



2018 年 7 月期 (2017 年 7 月 16 日～2018 年 7 月 15 日) 決算短信
Earnings Report for Fiscal Year ended July 2018 (July 16, 2017 - July 15, 2018)

2018 年 8 月 24 日
August 24, 2018

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 増田 真一 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: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 2018 年 9 月 27 日
分配金支払開始日 2018 年 8 月 23 日
Scheduled date of submission of securities report: September 27, 2018
Date of commencing dividend payment: August 23, 2018

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2018 年 7 月期の運用状況 (2017 年 7 月 16 日～2018 年 7 月 15 日)

Management Status for Year ended July 2018 (from July 16, 2017 to July 15, 2018)

(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.	% %
2018 年 7 月期 FY ended Jul. 2018	55,147	(100.0)	13	(0.0)	55,160	(100.0)
2017 年 7 月期 FY ended Jul. 2017	43,777	(100.0)	7	(0.0)	43,784	(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
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	228,292	139,994	53,969	314,318
2017年7月期 FY ended Jul. 2017	162,785	144,659	79,152	228,292

(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
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	56,695	1,534	55,160	17,549
2017年7月期 FY ended Jul. 2017	44,601	816	43,784	19,179

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	465
2017年7月期 FY ended Jul. 2017	338

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 15 期 (2017 年 7 月 15 日現在) 15th Fiscal Year As of July 15, 2017	第 16 期 (2018 年 7 月 15 日現在) 16th Fiscal Year As of July 15, 2018
	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	818,340,744	1,540,507,484
株式 Stocks	43,777,442,280	55,147,045,040
未収配当金 Accrued dividend receivable	5,460,000	8,164,000
流動資産合計 Total current assets	44,601,243,024	56,695,716,524
資産合計 Total assets	44,601,243,024	56,695,716,524
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	771,629,934	1,461,579,895
未払受託者報酬 Trustee fee payable	14,151,450	23,110,824
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	30,324,484	49,523,134
未払利息 Accrued interest expenses	2,028	8,715
その他未払費用 Other accrued expenses	404,260	660,236
流動負債合計 Total current liabilities	816,512,156	1,534,882,804
負債合計 Total liabilities	816,512,156	1,534,882,804
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	45,658,576,000	62,863,651,400
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△1,873,845,132	△7,702,817,680

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	1,745,200	1,964,204
元本等合計 Total principal and other	43,784,730,868	55,160,833,720
純資産合計 Total net assets	43,784,730,868	55,160,833,720
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	44,601,243,024	56,695,716,524

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	第15期 自 2016年7月16日 至 2017年7月15日 15th Fiscal Year From July 16, 2016 to July 15, 2017	第16期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日 16th Fiscal Year From July 16, 2017 to July 15, 2018
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	855,731,125	1,591,439,275
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	9,790,994,441	△7,552,737,903
その他収益 Other revenue	6,340	12,901
営業収益合計 Total operating revenue	10,646,731,906	△5,961,285,727
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	173,393	298,383
受託者報酬 Trustee fee	26,035,497	40,787,640
委託者報酬 Investment trust management fee	55,790,240	87,401,972
その他費用 Other expenses	743,776	1,165,282
営業費用合計 Total operating expenses	82,742,906	129,653,277
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	10,563,989,000	△6,090,939,004
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	10,563,989,000	△6,090,939,004
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	10,563,989,000	△6,090,939,004
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	△8,926,191,592	△1,873,845,132
剰余金増加額又は欠損金減少額	691,874,570	1,723,546,351

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	691,874,570	241,470,220
当期追加信託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 additional subscriptions for period	-	1,482,076,131
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	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	3,431,887,176	-
分配金 Dividends	771,629,934	1,461,579,895
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	△1,873,845,132	△7,702,817,680

(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、2017年7月16日から2018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15期 2017年7月15日現在	第16期 2018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 228,292,880 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 314,318,257 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 1,873,845,132 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 7,702,817,680 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)	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 175.49 円 (100口当たり純資産額) (17,549 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自2016年7月16日 至2017年7月15日	第16期 自2017年7月16日 至2018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	855,564,072 円	当期配当等収益額	A	1,591,153,793 円
分配準備積立金	B	380,575 円	分配準備積立金	B	1,745,200 円
配当等収益合計額	C=A+B	855,944,647 円	配当等収益合計額	C=A+B	1,592,898,993 円
経費	D	82,569,513 円	経費	D	129,354,894 円
収益分配可能額	E=C-D	773,375,134 円	収益分配可能額	E=C-D	1,463,544,099 円
収益分配金	F	771,629,934 円	収益分配金	F	1,461,579,895 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,745,200 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,964,204 円
口数	H	228,292,880 口	口数	H	314,318,257 口
100 口当たり分配金	I=F/H×100	338 円	100 口当たり分配金	I=F/H×100	465 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 15 期 自 2016 年 7 月 16 日 至 2017 年 7 月 15 日	第 16 期 自 2017 年 7 月 16 日 至 2018 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 15 期 2017 年 7 月 15 日現在	第 16 期 2018 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</p> <p>(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>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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</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>

ります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 15 期 自 2016 年 7 月 16 日 至 2017 年 7 月 15 日	第 16 期 自 2017 年 7 月 16 日 至 2018 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 15 期 自 2016 年 7 月 16 日 至 2017 年 7 月 15 日	第 16 期 自 2017 年 7 月 16 日 至 2018 年 7 月 15 日
期首元本額 32,557,023,000 円	期首元本額 45,658,576,000 円
期中追加設定元本額 28,931,960,000 円	期中追加設定元本額 27,998,980,000 円
期中一部交換元本額 15,830,407,000 円	期中一部交換元本額 10,793,904,600 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 15 期 自 2016 年 7 月 16 日 至 2017 年 7 月 15 日	第 16 期 自 2017 年 7 月 16 日 至 2018 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	6,540,699,649	△7,370,146,424
合計	6,540,699,649	△7,370,146,424

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(2018 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	7,000	1,228.00	8,596,000	
		じもとホールディングス	224,600	148.00	33,240,800	
		めぶきフィナンシャルグループ	1,727,300	364.00	628,737,200	
		東京きらぼしフィナンシャルグループ	44,900	2,302.00	103,359,800	
		九州フィナンシャルグループ	545,500	514.00	280,387,000	
		ゆうちょ銀行	941,800	1,270.00	1,196,086,000	
		富山第一銀行	84,500	454.00	38,363,000	
		コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,985,000	504.00	1,000,440,000	
		西日本フィナンシャルホールディングス	212,900	1,247.00	265,486,300	
		関西みらいフィナンシャルグループ	145,500	868.00	126,294,000	

三十三フィナンシャルグループ	28,000	1,928.00	53,984,000
新生銀行	271,100	1,669.00	452,465,900
あおぞら銀行	198,100	4,185.00	829,048,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	23,272,300	638.30	14,854,709,090
りそなホールディングス	3,647,900	598.80	2,184,362,520
三井住友トラスト・ホールディングス	653,600	4,424.00	2,891,526,400
三井住友フィナンシャルグループ	2,516,200	4,287.00	10,786,949,400
第四銀行	40,800	4,265.00	174,012,000
北越銀行	33,300	2,133.00	71,028,900
千葉銀行	1,177,400	724.00	852,437,600
群馬銀行	675,200	565.00	381,488,000
武蔵野銀行	53,100	3,070.00	163,017,000
千葉興業銀行	91,200	443.00	40,401,600
筑波銀行	138,200	242.00	33,444,400
七十七銀行	104,300	2,391.00	249,381,300
青森銀行	25,800	3,135.00	80,883,000
秋田銀行	21,300	2,966.00	63,175,800
山形銀行	37,300	2,285.00	85,230,500
岩手銀行	23,300	4,210.00	98,093,000
東邦銀行	297,200	401.00	119,177,200
東北銀行	17,000	1,350.00	22,950,000
みちのく銀行	21,300	1,741.00	37,083,300
ふくおかフィナンシャルグループ	1,349,000	549.00	740,601,000
静岡銀行	836,800	961.00	804,164,800
十六銀行	44,700	2,690.00	120,243,000
スルガ銀行	340,100	959.00	326,155,900
八十二銀行	601,600	450.00	270,720,000
山梨中央銀行	205,000	389.00	79,745,000
大垣共立銀行	52,500	2,739.00	143,797,500
福井銀行	28,400	2,293.00	65,121,200
北國銀行	37,700	4,285.00	161,544,500
清水銀行	13,400	2,007.00	26,893,800
富山銀行	6,400	4,030.00	25,792,000
滋賀銀行	312,000	574.00	179,088,000

南都銀行	38,900	2,696.00	104,874,400
百五銀行	319,100	427.00	136,255,700
京都銀行	127,000	4,990.00	633,730,000
紀陽銀行	125,000	1,791.00	223,875,000
ほくほくフィナンシャルグループ	221,300	1,456.00	322,212,800
広島銀行	490,700	699.00	342,999,300
山陰合同銀行	197,100	965.00	190,201,500
中国銀行	229,900	1,108.00	254,729,200
鳥取銀行	10,600	1,632.00	17,299,200
伊予銀行	474,300	708.00	335,804,400
百十四銀行	353,000	331.00	116,843,000
四国銀行	51,000	1,257.00	64,107,000
阿波銀行	267,000	667.00	178,089,000
大分銀行	19,100	3,835.00	73,248,500
宮崎銀行	22,100	3,105.00	68,620,500
佐賀銀行	20,200	2,320.00	46,864,000
十八銀行	204,000	276.00	56,304,000
沖縄銀行	32,400	3,955.00	128,142,000
琉球銀行	64,400	1,632.00	105,100,800
セブン銀行	1,246,800	338.00	421,418,400
みずほフィナンシャルグループ	45,170,700	188.90	8,532,745,230
高知銀行	12,000	1,079.00	12,948,000
山口フィナンシャルグループ	414,800	1,221.00	506,470,800
長野銀行	10,900	1,792.00	19,532,800
名古屋銀行	26,800	3,930.00	105,324,000
北洋銀行	501,100	374.00	187,411,400
愛知銀行	11,100	4,755.00	52,780,500
中京銀行	13,700	2,330.00	31,921,000
大光銀行	11,300	2,055.00	23,221,500
愛媛銀行	46,400	1,240.00	57,536,000
トマト銀行	12,800	1,413.00	18,086,400
京葉銀行	294,000	460.00	135,240,000
栃木銀行	172,000	367.00	63,124,000
北日本銀行	10,400	2,497.00	25,968,800
東和銀行	58,300	1,045.00	60,923,500

	福島銀行	31,300	621.00	19,437,300	
	大東銀行	16,000	1,119.00	17,904,000	
	トモニホールディングス	274,200	448.00	122,841,600	
	フィデアホールディングス	322,700	162.00	52,277,400	
	池田泉州ホールディングス	352,900	371.00	130,925,900	
	小計	銘柄数：84		55,147,045,040	
		組入時価比率：100.0%		100.0%	
	合計			55,147,045,040	

(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(2018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。