



平成 29 年 7 月期 (平成 28 年 7 月 16 日～平成 29 年 7 月 15 日) 決算短信
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2017 (July 16, 2016 – July 15, 2017)

平成 29 年 8 月 24 日
August 24, 2017

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

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: Kunio Watanabe, President & CEO
Contact person: Akihiro Watanabe, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 平成 29 年 9 月 28 日
分配金支払開始日 平成 29 年 8 月 23 日
Scheduled date of submission of securities report: September 28, 2017
Date of commencing dividend payment: August 23, 2017

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 平成 29 年 7 月期の運用状況 (平成 28 年 7 月 16 日～平成 29 年 7 月 15 日)

Management Status for Year ended July 2017 (from July 16, 2016 to July 15, 2017)

(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.	% %
平成 29 年 7 月期 FY ended Jul. 2017	43,777	(100.0)	7	(0.0)	43,784	(100.0)
平成 28 年 7 月期 FY ended Jul. 2016	23,587	(99.8)	43	(0.2)	23,630	(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
平成 29 年 7 月期 FY ended Jul. 2017	162,785	144,659	79,152	228,292
平成 28 年 7 月期 FY ended Jul. 2016	274,991	40,093	152,300	162,785

(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
平成 29 年 7 月期 FY ended Jul. 2017	44,601	816	43,784	19,179
平成 28 年 7 月期 FY ended Jul. 2016	24,598	967	23,630	14,517

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
平成 29 年 7 月期 FY ended Jul. 2017	338
平成 28 年 7 月期 FY ended Jul. 2016	575

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 14 期 (平成 28 年 7 月 15 日現在) 14th Fiscal Year As of July 15, 2016	第 15 期 (平成 29 年 7 月 15 日現在) 15th Fiscal Year As of July 15, 2017
	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	1,006,947,825	818,340,744
株式 Stocks	23,587,705,310	43,777,442,280
未収配当金 Accrued dividend receivable	4,052,000	5,460,000
流動資産合計 Total current assets	24,598,705,135	44,601,243,024
資産合計 Total assets	24,598,705,135	44,601,243,024
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	936,014,411	771,629,934
未払受託者報酬 Trustee fee payable	10,045,343	14,151,450
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	21,525,670	30,324,484
未払利息 Accrued interest expenses	1,355	2,028
その他未払費用 Other accrued expenses	286,948	404,260
流動負債合計 Total current liabilities	967,873,727	816,512,156
負債合計 Total liabilities	967,873,727	816,512,156
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	32,557,023,000	45,658,576,000
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△8,926,191,592	△1,873,845,132

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	380,575	1,745,200
元本等合計 Total principal and other	23,630,831,408	43,784,730,868
純資産合計 Total net assets	23,630,831,408	43,784,730,868
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	24,598,705,135	44,601,243,024

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日 14th Fiscal Year From July 16, 2015 to July 15, 2016	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 年 7 月 15 日 15th Fiscal Year From July 16, 2016 to July 15, 2017
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	1,038,333,000	855,731,125
受取利息 Interest income	141,083	-
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△25,329,689,276	9,790,994,441
その他収益 Other revenue	6,593	6,340
営業収益合計 Total operating revenue	△24,291,208,600	10,646,731,906
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	108,117	173,393
受託者報酬 Trustee fee	32,278,020	26,035,497
委託者報酬 Investment trust management fee	69,167,083	55,790,240
その他費用 Other expenses	922,153	743,776
営業費用合計 Total operating expenses	102,475,373	82,742,906
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△24,393,683,973	10,563,989,000
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△24,393,683,973	10,563,989,000
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△24,393,683,973	10,563,989,000
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 (△)	11,665,540,700	△8,926,191,592

Surplus (deficit) at beginning of period		
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	5,454,647,180	691,874,570
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	5,454,647,180	691,874,570
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	716,681,088	3,431,887,176
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	716,681,088	3,431,887,176
分配金 Dividends	936,014,411	771,629,934
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	△8,926,191,592	△1,873,845,132

(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 28 年 7 月 16 日から平成 29 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 14 期 平成 28 年 7 月 15 日現在	第 15 期 平成 29 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 162,785,115 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 228,292,880 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 8,926,191,592 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 1,873,845,132 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)	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 191.79 円 (100 口当たり純資産額) (19,179 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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>1,038,372,559 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>389,683 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1,038,372,559 円	分配準備積立金	B	389,683 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>855,564,072 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>380,575 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	855,564,072 円	分配準備積立金	B	380,575 円
項目																			
当期配当等収益額	A	1,038,372,559 円																	
分配準備積立金	B	389,683 円																	
項目																			
当期配当等収益額	A	855,564,072 円																	
分配準備積立金	B	380,575 円																	

配当等収益合計額	C=A+B	1,038,762,242 円
経費	D	102,367,256 円
収益分配可能額	E=C-D	936,394,986 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	380,575 円
口数	H	162,785,115 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	575 円

配当等収益合計額	C=A+B	855,944,647 円
経費	D	82,569,513 円
収益分配可能額	E=C-D	773,375,134 円
収益分配金	F	771,629,934 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,745,200 円
口数	H	228,292,880 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	338 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 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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 14 期 平成 28 年 7 月 15 日現在	第 15 期 平成 29 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ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>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。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

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。	
--	--

(関連当事者との取引に関する注記)

第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 年 7 月 15 日
期首元本額 54,998,386,400 円	期首元本額 32,557,023,000 円
期中追加設定元本額 8,018,720,000 円	期中追加設定元本額 28,931,960,000 円
期中一部交換元本額 30,460,083,400 円	期中一部交換元本額 15,830,407,000 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 14 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 15 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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	△12,948,312,090	6,540,699,649
合計	△12,948,312,090	6,540,699,649

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 29 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	4,900	1,326.00	6,497,400	
		じもとホールディングス	165,800	199.00	32,994,200	
		めぶきフィナンシャルグループ	1,114,500	425.00	473,662,500	
		東京TYフィナンシャルグループ	33,400	3,075.00	102,705,000	
		九州フィナンシャルグループ	379,000	724.00	274,396,000	
		ゆうちょ銀行	654,400	1,454.00	951,497,600	
		富山第一銀行	58,700	513.00	30,113,100	
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,498,000	564.00	844,872,000	
		西日本フィナンシャルホールディング	156,700	1,239.00	194,151,300	

ガス			
新生銀行	2,200,000	189.00	415,800,000
あおぞら銀行	1,462,000	431.00	630,122,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	17,513,700	731.80	12,816,525,660
りそなホールディングス	2,703,800	590.40	1,596,323,520
三井住友トラスト・ホールディングス	482,500	3,955.00	1,908,287,500
三井住友フィナンシャルグループ	1,850,700	4,293.00	7,945,055,100
第四銀行	283,000	517.00	146,311,000
北越銀行	25,000	2,636.00	65,900,000
千葉銀行	891,000	809.00	720,819,000
群馬銀行	513,600	661.00	339,489,600
武蔵野銀行	36,900	3,400.00	125,460,000
千葉興業銀行	63,300	582.00	36,840,600
筑波銀行	96,000	332.00	31,872,000
七十七銀行	362,000	557.00	201,634,000
青森銀行	179,000	388.00	69,452,000
秋田銀行	148,000	319.00	47,212,000
山形銀行	130,000	496.00	64,480,000
岩手銀行	15,100	4,495.00	67,874,500
東邦銀行	207,000	391.00	80,937,000
東北銀行	118,000	152.00	17,936,000
みちのく銀行	138,000	185.00	25,530,000
ふくおかフィナンシャルグループ	938,000	531.00	498,078,000
静岡銀行	610,000	1,017.00	620,370,000
十六銀行	310,000	363.00	112,530,000
スルガ銀行	236,300	2,779.00	656,677,700
八十二銀行	445,900	732.00	326,398,800
山梨中央銀行	143,000	458.00	65,494,000
大垣共立銀行	357,000	319.00	113,883,000
福井銀行	198,000	271.00	53,658,000
北國銀行	245,000	430.00	105,350,000
清水銀行	7,900	3,605.00	28,479,500
富山銀行	4,500	4,130.00	18,585,000
滋賀銀行	217,000	586.00	127,162,000

南都銀行	26,400	3,200.00	84,480,000
百五銀行	208,000	454.00	94,432,000
京都銀行	414,000	1,064.00	440,496,000
紀陽銀行	86,900	1,961.00	170,410,900
三重銀行	10,300	2,482.00	25,564,600
ほくほくフィナンシャルグループ	153,800	1,811.00	278,531,800
広島銀行	682,000	475.00	323,950,000
山陰合同銀行	137,000	908.00	124,396,000
中国銀行	163,800	1,666.00	272,890,800
鳥取銀行	7,300	1,700.00	12,410,000
伊予銀行	329,600	930.00	306,528,000
百十四銀行	254,000	363.00	92,202,000
四国銀行	177,000	298.00	52,746,000
阿波銀行	197,000	743.00	146,371,000
大分銀行	133,000	422.00	56,126,000
宮崎銀行	154,000	367.00	56,518,000
佐賀銀行	140,000	263.00	36,820,000
十八銀行	142,000	304.00	43,168,000
沖縄銀行	22,500	4,495.00	101,137,500
琉球銀行	47,600	1,601.00	76,207,600
セブン銀行	866,400	419.00	363,021,600
みずほフィナンシャルグループ	31,383,400	201.00	6,308,063,400
高知銀行	84,000	125.00	10,500,000
山口フィナンシャルグループ	216,000	1,369.00	295,704,000
長野銀行	7,600	1,978.00	15,032,800
名古屋銀行	18,700	4,145.00	77,511,500
北洋銀行	377,200	386.00	145,599,200
愛知銀行	7,800	6,170.00	48,126,000
第三銀行	13,100	1,713.00	22,440,300
中京銀行	9,500	2,307.00	21,916,500
大光銀行	79,000	236.00	18,644,000
愛媛銀行	29,400	1,398.00	41,101,200
トマト銀行	8,900	1,550.00	13,795,000
みなと銀行	20,900	2,111.00	44,119,900
京葉銀行	188,000	478.00	89,864,000

	関西アーバン銀行	32,200	1,337.00	43,051,400	
	栃木銀行	127,500	463.00	59,032,500	
	北日本銀行	7,200	3,175.00	22,860,000	
	東和銀行	433,000	124.00	53,692,000	
	福島銀行	251,000	88.00	22,088,000	
	大東銀行	120,000	165.00	19,800,000	
	トモニホールディングス	190,500	532.00	101,346,000	
	フィデアホールディングス	224,200	183.00	41,028,600	
	池田泉州ホールディングス	245,200	458.00	112,301,600	
	小計 銘柄数：86			43,777,442,280	
	組入時価比率：100.0%			100.0%	
	合計			43,777,442,280	

(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 29 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。