

2019年9月2日

各 位

委 託 会 社 名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者の役職氏名 代表取締役社長 松下 浩一
担当者の役職氏名 経 営 企 画 部 岡田 美範
(連絡先 03-5555-4946)

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7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2019年7月期（2019年1月21日～2019年7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

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 食品 上場取引所 東証
 コード番号 1634
 連動対象指標 TOPIX-17 食品
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	566	(99.0)	5	(1.0)	572	(100.0)
2019年 1月期	591	(99.1)	5	(0.9)	596	(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
2019年 7月期	19	—	—	19
2019年 1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
2019年 7月期	579	7	572	29,389
2019年 1月期	602	6	596	30,653

(4)分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	345
2019年 1月期	266

(注)分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

II 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	56,525	—
コール・ローン	6,701,433	8,612,639
株式 ※2	591,160,500	566,088,000
派生商品評価勘定	424,926	59,568
未収入金	—	23,386
未収配当金	4,428,200	4,538,500
前払金	—	131,000
流動資産合計	602,771,584	579,453,093
資産合計	602,771,584	579,453,093
負債の部		
流動負債		
前受金	112,250	—
未払金	175,864	—
未払収益分配金	5,177,158	6,714,735
未払受託者報酬	168,263	157,678
未払委託者報酬	437,502	410,026
未払利息	30	18
その他未払費用	93,234	164,573
流動負債合計	6,164,301	7,447,030
負債合計	6,164,301	7,447,030
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(△)	267,487,953	242,886,733
(分配準備積立金)	19,251	2,629
元本等合計	596,607,283	572,006,063
純資産合計	596,607,283	572,006,063
負債純資産合計	602,771,584	579,453,093

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,894,780	7,355,800
有価証券売買等損益	△62,108,728	△24,649,598
派生商品取引等損益	△336,976	65,000
その他収益	123	40
営業収益合計	△56,550,801	△17,228,758
営業費用		
支払利息	1,981	1,832
受託者報酬	168,263	157,678
委託者報酬	437,502	410,026
その他費用	94,340	88,191
営業費用合計	702,086	657,727
営業損失(△)	△57,252,887	△17,886,485
経常損失(△)	△57,252,887	△17,886,485
当期純損失(△)	△57,252,887	△17,886,485
期首剰余金又は期首欠損金(△)	329,917,998	267,487,953
分配金	※1 5,177,158	6,714,735
期末剰余金又は期末欠損金(△)	267,487,953	242,886,733

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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 39,950,000 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 36,305,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (5,892,922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>	<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 (7,354,008円)及び分配準備積立金(19,251円)の合計額から、経費(655,895円)を控除して計算される分配対象額は6,717,364円(1口当たり345円)であり、うち6,714,735円(1口当たり345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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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	△61,914,194	△24,625,316
合計	△61,914,194	△24,625,316

(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 21 期 2019年1月20日 現在				第 22 期 2019年7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)
株価指数 先物取引								
買 建	4,250,250	—	4,675,500	425,250	6,172,000	—	6,232,000	60,000
合計	4,250,250	—	4,675,500	425,250	6,172,000	—	6,232,000	60,000

(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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	30,653円	29,389円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 エネルギー資源 上場取引所 東証
 コード番号 1635
 連動対象指標 TOPIX-17 エネルギー資源
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	300	(99.4)	1	(0.6)	302	(100.0)
2019年 1月期	336	(99.5)	1	(0.5)	337	(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
2019年 7月期	25	—	—	25
2019年 1月期	25	61	61	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
2019年 7月期	309	6	302	12,011
2019年 1月期	343	5	337	13,425

(4)分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	254
2019年 1月期	177

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	55,638	—
コール・ローン	6,596,335	8,374,900
株式 ※3	336,225,000	300,592,160
派生商品評価勘定	—	16,442
未収入金	—	77,336
未収配当金	35,200	35,000
前払金	189,000	44,750
流動資産合計	343,101,173	309,140,588
資産合計	343,101,173	309,140,588
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,358	—
未払金	84,648	—
未払収益分配金	4,455,090	6,393,180
未払受託者報酬	153,063	87,874
未払委託者報酬	398,022	228,555
未払利息	30	17
その他未払費用	85,028	118,808
流動負債合計	5,202,239	6,828,434
負債合計	5,202,239	6,828,434
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	447,044,370	447,044,370
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△109,145,436	△144,732,216
(分配準備積立金)	13,054	13,859
元本等合計	337,898,934	302,312,154
純資産合計	337,898,934	302,312,154
負債純資産合計	343,101,173	309,140,588

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,082,700	6,760,600
有価証券売買等損益	△191,029,941	△35,466,375
派生商品取引等損益	△910,678	△121,210
その他収益	1	—
営業収益合計	△186,857,918	△28,826,985
営業費用		
支払利息	1,208	1,108
受託者報酬	153,063	87,874
委託者報酬	398,022	228,555
その他費用	85,757	49,078
営業費用合計	638,050	366,615
営業損失(△)	△187,495,968	△29,193,600
経常損失(△)	△187,495,968	△29,193,600
当期純損失(△)	△187,495,968	△29,193,600
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△9,023,857	△109,145,436
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	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	—
分配金 ※1	4,455,090	6,393,180
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△109,145,436	△144,732,216

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	446,671,389 円	447,044,370 円
期中追加設定元本額	1,092,834,330 円	—円
期中一部交換元本額	1,092,461,349 円	—円
2. 計算期間末日における受益権の総数	25,170 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 109,145,436 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 144,732,216 円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 10,830,000 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 9,872,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (5,081,493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>	<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 (6,759,492円)及び分配準備積立金(13,054円)の合計額から、経費(365,507円)を控除して計算される分配対象額は6,407,039円(1口当たり254円)であり、うち6,393,180円(1口当たり254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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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	△148,483,349	△35,461,076
合計	△148,483,349	△35,461,076

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 21 期 2019年1月20日 現在				第 22 期 2019年7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)
株価指数 先物取引								
買 建	1,584,750	—	1,558,500	△26,250	1,541,450	—	1,558,000	16,550
合計	1,584,750	—	1,558,500	△26,250	1,541,450	—	1,558,000	16,550

(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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	13,425円	12,011円

（重要な後発事象）

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 建設・資材 上場取引所 東証
 コード番号 1636
 連動対象指標 TOPIX-17 建設・資材
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	1,165	(99.8)	1	(0.2)	1,167	(100.0)
2019年 1月期	1,394	(99.9)	1	(0.1)	1,395	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2019年 7月期	59	—	6	53
2019年 1月期	53	6	—	59

(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
2019年 7月期	1,190	23	1,167	21,922
2019年 1月期	1,414	18	1,395	23,299

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	413
2019年 1月期	260

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	130,107	—
コール・ローン	15,425,092	19,507,491
株式 ※2	1,394,145,000	1,165,264,000
派生商品評価勘定	146,892	2,492
未収入金	2,377,469	3,412,761
未収配当金	2,145,250	2,184,900
前払金	178,250	297,700
流動資産合計	1,414,548,060	1,190,669,344
資産合計	1,414,548,060	1,190,669,344
負債の部		
流動負債		
未払金	1,383,134	—
未払収益分配金	15,577,380	21,987,707
未払受託者報酬	401,221	337,911
未払委託者報酬	1,043,246	878,652
未払利息	72	40
その他未払費用	222,693	371,618
流動負債合計	18,627,746	23,575,928
負債合計	18,627,746	23,575,928
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	842,616,432	748,753,296
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	553,303,882	418,340,120
(分配準備積立金)	58,597	3,053
元本等合計	1,395,920,314	1,167,093,416
純資産合計	1,395,920,314	1,167,093,416
負債純資産合計	1,414,548,060	1,190,669,344

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	17,281,350	23,340,225
有価証券売買等損益	△243,130,923	△69,869,856
派生商品取引等損益	△1,946,420	△266,098
その他収益	203	105
営業収益合計	△227,795,790	△46,795,624
営業費用		
支払利息	2,923	2,425
受託者報酬	401,221	337,911
委託者報酬	1,043,246	878,652
その他費用	225,117	189,179
営業費用合計	1,672,507	1,408,167
営業損失(△)	△229,468,297	△48,203,791
経常損失(△)	△229,468,297	△48,203,791
当期純損失(△)	△229,468,297	△48,203,791
期首剰余金又は期首欠損金(△)	719,773,595	553,303,882
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	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	64,772,264
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	64,772,264
分配金 ※1	15,577,380	21,987,707
期末剰余金又は期末欠損金(△)	553,303,882	418,340,120

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	746,362,416 円	842,616,432 円
期中追加設定元本額	96,254,016 円	— 円
期中一部交換元本額	— 円	93,863,136 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	59,913 口	53,239 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 15,951,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 15,117,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (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>	<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 (23,337,905円)及び分配準備積立金(58,597円)の合計額から、経費(1,405,742円)を控除して計算される分配対象額は21,990,760円(1口当たり413円)であり、うち21,987,707円(1口当たり413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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期
	2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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	△239,424,418	△72,737,773
合計	△239,424,418	△72,737,773

(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 21 期				第 22 期			
	2019年1月20日 現在				2019年7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	1,411,500	—	1,558,500	147,000	1,555,400	—	1,558,000	2,600
合計	1,411,500	—	1,558,500	147,000	1,555,400	—	1,558,000	2,600

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	23,299円	21,922円

（重要な後発事象）

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 素材・化学 上場取引所 東証
 コード番号 1637
 連動対象指標 TOPIX-17 素材・化学
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	905	(99.4)	5	(0.6)	911	(100.0)
2019年 1月期	880	(99.6)	3	(0.4)	883	(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
2019年 7月期	37	—	—	37
2019年 1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
2019年 7月期	921	10	911	24,556
2019年 1月期	893	9	883	23,811

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	247
2019年 1月期	221

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	85,420	—
コール・ローン	10,127,114	13,155,992
株式 ※2	880,198,010	905,966,060
派生商品評価勘定	141,642	25,176
未収入金	—	36,954
未収配当金	2,341,300	2,213,450
前払金	254,250	184,500
流動資産合計	893,147,736	921,582,132
資産合計	893,147,736	921,582,132
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	41,608	—
未払金	219,830	—
未払収益分配金	8,201,089	9,165,923
未払受託者報酬	264,896	250,024
未払委託者報酬	688,794	650,098
未払利息	48	27
その他未払費用	146,903	260,256
流動負債合計	9,563,168	10,326,328
負債合計	9,563,168	10,326,328
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(△)	387,845,437	415,516,673
(分配準備積立金)	24,374	30,433
元本等合計	883,584,568	911,255,804
純資産合計	883,584,568	911,255,804
負債純資産合計	893,147,736	921,582,132

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	9,329,040	10,214,240
有価証券売買等損益	△141,026,947	27,835,641
派生商品取引等損益	△1,112,316	△170,464
その他収益	59	29
営業収益合計	△132,810,164	37,879,446
営業費用		
支払利息	2,322	2,258
受託者報酬	264,896	250,024
委託者報酬	688,794	650,098
その他費用	148,587	139,907
営業費用合計	1,104,599	1,042,287
営業利益又は営業損失(△)	△133,914,763	36,837,159
経常利益又は経常損失(△)	△133,914,763	36,837,159
当期純利益又は当期純損失(△)	△133,914,763	36,837,159
期首剰余金又は期首欠損金(△)	529,961,289	387,845,437
分配金	※1 8,201,089	9,165,923
期末剰余金又は期末欠損金(△)	387,845,437	415,516,673

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	495,739,131 円	495,739,131 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	37,109 口	37,109 口
3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 14,307,500 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 15,966,500 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (9,326,777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>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (10,212,011円)及び分配準備積立金(24,374円)の合計額から、経費(1,040,029円)を控除して計算される分配対象額は9,196,356円(1口当たり247円)であり、うち9,165,923円(1口当たり247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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期
	2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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	△140,154,885	27,757,307
合計	△140,154,885	27,757,307

(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 21 期				第 22 期			
	2019年1月20日 現在				2019年7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	3,016,750	—	3,117,000	100,250	4,648,500	—	4,674,000	25,500
合計	3,016,750	—	3,117,000	100,250	4,648,500	—	4,674,000	25,500

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も

近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	23,811円	24,556円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 医薬品 上場取引所 東証
 コード番号 1638
 連動対象指標 TOPIX-17 医薬品
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	592	(99.9)	0	(0.1)	593	(100.0)
2019年 1月期	708	(99.8)	1	(0.2)	709	(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
2019年 7月期	32	—	4	28
2019年 1月期	28	4	—	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
2019年 7月期	601	8	593	20,990
2019年 1月期	716	7	709	21,828

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	255
2019年 1月期	197

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	64,427	—
コール・ローン	7,638,250	7,728,231
株式 ※2	708,062,400	592,438,700
未収入金	—	26,670
未収配当金	952,100	808,400
前払金	166,750	114,500
流動資産合計	716,883,927	601,116,501
資産合計	716,883,927	601,116,501
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,458	—
未払金	58,264	—
未払収益分配金	6,403,879	7,205,535
未払受託者報酬	207,317	168,657
未払委託者報酬	539,111	438,575
未払利息	36	16
その他未払費用	115,104	188,671
流動負債合計	7,336,169	8,001,454
負債合計	7,336,169	8,001,454
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	427,272,008	371,410,008
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	282,275,750	221,705,039
(分配準備積立金)	24,034	22,565
元本等合計	709,547,758	593,115,047
純資産合計	709,547,758	593,115,047
負債純資産合計	716,883,927	601,116,501

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	7,282,925	7,906,725
有価証券売買等損益	△67,930,403	△21,675,474
派生商品取引等損益	△1,083,218	△119,468
営業収益合計	△61,730,696	△13,888,217
営業費用		
支払利息	1,782	1,114
受託者報酬	207,317	168,657
委託者報酬	539,111	438,575
その他費用	116,231	94,313
営業費用合計	864,441	702,659
営業損失(△)	△62,595,137	△14,590,876
経常損失(△)	△62,595,137	△14,590,876
当期純損失(△)	△62,595,137	△14,590,876
期首剰余金又は期首欠損金(△)	305,579,390	282,275,750
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	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	38,774,300
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	38,774,300
分配金 ※1	6,403,879	7,205,535
期末剰余金又は期末欠損金(△)	282,275,750	221,705,039

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	371,160,272 円	427,272,008 円
期中追加設定元本額	56,111,736 円	— 円
期中一部交換元本額	— 円	55,862,000 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	32,507 口	28,257 口
3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 13,278,000 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 12,179,500 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 21 期	第 22 期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (7,281,143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>	<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 (7,905,611円)及び分配準備積立金(24,034円)の合計額から、経費(701,545円)を控除して計算される分配対象額は7,228,100円(1口当たり255円)であり、うち7,205,535円(1口当たり255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 22 期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△67,804,894	△24,945,378
合計	△67,804,894	△24,945,378

(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 21 期 2019年1月20日 現在				第 22 期 2019年7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)
株価指数 先物取引								
買 建	1,570,850	—	1,558,500	△12,350	—	—	—	—
合計	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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	21,828円	20,990円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。 2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 自動車・輸送機 上場取引所 東証
 コード番号 1639
 連動対象指標 TOPIX-17 自動車・輸送機
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	485	(99.4)	2	(0.6)	488	(100.0)
2019年 1月期	680	(99.5)	3	(0.5)	683	(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
2019年 7月期	33	4	12	25
2019年 1月期	33	4	4	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
2019年 7月期	498	10	488	19,544
2019年 1月期	695	11	683	20,541

(4)分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	372
2019年 1月期	328

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	94,603	—
コール・ローン	11,215,910	11,050,522
株式 ※2	680,766,700	485,818,330
派生商品評価勘定	190,266	22,684
未収入金	1,444,809	172,081
未収配当金	2,106,450	1,563,400
前払金	—	157,700
流動資産合計	695,818,738	498,784,717
資産合計	695,818,738	498,784,717
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,608	—
前受金	6,090	—
未払金	118,104	—
未払収益分配金	10,920,432	9,303,348
未払受託者報酬	208,288	147,496
未払委託者報酬	541,607	383,559
未払利息	52	23
その他未払費用	115,571	177,171
流動負債合計	11,917,752	10,011,597
負債合計	11,917,752	10,011,597
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	494,915,310	371,758,785
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	188,985,676	117,014,335
(分配準備積立金)	28,351	1,440
元本等合計	683,900,986	488,773,120
純資産合計	683,900,986	488,773,120
負債純資産合計	695,818,738	498,784,717

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	11,798,650	9,892,000
有価証券売買等損益	△80,807,041	△29,378,785
派生商品取引等損益	△1,352,790	△122,766
その他収益	10	1
営業収益合計	△70,361,171	△19,609,550
営業費用		
支払利息	2,032	2,013
受託者報酬	208,288	147,496
委託者報酬	541,607	383,559
その他費用	116,891	82,496
営業費用合計	868,818	615,564
営業損失(△)	△71,229,989	△20,225,114
経常損失(△)	△71,229,989	△20,225,114
当期純損失(△)	△71,229,989	△20,225,114
期首剰余金又は期首欠損金(△)	263,115,022	188,985,676
剰余金増加額又は欠損金減少額	34,130,160	21,570,651
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	21,570,651
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,109,085	64,013,530
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	64,013,530
分配金 ※1	10,920,432	9,303,348
期末剰余金又は期末欠損金(△)	188,985,676	117,014,335

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	494,781,525 円	494,915,310 円
期中追加設定元本額	61,541,100 円	61,674,885 円
期中一部交換元本額	61,407,315 円	184,831,410 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	33,294 口	25,009 口
3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 13,596,000 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 14,242,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (11,796,628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>	<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 (9,889,988円)及び分配準備積立金(28,351円)の合計額から、経費(613,551円)を控除して計算される分配対象額は9,304,788円(1口当たり372円)であり、うち9,303,348円(1口当たり372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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期
	2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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	△70,580,743	△21,950,614
合計	△70,580,743	△21,950,614

(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 21 期				第 22 期			
	2019年1月20日 現在				2019年7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	2,630,910	—	2,814,000	183,090	3,093,100	—	3,116,000	22,900
合計	2,630,910	—	2,814,000	183,090	3,093,100	—	3,116,000	22,900

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	20,541円	19,544円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 鉄鋼・非鉄 上場取引所 東証
 コード番号 1640
 連動対象指標 TOPIX-17 鉄鋼・非鉄
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	182	(99.6)	0	(0.4)	183	(100.0)
2019年 1月期	199	(99.6)	0	(0.4)	200	(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
2019年 7月期	10	—	—	10
2019年 1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
2019年 7月期	187	3	183	17,004
2019年 1月期	203	3	200	18,525

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	306
2019年 1月期	259

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	30,790	—
コール・ローン	3,650,340	4,185,358
株式 ※3	199,445,118	182,986,950
未収入金	—	11,568
未収配当金	32,200	33,600
前払金	125,000	44,500
流動資産合計	203,283,448	187,261,976
資産合計	203,283,448	187,261,976
負債の部		
流動負債		
未払金	87,432	—
未払収益分配金	2,798,236	3,306,024
未払受託者報酬	60,289	52,714
未払委託者報酬	156,819	137,154
未払利息	16	8
その他未払費用	33,328	56,736
流動負債合計	3,136,120	3,552,636
負債合計	3,136,120	3,552,636
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	△169,814,044	△186,252,032
(分配準備積立金)	10,408	3,930
元本等合計	200,147,328	183,709,340
純資産合計	200,147,328	183,709,340
負債純資産合計	203,283,448	187,261,976

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,058,000	3,519,300
有価証券売買等損益	△24,910,917	△16,357,646
派生商品取引等損益	△418,772	△73,864
その他収益	15	10
営業収益合計	△22,271,674	△12,912,200
営業費用		
支払利息	806	510
受託者報酬	60,289	52,714
委託者報酬	156,819	137,154
その他費用	33,732	29,386
営業費用合計	251,646	219,764
営業損失 (△)	△22,523,320	△13,131,964
経常損失 (△)	△22,523,320	△13,131,964
当期純損失 (△)	△22,523,320	△13,131,964
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△144,492,488	△169,814,044
分配金 ※1	2,798,236	3,306,024
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△169,814,044	△186,252,032

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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 169,814,044 円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は 186,252,032 円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 14,486,000 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 13,027,500 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 21 期	第 22 期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (3,057,209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>	<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 (3,518,800円) 及び分配準備積立金(10,408円)の合計額から、経費(219,254円)を控除して計算される分配対象額は3,309,954円(1口当たり306円)であり、うち3,306,024円(1口当たり306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 22 期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期
	2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△24,769,314	△16,355,000
合計	△24,769,314	△16,355,000

(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 21 期	第 22 期
2019年1月20日現在	2019年7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 22 期
自 2019年1月21日
至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	18,525円	17,004円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。 2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 機械 上場取引所 東証
 コード番号 1641
 連動対象指標 TOPIX-17 機械
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	633	(99.9)	0	(0.1)	634	(100.0)
2019年 1月期	613	(99.7)	2	(0.3)	615	(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
2019年 7月期	19	—	—	19
2019年 1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
2019年 7月期	642	7	634	33,323
2019年 1月期	622	6	615	32,355

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	378
2019年 1月期	320

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	61,429	—
コール・ローン	7,282,799	7,556,536
株式 ※2	613,898,500	633,551,600
派生商品評価勘定	141,642	—
未収入金	—	26,420
未収配当金	1,419,250	1,073,300
前払金	12,650	114,500
流動資産合計	622,816,270	642,322,356
資産合計	622,816,270	642,322,356
負債の部		
流動負債		
未払金	59,764	—
未払収益分配金	6,091,520	7,195,608
未払受託者報酬	182,384	170,654
未払委託者報酬	474,273	443,754
未払利息	34	15
その他未払費用	101,126	178,316
流動負債合計	6,909,101	7,988,347
負債合計	6,909,101	7,988,347
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 (△)	183,847,077	202,273,917
(分配準備積立金)	15,093	17,577
元本等合計	615,907,169	634,334,009
純資産合計	615,907,169	634,334,009
負債純資産合計	622,816,270	642,322,356

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,853,875	7,909,000
有価証券売買等損益	△80,413,591	18,547,074
派生商品取引等損益	△773,444	△122,718
その他収益	66	58
営業収益合計	△74,333,094	26,333,414
営業費用		
支払利息	1,403	1,122
受託者報酬	182,384	170,654
委託者報酬	474,273	443,754
その他費用	102,251	95,436
営業費用合計	760,311	710,966
営業利益又は営業損失(△)	△75,093,405	25,622,448
経常利益又は経常損失(△)	△75,093,405	25,622,448
当期純利益又は当期純損失(△)	△75,093,405	25,622,448
期首剰余金又は期首欠損金(△)	265,032,002	183,847,077
分配金 ※1	6,091,520	7,195,608
期末剰余金又は期末欠損金(△)	183,847,077	202,273,917

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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 1,094,600 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 984,400 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (6,852,538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>	<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 (7,907,936円)及び分配準備積立金(15,093円)の合計額から、経費(709,844円)を控除して計算される分配対象額は 7,213,185円(1口当たり378円)であり、うち7,195,608円(1口当たり378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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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	△79,087,316	18,479,649
合計	△79,087,316	18,479,649

(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 21 期 2019年1月20日 現在				第 22 期 2019年7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	1,416,750	—	1,558,500	141,750	—	—	—	—
合計	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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	32,355円	33,323円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 電機・精密 上場取引所 東証
 コード番号 1642
 連動対象指標 TOPIX-17 電機・精密
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	298	(98.7)	3	(1.3)	302	(100.0)
2019年 1月期	1,141	(99.7)	3	(0.3)	1,144	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2019年 7月期	70	4	58	16
2019年 1月期	95	4	29	70

(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
2019年 7月期	305	3	302	17,769
2019年 1月期	1,161	16	1,144	16,279

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	161
2019年 1月期	206

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	145,994	—
コール・ローン	17,308,682	6,556,669
株式 ※2	1,141,535,714	298,255,100
派生商品評価勘定	141,642	32,084
未収入金	—	37,918
未収配当金	1,841,500	512,950
前払金	354,250	37,100
流動資産合計	1,161,327,782	305,431,821
資産合計	1,161,327,782	305,431,821
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,608	—
未払金	258,944	—
未払収益分配金	14,485,508	2,736,839
未払受託者報酬	439,551	107,474
未払委託者報酬	1,142,917	279,480
未払利息	82	13
その他未払費用	243,656	259,648
流動負債合計	16,597,266	3,383,454
負債合計	16,597,266	3,383,454
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	951,754,130	230,081,465
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	192,976,386	71,966,902
(分配準備積立金)	147	1,643
元本等合計	1,144,730,516	302,048,367
純資産合計	1,144,730,516	302,048,367
負債純資産合計	1,161,327,782	305,431,821

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	16,296,142	3,187,336
有価証券売買等損益	△269,311,040	72,526,855
派生商品取引等損益	△1,981,686	△29,178
その他収益	31	6
営業収益合計	△254,996,553	75,685,019
営業費用		
支払利息	3,186	1,972
受託者報酬	439,551	107,474
委託者報酬	1,142,917	279,480
その他費用	246,594	60,081
営業費用合計	1,832,248	449,007
営業利益又は営業損失(△)	△256,828,801	75,236,012
経常利益又は経常損失(△)	△256,828,801	75,236,012
当期純利益又は当期純損失(△)	△256,828,801	75,236,012
期首剰余金又は期首欠損金(△)	561,482,833	192,976,386
剰余金増加額又は欠損金減少額	30,481,962	20,445,068
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	20,445,068
剰余金減少額又は欠損金増加額	127,674,100	213,953,725
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	213,953,725
分配金 ※1	14,485,508	2,736,839
期末剰余金又は期末欠損金(△)	192,976,386	71,966,902

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	1,287,097,290 円	951,754,130 円
期中追加設定元本額	67,052,390 円	65,996,660 円
期中一部交換元本額	402,395,550 円	787,669,325 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	70,318 口	16,999 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 23,667,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 5,150,300 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (16,292,987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>	<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 (3,185,370円)及び分配準備積立金(147円)の合計額から、経費(447,035円)を控除して計算される分配対象額は2,738,482円(1口当たり161円)であり、うち2,736,839円(1口当たり161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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期
	2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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	△213,615,731	16,621,372
合計	△213,615,731	16,621,372

(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 21 期				第 22 期			
	2019年1月20日 現在				2019年7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	3,001,750	—	3,117,000	115,250	3,083,700	—	3,116,000	32,300
合計	3,001,750	—	3,117,000	115,250	3,083,700	—	3,116,000	32,300

(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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	16,279円	17,769円

（重要な後発事象）

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 情報通信・サービスその他 上場取引所 東証
 コード番号 1643
 連動対象指標 TOPIX-17 情報通信・サービスその他
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日

分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	823	(99.8)	1	(0.2)	824	(100.0)
2019年 1月期	743	(99.8)	1	(0.2)	744	(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
2019年 7月期	36	—	—	36
2019年 1月期	32	4	—	36

(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
2019年 7月期	833	9	824	22,569
2019年 1月期	751	7	744	20,374

(4)分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	224
2019年 1月期	168

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	53,101	—
コール・ローン	6,295,470	10,145,571
株式 ※2	743,282,950	823,142,150
未収入金	1,056,058	35,120
未収配当金	829,969	481,724
前払金	93,000	106,300
流動資産合計	751,610,548	833,910,865
資産合計	751,610,548	833,910,865
負債の部		
流動負債		
未払金	38,148	—
未払収益分配金	6,139,224	8,185,632
未払受託者報酬	216,660	214,644
未払委託者報酬	563,382	558,155
未払利息	28	21
その他未払費用	120,251	218,639
流動負債合計	7,077,693	9,177,091
負債合計	7,077,693	9,177,091
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	421,340,790	421,340,790
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	323,192,065	403,392,984
(分配準備積立金)	3,490	6,364
元本等合計	744,532,855	824,733,774
純資産合計	744,532,855	824,733,774
負債純資産合計	751,610,548	833,910,865

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	7,044,080	9,082,559
有価証券売買等損益	△94,769,417	80,381,955
派生商品取引等損益	△667,904	△183,910
その他収益	153	102
営業収益合計	△88,393,088	89,280,706
営業費用		
支払利息	1,530	1,287
受託者報酬	216,660	214,644
委託者報酬	563,382	558,155
その他費用	121,441	120,069
営業費用合計	903,013	894,155
営業利益又は営業損失(△)	△89,296,101	88,386,551
経常利益又は経常損失(△)	△89,296,101	88,386,551
当期純利益又は当期純損失(△)	△89,296,101	88,386,551
期首剰余金又は期首欠損金(△)	370,067,812	323,192,065
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	6,139,224	8,185,632
期末剰余金又は期末欠損金(△)	323,192,065	403,392,984

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	372,015,450 円	421,340,790 円
期中追加設定元本額	49,325,340 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	36,543 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 1,684,400 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 1,308,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (7,042,703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>	<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 (9,081,374円) 及び分配準備積立金(3,490円)の合計額から、経費(892,868円)を控除して計算される分配対象額は8,191,996円(1口当たり224円)であり、うち8,185,632円(1口当たり224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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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	△92,714,353	79,251,437
合計	△92,714,353	79,251,437

(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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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 22 期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	20,374円	22,569円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。 2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 電力・ガス 上場取引所 東証
 コード番号 1644
 連動対象指標 TOPIX-17 電力・ガス
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	219	(99.7)	0	(0.3)	219	(100.0)
2019年 1月期	273	(99.8)	0	(0.2)	274	(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
2019年 7月期	32	—	—	32
2019年 1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
2019年 7月期	222	2	219	6,773
2019年 1月期	277	3	274	8,454

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	81
2019年 1月期	73

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	32,681	—
コール・ローン	3,874,516	3,424,025
株式 ※3	273,788,500	219,338,300
未収入金	—	14,368
未収配当金	13,500	16,800
前払金	62,500	42,200
流動資産合計	277,771,697	222,835,693
資産合計	277,771,697	222,835,693
負債の部		
流動負債		
未払金	650,352	—
未払収益分配金	2,369,945	2,629,665
未払受託者報酬	70,930	66,364
未払委託者報酬	184,534	172,616
未払利息	18	7
その他未払費用	39,275	69,220
流動負債合計	3,315,054	2,937,872
負債合計	3,315,054	2,937,872
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	△135,316,587	△189,875,409
(分配準備積立金)	9,812	7,906
元本等合計	274,456,643	219,897,821
純資産合計	274,456,643	219,897,821
負債純資産合計	277,771,697	222,835,693

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,655,600	2,904,150
有価証券売買等損益	17,224,894	△54,483,352
派生商品取引等損益	△418,872	△73,564
その他収益	6	—
営業収益合計	19,461,628	△51,652,766
営業費用		
支払利息	921	410
受託者報酬	70,930	66,364
委託者報酬	184,534	172,616
その他費用	39,727	37,001
営業費用合計	296,112	276,391
営業利益又は営業損失 (△)	19,165,516	△51,929,157
経常利益又は経常損失 (△)	19,165,516	△51,929,157
当期純利益又は当期純損失 (△)	19,165,516	△51,929,157
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△152,112,158	△135,316,587
分配金 ※1	2,369,945	2,629,665
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△135,316,587	△189,875,409

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	409,773,230 円 —円 —円	409,773,230 円 —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 135,316,587 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 189,875,409 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 6,944,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 5,280,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (2,654,685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。</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 (2,903,740円)及び分配準備積立金(9,812円)の合計額から、経費(275,981円)を控除して計算される分配対象額は2,637,571円(1口当たり81円)であり、うち2,629,665円(1口当たり81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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期
	2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	17,366,863	△54,463,833
合計	17,366,863	△54,463,833

(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 21 期	第 22 期
2019年1月20日現在	2019年7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 22 期
自 2019年1月21日
至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	8,454円	6,773円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。 2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 運輸・物流 上場取引所 東証
 コード番号 1645
 連動対象指標 TOPIX-17 運輸・物流
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	434	(99.6)	1	(0.4)	436	(100.0)
2019年 1月期	445	(99.6)	1	(0.4)	446	(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
2019年 7月期	24	—	—	24
2019年 1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
2019年 7月期	439	3	436	17,954
2019年 1月期	449	2	446	18,391

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	126
2019年 1月期	89

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	30,308	—
コール・ローン	3,593,247	5,252,704
株式 ※2	445,082,900	434,421,400
派生商品評価勘定	—	1,992
未収入金	650,710	10,268
未収配当金	11,800	5,500
前払金	77,600	70,200
流動資産合計	449,446,565	439,762,064
資産合計	449,446,565	439,762,064
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,908	—
未払金	20,516	—
未払収益分配金	2,161,988	3,060,792
未払受託者報酬	121,253	120,629
未払委託者報酬	315,339	313,693
未払利息	16	11
その他未払費用	67,164	122,492
流動負債合計	2,704,184	3,617,617
負債合計	2,704,184	3,617,617
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(△)	97,277,669	86,679,735
(分配準備積立金)	412	16,948
元本等合計	446,742,381	436,144,447
純資産合計	446,742,381	436,144,447
負債純資産合計	449,446,565	439,762,064

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,579,440	3,518,556
有価証券売買等損益	△3,696,891	△10,563,524
派生商品取引等損益	△417,264	△50,946
その他収益	70,721	61,306
営業収益合計	△1,463,994	△7,034,608
営業費用		
支払利息	902	810
受託者報酬	121,253	120,629
委託者報酬	315,339	313,693
その他費用	67,877	67,402
営業費用合計	505,371	502,534
営業損失 (△)	△1,969,365	△7,537,142
経常損失 (△)	△1,969,365	△7,537,142
当期純損失 (△)	△1,969,365	△7,537,142
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	101,409,022	97,277,669
分配金	※1 2,161,988	3,060,792
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	97,277,669	86,679,735

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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 4,349,000 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 4,214,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (2,649,259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>	<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 (3,579,052円)及び分配準備積立金(412円)の合計額から、経費(501,724円)を控除して計算される分配対象額は 3,077,740円(1口当たり126円)であり、うち3,060,792円(1口当たり126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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期
	2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△3,245,457	△10,552,132
合計	△3,245,457	△10,552,132

(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 21 期				第 22 期			
	2019年1月20日 現在				2019年7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	1,576,300	—	1,558,500	△17,800	1,555,900	—	1,558,000	2,100
合計	1,576,300	—	1,558,500	△17,800	1,555,900	—	1,558,000	2,100

(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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	18,391円	17,954円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。 2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 商社・卸売 上場取引所 東証
 コード番号 1646
 連動対象指標 TOPIX-17 商社・卸売
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	793	(99.9)	0	(0.1)	794	(100.0)
2019年 1月期	800	(99.8)	1	(0.2)	801	(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
2019年 7月期	22	—	—	22
2019年 1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
2019年 7月期	809	15	794	35,645
2019年 1月期	815	13	801	35,996

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	628
2019年 1月期	554

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	116,790	—
コール・ローン	13,846,279	15,013,151
株式 ※2	800,210,900	793,715,170
未収入金	853,161	45,306
未収配当金	240,000	196,050
前払金	33,550	209,250
流動資産合計	815,300,680	809,178,927
資産合計	815,300,680	809,178,927
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,658	—
未払収益分配金	12,343,120	13,991,840
未払受託者報酬	230,355	217,389
未払委託者報酬	599,003	565,261
未払利息	64	31
その他未払費用	127,851	226,369
流動負債合計	13,313,051	15,000,890
負債合計	13,313,051	15,000,890
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(△)	173,223,749	165,414,157
(分配準備積立金)	15,712	9,581
元本等合計	801,987,629	794,178,037
純資産合計	801,987,629	794,178,037
負債純資産合計	815,300,680	809,178,927

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	13,306,772	14,891,962
有価証券売買等損益	△43,588,817	△7,534,365
派生商品取引等損益	△256,124	△269,096
その他収益	203	78
営業収益合計	△30,537,966	7,088,579
営業費用		
支払利息	2,197	2,029
受託者報酬	230,355	217,389
委託者報酬	599,003	565,261
その他費用	129,314	121,652
営業費用合計	960,869	906,331
営業利益又は営業損失 (△)	△31,498,835	6,182,248
経常利益又は経常損失 (△)	△31,498,835	6,182,248
当期純利益又は当期純損失 (△)	△31,498,835	6,182,248
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	217,065,704	173,223,749
分配金 ※1	12,343,120	13,991,840
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	173,223,749	165,414,157

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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 4,875,000 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 4,720,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (13,304,778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>	<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 (14,890,011円)及び分配準備積立金(15,712円)の合計額から、経費(904,302円)を控除して計算される分配対象額は14,001,421円(1口当たり628円)であり、うち13,991,840円(1口当たり628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22期
	自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期 2019年7月20日現在
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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	△43,105,620	△7,523,186
合計	△43,105,620	△7,523,186

(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 21 期 2019年1月20日 現在				第 22 期 2019年7月20日 現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
	うち 1年超	うち 1年超			うち 1年超	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,571,050	—	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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	35,996円	35,645円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 小売 上場取引所 東証
 コード番号 1647
 連動対象指標 TOPIX-17 小売
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	421	(99.9)	0	(0.1)	422	(100.0)
2019年 1月期	448	(99.9)	0	(0.1)	448	(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
2019年 7月期	21	—	—	21
2019年 1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
2019年 7月期	426	3	422	19,445
2019年 1月期	452	3	448	20,663

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	153
2019年 1月期	129

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	30,483	—
コール・ローン	3,613,953	4,101,459
株式 ※2	448,239,750	421,808,800
未収入金	—	11,818
未収配当金	228,400	248,450
前払金	124,500	44,500
流動資産合計	452,237,086	426,215,027
資産合計	452,237,086	426,215,027
負債の部		
流動負債		
未払金	87,932	—
未払収益分配金	2,801,880	3,323,160
未払受託者報酬	133,996	116,447
未払委託者報酬	348,458	302,839
未払利息	16	8
その他未払費用	74,235	125,939
流動負債合計	3,446,517	3,868,393
負債合計	3,446,517	3,868,393
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(△)	216,886,129	190,442,194
(分配準備積立金)	18,440	17,763
元本等合計	448,790,569	422,346,634
純資産合計	448,790,569	422,346,634
負債純資産合計	452,237,086	426,215,027

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	3,364,450	3,807,025
有価証券売買等損益	△50,713,391	△26,369,812
派生商品取引等損益	△327,488	△73,446
その他収益	596	409
営業収益合計	△47,675,833	△22,635,824
営業費用		
支払利息	778	607
受託者報酬	133,996	116,447
委託者報酬	348,458	302,839
その他費用	75,013	65,058
営業費用合計	558,245	484,951
営業損失(△)	△48,234,078	△23,120,775
経常損失(△)	△48,234,078	△23,120,775
当期純損失(△)	△48,234,078	△23,120,775
期首剰余金又は期首欠損金(△)	267,922,087	216,886,129
分配金 ※1	2,801,880	3,323,160
期末剰余金又は期末欠損金(△)	216,886,129	190,442,194

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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 470,800 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 373,500 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (3,364,268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>	<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 (3,806,827円)及び分配準備積立金(18,440円)の合計額から、経費(484,344円)を控除して計算される分配対象額は3,340,923円(1口当たり153円)であり、うち3,323,160円(1口当たり153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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△51,098,439	△26,421,404
合計	△51,098,439	△26,421,404

(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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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 22 期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	20,663円	19,445円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。 2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 銀行 上場取引所 東証
 コード番号 1648
 連動対象指標 TOPIX-17 銀行
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	849	(97.6)	21	(2.4)	870	(100.0)
2019年 1月期	1,187	(98.1)	23	(1.9)	1,211	(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
2019年 7月期	121	—	24	96
2019年 1月期	113	8	—	121

(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
2019年 7月期	892	22	870	9,000
2019年 1月期	1,233	22	1,211	9,954

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	216
2019年 1月期	167

(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21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	207,091	—
コール・ローン	24,552,125	25,818,448
株式 ※3	1,187,821,340	849,016,310
未収入金	20,125,820	17,252,178
未収配当金	230,000	144,000
前払金	1,005,000	435,000
流動資産合計	1,233,941,376	892,665,936
資産合計	1,233,941,376	892,665,936
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	871,620	181,620
未払収益分配金	20,320,560	20,886,336
未払受託者報酬	366,936	269,424
未払委託者報酬	954,096	700,627
未払利息	116	54
その他未払費用	203,867	317,770
流動負債合計	22,717,195	22,355,831
負債合計	22,717,195	22,355,831
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,127,088,080	1,690,342,776
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△915,863,899	△820,032,671
(分配準備積立金)	101,882	49,152
元本等合計	1,211,224,181	870,310,105
純資産合計	1,211,224,181	870,310,105
負債純資産合計	1,233,941,376	892,665,936

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	21,950,975	21,960,575
受取利息	1	—
有価証券売買等損益	△166,721,298	△94,150,446
派生商品取引等損益	△2,781,480	△1,836,480
その他収益	30	—
営業収益合計	△147,551,772	△74,026,351
営業費用		
支払利息	7,614	6,003
受託者報酬	366,936	269,424
委託者報酬	954,096	700,627
その他費用	206,451	150,915
営業費用合計	1,535,097	1,126,969
営業損失(△)	△149,086,869	△75,153,320
経常損失(△)	△149,086,869	△75,153,320
当期純損失(△)	△149,086,869	△75,153,320
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△701,341,190	△915,863,899
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	191,870,884
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	191,870,884
剰余金減少額又は欠損金増加額	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	45,115,280	—
分配金 ※1	20,320,560	20,886,336
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△915,863,899	△820,032,671

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	1,981,471,350 円 145,616,730 円 －円	2,127,088,080 円 －円 436,745,304 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	121,680 口	96,696 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 915,863,899 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 820,032,671 円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 4,819,000 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 4,529,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第21期	第22期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7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 (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>	<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 (21,954,572円)及び分配準備積立金(101,882円)の合計額から、経費(1,120,966円)を控除して計算される分配対象額は20,935,488円(1口当たり216円)であり、うち20,886,336円(1口当たり216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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 22 期
	2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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	△163,758,393	△85,138,530
合計	△163,758,393	△85,138,530

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 21 期				第 22 期			
	2019年1月20日 現在				2019年7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	24,030,000	—	23,160,000	△870,000	21,210,000	—	21,030,000	△180,000
合計	24,030,000	—	23,160,000	△870,000	21,210,000	—	21,030,000	△180,000

(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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	9,954円	9,000円

（重要な後発事象）

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。 2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 金融（除く銀行） 上場取引所 東証
 コード番号 1649
 連動対象指標 TOPIX-17 金融（除く銀行）
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	326	(99.9)	0	(0.1)	327	(100.0)
2019年 1月期	333	(99.8)	0	(0.2)	334	(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
2019年 7月期	27	—	—	27
2019年 1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
2019年 7月期	333	6	327	11,977
2019年 1月期	339	5	334	12,244

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	234
2019年 1月期	178

(注)分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

II 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	48,472	—
コール・ローン	5,746,728	6,629,104
株式	333,828,150	326,803,370
未収入金	—	427,548
未収配当金	1,800	—
流動資産合計	339,625,150	333,860,022
資産合計	339,625,150	333,860,022
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,860,646	6,389,838
未払受託者報酬	98,588	87,682
未払委託者報酬	256,383	228,058
未払利息	26	13
その他未払費用	54,617	93,744
流動負債合計	5,270,260	6,799,335
負債合計	5,270,260	6,799,335
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	△73,174,778	△80,468,981
(分配準備積立金)	7,156	3,819
元本等合計	334,354,890	327,060,687
純資産合計	334,354,890	327,060,687
負債純資産合計	339,625,150	333,860,022

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,259,005	6,751,920
有価証券売買等損益	△29,042,863	△7,290,866
その他収益	18	4
営業収益合計	△23,783,840	△538,942
営業費用		
支払利息	847	718
受託者報酬	98,588	87,682
委託者報酬	256,383	228,058
その他費用	55,234	48,965
営業費用合計	411,052	365,423
営業損失(△)	△24,194,892	△904,365
経常損失(△)	△24,194,892	△904,365
当期純損失(△)	△24,194,892	△904,365
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△44,119,240	△73,174,778
分配金 ※1	4,860,646	6,389,838
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△73,174,778	△80,468,981

(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 22 期	
	自 2019年1月21日	至 2019年7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 21 期	第 22 期
	2019年1月20日現在	2019年7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 73,174,778 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 80,468,981 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 21 期	第 22 期
	自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (5,258,176 円) 及び分配準備積立金(19,831 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 (6,751,206 円) 及び分配準備積立金(7,156 円)の合計額か

	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。	ら、経費(364,705円)を控除して計算される分配対象額は6,393,657円(1口当たり234円)であり、うち6,389,838円(1口当たり234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22期
	自 2019年1月21日 至 2019年7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22期
	2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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	△28,275,765	△7,583,906
合計	△28,275,765	△7,583,906

（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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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 22 期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	12,244円	11,977円

（重要な後発事象）

第 22 期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。

2019年7月期（2019年1月21日～2019年7月20日）決算短信

2019年9月2日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 不動産 上場取引所 東証
 コード番号 1650
 連動対象指標 TOPIX-17 不動産
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 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 2019年10月11日
 分配金支払開始日 2019年 8月28日

I ファンドの運用状況

1. 2019年7月期の運用状況（2019年1月21日～2019年7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	%
2019年 7月期	268	(99.4)	1	(0.6)	270	(100.0)
2019年 1月期	266	(99.4)	1	(0.6)	268	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2019年 7月期	9	—	—	9
2019年 1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
2019年 7月期	272	2	270	29,668
2019年 1月期	270	2	268	29,505

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	244
2019年 1月期	222

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

II 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第21期	第22期
	2019年1月20日現在	2019年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	22,826	—
コール・ローン	2,706,172	2,801,814
株式	266,885,300	268,530,300
派生商品評価勘定	—	2,742
未収入金	610,893	856,518
未収配当金	530,150	298,550
前払金	66,200	45,300
差入委託証拠金	111,000	90,000
流動資産合計	270,932,541	272,625,224
資産合計	270,932,541	272,625,224
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,208	—
未払金	14,316	—
未払収益分配金	2,020,866	2,221,132
未払受託者報酬	73,126	72,494
未払委託者報酬	190,218	188,559
未払利息	12	5
その他未払費用	40,441	73,643
流動負債合計	2,351,187	2,555,833
負債合計	2,351,187	2,555,833
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(△)	40,460,174	41,948,211
(分配準備積立金)	2,154	4,386
元本等合計	268,581,354	270,069,391
純資産合計	268,581,354	270,069,391
負債純資産合計	270,932,541	272,625,224

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期	第22期
	自2018年7月21日 至2019年1月20日	自2019年1月21日 至2019年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,324,000	2,525,390
有価証券売買等損益	△15,088,288	1,500,669
派生商品取引等損益	△416,914	△14,864
その他収益	109	63
営業収益合計	△13,181,093	4,011,258
営業費用		
支払利息	699	577
受託者報酬	73,126	72,494
委託者報酬	190,218	188,559
その他費用	40,894	40,459
営業費用合計	304,937	302,089
営業利益又は営業損失(△)	△13,486,030	3,709,169
経常利益又は経常損失(△)	△13,486,030	3,709,169
当期純利益又は当期純損失(△)	△13,486,030	3,709,169
期首剰余金又は期首欠損金(△)	55,967,070	40,460,174
分配金	※1 2,020,866	2,221,132
期末剰余金又は期末欠損金(△)	40,460,174	41,948,211

(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 22 期 自 2019年1月21日 至 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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 21 期 自 2018年7月21日 至 2019年1月20日	第 22 期 自 2019年1月21日 至 2019年7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（2,323,410 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>	<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（2,524,876 円）及び分配準備積立金（2,154 円）の合計額から、経費（301,512 円）を控除して計算される分配対象額は 2,225,518 円（1 口当たり 244 円）であり、うち 2,221,132 円（1 口当たり 244 円）を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 22 期 自 2019年1月21日 至 2019年7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	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 22 期 2019年7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 21 期 2019年1月20日現在	第 22 期 2019年7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	△16,440,412	1,466,675
合計	△16,440,412	1,466,675

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第21期 2019年1月20日 現在				第22期 2019年7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	1,570,600	—	1,558,500	△12,100	1,555,150	—	1,558,000	2,850
合計	1,570,600	—	1,558,500	△12,100	1,555,150	—	1,558,000	2,850

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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22期 自 2019年1月21日 至 2019年7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21期 2019年1月20日現在	第22期 2019年7月20日現在
1口当たり純資産額	29,505円	29,668円

(重要な後発事象)

第22期 自 2019年1月21日 至 2019年7月20日
当ファンドは、投資信託約款の規定に基づき、書面決議を経た後、2019年12月19日付で投資信託約款を変更し、2019年12月20日付で繰上償還することを、2019年8月20日付で決定しております。 2019年9月12日時点の受益者を議決権行使の対象者と定め、2019年11月18日付で、当ファンドの投資信託約款変更および繰上償還の議案にかかる書面決議を行います。議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の多数の賛成を得て議案が可決された場合には、2019年12月19日付で金銭での支払いによる償還が行えるように投資信託約款を変更するとともに、信託期限を無期限から2019年12月20日までに変更した上で、2019年12月20日付で繰上償還いたします。ただし、当該議案が否決された場合には、投資信託約款変更および繰上償還は行いません。