

平成 29 年 2 月 23 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 岩本 信之
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 29 年 1 月期 (平成 28 年 7 月 11 日～平成 29 年 1 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 29 年 1 月期 (平成 28 年 7 月 11 日～平成 29 年 1 月 10 日) 決算短信をご報告します。

記

上場ETF銘柄 (3銘柄)

銘柄名	銘柄コード	上場取引所
ダイワ上場投信－MSCI 日本株人材設備投資指数	1479	東
ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials	1585	東
ダイワ上場投信－J P X 日経 400	1599	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29年1月期（平成28年7月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数 上場取引所 東証
 コード番号 1479
 連動対象指標 MSCI日本株人材設備投資指数
 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)岩本 信之
 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29年4月 3日
 分配金支払開始日 平成29年2月17日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月11日～平成29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	%
29年 1月期	78,904	(99.7)	248	(0.3)	79,153	(100.0)
28年 7月期	34,746	(99.7)	108	(0.3)	34,854	(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
29年 1月期	2,382	1,953	—	4,335
28年 7月期	—	2,382	—	2,382

(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
29年 1月期	79,813	660	79,153	18,256.3
28年 7月期	34,880	25	34,854	14,630.9

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	130
28年 7月期	0

(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1期	第2期
	平成28年7月10日現在	平成29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	60,305,942	741,532,161
株式 ※3	34,746,514,040	78,904,813,420
派生商品評価勘定	—	4,301,208
未収入金	—	21,710,544
未収配当金	68,911,000	141,300,250
前払金	4,777,600	—
流動資産合計	34,880,508,582	79,813,657,583
資産合計	34,880,508,582	79,813,657,583
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,000,508	—
前受金	—	30,116,000
未払収益分配金	—	563,635,410
未払受託者報酬	2,468,266	11,667,515
未払委託者報酬	14,809,665	53,127,438
未払利息	180	—
その他未払費用	2,708,320	1,944,574
流動負債合計	25,986,939	660,490,937
負債合計	25,986,939	660,490,937
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	38,342,281,560	69,782,399,415
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△3,487,759,917	9,370,767,231
（分配準備積立金）	48,919,484	141,533,896
元本等合計	34,854,521,643	79,153,166,646
純資産合計	34,854,521,643	79,153,166,646
負債純資産合計	34,880,508,582	79,813,657,583

(2) 損益及び剰余金計算書

	第1期	第2期
	自平成28年5月18日 至平成28年7月10日	自平成28年7月11日 至平成29年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	68,911,000	736,493,700
有価証券売買等損益	△3,085,864,254	12,596,871,181
派生商品取引等損益	△9,443,244	112,831,956
その他収益	—	104,579
営業収益合計	△3,026,396,498	13,446,301,416
営業費用		
支払利息	5,265	62,931
受託者報酬	2,468,266	11,667,515
委託者報酬	14,809,665	53,127,438
その他費用 ※1	2,708,320	15,490,573
営業費用合計	19,991,516	80,348,457
営業利益又は営業損失(△)	△3,046,388,014	13,365,952,959
経常利益又は経常損失(△)	△3,046,388,014	13,365,952,959
当期純利益又は当期純損失(△)	△3,046,388,014	13,365,952,959
期首剰余金又は期首欠損金(△)	—	△3,487,759,917
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	56,209,599
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	56,209,599
剰余金減少額又は欠損金増加額	441,371,903	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	441,371,903	—
分配金 ※2	—	563,635,410
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△3,487,759,917	9,370,767,231

(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 2 期	
	自 平成 28 年 7 月 11 日	至 平成 29 年 1 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。 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 1 期	第 2 期
	平成 28 年 7 月 10 日現在	平成 29 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	30,737,909,100 円	38,342,281,560 円
期中追加設定元本額	7,604,372,460 円	31,440,117,855 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	2,382,248 口	4,335,657 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3,487,759,917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 50,550,000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 68,610,000円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 1 期	第 2 期
	自 平成 28 年 5 月 18 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 1 月 10 日
1. ※1 その他費用	主に、対象株価指数の商標の使用料であります。	主に、対象株価指数の商標の使用料であります。
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（68,905,735円）及び分配準備積立金(0円)の合計額から、経費(19,986,251円)を控除して計算される分配対象額は48,919,484円(10口当たり205円)であり、分配を行っておりません。	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（736,535,348円）及び分配準備積立金(48,919,484円)の合計額から、経費(80,285,526円)を控除して計算される分配対象額は705,169,306円(10口当たり1,626円)であり、うち563,635,410円(10口当たり1,300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 2 期
	自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 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2期
	平成29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)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 1 期 平成 28 年 7 月 10 日 現在	第 2 期 平成 29 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	△3,130,863,126	11,333,780,143
合計	△3,130,863,126	11,333,780,143

（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 1 期 平成 28 年 7 月 10 日 現在				第 2 期 平成 29 年 1 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	116,130,100	—	110,140,500	△5,989,600	236,148,000	—	240,468,000	4,320,000
合計	116,130,100	—	110,140,500	△5,989,600	236,148,000	—	240,468,000	4,320,000

（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 2 期 自 平成 28 年 7 月 11 日

至 平成29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1期 平成28年7月10日現在	第2期 平成29年1月10日現在
1口当たり純資産額	14,630.9円	18,256.3円
(10口当たり純資産額)	(146,309円)	(182,563円)

平成29年1月期（平成28年7月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23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)岩本 信之
 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29年4月 3日
 分配金支払開始日 平成29年2月17日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月11日～平成29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	%
29年 1月期	1,789	(99.5)	9	(0.5)	1,799	(100.0)
28年 7月期	24,058	(99.8)	56	(0.2)	24,114	(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
29年 1月期	22,783	—	21,241	1,542
28年 7月期	21,822	3,883	2,922	22,783

(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
29年 1月期	2,048	248	1,799	11,664.8
28年 7月期	24,385	270	24,114	10,584.2

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
29年 1月期	1,498
28年 7月期	105

(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 6 期	第 7 期
	平成 28 年 7 月 10 日現在	平成 29 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	286,817,437	26,940,976
株式	24,058,279,890	1,789,470,429
未収入金	—	228,122,447
未収配当金	40,336,345	3,585,621
流動資産合計	24,385,433,672	2,048,119,473
資産合計	24,385,433,672	2,048,119,473
負債の部		
流動負債		
未払金	—	1,135,876
未払収益配当金	239,229,417	231,052,868
未払受託者報酬	6,622,066	4,272,439
未払委託者報酬	17,217,466	11,108,421
未払利息	858	—
その他未払費用	7,515,476	1,356,787
流動負債合計	270,585,283	248,926,391
負債合計	270,585,283	248,926,391
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	22,533,132,706	1,525,442,501
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1,581,715,683	273,750,581
(分配準備積立金)	41,868,920	3,730,264
元本等合計	24,114,848,389	1,799,193,082
純資産合計	24,114,848,389	1,799,193,082
負債純資産合計	24,385,433,672	2,048,119,473

(2) 損益及び剰余金計算書

	第6期	第7期
	自平成28年1月11日 至平成28年7月10日	自平成28年7月11日 至平成29年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	267,679,062	211,107,628
受取利息	12,032	—
有価証券売買等損益	△3,327,819,790	3,001,340,659
その他収益	188,462	202,345
営業収益合計	△3,059,940,234	3,212,650,632
営業費用		
支払利息	19,572	17,396
受託者報酬	6,622,066	4,272,439
委託者報酬	17,217,466	11,108,421
その他費用	4,635,586	2,997,505
営業費用合計	28,494,690	18,395,761
営業利益又は営業損失(△)	△3,088,434,924	3,194,254,871
経常利益又は経常損失(△)	△3,088,434,924	3,194,254,871
当期純利益又は当期純損失(△)	△3,088,434,924	3,194,254,871
期首剰余金又は期首欠損金(△)	5,011,143,881	1,581,715,683
剰余金増加額又は欠損金減少額	469,773,349	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	469,773,349	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	571,537,206	4,271,167,105
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	571,537,206	4,271,167,105
分配金 ※1	239,229,417	231,052,868
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,581,715,683	273,750,581

(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 7 期	
	自 平成 28 年 7 月 11 日	至 平成 29 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 6 期	第 7 期
	平成 28 年 7 月 10 日現在	平成 29 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	21,582,442,610 円	22,533,132,706 円
期中追加設定元本額	3,841,117,760 円	－円
期中一部交換元本額	2,890,427,664 円	21,007,690,205 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	22,783,754 口	1,542,409 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 6 期	第 7 期
	自 平成 28 年 1 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 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配当金、配当株式、受取利息及	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(267,859,984円)及び分配準備積立金(41,713,471円)の合計額から、経費(28,475,118円)を控除して計算される分配対象額は281,098,337円(100口当たり1,233円)であり、うち239,229,417円(100口当たり1,050円)を分配金額としております。	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(211,292,577円)及び分配準備積立金(41,868,920円)の合計額から、経費(18,378,365円)を控除して計算される分配対象額は234,783,132円(100口当たり15,221円)であり、うち231,052,868円(100口当たり14,980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7期	
	自 平成28年7月11日 至 平成29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7期	
	平成29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 6 期 平成 28 年 7 月 10 日現在	第 7 期 平成 29 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	△3,238,691,982	306,525,763
合計	△3,238,691,982	306,525,763

(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 6 期 平成 28 年 7 月 10 日現在	第 7 期 平成 29 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 7 期 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 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 6 期 平成 28 年 7 月 10 日現在	第 7 期 平成 29 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)	1,058.42円 (105,842円)	1,166.48円 (116,648円)

平成29年1月期（平成28年7月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－J P X日経400 上場取引所 東証
 コード番号 1599
 連動対象指標 J P X日経インデックス400
 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)岩本 信之
 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29年4月 3日
 分配金支払開始日 平成29年2月17日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年7月11日～平成29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	%
29年 1月期	114,107	(99.7)	354	(0.3)	114,462	(100.0)
28年 7月期	77,957	(99.8)	178	(0.2)	78,136	(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
29年 1月期	7,116	2,854	1,768	8,202
28年 7月期	4,935	3,355	1,174	7,116

(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
29年 1月期	115,407	944	114,462	13,954.4
28年 7月期	78,958	822	78,136	10,980.2

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	95
28年 7月期	98

(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 5 期	第 6 期
	平成 28 年 7 月 10 日現在	平成 29 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	391,009,514	1,083,800,778
株式 ※2	77,957,614,180	114,107,426,790
派生商品評価勘定	—	7,836,432
未収入金	432,190,817	29,432,100
未収配当金	138,180,900	158,873,300
前払金	39,243,400	—
差入委託証拠金	—	19,715,000
流動資産合計	78,958,238,811	115,407,084,400
資産合計	78,958,238,811	115,407,084,400
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,530,248	—
前受金	—	42,979,000
未払金	29,089,080	—
未払収益分配金	697,376,820	779,247,950
未払受託者報酬	19,305,264	25,385,894
未払委託者報酬	50,193,759	66,003,418
未払利息	1,170	—
その他未払費用	10,703,709	31,069,089
流動負債合計	822,200,050	944,685,351
負債合計	822,200,050	944,685,351
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	74,946,659,880	86,389,888,520
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	3,189,378,881	28,072,510,529
(分配準備積立金)	143,782,117	162,063,577
元本等合計	78,136,038,761	114,462,399,049
純資産合計	78,136,038,761	114,462,399,049
負債純資産合計	78,958,238,811	115,407,084,400

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 5 期	第 6 期
	自 平成 28 年 1 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 1 月 10 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	832,330,940	909,715,595
受取利息	20,696	—
有価証券売買等損益	△12,553,513,287	22,383,937,794
派生商品取引等損益	△72,721,879	151,750,584
その他収益	366,164	728,355
営業収益合計	△11,793,517,366	23,446,132,328
営業費用		
支払利息	24,265	110,219
受託者報酬	19,305,264	25,385,894
委託者報酬	50,193,759	66,003,418
その他費用	16,478,817	21,415,009
営業費用合計	86,002,105	112,914,540
営業利益又は営業損失 (△)	△11,879,519,471	23,333,217,788
経常利益又は経常損失 (△)	△11,879,519,471	23,333,217,788
当期純利益又は当期純損失 (△)	△11,879,519,471	23,333,217,788
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	12,754,073,945	3,189,378,881
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,791,055,763	6,145,895,580
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	4,791,055,763	6,145,895,580
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,778,854,536	3,816,733,770
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,778,854,536	3,816,733,770
分配金 ※1	697,376,820	779,247,950
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	3,189,378,881	28,072,510,529

(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 6 期	
	自 平成 28 年 7 月 11 日	至 平成 29 年 1 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。 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 5 期	第 6 期
	平成 28 年 7 月 10 日現在	平成 29 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	51,979,611,736 円	74,946,659,880 円
期中追加設定元本額	35,340,431,428 円	30,066,911,580 円
期中一部交換元本額	12,373,383,284 円	18,623,682,940 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	7,116,090 口	8,202,610 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。	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 79,845,000 円	株式 83,907,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 5 期	第 6 期
	自 平成 28 年 1 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日	自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 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(832,693,535 円)及び分配準備積立金(94,443,242 円)の合計額から、経費(85,977,840 円)を控除して計算される分配対象額は 841,158,937 円(10 口当たり 1,182 円)であり、うち 697,376,820 円(10 口当たり 980 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(910,333,731 円)及び分配準備積立金(143,782,117 円)の合計額から、経費(112,804,321 円)を控除して計算される分配対象額は 941,311,527 円(10 口当たり 1,147 円)であり、うち 779,247,950 円(10 口当たり 950 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 6 期
	自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。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 6 期 平成 29 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	<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 5 期 平成 28 年 7 月 10 日現在	第 6 期 平成 29 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	△11,437,709,860	19,360,441,847
合計	△11,437,709,860	19,360,441,847

（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 5 期 平成 28 年 7 月 10 日 現在				第 6 期 平成 29 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	185,631,400	－	170,118,000	△15,513,400	332,109,000	－	339,972,000	7,863,000
合計	185,631,400	－	170,118,000	△15,513,400	332,109,000	－	339,972,000	7,863,000

(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 6 期	
自	平成 28 年 7 月 11 日
至	平成 29 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 5 期 平成 28 年 7 月 10 日現在	第 6 期 平成 29 年 1 月 10 日現在
	1 口当たり純資産額 (10 口当たり純資産額)	10,980.2 円 (109,802 円)