

平成 27 年 2 月 20 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 白川 真
担当者の役職氏名 経 営 企 画 部 近藤龍一郎
(連絡先 03-5555-4946)

平成 27 年 7 月 期 中間決算短信 (平成 26 年 7 月 11 日～平成 27 年 1 月 10 日)

大和証券投資信託委託株式会社を管理会社として上場する ETF 銘柄について、以下のとおり平成 27 年 7 月 期 中間決算短信 (平成 26 年 7 月 11 日～平成 27 年 1 月 10 日) をご報告します。

記

上場ETF (5銘柄)

銘柄名	銘柄コード	上場取引所
ダイワ上場投信ートピックス	1305	東
ダイワ上場投信ートピックス・コア30	1310	東
ダイワ上場投信ー日経225	1320	東
ダイワ上場投信ー東証電気機器株価指数	1610	東
ダイワ上場投信ー東証銀行業株価指数	1612	東

*各銘柄の中間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、各銘柄の中間決算短信が表示されます。

以上

平成27年7月期 中間決算短信（平成26年7月11日～平成27年1月10日）

平成27年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信ートピックス 上場取引所 東証
 コード番号 1305
 連動対象指標 東証株価指数（TOPIX）
 主要投資資産 株式
 売買単位 10口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

半期報告書提出予定日 平成27年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 27年1月中間期の運用状況（平成26年7月11日～平成27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	%
27年 1月中間期	966,361	(99.8)	1,685	(0.2)	968,047	(100.0)
26年 7月期	1,122,765	(99.9)	965	(0.1)	1,123,731	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
27年 1月中間期	867,629	107,507	298,950	676,186

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
27年 1月中間期	1,026,692	58,644	968,047	14,316
26年 7月期	1,194,841	71,109	1,123,731	12,952

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成26年7月10日現在	平成27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	63,441,579,302	59,168,803,761
株式 ※2※3	1,122,765,596,200	966,361,674,062
派生商品評価勘定	9,530,062	—
未収入金	7,718,508,583	—
未収配当金	833,830,740	1,067,245,550
未収利息	—	99,241
前払金	—	37,806,000
その他未収収益 ※4	72,073,444	56,691,783
流動資産合計	1,194,841,118,331	1,026,692,320,397
資産合計	1,194,841,118,331	1,026,692,320,397
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,139,352	40,051,858
前受金	194,534,000	—
未払金	3,193,460	18,556,646
未払収益分配金	14,229,125,046	—
未払受託者報酬	189,125,149	216,759,790
未払委託者報酬	387,415,774	442,863,123
未払利息	523,613	465,745
受入担保金	55,882,560,090	57,795,257,886
その他未払費用	221,310,826	130,894,839
流動負債合計	71,109,927,310	58,644,849,887
負債合計	71,109,927,310	58,644,849,887
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,084,536,970,000	845,232,756,250
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	39,194,221,021	122,814,714,260
(分配準備積立金)	940,385,753	940,385,753
元本等合計	1,123,731,191,021	968,047,470,510
純資産合計	1,123,731,191,021	968,047,470,510
負債純資産合計	1,194,841,118,331	1,026,692,320,397

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成25年7月11日 至 平成26年1月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,954,166,315	9,074,876,333
受取利息	14,212,306	17,402,463
有価証券売買等損益	68,836,958,193	99,414,366,583
派生商品取引等損益	462,229,326	762,994,150
その他収益 ※1	255,369,541	366,087,897
営業収益合計	76,522,935,681	109,635,727,426
営業費用		
支払利息	7,054,386	8,462,732
受託者報酬	175,519,197	216,759,790
委託者報酬	358,220,887	442,863,123
その他費用	109,363,517	126,987,539
営業費用合計	650,157,987	795,073,184
営業利益	75,872,777,694	108,840,654,242
経常利益	75,872,777,694	108,840,654,242
中間純利益	75,872,777,694	108,840,654,242
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△20,975,928,290	39,194,221,021
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,722,294,290	8,797,165,197
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	5,722,294,290	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	8,797,165,197
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,214,083,116	34,017,326,200
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	34,017,326,200
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	5,214,083,116	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	55,405,060,578	122,814,714,260

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成26年7月11日	至 平成27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。
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。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成26年7月10日現在	平成27年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	956,555,088,750 円	1,084,536,970,000 円
期中追加設定元本額	627,433,200,000 円	134,384,087,500 円
期中一部交換元本額	499,451,318,750 円	373,688,301,250 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	867,629,576 口	676,186,205 口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 52,459,252,500 円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 55,841,578,050 円
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 486,150,000 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 769,200,000 円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 68,897,160 円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 53,512,444 円が含まれております。

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成25年7月11日 至 平成26年1月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日
1. ※1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額193,422,033円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額298,560,524円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成27年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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 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>

（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	前計算期間末 平成26年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成27年1月10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	914,088,000	—	921,625,000	7,537,000	1,738,281,000	—	1,698,630,000	△39,651,000
合計	914,088,000	—	921,625,000	7,537,000	1,738,281,000	—	1,698,630,000	△39,651,000

（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。

原則として中間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、中間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。

（1口当たり情報）

	前計算期間末 平成26年7月10日現在	当中間計算期間末 平成27年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,295.2円	1,431.6円
（10口当たり純資産額）	（12,952円）	（14,316円）

平成27年7月期 中間決算短信（平成26年7月11日～平成27年1月10日）

平成27年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信ートピックス・コア30 上場取引所 東証
 コード番号 1310
 連動対象指標 TOPIX Core30
 主要投資資産 株式
 売買単位 10口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

半期報告書提出予定日 平成27年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 27年1月中間期の運用状況（平成26年7月11日～平成27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	%
27年 1月中間期	1,785	(99.7)	5	(0.3)	1,791	(100.0)
26年 7月期	1,637	(99.8)	3	(0.2)	1,640	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
27年 1月中間期	2,602	—	—	2,602

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
27年 1月中間期	1,793	2	1,791	6,883.0
26年 7月期	1,677	37	1,640	6,304.6

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成26年7月10日現在	平成27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	19,298,275	5,138,156
株式 ※3	1,637,428,000	1,785,740,240
未収入金	19,686,600	—
未収配当金	1,498,500	2,559,000
未収利息	—	8
前払金	—	194,000
流動資産合計	1,677,911,375	1,793,631,404
資産合計	1,677,911,375	1,793,631,404
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	160,479
未払収益分配金	35,134,884	—
未払受託者報酬	862,556	940,095
未払委託者報酬	1,035,072	1,128,116
その他未払費用	43,576	46,906
流動負債合計	37,076,088	2,275,596
負債合計	37,076,088	2,275,596
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,102,887,872	2,102,887,872
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△462,052,585	△311,532,064
(分配準備積立金)	1,701,175	1,701,175
元本等合計	1,640,835,287	1,791,355,808
純資産合計	1,640,835,287	1,791,355,808
負債純資産合計	1,677,911,375	1,793,631,404

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成25年7月11日 至 平成26年1月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	17,230,290	20,253,601
受取利息	5,326	2,925
有価証券売買等損益	122,874,335	131,006,200
派生商品取引等損益	—	1,372,918
その他収益	—	3
営業収益合計	140,109,951	152,635,647
営業費用		
受託者報酬	946,361	940,095
委託者報酬	1,135,621	1,128,116
その他費用	47,239	46,915
営業費用合計	2,129,221	2,115,126
営業利益	137,980,730	150,520,521
経常利益	137,980,730	150,520,521
中間純利益	137,980,730	150,520,521
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△746,459,104	△462,052,585
剰余金増加額又は欠損金減少額	273,505,312	—
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	273,505,312	—
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△334,973,062	△311,532,064

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成26年7月11日	至 平成27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。
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。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成26年7月10日現在	平成27年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	3,311,485,384円	2,102,887,872円
期中追加設定元本額	—円	—円
期中一部交換元本額	1,208,597,512円	—円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	2,602,584口	2,602,584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462,052,585円であります。	中間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311,532,064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 7,609,000円

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成25年7月11日 至 平成26年1月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日
	該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成27年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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 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>

(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	前計算期間末 平成26年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成27年1月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	—	—	—	—	5,742,000	—	5,584,000	△158,000
合計	—	—	—	—	5,742,000	—	5,584,000	△158,000

(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。

原則として中間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、中間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。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 平成26年7月10日現在	当中間計算期間末 平成27年1月10日現在
1口当たり純資産額	630.46円	688.30円
(100口当たり純資産額)	(63,046円)	(68,830円)

平成27年7月期 中間決算短信（平成26年7月11日～平成27年1月10日）

平成27年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－日経225 上場取引所 東証
 コード番号 1320
 連動対象指標 日経平均株価
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

半期報告書提出予定日 平成27年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 27年1月中間期の運用状況（平成26年7月11日～平成27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	%
27年 1月中間期	1,185,437	(99.7)	3,866	(0.3)	1,189,304	(100.0)
26年 7月期	832,037	(99.8)	1,444	(0.2)	833,482	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
27年 1月中間期	53,943	35,718	22,017	67,644

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
27年 1月中間期	1,190,344	1,040	1,189,304	17,582
26年 7月期	845,353	11,871	833,482	15,451

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成26年7月10日現在	平成27年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	1,307,757
コール・ローン	5,528,220,667	3,397,274,045
株式 ※2	832,037,999,500	1,185,437,352,170
派生商品評価勘定	18,606,802	—
未収入金	7,024,828,993	—
未収配当金	743,968,000	1,456,006,200
未収利息	—	5,698
前払金	—	52,542,000
流動資産合計	845,353,623,962	1,190,344,487,870
資産合計	845,353,623,962	1,190,344,487,870
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	61,893,097
前受金	90,368,000	—
未払金	—	2,101,500
未払収益分配金	10,896,652,448	—
未払受託者報酬	297,919,761	369,067,213
未払委託者報酬	383,039,699	474,515,015
その他未払費用	203,627,131	132,768,357
流動負債合計	11,871,607,039	1,040,345,182
負債合計	11,871,607,039	1,040,345,182
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	663,886,641,968	832,505,476,625
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	169,595,374,955	356,798,666,063
(分配準備積立金)	794,678,062	794,678,062
元本等合計	833,482,016,923	1,189,304,142,688
純資産合計	833,482,016,923	1,189,304,142,688
負債純資産合計	845,353,623,962	1,190,344,487,870

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成 25 年 7 月 11 日 至 平成 26 年 1 月 10 日	自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 1 月 10 日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	5,256,358,800	7,791,521,800
受取利息	1,206,386	1,130,271
有価証券売買等損益	79,473,640,674	111,034,728,859
派生商品取引等損益	413,949,344	799,793,604
その他収益	965,894	710,758
営業収益合計	85,146,121,098	119,627,885,292
営業費用		
受託者報酬	269,273,156	369,067,213
委託者報酬	346,208,357	474,515,015
その他費用	97,490,492	135,669,648
営業費用合計	712,972,005	979,251,876
営業利益	84,433,149,093	118,648,633,416
経常利益	84,433,149,093	118,648,633,416
中間純利益	84,433,149,093	118,648,633,416
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	106,812,412,855	169,595,374,955
剰余金増加額又は欠損金減少額	53,178,285,294	160,763,066,326
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	53,178,285,294	160,763,066,326
剰余金減少額又は欠損金増加額	53,563,031,658	92,208,408,634
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	53,563,031,658	92,208,408,634
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	190,860,815,584	356,798,666,063

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成26年7月11日	至 平成27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。	
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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成26年7月10日現在	平成27年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	569,088,430,052 円	663,886,641,968 円
期中追加設定元本額	564,852,360,652 円	439,584,367,373 円
期中一部交換元本額	470,054,148,736 円	270,965,532,716 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	53,943,824 口	67,644,875 口
3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 2,557,250,000 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 3,206,750,000 円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成25年7月11日 至 平成26年1月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日
	該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成 27 年 1 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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 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。

（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	前計算期間末 平成 26 年 7 月 10 日 現在				当中間計算期間末 平成 27 年 1 月 10 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	1,369,012,000	—	1,387,750,000	18,738,000	3,864,792,000	—	3,803,410,000	△61,382,000
合計	1,369,012,000	—	1,387,750,000	18,738,000	3,864,792,000	—	3,803,410,000	△61,382,000

（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。

原則として中間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、中間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ぬ。
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。

（1口当たり情報）

	前計算期間末 平成 26 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 27 年 1 月 10 日現在
1口当たり純資産額	15,451円	17,582円

平成27年7月期 中間決算短信（平成26年7月11日～平成27年1月10日）

平成27年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－東証電気機器株価指数 上場取引所 東証
 コード番号 1610
 連動対象指標 東証電気機器株価指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 10口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

半期報告書提出予定日 平成27年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 27年1月中間期の運用状況（平成26年7月11日～平成27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	%
27年 1月中間期	1,955	(99.7)	5	(0.3)	1,960	(100.0)
26年 7月期	1,692	(99.8)	3	(0.2)	1,695	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
27年 1月中間期	1,023	-	-	1,023

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
27年 1月中間期	1,962	2	1,960	19,149.7
26年 7月期	1,718	22	1,695	16,562.3

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成26年7月10日現在	平成27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	15,723,925	3,396,722
株式	1,692,211,600	1,955,269,750
未収入金	7,172,749	—
未収配当金	3,086,000	3,953,200
未収利息	—	5
流動資産合計	1,718,194,274	1,962,619,677
資産合計	1,718,194,274	1,962,619,677
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	20,781,110	—
未払受託者報酬	859,182	1,004,762
未払委託者報酬	1,030,990	1,205,709
その他未払費用	43,407	50,142
流動負債合計	22,714,689	2,260,613
負債合計	22,714,689	2,260,613
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,958,338,100	1,958,338,100
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△262,858,515	2,020,964
(分配準備積立金)	3,102,308	3,102,308
元本等合計	1,695,479,585	1,960,359,064
純資産合計	1,695,479,585	1,960,359,064
負債純資産合計	1,718,194,274	1,962,619,677

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成25年7月11日 至 平成26年1月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	10,670,770	13,630,127
受取利息	2,311	1,994
有価証券売買等損益	239,740,462	253,507,950
その他収益	51	27
営業収益合計	250,413,594	267,140,098
営業費用		
受託者報酬	777,031	1,004,762
委託者報酬	932,450	1,205,709
その他費用	38,768	50,148
営業費用合計	1,748,249	2,260,619
営業利益	248,665,345	264,879,479
経常利益	248,665,345	264,879,479
中間純利益	248,665,345	264,879,479
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△519,267,565	△262,858,515
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△270,602,220	2,020,964

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成26年7月11日	至 平成27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。	
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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成26年7月10日現在	平成27年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	1,958,338,100 円	1,958,338,100 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	1,023,700 口	1,023,700 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262,858,515 円であります。	

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成25年7月11日 至 平成26年1月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日
	該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成27年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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 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。

（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

前計算期間末 平成26年7月10日現在	当中間計算期間末 平成27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。

（1口当たり情報）

	前計算期間末 平成26年7月10日現在	当中間計算期間末 平成27年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,656.23円	1,914.97円
（100口当たり純資産額）	（165,623円）	（191,497円）

平成27年7月期 中間決算短信（平成26年7月11日～平成27年1月10日）

平成27年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－東証銀行業株価指数 上場取引所 東証
 コード番号 1612
 連動対象指標 東証銀行業株価指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 100口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

半期報告書提出予定日 平成27年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 27年1月中間期の運用状況（平成26年7月11日～平成27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	%
27年 1月中間期	805	(99.9)	0	(0.1)	805	(100.0)
26年 7月期	771	(100.0)	0	(0.0)	771	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
27年 1月中間期	4,674	-	-	4,674

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	100口当たり基準価額 (③/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)×100)
	百万円	百万円	百万円	円
27年 1月中間期	806	0	805	17,233
26年 7月期	789	18	771	16,503

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成26年7月10日現在	平成27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	11,541,681	1,261,172
株式	771,152,200	805,142,830
未収入金	6,979,700	—
未収配当金	72,000	120,000
未収利息	—	2
流動資産合計	789,745,581	806,524,004
資産合計	789,745,581	806,524,004
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	17,435,332	—
未払受託者報酬	410,143	434,584
未払委託者報酬	492,169	521,504
その他未払費用	20,679	21,641
流動負債合計	18,358,323	977,729
負債合計	18,358,323	977,729
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	958,242,160	958,242,160
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△186,854,902	△152,695,885
(分配準備積立金)	112,910	112,910
元本等合計	771,387,258	805,546,275
純資産合計	771,387,258	805,546,275
負債純資産合計	789,745,581	806,524,004

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成25年7月11日 至 平成26年1月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	8,272,800	9,651,075
受取利息	2,041	1,245
有価証券売買等損益	58,785,018	25,484,436
その他収益	1	4
営業収益合計	67,059,860	35,136,760
営業費用		
受託者報酬	426,379	434,584
委託者報酬	511,648	521,504
その他費用	21,231	21,655
営業費用合計	959,258	977,743
営業利益	66,100,602	34,159,017
経常利益	66,100,602	34,159,017
中間純利益	66,100,602	34,159,017
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△146,415,012	△186,854,902
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△80,314,410	△152,695,885

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成26年7月11日	至 平成27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。	
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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成26年7月10日現在	平成27年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	958,242,160 円	958,242,160 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,674,352 口	4,674,352 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186,854,902円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は152,695,885円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成25年7月11日 至 平成26年1月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年1月10日
	該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成27年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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 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。

（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

前計算期間末 平成26年7月10日現在	当中間計算期間末 平成27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。

（1口当たり情報）

	前計算期間末 平成26年7月10日現在	当中間計算期間末 平成27年1月10日現在
1口当たり純資産額	165.03円	172.33円
（100口当たり純資産額）	（16,503円）	（17,233円）