

平成 28 年 2 月 22 日

各 位

委 託 会 社 名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者の役職氏名 代表取締役社長 白川 真
担当者の役職氏名 経 営 企 画 部 近藤龍一郎
(連絡先 03-5555-4946)

平成 28 年 7 月 期 中間決算短信 (平成 27 年 7 月 11 日～平成 28 年 1 月 10 日)

大和証券投資信託委託株式会社を管理会社として上場する ETF 銘柄について、以下のとおり平成 28 年 7 月 期 中間決算短信 (平成 27 年 7 月 11 日～平成 28 年 1 月 10 日) をご報告します。

記

上場ETF (5銘柄)

銘柄名	銘柄コード	上場取引所
ダイワ上場投信ートピックス	1305	東
ダイワ上場投信ートピックス・コア30	1310	東
ダイワ上場投信ー日経225	1320	東
ダイワ上場投信ー東証電気機器株価指数	1610	東
ダイワ上場投信ー東証銀行業株価指数	1612	東

*各銘柄の中間決算短信につきましては、次ページ以降をご参照ください。
なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の中間決算短信が表示されます。

以上

平成28年7月期 中間決算短信（平成27年7月11日～平成28年1月10日）

平成28年2月22日

ファンド名 ダイワ上場投信ートピックス 上場取引所 東証
 コード番号 1305
 連動対象指標 東証株価指数（TOPIX）
 主要投資資産 株式
 売買単位 10口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

半期報告書提出予定日 平成28年4月1日

I ファンドの運用状況

1. 28年1月中間期の運用状況（平成27年7月11日～平成28年1月10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	%
28年 1月中間期	1,285,708	(99.8)	2,490	(0.2)	1,288,198	(100.0)
27年 7月期	1,278,250	(99.9)	1,675	(0.1)	1,279,925	(100.0)

(2)設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 1月中間期	783,769	113,432	41,489	855,712

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月中間期	1,410,129	121,931	1,288,198	15,054
27年 7月期	1,357,768	77,843	1,279,925	16,330

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成27年7月10日現在	平成28年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	67,250,832,430	122,517,443,195
株式 ※2※3	1,278,250,047,993	1,285,708,142,385
未収入金	10,541,275,861	—
未収配当金	1,185,541,120	1,599,838,510
未収利息	—	463,148
前払金	502,430,000	201,872,000
その他未収収益 ※4	38,567,121	101,998,166
流動資産合計	1,357,768,694,525	1,410,129,757,404
資産合計	1,357,768,694,525	1,410,129,757,404
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	74,381,034	213,532,006
未払金	423,837,367	—
未払収益分配金	18,967,233,370	—
未払受託者報酬	235,333,371	280,089,548
未払委託者報酬	483,955,565	568,309,215
未払利息	456,957	915,892
受入担保金	57,397,637,955	120,721,449,722
その他未払費用	260,754,556	147,084,887
流動負債合計	77,843,590,175	121,931,381,270
負債合計	77,843,590,175	121,931,381,270
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	979,712,467,500	1,069,640,570,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	300,212,636,850	218,557,806,134
(分配準備積立金)	1,240,865,748	1,240,865,748
元本等合計	1,279,925,104,350	1,288,198,376,134
純資産合計	1,279,925,104,350	1,288,198,376,134
負債純資産合計	1,357,768,694,525	1,410,129,757,404

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	9,074,876,333	11,570,048,669
受取利息	17,402,463	27,175,503
有価証券売買等損益	99,414,366,583	△122,689,290,347
派生商品取引等損益	762,994,150	618,407,823
その他収益 ※1	366,087,897	476,005,587
営業収益合計	109,635,727,426	△109,997,652,765
営業費用		
支払利息	8,462,732	12,209,419
受託者報酬	216,759,790	280,089,548
委託者報酬	442,863,123	568,309,215
その他費用	126,987,539	140,986,712
営業費用合計	795,073,184	1,001,594,894
営業利益又は営業損失 (△)	108,840,654,242	△110,999,247,659
経常利益又は経常損失 (△)	108,840,654,242	△110,999,247,659
中間純利益又は中間純損失 (△)	108,840,654,242	△110,999,247,659
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	39,194,221,021	300,212,636,850
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,797,165,197	40,980,464,193
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	8,797,165,197	40,980,464,193
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,017,326,200	11,636,047,250
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	34,017,326,200	11,636,047,250
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	122,814,714,260	218,557,806,134

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成 27 年 7 月 11 日	至 平成 28 年 1 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式	移動平均法に基づき、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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引	個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金	原則として、株式の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。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成 27 年 7 月 10 日現在	平成 28 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	1,084,536,970,000 円	979,712,467,500 円
期中追加設定元本額	323,465,137,500 円	141,790,000,000 円
期中一部交換元本額	428,289,640,000 円	51,861,897,500 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	783,769,974 口	855,712,456 口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 54,263,050,450 円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 111,650,719,910 円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 890,730,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 858,480,000 円

5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 35,033,508 円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 96,320,516 円が含まれております。
---------------	---	---

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	前中間計算期間 自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日	当中間計算期間 自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日
※1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額 298,560,524 円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額 309,591,036 円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成28年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 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>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	前計算期間末 平成27年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成28年1月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,711,448,000	—	1,637,185,000	△74,263,000	2,760,032,000	—	2,546,720,000	△213,312,000
合計	1,711,448,000	—	1,637,185,000	△74,263,000	2,760,032,000	—	2,546,720,000	△213,312,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 平成27年7月10日現在	当中間計算期間末 平成28年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,633.0円	1,505.4円
(10口当たり純資産額)	(16,330円)	(15,054円)

平成28年7月期 中間決算短信（平成27年7月11日～平成28年1月10日）

平成28年2月22日

ファンド名 ダイワ上場投信ートピックス・コア30 上場取引所 東証
 コード番号 1310
 連動対象指標 TOPIX Core30
 主要投資資産 株式
 売買単位 10口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

半期報告書提出予定日 平成28年4月1日

I ファンドの運用状況

1. 28年1月中間期の運用状況（平成27年7月11日～平成28年1月10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	%
28年 1月中間期	1,814	(99.7)	6	(0.3)	1,820	(100.0)
27年 7月期	2,030	(99.6)	7	(0.4)	2,037	(100.0)

(2)設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 1月中間期	2,602	-	-	2,602

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月中間期	1,823	2	1,820	6,995.2
27年 7月期	2,079	41	2,037	7,829.5

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

II 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成27年7月10日現在	平成28年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	26,286,385	6,227,869
株式 ※3	2,030,088,680	1,814,213,000
未収入金	19,574,950	—
未収配当金	2,474,600	2,572,100
未収利息	—	22
前払金	1,141,500	400,200
差入委託証拠金	73,500	—
流動資産合計	2,079,639,615	1,823,413,191
資産合計	2,079,639,615	1,823,413,191
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	307,744	452,645
未払金	663,898	—
未払収益分配金	38,518,243	—
未払受託者報酬	1,091,381	1,070,818
未払委託者報酬	1,309,671	1,284,997
その他未払費用	54,490	53,450
流動負債合計	41,945,427	2,861,910
負債合計	41,945,427	2,861,910
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,102,887,872	2,102,887,872
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△65,193,684	△282,336,591
(分配準備積立金)	2,579,982	2,579,982
元本等合計	2,037,694,188	1,820,551,281
純資産合計	2,037,694,188	1,820,551,281
負債純資産合計	2,079,639,615	1,823,413,191

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	20,253,601	22,207,186
受取利息	2,925	3,470
有価証券売買等損益	131,006,200	△238,034,068
派生商品取引等損益	1,372,918	1,089,773
その他収益	3	2
営業収益合計	152,635,647	△214,733,637
営業費用		
受託者報酬	940,095	1,070,818
委託者報酬	1,128,116	1,284,997
その他費用	46,915	53,455
営業費用合計	2,115,126	2,409,270
営業利益又は営業損失(△)	150,520,521	△217,142,907
経常利益又は経常損失(△)	150,520,521	△217,142,907
中間純利益又は中間純損失(△)	150,520,521	△217,142,907
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△462,052,585	△65,193,684
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△311,532,064	△282,336,591

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成27年7月11日	至 平成28年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成27年7月10日現在	平成28年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	2,102,887,872円	2,102,887,872円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	2,602,584口	2,602,584口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は65,193,684円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は282,336,591円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 7,925,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 20,592,000円

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日
	該当事項はありません。	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

区 分	当中間計算期間末 平成28年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 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。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	前計算期間末 平成27年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成28年1月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	7,509,000	—	7,204,500	△304,500	6,817,200	—	6,367,500	△449,700
合計	7,509,000	—	7,204,500	△304,500	6,817,200	—	6,367,500	△449,700

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 平成27年7月10日現在	当中間計算期間末 平成28年1月10日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	782.95円 (78,295円)	699.52円 (69,952円)

平成28年7月期 中間決算短信（平成27年7月11日～平成28年1月10日）

平成28年2月22日

ファンド名 ダイワ上場投信－日経225 上場取引所 東証
 コード番号 1320
 連動対象指標 日経平均株価
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

半期報告書提出予定日 平成28年4月1日

I ファンドの運用状況

1. 28年1月中間期の運用状況（平成27年7月11日～平成28年1月10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	%
28年 1月中間期	1,394,073	(99.8)	3,078	(0.2)	1,397,151	(100.0)
27年 7月期	1,351,330	(99.7)	4,580	(0.3)	1,355,910	(100.0)

(2)設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 1月中間期	67,345	27,281	17,680	76,946

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月中間期	1,398,845	1,694	1,397,151	18,158
27年 7月期	1,374,147	18,236	1,355,910	20,134

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成27年7月10日現在	平成28年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,264,356,216	2,464,374,659
株式 ※2	1,351,330,178,940	1,394,073,121,500
未収入金	9,069,337,546	—
未収配当金	1,265,106,000	2,063,418,000
未収利息	—	9,316
前払金	218,420,000	244,965,000
流動資産合計	1,374,147,398,702	1,398,845,888,475
資産合計	1,374,147,398,702	1,398,845,888,475
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	92,827,248	240,103,705
未払金	160,019,794	13,288,313
未払収益分配金	16,566,892,140	—
未払受託者報酬	485,994,919	545,141,806
未払委託者報酬	624,850,653	700,896,640
その他未払費用	305,828,117	194,750,434
流動負債合計	18,236,412,871	1,694,180,898
負債合計	18,236,412,871	1,694,180,898
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	828,816,022,630	946,976,181,901
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	527,094,963,201	450,175,525,676
(分配準備積立金)	1,290,956,009	1,290,956,009
元本等合計	1,355,910,985,831	1,397,151,707,577
純資産合計	1,355,910,985,831	1,397,151,707,577
負債純資産合計	1,374,147,398,702	1,398,845,888,475

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	7,791,521,800	11,974,874,180
受取利息	1,130,271	1,812,486
有価証券売買等損益	111,034,728,859	△153,833,989,741
派生商品取引等損益	799,793,604	597,279,180
その他収益	710,758	189,509,296
営業収益合計	119,627,885,292	△141,070,514,599
営業費用		
受託者報酬	369,067,213	545,141,806
委託者報酬	474,515,015	700,896,640
その他費用	135,669,648	196,684,704
営業費用合計	979,251,876	1,442,723,150
営業利益又は営業損失 (△)	118,648,633,416	△142,513,237,749
経常利益又は経常損失 (△)	118,648,633,416	△142,513,237,749
中間純利益又は中間純損失 (△)	118,648,633,416	△142,513,237,749
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	169,595,374,955	527,094,963,201
剰余金増加額又は欠損金減少額	160,763,066,326	195,245,600,202
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	160,763,066,326	195,245,600,202
剰余金減少額又は欠損金増加額	92,208,408,634	129,651,799,978
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	92,208,408,634	129,651,799,978
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	356,798,666,063	450,175,525,676

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成 27 年 7 月 11 日	至 平成 28 年 1 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成 27 年 7 月 10 日現在	平成 28 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	663,886,641,968 円	828,816,022,630 円
期中追加設定元本額	657,535,725,381 円	335,753,777,403 円
期中一部交換元本額	492,606,344,719 円	217,593,618,132 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	67,345,090 口	76,946,143 口
3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 3,888,750,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 2,863,250,000 円

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日
	該当事項はありません。	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

区 分	当中間計算期間末 平成28年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 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。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	前計算期間末 平成27年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成28年1月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	4,521,200,000	—	4,428,780,000	△92,420,000	3,388,445,000	—	3,148,820,000	△239,625,000
合計	4,521,200,000	—	4,428,780,000	△92,420,000	3,388,445,000	—	3,148,820,000	△239,625,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 平成27年7月10日現在	当中間計算期間末 平成28年1月10日現在
1口当たり純資産額	20,134円	18,158円

平成28年7月期 中間決算短信（平成27年7月11日～平成28年1月10日）

平成28年2月22日

ファンド名 ダイワ上場投信－東証電気機器株価指数 上場取引所 東証
 コード番号 1610
 連動対象指標 東証電気機器株価指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 10口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

半期報告書提出予定日 平成28年4月1日

I ファンドの運用状況

1. 28年1月中間期の運用状況（平成27年7月11日～平成28年1月10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	%
28年 1月中間期	1,797	(99.4)	10	(0.6)	1,808	(100.0)
27年 7月期	2,139	(100.0)	0	(0.0)	2,139	(100.0)

(2)設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 1月中間期	1,023	-	-	1,023

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月中間期	1,811	3	1,808	17,662.0
27年 7月期	2,169	29	2,139	20,901.4

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成27年7月10日現在	平成28年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,729,814	9,613,888
株式	2,139,174,100	1,797,370,500
未収入金	8,191,750	—
未収配当金	3,570,800	3,220,400
未収利息	—	36
前払金	—	538,750
差入委託証拠金	—	346,500
流動資産合計	2,169,666,464	1,811,090,074
資産合計	2,169,666,464	1,811,090,074
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	588,876
未払収益分配金	27,332,790	—
未払受託者報酬	1,179,669	1,083,876
未払委託者報酬	1,415,625	1,300,648
その他未払費用	58,900	54,099
流動負債合計	29,986,984	3,027,499
負債合計	29,986,984	3,027,499
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,958,338,100	1,958,338,100
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	181,341,380	△150,275,525
(分配準備積立金)	3,631,057	3,631,057
元本等合計	2,139,679,480	1,808,062,575
純資産合計	2,139,679,480	1,808,062,575
負債純資産合計	2,169,666,464	1,811,090,074

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	13,630,127	15,578,722
受取利息	1,994	2,147
有価証券売買等損益	253,507,950	△344,170,306
派生商品取引等損益	—	△588,876
その他収益	27	35
営業収益合計	267,140,098	△329,178,278
営業費用		
受託者報酬	1,004,762	1,083,876
委託者報酬	1,205,709	1,300,648
その他費用	50,148	54,103
営業費用合計	2,260,619	2,438,627
営業利益又は営業損失(△)	264,879,479	△331,616,905
経常利益又は経常損失(△)	264,879,479	△331,616,905
中間純利益又は中間純損失(△)	264,879,479	△331,616,905
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△262,858,515	181,341,380
中間剰余金又は中間欠損金(△)	2,020,964	△150,275,525

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成27年7月11日	至 平成28年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金	<p>原則として、株式の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。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成27年7月10日現在	平成28年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	1,958,338,100 円	1,958,338,100 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	1,023,700 口	1,023,700 口
3. ※2 元本の欠損	――	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は150,275,525円であります。

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日
	該当事項はありません。	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

区 分	当中間計算期間末 平成28年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 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。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	前計算期間末 平成27年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成28年1月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	—	—	—	—	10,713,250	—	10,129,000	△584,250
合計	—	—	—	—	10,713,250	—	10,129,000	△584,250

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 平成27年7月10日現在	当中間計算期間末 平成28年1月10日現在
1口当たり純資産額	2,090.14円	1,766.20円
(100口当たり純資産額)	(209,014円)	(176,620円)

平成28年7月期 中間決算短信（平成27年7月11日～平成28年1月10日）

平成28年2月22日

ファンド名 ダイワ上場投信－東証銀行業株価指数 上場取引所 東証
 コード番号 1612
 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 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

半期報告書提出予定日 平成28年4月1日

I ファンドの運用状況

1. 28年1月中間期の運用状況（平成27年7月11日～平成28年1月10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	%
28年 1月中間期	854	(98.8)	10	(1.2)	864	(100.0)
27年 7月期	1,006	(99.9)	1	(0.1)	1,007	(100.0)

(2)設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 1月中間期	4,674	-	-	4,674

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	100口当たり基準価額 (③/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)×100)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月中間期	866	1	864	18,499
27年 7月期	1,028	21	1,007	21,560

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

II 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成27年7月10日現在	平成28年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,851,886	11,614,134
株式 ※3	1,006,745,000	854,214,090
未収入金	9,149,500	—
未収配当金	120,000	140,000
未収利息	—	42
前払金	—	450,000
流動資産合計	1,028,866,386	866,418,266
資産合計	1,028,866,386	866,418,266
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	554,425
未払収益分配金	19,912,739	—
未払受託者報酬	514,716	521,881
未払委託者報酬	617,668	626,253
その他未払費用	25,656	25,997
流動負債合計	21,070,779	1,728,556
負債合計	21,070,779	1,728,556
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	958,242,160	958,242,160
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	49,553,447	△93,552,450
(分配準備積立金)	158,026	158,026
元本等合計	1,007,795,607	864,689,710
純資産合計	1,007,795,607	864,689,710
負債純資産合計	1,028,866,386	866,418,266

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	9,651,075	11,103,450
受取利息	1,245	1,707
有価証券売買等損益	25,484,436	△152,482,480
派生商品取引等損益	—	△554,425
その他収益	4	2
営業収益合計	35,136,760	△141,931,746
営業費用		
受託者報酬	434,584	521,881
委託者報酬	521,504	626,253
その他費用	21,655	26,017
営業費用合計	977,743	1,174,151
営業利益又は営業損失(△)	34,159,017	△143,105,897
経常利益又は経常損失(△)	34,159,017	△143,105,897
中間純利益又は中間純損失(△)	34,159,017	△143,105,897
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△186,854,902	49,553,447
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△152,695,885	△93,552,450

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成27年7月11日	至 平成28年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式	移動平均法に基づき、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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引	個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金	原則として、株式の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。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成27年7月10日現在	平成28年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	958,242,160 円	958,242,160 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,674,352 口	4,674,352 口
3. ※2 元本の欠損	――	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は93,552,450円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	――	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 5,693,000 円

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日
	該当事項はありません。	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

区 分	当中間計算期間末 平成28年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 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。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	前計算期間末 平成27年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成28年1月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	—	—	—	—	10,245,000	—	9,695,000	△550,000
合計	—	—	—	—	10,245,000	—	9,695,000	△550,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 平成27年7月10日現在	当中間計算期間末 平成28年1月10日現在
1口当たり純資産額	215.60円	184.99円
(100口当たり純資産額)	(21,560円)	(18,499円)