

平成 30 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 30 年 7 月期 中間決算短信 (平成 29 年 7 月 11 日～平成 30 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 30 年 7 月期 中間決算短信 (平成 29 年 7 月 11 日～平成 30 年 1 月 10 日) をご報告します。

記

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30年7月期 中間決算短信（平成29年7月11日～平成30年1月10日）

平成30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30年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月中間期の運用状況（平成29年7月11日～平成30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	%
30年 1月中間期	3,381,445	(99.5)	15,641	(0.5)	3,397,086	(100.0)
29年 7月期	2,468,165	(99.8)	4,118	(0.2)	2,472,283	(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
30年 1月中間期	1,478,054	381,008	140,111	1,718,951

(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
30年 1月中間期	3,557,021	159,935	3,397,086	19,763
29年 7月期	2,961,549	489,266	2,472,283	16,727

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29年7月10日現在	平成30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	478,677,037,274	170,486,946,434
株式 ※2※3	2,468,165,203,854	3,381,445,386,088
新株予約権証券	5,712,600	—
派生商品評価勘定	38,923,920	849,386,960
未収入金	11,761,368,609	128,839,902
未収配当金	2,709,232,501	3,937,687,253
未収利息	11,548,693	3,979,697
その他未収収益 ※4	180,562,984	169,666,480
流動資産合計	2,961,549,590,435	3,557,021,892,814
資産合計	2,961,549,590,435	3,557,021,892,814
負債の部		
流動負債		
前受金	51,230,000	799,678,400
未払金	3,636,320	—
未払収益分配金	37,986,006,406	—
未払受託者報酬	498,877,192	657,452,713
未払委託者報酬	975,391,091	1,283,568,399
受入担保金	449,407,720,639	156,959,819,625
その他未払費用	343,295,671	234,503,937
流動負債合計	489,266,157,319	159,935,023,074
負債合計	489,266,157,319	159,935,023,074
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,847,568,405,000	2,148,689,271,250
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	624,715,028,116	1,248,397,598,490
(分配準備積立金)	2,956,400,148	2,956,400,148
元本等合計	2,472,283,433,116	3,397,086,869,740
純資産合計	2,472,283,433,116	3,397,086,869,740
負債純資産合計	2,961,549,590,435	3,557,021,892,814

(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28年7月11日 至平成29年1月10日	自平成29年7月11日 至平成30年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	15,049,031,146	26,720,865,200
受取利息	66,561,461	110,427,261
有価証券売買等損益	362,454,941,429	474,905,403,133
派生商品取引等損益	2,035,972,840	3,047,009,960
その他収益 ※1	591,490,122	981,778,388
営業収益合計	380,197,996,998	505,765,483,942
営業費用		
支払利息	31,520,356	60,948,818
受託者報酬	341,857,337	657,452,713
委託者報酬	670,759,688	1,283,568,399
その他費用	151,341,530	226,301,603
営業費用合計	1,195,478,911	2,228,271,533
営業利益	379,002,518,087	503,537,212,409
経常利益	379,002,518,087	503,537,212,409
中間純利益	379,002,518,087	503,537,212,409
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△3,505,432,894	624,715,028,116
剰余金増加額又は欠損金減少額	62,509,556,611	198,643,051,855
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	62,509,556,611	198,643,051,855
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,194,549,750	78,497,693,890
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	20,194,549,750	78,497,693,890
中間剰余金又は中間欠損金(△)	417,812,092,054	1,248,397,598,490

(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 29 年 7 月 11 日	至 平成 30 年 1 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。</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> <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。</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	<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>	

(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 29 年 7 月 10 日現在	平成 30 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	1, 181, 650, 276, 250 円	1, 847, 568, 405, 000 円
期中追加設定元本額	983, 163, 800, 000 円	476, 260, 512, 500 円
期中一部交換元本額	317, 245, 671, 250 円	175, 139, 646, 250 円
2. 中間計算期間末日における受	1, 478, 054, 724 円	1, 718, 951, 417 円

益権の総数		
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 427,474,840,540 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 150,290,902,250 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 2,711,320,000 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 3,933,710,000 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 162,310,521 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 150,730,339 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28年7月11日 至 平成29年1月10日	自 平成29年7月11日 至 平成30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 417,779,171 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 613,668,674 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30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			当中間計算期間末		
	平成29年7月10日 現在			平成30年1月10日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益

ダイワ上場投信ートピックス (1305) 平成 30 年 7 月期中間決算短信

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	4,034,520,000	—	4,073,580,000	39,060,000	14,979,821,600	—	15,829,660,000	849,838,400
合計	4,034,520,000	—	4,073,580,000	39,060,000	14,979,821,600	—	15,829,660,000	849,838,400

(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 29 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 30 年 1 月 10 日現在
1口当たり純資産額	1,672.7円	1,976.3円
(10口当たり純資産額)	(16,727円)	(19,763円)

平成30年7月期 中間決算短信（平成29年7月11日～平成30年1月10日）

平成30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30年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月中間期の運用状況（平成29年7月11日～平成30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	%
30年 1月中間期	2,173	(98.6)	30	(1.4)	2,203	(100.0)
29年 7月期	2,968	(99.8)	5	(0.2)	2,973	(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
30年 1月中間期	4,089	—	1,486	2,603

(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
30年 1月中間期	2,207	4	2,203	8,463.8
29年 7月期	3,016	43	2,973	7,270.3

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29年7月10日現在	平成30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	28,524,080	30,018,895
株式 ※3	2,968,034,570	2,173,562,200
派生商品評価勘定	12,184	1,432,720
未収入金	15,693,416	—
未収配当金	4,275,000	2,878,600
流動資産合計	3,016,539,250	2,207,892,415
資産合計	3,016,539,250	2,207,892,415
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,340	—
前受金	151,900	1,226,500
未払収益分配金	40,080,765	—
未払受託者報酬	1,257,475	1,316,942
未払委託者報酬	1,508,962	1,580,342
その他未払費用	62,783	65,759
流動負債合計	43,072,225	4,189,543
負債合計	43,072,225	4,189,543
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	3,304,618,192	2,103,769,400
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△331,151,167	99,933,472
(分配準備積立金)	4,549,013	4,549,013
元本等合計	2,973,467,025	2,203,702,872
純資産合計	2,973,467,025	2,203,702,872
負債純資産合計	3,016,539,250	2,207,892,415

(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28年7月11日 至平成29年1月10日	自平成29年7月11日 至平成30年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	21,949,175	24,111,920
有価証券売買等損益	418,180,026	309,150,392
派生商品取引等損益	3,347,668	3,428,836
その他収益	2	—
営業収益合計	443,476,871	336,691,148
営業費用		
支払利息	2,881	4,252
受託者報酬	914,895	1,316,942
委託者報酬	1,097,888	1,580,342
その他費用	45,677	65,765
営業費用合計	2,061,341	2,967,301
営業利益	441,415,530	333,723,847
経常利益	441,415,530	333,723,847
中間純利益	441,415,530	333,723,847
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△662,356,594	△331,151,167
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	97,360,792
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	97,360,792
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△220,941,064	99,933,472

(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29年7月11日	至 平成30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29年7月10日現在	平成30年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	2,102,887,872円	3,304,618,192円
期中追加設定元本額	1,201,730,320円	—円
期中一部交換元本額	—円	1,200,848,792円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,089,874口	2,603,675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331,151,167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 12,374,000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 15,412,000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28年7月11日 至 平成29年1月10日	自 平成29年7月11日 至 平成30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30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29年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成30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	5,173,900	—	5,176,500	2,600	28,366,000	—	29,802,500	1,436,500
合計	5,173,900	—	5,176,500	2,600	28,366,000	—	29,802,500	1,436,500

（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29年7月10日現在	当中間計算期間末 平成30年1月10日現在
1口当たり純資産額	727.03円	846.38円
(100口当たり純資産額)	(72,703円)	(84,638円)

平成30年7月期 中間決算短信（平成29年7月11日～平成30年1月10日）

平成30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30年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月中間期の運用状況（平成29年7月11日～平成30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	%
30年 1月中間期	2,527,185	(99.7)	7,846	(0.3)	2,535,032	(100.0)
29年 7月期	2,098,867	(99.8)	3,475	(0.2)	2,102,343	(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
30年 1月中間期	102,689	23,592	22,566	103,715

(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
30年 1月中間期	2,635,544	100,511	2,535,032	24,442
29年 7月期	2,137,234	34,890	2,102,343	20,473

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 29 年 7 月 10 日現在	平成 30 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	18,596,153,116	74,939,765,358
株式 ※2※3	2,098,867,821,820	2,527,185,950,380
交換未引渡株式 ※4	—	29,360,767,620
派生商品評価勘定	5,256,240	433,830,640
未収入金	16,964,953,760	38,139,200
未収配当金	2,750,748,000	3,558,954,000
未収利息	13,742	1,702,470
前払金	49,100,000	—
その他未収収益 ※5	14,745	24,937,435
流動資産合計	2,137,234,061,423	2,635,544,047,103
資産合計	2,137,234,061,423	2,635,544,047,103
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,418,580	—
前受金	—	454,051,000
未払金	—	1,723,587
未払収益分配金	31,731,170,448	—
未払解約金 ※4	—	29,360,767,620
未払受託者報酬	768,524,788	890,321,347
未払委託者報酬	988,101,714	1,141,728,557
受入担保金	892,483,725	68,348,818,072
その他未払費用	504,056,426	313,760,739
流動負債合計	34,890,755,681	100,511,170,922
負債合計	34,890,755,681	100,511,170,922
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,263,804,254,704	1,276,430,522,898
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	838,539,051,038	1,258,602,353,283
(分配準備積立金)	2,761,580,986	2,761,580,986
元本等合計	2,102,343,305,742	2,535,032,876,181
純資産合計	2,102,343,305,742	2,535,032,876,181
負債純資産合計	2,137,234,061,423	2,635,544,047,103

(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28年7月11日 至平成29年1月10日	自平成29年7月11日 至平成30年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	15,963,370,200	20,197,477,850
受取利息	—	23,638,039
有価証券売買等損益	400,436,040,654	410,879,440,087
派生商品取引等損益	2,101,469,482	2,569,395,820
その他収益 ※1	1,547,948	576,172,370
営業収益合計	418,502,428,284	434,246,124,166
営業費用		
支払利息	1,314,988	14,505,725
受託者報酬	642,519,368	890,321,347
委託者報酬	826,096,377	1,141,728,557
その他費用	230,713,871	315,263,785
営業費用合計	1,700,644,604	2,361,819,414
営業利益	416,801,783,680	431,884,304,752
経常利益	416,801,783,680	431,884,304,752
中間純利益	416,801,783,680	431,884,304,752
期首剰余金又は期首欠損金(△)	263,939,563,301	838,539,051,038
剰余金増加額又は欠損金減少額	177,823,425,796	213,911,479,404
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	177,823,425,796	213,911,479,404
剰余金減少額又は欠損金増加額	132,299,588,405	225,732,481,911
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	132,299,588,405	225,732,481,911
中間剰余金又は中間欠損金(△)	726,265,184,372	1,258,602,353,283

(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 29 年 7 月 11 日	至 平成 30 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 29 年 7 月 10 日現在	平成 30 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	1,060,047,753,575 円	1,263,804,254,704 円
期中追加設定元本額	618,805,374,855 円	290,351,777,563 円
期中一部交換元本額	415,048,873,726 円	277,725,509,369 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	102,689,872 口	103,715,814 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 834,976,300 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 65,460,231,600 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 2,962,000,000 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 3,857,500,000 円

5. ※4 交換未引渡株式及び未払解約金	—————	平成30年1月5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。
6. ※5 その他未収収益	該当事項はありません。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分22,270,000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 自 平成28年7月11日 至 平成29年1月10日	当中間計算期間 自 平成29年7月11日 至 平成30年1月10日
※1 その他収益	該当事項はありません。	貸付有価証券に係る配当金相当額547,843,150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30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29年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成30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	3,438,170,000	－	3,437,100,000	△1,070,000	7,515,189,000	－	7,949,200,000	434,011,000
合計	3,438,170,000	－	3,437,100,000	△1,070,000	7,515,189,000	－	7,949,200,000	434,011,000

(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29年7月10日現在	当中間計算期間末 平成30年1月10日現在
1口当たり純資産額	20,473円	24,442円

平成30年7月期 中間決算短信（平成29年7月11日～平成30年1月10日）

平成30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30年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月中間期の運用状況（平成29年7月11日～平成30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	%
30年 1月中間期	2,858	(99.2)	22	(0.8)	2,880	(100.0)
29年 7月期	2,286	(99.8)	5	(0.2)	2,291	(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
30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
30年 1月中間期	2,885	4	2,880	28,141.4
29年 7月期	2,323	31	2,291	22,386.4

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29年7月10日現在	平成30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	29,436,648	21,377,528
株式	2,286,535,700	2,858,077,150
派生商品評価勘定	22,326	1,236,704
未収入金	3,318,344	—
未収配当金	3,334,600	3,863,500
差入委託証拠金	969,000	558,000
流動資産合計	2,323,616,618	2,885,112,882
資産合計	2,323,616,618	2,885,112,882
負債の部		
流動負債		
前受金	140,550	1,166,000
未払収益分配金	29,175,450	—
未払受託者報酬	1,157,456	1,383,369
未払委託者報酬	1,388,947	1,660,031
その他未払費用	57,792	69,082
流動負債合計	31,920,195	4,278,482
負債合計	31,920,195	4,278,482
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(△)	333,358,323	922,496,300
(分配準備積立金)	3,378,467	3,378,467
元本等合計	2,291,696,423	2,880,834,400
純資産合計	2,291,696,423	2,880,834,400
負債純資産合計	2,323,616,618	2,885,112,882

(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28年7月11日 至平成29年1月10日	自平成29年7月11日 至平成30年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	15,051,880	18,761,470
有価証券売買等損益	512,504,985	570,705,822
派生商品取引等損益	3,012,032	2,786,386
その他収益	44	39
営業収益合計	530,568,941	592,253,717
営業費用		
支払利息	2,726	3,255
受託者報酬	1,000,944	1,383,369
委託者報酬	1,201,154	1,660,031
その他費用	49,959	69,085
営業費用合計	2,254,783	3,115,740
営業利益	528,314,158	589,137,977
経常利益	528,314,158	589,137,977
中間純利益	528,314,158	589,137,977
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△439,935,914	333,358,323
中間剰余金又は中間欠損金(△)	88,378,244	922,496,300

(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29年7月11日	至 平成30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29年7月10日現在	平成30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

(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28年7月11日 至 平成29年1月10日	自 平成29年7月11日 至 平成30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30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29年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成30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)
株価指数 先物取引								
買 建	4,826,850	—	4,849,500	22,650	21,484,000	—	22,722,000	1,238,000
合計	4,826,850	—	4,849,500	22,650	21,484,000	—	22,722,000	1,238,000

（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29年7月10日現在	当中間計算期間末 平成30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)	2,238.64円 (223,864円)	2,814.14円 (281,414円)

平成30年7月期 中間決算短信（平成29年7月11日～平成30年1月10日）

平成30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30年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月中間期の運用状況（平成29年7月11日～平成30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	%
30年 1月中間期	930	(97.3)	25	(2.7)	956	(100.0)
29年 7月期	812	(97.2)	23	(2.8)	835	(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
30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
30年 1月中間期	959	2	956	20,465
29年 7月期	858	23	835	17,873

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29年7月10日現在	平成30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	31,458,727	26,197,888
株式 ※3	812,339,940	930,851,000
派生商品評価勘定	1,042,704	2,302,704
未収入金	13,841,148	—
未収配当金	108,000	130,000
流動資産合計	858,790,519	959,481,592
資産合計	858,790,519	959,481,592
負債の部		
流動負債		
前受金	1,440,000	1,968,000
未払金	318,843	—
未払収益分配金	20,658,470	—
未払受託者報酬	445,322	453,548
未払委託者報酬	534,406	544,246
その他未払費用	22,191	22,585
流動負債合計	23,419,232	2,988,379
負債合計	23,419,232	2,988,379
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	△122,770,423	△1,648,497
(分配準備積立金)	150,617	150,617
元本等合計	835,371,287	956,493,213
純資産合計	835,371,287	956,493,213
負債純資産合計	858,790,519	959,481,592

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自平成28年7月11日 至平成29年1月10日	当中間計算期間 自平成29年7月11日 至平成30年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	11,007,975	11,282,425
有価証券売買等損益	298,584,193	107,703,175
派生商品取引等損益	9,379,844	3,162,816
その他収益	17	23
営業収益合計	318,972,029	122,148,439
営業費用		
支払利息	4,937	6,112
受託者報酬	385,269	453,548
委託者報酬	462,315	544,246
その他費用	19,188	22,607
営業費用合計	871,709	1,026,513
営業利益	318,100,320	121,121,926
経常利益	318,100,320	121,121,926
中間純利益	318,100,320	121,121,926
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△427,589,251	△122,770,423
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△109,488,931	△1,648,497

(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29年7月11日	至 平成30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29年7月10日現在	平成30年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	958,141,710円	958,141,710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	4,673,862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122,770,423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1,648,497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 5,933,000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 6,972,500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28年7月11日 至 平成29年1月10日	自 平成29年7月11日 至 平成30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30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29年7月10日 現在				当中間計算期間末 平成30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	21,852,000	—	22,896,000	1,044,000	23,580,000	—	25,884,000	2,304,000
合計	21,852,000	—	22,896,000	1,044,000	23,580,000	—	25,884,000	2,304,000

（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29年7月10日現在	当中間計算期間末 平成30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)	178.73円 (17,873円)	204.65円 (20,465円)