

平成28年7月期（平成27年7月16日～平成28年7月15日）決算短信

平成28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兼執行役社長 渡邊 国夫  
 問合せ先責任者 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成28年9月29日  
 分配金支払開始日 平成28年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年7月期の運用状況（平成27年7月16日～平成28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28年7月期	23,587	(99.8)	43	(0.2)	23,630	(100)
平成27年7月期	66,654	(100.0)	9	(0.0)	66,663	(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28年7月期	274,991	40,093	152,300	162,785
平成27年7月期	265,986	104,975	95,969	274,991

(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28年7月期	24,598	967	23,630	14,517
平成27年7月期	67,729	1,065	66,663	24,242

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成28年7月期	575.00
平成27年7月期	364.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有  無   
 ② ①以外の変更 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】

(単位：円)

	第 13 期 (平成 27 年 7 月 15 日現在)	第 14 期 (平成 28 年 7 月 15 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,061,207,413	1,006,947,825
株式	66,654,839,620	23,587,705,310
未収入金	5,450,180	-
未収配当金	7,584,000	4,052,000
未収利息	2,010	-
流動資産合計	67,729,083,223	24,598,705,135
資産合計	67,729,083,223	24,598,705,135
負債の部		
流動負債		
未払金	2,761,900	-
未払収益分配金	1,000,970,632	936,014,411
未払受託者報酬	19,367,837	10,045,343
未払委託者報酬	41,502,447	21,525,670
未払利息	-	1,355
その他未払費用	553,307	286,948
流動負債合計	1,065,156,123	967,873,727
負債合計	1,065,156,123	967,873,727
純資産の部		
元本等		
元本	54,998,386,400	32,557,023,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	11,665,540,700	△8,926,191,592
(分配準備積立金)	389,683	380,575
元本等合計	66,663,927,100	23,630,831,408
純資産合計	66,663,927,100	23,630,831,408
負債純資産合計	67,729,083,223	24,598,705,135

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日
営業収益		
受取配当金	1,111,866,950	1,038,333,000
受取利息	256,935	141,083
有価証券売買等損益	13,882,800,180	△25,329,689,276
その他収益	4,545	6,593
営業収益合計	14,994,928,610	△24,291,208,600
営業費用		

支払利息	-	108,117
受託者報酬	35,146,185	32,278,020
委託者報酬	75,313,135	69,167,083
その他費用	1,004,111	922,153
営業費用合計	111,463,431	102,475,373
営業利益又は営業損失(△)	14,883,465,179	△24,393,683,973
経常利益又は経常損失(△)	14,883,465,179	△24,393,683,973
当期純利益又は当期純損失(△)	14,883,465,179	△24,393,683,973
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△5,807,653,476	11,665,540,700
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,590,699,629	5,454,647,180
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	601,528,960	5,454,647,180
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,989,170,669	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	716,681,088
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	716,681,088
分配金	1,000,970,632	936,014,411
期末剰余金又は期末欠損金(△)	11,665,540,700	△8,926,191,592

## (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	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、信託約款の規定により、平成 27 年 7 月 16 日から平成 28 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 13 期 平成 27 年 7 月 15 日現在	第 14 期 平成 28 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 274,991,932 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 162,785,115 口
2. 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 242.42 円 (100 口当たり純資産額) (24,242 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 8,926,191,592 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 145.17 円 (100 口当たり純資産額) (14,517 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 13 期 自平成 26 年 7 月 16 日	第 14 期 自平成 27 年 7 月 16 日
-----------------------------	-----------------------------

至 平成 27 年 7 月 15 日			至 平成 28 年 7 月 15 日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	1,112,128,430 円	当期配当等収益額	A	1,038,372,559 円
分配準備積立金	B	695,316 円	分配準備積立金	B	389,683 円
配当等収益合計額	C=A+B	1,112,823,746 円	配当等収益合計額	C=A+B	1,038,762,242 円
経費	D	111,463,431 円	経費	D	102,367,256 円
収益分配可能額	E=C-D	1,001,360,315 円	収益分配可能額	E=C-D	936,394,986 円
収益分配金	F	1,000,970,632 円	収益分配金	F	936,014,411 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	389,683 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	380,575 円
口数	H	274,991,932 口	口数	H	162,785,115 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	364 円	100 口当たり分配金	I=F/H×100	575 円
			2. 追加情報		
			平成 28 年 1 月 29 日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。		

## (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 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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その金融商品に係るリスク</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

第 13 期 平成 27 年 7 月 15 日現在	第 14 期 平成 28 年 7 月 15 日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p>

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 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 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 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 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日
期首元本額 53,197,227,600 円	期首元本額 54,998,386,400 円
期中追加設定元本額 20,995,000,000 円	期中追加設定元本額 8,018,720,000 円
期中一部交換元本額 19,193,841,200 円	期中一部交換元本額 30,460,083,400 円

## 2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 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)
株式	12,641,455,084	△12,948,312,090
合計	12,641,455,084	△12,948,312,090

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

(1) 株式(平成 28 年 7 月 15 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	島根銀行	3,400	1,218.00	4,141,200	
		じもとホールディングス	114,900	156.00	17,924,400	
		足利ホールディングス	117,500	342.00	40,185,000	
		東京TYフィナンシャルグループ	22,100	2,474.00	54,675,400	
		九州フィナンシャルグループ	245,100	569.00	139,461,900	
		ゆうちょ銀行	410,300	1,214.00	498,104,200	
		富山第一銀行	40,700	495.00	20,146,500	

コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,115,600	439.70	490,529,320	
新生銀行	1,386,000	158.00	218,988,000	
あおぞら銀行	1,013,000	378.00	382,914,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	12,848,200	518.80	6,665,646,160	
りそなホールディングス	1,873,300	407.90	764,119,070	
三井住友トラスト・ホールディングス	3,343,000	362.50	1,211,837,500	
三井住友フィナンシャルグループ	1,282,300	3,233.00	4,145,675,900	
第四銀行	203,000	362.00	73,486,000	
北越銀行	173,000	197.00	34,081,000	
西日本シティ銀行	522,000	197.00	102,834,000	
千葉銀行	617,000	512.00	315,904,000	
常陽銀行	579,000	406.00	235,074,000	
群馬銀行	356,000	409.00	145,604,000	
武蔵野銀行	25,500	2,509.00	63,979,500	
千葉興業銀行	43,900	414.00	18,174,600	
筑波銀行	66,500	309.00	20,548,500	
七十七銀行	251,000	378.00	94,878,000	
青森銀行	116,000	311.00	36,076,000	
秋田銀行	104,000	339.00	35,256,000	
山形銀行	90,000	436.00	39,240,000	
岩手銀行	11,200	4,290.00	48,048,000	
東邦銀行	143,000	359.00	51,337,000	
東北銀行	81,000	147.00	11,907,000	
みちのく銀行	80,000	191.00	15,280,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	693,000	372.00	257,796,000	
静岡銀行	469,000	767.00	359,723,000	
十六銀行	201,000	286.00	57,486,000	
スルガ銀行	152,000	2,417.00	367,384,000	
八十二銀行	289,700	485.00	140,504,500	
山梨中央銀行	99,000	409.00	40,491,000	
大垣共立銀行	214,000	315.00	67,410,000	
福井銀行	137,000	246.00	33,702,000	
北國銀行	170,000	304.00	51,680,000	
清水銀行	5,400	2,522.00	13,618,800	

富山銀行	3,100	3,680.00	11,408,000	
滋賀銀行	150,000	482.00	72,300,000	
南都銀行	155,000	356.00	55,180,000	
百五銀行	144,000	389.00	56,016,000	
京都銀行	306,000	814.00	249,084,000	
紀陽銀行	62,900	1,451.00	91,267,900	
三重銀行	71,000	191.00	13,561,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,089,000	132.00	143,748,000	
広島銀行	472,000	376.00	177,472,000	
山陰合同銀行	96,300	731.00	70,395,300	
中国銀行	113,500	1,128.00	128,028,000	
鳥取銀行	51,000	169.00	8,619,000	
伊予銀行	171,300	660.00	113,058,000	
百十四銀行	176,000	339.00	59,664,000	
四国銀行	124,000	210.00	26,040,000	
阿波銀行	128,000	599.00	76,672,000	
大分銀行	92,000	321.00	29,532,000	
宮崎銀行	107,000	262.00	28,034,000	
佐賀銀行	97,000	245.00	23,765,000	
十八銀行	98,000	271.00	26,558,000	
沖縄銀行	14,640	3,265.00	47,799,600	
琉球銀行	33,000	1,127.00	37,191,000	
セブン銀行	600,100	337.00	202,233,700	
みずほフィナンシャルグループ	22,710,200	163.80	3,719,930,760	
高知銀行	62,000	107.00	6,634,000	
山口フィナンシャルグループ	150,000	1,000.00	150,000,000	
長野銀行	52,000	202.00	10,504,000	
名古屋銀行	134,000	338.00	45,292,000	
北洋銀行	241,200	314.00	75,736,800	
愛知銀行	5,400	4,675.00	25,245,000	
第三銀行	91,000	171.00	15,561,000	
中京銀行	66,000	243.00	16,038,000	
大光銀行	57,000	195.00	11,115,000	
愛媛銀行	94,000	239.00	22,466,000	
トマト銀行	62,000	148.00	9,176,000	
みなと銀行	145,000	170.00	24,650,000	

	京葉銀行	131,000	434.00	56,854,000	
	関西アーバン銀行	22,300	1,003.00	22,366,900	
	栃木銀行	83,000	382.00	31,706,000	
	北日本銀行	5,000	2,770.00	13,850,000	
	東和銀行	300,000	85.00	25,500,000	
	福島銀行	197,000	92.00	18,124,000	
	大東銀行	96,000	196.00	18,816,000	
	トモニホールディングス	122,900	361.00	44,366,900	
	フィデアホールディングス	130,600	145.00	18,937,000	
	池田泉州ホールディングス	169,900	420.00	71,358,000	
	小計	銘柄数 : 87		23,587,705,310	
		組入時価比率 : 99.8%		100.0%	
	合計			23,587,705,310	

(注 1) 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 28 年 7 月 15 日現在)

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。