

平成22年7月期（平成21年7月16日～平成22年7月15日）決算短信

平成22年8月19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 執行役社長 吉川 淳
 問合せ先責任者 投信ディスクロージャー部 新村 浩久 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成22年9月30日
 分配金支払開始予定日 平成22年8月20日

I ファンドの運用状況

1. 平成22年7月期の運用状況（平成21年7月16日～平成22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22年7月期	32,417	(100.0)	14	(0.0)	32,432	(100)
平成21年7月期	31,013	(100.0)	10	(0.0)	31,024	(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22年7月期	197,810	109,964	44,542	263,232
平成21年7月期	336,661	24,986	163,838	197,810

(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22年7月期	33,277	845	32,432	12,321
平成21年7月期	33,333	2,308	31,024	15,684

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成22年7月期	305.00
平成21年7月期	360.00

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 7 期 平成 21 年 7 月 15 日現在	第 8 期 平成 22 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	2,319,469,392	860,045,821
株式	31,013,788,400	32,417,595,700
未収利息	2,467	2,435
その他未収収益	135,570	
流動資産合計	33,333,395,829	33,277,643,956
資産合計	33,333,395,829	33,277,643,956
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	712,116,075	802,859,210
未払受託者報酬	12,224,148	13,388,971
未払委託者報酬	26,194,531	28,690,601
未払利息	56,871	
有価証券貸借取引受入金	1,557,991,890	
その他未払費用	349,204	382,478
流動負債合計	2,308,932,719	845,321,260
負債合計	2,308,932,719	845,321,260
純資産の部		
元本等		
元本	39,562,004,200	52,646,505,600
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	8,537,541,090	20,214,182,904
(分配準備積立金)	1,941,341	2,176,433
元本等合計	31,024,463,110	32,432,322,696
純資産合計	31,024,463,110	32,432,322,696
負債純資産合計	33,333,395,829	33,277,643,956

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第7期	第8期
		自平成20年7月16日 至平成21年7月15日	自平成21年7月16日 至平成22年7月15日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		802,703,150	883,300,260
受取利息		10,674,142	492,920
有価証券売買等損益		26,531,418,831	8,411,073,452
その他収益		5,384,690	453,460
営業収益合計		25,712,656,849	7,526,826,812
営業費用			
支払利息		8,466,469	150,191
受託者報酬		31,509,082	25,541,278
委託者報酬		67,519,327	54,731,223
その他費用		900,168	729,646
営業費用合計		108,395,046	81,152,338
営業利益		25,821,051,895	7,607,979,150
経常利益		25,821,051,895	7,607,979,150
当期純利益		25,821,051,895	7,607,979,150
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()		22,961,822,616	8,537,541,090
剰余金増加額又は欠損金減少額		95,945,464	2,638,137,900
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額			2,638,137,900
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		95,945,464	
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,062,141,200	5,903,941,354
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,062,141,200	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額			5,903,941,354
分配金		712,116,075	802,859,210
期末剰余金又は期末欠損金()		8,537,541,090	20,214,182,904

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第7期	第8期
	自平成20年7月16日 至平成21年7月15日	自平成21年7月16日 至平成22年7月15日
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、市場価額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。	(1) 株式 同左
2 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 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の計上基準 約定日基準で計上しております。	(1) 受取配当金の計上基準 同左 (2) 有価証券売買等損益の計上基準 同左
3 その他	当ファンドの計算期間は、平成20年7月16日から平成21年7月15日までとなっております。	当ファンドの計算期間は、平成21年7月16日から平成22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 7 期 平成 21 年 7 月 15 日現在	第 8 期 平成 22 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 197,810,021 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 263,232,528 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 8,537,541,090 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 20,214,182,904 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 156.84 円 (100 口当たり純資産額 15,684 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 123.21 円 (100 口当たり純資産額 12,321 円)
4 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 1,457,368,600 円	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 7 期 自 平成 20 年 7 月 16 日 至 平成 21 年 7 月 15 日	第 8 期 自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 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 714,057,416 円 (100 口当たり 360 円)のうち、712,116,075 円 (100 口当たり 360 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 805,035,643 円 (100 口当たり 305 円)のうち、802,859,210 円 (100 口当たり 305 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;">810,295,513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;">810,295,513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;">3,690,480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;">813,985,993円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">99,928,577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;">714,057,416円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">712,116,075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;">1,941,341円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">197,810,021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;">360円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	810,295,513円	当期配当等収益額	A	810,295,513円	分配準備積立金	B	3,690,480円	配当等収益合計額	C = A + B	813,985,993円	経費	D	99,928,577円	収益分配可能額	E = C - D	714,057,416円	収益分配金	F	712,116,075円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	1,941,341円	口数	H	197,810,021口	100 口当たり分配金	I = F / H × 100	360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;">884,096,449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;">884,096,449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;">1,941,341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;">886,037,790円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">81,002,147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;">805,035,643円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">802,859,210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;">2,176,433円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">263,232,528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;">305円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	884,096,449円	当期配当等収益額	A	884,096,449円	分配準備積立金	B	1,941,341円	配当等収益合計額	C = A + B	886,037,790円	経費	D	81,002,147円	収益分配可能額	E = C - D	805,035,643円	収益分配金	F	802,859,210円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	2,176,433円	口数	H	263,232,528口	100 口当たり分配金	I = F / H × 100	305円
項目	A	810,295,513円																																																											
当期配当等収益額	A	810,295,513円																																																											
分配準備積立金	B	3,690,480円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	813,985,993円																																																											
経費	D	99,928,577円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	714,057,416円																																																											
収益分配金	F	712,116,075円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	1,941,341円																																																											
口数	H	197,810,021口																																																											
100 口当たり分配金	I = F / H × 100	360円																																																											
項目	A	884,096,449円																																																											
当期配当等収益額	A	884,096,449円																																																											
分配準備積立金	B	1,941,341円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	886,037,790円																																																											
経費	D	81,002,147円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	805,035,643円																																																											
収益分配金	F	802,859,210円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	2,176,433円																																																											
口数	H	263,232,528口																																																											
100 口当たり分配金	I = F / H × 100	305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 7 期 自 平成 20 年 7 月 16 日 至 平成 21 年 7 月 15 日	第 8 期 自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 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なっております。</p> <p>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なっております。</p> <p>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なっております。</p> <p>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なっております。</p> <p>4 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。</p>
--	---

(2)金融商品の時価等に関する事項

第 7 期 平成 21 年 7 月 15 日現在	第 8 期 平成 22 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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第 7 期 自 平成 20 年 7 月 16 日 至 平成 21 年 7 月 15 日	第 8 期 自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 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7期 自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日		第8期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	
期首元本額	67,332,350,600 円	期首元本額	39,562,004,200 円
期中追加設定元本額	4,997,300,000 円	期中追加設定元本額	21,992,960,000 円
期中一部交換元本額	32,767,646,400 円	期中一部交換元本額	8,908,458,600 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券の貸借対照表計上額等

種類	第7期 自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日	
	貸借対照表計上額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
株式	31,013,788,400	19,162,822,140
合計	31,013,788,400	19,162,822,140

売買目的有価証券

種類	第8期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	7,408,986,705	
合計	7,408,986,705	

3 デリバティブ取引関係

第7期(自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日)

該当事項はございません。

第8期(自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日)

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22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	新生銀行	1,465,000	65.00	95,225,000	
	あおぞら銀行	1,006,000	109.00	109,654,000	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	22,999,100	412.00	9,475,629,200	
	りそなホールディングス	864,000	975.00	842,400,000	
	中央三井トラスト・ホールディングス	1,685,000	314.00	529,090,000	
	三井住友フィナンシャルグループ	2,298,600	2,522.00	5,797,069,200	
	第四銀行	423,000	296.00	125,208,000	
	北越銀行	336,000	143.00	48,048,000	
	西日本シティ銀行	1,052,000	248.00	260,896,000	
	札幌北洋ホールディングス	446,400	405.00	180,792,000	
	千葉銀行	1,183,000	532.00	629,356,000	
	横浜銀行	2,074,000	406.00	842,044,000	
	常陽銀行	1,169,000	347.00	405,643,000	
	群馬銀行	754,000	469.00	353,626,000	
	武蔵野銀行	49,000	2,440.00	119,560,000	
	千葉興業銀行	61,800	582.00	35,967,600	
	筑波銀行	98,300	230.00	22,609,000	
	東京都民銀行	57,000	974.00	55,518,000	
	七十七銀行	506,000	464.00	234,784,000	
	青森銀行	225,000	211.00	47,475,000	
	秋田銀行	222,000	304.00	67,488,000	
	山形銀行	183,000	405.00	74,115,000	
	岩手銀行	21,800	4,855.00	105,839,000	
東邦銀行	273,000	259.00	70,707,000		
東北銀行	164,000	138.00	22,632,000		
みちのく銀行	161,000	183.00	29,463,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	ふくおかフィナンシャルグループ	1,223,000	362.00	442,726,000		
	静岡銀行	931,000	738.00	687,078,000		
	十六銀行	391,000	310.00	121,210,000		
	スルガ銀行	315,000	764.00	240,660,000		
	八十二銀行	613,000	487.00	298,531,000		
	山梨中央銀行	203,000	350.00	71,050,000		
	大垣共立銀行	431,000	272.00	117,232,000		
	福井銀行	278,000	284.00	78,952,000		
	北國銀行	343,000	329.00	112,847,000		
	清水銀行	11,000	3,610.00	39,710,000		
	滋賀銀行	303,000	532.00	161,196,000		
	南都銀行	301,000	458.00	137,858,000		
	百五銀行	299,000	374.00	111,826,000		
	京都銀行	539,000	718.00	387,002,000		
	三重銀行	134,000	247.00	33,098,000		
	ほくほくフィナンシャルグループ	2,121,000	158.00	335,118,000		
	広島銀行	889,000	349.00	310,261,000		
	山陰合同銀行	194,000	647.00	125,518,000		
	中国銀行	267,000	1,022.00	272,874,000		
	鳥取銀行	103,000	233.00	23,999,000		
	伊予銀行	370,000	795.00	294,150,000		
	百十四銀行	354,000	325.00	115,050,000		
	四国銀行	233,000	276.00	64,308,000		
	阿波銀行	269,000	531.00	142,839,000		
	鹿児島銀行	208,000	551.00	114,608,000		
	大分銀行	209,000	280.00	58,520,000		
	宮崎銀行	202,000	231.00	46,662,000		
	肥後銀行	254,000	480.00	121,920,000		
	佐賀銀行	185,000	248.00	45,880,000		
	十八銀行	207,000	238.00	49,266,000		
	沖縄銀行	24,900	2,930.00	72,957,000		
	琉球銀行	63,900	980.00	62,622,000		
	住友信託銀行	2,723,000	459.00	1,249,857,000		
	みずほ信託銀行	2,553,000	75.00	191,475,000		
	八千代銀行	16,900	1,750.00	29,575,000		
	みずほフィナンシャルグループ	26,770,700	140.00	3,747,898,000		
	紀陽ホールディングス	1,205,000	118.00	142,190,000		
	山口フィナンシャルグループ	302,000	800.00	241,600,000		
	長野銀行	113,000	166.00	18,758,000		
	名古屋銀行	292,000	301.00	87,892,000		
	愛知銀行	11,700	5,600.00	65,520,000		
	第三銀行	197,000	254.00	50,038,000		
	中京銀行	133,000	264.00	35,112,000		
	東日本銀行	169,000	166.00	28,054,000		
	愛媛銀行	203,000	237.00	48,111,000		
	トマト銀行	125,000	177.00	22,125,000		
	みなと銀行	334,000	125.00	41,750,000		
	京葉銀行	266,000	439.00	116,774,000		
	関西アーバン銀行	375,000	127.00	47,625,000		
	栃木銀行	162,000	367.00	59,454,000		
	北日本銀行	10,100	2,235.00	22,573,500		
	東和銀行	324,000	72.00	23,328,000		
	福島銀行	397,000	51.00	20,247,000		
	大東銀行	205,000	64.00	13,120,000		
	トモニホールディングス	195,700	257.00	50,294,900		
	フィデアホールディングス	153,000	159.00	24,327,000		
	池田泉州ホールディングス	1,271,900	127.00	161,531,300		
	計	銘柄数：83			32,417,595,700	
		組入時価比率：100.0%			100%	
	合計				32,417,595,700	

(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22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。