

平成 31 年 2 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

平成 31 年 7 月期 中間決算短信（平成 30 年 7 月 11 日～平成 31 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 31 年 7 月期 中間決算短信（平成 30 年 7 月 11 日～平成 31 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－トピックス	1305	東
ダイワ上場投信－トピックス・コア 3 0	1310	東
ダイワ上場投信－日経 2 2 5	1320	東
ダイワ上場投信－東証電気機器株価指数	1610	東
ダイワ上場投信－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31年7月期 中間決算短信（平成30年7月11日～平成31年1月10日）

平成31年2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 <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

半期報告書提出予定日 平成31年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月中間期の運用状況（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月中間期	3,823,072	(99.7)	12,430	(0.3)	3,835,502	(100.0)
30年 7月期	3,707,005	(99.8)	7,236	(0.2)	3,714,241	(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
31年 1月中間期	2,086,595	371,702	52,329	2,405,968

(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
31年 1月中間期	4,698,292	862,790	3,835,502	15,942
30年 7月期	4,234,914	520,672	3,714,241	17,800

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 平成 30 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 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	47,547,348,675	—
コール・ローン	449,441,791,955	868,414,757,243
株式 ※2※3	3,707,005,265,350	3,823,072,149,822
派生商品評価勘定	2,644,600	480,121,540
未収入金	24,513,820,503	—
未収配当金	4,565,344,321	5,638,540,926
未収利息	11,965,061	22,291,170
前払金	1,585,832,700	—
その他未収収益 ※4	240,466,375	664,622,855
流動資産合計	4,234,914,479,540	4,698,292,483,556
資産合計	4,234,914,479,540	4,698,292,483,556
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	73,227,797	177,508,260
前受金	—	421,665,000
未払金	1,447,740,383	—
未払収益分配金	66,979,714,619	—
未払受託者報酬	818,791,573	955,013,857
未払委託者報酬	1,579,719,587	1,799,986,255
受入担保金	449,263,119,795	859,125,339,742
その他未払費用	510,179,229	310,700,301
流動負債合計	520,672,492,983	862,790,213,415
負債合計	520,672,492,983	862,790,213,415
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,608,244,338,750	3,007,460,048,750
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,105,997,647,807	828,042,221,391
（分配準備積立金）	1,384,937	1,384,937
元本等合計	3,714,241,986,557	3,835,502,270,141
純資産合計	3,714,241,986,557	3,835,502,270,141
負債純資産合計	4,234,914,479,540	4,698,292,483,556

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 平成 29 年 7 月 11 日 至 平成 30 年 1 月 10 日	当中間計算期間 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	26,720,865,200	39,468,387,845
受取利息	110,427,261	266,213,126
有価証券売買等損益	474,905,403,133	△458,450,158,367
派生商品取引等損益	3,047,009,960	△4,666,809,040
その他収益 ※1	981,778,388	2,897,898,908
営業収益合計	505,765,483,942	△420,484,467,528
営業費用		
支払利息	60,948,818	182,371,459
受託者報酬	657,452,713	955,013,857
委託者報酬	1,283,568,399	1,799,986,255
その他費用	226,301,603	314,669,115
営業費用合計	2,228,271,533	3,252,040,686
営業利益又は営業損失 (△)	503,537,212,409	△423,736,508,214
経常利益又は経常損失 (△)	503,537,212,409	△423,736,508,214
中間純利益又は中間純損失 (△)	503,537,212,409	△423,736,508,214
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	624,715,028,116	1,105,997,647,807
剰余金増加額又は欠損金減少額	198,643,051,855	171,735,596,588
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	198,643,051,855	171,735,596,588
剰余金減少額又は欠損金増加額	78,497,693,890	25,954,514,790
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	78,497,693,890	25,954,514,790
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	1,248,397,598,490	828,042,221,391

(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 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)新株予約権証券 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 平成 30 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 31 年 1 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	1,847,568,405,000 円 1,024,811,012,500 円 264,135,078,750 円	2,608,244,338,750 円 464,627,625,000 円 65,411,915,000 円

2.	中間計算期間末日における受益権の総数	2, 086, 595, 471 口	2, 405, 968, 039 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 435, 241, 778, 330 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 817, 970, 914, 770 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 4, 723, 490, 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, 200, 160, 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 210, 570, 080 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 623, 506, 552 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 29 年 7 月 11 日 至 平成 30 年 1 月 10 日	自 平成 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 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 613, 668, 674 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 2, 122, 608, 020 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 31 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

	前計算期間末 平成 30 年 7 月 10 日 現在	当中間計算期間末 平成 31 年 1 月 10 日 現在
--	-------------------------------	---------------------------------

種 類	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	7,281,756,400	—	7,211,400,000	△70,356,400	12,126,455,000	—	12,429,510,000	303,055,000
合計	7,281,756,400	—	7,211,400,000	△70,356,400	12,126,455,000	—	12,429,510,000	303,055,000

(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 30 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 31 年 1 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	1,780.0 円	1,594.2 円
(10 口当たり純資産額)	(17,800 円)	(15,942 円)

平成31年7月期 中間決算短信（平成30年7月11日～平成31年1月10日）

平成31年2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 <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

半期報告書提出予定日 平成31年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月中間期の運用状況（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月中間期	1,768	(99.5)	9	(0.5)	1,778	(100.0)
30年 7月期	1,943	(99.7)	5	(0.3)	1,949	(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
31年 1月中間期	2,603	—	—	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
31年 1月中間期	1,780	2	1,778	6,829.4
30年 7月期	2,002	52	1,949	7,485.9

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 平成30年7月10日現在	当中間計算期間末 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	4,797,663	—
コール・ローン	45,349,953	8,834,464
株式 ※3	1,943,942,730	1,768,478,060
派生商品評価勘定	—	237,110
未収入金	3,619,780	—
未収配当金	2,966,800	3,291,900
前払金	1,336,360	—
流動資産合計	2,002,013,286	1,780,841,534
資産合計	2,002,013,286	1,780,841,534
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	38,008	212,472
前受金	—	110,150
未払金	1,217,926	—
未払収益分配金	49,209,457	—
未払受託者報酬	1,098,869	1,050,320
未払委託者報酬	1,318,644	1,260,386
その他未払費用	56,429	52,646
流動負債合計	52,939,333	2,685,974
負債合計	52,939,333	2,685,974
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,103,769,400	2,103,769,400
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△） ※2	△154,695,447	△325,613,840
（分配準備積立金）	32,625	32,625
元本等合計	1,949,073,953	1,778,155,560
純資産合計	1,949,073,953	1,778,155,560
負債純資産合計	2,002,013,286	1,780,841,534

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 平成29年7月11日 至 平成30年1月10日	当中間計算期間 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	24,111,920	27,382,325
有価証券売買等損益	309,150,392	△193,223,752
派生商品取引等損益	3,428,836	△2,708,138
営業収益合計	336,691,148	△168,549,565
営業費用		
支払利息	4,252	4,617
受託者報酬	1,316,942	1,050,320
委託者報酬	1,580,342	1,260,386
その他費用	65,765	53,505
営業費用合計	2,967,301	2,368,828
営業利益又は営業損失（△）	333,723,847	△170,918,393
経常利益又は経常損失（△）	333,723,847	△170,918,393
中間純利益又は中間純損失（△）	333,723,847	△170,918,393
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△331,151,167	△154,695,447
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（△）	99,933,472	△325,613,840

(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 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。	

(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 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 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	3,304,618,192 円 — 円 1,200,848,792 円	2,103,769,400 円 — 円 — 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	2,603,675 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 154,695,447 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 325,613,840 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	14,302,000 円	株式	13,408,000 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29年7月11日 至 平成30年1月10日	自 平成30年7月11日 至 平成31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31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す。
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30年7月10日 現在				当中間計算期間末 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	4,615,360	—	4,578,000	△37,360	9,598,850	—	9,625,000	26,150
合計	4,615,360	—	4,578,000	△37,360	9,598,850	—	9,625,000	26,150

（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 30 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 31 年 1 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	748.59 円	682.94 円
(100 口当たり純資産額)	(74,859 円)	(68,294 円)

平成31年7月期 中間決算短信（平成30年7月11日～平成31年1月10日）

平成31年2月22日

ファンド名 ダイワ上場投信－日経２２５
 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 <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

半期報告書提出予定日 平成31年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月中間期の運用状況（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月中間期	2,474,130	(99.8)	5,339	(0.2)	2,479,470	(100.0)
30年 7月期	2,525,626	(99.8)	5,261	(0.2)	2,530,888	(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
31年 1月中間期	111,851	18,269	10,577	119,543

(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
31年 1月中間期	3,045,663	566,193	2,479,470	20,741
30年 7月期	2,842,718	311,829	2,530,888	22,627

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 平成30年7月10日現在	当中間計算期間末 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	27,315,739,083	—
コール・ローン	258,202,298,639	562,494,830,643
株式 ※2※3	2,525,626,787,500	2,474,130,842,880
交換未引渡株式 ※4	—	4,363,179,040
派生商品評価勘定	—	183,240,000
未収入金	27,516,096,795	1,380,961
未収配当金	3,186,715,000	4,330,405,200
未収利息	7,075,489	15,262,736
前払金	590,032,060	—
その他未収収益 ※5	182,225,856	144,675,398
差入委託証拠金	91,080,000	—
流動資産合計	2,842,718,050,422	3,045,663,816,858
資産合計	2,842,718,050,422	3,045,663,816,858
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	64,021,300	44,574,300
前受金	—	222,511,500
未払金	425,949,480	16,400,160
未払収益分配金	43,510,278,235	—
未払解約金 ※4	—	4,363,179,040
未払受託者報酬	979,160,484	1,044,806,436
未払委託者報酬	1,248,922,980	1,327,000,751
受入担保金	264,939,283,486	558,809,428,021
その他未払費用	661,960,330	365,146,890
流動負債合計	311,829,576,295	566,193,047,098
負債合計	311,829,576,295	566,193,047,098
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,376,557,825,805	1,471,219,491,556
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,154,330,648,322	1,008,251,278,204
（分配準備積立金）	49,654,069	49,654,069
元本等合計	2,530,888,474,127	2,479,470,769,760
純資産合計	2,530,888,474,127	2,479,470,769,760
負債純資産合計	2,842,718,050,422	3,045,663,816,858

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 平成 29 年 7 月 11 日 至 平成 30 年 1 月 10 日	当中間計算期間 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	20,197,477,850	26,177,272,740
受取利息	23,638,039	187,434,523
有価証券売買等損益	410,879,440,087	△248,231,286,727
派生商品取引等損益	2,569,395,820	△1,809,757,060
その他収益 ※1	576,172,370	874,123,836
営業収益合計	434,246,124,166	△222,802,212,688
営業費用		
支払利息	14,505,725	128,103,366
受託者報酬	890,321,347	1,044,806,436
委託者報酬	1,141,728,557	1,327,000,751
その他費用	315,263,785	377,291,895
営業費用合計	2,361,819,414	2,877,202,448
営業利益又は営業損失 (△)	431,884,304,752	△225,679,415,136
経常利益又は経常損失 (△)	431,884,304,752	△225,679,415,136
中間純利益又は中間純損失 (△)	431,884,304,752	△225,679,415,136
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	838,539,051,038	1,154,330,648,322
剰余金増加額又は欠損金減少額	213,911,479,404	189,191,857,267
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	213,911,479,404	189,191,857,267
剰余金減少額又は欠損金増加額	225,732,481,911	109,591,812,249
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	225,732,481,911	109,591,812,249
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	1,258,602,353,283	1,008,251,278,204

(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 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。	

(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 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 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	1,263,804,254,704 円 552,912,909,207 円 440,159,338,106 円	1,376,557,825,805 円 224,843,548,762 円 130,181,883,011 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	111,851,615 口	119,543,308 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 256,143,696,620 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 528,490,494,370 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	3,514,750,000 円	株式	3,457,500,000 円
5. ※4 交換未引渡株式及び未払解約金	—————		平成31年1月8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	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。		貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 131,938,800 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29年7月11日 至 平成30年1月10日	自 平成30年7月11日 至 平成31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 547,843,150 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 700,631,000 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31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30年7月10日 現在				当中間計算期間末 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								

先物取引								
買 建	5,300,733,860	－	5,236,840,000	△63,893,860	5,290,888,500	－	5,429,700,000	138,811,500
合計	5,300,733,860	－	5,236,840,000	△63,893,860	5,290,888,500	－	5,429,700,000	138,811,500

(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 30 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 31 年 1 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	22, 627 円	20, 741 円

平成31年7月期 中間決算短信（平成30年7月11日～平成31年1月10日）

平成31年2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 <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

半期報告書提出予定日 平成31年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月中間期の運用状況（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月中間期	2,022	(98.9)	23	(1.1)	2,045	(100.0)
30年 7月期	2,531	(99.8)	5	(0.2)	2,537	(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
31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
31年 1月中間期	2,049	3	2,045	19,980.5
30年 7月期	2,581	43	2,537	24,788.4

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 平成30年7月10日現在	当中間計算期間末 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	3,779,837	—
コール・ローン	35,728,948	22,380,147
株式 ※2	2,531,886,800	2,022,331,292
派生商品評価勘定	—	214,784
未収入金	3,720,300	—
未収配当金	3,749,830	3,829,300
前払金	1,333,750	581,500
差入委託証拠金	1,080,000	—
流動資産合計	2,581,279,465	2,049,337,023
資産合計	2,581,279,465	2,049,337,023
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	79,574	1,015,404
未払金	1,205,006	—
未払収益分配金	39,207,710	—
未払受託者報酬	1,423,294	1,297,968
未払委託者報酬	1,707,982	1,557,568
その他未払費用	72,350	65,263
流動負債合計	43,695,916	3,936,203
負債合計	43,695,916	3,936,203
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（△）	579,245,449	87,062,720
（分配準備積立金）	56,573	56,573
元本等合計	2,537,583,549	2,045,400,820
純資産合計	2,537,583,549	2,045,400,820
負債純資産合計	2,581,279,465	2,049,337,023

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 平成 29 年 7 月 11 日 至 平成 30 年 1 月 10 日	当中間計算期間 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	18,761,470	23,260,229
有価証券売買等損益	570,705,822	△509,861,790
派生商品取引等損益	2,786,386	△2,655,302
その他収益	39	33
営業収益合計	592,253,717	△489,256,830
営業費用		
支払利息	3,255	4,406
受託者報酬	1,383,369	1,297,968
委託者報酬	1,660,031	1,557,568
その他費用	69,085	65,957
営業費用合計	3,115,740	2,925,899
営業利益又は営業損失 (△)	589,137,977	△492,182,729
経常利益又は経常損失 (△)	589,137,977	△492,182,729
中間純利益又は中間純損失 (△)	589,137,977	△492,182,729
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	333,358,323	579,245,449
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	922,496,300	87,062,720

(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。	

(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	1,958,338,100 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
3. ※2 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 10,492,000 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29年7月11日 至 平成30年1月10日	自 平成30年7月11日 至 平成31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31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30年7月10日 現在				当中間計算期間末 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	5,230,250	—	5,151,000	△79,250	23,591,500	—	22,792,500	△799,000
合計	5,230,250	—	5,151,000	△79,250	23,591,500	—	22,792,500	△799,000

（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 30 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 31 年 1 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	2,478.84 円	1,998.05 円
(100 口当たり純資産額)	(247,884 円)	(199,805 円)

平成31年7月期 中間決算短信（平成30年7月11日～平成31年1月10日）

平成31年2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 <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

半期報告書提出予定日 平成31年4月3日

I ファンドの運用状況

1. 31年1月中間期の運用状況（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月中間期	653	(97.2)	18	(2.8)	671	(100.0)
30年 7月期	729	(97.2)	20	(2.8)	750	(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
31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
31年 1月中間期	673	1	671	14,374
30年 7月期	775	24	750	16,065

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 平成 30 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 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	2,088,534	—
コール・ローン	19,741,889	19,402,442
株式 ※3	729,990,530	653,275,770
未収入金	21,583,429	—
未収配当金	108,000	125,000
前払金	1,728,000	996,000
流動資産合計	775,240,382	673,799,212
資産合計	775,240,382	673,799,212
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,585,296	1,033,296
未払収益分配金	21,780,196	—
未払受託者報酬	450,954	411,935
未払委託者報酬	541,157	494,319
その他未払費用	23,051	20,879
流動負債合計	24,380,654	1,960,429
負債合計	24,380,654	1,960,429
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	△207,281,982	△286,302,927
（分配準備積立金）	35,884	35,884
元本等合計	750,859,728	671,838,783
純資産合計	750,859,728	671,838,783
負債純資産合計	775,240,382	673,799,212

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 平成 29 年 7 月 11 日 至 平成 30 年 1 月 10 日	当中間計算期間 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	11, 282, 425	12, 085, 450
受取利息	—	2
有価証券売買等損益	107, 703, 175	△87, 958, 141
派生商品取引等損益	3, 162, 816	△2, 213, 184
その他収益	23	19
営業収益合計	122, 148, 439	△78, 085, 854
営業費用		
支払利息	6, 112	7, 095
受託者報酬	453, 548	411, 935
委託者報酬	544, 246	494, 319
その他費用	22, 607	21, 742
営業費用合計	1, 026, 513	935, 091
営業利益又は営業損失 (△)	121, 121, 926	△79, 020, 945
経常利益又は経常損失 (△)	121, 121, 926	△79, 020, 945
中間純利益又は中間純損失 (△)	121, 121, 926	△79, 020, 945
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△122, 770, 423	△207, 281, 982
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△1, 648, 497	△286, 302, 927

(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 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。	

(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 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 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	958, 141, 710 円 －円 －円	958, 141, 710 円 －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 207, 281, 982 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 286, 302, 927 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	5,329,000 円	株式	4,718,500 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 29 年 7 月 11 日 至 平成 30 年 1 月 10 日	自 平成 30 年 7 月 11 日 至 平成 31 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 31 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 30 年 7 月 10 日 現在				当中間計算期間末 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	22,200,000	—	20,616,000	△1,584,000	19,224,000	—	18,192,000	△1,032,000
合計	22,200,000	—	20,616,000	△1,584,000	19,224,000	—	18,192,000	△1,032,000

（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 30 年 7 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 31 年 1 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	160.65 円	143.74 円
(100 口当たり純資産額)	(16,065 円)	(14,374 円)