

平成26年7月期 中間決算短信（平成25年7月16日～平成26年1月15日）

平成26年2月27日

ファンド名	東証銀行業株価指数連動型上場投資信託	上場取引所	東証
コード番号	(1615)	売買単位	100口
連動対象指標	東証銀行業株価指数		
主要投資資産	株式		
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	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	
半期報告書提出予定日	平成26年3月27日		

I ファンドの運用状況

1. 平成26年1月中間期の運用状況（平成25年7月16日～平成26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26年1月中間期	30,778	(99.1)	292	(0.9)	31,070	(100)
平成25年7月期	34,591	(99.9)	20	(0.1)	34,612	(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26年1月中間期	186,135	0	29,882	156,253

(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(前計算期末) 発行済口数)×100)
	百万円	百万円	百万円	円
平成26年1月中間期	31,107	36	31,070	19,885
平成25年7月期	35,471	859	34,612	18,595

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】

(単位：円)

	第11期 (平成25年7月15日現在)	第12期中間計算期間末 (平成26年1月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	879,757,054	328,871,333
株式	34,591,862,300	30,778,253,100
未収利息	7,693	696
流動資産合計	35,471,627,047	31,107,125,129
資産合計	35,471,627,047	31,107,125,129
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	815,275,399	-
未払受託者報酬	13,837,400	11,398,214
未払委託者報酬	29,651,505	24,424,688
その他未払費用	395,293	325,607
流動負債合計	859,159,597	36,148,509
負債合計	859,159,597	36,148,509
純資産の部		
元本等		
元本	37,227,187,200	31,250,672,600
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△2,614,719,750	△179,695,980
(分配準備積立金)	135,152	135,152
元本等合計	34,612,467,450	31,070,976,620
純資産合計	34,612,467,450	31,070,976,620
負債純資産合計	35,471,627,047	31,107,125,129

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期中間計算期間 自平成24年7月16日 至平成25年1月15日	第12期中間計算期間 自平成25年7月16日 至平成26年1月15日
営業収益		
受取配当金	361,153,725	314,823,800
受取利息	95,716	82,554
有価証券売買等損益	6,274,977,162	1,580,391,126
その他収益	2,272	2,846
営業収益合計	6,636,228,875	1,895,300,326
営業費用		
受託者報酬	8,983,763	11,398,214
委託者報酬	19,250,859	24,424,688
その他費用	256,656	325,654
営業費用合計	28,491,278	36,148,556

営業利益又は営業損失 (△)	6,607,737,597	1,859,151,770
経常利益又は経常損失 (△)	6,607,737,597	1,859,151,770
中間純利益又は中間純損失 (△)	6,607,737,597	1,859,151,770
一部交換に伴う中間純利益金額の分配額又は一部交換に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△19,321,070,413	△2,614,719,750
剰余金増加額又は欠損金減少額	441,650,400	575,872,000
中間一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	441,650,400	575,872,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△12,271,682,416	△179,695,980

(3) 【中間注記表】

(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	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	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。 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る場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの中間計算期間は、平成 25 年 7 月 16 日から平成 26 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 11 期 平成 25 年 7 月 15 日現在	第 12 期中間計算期間末 平成 26 年 1 月 15 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 186,135,936 口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 156,253,363 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 2,614,719,750 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 179,695,980 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)	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 198.85 円 (100 口当たり純資産額) (19,885 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 11 期 平成 25 年 7 月 15 日現在	第 12 期中間計算期間末 平成 26 年 1 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. 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。
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	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。

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。

(その他の注記)

1 元本の移動

第11期 自 平成24年7月16日 至 平成25年7月15日		第12期中間計算期間 自 平成25年7月16日 至 平成26年1月15日	
期首元本額	43,002,344,800円	期首元本額	37,227,187,200円
期中追加設定元本額	5,999,400,000円	期中追加設定元本額	0円
期中一部交換元本額	11,774,557,600円	期中一部交換元本額	5,976,514,600円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。