

平成 28 年 2 月 29 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 1 月期 (平成 27 年 7 月 21 日～平成 28 年 1 月 20 日) 決算短信

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 1 月期 (平成 27 年 7 月 21 日～平成 28 年 1 月 20 日) 決算短信をご報告します。

## 上場ETF銘柄 (17銘柄)

銘柄名	銘柄コード	上場取引所
ダイワ上場投信・TOPIX-17 食品	1634	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 エネルギー資源	1635	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 建設・資材	1636	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 素材・化学	1637	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 医薬品	1638	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 自動車・輸送機	1639	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 鉄鋼・非鉄	1640	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 機械	1641	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 電機・精密	1642	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 情報通信・サービスその他	1643	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 電力・ガス	1644	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 運輸・物流	1645	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 商社・卸売	1646	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 小売	1647	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 銀行	1648	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 金融 (除く銀行)	1649	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 不動産	1650	東

\*各銘柄の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、各銘柄の決算短信が表示されます。

以上

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 食品 上場取引所 東証  
 コード番号 1634  
 連動対象指標 TOPIX-17 食品  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	547	(99.5)	2	(0.5)	549	(100.0)
27年 7月期	616	(99.5)	3	(0.5)	619	(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月期	19	—	—	19
27年 7月期	19	—	—	19

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	554	4	549	28,257
27年 7月期	624	5	619	31,836

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	176
27年 7月期	222

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,064,855	94,355
株式	616,507,800	547,153,600
未収入金	—	3,046,972
未収配当金	3,063,950	3,774,550
未収利息	24	—
流動資産合計	624,636,629	554,069,477
資産合計	624,636,629	554,069,477
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,320,786	3,425,488
未払受託者報酬	151,479	161,512
未払委託者報酬	393,922	420,023
その他未払費用	143,079	89,455
流動負債合計	5,009,266	4,096,478
負債合計	5,009,266	4,096,478
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	329,119,330	329,119,330
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	290,508,033	220,853,669
(分配準備積立金)	3,080,481	3,786,984
元本等合計	619,627,363	549,972,999
純資産合計	619,627,363	549,972,999
負債純資産合計	624,636,629	554,069,477

(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日 金額(円)	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	4,894,250	4,803,300
受取利息	767	355
有価証券売買等損益	119,543,056	△70,360,867
その他収益	38	171
営業収益合計	124,438,111	△65,557,041
営業費用		
受託者報酬	151,479	161,512
委託者報酬	393,922	420,023
その他費用	84,666	90,300
営業費用合計	630,067	671,835
営業利益又は営業損失(△)	123,808,044	△66,228,876
経常利益又は経常損失(△)	123,808,044	△66,228,876
当期純利益又は当期純損失(△)	123,808,044	△66,228,876
期首剰余金又は期首欠損金(△)	171,020,775	290,508,033
分配金 ※1	4,320,786	3,425,488
期末剰余金又は期末欠損金(△)	290,508,033	220,853,669

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第15期	
	自 平成27年7月21日	至 平成28年1月20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. 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
1. ※1 期首元本額	329,119,330 円	329,119,330 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	19,463 口	19,463 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（4,895,055 円）及び分配準備積立金（3,136,279 円）の合計額から、経費（630,067 円）を控除して計算される分配対象額は 7,401,267 円（1 口当たり 380 円）であり、うち 4,320,786 円（1 口当たり 222 円）を分配金	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（4,803,826 円）及び分配準備積立金（3,080,481 円）の合計額から、経費（671,835 円）を控除して計算される分配対象額は 7,212,472 円（1 口当たり 370 円）であり、うち 3,425,488 円（1 口当たり 176 円）を分配金

	額としております。	額としております。
--	-----------	-----------

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期	
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。	

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期	
	平成28年1月20日現在	
1. 金融商品の時価及び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、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) 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。	

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	119,097,170	△69,874,234
合計	119,097,170	△69,874,234

（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

第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第 15 期 自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1 口当たり情報）

	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	31,836 円	28,257 円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 エネルギー資源 上場取引所 東証  
 コード番号 1635  
 連動対象指標 TOPIX-17 エネルギー資源  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	186	(99.8)	0	(0.2)	186	(100.0)
27年 7月期	254	(99.7)	0	(0.3)	255	(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月期	19	—	—	19
27年 7月期	19	—	—	19

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	189	2	186	9,737
27年 7月期	258	2	255	13,302

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	125
27年 7月期	133

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,330,377	1,892,953
株式	254,661,560	186,607,150
未収入金	570,384	419,781
未収配当金	626,000	628,900
未収利息	9	—
流動資産合計	258,188,330	189,548,784
資産合計	258,188,330	189,548,784
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,552,802	2,399,250
未払受託者報酬	68,624	62,971
未払委託者報酬	178,493	163,794
その他未払費用	68,710	34,764
流動負債合計	2,868,629	2,660,779
負債合計	2,868,629	2,660,779
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	340,904,634	340,904,634
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△85,584,933	△154,016,629
(分配準備積立金)	632,515	635,892
元本等合計	255,319,701	186,888,005
純資産合計	255,319,701	186,888,005
負債純資産合計	258,188,330	189,548,784

(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日 金額(円)	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,829,850	2,664,200
受取利息	180	301
有価証券売買等損益	24,869,475	△68,435,073
その他収益	10	—
営業収益合計	27,699,515	△65,770,572
営業費用		
受託者報酬	68,624	62,971
委託者報酬	178,493	163,794
その他費用	38,287	35,109
営業費用合計	285,404	261,874
営業利益又は営業損失(△)	27,414,111	△66,032,446
経常利益又は経常損失(△)	27,414,111	△66,032,446
当期純利益又は当期純損失(△)	27,414,111	△66,032,446
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△110,446,242	△85,584,933
分配金 ※1	2,552,802	2,399,250
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△85,584,933	△154,016,629

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第15期	
	自 平成27年7月21日	至 平成28年1月20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. 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
1. ※1 期首元本額	340,904,634 円	340,904,634 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	19,194 口	19,194 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85,584,933円であります。	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154,016,629円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (2,830,040円)及び分配準備積立金(640,681円)の合計額から、経費(285,404円)を控除し	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (2,664,501円)及び分配準備積立金(632,515円)の合計額から、経費(261,874円)を控除し

	て計算される分配対象額は 3,185,317円（1口当たり165円）であり、うち2,552,802円（1口当たり133円）を分配金額としております。	て計算される分配対象額は 3,035,142円（1口当たり158円）であり、うち2,399,250円（1口当たり125円）を分配金額としております。
--	---	---

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期
	平成28年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 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、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) 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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	24,717,091	△67,871,723
合計	24,717,091	△67,871,723

（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

第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
1口当たり純資産額	13,302円	9,737円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 建設・資材 上場取引所 東証  
 コード番号 1636  
 連動対象指標 TOPIX-17 建設・資材  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	1,072	(99.6)	4	(0.4)	1,077	(100.0)
27年 7月期	1,226	(99.9)	1	(0.1)	1,228	(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月期	53	—	—	53
27年 7月期	53	—	—	53

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	1,087	9	1,077	20,304
27年 7月期	1,239	11	1,228	23,141

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	149
27年 7月期	192

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,331,667	12,684,143
株式	1,226,321,650	1,072,867,850
未収配当金	1,045,900	1,217,100
未収利息	60	—
前払金	—	308,000
差入委託証拠金	—	129,000
流動資産合計	1,239,699,277	1,087,206,093
資産合計	1,239,699,277	1,087,206,093
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	420,333
未払収益分配金	10,189,248	7,907,281
未払受託者報酬	312,490	331,026
未払委託者報酬	812,530	860,795
その他未払費用	303,484	183,569
流動負債合計	11,617,752	9,703,004
負債合計	11,617,752	9,703,004
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	746,362,416	746,362,416
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	481,719,109	331,140,673
(分配準備積立金)	1,076,902	1,254,925
元本等合計	1,228,081,525	1,077,503,089
純資産合計	1,228,081,525	1,077,503,089
負債純資産合計	1,239,699,277	1,087,206,093

(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日 金額(円)	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	11,578,100	9,459,600
受取利息	1,128	2,616
有価証券売買等損益	166,367,597	△150,336,126
派生商品取引等損益	—	△420,333
その他収益	28	152
営業収益合計	177,946,853	△141,294,091
営業費用		
受託者報酬	312,490	331,026
委託者報酬	812,530	860,795
その他費用	174,843	185,243
営業費用合計	1,299,863	1,377,064
営業利益又は営業損失(△)	176,646,990	△142,671,155
経常利益又は経常損失(△)	176,646,990	△142,671,155
当期純利益又は当期純損失(△)	176,646,990	△142,671,155
期首剰余金又は期首欠損金(△)	315,261,367	481,719,109
分配金 ※1	10,189,248	7,907,281
期末剰余金又は期末欠損金(△)	481,719,109	331,140,673



(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日	至 平成 28 年 1 月 20 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	746,362,416 円	746,362,416 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	53,069 口	53,069 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (11,579,256 円) 及び分配準備	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (9,462,368 円) 及び分配準備

	積立金(986,757円)の合計額から、経費(1,299,863円)を控除して計算される分配対象額は11,266,150円(1口当たり212円)であり、うち10,189,248円(1口当たり192円)を分配金額としております。	積立金(1,076,902円)の合計額から、経費(1,377,064円)を控除して計算される分配対象額は9,162,206円(1口当たり172円)であり、うち7,907,281円(1口当たり149円)を分配金額としております。
--	---	---

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 平成28年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び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、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。
--	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	165,557,883	△149,143,067
合計	165,557,883	△149,143,067

(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	第14期 平成27年7月20日 現在				第15期 平成28年1月20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	—	—	—	—	3,088,000	—	2,669,000	△419,000
合計	—	—	—	—	3,088,000	—	2,669,000	△419,000

(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、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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1 口当たり情報）

	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	23,141 円	20,304 円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 素材・化学 上場取引所 東証  
 コード番号 1637  
 連動対象指標 TOPIX-17 素材・化学  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	661	(100.0)	0	(0.0)	661	(100.0)
27年 7月期	782	(100.0)	△0	(△0.0)	782	(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月期	37	—	—	37
27年 7月期	37	—	—	37

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	667	6	661	17,822
27年 7月期	788	6	782	21,083

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	128
27年 7月期	139

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,925,965	4,289,607
株式	782,567,470	661,265,600
未収配当金	973,560	1,342,940
未収利息	24	—
前払金	—	413,750
差入委託証拠金	—	193,500
流動資産合計	788,467,019	667,505,397
資産合計	788,467,019	667,505,397
負債の部		
流動負債		
未払金	—	571,963
未払収益分配金	5,158,151	4,749,952
未払受託者報酬	203,108	202,822
未払委託者報酬	528,172	527,446
その他未払費用	190,024	112,353
流動負債合計	6,079,455	6,164,536
負債合計	6,079,455	6,164,536
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	495,739,131	495,739,131
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	286,648,433	165,601,730
(分配準備積立金)	975,224	1,367,476
元本等合計	782,387,564	661,340,861
純資産合計	782,387,564	661,340,861
負債純資産合計	788,467,019	667,505,397

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	5,874,460	5,985,190
受取利息	399	662
有価証券売買等損益	100,590,120	△120,866,992
派生商品取引等損益	—	△571,963
その他収益	14	41
営業収益合計	106,464,993	△115,453,062
営業費用		
受託者報酬	203,108	202,822
委託者報酬	528,172	527,446
その他費用	113,585	113,421
営業費用合計	844,865	843,689
営業利益又は営業損失 (△)	105,620,128	△116,296,751
経常利益又は経常損失 (△)	105,620,128	△116,296,751
当期純利益又は当期純損失 (△)	105,620,128	△116,296,751
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	186,186,456	286,648,433
分配金 ※1	5,158,151	4,749,952
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	286,648,433	165,601,730

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日	至 平成 28 年 1 月 20 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	495,739,131 円	495,739,131 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	37,109 口	37,109 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (5,874,873 円) 及び分配準備	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (5,985,893 円) 及び分配準備



	積立金(1,103,367円)の合計額から、経費(844,865円)を控除して計算される分配対象額は6,133,375円(1口当たり165円)であり、うち5,158,151円(1口当たり139円)を分配金額としております。	積立金(975,224円)の合計額から、経費(843,689円)を控除して計算される分配対象額は6,117,428円(1口当たり164円)であり、うち4,749,952円(1口当たり128円)を分配金額としております。
--	---	---

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 平成28年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び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、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) 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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	100,509,388	△120,611,278
合計	100,509,388	△120,611,278

（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

第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
1口当たり純資産額	21,083円	17,822円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 医薬品 上場取引所 東証  
 コード番号 1638  
 連動対象指標 TOPIX-17 医薬品  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	545	(99.3)	3	(0.7)	549	(100.0)
27年 7月期	619	(99.6)	2	(0.4)	622	(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月期	28	—	—	28
27年 7月期	28	—	—	28

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	555	6	549	19,456
27年 7月期	628	5	622	22,036

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	187
27年 7月期	184

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,836,426	9,095,858
株式	619,557,000	545,442,300
未収配当金	755,400	795,400
未収利息	36	—
前払金	—	412,750
差入委託証拠金	—	193,500
流動資産合計	628,148,862	555,939,808
資産合計	628,148,862	555,939,808
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	387,318
未払金	—	196,985
未払収益分配金	5,195,792	5,280,506
未払受託者報酬	153,720	162,928
未払委託者報酬	399,751	423,688
その他未払費用	143,041	90,234
流動負債合計	5,892,304	6,541,659
負債合計	5,892,304	6,541,659
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	371,160,272	371,160,272
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	251,096,286	178,237,877
(分配準備積立金)	772,052	812,040
元本等合計	622,256,558	549,398,149
純資産合計	622,256,558	549,398,149
負債純資産合計	628,148,862	555,939,808

(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自平成27年1月21日 至平成27年7月20日 金額(円)	自平成27年7月21日 至平成28年1月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,965,990	5,996,310
受取利息	991	1,886
有価証券売買等損益	115,582,484	△72,314,094
派生商品取引等損益	—	△584,303
営業収益合計	121,549,465	△66,900,201
営業費用		
受託者報酬	153,720	162,928
委託者報酬	399,751	423,688
その他費用	85,921	91,086
営業費用合計	639,392	677,702
営業利益又は営業損失(△)	120,910,073	△67,577,903
経常利益又は経常損失(△)	120,910,073	△67,577,903
当期純利益又は当期純損失(△)	120,910,073	△67,577,903
期首剰余金又は期首欠損金(△)	135,382,005	251,096,286
分配金 ※1	5,195,792	5,280,506
期末剰余金又は期末欠損金(△)	251,096,286	178,237,877

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日	至 平成 28 年 1 月 20 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	371, 160, 272 円	371, 160, 272 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	28, 238 口	28, 238 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (5, 966, 981 円) 及び分配準備	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (5, 998, 196 円) 及び分配準備

	積立金(640,255円)の合計額から、経費(639,392円)を控除して計算される分配対象額は5,967,844円(1口当たり211円)であり、うち5,195,792円(1口当たり184円)を分配金額としております。	積立金(772,052円)の合計額から、経費(677,702円)を控除して計算される分配対象額は6,092,546円(1口当たり215円)であり、うち5,280,506円(1口当たり187円)を分配金額としております。
--	---	---

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 平成28年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び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、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。
--	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	115,623,816	△70,958,530
合計	115,623,816	△70,958,530

(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	第14期 平成27年7月20日 現在				第15期 平成28年1月20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	—	—	—	—	3,055,000	—	2,669,000	△386,000
合計	—	—	—	—	3,055,000	—	2,669,000	△386,000

(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、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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。



(1 口当たり情報)

	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	22,036 円	19,456 円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 自動車・輸送機 上場取引所 東証  
 コード番号 1639  
 連動対象指標 TOPIX-17 自動車・輸送機  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	690	(99.7)	2	(0.3)	692	(100.0)
27年 7月期	844	(99.7)	2	(0.3)	847	(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月期	33	—	—	33
27年 7月期	33	—	—	33

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	702	9	692	20,798
27年 7月期	857	10	847	25,456

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	257
27年 7月期	275

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,457,656	2,021,931
株式	844,798,200	690,152,300
未収入金	1,801,680	7,910,200
未収配当金	1,443,650	1,587,400
未収利息	45	—
前払金	—	286,000
差入委託証拠金	—	132,000
流動資産合計	857,501,231	702,089,831
資産合計	857,501,231	702,089,831
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	282,465
未払金	—	106,106
未払収益分配金	9,153,375	8,554,245
未払受託者報酬	226,671	216,213
未払委託者報酬	589,457	562,249
その他未払費用	215,215	119,773
流動負債合計	10,184,718	9,841,051
負債合計	10,184,718	9,841,051
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	494,781,525	494,781,525
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	352,534,988	197,467,255
(分配準備積立金)	1,472,679	1,599,836
元本等合計	847,316,513	692,248,780
純資産合計	847,316,513	692,248,780
負債純資産合計	857,501,231	702,089,831

(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日 金額(円)	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	10,287,650	9,579,950
受取利息	944	830
有価証券売買等損益	63,111,798	△154,806,319
派生商品取引等損益	—	△388,571
その他収益	—	11
営業収益合計	73,400,392	△145,614,099
営業費用		
受託者報酬	226,671	216,213
委託者報酬	589,457	562,249
その他費用	126,788	120,927
営業費用合計	942,916	899,389
営業利益又は営業損失(△)	72,457,476	△146,513,488
経常利益又は経常損失(△)	72,457,476	△146,513,488
当期純利益又は当期純損失(△)	72,457,476	△146,513,488
期首剰余金又は期首欠損金(△)	289,230,887	352,534,988
分配金 ※1	9,153,375	8,554,245
期末剰余金又は期末欠損金(△)	352,534,988	197,467,255

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第15期	
	自 平成27年7月21日	至 平成28年1月20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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
1. ※1 期首元本額	494,781,525 円	494,781,525 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	33,285 口	33,285 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (10,288,594 円) 及び分配準備	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (9,580,791 円) 及び分配準備

	積立金(1,280,376円)の合計額から、経費(942,916円)を控除して計算される分配対象額は10,626,054円（1口当たり319円）であり、うち9,153,375円（1口当たり275円）を分配金額としております。	積立金(1,472,679円)の合計額から、経費(899,389円)を控除して計算される分配対象額は10,154,081円（1口当たり305円）であり、うち8,554,245円（1口当たり257円）を分配金額としております。
--	--	--

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期
	平成28年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び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、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。
--	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	62,837,140	△150,406,966
合計	62,837,140	△150,406,966

(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	第14期 平成27年7月20日 現在				第15期 平成28年1月20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	-	-	-	-	2,239,000	-	1,957,500	△281,500
合計	-	-	-	-	2,239,000	-	1,957,500	△281,500

(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、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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	25,456 円	20,798 円



# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 鉄鋼・非鉄 上場取引所 東証  
 コード番号 1640  
 連動対象指標 TOPIX-17 鉄鋼・非鉄  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	191	(100.1)	△0	(△0.1)	191	(100.0)
27年 7月期	263	(100.0)	0	(0.0)	263	(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月期	10	—	—	10
27年 7月期	10	—	—	10

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	194	2	191	17,748
27年 7月期	267	3	263	24,423

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	186
27年 7月期	268

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,053,960	477,874
株式	263,828,400	191,955,900
未収入金	515,443	1,584,986
未収配当金	1,800	16,200
未収利息	15	—
流動資産合計	267,399,618	194,034,960
資産合計	267,399,618	194,034,960
負債の部		
流動負債		
未払金	279,901	—
未払収益分配金	2,895,740	2,009,730
未払受託者報酬	72,708	62,242
未払委託者報酬	189,115	161,904
その他未払費用	70,587	34,341
流動負債合計	3,508,051	2,268,217
負債合計	3,508,051	2,268,217
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	369,995,615	369,995,615
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	△106,104,048	△178,228,872
(分配準備積立金)	7,807	23,947
元本等合計	263,891,567	191,766,743
純資産合計	263,891,567	191,766,743
負債純資産合計	267,399,618	194,034,960

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,179,050	2,284,550
受取利息	188	156
有価証券売買等損益	17,835,111	△72,140,964
その他収益	4	8
営業収益合計	21,014,353	△69,856,250
営業費用		
受託者報酬	72,708	62,242
委託者報酬	189,115	161,904
その他費用	40,556	34,698
営業費用合計	302,379	258,844
営業利益又は営業損失 (△)	20,711,974	△70,115,094
経常利益又は経常損失 (△)	20,711,974	△70,115,094
当期純利益又は当期純損失 (△)	20,711,974	△70,115,094
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△123,920,282	△106,104,048
分配金 ※1	2,895,740	2,009,730
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△106,104,048	△178,228,872

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日	至 平成 28 年 1 月 20 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. 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	369,995,615 円	369,995,615 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	10,805 口	10,805 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 106,104,048 円であります。	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 178,228,872 円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (3,179,242 円) 及び分配準備積立金(26,684 円)の合計額から、経費(302,379 円)を控除し	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (2,284,714 円) 及び分配準備積立金(7,807 円)の合計額から、経費(258,844 円)を控除し

	て計算される分配対象額は 2,903,547円（1口当たり268円）であり、うち2,895,740円（1口当たり268円）を分配金額としております。	て計算される分配対象額は 2,033,677円（1口当たり188円）であり、うち2,009,730円（1口当たり186円）を分配金額としております。
--	---	---

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	
	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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。	

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 平成28年1月20日現在	
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表 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、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) 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。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	17,765,130	△71,018,418
合計	17,765,130	△71,018,418

(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

第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 15 期 自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
1口当たり純資産額	24,423 円	17,748 円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 機械 上場取引所 東証  
 コード番号 1641  
 連動対象指標 TOPIX-17 機械  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	482	(99.8)	0	(0.2)	483	(100.0)
27年 7月期	641	(99.9)	0	(0.1)	642	(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月期	19	—	—	19
27年 7月期	19	—	—	19

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	488	5	483	25,377
27年 7月期	648	5	642	33,755

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	223
27年 7月期	264

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,287,203	4,901,915
株式	641,928,000	482,294,200
未収配当金	148,600	728,250
未収利息	30	—
前払金	—	414,000
差入委託証拠金	—	193,500
流動資産合計	648,363,833	488,531,865
資産合計	648,363,833	488,531,865
負債の部		
流動負債		
未払金	—	574,712
未払収益分配金	5,025,504	4,245,028
未払受託者報酬	171,224	154,218
未払委託者報酬	445,281	401,040
その他未払費用	166,433	85,316
流動負債合計	5,808,442	5,460,314
負債合計	5,808,442	5,460,314
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	432,060,092	432,060,092
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	210,495,299	51,011,459
(分配準備積立金)	162,787	738,078
元本等合計	642,555,391	483,071,551
純資産合計	642,555,391	483,071,551
負債純資産合計	648,363,833	488,531,865



(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日 金額(円)	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,671,600	5,461,000
受取利息	669	720
有価証券売買等損益	49,797,184	△159,484,419
派生商品取引等損益	—	△574,712
その他収益	74	49
営業収益合計	55,469,527	△154,597,362
営業費用		
受託者報酬	171,224	154,218
委託者報酬	445,281	401,040
その他費用	95,744	86,192
営業費用合計	712,249	641,450
営業利益又は営業損失(△)	54,757,278	△155,238,812
経常利益又は経常損失(△)	54,757,278	△155,238,812
当期純利益又は当期純損失(△)	54,757,278	△155,238,812
期首剰余金又は期首欠損金(△)	160,763,525	210,495,299
分配金 ※1	5,025,504	4,245,028
期末剰余金又は期末欠損金(△)	210,495,299	51,011,459

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日	至 平成 28 年 1 月 20 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	432,060,092 円	432,060,092 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	19,036 口	19,036 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (5,672,343 円) 及び分配準備	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (5,461,769 円) 及び分配準備

	積立金(228,197円)の合計額から、経費(712,249円)を控除して計算される分配対象額は5,188,291円（1口当たり272円）であり、うち5,025,504円（1口当たり264円）を分配金額としております。	積立金(162,787円)の合計額から、経費(641,450円)を控除して計算される分配対象額は4,983,106円（1口当たり261円）であり、うち4,245,028円（1口当たり223円）を分配金額としております。
--	---	---

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 平成28年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び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、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) 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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	49,614,090	△158,108,122
合計	49,614,090	△158,108,122

（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

第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
1口当たり純資産額	33,755円	25,377円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 電機・精密 上場取引所 東証  
 コード番号 1642  
 連動対象指標 TOPIX-17 電機・精密  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	1,216	(99.8)	2	(0.2)	1,218	(100.0)
27年 7月期	1,581	(99.9)	2	(0.1)	1,583	(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月期	95	—	—	95
27年 7月期	95	—	—	95

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	1,239	21	1,218	12,813
27年 7月期	1,597	13	1,583	16,654

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	188
27年 7月期	125

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,254,153	13,261,872
株式 ※3	1,581,571,750	1,216,131,600
未収入金	2,401,904	6,970,117
未収配当金	2,307,600	2,104,500
未収利息	54	—
前払金	—	1,366,250
流動資産合計	1,597,535,461	1,239,834,339
資産合計	1,597,535,461	1,239,834,339
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	181,654
未払金	—	1,717,641
未払収益分配金	11,886,750	17,877,672
未払受託者報酬	420,234	386,881
未払委託者報酬	1,092,681	1,005,975
その他未払費用	399,004	214,339
流動負債合計	13,798,669	21,384,162
負債合計	13,798,669	21,384,162
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,287,097,290	1,287,097,290
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	296,639,502	△68,647,113
(分配準備積立金)	2,328,007	2,123,971
元本等合計	1,583,736,792	1,218,450,177
純資産合計	1,583,736,792	1,218,450,177
負債純資産合計	1,597,535,461	1,239,834,339

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	13,389,775	10,789,364
受取利息	1,067	1,589
有価証券売買等損益	189,041,378	△363,183,284
派生商品取引等損益	—	△1,899,295
その他収益 ※1	11	8,492,042
営業収益合計	202,432,231	△345,799,584
営業費用		
受託者報酬	420,234	386,881
委託者報酬	1,092,681	1,005,975
その他費用	300,651	216,503
営業費用合計	1,813,566	1,609,359
営業利益又は営業損失 (△)	200,618,665	△347,408,943
経常利益又は経常損失 (△)	200,618,665	△347,408,943
当期純利益又は当期純損失 (△)	200,618,665	△347,408,943
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	107,907,587	296,639,502
分配金 ※2	11,886,750	17,877,672
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	296,639,502	△68,647,113

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日	至 平成 28 年 1 月 20 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	1,287,097,290 円	1,287,097,290 円
期中追加設定元本額	— 円	— 円
期中一部交換元本額	— 円	— 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	95,094 口	95,094 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 68,647,113 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 14,598,000 円



（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
1. ※1 その他収益	該当事項はありません。	主に、受取和解金であります。
2. ※2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (13,390,853 円) 及び分配準備積立金(2,637,470 円)の合計額から、経費(1,813,566 円)を控除して計算される分配対象額は 14,214,757 円 (1 口当たり 149 円) であり、うち 11,886,750 円 (1 口当たり 125 円) を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (19,282,995 円) 及び分配準備積立金(2,328,007 円)の合計額から、経費(1,609,359 円)を控除して計算される分配対象額は 20,001,643 円 (1 口当たり 210 円) であり、うち 17,877,672 円 (1 口当たり 188 円) を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 15 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 平成28年1月20日現在
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	188,382,167	△358,256,353
合計	188,382,167	△358,256,353

(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	第14期 平成27年7月20日 現在				第15期 平成28年1月20日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	—	—	—	—	1,515,500	—	1,334,500	△181,000
合計	—	—	—	—	1,515,500	—	1,334,500	△181,000

(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  
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、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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第 15 期 自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1 口当たり情報）

	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	16,654 円	12,813 円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 情報通信・サービスその他 上場取引所 東証  
 コード番号 1643  
 連動対象指標 TOPIX-17 情報通信・サービスその他  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	503	(99.8)	1	(0.2)	504	(100.0)
27年 7月期	598	(99.9)	0	(0.1)	599	(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月期	32	—	—	32
27年 7月期	32	—	—	32

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	509	4	504	15,651
27年 7月期	604	5	599	18,569

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	101
27年 7月期	138

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

### (1) 貸借対照表

	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,556,081	4,280,071
株式	598,687,800	503,939,150
未収入金	2,104,768	154,650
未収配当金	182,334	634,103
未収利息	15	—
前払金	—	143,750
差入委託証拠金	—	64,500
流動資産合計	604,530,998	509,216,224
資産合計	604,530,998	509,216,224
負債の部		
流動負債		
未払金	264,385	328,309
未払収益分配金	4,452,570	3,258,765
未払受託者報酬	148,486	155,701
未払委託者報酬	386,102	404,902
その他未払費用	141,435	86,224
流動負債合計	5,392,978	4,233,901
負債合計	5,392,978	4,233,901
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	372,015,450	372,015,450
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	227,122,570	132,966,873
(分配準備積立金)	185,581	664,451
元本等合計	599,138,020	504,982,323
純資産合計	599,138,020	504,982,323
負債純資産合計	604,530,998	509,216,224

(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日 金額(円)	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	4,873,841	4,384,440
受取利息	426	712
有価証券売買等損益	109,263,701	△94,451,572
派生商品取引等損益	—	△182,995
その他収益	166	127
営業収益合計	114,138,134	△90,249,288
営業費用		
受託者報酬	148,486	155,701
委託者報酬	386,102	404,902
その他費用	83,385	87,041
営業費用合計	617,973	647,644
営業利益又は営業損失(△)	113,520,161	△90,896,932
経常利益又は経常損失(△)	113,520,161	△90,896,932
当期純利益又は当期純損失(△)	113,520,161	△90,896,932
期首剰余金又は期首欠損金(△)	118,054,979	227,122,570
分配金 ※1	4,452,570	3,258,765
期末剰余金又は期末欠損金(△)	227,122,570	132,966,873

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第15期	
	自 平成27年7月21日	至 平成28年1月20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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
1. ※1 期首元本額	372,015,450円	372,015,450円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	32,265口	32,265口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (4,874,433円) 及び分配準備	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (4,385,279円) 及び分配準備

	積立金(381,691円)の合計額から、経費(617,973円)を控除して計算される分配対象額は4,638,151円（1口当たり143円）であり、うち4,452,570円（1口当たり138円）を分配金額としております。	積立金(185,581円)の合計額から、経費(647,644円)を控除して計算される分配対象額は3,923,216円（1口当たり121円）であり、うち3,258,765円（1口当たり101円）を分配金額としております。
--	---	---

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 平成28年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び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、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) 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。



（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	107,808,883	△93,284,543
合計	107,808,883	△93,284,543

（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

第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
1口当たり純資産額	18,569円	15,651円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 電力・ガス 上場取引所 東証  
 コード番号 1644  
 連動対象指標 TOPIX-17 電力・ガス  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	241	(100.1)	△0	(△0.1)	241	(100.0)
27年 7月期	305	(100.0)	0	(0.0)	306	(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月期	32	—	—	32
27年 7月期	32	—	—	32

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	243	1	241	7,445
27年 7月期	307	1	306	9,427

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	39
27年 7月期	42

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,779,077	1,410,194
株式	305,957,850	241,862,600
未収配当金	9,600	9,600
未収利息	6	—
前払金	—	138,000
差入委託証拠金	—	64,500
流動資産合計	307,746,533	243,484,894
資産合計	307,746,533	243,484,894
負債の部		
流動負債		
未払金	—	191,236
未払収益分配金	1,363,530	1,266,135
未払受託者報酬	72,537	78,576
未払委託者報酬	188,658	204,364
その他未払費用	69,062	43,437
流動負債合計	1,693,787	1,783,748
負債合計	1,693,787	1,783,748
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	409,773,230	409,773,230
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	△103,720,484	△168,072,084
(分配準備積立金)	29,668	14,810
元本等合計	306,052,746	241,701,146
純資産合計	306,052,746	241,701,146
負債純資産合計	307,746,533	243,484,894

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,670,100	1,577,900
受取利息	80	174
有価証券売買等損益	58,173,599	△64,145,506
派生商品取引等損益	—	△191,236
営業収益合計	59,843,779	△62,758,668
営業費用		
受託者報酬	72,537	78,576
委託者報酬	188,658	204,364
その他費用	40,464	43,857
営業費用合計	301,659	326,797
営業利益又は営業損失 (△)	59,542,120	△63,085,465
経常利益又は経常損失 (△)	59,542,120	△63,085,465
当期純利益又は当期純損失 (△)	59,542,120	△63,085,465
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△161,899,074	△103,720,484
分配金 ※1	1,363,530	1,266,135
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△103,720,484	△168,072,084

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日	至 平成 28 年 1 月 20 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	409,773,230 円	409,773,230 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	32,465 口	32,465 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 103,720,484 円であります。	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 168,072,084 円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
※1 分配金の計算過程	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (1,670,180 円) 及び分配準備積立金(24,677 円)の合計額から、経費(301,659 円)を控除して計算される分配対象額は 1,393,198 円(1 口当たり 42 円)であり、うち 1,363,530 円(1 口当たり 42 円)を分配金額としております。</p>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (1,578,074 円) 及び分配準備積立金(29,668 円)の合計額から、経費(326,797 円)を控除して計算される分配対象額は 1,280,945 円(1 口当たり 39 円)であり、うち 1,266,135 円(1 口当たり 39 円)を分配金額としております。</p>

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 15 期 自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
1. 金融商品に対する取組方針	<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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 15 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. 金融商品の時価及び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、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) 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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	58,006,361	△63,791,254
合計	58,006,361	△63,791,254

(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

第 14 期	第 15 期
平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 15 期
自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	9,427 円	7,445 円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 運輸・物流 上場取引所 東証  
 コード番号 1645  
 連動対象指標 TOPIX-17 運輸・物流  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	398	(99.8)	0	(0.2)	399	(100.0)
27年 7月期	453	(99.8)	0	(0.2)	454	(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月期	24	—	—	24
27年 7月期	24	—	—	24

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	401	2	399	16,448
27年 7月期	457	3	454	18,690

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	58
27年 7月期	119

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,117,137	2,586,778
株式	453,297,500	398,850,100
未収配当金	1,400	7,200
未収利息	18	—
前払金	—	137,500
差入委託証拠金	—	64,500
流動資産合計	457,416,055	401,646,078
資産合計	457,416,055	401,646,078
負債の部		
流動負債		
未払金	—	197,233
未払収益分配金	2,890,748	1,408,936
未払受託者報酬	114,534	118,521
未払委託者報酬	297,882	308,222
その他未払費用	107,219	65,576
流動負債合計	3,410,383	2,098,488
負債合計	3,410,383	2,098,488
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	349,464,712	349,464,712
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	104,540,960	50,082,878
(分配準備積立金)	5,235	28,560
元本等合計	454,005,672	399,547,590
純資産合計	454,005,672	399,547,590
負債純資産合計	457,416,055	401,646,078

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,310,600	1,863,550
受取利息	332	507
有価証券売買等損益	66,993,881	△54,284,174
派生商品取引等損益	—	△197,233
その他収益	49,334	61,143
営業収益合計	70,354,147	△52,556,207
営業費用		
受託者報酬	114,534	118,521
委託者報酬	297,882	308,222
その他費用	63,980	66,196
営業費用合計	476,396	492,939
営業利益又は営業損失 (△)	69,877,751	△53,049,146
経常利益又は経常損失 (△)	69,877,751	△53,049,146
当期純利益又は当期純損失 (△)	69,877,751	△53,049,146
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	37,553,957	104,540,960
分配金 ※1	2,890,748	1,408,936
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	104,540,960	50,082,878

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日	至 平成 28 年 1 月 20 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	349,464,712 円	349,464,712 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	24,292 口	24,292 口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
※1 分配金の計算過程	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (3,360,266円)及び分配準備積立金(12,113円)の合計額から、経費(476,396円)を控除して計算される分配対象額は2,895,983円(1口当たり119円)であり、うち2,890,748円(1口当たり119円)を分配金額としております。</p>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (1,925,200円)及び分配準備積立金(5,235円)の合計額から、経費(492,939円)を控除して計算される分配対象額は1,437,496円(1口当たり59円)であり、うち1,408,936円(1口当たり58円)を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期
	平成28年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び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、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) 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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	67,122,529	△53,961,379
合計	67,122,529	△53,961,379

(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

第14期	第15期
平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第15期
自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
1口当たり純資産額	18,690円	16,448円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 商社・卸売 上場取引所 東証  
 コード番号 1646  
 連動対象指標 TOPIX-17 商社・卸売  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	552	(99.9)	0	(0.1)	553	(100.0)
27年 7月期	703	(99.9)	0	(0.1)	703	(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月期	22	—	—	22
27年 7月期	22	—	—	22

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	562	9	553	24,831
27年 7月期	713	9	703	31,584

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	361
27年 7月期	391

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,207,951	8,282,542
株式 ※3	703,106,600	552,823,670
未収入金	1,774,092	1,045,072
未収配当金	133,200	131,000
未収利息	39	—
前払金	—	687,500
流動資産合計	713,221,882	562,969,784
資産合計	713,221,882	562,969,784
負債の部		
流動負債		
未払金	—	952,439
未払収益分配金	8,711,480	8,043,080
未払受託者報酬	180,042	176,428
未払委託者報酬	468,175	458,790
その他未払費用	175,689	97,693
流動負債合計	9,535,386	9,728,430
負債合計	9,535,386	9,728,430
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	628,763,880	628,763,880
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	74,922,616	△75,522,526
(分配準備積立金)	145,775	139,558
元本等合計	703,686,496	553,241,354
純資産合計	703,686,496	553,241,354
負債純資産合計	713,221,882	562,969,784

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	9,492,096	8,769,386
受取利息	800	1,178
有価証券売買等損益	118,285,366	△149,486,486
派生商品取引等損益	—	△952,439
その他収益	56	165
営業収益合計	127,778,318	△141,668,196
営業費用		
受託者報酬	180,042	176,428
委託者報酬	468,175	458,790
その他費用	100,662	98,648
営業費用合計	748,879	733,866
営業利益又は営業損失 (△)	127,029,439	△142,402,062
経常利益又は経常損失 (△)	127,029,439	△142,402,062
当期純利益又は当期純損失 (△)	127,029,439	△142,402,062
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△43,395,343	74,922,616
分配金 ※1	8,711,480	8,043,080
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	74,922,616	△75,522,526



(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第15期	
	自 平成27年7月21日	至 平成28年1月20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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
1. ※1 期首元本額	628,763,880 円	628,763,880 円
期中追加設定元本額	— 円	— 円
期中一部交換元本額	— 円	— 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	22,280 口	22,280 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75,522,526 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 3,063,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（9,492,952円）及び分配準備積立金（113,182円）の合計額から、経費（748,879円）を控除して計算される分配対象額は8,857,255円（1口当たり397円）であり、うち8,711,480円（1口当たり391円）を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（8,770,729円）及び分配準備積立金（145,775円）の合計額から、経費（733,866円）を控除して計算される分配対象額は8,182,638円（1口当たり367円）であり、うち8,043,080円（1口当たり361円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期
	平成28年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び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、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) 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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	117,938,822	△147,606,091
合計	117,938,822	△147,606,091

(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

第14期	第15期
平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第15期
自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
1口当たり純資産額	31,584円	24,831円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 小売 上場取引所 東証  
 コード番号 1647  
 連動対象指標 TOPIX-17 小売  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	389	(100.0)	0	(0.0)	389	(100.0)
27年 7月期	466	(99.9)	0	(0.1)	466	(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月期	21	—	—	21
27年 7月期	21	—	—	21

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	392	2	389	17,932
27年 7月期	469	2	466	21,494

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	103
27年 7月期	105

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,898,383	2,092,596
株式 ※2	466,434,100	389,479,200
未収入金	1,095,418	588,168
未収配当金	203,920	114,865
未収利息	9	—
前払金	—	137,000
流動資産合計	469,631,830	392,411,829
資産合計	469,631,830	392,411,829
負債の部		
流動負債		
未払金	—	189,985
未払収益分配金	2,280,600	2,237,160
未払受託者報酬	109,674	120,472
未払委託者報酬	285,214	313,261
その他未払費用	101,555	66,668
流動負債合計	2,777,043	2,927,546
負債合計	2,777,043	2,927,546
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	231,904,440	231,904,440
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	234,950,347	157,579,843
(分配準備積立金)	219,729	115,469
元本等合計	466,854,787	389,484,283
純資産合計	466,854,787	389,484,283
負債純資産合計	469,631,830	392,411,829

(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日 金額(円)	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,836,772	2,632,965
受取利息	281	449
有価証券売買等損益	122,402,981	△77,076,259
派生商品取引等損益	—	△189,985
その他収益	434	527
営業収益合計	125,240,468	△74,632,303
営業費用		
受託者報酬	109,674	120,472
委託者報酬	285,214	313,261
その他費用	61,253	67,308
営業費用合計	456,141	501,041
営業利益又は営業損失(△)	124,784,327	△75,133,344
経常利益又は経常損失(△)	124,784,327	△75,133,344
当期純利益又は当期純損失(△)	124,784,327	△75,133,344
期首剰余金又は期首欠損金(△)	112,446,620	234,950,347
分配金 ※1	2,280,600	2,237,160
期末剰余金又は期末欠損金(△)	234,950,347	157,579,843

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第15期	
	自 平成27年7月21日	至 平成28年1月20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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
1. ※1 期首元本額	231,904,440 円	231,904,440 円
期中追加設定元本額	— 円	— 円
期中一部交換元本額	— 円	— 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	21,720 口	21,720 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 491,200 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
※1 分配金の計算過程	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (2,837,487円)及び分配準備積立金(118,983円)の合計額から、経費(456,141円)を控除して計算される分配対象額は 2,500,329円(1口当たり115円)であり、うち2,280,600円(1口当たり105円)を分配金額としております。</p>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (2,633,941円)及び分配準備積立金(219,729円)の合計額から、経費(501,041円)を控除して計算される分配対象額は 2,352,629円(1口当たり108円)であり、うち2,237,160円(1口当たり103円)を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>



II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 平成28年1月20日現在
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額
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) 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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	121,471,791	△76,752,929
合計	121,471,791	△76,752,929

(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

第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
1口当たり純資産額	21,494円	17,932円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 銀行 上場取引所 東証  
 コード番号 1648  
 連動対象指標 TOPIX-17 銀行  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	606	(99.1)	5	(0.9)	611	(100.0)
27年 7月期	845	(99.9)	1	(0.1)	846	(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月期	54	—	—	54
27年 7月期	54	—	—	54

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	621	9	611	11,237
27年 7月期	856	9	846	15,542

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	146
27年 7月期	164

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,946,509	8,636,120
株式 ※3	845,059,640	606,068,090
未収入金	4,037,786	6,031,346
未収配当金	96,000	110,000
未収利息	33	—
前払金	—	696,000
流動資産合計	856,139,968	621,541,556
資産合計	856,139,968	621,541,556
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	896,654
未払収益分配金	8,929,964	7,949,846
未払受託者報酬	205,575	204,653
未払委託者報酬	534,560	532,201
その他未払費用	193,631	113,300
流動負債合計	9,863,730	9,696,654
負債合計	9,863,730	9,696,654
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	951,857,931	951,857,931
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	△105,581,693	△340,013,029
(分配準備積立金)	101,045	122,223
元本等合計	846,276,238	611,844,902
純資産合計	846,276,238	611,844,902
負債純資産合計	856,139,968	621,541,556

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 14 期	第 15 期
	自 平成 27 年 1 月 21 日 至 平成 27 年 7 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	9,788,350	8,821,175
受取利息	625	1,158
有価証券売買等損益	216,817,150	△233,555,860
派生商品取引等損益	—	△896,654
営業収益合計	226,606,125	△225,630,181
営業費用		
受託者報酬	205,575	204,653
委託者報酬	534,560	532,201
その他費用	114,955	114,455
営業費用合計	855,090	851,309
営業利益又は営業損失 (△)	225,751,035	△226,481,490
経常利益又は経常損失 (△)	225,751,035	△226,481,490
当期純利益又は当期純損失 (△)	225,751,035	△226,481,490
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△322,402,764	△105,581,693
分配金 ※1	8,929,964	7,949,846
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△105,581,693	△340,013,029

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日	至 平成 28 年 1 月 20 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	951,857,931 円	951,857,931 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	54,451 口	54,451 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 105,581,693 円であります。	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 340,013,029 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 5,057,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
※1 分配金の計算過程	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（9,788,975円）及び分配準備積立金（97,124円）の合計額から、経費（855,090円）を控除して計算される分配対象額は9,031,009円（1口当たり165円）であり、うち8,929,964円（1口当たり164円）を分配金額としております。</p>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（8,822,333円）及び分配準備積立金（101,045円）の合計額から、経費（851,309円）を控除して計算される分配対象額は8,072,069円（1口当たり148円）であり、うち7,949,846円（1口当たり146円）を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	
	1. 金融商品の時価及び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、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。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	215,703,861	△227,607,880
合計	215,703,861	△227,607,880

(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	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日 現在				第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日 現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	—	—	—	—	6,147,000	—	5,253,000	△894,000
合計	—	—	—	—	6,147,000	—	5,253,000	△894,000

(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、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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第 15 期 自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1 口当たり情報）

	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	15,542 円	11,237 円



# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 金融（除く銀行） 上場取引所 東証  
 コード番号 1649  
 連動対象指標 TOPIX-17 金融（除く銀行）  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	303	(99.6)	1	(0.4)	304	(100.0)
27年 7月期	413	(99.7)	1	(0.3)	415	(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月期	27	—	—	27
27年 7月期	27	—	—	27

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	307	3	304	11,148
27年 7月期	420	5	415	15,209

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	111
27年 7月期	178

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,721,949	4,589,987
株式	413,909,230	303,278,440
未収利息	33	—
流動資産合計	420,631,212	307,868,427
資産合計	420,631,212	307,868,427
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,860,646	3,031,077
未払受託者報酬	99,559	100,661
未払委託者報酬	258,923	261,789
その他未払費用	92,983	55,638
流動負債合計	5,312,111	3,449,165
負債合計	5,312,111	3,449,165
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	407,529,668	407,529,668
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	7,789,433	△103,110,406
(分配準備積立金)	1,681	18,779
元本等合計	415,319,101	304,419,262
純資産合計	415,319,101	304,419,262
負債純資産合計	420,631,212	307,868,427

(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日 金額(円)	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,275,690	3,465,940
受取利息	712	869
有価証券売買等損益	111,150,290	△110,916,937
その他収益	—	19
営業収益合計	116,426,692	△107,450,109
営業費用		
受託者報酬	99,559	100,661
委託者報酬	258,923	261,789
その他費用	55,597	56,203
営業費用合計	414,079	418,653
営業利益又は営業損失(△)	116,012,613	△107,868,762
経常利益又は経常損失(△)	116,012,613	△107,868,762
当期純利益又は当期純損失(△)	116,012,613	△107,868,762
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△103,362,534	7,789,433
分配金 ※1	4,860,646	3,031,077
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,789,433	△103,110,406

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日	至 平成 28 年 1 月 20 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. 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	平成 27 年 7 月 20 日現在	平成 28 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	407,529,668 円	407,529,668 円
期中追加設定元本額	— 円	— 円
期中一部交換元本額	— 円	— 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	27,307 口	27,307 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 103,110,406 円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (5,276,402円)及び分配準備積立金(4円)の合計額から、経費(414,079円)を控除して計算される分配対象額は4,862,327円(1口当たり178円)であり、うち4,860,646円(1口当たり178円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (3,466,828円)及び分配準備積立金(1,681円)の合計額から、経費(418,653円)を控除して計算される分配対象額は3,049,856円(1口当たり111円)であり、うち3,031,077円(1口当たり111円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 平成28年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び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、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) 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。
--	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	110,896,137	△109,533,538
合計	110,896,137	△109,533,538

（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

第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
1口当たり純資産額	15,209円	11,148円

# 平成28年1月期（平成27年7月21日～平成28年1月20日）決算短信

平成28年2月29日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 不動産 上場取引所 東証  
 コード番号 1650  
 連動対象指標 TOPIX-17 不動産  
 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

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月13日  
 分配金支払開始日 平成28年 2月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 28年1月期の運用状況（平成27年7月21日～平成28年1月20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月期	249	(99.5)	1	(0.5)	250	(100.0)
27年 7月期	334	(99.8)	0	(0.2)	335	(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月期	9	—	—	9
27年 7月期	9	—	—	9

#### (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/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 1月期	253	2	250	27,573
27年 7月期	337	1	335	36,869

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 1月期	101
27年 7月期	117

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,166,912	3,167,078
株式	334,827,300	249,640,300
未収配当金	92,850	272,400
未収利息	9	—
前払金	—	308,000
差入委託証拠金	—	129,000
流動資産合計	337,087,071	253,516,778
資産合計	337,087,071	253,516,778
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	210,167
未払金	—	1,039,749
未払収益分配金	1,065,051	919,403
未払受託者報酬	88,224	84,281
未払委託者報酬	229,466	219,218
その他未払費用	86,412	46,592
流動負債合計	1,469,153	2,519,410
負債合計	1,469,153	2,519,410
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	228,121,180	228,121,180
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	107,496,738	22,876,188
(分配準備積立金)	98,135	274,628
元本等合計	335,617,918	250,997,368
純資産合計	335,617,918	250,997,368
負債純資産合計	337,087,071	253,516,778



(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日 金額(円)	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	1,294,200	1,446,160
受取利息	195	222
有価証券売買等損益	40,435,595	△84,378,634
派生商品取引等損益	—	△418,409
その他収益	2	61
営業収益合計	41,729,992	△83,350,600
営業費用		
受託者報酬	88,224	84,281
委託者報酬	229,466	219,218
その他費用	49,256	47,048
営業費用合計	366,946	350,547
営業利益又は営業損失(△)	41,363,046	△83,701,147
経常利益又は経常損失(△)	41,363,046	△83,701,147
当期純利益又は当期純損失(△)	41,363,046	△83,701,147
期首剰余金又は期首欠損金(△)	67,198,743	107,496,738
分配金 ※1	1,065,051	919,403
期末剰余金又は期末欠損金(△)	107,496,738	22,876,188

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第15期	
	自 平成27年7月21日	至 平成28年1月20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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	平成27年7月20日現在	平成28年1月20日現在
1. ※1 期首元本額	228,121,180円	228,121,180円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	9,103口	9,103口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第14期	第15期
	自 平成27年1月21日 至 平成27年7月20日	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
※1 分配金の計算過程	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 （1,294,397円）及び分配準備積立金（235,735円）の合計額から、経費（366,946円）を控除して計算される分配対象額は 1,163,186円（1口当たり127円）であり、うち1,065,051円（1口当たり117円）を分配金額としております。</p>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 （1,446,443円）及び分配準備積立金（98,135円）の合計額から、経費（350,547円）を控除して計算される分配対象額は 1,194,031円（1口当たり131円）であり、うち919,403円（1口当たり101円）を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期 自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 平成28年1月20日現在
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第14期 平成27年7月20日現在	第15期 平成28年1月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	39,646,739	△83,629,857
合計	39,646,739	△83,629,857

(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	第14期 平成27年7月20日 現在				第15期 平成28年1月20日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	—	—	—	—	1,544,000	—	1,334,500	△209,500
合計	—	—	—	—	1,544,000	—	1,334,500	△209,500

(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、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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第 15 期 自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1 口当たり情報）

	第 14 期 平成 27 年 7 月 20 日現在	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	36,869 円	27,573 円