

2020年2月20日

各 位

委 託 会 社 名 大和証券投資信託委託株式会社  
代表者の役職氏名 代表取締役社長 松下 浩一  
担当者の役職氏名 経 営 企 画 部 岡田 美範

(訂正) 「2020年1月期 (2019年7月11日～2020年1月10日) 決算短信」の訂正について

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下記ETF銘柄について、本日、2020年1月期 (2019年7月11日～2020年1月10日) 決算短信を開示いたしましたが、誤って平成31年1月期の決算短信を掲載いたしました。

つきましては2020年1月期 決算短信を改めて以下のとおり報告させていただきます。

記

#### 上場ETF銘柄 (6銘柄)

銘柄名	銘柄コード	上場取引所
ダイワ上場投信－MSCI 日本株人材設備投資指数	1479	東
ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials	1585	東
ダイワ上場投信－J P X日経 400	1599	東
ダイワ上場投信－MSCI 日本株女性活躍指数 (WIN)	1652	東
ダイワ上場投信－MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数	1653	東
ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index	1654	東

\*各銘柄の決算短信につきましては、次ページ以降をご参照ください。  
なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の決算短信が表示されます。

以上

# 2020年1月期（2019年7月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数 上場取引所 東証  
 コード番号 1479  
 連動対象指標 MSCI日本株人材設備投資指数  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 1口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 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 2020年 4月 3日  
 分配金支払開始日 2020年 2月18日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2020年1月期の運用状況（2019年7月11日～2020年1月10日）

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 1月期	48,981	(98.5)	732	(1.5)	49,714	(100.0)
2019年 7月期	53,448	(98.9)	574	(1.1)	54,023	(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
2020年 1月期	2,917	—	535	2,381
2019年 7月期	2,976	—	59	2,917

#### (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
2020年 1月期	62,476	12,762	49,714	20,872.9
2019年 7月期	64,794	10,771	54,023	18,519.3

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	230
2019年 7月期	231

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

### 2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無  
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第7期	第8期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,335,445,549	—
コール・ローン	8,872,403,100	13,306,443,447
株式 ※2※3	53,448,302,470	48,981,695,900
派生商品評価勘定	5,340,192	5,520,744
未収入金	7,752,276	69,015,630
未収配当金	101,721,850	86,278,850
未収利息	271,207	141,137
その他未収収益 ※4	2,790,164	12,238,720
差入委託証拠金	20,400,000	15,456,000
流動資産合計	64,794,426,808	62,476,790,428
資産合計	64,794,426,808	62,476,790,428
負債の部		
流動負債		
前受金	15,984,900	8,208,264
未払収益分配金	673,856,799	547,805,720
未払受託者報酬	10,586,306	9,378,600
未払委託者報酬	36,559,467	32,842,811
受入担保金	10,032,536,293	12,162,490,179
その他未払費用	1,710,745	1,624,874
流動負債合計	10,771,234,510	12,762,350,448
負債合計	10,771,234,510	12,762,350,448
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	46,951,191,255	38,334,491,580
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,072,001,043	11,379,948,400
（分配準備積立金）	2,877,405	2,172,164
元本等合計	54,023,192,298	49,714,439,980
純資産合計	54,023,192,298	49,714,439,980
負債純資産合計	64,794,426,808	62,476,790,428

(2) 損益及び剰余金計算書

	第7期	第8期
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	706,905,859	564,626,200
受取利息	6,123,398	4,156,565
有価証券売買等損益	2,915,355,281	5,018,575,021
派生商品取引等損益	14,156,499	108,239,902
その他収益 ※1	25,692,441	34,177,792
営業収益合計	3,668,233,478	5,729,775,480
営業費用		
支払利息	4,140,997	2,163,239
受託者報酬	10,586,306	9,378,600
委託者報酬	36,559,467	32,842,811
その他費用 ※2	12,921,674	11,475,428
営業費用合計	64,208,444	55,860,078
営業利益	3,604,025,034	5,673,915,402
経常利益	3,604,025,034	5,673,915,402
当期純利益	3,604,025,034	5,673,915,402
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	4,251,086,308	7,072,001,043
剰余金減少額又は欠損金増加額	109,253,500	818,162,325
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	109,253,500	818,162,325
分配金 ※3	673,856,799	547,805,720
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	7,072,001,043	11,379,948,400

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 8 期	
	自 2019年7月11日	至 2020年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。                      時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。                      なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。                      時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 7 期	第 8 期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	47,907,717,105 円	46,951,191,255 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	956,525,850 円	8,616,699,675 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,917,129 口	2,381,764 口

3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 9,521,105,910円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 11,870,817,410円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 69,080,000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 76,610,000円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分2,561,800円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分12,122,900円が含まれております。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第7期	第8期
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
1. ※1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額20,345,000円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額30,483,900円が含まれております。
2. ※2 その他費用	主に、対象指数の商標の使用料であります。	主に、対象指数の商標の使用料であります。
3. ※3 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(734,580,701円)及び分配準備積立金(2,220,950円)の合計額から、経費(60,067,447円)を控除して計算される分配対象額は676,734,204円(10口当たり2,319円)であり、うち673,856,799円(10口当たり2,310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(600,797,318円)及び分配準備積立金(2,877,405円)の合計額から、経費(53,696,839円)を控除して計算される分配対象額は549,977,884円(10口当たり2,309円)であり、うち547,805,720円(10口当たり2,300円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 8 期 自 2019 年 7 月 11 日 至 2020 年 1 月 10 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 8 期 2020 年 1 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

	(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 7 期 2019年7月10日現在	第 8 期 2020年1月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	2,190,833,681	4,979,940,771
合計	2,190,833,681	4,979,940,771

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 7 期 2019年7月10日 現在				第 8 期 2020年1月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	568,165,920	—	573,550,500	5,384,580	725,083,336	—	730,656,000	5,572,664
合計	568,165,920	—	573,550,500	5,384,580	725,083,336	—	730,656,000	5,572,664

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。



（関連当事者との取引に関する注記）

第8期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第7期 2019年7月10日現在	第8期 2020年1月10日現在
1口当たり純資産額	18,519.3円	20,872.9円
（10口当たり純資産額）	（185,193円）	（208,729円）

# 2020年1月期（2019年7月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials 上場取引所 東証  
 コード番号 1585  
 連動対象指標 TOPIX Ex-Financials  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 10口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 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 2020年 4月 3日  
 分配金支払開始日 2020年 2月18日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2020年1月期の運用状況（2019年7月11日～2020年1月10日）

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 1月期	29,493	(99.9)	30	(0.1)	29,524	(100.0)
2019年 7月期	26,776	(99.8)	48	(0.2)	26,825	(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
2020年 1月期	22,039	6,815	6,911	21,943
2019年 7月期	20,093	1,946	—	22,039

#### (3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年 1月期	29,899	375	29,524	13,454.7
2019年 7月期	27,141	316	26,825	12,171.6

#### (4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2020年 1月期	156
2019年 7月期	129

(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12期	第13期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	62,303,034	—
コール・ローン	236,690,437	346,311,408
株式	26,776,579,560	29,493,240,421
未収入金	21,477,217	8,797,800
未収配当金	44,536,540	50,755,286
流動資産合計	27,141,586,788	29,899,104,915
資産合計	27,141,586,788	29,899,104,915
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	284,309,266	342,315,402
未払受託者報酬	6,764,736	8,048,475
未払委託者報酬	17,588,399	20,926,114
その他未払費用	7,424,512	3,794,473
流動負債合計	316,086,913	375,084,464
負債合計	316,086,913	375,084,464
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	21,797,043,742	21,701,918,755
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	5,028,456,133	7,822,101,696
(分配準備積立金)	1,280,555	623,504
元本等合計	26,825,499,875	29,524,020,451
純資産合計	26,825,499,875	29,524,020,451
負債純資産合計	27,141,586,788	29,899,104,915

(2) 損益及び剰余金計算書

	第12期	第13期
	自2019年1月11日 至2019年7月10日	自2019年7月11日 至2020年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	312,546,349	376,091,488
受取利息	—	130
有価証券売買等損益	1,000,479,730	3,390,265,093
その他収益	218,208	222,921
営業収益合計	1,313,244,287	3,766,579,632
営業費用		
支払利息	36,821	37,986
受託者報酬	6,764,736	8,048,475
委託者報酬	17,588,399	20,926,114
その他費用	4,737,223	5,643,613
営業費用合計	29,127,179	34,656,188
営業利益	1,284,117,108	3,731,923,444
経常利益	1,284,117,108	3,731,923,444
当期純利益	1,284,117,108	3,731,923,444
期首剰余金又は期首欠損金(△)	3,604,966,173	5,028,456,133
剰余金増加額又は欠損金減少額	423,682,118	1,157,372,314
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	423,682,118	1,157,372,314
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	1,753,334,793
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	1,753,334,793
分配金 ※1	284,309,266	342,315,402
期末剰余金又は期末欠損金(△)	5,028,456,133	7,822,101,696

(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 13 期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 12 期 2019年7月10日現在	第 13 期 2020年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	19,872,251,942 円	21,797,043,742 円
期中追加設定元本額	1,924,791,800 円	6,740,717,410 円
期中一部交換元本額	－円	6,835,842,397 円
2. 計算期間末日における受益 権の総数	22,039,478 口	21,943,295 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 12 期 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	第 13 期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取 配当金、配当株式、受取利息及 びその他収益金から支払利息 を控除した当期配当等収益額 (312,727,736 円) 及び分配準 備積立金(1,952,443 円)の合 計額から、経費(29,090,358 円)を控除して計算される分配 対象額は 285,589,821 円 (100 口当たり 1,295 円) であり、う ち 284,309,266 円 (100 口当 たり 1,290 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 (376,276,553 円) 及び分配準 備積立金(1,280,555 円)の合 計額から、経費(34,618,202 円)を控除して計算される分配 対象額は 342,938,906 円 (100 口当たり 1,562 円) であり、う ち 342,315,402 円 (100 口当 たり 1,560 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 13 期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の 基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 13 期 2020年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<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 12 期 2019年7月10日現在	第 13 期 2020年1月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	983,305,303	3,143,956,109
合計	983,305,303	3,143,956,109

(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12期 2019年7月10日現在	第13期 2020年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第13期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第12期 2019年7月10日現在	第13期 2020年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,217.16円	1,345.47円
(100口当たり純資産額)	(121,716円)	(134,547円)



# 2020年1月期（2019年7月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－JPX日経400 上場取引所 東証  
 コード番号 1599  
 連動対象指標 JPX日経インデックス400  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 1口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 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 2020年 4月 3日  
 分配金支払開始日 2020年 2月18日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2020年1月期の運用状況（2019年7月11日～2020年1月10日）

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 1月期	258,902	(99.5)	1,373	(0.5)	260,275	(100.0)
2019年 7月期	218,130	(99.7)	678	(0.3)	218,809	(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
2020年 1月期	15,491	1,390	297	16,583
2019年 7月期	12,810	2,681	—	15,491

#### (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
2020年 1月期	311,096	50,820	260,275	15,694.5
2019年 7月期	260,583	41,774	218,809	14,124.6

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	152
2019年 7月期	165

(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11期	第12期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	8,755,608,349	—
コール・ローン	33,262,726,538	51,670,028,355
株式 ※2※3	218,130,971,870	258,902,624,500
派生商品評価勘定	8,788,344	11,176,035
未収入金	25,297,664	25,817,050
未収配当金	345,765,495	332,385,000
未収利息	1,017,973	914,100
その他未収収益 ※4	14,891,075	103,003,964
差入委託証拠金	38,633,000	50,460,000
流動資産合計	260,583,700,308	311,096,409,004
資産合計	260,583,700,308	311,096,409,004
負債の部		
流動負債		
前受金	41,176,140	28,110,345
未払収益分配金	2,556,069,450	2,520,750,216
未払受託者報酬	63,146,654	75,362,026
未払委託者報酬	152,140,767	179,809,807
受入担保金	38,934,278,775	47,936,710,636
その他未払費用	27,692,355	79,854,739
流動負債合計	41,774,504,141	50,820,597,769
負債合計	41,774,504,141	50,820,597,769
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	163,154,687,560	174,661,455,756
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	55,654,508,607	85,614,355,479
（分配準備積立金）	580,364	15,500,223
元本等合計	218,809,196,167	260,275,811,235
純資産合計	218,809,196,167	260,275,811,235
負債純資産合計	260,583,700,308	311,096,409,004

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 11 期	第 12 期
	自 2019 年 1 月 11 日 至 2019 年 7 月 10 日	自 2019 年 7 月 11 日 至 2020 年 1 月 10 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,653,778,648	2,599,117,195
受取利息	20,897,793	21,748,351
有価証券売買等損益	6,554,321,117	25,416,858,291
派生商品取引等損益	△8,891,629	299,612,356
その他収益 ※1	147,741,060	233,957,999
営業収益合計	9,367,846,989	28,571,294,192
営業費用		
支払利息	13,622,571	10,567,752
受託者報酬	63,146,654	75,362,026
委託者報酬	152,140,767	179,809,807
その他費用	46,176,077	53,413,885
営業費用合計	275,086,069	319,153,470
営業利益	9,092,760,920	28,252,140,722
経常利益	9,092,760,920	28,252,140,722
当期純利益	9,092,760,920	28,252,140,722
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	39,616,035,888	55,654,508,607
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,501,781,249	5,461,299,824
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	9,501,781,249	5,461,299,824
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	1,232,843,458
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	1,232,843,458
分配金 ※2	2,556,069,450	2,520,750,216
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	55,654,508,607	85,614,355,479

(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 12 期	
	自 2019年7月11日	至 2020年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金  原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 11 期	第 12 期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	134,915,499,260 円	163,154,687,560 円
期中追加設定元本額	28,239,188,300 円	14,639,574,788 円
期中一部交換元本額	－円	3,132,806,592 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	15,491,330 口	16,583,883 口

<p>3. ※2 貸付有価証券</p>	<p>株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 36,829,034,880 円</p>	<p>株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 46,838,641,720 円</p>
<p>4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券</p>	<p>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 134,943,500 円</p>	<p>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 88,599,500 円</p>
<p>5. ※4 その他未収収益</p>	<p>貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 13,891,150 円が含まれております。</p>	<p>貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 101,796,900 円が含まれております。</p>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

<p>区 分</p>	<p>第 11 期 自 2019 年 1 月 11 日 至 2019 年 7 月 10 日</p>	<p>第 12 期 自 2019 年 7 月 11 日 至 2020 年 1 月 10 日</p>
<p>1. ※1 その他収益</p>	<p>貸付有価証券に係る配当金相当額 124,943,764 円が含まれております。</p>	<p>貸付有価証券に係る配当金相当額 206,906,979 円が含まれております。</p>
<p>2. ※2 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 (2,808,794,930 円) 及び分配準備積立金 (9,318,382 円) の合計額から、経費 (261,463,498 円) を控除して計算される分配対象額は 2,556,649,814 円 (10 口当たり 1,650 円) であり、うち 2,556,069,450 円 (10 口当たり 1,650 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 (2,844,255,793 円) 及び分配準備積立金 (580,364 円) の合計額から、経費 (308,585,718 円) を控除して計算される分配対象額は 2,536,250,439 円 (10 口当たり 1,529 円) であり、うち 2,520,750,216 円 (10 口当たり 1,520 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 12 期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 12 期 2020年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

	<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 11 期 2019年7月10日現在	第 12 期 2020年1月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	6,423,780,694	25,592,260,851
合計	6,423,780,694	25,592,260,851

(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 11 期 2019年7月10日 現在				第 12 期 2020年1月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	666,581,384	－	675,422,000	8,840,616	1,349,419,275	－	1,360,692,000	11,272,725
合計	666,581,384	－	675,422,000	8,840,616	1,349,419,275	－	1,360,692,000	11,272,725

(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12期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第11期 2019年7月10日現在	第12期 2020年1月10日現在
1口当たり純資産額	14,124.6円	15,694.5円
（10口当たり純資産額）	（141,246円）	（156,945円）



# 2020年1月期（2019年7月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数（WIN） 上場取引所 東証  
 コード番号 1652  
 連動対象指標 MSCI日本株女性活躍指数  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 10口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 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 2020年 4月 3日  
 分配金支払開始日 2020年 2月18日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2020年1月期の運用状況（2019年7月11日～2020年1月10日）

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 1月期	1,294	(99.5)	6	(0.5)	1,301	(100.0)
2019年 7月期	1,053	(98.4)	16	(1.6)	1,070	(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
2020年 1月期	559	49	-	609
2019年 7月期	657	49	147	559

#### (3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年 1月期	1,313	12	1,301	21,355.1
2019年 7月期	1,089	18	1,070	19,136.6

#### (4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2020年 1月期	184
2019年 7月期	300

(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4期	第5期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	33,087,386	—
コール・ローン	—	16,231,987
株式 ※3	1,053,742,920	1,294,143,320
派生商品評価勘定	156,704	57,560
未収入金	159,408	1,122,460
未収配当金	1,870,850	1,879,312
流動資産合計	1,089,017,268	1,313,434,639
資産合計	1,089,017,268	1,313,434,639
負債の部		
流動負債		
前受金	392,000	137,500
未払収益分配金	16,785,270	11,210,365
未払受託者報酬	207,122	184,830
未払委託者報酬	828,590	739,492
その他未払費用	93,021	84,649
流動負債合計	18,306,003	12,356,836
負債合計	18,306,003	12,356,836
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,116,220,455	1,215,471,705
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△45,509,190	85,606,098
（分配準備積立金）	28,345	47,365
元本等合計	1,070,711,265	1,301,077,803
純資産合計	1,070,711,265	1,301,077,803
負債純資産合計	1,089,017,268	1,313,434,639

(2) 損益及び剰余金計算書

	第4期	第5期
	自2019年1月11日 至2019年7月10日	自2019年7月11日 至2020年1月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	18,197,772	12,554,912
受取利息	—	4
有価証券売買等損益	54,309,378	122,135,063
派生商品取引等損益	△109,640	2,035,508
その他収益	21,139	8,073
営業収益合計	72,418,649	136,733,560
営業費用		
支払利息	2,925	5,439
受託者報酬	207,122	184,830
委託者報酬	828,590	739,492
その他費用 ※1	420,307	403,843
営業費用合計	1,458,944	1,333,604
営業利益	70,959,705	135,399,956
経常利益	70,959,705	135,399,956
当期純利益	70,959,705	135,399,956
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△105,858,417	△45,509,190
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,677,095	6,925,697
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	8,677,095	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	6,925,697
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,502,303	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	2,502,303	—
分配金 ※2	16,785,270	11,210,365
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△45,509,190	85,606,098

(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 5 期	
	自 2019年7月11日	至 2020年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金  原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 4 期	第 5 期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	1,312,111,500 円	1,116,220,455 円
期中追加設定元本額	98,912,100 円	99,251,250 円
期中一部交換元本額	294,803,145 円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	559,509 口	609,259 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45,509,190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 9,003,750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 10,572,000円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第4期	第5期
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
1. ※1 その他費用	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。
2. ※2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（18,215,986円）及び分配準備積立金（53,648円）の合計額から、経費（1,456,019円）を控除して計算される分配対象額は16,813,615円（100口当たり3,005円）であり、うち16,785,270円（100口当たり3,000円）を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（12,557,550円）及び分配準備積立金（28,345円）の合計額から、経費（1,328,165円）を控除して計算される分配対象額は11,257,730円（100口当たり1,847円）であり、うち11,210,365円（100口当たり1,840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5期
	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<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5期 2020年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<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時価との差額はありません。</p>
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 4 期 2019年7月10日現在	第 5 期 2020年1月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	35,455,610	108,574,468
合計	35,455,610	108,574,468

（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 4 期 2019年7月10日現在				第 5 期 2020年1月10日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	16,588,000	—	16,746,000	158,000	6,134,000	—	6,192,000	58,000
合計	16,588,000	—	16,746,000	158,000	6,134,000	—	6,192,000	58,000

（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5期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第4期 2019年7月10日現在	第5期 2020年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,913.66円	2,135.51円
（100口当たり純資産額）	（191,366円）	（213,551円）



# 2020年1月期（2019年7月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数 上場取引所 東証  
 コード番号 1653  
 連動対象指標 MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数  
 主要投資資産 株式、投資証券  
 売買単位 10口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 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 2020年 4月 3日

分配金支払開始日 2020年 2月18日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2020年1月期の運用状況（2019年7月11日～2020年1月10日）

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 1月期	6,005	(99.5)	29	(0.5)	6,034	(100.0)
2019年 7月期	3,506	(99.6)	13	(0.4)	3,519	(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
2020年 1月期	1,833	1,006	47	2,791
2019年 7月期	1,487	395	49	1,833

#### (3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10
	百万円	百万円	百万円	円
2020年 1月期	6,082	48	6,034	21,615.0
2019年 7月期	3,558	38	3,519	19,200.0

#### (4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2020年 1月期	156
2019年 7月期	195

(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4期	第5期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	48,583,267	—
コール・ローン	—	59,962,811
株式 ※3	3,453,323,930	5,916,072,930
投資証券	52,894,600	88,996,200
派生商品評価勘定	157,920	215,850
未収入金	332,100	11,379,380
未収配当金	3,429,240	6,186,467
流動資産合計	3,558,721,057	6,082,813,638
資産合計	3,558,721,057	6,082,813,638
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	8,440
前受金	594,000	434,000
未払収益分配金	35,747,185	43,554,295
未払受託者報酬	486,502	734,704
未払委託者報酬	1,946,189	2,938,953
その他未払費用	221,978	355,176
流動負債合計	38,995,854	48,025,568
負債合計	38,995,854	48,025,568
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	3,600,383,196	5,483,374,088
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△80,657,993	551,413,982
（分配準備積立金）	76,438	63,757
元本等合計	3,519,725,203	6,034,788,070
純資産合計	3,519,725,203	6,034,788,070
負債純資産合計	3,558,721,057	6,082,813,638

(2) 損益及び剰余金計算書

	第4期	第5期
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	38,865,904	47,998,785
受取利息	—	17
有価証券売買等損益	141,124,517	541,657,365
派生商品取引等損益	△382,280	4,774,012
その他収益	6,960	13,711
営業収益合計	179,615,101	594,443,890
営業費用		
支払利息	5,176	9,385
受託者報酬	486,502	734,704
委託者報酬	1,946,189	2,938,953
その他費用 ※1	623,635	787,857
営業費用合計	3,061,502	4,470,899
営業利益	176,553,599	589,972,991
経常利益	176,553,599	589,972,991
当期純利益	176,553,599	589,972,991
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△205,924,641	△80,657,993
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,026,718	85,653,279
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,026,718	1,498,678
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	84,154,601
剰余金減少額又は欠損金増加額	18,566,484	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	18,566,484	—
分配金 ※2	35,747,185	43,554,295
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△80,657,993	551,413,982

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 5 期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 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、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第 4 期	第 5 期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	2,920,951,144 円	3,600,383,196 円
期中追加設定元本額	776,329,920 円	1,976,373,200 円
期中一部交換元本額	96,897,868 円	93,382,308 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,833,189 口	2,791,942 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80,657,993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 24,551,000 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 12,072,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第 4 期	第 5 期
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
1. ※1 その他費用	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用及び対象指数の商標の使用料であります。	主に、対象指数の商標の使用料及び分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。
2. ※2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（38,867,688 円）及び分配準備積立金（12,261 円）の合計額から、経費（3,056,326 円）を控除して計算される分配対象額は 35,823,623 円（100 口当たり 1,954 円）であり、うち 35,747,185 円（100 口当たり	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（48,003,128 円）及び分配準備積立金（76,438 円）の合計額から、経費（4,461,514 円）を控除して計算される分配対象額は 43,618,052 円（100 口当たり 1,562 円）であり、うち 43,554,295 円（100 口当たり

	1,950円)を分配金額としてお ります。		1,560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 5 期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 5 期 2020年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

	<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 4 期 2019年7月10日現在	第 5 期 2020年1月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	133,879,671	515,301,929
投資証券	3,095,997	3,977,293
合計	136,975,668	519,279,222

(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 4 期 2019年7月10日 現在				第 5 期 2020年1月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	13,796,000	—	13,955,000	159,000	29,202,500	—	29,412,000	209,500
合計	13,796,000	—	13,955,000	159,000	29,202,500	—	29,412,000	209,500

(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5期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第4期 2019年7月10日現在	第5期 2020年1月10日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,920.00円 (192,000円)	2,161.50円 (216,150円)



# 2020年1月期（2019年7月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index 上場取引所 東証  
 コード番号 1654  
 連動対象指標 FTSE Blossom Japan Index  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 10口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 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 2020年 4月 3日  
 分配金支払開始日 2020年 2月18日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2020年1月期の運用状況（2019年7月11日～2020年1月10日）

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 1月期	2,223	(99.1)	19	(0.9)	2,242	(100.0)
2019年 7月期	2,281	(99.8)	4	(0.2)	2,285	(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
2020年 1月期	1,945	—	232	1,712
2019年 7月期	1,719	305	79	1,945

#### (3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年 1月期	2,270	27	2,242	13,096.1
2019年 7月期	2,320	35	2,285	11,749.9

#### (4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2020年 1月期	146
2019年 7月期	169

(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4期	第5期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	35,780,031	—
コール・ローン	—	38,800,331
株式 ※3	2,281,068,320	2,223,773,950
派生商品評価勘定	60,176	143,680
未収入金	291,032	3,840,320
未収配当金	3,769,950	3,601,950
流動資産合計	2,320,969,509	2,270,160,231
資産合計	2,320,969,509	2,270,160,231
負債の部		
流動負債		
前受金	416,000	289,000
未払収益分配金	32,876,144	25,005,536
未払受託者報酬	359,158	350,678
未払委託者報酬	1,436,704	1,402,860
その他未払費用	130,689	125,696
流動負債合計	35,218,695	27,173,770
負債合計	35,218,695	27,173,770
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,431,667,500	2,140,885,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△145,916,686	102,101,461
(分配準備積立金)	26,807	133,162
元本等合計	2,285,750,814	2,242,986,461
純資産合計	2,285,750,814	2,242,986,461
負債純資産合計	2,320,969,509	2,270,160,231

(2) 損益及び剰余金計算書

	第4期	第5期
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	34,739,152	27,067,100
受取利息	31	127
有価証券売買等損益	56,808,159	228,490,704
派生商品取引等損益	△384,908	3,318,948
その他収益	12,616	7,412
営業収益合計	91,175,050	258,884,291
営業費用		
支払利息	2,989	6,841
受託者報酬	359,158	350,678
委託者報酬	1,436,704	1,402,860
その他費用	207,696	202,369
営業費用合計	2,006,547	1,962,748
営業利益	89,168,503	256,921,543
経常利益	89,168,503	256,921,543
当期純利益	89,168,503	256,921,543
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△191,140,889	△145,916,686
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,581,460	16,102,140
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	6,581,460	16,102,140
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,649,616	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	17,649,616	—
分配金 ※1	32,876,144	25,005,536
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△145,916,686	102,101,461

(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 5 期	
	自 2019年7月11日	至 2020年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 4 期	第 5 期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
1. ※1 期首元本額	2,149,737,500 円	2,431,667,500 円
期中追加設定元本額	381,300,000 円	－円
期中一部交換元本額	99,370,000 円	290,782,500 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,945,334 口	1,712,708 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145,916,686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 6,776,800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 7,487,600円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	第5期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(34,748,810円)及び分配準備積立金(157,699円)の合計額から、経費(2,003,558円)を控除して計算される分配対象額は32,902,951円(100口当たり1,691円)であり、うち32,876,144円(100口当たり1,690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(27,067,798円)及び分配準備積立金(26,807円)の合計額から、経費(1,955,907円)を控除して計算される分配対象額は25,138,698円(100口当たり1,467円)であり、うち25,005,536円(100口当たり1,460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5期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<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5期 2020年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<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時価との差額はありません。</p>
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 4 期 2019年7月10日現在	第 5 期 2020年1月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	47,501,971	220,469,301
合計	47,501,971	220,469,301

(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 4 期 2019年7月10日現在				第 5 期 2020年1月10日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	4,126,000	—	4,186,500	60,500	18,431,000	—	18,576,000	145,000
合計	4,126,000	—	4,186,500	60,500	18,431,000	—	18,576,000	145,000

(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5期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第4期 2019年7月10日現在	第5期 2020年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,174.99円	1,309.61円
(100口当たり純資産額)	(117,499円)	(130,961円)