

# 2021年1月期（2020年7月11日～2021年1月10日）決算短信

2021年2月19日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials 上場取引所 東証  
 コード番号 1585  
 連動対象指標 TOPIX Ex-Financials  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 10口  
 管理会社 大和アセットマネジメント株式会社 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)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

有価証券報告書提出予定日 2021年 4月 2日  
 分配金支払開始日 2021年 2月18日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2021年1月期の運用状況（2020年7月11日～2021年1月10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	%
2021年 1月期	8,824	(99.8)	16	(0.2)	8,840	(100.0)
2020年 7月期	10,846	(99.9)	13	(0.1)	10,859	(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
2021年 1月期	8,969	1,950	4,883	6,037
2020年 7月期	21,943	1,949	14,922	8,969

#### (3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10
	百万円	百万円	百万円	円
2021年 1月期	8,919	79	8,840	14,643.9
2020年 7月期	10,980	121	10,859	12,106.7

#### (4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2021年 1月期	114
2020年 7月期	113

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

### 2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無  
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第14期	第15期
	2020年7月10日現在	2021年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	118,082,371	83,035,611
株式	10,846,064,770	8,824,607,430
未収配当金	16,779,656	12,340,097
流動資産合計	10,980,926,797	8,919,983,138
資産合計	10,980,926,797	8,919,983,138
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	101,358,796	68,823,658
未払受託者報酬	3,973,770	2,566,804
未払委託者報酬	10,331,882	6,673,733
未払利息	—	82
その他未払費用	5,764,589	1,128,268
流動負債合計	121,429,037	79,192,545
負債合計	121,429,037	79,192,545
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	8,871,137,145	5,970,754,207
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,988,360,615	2,870,036,386
(分配準備積立金)	152,338	538,847
元本等合計	10,859,497,760	8,840,790,593
純資産合計	10,859,497,760	8,840,790,593
負債純資産合計	10,980,926,797	8,919,983,138

(2) 損益及び剰余金計算書

	第14期	第15期
	自2020年1月11日 至2020年7月10日	自2020年7月11日 至2021年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	117,944,733	80,179,955
受取利息	159	19
有価証券売買等損益	△2,455,891,197	1,803,340,855
その他収益	42,527	18,435
営業収益合計	△2,337,903,778	1,883,539,264
営業費用		
支払利息	12,486	6,513
受託者報酬	3,973,770	2,566,804
委託者報酬	10,331,882	6,673,733
その他費用	2,781,651	1,741,192
営業費用合計	17,099,789	10,988,242
営業利益又は営業損失(△)	△2,355,003,567	1,872,551,022
経常利益又は経常損失(△)	△2,355,003,567	1,872,551,022
当期純利益又は当期純損失(△)	△2,355,003,567	1,872,551,022
期首剰余金又は期首欠損金(△)	7,822,101,696	1,988,360,615
剰余金増加額又は欠損金減少額	433,710,462	760,930,649
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	433,710,462	760,930,649
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,811,089,180	1,682,982,242
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,811,089,180	1,682,982,242
分配金 ※1	101,358,796	68,823,658
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,988,360,615	2,870,036,386

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 15 期	
	自 2020年7月11日	至 2021年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	2020年7月10日現在	2021年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	21,701,918,755 円	8,871,137,145 円
期中追加設定元本額	1,927,699,460 円	1,929,103,840 円
期中一部交換元本額	14,758,481,070 円	4,829,486,778 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	8,969,805 口	6,037,163 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 14 期	第 15 期
	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日	自 2020年7月11日 至 2021年1月10日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取	当計算期間中に計上した受取

<p>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(117,974,933円)及び分配準備積立金(623,504円)の合計額から、経費(17,087,303円)を控除して計算される分配対象額は101,511,134円(100口当たり1,131円)であり、うち101,358,796円(100口当たり1,130円)を分配金額としております。</p>	<p>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(80,191,896円)及び分配準備積立金(152,338円)の合計額から、経費(10,981,729円)を控除して計算される分配対象額は69,362,505円(100口当たり1,148円)であり、うち68,823,658円(100口当たり1,140円)を分配金額としております。</p>
---	--

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 15 期 自 2020年7月11日 至 2021年1月10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 15 期 2021年1月10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 14 期 2020年7月10日現在	第 15 期 2021年1月10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	△939,954,525	1,251,421,090
合計	△939,954,525	1,251,421,090

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第 14 期 2020年7月10日現在	第 15 期 2021年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 15 期 自 2020年7月11日 至 2021年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第 14 期 2020年7月10日現在	第 15 期 2021年1月10日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,210.67円 (121,067円)	1,464.39円 (146,439円)