

平成 27 年 8 月 21 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 (平成 26 年 7 月 11 日～平成 27 年 7 月 10 日) 決算短信

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

上場ETF銘柄 (5銘柄)

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

*各銘柄の決算短信につきましては、次ページ以降をご参照ください。
なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の決算短信が表示されます。

以上

平成27年7月期（平成26年7月11日～平成27年7月10日）決算短信

平成27年8月21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

有価証券報告書提出予定日 平成27年10月 2日
 分配金支払開始日 平成27年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 27年7月期の運用状況（平成26年7月11日～平成27年7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 7月期	1,278,250	(99.9)	1,675	(0.1)	1,279,925	(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)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
27年 7月期	867,629	258,772	342,631	783,769
26年 7月期	765,244	501,946	399,561	867,629

(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
27年 7月期	1,357,768	77,843	1,279,925	16,330
26年 7月期	1,194,841	71,109	1,123,731	12,952

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
27年 7月期	242
26年 7月期	164

(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13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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	67,250,832,430
株式 ※2※3	1,122,765,596,200	1,278,250,047,993
派生商品評価勘定	9,530,062	—
未収入金	7,718,508,583	10,541,275,861
未収配当金	833,830,740	1,185,541,120
前払金	—	502,430,000
その他未収収益 ※4	72,073,444	38,567,121
流動資産合計	1,194,841,118,331	1,357,768,694,525
資産合計	1,194,841,118,331	1,357,768,694,525
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,139,352	74,381,034
前受金	194,534,000	—
未払金	3,193,460	423,837,367
未払収益分配金	14,229,125,046	18,967,233,370
未払受託者報酬	189,125,149	235,333,371
未払委託者報酬	387,415,774	483,955,565
未払利息	523,613	456,957
受入担保金	55,882,560,090	57,397,637,955
その他未払費用	221,310,826	260,754,556
流動負債合計	71,109,927,310	77,843,590,175
負債合計	71,109,927,310	77,843,590,175
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,084,536,970,000	979,712,467,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	39,194,221,021	300,212,636,850
(分配準備積立金)	940,385,753	1,240,865,748
元本等合計	1,123,731,191,021	1,279,925,104,350
純資産合計	1,123,731,191,021	1,279,925,104,350
負債純資産合計	1,194,841,118,331	1,357,768,694,525

(2) 損益及び剰余金計算書

	第13期	第14期
	自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日 金額(円)	自 平成26年7月11日 至 平成27年7月10日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	15,175,316,794	20,134,374,139
受取利息	27,641,510	33,370,018
有価証券売買等損益	82,593,459,094	237,708,985,252
派生商品取引等損益	740,376,711	1,125,587,248
その他収益 ※1	569,567,764	753,969,989
営業収益合計	99,106,361,873	259,756,286,646
営業費用		
支払利息	15,024,043	16,404,328
受託者報酬	364,644,346	452,093,161
委託者報酬	745,636,661	926,818,688
その他費用	221,628,771	258,684,604
営業費用合計	1,346,933,821	1,654,000,781
営業利益	97,759,428,052	258,102,285,865
経常利益	97,759,428,052	258,102,285,865
当期純利益	97,759,428,052	258,102,285,865
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	4,035,419,440	68,554,144,614
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	4,035,419,440	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	68,554,144,614
剰余金減少額又は欠損金増加額	27,395,573,135	46,670,781,280
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	46,670,781,280
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	27,395,573,135	—
分配金 ※2	14,229,125,046	18,967,233,370
期末剰余金又は期末欠損金(△)	39,194,221,021	300,212,636,850

(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14期	
	自 平成26年7月11日	至 平成27年7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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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	323,465,137,500円
期中一部交換元本額	499,451,318,750円	428,289,640,000円
2. 計算期間末日における受益権の総数	867,629,576口	783,769,974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 54,263,050,450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 890,730,000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35,033,508円が含まれております。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第13期	第14期
	自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年7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448,896,727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620,842,824円が含まれております。
2. ※2 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（15,757,502,025円）及び分配準備積立金（743,918,552円）の合計額から、経費（1,331,909,778円）を控除して計算される分配対象額は15,169,510,799円（10口当たり174円）であり、うち14,229,125,046円（10口当たり164円）を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（20,905,309,818円）及び分配準備積立金（940,385,753円）の合計額から、経費（1,637,596,453円）を控除して計算される分配対象額は20,208,099,118円（10口当たり257円）であり、うち18,967,233,370円（10口当たり242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14期
	自 平成26年7月11日 至 平成27年7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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、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における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

	デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--	--

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第14期 平成27年7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
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7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	76,245,556,551	206,990,913,449
合計	76,245,556,551	206,990,913,449

(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13期 平成26年7月10日 現在				第14期 平成27年7月10日 現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	914,088,000	—	921,625,000	7,537,000	1,711,448,000	—	1,637,185,000	△74,263,000
合計	914,088,000	—	921,625,000	7,537,000	1,711,448,000	—	1,637,185,000	△74,263,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

第14期 自 平成26年7月11日 至 平成27年7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13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,295.2円	1,633.0円
(10口当たり純資産額)	(12,952円)	(16,330円)

平成27年7月期（平成26年7月11日～平成27年7月10日）決算短信

平成27年8月21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

有価証券報告書提出予定日 平成27年10月 2日
 分配金支払開始日 平成27年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 27年7月期の運用状況（平成26年7月11日～平成27年7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 7月期	2,030	(99.6)	7	(0.4)	2,037	(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)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
27年 7月期	2,602	-	-	2,602
26年 7月期	4,098	-	1,495	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/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
27年 7月期	2,079	41	2,037	7,829.5
26年 7月期	1,677	37	1,640	6,304.6

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
27年 7月期	148
26年 7月期	135

(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13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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	26,286,385
株式 ※3	1,637,428,000	2,030,088,680
未収入金	19,686,600	19,574,950
未収配当金	1,498,500	2,474,600
前払金	—	1,141,500
差入委託証拠金	—	73,500
流動資産合計	1,677,911,375	2,079,639,615
資産合計	1,677,911,375	2,079,639,615
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	307,744
未払金	—	663,898
未払収益分配金	35,134,884	38,518,243
未払受託者報酬	862,556	1,091,381
未払委託者報酬	1,035,072	1,309,671
その他未払費用	43,576	54,490
流動負債合計	37,076,088	41,945,427
負債合計	37,076,088	41,945,427
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,102,887,872	2,102,887,872
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△462,052,585	△65,193,684
(分配準備積立金)	1,701,175	2,579,982
元本等合計	1,640,835,287	2,037,694,188
純資産合計	1,640,835,287	2,037,694,188
負債純資産合計	1,677,911,375	2,079,639,615

(2) 損益及び剰余金計算書

	第13期	第14期
	自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日 金額(円)	自 平成26年7月11日 至 平成27年7月10日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	37,872,794	43,962,662
受取利息	6,353	4,747
有価証券売買等損益	12,227,072	394,022,843
派生商品取引等損益	—	1,957,251
その他収益	297	309
営業収益合計	50,106,516	439,947,812
営業費用		
受託者報酬	1,808,917	2,031,476
委託者報酬	2,170,693	2,437,787
その他費用	90,815	101,405
営業費用合計	4,070,425	4,570,668
営業利益	46,036,091	435,377,144
経常利益	46,036,091	435,377,144
当期純利益	46,036,091	435,377,144
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	—
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	273,505,312	—
分配金 ※1	35,134,884	38,518,243
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△462,052,585	△65,193,684

(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14期	
	自 平成26年7月11日	至 平成27年7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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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. 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。	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65,193,684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 7,925,000円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年7月10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 (37,879,444円)及び分配準備積立金(3,027,040円)の合計額から、経費(4,070,425円)を控除して計算される分配対象額は36,836,059円(100口当たり1,415円)であり、うち35,134,884円(100口当たり1,350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 (43,967,718円)及び分配準備積立金(1,701,175円)の合計額から、経費(4,570,668円)を控除して計算される分配対象額は41,098,225円(100口当たり1,579円)であり、うち38,518,243円(100口当たり1,480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14期 自 平成26年7月11日 至 平成27年7月10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14期 平成27年7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
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7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	17,987,779	388,515,271
合計	17,987,779	388,515,271

(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13期 平成26年7月10日 現在				第14期 平成27年7月10日 現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	—	—	—	—	7,509,000	—	7,204,500	△304,500
合計	—	—	—	—	7,509,000	—	7,204,500	△304,500

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

第14期 自 平成26年7月11日 至 平成27年7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13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7月10日現在
1口当たり純資産額	630.46円	782.95円
(100口当たり純資産額)	(63,046円)	(78,295円)

平成27年7月期（平成26年7月11日～平成27年7月10日）決算短信

平成27年8月21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

有価証券報告書提出予定日 平成27年10月 2日
 分配金支払開始日 平成27年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 27年7月期の運用状況（平成26年7月11日～平成27年7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 7月期	1,351,330	(99.7)	4,580	(0.3)	1,355,910	(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)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
27年 7月期	53,943	53,427	40,026	67,345
26年 7月期	46,241	45,896	38,194	53,943

(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
27年 7月期	1,374,147	18,236	1,355,910	20,134
26年 7月期	845,353	11,871	833,482	15,451

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
27年 7月期	246
26年 7月期	202

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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	5,528,220,667	12,264,356,216
株式 ※2	832,037,999,500	1,351,330,178,940
派生商品評価勘定	18,606,802	—
未収入金	7,024,828,993	9,069,337,546
未収配当金	743,968,000	1,265,106,000
前払金	—	218,420,000
流動資産合計	845,353,623,962	1,374,147,398,702
資産合計	845,353,623,962	1,374,147,398,702
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	92,827,248
前受金	90,368,000	—
未払金	—	160,019,794
未払収益分配金	10,896,652,448	16,566,892,140
未払受託者報酬	297,919,761	485,994,919
未払委託者報酬	383,039,699	624,850,653
その他未払費用	203,627,131	305,828,117
流動負債合計	11,871,607,039	18,236,412,871
負債合計	11,871,607,039	18,236,412,871
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	663,886,641,968	828,816,022,630
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	169,595,374,955	527,094,963,201
(分配準備積立金)	794,678,062	1,290,956,009
元本等合計	833,482,016,923	1,355,910,985,831
純資産合計	833,482,016,923	1,355,910,985,831
負債純資産合計	845,353,623,962	1,374,147,398,702

(2) 損益及び剰余金計算書

	第13期	第14期
	自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日 金額(円)	自 平成26年7月11日 至 平成27年7月10日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	12,590,503,320	19,325,307,192
受取利息	2,185,852	2,477,869
有価証券売買等損益	51,848,412,953	286,706,881,847
派生商品取引等損益	534,517,148	1,628,287,271
その他収益	1,743,032	1,566,078
営業収益合計	64,977,362,305	307,664,520,257
営業費用		
受託者報酬	567,192,917	855,062,132
委託者報酬	729,248,056	1,099,365,668
その他費用	208,698,588	311,753,252
営業費用合計	1,505,139,561	2,266,181,052
営業利益	63,472,222,744	305,398,339,205
経常利益	63,472,222,744	305,398,339,205
当期純利益	63,472,222,744	305,398,339,205
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	119,719,967,968	293,135,958,142
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	119,719,967,968	293,135,958,142
剰余金減少額又は欠損金増加額	109,512,576,164	224,467,816,961
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	109,512,576,164	224,467,816,961
分配金 ※1	10,896,652,448	16,566,892,140
期末剰余金又は期末欠損金(△)	169,595,374,955	527,094,963,201

(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 14 期	
	自 平成 26 年 7 月 11 日	至 平成 27 年 7 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 13 期	第 14 期
	平成 26 年 7 月 10 日現在	平成 27 年 7 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	657,535,725,381 円
期中一部交換元本額	470,054,148,736 円	492,606,344,719 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	53,943,824 口	67,345,090 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 3,888,750,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 13 期	第 14 期
	自 平成 25 年 7 月 11 日 至 平成 26 年 7 月 10 日	自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 7 月 10 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 (12,594,432,204 円) 及び分配準備積立金(602,037,867 円)の合計額から、経費(1,505,139,561 円)を控除して計算される分配対象額は 11,691,330,510 円 (1 口当たり 216 円) であり、うち 10,896,652,448 円 (1 口当たり 202 円) を分配金額としております。</p>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (19,329,351,139 円) 及び分配準備積立金(794,678,062 円)の合計額から、経費(2,266,181,052 円)を控除して計算される分配対象額は 17,857,848,149 円 (1 口当たり 265 円) であり、うち 16,566,892,140 円 (1 口当たり 246 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 14 期 自 平成 26 年 7 月 11 日 至 平成 27 年 7 月 10 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14期 平成27年7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) 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。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7月10日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	
株式	35,153,813,677	210,750,893,081
合計	35,153,813,677	210,750,893,081

(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13期 平成26年7月10日 現在				第14期 平成27年7月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,369,012,000	—	1,387,750,000	18,738,000	4,521,200,000	—	4,428,780,000	△92,420,000
合計	1,369,012,000	—	1,387,750,000	18,738,000	4,521,200,000	—	4,428,780,000	△92,420,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

第14期 自 平成26年7月11日 至 平成27年7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13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7月10日現在
1口当たり純資産額	15,451円	20,134円

平成27年7月期（平成26年7月11日～平成27年7月10日）決算短信

平成27年8月21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

有価証券報告書提出予定日 平成27年10月 2日
 分配金支払開始日 平成27年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 27年7月期の運用状況（平成26年7月11日～平成27年7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 7月期	2,139	(100.0)	0	(0.0)	2,139	(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)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
27年 7月期	1,023	—	—	1,023
26年 7月期	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/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
27年 7月期	2,169	29	2,139	20,901.4
26年 7月期	1,718	22	1,695	16,562.3

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
27年 7月期	267
26年 7月期	203

(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13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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	18,729,814
株式	1,692,211,600	2,139,174,100
未収入金	7,172,749	8,191,750
未収配当金	3,086,000	3,570,800
流動資産合計	1,718,194,274	2,169,666,464
資産合計	1,718,194,274	2,169,666,464
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	20,781,110	27,332,790
未払受託者報酬	859,182	1,179,669
未払委託者報酬	1,030,990	1,415,625
その他未払費用	43,407	58,900
流動負債合計	22,714,689	29,986,984
負債合計	22,714,689	29,986,984
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,958,338,100	1,958,338,100
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△262,858,515	181,341,380
(分配準備積立金)	3,102,308	3,631,057
元本等合計	1,695,479,585	2,139,679,480
純資産合計	1,695,479,585	2,139,679,480
負債純資産合計	1,718,194,274	2,169,666,464

(2) 損益及び剰余金計算書

	第13期	第14期
	自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日 金額(円)	自 平成26年7月11日 至 平成27年7月10日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	24,319,004	32,773,088
受取利息	3,730	3,221
有価証券売買等損益	256,549,201	443,671,146
その他収益	53	43
営業収益合計	280,871,988	476,447,498
営業費用		
受託者報酬	1,636,213	2,184,431
委託者報酬	1,963,440	2,621,334
その他費用	82,175	109,048
営業費用合計	3,681,828	4,914,813
営業利益	277,190,160	471,532,685
経常利益	277,190,160	471,532,685
当期純利益	277,190,160	471,532,685
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△519,267,565	△262,858,515
分配金 ※1	20,781,110	27,332,790
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△262,858,515	181,341,380

(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14期	
	自 平成26年7月11日	至 平成27年7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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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. 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。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年7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 (24,322,787円)及び分配準備積立金(3,242,459円)の合計額から、経費(3,681,828円)を控除して計算される分配対象額は23,883,418円(100口当たり2,333円)であり、うち20,781,110円(100口当たり2,030円)を分配金額としてお	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 (32,776,352円)及び分配準備積立金(3,102,308円)の合計額から、経費(4,914,813円)を控除して計算される分配対象額は30,963,847円(100口当たり3,024円)であり、うち27,332,790円(100口当たり2,670円)を分配金額としてお

	ります。	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14期
	自 平成26年7月11日 至 平成27年7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14期
	平成27年7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 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13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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	254,180,139	438,306,290
合計	254,180,139	438,306,290

(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13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7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14期 自 平成26年7月11日 至 平成27年7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13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7月10日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,656.23円 (165,623円)	2,090.14円 (209,014円)

平成27年7月期（平成26年7月11日～平成27年7月10日）決算短信

平成27年8月21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

有価証券報告書提出予定日 平成27年10月 2日
 分配金支払開始日 平成27年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 27年7月期の運用状況（平成26年7月11日～平成27年7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 7月期	1,006	(99.9)	1	(0.1)	1,007	(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)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
27年 7月期	4,674	-	-	4,674
26年 7月期	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/当計算期間末発行済口数) × 100
	百万円	百万円	百万円	円
27年 7月期	1,028	21	1,007	21,560
26年 7月期	789	18	771	16,503

(4) 分配金

	100口当たり分配金
	円
27年 7月期	426
26年 7月期	373

(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13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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	12,851,886
株式	771,152,200	1,006,745,000
未収入金	6,979,700	9,149,500
未収配当金	72,000	120,000
流動資産合計	789,745,581	1,028,866,386
資産合計	789,745,581	1,028,866,386
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	17,435,332	19,912,739
未払受託者報酬	410,143	514,716
未払委託者報酬	492,169	617,668
その他未払費用	20,679	25,656
流動負債合計	18,358,323	21,070,779
負債合計	18,358,323	21,070,779
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	958,242,160	958,242,160
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△186,854,902	49,553,447
(分配準備積立金)	112,910	158,026
元本等合計	771,387,258	1,007,795,607
純資産合計	771,387,258	1,007,795,607
負債純資産合計	789,745,581	1,028,866,386

(2) 損益及び剰余金計算書

	第13期	第14期
	自平成25年7月11日 至平成26年7月10日 金額(円)	自平成26年7月11日 至平成27年7月10日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	19,410,950	22,091,975
受取利息	2,408	1,659
有価証券売買等損益	△40,535,668	236,363,233
その他収益	1	4
営業収益合計	△21,122,309	258,456,871
営業費用		
受託者報酬	836,522	949,300
委託者報酬	1,003,817	1,139,172
その他費用	41,910	47,311
営業費用合計	1,882,249	2,135,783
営業利益又は営業損失(△)	△23,004,558	256,321,088
経常利益又は経常損失(△)	△23,004,558	256,321,088
当期純利益又は当期純損失(△)	△23,004,558	256,321,088
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△146,415,012	△186,854,902
分配金 ※1	17,435,332	19,912,739
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△186,854,902	49,553,447

(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14期	
	自 平成26年7月11日 至 平成27年7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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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. 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。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日	自 平成26年7月11日 至 平成27年7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（19,413,359円）及び分配準備積立金（17,132円）の合計額から、経費（1,882,249円）を控除して計算される分配対象額は17,548,242円（100口当たり375円）であり、うち17,435,332円（100口当たり373円）を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（22,093,638円）及び分配準備積立金（112,910円）の合計額から、経費（2,135,783円）を控除して計算される分配対象額は20,070,765円（100口当たり429円）であり、うち19,912,739円（100口当たり426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14期	
	自 平成26年7月11日 至 平成27年7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14期	
	平成27年7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	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7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	△39,722,241	233,990,166
合計	△39,722,241	233,990,166

（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13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7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14期 自 平成26年7月11日 至 平成27年7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13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7月10日現在
1口当たり純資産額	165.03円	215.60円
（100口当たり純資産額）	（16,503円）	（21,560円）