

平成 30 年 3 月 2 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 30 年 1 月期 (平成 29 年 7 月 21 日～平成 30 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 30 年 1 月期 (平成 29 年 7 月 21 日～平成 30 年 1 月 20 日) 決算短信をご報告します。

記

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30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	689	(100.0)	△0	(△0.0)	689	(100.0)
29年 7月期	651	(99.2)	5	(0.8)	656	(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
30年 1月期	19	—	—	19
29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
30年 1月期	699	9	689	35,432
29年 7月期	662	6	656	33,717

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	448
29年 7月期	282

(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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	7,502,558	2,949,300
株式 ※2	651,094,900	689,691,200
派生商品評価勘定	83,076	—
未収入金	61,902	2,396,715
未収配当金	3,852,000	4,263,750
流動資産合計	662,594,436	699,300,965
資産合計	662,594,436	699,300,965
負債の部		
流動負債		
前受金	89,700	199,900
未払収益分配金	5,488,566	8,719,424
未払受託者報酬	168,556	183,459
未払委託者報酬	438,328	477,096
未払利息	—	4
その他未払費用	166,303	101,694
流動負債合計	6,351,453	9,681,577
負債合計	6,351,453	9,681,577
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(△)	327,123,653	360,500,058
(分配準備積立金)	3,854,776	19,124
元本等合計	656,242,983	689,619,388
純資産合計	656,242,983	689,619,388
負債純資産合計	662,594,436	699,300,965

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,268,750	5,647,850
有価証券売買等損益	68,120,552	36,461,327
派生商品取引等損益	475,608	750,730
その他収益	15	227
営業収益合計	74,864,925	42,860,134
営業費用		
支払利息	1,204	1,166
受託者報酬	168,556	183,459
委託者報酬	438,328	477,096
その他費用	94,258	102,584
営業費用合計	702,346	764,305
営業利益	74,162,579	42,095,829
経常利益	74,162,579	42,095,829
当期純利益	74,162,579	42,095,829
期首剰余金又は期首欠損金(△)	258,449,640	327,123,653
分配金 ※1	5,488,566	8,719,424
期末剰余金又は期末欠損金(△)	327,123,653	360,500,058

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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 50,412,500 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 49,775,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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 （6,267,561円）及び分配準備積立金（3,776,923円）の合計額から、経費（701,142円）を控除して計算される分配対象額は9,343,342円（1口当たり480円）であり、うち5,488,566円（1口当たり282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 （5,646,911円）及び分配準備積立金（3,854,776円）の合計額から、経費（763,139円）を控除して計算される分配対象額は8,738,548円（1口当たり448円）であり、うち8,719,424円（1口当たり448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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期 平成30年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表	<p>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</p>

計上額との差額	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) 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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	68,177,073	36,245,403
合計	68,177,073	36,245,403

(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18期 平成29年7月20日 現在				第19期 平成30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	4,805,100	—	4,888,500	83,400	—	—	—	—
合計	4,805,100	—	4,888,500	83,400	—	—	—	—

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	33,717円	35,432円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	347	(99.4)	1	(0.6)	349	(100.0)
29年 7月期	232	(99.2)	1	(0.8)	234	(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
30年 1月期	19	—	—	19
29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
30年 1月期	352	3	349	18,191
29年 7月期	242	7	234	12,222

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	151
29年 7月期	153

(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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	3,388,495	2,187,968
株式 ※3	232,749,160	347,158,000
派生商品評価勘定	28,142	112,242
未収入金	5,987,214	2,766,245
未収配当金	248,600	243,900
流動資産合計	242,401,611	352,468,355
資産合計	242,401,611	352,468,355
負債の部		
流動負債		
前受金	40,500	100,850
未払金	4,545,800	—
未払収益分配金	2,936,682	2,898,294
未払受託者報酬	64,618	75,782
未払委託者報酬	168,075	197,094
未払利息	—	3
その他未払費用	61,411	41,969
流動負債合計	7,817,086	3,313,992
負債合計	7,817,086	3,313,992
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	△106,320,109	8,249,729
(分配準備積立金)	254,201	9,231
元本等合計	234,584,525	349,154,363
純資産合計	234,584,525	349,154,363
負債純資産合計	242,401,611	352,468,355

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,593,400	2,969,000
有価証券売買等損益	△12,589,219	114,300,822
派生商品取引等損益	119,206	513,986
その他収益	1	2
営業収益合計	△9,876,612	117,783,810
営業費用		
支払利息	344	516
受託者報酬	64,618	75,782
委託者報酬	168,075	197,094
その他費用	36,031	42,286
営業費用合計	269,068	315,678
営業利益又は営業損失(△)	△10,145,680	117,468,132
経常利益又は経常損失(△)	△10,145,680	117,468,132
当期純利益又は当期純損失(△)	△10,145,680	117,468,132
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△93,237,747	△106,320,109
分配金 ※1	2,936,682	2,898,294
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△106,320,109	8,249,729

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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106,320,109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 10,441,000 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 15,189,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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（2,593,057円）及び分配準備積立金（866,550円）の合計額から、経費（268,724円）を控除して計算される分配対象額は3,190,883円（1口当たり166円）であり、うち2,936,682円（1口当たり153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（2,968,486円）及び分配準備積立金（254,201円）の合計額から、経費（315,162円）を控除して計算される分配対象額は2,907,525円（1口当たり151円）であり、うち2,898,294円（1口当たり151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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	△12,369,363	112,626,187
合計	△12,369,363	112,626,187

(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18期 平成29年7月20日 現在				第19期 平成30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	1,601,250	—	1,629,500	28,250	1,777,650	—	1,890,000	112,350
合計	1,601,250	—	1,629,500	28,250	1,777,650	—	1,890,000	112,350

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	12,222円	18,191円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	1,640	(99.0)	15	(1.0)	1,656	(100.0)
29年 7月期	1,427	(99.4)	8	(0.6)	1,435	(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
30年 1月期	53	—	—	53
29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
30年 1月期	1,672	15	1,656	31,216
29年 7月期	1,454	18	1,435	27,053

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	244
29年 7月期	316

(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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	25,046,940	28,906,337
株式 ※2	1,427,543,800	1,640,733,200
派生商品評価勘定	133,960	1,009,136
未収入金	191,454	380,352
未収配当金	1,357,800	1,500,450
流動資産合計	1,454,273,954	1,672,529,475
資産合計	1,454,273,954	1,672,529,475
負債の部		
流動負債		
前受金	234,000	1,262,250
未払収益分配金	16,769,804	12,948,836
未払受託者報酬	354,662	416,574
未払委託者報酬	922,162	1,083,153
未払利息	—	39
その他未払費用	343,807	231,163
流動負債合計	18,624,435	15,942,015
負債合計	18,624,435	15,942,015
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(△)	689,287,103	910,225,044
(分配準備積立金)	1,365,563	23,857
元本等合計	1,435,649,519	1,656,587,460
純資産合計	1,435,649,519	1,656,587,460
負債純資産合計	1,454,273,954	1,672,529,475

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	18,401,700	13,344,900
有価証券売買等損益	165,167,118	219,414,075
派生商品取引等損益	977,638	2,865,572
その他収益	103	185
営業収益合計	184,546,559	235,624,732
営業費用		
支払利息	3,133	5,116
受託者報酬	354,662	416,574
委託者報酬	922,162	1,083,153
その他費用	198,481	233,112
営業費用合計	1,478,438	1,737,955
営業利益	183,068,121	233,886,777
経常利益	183,068,121	233,886,777
当期純利益	183,068,121	233,886,777
期首剰余金又は期首欠損金(△)	522,988,786	689,287,103
分配金 ※1	16,769,804	12,948,836
期末剰余金又は期末欠損金(△)	689,287,103	910,225,044

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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 17,511,000 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 19,989,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日

<p>※1 分配金の計算過程</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 (18,398,670円)及び分配準備積立金(1,212,002円)の合計額から、経費(1,475,305円)を控除して計算される分配対象額は18,135,367円(1口当たり341円)であり、うち16,769,804円(1口当たり316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 (13,339,969円)及び分配準備積立金(1,365,563円)の合計額から、経費(1,732,839円)を控除して計算される分配対象額は12,972,693円(1口当たり244円)であり、うち12,948,836円(1口当たり244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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期 平成30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

	<p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	164,624,904	217,731,545
合計	164,624,904	217,731,545

(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18期 平成29年7月20日 現在				第19期 平成30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	8,013,000	—	8,147,500	134,500	14,110,000	—	15,120,000	1,010,000
合計	8,013,000	—	8,147,500	134,500	14,110,000	—	15,120,000	1,010,000

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	27,053円	31,216円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	1,078	(99.4)	6	(0.6)	1,084	(100.0)
29年 7月期	940	(99.5)	5	(0.5)	945	(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
30年 1月期	37	—	—	37
29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
30年 1月期	1,094	10	1,084	29,215
29年 7月期	953	8	945	25,480

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	223
29年 7月期	190

(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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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	11,575,386	13,441,164
株式 ※2	940,486,440	1,078,125,550
派生商品評価勘定	85,326	278,676
未収入金	109,036	430,886
未収配当金	1,511,700	1,901,300
流動資産合計	953,767,888	1,094,177,576
資産合計	953,767,888	1,094,177,576
負債の部		
流動負債		
前受金	128,550	626,500
未払収益分配金	7,050,710	8,275,307
未払受託者報酬	231,141	272,316
未払委託者報酬	601,022	708,087
未払利息	—	18
その他未払費用	220,119	151,041
流動負債合計	8,231,542	10,033,269
負債合計	8,231,542	10,033,269
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 (△)	449,797,215	588,405,176
(分配準備積立金)	1,514,936	10,706
元本等合計	945,536,346	1,084,144,307
純資産合計	945,536,346	1,084,144,307
負債純資産合計	953,767,888	1,094,177,576

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	7,905,840	7,905,990
有価証券売買等損益	131,513,130	138,518,199
派生商品取引等損益	640,750	1,593,992
その他収益	32	56
営業収益合計	140,059,752	148,018,237
営業費用		
支払利息	1,583	2,239
受託者報酬	231,141	272,316
委託者報酬	601,022	708,087
その他費用	129,294	152,327
営業費用合計	963,040	1,134,969
営業利益	139,096,712	146,883,268
経常利益	139,096,712	146,883,268
当期純利益	139,096,712	146,883,268
期首剰余金又は期首欠損金(△)	317,751,213	449,797,215
分配金 ※1	7,050,710	8,275,307
期末剰余金又は期末欠損金(△)	449,797,215	588,405,176

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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 14,343,000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 16,276,000円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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（7,904,289円）及び分配準備積立金（1,622,814円）の合計額から、経費（961,457円）を控除して計算される分配対象額は8,565,646円（1口当たり230円）であり、うち7,050,710円（1口当たり190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（7,903,807円）及び分配準備積立金（1,514,936円）の合計額から、経費（1,132,730円）を控除して計算される分配対象額は8,286,013円（1口当たり223円）であり、うち8,275,307円（1口当たり223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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期
	平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	131,309,835	136,927,586
合計	131,309,835	136,927,586

(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18期				第19期			
	平成29年7月20日 現在				平成30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	4,802,850	—	4,888,500	85,650	5,391,000	—	5,670,000	279,000
合計	4,802,850	—	4,888,500	85,650	5,391,000	—	5,670,000	279,000

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	25,480円	29,215円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	623	(99.1)	5	(0.9)	628	(100.0)
29年 7月期	573	(99.1)	5	(0.9)	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
30年 1月期	28	—	—	28
29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
30年 1月期	636	7	628	22,266
29年 7月期	585	6	579	20,509

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	230
29年 7月期	199

(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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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	10,606,914	11,696,764
株式 ※2	573,974,650	623,340,600
派生商品評価勘定	98,676	378,426
未収入金	66,568	253,568
未収配当金	847,000	827,000
流動資産合計	585,593,808	636,496,358
資産合計	585,593,808	636,496,358
負債の部		
流動負債		
前受金	125,000	573,750
未払収益分配金	5,619,362	6,494,740
未払受託者報酬	152,914	164,210
未払委託者報酬	397,650	426,986
未払利息	—	16
その他未払費用	153,519	91,021
流動負債合計	6,448,445	7,750,723
負債合計	6,448,445	7,750,723
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 (△)	207,985,091	257,585,363
(分配準備積立金)	871,531	28,162
元本等合計	579,145,363	628,745,635
純資産合計	579,145,363	628,745,635
負債純資産合計	585,593,808	636,496,358

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,284,150	6,336,450
有価証券売買等損益	25,697,637	49,146,951
派生商品取引等損益	526,890	1,296,690
営業収益合計	32,508,677	56,780,091
営業費用		
支払利息	1,826	2,076
受託者報酬	152,914	164,210
委託者報酬	397,650	426,986
その他費用	85,493	91,807
営業費用合計	637,883	685,079
営業利益	31,870,794	56,095,012
経常利益	31,870,794	56,095,012
当期純利益	31,870,794	56,095,012
期首剰余金又は期首欠損金(△)	181,733,659	207,985,091
分配金 ※1	5,619,362	6,494,740
期末剰余金又は期末欠損金(△)	207,985,091	257,585,363

(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 19 期	
	自 平成 29 年 7 月 21 日	至 平成 30 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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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 15,654,000 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 17,082,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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 （6,282,324円）及び分配準備積立金（844,626円）の合計額から、経費（636,057円）を控除して計算される分配対象額は 6,490,893円（1口当たり229円）であり、うち5,619,362円（1口当たり199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 （6,334,374円）及び分配準備積立金（871,531円）の合計額から、経費（683,003円）を控除して計算される分配対象額は 6,522,902円（1口当たり230円）であり、うち6,494,740円（1口当たり230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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期
	平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	26,011,182	48,199,228
合計	26,011,182	48,199,228

(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18期				第19期			
	平成29年7月20日 現在				平成30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	4,789,500	—	4,888,500	99,000	5,291,250	—	5,670,000	378,750
合計	4,789,500	—	4,888,500	99,000	5,291,250	—	5,670,000	378,750

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	20,509円	22,266円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	849	(99.7)	2	(0.3)	852	(100.0)
29年 7月期	714	(99.6)	3	(0.4)	717	(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
30年 1月期	33	—	—	33
29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
30年 1月期	865	12	852	25,622
29年 7月期	729	12	717	21,554

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	335
29年 7月期	319

(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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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	13,643,243	12,927,205
株式 ※2	714,324,450	849,895,850
派生商品評価勘定	11,888	114,176
未収入金	117,824	549,432
未収配当金	1,858,650	1,958,550
流動資産合計	729,956,055	865,445,213
資産合計	729,956,055	865,445,213
負債の部		
流動負債		
前受金	89,520	584,000
未払金	933,408	—
未払収益分配金	10,617,915	11,150,475
未払受託者報酬	190,696	210,848
未払委託者報酬	495,867	548,249
未払利息	—	17
その他未払費用	190,141	116,935
流動負債合計	12,517,547	12,610,524
負債合計	12,517,547	12,610,524
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 (△)	222,656,983	358,053,164
(分配準備積立金)	1,891,423	1,529
元本等合計	717,438,508	852,834,689
純資産合計	717,438,508	852,834,689
負債純資産合計	729,956,055	865,445,213

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	11,505,133	10,139,450
有価証券売買等損益	△21,914,517	135,768,423
派生商品取引等損益	376,742	1,517,652
その他収益	—	10
営業収益合計	△10,032,642	147,425,535
営業費用		
支払利息	2,072	1,874
受託者報酬	190,696	210,848
委託者報酬	495,867	548,249
その他費用	106,651	117,908
営業費用合計	795,286	878,879
営業利益又は営業損失(△)	△10,827,928	146,546,656
経常利益又は経常損失(△)	△10,827,928	146,546,656
当期純利益又は当期純損失(△)	△10,827,928	146,546,656
期首剰余金又は期首欠損金(△)	244,102,826	222,656,983
分配金 ※1	10,617,915	11,150,475
期末剰余金又は期末欠損金(△)	222,656,983	358,053,164

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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 12,300,000 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 15,478,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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 （11,503,061円）及び分配準備積立金（1,799,491円）の合計額から、経費（793,214円）を控除して計算される分配対象額は12,509,338円（1口当たり375円）であり、うち10,617,915円（1口当たり319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 （10,137,586円）及び分配準備積立金（1,891,423円）の合計額から、経費（877,005円）を控除して計算される分配対象額は11,152,004円（1口当たり335円）であり、うち11,150,475円（1口当たり335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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期
	平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	△20,618,919	134,735,732
合計	△20,618,919	134,735,732

(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18期				第19期			
	平成29年7月20日 現在				平成30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	2,957,680	—	2,970,000	12,320	2,446,000	—	2,560,500	114,500
合計	2,957,680	—	2,970,000	12,320	2,446,000	—	2,560,500	114,500

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	21,554円	25,622円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	291	(99.8)	0	(0.2)	291	(100.0)
29年 7月期	250	(99.7)	0	(0.3)	251	(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
30年 1月期	10	—	—	10
29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
30年 1月期	294	2	291	27,026
29年 7月期	254	3	251	23,246

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	187
29年 7月期	255

(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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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	3,686,255	2,890,855
株式 ※3	250,488,000	291,396,650
未収入金	58,168	106,684
未収配当金	2,300	17,000
流動資産合計	254,234,723	294,411,189
資産合計	254,234,723	294,411,189
負債の部		
流動負債		
前受金	37,600	94,900
未払収益分配金	2,755,020	2,020,348
未払受託者報酬	64,021	73,134
未払委託者報酬	166,557	190,219
未払利息	—	3
その他未払費用	61,561	40,442
流動負債合計	3,084,759	2,419,046
負債合計	3,084,759	2,419,046
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	369,961,372	369,961,372
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	△118,811,408	△77,969,229
(分配準備積立金)	10,866	5,917
元本等合計	251,149,964	291,992,143
純資産合計	251,149,964	291,992,143
負債純資産合計	254,234,723	294,411,189

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 18 期	第 19 期
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,006,100	2,319,900
有価証券売買等損益	12,731,174	40,614,160
派生商品取引等損益	157,486	232,968
その他収益	9	15
営業収益合計	15,894,769	43,167,043
営業費用		
支払利息	243	382
受託者報酬	64,021	73,134
委託者報酬	166,557	190,219
その他費用	35,713	40,781
営業費用合計	266,534	304,516
営業利益	15,628,235	42,862,527
経常利益	15,628,235	42,862,527
当期純利益	15,628,235	42,862,527
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△131,684,623	△118,811,408
分配金 ※1	2,755,020	2,020,348
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△118,811,408	△77,969,229

(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 19 期	
	自 平成 29 年 7 月 21 日	至 平成 30 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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 年 1 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	369,961,372 円	369,961,372 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	10,804 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 118,811,408 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 77,969,229 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 18,694,500 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 20,436,500 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 18 期	第 19 期
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 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 (3,005,866 円) 及び分配準備積立金(26,311 円)の合計額から、経費(266,291 円)を控除して計算される分配対象額は 2,765,886 円 (1 口当たり 256 円) であり、うち 2,755,020 円 (1 口当たり 255 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 (2,319,533 円) 及び分配準備積立金(10,866 円)の合計額から、経費(304,134 円)を控除して計算される分配対象額は 2,026,265 円 (1 口当たり 187 円) であり、うち 2,020,348 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 19 期 自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 19 期 平成 30 年 1 月 20 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表	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

計上額との差額	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 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在	第 19 期 平成 30 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	12,756,281	40,011,930
合計	12,756,281	40,011,930

(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 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在	第 19 期 平成 30 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 19 期 自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 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 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在	第 19 期 平成 30 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	23,246 円	27,026 円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	874	(100.5)	△4	(△0.5)	870	(100.0)
29年 7月期	679	(99.8)	1	(0.2)	680	(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
30年 1月期	19	—	—	19
29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
30年 1月期	877	6	870	45,735
29年 7月期	687	6	680	35,752

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	314
29年 7月期	326

(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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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	1,702,744	1,541,075
株式 ※2	679,217,050	874,729,100
未収入金	6,017,853	—
未収配当金	629,800	1,172,700
流動資産合計	687,567,447	877,442,875
資産合計	687,567,447	877,442,875
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	6,205,736	5,977,304
未払受託者報酬	173,507	203,655
未払委託者報酬	451,195	529,579
未払利息	—	2
その他未払費用	166,734	112,955
流動負債合計	6,997,172	6,823,495
負債合計	6,997,172	6,823,495
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 (△)	248,510,183	438,559,288
(分配準備積立金)	638,964	14,182
元本等合計	680,570,275	870,619,380
純資産合計	680,570,275	870,619,380
負債純資産合計	687,567,447	877,442,875

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 18 期	第 19 期
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	6,699,700	6,200,200
有価証券売買等損益	50,845,299	190,360,251
派生商品取引等損益	317,372	313,636
その他収益	64	78
営業収益合計	57,862,435	196,874,165
営業費用		
支払利息	811	637
受託者報酬	173,507	203,655
委託者報酬	451,195	529,579
その他費用	96,998	113,885
営業費用合計	722,511	847,756
営業利益	57,139,924	196,026,409
経常利益	57,139,924	196,026,409
当期純利益	57,139,924	196,026,409
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	197,575,995	248,510,183
分配金 ※1	6,205,736	5,977,304
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	248,510,183	438,559,288

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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
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 1,734,800 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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 （6,698,953円）及び分配準備積立金（867,447円）の合計額から、経費（721,700円）を控除して計算される分配対象額は 6,844,700円（1口当たり359円）であり、うち6,205,736円（1口当たり326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 （6,199,641円）及び分配準備積立金（638,964円）の合計額から、経費（847,119円）を控除して計算される分配対象額は 5,991,486円（1口当たり314円）であり、うち5,977,304円（1口当たり314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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期 平成30年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表	<p>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</p>

計上額との差額	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) 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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	51,253,776	188,698,683
合計	51,253,776	188,698,683

(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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	35,752円	45,735円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	2,078	(99.8)	4	(0.2)	2,082	(100.0)
29年 7月期	1,687	(99.8)	3	(0.2)	1,690	(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
30年 1月期	95	—	—	95
29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
30年 1月期	2,098	15	2,082	21,903
29年 7月期	1,704	13	1,690	17,779

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	137
29年 7月期	122

(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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	12,897,501	16,783,874
株式 ※2	1,687,108,000	2,078,585,200
派生商品評価勘定	41,284	175,884
未収入金	2,087,675	773,188
未収配当金	2,158,200	2,501,000
流動資産合計	1,704,292,660	2,098,819,146
資産合計	1,704,292,660	2,098,819,146
負債の部		
流動負債		
前受金	150,000	860,800
未払収益分配金	11,601,468	13,027,878
未払受託者報酬	418,128	501,563
未払委託者報酬	1,087,184	1,304,130
未払利息	—	23
その他未払費用	400,546	278,422
流動負債合計	13,657,326	15,972,816
負債合計	13,657,326	15,972,816
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(△)	403,538,044	795,749,040
(分配準備積立金)	2,188,222	11,818
元本等合計	1,690,635,334	2,082,846,330
純資産合計	1,690,635,334	2,082,846,330
負債純資産合計	1,704,292,660	2,098,819,146

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	13,397,284	12,940,355
有価証券売買等損益	209,029,329	392,341,488
派生商品取引等損益	782,696	2,045,912
その他収益	11	20
営業収益合計	223,209,320	407,327,775
営業費用		
支払利息	1,740	2,477
受託者報酬	418,128	501,563
委託者報酬	1,087,184	1,304,130
その他費用	302,850	280,731
営業費用合計	1,809,902	2,088,901
営業利益	221,399,418	405,238,874
経常利益	221,399,418	405,238,874
当期純利益	221,399,418	405,238,874
期首剰余金又は期首欠損金(△)	193,740,094	403,538,044
分配金 ※1	11,601,468	13,027,878
期末剰余金又は期末欠損金(△)	403,538,044	795,749,040

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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 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 22,484,000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 29,220,000円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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（13,395,555円）及び分配準備積立金（2,202,297円）の合計額から、経費（1,808,162円）を控除して計算される分配対象額は13,789,690円（1口当たり145円）であり、うち11,601,468円（1口当たり122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（12,937,898円）及び分配準備積立金（2,188,222円）の合計額から、経費（2,086,424円）を控除して計算される分配対象額は13,039,696円（1口当たり137円）であり、うち13,027,878円（1口当たり137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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	208,590,089	391,603,899
合計	208,590,089	391,603,899

(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18期 平成29年7月20日 現在				第19期 平成30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	3,217,500	—	3,259,000	41,500	3,603,900	—	3,780,000	176,100
合計	3,217,500	—	3,259,000	41,500	3,603,900	—	3,780,000	176,100

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	17,779円	21,903円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	733	(99.8)	1	(0.2)	734	(100.0)
29年 7月期	676	(99.8)	1	(0.2)	677	(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
30年 1月期	32	—	—	32
29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
30年 1月期	740	6	734	22,771
29年 7月期	684	6	677	21,000

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	163
29年 7月期	179

(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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	2,252,571	1,475,576
株式 ※2	676,419,000	733,398,080
未収入金	5,119,560	5,200,692
未収配当金	320,496	694,739
流動資産合計	684,111,627	740,769,087
資産合計	684,111,627	740,769,087
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,775,435	5,259,195
未払受託者報酬	169,274	191,936
未払委託者報酬	440,209	499,093
未払利息	—	2
その他未払費用	165,159	106,415
流動負債合計	6,550,077	6,056,641
負債合計	6,550,077	6,056,641
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(△)	305,546,100	362,696,996
(分配準備積立金)	334,895	23,211
元本等合計	677,561,550	734,712,446
純資産合計	677,561,550	734,712,446
負債純資産合計	684,111,627	740,769,087

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,188,930	5,746,417
有価証券売買等損益	70,425,802	57,148,944
派生商品取引等損益	325,256	313,636
その他収益	24,203	164
営業収益合計	76,964,191	63,209,161
営業費用		
支払利息	703	706
受託者報酬	169,274	191,936
委託者報酬	440,209	499,093
その他費用	94,635	107,335
営業費用合計	704,821	799,070
営業利益	76,259,370	62,410,091
経常利益	76,259,370	62,410,091
当期純利益	76,259,370	62,410,091
期首剰余金又は期首欠損金(△)	235,062,165	305,546,100
分配金 ※1	5,775,435	5,259,195
期末剰余金又は期末欠損金(△)	305,546,100	362,696,996

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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 2,010,100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 1,962,000円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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 (6,212,430円)及び分配準備積立金(602,018円)の合計額から、経費(704,118円)を控除して計算される分配対象額は 6,110,330円(1口当たり189円)であり、うち5,775,435円(1口当たり179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 (5,745,875円)及び分配準備積立金(334,895円)の合計額から、経費(798,364円)を控除して計算される分配対象額は 5,282,406円(1口当たり163円)であり、うち5,259,195円(1口当たり163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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期 平成30年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表	<p>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</p>

計上額との差額	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) 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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	69,113,539	55,547,266
合計	69,113,539	55,547,266

(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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	21,000円	22,771円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	230	(99.0)	2	(1.0)	232	(100.0)
29年 7月期	241	(99.3)	1	(0.7)	243	(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
30年 1月期	32	—	—	32
29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
30年 1月期	235	2	232	7,163
29年 7月期	246	2	243	7,504

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	61
29年 7月期	74

(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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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	4,445,453	4,574,808
株式 ※3	241,829,400	230,174,250
派生商品評価勘定	32,892	126,142
未収入金	18,534	125,534
未収配当金	14,200	11,900
流動資産合計	246,340,479	235,012,634
資産合計	246,340,479	235,012,634
負債の部		
流動負債		
前受金	34,750	229,500
未払収益分配金	2,402,410	1,980,365
未払受託者報酬	64,067	65,461
未払委託者報酬	166,626	170,283
未払利息	—	6
その他未払費用	62,949	36,168
流動負債合計	2,730,802	2,481,783
負債合計	2,730,802	2,481,783
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	△166,163,553	△177,242,379
(分配準備積立金)	16,055	8,130
元本等合計	243,609,677	232,530,851
純資産合計	243,609,677	232,530,851
負債純資産合計	246,340,479	235,012,634

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 18 期	第 19 期
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,662,800	2,245,400
有価証券売買等損益	1,120,834	△11,580,237
派生商品取引等損益	126,352	509,336
営業収益合計	3,909,986	△8,825,501
営業費用		
支払利息	492	718
受託者報酬	64,067	65,461
委託者報酬	166,626	170,283
その他費用	35,715	36,498
営業費用合計	266,900	272,960
営業利益又は営業損失 (△)	3,643,086	△9,098,461
経常利益又は経常損失 (△)	3,643,086	△9,098,461
当期純利益又は当期純損失 (△)	3,643,086	△9,098,461
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△167,404,229	△166,163,553
分配金 ※1	2,402,410	1,980,365
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△166,163,553	△177,242,379

(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 19 期	
	自 平成 29 年 7 月 21 日	至 平成 30 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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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 166,163,553 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 177,242,379 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 4,370,000 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 5,575,500 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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 (2,662,308円)及び分配準備積立金(22,565円)の合計額から、経費(266,408円)を控除して計算される分配対象額は 2,418,465円(1口当たり74円)であり、うち2,402,410円(1口当たり74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 (2,244,682円)及び分配準備積立金(16,055円)の合計額から、経費(272,242円)を控除して計算される分配対象額は 1,988,495円(1口当たり61円)であり、うち1,980,365円(1口当たり61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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期
	平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	1,115,358	△11,555,675
合計	1,115,358	△11,555,675

(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18期				第19期			
	平成29年7月20日 現在				平成30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	1,596,500	—	1,629,500	33,000	1,763,750	—	1,890,000	126,250
合計	1,596,500	—	1,629,500	33,000	1,763,750	—	1,890,000	126,250

(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 19 期 自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 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 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在	第 19 期 平成 30 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	7,504 円	7,163 円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	465	(99.6)	2	(0.4)	468	(100.0)
29年 7月期	415	(99.5)	2	(0.5)	417	(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
30年 1月期	24	—	—	24
29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
30年 1月期	470	2	468	19,267
29年 7月期	421	3	417	17,207

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	79
29年 7月期	116

(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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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	5,378,067	4,454,723
株式 ※2	415,893,200	465,962,900
派生商品評価勘定	29,692	100,092
未収入金	64,168	100,484
未収配当金	3,500	11,500
流動資産合計	421,368,627	470,629,699
資産合計	421,368,627	470,629,699
負債の部		
流動負債		
前受金	65,400	177,400
未払収益分配金	2,817,872	1,919,068
未払受託者報酬	109,556	118,826
未払委託者報酬	284,861	309,006
未払利息	—	6
その他未払費用	108,012	65,809
流動負債合計	3,385,701	2,590,115
負債合計	3,385,701	2,590,115
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 (△)	68,518,214	118,574,872
(分配準備積立金)	15,978	5,829
元本等合計	417,982,926	468,039,584
純資産合計	417,982,926	468,039,584
負債純資産合計	421,368,627	470,629,699

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 18 期	第 19 期
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,240,675	2,360,825
有価証券売買等損益	4,824,097	49,556,121
派生商品取引等損益	315,804	510,686
その他収益	40,158	43,023
営業収益合計	8,420,734	52,470,655
営業費用		
支払利息	638	722
受託者報酬	109,556	118,826
委託者報酬	284,861	309,006
その他費用	61,180	66,375
営業費用合計	456,235	494,929
営業利益	7,964,499	51,975,726
経常利益	7,964,499	51,975,726
当期純利益	7,964,499	51,975,726
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	63,371,587	68,518,214
分配金 ※1	2,817,872	1,919,068
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	68,518,214	118,574,872

(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 19 期	
	自 平成 29 年 7 月 21 日	至 平成 30 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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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 3,935,000 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 4,359,500 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 18 期	第 19 期
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 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 (3,280,195 円) 及び分配準備積立金(9,252 円)の合計額から、経費(455,597 円)を控除して計算される分配対象額は 2,833,850 円 (1 口当たり 116 円) であり、うち 2,817,872 円 (1 口当たり 116 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 (2,403,126 円) 及び分配準備積立金(15,978 円)の合計額から、経費(494,207 円)を控除して計算される分配対象額は 1,924,897 円(1 口当たり 79 円) であり、うち 1,919,068 円 (1 口当たり 79 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 19 期 自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 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19期 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	5,024,234	49,256,113
合計	5,024,234	49,256,113

(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18期 平成29年7月20日 現在				第19期 平成30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	1,599,700	—	1,629,500	29,800	1,789,800	—	1,890,000	100,200
合計	1,599,700	—	1,629,500	29,800	1,789,800	—	1,890,000	100,200

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	17,207円	19,267円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	903	(100.0)	0	(0.0)	903	(100.0)
29年 7月期	729	(100.0)	0	(0.0)	729	(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
30年 1月期	22	—	—	22
29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
30年 1月期	914	11	903	40,546
29年 7月期	741	11	729	32,749

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	456
29年 7月期	467

(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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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	7,356,781	11,122,863
株式 ※2	729,344,140	903,113,620
未収入金	4,142,319	—
未収配当金	160,450	189,550
流動資産合計	741,003,690	914,426,033
資産合計	741,003,690	914,426,033
負債の部		
流動負債		
前受金	87,450	—
未払収益分配金	10,404,760	10,159,680
未払受託者報酬	188,771	217,319
未払委託者報酬	490,905	565,078
未払利息	—	15
その他未払費用	182,346	120,530
流動負債合計	11,354,232	11,062,622
負債合計	11,354,232	11,062,622
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 (△)	100,885,578	274,599,531
(分配準備積立金)	169,407	22,011
元本等合計	729,649,458	903,363,411
純資産合計	729,649,458	903,363,411
負債純資産合計	741,003,690	914,426,033

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	11,204,070	10,917,208
有価証券売買等損益	42,169,605	173,861,349
派生商品取引等損益	331,688	—
その他収益	84	146
営業収益合計	53,705,447	184,778,703
営業費用		
支払利息	869	1,152
受託者報酬	188,771	217,319
委託者報酬	490,905	565,078
その他費用	105,557	121,521
営業費用合計	786,102	905,070
営業利益	52,919,345	183,873,633
経常利益	52,919,345	183,873,633
当期純利益	52,919,345	183,873,633
期首剰余金又は期首欠損金(△)	58,370,993	100,885,578
分配金 ※1	10,404,760	10,159,680
期末剰余金又は期末欠損金(△)	100,885,578	274,599,531

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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 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 4,039,500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 5,134,500円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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（11,203,285円）及び分配準備積立金（156,115円）の合計額か	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（10,916,202円）及び分配準備積立金（169,407円）の合計額か

	ら、経費(785,233円)を控除して計算される分配対象額は10,574,167円(1口当たり474円)であり、うち10,404,760円(1口当たり467円)を分配金額としております。	ら、経費(903,918円)を控除して計算される分配対象額は10,181,691円(1口当たり456円)であり、うち10,159,680円(1口当たり456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19期
	自 平成29年7月21日 至 平成30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19期
	平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	41,773,530	172,445,481
合計	41,773,530	172,445,481

（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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	32,749円	40,546円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	490	(99.8)	1	(0.2)	491	(100.0)
29年 7月期	430	(99.5)	2	(0.5)	432	(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
30年 1月期	21	—	—	21
29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
30年 1月期	494	3	491	22,616
29年 7月期	436	3	432	19,915

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	130
29年 7月期	134

(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 18 期	第 19 期
	平成 29 年 7 月 20 日現在	平成 30 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	5,428,281	4,170,969
株式 ※2	430,262,700	490,185,550
派生商品評価勘定	27,492	—
未収入金	66,768	215,068
未収配当金	263,800	186,300
流動資産合計	436,049,041	494,757,887
資産合計	436,049,041	494,757,887
負債の部		
流動負債		
前受金	65,300	190,500
未払収益分配金	2,910,480	2,823,600
未払受託者報酬	115,061	126,239
未払委託者報酬	299,227	328,286
未払利息	—	5
その他未払費用	113,575	69,948
流動負債合計	3,503,643	3,538,578
負債合計	3,503,643	3,538,578
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 (△)	200,640,958	259,314,869
(分配準備積立金)	269,555	4,301
元本等合計	432,545,398	491,219,309
純資産合計	432,545,398	491,219,309
負債純資産合計	436,049,041	494,757,887

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 18 期	第 19 期
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,503,300	3,083,550
有価証券売買等損益	13,126,973	58,357,853
派生商品取引等損益	322,938	581,312
その他収益	429	612
営業収益合計	16,953,640	62,023,327
営業費用		
支払利息	807	756
受託者報酬	115,061	126,239
委託者報酬	299,227	328,286
その他費用	64,264	70,535
営業費用合計	479,359	525,816
営業利益	16,474,281	61,497,511
経常利益	16,474,281	61,497,511
当期純利益	16,474,281	61,497,511
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	187,077,157	200,640,958
分配金 ※1	2,910,480	2,823,600
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	200,640,958	259,314,869

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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 444,900 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 453,800 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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 (3,502,922円)及び分配準備積立金(155,665円)の合計額から、経費(478,552円)を控除して計算される分配対象額は 3,180,035円(1口当たり146円)であり、うち2,910,480円(1口当たり134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 (3,083,406円)及び分配準備積立金(269,555円)の合計額から、経費(525,060円)を控除して計算される分配対象額は 2,827,901円(1口当たり130円)であり、うち2,823,600円(1口当たり130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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期 平成30年1月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表	<p>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</p>

計上額との差額	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) 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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	13,075,065	58,079,289
合計	13,075,065	58,079,289

(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18期 平成29年7月20日 現在				第19期 平成30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	1,601,900	—	1,629,500	27,600	—	—	—	—
合計	1,601,900	—	1,629,500	27,600	—	—	—	—

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	19,915円	22,616円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	1,148	(99.0)	11	(1.0)	1,159	(100.0)
29年 7月期	638	(98.6)	9	(1.4)	648	(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
30年 1月期	54	58	29	83
29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
30年 1月期	1,170	10	1,159	13,878
29年 7月期	657	9	648	11,903

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	99
29年 7月期	156

(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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	17,322,643	11,876,567
株式 ※3	638,733,890	1,148,705,760
派生商品評価勘定	144,460	899,460
未収入金	1,383,132	8,462,004
未収配当金	88,000	165,000
流動資産合計	657,672,125	1,170,108,791
資産合計	657,672,125	1,170,108,791
負債の部		
流動負債		
前受金	252,000	825,000
未払収益分配金	8,494,356	8,274,519
未払受託者報酬	176,076	252,832
未払委託者報酬	457,889	657,427
未払利息	—	16
その他未払費用	169,975	140,535
流動負債合計	9,550,296	10,150,329
負債合計	9,550,296	10,150,329
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	951,857,931	1,461,079,461
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△303,736,102	△301,120,999
(分配準備積立金)	128,971	9,626
元本等合計	648,121,829	1,159,958,462
純資産合計	648,121,829	1,159,958,462
負債純資産合計	657,672,125	1,170,108,791

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	9,243,550	9,209,075
有価証券売買等損益	△21,385,684	162,896,412
派生商品取引等損益	△422,920	1,547,840
その他収益	—	21
営業収益合計	△12,565,054	173,653,348
営業費用		
支払利息	3,922	2,249
受託者報酬	176,076	252,832
委託者報酬	457,889	657,427
その他費用	98,479	141,414
営業費用合計	736,366	1,053,922
営業利益又は営業損失(△)	△13,301,420	172,599,426
経常利益又は経常損失(△)	△13,301,420	172,599,426
当期純利益又は当期純損失(△)	△13,301,420	172,599,426
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△281,940,326	△303,736,102
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	150,733,476
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	150,733,476
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	312,443,280
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	312,443,280
分配金 ※1	8,494,356	8,274,519
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△303,736,102	△301,120,999

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	1,029,560,976 円
期中一部交換元本額	－円	520,339,446 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	54,451 口	83,581 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303,736,102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301,120,999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 5,713,500 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 7,041,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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（9,239,628円）及び分配準備積立金（116,143円）の合計額から、経費（732,444円）を控除して計算される分配対象額は8,623,327円（1口当たり158円）であり、うち8,494,356円（1口当たり156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（9,206,847円）及び分配準備積立金（128,971円）の合計額から、経費（1,051,673円）を控除して計算される分配対象額は8,284,145円（1口当たり99円）であり、うち8,274,519円（1口当たり99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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	△21,299,647	151,923,664
合計	△21,299,647	151,923,664

(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18期 平成29年7月20日 現在				第19期 平成30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	9,105,000	—	9,250,000	145,000	9,825,000	—	10,725,000	900,000
合計	9,105,000	—	9,250,000	145,000	9,825,000	—	10,725,000	900,000

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	11,903円	13,878円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	409	(99.9)	0	(0.1)	410	(100.0)
29年 7月期	362	(99.9)	0	(0.1)	362	(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
30年 1月期	27	—	—	27
29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
30年 1月期	414	4	410	15,023
29年 7月期	368	5	362	13,277

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	145
29年 7月期	201

(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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	6,422,575	4,707,237
株式	362,054,360	409,802,740
未収入金	—	106,885
流動資産合計	368,476,935	414,616,862
資産合計	368,476,935	414,616,862
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,488,707	3,959,515
未払受託者報酬	96,521	100,435
未払委託者報酬	251,045	261,189
未払利息	—	6
その他未払費用	92,383	55,601
流動負債合計	5,928,656	4,376,746
負債合計	5,928,656	4,376,746
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	△44,981,389	2,710,448
(分配準備積立金)	25,059	14,268
元本等合計	362,548,279	410,240,116
純資産合計	362,548,279	410,240,116
負債純資産合計	368,476,935	414,616,862

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,889,555	4,367,020
有価証券売買等損益	2,477,345	47,702,628
その他収益	6	19
営業収益合計	8,366,906	52,069,667
営業費用		
支払利息	519	599
受託者報酬	96,521	100,435
委託者報酬	251,045	261,189
その他費用	53,889	56,092
営業費用合計	401,974	418,315
営業利益	7,964,932	51,651,352
経常利益	7,964,932	51,651,352
当期純利益	7,964,932	51,651,352
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△47,457,614	△44,981,389
分配金 ※1	5,488,707	3,959,515
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△44,981,389	2,710,448

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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44,981,389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18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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 (5,889,042円)及び分配準備積立金(26,179円)の合計額から、経費(401,455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 (4,366,440円)及び分配準備積立金(25,059円)の合計額から、経費(417,716円)を控除し

	て計算される分配対象額は 5,513,766円（1口当たり201円）であり、うち5,488,707円（1口当たり201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 3,973,783円（1口当たり145円）であり、うち3,959,515円（1口当たり145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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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19期 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	2,480,790	47,581,284
合計	2,480,790	47,581,284

（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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30年1月20日現在
1口当たり純資産額	13,277円	15,023円

平成30年1月期（平成29年7月21日～平成30年1月20日）決算短信

平成30年3月2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30年 4月13日
 分配金支払開始日 平成30年 2月28日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（平成29年7月21日～平成30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	%
30年 1月期	301	(99.3)	2	(0.7)	303	(100.0)
29年 7月期	265	(99.4)	1	(0.6)	266	(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
30年 1月期	9	—	—	9
29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
30年 1月期	305	2	303	33,319
29年 7月期	269	2	266	29,312

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	220
29年 7月期	198

(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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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	3,364,935	3,768,666
株式	265,189,700	301,292,750
派生商品評価勘定	31,642	106,642
未収入金	354,765	106,534
未収配当金	179,450	438,250
差入委託証拠金	99,000	93,000
流動資産合計	269,219,492	305,805,842
資産合計	269,219,492	305,805,842
負債の部		
流動負債		
前受金	47,500	190,500
未払金	219,970	—
未払収益分配金	1,802,394	2,002,660
未払受託者報酬	71,119	74,547
未払委託者報酬	185,007	193,879
未払利息	—	5
その他未払費用	70,742	41,215
流動負債合計	2,396,732	2,502,806
負債合計	2,396,732	2,502,806
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(△)	38,701,580	75,181,856
(分配準備積立金)	181,626	1,008
元本等合計	266,822,760	303,303,036
純資産合計	266,822,760	303,303,036
負債純資産合計	269,219,492	305,805,842

(2) 損益及び剰余金計算書

	第18期	第19期
	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	1,922,140	2,132,460
有価証券売買等損益	△3,243,568	36,151,458
派生商品取引等損益	211,736	509,436
その他収益	65	156
営業収益合計	△1,109,627	38,793,510
営業費用		
支払利息	469	571
受託者報酬	71,119	74,547
委託者報酬	185,007	193,879
その他費用	39,676	41,577
営業費用合計	296,271	310,574
営業利益又は営業損失(△)	△1,405,898	38,482,936
経常利益又は経常損失(△)	△1,405,898	38,482,936
当期純利益又は当期純損失(△)	△1,405,898	38,482,936
期首剰余金又は期首欠損金(△)	41,909,872	38,701,580
分配金 ※1	1,802,394	2,002,660
期末剰余金又は期末欠損金(△)	38,701,580	75,181,856

(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19期	
	自 平成29年7月21日	至 平成30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18期	第19期
	平成29年7月20日現在	平成30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18期	第19期
	自 平成29年1月21日 至 平成29年7月20日	自 平成29年7月21日 至 平成30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 (1,921,736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 (2,132,045円) 及び分配準備

	積立金(358,086円)の合計額から、経費(295,802円)を控除して計算される分配対象額は1,984,020円（1口当たり217円）であり、うち1,802,394円（1口当たり198円）を分配金額としております。	積立金(181,626円)の合計額から、経費(310,003円)を控除して計算される分配対象額は2,003,668円（1口当たり220円）であり、うち2,002,660円（1口当たり220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19期
	自 平成29年7月21日 至 平成30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19期
	平成30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18期 平成29年7月20日現在	第19期 平成30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	△3,458,229	36,085,905
合計	△3,458,229	36,085,905

(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18期 平成29年7月20日 現在				第19期 平成30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	1,597,750	—	1,629,500	31,750	1,783,250	—	1,890,000	106,750
合計	1,597,750	—	1,629,500	31,750	1,783,250	—	1,890,000	106,750

(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19期 自 平成29年7月21日 至 平成30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 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在	第 19 期 平成 30 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	29,312 円	33,319 円