

平成29年7月期 中間決算短信（平成28年7月16日～平成29年1月15日）

平成29年2月24日

ファンド名	東証銀行業株価指数連動型上場投資信託		上場取引所	東証
コード番号	(1615)		売買単位	100口
連動対象指標	東証銀行業株価指数			
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29年3月29日			

I ファンドの運用状況

1. 平成29年1月中間期の運用状況（平成28年7月16日～平成29年1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29年1月中間期	38,679	(98.9)	423	(1.1)	39,103	(100)
平成28年7月期	23,587	(99.8)	43	(0.2)	23,630	(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29年1月中間期	162,785	59,995	24,746	198,034

(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/当中間計算期間末(前計算期末) 発行済口数)×100)
	百万円	百万円	百万円	円
平成29年1月中間期	39,145	42	39,103	19,746
平成28年7月期	24,598	967	23,630	14,517

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

東証銀行業株価指数連動型上場投資信託

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 14 期 (平成 28 年 7 月 15 日現在)	第 15 期中間計算期間末 (平成 29 年 1 月 15 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,006,947,825	455,023,902
株式	23,587,705,310	38,679,573,250
未収入金	-	4,309,200
未収配当金	4,052,000	6,145,000
流動資産合計	24,598,705,135	39,145,051,352
資産合計	24,598,705,135	39,145,051,352
負債の部		
流動負債		
未払金	-	4,343,380
未払収益分配金	936,014,411	-
未払受託者報酬	10,045,343	11,884,047
未払委託者報酬	21,525,670	25,465,756
未払利息	1,355	1,183
その他未払費用	286,948	339,481
流動負債合計	967,873,727	42,033,847
負債合計	967,873,727	42,033,847
純資産の部		
元本等		
元本	32,557,023,000	39,606,880,400
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△8,926,191,592	△503,862,895
(分配準備積立金)	380,575	380,575
元本等合計	23,630,831,408	39,103,017,505
純資産合計	23,630,831,408	39,103,017,505
負債純資産合計	24,598,705,135	39,145,051,352

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 14 期中間計算期間 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 1 月 15 日	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
営業収益		
受取配当金	667,942,675	451,987,250
受取利息	104,623	-
有価証券売買等損益	△13,573,416,406	10,237,402,866
その他収益	5,509	6,072
営業収益合計	△12,905,363,599	10,689,396,188

営業費用		
支払利息	-	59,505
受託者報酬	22,232,677	11,884,047
委託者報酬	47,641,413	25,465,756
その他費用	635,205	339,516
営業費用合計	70,509,295	37,748,824
営業利益又は営業損失(△)	△12,975,872,894	10,651,647,364
経常利益又は経常損失(△)	△12,975,872,894	10,651,647,364
中間純利益又は中間純損失(△)	△12,975,872,894	10,651,647,364
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(△)	11,665,540,700	△8,926,191,592
剰余金増加額又は欠損金減少額	209,388,032	205,595,550
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	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	209,388,032	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	659,434,940	2,434,914,217
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	659,434,940	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	2,434,914,217
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△1,760,379,102	△503,862,895

(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	当ファンドの中間計算期間は、平成 28 年 7 月 16 日から平成 29 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 14 期 平成 28 年 7 月 15 日現在	第 15 期中間計算期間末 平成 29 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 162,785,115 口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 198,034,402 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 8,926,191,592 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 503,862,895 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 145.17 円	3. 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 197.46 円

(100 口当たり純資産額)	(14,517 円)	(100 口当たり純資産額)	(19,746 円)
----------------	------------	----------------	------------

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 14 期中間計算期間 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 1 月 15 日	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
該当事項はありません。	<p>1. 追加情報</p> <p>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。</p>

(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 14 期 平成 28 年 7 月 15 日現在	第 15 期中間計算期間末 平成 29 年 1 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</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

(その他の注記)

1 元本の移動

第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	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		
期首元本額	54,998,386,400 円	期首元本額	32,557,023,000 円
期中追加設定元本額	8,018,720,000 円	期中追加設定元本額	11,999,080,000 円
期中一部交換元本額	30,460,083,400 円	期中一部交換元本額	4,949,222,600 円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。