

## 平成23年7月期 中間決算短信（平成22年7月16日～平成23年1月15日）

平成23年2月18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

半期報告書提出予定日 平成23年3月31日

## I ファンドの運用状況

## 1. 平成23年1月中間期の運用状況（平成22年7月16日～平成23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23年1月中間期	29,613	(99.0)	286	(1.0)	29,900	(100)
平成22年1月中間期	35,374	(99.3)	247	(0.7)	35,622	(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23年1月中間期	263,232	4,997	49,801	218,428
平成22年1月中間期	197,810	49,984	9,906	237,887

(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/当中間計算期間末発行済口数)×100
	百万円	百万円	百万円	円
平成23年1月中間期	29,933	33	29,900	13,689
平成22年1月中間期	35,664	41	35,622	14,975

## 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】

期別	第 8 期中間計算期間末 平成 22 年 1 月 15 日現在	第 9 期中間計算期間末 平成 23 年 1 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	286,208,095	320,551,611
株式	35,374,733,800	29,613,282,900
未収入金	3,106,200	—
未収利息	840	1,750
流動資産合計	35,664,048,935	29,933,836,261
資産合計	35,664,048,935	29,933,836,261
負債の部		
流動負債		
未払金	2,803,400	—
未払受託者報酬	12,152,307	10,668,724
未払委託者報酬	26,040,622	22,861,476
その他未払費用	347,149	304,763
流動負債合計	41,343,478	33,834,963
負債合計	41,343,478	33,834,963
純資産の部		
元本等		
元本	47,577,553,400	43,685,791,400
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△11,954,847,943	△13,785,790,102
(分配準備積立金)	1,941,341	2,176,433
元本等合計	35,622,705,457	29,900,001,298
純資産合計	35,622,705,457	29,900,001,298
負債純資産合計	35,664,048,935	29,933,836,261

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第 8 期中間計算期間	第 9 期中間計算期間
		自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 年 1 月 15 日	自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 年 1 月 15 日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		271,410,400	305,633,200
受取利息		327,043	91,493
有価証券売買等損益		△1,808,026,838	2,721,871,374
その他収益		453,460	494
営業収益合計		△1,535,835,935	3,027,596,561
営業費用			
支払利息		150,191	—
受託者報酬		12,152,307	10,668,724
委託者報酬		26,040,622	22,861,476
その他費用		347,168	304,784
営業費用合計		38,690,288	33,834,984
営業利益		△1,574,526,223	2,993,761,577
経常利益		△1,574,526,223	2,993,761,577
中間純利益		△1,574,526,223	2,993,761,577
一部交換に伴う中間純利益金額の分配額		—	—
期首剰余金又は期首欠損金(△)		△8,537,541,090	△20,214,182,904
剰余金増加額又は欠損金減少額		544,082,200	3,852,272,300
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		544,082,200	3,852,272,300
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,386,862,830	417,641,075
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,386,862,830	417,641,075
分配金		—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)		△11,954,847,943	△13,785,790,102

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 8 期中間計算期間	第 9 期中間計算期間
	自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 年 1 月 15 日	自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 年 1 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 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。 なお、当該中間計算期間は、平成 21 年 7 月 16 日から平成 22 年 1 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 22 年 7 月 16 日から平成 23 年 7 月 15 日までとなっております。 なお、当該中間計算期間は、平成 22 年 7 月 16 日から平成 23 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 8 期中間計算期間末 平成 22 年 1 月 15 日現在	第 9 期中間計算期間末 平成 23 年 1 月 15 日現在
1 中間計算期間の末日における受益権の総数 237,887,767 口	1 中間計算期間の末日における受益権の総数 218,428,957 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 11,954,847,943 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 13,785,790,102 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 149.75 円 (100 口当たり純資産額 14,975 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 136.89 円 (100 口当たり純資産額 13,689 円)

## (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 8 期中間計算期間末 平成 22 年 1 月 15 日現在	第 9 期中間計算期間末 平成 23 年 1 月 15 日現在
—	<p>1 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 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>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。</p>

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

第 8 期中間計算期間 自 平成 21 年 7 月 16 日 至 平成 22 年 1 月 15 日	第 9 期中間計算期間 自 平成 22 年 7 月 16 日 至 平成 23 年 1 月 15 日
期首元本額 39,562,004,200 円	期首元本額 52,646,505,600 円
期中追加設定元本額 9,996,840,000 円	期中追加設定元本額 999,500,000 円
期中一部交換元本額 1,981,290,800 円	期中一部交換元本額 9,960,214,200 円

## 2 デリバティブ取引関係

第 8 期中間計算期間末(平成 22 年 1 月 15 日現在)

該当事項はございません。

第 9 期中間計算期間末(平成 23 年 1 月 15 日現在)

該当事項はございません。