

2020年2月20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 松下 浩一
担当者の役職氏名 経営企画部 岡田 美範
(連絡先 03-5555-4946)

2020年1月期（2019年7月11日～2020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2020年1月期（2019年7月11日～2020年1月10日）決算短信をご報告します。

記

上場ETF銘柄（6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
ダイワ上場投信－MSCI 日本株女性活躍指数（WIN）	1652	東
ダイワ上場投信－MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数	1653	東
ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index	1654	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31年1月期（平成30年7月11日～平成31年1月10日）決算短信

平成31年2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 <https://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31年 4月 3日
 分配金支払開始日 平成31年 2月18日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月11日～平成31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	%
31年 1月期	51,627	(99.0)	530	(1.0)	52,158	(100.0)
30年 7月期	70,126	(99.5)	369	(0.5)	70,495	(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
31年 1月期	3,510	—	533	2,976
30年 7月期	4,335	—	825	3,510

(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
31年 1月期	67,262	15,103	52,158	17,523.2
30年 7月期	79,113	8,617	70,495	20,082.6

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	219
30年 7月期	201

(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5期	第6期
	平成30年7月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	846,369,636	—
コール・ローン	8,000,317,504	15,454,484,324
株式 ※2※3	70,126,049,870	51,627,963,330
派生商品評価勘定	—	6,454,645
未収配当金	102,045,500	107,544,800
未収利息	206,430	341,231
前払金	31,627,000	34,827,825
その他未収収益 ※4	7,059,268	1,733,652
差入委託証拠金	—	28,890,000
流動資産合計	79,113,675,208	67,262,239,807
資産合計	79,113,675,208	67,262,239,807
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,984,852	20,632,884
未払金	21,925,215	33,118,602
未払収益分配金	705,569,295	651,866,421
未払受託者報酬	12,944,063	12,599,786
未払委託者報酬	48,769,978	45,863,725
受入担保金	7,817,392,590	14,337,443,640
その他未払費用	2,156,193	1,911,336
流動負債合計	8,617,742,186	15,103,436,394
負債合計	8,617,742,186	15,103,436,394
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	56,498,198,025	47,907,717,105
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	13,997,734,997	4,251,086,308
(分配準備積立金)	2,004,244	2,220,950
元本等合計	70,495,933,022	52,158,803,413
純資産合計	70,495,933,022	52,158,803,413
負債純資産合計	79,113,675,208	67,262,239,807

(2) 損益及び剰余金計算書

	第5期	第6期
	自平成30年1月11日 至平成30年7月10日	自平成30年7月11日 至平成31年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	754,899,754	648,500,825
受取利息	3,261,455	5,152,413
有価証券売買等損益	△6,340,034,006	△8,408,518,746
派生商品取引等損益	△26,193,167	△157,564,289
その他収益 ※1	29,449,320	76,935,088
営業収益合計	△5,578,616,644	△7,835,494,709
営業費用		
支払利息	2,040,896	3,671,264
受託者報酬	12,944,063	12,599,786
委託者報酬	48,769,978	45,863,725
その他費用 ※2	17,635,854	16,370,424
営業費用合計	81,390,791	78,505,199
営業損失(△)	△5,660,007,435	△7,913,999,908
経常損失(△)	△5,660,007,435	△7,913,999,908
当期純損失(△)	△5,660,007,435	△7,913,999,908
期首剰余金又は期首欠損金(△)	24,358,970,537	13,997,734,997
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,995,658,810	1,180,782,360
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,995,658,810	1,180,782,360
分配金 ※3	705,569,295	651,866,421
期末剰余金又は期末欠損金(△)	13,997,734,997	4,251,086,308

(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6期	
	自 平成30年7月11日	至 平成31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5期	第6期
	平成30年7月10日現在	平成31年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	69,782,399,415 円	56,498,198,025 円
期中追加設定元本額	— 円	— 円
期中一部交換元本額	13,284,201,390 円	8,590,480,920 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,510,295 口	2,976,559 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 7,587,522,850 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 13,662,626,480 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。	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	71,510,000円	株式	67,040,000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6,894,000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1,444,500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5期	第6期
	自 平成30年1月11日 至 平成30年7月10日	自 平成30年7月11日 至 平成31年1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26,441,070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72,220,800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(785,569,633円)及び分配準備積立金(1,353,801円)の合計額から、経費(79,349,895円)を控除して計算される分配対象額は707,573,539円(10口当たり2,015円)であり、うち705,569,295円(10口当たり2,010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(726,917,062円)及び分配準備積立金(2,004,244円)の合計額から、経費(74,833,935円)を控除して計算される分配対象額は654,087,371円(10口当たり2,197円)であり、うち651,866,421円(10口当たり2,190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6期
	自 平成30年7月11日 至 平成31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6期 平成31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5期 平成30年7月10日現在	第6期 平成31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	△4,806,476,080	△7,026,787,708
合計	△4,806,476,080	△7,026,787,708

(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5期 平成30年7月10日 現在				第6期 平成31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								

ダイワ上場投信－MSC I 日本株人材設備投資指数（1479）平成31年1月期決算短信

先物取引								
買建	380,082,500	－	371,124,000	△8,958,500	543,310,295	－	529,174,500	△14,135,795
合計	380,082,500	－	371,124,000	△8,958,500	543,310,295	－	529,174,500	△14,135,795

(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6期 自 平成30年7月11日 至 平成31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5期 平成30年7月10日現在	第6期 平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額	20,082.6円	17,523.2円
(10口当たり純資産額)	(200,826円)	(175,232円)

平成31年1月期（平成30年7月11日～平成31年1月10日）決算短信

平成31年2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 <https://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31年 4月 3日
 分配金支払開始日 平成31年 2月18日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月期の運用状況（平成31年7月11日～平成31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	%
31年 1月期	23,429	(99.8)	47	(0.2)	23,477	(100.0)
30年 7月期	25,224	(99.8)	40	(0.2)	25,265	(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
31年 1月期	19,123	7,860	6,891	20,093
30年 7月期	1,543	17,580	—	19,123

(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
31年 1月期	23,807	330	23,477	11,684.1
30年 7月期	25,413	148	25,265	13,211.5

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
31年 1月期	150
30年 7月期	33

(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10期	第11期
	平成30年7月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	5,876,970	—
コール・ローン	55,552,113	335,119,705
株式	25,224,767,820	23,429,437,500
未収入金	91,010,907	—
未収配当金	36,179,826	43,338,262
流動資産合計	25,413,387,636	23,807,895,467
資産合計	25,413,387,636	23,807,895,467
負債の部		
流動負債		
未払金	70,833,092	—
未払収益分配金	63,108,031	301,399,170
未払受託者報酬	3,218,844	7,184,385
未払委託者報酬	8,369,083	18,679,465
その他未払費用	2,567,268	3,414,332
流動負債合計	148,096,318	330,677,352
負債合計	148,096,318	330,677,352
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	18,913,285,894	19,872,251,942
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	6,352,005,424	3,604,966,173
(分配準備積立金)	1,659,573	1,952,443
元本等合計	25,265,291,318	23,477,218,115
純資産合計	25,265,291,318	23,477,218,115
負債純資産合計	25,413,387,636	23,807,895,467

(2) 損益及び剰余金計算書

	第10期	第11期
	自平成30年1月11日 至平成30年7月10日	自平成30年7月11日 至平成31年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	78,485,123	332,323,547
受取利息	—	5
有価証券売買等損益	△1,025,991,465	△3,042,153,112
その他収益	38,154	337,515
営業収益合計	△947,468,188	△2,709,492,045
営業費用		
支払利息	5,037	34,844
受託者報酬	3,218,844	7,184,385
委託者報酬	8,369,083	18,679,465
その他費用	2,260,013	5,070,333
営業費用合計	13,852,977	30,969,027
営業損失(△)	△961,321,165	△2,740,461,072
経常損失(△)	△961,321,165	△2,740,461,072
当期純損失(△)	△961,321,165	△2,740,461,072
期首剰余金又は期首欠損金(△)	682,044,412	6,352,005,424
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,694,390,208	3,003,051,579
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	6,694,390,208	3,003,051,579
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	2,708,230,588
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	2,708,230,588
分配金 ※1	63,108,031	301,399,170
期末剰余金又は期末欠損金(△)	6,352,005,424	3,604,966,173

(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11期	
	自 平成30年7月11日	至 平成31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. 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10期	第11期
	平成30年7月10日現在	平成31年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	1,526,379,084 円	18,913,285,894 円
期中追加設定元本額	17,386,906,810 円	7,774,509,220 円
期中一部交換元本額	－円	6,815,543,172 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	19,123,646 口	20,093,278 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第10期	第11期
	自 平成30年1月11日 至 平成30年7月10日	自 平成30年7月11日 至 平成31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(78,518,240円)及び分配準備積立金(97,304円)の合計額から、経費(13,847,940円)を控除して計算される分配対象額は64,767,604円(100口当たり338円)であり、うち63,108,031円(100口当たり330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(332,626,223円)及び分配準備積立金(1,659,573円)の合計額から、経費(30,934,183円)を控除して計算される分配対象額は303,351,613円(100口当たり1,509円)であり、うち301,399,170円(100口当たり1,500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11期 自 平成30年7月11日 至 平成31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11期 平成31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

	<p>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) 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10期 平成30年7月10日現在	第11期 平成31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	△1,009,577,036	△3,265,611,820
合計	△1,009,577,036	△3,265,611,820

(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10期 平成30年7月10日現在	第11期 平成31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11期 自 平成30年7月11日 至 平成31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10期 平成30年7月10日現在	第11期 平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,321.15円	1,168.41円
(100口当たり純資産額)	(132,115円)	(116,841円)

平成31年1月期（平成30年7月11日～平成31年1月10日）決算短信

平成31年2月22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 <https://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31年 4月 3日
 分配金支払開始日 平成31年 2月18日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月11日～平成31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	%
31年 1月期	174,092	(99.7)	439	(0.3)	174,531	(100.0)
30年 7月期	182,068	(99.7)	574	(0.3)	182,643	(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
31年 1月期	11,869	1,586	646	12,810
30年 7月期	10,295	2,259	685	11,869

(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
31年 1月期	221,044	46,513	174,531	13,624.6
30年 7月期	201,943	19,300	182,643	15,387.8

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
31年 1月期	149
30年 7月期	146

(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 9 期	第 10 期
	平成 30 年 7 月 10 日現在	平成 31 年 1 月 10 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,868,826,089	—
コール・ローン	17,665,097,414	46,537,259,996
株式 ※2※3	182,068,738,780	174,092,507,180
未収入金	—	23,003,586
未収配当金	254,809,257	291,353,920
未収利息	478,962	1,083,760
前払金	67,596,000	47,530,576
その他未収収益 ※4	13,015,737	19,772,065
差入委託証拠金	4,942,000	32,457,000
流動資産合計	201,943,504,239	221,044,968,083
資産合計	201,943,504,239	221,044,968,083
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,088,040	22,462,076
未払金	54,157,650	72,384,932
未払収益分配金	1,732,928,458	1,908,698,195
未払受託者報酬	49,818,758	56,155,666
未払委託者報酬	125,387,262	138,766,090
受入担保金	17,301,285,540	44,248,979,155
その他未払費用	24,579,273	65,986,821
流動負債合計	19,300,244,981	46,513,432,935
負債合計	19,300,244,981	46,513,432,935
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	125,008,236,436	134,915,499,260
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	57,635,022,822	39,616,035,888
(分配準備積立金)	5,937,753	9,318,382
元本等合計	182,643,259,258	174,531,535,148
純資産合計	182,643,259,258	174,531,535,148
負債純資産合計	201,943,504,239	221,044,968,083

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 9 期	第 10 期
	自 平成 30 年 1 月 11 日 至 平成 30 年 7 月 10 日	自 平成 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 年 1 月 10 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,869,053,044	2,005,759,937
受取利息	7,285,731	14,055,733
有価証券売買等損益	△16,516,447,023	△22,092,546,070
派生商品取引等損益	△26,163,734	△290,815,518
その他収益 ※1	73,484,548	141,043,820
営業収益合計	△14,592,787,434	△20,222,502,098
営業費用		
支払利息	4,465,063	9,752,097
受託者報酬	49,818,758	56,155,666
委託者報酬	125,387,262	138,766,090
その他費用	39,989,697	44,106,813
営業費用合計	219,660,780	248,780,666
営業損失 (△)	△14,812,448,214	△20,471,282,764
経常損失 (△)	△14,812,448,214	△20,471,282,764
当期純損失 (△)	△14,812,448,214	△20,471,282,764
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	65,930,821,215	57,635,022,822
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,831,127,005	7,190,864,313
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	11,831,127,005	7,190,864,313
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,581,548,726	2,829,870,288
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,581,548,726	2,829,870,288
分配金 ※2	1,732,928,458	1,908,698,195
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	57,635,022,822	39,616,035,888

(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 10 期	
	自 平成 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 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>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 9 期	第 10 期
	平成 30 年 7 月 10 日現在	平成 31 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	108,431,605,676 円	125,008,236,436 円
期中追加設定元本額	23,796,021,864 円	16,712,156,536 円
期中一部交換元本額	7,219,391,104 円	6,804,893,712 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	11,869,373 口	12,810,055 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 16,747,702,700 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 42,155,072,200 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 79,597,000 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 134,508,000 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 12,587,570 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 18,765,070 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 9 期	第 10 期
	自 平成 30 年 1 月 11 日 至 平成 30 年 7 月 10 日	自 平成 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 年 1 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 64,231,360 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 125,193,130 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 (1,945,358,260 円) 及び分配準備積立金 (8,703,668 円) の合計額から、経費 (215,195,717 円) を控除して計算される分配対象額は 1,738,866,211 円 (10 口当たり 1,465 円) であり、うち 1,732,928,458 円 (10 口当たり 1,460 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 (2,151,107,393 円) 及び分配準備積立金 (5,937,753 円) の合計額から、経費 (239,028,569 円) を控除して計算される分配対象額は 1,918,016,577 円 (10 口当たり 1,497 円) であり、うち 1,908,698,195 円 (10 口当たり 1,490 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 10 期 自 平成 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 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 10 期 平成 31 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 9 期 平成 30 年 7 月 10 日現在	第 10 期 平成 31 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	△15,720,226,872	△21,703,839,927
合計	△15,720,226,872	△21,703,839,927

（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 9 期 平成 30 年 7 月 10 日 現在				第 10 期 平成 31 年 1 月 10 日 現在			
	契約額等 （円）	うち	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち	時価 （円）	評価損益 （円）
		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	590,027,000	—	577,980,000	△12,047,000	456,000,300	—	433,573,000	△22,427,300
合計	590,027,000	—	577,980,000	△12,047,000	456,000,300	—	433,573,000	△22,427,300

（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 10 期 自 平成 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 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 9 期 平成 30 年 7 月 10 日現在	第 10 期 平成 31 年 1 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	15,387.8 円	13,624.6 円
(10 口当たり純資産額)	(153,878 円)	(136,246 円)

平成31年1月期（平成30年7月11日～平成31年1月10日）決算短信

平成31年2月22日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数（WIN） 上場取引所 東証
 コード番号 1652
 連動対象指標 MSCI日本株女性活躍指数
 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 <https://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31年 4月 3日
 分配金支払開始日 平成31年 2月18日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月11日～平成31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	%
31年 1月期	1,202	(99.7)	3	(0.3)	1,206	(100.0)
30年 7月期	1,052	(99.7)	3	(0.3)	1,055	(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
31年 1月期	510	147	—	657
30年 7月期	510	—	—	510

(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
31年 1月期	1,219	13	1,206	18,340.5
30年 7月期	1,069	13	1,055	20,680.6

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
31年 1月期	176
30年 7月期	223

(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30年7月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	12,247,989	—
コール・ローン	—	12,689,891
株式 ※3	1,052,424,990	1,202,941,170
派生商品評価勘定	—	149,784
未収入金	2,518,942	1,476,106
未収配当金	1,663,940	1,936,050
前払金	394,400	69,000
流動資産合計	1,069,250,261	1,219,262,001
資産合計	1,069,250,261	1,219,262,001
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	94,816	—
未払金	1,125,644	369,728
未払収益分配金	11,383,704	11,575,520
未払受託者報酬	172,645	195,136
未払委託者報酬	690,699	780,658
その他未払費用	77,575	87,876
流動負債合計	13,545,083	13,008,918
負債合計	13,545,083	13,008,918
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,018,407,600	1,312,111,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	37,297,578	△105,858,417
(分配準備積立金)	47,489	53,648
元本等合計	1,055,705,178	1,206,253,083
純資産合計	1,055,705,178	1,206,253,083
負債純資産合計	1,069,250,261	1,219,262,001

(2) 損益及び剰余金計算書

	第2期	第3期
	自平成30年1月11日 至平成30年7月10日	自平成30年7月11日 至平成31年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	12,664,719	12,978,935
受取利息	1	—
有価証券売買等損益	△81,980,425	△148,075,158
派生商品取引等損益	△162,656	△1,762,688
その他収益	16,768	16,685
営業収益合計	△69,461,593	△136,842,226
営業費用		
支払利息	682	810
受託者報酬	172,645	195,136
委託者報酬	690,699	780,658
その他費用 ※1	417,513	437,337
営業費用合計	1,281,539	1,413,941
営業損失(△)	△70,743,132	△138,256,167
経常損失(△)	△70,743,132	△138,256,167
当期純損失(△)	△70,743,132	△138,256,167
期首剰余金又は期首欠損金(△)	119,424,414	37,297,578
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	6,675,692
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	6,675,692
分配金 ※2	11,383,704	11,575,520
期末剰余金又は期末欠損金(△)	37,297,578	△105,858,417

(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30年7月11日	至 平成31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2期	第3期
	平成30年7月10日現在	平成31年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	1,018,407,600円	1,018,407,600円
期中追加設定元本額	－円	293,703,900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	510,480口	657,700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105,858,417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 9,933,000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 8,543,250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30年1月11日 至 平成30年7月10日	自 平成30年7月11日 至 平成31年1月10日
1. ※1 その他費用	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。
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（12,680,806円）及び分配準備積立金（31,244円）の合計額から、経費（1,280,857円）を控除して計算される分配対象額は11,431,193円（100口当たり2,239円）であり、うち11,383,704円（100口当たり2,230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（12,994,810円）及び分配準備積立金（47,489円）の合計額から、経費（1,413,131円）を控除して計算される分配対象額は11,629,168円（100口当たり1,768円）であり、うち11,575,520円（100口当たり1,760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30年7月11日 至 平成31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3期
	平成31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2期	第3期
	平成30年7月10日現在	平成31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	△66,094,642	△141,223,160
合計	△66,094,642	△141,223,160

(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				第3期			
	平成30年7月10日 現在				平成31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	3,136,600	—	3,042,000	△94,600	2,543,000	—	2,693,000	150,000
合計	3,136,600	—	3,042,000	△94,600	2,543,000	—	2,693,000	150,000

(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 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 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 2 期 平成 30 年 7 月 10 日現在	第 3 期 平成 31 年 1 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	2,068.06 円	1,834.05 円
(100 口当たり純資産額)	(206,806 円)	(183,405 円)

平成31年1月期（平成30年7月11日～平成31年1月10日）決算短信

平成31年2月22日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数 上場取引所 東証
 コード番号 1653
 連動対象指標 MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数
 主要投資資産 株式、投資証券
 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 <https://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31年 4月 3日
 分配金支払開始日 平成31年 2月18日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月11日～平成31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	%
31年 1月期	2,706	(99.7)	8	(0.3)	2,715	(100.0)
30年 7月期	2,206	(99.6)	8	(0.4)	2,214	(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
31年 1月期	1,090	445	49	1,487
30年 7月期	1,041	49	—	1,090

(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
31年 1月期	2,739	24	2,715	18,255.4
30年 7月期	2,237	23	2,214	20,298.9

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
31年 1月期	144
30年 7月期	187

(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30年7月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	28,032,781	—
コール・ローン	—	29,443,201
株式 ※3	2,189,879,770	2,675,725,450
投資証券	16,582,000	30,306,400
派生商品評価勘定	—	224,676
未収配当金	2,273,622	3,481,170
前払金	887,400	341,500
流動資産合計	2,237,655,573	2,739,522,397
資産合計	2,237,655,573	2,739,522,397
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	237,040	180,432
未払金	624,708	715,456
未払収益分配金	20,400,578	21,416,342
未払受託者報酬	349,179	399,821
未払委託者報酬	1,396,774	1,599,405
その他未払費用	157,028	184,438
流動負債合計	23,165,307	24,495,894
負債合計	23,165,307	24,495,894
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,142,606,160	2,920,951,144
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	71,884,106	△205,924,641
(分配準備積立金)	42,511	12,261
元本等合計	2,214,490,266	2,715,026,503
純資産合計	2,214,490,266	2,715,026,503
負債純資産合計	2,237,655,573	2,739,522,397

(2) 損益及び剰余金計算書

	第2期	第3期
	自平成30年1月11日 至平成30年7月10日	自平成30年7月11日 至平成31年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	22,643,248	23,971,846
受取利息	3	—
有価証券売買等損益	△194,550,242	△294,783,586
派生商品取引等損益	△503,476	△4,103,288
その他収益	9,416	6,652
営業収益合計	△172,401,051	△274,908,376
営業費用		
支払利息	1,725	2,100
受託者報酬	349,179	399,821
委託者報酬	1,396,774	1,599,405
その他費用 ※1	551,517	591,080
営業費用合計	2,299,195	2,592,406
営業損失(△)	△174,700,246	△277,500,782
経常損失(△)	△174,700,246	△277,500,782
当期純損失(△)	△174,700,246	△277,500,782
期首剰余金又は期首欠損金(△)	262,011,597	71,884,106
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,973,333	21,108,377
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	7,967,356
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	4,973,333	13,141,021
分配金 ※2	20,400,578	21,416,342
期末剰余金又は期末欠損金(△)	71,884,106	△205,924,641

(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 30 年 7 月 11 日	至 平成 31 年 1 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 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) 投資証券 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、株式及び投資証券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 2 期	第 3 期
	平成 30 年 7 月 10 日現在	平成 31 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	2,045,289,960 円	2,142,606,160 円
期中追加設定元本額	97,316,200 円	875,845,800 円
期中一部交換元本額	－円	97,500,816 円
2. 計算期間末日における受益権	1,090,940 口	1,487,246 口

の総数		
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 205,924,641 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 25,077,000 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 22,037,000 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 30 年 1 月 11 日 至 平成 30 年 7 月 10 日	自 平成 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 年 1 月 10 日
1. ※1 その他費用	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。
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 (22,650,942 円) 及び分配準備積立金 (89,617 円) の合計額から、経費 (2,297,470 円) を控除して計算される分配対象額は 20,443,089 円 (100 口当たり 1,873 円) であり、うち 20,400,578 円 (100 口当たり 1,870 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 (23,976,398 円) 及び分配準備積立金 (42,511 円) の合計額から、経費 (2,590,306 円) を控除して計算される分配対象額は 21,428,603 円 (100 口当たり 1,440 円) であり、うち 21,416,342 円 (100 口当たり 1,440 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 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 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3期 平成31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2期 平成30年7月10日現在	第3期 平成31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	△180,169,882	△278,577,284
投資証券	△120,916	766,141
合計	△180,290,798	△277,811,143

(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30年7月10日 現在			第3期 平成31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	7,841,500	－	7,605,000	△236,500	9,380,500	－	9,425,500	45,000
合計	7,841,500	－	7,605,000	△236,500	9,380,500	－	9,425,500	45,000

(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 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 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 2 期 平成 30 年 7 月 10 日現在	第 3 期 平成 31 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)	2,029.89 円 (202,989 円)	1,825.54 円 (182,554 円)

平成31年1月期（平成30年7月11日～平成31年1月10日）決算短信

平成31年2月22日

ファンド名 ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index 上場取引所 東証
 コード番号 1654
 連動対象指標 FTSE Blossom Japan Index
 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 <https://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31年 4月 3日
 分配金支払開始日 平成31年 2月18日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月期の運用状況（平成30年7月11日～平成31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	%
31年 1月期	1,955	(99.8)	3	(0.2)	1,958	(100.0)
30年 7月期	2,115	(99.8)	5	(0.2)	2,120	(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
31年 1月期	1,642	77	—	1,719
30年 7月期	1,642	—	—	1,642

(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
31年 1月期	1,985	26	1,958	11,388.6
30年 7月期	2,147	26	2,120	12,911.6

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
31年 1月期	140
30年 7月期	149

(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30年7月10日現在 金額(円)	平成31年1月10日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	14,311,728	—
コール・ローン	3,834,416	25,600,093
株式 ※3	2,115,428,720	1,955,404,130
未収入金	11,205,328	1,283,612
未収配当金	2,260,800	2,772,650
前払金	527,000	301,000
流動資産合計	2,147,567,992	1,985,361,485
資産合計	2,147,567,992	1,985,361,485
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	133,824	98,216
未払金	380,444	689,024
未払収益分配金	24,472,356	24,077,060
未払受託者報酬	351,433	355,223
未払委託者報酬	1,405,787	1,421,003
その他未払費用	178,997	124,348
流動負債合計	26,922,841	26,764,874
負債合計	26,922,841	26,764,874
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,053,050,000	2,149,737,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	67,595,151	△191,140,889
(分配準備積立金)	101,403	157,699
元本等合計	2,120,645,151	1,958,596,611
純資産合計	2,120,645,151	1,958,596,611
負債純資産合計	2,147,567,992	1,985,361,485

(2) 損益及び剰余金計算書

	第2期	第3期
	自平成30年1月11日 至平成30年7月10日	自平成30年7月11日 至平成31年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	26,426,363	26,109,425
受取利息	22	46
有価証券売買等損益	△238,666,515	△258,166,056
派生商品取引等損益	180,752	△3,513,168
その他収益	8,891	9,406
営業収益合計	△212,050,487	△235,560,347
営業費用		
支払利息	2,016	2,014
受託者報酬	351,433	355,223
委託者報酬	1,405,787	1,421,003
その他費用	194,779	207,281
営業費用合計	1,954,015	1,985,521
営業損失(△)	△214,004,502	△237,545,868
経常損失(△)	△214,004,502	△237,545,868
当期純損失(△)	△214,004,502	△237,545,868
期首剰余金又は期首欠損金(△)	306,072,009	67,595,151
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	2,886,888
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	2,886,888
分配金 ※1	24,472,356	24,077,060
期末剰余金又は期末欠損金(△)	67,595,151	△191,140,889

(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 30 年 7 月 11 日	至 平成 31 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 2 期	第 3 期
	平成 30 年 7 月 10 日現在	平成 31 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	2,053,050,000 円	2,053,050,000 円
期中追加設定元本額	－円	96,687,500 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	1,642,440 口	1,719,790 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 191,140,889 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。	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 7,473,100円	株式 6,831,400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30年1月11日 至 平成30年7月10日	自 平成30年7月11日 至 平成31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(26,433,260円)及び分配準備積立金(92,498円)の合計額から、経費(1,951,999円)を控除して計算される分配対象額は24,573,759円(100口当たり1,496円)であり、うち24,472,356円(100口当たり1,490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(26,116,863円)及び分配準備積立金(101,403円)の合計額から、経費(1,983,507円)を控除して計算される分配対象額は24,234,759円(100口当たり1,409円)であり、うち24,077,060円(100口当たり1,400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30年7月11日 至 平成31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3期 平成31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2期 平成30年7月10日現在	第3期 平成31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	△210,555,004	△233,153,153
合計	△210,555,004	△233,153,153

(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30年7月10日 現在				第3期 平成31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	4,696,500	－	4,563,000	△133,500	2,791,000	－	2,693,000	△98,000

合計	4,696,500	－	4,563,000	△133,500	2,791,000	－	2,693,000	△98,000
----	-----------	---	-----------	----------	-----------	---	-----------	---------

(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30年7月11日 至 平成31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2期 平成30年7月10日現在	第3期 平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,291.16円	1,138.86円
(100口当たり純資産額)	(129,116円)	(113,886円)