

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 近藤龍一郎

平成 29 年 7 月期（平成 29 年 1 月 21 日～平成 29 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 29 年 7 月期（平成 29 年 1 月 21 日～平成 29 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29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	651	(99.2)	5	(0.8)	656	(100.0)
29年 1月期	585	(99.6)	2	(0.4)	587	(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
29年 7月期	19	—	—	19
29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
29年 7月期	662	6	656	33,717
29年 1月期	592	4	587	30,189

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	282
29年 1月期	213

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,094,498	7,502,558
株式 ※2	585,507,200	651,094,900
派生商品評価勘定	3,892	83,076
未収入金	60,568	61,902
未収配当金	3,764,500	3,852,000
流動資産合計	592,430,658	662,594,436
資産合計	592,430,658	662,594,436
負債の部		
流動負債		
前受金	57,000	89,700
未払金	216	—
未払収益分配金	4,145,619	5,488,566
未払受託者報酬	158,590	168,556
未払委託者報酬	412,430	438,328
その他未払費用	87,833	166,303
流動負債合計	4,861,688	6,351,453
負債合計	4,861,688	6,351,453
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 (△)	258,449,640	327,123,653
(分配準備積立金)	3,776,923	3,854,776
元本等合計	587,568,970	656,242,983
純資産合計	587,568,970	656,242,983
負債純資産合計	592,430,658	662,594,436

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	4,969,400	6,268,750
有価証券売買等損益	△26,524,541	68,120,552
派生商品取引等損益	635,282	475,608
その他収益	75	15
営業収益合計	△20,919,784	74,864,925
営業費用		
支払利息	733	1,204
受託者報酬	158,590	168,556
委託者報酬	412,430	438,328
その他費用	88,661	94,258
営業費用合計	660,414	702,346
営業利益又は営業損失 (△)	△21,580,198	74,162,579
経常利益又は経常損失 (△)	△21,580,198	74,162,579
当期純利益又は当期純損失 (△)	△21,580,198	74,162,579
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	284,175,457	258,449,640
分配金 ※1	4,145,619	5,488,566
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	258,449,640	327,123,653

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 47,115,000 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 50,412,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第17期	第18期
	自 平成28年7月21日 至 平成29年1月20日	自 平成29年1月21日 至 平成29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（4,968,742円）及び分配準備積立金（3,613,481円）の合計額から、経費（659,681円）を控除して計算される分配対象額は7,922,542円（1口当たり407円）であり、うち4,145,619円（1口当たり213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（6,267,561円）及び分配準備積立金（3,776,923円）の合計額から、経費（701,142円）を控除して計算される分配対象額は9,343,342円（1口当たり480円）であり、うち5,488,566円（1口当たり282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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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18期 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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	△26,150,338	68,177,073
合計	△26,150,338	68,177,073

(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17期 平成29年1月20日 現在				第18期 平成29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)
株価指数 先物取引								
買 建	1,532,500	—	1,536,500	4,000	4,805,100	—	4,888,500	83,400
合計	1,532,500	—	1,536,500	4,000	4,805,100	—	4,888,500	83,400

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

第 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	30, 189 円	33, 717 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	232	(99.2)	1	(0.8)	234	(100.0)
29年 1月期	246	(99.4)	1	(0.6)	247	(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
29年 7月期	19	—	—	19
29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
29年 7月期	242	7	234	12,222
29年 1月期	250	2	247	12,903

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	153
29年 1月期	126

(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17期	第18期
	平成29年1月20日現在	平成29年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,110,625	3,388,495
株式 ※3	246,057,900	232,749,160
派生商品評価勘定	60,592	28,142
未収入金	2,292,464	5,987,214
未収配当金	851,500	248,600
流動資産合計	250,373,081	242,401,611
資産合計	250,373,081	242,401,611
負債の部		
流動負債		
前受金	55,700	40,500
未払金	—	4,545,800
未払収益分配金	2,418,444	2,936,682
未払受託者報酬	55,861	64,618
未払委託者報酬	145,311	168,075
その他未払費用	30,878	61,411
流動負債合計	2,706,194	7,817,086
負債合計	2,706,194	7,817,086
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	340,904,634	340,904,634
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△93,237,747	△106,320,109
(分配準備積立金)	866,550	254,201
元本等合計	247,666,887	234,584,525
純資産合計	247,666,887	234,584,525
負債純資産合計	250,373,081	242,401,611

(2) 損益及び剰余金計算書

	第17期	第18期
	自平成28年7月21日 至平成29年1月20日	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,888,300	2,593,400
有価証券売買等損益	67,619,025	△12,589,219
派生商品取引等損益	327,910	119,206
その他収益	1	1
営業収益合計	70,835,236	△9,876,612
営業費用		
支払利息	200	344
受託者報酬	55,861	64,618
委託者報酬	145,311	168,075
その他費用	31,123	36,031
営業費用合計	232,495	269,068
営業利益又は営業損失(△)	70,602,741	△10,145,680
経常利益又は経常損失(△)	70,602,741	△10,145,680
当期純利益又は当期純損失(△)	70,602,741	△10,145,680
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△161,422,044	△93,237,747
分配金 ※1	2,418,444	2,936,682
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△93,237,747	△106,320,109

(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18期	
	自 平成29年1月21日	至 平成29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17期	第18期
	平成29年1月20日現在	平成29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	－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	19,194 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93,237,747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106,320,109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 11,015,000 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 10,441,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第17期	第18期
	自 平成28年7月21日 至 平成29年1月20日	自 平成29年1月21日 至 平成29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（2,888,101円）及び分配準備積立金（629,188円）の合計額から、経費（232,295円）を控除して計算される分配対象額は3,284,994円（1口当たり171円）であり、うち2,418,444円（1口当たり126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（2,593,057円）及び分配準備積立金（866,550円）の合計額から、経費（268,724円）を控除して計算される分配対象額は3,190,883円（1口当たり166円）であり、うち2,936,682円（1口当たり153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18期
	自 平成29年1月21日 至 平成29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18期 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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	66,704,076	△12,369,363
合計	66,704,076	△12,369,363

(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17期 平成29年1月20日 現在				第18期 平成29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	1,475,800	—	1,536,500	60,700	1,601,250	—	1,629,500	28,250
合計	1,475,800	—	1,536,500	60,700	1,601,250	—	1,629,500	28,250

(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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29年7月20日現在
1口当たり純資産額	12,903円	12,222円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	1,427	(99.4)	8	(0.6)	1,435	(100.0)
29年 1月期	1,262	(99.4)	7	(0.6)	1,269	(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
29年 7月期	53	—	—	53
29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
29年 7月期	1,454	18	1,435	27,053
29年 1月期	1,280	11	1,269	23,919

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	316
29年 1月期	182

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,823,393	25,046,940
株式 ※2	1,262,294,250	1,427,543,800
派生商品評価勘定	214,568	133,960
未収入金	51,034	191,454
未収配当金	1,197,900	1,357,800
流動資産合計	1,280,581,145	1,454,273,954
資産合計	1,280,581,145	1,454,273,954
負債の部		
流動負債		
前受金	243,750	234,000
未払収益分配金	9,658,558	16,769,804
未払受託者報酬	319,539	354,662
未払委託者報酬	830,881	922,162
その他未払費用	177,215	343,807
流動負債合計	11,229,943	18,624,435
負債合計	11,229,943	18,624,435
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 (△)	522,988,786	689,287,103
(分配準備積立金)	1,212,002	1,365,563
元本等合計	1,269,351,202	1,435,649,519
純資産合計	1,269,351,202	1,435,649,519
負債純資産合計	1,280,581,145	1,454,273,954

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	10,976,500	18,401,700
有価証券売買等損益	123,959,808	165,167,118
派生商品取引等損益	1,072,798	977,638
その他収益	194	103
営業収益合計	136,009,300	184,546,559
営業費用		
支払利息	2,590	3,133
受託者報酬	319,539	354,662
委託者報酬	830,881	922,162
その他費用	178,775	198,481
営業費用合計	1,331,785	1,478,438
営業利益	134,677,515	183,068,121
経常利益	134,677,515	183,068,121
当期純利益	134,677,515	183,068,121
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	397,969,829	522,988,786
分配金 ※1	9,658,558	16,769,804
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	522,988,786	689,287,103

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 15,145,500 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 17,511,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第17期	第18期
	自 平成28年7月21日 至 平成29年1月20日	自 平成29年1月21日 至 平成29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 （10,974,104円）及び分配準備積立金（1,225,651円）の合計額から、経費（1,329,195円）を控除して計算される分配対象額は10,870,560円（1口当たり204円）であり、うち9,658,558円（1口当たり182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 （18,398,670円）及び分配準備積立金（1,212,002円）の合計額から、経費（1,475,305円）を控除して計算される分配対象額は18,135,367円（1口当たり341円）であり、うち16,769,804円（1口当たり316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18期
	自 平成29年1月21日 至 平成29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18期
	平成29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17期	第18期
	平成29年1月20日現在	平成29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	124,092,542	164,624,904
合計	124,092,542	164,624,904

(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17期				第18期			
	平成29年1月20日 現在				平成29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	5,931,000	—	6,146,000	215,000	8,013,000	—	8,147,500	134,500
合計	5,931,000	—	6,146,000	215,000	8,013,000	—	8,147,500	134,500

(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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	23,919 円	27,053 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	940	(99.5)	5	(0.5)	945	(100.0)
29年 1月期	809	(99.5)	3	(0.5)	813	(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
29年 7月期	37	—	—	37
29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
29年 7月期	953	8	945	25,480
29年 1月期	819	6	813	21,922

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	190
29年 1月期	144

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,328,677	11,575,386
株式 ※2	809,722,510	940,486,440
派生商品評価勘定	119,284	85,326
未収入金	169,602	109,036
未収配当金	1,597,100	1,511,700
流動資産合計	819,937,173	953,767,888
資産合計	819,937,173	953,767,888
負債の部		
流動負債		
前受金	273,750	128,550
未払収益分配金	5,343,696	7,050,710
未払受託者報酬	199,611	231,141
未払委託者報酬	519,068	601,022
その他未払費用	110,704	220,119
流動負債合計	6,446,829	8,231,542
負債合計	6,446,829	8,231,542
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 (△)	317,751,213	449,797,215
(分配準備積立金)	1,622,814	1,514,936
元本等合計	813,490,344	945,536,346
純資産合計	813,490,344	945,536,346
負債純資産合計	819,937,173	953,767,888

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	6,550,750	7,905,840
有価証券売買等損益	135,886,728	131,513,130
派生商品取引等損益	1,100,150	640,750
その他収益	32	32
営業収益合計	143,537,660	140,059,752
営業費用		
支払利息	1,126	1,583
受託者報酬	199,611	231,141
委託者報酬	519,068	601,022
その他費用	111,625	129,294
営業費用合計	831,430	963,040
営業利益	142,706,230	139,096,712
経常利益	142,706,230	139,096,712
当期純利益	142,706,230	139,096,712
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	180,388,679	317,751,213
分配金 ※1	5,343,696	7,050,710
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	317,751,213	449,797,215

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 12,382,000 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 14,343,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 （6,549,656 円）及び分配準備積立金（1,247,158 円）の合計額から、経費（830,304 円）を控除して計算される分配対象額は 6,966,510 円（1 口当たり 187 円）であり、うち 5,343,696 円（1 口当たり 144 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 （7,904,289 円）及び分配準備積立金（1,622,814 円）の合計額から、経費（961,457 円）を控除して計算される分配対象額は 8,565,646 円（1 口当たり 230 円）であり、うち 7,050,710 円（1 口当たり 190 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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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18期 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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	135,139,170	131,309,835
合計	135,139,170	131,309,835

(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17期 平成29年1月20日 現在				第18期 平成29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)
株価指数 先物取引								
買 建	2,953,500	—	3,073,000	119,500	4,802,850	—	4,888,500	85,650
合計	2,953,500	—	3,073,000	119,500	4,802,850	—	4,888,500	85,650

(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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	21,922 円	25,480 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	573	(99.1)	5	(0.9)	579	(100.0)
29年 1月期	547	(99.1)	5	(0.9)	552	(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
29年 7月期	28	—	—	28
29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
29年 7月期	585	6	579	20,509
29年 1月期	559	6	552	19,580

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	199
29年 1月期	193

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,351,840	10,606,914
株式 ※2	547,767,550	573,974,650
派生商品評価勘定	155,676	98,676
未収入金	49,284	66,568
未収配当金	829,600	847,000
流動資産合計	559,153,950	585,593,808
資産合計	559,153,950	585,593,808
負債の部		
流動負債		
前受金	188,000	125,000
未払収益分配金	5,449,934	5,619,362
未払受託者報酬	149,747	152,914
未払委託者報酬	389,423	397,650
その他未払費用	82,915	153,519
流動負債合計	6,260,019	6,448,445
負債合計	6,260,019	6,448,445
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 (△)	181,733,659	207,985,091
(分配準備積立金)	844,626	871,531
元本等合計	552,893,931	579,145,363
純資産合計	552,893,931	579,145,363
負債純資産合計	559,153,950	585,593,808

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	6,104,300	6,284,150
有価証券売買等損益	△27,621,328	25,697,637
派生商品取引等損益	880,364	526,890
営業収益合計	△20,636,664	32,508,677
営業費用		
支払利息	1,506	1,826
受託者報酬	149,747	152,914
委託者報酬	389,423	397,650
その他費用	83,697	85,493
営業費用合計	624,373	637,883
営業利益又は営業損失 (△)	△21,261,037	31,870,794
経常利益又は経常損失 (△)	△21,261,037	31,870,794
当期純利益又は当期純損失 (△)	△21,261,037	31,870,794
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	208,444,630	181,733,659
分配金 ※1	5,449,934	5,619,362
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	181,733,659	207,985,091

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 14,060,000 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 15,654,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第17期	第18期
	自 平成28年7月21日 至 平成29年1月20日	自 平成29年1月21日 至 平成29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 （6,102,794円）及び分配準備積立金（814,633円）の合計額から、経費（622,867円）を控除して計算される分配対象額は 6,294,560円（1口当たり222円）であり、うち5,449,934円（1口当たり193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 （6,282,324円）及び分配準備積立金（844,626円）の合計額から、経費（636,057円）を控除して計算される分配対象額は 6,490,893円（1口当たり229円）であり、うち5,619,362円（1口当たり199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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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18期
	平成29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17期	第18期
	平成29年1月20日現在	平成29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	△27,204,480	26,011,182
合計	△27,204,480	26,011,182

(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17期				第18期			
	平成29年1月20日 現在				平成29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	4,453,500	—	4,609,500	156,000	4,789,500	—	4,888,500	99,000
合計	4,453,500	—	4,609,500	156,000	4,789,500	—	4,888,500	99,000

(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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	19,580 円	20,509 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	714	(99.6)	3	(0.4)	717	(100.0)
29年 1月期	734	(99.4)	4	(0.6)	738	(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
29年 7月期	33	—	—	33
29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
29年 7月期	729	12	717	21,554
29年 1月期	748	9	738	22,199

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	319
29年 1月期	266

(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17期	第18期
	平成29年1月20日現在	平成29年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,347,370	13,643,243
株式 ※2	734,368,000	714,324,450
派生商品評価勘定	38,376	11,888
未収入金	144,528	117,824
未収配当金	1,769,100	1,858,650
流動資産合計	748,667,374	729,956,055
資産合計	748,667,374	729,956,055
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	324	—
前受金	166,500	89,520
未払金	—	933,408
未払収益分配金	8,853,810	10,617,915
未払受託者報酬	183,490	190,696
未払委託者報酬	477,142	495,867
その他未払費用	101,757	190,141
流動負債合計	9,783,023	12,517,547
負債合計	9,783,023	12,517,547
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(△)	244,102,826	222,656,983
(分配準備積立金)	1,799,491	1,891,423
元本等合計	738,884,351	717,438,508
純資産合計	738,884,351	717,438,508
負債純資産合計	748,667,374	729,956,055

(2) 損益及び剰余金計算書

	第17期	第18期
	自平成28年7月21日 至平成29年1月20日	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	9,616,250	11,505,133
有価証券売買等損益	128,206,715	△21,914,517
派生商品取引等損益	1,535,808	376,742
その他収益	7	—
営業収益合計	139,358,780	△10,032,642
営業費用		
支払利息	1,532	2,072
受託者報酬	183,490	190,696
委託者報酬	477,142	495,867
その他費用	102,592	106,651
営業費用合計	764,756	795,286
営業利益又は営業損失(△)	138,594,024	△10,827,928
経常利益又は経常損失(△)	138,594,024	△10,827,928
当期純利益又は当期純損失(△)	138,594,024	△10,827,928
期首剰余金又は期首欠損金(△)	114,362,612	244,102,826
分配金 ※1	8,853,810	10,617,915
期末剰余金又は期末欠損金(△)	244,102,826	222,656,983

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 13,602,000 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 12,300,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第17期	第18期
	自 平成28年7月21日 至 平成29年1月20日	自 平成29年1月21日 至 平成29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                      (9,614,725円)及び分配準備積立金(1,801,800円)の合計額から、経費(763,224円)を控除して計算される分配対象額は10,653,301円(1口当たり320円)であり、うち8,853,810円(1口当たり266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                      (11,503,061円)及び分配準備積立金(1,799,491円)の合計額から、経費(793,214円)を控除して計算される分配対象額は12,509,338円(1口当たり375円)であり、うち10,617,915円(1口当たり319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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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18期 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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	127,078,394	△20,618,919
合計	127,078,394	△20,618,919

(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17期 平成29年1月20日 現在				第18期 平成29年7月20日 現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
	うち 1年超				うち 1年超			
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	4,359,300	—	4,398,000	38,700	2,957,680	—	2,970,000	12,320
合計	4,359,300	—	4,398,000	38,700	2,957,680	—	2,970,000	12,320

(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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29年7月20日現在
1口当たり純資産額	22,199円	21,554円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	250	(99.7)	0	(0.3)	251	(100.0)
29年 1月期	237	(99.7)	0	(0.3)	238	(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
29年 7月期	10	—	—	10
29年 1月期	10	6	6	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
29年 7月期	254	3	251	23,246
29年 1月期	239	0	238	22,054

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	255
29年 1月期	59

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,672,584	3,686,255
株式 ※3	237,461,700	250,488,000
未収入金	29,284	58,168
未収配当金	16,500	2,300
流動資産合計	239,180,068	254,234,723
資産合計	239,180,068	254,234,723
負債の部		
流動負債		
前受金	29,500	37,600
未払収益分配金	637,436	2,755,020
未払受託者報酬	56,905	64,021
未払委託者報酬	148,025	166,557
その他未払費用	31,453	61,561
流動負債合計	903,319	3,084,759
負債合計	903,319	3,084,759
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	△131,684,623	△118,811,408
(分配準備積立金)	26,311	10,866
元本等合計	238,276,749	251,149,964
純資産合計	238,276,749	251,149,964
負債純資産合計	239,180,068	254,234,723

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	892,150	3,006,100
有価証券売買等損益	51,261,980	12,731,174
派生商品取引等損益	141,168	157,486
その他収益	9	9
営業収益合計	52,295,307	15,894,769
営業費用		
支払利息	159	243
受託者報酬	56,905	64,021
委託者報酬	148,025	166,557
その他費用	31,706	35,713
営業費用合計	236,795	266,534
営業利益	52,058,512	15,628,235
経常利益	52,058,512	15,628,235
当期純利益	52,058,512	15,628,235
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△184,305,816	△131,684,623
剰余金増加額又は欠損金減少額	93,013,685	—
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	93,013,685	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	91,813,568	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	91,813,568	—
分配金 ※1	637,436	2,755,020
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△131,684,623	△118,811,408

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	369,995,615 円	369,961,372 円
期中追加設定元本額	237,783,392 円	—円
期中一部交換元本額	237,817,635 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 131,684,623 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 118,811,408 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 18,584,000 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 18,694,500 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 (892,000 円) 及び分配準備積立金(8,383 円)の合計額から、経費(236,636 円)を控除して計算される分配対象額は 663,747 円 (1 口当たり 61 円) であり、うち 637,436 円 (1 口当たり 59 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 (3,005,866 円) 及び分配準備積立金(26,311 円)の合計額から、経費(266,291 円)を控除して計算される分配対象額は 2,765,886 円 (1 口当たり 256 円) であり、うち 2,755,020 円 (1 口当たり 255 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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 18 期
	平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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	36,314,573	12,756,281
合計	36,314,573	12,756,281

(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 17 期	第 18 期
平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 18 期
自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	22,054 円	23,246 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	679	(99.8)	1	(0.2)	680	(100.0)
29年 1月期	626	(99.5)	3	(0.5)	629	(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
29年 7月期	19	—	—	19
29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
29年 7月期	687	6	680	35,752
29年 1月期	634	5	629	33,076

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	326
29年 1月期	222

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,792,212	1,702,744
株式	626,502,150	679,217,050
派生商品評価勘定	119,584	—
未収入金	135,402	6,017,853
未収配当金	859,550	629,800
差入委託証拠金	330,000	—
流動資産合計	634,738,898	687,567,447
資産合計	634,738,898	687,567,447
負債の部		
流動負債		
前受金	239,850	—
未払収益分配金	4,225,992	6,205,736
未払受託者報酬	153,299	173,507
未払委託者報酬	398,674	451,195
その他未払費用	84,996	166,734
流動負債合計	5,102,811	6,997,172
負債合計	5,102,811	6,997,172
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 (△)	197,575,995	248,510,183
(分配準備積立金)	867,447	638,964
元本等合計	629,636,087	680,570,275
純資産合計	629,636,087	680,570,275
負債純資産合計	634,738,898	687,567,447

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	5,080,050	6,699,700
有価証券売買等損益	119,809,469	50,845,299
派生商品取引等損益	861,142	317,372
その他収益	84	64
営業収益合計	125,750,745	57,862,435
営業費用		
支払利息	810	811
受託者報酬	153,299	173,507
委託者報酬	398,674	451,195
その他費用	85,692	96,998
営業費用合計	638,475	722,511
営業利益	125,112,270	57,139,924
経常利益	125,112,270	57,139,924
当期純利益	125,112,270	57,139,924
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	76,689,717	197,575,995
分配金 ※1	4,225,992	6,205,736
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	197,575,995	248,510,183

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第17期	第18期
	自 平成28年7月21日 至 平成29年1月20日	自 平成29年1月21日 至 平成29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 （5,079,324円）及び分配準備積立金（651,780円）の合計額から、経費（637,665円）を控除して計算される分配対象額は 5,093,439円（1口当たり267円）であり、うち4,225,992円（1口当たり222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 （6,698,953円）及び分配準備積立金（867,447円）の合計額から、経費（721,700円）を控除して計算される分配対象額は 6,844,700円（1口当たり359円）であり、うち6,205,736円（1口当たり326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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第18期 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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	119,074,366	51,253,776
合計	119,074,366	51,253,776

(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17期 平成29年1月20日 現在				第18期 平成29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)
株価指数 先物取引								
買 建	2,953,200	—	3,073,000	119,800	—	—	—	—
合計	2,953,200	—	3,073,000	119,800	—	—	—	—

(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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	33,076 円	35,752 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	1,687	(99.8)	3	(0.2)	1,690	(100.0)
29年 1月期	1,476	(99.7)	3	(0.3)	1,480	(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
29年 7月期	95	—	—	95
29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
29年 7月期	1,704	13	1,690	17,779
29年 1月期	1,491	10	1,480	15,572

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	122
29年 1月期	94

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,278,057	12,897,501
株式 ※2	1,476,988,150	1,687,108,000
派生商品評価勘定	63,734	41,284
未収入金	6,956,303	2,087,675
未収配当金	2,120,000	2,158,200
流動資産合計	1,491,406,244	1,704,292,660
資産合計	1,491,406,244	1,704,292,660
負債の部		
流動負債		
前受金	109,650	150,000
未払収益分配金	8,938,836	11,601,468
未払受託者報酬	365,905	418,128
未払委託者報酬	951,419	1,087,184
その他未払費用	203,050	400,546
流動負債合計	10,568,860	13,657,326
負債合計	10,568,860	13,657,326
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 (△)	193,740,094	403,538,044
(分配準備積立金)	2,202,297	2,188,222
元本等合計	1,480,837,384	1,690,635,334
純資産合計	1,480,837,384	1,690,635,334
負債純資産合計	1,491,406,244	1,704,292,660

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	10,480,860	13,397,284
有価証券売買等損益	239,154,312	209,029,329
派生商品取引等損益	1,254,258	782,696
その他収益	24	11
営業収益合計	250,889,454	223,209,320
営業費用		
支払利息	1,157	1,740
受託者報酬	365,905	418,128
委託者報酬	951,419	1,087,184
その他費用	204,741	302,850
営業費用合計	1,523,222	1,809,902
営業利益	249,366,232	221,399,418
経常利益	249,366,232	221,399,418
当期純利益	249,366,232	221,399,418
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△46,687,302	193,740,094
分配金 ※1	8,938,836	11,601,468
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	193,740,094	403,538,044

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 18,958,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 22,484,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 （10,479,727 円）及び分配準備積立金（2,183,471 円）の合計額から、経費（1,522,065 円）を控除して計算される分配対象額は 11,141,133 円（1 口当たり 117 円）であり、うち 8,938,836 円（1 口当たり 94 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 （13,395,555 円）及び分配準備積立金（2,202,297 円）の合計額から、経費（1,808,162 円）を控除して計算される分配対象額は 13,789,690 円（1 口当たり 145 円）であり、うち 11,601,468 円（1 口当たり 122 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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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18期
	平成29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17期	第18期
	平成29年1月20日現在	平成29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	236,874,328	208,590,089
合計	236,874,328	208,590,089

(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17期				第18期			
	平成29年1月20日 現在				平成29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	3,009,050	—	3,073,000	63,950	3,217,500	—	3,259,000	41,500
合計	3,009,050	—	3,073,000	63,950	3,217,500	—	3,259,000	41,500

(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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	15,572 円	17,779 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	676	(99.8)	1	(0.2)	677	(100.0)
29年 1月期	605	(99.8)	1	(0.2)	607	(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
29年 7月期	32	—	—	32
29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
29年 7月期	684	6	677	21,000
29年 1月期	611	4	607	18,815

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	179
29年 1月期	121

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,617,820	2,252,571
株式 ※2	605,763,200	676,419,000
未収入金	3,643,601	5,119,560
未収配当金	601,598	320,496
流動資産合計	611,626,219	684,111,627
資産合計	611,626,219	684,111,627
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,904,065	5,775,435
未払受託者報酬	155,141	169,274
未払委託者報酬	403,441	440,209
その他未払費用	85,957	165,159
流動負債合計	4,548,604	6,550,077
負債合計	4,548,604	6,550,077
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 (△)	235,062,165	305,546,100
(分配準備積立金)	602,018	334,895
元本等合計	607,077,615	677,561,550
純資産合計	607,077,615	677,561,550
負債純資産合計	611,626,219	684,111,627

(2) 損益及び剰余金計算書

	第17期	第18期
	自平成28年7月21日 至平成29年1月20日	自平成29年1月21日 至平成29年7月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	4,718,598	6,188,930
有価証券売買等損益	38,509,916	70,425,802
派生商品取引等損益	471,320	325,256
その他収益	187	24,203
営業収益合計	43,700,021	76,964,191
営業費用		
支払利息	486	703
受託者報酬	155,141	169,274
委託者報酬	403,441	440,209
その他費用	86,725	94,635
営業費用合計	645,793	704,821
営業利益	43,054,228	76,259,370
経常利益	43,054,228	76,259,370
当期純利益	43,054,228	76,259,370
期首剰余金又は期首欠損金(△)	195,912,002	235,062,165
分配金 ※1	3,904,065	5,775,435
期末剰余金又は期末欠損金(△)	235,062,165	305,546,100

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 1,865,200 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 2,010,100 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第17期	第18期
	自 平成28年7月21日 至 平成29年1月20日	自 平成29年1月21日 至 平成29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 （4,718,299円）及び分配準備積立金（433,091円）の合計額から、経費（645,307円）を控除して計算される分配対象額は 4,506,083円（1口当たり139円）であり、うち3,904,065円（1口当たり121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 （6,212,430円）及び分配準備積立金（602,018円）の合計額から、経費（704,118円）を控除して計算される分配対象額は 6,110,330円（1口当たり189円）であり、うち5,775,435円（1口当たり179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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第18期 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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	34,977,156	69,113,539
合計	34,977,156	69,113,539

(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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29年7月20日現在
1口当たり純資産額	18,815円	21,000円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	241	(99.3)	1	(0.7)	243	(100.0)
29年 1月期	240	(99.4)	1	(0.6)	242	(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
29年 7月期	32	—	—	32
29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
29年 7月期	246	2	243	7,504
29年 1月期	244	1	242	7,466

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	74
29年 1月期	47

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,191,701	4,445,453
株式 ※3	240,934,050	241,829,400
派生商品評価勘定	59,792	32,892
未収入金	56,684	18,534
未収配当金	11,700	14,200
流動資産合計	244,253,927	246,340,479
資産合計	244,253,927	246,340,479
負債の部		
流動負債		
前受金	109,800	34,750
未払収益分配金	1,525,855	2,402,410
未払受託者報酬	60,016	64,067
未払委託者報酬	156,103	166,626
その他未払費用	33,152	62,949
流動負債合計	1,884,926	2,730,802
負債合計	1,884,926	2,730,802
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	△167,404,229	△166,163,553
(分配準備積立金)	22,565	16,055
元本等合計	242,369,001	243,609,677
純資産合計	242,369,001	243,609,677
負債純資産合計	244,253,927	246,340,479

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,767,800	2,662,800
有価証券売買等損益	24,919,227	1,120,834
派生商品取引等損益	409,536	126,352
営業収益合計	27,096,563	3,909,986
営業費用		
支払利息	413	492
受託者報酬	60,016	64,067
委託者報酬	156,103	166,626
その他費用	33,446	35,715
営業費用合計	249,978	266,900
営業利益	26,846,585	3,643,086
経常利益	26,846,585	3,643,086
当期純利益	26,846,585	3,643,086
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△192,724,959	△167,404,229
分配金 ※1	1,525,855	2,402,410
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△167,404,229	△166,163,553

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 167,404,229 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 166,163,553 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 4,240,500 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 4,370,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 (1,767,387 円) 及び分配準備積立金(30,598 円)の合計額から、経費(249,565 円)を控除して計算される分配対象額は 1,548,420 円(1 口当たり 47 円)であり、うち 1,525,855 円(1 口当たり 47 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 (2,662,308 円) 及び分配準備積立金(22,565 円)の合計額から、経費(266,408 円)を控除して計算される分配対象額は 2,418,465 円(1 口当たり 74 円)であり、うち 2,402,410 円(1 口当たり 74 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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 18 期
	平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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	24,788,457	1,115,358
合計	24,788,457	1,115,358

(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 17 期				第 18 期			
	平成 29 年 1 月 20 日 現在				平成 29 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	1,476,600	—	1,536,500	59,900	1,596,500	—	1,629,500	33,000
合計	1,476,600	—	1,536,500	59,900	1,596,500	—	1,629,500	33,000

(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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	7,466 円	7,504 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	415	(99.5)	2	(0.5)	417	(100.0)
29年 1月期	411	(99.6)	1	(0.4)	412	(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
29年 7月期	24	—	—	24
29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
29年 7月期	421	3	417	17,207
29年 1月期	414	1	412	16,995

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	116
29年 1月期	59

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,547,347	5,378,067
株式 ※2	411,135,400	415,893,200
派生商品評価勘定	60,142	29,692
未収入金	57,284	64,168
未収配当金	8,200	3,500
流動資産合計	414,808,373	421,368,627
資産合計	414,808,373	421,368,627
負債の部		
流動負債		
前受金	110,500	65,400
未払収益分配金	1,433,228	2,817,872
未払受託者報酬	103,118	109,556
未払委託者報酬	268,168	284,861
その他未払費用	57,060	108,012
流動負債合計	1,972,074	3,385,701
負債合計	1,972,074	3,385,701
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 (△)	63,371,587	68,518,214
(分配準備積立金)	9,252	15,978
元本等合計	412,836,299	417,982,926
純資産合計	412,836,299	417,982,926
負債純資産合計	414,808,373	421,368,627

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,812,875	3,240,675
有価証券売買等損益	19,273,031	4,824,097
派生商品取引等損益	397,794	315,804
その他収益	45,659	40,158
営業収益合計	21,529,359	8,420,734
営業費用		
支払利息	456	638
受託者報酬	103,118	109,556
委託者報酬	268,168	284,861
その他費用	57,591	61,180
営業費用合計	429,333	456,235
営業利益	21,100,026	7,964,499
経常利益	21,100,026	7,964,499
当期純利益	21,100,026	7,964,499
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	43,704,789	63,371,587
分配金 ※1	1,433,228	2,817,872
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	63,371,587	68,518,214

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 4,006,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 3,935,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 (1,858,078 円) 及び分配準備積立金(13,279 円)の合計額から、経費(428,877 円)を控除して計算される分配対象額は 1,442,480 円(1 口当たり 59 円)であり、うち 1,433,228 円(1 口当たり 59 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 (3,280,195 円) 及び分配準備積立金(9,252 円)の合計額から、経費(455,597 円)を控除して計算される分配対象額は 2,833,850 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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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18期
	平成29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17期	第18期
	平成29年1月20日現在	平成29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	19,857,672	5,024,234
合計	19,857,672	5,024,234

(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17期				第18期			
	平成29年1月20日 現在				平成29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	1,476,250	—	1,536,500	60,250	1,599,700	—	1,629,500	29,800
合計	1,476,250	—	1,536,500	60,250	1,599,700	—	1,629,500	29,800

(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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	16,995 円	17,207 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	729	(100.0)	0	(0.0)	729	(100.0)
29年 1月期	686	(99.9)	1	(0.1)	687	(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
29年 7月期	22	—	—	22
29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
29年 7月期	741	11	729	32,749
29年 1月期	695	8	687	30,841

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	467
29年 1月期	364

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,678,717	7,356,781
株式 ※2	686,111,530	729,344,140
未収入金	—	4,142,319
未収配当金	155,700	160,450
流動資産合計	695,945,947	741,003,690
資産合計	695,945,947	741,003,690
負債の部		
流動負債		
前受金	—	87,450
未払収益分配金	8,109,920	10,404,760
未払受託者報酬	168,738	188,771
未払委託者報酬	438,831	490,905
その他未払費用	93,585	182,346
流動負債合計	8,811,074	11,354,232
負債合計	8,811,074	11,354,232
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 (△)	58,370,993	100,885,578
(分配準備積立金)	156,115	169,407
元本等合計	687,134,873	729,649,458
純資産合計	687,134,873	729,649,458
負債純資産合計	695,945,947	741,003,690

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	8,825,236	11,204,070
有価証券売買等損益	123,238,233	42,169,605
派生商品取引等損益	—	331,688
その他収益	133	84
営業収益合計	132,063,602	53,705,447
営業費用		
支払利息	976	869
受託者報酬	168,738	188,771
委託者報酬	438,831	490,905
その他費用	94,351	105,557
営業費用合計	702,896	786,102
営業利益	131,360,706	52,919,345
経常利益	131,360,706	52,919,345
当期純利益	131,360,706	52,919,345
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△64,879,793	58,370,993
分配金 ※1	8,109,920	10,404,760
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	58,370,993	100,885,578

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 4,206,500 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 4,039,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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                      (8,824,393 円) 及び分配準備積立金(143,562 円)の合計額から、経費(701,920 円)を控除して計算される分配対象額は                      8,266,035 円 (1 口当たり 371 円) であり、うち 8,109,920 円 (1 口当たり 364 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                      (11,203,285 円) 及び分配準備積立金(156,115 円)の合計額から、経費(785,233 円)を控除して計算される分配対象額は                      10,574,167 円 (1 口当たり 474 円) であり、うち 10,404,760 円 (1 口当たり 467 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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 18 期 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 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	123,329,182	41,773,530
合計	123,329,182	41,773,530

(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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	30,841 円	32,749 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	430	(99.5)	2	(0.5)	432	(100.0)
29年 1月期	417	(99.6)	1	(0.4)	418	(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
29年 7月期	21	—	—	21
29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
29年 7月期	436	3	432	19,915
29年 1月期	422	3	418	19,290

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	134
29年 1月期	118

(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17期	第18期
	平成29年1月20日現在	平成29年7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,737,993	5,428,281
株式 ※2	417,100,000	430,262,700
派生商品評価勘定	34,740	27,492
未収入金	59,570	66,768
未収配当金	152,850	263,800
流動資産合計	422,085,153	436,049,041
資産合計	422,085,153	436,049,041
負債の部		
流動負債		
前受金	89,850	65,300
未払収益分配金	2,562,960	2,910,480
未払受託者報酬	108,502	115,061
未払委託者報酬	282,169	299,227
その他未払費用	60,075	113,575
流動負債合計	3,103,556	3,503,643
負債合計	3,103,556	3,503,643
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 (△)	187,077,157	200,640,958
(分配準備積立金)	155,665	269,555
元本等合計	418,981,597	432,545,398
純資産合計	418,981,597	432,545,398
負債純資産合計	422,085,153	436,049,041

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,926,695	3,503,300
有価証券売買等損益	23,246,248	13,126,973
派生商品取引等損益	704,346	322,938
その他収益	511	429
営業収益合計	26,877,800	16,953,640
営業費用		
支払利息	588	807
受託者報酬	108,502	115,061
委託者報酬	282,169	299,227
その他費用	60,610	64,264
営業費用合計	451,869	479,359
営業利益	26,425,931	16,474,281
経常利益	26,425,931	16,474,281
当期純利益	26,425,931	16,474,281
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	163,214,186	187,077,157
分配金 ※1	2,562,960	2,910,480
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	187,077,157	200,640,958

(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18期	
	自 平成29年1月21日	至 平成29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17期	第18期
	平成29年1月20日現在	平成29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 464,700 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 444,900 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第17期	第18期
	自 平成28年7月21日 至 平成29年1月20日	自 平成29年1月21日 至 平成29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                      (2,926,618円)及び分配準備積立金(243,288円)の合計額から、経費(451,281円)を控除して計算される分配対象額は                      2,718,625円(1口当たり125円)であり、うち2,562,960円(1口当たり118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                      (3,502,922円)及び分配準備積立金(155,665円)の合計額から、経費(478,552円)を控除して計算される分配対象額は                      3,180,035円(1口当たり146円)であり、うち2,910,480円(1口当たり134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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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18期 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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	23,364,759	13,075,065
合計	23,364,759	13,075,065

(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17期 平成29年1月20日 現在				第18期 平成29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)
株価指数 先物取引								
買 建	1,501,650	—	1,536,500	34,850	1,601,900	—	1,629,500	27,600
合計	1,501,650	—	1,536,500	34,850	1,601,900	—	1,629,500	27,600

(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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	19,290 円	19,915 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	638	(98.6)	9	(1.4)	648	(100.0)
29年 1月期	652	(97.4)	17	(2.6)	669	(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
29年 7月期	54	—	—	54
29年 1月期	54	—	—	54

#### (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
29年 7月期	657	9	648	11,903
29年 1月期	678	9	669	12,303

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	156
29年 1月期	149

(注)分配金は売買単位当たりの金額

### 2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無  
 ② ①以外の変更 無

II 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	26,266,107	17,322,643
株式 ※3	652,253,410	638,733,890
派生商品評価勘定	260,028	144,460
未収入金	111,136	1,383,132
未収配当金	105,000	88,000
流動資産合計	678,995,681	657,672,125
資産合計	678,995,681	657,672,125
負債の部		
流動負債		
前受金	312,000	252,000
未払収益分配金	8,113,199	8,494,356
未払受託者報酬	157,118	176,076
未払委託者報酬	408,622	457,889
その他未払費用	87,137	169,975
流動負債合計	9,078,076	9,550,296
負債合計	9,078,076	9,550,296
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	951,857,931	951,857,931
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	△281,940,326	△303,736,102
(分配準備積立金)	116,143	128,971
元本等合計	669,917,605	648,121,829
純資産合計	669,917,605	648,121,829
負債純資産合計	678,995,681	657,672,125

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	8,787,725	9,243,550
有価証券売買等損益	169,946,197	△21,385,684
派生商品取引等損益	6,185,492	△422,920
その他収益	13	—
営業収益合計	184,919,427	△12,565,054
営業費用		
支払利息	4,174	3,922
受託者報酬	157,118	176,076
委託者報酬	408,622	457,889
その他費用	87,811	98,479
営業費用合計	657,725	736,366
営業利益又は営業損失 (△)	184,261,702	△13,301,420
経常利益又は経常損失 (△)	184,261,702	△13,301,420
当期純利益又は当期純損失 (△)	184,261,702	△13,301,420
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△458,088,829	△281,940,326
分配金 ※1	8,113,199	8,494,356
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△281,940,326	△303,736,102

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	951,857,931 円	951,857,931 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	54,451 口	54,451 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 281,940,326 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 303,736,102 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 5,899,000 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 5,713,500 円

ダイワ上場投信・TOPIX-17 銀行（1648）平成 29 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 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 (8,783,564 円) 及び分配準備積立金(99,329 円)の合計額から、経費(653,551 円)を控除して計算される分配対象額は 8,229,342 円 (1 口当たり 151 円) であり、うち 8,113,199 円 (1 口当たり 149 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 (9,239,628 円) 及び分配準備積立金(116,143 円)の合計額から、経費(732,444 円)を控除して計算される分配対象額は 8,623,327 円 (1 口当たり 158 円) であり、うち 8,494,356 円 (1 口当たり 156 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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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18期 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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	169,186,098	△21,299,647
合計	169,186,098	△21,299,647

(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17期 平成29年1月20日 現在				第18期 平成29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)
株価指数 先物取引								
買 建	16,947,000	—	17,208,000	261,000	9,105,000	—	9,250,000	145,000
合計	16,947,000	—	17,208,000	261,000	9,105,000	—	9,250,000	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 18 期 自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	12,303 円	11,903 円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	362	(99.9)	0	(0.1)	362	(100.0)
29年 1月期	359	(99.8)	0	(0.2)	360	(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
29年 7月期	27	—	—	27
29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
29年 7月期	368	5	362	13,277
29年 1月期	363	3	360	13,186

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	201
29年 1月期	123

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,351,638	6,422,575
株式	359,430,810	362,054,360
流動資産合計	363,782,448	368,476,935
資産合計	363,782,448	368,476,935
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,358,761	5,488,707
未払受託者報酬	84,635	96,521
未払委託者報酬	220,137	251,045
その他未払費用	46,861	92,383
流動負債合計	3,710,394	5,928,656
負債合計	3,710,394	5,928,656
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	△47,457,614	△44,981,389
(分配準備積立金)	26,179	25,059
元本等合計	360,072,054	362,548,279
純資産合計	360,072,054	362,548,279
負債純資産合計	363,782,448	368,476,935

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,720,175	5,889,555
有価証券売買等損益	91,834,879	2,477,345
その他収益	21	6
営業収益合計	95,555,075	8,366,906
営業費用		
支払利息	480	519
受託者報酬	84,635	96,521
委託者報酬	220,137	251,045
その他費用	47,229	53,889
営業費用合計	352,481	401,974
営業利益	95,202,594	7,964,932
経常利益	95,202,594	7,964,932
当期純利益	95,202,594	7,964,932
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△139,301,447	△47,457,614
分配金 ※1	3,358,761	5,488,707
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△47,457,614	△44,981,389

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日	至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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 47,457,614 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 44,981,389 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 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 (3,719,716 円) 及び分配準備積立金(17,225 円)の合計額から、経費(352,001 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 (5,889,042 円) 及び分配準備積立金(26,179 円)の合計額から、経費(401,455 円)を控除し

	て計算される分配対象額は 3,384,940 円（1 口当たり 123 円）であり、うち 3,358,761 円 （1 口当たり 123 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 5,513,766 円（1 口当たり 201 円）であり、うち 5,488,707 円 （1 口当たり 201 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 18 期
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 18 期
	平成 29 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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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	91,428,313	2,480,790
合計	91,428,313	2,480,790

（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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29年7月20日現在
1口当たり純資産額	13,186円	13,277円

# 平成29年7月期（平成29年1月21日～平成29年7月20日）決算短信

平成29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)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年10月13日  
 分配金支払開始日 平成29年 8月28日

## I ファンドの運用状況

### 1. 29年7月期の運用状況（平成29年1月21日～平成29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	%
29年 7月期	265	(99.4)	1	(0.6)	266	(100.0)
29年 1月期	268	(99.4)	1	(0.6)	270	(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
29年 7月期	9	—	—	9
29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
29年 7月期	269	2	266	29,312
29年 1月期	271	1	270	29,664

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 7月期	198
29年 1月期	141

(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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 年 7 月 20 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,830,018	3,364,935
株式	268,281,300	265,189,700
派生商品評価勘定	52,142	31,642
未収入金	47,534	354,765
未収配当金	350,300	179,450
差入委託証拠金	132,000	99,000
流動資産合計	271,693,294	269,219,492
資産合計	271,693,294	269,219,492
負債の部		
流動負債		
前受金	94,500	47,500
未払金	—	219,970
未払収益分配金	1,283,523	1,802,394
未払受託者報酬	68,421	71,119
未払委託者報酬	177,978	185,007
その他未払費用	37,820	70,742
流動負債合計	1,662,242	2,396,732
負債合計	1,662,242	2,396,732
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 (△)	41,909,872	38,701,580
(分配準備積立金)	358,086	181,626
元本等合計	270,031,052	266,822,760
純資産合計	270,031,052	266,822,760
負債純資産合計	271,693,294	269,219,492

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,781,000	1,922,140
有価証券売買等損益	21,658,476	△3,243,568
派生商品取引等損益	415,236	211,736
その他収益	147	65
営業収益合計	23,854,859	△1,109,627
営業費用		
支払利息	373	469
受託者報酬	68,421	71,119
委託者報酬	177,978	185,007
その他費用	38,158	39,676
営業費用合計	284,930	296,271
営業利益又は営業損失 (△)	23,569,929	△1,405,898
経常利益又は経常損失 (△)	23,569,929	△1,405,898
当期純利益又は当期純損失 (△)	23,569,929	△1,405,898
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	19,623,466	41,909,872
分配金 ※1	1,283,523	1,802,394
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	41,909,872	38,701,580

(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 18 期	
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 17 期	第 18 期
	平成 29 年 1 月 20 日現在	平成 29 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の総数	9, 103 口	9, 103 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 17 期	第 18 期
	自 平成 28 年 7 月 21 日 至 平成 29 年 1 月 20 日	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 (1, 780, 774 円) 及び分配準備	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (1, 921, 736 円) 及び分配準備

	積立金(145,392 円)の合計額から、経費(284,557 円)を控除して計算される分配対象額は 1,641,609 円（1 口当たり 180 円）であり、うち 1,283,523 円（1 口当たり 141 円）を分配金額としております。	積立金(358,086 円)の合計額から、経費(295,802 円)を控除して計算される分配対象額は 1,984,020 円（1 口当たり 217 円）であり、うち 1,802,394 円（1 口当たり 198 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 18 期
	自 平成 29 年 1 月 21 日 至 平成 29 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 18 期
	平成 29 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17期 平成29年1月20日現在	第18期 平成29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	21,672,679	△3,458,229
合計	21,672,679	△3,458,229

(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17期 平成29年1月20日 現在				第18期 平成29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	1,484,250	—	1,536,500	52,250	1,597,750	—	1,629,500	31,750
合計	1,484,250	—	1,536,500	52,250	1,597,750	—	1,629,500	31,750

(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18期 自 平成29年1月21日 至 平成29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 17 期 平成 29 年 1 月 20 日現在	第 18 期 平成 29 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	29,664 円	29,312 円