

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 30 年 7 月期（平成 30 年 1 月 21 日～平成 30 年 7 月 20 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 30 年 1 月 21 日～平成 30 年 7 月 20 日）決算短信をご報告します。

## 記

## 上場ETF銘柄（17銘柄）

銘柄名	銘柄コード	上場取引所
ダイワ上場投信・TOPIX-17 食品	1634	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 エネルギー資源	1635	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 建設・資材	1636	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 素材・化学	1637	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 医薬品	1638	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 自動車・輸送機	1639	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 鉄鋼・非鉄	1640	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 機械	1641	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 電機・精密	1642	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 情報通信・サービスその他	1643	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 電力・ガス	1644	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 運輸・物流	1645	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 商社・卸売	1646	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 小売	1647	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 銀行	1648	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 金融（除く銀行）	1649	東
ダイワ上場投信・TOPIX-17 不動産	1650	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30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 食品 上場取引所 東証  
 コード番号 1634  
 連動対象指標 TOPIX-17 食品  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	654	(99.3)	4	(0.7)	659	(100.0)
30年 1月期	689	(100.0)	△0	(△0.0)	689	(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	19	—	—	19
30年 1月期	19	—	—	19

#### (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	666	7	659	33,861
30年 1月期	699	9	689	35,432

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	322
30年 1月期	448

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	2,362,467
コール・ローン	2,949,300	5,234,744
株式 ※2	689,691,200	654,202,600
派生商品評価勘定	—	36,034
未収入金	2,396,715	—
未収配当金	4,263,750	4,362,400
前払金	—	50,750
流動資産合計	699,300,965	666,248,995
資産合計	699,300,965	666,248,995
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	28,608
前受金	199,900	—
未払金	—	97,648
未払収益分配金	8,719,424	6,267,086
未払受託者報酬	183,459	176,655
未払委託者報酬	477,096	459,378
未払利息	4	—
その他未払費用	101,694	182,292
流動負債合計	9,681,577	7,211,667
負債合計	9,681,577	7,211,667
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	329,119,330	329,119,330
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	360,500,058	329,917,998
(分配準備積立金)	19,124	3,592
元本等合計	689,619,388	659,037,328
純資産合計	689,619,388	659,037,328
負債純資産合計	699,300,965	666,248,995

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,647,850	6,987,880
有価証券売買等損益	36,461,327	△30,645,810
派生商品取引等損益	750,730	79,282
その他収益	227	105
営業収益合計	42,860,134	△23,578,543
営業費用		
支払利息	1,166	1,297
受託者報酬	183,459	176,655
委託者報酬	477,096	459,378
その他費用	102,584	99,101
営業費用合計	764,305	736,431
営業利益又は営業損失(△)	42,095,829	△24,314,974
経常利益又は経常損失(△)	42,095,829	△24,314,974
当期純利益又は当期純損失(△)	42,095,829	△24,314,974
期首剰余金又は期首欠損金(△)	327,123,653	360,500,058
分配金	※1 8,719,424	6,267,086
期末剰余金又は期末欠損金(△)	360,500,058	329,917,998

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	329,119,330 円	329,119,330 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	19,463 口	19,463 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 49,775,000 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 45,020,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>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 （5,646,911円）及び分配準備積立金（3,854,776円）の合計額から、経費（763,139円）を控除して計算される分配対象額は8,738,548円（1口当たり448円）であり、うち8,719,424円（1口当たり448円）を分配金額としております。</p>	<p>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 （6,986,688円）及び分配準備積立金（19,124円）の合計額から、経費（735,134円）を控除して計算される分配対象額は6,270,678円（1口当たり322円）であり、うち6,267,086円（1口当たり322円）を分配金額としております。</p>

（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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	36,245,403	△30,590,565
合計	36,245,403	△30,590,565

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	—	—	—	—	5,234,750	—	5,242,500	7,750
合計	—	—	—	—	5,234,750	—	5,242,500	7,750

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	35,432円	33,861円



# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 エネルギー資源 上場取引所 東証  
 コード番号 1635  
 連動対象指標 TOPIX-17 エネルギー資源  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	435	(99.5)	2	(0.5)	437	(100.0)
30年 1月期	347	(99.4)	1	(0.6)	349	(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	19	5	—	25
30年 1月期	19	—	—	19

#### (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	441	3	437	17,402
30年 1月期	352	3	349	18,191

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	131
30年 1月期	151

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	1,704,036
コール・ローン	2,187,968	3,775,793
株式 ※3	347,158,000	435,535,040
派生商品評価勘定	112,242	—
未収入金	2,766,245	—
未収配当金	243,900	350,700
前払金	—	65,250
流動資産合計	352,468,355	441,430,819
資産合計	352,468,355	441,430,819
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	26,358
前受金	100,850	—
未払金	—	60,932
未払収益分配金	2,898,294	3,294,519
未払受託者報酬	75,782	88,221
未払委託者報酬	197,094	229,457
未払利息	3	—
その他未払費用	41,969	83,800
流動負債合計	3,313,992	3,783,287
負債合計	3,313,992	3,783,287
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	340,904,634	446,671,389
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	8,249,729	△9,023,857
(分配準備積立金)	9,231	23,493
元本等合計	349,154,363	437,647,532
純資産合計	349,154,363	437,647,532
負債純資産合計	352,468,355	441,430,819

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,969,000	3,676,600
有価証券売買等損益	114,300,822	△6,533,797
派生商品取引等損益	513,986	△29,096
その他収益	2	—
営業収益合計	117,783,810	△2,886,293
営業費用		
支払利息	516	740
受託者報酬	75,782	88,221
委託者報酬	197,094	229,457
その他費用	42,286	49,401
営業費用合計	315,678	367,819
営業利益又は営業損失(△)	117,468,132	△3,254,112
経常利益又は経常損失(△)	117,468,132	△3,254,112
当期純利益又は当期純損失(△)	117,468,132	△3,254,112
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△106,320,109	8,249,729
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	10,724,955
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	10,724,955
分配金 ※1	2,898,294	3,294,519
期末剰余金又は期末欠損金(△)	8,249,729	△9,023,857

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	340,904,634 円	340,904,634 円
期中追加設定元本額	— 円	105,766,755 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	19,194 口	25,149 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9,023,857 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 15,189,000 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 13,821,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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（2,968,486円）及び分配準備積立金（254,201円）の合計額から、経費（315,162円）を控除して計算される分配対象額は2,907,525円（1口当たり151円）であり、うち2,898,294円（1口当たり151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（3,675,860円）及び分配準備積立金（9,231円）の合計額から、経費（367,079円）を控除して計算される分配対象額は3,318,012円（1口当たり131円）であり、うち3,294,519円（1口当たり131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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	112,626,187	△5,020,590
合計	112,626,187	△5,020,590

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	1,777,650	—	1,890,000	112,350	1,773,750	—	1,747,500	△26,250
合計	1,777,650	—	1,890,000	112,350	1,773,750	—	1,747,500	△26,250

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	18,191円	17,402円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 建設・資材 上場取引所 東証  
 コード番号 1636  
 連動対象指標 TOPIX-17 建設・資材  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	1,464	(99.9)	1	(0.1)	1,466	(100.0)
30年 1月期	1,640	(99.0)	15	(1.0)	1,656	(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	53	—	—	53
30年 1月期	53	—	—	53

#### (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	1,487	21	1,466	27,627
30年 1月期	1,672	15	1,656	31,216

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	363
30年 1月期	244

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	6,573,476
コール・ローン	28,906,337	14,565,475
株式 ※2	1,640,733,200	1,464,409,000
派生商品評価勘定	1,009,136	—
未収入金	380,352	—
未収配当金	1,500,450	1,817,650
前払金	—	225,600
流動資産合計	1,672,529,475	1,487,591,201
資産合計	1,672,529,475	1,487,591,201
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	23,408
前受金	1,262,250	—
未払金	—	297,926
未払収益分配金	12,948,836	19,264,047
未払受託者報酬	416,574	403,843
未払委託者報酬	1,083,153	1,050,084
未払利息	39	—
その他未払費用	231,163	415,882
流動負債合計	15,942,015	21,455,190
負債合計	15,942,015	21,455,190
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	746,362,416	746,362,416
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	910,225,044	719,773,595
(分配準備積立金)	23,857	26,931
元本等合計	1,656,587,460	1,466,136,011
純資産合計	1,656,587,460	1,466,136,011
負債純資産合計	1,672,529,475	1,487,591,201

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	13,344,900	20,951,300
有価証券売買等損益	219,414,075	△189,624,383
派生商品取引等損益	2,865,572	△830,140
その他収益	185	66
営業収益合計	235,624,732	△169,503,157
営業費用		
支払利息	5,116	3,702
受託者報酬	416,574	403,843
委託者報酬	1,083,153	1,050,084
その他費用	233,112	226,616
営業費用合計	1,737,955	1,684,245
営業利益又は営業損失(△)	233,886,777	△171,187,402
経常利益又は経常損失(△)	233,886,777	△171,187,402
当期純利益又は当期純損失(△)	233,886,777	△171,187,402
期首剰余金又は期首欠損金(△)	689,287,103	910,225,044
分配金	※1 12,948,836	19,264,047
期末剰余金又は期末欠損金(△)	910,225,044	719,773,595

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	746,362,416 円	746,362,416 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	53,069 口	53,069 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 19,989,000 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 17,614,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>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 （13,339,969円）及び分配準備積立金（1,365,563円）の合計額から、経費（1,732,839円）を控除して計算される分配対象額は12,972,693円（1口当たり244円）であり、うち12,948,836円（1口当たり244円）を分配金額としております。</p>	<p>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 （20,947,664円）及び分配準備積立金（23,857円）の合計額から、経費（1,680,543円）を控除して計算される分配対象額は19,290,978円（1口当たり363円）であり、うち19,264,047円（1口当たり363円）を分配金額としております。</p>

（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20期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	217,731,545	△189,170,531
合計	217,731,545	△189,170,531

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	14,110,000	—	15,120,000	1,010,000	1,770,800	—	1,747,500	△23,300
合計	14,110,000	—	15,120,000	1,010,000	1,770,800	—	1,747,500	△23,300

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	31,216円	27,627円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 素材・化学 上場取引所 東証  
 コード番号 1637  
 連動対象指標 TOPIX-17 素材・化学  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	1,020	(99.5)	5	(0.5)	1,025	(100.0)
30年 1月期	1,078	(99.4)	6	(0.6)	1,084	(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	37	—	—	37
30年 1月期	37	—	—	37

#### (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	1,035	9	1,025	27,640
30年 1月期	1,094	10	1,084	29,215

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	223
30年 1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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	4,129,895
コール・ローン	13,441,164	9,151,001
株式 ※2	1,078,125,550	1,020,161,740
派生商品評価勘定	278,676	17,142
未収入金	430,886	—
未収配当金	1,901,300	1,860,500
前払金	—	137,500
流動資産合計	1,094,177,576	1,035,457,778
資産合計	1,094,177,576	1,035,457,778
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	54,716
前受金	626,500	—
未払金	—	155,330
未払収益分配金	8,275,307	8,275,307
未払受託者報酬	272,316	275,964
未払委託者報酬	708,087	717,577
未払利息	18	—
その他未払費用	151,041	278,464
流動負債合計	10,033,269	9,757,358
負債合計	10,033,269	9,757,358
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	495,739,131	495,739,131
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	588,405,176	529,961,289
(分配準備積立金)	10,706	963
元本等合計	1,084,144,307	1,025,700,420
純資産合計	1,084,144,307	1,025,700,420
負債純資産合計	1,094,177,576	1,035,457,778



(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	7,905,990	9,416,190
有価証券売買等損益	138,518,199	△58,274,104
派生商品取引等損益	1,593,992	△160,040
その他収益	56	25
営業収益合計	148,018,237	△49,017,929
営業費用		
支払利息	2,239	2,213
受託者報酬	272,316	275,964
委託者報酬	708,087	717,577
その他費用	152,327	154,897
営業費用合計	1,134,969	1,150,651
営業利益又は営業損失(△)	146,883,268	△50,168,580
経常利益又は経常損失(△)	146,883,268	△50,168,580
当期純利益又は当期純損失(△)	146,883,268	△50,168,580
期首剰余金又は期首欠損金(△)	449,797,215	588,405,176
分配金 ※1	8,275,307	8,275,307
期末剰余金又は期末欠損金(△)	588,405,176	529,961,289

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	495,739,131円	495,739,131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	37,109口	37,109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 16,276,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 15,792,500円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>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（7,903,807円）及び分配準備積立金（1,514,936円）の合計額から、経費（1,132,730円）を控除して計算される分配対象額は8,286,013円（1口当たり223円）であり、うち8,275,307円（1口当たり223円）を分配金額としております。</p>	<p>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（9,414,002円）及び分配準備積立金（10,706円）の合計額から、経費（1,148,438円）を控除して計算される分配対象額は8,276,270円（1口当たり223円）であり、うち8,275,307円（1口当たり223円）を分配金額としております。</p>

（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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	136,927,586	△57,986,409
合計	136,927,586	△57,986,409

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	5,391,000	—	5,670,000	279,000	5,279,750	—	5,242,500	△37,250
合計	5,391,000	—	5,670,000	279,000	5,279,750	—	5,242,500	△37,250

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	29,215円	27,640円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 医薬品 上場取引所 東証  
 コード番号 1638  
 連動対象指標 TOPIX-17 医薬品  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	673	(99.5)	3	(0.5)	676	(100.0)
30年 1月期	623	(99.1)	5	(0.9)	628	(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	28	—	—	28
30年 1月期	28	—	—	28

#### (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	683	6	676	23,966
30年 1月期	636	7	628	22,266

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	202
30年 1月期	230

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	2,793,415
コール・ローン	11,696,764	6,189,636
株式 ※2	623,340,600	673,424,500
派生商品評価勘定	378,426	—
未収入金	253,568	—
未収配当金	827,000	856,300
前払金	—	93,750
流動資産合計	636,496,358	683,357,601
資産合計	636,496,358	683,357,601
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	46,716
前受金	573,750	—
未払金	—	80,898
未払収益分配金	6,494,740	5,704,076
未払受託者報酬	164,210	171,044
未払委託者報酬	426,986	444,785
未払利息	16	—
その他未払費用	91,021	170,420
流動負債合計	7,750,723	6,617,939
負債合計	7,750,723	6,617,939
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	371,160,272	371,160,272
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	257,585,363	305,579,390
(分配準備積立金)	28,162	9,429
元本等合計	628,745,635	676,739,662
純資産合計	628,745,635	676,739,662
負債純資産合計	636,496,358	683,357,601

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,336,450	6,399,050
有価証券売買等損益	49,146,951	48,256,844
派生商品取引等損益	1,296,690	△244,084
営業収益合計	56,780,091	54,411,810
営業費用		
支払利息	2,076	1,889
受託者報酬	164,210	171,044
委託者報酬	426,986	444,785
その他費用	91,807	95,989
営業費用合計	685,079	713,707
営業利益	56,095,012	53,698,103
経常利益	56,095,012	53,698,103
当期純利益	56,095,012	53,698,103
期首剰余金又は期首欠損金(△)	207,985,091	257,585,363
分配金 ※1	6,494,740	5,704,076
期末剰余金又は期末欠損金(△)	257,585,363	305,579,390



(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	371,160,272 円	371,160,272 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	28,238 口	28,238 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 17,082,500 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 14,881,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>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（6,334,374円）及び分配準備積立金（871,531円）の合計額から、経費（683,003円）を控除して計算される分配対象額は6,522,902円（1口当たり230円）であり、うち6,494,740円（1口当たり230円）を分配金額としております。</p>	<p>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（6,397,161円）及び分配準備積立金（28,162円）の合計額から、経費（711,818円）を控除して計算される分配対象額は5,713,505円（1口当たり202円）であり、うち5,704,076円（1口当たり202円）を分配金額としております。</p>

（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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	48,199,228	47,709,125
合計	48,199,228	47,709,125

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	5,291,250	—	5,670,000	378,750	3,541,500	—	3,495,000	△46,500
合計	5,291,250	—	5,670,000	378,750	3,541,500	—	3,495,000	△46,500

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	22,266円	23,966円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 自動車・輸送機 上場取引所 東証  
 コード番号 1639  
 連動対象指標 TOPIX-17 自動車・輸送機  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	755	(99.6)	2	(0.4)	757	(100.0)
30年 1月期	849	(99.7)	2	(0.3)	852	(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	33	—	—	33
30年 1月期	33	—	—	33

#### (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	769	11	757	22,770
30年 1月期	865	12	852	25,622

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	325
30年 1月期	335

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	3,874,097
コール・ローン	12,927,205	8,584,204
株式 ※2	849,895,850	755,174,050
派生商品評価勘定	114,176	32,104
未収入金	549,432	—
未収配当金	1,958,550	2,108,250
流動資産合計	865,445,213	769,772,705
資産合計	865,445,213	769,772,705
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	1,608
前受金	584,000	18,320
未払金	—	73,724
未払収益分配金	11,150,475	10,817,625
未払受託者報酬	210,848	208,874
未払委託者報酬	548,249	543,102
未払利息	17	—
その他未払費用	116,935	212,905
流動負債合計	12,610,524	11,876,158
負債合計	12,610,524	11,876,158
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	494,781,525	494,781,525
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	358,053,164	263,115,022
(分配準備積立金)	1,529	18,941
元本等合計	852,834,689	757,896,547
純資産合計	852,834,689	757,896,547
負債純資産合計	865,445,213	769,772,705

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	10,139,450	11,706,033
有価証券売買等損益	135,768,423	△94,891,722
派生商品取引等損益	1,517,652	△63,832
その他収益	10	—
営業収益合計	147,425,535	△83,249,521
営業費用		
支払利息	1,874	1,735
受託者報酬	210,848	208,874
委託者報酬	548,249	543,102
その他費用	117,908	117,285
営業費用合計	878,879	870,996
営業利益又は営業損失(△)	146,546,656	△84,120,517
経常利益又は経常損失(△)	146,546,656	△84,120,517
当期純利益又は当期純損失(△)	146,546,656	△84,120,517
期首剰余金又は期首欠損金(△)	222,656,983	358,053,164
分配金 ※1	11,150,475	10,817,625
期末剰余金又は期末欠損金(△)	358,053,164	263,115,022

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	494,781,525 円	494,781,525 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	33,285 口	33,285 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 15,478,000 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 14,880,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日



<p>※1 分配金の計算過程</p>	<p>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（10,137,586円）及び分配準備積立金（1,891,423円）の合計額から、経費（877,005円）を控除して計算される分配対象額は11,152,004円（1口当たり335円）であり、うち11,150,475円（1口当たり335円）を分配金額としております。</p>	<p>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（11,704,298円）及び分配準備積立金（1,529円）の合計額から、経費（869,261円）を控除して計算される分配対象額は10,836,566円（1口当たり325円）であり、うち10,817,625円（1口当たり325円）を分配金額としております。</p>
--------------------	--	--

（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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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20期 平成30年7月20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) 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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20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	134,735,732	△94,488,354
合計	134,735,732	△94,488,354

(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19期 平成30年1月20日 現在				第20期 平成30年7月20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	2,446,000	—	2,560,500	114,500	2,307,680	—	2,338,500	30,820
合計	2,446,000	—	2,560,500	114,500	2,307,680	—	2,338,500	30,820

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	25,622円	22,770円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 鉄鋼・非鉄 上場取引所 東証  
 コード番号 1640  
 連動対象指標 TOPIX-17 鉄鋼・非鉄  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	223	(99.3)	1	(0.7)	225	(100.0)
30年 1月期	291	(99.8)	0	(0.2)	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	10	—	—	10
30年 1月期	10	—	—	10

#### (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	229	4	225	20,869
30年 1月期	294	2	291	27,026

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	342
30年 1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 19 期	第 20 期
	平成 30 年 1 月 20 日現在	平成 30 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	1,741,200
コール・ローン	2,890,855	3,858,143
株式 ※3	291,396,650	223,883,150
派生商品評価勘定	—	56,392
未収入金	106,684	—
未収配当金	17,000	16,800
流動資産合計	294,411,189	229,555,685
資産合計	294,411,189	229,555,685
負債の部		
流動負債		
前受金	94,900	13,000
未払金	—	65,432
未払収益分配金	2,020,348	3,694,968
未払受託者報酬	73,134	67,356
未払委託者報酬	190,219	175,202
未払利息	3	—
その他未払費用	40,442	70,843
流動負債合計	2,419,046	4,086,801
負債合計	2,419,046	4,086,801
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	369,961,372	369,961,372
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	△77,969,229	△144,492,488
(分配準備積立金)	5,917	2,275
元本等合計	291,992,143	225,468,884
純資産合計	291,992,143	225,468,884
負債純資産合計	294,411,189	229,555,685

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 19 期	第 20 期
	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,319,900	3,972,000
有価証券売買等損益	40,614,160	△66,673,645
派生商品取引等損益	232,968	154,028
その他収益	15	7
営業収益合計	43,167,043	△62,547,610
営業費用		
支払利息	382	467
受託者報酬	73,134	67,356
委託者報酬	190,219	175,202
その他費用	40,781	37,656
営業費用合計	304,516	280,681
営業利益又は営業損失 (△)	42,862,527	△62,828,291
経常利益又は経常損失 (△)	42,862,527	△62,828,291
当期純利益又は当期純損失 (△)	42,862,527	△62,828,291
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△118,811,408	△77,969,229
分配金 ※1	2,020,348	3,694,968
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△77,969,229	△144,492,488

(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 20 期	
	自 平成 30 年 1 月 21 日	至 平成 30 年 7 月 20 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 19 期	第 20 期
	平成 30 年 1 月 20 日現在	平成 30 年 7 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	369,961,372 円	369,961,372 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	10,804 口	10,804 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 77,969,229 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 144,492,488 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 20,436,500 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 15,673,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 19 期	第 20 期
	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 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 (2,319,533 円) 及び分配準備積立金(10,866 円)の合計額から、経費(304,134 円)を控除して計算される分配対象額は 2,026,265 円 (1 口当たり 187 円) であり、うち 2,020,348 円 (1 口当たり 187 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 (3,971,540 円) 及び分配準備積立金(5,917 円)の合計額から、経費(280,214 円)を控除して計算される分配対象額は 3,697,243 円 (1 口当たり 342 円) であり、うち 3,694,968 円 (1 口当たり 342 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 20 期 自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 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20期 平成30年7月20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
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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20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	40,011,930	△66,904,716
合計	40,011,930	△66,904,716

(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19期 平成30年1月20日 現在				第20期 平成30年7月20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	—	—	—	—	1,691,000	—	1,747,500	56,500
合計	—	—	—	—	1,691,000	—	1,747,500	56,500

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	27,026円	20,869円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 機械 上場取引所 東証  
 コード番号 1641  
 連動対象指標 TOPIX-17 機械  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	695	(99.7)	1	(0.3)	697	(100.0)
30年 1月期	874	(100.5)	△4	(△0.5)	870	(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	19	—	—	19
30年 1月期	19	—	—	19

#### (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	704	7	697	36,620
30年 1月期	877	6	870	45,735

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	336
30年 1月期	314

(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 19 期	第 20 期
	平成 30 年 1 月 20 日現在	平成 30 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	2,207,689
コール・ローン	1,541,075	4,891,787
株式 ※2	874,729,100	695,136,500
未収入金	—	1,218,827
未収配当金	1,172,700	995,050
前払金	—	75,200
流動資産合計	877,442,875	704,525,053
資産合計	877,442,875	704,525,053
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	23,408
未払金	—	80,548
未払収益分配金	5,977,304	6,396,096
未払受託者報酬	203,655	201,963
未払委託者報酬	529,579	525,217
未払利息	2	—
その他未払費用	112,955	205,727
流動負債合計	6,823,495	7,432,959
負債合計	6,823,495	7,432,959
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	432,060,092	432,060,092
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	438,559,288	265,032,002
(分配準備積立金)	14,182	12,983
元本等合計	870,619,380	697,092,094
純資産合計	870,619,380	697,092,094
負債純資産合計	877,442,875	704,525,053

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	6,200,200	7,235,990
有価証券売買等損益	190,360,251	△173,641,601
派生商品取引等損益	313,636	115,514
その他収益	78	61
営業収益合計	196,874,165	△166,290,036
営業費用		
支払利息	637	828
受託者報酬	203,655	201,963
委託者報酬	529,579	525,217
その他費用	113,885	113,146
営業費用合計	847,756	841,154
営業利益又は営業損失(△)	196,026,409	△167,131,190
経常利益又は経常損失(△)	196,026,409	△167,131,190
当期純利益又は当期純損失(△)	196,026,409	△167,131,190
期首剰余金又は期首欠損金(△)	248,510,183	438,559,288
分配金 ※1	5,977,304	6,396,096
期末剰余金又は期末欠損金(△)	438,559,288	265,032,002

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	432,060,092 円	432,060,092 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	19,036 口	19,036 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 1,734,800 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 1,271,600 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>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 （6,199,641円）及び分配準備積立金（638,964円）の合計額から、経費（847,119円）を控除して計算される分配対象額は 5,991,486円（1口当たり314円）であり、うち5,977,304円（1口当たり314円）を分配金額としております。</p>	<p>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 （7,235,223円）及び分配準備積立金（14,182円）の合計額から、経費（840,326円）を控除して計算される分配対象額は 6,409,079円（1口当たり336円）であり、うち6,396,096円（1口当たり336円）を分配金額としております。</p>

（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20期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	188,698,683	△173,085,269
合計	188,698,683	△173,085,269

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	—	—	—	—	1,770,800	—	1,747,500	△23,300
合計	—	—	—	—	1,770,800	—	1,747,500	△23,300

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	45,735円	36,620円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 電機・精密 上場取引所 東証  
 コード番号 1642  
 連動対象指標 TOPIX-17 電機・精密  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	1,845	(99.8)	3	(0.2)	1,848	(100.0)
30年 1月期	2,078	(99.8)	4	(0.2)	2,082	(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	95	—	—	95
30年 1月期	95	—	—	95

#### (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	1,865	16	1,848	19,440
30年 1月期	2,098	15	2,082	21,903

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	151
30年 1月期	137

(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 19 期	第 20 期
	平成 30 年 1 月 20 日現在	平成 30 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	5,292,475
コール・ローン	16,783,874	11,727,040
株式 ※2	2,078,585,200	1,845,032,300
派生商品評価勘定	175,884	18,142
未収入金	773,188	874,783
未収配当金	2,501,000	2,420,830
前払金	—	173,000
流動資産合計	2,098,819,146	1,865,538,570
資産合計	2,098,819,146	1,865,538,570
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	26,358
前受金	860,800	—
未払金	—	242,978
未払収益分配金	13,027,878	14,359,194
未払受託者報酬	501,563	505,149
未払委託者報酬	1,304,130	1,313,473
未払利息	23	—
その他未払費用	278,422	511,295
流動負債合計	15,972,816	16,958,447
負債合計	15,972,816	16,958,447
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,287,097,290	1,287,097,290
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	795,749,040	561,482,833
(分配準備積立金)	11,818	21,730
元本等合計	2,082,846,330	1,848,580,123
純資産合計	2,082,846,330	1,848,580,123
負債純資産合計	2,098,819,146	1,865,538,570

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	12,940,355	16,473,480
有価証券売買等損益	392,341,488	△234,358,335
派生商品取引等損益	2,045,912	82,216
その他収益	20	11
営業収益合計	407,327,775	△217,802,628
営業費用		
支払利息	2,477	2,453
受託者報酬	501,563	505,149
委託者報酬	1,304,130	1,313,473
その他費用	280,731	283,310
営業費用合計	2,088,901	2,104,385
営業利益又は営業損失(△)	405,238,874	△219,907,013
経常利益又は経常損失(△)	405,238,874	△219,907,013
当期純利益又は当期純損失(△)	405,238,874	△219,907,013
期首剰余金又は期首欠損金(△)	403,538,044	795,749,040
分配金 ※1	13,027,878	14,359,194
期末剰余金又は期末欠損金(△)	795,749,040	561,482,833

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	1,287,097,290円	1,287,097,290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	95,094口	95,094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 29,220,000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 26,261,000円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日

<p>※1 分配金の計算過程</p>	<p>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（12,937,898円）及び分配準備積立金（2,188,222円）の合計額から、経費（2,086,424円）を控除して計算される分配対象額は13,039,696円（1口当たり137円）であり、うち13,027,878円（1口当たり137円）を分配金額としております。</p>	<p>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（16,471,038円）及び分配準備積立金（11,818円）の合計額から、経費（2,101,932円）を控除して計算される分配対象額は14,380,924円（1口当たり151円）であり、うち14,359,194円（1口当たり151円）を分配金額としております。</p>
--------------------	--	---

（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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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20期 平成30年7月20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) 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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20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	391,603,899	△233,983,997
合計	391,603,899	△233,983,997

(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19期 平成30年1月20日 現在				第20期 平成30年7月20日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)				(円)			
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	3,603,900	—	3,780,000	176,100	3,503,000	—	3,495,000	△8,000
合計	3,603,900	—	3,780,000	176,100	3,503,000	—	3,495,000	△8,000

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	21,903円	19,440円



# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 情報通信・サービスその他 上場取引所 東証  
 コード番号 1643  
 連動対象指標 TOPIX-17 情報通信・サービスその他  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	739	(99.6)	3	(0.4)	742	(100.0)
30年 1月期	733	(99.8)	1	(0.2)	734	(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	32	—	—	32
30年 1月期	32	—	—	32

#### (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	749	6	742	23,000
30年 1月期	740	6	734	22,771

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	185
30年 1月期	163

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	2,174,035
コール・ローン	1,475,576	4,817,215
株式 ※2	733,398,080	739,071,900
未収入金	5,200,692	2,516,495
未収配当金	694,739	383,047
前払金	—	55,500
流動資産合計	740,769,087	749,018,192
資産合計	740,769,087	749,018,192
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	23,108
未払金	—	53,432
未払収益分配金	5,259,195	5,969,025
未払受託者報酬	191,936	192,803
未払委託者報酬	499,093	501,353
未払利息	2	—
その他未払費用	106,415	195,209
流動負債合計	6,056,641	6,934,930
負債合計	6,056,641	6,934,930
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	372,015,450	372,015,450
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	362,696,996	370,067,812
(分配準備積立金)	23,211	1,494
元本等合計	734,712,446	742,083,262
純資産合計	734,712,446	742,083,262
負債純資産合計	740,769,087	749,018,192

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,746,417	6,749,986
有価証券売買等損益	57,148,944	7,252,721
派生商品取引等損益	313,636	139,812
その他収益	164	108
営業収益合計	63,209,161	14,142,627
営業費用		
支払利息	706	645
受託者報酬	191,936	192,803
委託者報酬	499,093	501,353
その他費用	107,335	107,985
営業費用合計	799,070	802,786
営業利益	62,410,091	13,339,841
経常利益	62,410,091	13,339,841
当期純利益	62,410,091	13,339,841
期首剰余金又は期首欠損金(△)	305,546,100	362,696,996
分配金 ※1	5,259,195	5,969,025
期末剰余金又は期末欠損金(△)	362,696,996	370,067,812

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	372,015,450 円	372,015,450 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	32,265 口	32,265 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 1,962,000 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 2,008,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>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                      (5,745,875円)及び分配準備積立金(334,895円)の合計額から、経費(798,364円)を控除して計算される分配対象額は                      5,282,406円(1口当たり163円)であり、うち5,259,195円(1口当たり163円)を分配金額としております。</p>	<p>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                      (6,749,449円)及び分配準備積立金(23,211円)の合計額から、経費(802,141円)を控除して計算される分配対象額は                      5,970,519円(1口当たり185円)であり、うち5,969,025円(1口当たり185円)を分配金額としております。</p>

（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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期 平成30年7月20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
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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20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	55,547,266	6,838,832
合計	55,547,266	6,838,832

(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19期 平成30年1月20日 現在				第20期 平成30年7月20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	—	—	—	—	1,770,500	—	1,747,500	△23,000
合計	—	—	—	—	1,770,500	—	1,747,500	△23,000

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	22,771円	23,000円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 電力・ガス 上場取引所 東証  
 コード番号 1644  
 連動対象指標 TOPIX-17 電力・ガス  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	255	(99.1)	2	(0.9)	257	(100.0)
30年 1月期	230	(99.0)	2	(1.0)	232	(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	32	—	—	32
30年 1月期	32	—	—	32

#### (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	260	2	257	7,937
30年 1月期	235	2	232	7,163

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	69
30年 1月期	61

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	1,378,562
コール・ローン	4,574,808	3,054,611
株式 ※3	230,174,250	255,256,800
派生商品評価勘定	126,142	—
未収入金	125,534	509,777
未収配当金	11,900	15,150
前払金	—	37,000
流動資産合計	235,012,634	260,251,900
資産合計	235,012,634	260,251,900
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	23,108
前受金	229,500	—
未払金	—	26,716
未払収益分配金	1,980,365	2,240,085
未払受託者報酬	65,461	65,196
未払委託者報酬	170,283	169,597
未払利息	6	—
その他未払費用	36,168	66,126
流動負債合計	2,481,783	2,590,828
負債合計	2,481,783	2,590,828
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	409,773,230	409,773,230
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△177,242,379	△152,112,158
(分配準備積立金)	8,130	20,263
元本等合計	232,530,851	257,661,072
純資産合計	232,530,851	257,661,072
負債純資産合計	235,012,634	260,251,900

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 19 期	第 20 期
	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,245,400	2,524,200
有価証券売買等損益	△11,580,237	25,196,152
派生商品取引等損益	509,336	△78,064
営業収益合計	△8,825,501	27,642,288
営業費用		
支払利息	718	712
受託者報酬	65,461	65,196
委託者報酬	170,283	169,597
その他費用	36,498	36,477
営業費用合計	272,960	271,982
営業利益又は営業損失 (△)	△9,098,461	27,370,306
経常利益又は経常損失 (△)	△9,098,461	27,370,306
当期純利益又は当期純損失 (△)	△9,098,461	27,370,306
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△166,163,553	△177,242,379
分配金 ※1	1,980,365	2,240,085
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△177,242,379	△152,112,158

(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 20 期	
	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 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 19 期	第 20 期
	平成 30 年 1 月 20 日現在	平成 30 年 7 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	409,773,230 円	409,773,230 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	32,465 口	32,465 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 177,242,379 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 152,112,158 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 5,575,500 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 6,629,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>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 (2,244,682円)及び分配準備積立金(16,055円)の合計額から、経費(272,242円)を控除して計算される分配対象額は1,988,495円(1口当たり61円)であり、うち1,980,365円(1口当たり61円)を分配金額としております。</p>	<p>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 (2,523,488円)及び分配準備積立金(8,130円)の合計額から、経費(271,270円)を控除して計算される分配対象額は2,260,348円(1口当たり69円)であり、うち2,240,085円(1口当たり69円)を分配金額としております。</p>

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	△11,555,675	25,098,568
合計	△11,555,675	25,098,568

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	1,763,750	—	1,890,000	126,250	1,770,500	—	1,747,500	△23,000
合計	1,763,750	—	1,890,000	126,250	1,770,500	—	1,747,500	△23,000

(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 20 期 自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 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 19 期 平成 30 年 1 月 20 日現在	第 20 期 平成 30 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	7,163 円	7,937 円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 運輸・物流 上場取引所 東証  
 コード番号 1645  
 連動対象指標 TOPIX-17 運輸・物流  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	448	(99.5)	2	(0.5)	450	(100.0)
30年 1月期	465	(99.6)	2	(0.4)	468	(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	24	—	—	24
30年 1月期	24	—	—	24

#### (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	454	3	450	18,561
30年 1月期	470	2	468	19,267

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	116
30年 1月期	79

(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 19 期	第 20 期
	平成 30 年 1 月 20 日現在	平成 30 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	1,480,066
コール・ローン	4,454,723	3,279,522
株式 ※2	465,962,900	448,807,300
派生商品評価勘定	100,092	—
未収入金	100,484	682,704
未収配当金	11,500	5,300
前払金	—	34,000
流動資産合計	470,629,699	454,288,892
資産合計	470,629,699	454,288,892
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	21,608
前受金	177,400	—
未払金	—	25,216
未払収益分配金	1,919,068	2,817,872
未払受託者報酬	118,826	119,345
未払委託者報酬	309,006	310,372
未払利息	6	—
その他未払費用	65,809	120,745
流動負債合計	2,590,115	3,415,158
負債合計	2,590,115	3,415,158
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	349,464,712	349,464,712
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	118,574,872	101,409,022
(分配準備積立金)	5,829	17,610
元本等合計	468,039,584	450,873,734
純資産合計	468,039,584	450,873,734
負債純資産合計	470,629,699	454,288,892



(2) 損益及び剰余金計算書

	第 19 期	第 20 期
	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,360,825	3,265,576
有価証券売買等損益	49,556,121	△17,100,417
派生商品取引等損益	510,686	△77,214
その他収益	43,023	61,242
営業収益合計	52,470,655	△13,850,813
営業費用		
支払利息	722	659
受託者報酬	118,826	119,345
委託者報酬	309,006	310,372
その他費用	66,375	66,789
営業費用合計	494,929	497,165
営業利益又は営業損失 (△)	51,975,726	△14,347,978
経常利益又は経常損失 (△)	51,975,726	△14,347,978
当期純利益又は当期純損失 (△)	51,975,726	△14,347,978
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	68,518,214	118,574,872
分配金 ※1	1,919,068	2,817,872
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	118,574,872	101,409,022

(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 20 期	
	自 平成 30 年 1 月 21 日	至 平成 30 年 7 月 20 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 19 期	第 20 期
	平成 30 年 1 月 20 日現在	平成 30 年 7 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	349,464,712 円	349,464,712 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	24,292 口	24,292 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 4,359,500 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 4,362,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 19 期	第 20 期
	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日
※1 分配金の計算過程	<p>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 (2,403,126 円) 及び分配準備積立金(15,978 円)の合計額から、経費(494,207 円)を控除して計算される分配対象額は 1,924,897 円(1 口当たり 79 円)であり、うち 1,919,068 円(1 口当たり 79 円)を分配金額としております。</p>	<p>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 (3,326,159 円) 及び分配準備積立金(5,829 円)の合計額から、経費(496,506 円)を控除して計算される分配対象額は 2,835,482 円(1 口当たり 116 円)であり、うち 2,817,872 円(1 口当たり 116 円)を分配金額としております。</p>

(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 20 期
	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	49,256,113	△16,833,752
合計	49,256,113	△16,833,752

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	1,789,800	—	1,890,000	100,200	1,769,000	—	1,747,500	△21,500
合計	1,789,800	—	1,890,000	100,200	1,769,000	—	1,747,500	△21,500

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	19,267円	18,561円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 商社・卸売 上場取引所 東証  
 コード番号 1646  
 連動対象指標 TOPIX-17 商社・卸売  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	845	(99.9)	0	(0.1)	845	(100.0)
30年 1月期	903	(100.0)	0	(0.0)	903	(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	22	—	—	22
30年 1月期	22	—	—	22

#### (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	860	14	845	37,964
30年 1月期	914	11	903	40,546

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	590
30年 1月期	456

(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 19 期	第 20 期
	平成 30 年 1 月 20 日現在	平成 30 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	4,523,059
コール・ローン	11,122,863	10,022,171
株式 ※2	903,113,620	845,341,660
未収入金	—	41,352
未収配当金	189,550	190,400
流動資産合計	914,426,033	860,118,642
資産合計	914,426,033	860,118,642
負債の部		
流動負債		
前受金	—	23,500
未払金	—	58,932
未払収益分配金	10,159,680	13,145,200
未払受託者報酬	217,319	231,348
未払委託者報酬	565,078	601,593
未払利息	15	—
その他未払費用	120,530	228,485
流動負債合計	11,062,622	14,289,058
負債合計	11,062,622	14,289,058
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	628,763,880	628,763,880
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	274,599,531	217,065,704
(分配準備積立金)	22,011	12,726
元本等合計	903,363,411	845,829,584
純資産合計	903,363,411	845,829,584
負債純資産合計	914,426,033	860,118,642

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	10,917,208	14,099,656
有価証券売買等損益	173,861,349	△57,661,230
派生商品取引等損益	—	136,688
その他収益	146	83
営業収益合計	184,778,703	△43,424,803
営業費用		
支払利息	1,152	1,151
受託者報酬	217,319	231,348
委託者報酬	565,078	601,593
その他費用	121,521	129,732
営業費用合計	905,070	963,824
営業利益又は営業損失(△)	183,873,633	△44,388,627
経常利益又は経常損失(△)	183,873,633	△44,388,627
当期純利益又は当期純損失(△)	183,873,633	△44,388,627
期首剰余金又は期首欠損金(△)	100,885,578	274,599,531
分配金 ※1	10,159,680	13,145,200
期末剰余金又は期末欠損金(△)	274,599,531	217,065,704



(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	628,763,880 円	628,763,880 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	22,280 口	22,280 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 5,134,500 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 4,956,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>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（10,916,202円）及び分配準備積立金（169,407円）の合計額から、経費（903,918円）を控除して計算される分配対象額は10,181,691円（1口当たり456円）であり、うち10,159,680円（1口当たり456円）を分配金額としております。</p>	<p>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（14,098,588円）及び分配準備積立金（22,011円）の合計額から、経費（962,673円）を控除して計算される分配対象額は13,157,926円（1口当たり590円）であり、うち13,145,200円（1口当たり590円）を分配金額としております。</p>

（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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期 平成30年7月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表	<p>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</p>

計上額との差額	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) 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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20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	172,445,481	△57,493,624
合計	172,445,481	△57,493,624

(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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	40,546円	37,964円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 小売 上場取引所 東証  
 コード番号 1647  
 連動対象指標 TOPIX-17 小売  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	498	(99.8)	1	(0.2)	499	(100.0)
30年 1月期	490	(99.8)	1	(0.2)	491	(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	21	—	—	21
30年 1月期	21	—	—	21

#### (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	503	3	499	23,012
30年 1月期	494	3	491	22,616

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	141
30年 1月期	130

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	1,437,521
コール・ローン	4,170,969	3,185,253
株式 ※2	490,185,550	498,671,700
未収入金	215,068	—
未収配当金	186,300	223,850
前払金	—	45,500
流動資産合計	494,757,887	503,563,824
資産合計	494,757,887	503,563,824
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	27,358
前受金	190,500	—
未払金	—	31,216
未払収益分配金	2,823,600	3,062,520
未払受託者報酬	126,239	134,338
未払委託者報酬	328,286	349,333
未払利息	5	—
その他未払費用	69,948	132,532
流動負債合計	3,538,578	3,737,297
負債合計	3,538,578	3,737,297
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	231,904,440	231,904,440
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	259,314,869	267,922,087
(分配準備積立金)	4,301	13,519
元本等合計	491,219,309	499,826,527
純資産合計	491,219,309	499,826,527
負債純資産合計	494,757,887	503,563,824

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 19 期	第 20 期
	自 平成 29 年 7 月 21 日 至 平成 30 年 1 月 20 日	自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,083,550	3,630,875
有価証券売買等損益	58,357,853	8,586,388
派生商品取引等損益	581,312	11,612
その他収益	612	448
営業収益合計	62,023,327	12,229,323
営業費用		
支払利息	756	682
受託者報酬	126,239	134,338
委託者報酬	328,286	349,333
その他費用	70,535	75,232
営業費用合計	525,816	559,585
営業利益	61,497,511	11,669,738
経常利益	61,497,511	11,669,738
当期純利益	61,497,511	11,669,738
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	200,640,958	259,314,869
分配金 ※1	2,823,600	3,062,520
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	259,314,869	267,922,087

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	231,904,440 円	231,904,440 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	21,720 口	21,720 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 453,800 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 462,700 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
※1 分配金の計算過程	<p>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                      (3,083,406円)及び分配準備積立金(269,555円)の合計額から、経費(525,060円)を控除して計算される分配対象額は                      2,827,901円(1口当たり130円)であり、うち2,823,600円(1口当たり130円)を分配金額としております。</p>	<p>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                      (3,630,641円)及び分配準備積立金(4,301円)の合計額から、経費(558,903円)を控除して計算される分配対象額は                      3,076,039円(1口当たり141円)であり、うち3,062,520円(1口当たり141円)を分配金額としております。</p>

（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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>



II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	58,079,289	9,224,766
合計	58,079,289	9,224,766

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	—	—	—	—	1,774,750	—	1,747,500	△27,250
合計	—	—	—	—	1,774,750	—	1,747,500	△27,250

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	22,616円	23,012円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 銀行 上場取引所 東証  
 コード番号 1648  
 連動対象指標 TOPIX-17 銀行  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	1,253	(97.9)	26	(2.1)	1,280	(100.0)
30年 1月期	1,148	(99.0)	11	(1.0)	1,159	(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	83	29	—	113
30年 1月期	54	58	29	83

#### (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	1,302	22	1,280	11,294
30年 1月期	1,170	10	1,159	13,878

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	172
30年 1月期	99

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	8,644,882
コール・ローン	11,876,567	19,155,285
株式 ※3	1,148,705,760	1,253,571,180
派生商品評価勘定	899,460	—
未収入金	8,462,004	19,788,156
未収配当金	165,000	180,000
前払金	—	1,440,000
流動資産合計	1,170,108,791	1,302,779,503
資産合計	1,170,108,791	1,302,779,503
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	1,546,620
前受金	825,000	—
未払収益分配金	8,274,519	19,496,200
未払受託者報酬	252,832	358,386
未払委託者報酬	657,427	931,878
未払利息	16	—
その他未払費用	140,535	316,259
流動負債合計	10,150,329	22,649,343
負債合計	10,150,329	22,649,343
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,461,079,461	1,981,471,350
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△301,120,999	△701,341,190
(分配準備積立金)	9,626	6,533
元本等合計	1,159,958,462	1,280,130,160
純資産合計	1,159,958,462	1,280,130,160
負債純資産合計	1,170,108,791	1,302,779,503

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	9,209,075	20,988,925
有価証券売買等損益	162,896,412	△270,797,372
派生商品取引等損益	1,547,840	△2,782,400
その他収益	21	—
営業収益合計	173,653,348	△252,590,847
営業費用		
支払利息	2,249	4,096
受託者報酬	252,832	358,386
委託者報酬	657,427	931,878
その他費用	141,414	201,458
営業費用合計	1,053,922	1,495,818
営業利益又は営業損失(△)	172,599,426	△254,086,665
経常利益又は経常損失(△)	172,599,426	△254,086,665
当期純利益又は当期純損失(△)	172,599,426	△254,086,665
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△303,736,102	△301,120,999
剰余金増加額又は欠損金減少額	150,733,476	—
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	150,733,476	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	312,443,280	126,637,326
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	312,443,280	126,637,326
分配金 ※1	8,274,519	19,496,200
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△301,120,999	△701,341,190

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	951,857,931 円	1,461,079,461 円
期中追加設定元本額	1,029,560,976 円	520,391,889 円
期中一部交換元本額	520,339,446 円	— 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	83,581 口	113,350 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301,120,999 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701,341,190 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 7,041,000 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 5,480,500 円

ダイワ上場投信・TOPIX-17 銀行（1648）平成30年7月期決算短信  
 （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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（9,206,847円）及び分配準備積立金（128,971円）の合計額から、経費（1,051,673円）を控除して計算される分配対象額は8,284,145円（1口当たり99円）であり、うち8,274,519円（1口当たり99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（20,984,829円）及び分配準備積立金（9,626円）の合計額から、経費（1,491,722円）を控除して計算される分配対象額は19,502,733円（1口当たり172円）であり、うち19,496,200円（1口当たり172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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	151,923,664	△265,757,561
合計	151,923,664	△265,757,561

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	9,825,000	—	10,725,000	900,000	27,750,000	—	26,205,000	△1,545,000
合計	9,825,000	—	10,725,000	900,000	27,750,000	—	26,205,000	△1,545,000

(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 20 期 自 平成 30 年 1 月 21 日 至 平成 30 年 7 月 20 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 19 期 平成 30 年 1 月 20 日現在	第 20 期 平成 30 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	13,878 円	11,294 円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 金融（除く銀行） 上場取引所 東証  
 コード番号 1649  
 連動対象指標 TOPIX-17 金融（除く銀行）  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	362	(99.9)	0	(0.1)	363	(100.0)
30年 1月期	409	(99.9)	0	(0.1)	410	(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	27	—	—	27
30年 1月期	27	—	—	27

#### (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	370	6	363	13,308
30年 1月期	414	4	410	15,023

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	236
30年 1月期	145

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	2,289,129
コール・ローン	4,707,237	5,072,241
株式	409,802,740	362,961,280
未収入金	106,885	—
流動資産合計	414,616,862	370,322,650
資産合計	414,616,862	370,322,650
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,959,515	6,444,452
未払受託者報酬	100,435	101,465
未払委託者報酬	261,189	263,895
未払利息	6	—
その他未払費用	55,601	102,410
流動負債合計	4,376,746	6,912,222
負債合計	4,376,746	6,912,222
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	407,529,668	407,529,668
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	2,710,448	△44,119,240
(分配準備積立金)	14,268	19,831
元本等合計	410,240,116	363,410,428
純資産合計	410,240,116	363,410,428
負債純資産合計	414,616,862	370,322,650

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	4,367,020	6,872,800
有価証券売買等損益	47,702,628	△46,835,251
その他収益	19	4
営業収益合計	52,069,667	△39,962,447
営業費用		
支払利息	599	576
受託者報酬	100,435	101,465
委託者報酬	261,189	263,895
その他費用	56,092	56,853
営業費用合計	418,315	422,789
営業利益又は営業損失(△)	51,651,352	△40,385,236
経常利益又は経常損失(△)	51,651,352	△40,385,236
当期純利益又は当期純損失(△)	51,651,352	△40,385,236
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△44,981,389	2,710,448
分配金 ※1	3,959,515	6,444,452
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,710,448	△44,119,240

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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. 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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	407,529,668 円	407,529,668 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	27,307 口	27,307 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44,119,240 円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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 (4,366,440 円) 及び分配準備積立金(25,059 円)の合計額から、経費(417,716 円)を控除し	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 (6,872,228 円) 及び分配準備積立金(14,268 円)の合計額から、経費(422,213 円)を控除し

	て計算される分配対象額は 3,973,783円（1口当たり145円）であり、うち3,959,515円（1口当たり145円）を分配金額としております。	て計算される分配対象額は 6,464,283円（1口当たり236円）であり、うち6,444,452円（1口当たり236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20期
	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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20期
	平成30年7月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20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	47,581,284	△46,762,830
合計	47,581,284	△46,762,830

（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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	15,023円	13,308円

# 平成30年7月期（平成30年1月21日～平成30年7月20日）決算短信

平成30年8月31日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX-17 不動産 上場取引所 東証  
 コード番号 1650  
 連動対象指標 TOPIX-17 不動産  
 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12日  
 分配金支払開始日 平成30年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 30年7月期の運用状況（平成30年1月21日～平成30年7月20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	282	(99.4)	1	(0.6)	284	(100.0)
30年 1月期	301	(99.3)	2	(0.7)	303	(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	9	—	—	9
30年 1月期	9	—	—	9

#### (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	286	2	284	31,208
30年 1月期	305	2	303	33,319

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
30年 7月期	213
30年 1月期	220

(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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	1,119,112
コール・ローン	3,768,666	2,479,724
株式	301,292,750	282,488,950
派生商品評価勘定	106,642	—
未収入金	106,534	—
未収配当金	438,250	216,500
前払金	—	37,600
差入委託証拠金	93,000	90,000
流動資産合計	305,805,842	286,431,886
資産合計	305,805,842	286,431,886
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	23,408
前受金	190,500	—
未払金	—	26,766
未払収益分配金	2,002,660	1,938,939
未払受託者報酬	74,547	77,092
未払委託者報酬	193,879	200,526
未払利息	5	—
その他未払費用	41,215	76,905
流動負債合計	2,502,806	2,343,636
負債合計	2,502,806	2,343,636
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	228,121,180	228,121,180
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	75,181,856	55,967,070
(分配準備積立金)	1,008	3,848
元本等合計	303,303,036	284,088,250
純資産合計	303,303,036	284,088,250
負債純資産合計	305,805,842	286,431,886

(2) 損益及び剰余金計算書

	第19期	第20期
	自平成29年7月21日 至平成30年1月20日	自平成30年1月21日 至平成30年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,132,460	2,263,060
有価証券売買等損益	36,151,458	△19,140,962
派生商品取引等損益	509,436	△76,664
その他収益	156	46
営業収益合計	38,793,510	△16,954,520
営業費用		
支払利息	571	589
受託者報酬	74,547	77,092
委託者報酬	193,879	200,526
その他費用	41,577	43,120
営業費用合計	310,574	321,327
営業利益又は営業損失(△)	38,482,936	△17,275,847
経常利益又は経常損失(△)	38,482,936	△17,275,847
当期純利益又は当期純損失(△)	38,482,936	△17,275,847
期首剰余金又は期首欠損金(△)	38,701,580	75,181,856
分配金 ※1	2,002,660	1,938,939
期末剰余金又は期末欠損金(△)	75,181,856	55,967,070

(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20期	
	自 平成30年1月21日	至 平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20日現在
1. ※1 期首元本額	228,121,180円	228,121,180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	9,103口	9,103口

の総数		
-----	--	--

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第19期	第20期
	自 平成29年7月21日 至 平成30年1月20日	自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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（2,132,045円）及び分配準備積立金（181,626円）の合計額から、経費（310,003円）を控除して計算される分配対象額は2,003,668円（1口当たり220円）であり、うち2,002,660円（1口当たり220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（2,262,517円）及び分配準備積立金（1,008円）の合計額から、経費（320,738円）を控除して計算される分配対象額は1,942,787円（1口当たり213円）であり、うち1,938,939円（1口当たり213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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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20期
	平成30年7月20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19期	第20期
	平成30年1月20日現在	平成30年7月20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	36,085,905	△19,259,256
合計	36,085,905	△19,259,256

(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19期				第20期			
	平成30年1月20日 現在				平成30年7月20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	1,783,250	—	1,890,000	106,750	1,770,800	—	1,747,500	△23,300
合計	1,783,250	—	1,890,000	106,750	1,770,800	—	1,747,500	△23,300

(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20期 自 平成30年1月21日 至 平成30年7月20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19期 平成30年1月20日現在	第20期 平成30年7月20日現在
1口当たり純資産額	33,319円	31,208円