

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 岡田 美範  
(連絡先 03-5555-4946)

## 平成 31 年 1 月期 (平成 30 年 7 月 21 日～平成 31 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 31 年 1 月期 (平成 30 年 7 月 21 日～平成 31 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31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	591	(99.1)	5	(0.9)	596	(100.0)
30年 7月期	654	(99.3)	4	(0.7)	659	(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
31年 1月期	19	—	—	19
30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
31年 1月期	602	6	596	30,653
30年 7月期	666	7	659	33,861

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	266
30年 7月期	322

(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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,362,467	56,525
コール・ローン	5,234,744	6,701,433
株式 ※2	654,202,600	591,160,500
派生商品評価勘定	36,034	424,926
未収配当金	4,362,400	4,428,200
前払金	50,750	—
流動資産合計	666,248,995	602,771,584
資産合計	666,248,995	602,771,584
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	28,608	—
前受金	—	112,250
未払金	97,648	175,864
未払収益分配金	6,267,086	5,177,158
未払受託者報酬	176,655	168,263
未払委託者報酬	459,378	437,502
未払利息	—	30
その他未払費用	182,292	93,234
流動負債合計	7,211,667	6,164,301
負債合計	7,211,667	6,164,301
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(△)	329,917,998	267,487,953
(分配準備積立金)	3,592	19,251
元本等合計	659,037,328	596,607,283
純資産合計	659,037,328	596,607,283
負債純資産合計	666,248,995	602,771,584

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,987,880	5,894,780
有価証券売買等損益	△30,645,810	△62,108,728
派生商品取引等損益	79,282	△336,976
その他収益	105	123
営業収益合計	△23,578,543	△56,550,801
営業費用		
支払利息	1,297	1,981
受託者報酬	176,655	168,263
委託者報酬	459,378	437,502
その他費用	99,101	94,340
営業費用合計	736,431	702,086
営業損失(△)	△24,314,974	△57,252,887
経常損失(△)	△24,314,974	△57,252,887
当期純損失(△)	△24,314,974	△57,252,887
期首剰余金又は期首欠損金(△)	360,500,058	329,917,998
分配金 ※1	6,267,086	5,177,158
期末剰余金又は期末欠損金(△)	329,917,998	267,487,953

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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 45,020,000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 39,950,000円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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 （6,986,688円）及び分配準備積立金（19,124円）の合計額から、経費（735,134円）を控除して計算される分配対象額は 6,270,678円（1口当たり322円）であり、うち6,267,086円（1口当たり322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 （5,892,922円）及び分配準備積立金（3,592円）の合計額から、経費（700,105円）を控除して計算される分配対象額は 5,196,409円（1口当たり266円）であり、うち5,177,158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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	△30,590,565	△61,914,194
合計	△30,590,565	△61,914,194

(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20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	5,234,750	—	5,242,500	7,750	4,250,250	—	4,675,500	425,250
合計	5,234,750	—	5,242,500	7,750	4,250,250	—	4,675,500	425,250

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	33,861円	30,653円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	336	(99.5)	1	(0.5)	337	(100.0)
30年 7月期	435	(99.5)	2	(0.5)	437	(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
31年 1月期	25	61	61	25
30年 7月期	19	5	—	25

#### (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
31年 1月期	343	5	337	13,425
30年 7月期	441	3	437	17,402

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	177
30年 7月期	131

(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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,704,036	55,638
コール・ローン	3,775,793	6,596,335
株式 ※3	435,535,040	336,225,000
未収配当金	350,700	35,200
前払金	65,250	189,000
流動資産合計	441,430,819	343,101,173
資産合計	441,430,819	343,101,173
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,358	26,358
未払金	60,932	84,648
未払収益分配金	3,294,519	4,455,090
未払受託者報酬	88,221	153,063
未払委託者報酬	229,457	398,022
未払利息	—	30
その他未払費用	83,800	85,028
流動負債合計	3,783,287	5,202,239
負債合計	3,783,287	5,202,239
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	446,671,389	447,044,370
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	△9,023,857	△109,145,436
(分配準備積立金)	23,493	13,054
元本等合計	437,647,532	337,898,934
純資産合計	437,647,532	337,898,934
負債純資産合計	441,430,819	343,101,173

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	3,676,600	5,082,700
有価証券売買等損益	△6,533,797	△191,029,941
派生商品取引等損益	△29,096	△910,678
その他収益	—	1
営業収益合計	△2,886,293	△186,857,918
営業費用		
支払利息	740	1,208
受託者報酬	88,221	153,063
委託者報酬	229,457	398,022
その他費用	49,401	85,757
営業費用合計	367,819	638,050
営業損失(△)	△3,254,112	△187,495,968
経常損失(△)	△3,254,112	△187,495,968
当期純損失(△)	△3,254,112	△187,495,968
期首剰余金又は期首欠損金(△)	8,249,729	△9,023,857
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	165,492,120
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	165,492,120
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,724,955	73,662,641
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	73,662,641
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	10,724,955	—
分配金 ※1	3,294,519	4,455,090
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△9,023,857	△109,145,436

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31年1月20日現在
1. ※1 期首元本額	340,904,634 円	446,671,389 円
期中追加設定元本額	105,766,755 円	1,092,834,330 円
期中一部交換元本額	－円	1,092,461,349 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	25,149 口	25,170 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9,023,857 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109,145,436 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 13,821,500 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 10,830,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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（3,675,860円）及び分配準備積立金（9,231円）の合計額から、経費（367,079円）を控除して計算される分配対象額は3,318,012円（1口当たり131円）であり、うち3,294,519円（1口当たり131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（5,081,493円）及び分配準備積立金（23,493円）の合計額から、経費（636,842円）を控除して計算される分配対象額は4,468,144円（1口当たり177円）であり、うち4,455,090円（1口当たり177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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	△5,020,590	△148,483,349
合計	△5,020,590	△148,483,349

(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20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	1,773,750	—	1,747,500	△26,250	1,584,750	—	1,558,500	△26,250
合計	1,773,750	—	1,747,500	△26,250	1,584,750	—	1,558,500	△26,250

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	17,402円	13,425円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	1,394	(99.9)	1	(0.1)	1,395	(100.0)
30年 7月期	1,464	(99.9)	1	(0.1)	1,466	(100.0)

#### (2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
31年 1月期	53	6	—	59
30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
31年 1月期	1,414	18	1,395	23,299
30年 7月期	1,487	21	1,466	27,627

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	260
30年 7月期	363

(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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	6,573,476	130,107
コール・ローン	14,565,475	15,425,092
株式 ※2	1,464,409,000	1,394,145,000
派生商品評価勘定	—	146,892
未収入金	—	2,377,469
未収配当金	1,817,650	2,145,250
前払金	225,600	178,250
流動資産合計	1,487,591,201	1,414,548,060
資産合計	1,487,591,201	1,414,548,060
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,408	—
未払金	297,926	1,383,134
未払収益分配金	19,264,047	15,577,380
未払受託者報酬	403,843	401,221
未払委託者報酬	1,050,084	1,043,246
未払利息	—	72
その他未払費用	415,882	222,693
流動負債合計	21,455,190	18,627,746
負債合計	21,455,190	18,627,746
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	746,362,416	842,616,432
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	719,773,595	553,303,882
(分配準備積立金)	26,931	58,597
元本等合計	1,466,136,011	1,395,920,314
純資産合計	1,466,136,011	1,395,920,314
負債純資産合計	1,487,591,201	1,414,548,060

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	20,951,300	17,281,350
有価証券売買等損益	△189,624,383	△243,130,923
派生商品取引等損益	△830,140	△1,946,420
その他収益	66	203
営業収益合計	△169,503,157	△227,795,790
営業費用		
支払利息	3,702	2,923
受託者報酬	403,843	401,221
委託者報酬	1,050,084	1,043,246
その他費用	226,616	225,117
営業費用合計	1,684,245	1,672,507
営業損失(△)	△171,187,402	△229,468,297
経常損失(△)	△171,187,402	△229,468,297
当期純損失(△)	△171,187,402	△229,468,297
期首剰余金又は期首欠損金(△)	910,225,044	719,773,595
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	78,575,964
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	78,575,964
分配金 ※1	19,264,047	15,577,380
期末剰余金又は期末欠損金(△)	719,773,595	553,303,882

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	96,254,016 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	59,913 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 17,614,500 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 15,951,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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                      (20,947,664円)及び分配準備積立金(23,857円)の合計額から、経費(1,680,543円)を控除して計算される分配対象額は19,290,978円(1口当たり363円)であり、うち19,264,047円(1口当たり363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                      (17,278,630円)及び分配準備積立金(26,931円)の合計額から、経費(1,669,584円)を控除して計算される分配対象額は15,635,977円(1口当たり260円)であり、うち15,577,380円(1口当たり260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21期
	自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	△189,170,531	△239,424,418
合計	△189,170,531	△239,424,418

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	1,770,800	—	1,747,500	△23,300	1,411,500	—	1,558,500	147,000
合計	1,770,800	—	1,747,500	△23,300	1,411,500	—	1,558,500	147,000

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	27,627円	23,299円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	880	(99.6)	3	(0.4)	883	(100.0)
30年 7月期	1,020	(99.5)	5	(0.5)	1,025	(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
31年 1月期	37	—	—	37
30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
31年 1月期	893	9	883	23,811
30年 7月期	1,035	9	1,025	27,640

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	221
30年 7月期	223

(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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,129,895	85,420
コール・ローン	9,151,001	10,127,114
株式 ※2	1,020,161,740	880,198,010
派生商品評価勘定	17,142	141,642
未収配当金	1,860,500	2,341,300
前払金	137,500	254,250
流動資産合計	1,035,457,778	893,147,736
資産合計	1,035,457,778	893,147,736
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	54,716	41,608
未払金	155,330	219,830
未払収益分配金	8,275,307	8,201,089
未払受託者報酬	275,964	264,896
未払委託者報酬	717,577	688,794
未払利息	—	48
その他未払費用	278,464	146,903
流動負債合計	9,757,358	9,563,168
負債合計	9,757,358	9,563,168
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 (△)	529,961,289	387,845,437
(分配準備積立金)	963	24,374
元本等合計	1,025,700,420	883,584,568
純資産合計	1,025,700,420	883,584,568
負債純資産合計	1,035,457,778	893,147,736

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	9,416,190	9,329,040
有価証券売買等損益	△58,274,104	△141,026,947
派生商品取引等損益	△160,040	△1,112,316
その他収益	25	59
営業収益合計	△49,017,929	△132,810,164
営業費用		
支払利息	2,213	2,322
受託者報酬	275,964	264,896
委託者報酬	717,577	688,794
その他費用	154,897	148,587
営業費用合計	1,150,651	1,104,599
営業損失(△)	△50,168,580	△133,914,763
経常損失(△)	△50,168,580	△133,914,763
当期純損失(△)	△50,168,580	△133,914,763
期首剰余金又は期首欠損金(△)	588,405,176	529,961,289
分配金 ※1	8,275,307	8,201,089
期末剰余金又は期末欠損金(△)	529,961,289	387,845,437

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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 15,792,500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 14,307,500円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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                      (9,414,002円)及び分配準備積立金(10,706円)の合計額から、経費(1,148,438円)を控除して計算される分配対象額は8,276,270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>	<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                      (9,326,777円)及び分配準備積立金(963円)の合計額から、経費(1,102,277円)を控除して計算される分配対象額は8,225,463円(1口当たり221円)であり、うち8,201,089円(1口当たり221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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	△57,986,409	△140,154,885
合計	△57,986,409	△140,154,885

(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20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	5,279,750	—	5,242,500	△37,250	3,016,750	—	3,117,000	100,250
合計	5,279,750	—	5,242,500	△37,250	3,016,750	—	3,117,000	100,250

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	27,640円	23,811円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	708	(99.8)	1	(0.2)	709	(100.0)
30年 7月期	673	(99.5)	3	(0.5)	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
31年 1月期	28	4	—	32
30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
31年 1月期	716	7	709	21,828
30年 7月期	683	6	676	23,966

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	197
30年 7月期	202

(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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,793,415	64,427
コール・ローン	6,189,636	7,638,250
株式 ※2	673,424,500	708,062,400
未収配当金	856,300	952,100
前払金	93,750	166,750
流動資産合計	683,357,601	716,883,927
資産合計	683,357,601	716,883,927
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	46,716	12,458
未払金	80,898	58,264
未払収益分配金	5,704,076	6,403,879
未払受託者報酬	171,044	207,317
未払委託者報酬	444,785	539,111
未払利息	—	36
その他未払費用	170,420	115,104
流動負債合計	6,617,939	7,336,169
負債合計	6,617,939	7,336,169
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	371,160,272	427,272,008
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	305,579,390	282,275,750
(分配準備積立金)	9,429	24,034
元本等合計	676,739,662	709,547,758
純資産合計	676,739,662	709,547,758
負債純資産合計	683,357,601	716,883,927

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 20 期	第 21 期
	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	6,399,050	7,282,925
有価証券売買等損益	48,256,844	△67,930,403
派生商品取引等損益	△244,084	△1,083,218
営業収益合計	54,411,810	△61,730,696
営業費用		
支払利息	1,889	1,782
受託者報酬	171,044	207,317
委託者報酬	444,785	539,111
その他費用	95,989	116,231
営業費用合計	713,707	864,441
営業利益又は営業損失 (△)	53,698,103	△62,595,137
経常利益又は経常損失 (△)	53,698,103	△62,595,137
当期純利益又は当期純損失 (△)	53,698,103	△62,595,137
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	257,585,363	305,579,390
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	45,695,376
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	45,695,376
分配金 ※1	5,704,076	6,403,879
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	305,579,390	282,275,750

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	56,111,736 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	32,507 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 14,881,500 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 13,278,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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 （6,397,161円）及び分配準備積立金（28,162円）の合計額から、経費（711,818円）を控除して計算される分配対象額は 5,713,505円（1口当たり202円）であり、うち5,704,076円（1口当たり202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 （7,281,143円）及び分配準備積立金（9,429円）の合計額から、経費（862,659円）を控除して計算される分配対象額は 6,427,913円（1口当たり197円）であり、うち6,403,879円（1口当たり197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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	47,709,125	△67,804,894
合計	47,709,125	△67,804,894

(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20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	3,541,500	—	3,495,000	△46,500	1,570,850	—	1,558,500	△12,350
合計	3,541,500	—	3,495,000	△46,500	1,570,850	—	1,558,500	△12,350

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	23,966円	21,828円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	680	(99.5)	3	(0.5)	683	(100.0)
30年 7月期	755	(99.6)	2	(0.4)	757	(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
31年 1月期	33	4	4	33
30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
31年 1月期	695	11	683	20,541
30年 7月期	769	11	757	22,770

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	328
30年 7月期	325

(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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,874,097	94,603
コール・ローン	8,584,204	11,215,910
株式 ※2	755,174,050	680,766,700
派生商品評価勘定	32,104	190,266
未収入金	—	1,444,809
未収配当金	2,108,250	2,106,450
流動資産合計	769,772,705	695,818,738
資産合計	769,772,705	695,818,738
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,608	7,608
前受金	18,320	6,090
未払金	73,724	118,104
未払収益分配金	10,817,625	10,920,432
未払受託者報酬	208,874	208,288
未払委託者報酬	543,102	541,607
未払利息	—	52
その他未払費用	212,905	115,571
流動負債合計	11,876,158	11,917,752
負債合計	11,876,158	11,917,752
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	494,781,525	494,915,310
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	263,115,022	188,985,676
(分配準備積立金)	18,941	28,351
元本等合計	757,896,547	683,900,986
純資産合計	757,896,547	683,900,986
負債純資産合計	769,772,705	695,818,738

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	11,706,033	11,798,650
有価証券売買等損益	△94,891,722	△80,807,041
派生商品取引等損益	△63,832	△1,352,790
その他収益	—	10
営業収益合計	△83,249,521	△70,361,171
営業費用		
支払利息	1,735	2,032
受託者報酬	208,874	208,288
委託者報酬	543,102	541,607
その他費用	117,285	116,891
営業費用合計	870,996	868,818
営業損失(△)	△84,120,517	△71,229,989
経常損失(△)	△84,120,517	△71,229,989
当期純損失(△)	△84,120,517	△71,229,989
期首剰余金又は期首欠損金(△)	358,053,164	263,115,022
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	34,130,160
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	34,130,160
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	26,109,085
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	26,109,085
分配金 ※1	10,817,625	10,920,432
期末剰余金又は期末欠損金(△)	263,115,022	188,985,676

(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 21 期	
	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 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	61,541,100 円
期中一部交換元本額	－円	61,407,315 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	33,285 口	33,294 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 14,880,000 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 13,596,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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 （11,704,298円）及び分配準備積立金（1,529円）の合計額から、経費（869,261円）を控除して計算される分配対象額は 10,836,566円（1口当たり325円）であり、うち10,817,625円（1口当たり325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 （11,796,628円）及び分配準備積立金（18,941円）の合計額から、経費（866,786円）を控除して計算される分配対象額は 10,948,783円（1口当たり328円）であり、うち10,920,432円（1口当たり328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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	△94,488,354	△70,580,743
合計	△94,488,354	△70,580,743

(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20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	2,307,680	—	2,338,500	30,820	2,630,910	—	2,814,000	183,090
合計	2,307,680	—	2,338,500	30,820	2,630,910	—	2,814,000	183,090

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	22,770円	20,541円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	199	(99.6)	0	(0.4)	200	(100.0)
30年 7月期	223	(99.3)	1	(0.7)	225	(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
31年 1月期	10	—	—	10
30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
31年 1月期	203	3	200	18,525
30年 7月期	229	4	225	20,869

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	259
30年 7月期	342

(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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,741,200	30,790
コール・ローン	3,858,143	3,650,340
株式 ※3	223,883,150	199,445,118
派生商品評価勘定	56,392	—
未収配当金	16,800	32,200
前払金	—	125,000
流動資産合計	229,555,685	203,283,448
資産合計	229,555,685	203,283,448
負債の部		
流動負債		
前受金	13,000	—
未払金	65,432	87,432
未払収益分配金	3,694,968	2,798,236
未払受託者報酬	67,356	60,289
未払委託者報酬	175,202	156,819
未払利息	—	16
その他未払費用	70,843	33,328
流動負債合計	4,086,801	3,136,120
負債合計	4,086,801	3,136,120
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	△144,492,488	△169,814,044
(分配準備積立金)	2,275	10,408
元本等合計	225,468,884	200,147,328
純資産合計	225,468,884	200,147,328
負債純資産合計	229,555,685	203,283,448

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 20 期	第 21 期
	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,972,000	3,058,000
有価証券売買等損益	△66,673,645	△24,910,917
派生商品取引等損益	154,028	△418,772
その他収益	7	15
営業収益合計	△62,547,610	△22,271,674
営業費用		
支払利息	467	806
受託者報酬	67,356	60,289
委託者報酬	175,202	156,819
その他費用	37,656	33,732
営業費用合計	280,681	251,646
営業損失 (△)	△62,828,291	△22,523,320
経常損失 (△)	△62,828,291	△22,523,320
当期純損失 (△)	△62,828,291	△22,523,320
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△77,969,229	△144,492,488
分配金 ※1	3,694,968	2,798,236
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△144,492,488	△169,814,044

(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 21 期	
	自 平成 30 年 7 月 21 日	至 平成 31 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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 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 144,492,488 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 169,814,044 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 15,673,000 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 14,486,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 20 期	第 21 期
	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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 (3,971,540 円) 及び分配準備積立金(5,917 円)の合計額から、経費(280,214 円)を控除して計算される分配対象額は 3,697,243 円 (1 口当たり 342 円) であり、うち 3,694,968 円 (1 口当たり 342 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 (3,057,209 円) 及び分配準備積立金(2,275 円)の合計額から、経費(250,840 円)を控除して計算される分配対象額は 2,808,644 円 (1 口当たり 259 円) であり、うち 2,798,236 円 (1 口当たり 259 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 21 期 自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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 21 期 平成 31 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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31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	△66,904,716	△24,769,314
合計	△66,904,716	△24,769,314

(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20期 平成30年7月20日 現在				第21期 平成31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	1,691,000	—	1,747,500	56,500	—	—	—	—
合計	1,691,000	—	1,747,500	56,500	—	—	—	—

(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 21 期 自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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 20 期 平成 30 年 7 月 20 日現在	第 21 期 平成 31 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	20,869 円	18,525 円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	613	(99.7)	2	(0.3)	615	(100.0)
30年 7月期	695	(99.7)	1	(0.3)	697	(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
31年 1月期	19	—	—	19
30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
31年 1月期	622	6	615	32,355
30年 7月期	704	7	697	36,620

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	320
30年 7月期	336

(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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,207,689	61,429
コール・ローン	4,891,787	7,282,799
株式 ※2	695,136,500	613,898,500
派生商品評価勘定	—	141,642
未収入金	1,218,827	—
未収配当金	995,050	1,419,250
前払金	75,200	12,650
流動資産合計	704,525,053	622,816,270
資産合計	704,525,053	622,816,270
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,408	—
未払金	80,548	59,764
未払収益分配金	6,396,096	6,091,520
未払受託者報酬	201,963	182,384
未払委託者報酬	525,217	474,273
未払利息	—	34
その他未払費用	205,727	101,126
流動負債合計	7,432,959	6,909,101
負債合計	7,432,959	6,909,101
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 (△)	265,032,002	183,847,077
(分配準備積立金)	12,983	15,093
元本等合計	697,092,094	615,907,169
純資産合計	697,092,094	615,907,169
負債純資産合計	704,525,053	622,816,270

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	7,235,990	6,853,875
有価証券売買等損益	△173,641,601	△80,413,591
派生商品取引等損益	115,514	△773,444
その他収益	61	66
営業収益合計	△166,290,036	△74,333,094
営業費用		
支払利息	828	1,403
受託者報酬	201,963	182,384
委託者報酬	525,217	474,273
その他費用	113,146	102,251
営業費用合計	841,154	760,311
営業損失(△)	△167,131,190	△75,093,405
経常損失(△)	△167,131,190	△75,093,405
当期純損失(△)	△167,131,190	△75,093,405
期首剰余金又は期首欠損金(△)	438,559,288	265,032,002
分配金	※1 6,396,096	6,091,520
期末剰余金又は期末欠損金(△)	265,032,002	183,847,077

(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21期	
	自 平成30年7月21日 至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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 1,271,600 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 1,094,600 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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（7,235,223円）及び分配準備積立金（14,182円）の合計額から、経費（840,326円）を控除して計算される分配対象額は6,409,079円（1口当たり336円）であり、うち6,396,096円（1口当たり336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（6,852,538円）及び分配準備積立金（12,983円）の合計額から、経費（758,908円）を控除して計算される分配対象額は6,106,613円（1口当たり320円）であり、うち6,091,520円（1口当たり320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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31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	△173,085,269	△79,087,316
合計	△173,085,269	△79,087,316

(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20期 平成30年7月20日 現在				第21期 平成31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	1,770,800	—	1,747,500	△23,300	1,416,750	—	1,558,500	141,750
合計	1,770,800	—	1,747,500	△23,300	1,416,750	—	1,558,500	141,750

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	36,620円	32,355円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	1,141	(99.7)	3	(0.3)	1,144	(100.0)
30年 7月期	1,845	(99.8)	3	(0.2)	1,848	(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
31年 1月期	95	4	29	70
30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
31年 1月期	1,161	16	1,144	16,279
30年 7月期	1,865	16	1,848	19,440

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	206
30年 7月期	151

(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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	5,292,475	145,994
コール・ローン	11,727,040	17,308,682
株式 ※2	1,845,032,300	1,141,535,714
派生商品評価勘定	18,142	141,642
未収入金	874,783	—
未収配当金	2,420,830	1,841,500
前払金	173,000	354,250
流動資産合計	1,865,538,570	1,161,327,782
資産合計	1,865,538,570	1,161,327,782
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,358	26,608
未払金	242,978	258,944
未払収益分配金	14,359,194	14,485,508
未払受託者報酬	505,149	439,551
未払委託者報酬	1,313,473	1,142,917
未払利息	—	82
その他未払費用	511,295	243,656
流動負債合計	16,958,447	16,597,266
負債合計	16,958,447	16,597,266
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,287,097,290	951,754,130
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	561,482,833	192,976,386
(分配準備積立金)	21,730	147
元本等合計	1,848,580,123	1,144,730,516
純資産合計	1,848,580,123	1,144,730,516
負債純資産合計	1,865,538,570	1,161,327,782

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	16,473,480	16,296,142
有価証券売買等損益	△234,358,335	△269,311,040
派生商品取引等損益	82,216	△1,981,686
その他収益	11	31
営業収益合計	△217,802,628	△254,996,553
営業費用		
支払利息	2,453	3,186
受託者報酬	505,149	439,551
委託者報酬	1,313,473	1,142,917
その他費用	283,310	246,594
営業費用合計	2,104,385	1,832,248
営業損失(△)	△219,907,013	△256,828,801
経常損失(△)	△219,907,013	△256,828,801
当期純損失(△)	△219,907,013	△256,828,801
期首剰余金又は期首欠損金(△)	795,749,040	561,482,833
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	30,481,962
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	30,481,962
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	127,674,100
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	127,674,100
分配金 ※1	14,359,194	14,485,508
期末剰余金又は期末欠損金(△)	561,482,833	192,976,386

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	67,052,390 円
期中一部交換元本額	－円	402,395,550 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	95,094 口	70,318 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 26,261,000 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 23,667,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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 （16,471,038円）及び分配準備積立金（11,818円）の合計額から、経費（2,101,932円）を控除して計算される分配対象額は14,380,924円（1口当たり151円）であり、うち14,359,194円（1口当たり151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 （16,292,987円）及び分配準備積立金（21,730円）の合計額から、経費（1,829,062円）を控除して計算される分配対象額は14,485,655円（1口当たり206円）であり、うち14,485,508円（1口当たり206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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	△233,983,997	△213,615,731
合計	△233,983,997	△213,615,731

(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20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	3,503,000	—	3,495,000	△8,000	3,001,750	—	3,117,000	115,250
合計	3,503,000	—	3,495,000	△8,000	3,001,750	—	3,117,000	115,250

(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 21 期 自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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 20 期 平成 30 年 7 月 20 日現在	第 21 期 平成 31 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	19,440 円	16,279 円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	743	(99.8)	1	(0.2)	744	(100.0)
30年 7月期	739	(99.6)	3	(0.4)	742	(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
31年 1月期	32	4	—	36
30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
31年 1月期	751	7	744	20,374
30年 7月期	749	6	742	23,000

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	168
30年 7月期	185

(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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,174,035	53,101
コール・ローン	4,817,215	6,295,470
株式 ※2	739,071,900	743,282,950
未収入金	2,516,495	1,056,058
未収配当金	383,047	829,969
前払金	55,500	93,000
流動資産合計	749,018,192	751,610,548
資産合計	749,018,192	751,610,548
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,108	—
未払金	53,432	38,148
未払収益分配金	5,969,025	6,139,224
未払受託者報酬	192,803	216,660
未払委託者報酬	501,353	563,382
未払利息	—	28
その他未払費用	195,209	120,251
流動負債合計	6,934,930	7,077,693
負債合計	6,934,930	7,077,693
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	372,015,450	421,340,790
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	370,067,812	323,192,065
(分配準備積立金)	1,494	3,490
元本等合計	742,083,262	744,532,855
純資産合計	742,083,262	744,532,855
負債純資産合計	749,018,192	751,610,548

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,749,986	7,044,080
有価証券売買等損益	7,252,721	△94,769,417
派生商品取引等損益	139,812	△667,904
その他収益	108	153
営業収益合計	14,142,627	△88,393,088
営業費用		
支払利息	645	1,530
受託者報酬	192,803	216,660
委託者報酬	501,353	563,382
その他費用	107,985	121,441
営業費用合計	802,786	903,013
営業利益又は営業損失(△)	13,339,841	△89,296,101
経常利益又は経常損失(△)	13,339,841	△89,296,101
当期純利益又は当期純損失(△)	13,339,841	△89,296,101
期首剰余金又は期首欠損金(△)	362,696,996	370,067,812
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	48,559,578
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	48,559,578
分配金 ※1	5,969,025	6,139,224
期末剰余金又は期末欠損金(△)	370,067,812	323,192,065

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	49,325,340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	36,543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 2,008,500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 1,684,400円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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                      (6,749,449円)及び分配準備積立金(23,211円)の合計額から、経費(802,141円)を控除して計算される分配対象額は                      5,970,519円(1口当たり185円)であり、うち5,969,025円(1口当たり185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                      (7,042,703円)及び分配準備積立金(1,494円)の合計額から、経費(901,483円)を控除して計算される分配対象額は                      6,142,714円(1口当たり168円)であり、うち6,139,224円(1口当たり168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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	6,838,832	△92,714,353
合計	6,838,832	△92,714,353

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	1,770,500	—	1,747,500	△23,000	—	—	—	—
合計	1,770,500	—	1,747,500	△23,000	—	—	—	—

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	23,000円	20,374円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	273	(99.8)	0	(0.2)	274	(100.0)
30年 7月期	255	(99.1)	2	(0.9)	257	(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
31年 1月期	32	—	—	32
30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
31年 1月期	277	3	274	8,454
30年 7月期	260	2	257	7,937

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	73
30年 7月期	69

(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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,378,562	32,681
コール・ローン	3,054,611	3,874,516
株式 ※3	255,256,800	273,788,500
未収入金	509,777	—
未収配当金	15,150	13,500
前払金	37,000	62,500
流動資産合計	260,251,900	277,771,697
資産合計	260,251,900	277,771,697
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,108	—
未払金	26,716	650,352
未払収益分配金	2,240,085	2,369,945
未払受託者報酬	65,196	70,930
未払委託者報酬	169,597	184,534
未払利息	—	18
その他未払費用	66,126	39,275
流動負債合計	2,590,828	3,315,054
負債合計	2,590,828	3,315,054
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	△152,112,158	△135,316,587
(分配準備積立金)	20,263	9,812
元本等合計	257,661,072	274,456,643
純資産合計	257,661,072	274,456,643
負債純資産合計	260,251,900	277,771,697

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 20 期	第 21 期
	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,524,200	2,655,600
有価証券売買等損益	25,196,152	17,224,894
派生商品取引等損益	△78,064	△418,872
その他収益	—	6
営業収益合計	27,642,288	19,461,628
営業費用		
支払利息	712	921
受託者報酬	65,196	70,930
委託者報酬	169,597	184,534
その他費用	36,477	39,727
営業費用合計	271,982	296,112
営業利益	27,370,306	19,165,516
経常利益	27,370,306	19,165,516
当期純利益	27,370,306	19,165,516
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△177,242,379	△152,112,158
分配金 ※1	2,240,085	2,369,945
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△152,112,158	△135,316,587

(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 21 期	
	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 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 152,112,158 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 135,316,587 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 6,629,000 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 6,944,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 20 期	第 21 期
	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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 (2,523,488 円) 及び分配準備積立金(8,130 円)の合計額から、経費(271,270 円)を控除して計算される分配対象額は 2,260,348 円(1 口当たり 69 円)であり、うち 2,240,085 円(1 口当たり 69 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 (2,654,685 円) 及び分配準備積立金(20,263 円)の合計額から、経費(295,191 円)を控除して計算される分配対象額は 2,379,757 円(1 口当たり 73 円)であり、うち 2,369,945 円(1 口当たり 73 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 21 期
	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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 21 期
	平成 31 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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 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	25,098,568	17,366,863
合計	25,098,568	17,366,863

(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 20 期				第 21 期			
	平成 30 年 7 月 20 日 現在				平成 31 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	1,770,500	—	1,747,500	△23,000	—	—	—	—
合計	1,770,500	—	1,747,500	△23,000	—	—	—	—

(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 21 期 自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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 20 期 平成 30 年 7 月 20 日現在	第 21 期 平成 31 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	7,937 円	8,454 円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	445	(99.6)	1	(0.4)	446	(100.0)
30年 7月期	448	(99.5)	2	(0.5)	450	(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
31年 1月期	24	—	—	24
30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
31年 1月期	449	2	446	18,391
30年 7月期	454	3	450	18,561

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	89
30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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,480,066	30,308
コール・ローン	3,279,522	3,593,247
株式 ※2	448,807,300	445,082,900
未収入金	682,704	650,710
未収配当金	5,300	11,800
前払金	34,000	77,600
流動資産合計	454,288,892	449,446,565
資産合計	454,288,892	449,446,565
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,608	17,908
未払金	25,216	20,516
未払収益分配金	2,817,872	2,161,988
未払受託者報酬	119,345	121,253
未払委託者報酬	310,372	315,339
未払利息	—	16
その他未払費用	120,745	67,164
流動負債合計	3,415,158	2,704,184
負債合計	3,415,158	2,704,184
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 (△)	101,409,022	97,277,669
(分配準備積立金)	17,610	412
元本等合計	450,873,734	446,742,381
純資産合計	450,873,734	446,742,381
負債純資産合計	454,288,892	449,446,565

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 20 期	第 21 期
	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,265,576	2,579,440
有価証券売買等損益	△17,100,417	△3,696,891
派生商品取引等損益	△77,214	△417,264
その他収益	61,242	70,721
営業収益合計	△13,850,813	△1,463,994
営業費用		
支払利息	659	902
受託者報酬	119,345	121,253
委託者報酬	310,372	315,339
その他費用	66,789	67,877
営業費用合計	497,165	505,371
営業損失 (△)	△14,347,978	△1,969,365
経常損失 (△)	△14,347,978	△1,969,365
当期純損失 (△)	△14,347,978	△1,969,365
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	118,574,872	101,409,022
分配金 ※1	2,817,872	2,161,988
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	101,409,022	97,277,669

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 21 期	
	自 平成 30 年 7 月 21 日	至 平成 31 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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 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 4,362,000 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 4,349,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 20 期	第 21 期
	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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, 159 円) 及び分配準備積立金(5, 829 円)の合計額から、経費(496, 506 円)を控除して計算される分配対象額は 2, 835, 482 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, 649, 259 円) 及び分配準備積立金(17, 610 円)の合計額から、経費(504, 469 円)を控除して計算される分配対象額は 2, 162, 400 円(1 口当たり 89 円) であり、うち 2, 161, 988 円 (1 口当たり 89 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 21 期 自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	△16,833,752	△3,245,457
合計	△16,833,752	△3,245,457

(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20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	1,769,000	—	1,747,500	△21,500	1,576,300	—	1,558,500	△17,800
合計	1,769,000	—	1,747,500	△21,500	1,576,300	—	1,558,500	△17,800

(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 21 期 自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 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 20 期 平成 30 年 7 月 20 日現在	第 21 期 平成 31 年 1 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	18,561 円	18,391 円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	800	(99.8)	1	(0.2)	801	(100.0)
30年 7月期	845	(99.9)	0	(0.1)	845	(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
31年 1月期	22	—	—	22
30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
31年 1月期	815	13	801	35,996
30年 7月期	860	14	845	37,964

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	554
30年 7月期	590

(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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,523,059	116,790
コール・ローン	10,022,171	13,846,279
株式 ※2	845,341,660	800,210,900
未収入金	41,352	853,161
未収配当金	190,400	240,000
前払金	—	33,550
流動資産合計	860,118,642	815,300,680
資産合計	860,118,642	815,300,680
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	12,658
前受金	23,500	—
未払金	58,932	—
未払収益分配金	13,145,200	12,343,120
未払受託者報酬	231,348	230,355
未払委託者報酬	601,593	599,003
未払利息	—	64
その他未払費用	228,485	127,851
流動負債合計	14,289,058	13,313,051
負債合計	14,289,058	13,313,051
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 (△)	217,065,704	173,223,749
(分配準備積立金)	12,726	15,712
元本等合計	845,829,584	801,987,629
純資産合計	845,829,584	801,987,629
負債純資産合計	860,118,642	815,300,680

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	14,099,656	13,306,772
有価証券売買等損益	△57,661,230	△43,588,817
派生商品取引等損益	136,688	△256,124
その他収益	83	203
営業収益合計	△43,424,803	△30,537,966
営業費用		
支払利息	1,151	2,197
受託者報酬	231,348	230,355
委託者報酬	601,593	599,003
その他費用	129,732	129,314
営業費用合計	963,824	960,869
営業損失(△)	△44,388,627	△31,498,835
経常損失(△)	△44,388,627	△31,498,835
当期純損失(△)	△44,388,627	△31,498,835
期首剰余金又は期首欠損金(△)	274,599,531	217,065,704
分配金 ※1	13,145,200	12,343,120
期末剰余金又は期末欠損金(△)	217,065,704	173,223,749

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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 4,956,500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 4,875,000円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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 （14,098,588円）及び分配準備積立金（22,011円）の合計額から、経費（962,673円）を控除して計算される分配対象額は 13,157,926円（1口当たり590円）であり、うち13,145,200円（1口当たり590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 （13,304,778円）及び分配準備積立金（12,726円）の合計額から、経費（958,672円）を控除して計算される分配対象額は 12,358,832円（1口当たり554円）であり、うち12,343,120円（1口当たり554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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	△57,493,624	△43,105,620
合計	△57,493,624	△43,105,620

(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20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	—	—	—	—	1,571,050	—	1,558,500	△12,550
合計	—	—	—	—	1,571,050	—	1,558,500	△12,550

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	37,964円	35,996円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	448	(99.9)	0	(0.1)	448	(100.0)
30年 7月期	498	(99.8)	1	(0.2)	499	(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
31年 1月期	21	—	—	21
30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
31年 1月期	452	3	448	20,663
30年 7月期	503	3	499	23,012

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	129
30年 7月期	141

(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 20 期	第 21 期
	平成 30 年 7 月 20 日現在	平成 31 年 1 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,437,521	30,483
コール・ローン	3,185,253	3,613,953
株式 ※2	498,671,700	448,239,750
未収配当金	223,850	228,400
前払金	45,500	124,500
流動資産合計	503,563,824	452,237,086
資産合計	503,563,824	452,237,086
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	27,358	—
未払金	31,216	87,932
未払収益分配金	3,062,520	2,801,880
未払受託者報酬	134,338	133,996
未払委託者報酬	349,333	348,458
未払利息	—	16
その他未払費用	132,532	74,235
流動負債合計	3,737,297	3,446,517
負債合計	3,737,297	3,446,517
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 (△)	267,922,087	216,886,129
(分配準備積立金)	13,519	18,440
元本等合計	499,826,527	448,790,569
純資産合計	499,826,527	448,790,569
負債純資産合計	503,563,824	452,237,086

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 20 期	第 21 期
	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日	自 平成 30 年 7 月 21 日 至 平成 31 年 1 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,630,875	3,364,450
有価証券売買等損益	8,586,388	△50,713,391
派生商品取引等損益	11,612	△327,488
その他収益	448	596
営業収益合計	12,229,323	△47,675,833
営業費用		
支払利息	682	778
受託者報酬	134,338	133,996
委託者報酬	349,333	348,458
その他費用	75,232	75,013
営業費用合計	559,585	558,245
営業利益又は営業損失 (△)	11,669,738	△48,234,078
経常利益又は経常損失 (△)	11,669,738	△48,234,078
当期純利益又は当期純損失 (△)	11,669,738	△48,234,078
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	259,314,869	267,922,087
分配金 ※1	3,062,520	2,801,880
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	267,922,087	216,886,129

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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 462,700 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 470,800 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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                      (3,630,641円)及び分配準備積立金(4,301円)の合計額から、経費(558,903円)を控除して計算される分配対象額は                      3,076,039円（1口当たり141円）であり、うち3,062,520円（1口当たり141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                      (3,364,268円)及び分配準備積立金(13,519円)の合計額から、経費(557,467円)を控除して計算される分配対象額は                      2,820,320円（1口当たり129円）であり、うち2,801,880円（1口当たり129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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31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	9,224,766	△51,098,439
合計	9,224,766	△51,098,439

(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20期 平成30年7月20日 現在				第21期 平成31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	1,774,750	—	1,747,500	△27,250	—	—	—	—
合計	1,774,750	—	1,747,500	△27,250	—	—	—	—

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	23,012円	20,663円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	1,187	(98.1)	23	(1.9)	1,211	(100.0)
30年 7月期	1,253	(97.9)	26	(2.1)	1,280	(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
31年 1月期	113	8	—	121
30年 7月期	83	29	—	113

#### (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
31年 1月期	1,233	22	1,211	9,954
30年 7月期	1,302	22	1,280	11,294

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	167
30年 7月期	172

(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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	8,644,882	207,091
コール・ローン	19,155,285	24,552,125
株式 ※3	1,253,571,180	1,187,821,340
未収入金	19,788,156	20,125,820
未収配当金	180,000	230,000
前払金	1,440,000	1,005,000
流動資産合計	1,302,779,503	1,233,941,376
資産合計	1,302,779,503	1,233,941,376
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,546,620	871,620
未払収益分配金	19,496,200	20,320,560
未払受託者報酬	358,386	366,936
未払委託者報酬	931,878	954,096
未払利息	—	116
その他未払費用	316,259	203,867
流動負債合計	22,649,343	22,717,195
負債合計	22,649,343	22,717,195
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,981,471,350	2,127,088,080
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△701,341,190	△915,863,899
(分配準備積立金)	6,533	101,882
元本等合計	1,280,130,160	1,211,224,181
純資産合計	1,280,130,160	1,211,224,181
負債純資産合計	1,302,779,503	1,233,941,376

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	20,988,925	21,950,975
受取利息	—	1
有価証券売買等損益	△270,797,372	△166,721,298
派生商品取引等損益	△2,782,400	△2,781,480
その他収益	—	30
営業収益合計	△252,590,847	△147,551,772
営業費用		
支払利息	4,096	7,614
受託者報酬	358,386	366,936
委託者報酬	931,878	954,096
その他費用	201,458	206,451
営業費用合計	1,495,818	1,535,097
営業損失(△)	△254,086,665	△149,086,869
経常損失(△)	△254,086,665	△149,086,869
当期純損失(△)	△254,086,665	△149,086,869
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△301,120,999	△701,341,190
剰余金減少額又は欠損金増加額	126,637,326	45,115,280
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	126,637,326	45,115,280
分配金 ※1	19,496,200	20,320,560
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△701,341,190	△915,863,899

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31年1月20日現在
1. ※1 期首元本額	1,461,079,461円	1,981,471,350円
期中追加設定元本額	520,391,889円	145,616,730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	113,350口	121,680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701,341,190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915,863,899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 5,480,500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 4,819,000円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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（20,984,829円）及び分配準備積立金（9,626円）の合計額から、経費（1,491,722円）を控除して計算される分配対象額は19,502,733円（1口当たり172円）であり、うち19,496,200円（1口当たり172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（21,943,392円）及び分配準備積立金（6,533円）の合計額から、経費（1,527,483円）を控除して計算される分配対象額は20,422,442円（1口当たり167円）であり、うち20,320,560円（1口当たり167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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	△265,757,561	△163,758,393
合計	△265,757,561	△163,758,393

(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20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	27,750,000	—	26,205,000	△1,545,000	24,030,000	—	23,160,000	△870,000
合計	27,750,000	—	26,205,000	△1,545,000	24,030,000	—	23,160,000	△870,000

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	11,294円	9,954円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	333	(99.8)	0	(0.2)	334	(100.0)
30年 7月期	362	(99.9)	0	(0.1)	363	(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
31年 1月期	27	—	—	27
30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
31年 1月期	339	5	334	12,244
30年 7月期	370	6	363	13,308

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	178
30年 7月期	236

(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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,289,129	48,472
コール・ローン	5,072,241	5,746,728
株式	362,961,280	333,828,150
未収配当金	—	1,800
流動資産合計	370,322,650	339,625,150
資産合計	370,322,650	339,625,150
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	6,444,452	4,860,646
未払受託者報酬	101,465	98,588
未払委託者報酬	263,895	256,383
未払利息	—	26
その他未払費用	102,410	54,617
流動負債合計	6,912,222	5,270,260
負債合計	6,912,222	5,270,260
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	△44,119,240	△73,174,778
(分配準備積立金)	19,831	7,156
元本等合計	363,410,428	334,354,890
純資産合計	363,410,428	334,354,890
負債純資産合計	370,322,650	339,625,150

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,872,800	5,259,005
有価証券売買等損益	△46,835,251	△29,042,863
その他収益	4	18
営業収益合計	△39,962,447	△23,783,840
営業費用		
支払利息	576	847
受託者報酬	101,465	98,588
委託者報酬	263,895	256,383
その他費用	56,853	55,234
営業費用合計	422,789	411,052
営業損失(△)	△40,385,236	△24,194,892
経常損失(△)	△40,385,236	△24,194,892
当期純損失(△)	△40,385,236	△24,194,892
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,710,448	△44,119,240
分配金 ※1	6,444,452	4,860,646
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△44,119,240	△73,174,778

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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44,119,240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73,174,778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20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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 (6,872,228円)及び分配準備積立金(14,268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 (5,258,176円)及び分配準備積立金(19,831円)の合計額か

	ら、経費(422,213円)を控除して計算される分配対象額は6,464,283円(1口当たり236円)であり、うち6,444,452円(1口当たり236円)を分配金額としております。	ら、経費(410,205円)を控除して計算される分配対象額は4,867,802円(1口当たり178円)であり、うち4,860,646円(1口当たり178円)を分配金額としております。
--	---	---

(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21期
	自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31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	△46,762,830	△28,275,765
合計	△46,762,830	△28,275,765

（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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	13,308円	12,244円

# 平成31年1月期（平成30年7月21日～平成31年1月20日）決算短信

平成31年3月4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 <https://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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成31年 4月12日  
 分配金支払開始日 平成31年 2月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月21日～平成31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	%
31年 1月期	266	(99.4)	1	(0.6)	268	(100.0)
30年 7月期	282	(99.4)	1	(0.6)	284	(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
31年 1月期	9	—	—	9
30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
31年 1月期	270	2	268	29,505
30年 7月期	286	2	284	31,208

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	222
30年 7月期	213

(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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31年1月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,119,112	22,826
コール・ローン	2,479,724	2,706,172
株式	282,488,950	266,885,300
未収入金	—	610,893
未収配当金	216,500	530,150
前払金	37,600	66,200
差入委託証拠金	90,000	111,000
流動資産合計	286,431,886	270,932,541
資産合計	286,431,886	270,932,541
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,408	12,208
未払金	26,766	14,316
未払収益分配金	1,938,939	2,020,866
未払受託者報酬	77,092	73,126
未払委託者報酬	200,526	190,218
未払利息	—	12
その他未払費用	76,905	40,441
流動負債合計	2,343,636	2,351,187
負債合計	2,343,636	2,351,187
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(△)	55,967,070	40,460,174
(分配準備積立金)	3,848	2,154
元本等合計	284,088,250	268,581,354
純資産合計	284,088,250	268,581,354
負債純資産合計	286,431,886	270,932,541

(2) 損益及び剰余金計算書

	第20期	第21期
	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日	自平成30年7月21日 至平成31年1月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,263,060	2,324,000
有価証券売買等損益	△19,140,962	△15,088,288
派生商品取引等損益	△76,664	△416,914
その他収益	46	109
営業収益合計	△16,954,520	△13,181,093
営業費用		
支払利息	589	699
受託者報酬	77,092	73,126
委託者報酬	200,526	190,218
その他費用	43,120	40,894
営業費用合計	321,327	304,937
営業損失(△)	△17,275,847	△13,486,030
経常損失(△)	△17,275,847	△13,486,030
当期純損失(△)	△17,275,847	△13,486,030
期首剰余金又は期首欠損金(△)	75,181,856	55,967,070
分配金 ※1	1,938,939	2,020,866
期末剰余金又は期末欠損金(△)	55,967,070	40,460,174

(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21期	
	自 平成30年7月21日	至 平成31年1月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>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。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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20期	第21期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日	自 平成30年7月21日 至 平成31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（2,262,517円）及び分配準備積立金(1,008円)の合計額から、経費(320,738円)を控除して計算される分配対象額は1,942,787円（1口当たり213円）であり、うち1,938,939円（1口当たり213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（2,323,410円）及び分配準備積立金(3,848円)の合計額から、経費(304,238円)を控除して計算される分配対象額は2,023,020円（1口当たり222円）であり、うち2,020,866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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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21期
	平成31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20期	第21期
	平成30年7月20日現在	平成31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	△19,259,256	△16,440,412
合計	△19,259,256	△16,440,412

(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20期				第21期			
	平成30年7月20日 現在				平成31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	1,770,800	—	1,747,500	△23,300	1,570,600	—	1,558,500	△12,100
合計	1,770,800	—	1,747,500	△23,300	1,570,600	—	1,558,500	△12,100

(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21期 自 平成30年7月21日 至 平成31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20期 平成30年7月20日現在	第21期 平成31年1月20日現在
1口当たり純資産額	31,208円	29,505円