



2019年7月期 (2018年7月16日～2019年7月15日) 決算短信  
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2019 (July 16, 2018 – July 15, 2019)

2019年8月26日  
August 26, 2019

上場取引所 東証  
Listed Exchange TSE

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 兼代表取締役社長 中川 順子  
問合せ先責任者 商品企画部長 増田 真一 TEL(03)-3241-9511

Fund name: TOPIX Banks Exchange Traded Fund  
Code: 1615  
Underlying index: TOPIX Banks Index  
Primary invested assets: Stocks  
Trading unit: 100 units  
Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>  
Representative: Junko Nakagawa, President & CEO  
Contact person: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 2019年9月26日  
分配金支払開始日 2019年8月23日  
Scheduled date of submission of securities report: September 26, 2019  
Date of commencing dividend payment: August 23, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年7月期の運用状況 (2018年7月16日～2019年7月15日)

Management Status for Year ended July 2019 (from July 16, 2018 to July 15, 2019)

(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.	%
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	24,802	(99.6)	92	(0.4)	24,894	(100.0)
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	55,147	(100.0)	13	(0.0)	55,160	(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)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	314,318	23,864	165,049	173,132
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	228,292	139,994	53,969	314,318

(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/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	26,258	1,363	24,894	14,379
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	56,695	1,534	55,160	17,549

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	767
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	465

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 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit：JPY)

	第 16 期 (2018 年 7 月 15 日現在) 16th Fiscal Year As of July 15, 2018	第 17 期 (2019 年 7 月 15 日現在) 17th Fiscal Year As of July 15, 2019
	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	1,540,507,484	1,451,695,622
株式 Stocks	55,147,045,040	24,802,459,590
未収配当金 Accrued dividends receivable	8,164,000	4,168,000
流動資産合計 Total current assets	56,695,716,524	26,258,323,212
資産合計 Total assets	56,695,716,524	26,258,323,212
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	1,461,579,895	1,327,929,389
未払受託者報酬 Trustee fee payable	23,110,824	11,231,131
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	49,523,134	24,066,640
未払利息 Accrued interest expenses	8,715	12,409
その他未払費用 Other accrued expenses	660,236	320,827
流動負債合計 Total current liabilities	1,534,882,804	1,363,560,396
負債合計 Total liabilities	1,534,882,804	1,363,560,396
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	62,863,651,400	34,626,581,200
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△7,702,817,680	△9,731,818,384

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	1,964,204	265,331
元本等合計 Total principal and other	55,160,833,720	24,894,762,816
純資産合計 Total net assets	55,160,833,720	24,894,762,816
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	56,695,716,524	26,258,323,212

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第16期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日 16th Fiscal Year From July 16, 2017 to July 15, 2018	第17期 自 2018年7月16日 至 2019年7月15日 17th Fiscal Year From July 16, 2018 to July 15, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	1,591,439,275	1,421,237,475
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△7,552,737,903	△5,540,062,921
その他収益 Other revenue	12,901	14,417
営業収益合計 Total operating revenue	△5,961,285,727	△4,118,811,029
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	298,383	489,128
受託者報酬 Trustee fee	40,787,640	29,807,527
委託者報酬 Investment trust management fee	87,401,972	63,873,145
その他費用 Other expenses	1,165,282	851,576
営業費用合計 Total operating expenses	129,653,277	95,021,376
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△6,090,939,004	△4,213,832,405
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△6,090,939,004	△4,213,832,405
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△6,090,939,004	△4,213,832,405
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 (△) 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	△1,873,845,132	△7,702,817,680
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,723,546,351	4,401,283,720

Increase in surplus or decrease in deficit		
当期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	241,470,220	4,401,283,720
当期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	1,482,076,131	-
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	-	888,522,630
当期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	-	888,522,630
分配金 Dividends	1,461,579,895	1,327,929,389
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△7,702,817,680	△9,731,818,384

(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 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。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配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る場合、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、2018年7月16日から2019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16期 2018年7月15日現在	第17期 2019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 314,318,257 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 173,132,906 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 7,702,817,680 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 9,731,818,384 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 175.49 円 (100口当たり純資産額) (17,549 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 143.79 円 (100口当たり純資産額) (14,379 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自2017年7月16日 至2018年7月15日	第17期 自2018年7月16日 至2019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	1,591,153,793 円	当期配当等収益額	A	1,420,762,764 円
分配準備積立金	B	1,745,200 円	分配準備積立金	B	1,964,204 円
配当等収益合計額	C=A+B	1,592,898,993 円	配当等収益合計額	C=A+B	1,422,726,968 円
経費	D	129,354,894 円	経費	D	94,532,248 円
収益分配可能額	E=C-D	1,463,544,099 円	収益分配可能額	E=C-D	1,328,194,720 円
収益分配金	F	1,461,579,895 円	収益分配金	F	1,327,929,389 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,964,204 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	265,331 円
口数	H	314,318,257 口	口数	H	173,132,906 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	465 円	100 口当たり分配金	I=F/H×100	767 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 16 期 自 2017 年 7 月 16 日 至 2018 年 7 月 15 日	第 17 期 自 2018 年 7 月 16 日 至 2019 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 16 期 2018 年 7 月 15 日現在	第 17 期 2019 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</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>

ります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第16期 自2017年7月16日 至2018年7月15日	第17期 自2018年7月16日 至2019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16期 自2017年7月16日 至2018年7月15日	第17期 自2018年7月16日 至2019年7月15日
期首元本額 45,658,576,000円	期首元本額 62,863,651,400円
期中追加設定元本額 27,998,980,000円	期中追加設定元本額 4,772,900,000円
期中一部交換元本額 10,793,904,600円	期中一部交換元本額 33,009,970,200円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第16期 自2017年7月16日 至2018年7月15日	第17期 自2018年7月16日 至2019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	△7,370,146,424	△4,665,974,156
合計	△7,370,146,424	△4,665,974,156

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(2019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	3,900	710.00	2,769,000	
		じもとホールディングス	123,900	102.00	12,637,800	
		めぶきフィナンシャルグループ	953,000	283.00	269,699,000	
		東京きらぼしフィナンシャルグループ	24,800	1,586.00	39,332,800	
		九州フィナンシャルグループ	301,000	443.00	133,343,000	
		ゆうちょ銀行	519,600	1,104.00	573,638,400	
		富山第一銀行	43,700	316.00	13,809,200	
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,150,600	419.00	482,101,400	
		西日本フィナンシャルホールディングス	115,400	802.00	92,550,800	
		関西みらいフィナンシャルグループ	86,100	741.00	63,800,100	

三十三フィナンシャルグループ	15,900	1,560.00	24,804,000
第四北越フィナンシャルグループ	31,800	2,846.00	90,502,800
新生銀行	134,600	1,721.00	231,646,600
あおぞら銀行	102,400	2,626.00	268,902,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	12,624,900	527.60	6,660,897,240
りそなホールディングス	2,012,600	461.60	929,016,160
三井住友トラスト・ホールディングス	360,500	3,954.00	1,425,417,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,292,600	3,840.00	4,963,584,000
千葉銀行	630,900	556.00	350,780,400
群馬銀行	366,900	389.00	142,724,100
武蔵野銀行	27,300	2,152.00	58,749,600
千葉興業銀行	50,300	276.00	13,882,800
筑波銀行	76,300	175.00	13,352,500
七十七銀行	57,600	1,617.00	93,139,200
青森銀行	14,200	2,744.00	38,964,800
秋田銀行	11,700	2,053.00	24,020,100
山形銀行	20,600	1,719.00	35,411,400
岩手銀行	12,800	2,899.00	37,107,200
東邦銀行	164,000	271.00	44,444,000
東北銀行	9,300	1,064.00	9,895,200
みちのく銀行	11,700	1,719.00	20,112,300
ふくおかフィナンシャルグループ	161,600	2,048.00	330,956,800
静岡銀行	454,200	822.00	373,352,400
十六銀行	24,700	2,388.00	58,983,600
スルガ銀行	187,600	413.00	77,478,800
八十二銀行	442,600	451.00	199,612,600
山梨中央銀行	22,100	1,165.00	25,746,500
大垣共立銀行	38,700	2,462.00	95,279,400
福井銀行	15,700	1,497.00	23,502,900
北國銀行	18,900	3,035.00	57,361,500
清水銀行	7,600	1,852.00	14,075,200
富山銀行	3,600	2,625.00	9,450,000
滋賀銀行	36,800	2,523.00	92,846,400
南都銀行	28,600	2,380.00	68,068,000



百五銀行	165,000	337.00	55,605,000
京都銀行	65,700	4,230.00	277,911,000
紀陽銀行	64,900	1,473.00	95,597,700
ほくほくフィナンシャルグループ	122,100	1,160.00	141,636,000
広島銀行	270,700	539.00	145,907,300
山陰合同銀行	108,800	702.00	76,377,600
中国銀行	157,800	997.00	157,326,600
鳥取銀行	6,300	1,412.00	8,895,600
伊予銀行	243,000	570.00	138,510,000
百十四銀行	19,500	2,297.00	44,791,500
四国銀行	26,000	972.00	25,272,000
阿波銀行	28,000	2,612.00	73,136,000
大分銀行	11,200	3,150.00	35,280,000
宮崎銀行	12,200	2,611.00	31,854,200
佐賀銀行	11,100	1,626.00	18,048,600
沖縄銀行	16,800	3,495.00	58,716,000
琉球銀行	42,400	1,167.00	49,480,800
セブン銀行	619,600	293.00	181,542,800
みずほフィナンシャルグループ	24,920,900	159.10	3,964,915,190
高知銀行	6,700	802.00	5,373,400
山口フィナンシャルグループ	228,900	780.00	178,542,000
長野銀行	6,000	1,749.00	10,494,000
名古屋銀行	14,800	3,485.00	51,578,000
北洋銀行	276,500	259.00	71,613,500
愛知銀行	6,700	3,845.00	25,761,500
中京銀行	7,600	2,233.00	16,970,800
大光銀行	6,300	1,787.00	11,258,100
愛媛銀行	25,600	1,093.00	27,980,800
トマト銀行	7,100	1,053.00	7,476,300
京葉銀行	78,200	666.00	52,081,200
栃木銀行	95,000	183.00	17,385,000
北日本銀行	5,700	1,828.00	10,419,600
東和銀行	32,200	723.00	23,280,600
福島銀行	15,900	259.00	4,118,100
大東銀行	8,800	557.00	4,901,600

	トモニホールディングス	141,800	375.00	53,175,000	
	フィデアホールディングス	178,100	119.00	21,193,900	
	池田泉州ホールディングス	194,700	207.00	40,302,900	
	小計 銘柄数：82			24,802,459,590	
	組入時価比率：99.6%			100.0%	
	合計			24,802,459,590	

(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 (2019 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。