

平成23年7月期（平成22年7月16日～平成23年7月15日）決算短信

平成23年8月24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 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23年9月29日
 分配金支払開始予定日 平成23年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成23年7月期の運用状況（平成22年7月16日～平成23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23年7月期	24,777	(99.9)	12	(0.1)	24,789	(100)
平成22年7月期	32,417	(100.0)	14	(0.0)	32,432	(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23年7月期	263,232	49,965	98,519	214,678
平成22年7月期	197,810	109,964	44,542	263,232

(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23年7月期	25,566	776	24,789	11,548
平成22年7月期	33,277	845	32,432	12,321

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成23年7月期	347.00
平成22年7月期	305.00

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】

科目	期別	第8期	第9期
		平成22年7月15日現在 金額(円)	平成23年7月15日現在 金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		860,045,821	789,629,589
株式		32,417,595,700	24,777,141,500
未収利息		2,435	1,904
流動資産合計		33,277,643,956	25,566,772,993
資産合計		33,277,643,956	25,566,772,993
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		802,859,210	744,933,322
未払受託者報酬		13,388,971	10,047,626
未払委託者報酬		28,690,601	21,530,577
その他未払費用		382,478	287,010
流動負債合計		845,321,260	776,798,535
負債合計		845,321,260	776,798,535
純資産の部			
元本等			
元本		52,646,505,600	42,935,638,200
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		20,214,182,904	18,145,663,742
(分配準備積立金)		2,176,433	1,620,890
元本等合計		32,432,322,696	24,789,974,458
純資産合計		32,432,322,696	24,789,974,458
負債純資産合計		33,277,643,956	25,566,772,993

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第8期	第9期
		自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		883,300,260	809,823,650
受取利息		492,920	253,832
有価証券売買等損益		8,411,073,452	1,847,894,741
その他収益		453,460	494
営業収益合計		7,526,826,812	1,037,816,765
営業費用			
支払利息		150,191	
受託者報酬		25,541,278	20,716,350
委託者報酬		54,731,223	44,392,053
その他費用		729,646	591,794
営業費用合計		81,152,338	65,700,197
営業利益		7,607,979,150	1,103,516,962
経常利益		7,607,979,150	1,103,516,962
当期純利益		7,607,979,150	1,103,516,962
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()		8,537,541,090	20,214,182,904
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,638,137,900	7,924,577,200
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	7,924,577,200
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,903,941,354	4,007,607,754
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	4,007,607,754
分配金		802,859,210	744,933,322
期末剰余金又は期末欠損金()		20,214,182,904	18,145,663,742

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第8期	第9期
	自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	自 平成22年7月16日 至 平成23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 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。	(1) 受取配当金 同左 (2) 有価証券売買等損益 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。	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。

(貸借対照表に関する注記)

第8期 平成22年7月15日現在	第9期 平成23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 263,232,528 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 214,678,191 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 20,214,182,904 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 18,145,663,742 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)	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 115.48 円 (100口当たり純資産額 11,548 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	第9期 自 平成22年7月16日 至 平成23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 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。	1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 746,554,212 円 (100口当たり347円)のうち、744,933,322 円 (100口当たり347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;">円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: right;">884,096,449</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: right;">1,941,341</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: right;">C = A + B 886,037,790</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: right;">D 81,002,147</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: right;">E = C - D 805,035,643</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: right;">F 802,859,210</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: right;">G = E - F 2,176,433</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: right;">H 263,232,528</td> <td>口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td style="text-align: right;">I = F / H × 100 305</td> <td>円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	円	当期配当等収益額	884,096,449	円	分配準備積立金	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	<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;">円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: right;">810,077,976</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: right;">B 2,176,433</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: right;">C = A + B 812,254,409</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: right;">D 65,700,197</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: right;">E = C - D 746,554,212</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: right;">F 744,933,322</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: right;">G = E - F 1,620,890</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: right;">H 214,678,191</td> <td>口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金</td> <td style="text-align: right;">I = F / H × 100 347</td> <td>円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	円	当期配当等収益額	810,077,976	円	分配準備積立金	B 2,176,433	円	配当等収益合計額	C = A + B 812,254,409	円	経費	D 65,700,197	円	収益分配可能額	E = C - D 746,554,212	円	収益分配金	F 744,933,322	円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F 1,620,890	円	口数	H 214,678,191	口	100口当たり分配金	I = F / H × 100 347	円
項目	A	円																																																											
当期配当等収益額	884,096,449	円																																																											
分配準備積立金	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	円																																																											
当期配当等収益額	810,077,976	円																																																											
分配準備積立金	B 2,176,433	円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B 812,254,409	円																																																											
経費	D 65,700,197	円																																																											
収益分配可能額	E = C - D 746,554,212	円																																																											
収益分配金	F 744,933,322	円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F 1,620,890	円																																																											
口数	H 214,678,191	口																																																											
100口当たり分配金	I = F / H × 100 347	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8期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	第9期 自 平成22年7月16日 至 平成23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>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>	<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> <p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第8期 平成22年7月15日現在	第9期 平成23年7月15日現在
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。	1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。	2 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第8期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	第9期 自 平成22年7月16日 至 平成23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8期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日		第9期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7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	21,992,960,000 円	期中追加設定元本額	9,993,120,000 円
期中一部交換元本額	8,908,458,600 円	期中一部交換元本額	19,703,987,400 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第8期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	第9期 自 平成22年7月16日 至 平成23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)
種類		
株式	7,408,986,705	1,239,621,180
合計	7,408,986,705	1,239,621,180

3 デリバティブ取引関係

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。

第9期(自 平成22年7月16日 至 平成23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23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	1,618,000	86.00	139,148,000	
	あおぞら銀行	850,000	175.00	148,750,000	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	17,694,600	393.00	6,953,977,800	
	りそなホールディングス	1,442,800	388.00	559,806,400	
	三井住友トラスト・ホールディングス	4,463,000	286.00	1,276,418,000	
	三井住友フィナンシャルグループ	1,782,400	2,435.00	4,340,144,000	
	第四銀行	304,000	247.00	75,088,000	
	北越銀行	262,000	173.00	45,326,000	
	西日本シティ銀行	820,000	245.00	200,900,000	
	札幌北洋ホールディングス	352,500	350.00	123,375,000	
	千葉銀行	922,000	495.00	456,390,000	
	横浜銀行	1,602,000	394.00	631,188,000	
	常陽銀行	901,000	346.00	311,746,000	
	群馬銀行	534,000	426.00	227,484,000	
	武蔵野銀行	37,700	2,787.00	105,069,900	
	千葉興業銀行	44,800	443.00	19,846,400	
	筑波銀行	103,200	269.00	27,760,800	
	東京都民銀行	44,200	1,058.00	46,763,600	
	七十七銀行	395,000	365.00	144,175,000	
	青森銀行	186,000	271.00	50,406,000	
	秋田銀行	160,000	245.00	39,200,000	
	山形銀行	142,000	388.00	55,096,000	
	岩手銀行	15,800	3,190.00	50,402,000	
	東邦銀行	197,000	187.00	36,839,000	
	東北銀行	126,000	120.00	15,120,000	
	みちのく銀行	117,000	157.00	18,369,000	
	ふくおかフィナンシャルグループ	949,000	344.00	326,456,000	
	静岡銀行	705,000	746.00	525,930,000	
	十六銀行	293,000	249.00	72,957,000	
	スルガ銀行	247,000	705.00	174,135,000	
	八十二銀行	431,000	458.00	197,398,000	
	山梨中央銀行	143,000	347.00	49,621,000	
	大垣共立銀行	312,000	252.00	78,624,000	
	福井銀行	201,000	235.00	47,235,000	
	北國銀行	261,000	278.00	72,558,000	
	清水銀行	7,900	2,894.00	22,862,600	
	滋賀銀行	220,000	461.00	101,420,000	
	南都銀行	218,000	419.00	91,342,000	
	百五銀行	211,000	326.00	68,786,000	
	京都銀行	418,000	745.00	311,410,000	
	三重銀行	104,000	204.00	21,216,000	
	ほくほくフィナンシャルグループ	1,638,000	165.00	270,270,000	
	広島銀行	690,000	357.00	246,330,000	
	山陰合同銀行	139,000	607.00	84,373,000	
	中国銀行	191,000	1,016.00	194,056,000	
	鳥取銀行	74,000	158.00	11,692,000	
	伊予銀行	250,000	758.00	189,500,000	
	百十四銀行	274,000	295.00	80,830,000	
	四国銀行	169,000	262.00	44,278,000	
	阿波銀行	193,000	516.00	99,588,000	
鹿児島銀行	151,000	536.00	80,936,000		
大分銀行	151,000	242.00	36,542,000		
宮崎銀行	156,000	187.00	29,172,000		
肥後銀行	184,000	457.00	84,088,000		
佐賀銀行	142,000	205.00	29,110,000		
十八銀行	150,000	221.00	33,150,000		
沖縄銀行	17,700	3,710.00	65,667,000		
琉球銀行	49,100	1,032.00	50,671,200		
みずほ信託銀行	2,218,000	70.00	155,260,000		
八千代銀行	12,200	2,408.00	29,377,600		
みずほフィナンシャルグループ	28,845,400	129.00	3,721,056,600		
紀陽ホールディングス	927,000	109.00	101,043,000		
山口フィナンシャルグループ	233,000	793.00	184,769,000		
長野銀行	82,000	173.00	14,186,000		
名古屋銀行	211,000	259.00	54,649,000		
愛知銀行	7,800	4,505.00	35,139,000		
第三銀行	142,000	194.00	27,548,000		
中京銀行	96,000	200.00	19,200,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	東日本銀行	122,000	167.00	20,374,000		
	大光銀行	88,000	278.00	24,464,000		
	愛媛銀行	147,000	239.00	35,133,000		
	トマト銀行	90,000	151.00	13,590,000		
	みなと銀行	242,000	156.00	37,752,000		
	京葉銀行	193,000	427.00	82,411,000		
	関西アーバン銀行	326,000	147.00	47,922,000		
	栃木銀行	117,000	309.00	36,153,000		
	北日本銀行	7,300	1,846.00	13,475,800		
	東和銀行	251,000	97.00	24,347,000		
	福島銀行	288,000	42.00	12,096,000		
	大東銀行	149,000	50.00	7,450,000		
	トモニホールディングス	179,900	317.00	57,028,300		
	フィデアホールディングス	134,500	197.00	26,496,500		
	池田泉州ホールディングス	876,900	120.00	105,228,000		
	計	銘柄数：83			24,777,141,500	
		組入時価比率：99.9%			100%	
合計				24,777,141,500		

(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23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。