



2020年7月期 (2019年7月16日～2020年7月15日) 決算短信
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2020 (July 16, 2019 – July 15, 2020)

2020年8月26日
August 26, 2020

上場取引所 東証
Listed Exchange TSE

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 兼代表取締役社長 中川 順子
問合せ先責任者 サポートダイヤル 山中 淳 TEL 0120-753104

Fund name: TOPIX Banks Exchange Traded Fund
Code: 1615
Underlying index: TOPIX Banks Index
Primary invested assets: Stocks
Trading unit: 100 units
Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
Representative: Junko Nakagawa, President & CEO
Contact person: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2020年9月30日
分配金支払開始日 2020年8月21日
Scheduled date of submission of securities report: September 30, 2020
Date of commencing dividend payment: August 21, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年7月期の運用状況 (2019年7月16日～2020年7月15日)

Management Status for Year ended July 2020 (from July 16, 2019 to July 15, 2020)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

Assets (fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

	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)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	15,497	(99.8)	33	(0.2)	15,530	(100.0)
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	24,802	(99.6)	92	(0.4)	24,894	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	173,132	24,964	67,502	130,595
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	314,318	23,864	165,049	173,132

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	100口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	16,307	777	15,530	11,892
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	26,258	1,363	24,894	14,379

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	580
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	767

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無
Changes other than those in ① No

II 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit: JPY)

	第17期 (2019年7月15日現在) 17th Fiscal Year As of July 15, 2019	第18期 (2020年7月15日現在) 18th Fiscal Year As of July 15, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
コール・ローン Call loans	1,451,695,622	807,652,511
株式 Stocks	24,802,459,590	15,497,317,660
未収配当金 Accrued dividends receivable	4,168,000	2,531,500
流動資産合計 Total current assets	26,258,323,212	16,307,501,671
資産合計 Total assets	26,258,323,212	16,307,501,671
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	1,327,929,389	757,453,784
未払受託者報酬 Trustee fee payable	11,231,131	6,184,858
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	24,066,640	13,253,189
未払利息 Accrued interest expenses	12,409	416
その他未払費用 Other accrued expenses	320,827	176,646
流動負債合計 Total current liabilities	1,363,560,396	777,068,893
負債合計 Total liabilities	1,363,560,396	777,068,893
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	34,626,581,200	26,119,096,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△9,731,818,384	△10,588,663,222

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	265,331	642,872
元本等合計 Total principal and other	24,894,762,816	15,530,432,778
純資産合計 Total net assets	24,894,762,816	15,530,432,778
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	26,258,323,212	16,307,501,671

(2) 【損益及び剰余金計算書】 Statement of Income and Retained Earnings

(単位：円) (Unit：JPY)

	第17期 自 2018年7月16日 至 2019年7月15日 17th Fiscal Year From July 16, 2018 to July 15, 2019	第18期 自 2019年7月16日 至 2020年7月15日 18th Fiscal Year From July 16, 2019 to July 15, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	1,421,237,475	805,130,050
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△5,540,062,921	△3,795,824,521
その他収益 Other revenue	14,417	11,552
営業収益合計 Total operating revenue	△4,118,811,029	△2,990,682,919
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	489,128	189,591
受託者報酬 Trustee fee	29,807,527	14,857,940
委託者報酬 Investment trust management fee	63,873,145	31,838,294
その他費用 Other expenses	851,576	424,452
営業費用合計 Total operating expenses	95,021,376	47,310,277
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△4,213,832,405	△3,037,993,196
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△4,213,832,405	△3,037,993,196
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△4,213,832,405	△3,037,993,196
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 (△) Distribution of profit loss from partial exchange	-	-
期首剰余金又は期首欠損金 (△) Surplus (deficit) at beginning of period	△7,702,817,680	△9,731,818,384
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,401,283,720	4,575,557,260

Increase in surplus or decrease in deficit		
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from partial exchange	4,401,283,720	4,575,557,260
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	888,522,630	1,636,955,118
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from additional subscriptions for period	888,522,630	1,636,955,118
分配金 Dividends	1,327,929,389	757,453,784
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△9,731,818,384	△10,588,663,222

(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 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。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配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	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年7月16日から2020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17期 2019年7月15日現在	第18期 2020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 173,132,906 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 130,595,480 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 9,731,818,384 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 10,588,663,222 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 143.79 円 (100口当たり純資産額) (14,379 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 118.92 円 (100口当たり純資産額) (11,892 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自2018年7月16日 至2019年7月15日	第18期 自2019年7月16日 至2020年7月15日																		
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																		
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,420,762,764 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>1,964,204 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1,420,762,764 円	分配準備積立金	B	1,964,204 円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>804,952,011 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>265,331 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	804,952,011 円	分配準備積立金	B	265,331 円
項目																			
当期配当等収益額	A	1,420,762,764 円																	
分配準備積立金	B	1,964,204 円																	
項目																			
当期配当等収益額	A	804,952,011 円																	
分配準備積立金	B	265,331 円																	

配当等収益合計額	C=A+B	1,422,726,968円	配当等収益合計額	C=A+B	805,217,342円
経費	D	94,532,248円	経費	D	47,120,686円
収益分配可能額	E=C-D	1,328,194,720円	収益分配可能額	E=C-D	758,096,656円
収益分配金	F	1,327,929,389円	収益分配金	F	757,453,784円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	265,331円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	642,872円
口数	H	173,132,906口	口数	H	130,595,480口
100口当たり分配金	I=F/H×100	767円	100口当たり分配金	I=F/H×100	580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17期 自 2018年7月16日 至 2019年7月15日	第18期 自 2019年7月16日 至 2020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その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その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17期 2019年7月15日現在	第18期 2020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17期	第18期
------	------

自 2018年 7月 16日 至 2019年 7月 15日	自 2019年 7月 16日 至 2020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 17 期 自 2018年 7月 16日 至 2019年 7月 15日	第 18 期 自 2019年 7月 16日 至 2020年 7月 15日
期首元本額 62,863,651,400 円	期首元本額 34,626,581,200 円
期中追加設定元本額 4,772,900,000 円	期中追加設定元本額 4,992,980,000 円
期中一部交換元本額 33,009,970,200 円	期中一部交換元本額 13,500,465,200 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 17 期 自 2018年 7月 16日 至 2019年 7月 15日	第 18 期 自 2019年 7月 16日 至 2020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	△4,665,974,156	△2,827,436,131
合計	△4,665,974,156	△2,827,436,131

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(2020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	3,700	544.00	2,012,800	
		じもとホールディングス	94,200	94.00	8,854,800	
		めぶきフィナンシャルグループ	724,500	254.00	184,023,000	
		東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,800	1,182.00	22,221,600	
		九州フィナンシャルグループ	305,100	444.00	135,464,400	
		ゆうちょ銀行	395,000	838.00	331,010,000	
		富山第一銀行	33,200	270.00	8,964,000	
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	796,400	347.00	276,350,800	
		西日本フィナンシャルホールディングス	92,800	724.00	67,187,200	
		関西みらいフィナンシャルグループ	81,800	416.00	34,028,800	
		三十三フィナンシャルグループ	12,900	1,375.00	17,737,500	
		第四北越フィナンシャルグループ	24,200	2,079.00	50,311,800	

新生銀行	102,300	1,300.00	132,990,000
あおぞら銀行	83,100	1,915.00	159,136,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,538,500	424.60	4,050,047,100
りそなホールディングス	1,530,200	379.60	580,863,920
三井住友トラスト・ホールディングス	263,600	3,016.00	795,017,600
三井住友フィナンシャルグループ	964,400	3,087.00	2,977,102,800
千葉銀行	465,300	524.00	243,817,200
群馬銀行	267,900	343.00	91,889,700
武蔵野銀行	20,800	1,565.00	32,552,000
千葉興業銀行	38,200	233.00	8,900,600
筑波銀行	58,000	161.00	9,338,000
七十七銀行	47,100	1,560.00	73,476,000
青森銀行	10,800	2,207.00	23,835,600
秋田銀行	8,900	1,503.00	13,376,700
山形銀行	15,700	1,326.00	20,818,200
岩手銀行	9,100	2,586.00	23,532,600
東邦銀行	124,700	232.00	28,930,400
東北銀行	6,700	965.00	6,465,500
みちのく銀行	9,000	1,002.00	9,018,000
ふくおかフィナンシャルグループ	117,500	1,712.00	201,160,000
静岡銀行	339,600	703.00	238,738,800
十六銀行	17,500	1,973.00	34,527,500
スルガ銀行	142,700	377.00	53,797,900
八十二銀行	336,500	412.00	138,638,000
山梨中央銀行	16,200	867.00	14,045,400
大垣共立銀行	27,500	2,234.00	61,435,000
福井銀行	11,900	1,605.00	19,099,500
北國銀行	13,900	2,909.00	40,435,100
清水銀行	5,700	1,617.00	9,216,900
富山銀行	2,700	2,164.00	5,842,800
滋賀銀行	28,000	2,435.00	68,180,000
南都銀行	23,200	2,072.00	48,070,400
百五銀行	125,500	325.00	40,787,500
京都銀行	49,900	3,950.00	197,105,000

紀陽銀行	49,400	1,595.00	78,793,000
ほくほくフィナンシャルグループ	92,800	924.00	85,747,200
広島銀行	205,800	508.00	104,546,400
山陰合同銀行	82,700	530.00	43,831,000
中国銀行	120,000	958.00	114,960,000
鳥取銀行	4,800	1,134.00	5,443,200
伊予銀行	199,000	647.00	128,753,000
百十四銀行	14,800	1,855.00	27,454,000
四国銀行	21,200	800.00	16,960,000
阿波銀行	22,800	2,394.00	54,583,200
大分銀行	8,000	2,443.00	19,544,000
宮崎銀行	9,300	2,351.00	21,864,300
佐賀銀行	8,500	1,229.00	10,446,500
沖縄銀行	12,800	3,155.00	40,384,000
琉球銀行	32,200	942.00	30,332,400
セブン銀行	465,800	282.00	131,355,600
みずほフィナンシャルグループ	18,947,400	136.60	2,588,214,840
高知銀行	5,100	643.00	3,279,300
山口フィナンシャルグループ	174,000	654.00	113,796,000
長野銀行	4,600	1,052.00	4,839,200
名古屋銀行	10,400	2,429.00	25,261,600
北洋銀行	210,200	214.00	44,982,800
愛知銀行	5,000	2,873.00	14,365,000
中京銀行	5,700	2,023.00	11,531,100
大光銀行	4,800	1,475.00	7,080,000
愛媛銀行	19,500	1,164.00	22,698,000
トマト銀行	5,400	991.00	5,351,400
京葉銀行	59,500	527.00	31,356,500
栃木銀行	67,400	168.00	11,323,200
北日本銀行	4,300	1,747.00	7,512,100
東和銀行	24,500	683.00	16,733,500
福島銀行	13,100	161.00	2,109,100
大東銀行	7,200	630.00	4,536,000
トモニホールディングス	107,800	345.00	37,191,000
フィデアホールディングス	135,400	101.00	13,675,400

	池田泉州ホールディングス	160,300	163.00	26,128,900	
小計	銘柄数：82 組入時価比率：99.8%			15,497,317,660	100.0%
合計				15,497,317,660	

(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(2020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。