

平成 29 年 8 月 22 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 (平成 29 年 1 月 11 日～平成 29 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 29 年 7 月 期 (平成 29 年 1 月 11 日～平成 29 年 7 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7月期（平成29年1月11日～平成29年7月10日）決算短信

平成29年8月22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10月 3日
 分配金支払開始日 平成29年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月11日～平成29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	%
29年 7月期	81,707	(99.7)	236	(0.3)	81,943	(100.0)
29年 1月期	78,904	(99.7)	248	(0.3)	79,153	(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 7月期	4,335	—	—	4,335
29年 1月期	2,382	1,953	—	4,335

(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 7月期	82,932	988	81,943	18,899.9
29年 1月期	79,813	660	79,153	18,256.3

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	193
29年 1月期	130

(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2期	第3期
	平成29年1月10日現在	平成29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	741,532,161	1,077,062,998
株式 ※2※3	78,904,813,420	81,707,460,020
派生商品評価勘定	4,301,208	1,216,224
未収入金	21,710,544	9,044,028
未収配当金	141,300,250	137,467,550
未収利息	—	1,070
その他未収収益	—	5,889
流動資産合計	79,813,657,583	82,932,257,779
資産合計	79,813,657,583	82,932,257,779
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	9,504
前受金	30,116,000	5,236,000
未払収益分配金	563,635,410	836,781,801
未払受託者報酬	11,667,515	12,797,736
未払委託者報酬	53,127,438	51,185,956
受入担保金	—	80,839,500
その他未払費用	1,944,574	1,945,235
流動負債合計	660,490,937	988,795,732
負債合計	660,490,937	988,795,732
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	69,782,399,415	69,782,399,415
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,370,767,231	12,161,062,632
（分配準備積立金）	141,533,896	141,363,916
元本等合計	79,153,166,646	81,943,462,047
純資産合計	79,153,166,646	81,943,462,047
負債純資産合計	79,813,657,583	82,932,257,779

(2) 損益及び剰余金計算書

	第2期	第3期
	自平成28年7月11日 至平成29年1月10日	自平成29年1月11日 至平成29年7月10日
	金額（円）	金額（円）
営業収益		
受取配当金	736,493,700	918,846,112
受取利息	—	1,070
有価証券売買等損益	12,596,871,181	2,748,824,361
派生商品取引等損益	112,831,956	41,641,020
その他収益	104,579	121,494
営業収益合計	13,446,301,416	3,709,434,057
営業費用		
支払利息	62,931	106,770
受託者報酬	11,667,515	12,797,736
委託者報酬	53,127,438	51,185,956
その他費用 ※1	15,490,573	18,266,393
営業費用合計	80,348,457	82,356,855
営業利益	13,365,952,959	3,627,077,202
経常利益	13,365,952,959	3,627,077,202
当期純利益	13,365,952,959	3,627,077,202
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△3,487,759,917	9,370,767,231
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	—
分配金 ※2	563,635,410	836,781,801
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,370,767,231	12,161,062,632

(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 3 期	
	自 平成 29 年 1 月 11 日	至 平成 29 年 7 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 2 期	第 3 期
	平成 29 年 1 月 10 日現在	平成 29 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	38,342,281,560 円	69,782,399,415 円
期中追加設定元本額	31,440,117,855 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	4,335,657 口	4,335,657 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 78,400,000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 68,610,000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 61,870,000円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 平成28年7月11日 至 平成29年1月10日	自 平成29年1月11日 至 平成29年7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(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。	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(918,861,906円)及び分配準備積立金(141,533,896円)の合計額から、経費(82,250,085円)を控除して計算される分配対象額は978,145,717円(10口当たり2,256円)であり、うち836,781,801円(10口当たり1,930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3期
	自 平成29年1月11日 至 平成29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3期
	平成29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 2 期 平成 29 年 1 月 10 日 現在	第 3 期 平成 29 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	11,333,780,143	2,831,463,995
合計	11,333,780,143	2,831,463,995

（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 2 期 平成 29 年 1 月 10 日 現在				第 3 期 平成 29 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	236,148,000	—	240,468,000	4,320,000	229,176,000	—	230,400,000	1,224,000
合計	236,148,000	—	240,468,000	4,320,000	229,176,000	—	230,400,000	1,224,000

（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 3 期 自 平成 29 年 1 月 11 日

至 平成29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2期 平成29年1月10日現在	第3期 平成29年7月10日現在
1口当たり純資産額	18,256.3円	18,899.9円
(10口当たり純資産額)	(182,563円)	(188,999円)

平成29年7月期（平成29年1月11日～平成29年7月10日）決算短信

平成29年8月22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10月 3日
 分配金支払開始日 平成29年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月11日～平成29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	%
29年 7月期	6,681	(99.8)	12	(0.2)	6,694	(100.0)
29年 1月期	1,789	(99.5)	9	(0.5)	1,799	(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 7月期	1,542	5,813	1,941	5,414
29年 1月期	22,783	—	21,241	1,542

(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 7月期	6,726	32	6,694	12,362.4
29年 1月期	2,048	248	1,799	11,664.8

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
29年 7月期	47
29年 1月期	1,498

(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7期	第8期
	平成29年1月10日現在	平成29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	26,940,976	33,477,737
株式	1,789,470,429	6,681,582,472
新株予約権証券	—	18,000
未収入金	228,122,447	1,106,458
未収配当金	3,585,621	10,524,846
流動資産合計	2,048,119,473	6,726,709,513
資産合計	2,048,119,473	6,726,709,513
負債の部		
流動負債		
未払金	1,135,876	—
未払収益分配金	231,052,868	25,450,044
未払受託者報酬	4,272,439	1,438,203
未払委託者報酬	11,108,421	3,739,410
その他未払費用	1,356,787	1,947,967
流動負債合計	248,926,391	32,575,624
負債合計	248,926,391	32,575,624
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,525,442,501	5,355,339,067
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	273,750,581	1,338,794,822
(分配準備積立金)	3,730,264	10,589,676
元本等合計	1,799,193,082	6,694,133,889
純資産合計	1,799,193,082	6,694,133,889
負債純資産合計	2,048,119,473	6,726,709,513

(2) 損益及び剰余金計算書

	第7期	第8期
	自平成28年7月11日 至平成29年1月10日	自平成29年1月11日 至平成29年7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	211,107,628	38,589,028
有価証券売買等損益	3,001,340,659	644,041,870
その他収益	202,345	101,491
営業収益合計	3,212,650,632	682,732,389
営業費用		
支払利息	17,396	11,028
受託者報酬	4,272,439	1,438,203
委託者報酬	11,108,421	3,739,410
その他費用	2,997,505	1,192,422
営業費用合計	18,395,761	6,381,063
営業利益	3,194,254,871	676,351,326
経常利益	3,194,254,871	676,351,326
当期純利益	3,194,254,871	676,351,326
期首剰余金又は期首欠損金(△)	1,581,715,683	273,750,581
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	877,553,165
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	877,553,165
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,271,167,105	463,410,206
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	4,271,167,105	463,410,206
分配金 ※1	231,052,868	25,450,044
期末剰余金又は期末欠損金(△)	273,750,581	1,338,794,822

(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 8 期	
	自 平成 29 年 1 月 11 日	至 平成 29 年 7 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 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> <p>(2) 新株予約権証券</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. 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 7 期	第 8 期
	平成 29 年 1 月 10 日現在	平成 29 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	22,533,132,706 円	1,525,442,501 円
期中追加設定元本額	－円	5,749,670,180 円

期中一部交換元本額	21,007,690,205 円	1,919,773,614 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,542,409 口	5,414,903 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第7期	第8期
	自 平成28年7月11日 至 平成29年1月10日	自 平成29年1月11日 至 平成29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(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。	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(38,679,491円)及び分配準備積立金(3,730,264円)の合計額から、経費(6,370,035円)を控除して計算される分配対象額は36,039,720円(100口当たり665円)であり、うち25,450,044円(100口当たり470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8期
	自 平成29年1月11日 至 平成29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8期 平成29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7期 平成29年1月10日現在	第8期 平成29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	306,525,763	480,503,363
新株予約権証券	—	18,000
合計	306,525,763	480,521,363

(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7期 平成29年1月10日現在	第8期 平成29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8期 自 平成29年1月11日 至 平成29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7期 平成29年1月10日現在	第8期 平成29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)	1,166.48円 (116,648円)	1,236.24円 (123,624円)

平成29年7月期（平成29年1月11日～平成29年7月10日）決算短信

平成29年8月22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10月 3日
 分配金支払開始日 平成29年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月11日～平成29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	%
29年 7月期	129,081	(99.6)	455	(0.4)	129,536	(100.0)
29年 1月期	114,107	(99.7)	354	(0.3)	114,462	(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 7月期	8,202	2,572	1,866	8,908
29年 1月期	7,116	2,854	1,768	8,202

(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 7月期	131,097	1,560	129,536	14,540.4
29年 1月期	115,407	944	114,462	13,954.4

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	147
29年 1月期	95

(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 29 年 1 月 10 日現在	平成 29 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	1,083,800,778	1,827,381,981
株式 ※2※3	114,107,426,790	129,081,261,650
派生商品評価勘定	7,836,432	3,720,980
未収入金	29,432,100	13,829,115
未収配当金	158,873,300	169,011,310
未収利息	—	1,152
その他未収収益	—	10,954
差入委託証拠金	19,715,000	1,928,000
流動資産合計	115,407,084,400	131,097,145,142
資産合計	115,407,084,400	131,097,145,142
負債の部		
流動負債		
前受金	42,979,000	9,225,500
未払収益分配金	779,247,950	1,309,586,103
未払受託者報酬	25,385,894	33,337,873
未払委託者報酬	66,003,418	86,673,576
受入担保金	—	104,445,600
その他未払費用	31,069,089	16,918,929
流動負債合計	944,685,351	1,560,187,581
負債合計	944,685,351	1,560,187,581
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	86,389,888,520	93,826,944,468
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	28,072,510,529	35,710,013,093
(分配準備積立金)	162,063,577	171,651,884
元本等合計	114,462,399,049	129,536,957,561
純資産合計	114,462,399,049	129,536,957,561
負債純資産合計	115,407,084,400	131,097,145,142

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 6 期	第 7 期
	自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 1 月 10 日	自 平成 29 年 1 月 11 日 至 平成 29 年 7 月 10 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	909,715,595	1,466,542,439
受取利息	—	1,152
有価証券売買等損益	22,383,937,794	5,146,624,356
派生商品取引等損益	151,750,584	71,056,599
その他収益	728,355	901,902
営業収益合計	23,446,132,328	6,685,126,448
営業費用		
支払利息	110,219	159,167
受託者報酬	25,385,894	33,337,873
委託者報酬	66,003,418	86,673,576
その他費用	21,415,009	28,100,467
営業費用合計	112,914,540	148,271,083
営業利益	23,333,217,788	6,536,855,365
経常利益	23,333,217,788	6,536,855,365
当期純利益	23,333,217,788	6,536,855,365
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	3,189,378,881	28,072,510,529
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,145,895,580	8,885,869,502
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	6,145,895,580	8,885,869,502
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,816,733,770	6,475,636,200
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,816,733,770	6,475,636,200
分配金 ※1	779,247,950	1,309,586,103
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	28,072,510,529	35,710,013,093

(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 29 年 1 月 11 日	至 平成 29 年 7 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 6 期	第 7 期
	平成 29 年 1 月 10 日現在	平成 29 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	74,946,659,880 円	86,389,888,520 円
期中追加設定元本額	30,066,911,580 円	27,096,350,448 円
期中一部交換元本額	18,623,682,940 円	19,659,294,500 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	8,202,610 口	8,908,749 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 100,253,000 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 83,907,000 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 83,959,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 6 期 自 平成 28 年 7 月 11 日 至 平成 29 年 1 月 10 日	第 7 期 自 平成 29 年 1 月 11 日 至 平成 29 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(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 7 期 自 平成 29 年 1 月 11 日 至 平成 29 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	<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。</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（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。</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 7 期 平成 29 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	<p>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。</p>
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

	第 6 期 平成 29 年 1 月 10 日現在	第 7 期 平成 29 年 7 月 10 日現在
--	-----------------------------	-----------------------------

種 類	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	19,360,441,847	5,223,206,208
合計	19,360,441,847	5,223,206,208

（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 6 期 平成 29 年 1 月 10 日 現在				第 7 期 平成 29 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	332,109,000	—	339,972,000	7,863,000	449,845,000	—	453,600,000	3,755,000
合計	332,109,000	—	339,972,000	7,863,000	449,845,000	—	453,600,000	3,755,000

（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 7 期	
自 平成 29 年 1 月 11 日	
至 平成 29 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 6 期 平成 29 年 1 月 10 日現在	第 7 期 平成 29 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	13,954.4 円	14,540.4 円
(10 口当たり純資産額)	(139,544 円)	(145,404 円)