

平成27年7月期（平成26年7月16日～平成27年7月15日）決算短信

平成27年8月26日

上場取引所

東証

ファンド名 東証銀行業株価指数連動型上場投資信託  
 コード番号 ( 1615 )  
 連動対象指標 東証銀行業株価指数  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 100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兼執行役社長 渡邊 国夫  
 問合せ先責任者 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成27年9月30日  
 分配金支払開始日 平成27年8月21日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年7月期の運用状況（平成26年7月16日～平成27年7月15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7月期	66,654	(100.0)	9	(0.0)	66,663	(100)
平成26年7月期	47,368	(100.0)	21	(0.0)	47,389	(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27年7月期	265,986	104,975	95,969	274,991
平成26年7月期	186,135	129,500	49,650	265,986

(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27年7月期	67,729	1,065	66,663	24,242
平成26年7月期	48,077	687	47,389	17,817

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成27年7月期	364.00
平成26年7月期	242.00

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 財務諸表等

## 東証銀行業株価指数連動型上場投資信託

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 12 期 (平成 26 年 7 月 15 日現在)	第 13 期 (平成 27 年 7 月 15 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	704,827,709	1,061,207,413
株式	47,368,069,100	66,654,839,620
未収入金	-	5,450,180
未収配当金	4,590,000	7,584,000
未収利息	1,271	2,010
流動資産合計	48,077,488,080	67,729,083,223
資産合計	48,077,488,080	67,729,083,223
負債の部		
流動負債		
未払金	-	2,761,900
未払収益分配金	643,686,453	1,000,970,632
未払受託者報酬	13,945,651	19,367,837
未払委託者報酬	29,883,464	41,502,447
その他未払費用	398,388	553,307
流動負債合計	687,913,956	1,065,156,123
負債合計	687,913,956	1,065,156,123
純資産の部		
元本等		
元本	53,197,227,600	54,998,386,400
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△5,807,653,476	11,665,540,700
(分配準備積立金)	695,316	389,683
元本等合計	47,389,574,124	66,663,927,100
純資産合計	47,389,574,124	66,663,927,100
負債純資産合計	48,077,488,080	67,729,083,223

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日
営業収益		
受取配当金	724,403,700	1,111,866,950
受取利息	215,696	256,935
有価証券売買等損益	△819,124,054	13,882,800,180
その他収益	3,280	4,545
営業収益合計	△94,501,378	14,994,928,610
営業費用		
受託者報酬	25,343,865	35,146,185
委託者報酬	54,308,152	75,313,135

その他費用	724,042	1,004,111
営業費用合計	80,376,059	111,463,431
営業利益又は営業損失(△)	△174,877,437	14,883,465,179
経常利益又は経常損失(△)	△174,877,437	14,883,465,179
当期純利益又は当期純損失(△)	△174,877,437	14,883,465,179
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△2,614,719,750	△5,807,653,476
剰余金増加額又は欠損金減少額	888,216,900	3,590,699,629
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	888,216,900	601,528,960
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	2,989,170,669
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,262,586,736	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,262,586,736	-
分配金	643,686,453	1,000,970,632
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△5,807,653,476	11,665,540,700

## (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	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	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。
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、信託約款の規定により、平成 26 年 7 月 16 日から平成 27 年 7 月 15 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 12 期 平成 26 年 7 月 15 日現在	第 13 期 平成 27 年 7 月 15 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 265,986,138 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 274,991,932 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 5,807,653,476 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 242.42 円 (100 口当たり純資産額) (24,242 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 178.17 円 (100 口当たり純資産額) (17,817 円)	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程
項目	項目

当期配当等収益額	A	724,622,676 円
分配準備積立金	B	135,152 円
配当等収益合計額	C=A+B	724,757,828 円
経費	D	80,376,059 円
収益分配可能額	E=C-D	644,381,769 円
収益分配金	F	643,686,453 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	695,316 円
口数	H	265,986,138 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	242 円

当期配当等収益額	A	1,112,128,430 円
分配準備積立金	B	695,316 円
配当等収益合計額	C=A+B	1,112,823,746 円
経費	D	111,463,431 円
収益分配可能額	E=C-D	1,001,360,315 円
収益分配金	F	1,000,970,632 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	389,683 円
口数	H	274,991,932 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	364 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

第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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その金融商品に係るリスク</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

第 12 期 平成 26 年 7 月 15 日現在	第 13 期 平成 27 年 7 月 15 日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>株式</p> <p>(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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

## (関連当事者との取引に関する注記)

第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 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 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日
期首元本額 37,227,187,200 円	期首元本額 53,197,227,600 円
期中追加設定元本額 25,900,180,000 円	期中追加設定元本額 20,995,000,000 円
期中一部交換元本額 9,930,139,600 円	期中一部交換元本額 19,193,841,200 円

## 2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 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	△610,240,834	12,641,455,084
合計	△610,240,834	12,641,455,084

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

(1) 株式(平成 27 年 7 月 15 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	島根銀行	5,900	1,585.00	9,351,500	
		じもとホールディングス	201,600	222.00	44,755,200	
		足利ホールディングス	176,700	520.00	91,884,000	
		東京TYフィナンシャルグループ	36,200	4,045.00	146,429,000	
		新生銀行	2,674,000	264.00	705,936,000	
		あおぞら銀行	1,896,000	476.00	902,496,000	
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	22,543,100	883.00	19,905,557,300	
		りそなホールディングス	3,286,900	680.80	2,237,721,520	
		三井住友トラスト・ホールディングス	6,211,000	565.40	3,511,699,400	
		三井住友フィナンシャルグループ	2,124,800	5,451.00	11,582,284,800	
		第四銀行	355,000	533.00	189,215,000	
		北越銀行	303,000	254.00	76,962,000	

西日本シティ銀行	986,000	380.00	374,680,000
千葉銀行	1,083,000	964.00	1,044,012,000
横浜銀行	1,884,000	805.80	1,518,127,200
常陽銀行	1,016,000	726.00	737,616,000
群馬銀行	666,000	927.00	617,382,000
武蔵野銀行	44,800	4,850.00	217,280,000
千葉興業銀行	58,300	782.00	45,590,600
筑波銀行	116,800	406.00	47,420,800
七十七銀行	474,000	776.00	367,824,000
青森銀行	220,000	407.00	89,540,000
秋田銀行	186,000	389.00	72,354,000
山形銀行	169,000	540.00	91,260,000
岩手銀行	19,600	5,470.00	107,212,000
東邦銀行	251,000	565.00	141,815,000
東北銀行	151,000	172.00	25,972,000
みちのく銀行	140,000	218.00	30,520,000
ふくおかフィナンシャルグループ	1,140,000	662.00	754,680,000
静岡銀行	823,000	1,349.00	1,110,227,000
十六銀行	352,000	506.00	178,112,000
スルガ銀行	296,600	2,680.00	794,888,000
八十二銀行	508,000	948.00	481,584,000
山梨中央銀行	174,000	583.00	101,442,000
大垣共立銀行	351,000	453.00	159,003,000
福井銀行	240,000	267.00	64,080,000
北國銀行	313,000	450.00	140,850,000
清水銀行	9,500	3,650.00	34,675,000
滋賀銀行	282,000	661.00	186,402,000
南都銀行	271,000	440.00	119,240,000
百五銀行	270,000	595.00	160,650,000
京都銀行	536,000	1,481.00	793,816,000
紀陽銀行	110,300	1,871.00	206,371,300
三重銀行	125,000	292.00	36,500,000
ほくほくフィナンシャルグループ	1,912,000	281.00	537,272,000
広島銀行	829,000	730.00	605,170,000
山陰合同銀行	170,000	1,238.00	210,460,000
中国銀行	199,100	1,958.00	389,837,800

鳥取銀行	89,000	230.00	20,470,000	
伊予銀行	300,500	1,540.00	462,770,000	
百十四銀行	308,000	436.00	134,288,000	
四国銀行	217,000	275.00	59,675,000	
阿波銀行	230,000	793.00	182,390,000	
鹿児島銀行	195,000	857.00	167,115,000	
大分銀行	172,000	539.00	92,708,000	
宮崎銀行	187,000	445.00	83,215,000	
肥後銀行	229,000	766.00	175,414,000	
佐賀銀行	170,000	307.00	52,190,000	
十八銀行	173,000	383.00	66,259,000	
沖縄銀行	22,300	5,290.00	117,967,000	
琉球銀行	57,900	1,840.00	106,536,000	
セブン銀行	947,500	575.00	544,812,500	
みずほフィナンシャルグループ	39,204,000	265.70	10,416,502,800	
高知銀行	109,000	166.00	18,094,000	
山口フィナンシャルグループ	280,000	1,599.00	447,720,000	
長野銀行	92,000	233.00	21,436,000	
名古屋銀行	254,000	489.00	124,206,000	
北洋銀行	423,300	563.00	238,317,900	
愛知銀行	10,200	7,080.00	72,216,000	
第三銀行	159,000	198.00	31,482,000	
中京銀行	115,000	239.00	27,485,000	
東日本銀行	122,000	474.00	57,828,000	
大光銀行	99,000	256.00	25,344,000	
愛媛銀行	165,000	271.00	44,715,000	
トマト銀行	108,000	199.00	21,492,000	
みなと銀行	254,000	319.00	81,026,000	
京葉銀行	231,000	632.00	145,992,000	
関西アーバン銀行	39,100	1,451.00	56,734,100	
栃木銀行	141,000	698.00	98,418,000	
北日本銀行	8,700	3,560.00	30,972,000	
東和銀行	394,000	119.00	46,886,000	
福島銀行	346,000	101.00	34,946,000	
大東銀行	180,000	174.00	31,320,000	
トモニホールディングス	215,600	557.00	120,089,200	

	フィデアホールディングス	172,700	273.00	47,147,100	
	池田泉州ホールディングス	267,800	562.00	150,503,600	
	小計 銘柄数：86			66,654,839,620	
	組入時価比率：100.0%			100.0%	
	合計			66,654,839,620	

(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) 株式以外の有価証券(平成 27 年 7 月 15 日現在)

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。