

平成 30 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 岡田 美範
(連絡先 03-5555-4946)

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

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7月期（平成29年7月11日～平成30年7月10日）決算短信

平成30年8月22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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成30年10月 3日
 分配金支払開始日 平成30年 8月17日

I ファンドの運用状況

1. 30年7月期の運用状況（平成29年7月11日～平成30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	%
30年 7月期	3,707,005	(99.8)	7,236	(0.2)	3,714,241	(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)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
30年 7月期	1,478,054	819,848	211,308	2,086,595
29年 7月期	945,320	786,531	253,796	1,478,054

(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 7月期	4,234,914	520,672	3,714,241	17,800
29年 7月期	2,961,549	489,266	2,472,283	16,727

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
30年 7月期	321
29年 7月期	257

(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16期	第17期
	平成29年7月10日現在	平成30年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	47,547,348,675
コール・ローン	478,677,037,274	449,441,791,955
株式 ※2※3	2,468,165,203,854	3,707,005,265,350
新株予約権証券	5,712,600	—
派生商品評価勘定	38,923,920	2,644,600
未収入金	11,761,368,609	24,513,820,503
未収配当金	2,709,232,501	4,565,344,321
未収利息	11,548,693	11,965,061
前払金	—	1,585,832,700
その他未収収益 ※4	180,562,984	240,466,375
流動資産合計	2,961,549,590,435	4,234,914,479,540
資産合計	2,961,549,590,435	4,234,914,479,540
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	73,227,797
前受金	51,230,000	—
未払金	3,636,320	1,447,740,383
未払収益分配金	37,986,006,406	66,979,714,619
未払受託者報酬	498,877,192	818,791,573
未払委託者報酬	975,391,091	1,579,719,587
受入担保金	449,407,720,639	449,263,119,795
その他未払費用	343,295,671	510,179,229
流動負債合計	489,266,157,319	520,672,492,983
負債合計	489,266,157,319	520,672,492,983
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,847,568,405,000	2,608,244,338,750
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	624,715,028,116	1,105,997,647,807
(分配準備積立金)	2,956,400,148	1,384,937
元本等合計	2,472,283,433,116	3,714,241,986,557
純資産合計	2,472,283,433,116	3,714,241,986,557
負債純資産合計	2,961,549,590,435	4,234,914,479,540

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年7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7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	40,084,875,898	66,142,401,208
受取利息	178,289,170	271,044,509
有価証券売買等損益	473,799,136,457	145,423,696,751
派生商品取引等損益	3,589,860,900	2,385,852,940
その他収益 ※1	1,810,978,757	2,619,673,447
営業収益合計	519,463,141,182	216,842,668,855
営業費用		
支払利息	94,397,282	157,431,833
受託者報酬	840,734,529	1,476,244,286
委託者報酬	1,646,150,779	2,863,287,986
その他費用	346,015,519	511,455,651
営業費用合計	2,927,298,109	5,008,419,756
営業利益	516,535,843,073	211,834,249,099
経常利益	516,535,843,073	211,834,249,099
当期純利益	516,535,843,073	211,834,249,099
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	224,577,376,643	457,860,109,941
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	224,577,376,643	457,860,109,941
剰余金減少額又は欠損金増加額	74,906,752,300	121,432,024,730
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	74,906,752,300	121,432,024,730
分配金 ※2	37,986,006,406	66,979,714,619
期末剰余金又は期末欠損金(△)	624,715,028,116	1,105,997,647,807

(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17期	
	自 平成29年7月11日	至 平成30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。</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>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第16期	第17期
	平成29年7月10日現在	平成30年7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	1,024,811,012,500円
期中一部交換元本額	317,245,671,250円	264,135,078,750円
2. 計算期間末日における受益権	1,478,054,724口	2,086,595,471口

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 435,241,778,330 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 4,723,490,000 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 210,570,080 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16期	第17期
	自 平成28年7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7月10日
1. ※1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額 1,363,314,103 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 1,701,871,656 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 (41,979,746,543 円) 及び分配準備積立金 (1,795,560,838 円) の合計額から、経費 (2,832,900,827 円) を控除して計算される分配対象額は 40,942,406,554 円 (10 口当たり 277 円) であり、うち 37,986,006,406 円 (10 口当たり 257 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 (68,875,687,331 円) 及び分配準備積立金 (2,956,400,148 円) の合計額から、経費 (4,850,987,923 円) を控除して計算される分配対象額は 66,981,099,556 円 (10 口当たり 321 円) であり、うち 66,979,714,619 円 (10 口当たり 321 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17期
	自 平成29年7月11日 至 平成30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17期 平成30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16期 平成29年7月10日現在	第17期 平成30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	413,713,208,446	113,775,403,510
合計	413,713,208,446	113,775,403,510

（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16期 平成29年7月10日現在				第17期 平成30年7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	4,034,520,000	—	4,073,580,000	39,060,000	7,281,756,400	—	7,211,400,000	△70,356,400
合計	4,034,520,000	—	4,073,580,000	39,060,000	7,281,756,400	—	7,211,400,000	△70,356,400

- (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17期 自 平成29年7月11日 至 平成30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16期 平成29年7月10日現在	第17期 平成30年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,672.7円	1,780.0円
(10口当たり純資産額)	(16,727円)	(17,800円)

平成30年7月期（平成29年7月11日～平成30年7月10日）決算短信

平成30年8月22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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成30年10月 3日
 分配金支払開始日 平成30年 8月17日

I ファンドの運用状況

1. 30年7月期の運用状況（平成29年7月11日～平成30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	%
30年 7月期	1,943	(99.7)	5	(0.3)	1,949	(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)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
30年 7月期	4,089	—	1,486	2,603
29年 7月期	2,602	1,487	—	4,089

(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 7月期	2,002	52	1,949	7,485.9
29年 7月期	3,016	43	2,973	7,270.3

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
30年 7月期	189
29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16期	第17期
	平成29年7月10日現在	平成30年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	4,797,663
コール・ローン	28,524,080	45,349,953
株式 ※3	2,968,034,570	1,943,942,730
派生商品評価勘定	12,184	—
未収入金	15,693,416	3,619,780
未収配当金	4,275,000	2,966,800
前払金	—	1,336,360
流動資産合計	3,016,539,250	2,002,013,286
資産合計	3,016,539,250	2,002,013,286
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,340	38,008
前受金	151,900	—
未払金	—	1,217,926
未払収益分配金	40,080,765	49,209,457
未払受託者報酬	1,257,475	1,098,869
未払委託者報酬	1,508,962	1,318,644
その他未払費用	62,783	56,429
流動負債合計	43,072,225	52,939,333
負債合計	43,072,225	52,939,333
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	3,304,618,192	2,103,769,400
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△331,151,167	△154,695,447
(分配準備積立金)	4,549,013	32,625
元本等合計	2,973,467,025	1,949,073,953
純資産合計	2,973,467,025	1,949,073,953
負債純資産合計	3,016,539,250	2,002,013,286

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年7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7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	46,691,173	50,143,445
有価証券売買等損益	512,462,100	83,301,562
派生商品取引等損益	4,037,516	309,754
その他収益	513	443
営業収益合計	563,191,302	133,755,204
営業費用		
支払利息	5,563	13,218
受託者報酬	2,172,370	2,415,811
委託者報酬	2,606,850	2,898,986
その他費用	108,482	122,804
営業費用合計	4,893,265	5,450,819
営業利益	558,298,037	128,304,385
経常利益	558,298,037	128,304,385
当期純利益	558,298,037	128,304,385
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
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	97,360,792
剰余金減少額又は欠損金増加額	187,011,845	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	187,011,845	—
分配金 ※1	40,080,765	49,209,457
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△331,151,167	△154,695,447

(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17期	
	自 平成29年7月11日	至 平成30年7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16期	第17期
	平成29年7月10日現在	平成30年7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. 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。	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154,695,447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 14,302,000円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年7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(46,686,123円)及び分配準備積立金(2,831,357円)の合計額から、経費(4,887,702円)を控除して計算される分配対象額は44,629,778円(100口当たり1,091円)であり、うち40,080,765円(100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(50,130,670円)及び分配準備積立金(4,549,013円)の合計額から、経費(5,437,601円)を控除して計算される分配対象額は49,242,082円(100口当たり1,891円)であり、うち49,209,457円(100口当たり1,890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17期
	自 平成29年7月11日 至 平成30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17期
	平成30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16期	第17期
	平成29年7月10日現在	平成30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	492,465,885	55,762,689
合計	492,465,885	55,762,689

(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16期				第17期			
	平成29年7月10日現在				平成30年7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	4,615,360	—	4,578,000	△37,360
合計	5,173,900	—	5,176,500	2,600	4,615,360	—	4,578,000	△37,360

(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17期 自 平成29年7月11日 至 平成30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16期 平成29年7月10日現在	第17期 平成30年7月10日現在
1口当たり純資産額	727.03円	748.59円
(100口当たり純資産額)	(72,703円)	(74,859円)

平成30年7月期（平成29年7月11日～平成30年7月10日）決算短信

平成30年8月22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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成30年10月 3日
 分配金支払開始日 平成30年 8月17日

I ファンドの運用状況

1. 30年7月期の運用状況（平成29年7月11日～平成30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	%
30年 7月期	2,525,626	(99.8)	5,261	(0.2)	2,530,888	(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)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
30年 7月期	102,689	44,926	35,764	111,851
29年 7月期	86,133	50,280	33,724	102,689

(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 7月期	2,842,718	311,829	2,530,888	22,627
29年 7月期	2,137,234	34,890	2,102,343	20,473

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	389
29年 7月期	309

(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16期	第17期
	平成29年7月10日現在	平成30年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	27,315,739,083
コール・ローン	18,596,153,116	258,202,298,639
株式 ※2※3	2,098,867,821,820	2,525,626,787,500
派生商品評価勘定	5,256,240	—
未収入金	16,964,953,760	27,516,096,795
未収配当金	2,750,748,000	3,186,715,000
未収利息	13,742	7,075,489
前払金	49,100,000	590,032,060
その他未収収益 ※4	14,745	182,225,856
差入委託証拠金	—	91,080,000
流動資産合計	2,137,234,061,423	2,842,718,050,422
資産合計	2,137,234,061,423	2,842,718,050,422
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,418,580	64,021,300
未払金	—	425,949,480
未払収益分配金	31,731,170,448	43,510,278,235
未払受託者報酬	768,524,788	979,160,484
未払委託者報酬	988,101,714	1,248,922,980
受入担保金	892,483,725	264,939,283,486
その他未払費用	504,056,426	661,960,330
流動負債合計	34,890,755,681	311,829,576,295
負債合計	34,890,755,681	311,829,576,295
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,263,804,254,704	1,376,557,825,805
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	838,539,051,038	1,154,330,648,322
(分配準備積立金)	2,761,580,986	49,654,069
元本等合計	2,102,343,305,742	2,530,888,474,127
純資産合計	2,102,343,305,742	2,530,888,474,127
負債純資産合計	2,137,234,061,423	2,842,718,050,422

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年7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7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	36,222,498,916	44,394,742,976
受取利息	13,753	124,736,113
有価証券売買等損益	479,014,217,710	241,429,510,836
派生商品取引等損益	2,915,883,482	3,277,917,960
その他収益 ※1	3,095,285	1,285,503,768
営業収益合計	518,155,709,146	290,512,411,653
営業費用		
支払利息	2,920,193	76,370,280
受託者報酬	1,411,044,156	1,869,481,831
委託者報酬	1,814,198,091	2,390,651,537
その他費用	508,142,597	670,127,891
営業費用合計	3,736,305,037	5,006,631,539
営業利益	514,419,404,109	285,505,780,114
経常利益	514,419,404,109	285,505,780,114
当期純利益	514,419,404,109	285,505,780,114
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	322,348,929,540	437,893,608,899
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	322,348,929,540	437,893,608,899
剰余金減少額又は欠損金増加額	230,437,675,464	364,097,513,494
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	230,437,675,464	364,097,513,494
分配金 ※2	31,731,170,448	43,510,278,235
期末剰余金又は期末欠損金(△)	838,539,051,038	1,154,330,648,322

(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 17 期	
	自 平成 29 年 7 月 11 日	至 平成 30 年 7 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 16 期	第 17 期
	平成 29 年 7 月 10 日現在	平成 30 年 7 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	552,912,909,207 円
期中一部交換元本額	415,048,873,726 円	440,159,338,106 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	102,689,872 口	111,851,615 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 256,143,696,620 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 3,514,750,000 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175,806,200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16期 自 平成28年7月11日 至 平成29年7月10日	第17期 自 平成29年7月11日 至 平成30年7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1,151,465,240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(36,222,687,761円)及び分配準備積立金(2,003,448,517円)の合計額から、経費(3,733,384,844円)を控除して計算される分配対象額は34,492,751,434円(1口当たり335円)であり、うち31,731,170,448円(1口当たり309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(45,728,612,577円)及び分配準備積立金(2,761,580,986円)の合計額から、経費(4,930,261,259円)を控除して計算される分配対象額は43,559,932,304円(1口当たり389円)であり、うち43,510,278,235円(1口当たり389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17期 自 平成29年7月11日 至 平成30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17期 平成30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	<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16期 平成29年7月10日現在	第17期 平成30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	373,977,679,883	180,681,435,250
合計	373,977,679,883	180,681,435,250

(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16期 平成29年7月10日 現在				第17期 平成30年7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	5,300,733,860	-	5,236,840,000	△63,893,860

合計	3,438,170,000	－	3,437,100,000	△1,070,000	5,300,733,860	－	5,236,840,000	△63,893,860
----	---------------	---	---------------	------------	---------------	---	---------------	-------------

(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 17 期 自 平成 29 年 7 月 11 日 至 平成 30 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 16 期 平成 29 年 7 月 10 日現在	第 17 期 平成 30 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	20,473 円	22,627 円

平成30年7月期（平成29年7月11日～平成30年7月10日）決算短信

平成30年8月22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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成30年10月 3日
 分配金支払開始日 平成30年 8月17日

I ファンドの運用状況

1. 30年7月期の運用状況（平成29年7月11日～平成30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	%
30年 7月期	2,531	(99.8)	5	(0.2)	2,537	(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)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
30年 7月期	1,023	—	—	1,023
29年 7月期	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/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
30年 7月期	2,581	43	2,537	24,788.4
29年 7月期	2,323	31	2,291	22,386.4

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
30年 7月期	383
29年 7月期	285

(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16期	第17期
	平成29年7月10日現在	平成30年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	3,779,837
コール・ローン	29,436,648	35,728,948
株式	2,286,535,700	2,531,886,800
派生商品評価勘定	22,326	—
未収入金	3,318,344	3,720,300
未収配当金	3,334,600	3,749,830
前払金	—	1,333,750
差入委託証拠金	969,000	1,080,000
流動資産合計	2,323,616,618	2,581,279,465
資産合計	2,323,616,618	2,581,279,465
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	79,574
前受金	140,550	—
未払金	—	1,205,006
未払収益分配金	29,175,450	39,207,710
未払受託者報酬	1,157,456	1,423,294
未払委託者報酬	1,388,947	1,707,982
その他未払費用	57,792	72,350
流動負債合計	31,920,195	43,695,916
負債合計	31,920,195	43,695,916
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,958,338,100	1,958,338,100
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	333,358,323	579,245,449
(分配準備積立金)	3,378,467	56,573
元本等合計	2,291,696,423	2,537,583,549
純資産合計	2,291,696,423	2,537,583,549
負債純資産合計	2,323,616,618	2,581,279,465

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年7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7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	34,031,312	42,212,300
有価証券売買等損益	768,787,593	248,119,110
派生商品取引等損益	4,566,140	1,089,910
その他収益	63	53
営業収益合計	807,385,108	291,421,373
営業費用		
支払利息	8,347	9,975
受託者報酬	2,158,400	2,806,663
委託者報酬	2,590,101	3,368,013
その他費用	158,573	141,886
営業費用合計	4,915,421	6,326,537
営業利益	802,469,687	285,094,836
経常利益	802,469,687	285,094,836
当期純利益	802,469,687	285,094,836
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△439,935,914	333,358,323
分配金 ※1	29,175,450	39,207,710
期末剰余金又は期末欠損金(△)	333,358,323	579,245,449

(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17期	
	自 平成29年7月11日	至 平成30年7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16期	第17期
	平成29年7月10日現在	平成30年7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. 計算期間末日における受益権の総数	1,023,700口	1,023,700口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年7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 (34,023,028円) 及び分配準備	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 (42,202,378円) 及び分配準備

	積立金(3,437,963円)の合計額から、経費(4,907,074円)を控除して計算される分配対象額は32,553,917円（100口当たり3,180円）であり、うち29,175,450円（100口当たり2,850円）を分配金額としております。	積立金(3,378,467円)の合計額から、経費(6,316,562円)を控除して計算される分配対象額は39,264,283円（100口当たり3,835円）であり、うち39,207,710円（100口当たり3,830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17期 自 平成29年7月11日 至 平成30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17期 平成30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16期 平成29年7月10日現在	第17期 平成30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	761,271,426	238,563,789
合計	761,271,426	238,563,789

(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16期 平成29年7月10日 現在				第17期 平成30年7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	4,826,850	—	4,849,500	22,650	5,230,250	—	5,151,000	△79,250
合計	4,826,850	—	4,849,500	22,650	5,230,250	—	5,151,000	△79,250

(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17期 自 平成29年7月11日 至 平成30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16期 平成29年7月10日現在	第17期 平成30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)	2,238.64円 (223,864円)	2,478.84円 (247,884円)

平成30年7月期（平成29年7月11日～平成30年7月10日）決算短信

平成30年8月22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)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成30年10月 3日
 分配金支払開始日 平成30年 8月17日

I ファンドの運用状況

1. 30年7月期の運用状況（平成29年7月11日～平成30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	%
30年 7月期	729	(97.2)	20	(2.8)	750	(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)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
30年 7月期	4,673	—	—	4,673
29年 7月期	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/当計算期間末発行済口数) × 100
	百万円	百万円	百万円	円
30年 7月期	775	24	750	16,065
29年 7月期	858	23	835	17,873

(4) 分配金

	100口当たり分配金
	円
30年 7月期	466
29年 7月期	442

(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16期	第17期
	平成29年7月10日現在	平成30年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	2,088,534
コール・ローン	31,458,727	19,741,889
株式 ※3	812,339,940	729,990,530
派生商品評価勘定	1,042,704	—
未収入金	13,841,148	21,583,429
未収配当金	108,000	108,000
前払金	—	1,728,000
流動資産合計	858,790,519	775,240,382
資産合計	858,790,519	775,240,382
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	1,585,296
前受金	1,440,000	—
未払金	318,843	—
未払収益分配金	20,658,470	21,780,196
未払受託者報酬	445,322	450,954
未払委託者報酬	534,406	541,157
その他未払費用	22,191	23,051
流動負債合計	23,419,232	24,380,654
負債合計	23,419,232	24,380,654
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	958,141,710	958,141,710
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△122,770,423	△207,281,982
(分配準備積立金)	150,617	35,884
元本等合計	835,371,287	750,859,728
純資産合計	835,371,287	750,859,728
負債純資産合計	858,790,519	775,240,382

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自平成28年7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7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	22,563,750	23,712,675
有価証券売買等損益	295,295,569	△82,157,362
派生商品取引等損益	9,498,500	△2,239,464
その他収益	17	23
営業収益合計	327,357,836	△60,684,128
営業費用		
支払利息	11,784	11,405
受託者報酬	830,591	904,502
委託者報酬	996,721	1,085,403
その他費用	41,442	45,925
営業費用合計	1,880,538	2,047,235
営業利益又は営業損失(△)	325,477,298	△62,731,363
経常利益又は経常損失(△)	325,477,298	△62,731,363
当期純利益又は当期純損失(△)	325,477,298	△62,731,363
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△427,589,251	△122,770,423
分配金 ※1	20,658,470	21,780,196
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△122,770,423	△207,281,982

(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17期	
	自 平成29年7月11日	至 平成30年7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16期	第17期
	平成29年7月10日現在	平成30年7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. 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。	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207,281,982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 5,329,000円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第16期	第17期
	自 平成28年7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（22,551,983円）及び分配準備積立金(125,858円)の合計額から、経費(1,868,754円)を控除して計算される分配対象額は20,809,087円(100口当たり445円)であり、うち20,658,470円(100口当たり442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（23,701,293円）及び分配準備積立金(150,617円)の合計額から、経費(2,035,830円)を控除して計算される分配対象額は21,816,080円(100口当たり466円)であり、うち21,780,196円(100口当たり466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17期 自 平成29年7月11日 至 平成30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17期 平成30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16期 平成29年7月10日現在	第17期 平成30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	287,215,293	△80,484,214
合計	287,215,293	△80,484,214

(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16期 平成29年7月10日 現在				第17期 平成30年7月10日 現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	21,852,000	—	22,896,000	1,044,000	22,200,000	—	20,616,000	△1,584,000
合計	21,852,000	—	22,896,000	1,044,000	22,200,000	—	20,616,000	△1,584,000

(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17期 自 平成29年7月11日 至 平成30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16期 平成29年7月10日現在	第17期 平成30年7月10日現在
1口当たり純資産額	178.73円	160.65円
(100口当たり純資産額)	(17,873円)	(16,065円)