

平成24年7月期（平成23年7月16日～平成24年7月15日）決算短信

平成24年8月23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24年9月27日
 分配金支払開始予定日 平成24年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成24年7月期の運用状況（平成23年7月16日～平成24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24年7月期	23,666	(99.9)	14	(0.1)	23,681	(100)
平成23年7月期	24,777	(99.9)	12	(0.1)	24,789	(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24年7月期	214,678	19,993	19,660	215,011
平成23年7月期	263,232	49,965	98,519	214,678

(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24年7月期	24,473	792	23,681	11,014
平成23年7月期	25,566	776	24,789	11,548

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成24年7月期	355.00
平成23年7月期	347.00

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9期 平成23年7月15日現在	第10期 平成24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	789,629,589	806,759,695
株式	24,777,141,500	23,666,640,800
未収利息	1,904	6,114
流動資産合計	25,566,772,993	24,473,406,609
資産合計	25,566,772,993	24,473,406,609
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	744,933,322	763,291,620
未払受託者報酬	10,047,626	9,093,924
未払委託者報酬	21,530,577	19,486,917
その他未払費用	287,010	259,761
流動負債合計	776,798,535	792,132,222
負債合計	776,798,535	792,132,222
純資産の部		
元本等		
元本	42,935,638,200	43,002,344,800
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	18,145,663,742	19,321,070,413
(分配準備積立金)	1,620,890	1,425,747
元本等合計	24,789,974,458	23,681,274,387
純資産合計	24,789,974,458	23,681,274,387
負債純資産合計	25,566,772,993	24,473,406,609

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第9期	第10期
		自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		809,823,650	819,702,440
受取利息		253,832	290,697
有価証券売買等損益		1,847,894,741	1,120,521,042
その他収益		494	1,505
営業収益合計		1,037,816,765	300,526,400
営業費用			
受託者報酬		20,716,350	17,940,941
委託者報酬		44,392,053	38,444,721
その他費用		591,794	512,503
営業費用合計		65,700,197	56,898,165
営業利益		1,103,516,962	357,424,565
経常利益		1,103,516,962	357,424,565
当期純利益		1,103,516,962	357,424,565
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()		20,214,182,904	18,145,663,742
剰余金増加額又は欠損金減少額		7,924,577,200	1,718,294,900
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,924,577,200	1,718,294,900
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,007,607,754	1,772,985,386
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,007,607,754	1,772,985,386
分配金		744,933,322	763,291,620
期末剰余金又は期末欠損金()		18,145,663,742	19,321,070,413

(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23年7月16日から平成24年7月15日までとなっております。

(追加情報)

第10期 自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

第9期 平成23年7月15日現在	第10期 平成24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 214,678,191 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 215,011,724 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 18,145,663,742 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 19,321,070,413 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)	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)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第10期 自 平成23年7月16日 至 平成24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 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。	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。																																																												
<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;">810,077,976 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;">810,077,976 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;">2,176,433 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;">812,254,409 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">65,700,197 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;">746,554,212 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">744,933,322 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;">1,620,890 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">214,678,191 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;">347 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	810,077,976 円	当期配当等収益額	A	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	<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
項目	A	810,077,976 円																																																											
当期配当等収益額	A	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	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																																																											

(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9期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第10期 自 平成23年7月16日 至 平成24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9期 平成23年7月15日現在	第10期 平成24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9期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第10期 自 平成23年7月16日 至 平成24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9期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第10期 自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日
期首元本額 52,646,505,600 円	期首元本額 42,935,638,200 円
期中追加設定元本額 9,993,120,000 円	期中追加設定元本額 3,998,760,000 円
期中一部交換元本額 19,703,987,400 円	期中一部交換元本額 3,932,053,400 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第9期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第10期 自 平成23年7月16日 至 平成24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	1,239,621,180	973,630,176
合計	1,239,621,180	973,630,176

3 デリバティブ取引関係

第9期(平成23年7月15日現在)

該当事項はございません。

第10期(平成24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24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	5,200	1,149.00	5,974,800	
	新生銀行	1,799,000	95.00	170,905,000	
	あおぞら銀行	719,000	179.00	128,701,000	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	17,485,700	375.00	6,557,137,500	
	りそなホールディングス	2,010,200	317.00	637,233,400	
	三井住友トラスト・ホールディングス	4,527,000	237.00	1,072,899,000	
	三井住友フィナンシャルグループ	1,753,700	2,527.00	4,431,599,900	
	第四銀行	297,000	233.00	69,201,000	
	北越銀行	237,000	156.00	36,972,000	
	西日本シティ銀行	811,000	186.00	150,846,000	
	札幌北洋ホールディングス	348,300	231.00	80,457,300	
	千葉銀行	911,000	469.00	427,259,000	
	横浜銀行	1,469,000	366.00	537,654,000	
	常陽銀行	883,000	356.00	314,348,000	
	群馬銀行	522,000	384.00	200,448,000	
	武蔵野銀行	37,200	2,299.00	85,522,800	
	千葉興業銀行	44,200	421.00	18,608,200	
	筑波銀行	96,000	279.00	26,784,000	
	東京都民銀行	43,700	746.00	32,600,200	
	七十七銀行	362,000	315.00	114,030,000	
	青森銀行	173,000	246.00	42,558,000	
	秋田銀行	159,000	220.00	34,980,000	
	山形銀行	141,000	341.00	48,081,000	
	岩手銀行	15,600	3,330.00	51,948,000	
東邦銀行	195,000	243.00	47,385,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	東北銀行	124,000	122.00	15,128,000	
	みちのく銀行	115,000	156.00	17,940,000	
	ふくおかフィナンシャルグループ	937,000	290.00	271,730,000	
	静岡銀行	677,000	829.00	561,233,000	
	十六銀行	289,000	261.00	75,429,000	
	スルガ銀行	225,000	827.00	186,075,000	
	八十二銀行	426,000	417.00	177,642,000	
	山梨中央銀行	141,000	320.00	45,120,000	
	大垣共立銀行	308,000	274.00	84,392,000	
	福井銀行	199,000	185.00	36,815,000	
	北國銀行	268,000	307.00	82,276,000	
	清水銀行	7,800	2,161.00	16,855,800	
	滋賀銀行	217,000	433.00	93,961,000	
	南都銀行	215,000	335.00	72,025,000	
	百五銀行	209,000	331.00	69,179,000	
	京都銀行	413,000	594.00	245,322,000	
	三重銀行	96,000	175.00	16,800,000	
	ほくほくフィナンシャルグループ	1,618,000	125.00	202,250,000	
	広島銀行	682,000	270.00	184,140,000	
	山陰合同銀行	136,000	544.00	73,984,000	
	中国銀行	178,000	1,021.00	181,738,000	
	鳥取銀行	73,000	143.00	10,439,000	
	伊予銀行	247,000	624.00	154,128,000	
	百十四銀行	253,000	306.00	77,418,000	
	四国銀行	167,000	199.00	33,233,000	
	阿波銀行	203,000	502.00	101,906,000	
	鹿児島銀行	149,000	487.00	72,563,000	
	大分銀行	149,000	251.00	37,399,000	
	宮崎銀行	154,000	206.00	31,724,000	
	肥後銀行	178,000	410.00	72,980,000	
	佐賀銀行	140,000	197.00	27,580,000	
	十八銀行	148,000	205.00	30,340,000	
	沖縄銀行	17,500	3,630.00	63,525,000	
	琉球銀行	48,600	1,007.00	48,940,200	
	八千代銀行	11,800	1,513.00	17,853,400	
	セブン銀行	865,300	201.00	173,925,300	
	みずほフィナンシャルグループ	29,709,500	128.00	3,802,816,000	
	紀陽ホールディングス	920,000	116.00	106,720,000	
	山口フィナンシャルグループ	231,000	694.00	160,314,000	
	長野銀行	76,000	148.00	11,248,000	
	名古屋銀行	209,000	244.00	50,996,000	
	愛知銀行	8,300	3,910.00	32,453,000	
	第三銀行	131,000	149.00	19,519,000	
	中京銀行	95,000	179.00	17,005,000	
	東日本銀行	111,000	174.00	19,314,000	
	大光銀行	82,000	222.00	18,204,000	
	愛媛銀行	145,000	218.00	31,610,000	
	トマト銀行	89,000	135.00	12,015,000	
	みなと銀行	209,000	148.00	30,932,000	
	京葉銀行	190,000	357.00	67,830,000	
	関西アーバン銀行	322,000	102.00	32,844,000	
	栃木銀行	116,000	249.00	28,884,000	
	北日本銀行	7,200	2,120.00	15,264,000	
	東和銀行	232,000	77.00	17,864,000	
	福島銀行	267,000	56.00	14,952,000	
	大東銀行	147,000	66.00	9,702,000	
	トモニホールディングス	177,200	326.00	57,767,200	
	フィデアホールディングス	132,900	152.00	20,200,800	
	池田泉州ホールディングス	953,000	105.00	100,065,000	
計	銘柄数：84			23,666,640,800	
	組入時価比率：99.9%			100.0%	
合計				23,666,640,800	

(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24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。