

平成25年7月期（平成24年7月16日～平成25年7月15日）決算短信

平成25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兼執行役会長兼社長 岩崎 俊博
 問合せ先責任者 投信ディスクロージャー部長 森保 一美 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成25年9月26日
 分配金支払開始日 平成25年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成25年7月期の運用状況（平成24年7月16日～平成25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25年7月期	34,591	(99.9)	20	(0.1)	34,612	(100)
平成24年7月期	23,666	(99.9)	14	(0.1)	23,681	(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25年7月期	215,011	29,997	58,872	186,135
平成24年7月期	214,678	19,993	19,660	215,011

(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25年7月期	35,471	859	34,612	18,595
平成24年7月期	24,473	792	23,681	11,014

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成25年7月期	438.00
平成24年7月期	355.00

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 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】

期別	第10期 平成24年7月15日現在	第11期 平成25年7月15日現在
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	806,759,695	879,757,054
株式	23,666,640,800	34,591,862,300
未収利息	6,114	7,693
流動資産合計	24,473,406,609	35,471,627,047
資産合計	24,473,406,609	35,471,627,047
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	763,291,620	815,275,399
未払受託者報酬	9,093,924	13,837,400
未払委託者報酬	19,486,917	29,651,505
その他未払費用	259,761	395,293
流動負債合計	792,132,222	859,159,597
負債合計	792,132,222	859,159,597
純資産の部		
元本等		
元本	43,002,344,800	37,227,187,200
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	19,321,070,413	2,614,719,750
(分配準備積立金)	1,425,747	135,152
元本等合計	23,681,274,387	34,612,467,450
純資産合計	23,681,274,387	34,612,467,450
負債純資産合計	24,473,406,609	35,471,627,047

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第10期	第11期
		自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日	自 平成24年7月16日 至 平成25年7月15日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		819,702,440	886,090,325
受取利息		290,697	267,129
有価証券売買等損益		1,120,521,042	16,311,393,070
その他収益		1,505	2,826
営業収益合計		300,526,400	17,197,753,350
営業費用			
受託者報酬		17,940,941	22,821,163
委託者報酬		38,444,721	48,902,364
その他費用		512,503	651,949
営業費用合計		56,898,165	72,375,476
営業利益		357,424,565	17,125,377,874
経常利益		357,424,565	17,125,377,874
当期純利益		357,424,565	17,125,377,874
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額			
期首剰余金又は期首欠損金()		18,145,663,742	19,321,070,413
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,718,294,900	1,485,301,400
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,718,294,900	1,485,301,400
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,772,985,386	1,089,053,212
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,772,985,386	1,089,053,212
分配金		763,291,620	815,275,399
期末剰余金又は期末欠損金()		19,321,070,413	2,614,719,750

(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	(1) 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	(1) 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。 (2) 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、平成24年7月16日から平成25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 10 期 平成 24 年 7 月 15 日現在	第 11 期 平成 25 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 215,011,724 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 186,135,936 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 19,321,070,413 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 2,614,719,750 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 110.14 円 (100 口当たり純資産額 11,014 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)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 10 期 自 平成 23 年 7 月 16 日 至 平成 24 年 7 月 15 日	第 11 期 自 平成 24 年 7 月 16 日 至 平成 25 年 7 月 15 日																																																												
1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 764,717,367 円 (100 口当たり 355 円)のうち、763,291,620 円 (100 口当たり 355 円)を分配金額としております。	1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 815,410,551 円 (100 口当たり 438 円)のうち、815,275,399 円 (100 口当たり 438 円)を分配金額としております。																																																												
<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: right;">819,994,642 円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">819,994,642 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">1,620,890 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">821,615,532 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">56,898,165 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">764,717,367 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">763,291,620 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">1,425,747 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">215,011,724 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I = F / H × 100</td> <td style="text-align: right;">355 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	819,994,642 円	当期配当等収益額	A	819,994,642 円	分配準備積立金	B	1,620,890 円	配当等収益合計額	C = A + B	821,615,532 円	経費	D	56,898,165 円	収益分配可能額	E = C - D	764,717,367 円	収益分配金	F	763,291,620 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	1,425,747 円	口数	H	215,011,724 口	100 口当たり分配金	I = F / H × 100	355 円	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: right;">886,360,280 円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">886,360,280 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">1,425,747 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">887,786,027 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">72,375,476 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">815,410,551 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">815,275,399 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">135,152 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">186,135,936 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I = F / H × 100</td> <td style="text-align: right;">438 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	886,360,280 円	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	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
項目	A	819,994,642 円																																																											
当期配当等収益額	A	819,994,642 円																																																											
分配準備積立金	B	1,620,890 円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	821,615,532 円																																																											
経費	D	56,898,165 円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	764,717,367 円																																																											
収益分配金	F	763,291,620 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	1,425,747 円																																																											
口数	H	215,011,724 口																																																											
100 口当たり分配金	I = F / H × 100	355 円																																																											
項目	A	886,360,280 円																																																											
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																																																											
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																																																											

(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10期 自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日	第11期 自 平成24年7月16日 至 平成25年7月15日
<p>1 金融商品に対する取組方針 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金融商品に係るリスク 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。 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。 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 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。 市場リスクの管理 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。 信用リスクの管理 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。 流動性リスクの管理 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 同左</p> <p>2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第10期 平成24年7月15日現在	第11期 平成25年7月15日現在
<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第10期 自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日	第11期 自 平成24年7月16日 至 平成25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。	

(その他の注記)

1 元本の移動

第10期 自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日	第11期 自 平成24年7月16日 至 平成25年7月15日
期首元本額 42,935,638,200 円	期首元本額 43,002,344,800 円
期中追加設定元本額 3,998,760,000 円	期中追加設定元本額 5,999,400,000 円
期中一部交換元本額 3,932,053,400 円	期中一部交換元本額 11,774,557,600 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第10期 自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日	第11期 自 平成24年7月16日 至 平成25年7月15日
種類	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	973,630,176	12,885,029,047
合計	973,630,176	12,885,029,047

3 デリバティブ取引関係

第10期(平成24年7月15日現在)

該当事項はございません。

第11期(平成25年7月15日現在)

該当事項はございません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

(平成25年7月15日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	島根銀行	4,400	1,298.00	5,711,200	
	じもとホールディングス	142,000	234.00	33,228,000	
	新生銀行	1,713,000	238.00	407,694,000	
	あおぞら銀行	719,000	316.00	227,204,000	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	14,987,900	655.00	9,817,074,500	
	りそなホールディングス	2,035,800	511.00	1,040,293,800	
	三井住友トラスト・ホールディングス	3,889,000	492.00	1,913,388,000	
	三井住友フィナンシャルグループ	1,496,900	4,775.00	7,147,697,500	
	第四銀行	252,000	343.00	86,436,000	
	北越銀行	200,000	210.00	42,000,000	
	西日本シティ銀行	695,000	274.00	190,430,000	
	千葉銀行	763,000	728.00	555,464,000	
	横浜銀行	1,224,000	555.00	679,320,000	
	常陽銀行	747,000	562.00	419,814,000	
	群馬銀行	444,000	599.00	265,956,000	
	武蔵野銀行	31,600	3,570.00	112,812,000	
	千葉興業銀行	37,900	811.00	30,736,900	
	筑波銀行	82,200	364.00	29,920,800	
	東京都民銀行	37,400	1,180.00	44,132,000	
	七十七銀行	310,000	498.00	154,380,000	
	青森銀行	145,000	260.00	37,700,000	
	秋田銀行	136,000	270.00	36,720,000	
	山形銀行	120,000	431.00	51,720,000	
	岩手銀行	14,300	4,005.00	57,271,500	
	東邦銀行	167,000	303.00	50,601,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	東北銀行	101,000	149.00	15,049,000	
	みちのく銀行	99,000	195.00	19,305,000	
	ふくおかフィナンシャルグループ	803,000	449.00	360,547,000	
	静岡銀行	580,000	1,117.00	647,860,000	
	十六銀行	248,000	380.00	94,240,000	
	スルガ銀行	193,000	1,794.00	346,242,000	
	八十二銀行	365,000	616.00	224,840,000	
	山梨中央銀行	118,000	443.00	52,274,000	
	大垣共立銀行	264,000	304.00	80,256,000	
	福井銀行	171,000	223.00	38,133,000	
	北國銀行	222,000	350.00	77,700,000	
	清水銀行	6,700	2,852.00	19,108,400	
	滋賀銀行	186,000	530.00	98,580,000	
	南都銀行	193,000	385.00	74,305,000	
	百五銀行	178,000	434.00	77,252,000	
	京都銀行	354,000	858.00	303,732,000	
	三重銀行	82,000	213.00	17,466,000	
	ほくほくフィナンシャルグループ	1,347,000	205.00	276,135,000	
	広島銀行	584,000	440.00	256,960,000	
	山陰合同銀行	115,000	771.00	88,665,000	
	中国銀行	147,000	1,413.00	207,711,000	
	鳥取銀行	63,000	196.00	12,348,000	
	伊予銀行	212,000	999.00	211,788,000	
	百十四銀行	217,000	327.00	70,959,000	
	四国銀行	143,000	237.00	33,891,000	
	阿波銀行	162,000	559.00	90,558,000	
	鹿児島銀行	138,000	687.00	94,806,000	
	大分銀行	117,000	325.00	38,025,000	
	宮崎銀行	132,000	317.00	41,844,000	
	肥後銀行	162,000	608.00	98,496,000	
	佐賀銀行	120,000	214.00	25,680,000	
	十八銀行	123,000	239.00	29,397,000	
	沖縄銀行	14,700	4,255.00	62,548,500	
	琉球銀行	41,100	1,281.00	52,649,100	
	八千代銀行	10,100	3,000.00	30,300,000	
	セブン銀行	667,400	382.00	254,946,800	
	みずほフィナンシャルグループ	25,602,500	217.00	5,555,742,500	
	紀陽ホールディングス	789,000	140.00	110,460,000	
	山口フィナンシャルグループ	198,000	995.00	197,010,000	
	長野銀行	69,000	183.00	12,627,000	
	名古屋銀行	179,000	385.00	68,915,000	
	北洋銀行	298,200	403.00	120,174,600	
	愛知銀行	7,200	4,710.00	33,912,000	
	第三銀行	112,000	162.00	18,144,000	
	中京銀行	81,000	187.00	15,147,000	
	東日本銀行	86,000	218.00	18,748,000	
	大光銀行	70,000	242.00	16,940,000	
	愛媛銀行	116,000	246.00	28,536,000	
	トマト銀行	76,000	177.00	13,452,000	
	みなと銀行	179,000	179.00	32,041,000	
京葉銀行	163,000	528.00	86,064,000		
関西アーバン銀行	276,000	112.00	30,912,000		
栃木銀行	99,000	368.00	36,432,000		
北日本銀行	5,700	2,290.00	13,053,000		
東和銀行	222,000	91.00	20,202,000		
福島銀行	243,000	81.00	19,683,000		
大東銀行	127,000	87.00	11,049,000		
トモニホールディングス	151,900	382.00	58,025,800		
フィデアホールディングス	113,900	226.00	25,741,400		
池田泉州ホールディングス	163,300	530.00	86,549,000		
計	銘柄数：85			34,591,862,300	
	組入時価比率：99.9%			100.0%	
合計				34,591,862,300	

(注) 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25年7月15日現在)
該当事項はございません。

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
該当事項はございません。