

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

平成30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30年 4月 3日
 分配金支払開始日 平成30年 2月16日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（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月期	93,753	(99.6)	387	(0.4)	94,141	(100.0)
29年 7月期	81,707	(99.7)	236	(0.3)	81,943	(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
30年 1月期	4,335	—	—	4,335
29年 7月期	4,335	—	—	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
30年 1月期	99,344	5,202	94,141	21,713.3
29年 7月期	82,932	988	81,943	18,899.9

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	217
29年 7月期	193

(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3期	第4期
	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	1,077,062,998	5,356,779,370
株式 ※2※3	81,707,460,020	93,753,476,090
派生商品評価勘定	1,216,224	18,744,632
未収入金	9,044,028	54,601,035
未収配当金	137,467,550	159,244,250
未収利息	1,070	111,949
その他未収収益 ※4	5,889	1,255,934
流動資産合計	82,932,257,779	99,344,213,260
資産合計	82,932,257,779	99,344,213,260
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,504	—
前受金	5,236,000	70,630,380
未払収益分配金	836,781,801	940,837,569
未払受託者報酬	12,797,736	14,758,896
未払委託者報酬	51,185,956	57,171,944
受入担保金	80,839,500	4,117,365,210
その他未払費用	1,945,235	2,079,309
流動負債合計	988,795,732	5,202,843,308
負債合計	988,795,732	5,202,843,308
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（△）	12,161,062,632	24,358,970,537
（分配準備積立金）	141,363,916	1,353,801
元本等合計	81,943,462,047	94,141,369,952
純資産合計	81,943,462,047	94,141,369,952
負債純資産合計	82,932,257,779	99,344,213,260

(2) 損益及び剰余金計算書

	第3期	第4期
	自平成29年1月11日 至平成29年7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	918,846,112	864,579,625
受取利息	1,070	1,416,717
有価証券売買等損益	2,748,824,361	12,193,512,297
派生商品取引等損益	41,641,020	144,405,723
その他収益 ※1	121,494	27,406,367
営業収益合計	3,709,434,057	13,231,320,729
営業費用		
支払利息	106,770	862,614
受託者報酬	12,797,736	14,758,896
委託者報酬	51,185,956	57,171,944
その他費用 ※2	18,266,393	19,781,801
営業費用合計	82,356,855	92,575,255
営業利益	3,627,077,202	13,138,745,474
経常利益	3,627,077,202	13,138,745,474
当期純利益	3,627,077,202	13,138,745,474
期首剰余金又は期首欠損金（△）	9,370,767,231	12,161,062,632
分配金 ※3	836,781,801	940,837,569
期末剰余金又は期末欠損金（△）	12,161,062,632	24,358,970,537

(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 4 期	
	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>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 3 期	第 4 期
	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	69,782,399,415 円	69,782,399,415 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	4,335,657 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	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 3,948,063,500 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 61,870,000 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 77,060,000 円
5. ※4 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1,141,500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3期	第4期
	自 平成29年1月11日 至 平成29年7月10日	自 平成29年7月11日 至 平成30年1月10日
1. ※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25,689,250円が含まれております。
2. ※2 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。
3. ※3 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（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。	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（892,540,095円）及び分配準備積立金（141,363,916円）の合計額から、経費（91,712,641円）を控除して計算される分配対象額は942,191,370円（10口当たり2,173円）であり、うち940,837,569円（10口当たり2,170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4期 自 平成29年7月11日 至 平成30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4期 平成30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 3 期 平成 29 年 7 月 10 日 現在	第 4 期 平成 30 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	2,831,463,995	10,915,467,786
合計	2,831,463,995	10,915,467,786

(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 3 期 平成 29 年 7 月 10 日 現在				第 4 期 平成 30 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	229,176,000	－	230,400,000	1,224,000	368,270,920	－	387,040,500	18,769,580
合計	229,176,000	－	230,400,000	1,224,000	368,270,920	－	387,040,500	18,769,580

(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4期 自 平成29年7月11日 至 平成30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3期 平成29年7月10日現在	第4期 平成30年1月10日現在
1口当たり純資産額	18,899.9円	21,713.3円
（10口当たり純資産額）	（188,999円）	（217,133円）

平成30年1月期（平成29年7月11日～平成30年1月10日）決算短信

平成30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30年 4月 3日
 分配金支払開始日 平成30年 2月16日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（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月期	2,203	(99.8)	5	(0.2)	2,208	(100.0)
29年 7月期	6,681	(99.8)	12	(0.2)	6,694	(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
30年 1月期	5,414	967	4,839	1,543
29年 7月期	1,542	5,813	1,941	5,414

(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
30年 1月期	2,265	57	2,208	14,309.2
29年 7月期	6,726	32	6,694	12,362.4

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
30年 1月期	339
29年 7月期	47

(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8期	第9期
	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	33,477,737	37,346,929
株式	6,681,582,472	2,203,395,987
新株予約権証券	18,000	—
未収入金	1,106,458	21,932,390
未収配当金	10,524,846	3,086,777
流動資産合計	6,726,709,513	2,265,762,083
資産合計	6,726,709,513	2,265,762,083
負債の部		
流動負債		
未払金	—	433,399
未払収益分配金	25,450,044	52,319,768
未払受託者報酬	1,438,203	1,156,225
未払委託者報酬	3,739,410	3,006,274
その他未払費用	1,947,967	422,921
流動負債合計	32,575,624	57,338,587
負債合計	32,575,624	57,338,587
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	5,355,339,067	1,526,379,084
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,338,794,822	682,044,412
(分配準備積立金)	10,589,676	97,304
元本等合計	6,694,133,889	2,208,423,496
純資産合計	6,694,133,889	2,208,423,496
負債純資産合計	6,726,709,513	2,265,762,083

(2) 損益及び剰余金計算書

	第8期	第9期
	自平成29年1月11日 至平成29年7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	38,589,028	46,786,500
有価証券売買等損益	644,041,870	546,555,707
その他収益	101,491	34,198
営業収益合計	682,732,389	593,376,405
営業費用		
支払利息	11,028	4,804
受託者報酬	1,438,203	1,156,225
委託者報酬	3,739,410	3,006,274
その他費用	1,192,422	825,999
営業費用合計	6,381,063	4,993,302
営業利益	676,351,326	588,383,103
経常利益	676,351,326	588,383,103
当期純利益	676,351,326	588,383,103
期首剰余金又は期首欠損金(△)	273,750,581	1,338,794,822
剰余金増加額又は欠損金減少額	877,553,165	322,691,922
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	322,691,922
剰余金減少額又は欠損金増加額	463,410,206	1,515,505,667
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	463,410,206	1,515,505,667
分配金 ※1	25,450,044	52,319,768
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,338,794,822	682,044,412

(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9期	
	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。 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8期	第9期
	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	1,525,442,501 円	5,355,339,067 円

期中追加設定元本額	5,749,670,180 円	957,005,850 円
期中一部交換元本額	1,919,773,614 円	4,785,965,833 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	5,414,903 口	1,543,356 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第8期	第9期
	自 平成29年1月11日 至 平成29年7月10日	自 平成29年7月11日 至 平成30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(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。	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(46,815,894円)及び分配準備積立金(10,589,676円)の合計額から、経費(4,988,498円)を控除して計算される分配対象額は52,417,072円(100口当たり3,396円)であり、うち52,319,768円(100口当たり3,390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9期 自 平成29年7月11日 至 平成30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9期
	平成30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8期	第9期
	平成29年7月10日現在	平成30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	480,503,363	248,732,909
新株予約権証券	18,000	—
合計	480,521,363	248,732,909

(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8期	第9期
平成29年7月10日現在	平成30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9期 自 平成29年7月11日 至 平成30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8期 平成29年7月10日現在	第9期 平成30年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,236.24円	1,430.92円
(100口当たり純資産額)	(123,624円)	(143,092円)

平成30年1月期（平成29年7月11日～平成30年1月10日）決算短信

平成30年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－JPX日経400 上場取引所 東証
 コード番号 1599
 連動対象指標 JPX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30年 4月 3日
 分配金支払開始日 平成30年 2月16日

I ファンドの運用状況

1. 30年1月期の運用状況（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月期	173,866	(99.7)	495	(0.3)	174,362	(100.0)
29年 7月期	129,081	(99.6)	455	(0.4)	129,536	(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
30年 1月期	8,908	1,974	587	10,295
29年 7月期	8,202	2,572	1,866	8,908

(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
30年 1月期	184,796	10,434	174,362	16,935.9
29年 7月期	131,097	1,560	129,536	14,540.4

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 1月期	143
29年 7月期	147

(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 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	1,827,381,981	10,270,916,969
株式 ※2※3	129,081,261,650	173,866,814,350
派生商品評価勘定	3,720,980	23,020,516
未収入金	13,829,115	403,648,402
未収配当金	169,011,310	225,871,700
未収利息	1,152	202,353
その他未収収益 ※4	10,954	5,984,898
差入委託証拠金	1,928,000	—
流動資産合計	131,097,145,142	184,796,459,188
資産合計	131,097,145,142	184,796,459,188
負債の部		
流動負債		
前受金	9,225,500	93,060,300
未払金	—	119,508,854
未払収益分配金	1,309,586,103	1,472,248,349
未払受託者報酬	33,337,873	42,311,658
未払委託者報酬	86,673,576	107,945,313
受入担保金	104,445,600	8,549,202,585
その他未払費用	16,918,929	49,755,238
流動負債合計	1,560,187,581	10,434,032,297
負債合計	1,560,187,581	10,434,032,297
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	93,826,944,468	108,431,605,676
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	35,710,013,093	65,930,821,215
(分配準備積立金)	171,651,884	8,703,668
元本等合計	129,536,957,561	174,362,426,891
純資産合計	129,536,957,561	174,362,426,891
負債純資産合計	131,097,145,142	184,796,459,188

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 7 期	第 8 期
	自 平成 29 年 1 月 11 日 至 平成 29 年 7 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	1,466,542,439	1,445,149,565
受取利息	1,152	2,178,408
有価証券売買等損益	5,146,624,356	23,971,862,965
派生商品取引等損益	71,056,599	198,059,982
その他収益 ※1	901,902	47,438,394
営業収益合計	6,685,126,448	25,664,689,314
営業費用		
支払利息	159,167	1,319,161
受託者報酬	33,337,873	42,311,658
委託者報酬	86,673,576	107,945,313
その他費用	28,100,467	33,890,102
営業費用合計	148,271,083	185,466,234
営業利益	6,536,855,365	25,479,223,080
経常利益	6,536,855,365	25,479,223,080
当期純利益	6,536,855,365	25,479,223,080
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	28,072,510,529	35,710,013,093
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,885,869,502	9,310,341,065
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	8,885,869,502	9,310,341,065
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,475,636,200	3,096,507,674
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	6,475,636,200	3,096,507,674
分配金 ※2	1,309,586,103	1,472,248,349
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	35,710,013,093	65,930,821,215

(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 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 7 期	第 8 期
	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	86,389,888,520 円	93,826,944,468 円
期中追加設定元本額	27,096,350,448 円	20,796,824,224 円
期中一部交換元本額	19,659,294,500 円	6,192,163,016 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	8,908,749 口	10,295,443 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	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 8,191,033,400 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 83,959,000 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 87,367,000 円
5. ※4 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 5,694,500 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 7 期	第 8 期
	自 平成 29 年 1 月 11 日 至 平成 29 年 7 月 10 日	自 平成 29 年 7 月 11 日 至 平成 30 年 1 月 10 日
1. ※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 42,712,700 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 (1,467,286,326 円) 及び分配準備積立金 (162,063,577 円) の合計額から、経費 (148,111,916 円) を控除して計算される分配対象額は 1,481,237,987 円 (10 口当たり 1,662 円) であり、うち 1,309,586,103 円 (10 口当たり 1,470 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 (1,493,447,206 円) 及び分配準備積立金 (171,651,884 円) の合計額から、経費 (184,147,073 円) を控除して計算される分配対象額は 1,480,952,017 円 (10 口当たり 1,438 円) であり、うち 1,472,248,349 円 (10 口当たり 1,430 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 7 月 11 日 至 平成 30 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 8 期 平成 30 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 7 期 平成 29 年 7 月 10 日現在	第 8 期 平成 30 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	5,223,206,208	23,298,925,378
合計	5,223,206,208	23,298,925,378

（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 7 期 平成 29 年 7 月 10 日 現在				第 8 期 平成 30 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	449,845,000	—	453,600,000	3,755,000	467,869,340	—	490,921,500	23,052,160
合計	449,845,000	—	453,600,000	3,755,000	467,869,340	—	490,921,500	23,052,160

（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 8 期 自 平成 29 年 7 月 11 日 至 平成 30 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 7 期 平成 29 年 7 月 10 日現在	第 8 期 平成 30 年 1 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	14,540.4 円	16,935.9 円
(10 口当たり純資産額)	(145,404 円)	(169,359 円)