

2019年8月23日

各 位

委託会社名 大和証券投資信託委託株式会社  
代表者の役職氏名 代表取締役社長 松下 浩一  
担当者の役職氏名 経営企画部 岡田 美範  
(連絡先 03-5555-4946)

2019年7月期（2019年1月11日～2019年7月10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2019年7月期（2019年1月11日～2019年7月10日）決算短信をご報告します。

記

上場ETF銘柄（6銘柄）

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

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

以上

# 2019年7月期（2019年1月11日～2019年7月10日）決算短信

2019年8月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数 上場取引所 東証  
 コード番号 1479  
 連動対象指標 MSCI日本株人材設備投資指数  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 1口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 2019年10月 3日  
 分配金支払開始日 2019年 8月16日

## I ファンドの運用状況

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

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2019年 7月期	53,448	(98.9)	574	(1.1)	54,023	(100.0)
2019年 1月期	51,627	(99.0)	530	(1.0)	52,158	(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
2019年 7月期	2,976	—	59	2,917
2019年 1月期	3,510	—	533	2,976

#### (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
2019年 7月期	64,794	10,771	54,023	18,519.3
2019年 1月期	67,262	15,103	52,158	17,523.2

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	231
2019年 1月期	219

(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6期	第7期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	2,335,445,549
コール・ローン	15,454,484,324	8,872,403,100
株式 ※2※3	51,627,963,330	53,448,302,470
派生商品評価勘定	6,454,645	5,340,192
未収入金	—	7,752,276
未収配当金	107,544,800	101,721,850
未収利息	341,231	271,207
前払金	34,827,825	—
その他未収収益 ※4	1,733,652	2,790,164
差入委託証拠金	28,890,000	20,400,000
流動資産合計	67,262,239,807	64,794,426,808
資産合計	67,262,239,807	64,794,426,808
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,632,884	—
前受金	—	15,984,900
未払金	33,118,602	—
未払収益分配金	651,866,421	673,856,799
未払受託者報酬	12,599,786	10,586,306
未払委託者報酬	45,863,725	36,559,467
受入担保金	14,337,443,640	10,032,536,293
その他未払費用	1,911,336	1,710,745
流動負債合計	15,103,436,394	10,771,234,510
負債合計	15,103,436,394	10,771,234,510
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	47,907,717,105	46,951,191,255
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	4,251,086,308	7,072,001,043
(分配準備積立金)	2,220,950	2,877,405
元本等合計	52,158,803,413	54,023,192,298

純資産合計	52,158,803,413	54,023,192,298
負債純資産合計	67,262,239,807	64,794,426,808

(2) 損益及び剰余金計算書

	第6期	第7期
	自2018年7月11日 至2019年1月10日	自2019年1月11日 至2019年7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	648,500,825	706,905,859
受取利息	5,152,413	6,123,398
有価証券売買等損益	△8,408,518,746	2,915,355,281
派生商品取引等損益	△157,564,289	14,156,499
その他収益 ※1	76,935,088	25,692,441
営業収益合計	△7,835,494,709	3,668,233,478
営業費用		
支払利息	3,671,264	4,140,997
受託者報酬	12,599,786	10,586,306
委託者報酬	45,863,725	36,559,467
その他費用 ※2	16,370,424	12,921,674
営業費用合計	78,505,199	64,208,444
営業利益又は営業損失(△)	△7,913,999,908	3,604,025,034
経常利益又は経常損失(△)	△7,913,999,908	3,604,025,034
当期純利益又は当期純損失(△)	△7,913,999,908	3,604,025,034
期首剰余金又は期首欠損金(△)	13,997,734,997	4,251,086,308
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,180,782,360	109,253,500
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,180,782,360	109,253,500
分配金 ※3	651,866,421	673,856,799
期末剰余金又は期末欠損金(△)	4,251,086,308	7,072,001,043

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 6 期	第 7 期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	56,498,198,025 円	47,907,717,105 円
期中追加設定元本額	— 円	— 円
期中一部交換元本額	8,590,480,920 円	956,525,850 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,976,559 口	2,917,129 口

3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 13,662,626,480円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 9,521,105,910円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 67,040,000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 69,080,000円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分1,444,500円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分2,561,800円が含まれております。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第6期	第7期
	自 2018年7月11日 至 2019年1月10日	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. ※1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額72,220,800円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額20,345,000円が含まれております。
2. ※2 その他費用	主に、対象株価指数の商標の使用料であります。	主に、対象株価指数の商標の使用料であります。
3. ※3 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（726,917,062円）及び分配準備積立金（2,004,244円）の合計額から、経費（74,833,935円）を控除して計算される分配対象額は654,087,371円（10口当たり2,197円）であり、うち651,866,421円（10口当たり2,190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（734,580,701円）及び分配準備積立金（2,220,950円）の合計額から、経費（60,067,447円）を控除して計算される分配対象額は676,734,204円（10口当たり2,319円）であり、うち673,856,799円（10口当たり2,310円）を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 7 期 2019 年 7 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引



	デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 6 期 2019年1月10日現在	第 7 期 2019年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△7,026,787,708	2,190,833,681
合計	△7,026,787,708	2,190,833,681

(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 6 期 2019年1月10日現在				第 7 期 2019年7月10日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	543,310,295	－	529,174,500	△14,135,795	568,165,920	－	573,550,500	5,384,580
合計	543,310,295	－	529,174,500	△14,135,795	568,165,920	－	573,550,500	5,384,580

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

（1口当たり情報）

	第6期 2019年1月10日現在	第7期 2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	17,523.2円	18,519.3円
（10口当たり純資産額）	（175,232円）	（185,193円）

# 2019年7月期（2019年1月11日～2019年7月10日）決算短信

2019年8月23日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials 上場取引所 東証  
 コード番号 1585  
 連動対象指標 TOPIX Ex-Financials  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 10口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 2019年10月 3日  
 分配金支払開始日 2019年 8月16日

## I ファンドの運用状況

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

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2019年 7月期	26,776	(99.8)	48	(0.2)	26,825	(100.0)
2019年 1月期	23,429	(99.8)	47	(0.2)	23,477	(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
2019年 7月期	20,093	1,946	—	22,039
2019年 1月期	19,123	7,860	6,891	20,093

#### (3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
2019年 7月期	27,141	316	26,825	12,171.6
2019年 1月期	23,807	330	23,477	11,684.1

#### (4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2019年 7月期	129
2019年 1月期	150

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

### 2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無  
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第11期	第12期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	62,303,034
コール・ローン	335,119,705	236,690,437
株式	23,429,437,500	26,776,579,560
未収入金	—	21,477,217
未収配当金	43,338,262	44,536,540
流動資産合計	23,807,895,467	27,141,586,788
資産合計	23,807,895,467	27,141,586,788
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	301,399,170	284,309,266
未払受託者報酬	7,184,385	6,764,736
未払委託者報酬	18,679,465	17,588,399
その他未払費用	3,414,332	7,424,512
流動負債合計	330,677,352	316,086,913
負債合計	330,677,352	316,086,913
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	19,872,251,942	21,797,043,742
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,604,966,173	5,028,456,133
(分配準備積立金)	1,952,443	1,280,555
元本等合計	23,477,218,115	26,825,499,875
純資産合計	23,477,218,115	26,825,499,875
負債純資産合計	23,807,895,467	27,141,586,788

(2) 損益及び剰余金計算書

	第11期	第12期
	自2018年7月11日 至2019年1月10日	自2019年1月11日 至2019年7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	332,323,547	312,546,349
受取利息	5	—
有価証券売買等損益	△3,042,153,112	1,000,479,730
その他収益	337,515	218,208
営業収益合計	△2,709,492,045	1,313,244,287
営業費用		
支払利息	34,844	36,821
受託者報酬	7,184,385	6,764,736
委託者報酬	18,679,465	17,588,399
その他費用	5,070,333	4,737,223
営業費用合計	30,969,027	29,127,179
営業利益又は営業損失(△)	△2,740,461,072	1,284,117,108
経常利益又は経常損失(△)	△2,740,461,072	1,284,117,108
当期純利益又は当期純損失(△)	△2,740,461,072	1,284,117,108
期首剰余金又は期首欠損金(△)	6,352,005,424	3,604,966,173
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,003,051,579	423,682,118
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,003,051,579	423,682,118
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,708,230,588	—
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	2,708,230,588	—
分配金 ※1	301,399,170	284,309,266
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,604,966,173	5,028,456,133

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 12 期 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 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 11 期 2019年1月10日現在	第 12 期 2019年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	18,913,285,894 円	19,872,251,942 円
期中追加設定元本額	7,774,509,220 円	1,924,791,800 円
期中一部交換元本額	6,815,543,172 円	－円
2. 計算期間末日における受益 権の総数	20,093,278 口	22,039,478 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 11 期 自 2018年7月11日 至 2019年1月10日	第 12 期 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取 配当金、配当株式、受取利息及 びその他収益金から支払利息 を控除した当期配当等収益額 (332,626,223 円) 及び分配準 備積立金(1,659,573 円)の合 計額から、経費(30,934,183 円)を控除して計算される分配 対象額は 303,351,613 円 (100 口当たり 1,509 円) であり、う ち 301,399,170 円 (100 口当 たり 1,500 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 (312,727,736 円) 及び分配準 備積立金(1,952,443 円)の合 計額から、経費(29,090,358 円)を控除して計算される分配 対象額は 285,589,821 円 (100 口当たり 1,295 円) であり、う ち 284,309,266 円 (100 口当 たり 1,290 円) を分配金額とし ております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 12 期 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 12 期 2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)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 11 期 2019年1月10日現在	第 12 期 2019年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△3,265,611,820	983,305,303
新株予約権証券	—	0
合計	△3,265,611,820	983,305,303

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

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(1口当たり情報)

	第 11 期 2019年1月10日現在	第 12 期 2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,168.41円	1,217.16円
(100口当たり純資産額)	(116,841円)	(121,716円)

# 2019年7月期（2019年1月11日～2019年7月10日）決算短信

2019年8月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－J P X日経400 上場取引所 東証  
 コード番号 1599  
 連動対象指標 J P X日経インデックス400  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 1口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 2019年10月 3日  
 分配金支払開始日 2019年 8月16日

## I ファンドの運用状況

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

#### (1)資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2019年 7月期	218,130	(99.7)	678	(0.3)	218,809	(100.0)
2019年 1月期	174,092	(99.7)	439	(0.3)	174,531	(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
2019年 7月期	12,810	2,681	—	15,491
2019年 1月期	11,869	1,586	646	12,810

#### (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
2019年 7月期	260,583	41,774	218,809	14,124.6
2019年 1月期	221,044	46,513	174,531	13,624.6

#### (4)分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年 7月期	165
2019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 10 期	第 11 期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
	金額 (円)	金額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	8,755,608,349
コール・ローン	46,537,259,996	33,262,726,538
株式 ※2※3	174,092,507,180	218,130,971,870
派生商品評価勘定	—	8,788,344
未収入金	23,003,586	25,297,664
未収配当金	291,353,920	345,765,495
未収利息	1,083,760	1,017,973
前払金	47,530,576	—
その他未収収益 ※4	19,772,065	14,891,075
差入委託証拠金	32,457,000	38,633,000
流動資産合計	221,044,968,083	260,583,700,308
資産合計	221,044,968,083	260,583,700,308
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	22,462,076	—
前受金	—	41,176,140
未払金	72,384,932	—
未払収益分配金	1,908,698,195	2,556,069,450
未払受託者報酬	56,155,666	63,146,654
未払委託者報酬	138,766,090	152,140,767
受入担保金	44,248,979,155	38,934,278,775
その他未払費用	65,986,821	27,692,355
流動負債合計	46,513,432,935	41,774,504,141
負債合計	46,513,432,935	41,774,504,141
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	134,915,499,260	163,154,687,560
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	39,616,035,888	55,654,508,607
(分配準備積立金)	9,318,382	580,364
元本等合計	174,531,535,148	218,809,196,167
純資産合計	174,531,535,148	218,809,196,167

負債純資産合計	221,044,968,083	260,583,700,308
---------	-----------------	-----------------

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 10 期	第 11 期
	自 2018 年 7 月 11 日 至 2019 年 1 月 10 日	自 2019 年 1 月 11 日 至 2019 年 7 月 10 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,005,759,937	2,653,778,648
受取利息	14,055,733	20,897,793
有価証券売買等損益	△22,092,546,070	6,554,321,117
派生商品取引等損益	△290,815,518	△8,891,629
その他収益 ※1	141,043,820	147,741,060
営業収益合計	△20,222,502,098	9,367,846,989
営業費用		
支払利息	9,752,097	13,622,571
受託者報酬	56,155,666	63,146,654
委託者報酬	138,766,090	152,140,767
その他費用	44,106,813	46,176,077
営業費用合計	248,780,666	275,086,069
営業利益又は営業損失 (△)	△20,471,282,764	9,092,760,920
経常利益又は経常損失 (△)	△20,471,282,764	9,092,760,920
当期純利益又は当期純損失 (△)	△20,471,282,764	9,092,760,920
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	57,635,022,822	39,616,035,888
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,190,864,313	9,501,781,249
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	7,190,864,313	9,501,781,249
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,829,870,288	—
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	2,829,870,288	—
分配金 ※2	1,908,698,195	2,556,069,450
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	39,616,035,888	55,654,508,607

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 10 期	第 11 期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	125,008,236,436 円	134,915,499,260 円
期中追加設定元本額	16,712,156,536 円	28,239,188,300 円
期中一部交換元本額	6,804,893,712 円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	12,810,055 口	15,491,330 口

3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 42,155,072,200 円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 36,829,034,880 円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 134,508,000 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 134,943,500 円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 18,765,070 円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 13,891,150 円が含まれております。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 10 期	第 11 期
	自 2018年7月11日 至 2019年1月10日	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. ※1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額 125,193,130 円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額 124,943,764 円が含まれております。
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 (2,151,107,393 円) 及び分配準備積立金 (5,937,753 円) の合計額から、経費 (239,028,569 円) を控除して計算される分配対象額は 1,918,016,577 円 (10 口当たり 1,497 円) であり、うち 1,908,698,195 円 (10 口当たり 1,490 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 (2,808,794,930 円) 及び分配準備積立金 (9,318,382 円) の合計額から、経費 (261,463,498 円) を控除して計算される分配対象額は 2,556,649,814 円 (10 口当たり 1,650 円) であり、うち 2,556,069,450 円 (10 口当たり 1,650 円) を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 11 期 2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。



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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 10 期 2019年1月10日現在	第 11 期 2019年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△21,703,839,927	6,423,780,694
合計	△21,703,839,927	6,423,780,694

(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 10 期 2019年1月10日 現在				第 11 期 2019年7月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	456,000,300	－	433,573,000	△22,427,300	666,581,384	－	675,422,000	8,840,616
合計	456,000,300	－	433,573,000	△22,427,300	666,581,384	－	675,422,000	8,840,616

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

(1口当たり情報)

	第 10 期 2019年1月10日現在	第 11 期 2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	13,624.6円	14,124.6円
(10口当たり純資産額)	(136,246円)	(141,246円)

# 2019年7月期（2019年1月11日～2019年7月10日）決算短信

2019年8月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数（WIN） 上場取引所 東証  
 コード番号 1652  
 連動対象指標 MSCI日本株女性活躍指数  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 10口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 2019年10月 3日  
 分配金支払開始日 2019年 8月16日

## I ファンドの運用状況

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

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2019年 7月期	1,053	(98.4)	16	(1.6)	1,070	(100.0)
2019年 1月期	1,202	(99.7)	3	(0.3)	1,206	(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
2019年 7月期	657	49	147	559
2019年 1月期	510	147	—	657

#### (3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
2019年 7月期	1,089	18	1,070	19,136.6
2019年 1月期	1,219	13	1,206	18,340.5

#### (4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2019年 7月期	300
2019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3期	第4期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	33,087,386
コール・ローン	12,689,891	—
株式 ※3	1,202,941,170	1,053,742,920
派生商品評価勘定	149,784	156,704
未収入金	1,476,106	159,408
未収配当金	1,936,050	1,870,850
前払金	69,000	—
流動資産合計	1,219,262,001	1,089,017,268
資産合計	1,219,262,001	1,089,017,268
負債の部		
流動負債		
前受金	—	392,000
未払金	369,728	—
未払収益分配金	11,575,520	16,785,270
未払受託者報酬	195,136	207,122
未払委託者報酬	780,658	828,590
その他未払費用	87,876	93,021
流動負債合計	13,008,918	18,306,003
負債合計	13,008,918	18,306,003
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,312,111,500	1,116,220,455
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△105,858,417	△45,509,190
（分配準備積立金）	53,648	28,345
元本等合計	1,206,253,083	1,070,711,265
純資産合計	1,206,253,083	1,070,711,265
負債純資産合計	1,219,262,001	1,089,017,268

(2) 損益及び剰余金計算書

	第3期	第4期
	自2018年7月11日 至2019年1月10日	自2019年1月11日 至2019年7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	12,978,935	18,197,772
有価証券売買等損益	△148,075,158	54,309,378
派生商品取引等損益	△1,762,688	△109,640
その他収益	16,685	21,139
営業収益合計	△136,842,226	72,418,649
営業費用		
支払利息	810	2,925
受託者報酬	195,136	207,122
委託者報酬	780,658	828,590
その他費用 ※1	437,337	420,307
営業費用合計	1,413,941	1,458,944
営業利益又は営業損失(△)	△138,256,167	70,959,705
経常利益又は経常損失(△)	△138,256,167	70,959,705
当期純利益又は当期純損失(△)	△138,256,167	70,959,705
期首剰余金又は期首欠損金(△)	37,297,578	△105,858,417
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,675,692	8,677,095
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	8,677,095
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	6,675,692	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	2,502,303
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	2,502,303
分配金 ※2	11,575,520	16,785,270
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△105,858,417	△45,509,190

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 4 期	
	自 2019年1月11日	至 2019年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 3 期	第 4 期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	1,018,407,600 円	1,312,111,500 円
期中追加設定元本額	293,703,900 円	98,912,100 円
期中一部交換元本額	－円	294,803,145 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	657,700 口	559,509 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105,858,417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45,509,190円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 8,543,250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 9,003,750円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期 自 2018年7月11日 至 2019年1月10日	第4期 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
	1. ※1 その他費用	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。
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（12,994,810円）及び分配準備積立金（47,489円）の合計額から、経費（1,413,131円）を控除して計算される分配対象額は11,629,168円（100口当たり1,768円）であり、うち11,575,520円（100口当たり1,760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（18,215,986円）及び分配準備積立金（53,648円）の合計額から、経費（1,456,019円）を控除して計算される分配対象額は16,813,615円（100口当たり3,005円）であり、うち16,785,270円（100口当たり3,000円）を分配金額としております。

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



II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 4 期 2019年7月10日現在	
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 3 期 2019年1月10日現在	第 4 期 2019年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	△141,223,160	35,455,610
合計	△141,223,160	35,455,610

（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 3 期 2019年1月10日 現在				第 4 期 2019年7月10日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								

ダイワ上場投信－MSCI 日本株女性活躍指数（WIN）（1652）2019年7月期決算短信

買 建	2,543,000	－	2,693,000	150,000	16,588,000	－	16,746,000	158,000
合計	2,543,000	－	2,693,000	150,000	16,588,000	－	16,746,000	158,000

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

(1口当たり情報)

	第 3 期 2019年1月10日現在	第 4 期 2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,834.05円	1,913.66円
(100口当たり純資産額)	(183,405円)	(191,366円)

# 2019年7月期（2019年1月11日～2019年7月10日）決算短信

2019年8月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数 上場取引所 東証  
 コード番号 1653  
 連動対象指標 MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数  
 主要投資資産 株式、投資証券  
 売買単位 10口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 2019年10月 3日  
 分配金支払開始日 2019年 8月16日

## I ファンドの運用状況

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

#### (1)資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2019年 7月期	3,506	(99.6)	13	(0.4)	3,519	(100.0)
2019年 1月期	2,706	(99.7)	8	(0.3)	2,715	(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
2019年 7月期	1,487	395	49	1,833
2019年 1月期	1,090	445	49	1,487

#### (3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10
	百万円	百万円	百万円	円
2019年 7月期	3,558	38	3,519	19,200.0
2019年 1月期	2,739	24	2,715	18,255.4

#### (4)分配金

	10口当たり分配金
	円
2019年 7月期	195
2019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3期	第4期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	48,583,267
コール・ローン	29,443,201	—
株式 ※3	2,675,725,450	3,453,323,930
投資証券	30,306,400	52,894,600
派生商品評価勘定	224,676	157,920
未収入金	—	332,100
未収配当金	3,481,170	3,429,240
前払金	341,500	—
流動資産合計	2,739,522,397	3,558,721,057
資産合計	2,739,522,397	3,558,721,057
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	180,432	—
前受金	—	594,000
未払金	715,456	—
未払収益分配金	21,416,342	35,747,185
未払受託者報酬	399,821	486,502
未払委託者報酬	1,599,405	1,946,189
その他未払費用	184,438	221,978
流動負債合計	24,495,894	38,995,854
負債合計	24,495,894	38,995,854
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,920,951,144	3,600,383,196
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△205,924,641	△80,657,993
（分配準備積立金）	12,261	76,438
元本等合計	2,715,026,503	3,519,725,203
純資産合計	2,715,026,503	3,519,725,203
負債純資産合計	2,739,522,397	3,558,721,057

(2) 損益及び剰余金計算書

	第3期	第4期
	自 2018年7月11日 至 2019年1月10日	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	23,971,846	38,865,904
有価証券売買等損益	△294,783,586	141,124,517
派生商品取引等損益	△4,103,288	△382,280
その他収益	6,652	6,960
営業収益合計	△274,908,376	179,615,101
営業費用		
支払利息	2,100	5,176
受託者報酬	399,821	486,502
委託者報酬	1,599,405	1,946,189
その他費用 ※1	591,080	623,635
営業費用合計	2,592,406	3,061,502
営業利益又は営業損失 (△)	△277,500,782	176,553,599
経常利益又は経常損失 (△)	△277,500,782	176,553,599
当期純利益又は当期純損失 (△)	△277,500,782	176,553,599
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	71,884,106	△205,924,641
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,108,377	3,026,718
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	7,967,356	3,026,718
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	13,141,021	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	18,566,484
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	18,566,484
分配金 ※2	21,416,342	35,747,185
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△205,924,641	△80,657,993

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第 3 期	第 4 期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	2,142,606,160 円	2,920,951,144 円
期中追加設定元本額	875,845,800 円	776,329,920 円
期中一部交換元本額	97,500,816 円	96,897,868 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,487,246 口	1,833,189 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205,924,641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80,657,993円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 22,037,000 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 24,551,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第 3 期	第 4 期
	自 2018年7月11日 至 2019年1月10日	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. ※1 その他費用	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用及び対象指数の商標の使用料であります。
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（23,976,398円）及び分配準備積立金（42,511円）の合計額から、経費（2,590,306円）を控除して計算される分配対象額は21,428,603円（100口当たり1,440円）であり、うち21,416,342円（100口当たり	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（38,867,688円）及び分配準備積立金（12,261円）の合計額から、経費（3,056,326円）を控除して計算される分配対象額は35,823,623円（100口当たり1,954円）であり、うち35,747,185円（100口当たり

	1,440円)を分配金額としてお ります。	1,950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 4 期 自 2019 年 1 月 11 日 至 2019 年 7 月 10 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 4 期 2019 年 7 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 3 期 2019年1月10日現在	第 4 期 2019年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△278,577,284	133,879,671
投資証券	766,141	3,095,997
合計	△277,811,143	136,975,668

(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 3 期 2019年1月10日 現在				第 4 期 2019年7月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	9,380,500	—	9,425,500	45,000	13,796,000	—	13,955,000	159,000
合計	9,380,500	—	9,425,500	45,000	13,796,000	—	13,955,000	159,000

(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4期 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第3期 2019年1月10日現在	第4期 2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,825.54円	1,920.00円
（100口当たり純資産額）	（182,554円）	（192,000円）

# 2019年7月期（2019年1月11日～2019年7月10日）決算短信

2019年8月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index 上場取引所 東証  
 コード番号 1654  
 連動対象指標 FTSE Blossom Japan Index  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 10口  
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>  
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一  
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)岡田 美範 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 2019年10月 3日  
 分配金支払開始日 2019年 8月16日

## I ファンドの運用状況

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

#### (1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2019年 7月期	2,281	(99.8)	4	(0.2)	2,285	(100.0)
2019年 1月期	1,955	(99.8)	3	(0.2)	1,958	(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
2019年 7月期	1,719	305	79	1,945
2019年 1月期	1,642	77	—	1,719

#### (3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
2019年 7月期	2,320	35	2,285	11,749.9
2019年 1月期	1,985	26	1,958	11,388.6

#### (4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2019年 7月期	169
2019年 1月期	140

(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3期	第4期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	35,780,031
コール・ローン	25,600,093	—
株式 ※3	1,955,404,130	2,281,068,320
派生商品評価勘定	—	60,176
未収入金	1,283,612	291,032
未収配当金	2,772,650	3,769,950
前払金	301,000	—
流動資産合計	1,985,361,485	2,320,969,509
資産合計	1,985,361,485	2,320,969,509
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	98,216	—
前受金	—	416,000
未払金	689,024	—
未払収益分配金	24,077,060	32,876,144
未払受託者報酬	355,223	359,158
未払委託者報酬	1,421,003	1,436,704
その他未払費用	124,348	130,689
流動負債合計	26,764,874	35,218,695
負債合計	26,764,874	35,218,695
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,149,737,500	2,431,667,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△191,140,889	△145,916,686
(分配準備積立金)	157,699	26,807
元本等合計	1,958,596,611	2,285,750,814
純資産合計	1,958,596,611	2,285,750,814
負債純資産合計	1,985,361,485	2,320,969,509

(2) 損益及び剰余金計算書

	第3期	第4期
	自2018年7月11日 至2019年1月10日	自2019年1月11日 至2019年7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	26,109,425	34,739,152
受取利息	46	31
有価証券売買等損益	△258,166,056	56,808,159
派生商品取引等損益	△3,513,168	△384,908
その他収益	9,406	12,616
営業収益合計	△235,560,347	91,175,050
営業費用		
支払利息	2,014	2,989
受託者報酬	355,223	359,158
委託者報酬	1,421,003	1,436,704
その他費用	207,281	207,696
営業費用合計	1,985,521	2,006,547
営業利益又は営業損失(△)	△237,545,868	89,168,503
経常利益又は経常損失(△)	△237,545,868	89,168,503
当期純利益又は当期純損失(△)	△237,545,868	89,168,503
期首剰余金又は期首欠損金(△)	67,595,151	△191,140,889
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,886,888	6,581,460
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	6,581,460
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	2,886,888	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	17,649,616
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	17,649,616
分配金 ※1	24,077,060	32,876,144
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△191,140,889	△145,916,686

(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 4 期	
	自 2019年1月11日	至 2019年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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 3 期	第 4 期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	2,053,050,000 円	2,149,737,500 円
期中追加設定元本額	96,687,500 円	381,300,000 円
期中一部交換元本額	－円	99,370,000 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,719,790 口	1,945,334 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191,140,889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145,916,686円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 6,831,400円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 6,776,800円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2018年7月11日 至 2019年1月10日	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(26,116,863円)及び分配準備積立金(101,403円)の合計額から、経費(1,983,507円)を控除して計算される分配対象額は24,234,759円(100口当たり1,409円)であり、うち24,077,060円(100口当たり1,400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(34,748,810円)及び分配準備積立金(157,699円)の合計額から、経費(2,003,558円)を控除して計算される分配対象額は32,902,951円(100口当たり1,691円)であり、うち32,876,144円(100口当たり1,690円)を分配金額としております。

(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4期
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。



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

## II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期 2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 3 期 2019年1月10日現在	第 4 期 2019年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△233,153,153	47,501,971
合計	△233,153,153	47,501,971

(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 3 期 2019年1月10日現在				第 4 期 2019年7月10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	2,791,000	—	2,693,000	△98,000	4,126,000	—	4,186,500	60,500
合計	2,791,000	—	2,693,000	△98,000	4,126,000	—	4,186,500	60,500

(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4期 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第3期 2019年1月10日現在	第4期 2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,138.86円	1,174.99円
(100口当たり純資産額)	(113,886円)	(117,499円)