

平成 28 年 8 月 31 日

各 位

委 託 会 社 名 大和証券投資信託委託株式会社
代表者の役職氏名 代表取締役社長 岩本 信之
担当者の役職氏名 経 営 企 画 部 近藤龍一郎
(連絡先 03-5555-4946)

平成 28 年 7 月期 (平成 28 年 1 月 21 日～平成 28 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 28 年 7 月期 (平成 28 年 1 月 21 日～平成 28 年 7 月 20 日) 決算短信をご報告します。

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28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	612	(99.8)	1	(0.2)	613	(100.0)
28年 1月期	547	(99.5)	2	(0.5)	549	(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
28年 7月期	19	—	—	19
28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
28年 7月期	619	6	613	31,511
28年 1月期	554	4	549	28,257

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	267
28年 1月期	176

(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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	94,355	3,498,581
株式 ※2	547,153,600	612,134,400
未収入金	3,046,972	246,068
未収配当金	3,774,550	3,607,900
流動資産合計	554,069,477	619,486,949
資産合計	554,069,477	619,486,949
負債の部		
流動負債		
前受金	—	226,300
未払金	—	27,632
未払収益分配金	3,425,488	5,196,621
未払受託者報酬	161,512	160,640
未払委託者報酬	420,023	417,768
その他未払費用	89,455	163,201
流動負債合計	4,096,478	6,192,162
負債合計	4,096,478	6,192,162
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 (△)	220,853,669	284,175,457
(分配準備積立金)	3,786,984	3,613,481
元本等合計	549,972,999	613,294,787
純資産合計	549,972,999	613,294,787
負債純資産合計	554,069,477	619,486,949

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	4,803,300	5,691,400
受取利息	355	100
有価証券売買等損益	△70,360,867	63,320,251
派生商品取引等損益	—	175,040
その他収益	171	37
営業収益合計	△65,557,041	69,186,828
営業費用		
支払利息	—	200
受託者報酬	161,512	160,640
委託者報酬	420,023	417,768
その他費用	90,300	89,811
営業費用合計	671,835	668,419
営業利益又は営業損失 (△)	△66,228,876	68,518,409
経常利益又は経常損失 (△)	△66,228,876	68,518,409
当期純利益又は当期純損失 (△)	△66,228,876	68,518,409
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	290,508,033	220,853,669
分配金 ※1	3,425,488	5,196,621
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	220,853,669	284,175,457

(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 16 期	
	自 平成 28 年 1 月 21 日	至 平成 28 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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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 51,410,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	自 平成28年1月21日 至 平成28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 （4,803,826円）及び分配準備積立金（3,080,481円）の合計額から、経費（671,835円）を控除して計算される分配対象額は7,212,472円（1口当たり370円）であり、うち3,425,488円（1口当たり176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 （5,691,337円）及び分配準備積立金（3,786,984円）の合計額から、経費（668,219円）を控除して計算される分配対象額は8,810,102円（1口当たり452円）であり、うち5,196,621円（1口当たり267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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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16期 平成28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) 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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28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	△69,874,234	63,164,156
合計	△69,874,234	63,164,156

(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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	28,257円	31,511円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	178	(99.6)	0	(0.4)	179	(100.0)
28年 1月期	186	(99.8)	0	(0.2)	186	(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
28年 7月期	19	—	—	19
28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
28年 7月期	182	3	179	9,351
28年 1月期	189	2	186	9,737

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	144
28年 1月期	125

(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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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	1,892,953	2,419,005
株式	186,607,150	178,838,100
未収入金	419,781	606,265
未収配当金	628,900	627,900
流動資産合計	189,548,784	182,491,270
資産合計	189,548,784	182,491,270
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,399,250	2,763,936
未払受託者報酬	62,971	51,989
未払委託者報酬	163,794	135,238
その他未払費用	34,764	57,517
流動負債合計	2,660,779	3,008,680
負債合計	2,660,779	3,008,680
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	△154,016,629	△161,422,044
(分配準備積立金)	635,892	629,188
元本等合計	186,888,005	179,482,590
純資産合計	186,888,005	179,482,590
負債純資産合計	189,548,784	182,491,270

(2) 損益及び剰余金計算書

	第15期	第16期
	自平成27年7月21日 至平成28年1月20日 金額(円)	自平成28年1月21日 至平成28年7月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,664,200	2,973,400
受取利息	301	79
有価証券売買等損益	△68,435,073	△7,398,711
その他収益	—	1
営業収益合計	△65,770,572	△4,425,231
営業費用		
支払利息	—	64
受託者報酬	62,971	51,989
委託者報酬	163,794	135,238
その他費用	35,109	28,957
営業費用合計	261,874	216,248
営業損失(△)	△66,032,446	△4,641,479
経常損失(△)	△66,032,446	△4,641,479
当期純損失(△)	△66,032,446	△4,641,479
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△85,584,933	△154,016,629
分配金 ※1	2,399,250	2,763,936
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△154,016,629	△161,422,044

(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16期	
	自 平成28年1月21日	至 平成28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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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154,016,629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161,422,044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15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	自 平成28年1月21日 至 平成28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 (2,664,501円)及び分配準備積立金(632,515円)の合計額から、経費(261,874円)を控除して計算される分配対象額は 3,035,142円(1口当たり158円)であり、うち2,399,250円(1口当たり125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 (2,973,416円)及び分配準備積立金(635,892円)の合計額から、経費(216,184円)を控除して計算される分配対象額は 3,393,124円(1口当たり176円)であり、うち2,763,936円(1口当たり144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16期
	自 平成28年1月21日 至 平成28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、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。</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16期 平成28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) 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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28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	△67,871,723	△7,426,223
合計	△67,871,723	△7,426,223

(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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	9,737円	9,351円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	1,139	(99.5)	5	(0.5)	1,144	(100.0)
28年 1月期	1,072	(99.6)	4	(0.4)	1,077	(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
28年 7月期	53	—	—	53
28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
28年 7月期	1,159	15	1,144	21,563
28年 1月期	1,087	9	1,077	20,304

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	266
28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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	12,684,143	19,524,316
株式 ※2	1,072,867,850	1,139,102,150
派生商品評価勘定	—	105,642
未収配当金	1,217,100	1,224,200
前払金	308,000	—
差入委託証拠金	129,000	—
流動資産合計	1,087,206,093	1,159,956,308
資産合計	1,087,206,093	1,159,956,308
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	420,333	8,716
前受金	—	86,250
未払金	—	9,932
未払収益分配金	7,907,281	14,116,354
未払受託者報酬	331,026	301,035
未払委託者報酬	860,795	782,793
その他未払費用	183,569	318,983
流動負債合計	9,703,004	15,624,063
負債合計	9,703,004	15,624,063
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 (△)	331,140,673	397,969,829
(分配準備積立金)	1,254,925	1,225,651
元本等合計	1,077,503,089	1,144,332,245
純資産合計	1,077,503,089	1,144,332,245
負債純資産合計	1,087,206,093	1,159,956,308

(2) 損益及び剰余金計算書

	第15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	9,459,600	15,340,000
受取利息	2,616	507
有価証券売買等損益	△150,336,126	66,815,183
派生商品取引等損益	△420,333	43,247
その他収益	152	69
営業収益合計	△141,294,091	82,199,006
営業費用		
支払利息	—	1,220
受託者報酬	331,026	301,035
委託者報酬	860,795	782,793
その他費用	185,243	168,448
営業費用合計	1,377,064	1,253,496
営業利益又は営業損失(△)	△142,671,155	80,945,510
経常利益又は経常損失(△)	△142,671,155	80,945,510
当期純利益又は当期純損失(△)	△142,671,155	80,945,510
期首剰余金又は期首欠損金(△)	481,719,109	331,140,673
分配金 ※1	7,907,281	14,116,354
期末剰余金又は期末欠損金(△)	331,140,673	397,969,829

(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16期	
	自 平成28年1月21日	至 平成28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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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 14,245,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	自 平成28年1月21日 至 平成28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 （9,462,368円）及び分配準備積立金（1,076,902円）の合計額から、経費（1,377,064円）を控除して計算される分配対象額は9,162,206円（1口当たり172円）であり、うち7,907,281円（1口当たり149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 （15,339,356円）及び分配準備積立金（1,254,925円）の合計額から、経費（1,252,276円）を控除して計算される分配対象額は15,342,005円（1口当たり289円）であり、うち14,116,354円（1口当たり266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16期
	自 平成28年1月21日 至 平成28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16期 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28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	△149,143,067	66,189,825
合計	△149,143,067	66,189,825

(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15期 平成28年1月20日 現在				第16期 平成28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	3,088,000	—	2,669,000	△419,000	3,897,250	—	3,994,500	97,250
合計	3,088,000	—	2,669,000	△419,000	3,897,250	—	3,994,500	97,250

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	20,304円	21,563円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	674	(99.8)	1	(0.2)	676	(100.0)
28年 1月期	661	(100.0)	0	(0.0)	661	(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
28年 7月期	37	—	—	37
28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
28年 7月期	683	6	676	18,220
28年 1月期	667	6	661	17,822

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	163
28年 1月期	128

(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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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	4,289,607	6,700,607
株式 ※2	661,265,600	674,635,830
派生商品評価勘定	—	84,392
未収入金	—	462,152
未収配当金	1,342,940	1,222,500
前払金	413,750	—
差入委託証拠金	193,500	—
流動資産合計	667,505,397	683,105,481
資産合計	667,505,397	683,105,481
負債の部		
流動負債		
前受金	—	55,200
未払金	571,963	33,664
未払収益分配金	4,749,952	6,048,767
未払受託者報酬	202,822	179,791
未払委託者報酬	527,446	467,536
その他未払費用	112,353	192,713
流動負債合計	6,164,536	6,977,671
負債合計	6,164,536	6,977,671
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（△）	165,601,730	180,388,679
（分配準備積立金）	1,367,476	1,247,158
元本等合計	661,340,861	676,127,810
純資産合計	661,340,861	676,127,810
負債純資産合計	667,505,397	683,105,481

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	5,985,190	6,676,400
受取利息	662	172
有価証券売買等損益	△120,866,992	14,985,784
派生商品取引等損益	△571,963	△78,517
その他収益	41	27
営業収益合計	△115,453,062	21,583,866
営業費用		
支払利息	—	274
受託者報酬	202,822	179,791
委託者報酬	527,446	467,536
その他費用	113,421	100,549
営業費用合計	843,689	748,150
営業利益又は営業損失 (△)	△116,296,751	20,835,716
経常利益又は経常損失 (△)	△116,296,751	20,835,716
当期純利益又は当期純損失 (△)	△116,296,751	20,835,716
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	286,648,433	165,601,730
分配金 ※1	4,749,952	6,048,767
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	165,601,730	180,388,679

(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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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 11,246,500 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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(5,985,893 円)及び分配準備積立金(975,224 円)の合計額から、経費(843,689 円)を控除して計算される分配対象額は 6,117,428 円(1 口当たり 164 円)であり、うち 4,749,952 円(1 口当たり 128 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(6,676,325 円)及び分配準備積立金(1,367,476 円)の合計額から、経費(747,876 円)を控除して計算される分配対象額は 7,295,925 円(1 口当たり 196 円)であり、うち 6,048,767 円(1 口当たり 163 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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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 16 期 平成 28 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。

	<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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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	△120,611,278	15,052,113
合計	△120,611,278	15,052,113

（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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日 現在				第 16 期 平成 28 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	—	—	—	—	1,247,000	—	1,331,500	84,500
合計	—	—	—	—	1,247,000	—	1,331,500	84,500

（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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	17,822円	18,220円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	576	(99.4)	3	(0.6)	579	(100.0)
28年 1月期	545	(99.3)	3	(0.7)	549	(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
28年 7月期	28	—	—	28
28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
28年 7月期	585	6	579	20,526
28年 1月期	555	6	549	19,456

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	192
28年 1月期	187

(注)分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

II 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	9,095,858	8,663,747
株式 ※2	545,442,300	576,284,500
未収配当金	795,400	793,050
前払金	412,750	19,200
差入委託証拠金	193,500	—
流動資産合計	555,939,808	585,760,497
資産合計	555,939,808	585,760,497
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	387,318	17,632
未払金	196,985	—
未払収益分配金	5,280,506	5,421,696
未払受託者報酬	162,928	154,402
未払委託者報酬	423,688	401,536
その他未払費用	90,234	160,329
流動負債合計	6,541,659	6,155,595
負債合計	6,541,659	6,155,595
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 (△)	178,237,877	208,444,630
(分配準備積立金)	812,040	814,633
元本等合計	549,398,149	579,604,902
純資産合計	549,398,149	579,604,902
負債純資産合計	555,939,808	585,760,497

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	5,996,310	6,066,790
受取利息	1,886	366
有価証券売買等損益	△72,314,094	30,266,287
派生商品取引等損益	△584,303	△62,127
営業収益合計	△66,900,201	36,271,316
営業費用		
支払利息	—	624
受託者報酬	162,928	154,402
委託者報酬	423,688	401,536
その他費用	91,086	86,305
営業費用合計	677,702	642,867
営業利益又は営業損失 (△)	△67,577,903	35,628,449
経常利益又は経常損失 (△)	△67,577,903	35,628,449
当期純利益又は当期純損失 (△)	△67,577,903	35,628,449
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	251,096,286	178,237,877
分配金 ※1	5,280,506	5,421,696
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	178,237,877	208,444,630

(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 16 期	
	自 平成 28 年 1 月 21 日	至 平成 28 年 7 月 20 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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

<p>3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券</p>	<p>—————</p>	<p>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 13,979,000 円</p>
----------------------------	--------------	---

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

<p>区 分</p>	<p>第 15 期 自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日</p>	<p>第 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日</p>
<p>※1 分配金の計算過程</p>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(5,998,196 円)及び分配準備積立金(772,052 円)の合計額から、経費(677,702 円)を控除して計算される分配対象額は 6,092,546 円(1 口当たり 215 円)であり、うち 5,280,506 円(1 口当たり 187 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(6,066,532 円)及び分配準備積立金(812,040 円)の合計額から、経費(642,243 円)を控除して計算される分配対象額は 6,236,329 円(1 口当たり 220 円)であり、うち 5,421,696 円(1 口当たり 192 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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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	<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	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	<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 16 期 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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	△70,958,530	29,737,755
合計	△70,958,530	29,737,755

(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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日 現在				第 16 期 平成 28 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	3,055,000	—	2,669,000	△386,000	5,343,200	—	5,326,000	△17,200
合計	3,055,000	—	2,669,000	△386,000	5,343,200	—	5,326,000	△17,200

(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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	19,456 円	20,526 円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	606	(99.6)	2	(0.4)	609	(100.0)
28年 1月期	690	(99.7)	2	(0.3)	692	(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
28年 7月期	33	—	—	33
28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
28年 7月期	619	10	609	18,301
28年 1月期	702	9	692	20,798

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	279
28年 1月期	257

(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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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	2,021,931	4,241,194
株式 ※2	690,152,300	606,577,000
未収入金	7,910,200	6,652,550
未収配当金	1,587,400	1,771,900
前払金	286,000	8,000
差入委託証拠金	132,000	—
流動資産合計	702,089,831	619,250,644
資産合計	702,089,831	619,250,644
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	282,465	4,432
未払金	106,106	12,864
未払収益分配金	8,554,245	9,286,515
未払受託者報酬	216,213	169,351
未払委託者報酬	562,249	440,424
その他未払費用	119,773	192,921
流動負債合計	9,841,051	10,106,507
負債合計	9,841,051	10,106,507
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（△）	197,467,255	114,362,612
（分配準備積立金）	1,599,836	1,801,800
元本等合計	692,248,780	609,144,137
純資産合計	692,248,780	609,144,137
負債純資産合計	702,089,831	619,250,644

(2) 損益及び剰余金計算書

	第15期	第16期
	自平成27年7月21日 至平成28年1月20日	自平成28年1月21日 至平成28年7月20日
	金額（円）	金額（円）
営業収益		
受取配当金	9,579,950	10,192,983
受取利息	830	318
有価証券売買等損益	△154,806,319	△83,033,370
派生商品取引等損益	△388,571	△273,237
その他収益	11	—
営業収益合計	△145,614,099	△73,113,306
営業費用		
支払利息	—	359
受託者報酬	216,213	169,351
委託者報酬	562,249	440,424
その他費用	120,927	94,688
営業費用合計	899,389	704,822
営業損失（△）	△146,513,488	△73,818,128
経常損失（△）	△146,513,488	△73,818,128
当期純損失（△）	△146,513,488	△73,818,128
期首剰余金又は期首欠損金（△）	352,534,988	197,467,255
分配金 ※1	8,554,245	9,286,515
期末剰余金又は期末欠損金（△）	197,467,255	114,362,612

(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 16 期	
	自 平成 28 年 1 月 21 日	至 平成 28 年 7 月 20 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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

<p>3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券</p>	<p>—————</p>	<p>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 11,550,000 円</p>
----------------------------	--------------	---

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

<p>区 分</p>	<p>第 15 期 自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日</p>	<p>第 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日</p>
<p>※1 分配金の計算過程</p>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(9,580,791 円)及び分配準備積立金(1,472,679 円)の合計額から、経費(899,389 円)を控除して計算される分配対象額は 10,154,081 円(1 口当たり 305 円)であり、うち 8,554,245 円(1 口当たり 257 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(10,192,942 円)及び分配準備積立金(1,599,836 円)の合計額から、経費(704,463 円)を控除して計算される分配対象額は 11,088,315 円(1 口当たり 333 円)であり、うち 9,286,515 円(1 口当たり 279 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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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	<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	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	<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 16 期 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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	△150,406,966	△81,978,774
合計	△150,406,966	△81,978,774

(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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日 現在				第 16 期 平成 28 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	2,239,000	－	1,957,500	△281,500	2,500,000	－	2,496,000	△4,000
合計	2,239,000	－	1,957,500	△281,500	2,500,000	－	2,496,000	△4,000

(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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	20,798円	18,301円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	185	(99.8)	0	(0.2)	185	(100.0)
28年 1月期	191	(100.1)	△0	(△0.1)	191	(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
28年 7月期	10	—	—	10
28年 1月期	10	—	—	10

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
28年 7月期	187	2	185	17,186
28年 1月期	194	2	191	17,748

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	166
28年 1月期	186

(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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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	477,874	2,327,860
株式 ※3	191,955,900	185,392,450
未収入金	1,584,986	—
未収配当金	16,200	2,200
前払金	—	11,850
流動資産合計	194,034,960	187,734,360
資産合計	194,034,960	187,734,360
負債の部		
流動負債		
未払金	—	13,816
未払収益分配金	2,009,730	1,793,630
未払受託者報酬	62,242	50,233
未払委託者報酬	161,904	130,691
その他未払費用	34,341	56,191
流動負債合計	2,268,217	2,044,561
負債合計	2,268,217	2,044,561
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	369,995,615	369,995,615
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△178,228,872	△184,305,816
（分配準備積立金）	23,947	8,383
元本等合計	191,766,743	185,689,799
純資産合計	191,766,743	185,689,799
負債純資産合計	194,034,960	187,734,360

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 15 期		第 16 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日		自 平成 28 年 1 月 21 日	
	至 平成 28 年 1 月 20 日		至 平成 28 年 7 月 20 日	
	金 額 (円)		金 額 (円)	
営業収益				
受取配当金		2,284,550		1,987,000
受取利息		156		64
有価証券売買等損益		△72,140,964		△6,025,867
派生商品取引等損益		—		△35,513
その他収益		8		6
営業収益合計		△69,856,250		△4,074,310
営業費用				
支払利息		—		91
受託者報酬		62,242		50,233
委託者報酬		161,904		130,691
その他費用		34,698		27,989
営業費用合計		258,844		209,004
営業損失 (△)		△70,115,094		△4,283,314
経常損失 (△)		△70,115,094		△4,283,314
当期純損失 (△)		△70,115,094		△4,283,314
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		△106,104,048		△178,228,872
分配金 ※1		2,009,730		1,793,630
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		△178,228,872		△184,305,816

(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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 年 7 月 20 日現在
1. ※1 期首元本額	369,995,615 円	369,995,615 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	10,805 口	10,805 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 178,228,872 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 184,305,816 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 14,825,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (2,284,714 円) 及び分配準備積立金 (7,807 円) の合計額から、経費 (258,844 円) を控除して計算される分配対象額は 2,033,677 円 (1 口当たり 188 円) であり、うち 2,009,730 円 (1 口当たり 186 円) を分配	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 (1,986,979 円) 及び分配準備積立金 (23,947 円) の合計額から、経費 (208,913 円) を控除して計算される分配対象額は 1,802,013 円 (1 口当たり 166 円) であり、うち 1,793,630 円 (1 口当たり 166 円) を分配

	金額としております。	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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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 16 期 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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	△71,018,418	△6,019,650
合計	△71,018,418	△6,019,650

(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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	17,748 円	17,186 円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	508	(99.9)	0	(0.1)	508	(100.0)
28年 1月期	482	(99.8)	0	(0.2)	483	(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
28年 7月期	19	—	—	19
28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
28年 7月期	514	5	508	26,726
28年 1月期	488	5	483	25,377

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	274
28年 1月期	223

(注)分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	4,901,915	4,853,749
株式	482,294,200	508,318,250
未収入金	—	680,081
未収配当金	728,250	637,825
前払金	414,000	—
差入委託証拠金	193,500	184,500
流動資産合計	488,531,865	514,674,405
資産合計	488,531,865	514,674,405
負債の部		
流動負債		
前受金	—	68,400
未払金	574,712	16,032
未払収益分配金	4,245,028	5,215,864
未払受託者報酬	154,218	133,277
未払委託者報酬	401,040	346,553
その他未払費用	85,316	144,470
流動負債合計	5,460,314	5,924,596
負債合計	5,460,314	5,924,596
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 (△)	51,011,459	76,689,717
(分配準備積立金)	738,078	651,780
元本等合計	483,071,551	508,749,809
純資産合計	483,071,551	508,749,809
負債純資産合計	488,531,865	514,674,405

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 15 期		第 16 期	
	自 平成 27 年 7 月 21 日		自 平成 28 年 1 月 21 日	
	至 平成 28 年 1 月 20 日		至 平成 28 年 7 月 20 日	
	金 額 (円)		金 額 (円)	
営業収益				
受取配当金		5,461,000		5,683,775
受取利息		720		196
有価証券売買等損益		△159,484,419		25,733,941
派生商品取引等損益		△574,712		30,615
その他収益		49		80
営業収益合計		△154,597,362		31,448,607
営業費用				
支払利息		—		176
受託者報酬		154,218		133,277
委託者報酬		401,040		346,553
その他費用		86,192		74,479
営業費用合計		641,450		554,485
営業利益又は営業損失 (△)		△155,238,812		30,894,122
経常利益又は経常損失 (△)		△155,238,812		30,894,122
当期純利益又は当期純損失 (△)		△155,238,812		30,894,122
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		210,495,299		51,011,459
分配金 ※1		4,245,028		5,215,864
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		51,011,459		76,689,717

(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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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(5,461,769 円)及び分配準備積立金(162,787 円)の合計額から、経費(641,450 円)を控除して計算される分配対象額は 4,983,106 円(1 口当たり 261 円)であり、うち 4,245,028 円(1 口当たり 223 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(5,683,875 円)及び分配準備積立金(738,078 円)の合計額から、経費(554,309 円)を控除して計算される分配対象額は 5,867,644 円(1 口当たり 308 円)であり、うち 5,215,864 円(1 口当たり 274 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 16 期
	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 16 期 平成 28 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	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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	△158,108,122	25,645,745
合計	△158,108,122	25,645,745

(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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	25,377 円	26,726 円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	1,237	(99.7)	3	(0.3)	1,240	(100.0)
28年 1月期	1,216	(99.8)	2	(0.2)	1,218	(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
28年 7月期	95	—	—	95
28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
28年 7月期	1,253	12	1,240	13,044
28年 1月期	1,239	21	1,218	12,813

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	118
28年 1月期	188

(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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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	13,261,872	13,746,086
株式 ※3	1,216,131,600	1,237,285,720
未収入金	6,970,117	203,568
未収配当金	2,104,500	2,141,200
前払金	1,366,250	—
流動資産合計	1,239,834,339	1,253,376,574
資産合計	1,239,834,339	1,253,376,574
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	181,654	14,216
前受金	—	140,000
未払金	1,717,641	65,762
未払収益分配金	17,877,672	11,221,092
未払受託者報酬	386,881	324,483
未払委託者報酬	1,005,975	843,738
その他未払費用	214,339	357,295
流動負債合計	21,384,162	12,966,586
負債合計	21,384,162	12,966,586
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（△） ※2	△68,647,113	△46,687,302
（分配準備積立金）	2,123,971	2,183,471
元本等合計	1,218,450,177	1,240,409,988
純資産合計	1,218,450,177	1,240,409,988
負債純資産合計	1,239,834,339	1,253,376,574

(2) 損益及び剰余金計算書

	第15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日
	金額（円）	金額（円）
営業収益		
受取配当金	10,789,364	12,630,608
受取利息	1,589	746
有価証券売買等損益	△363,183,284	21,803,728
派生商品取引等損益	△1,899,295	96,583
その他収益 ※1	8,492,042	11
営業収益合計	△345,799,584	34,531,676
営業費用		
支払利息	—	985
受託者報酬	386,881	324,483
委託者報酬	1,005,975	843,738
その他費用	216,503	181,567
営業費用合計	1,609,359	1,350,773
営業利益又は営業損失（△）	△347,408,943	33,180,903
経常利益又は経常損失（△）	△347,408,943	33,180,903
当期純利益又は当期純損失（△）	△347,408,943	33,180,903
期首剰余金又は期首欠損金（△）	296,639,502	△68,647,113
分配金 ※2	17,877,672	11,221,092
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△68,647,113	△46,687,302

(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 16 期	
	自 平成 28 年 1 月 21 日	至 平成 28 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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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 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68,647,113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46,687,302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 14,598,000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 16,614,000円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 15 期 自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日	第 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日
	1. ※1 その他収益	主に、受取和解金であります。
2. ※2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(19,282,995円)及び分配準備積立金(2,328,007円)の合計額から、経費(1,609,359円)を控除して計算される分配対象額は20,001,643円(1口当たり210円)であり、うち17,877,672円(1口当たり188円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(12,630,380円)及び分配準備積立金(2,123,971円)の合計額から、経費(1,349,788円)を控除して計算される分配対象額は13,404,563円(1口当たり140円)であり、うち11,221,092円(1口当たり118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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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	<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	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	<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 16 期 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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	△358,256,353	21,698,036
合計	△358,256,353	21,698,036

(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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日 現在				第 16 期 平成 28 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	1,515,500	－	1,334,500	△181,000	2,677,000	－	2,663,000	△14,000
合計	1,515,500	－	1,334,500	△181,000	2,677,000	－	2,663,000	△14,000

(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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	12,813円	13,044円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	567	(99.9)	0	(0.1)	567	(100.0)
28年 1月期	503	(99.8)	1	(0.2)	504	(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
28年 7月期	32	—	—	32
28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
28年 7月期	573	5	567	17,602
28年 1月期	509	4	504	15,651

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	149
28年 1月期	101

(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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	4,280,071	2,481,513
株式	503,939,150	567,444,400
未収入金	154,650	3,083,974
未収配当金	634,103	405,416
前払金	143,750	—
差入委託証拠金	64,500	—
流動資産合計	509,216,224	573,415,303
資産合計	509,216,224	573,415,303
負債の部		
流動負債		
未払金	328,309	—
未払収益分配金	3,258,765	4,807,485
未払受託者報酬	155,701	146,573
未払委託者報酬	404,902	381,136
その他未払費用	86,224	152,657
流動負債合計	4,233,901	5,487,851
負債合計	4,233,901	5,487,851
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 (△)	132,966,873	195,912,002
(分配準備積立金)	664,451	433,091
元本等合計	504,982,323	567,927,452
純資産合計	504,982,323	567,927,452
負債純資産合計	509,216,224	573,415,303

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	4,384,440	5,185,722
受取利息	712	153
有価証券売買等損益	△94,451,572	63,416,119
派生商品取引等損益	△182,995	△239,630
その他収益	127	55
営業収益合計	△90,249,288	68,362,419
営業費用		
支払利息	—	182
受託者報酬	155,701	146,573
委託者報酬	404,902	381,136
その他費用	87,041	81,914
営業費用合計	647,644	609,805
営業利益又は営業損失 (△)	△90,896,932	67,752,614
経常利益又は経常損失 (△)	△90,896,932	67,752,614
当期純利益又は当期純損失 (△)	△90,896,932	67,752,614
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	227,122,570	132,966,873
分配金 ※1	3,258,765	4,807,485
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	132,966,873	195,912,002

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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(4,385,279 円)及び分配準備積立金(185,581 円)の合計額から、経費(647,644 円)を控除して計算される分配対象額は 3,923,216 円(1 口当たり 121 円)であり、うち 3,258,765 円(1 口当たり 101 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(5,185,748 円)及び分配準備積立金(664,451 円)の合計額から、経費(609,623 円)を控除して計算される分配対象額は 5,240,576 円(1 口当たり 162 円)であり、うち 4,807,485 円(1 口当たり 149 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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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 16 期 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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	△93,284,543	62,312,338
合計	△93,284,543	62,312,338

（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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在
1口当たり純資産額	15,651円	17,602円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	215	(99.4)	1	(0.6)	217	(100.0)
28年 1月期	241	(100.1)	△0	(△0.1)	241	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 7月期	32	—	—	32
28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
28年 7月期	219	2	217	6,686
28年 1月期	243	1	241	7,445

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	53
28年 1月期	39

(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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	1,410,194	2,995,453
株式 ※3	241,862,600	215,688,970
派生商品評価勘定	—	83,642
未収入金	—	369,874
未収配当金	9,600	11,400
前払金	138,000	—
差入委託証拠金	64,500	—
流動資産合計	243,484,894	219,149,339
資産合計	243,484,894	219,149,339
負債の部		
流動負債		
前受金	—	76,050
未払金	191,236	9,166
未払収益分配金	1,266,135	1,720,645
未払受託者報酬	78,576	62,402
未払委託者報酬	204,364	162,329
その他未払費用	43,437	70,476
流動負債合計	1,783,748	2,101,068
負債合計	1,783,748	2,101,068
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	△168,072,084	△192,724,959
(分配準備積立金)	14,810	30,598
元本等合計	241,701,146	217,048,271
純資産合計	241,701,146	217,048,271
負債純資産合計	243,484,894	219,149,339

(2) 損益及び剰余金計算書

	第15期		第16期	
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日		自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日	
	金額 (円)		金額 (円)	
営業収益				
受取配当金		1,577,900		1,996,000
受取利息		174		49
有価証券売買等損益		△64,145,506		△24,725,695
派生商品取引等損益		△191,236		57,032
営業収益合計		△62,758,668		△22,672,614
営業費用				
支払利息		—		73
受託者報酬		78,576		62,402
委託者報酬		204,364		162,329
その他費用		43,857		34,812
営業費用合計		326,797		259,616
営業損失 (△)		△63,085,465		△22,932,230
経常損失 (△)		△63,085,465		△22,932,230
当期純損失 (△)		△63,085,465		△22,932,230
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		△103,720,484		△168,072,084
分配金 ※1		1,266,135		1,720,645
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		△168,072,084		△192,724,959

(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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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 168,072,084 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 192,724,959 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 3,824,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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(1,578,074 円)及び分配準備積立金(29,668 円)の合計額から、経費(326,797 円)を控除して計算される分配対象額は 1,280,945 円(1 口当たり 39 円)であり、うち 1,266,135 円(1 口当たり 39 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(1,995,976 円)及び分配準備積立金(14,810 円)の合計額から、経費(259,543 円)を控除して計算される分配対象額は 1,751,243 円(1 口当たり 53 円)であり、うち 1,720,645 円(1 口当たり 53 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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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	<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	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	<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 16 期 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 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	△63,791,254	△24,499,409
合計	△63,791,254	△24,499,409

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 15 期 平成 28 年 1 月 20 日 現在				第 16 期 平成 28 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	-	-	-	-	1,247,750	-	1,331,500	83,750
合計	-	-	-	-	1,247,750	-	1,331,500	83,750

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

第16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	7,445円	6,686円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	392	(99.7)	0	(0.3)	393	(100.0)
28年 1月期	398	(99.8)	0	(0.2)	399	(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
28年 7月期	24	—	—	24
28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
28年 7月期	396	3	393	16,185
28年 1月期	401	2	399	16,448

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	125
28年 1月期	58

(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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	2,586,778	4,522,243
株式 ※2	398,850,100	392,184,600
未収配当金	7,200	3,200
前払金	137,500	17,600
差入委託証拠金	64,500	—
流動資産合計	401,646,078	396,727,643
資産合計	401,646,078	396,727,643
負債の部		
流動負債		
未払金	197,233	22,532
未払収益分配金	1,408,936	3,036,500
未払受託者報酬	118,521	107,055
未払委託者報酬	308,222	278,446
その他未払費用	65,576	113,609
流動負債合計	2,098,488	3,558,142
負債合計	2,098,488	3,558,142
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 (△)	50,082,878	43,704,789
(分配準備積立金)	28,560	13,279
元本等合計	399,547,590	393,169,501
純資産合計	399,547,590	393,169,501
負債純資産合計	401,646,078	396,727,643

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,863,550	3,420,225
受取利息	507	89
有価証券売買等損益	△54,284,174	△6,288,379
派生商品取引等損益	△197,233	△74,429
その他収益	61,143	46,409
営業収益合計	△52,556,207	△2,896,085
営業費用		
支払利息	—	213
受託者報酬	118,521	107,055
委託者報酬	308,222	278,446
その他費用	66,196	59,790
営業費用合計	492,939	445,504
営業損失 (△)	△53,049,146	△3,341,589
経常損失 (△)	△53,049,146	△3,341,589
当期純損失 (△)	△53,049,146	△3,341,589
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	104,540,960	50,082,878
分配金 ※1	1,408,936	3,036,500
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	50,082,878	43,704,789

(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 16 期	
	自 平成 28 年 1 月 21 日	至 平成 28 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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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 3,897,400 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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 (1,925,200 円) 及び分配準備積立金(5,235 円)の合計額から、経費(492,939 円)を控除して計算される分配対象額は 1,437,496 円(1 口当たり 59 円)であり、うち 1,408,936 円(1 口当たり 58 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 (3,466,510 円) 及び分配準備積立金(28,560 円)の合計額から、経費(445,291 円)を控除して計算される分配対象額は 3,049,779 円(1 口当たり 125 円)であり、うち 3,036,500 円(1 口当たり 125 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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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 16 期
	平成 28 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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	△53,961,379	△6,282,492
合計	△53,961,379	△6,282,492

(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 15 期	第 16 期
平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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 16 期
自 平成 28 年 1 月 21 日
至 平成 28 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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	16,448 円	16,185 円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	563	(99.9)	0	(0.1)	563	(100.0)
28年 1月期	552	(99.9)	0	(0.1)	553	(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
28年 7月期	22	—	—	22
28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
28年 7月期	573	9	563	25,309
28年 1月期	562	9	553	24,831

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	401
28年 1月期	361

(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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	8,282,542	10,242,978
株式 ※3	552,823,670	563,171,550
未収入金	1,045,072	—
未収配当金	131,000	135,500
前払金	687,500	51,250
流動資産合計	562,969,784	573,601,278
資産合計	562,969,784	573,601,278
負債の部		
流動負債		
未払金	952,439	62,080
未払収益分配金	8,043,080	8,934,280
未払受託者報酬	176,428	154,039
未払委託者報酬	458,790	400,557
その他未払費用	97,693	166,235
流動負債合計	9,728,430	9,717,191
負債合計	9,728,430	9,717,191
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 (△) ※2	△75,522,526	△64,879,793
(分配準備積立金)	139,558	143,562
元本等合計	553,241,354	563,884,087
純資産合計	553,241,354	563,884,087
負債純資産合計	562,969,784	573,601,278

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	8,769,386	9,579,030
受取利息	1,178	362
有価証券売買等損益	△149,486,486	10,831,307
派生商品取引等損益	△952,439	△192,578
その他収益	165	57
営業収益合計	△141,668,196	20,218,178
営業費用		
支払利息	—	468
受託者報酬	176,428	154,039
委託者報酬	458,790	400,557
その他費用	98,648	86,101
営業費用合計	733,866	641,165
営業利益又は営業損失 (△)	△142,402,062	19,577,013
経常利益又は経常損失 (△)	△142,402,062	19,577,013
当期純利益又は当期純損失 (△)	△142,402,062	19,577,013
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	74,922,616	△75,522,526
分配金 ※1	8,043,080	8,934,280
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△75,522,526	△64,879,793

(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 16 期	
	自 平成 28 年 1 月 21 日	至 平成 28 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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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 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 75,522,526 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 64,879,793 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 3,063,500 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 3,164,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	自 平成28年1月21日 至 平成28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（8,770,729円）及び分配準備積立金（145,775円）の合計額から、経費（733,866円）を控除して計算される分配対象額は8,182,638円（1口当たり367円）であり、うち8,043,080円（1口当たり361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（9,578,981円）及び分配準備積立金（139,558円）の合計額から、経費（640,697円）を控除して計算される分配対象額は9,077,842円（1口当たり407円）であり、うち8,934,280円（1口当たり401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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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16期
	平成28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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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	△147,606,091	10,466,701
合計	△147,606,091	10,466,701

(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15期	第16期
平成28年1月20日現在	平成28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16期
自 平成28年1月21日 至 平成28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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	24,831円	25,309円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	394	(99.9)	0	(0.1)	395	(100.0)
28年 1月期	389	(100.0)	0	(0.0)	389	(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
28年 7月期	21	—	—	21
28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
28年 7月期	398	3	395	18,191
28年 1月期	392	2	389	17,932

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	127
28年 1月期	103

(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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	2,092,596	3,428,091
株式 ※2	389,479,200	394,705,000
未収入金	588,168	—
未収配当金	114,865	243,125
前払金	137,000	22,200
流動資産合計	392,411,829	398,398,416
資産合計	392,411,829	398,398,416
負債の部		
流動負債		
未払金	189,985	26,132
未払収益分配金	2,237,160	2,758,440
未払受託者報酬	120,472	105,919
未払委託者報酬	313,261	275,447
その他未払費用	66,668	113,852
流動負債合計	2,927,546	3,279,790
負債合計	2,927,546	3,279,790
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 (△)	157,579,843	163,214,186
(分配準備積立金)	115,469	243,288
元本等合計	389,484,283	395,118,626
純資産合計	389,484,283	395,118,626
負債純資産合計	392,411,829	398,398,416

(2) 損益及び剰余金計算書

	第15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,632,965	3,326,510
受取利息	449	85
有価証券売買等損益	△77,076,259	5,517,482
派生商品取引等損益	△189,985	△10,958
その他収益	527	406
営業収益合計	△74,632,303	8,833,525
営業費用		
支払利息	—	233
受託者報酬	120,472	105,919
委託者報酬	313,261	275,447
その他費用	67,308	59,143
営業費用合計	501,041	440,742
営業利益又は営業損失(△)	△75,133,344	8,392,783
経常利益又は経常損失(△)	△75,133,344	8,392,783
当期純利益又は当期純損失(△)	△75,133,344	8,392,783
期首剰余金又は期首欠損金(△)	234,950,347	157,579,843
分配金 ※1	2,237,160	2,758,440
期末剰余金又は期末欠損金(△)	157,579,843	163,214,186

(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16期	
	自 平成28年1月21日	至 平成28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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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 491,200 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 452,100 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	自 平成28年1月21日 至 平成28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 (2,633,941円)及び分配準備積立金(219,729円)の合計額から、経費(501,041円)を控除して計算される分配対象額は 2,352,629円(1口当たり108円)であり、うち2,237,160円(1口当たり103円)を分配金額としております。</p>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (3,326,768円)及び分配準備積立金(115,469円)の合計額から、経費(440,509円)を控除して計算される分配対象額は 3,001,728円(1口当たり138円)であり、うち2,758,440円(1口当たり127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16期
	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第16期
	平成28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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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	△76,752,929	5,911,070
合計	△76,752,929	5,911,070

(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15期	第16期
平成28年1月20日現在	平成28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16期
自 平成28年1月21日 至 平成28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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	17,932円	18,191円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	482	(97.6)	11	(2.4)	493	(100.0)
28年 1月期	606	(99.1)	5	(0.9)	611	(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
28年 7月期	54	—	—	54
28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
28年 7月期	503	9	493	9,068
28年 1月期	621	9	611	11,237

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	160
28年 1月期	146

(注)分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

II 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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	8,636,120	15,017,241
株式 ※3	606,068,090	482,027,510
未収入金	6,031,346	6,189,057
未収配当金	110,000	84,000
前払金	696,000	120,000
流動資産合計	621,541,556	503,437,808
資産合計	621,541,556	503,437,808
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	896,654	288,864
未払収益分配金	7,949,846	8,712,160
未払受託者報酬	204,653	138,182
未払委託者報酬	532,201	359,357
その他未払費用	113,300	170,143
流動負債合計	9,696,654	9,668,706
負債合計	9,696,654	9,668,706
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	△340,013,029	△458,088,829
(分配準備積立金)	122,223	99,329
元本等合計	611,844,902	493,769,102
純資産合計	611,844,902	493,769,102
負債純資産合計	621,541,556	503,437,808

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 15 期	第 16 期
	自 平成 27 年 7 月 21 日 至 平成 28 年 1 月 20 日 金 額 (円)	自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 年 7 月 20 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	8,821,175	9,264,525
受取利息	1,158	540
有価証券売買等損益	△233,555,860	△116,742,974
派生商品取引等損益	△896,654	△1,309,932
その他収益	—	1
営業収益合計	△225,630,181	△108,787,840
営業費用		
支払利息	—	1,034
受託者報酬	204,653	138,182
委託者報酬	532,201	359,357
その他費用	114,455	77,227
営業費用合計	851,309	575,800
営業損失 (△)	△226,481,490	△109,363,640
経常損失 (△)	△226,481,490	△109,363,640
当期純損失 (△)	△226,481,490	△109,363,640
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△105,581,693	△340,013,029
分配金 ※1	7,949,846	8,712,160
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△340,013,029	△458,088,829

(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 16 期	
	自 平成 28 年 1 月 21 日	至 平成 28 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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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 340,013,029 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 458,088,829 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 5,057,500 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 4,139,500 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	自 平成28年1月21日 至 平成28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（8,822,333円）及び分配準備積立金（101,045円）の合計額から、経費（851,309円）を控除して計算される分配対象額は8,072,069円（1口当たり148円）であり、うち7,949,846円（1口当たり146円）を分配金額としております。</p>	<p>当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（9,264,032円）及び分配準備積立金（122,223円）の合計額から、経費（574,766円）を控除して計算される分配対象額は8,811,489円（1口当たり161円）であり、うち8,712,160円（1口当たり160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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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16期 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28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	△227,607,880	△114,673,502
合計	△227,607,880	△114,673,502

(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15期 平成28年1月20日 現在				第16期 平成28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	6,147,000	—	5,253,000	△894,000	11,600,000	—	11,312,000	△288,000
合計	6,147,000	—	5,253,000	△894,000	11,600,000	—	11,312,000	△288,000

(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 16 期 自 平成 28 年 1 月 21 日 至 平成 28 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 15 期 平成 28 年 1 月 20 日現在	第 16 期 平成 28 年 7 月 20 日現在
1 口当たり純資産額	11,237 円	9,068 円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	267	(99.6)	1	(0.4)	268	(100.0)
28年 1月期	303	(99.6)	1	(0.4)	304	(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
28年 7月期	27	—	—	27
28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
28年 7月期	273	4	268	9,823
28年 1月期	307	3	304	11,148

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	166
28年 1月期	111

(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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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	4,589,987	5,960,997
株式	303,278,440	267,163,800
流動資産合計	307,868,427	273,124,797
資産合計	307,868,427	273,124,797
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,031,077	4,532,962
未払受託者報酬	100,661	76,452
未払委託者報酬	261,789	198,832
その他未払費用	55,638	88,330
流動負債合計	3,449,165	4,896,576
負債合計	3,449,165	4,896,576
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	△103,110,406	△139,301,447
(分配準備積立金)	18,779	17,225
元本等合計	304,419,262	268,228,221
純資産合計	304,419,262	268,228,221
負債純資産合計	307,868,427	273,124,797

(2) 損益及び剰余金計算書

	第15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	3,465,940	4,849,500
受取利息	869	172
有価証券売買等損益	△110,916,937	△36,189,487
その他収益	19	2
営業収益合計	△107,450,109	△31,339,813
営業費用		
支払利息	—	317
受託者報酬	100,661	76,452
委託者報酬	261,789	198,832
その他費用	56,203	42,665
営業費用合計	418,653	318,266
営業損失(△)	△107,868,762	△31,658,079
経常損失(△)	△107,868,762	△31,658,079
当期純損失(△)	△107,868,762	△31,658,079
期首剰余金又は期首欠損金(△)	7,789,433	△103,110,406
分配金 ※1	3,031,077	4,532,962
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△103,110,406	△139,301,447

(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16期	
	自 平成28年1月21日	至 平成28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15期	第16期
	平成28年1月20日現在	平成28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103,110,406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139,301,447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15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	自 平成28年1月21日 至 平成28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(3,466,828円)及び分配準備積立金(1,681円)の合計額から、経費(418,653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(4,849,357円)及び分配準備積立金(18,779円)の合計額から、経費(317,949円)を控除し

	て計算される分配対象額は 3,049,856円（1口当たり111円）であり、うち3,031,077円（1口当たり111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 4,550,187円（1口当たり166円）であり、うち4,532,962円（1口当たり166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16期	
	自 平成28年1月21日 至 平成28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16期	
	平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28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	△109,533,538	△36,182,664
合計	△109,533,538	△36,182,664

（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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	11,148円	9,823円

平成28年7月期（平成28年1月21日～平成28年7月20日）決算短信

平成28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28年10月13日
 分配金支払開始日 平成28年 8月26日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月期の運用状況（平成28年1月21日～平成28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	%
28年 7月期	246	(99.4)	1	(0.6)	247	(100.0)
28年 1月期	249	(99.5)	1	(0.5)	250	(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
28年 7月期	9	—	—	9
28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
28年 7月期	249	1	247	27,216
28年 1月期	253	2	250	27,573

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
28年 7月期	163
28年 1月期	101

(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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在 金 額 (円)	平成 28 年 7 月 20 日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,167,078	2,727,867
株式	249,640,300	246,375,800
未収入金	—	186,460
未収配当金	272,400	144,600
前払金	308,000	15,300
差入委託証拠金	129,000	123,000
流動資産合計	253,516,778	249,573,027
資産合計	253,516,778	249,573,027
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	210,167	7,258
未払金	1,039,749	9,616
未払収益分配金	919,403	1,483,789
未払受託者報酬	84,281	69,605
未払委託者報酬	219,218	181,048
その他未払費用	46,592	77,065
流動負債合計	2,519,410	1,828,381
負債合計	2,519,410	1,828,381
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 (△)	22,876,188	19,623,466
(分配準備積立金)	274,628	145,392
元本等合計	250,997,368	247,744,646
純資産合計	250,997,368	247,744,646
負債純資産合計	253,516,778	249,573,027

(2) 損益及び剰余金計算書

	第15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日 金額(円)	自 平成28年1月21日 至 平成28年7月20日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	1,446,160	1,644,070
受取利息	222	92
有価証券売買等損益	△84,378,634	△3,101,116
派生商品取引等損益	△418,409	△22,370
その他収益	61	61
営業収益合計	△83,350,600	△1,479,263
営業費用		
支払利息	—	194
受託者報酬	84,281	69,605
委託者報酬	219,218	181,048
その他費用	47,048	38,823
営業費用合計	350,547	289,670
営業損失(△)	△83,701,147	△1,768,933
経常損失(△)	△83,701,147	△1,768,933
当期純損失(△)	△83,701,147	△1,768,933
期首剰余金又は期首欠損金(△)	107,496,738	22,876,188
分配金 ※1	919,403	1,483,789
期末剰余金又は期末欠損金(△)	22,876,188	19,623,466

(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 16 期	
	自 平成 28 年 1 月 21 日	至 平成 28 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 15 期	第 16 期
	平成 28 年 1 月 20 日現在	平成 28 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15期	第16期
	自 平成27年7月21日 至 平成28年1月20日	自 平成28年1月21日 至 平成28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 （1,446,443円）及び分配準備積立金（98,135円）の合計額から、経費（350,547円）を控除して計算される分配対象額は 1,194,031円（1口当たり131円）であり、うち919,403円（1口当たり101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 （1,644,029円）及び分配準備積立金（274,628円）の合計額から、経費（289,476円）を控除して計算される分配対象額は 1,629,181円（1口当たり178円）であり、うち1,483,789円（1口当たり163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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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16期 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28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	△83,629,857	△3,321,720
合計	△83,629,857	△3,321,720

(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15期 平成28年1月20日 現在				第16期 平成28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	1,544,000	—	1,334,500	△209,500	1,338,650	—	1,331,500	△7,150
合計	1,544,000	—	1,334,500	△209,500	1,338,650	—	1,331,500	△7,150

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として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16期 自 平成28年1月21日 至 平成28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15期 平成28年1月20日現在	第16期 平成28年7月20日現在
1口当たり純資産額	27,573円	27,216円