

平成27年7月期 中間決算短信（平成26年7月9日～平成27年1月8日）

平成27年2月20日

ファンド名	日経225連動型上場投資信託	上場取引所	東証
コード番号	(1321)	売買単位	1口
連動対象指標	日経平均株価		
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		
U R L	http://www.nomura-am.co.jp		
代表者	CEO兼執行役社長	渡邊 国夫	
問合せ先責任者	投信ディスクロージャー部長	村山 治子	TEL (03)-3241-9511
半期報告書提出予定日	平成27年3月26日		

I ファンドの運用状況

1. 平成27年1月中間期の運用状況（平成26年7月9日～平成27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27年1月中間期	2,310,680	(98.2)	42,950	(1.8)	2,353,631	(100)
平成26年7月期	1,892,525	(98.7)	24,050	(1.3)	1,916,575	(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27年1月中間期	123,274	36,450	25,571	134,153

(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(前計算期末) 発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
平成27年1月中間期	2,461,689	108,057	2,353,631	175,444
平成26年7月期	2,027,959	111,383	1,916,575	155,473

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】

(単位：円)

	第 13 期 (平成 26 年 7 月 8 日現在)	第 14 期中間計算期間末 (平成 27 年 1 月 8 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	132,404,033,805	144,782,238,163
株式	1,892,525,209,000	2,310,680,861,860
派生商品評価勘定	273,050,966	-
未収入金	295,907,380	-
未収配当金	1,731,530,000	2,893,275,000
未収利息	86,610	78,539
その他未収収益	11,205,629	11,507,754
差入委託証拠金	718,637,000	3,321,537,000
流動資産合計	2,027,959,660,390	2,461,689,498,316
資産合計	2,027,959,660,390	2,461,689,498,316
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	817,267,701
未払金	-	394,000
未払収益分配金	24,531,576,546	-
未払受託者報酬	585,532,784	657,338,745
未払委託者報酬	1,583,702,736	1,841,671,692
未払利息	3,941,218	3,471,649
有価証券貸借取引受入金	84,659,489,775	104,715,102,490
その他未払費用	19,720,263	22,718,219
流動負債合計	111,383,963,322	108,057,964,496
負債合計	111,383,963,322	108,057,964,496
純資産の部		
元本等		
元本	1,517,136,243,978	1,651,023,100,111
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	399,439,453,090	702,608,433,709
(分配準備積立金)	42,022,437	42,022,437
元本等合計	1,916,575,697,068	2,353,631,533,820
純資産合計	1,916,575,697,068	2,353,631,533,820
負債純資産合計	2,027,959,660,390	2,461,689,498,316

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 13 期中間計算期間 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 1 月 8 日	第 14 期中間計算期間 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 1 月 8 日
営業収益		
受取配当金	11,604,003,600	16,659,609,960

受取利息	38,780,902	27,327,453
有価証券売買等損益	228,796,508,258	241,339,272,580
派生商品取引等損益	3,339,153,512	3,887,919,242
その他収益	62,379,715	47,463,045
営業収益合計	243,840,825,987	261,961,592,280
営業費用		
支払利息	17,366,256	13,095,531
受託者報酬	520,567,635	657,338,745
委託者報酬	1,362,357,297	1,841,671,692
その他費用	21,358,943	26,664,239
営業費用合計	1,921,650,131	2,538,770,207
営業利益又は営業損失(△)	241,919,175,856	259,422,822,073
経常利益又は経常損失(△)	241,919,175,856	259,422,822,073
中間純利益又は中間純損失(△)	241,919,175,856	259,422,822,073
一部交換に伴う中間純利益金額の分配額又は一部交換に伴う中間純損失金額の分配額(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	204,046,639,550	399,439,453,090
剰余金増加額又は欠損金減少額	67,066,378,426	154,935,924,509
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	67,066,378,426	154,935,924,509
剰余金減少額又は欠損金増加額	39,031,135,064	111,189,765,963
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	39,031,135,064	111,189,765,963
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	474,001,058,768	702,608,433,709

(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	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。 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	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。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 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る場合、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	当ファンドの中間計算期間は、平成 26 年 7 月 9 日から平成 27 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 13 期 平成 26 年 7 月 8 日現在	第 14 期中間計算期間末 平成 27 年 1 月 8 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数

123, 274, 254 口	134, 153, 173 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	2. 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 15, 547. 3 円	1 口当たり純資産額 17, 544. 4 円
(10 口当たり純資産額) (155, 473 円)	(10 口当たり純資産額) (175, 444 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	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券
80, 101, 690, 300 円	101, 553, 954, 960 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 13 期 平成 26 年 7 月 8 日現在	第 14 期中間計算期間末 平成 27 年 1 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. 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。	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。	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。	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 13 期 自 平成 25 年 7 月 9 日 至 平成 26 年 7 月 8 日	第 14 期中間計算期間 自 平成 26 年 7 月 9 日 至 平成 27 年 1 月 8 日
期首元本額 1, 259, 992, 075, 305 円	期首元本額 1, 517, 136, 243, 978 円
期中追加設定元本額 569, 191, 242, 730 円	期中追加設定元本額 448, 600, 364, 810 円
期中一部交換元本額 312, 047, 074, 057 円	期中一部交換元本額 314, 713, 508, 677 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 13 期(平成 26 年 7 月 8 日現在)				第 14 期中間計算期間末(平成 27 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								
株価指数先物取引								
買建	23, 564, 344, 000	—	23, 838, 360, 000	273, 050, 966	43, 612, 977, 000	—	42, 797, 250, 000	△817, 267, 701
合計	23, 564, 344, 000	—	23, 838, 360, 000	273, 050, 966	43, 612, 977, 000	—	42, 797, 250, 000	△817, 267, 701

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、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。