370	71,420,000		75,670,000	4,245,590
合計	7,890,000		8,870,000	979,370	71,420,000		75,670,000	4,245,590

(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。