

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 7 月期 中間決算短信（平成 28 年 7 月 11 日～平成 29 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 29 年 7 月期 中間決算短信（平成 28 年 7 月 11 日～平成 29 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－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29年7月期 中間決算短信（平成28年7月11日～平成29年1月10日）

平成29年2月23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)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

半期報告書提出予定日 平成29年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月中間期の運用状況（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月中間期	1,888,854	(99.8)	4,623	(0.2)	1,893,478	(100.0)
28年 7月期	1,176,133	(99.8)	2,011	(0.2)	1,178,144	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
29年 1月中間期	945,320	338,106	102,894	1,180,532

(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
29年 1月中間期	2,092,737	199,258	1,893,478	16,039
28年 7月期	1,269,711	91,566	1,178,144	12,463

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	77,896,573,945	201,348,659,822
株式 ※3※4	1,176,133,662,940	1,888,854,970,680
派生商品評価勘定	—	74,761,920
未収入金	12,431,305,032	28,365,109
未収配当金	1,743,294,469	2,286,667,169
未収利息	1,744,165	4,992,674
前払金	1,235,666,000	—
その他未収収益 ※5	14,854,046	138,598,315
差入委託証拠金	254,130,000	—
流動資産合計	1,269,711,230,597	2,092,737,015,689
資産合計	1,269,711,230,597	2,092,737,015,689
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	215,092,560	—
前受金	—	91,535,000
未払金	1,201,406,720	90,539,186
未払収益分配金	24,578,325,746	—
未払受託者報酬	253,633,098	341,857,337
未払委託者報酬	522,306,583	670,759,688
未払利息	233,092	—
受入担保金	64,513,948,432	197,906,937,784
その他未払費用	281,441,010	157,234,640
流動負債合計	91,566,387,241	199,258,863,635
負債合計	91,566,387,241	199,258,863,635
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,181,650,276,250	1,475,666,060,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△3,505,432,894	417,812,092,054
(分配準備積立金)	1,795,560,838	1,795,560,838
元本等合計	1,178,144,843,356	1,893,478,152,054
純資産合計	1,178,144,843,356	1,893,478,152,054
負債純資産合計	1,269,711,230,597	2,092,737,015,689

(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27年7月11日 至平成28年1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	11,570,048,669	15,049,031,146
受取利息	27,175,503	66,561,461
有価証券売買等損益	△122,689,290,347	362,454,941,429
派生商品取引等損益	618,407,823	2,035,972,840
その他収益 ※1	476,005,587	591,490,122
営業収益合計	△109,997,652,765	380,197,996,998
営業費用		
支払利息	12,209,419	31,520,356
受託者報酬	280,089,548	341,857,337
委託者報酬	568,309,215	670,759,688
その他費用	140,986,712	151,341,530
営業費用合計	1,001,594,894	1,195,478,911
営業利益又は営業損失(△)	△110,999,247,659	379,002,518,087
経常利益又は経常損失(△)	△110,999,247,659	379,002,518,087
中間純利益又は中間純損失(△)	△110,999,247,659	379,002,518,087
期首剰余金又は期首欠損金(△)	300,212,636,850	△3,505,432,894
剰余金増加額又は欠損金減少額	40,980,464,193	62,509,556,611
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	40,980,464,193	62,509,556,611
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,636,047,250	20,194,549,750
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	11,636,047,250	20,194,549,750
中間剰余金又は中間欠損金(△)	218,557,806,134	417,812,092,054

(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 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. 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 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	979,712,467,500 円	1,181,650,276,250 円
期中追加設定元本額	352,790,212,500 円	422,633,350,000 円
期中一部交換元本額	150,852,403,750 円	128,617,566,250 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	945,320,221 口	1,180,532,848 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 3,505,432,894 円であります。	
4. ※3 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 60,234,566,570 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 186,768,242,550 円

5. ※4 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 589,455,000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 2,788,560,000円
6. ※5 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9,548,470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127,232,290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27年7月11日 至 平成28年1月10日	自 平成28年7月11日 至 平成29年1月10日
※1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額309,591,036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417,779,171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29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	(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。

（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 28 年 7 月 10 日 現在				当中間計算期間末 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	2,201,044,000	—	1,986,040,000	△215,004,000	4,584,935,000	—	4,659,860,000	74,925,000
合計	2,201,044,000	—	1,986,040,000	△215,004,000	4,584,935,000	—	4,659,860,000	74,925,000

（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 28 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 29 年 1 月 10 日現在
1口当たり純資産額	1,246.3円	1,603.9円
（10口当たり純資産額）	（12,463円）	（16,039円）

平成29年7月期 中間決算短信（平成28年7月11日～平成29年1月10日）

平成29年2月23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)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

半期報告書提出予定日 平成29年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月中間期の運用状況（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月中間期	1,874	(99.6)	7	(0.4)	1,881	(100.0)
28年 7月期	1,436	(99.7)	3	(0.3)	1,440	(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
29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
29年 1月中間期	1,884	2	1,881	7,231.1
28年 7月期	1,483	43	1,440	5,535.0

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	16,260,461	6,772,885
株式 ※3	1,436,879,080	1,874,748,150
派生商品評価勘定	—	132,920
未収入金	26,574,688	—
未収配当金	2,588,200	2,540,300
前払金	1,245,500	—
流動資産合計	1,483,547,929	1,884,194,255
資産合計	1,483,547,929	1,884,194,255
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	149,648	—
前受金	—	189,000
未払金	1,327,468	—
未払収益分配金	39,559,276	—
未払受託者報酬	880,132	914,895
未払委託者報酬	1,056,157	1,097,888
未払利息	48	—
その他未払費用	43,922	45,664
流動負債合計	43,016,651	2,247,447
負債合計	43,016,651	2,247,447
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	△662,356,594	△220,941,064
(分配準備積立金)	2,831,357	2,831,357
元本等合計	1,440,531,278	1,881,946,808
純資産合計	1,440,531,278	1,881,946,808
負債純資産合計	1,483,547,929	1,884,194,255

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日	当中間計算期間 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	22,207,186	21,949,175
受取利息	3,470	—
有価証券売買等損益	△238,034,068	418,180,026
派生商品取引等損益	1,089,773	3,347,668
その他収益	2	2
営業収益合計	△214,733,637	443,476,871
営業費用		
支払利息	—	2,881
受託者報酬	1,070,818	914,895
委託者報酬	1,284,997	1,097,888
その他費用	53,455	45,677
営業費用合計	2,409,270	2,061,341
営業利益又は営業損失(△)	△217,142,907	441,415,530
経常利益又は経常損失(△)	△217,142,907	441,415,530
中間純利益又は中間純損失(△)	△217,142,907	441,415,530
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△65,193,684	△662,356,594
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△282,336,591	△220,941,064

(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. 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	2,102,887,872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	－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662,356,594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220,941,064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 15,165,000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 13,722,000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27年7月11日 至 平成28年1月10日	自 平成28年7月11日 至 平成29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29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	(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。

（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28年7月10日 現在				当中間計算期間末 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	3,560,000	—	3,411,000	△149,000	7,201,000	—	7,335,000	134,000
合計	3,560,000	—	3,411,000	△149,000	7,201,000	—	7,335,000	134,000

（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28年7月10日現在	当中間計算期間末 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)	553.50円 (55,350円)	723.11円 (72,311円)

平成29年7月期 中間決算短信（平成28年7月11日～平成29年1月10日）

平成29年2月23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)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

半期報告書提出予定日 平成29年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月中間期の運用状況（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月中間期	1,913,541	(99.7)	4,980	(0.3)	1,918,522	(100.0)
28年 7月期	1,321,842	(99.8)	2,144	(0.2)	1,323,987	(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
29年 1月中間期	86,133	31,431	20,689	96,876

(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
29年 1月中間期	1,921,388	2,865	1,918,522	19,804
28年 7月期	1,349,062	25,075	1,323,987	15,371

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	1,927,483,407	3,892,426,284
株式 ※2	1,321,842,933,840	1,913,541,906,600
交換未引渡株式 ※3	—	1,013,608,740
派生商品評価勘定	—	108,173,580
未収入金	23,109,142,200	428,106
未収配当金	1,969,968,000	2,831,724,000
前払金	213,125,000	—
流動資産合計	1,349,062,652,447	1,921,388,267,310
資産合計	1,349,062,652,447	1,921,388,267,310
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	216,722,222	15,713,440
前受金	—	115,910,000
未払金	18,432,960	22,428,744
未払収益分配金	23,256,105,750	—
未払解約金 ※3	—	1,013,608,740
未払受託者報酬	525,671,441	642,519,368
未払委託者報酬	675,863,310	826,096,377
未払利息	5,766	—
その他未払費用	382,534,122	229,554,512
流動負債合計	25,075,335,571	2,865,831,181
負債合計	25,075,335,571	2,865,831,181
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,060,047,753,575	1,192,257,251,757
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	263,939,563,301	726,265,184,372
(分配準備積立金)	2,003,448,517	2,003,448,517
元本等合計	1,323,987,316,876	1,918,522,436,129
純資産合計	1,323,987,316,876	1,918,522,436,129
負債純資産合計	1,349,062,652,447	1,921,388,267,310

(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27年7月11日 至平成28年1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	11,974,874,180	15,963,370,200
受取利息	1,812,486	—
有価証券売買等損益	△153,833,989,741	400,436,040,654
派生商品取引等損益	597,279,180	2,101,469,482
その他収益	189,509,296	1,547,948
営業収益合計	△141,070,514,599	418,502,428,284
営業費用		
支払利息	—	1,314,988
受託者報酬	545,141,806	642,519,368
委託者報酬	700,896,640	826,096,377
その他費用	196,684,704	230,713,871
営業費用合計	1,442,723,150	1,700,644,604
営業利益又は営業損失(△)	△142,513,237,749	416,801,783,680
経常利益又は経常損失(△)	△142,513,237,749	416,801,783,680
中間純利益又は中間純損失(△)	△142,513,237,749	416,801,783,680
期首剰余金又は期首欠損金(△)	527,094,963,201	263,939,563,301
剰余金増加額又は欠損金減少額	195,245,600,202	177,823,425,796
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	195,245,600,202	177,823,425,796
剰余金減少額又は欠損金増加額	129,651,799,978	132,299,588,405
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	129,651,799,978	132,299,588,405
中間剰余金又は中間欠損金(△)	450,175,525,676	726,265,184,372

(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 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. 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 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	828,816,022,630 円	1,060,047,753,575 円
期中追加設定元本額	596,718,629,612 円	386,830,682,627 円
期中一部交換元本額	365,486,898,667 円	254,621,184,445 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	86,133,725 口	96,876,351 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 2,047,250,000 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 2,938,000,000 円
4. ※3 交換未引渡株式及び未払解約金	—————	平成 29 年 1 月 6 日を交換請求受付日とした交換の対象となる株式及び当該株式の引渡債務であります。

--	--	--

(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 27 年 7 月 11 日 至 平成 28 年 1 月 10 日	自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 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 29 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	(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。

(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 28 年 7 月 10 日 現在				当中間計算期間末 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	2,378,805,000	—	2,162,160,000	△216,645,000	4,908,690,000	—	5,001,290,000	92,600,000
合計	2,378,805,000	—	2,162,160,000	△216,645,000	4,908,690,000	—	5,001,290,000	92,600,000

(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28年7月10日現在	当中間計算期間末 平成29年1月10日現在
1 口当たり純資産額	15,371 円	19,804 円

平成29年7月期 中間決算短信（平成28年7月11日～平成29年1月10日）

平成29年2月23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)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

半期報告書提出予定日 平成29年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月中間期の運用状況（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月中間期	2,025	(98.9)	21	(1.1)	2,046	(100.0)
28年 7月期	1,513	(99.7)	4	(0.3)	1,518	(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
29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
29年 1月中間期	2,049	3	2,046	19,993.3
28年 7月期	1,550	32	1,518	14,832.5

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	12,512,238	19,880,609
株式	1,513,603,050	2,025,008,450
派生商品評価勘定	—	735,988
未収入金	19,818,835	—
未収配当金	3,358,100	3,254,850
前払金	746,250	—
差入委託証拠金	684,000	903,000
流動資産合計	1,550,722,473	2,049,782,897
資産合計	1,550,722,473	2,049,782,897
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	155,434	—
前受金	—	814,500
未払金	765,476	—
未払収益分配金	29,380,190	—
未払受託者報酬	897,428	1,000,944
未払委託者報酬	1,076,940	1,201,154
未払利息	36	—
その他未払費用	44,783	49,955
流動負債合計	32,320,287	3,066,553
負債合計	32,320,287	3,066,553
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	△439,935,914	88,378,244
(分配準備積立金)	3,437,963	3,437,963
元本等合計	1,518,402,186	2,046,716,344
純資産合計	1,518,402,186	2,046,716,344
負債純資産合計	1,550,722,473	2,049,782,897

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日	当中間計算期間 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	15,578,722	15,051,880
受取利息	2,147	—
有価証券売買等損益	△344,170,306	512,504,985
派生商品取引等損益	△588,876	3,012,032
その他収益	35	44
営業収益合計	△329,178,278	530,568,941
営業費用		
支払利息	—	2,726
受託者報酬	1,083,876	1,000,944
委託者報酬	1,300,648	1,201,154
その他費用	54,103	49,959
営業費用合計	2,438,627	2,254,783
営業利益又は営業損失 (△)	△331,616,905	528,314,158
経常利益又は経常損失 (△)	△331,616,905	528,314,158
中間純利益又は中間純損失 (△)	△331,616,905	528,314,158
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	181,341,380	△439,935,914
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△150,275,525	88,378,244

(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	<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。</p> <p>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	先物取引	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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	受取配当金	<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>

(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	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439,935,914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27年7月11日 至 平成28年1月10日	自 平成28年7月11日 至 平成29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29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	(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。

（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28年7月10日 現在				当中間計算期間末 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	4,999,000	—	4,844,000	△155,000	20,864,500	—	21,602,000	737,500
合計	4,999,000	—	4,844,000	△155,000	20,864,500	—	21,602,000	737,500

（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28年7月10日現在	当中間計算期間末 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)	1,483.25円 (148,325円)	1,999.33円 (199,933円)

平成29年7月期 中間決算短信（平成28年7月11日～平成29年1月10日）

平成29年2月23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)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

半期報告書提出予定日 平成29年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 29年1月中間期の運用状況（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月中間期	818	(96.4)	30	(3.6)	848	(100.0)
28年 7月期	519	(97.9)	11	(2.1)	530	(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
29年 1月中間期	4,673	—	—	4,673

(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
29年 1月中間期	850	1	848	18,157
28年 7月期	555	24	530	11,351

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	15,638,542	31,575,304
株式 ※3	519,212,600	818,226,960
派生商品評価勘定	—	526,272
未収入金	17,566,079	—
未収配当金	108,000	135,000
前払金	2,592,000	—
流動資産合計	555,117,221	850,463,536
資産合計	555,117,221	850,463,536
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,106,972	—
前受金	—	944,000
未払金	714,648	—
未払収益分配金	20,892,163	—
未払受託者報酬	378,226	385,269
未払委託者報酬	453,877	462,315
未払利息	46	—
その他未払費用	18,830	19,173
流動負債合計	24,564,762	1,810,757
負債合計	24,564,762	1,810,757
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	958,141,710	958,141,710
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△427,589,251	△109,488,931
(分配準備積立金)	125,858	125,858
元本等合計	530,552,459	848,652,779
純資産合計	530,552,459	848,652,779
負債純資産合計	555,117,221	850,463,536

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日	当中間計算期間 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	11,103,450	11,007,975
受取利息	1,707	—
有価証券売買等損益	△152,482,480	298,584,193
派生商品取引等損益	△554,425	9,379,844
その他収益	2	17
営業収益合計	△141,931,746	318,972,029
営業費用		
支払利息	—	4,937
受託者報酬	521,881	385,269
委託者報酬	626,253	462,315
その他費用	26,017	19,188
営業費用合計	1,174,151	871,709
営業利益又は営業損失 (△)	△143,105,897	318,100,320
経常利益又は経常損失 (△)	△143,105,897	318,100,320
中間純利益又は中間純損失 (△)	△143,105,897	318,100,320
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	49,553,447	△427,589,251
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△93,552,450	△109,488,931

(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 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. 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 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	958,242,160 円	958,141,710 円
期中追加設定元本額	1,014,545,000 円	－円
期中一部交換元本額	1,014,645,450 円	－円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,673,862 口	4,673,862 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 427,589,251 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 109,488,931 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 3,531,000 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 5,879,000 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27年7月11日 至 平成28年1月10日	自 平成28年7月11日 至 平成29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29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	(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。

（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28年7月10日 現在				当中間計算期間末 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	13,050,000	—	10,944,000	△2,106,000	30,128,000	—	30,656,000	528,000
合計	13,050,000	—	10,944,000	△2,106,000	30,128,000	—	30,656,000	528,000

（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28年7月10日現在	当中間計算期間末 平成29年1月10日現在
1口当たり純資産額	113.51円	181.57円
(100口当たり純資産額)	(11,351円)	(18,157円)