

平成 29 年 3 月 3 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 岩本 信之
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 29 年 1 月 期 (平成 28 年 7 月 21 日～平成 29 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 29 年 1 月 期 (平成 28 年 7 月 21 日～平成 29 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29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	585	(99.6)	2	(0.4)	587	(100.0)
28年 7月期	612	(99.8)	1	(0.2)	613	(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
29年 1月期	19	—	—	19
28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
29年 1月期	592	4	587	30,189
28年 7月期	619	6	613	31,511

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	213
28年 7月期	267

(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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	3,498,581	3,094,498
株式 ※2	612,134,400	585,507,200
派生商品評価勘定	—	3,892
未収入金	246,068	60,568
未収配当金	3,607,900	3,764,500
流動資産合計	619,486,949	592,430,658
資産合計	619,486,949	592,430,658
負債の部		
流動負債		
前受金	226,300	57,000
未払金	27,632	216
未払収益分配金	5,196,621	4,145,619
未払受託者報酬	160,640	158,590
未払委託者報酬	417,768	412,430
その他未払費用	163,201	87,833
流動負債合計	6,192,162	4,861,688
負債合計	6,192,162	4,861,688
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 (△)	284,175,457	258,449,640
(分配準備積立金)	3,613,481	3,776,923
元本等合計	613,294,787	587,568,970
純資産合計	613,294,787	587,568,970
負債純資産合計	619,486,949	592,430,658

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年1月21日 至平成28年7月20日	自平成28年7月21日 至平成29年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,691,400	4,969,400
受取利息	100	—
有価証券売買等損益	63,320,251	△26,524,541
派生商品取引等損益	175,040	635,282
その他収益	37	75
営業収益合計	69,186,828	△20,919,784
営業費用		
支払利息	200	733
受託者報酬	160,640	158,590
委託者報酬	417,768	412,430
その他費用	89,811	88,661
営業費用合計	668,419	660,414
営業利益又は営業損失(△)	68,518,409	△21,580,198
経常利益又は経常損失(△)	68,518,409	△21,580,198
当期純利益又は当期純損失(△)	68,518,409	△21,580,198
期首剰余金又は期首欠損金(△)	220,853,669	284,175,457
分配金 ※1	5,196,621	4,145,619
期末剰余金又は期末欠損金(△)	284,175,457	258,449,640

(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 17 期	
	自 平成 28 年 7 月 21 日	至 平成 29 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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
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 51,410,000 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 47,115,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	自 平成28年7月21日 至 平成29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 （5,691,337円）及び分配準備積立金（3,786,984円）の合計額から、経費（668,219円）を控除して計算される分配対象額は8,810,102円（1口当たり452円）であり、うち5,196,621円（1口当たり267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 （4,968,742円）及び分配準備積立金（3,613,481円）の合計額から、経費（659,681円）を控除して計算される分配対象額は7,922,542円（1口当たり407円）であり、うち4,145,619円（1口当たり213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17期
	自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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。</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。 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17期 平成29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等 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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29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	63,164,156	△26,150,338
合計	63,164,156	△26,150,338

(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16期 平成28年7月20日 現在				第17期 平成29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	—	—	—	—	1,532,500	—	1,536,500	4,000
合計	—	—	—	—	1,532,500	—	1,536,500	4,000

(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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	31,511 円	30,189 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	246	(99.4)	1	(0.6)	247	(100.0)
28年 7月期	178	(99.6)	0	(0.4)	179	(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
29年 1月期	19	—	—	19
28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
29年 1月期	250	2	247	12,903
28年 7月期	182	3	179	9,351

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	126
28年 7月期	144

(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16期	第17期
	平成28年7月20日現在 金額(円)	平成29年1月20日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,419,005	1,110,625
株式 ※3	178,838,100	246,057,900
派生商品評価勘定	—	60,592
未収入金	606,265	2,292,464
未収配当金	627,900	851,500
流動資産合計	182,491,270	250,373,081
資産合計	182,491,270	250,373,081
負債の部		
流動負債		
前受金	—	55,700
未払収益分配金	2,763,936	2,418,444
未払受託者報酬	51,989	55,861
未払委託者報酬	135,238	145,311
その他未払費用	57,517	30,878
流動負債合計	3,008,680	2,706,194
負債合計	3,008,680	2,706,194
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	△161,422,044	△93,237,747
(分配準備積立金)	629,188	866,550
元本等合計	179,482,590	247,666,887
純資産合計	179,482,590	247,666,887
負債純資産合計	182,491,270	250,373,081

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年1月21日 至平成28年7月20日	自平成28年7月21日 至平成29年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,973,400	2,888,300
受取利息	79	—
有価証券売買等損益	△7,398,711	67,619,025
派生商品取引等損益	—	327,910
その他収益	1	1
営業収益合計	△4,425,231	70,835,236
営業費用		
支払利息	64	200
受託者報酬	51,989	55,861
委託者報酬	135,238	145,311
その他費用	28,957	31,123
営業費用合計	216,248	232,495
営業利益又は営業損失(△)	△4,641,479	70,602,741
経常利益又は経常損失(△)	△4,641,479	70,602,741
当期純利益又は当期純損失(△)	△4,641,479	70,602,741
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△154,016,629	△161,422,044
分配金 ※1	2,763,936	2,418,444
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△161,422,044	△93,237,747

(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17期	
	自 平成28年7月21日	至 平成29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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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161,422,044 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93,237,747 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 11,015,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	自 平成28年7月21日 至 平成29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（2,973,416円）及び分配準備積立金（635,892円）の合計額から、経費（216,184円）を控除して計算される分配対象額は3,393,124円（1口当たり176円）であり、うち2,763,936円（1口当たり144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（2,888,101円）及び分配準備積立金（629,188円）の合計額から、経費（232,295円）を控除して計算される分配対象額は3,284,994円（1口当たり171円）であり、うち2,418,444円（1口当たり126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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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17期
	平成29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等 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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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	△7,426,223	66,704,076
合計	△7,426,223	66,704,076

(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16期				第17期			
	平成28年7月20日 現在				平成29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	—	—	—	—	1,475,800	—	1,536,500	60,700
合計	—	—	—	—	1,475,800	—	1,536,500	60,700

(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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29年1月20日現在
1口当たり純資産額	9,351円	12,903円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	1,262	(99.4)	7	(0.6)	1,269	(100.0)
28年 7月期	1,139	(99.5)	5	(0.5)	1,144	(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
29年 1月期	53	—	—	53
28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
29年 1月期	1,280	11	1,269	23,919
28年 7月期	1,159	15	1,144	21,563

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	182
28年 7月期	266

(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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	19,524,316	16,823,393
株式 ※2	1,139,102,150	1,262,294,250
派生商品評価勘定	105,642	214,568
未収入金	—	51,034
未収配当金	1,224,200	1,197,900
流動資産合計	1,159,956,308	1,280,581,145
資産合計	1,159,956,308	1,280,581,145
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,716	—
前受金	86,250	243,750
未払金	9,932	—
未払収益分配金	14,116,354	9,658,558
未払受託者報酬	301,035	319,539
未払委託者報酬	782,793	830,881
その他未払費用	318,983	177,215
流動負債合計	15,624,063	11,229,943
負債合計	15,624,063	11,229,943
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 (△)	397,969,829	522,988,786
(分配準備積立金)	1,225,651	1,212,002
元本等合計	1,144,332,245	1,269,351,202
純資産合計	1,144,332,245	1,269,351,202
負債純資産合計	1,159,956,308	1,280,581,145

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年1月21日 至平成28年7月20日	自平成28年7月21日 至平成29年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	15,340,000	10,976,500
受取利息	507	—
有価証券売買等損益	66,815,183	123,959,808
派生商品取引等損益	43,247	1,072,798
その他収益	69	194
営業収益合計	82,199,006	136,009,300
営業費用		
支払利息	1,220	2,590
受託者報酬	301,035	319,539
委託者報酬	782,793	830,881
その他費用	168,448	178,775
営業費用合計	1,253,496	1,331,785
営業利益	80,945,510	134,677,515
経常利益	80,945,510	134,677,515
当期純利益	80,945,510	134,677,515
期首剰余金又は期首欠損金(△)	331,140,673	397,969,829
分配金 ※1	14,116,354	9,658,558
期末剰余金又は期末欠損金(△)	397,969,829	522,988,786

(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17期	
	自 平成28年7月21日	至 平成29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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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
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 14,245,500 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 15,145,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	自 平成28年7月21日 至 平成29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 （15,339,356円）及び分配準備積立金（1,254,925円）の合計額から、経費（1,252,276円）を控除して計算される分配対象額は15,342,005円（1口当たり289円）であり、うち14,116,354円（1口当たり266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 （10,974,104円）及び分配準備積立金（1,225,651円）の合計額から、経費（1,329,195円）を控除して計算される分配対象額は10,870,560円（1口当たり204円）であり、うち9,658,558円（1口当たり182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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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。</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。 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17期
	平成29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等 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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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	66,189,825	124,092,542
合計	66,189,825	124,092,542

(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16期				第17期			
	平成28年7月20日 現在				平成29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	3,897,250	—	3,994,500	97,250	5,931,000	—	6,146,000	215,000
合計	3,897,250	—	3,994,500	97,250	5,931,000	—	6,146,000	215,000

(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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	21, 563 円	23, 919 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	809	(99.5)	3	(0.5)	813	(100.0)
28年 7月期	674	(99.8)	1	(0.2)	676	(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
29年 1月期	37	—	—	37
28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
29年 1月期	819	6	813	21,922
28年 7月期	683	6	676	18,220

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	144
28年 7月期	163

(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16期	第17期
	平成28年7月20日現在 金額(円)	平成29年1月20日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,700,607	8,328,677
株式 ※2	674,635,830	809,722,510
派生商品評価勘定	84,392	119,284
未収入金	462,152	169,602
未収配当金	1,222,500	1,597,100
流動資産合計	683,105,481	819,937,173
資産合計	683,105,481	819,937,173
負債の部		
流動負債		
前受金	55,200	273,750
未払金	33,664	—
未払収益分配金	6,048,767	5,343,696
未払受託者報酬	179,791	199,611
未払委託者報酬	467,536	519,068
その他未払費用	192,713	110,704
流動負債合計	6,977,671	6,446,829
負債合計	6,977,671	6,446,829
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(△)	180,388,679	317,751,213
(分配準備積立金)	1,247,158	1,622,814
元本等合計	676,127,810	813,490,344
純資産合計	676,127,810	813,490,344
負債純資産合計	683,105,481	819,937,173

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	6,676,400	6,550,750
受取利息	172	—
有価証券売買等損益	14,985,784	135,886,728
派生商品取引等損益	△78,517	1,100,150
その他収益	27	32
営業収益合計	21,583,866	143,537,660
営業費用		
支払利息	274	1,126
受託者報酬	179,791	199,611
委託者報酬	467,536	519,068
その他費用	100,549	111,625
営業費用合計	748,150	831,430
営業利益	20,835,716	142,706,230
経常利益	20,835,716	142,706,230
当期純利益	20,835,716	142,706,230
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	165,601,730	180,388,679
分配金 ※1	6,048,767	5,343,696
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	180,388,679	317,751,213

(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 17 期	
	自 平成 28 年 7 月 21 日	至 平成 29 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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
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 11,246,500 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 12,382,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 (6,676,325 円) 及び分配準備積立金(1,367,476 円)の合計額から、経費(747,876 円)を控除して計算される分配対象額は 7,295,925 円 (1 口当たり 196 円) であり、うち 6,048,767 円 (1 口当たり 163 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 (6,549,656 円) 及び分配準備積立金(1,247,158 円)の合計額から、経費(830,304 円)を控除して計算される分配対象額は 6,966,510 円 (1 口当たり 187 円) であり、うち 5,343,696 円 (1 口当たり 144 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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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等であり、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。</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。 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17期
	平成29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	<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等 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>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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	15,052,113	135,139,170
合計	15,052,113	135,139,170

(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16期				第17期			
	平成28年7月20日 現在				平成29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	1,247,000	—	1,331,500	84,500	2,953,500	—	3,073,000	119,500
合計	1,247,000	—	1,331,500	84,500	2,953,500	—	3,073,000	119,500

(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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	18,220 円	21,922 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	547	(99.1)	5	(0.9)	552	(100.0)
28年 7月期	576	(99.4)	3	(0.6)	579	(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
29年 1月期	28	—	—	28
28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
29年 1月期	559	6	552	19,580
28年 7月期	585	6	579	20,526

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	193
28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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	8,663,747	10,351,840
株式 ※2	576,284,500	547,767,550
派生商品評価勘定	—	155,676
未収入金	—	49,284
未収配当金	793,050	829,600
前払金	19,200	—
流動資産合計	585,760,497	559,153,950
資産合計	585,760,497	559,153,950
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,632	—
前受金	—	188,000
未払収益分配金	5,421,696	5,449,934
未払受託者報酬	154,402	149,747
未払委託者報酬	401,536	389,423
その他未払費用	160,329	82,915
流動負債合計	6,155,595	6,260,019
負債合計	6,155,595	6,260,019
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 (△)	208,444,630	181,733,659
(分配準備積立金)	814,633	844,626
元本等合計	579,604,902	552,893,931
純資産合計	579,604,902	552,893,931
負債純資産合計	585,760,497	559,153,950

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年1月21日 至平成28年7月20日	自平成28年7月21日 至平成29年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,066,790	6,104,300
受取利息	366	—
有価証券売買等損益	30,266,287	△27,621,328
派生商品取引等損益	△62,127	880,364
営業収益合計	36,271,316	△20,636,664
営業費用		
支払利息	624	1,506
受託者報酬	154,402	149,747
委託者報酬	401,536	389,423
その他費用	86,305	83,697
営業費用合計	642,867	624,373
営業利益又は営業損失(△)	35,628,449	△21,261,037
経常利益又は経常損失(△)	35,628,449	△21,261,037
当期純利益又は当期純損失(△)	35,628,449	△21,261,037
期首剰余金又は期首欠損金(△)	178,237,877	208,444,630
分配金 ※1	5,421,696	5,449,934
期末剰余金又は期末欠損金(△)	208,444,630	181,733,659

(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17期	
	自 平成28年7月21日	至 平成29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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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
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 13,979,000 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 14,060,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	自 平成28年7月21日 至 平成29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 （6,066,532円）及び分配準備積立金（812,040円）の合計額から、経費（642,243円）を控除して計算される分配対象額は 6,236,329円（1口当たり220円）であり、うち5,421,696円（1口当たり192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 （6,102,794円）及び分配準備積立金（814,633円）の合計額から、経費（622,867円）を控除して計算される分配対象額は 6,294,560円（1口当たり222円）であり、うち5,449,934円（1口当たり193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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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。</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。 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17期
	平成29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等 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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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	29,737,755	△27,204,480
合計	29,737,755	△27,204,480

(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16期				第17期			
	平成28年7月20日 現在				平成29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	5,343,200	—	5,326,000	△17,200	4,453,500	—	4,609,500	156,000
合計	5,343,200	—	5,326,000	△17,200	4,453,500	—	4,609,500	156,000

(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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	20,526 円	19,580 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	734	(99.4)	4	(0.6)	738	(100.0)
28年 7月期	606	(99.6)	2	(0.4)	609	(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
29年 1月期	33	—	—	33
28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
29年 1月期	748	9	738	22,199
28年 7月期	619	10	609	18,301

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	266
28年 7月期	279

(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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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	4,241,194	12,347,370
株式 ※2	606,577,000	734,368,000
派生商品評価勘定	—	38,376
未収入金	6,652,550	144,528
未収配当金	1,771,900	1,769,100
前払金	8,000	—
流動資産合計	619,250,644	748,667,374
資産合計	619,250,644	748,667,374
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,432	324
前受金	—	166,500
未払金	12,864	—
未払収益分配金	9,286,515	8,853,810
未払受託者報酬	169,351	183,490
未払委託者報酬	440,424	477,142
その他未払費用	192,921	101,757
流動負債合計	10,106,507	9,783,023
負債合計	10,106,507	9,783,023
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(△)	114,362,612	244,102,826
(分配準備積立金)	1,801,800	1,799,491
元本等合計	609,144,137	738,884,351
純資産合計	609,144,137	738,884,351
負債純資産合計	619,250,644	748,667,374

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年1月21日 至平成28年7月20日	自平成28年7月21日 至平成29年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	10,192,983	9,616,250
受取利息	318	—
有価証券売買等損益	△83,033,370	128,206,715
派生商品取引等損益	△273,237	1,535,808
その他収益	—	7
営業収益合計	△73,113,306	139,358,780
営業費用		
支払利息	359	1,532
受託者報酬	169,351	183,490
委託者報酬	440,424	477,142
その他費用	94,688	102,592
営業費用合計	704,822	764,756
営業利益又は営業損失(△)	△73,818,128	138,594,024
経常利益又は経常損失(△)	△73,818,128	138,594,024
当期純利益又は当期純損失(△)	△73,818,128	138,594,024
期首剰余金又は期首欠損金(△)	197,467,255	114,362,612
分配金 ※1	9,286,515	8,853,810
期末剰余金又は期末欠損金(△)	114,362,612	244,102,826

(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17期	
	自 平成28年7月21日	至 平成29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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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
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 11,550,000 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 13,602,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	自 平成28年7月21日 至 平成29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 （10,192,942円）及び分配準備積立金（1,599,836円）の合計額から、経費（704,463円）を控除して計算される分配対象額は11,088,315円（1口当たり333円）であり、うち9,286,515円（1口当たり279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 （9,614,725円）及び分配準備積立金（1,801,800円）の合計額から、経費（763,224円）を控除して計算される分配対象額は10,653,301円（1口当たり320円）であり、うち8,853,810円（1口当たり266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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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。</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。 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17期
	平成29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等 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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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	△81,978,774	127,078,394
合計	△81,978,774	127,078,394

(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16期				第17期			
	平成28年7月20日 現在				平成29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	2,500,000	—	2,496,000	△4,000	4,359,300	—	4,398,000	38,700
合計	2,500,000	—	2,496,000	△4,000	4,359,300	—	4,398,000	38,700

(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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29年1月20日現在
1口当たり純資産額	18,301円	22,199円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	237	(99.7)	0	(0.3)	238	(100.0)
28年 7月期	185	(99.8)	0	(0.2)	185	(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
29年 1月期	10	6	6	10
28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
29年 1月期	239	0	238	22,054
28年 7月期	187	2	185	17,186

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	59
28年 7月期	166

(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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在 金 額 (円)	平成 29 年 1 月 20 日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,327,860	1,672,584
株式 ※3	185,392,450	237,461,700
未収入金	—	29,284
未収配当金	2,200	16,500
前払金	11,850	—
流動資産合計	187,734,360	239,180,068
資産合計	187,734,360	239,180,068
負債の部		
流動負債		
前受金	—	29,500
未払金	13,816	—
未払収益分配金	1,793,630	637,436
未払受託者報酬	50,233	56,905
未払委託者報酬	130,691	148,025
その他未払費用	56,191	31,453
流動負債合計	2,044,561	903,319
負債合計	2,044,561	903,319
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	369,995,615	369,961,372
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	△184,305,816	△131,684,623
(分配準備積立金)	8,383	26,311
元本等合計	185,689,799	238,276,749
純資産合計	185,689,799	238,276,749
負債純資産合計	187,734,360	239,180,068

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,987,000	892,150
受取利息	64	—
有価証券売買等損益	△6,025,867	51,261,980
派生商品取引等損益	△35,513	141,168
その他収益	6	9
営業収益合計	△4,074,310	52,295,307
営業費用		
支払利息	91	159
受託者報酬	50,233	56,905
委託者報酬	130,691	148,025
その他費用	27,989	31,706
営業費用合計	209,004	236,795
営業利益又は営業損失 (△)	△4,283,314	52,058,512
経常利益又は経常損失 (△)	△4,283,314	52,058,512
当期純利益又は当期純損失 (△)	△4,283,314	52,058,512
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△178,228,872	△184,305,816
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	93,013,685
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	93,013,685
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	91,813,568
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	91,813,568
分配金 ※1	1,793,630	637,436
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△184,305,816	△131,684,623

(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 17 期	
	自 平成 28 年 7 月 21 日	至 平成 29 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	237,783,392 円
期中一部交換元本額	－円	237,817,635 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	10,805 口	10,804 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 184,305,816 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 131,684,623 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 14,825,000 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 18,584,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 (1,986,979 円) 及び分配準備積立金(23,947 円)の合計額から、経費(208,913 円)を控除して計算される分配対象額は 1,802,013 円 (1 口当たり 166 円) であり、うち 1,793,630 円 (1 口当たり 166 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 (892,000 円) 及び分配準備積立金(8,383 円)の合計額から、経費(236,636 円)を控除して計算される分配対象額は 663,747 円 (1 口当たり 61 円) であり、うち 637,436 円 (1 口当たり 59 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 17 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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等であり、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17期 平成29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等 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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29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	△6,019,650	36,314,573
合計	△6,019,650	36,314,573

(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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29年1月20日現在
1口当たり純資産額	17,186円	22,054円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	626	(99.5)	3	(0.5)	629	(100.0)
28年 7月期	508	(99.9)	0	(0.1)	508	(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
29年 1月期	19	—	—	19
28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
29年 1月期	634	5	629	33,076
28年 7月期	514	5	508	26,726

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	222
28年 7月期	274

(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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	4,853,749	6,792,212
株式	508,318,250	626,502,150
派生商品評価勘定	—	119,584
未収入金	680,081	135,402
未収配当金	637,825	859,550
差入委託証拠金	184,500	330,000
流動資産合計	514,674,405	634,738,898
資産合計	514,674,405	634,738,898
負債の部		
流動負債		
前受金	68,400	239,850
未払金	16,032	—
未払収益分配金	5,215,864	4,225,992
未払受託者報酬	133,277	153,299
未払委託者報酬	346,553	398,674
その他未払費用	144,470	84,996
流動負債合計	5,924,596	5,102,811
負債合計	5,924,596	5,102,811
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 (△)	76,689,717	197,575,995
(分配準備積立金)	651,780	867,447
元本等合計	508,749,809	629,636,087
純資産合計	508,749,809	629,636,087
負債純資産合計	514,674,405	634,738,898

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	5,683,775	5,080,050
受取利息	196	—
有価証券売買等損益	25,733,941	119,809,469
派生商品取引等損益	30,615	861,142
その他収益	80	84
営業収益合計	31,448,607	125,750,745
営業費用		
支払利息	176	810
受託者報酬	133,277	153,299
委託者報酬	346,553	398,674
その他費用	74,479	85,692
営業費用合計	554,485	638,475
営業利益	30,894,122	125,112,270
経常利益	30,894,122	125,112,270
当期純利益	30,894,122	125,112,270
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	51,011,459	76,689,717
分配金 ※1	5,215,864	4,225,992
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	76,689,717	197,575,995

(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 17 期	
	自 平成 28 年 7 月 21 日	至 平成 29 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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16期	第17期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	自 平成28年7月21日 至 平成29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 （5,683,875円）及び分配準備積立金（738,078円）の合計額から、経費（554,309円）を控除して計算される分配対象額は 5,867,644円（1口当たり308円）であり、うち5,215,864円（1口当たり274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 （5,079,324円）及び分配準備積立金（651,780円）の合計額から、経費（637,665円）を控除して計算される分配対象額は 5,093,439円（1口当たり267円）であり、うち4,225,992円（1口当たり222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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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。</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。 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17期
	平成29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	<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等 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>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29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	25,645,745	119,074,366
合計	25,645,745	119,074,366

(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16期 平成28年7月20日 現在				第17期 平成29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	—	—	—	—	2,953,200	—	3,073,000	119,800
合計	—	—	—	—	2,953,200	—	3,073,000	119,800

(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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	26,726 円	33,076 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	1,476	(99.7)	3	(0.3)	1,480	(100.0)
28年 7月期	1,237	(99.7)	3	(0.3)	1,240	(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
29年 1月期	95	—	—	95
28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
29年 1月期	1,491	10	1,480	15,572
28年 7月期	1,253	12	1,240	13,044

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	94
28年 7月期	118

(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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	13,746,086	5,278,057
株式 ※3	1,237,285,720	1,476,988,150
派生商品評価勘定	—	63,734
未収入金	203,568	6,956,303
未収配当金	2,141,200	2,120,000
流動資産合計	1,253,376,574	1,491,406,244
資産合計	1,253,376,574	1,491,406,244
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,216	—
前受金	140,000	109,650
未払金	65,762	—
未払収益分配金	11,221,092	8,938,836
未払受託者報酬	324,483	365,905
未払委託者報酬	843,738	951,419
その他未払費用	357,295	203,050
流動負債合計	12,966,586	10,568,860
負債合計	12,966,586	10,568,860
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	△46,687,302	193,740,094
(分配準備積立金)	2,183,471	2,202,297
元本等合計	1,240,409,988	1,480,837,384
純資産合計	1,240,409,988	1,480,837,384
負債純資産合計	1,253,376,574	1,491,406,244

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	12,630,608	10,480,860
受取利息	746	—
有価証券売買等損益	21,803,728	239,154,312
派生商品取引等損益	96,583	1,254,258
その他収益	11	24
営業収益合計	34,531,676	250,889,454
営業費用		
支払利息	985	1,157
受託者報酬	324,483	365,905
委託者報酬	843,738	951,419
その他費用	181,567	204,741
営業費用合計	1,350,773	1,523,222
営業利益	33,180,903	249,366,232
経常利益	33,180,903	249,366,232
当期純利益	33,180,903	249,366,232
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△68,647,113	△46,687,302
分配金 ※1	11,221,092	8,938,836
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△46,687,302	193,740,094

(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 17 期	
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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 46,687,302 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 16,614,000 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 18,958,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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（12,630,380 円）及び分配準備積立金（2,123,971 円）の合計額から、経費（1,349,788 円）を控除して計算される分配対象額は 13,404,563 円（1 口当たり 140 円）であり、うち 11,221,092 円（1 口当たり 118 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（10,479,727 円）及び分配準備積立金（2,183,471 円）の合計額から、経費（1,522,065 円）を控除して計算される分配対象額は 11,141,133 円（1 口当たり 117 円）であり、うち 8,938,836 円（1 口当たり 94 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 17 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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等であり、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17期
	平成29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等 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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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	21,698,036	236,874,328
合計	21,698,036	236,874,328

(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16期				第17期			
	平成28年7月20日 現在				平成29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	2,677,000	—	2,663,000	△14,000	3,009,050	—	3,073,000	63,950
合計	2,677,000	—	2,663,000	△14,000	3,009,050	—	3,073,000	63,950

(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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	13,044 円	15,572 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	605	(99.8)	1	(0.2)	607	(100.0)
28年 7月期	567	(99.9)	0	(0.1)	567	(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
29年 1月期	32	—	—	32
28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
29年 1月期	611	4	607	18,815
28年 7月期	573	5	567	17,602

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	121
28年 7月期	149

(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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	2,481,513	1,617,820
株式 ※2	567,444,400	605,763,200
未収入金	3,083,974	3,643,601
未収配当金	405,416	601,598
流動資産合計	573,415,303	611,626,219
資産合計	573,415,303	611,626,219
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,807,485	3,904,065
未払受託者報酬	146,573	155,141
未払委託者報酬	381,136	403,441
その他未払費用	152,657	85,957
流動負債合計	5,487,851	4,548,604
負債合計	5,487,851	4,548,604
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 (△)	195,912,002	235,062,165
(分配準備積立金)	433,091	602,018
元本等合計	567,927,452	607,077,615
純資産合計	567,927,452	607,077,615
負債純資産合計	573,415,303	611,626,219

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	5,185,722	4,718,598
受取利息	153	—
有価証券売買等損益	63,416,119	38,509,916
派生商品取引等損益	△239,630	471,320
その他収益	55	187
営業収益合計	68,362,419	43,700,021
営業費用		
支払利息	182	486
受託者報酬	146,573	155,141
委託者報酬	381,136	403,441
その他費用	81,914	86,725
営業費用合計	609,805	645,793
営業利益	67,752,614	43,054,228
経常利益	67,752,614	43,054,228
当期純利益	67,752,614	43,054,228
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	132,966,873	195,912,002
分配金 ※1	4,807,485	3,904,065
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	195,912,002	235,062,165

(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17期	
	自 平成28年7月21日	至 平成29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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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
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 1,865,200 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	自 平成28年7月21日 至 平成29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 (5,185,748円)及び分配準備積立金(664,451円)の合計額から、経費(609,623円)を控除して計算される分配対象額は 5,240,576円(1口当たり162円)であり、うち4,807,485円(1口当たり149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 (4,718,299円)及び分配準備積立金(433,091円)の合計額から、経費(645,307円)を控除して計算される分配対象額は 4,506,083円(1口当たり139円)であり、うち3,904,065円(1口当たり121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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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。</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17期
	平成29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等 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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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	62,312,338	34,977,156
合計	62,312,338	34,977,156

(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16期	第17期
平成28年7月20日現在	平成29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17期
自 平成28年7月21日 至 平成29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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29年1月20日現在
1口当たり純資産額	17,602円	18,815円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	240	(99.4)	1	(0.6)	242	(100.0)
28年 7月期	215	(99.4)	1	(0.6)	217	(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
29年 1月期	32	—	—	32
28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
29年 1月期	244	1	242	7,466
28年 7月期	219	2	217	6,686

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	47
28年 7月期	53

(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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	2,995,453	3,191,701
株式 ※3	215,688,970	240,934,050
派生商品評価勘定	83,642	59,792
未収入金	369,874	56,684
未収配当金	11,400	11,700
流動資産合計	219,149,339	244,253,927
資産合計	219,149,339	244,253,927
負債の部		
流動負債		
前受金	76,050	109,800
未払金	9,166	—
未払収益分配金	1,720,645	1,525,855
未払受託者報酬	62,402	60,016
未払委託者報酬	162,329	156,103
その他未払費用	70,476	33,152
流動負債合計	2,101,068	1,884,926
負債合計	2,101,068	1,884,926
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	△192,724,959	△167,404,229
(分配準備積立金)	30,598	22,565
元本等合計	217,048,271	242,369,001
純資産合計	217,048,271	242,369,001
負債純資産合計	219,149,339	244,253,927

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,996,000	1,767,800
受取利息	49	—
有価証券売買等損益	△24,725,695	24,919,227
派生商品取引等損益	57,032	409,536
営業収益合計	△22,672,614	27,096,563
営業費用		
支払利息	73	413
受託者報酬	62,402	60,016
委託者報酬	162,329	156,103
その他費用	34,812	33,446
営業費用合計	259,616	249,978
営業利益又は営業損失 (△)	△22,932,230	26,846,585
経常利益又は経常損失 (△)	△22,932,230	26,846,585
当期純利益又は当期純損失 (△)	△22,932,230	26,846,585
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△168,072,084	△192,724,959
分配金 ※1	1,720,645	1,525,855
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△192,724,959	△167,404,229

(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 17 期	
	自 平成 28 年 7 月 21 日	至 平成 29 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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 192,724,959 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 167,404,229 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 3,824,000 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 4,240,500 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 (1,995,976 円) 及び分配準備積立金(14,810 円)の合計額から、経費(259,543 円)を控除して計算される分配対象額は 1,751,243 円(1 口当たり 53 円)であり、うち 1,720,645 円(1 口当たり 53 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 (1,767,387 円) 及び分配準備積立金(30,598 円)の合計額から、経費(249,565 円)を控除して計算される分配対象額は 1,548,420 円(1 口当たり 47 円)であり、うち 1,525,855 円(1 口当たり 47 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 17 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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等であり、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 17 期
	平成 29 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等 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	△24,499,409	24,788,457
合計	△24,499,409	24,788,457

(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 16 期				第 17 期			
	平成 28 年 7 月 20 日 現在				平成 29 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	1,247,750	—	1,331,500	83,750	1,476,600	—	1,536,500	59,900
合計	1,247,750	—	1,331,500	83,750	1,476,600	—	1,536,500	59,900

(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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	6,686 円	7,466 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	411	(99.6)	1	(0.4)	412	(100.0)
28年 7月期	392	(99.7)	0	(0.3)	393	(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
29年 1月期	24	—	—	24
28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
29年 1月期	414	1	412	16,995
28年 7月期	396	3	393	16,185

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	59
28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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	4,522,243	3,547,347
株式 ※2	392,184,600	411,135,400
派生商品評価勘定	—	60,142
未収入金	—	57,284
未収配当金	3,200	8,200
前払金	17,600	—
流動資産合計	396,727,643	414,808,373
資産合計	396,727,643	414,808,373
負債の部		
流動負債		
前受金	—	110,500
未払金	22,532	—
未払収益分配金	3,036,500	1,433,228
未払受託者報酬	107,055	103,118
未払委託者報酬	278,446	268,168
その他未払費用	113,609	57,060
流動負債合計	3,558,142	1,972,074
負債合計	3,558,142	1,972,074
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 (△)	43,704,789	63,371,587
(分配準備積立金)	13,279	9,252
元本等合計	393,169,501	412,836,299
純資産合計	393,169,501	412,836,299
負債純資産合計	396,727,643	414,808,373

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,420,225	1,812,875
受取利息	89	—
有価証券売買等損益	△6,288,379	19,273,031
派生商品取引等損益	△74,429	397,794
その他収益	46,409	45,659
営業収益合計	△2,896,085	21,529,359
営業費用		
支払利息	213	456
受託者報酬	107,055	103,118
委託者報酬	278,446	268,168
その他費用	59,790	57,591
営業費用合計	445,504	429,333
営業利益又は営業損失 (△)	△3,341,589	21,100,026
経常利益又は経常損失 (△)	△3,341,589	21,100,026
当期純利益又は当期純損失 (△)	△3,341,589	21,100,026
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	50,082,878	43,704,789
分配金 ※1	3,036,500	1,433,228
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	43,704,789	63,371,587

(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 17 期	
	自 平成 28 年 7 月 21 日	至 平成 29 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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
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 3,897,400 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 4,006,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 (3,466,510 円) 及び分配準備積立金(28,560 円)の合計額から、経費(445,291 円)を控除して計算される分配対象額は 3,049,779 円 (1 口当たり 125 円) であり、うち 3,036,500 円 (1 口当たり 125 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 (1,858,078 円) 及び分配準備積立金(13,279 円)の合計額から、経費(428,877 円)を控除して計算される分配対象額は 1,442,480 円(1 口当たり 59 円) であり、うち 1,433,228 円 (1 口当たり 59 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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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等であり、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。</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。 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17期 平成29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等 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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29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	△6,282,492	19,857,672
合計	△6,282,492	19,857,672

(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16期 平成28年7月20日 現在				第17期 平成29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	—	—	—	—	1,476,250	—	1,536,500	60,250
合計	—	—	—	—	1,476,250	—	1,536,500	60,250

(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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	16, 185 円	16, 995 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	686	(99.9)	1	(0.1)	687	(100.0)
28年 7月期	563	(99.9)	0	(0.1)	563	(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
29年 1月期	22	—	—	22
28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
29年 1月期	695	8	687	30,841
28年 7月期	573	9	563	25,309

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	364
28年 7月期	401

(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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	10,242,978	9,678,717
株式 ※3	563,171,550	686,111,530
未収配当金	135,500	155,700
前払金	51,250	—
流動資産合計	573,601,278	695,945,947
資産合計	573,601,278	695,945,947
負債の部		
流動負債		
未払金	62,080	—
未払収益分配金	8,934,280	8,109,920
未払受託者報酬	154,039	168,738
未払委託者報酬	400,557	438,831
その他未払費用	166,235	93,585
流動負債合計	9,717,191	8,811,074
負債合計	9,717,191	8,811,074
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	△64,879,793	58,370,993
(分配準備積立金)	143,562	156,115
元本等合計	563,884,087	687,134,873
純資産合計	563,884,087	687,134,873
負債純資産合計	573,601,278	695,945,947

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年1月21日 至平成28年7月20日	自平成28年7月21日 至平成29年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	9,579,030	8,825,236
受取利息	362	—
有価証券売買等損益	10,831,307	123,238,233
派生商品取引等損益	△192,578	—
その他収益	57	133
営業収益合計	20,218,178	132,063,602
営業費用		
支払利息	468	976
受託者報酬	154,039	168,738
委託者報酬	400,557	438,831
その他費用	86,101	94,351
営業費用合計	641,165	702,896
営業利益	19,577,013	131,360,706
経常利益	19,577,013	131,360,706
当期純利益	19,577,013	131,360,706
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△75,522,526	△64,879,793
分配金 ※1	8,934,280	8,109,920
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△64,879,793	58,370,993

(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 17 期	
	自 平成 28 年 7 月 21 日	至 平成 29 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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 64,879,793 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 3,164,500 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 4,206,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 (9,578,981 円) 及び分配準備積立金(139,558 円)の合計額から、経費(640,697 円)を控除して計算される分配対象額は 9,077,842 円（1 口当たり 407 円）であり、うち 8,934,280 円（1 口当たり 401 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 (8,824,393 円) 及び分配準備積立金(143,562 円)の合計額から、経費(701,920 円)を控除して計算される分配対象額は 8,266,035 円（1 口当たり 371 円）であり、うち 8,109,920 円（1 口当たり 364 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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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等であり、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 17 期 平成 29 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等 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 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	10,466,701	123,329,182
合計	10,466,701	123,329,182

(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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	25,309 円	30,841 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	417	(99.6)	1	(0.4)	418	(100.0)
28年 7月期	394	(99.9)	0	(0.1)	395	(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
29年 1月期	21	—	—	21
28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
29年 1月期	422	3	418	19,290
28年 7月期	398	3	395	18,191

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	118
28年 7月期	127

(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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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	3,428,091	4,737,993
株式 ※2	394,705,000	417,100,000
派生商品評価勘定	—	34,740
未収入金	—	59,570
未収配当金	243,125	152,850
前払金	22,200	—
流動資産合計	398,398,416	422,085,153
資産合計	398,398,416	422,085,153
負債の部		
流動負債		
前受金	—	89,850
未払金	26,132	—
未払収益分配金	2,758,440	2,562,960
未払受託者報酬	105,919	108,502
未払委託者報酬	275,447	282,169
その他未払費用	113,852	60,075
流動負債合計	3,279,790	3,103,556
負債合計	3,279,790	3,103,556
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(△)	163,214,186	187,077,157
(分配準備積立金)	243,288	155,665
元本等合計	395,118,626	418,981,597
純資産合計	395,118,626	418,981,597
負債純資産合計	398,398,416	422,085,153

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,326,510	2,926,695
受取利息	85	—
有価証券売買等損益	5,517,482	23,246,248
派生商品取引等損益	△10,958	704,346
その他収益	406	511
営業収益合計	8,833,525	26,877,800
営業費用		
支払利息	233	588
受託者報酬	105,919	108,502
委託者報酬	275,447	282,169
その他費用	59,143	60,610
営業費用合計	440,742	451,869
営業利益	8,392,783	26,425,931
経常利益	8,392,783	26,425,931
当期純利益	8,392,783	26,425,931
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	157,579,843	163,214,186
分配金 ※1	2,758,440	2,562,960
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	163,214,186	187,077,157

(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17期	
	自 平成28年7月21日	至 平成29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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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 452,100 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 464,700 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	自 平成28年7月21日 至 平成29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 (3,326,768円)及び分配準備積立金(115,469円)の合計額から、経費(440,509円)を控除して計算される分配対象額は 3,001,728円(1口当たり138円)であり、うち2,758,440円(1口当たり127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 (2,926,618円)及び分配準備積立金(243,288円)の合計額から、経費(451,281円)を控除して計算される分配対象額は 2,718,625円(1口当たり125円)であり、うち2,562,960円(1口当たり118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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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。</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。 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17期 平成29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等 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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29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	5,911,070	23,364,759
合計	5,911,070	23,364,759

(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16期 平成28年7月20日 現在				第17期 平成29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	—	—	—	—	1,501,650	—	1,536,500	34,850
合計	—	—	—	—	1,501,650	—	1,536,500	34,850

(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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	18, 191 円	19, 290 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	652	(97.4)	17	(2.6)	669	(100.0)
28年 7月期	482	(97.6)	11	(2.4)	493	(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
29年 1月期	54	—	—	54
28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
29年 1月期	678	9	669	12,303
28年 7月期	503	9	493	9,068

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	149
28年 7月期	160

(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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	15,017,241	26,266,107
株式 ※3	482,027,510	652,253,410
派生商品評価勘定	—	260,028
未収入金	6,189,057	111,136
未収配当金	84,000	105,000
前払金	120,000	—
流動資産合計	503,437,808	678,995,681
資産合計	503,437,808	678,995,681
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	288,864	—
前受金	—	312,000
未払収益分配金	8,712,160	8,113,199
未払受託者報酬	138,182	157,118
未払委託者報酬	359,357	408,622
その他未払費用	170,143	87,137
流動負債合計	9,668,706	9,078,076
負債合計	9,668,706	9,078,076
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	△458,088,829	△281,940,326
(分配準備積立金)	99,329	116,143
元本等合計	493,769,102	669,917,605
純資産合計	493,769,102	669,917,605
負債純資産合計	503,437,808	678,995,681

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	9,264,525	8,787,725
受取利息	540	—
有価証券売買等損益	△116,742,974	169,946,197
派生商品取引等損益	△1,309,932	6,185,492
その他収益	1	13
営業収益合計	△108,787,840	184,919,427
営業費用		
支払利息	1,034	4,174
受託者報酬	138,182	157,118
委託者報酬	359,357	408,622
その他費用	77,227	87,811
営業費用合計	575,800	657,725
営業利益又は営業損失 (△)	△109,363,640	184,261,702
経常利益又は経常損失 (△)	△109,363,640	184,261,702
当期純利益又は当期純損失 (△)	△109,363,640	184,261,702
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△340,013,029	△458,088,829
分配金 ※1	8,712,160	8,113,199
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△458,088,829	△281,940,326

(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 17 期	
	自 平成 28 年 7 月 21 日	至 平成 29 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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 458,088,829 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 281,940,326 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 4,139,500 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 5,899,000 円

ダイワ上場投信・TOPIX-17 銀行（1648）平成29年1月期決算短信
 （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	自 平成28年7月21日 至 平成29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（9,264,032円）及び分配準備積立金（122,223円）の合計額から、経費（574,766円）を控除して計算される分配対象額は8,811,489円（1口当たり161円）であり、うち8,712,160円（1口当たり160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（8,783,564円）及び分配準備積立金（99,329円）の合計額から、経費（653,551円）を控除して計算される分配対象額は8,229,342円（1口当たり151円）であり、うち8,113,199円（1口当たり149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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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 17 期
	平成 29 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等 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	△114,673,502	169,186,098
合計	△114,673,502	169,186,098

(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 16 期				第 17 期			
	平成 28 年 7 月 20 日 現在				平成 29 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	11,600,000	—	11,312,000	△288,000	16,947,000	—	17,208,000	261,000
合計	11,600,000	—	11,312,000	△288,000	16,947,000	—	17,208,000	261,000

(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 17 期 自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	9,068 円	12,303 円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	359	(99.8)	0	(0.2)	360	(100.0)
28年 7月期	267	(99.6)	1	(0.4)	268	(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
29年 1月期	27	—	—	27
28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
29年 1月期	363	3	360	13,186
28年 7月期	273	4	268	9,823

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	123
28年 7月期	166

(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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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	5,960,997	4,351,638
株式	267,163,800	359,430,810
流動資産合計	273,124,797	363,782,448
資産合計	273,124,797	363,782,448
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,532,962	3,358,761
未払受託者報酬	76,452	84,635
未払委託者報酬	198,832	220,137
その他未払費用	88,330	46,861
流動負債合計	4,896,576	3,710,394
負債合計	4,896,576	3,710,394
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	△139,301,447	△47,457,614
(分配準備積立金)	17,225	26,179
元本等合計	268,228,221	360,072,054
純資産合計	268,228,221	360,072,054
負債純資産合計	273,124,797	363,782,448

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	4,849,500	3,720,175
受取利息	172	—
有価証券売買等損益	△36,189,487	91,834,879
その他収益	2	21
営業収益合計	△31,339,813	95,555,075
営業費用		
支払利息	317	480
受託者報酬	76,452	84,635
委託者報酬	198,832	220,137
その他費用	42,665	47,229
営業費用合計	318,266	352,481
営業利益又は営業損失 (△)	△31,658,079	95,202,594
経常利益又は経常損失 (△)	△31,658,079	95,202,594
当期純利益又は当期純損失 (△)	△31,658,079	95,202,594
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△103,110,406	△139,301,447
分配金 ※1	4,532,962	3,358,761
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△139,301,447	△47,457,614

(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17期	
	自 平成28年7月21日	至 平成29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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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139,301,447 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47,457,614 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16期	第17期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	自 平成28年7月21日 至 平成29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 (4,849,357 円) 及び分配準備積立金(18,779 円)の合計額から、経費(317,949 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 (3,719,716 円) 及び分配準備積立金(17,225 円)の合計額から、経費(352,001 円)を控除し

	て計算される分配対象額は 4,550,187円（1口当たり166円）であり、うち4,532,962円（1口当たり166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 3,384,940円（1口当たり123円）であり、うち3,358,761円（1口当たり123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17期
	自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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17期
	平成29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等 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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29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	△36,182,664	91,428,313
合計	△36,182,664	91,428,313

（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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29年1月20日現在
1口当たり純資産額	9,823円	13,186円

平成29年1月期（平成28年7月21日～平成29年1月20日）決算短信

平成29年3月3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)岩本 信之
 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29年4月13日
 分配金支払開始日 平成29年2月28日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月21日～平成29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	%
29年 1月期	268	(99.4)	1	(0.6)	270	(100.0)
28年 7月期	246	(99.4)	1	(0.6)	247	(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
29年 1月期	9	—	—	9
28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
29年 1月期	271	1	270	29,664
28年 7月期	249	1	247	27,216

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	141
28年 7月期	163

(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16期	第17期
	平成28年7月20日現在	平成29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	2,727,867	2,830,018
株式	246,375,800	268,281,300
派生商品評価勘定	—	52,142
未収入金	186,460	47,534
未収配当金	144,600	350,300
前払金	15,300	—
差入委託証拠金	123,000	132,000
流動資産合計	249,573,027	271,693,294
資産合計	249,573,027	271,693,294
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,258	—
前受金	—	94,500
未払金	9,616	—
未払収益分配金	1,483,789	1,283,523
未払受託者報酬	69,605	68,421
未払委託者報酬	181,048	177,978
その他未払費用	77,065	37,820
流動負債合計	1,828,381	1,662,242
負債合計	1,828,381	1,662,242
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(△)	19,623,466	41,909,872
(分配準備積立金)	145,392	358,086
元本等合計	247,744,646	270,031,052
純資産合計	247,744,646	270,031,052
負債純資産合計	249,573,027	271,693,294

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,644,070	1,781,000
受取利息	92	—
有価証券売買等損益	△3,101,116	21,658,476
派生商品取引等損益	△22,370	415,236
その他収益	61	147
営業収益合計	△1,479,263	23,854,859
営業費用		
支払利息	194	373
受託者報酬	69,605	68,421
委託者報酬	181,048	177,978
その他費用	38,823	38,158
営業費用合計	289,670	284,930
営業利益又は営業損失 (△)	△1,768,933	23,569,929
経常利益又は経常損失 (△)	△1,768,933	23,569,929
当期純利益又は当期純損失 (△)	△1,768,933	23,569,929
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	22,876,188	19,623,466
分配金 ※1	1,483,789	1,283,523
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	19,623,466	41,909,872

(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 17 期	
	自 平成 28 年 7 月 21 日	至 平成 29 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 16 期	第 17 期
	平成 28 年 7 月 20 日現在	平成 29 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 16 期	第 17 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 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 (1, 644, 029 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 (1, 780, 774 円) 及び分配準備

	積立金(274,628円)の合計額から、経費(289,476円)を控除して計算される分配対象額は1,629,181円（1口当たり178円）であり、うち1,483,789円（1口当たり163円）を分配金額としております。	積立金(145,392円)の合計額から、経費(284,557円)を控除して計算される分配対象額は1,641,609円（1口当たり180円）であり、うち1,283,523円（1口当たり141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17期
	自 平成28年7月21日 至 平成29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等であり、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17期
	平成29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等 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16期 平成28年7月20日現在	第17期 平成29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	△3,321,720	21,672,679
合計	△3,321,720	21,672,679

(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16期 平成28年7月20日 現在				第17期 平成29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	1,338,650	—	1,331,500	△7,150	1,484,250	—	1,536,500	52,250
合計	1,338,650	—	1,331,500	△7,150	1,484,250	—	1,536,500	52,250

(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17期 自 平成28年7月21日 至 平成29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 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在	第 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	27,216 円	29,664 円