

平成26年7月期（平成25年7月16日～平成26年7月15日）決算短信

平成26年8月27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 投信ディストロージャー部長 村山 治子 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成26年9月25日
 分配金支払開始日 平成26年8月22日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年7月期の運用状況（平成25年7月16日～平成26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26年7月期	47,368	(100.0)	21	(0.0)	47,389	(100)
平成25年7月期	34,591	(99.9)	20	(0.1)	34,612	(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26年7月期	186,135	129,500	49,650	265,986
平成25年7月期	215,011	29,997	58,872	186,135

(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26年7月期	48,077	687	47,389	17,817
平成25年7月期	35,471	859	34,612	18,595

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成26年7月期	242.00
平成25年7月期	438.00

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 11 期 (平成 25 年 7 月 15 日現在)	第 12 期 (平成 26 年 7 月 15 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	879,757,054	704,827,709
株式	34,591,862,300	47,368,069,100
未収配当金	-	4,590,000
未収利息	7,693	1,271
流動資産合計	35,471,627,047	48,077,488,080
資産合計	35,471,627,047	48,077,488,080
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	815,275,399	643,686,453
未払受託者報酬	13,837,400	13,945,651
未払委託者報酬	29,651,505	29,883,464
その他未払費用	395,293	398,388
流動負債合計	859,159,597	687,913,956
負債合計	859,159,597	687,913,956
純資産の部		
元本等		
元本	37,227,187,200	53,197,227,600
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△2,614,719,750	△5,807,653,476
(分配準備積立金)	135,152	695,316
元本等合計	34,612,467,450	47,389,574,124
純資産合計	34,612,467,450	47,389,574,124
負債純資産合計	35,471,627,047	48,077,488,080

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日
営業収益		
受取配当金	886,090,325	724,403,700
受取利息	267,129	215,696
有価証券売買等損益	16,311,393,070	△819,124,054
その他収益	2,826	3,280
営業収益合計	17,197,753,350	△94,501,378
営業費用		
受託者報酬	22,821,163	25,343,865
委託者報酬	48,902,364	54,308,152
その他費用	651,949	724,042
営業費用合計	72,375,476	80,376,059

営業利益又は営業損失 (△)	17, 125, 377, 874	△174, 877, 437
経常利益又は経常損失 (△)	17, 125, 377, 874	△174, 877, 437
当期純利益又は当期純損失 (△)	17, 125, 377, 874	△174, 877, 437
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 (△)	△19, 321, 070, 413	△2, 614, 719, 750
剰余金増加額又は欠損金減少額	1, 485, 301, 400	888, 216, 900
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1, 485, 301, 400	888, 216, 900
剰余金減少額又は欠損金増加額	1, 089, 053, 212	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	1, 089, 053, 212	3, 262, 586, 736
分配金	815, 275, 399	643, 686, 453
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△2, 614, 719, 750	△5, 807, 653, 476

(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 25 年 7 月 16 日から平成 26 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 11 期 平成 25 年 7 月 15 日現在	第 12 期 平成 26 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 186, 135, 936 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 265, 986, 138 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 2, 614, 719, 750 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 5, 807, 653, 476 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 185.95 円 (100 口当たり純資産額) (18, 595 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 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日																								
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																								
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>886, 360, 280 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>1, 425, 747 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>887, 786, 027 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	886, 360, 280 円	分配準備積立金	B	1, 425, 747 円	配当等収益合計額	C=A+B	887, 786, 027 円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>724, 622, 676 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>135, 152 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>724, 757, 828 円</td> </tr> </tbody> </table>	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
項目																									
当期配当等収益額	A	886, 360, 280 円																							
分配準備積立金	B	1, 425, 747 円																							
配当等収益合計額	C=A+B	887, 786, 027 円																							
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	72,375,476 円
収益分配可能額	E=C-D	815,410,551 円
収益分配金	F	815,275,399 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	135,152 円
口数	H	186,135,936 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	438 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

(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 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 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 11 期 平成 25 年 7 月 15 日現在	第 12 期 平成 26 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 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 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 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日
期首元本額	43,002,344,800 円	期首元本額 37,227,187,200 円
期中追加設定元本額	5,999,400,000 円	期中追加設定元本額 25,900,180,000 円
期中一部交換元本額	11,774,557,600 円	期中一部交換元本額 9,930,139,600 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 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	12,885,029,047	△610,240,834
合計	12,885,029,047	△610,240,834

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 26 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	6,000	1,320.00	7,920,000	
		じもとホールディングス	203,900	213.00	43,430,700	
		足利ホールディングス	148,900	427.00	63,580,300	
		新生銀行	2,458,000	216.00	530,928,000	
		あおぞら銀行	1,475,000	338.00	498,550,000	
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	21,524,500	606.00	13,043,847,000	
		りそなホールディングス	2,700,700	592.00	1,598,814,400	
		三井住友トラスト・ホールディングス	5,583,000	454.00	2,534,682,000	
		三井住友フィナンシャルグループ	2,148,800	4,137.00	8,889,585,600	
		第四銀行	359,000	365.00	131,035,000	
		北越銀行	307,000	210.00	64,470,000	
		西日本シティ銀行	997,000	256.00	255,232,000	
		千葉銀行	1,096,000	736.00	806,656,000	

横浜銀行	1,848,000	593.00	1,095,864,000
常陽銀行	1,058,000	550.00	581,900,000
群馬銀行	631,000	606.00	382,386,000
武蔵野銀行	45,300	3,475.00	157,417,500
千葉興業銀行	58,900	752.00	44,292,800
筑波銀行	118,100	355.00	41,925,500
東京都民銀行	50,100	1,203.00	60,270,300
七十七銀行	445,000	538.00	239,410,000
青森銀行	208,000	289.00	60,112,000
秋田銀行	195,000	280.00	54,600,000
山形銀行	171,000	480.00	82,080,000
岩手銀行	18,600	4,770.00	88,722,000
東邦銀行	254,000	368.00	93,472,000
東北銀行	145,000	149.00	21,605,000
みちのく銀行	152,000	218.00	33,136,000
ふくおかフィナンシャルグループ	1,153,000	497.00	573,041,000
静岡銀行	832,000	1,140.00	948,480,000
十六銀行	356,000	379.00	134,924,000
スルガ銀行	277,000	1,948.00	539,596,000
八十二銀行	524,000	624.00	326,976,000
山梨中央銀行	181,000	452.00	81,812,000
大垣共立銀行	355,000	282.00	100,110,000
福井銀行	243,000	240.00	58,320,000
北國銀行	316,000	340.00	107,440,000
清水銀行	9,700	2,755.00	26,723,500
滋賀銀行	267,000	617.00	164,739,000
南都銀行	274,000	412.00	112,888,000
百五銀行	256,000	407.00	104,192,000
京都銀行	542,000	931.00	504,602,000
紀陽銀行	111,500	1,377.00	153,535,500
三重銀行	118,000	227.00	26,786,000
ほくほくフィナンシャルグループ	1,933,000	211.00	407,863,000
広島銀行	838,000	498.00	417,324,000
山陰合同銀行	174,000	725.00	126,150,000
中国銀行	204,400	1,557.00	318,250,800

鳥取銀行	90,000	215.00	19,350,000
伊予銀行	303,900	1,043.00	316,967,700
百十四銀行	312,000	352.00	109,824,000
四国銀行	205,000	225.00	46,125,000
阿波銀行	232,000	576.00	133,632,000
鹿児島銀行	197,000	681.00	134,157,000
大分銀行	174,000	360.00	62,640,000
宮崎銀行	189,000	329.00	62,181,000
肥後銀行	232,000	549.00	127,368,000
佐賀銀行	172,000	228.00	39,216,000
十八銀行	177,000	272.00	48,144,000
沖縄銀行	21,100	4,365.00	92,101,500
琉球銀行	55,100	1,462.00	80,556,200
八千代銀行	13,500	3,230.00	43,605,000
セブン銀行	1,064,600	414.00	440,744,400
みずほフィナンシャルグループ	36,888,500	201.00	7,414,588,500
高知銀行	110,000	147.00	16,170,000
山口フィナンシャルグループ	284,000	1,050.00	298,200,000
長野銀行	93,000	188.00	17,484,000
名古屋銀行	257,000	395.00	101,515,000
北洋銀行	428,000	420.00	179,760,000
愛知銀行	10,300	5,170.00	53,251,000
第三銀行	161,000	181.00	29,141,000
中京銀行	117,000	179.00	20,943,000
東日本銀行	124,000	257.00	31,868,000
大光銀行	101,000	226.00	22,826,000
愛媛銀行	167,000	240.00	40,080,000
トマト銀行	110,000	176.00	19,360,000
みなと銀行	257,000	194.00	49,858,000
京葉銀行	234,000	508.00	118,872,000
関西アーバン銀行	396,000	124.00	49,104,000
栃木銀行	143,000	428.00	61,204,000
北日本銀行	8,800	2,609.00	22,959,200
東和銀行	350,000	99.00	34,650,000
福島銀行	350,000	88.00	30,800,000

	大東銀行	182,000	125.00	22,750,000	
	トモニホールディングス	218,000	423.00	92,214,000	
	フィデアホールディングス	163,500	209.00	34,171,500	
	池田泉州ホールディングス	213,200	516.00	110,011,200	
	小計 銘柄数：87			47,368,069,100	
	組入時価比率：100.0%			100.0%	
	合計			47,368,069,100	

(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 26 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。