



2020年7月期 中間決算短信 (2019年7月16日～2020年1月15日)
Semi-annual Earnings Report for Fiscal Year ending July 2020 (July 16, 2019 - January 15, 2020)

2020年2月26日
February 26, 2020

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) 上場取引所 東証
連動対象指標 東証銀行業株価指数 売買単位 100口
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 兼代表取締役社長 中川 順子
問合せ先責任者 商品企画部長 増田 真一 TEL(03)-3241-9511
半期報告書提出予定日 2020年3月25日

Fund name: TOPIX Banks Exchange Traded Fund
Code: 1615 Listed Exchange:TSE
Underlying index: TOPIX Banks Index Trading unit: 100 units
Primary invested assets: Stocks
Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd.
URL: http://www.nomura-am.co.jp
Representative: Junko Nakagawa, President & CEO
Contact person: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.
Scheduled date of submission of semi-annual securities report: March 25, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

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

Management Status for Half-Year ended January 2020 (July 16, 2019 - January 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1月中間期 HY ended Jan. 2020	20,967	(97.8)	474	(2.2)	21,441	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Semi-annual Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2020年1月中間期 HY ended Jan. 2020	173,132	4,994	37,709	140,418

(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/当中間計算期間末(前計算期末) 発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Semi-annual Period(Previous Fiscal Period))×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2020年1月中間期 HY ended Jan. 2020	21,469	27	21,441	15,270
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	26,258	1,363	24,894	14,379

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 中間財務諸表等 Semi-annual Financial Statements

(1) 【中間貸借対照表】 Semi-annual 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 期中間計算期間末 (2020 年 1 月 15 日現在) 18th Semi-annual Period As of January 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	498,071,825
株式 Stocks	24,802,459,590	20,967,622,010
未収配当金 Accrued dividends receivable	4,168,000	3,474,900
流動資産合計 Total current assets	26,258,323,212	21,469,168,735
資産合計 Total assets	26,258,323,212	21,469,168,735
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	1,327,929,389	-
未払受託者報酬 Trustee fee payable	11,231,131	8,673,082
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	24,066,640	18,585,105
未払利息 Accrued interest expenses	12,409	298
その他未払費用 Other accrued expenses	320,827	247,741
流動負債合計 Total current liabilities	1,363,560,396	27,506,226
負債合計 Total liabilities	1,363,560,396	27,506,226
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	34,626,581,200	28,083,677,800
剰余金 Surplus		
中間剰余金又は中間欠損金 (△) Balance at end of period	△9,731,818,384	△6,642,015,291

(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	265,331	265,331
元本等合計 Total principal and other	24,894,762,816	21,441,662,509
純資産合計 Total net assets	24,894,762,816	21,441,662,509
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	26,258,323,212	21,469,168,735

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	第 17 期中間計算期間 自 2018 年 7 月 16 日 至 2019 年 1 月 15 日 17th Semi-annual Period From July 16, 2018 to January 15, 2019	第 18 期中間計算期間 自 2019 年 7 月 16 日 至 2020 年 1 月 15 日 18th Semi-annual Period From July 16, 2019 to January 15, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	857,050,950	430,942,425
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△3,491,100,458	844,714,990
その他収益 Other revenue	13,612	11,276
営業収益合計 Total operating revenue	△2,634,035,896	1,275,668,691
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	175,080	97,285
受託者報酬 Trustee fee	18,576,396	8,673,082
委託者報酬 Investment trust management fee	39,806,505	18,585,105
その他費用 Other expenses	530,749	247,806
営業費用合計 Total operating expenses	59,088,730	27,603,278
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△2,693,124,626	1,248,065,413
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△2,693,124,626	1,248,065,413
中間純利益又は中間純損失 (△) Profit (loss)	△2,693,124,626	1,248,065,413
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 (△) 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	1,250,526,700	2,055,402,390

Increase in surplus or decrease in deficit		
中間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	1,250,526,700	2,055,402,390
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	268,295,367	213,664,710
中間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	268,295,367	213,664,710
分配金 Dividends	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△) Balance at end of period	△9,413,710,973	△6,642,015,291

(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 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	当ファンドの中間計算期間は、2019年7月16日から2020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17期 2019年7月15日現在	第18期中間計算期間末 2020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 173,132,906口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 140,418,389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 6,642,015,291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. 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 152.70円 (100口当たり純資産額) (15,270円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(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17期 2019年7月15日現在	第18期中間計算期間末 2020年1月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額

<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>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>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。</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>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>
---	---

(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 期中間計算期間 自 2019 年 7 月 16 日 至 2020 年 1 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	998,900,000 円
期中一部交換元本額	33,009,970,200 円	期中一部交換元本額	7,541,803,400 円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。