平成24年7月期　中間決算短信（平成23年7月11日～平成24年1月10日）

平成24年2月16日

ファンド名	TOPIX連動型上場投資信託		
コード番号	(1306)	上場取引所	東証
連動対象指標	東証株価指数(TOPIX)	売買単位	10口
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11日～平成24年1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1月中間期	640,766	(98.3)	11,272	(1.7)	652,038	(100)
平成23年7月期	599,628	(99.9)	624	(0.1)	600,253	(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	683,396	220,952	27,313	877,036

(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/当中間計算期間末(前計算期末)発行済口数)×100)
	百万円	百万円	百万円	円
平成24年1月中間期	762,826	110,787	652,038	74,346
平成23年7月期	683,896	83,643	600,253	87,834

2. 会計方針の変更

① 会計基準等の改正に伴う変更　　有・(無)

② ①以外の変更　　有・(無)

Ⅱ 中間財務諸表等

【TOPIX 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 10 日現在	第 11 期中間計算期間末 平成 24 年 1 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	83,753,413,977	110,743,012,872
株式	599,628,870,563	640,766,651,557
派生商品評価勘定	―	45,664,570
未収入金	―	61,995,984
未収配当金	508,777,950	752,569,325
未収利息	469,030	27,178
その他未収収益	5,377,345	7,541,611
差入委託証拠金	―	178,780,000
預有価証券	―	10,270,387,138
流動資産合計	683,896,908,865	762,826,630,235
資産合計	683,896,908,865	762,826,630,235
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	―	23,823,850
未払金	―	62,306,226
未払収益分配金	14,146,317,486	―
未払解約金	―	10,270,387,138
未払受託者報酬	136,720,591	148,732,308
未払委託者報酬	261,657,386	282,013,737
未払利息	1,005,122	1,354,009
有価証券貸借取引受入金	68,925,625,835	99,906,659,161
その他未払費用	171,986,071	92,502,169
流動負債合計	83,643,312,491	110,787,778,598
負債合計	83,643,312,491	110,787,778,598
純資産の部		
元本等		
元本	854,246,225,000	1,096,295,268,750
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△253,992,628,626	△444,256,417,113
(分配準備積立金)	577,834,177	577,834,177
元本等合計	600,253,596,374	652,038,851,637
純資産合計	600,253,596,374	652,038,851,637
負債純資産合計	683,896,908,865	762,826,630,235

(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 11 日 至　平成 23 年 1 月 10 日	第 11 期中間計算期間 自　平成 23 年 7 月 11 日 至　平成 24 年 1 月 10 日
科目	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	7,890,275,419	7,057,769,490
受取利息	56,264,495	44,938,964
有価証券売買等損益	47,710,970,033	△105,209,077,981
派生商品取引等損益	―	37,519,900
その他収益	143,204,649	132,476,994
営業収益合計	55,800,714,596	△97,936,372,633
営業費用		
支払利息	32,824,113	22,619,244
受託者報酬	157,112,507	148,732,308
委託者報酬	297,319,562	282,013,737
その他費用	96,023,564	92,915,718
営業費用合計	583,279,746	546,281,007
営業利益	55,217,434,850	△98,482,653,640
経常利益	55,217,434,850	△98,482,653,640
中間純利益	55,217,434,850	△98,482,653,640
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(△)	△229,454,494,202	△253,992,628,626
剰余金増加額又は欠損金減少額	135,080,828,673	13,685,565,327
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	135,080,828,673	13,685,565,327
剰余金減少額又は欠損金増加額	186,759,084,100	105,466,700,174
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	186,759,084,100	105,466,700,174
分配金	―	―
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△225,915,314,779	△444,256,417,113

(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 11 日から平成 24 年 7 月 10 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 11 日から平成 24 年 1 月 10 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 11 日 至　平成 24 年 1 月 10 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 10 日現在	第 11 期中間計算期間末 平成 24 年 1 月 10 日現在
1 計算期間の末日における受益権の総数 683,396,980 口	1 中間計算期間の末日における受益権の総数 877,036,215 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　253,992,628,626 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　444,256,417,113 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　878.34 円 (100 口当たり純資産額　87,834 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　743.46 円 (100 口当たり純資産額　74,346 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 65,769,507,307 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 94,717,969,215 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 10 日現在	第 11 期中間計算期間末 平成 24 年 1 月 10 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 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。
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。	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。

(その他の注記)

1 元本の移動

第 10 期 自　平成 22 年 7 月 11 日 至　平成 23 年 7 月 10 日		第 11 期中間計算期間 自　平成 23 年 7 月 11 日 至　平成 24 年 1 月 10 日	
期首元本額	751,223,726,250 円	期首元本額	854,246,225,000 円
期中追加設定元本額	751,350,000,000 円	期中追加設定元本額	276,190,750,000 円
期中一部交換元本額	648,327,501,250 円	期中一部交換元本額	34,141,706,250 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 10 日現在)				第 11 期中間計算期間末(平成 24 年 1 月 10 日現在)			
	契約額等(円)	うち 1 年超	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち 1 年超	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	―	―	―	―	6,247,820,000	―	6,270,200,000	21,840,720
合計	―	―	―	―	6,247,820,000	―	6,270,200,000	21,840,720

(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。