



平成30年7月期 中間決算短信 (平成29年7月16日～平成30年1月15日)
Semi-annual Earnings Report for Fiscal Year ending July 2018 (July 16, 2017 - January 15, 2018)

平成30年2月26日
February 26, 2018

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) 上場取引所 東証
連動対象指標 東証銀行業株価指数 売買単位 100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
半期報告書提出予定日 平成30年3月29日

Fund name: TOPIX Banks Exchange Traded Fund
Code: 1615 Listed Exchange:TSE
Underlying index: TOPIX Banks Index Trading unit: 100 units
Primary invested assets: Stocks
Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd.
URL: http://www.nomura-am.co.jp
Representative: Kunio Watanabe, President & CEO
Contact person: Akihiro Watanabe, General Manager of Products Planning & Development Dept.
Scheduled date of submission of semi-annual securities report: March 29, 2018

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 平成30年1月中間期の運用状況 (平成29年7月16日～平成30年1月15日)

Management Status for Half-Year ended January 2018 (July 16, 2017 - January 15, 2018)

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

Assets

(fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

	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)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	% %	百万円 JPY mil.	% %	百万円 JPY mil.	% %
平成30年1月中間期 HY ended Jan. 2018	55,422	(98.9)	624	(1.1)	56,046	(100.0)
平成29年7月期 FY ended Jul. 2017	43,777	(100.0)	7	(0.0)	43,784	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当中間計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Semi-annual Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
平成30年1月中間期 HY ended Jan. 2018	228,292	40,000	19,705	248,588

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (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) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Semi-annual Period(Previous Fiscal Period))×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
平成30年1月中間期 HY ended Jan. 2018	56,112	66	56,046	22,546
平成29年7月期 FY ended Jul. 2017	44,601	816	43,784	19,179

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無
Changes other than those in ① No

II 中間財務諸表等 Semi-annual Financial Statements

(1) 【中間貸借対照表】 Semi-annual Balance Sheet

(単位：円) (Unit: JPY)

	第15期 (平成29年7月15日現在) 15th Fiscal Year As of July 15, 2017	第16期中間計算期間末 (平成30年1月15日現在) 16th Semi-annual Period As of January 15, 2018
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
コール・ローン Call loans	818,340,744	673,695,457
株式 Stocks	43,777,442,280	55,422,186,260
未収入金 Accounts receivable - other	-	9,673,580
未収配当金 Accrued dividend receivable	5,460,000	7,310,000
流動資産合計 Total current assets	44,601,243,024	56,112,865,297
資産合計 Total assets	44,601,243,024	56,112,865,297
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払金 Accounts payable - other	-	9,998,560
未払収益分配金 Unpaid dividends	771,629,934	-
未払受託者報酬 Trustee fee payable	14,151,450	17,676,816
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	30,324,484	37,878,838
未払利息 Accrued interest expenses	2,028	546
その他未払費用 Other accrued expenses	404,260	504,993
流動負債合計 Total current liabilities	816,512,156	66,059,753
負債合計 Total liabilities	816,512,156	66,059,753
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	45,658,576,000	49,717,699,800

剰余金 Surplus		
中間剰余金又は中間欠損金 (△) Balance at end of current period	△1,873,845,132	6,329,105,744
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	1,745,200	1,745,200
元本等合計 Total principal and other	43,784,730,868	56,046,805,544
純資産合計 Total net assets	43,784,730,868	56,046,805,544
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	44,601,243,024	56,112,865,297

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】 Semi-annual Statement of Income and Retained Earnings

(単位：円) (Unit：JPY)

	第15期中間計算期間 自平成28年7月16日 至平成29年1月15日 15th Semi-annual Period From July 16, 2016 to January 15, 2017	第16期中間計算期間 自平成29年7月16日 至平成30年1月15日 16th Semi-annual Period From July 16, 2017 to January 15, 2018
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	451,987,250	650,058,325
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	10,237,402,866	7,482,891,085
その他収益 Other revenue	6,072	12,152
営業収益合計 Total operating revenue	10,689,396,188	8,132,961,562
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	59,505	69,383
受託者報酬 Trustee fee	11,884,047	17,676,816
委託者報酬 Investment trust management fee	25,465,756	37,878,838
その他費用 Other expenses	339,516	505,046
営業費用合計 Total operating expenses	37,748,824	56,130,083
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	10,651,647,364	8,076,831,479
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	10,651,647,364	8,076,831,479
中間純利益又は中間純損失 (△) Profit (loss)	10,651,647,364	8,076,831,479
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 (△) Distribution of profit loss from partial	-	-

exchange		
期首剰余金又は期首欠損金 (△) Surplus (deficit) at beginning of period	△8,926,191,592	△1,873,845,132
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	205,595,550	134,298,577
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from partial exchange	205,595,550	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from additional subscriptions for period	-	134,298,577
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	2,434,914,217	8,179,180
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from partial exchange	-	8,179,180
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from additional subscriptions for period	2,434,914,217	-
分配金 Dividends	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△) Balance at end of current period	△503,862,895	6,329,105,744

(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。
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	当ファンドの中間計算期間は、平成29年7月16日から平成30年1月15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15期 平成29年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成30年1月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 228,292,880口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 248,588,499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 1,873,845,132円	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
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	191.79円	1口当たり純資産額	225.46円
(100口当たり純資産額)	(19,179円)	(100口当たり純資産額)	(22,546円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期中間計算期間 自平成28年7月16日 至平成29年1月15日	第16期中間計算期間 自平成29年7月16日 至平成30年1月15日
1. 追加情報 平成28年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。	該当事項はありません。

(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15期 平成29年7月15日現在	第16期中間計算期間末 平成30年1月15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。 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。	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。

(その他の注記)

1 元本の移動

第15期 自平成28年7月16日 至平成29年7月15日	第16期中間計算期間 自平成29年7月16日 至平成30年1月15日		
期首元本額	32,557,023,000円	期首元本額	45,658,576,000円
期中追加設定元本額	28,931,960,000円	期中追加設定元本額	8,000,140,000円
期中一部交換元本額	15,830,407,000円	期中一部交換元本額	3,941,016,200円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。