

平成 25 年 8 月 20 日

各 位

委 託 会 社 名	大和証券投資信託委託株式会社
代表者の役職氏名	代表取締役社長 白川 真
担当者の役職氏名	経営企画部担当部長 近藤龍一郎 (連絡先 03-5555-4946)

平成 25 年 7 月期（平成 24 年 7 月 11 日～平成 25 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、以下のとおり平成 25 年 7 月期（平成 24 年 7 月 11 日～平成 25 年 7 月 10 日）決算短信をご報告します。

記

上場ETF銘柄（5銘柄）

銘柄名	銘柄コード	上場取引所
ダイワ上場投信－日経 2 2 5	1320	東
ダイワ上場投信－トピックス	1305	東
ダイワ上場投信－トピックス・コア 3 0	1310	東
ダイワ上場投信－東証電気機器株価指数	1610	東
ダイワ上場投信－東証銀行業株価指数	1612	東

* 各銘柄の決算短針につきましては、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、各銘柄の決算短針が表示されます。

以上

平成25年7月期（平成24年7月11日～平成25年7月10日）決算短信

平成25年8月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－日経２２５
 コード番号 1320
 連動対象指標 日経平均株価
 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)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部担当部長 (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25年10月 3日
 分配金支払開始日 平成25年 8月16日

I ファンドの運用状況

1. 25年7月期の運用状況（平成24年7月11日～平成25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	%
25年 7月期	674,742	(99.8)	1,158	(0.2)	675,900	(100.0)
24年 7月期	360,019	(99.8)	632	(0.2)	360,652	(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
25年 7月期	40,400	27,438	21,598	46,241
24年 7月期	23,486	25,376	8,461	40,400

(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
25年 7月期	685,149	9,248	675,900	14,617
24年 7月期	366,424	5,772	360,652	8,927

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
25年 7月期	173
24年 7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 11 期 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 年 7 月 10 日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,423,442,387	6,293,788,098
株式	※3	360,019,469,040	674,742,226,700
派生商品評価勘定		17,544,813	115,391,361
未収入金		1,557,101,813	3,428,843,076
未収配当金		406,706,000	568,841,000
流動資産合計		366,424,264,053	685,149,090,235
資産合計		366,424,264,053	685,149,090,235
負債の部			
流動負債			
前受金		261,756,000	681,753,000
未払収益分配金		5,171,296,256	7,999,699,228
未払受託者報酬		115,651,402	195,100,447
未払委託者報酬		148,694,703	250,843,450
その他未払費用		74,678,262	120,851,203
流動負債合計		5,772,076,623	9,248,247,328
負債合計		5,772,076,623	9,248,247,328
純資産の部			
元本等			
元本	※1	497,212,054,864	569,088,430,052
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△136,559,867,434	106,812,412,855
（分配準備積立金）		420,580,326	602,037,867
元本等合計		360,652,187,430	675,900,842,907
純資産合計		360,652,187,430	675,900,842,907
負債純資産合計		366,424,264,053	685,149,090,235

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 11 期 自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 日 金 額 (円)	第 12 期 自 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 年 7 月 10 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	5,902,346,620	9,069,643,568
受取利息	1,450,716	2,115,950
有価証券売買等損益	△26,102,882,553	235,808,484,079
派生商品取引等損益	△486,663,076	1,937,671,475
その他収益	1,933,468	1,737,792
営業収益合計	△20,683,814,825	246,819,652,864
営業費用		
受託者報酬	203,643,249	336,436,330
委託者報酬	261,827,078	432,561,023
その他費用	76,923,891	123,343,188
営業費用合計	542,394,218	892,340,541
営業利益又は営業損失 (△)	△21,226,209,043	245,927,312,323
経常利益又は経常損失 (△)	△21,226,209,043	245,927,312,323
当期純利益又は当期純損失 (△)	△21,226,209,043	245,927,312,323
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△50,304,566,696	△136,559,867,434
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,823,898,805	18,436,526,437
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	23,823,898,805	18,436,526,437
剰余金減少額又は欠損金増加額	83,681,694,244	12,991,859,243
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	83,681,694,244	12,991,859,243
分配金 ※1	5,171,296,256	7,999,699,228
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△136,559,867,434	106,812,412,855

(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 平成 24 年 7 月 11 日	至 平成 25 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。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 11 期	第 12 期
	平成 24 年 7 月 10 日現在	平成 25 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	289,045,943,328 円 312,306,161,021 円 104,140,049,485 円	497,212,054,864 円 337,687,034,805 円 265,810,659,617 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	40,400,752 口	46,241,036 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 136,559,867,434 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 1,396,500,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 2,638,000,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 11 期	第 12 期
	自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 日	自 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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 (5,905,730,804 円) 及び分配準備積立金 (228,539,996 円) の合計額から、経費 (542,394,218 円) を控除して計算される分配対象額は 5,591,876,582 円 (1 口当たり 138.4 円) であり、うち 5,171,296,256 円 (1 口当たり 128.0 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 (9,073,497,310 円) 及び分配準備積立金 (420,580,326 円) の合計額から、経費 (892,340,541 円) を控除して計算される分配対象額は 8,601,737,095 円 (1 口当たり 186.0 円) であり、うち 7,999,699,228 円 (1 口当たり 173.0 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 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 12 期 平成 25 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 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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 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	△23,123,106,697	190,106,169,247
合計	△23,123,106,697	190,106,169,247

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 11 期 平成 24 年 7 月 10 日 現在				第 12 期 平成 25 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	575,934,000	—	593,620,000	17,686,000	937,816,000	—	1,053,390,000	115,574,000
合計	575,934,000	—	593,620,000	17,686,000	937,816,000	—	1,053,390,000	115,574,000

(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 12 期 自 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	8,927 円	14,617 円

平成25年7月期（平成24年7月11日～平成25年7月10日）決算短信

平成25年8月20日

ファンド名 ダイワ上場投信ートピックス 上場取引所 東証
 コード番号 1305
 連動対象指標 東証株価指数（TOPIX）
 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 <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部担当部長 (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25年10月 3日
 分配金支払開始日 平成25年 8月16日

I ファンドの運用状況

1. 25年7月期の運用状況（平成24年7月11日～平成25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	%
25年 7月期	934,650	(99.9)	928	(0.1)	935,579	(100.0)
24年 7月期	293,178	(99.8)	593	(0.2)	293,772	(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
25年 7月期	383,435	425,333	43,524	765,244
24年 7月期	275,771	147,354	39,691	383,435

(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
25年 7月期	969,505	33,926	935,579	12,226
24年 7月期	326,970	33,198	293,772	7,662

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
25年 7月期	98
24年 7月期	155

(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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 年 7 月 10 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	30,636,040,637	30,566,239,359
株式 ※3 ※4	293,178,366,298	934,650,293,976
派生商品評価勘定	49,012,327	91,866,558
未収入金	2,807,960,786	3,460,646,545
未収配当金	292,084,700	713,952,870
その他未収収益 ※5	7,359,591	22,881,015
流動資産合計	326,970,824,339	969,505,880,323
資産合計	326,970,824,339	969,505,880,323
負債の部		
流動負債		
前受金	344,416,000	556,629,000
未払金	493,146	—
未払収益分配金	5,943,243,848	7,499,391,895
未払受託者報酬	66,197,089	116,621,694
未払委託者報酬	124,890,683	238,834,310
未払利息	316,200	269,706
受入担保金	26,637,950,811	25,392,615,053
その他未払費用	81,058,268	122,358,205
流動負債合計	33,198,566,045	33,926,719,863
負債合計	33,198,566,045	33,926,719,863
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	479,293,858,750	956,555,088,750
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	△185,521,600,456	△20,975,928,290
(分配準備積立金)	334,799,396	743,918,552
元本等合計	293,772,258,294	935,579,160,460
純資産合計	293,772,258,294	935,579,160,460
負債純資産合計	326,970,824,339	969,505,880,323

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 11 期 自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 日 金 額 (円)	第 12 期 自 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 年 7 月 10 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	6,144,825,716	8,232,140,255
受取利息	36,323,784	22,267,920
有価証券売買等損益	△26,581,052,447	185,169,889,627
派生商品取引等損益	△398,966,796	1,231,137,500
その他収益 ※1	352,636,944	336,147,232
営業収益合計	△20,446,232,799	194,991,582,534
営業費用		
支払利息	18,493,722	11,087,645
受託者報酬	125,198,976	181,375,780
委託者報酬	235,122,644	367,102,888
その他費用	81,560,417	122,478,043
営業費用合計	460,375,759	682,044,356
営業利益又は営業損失 (△)	△20,906,608,558	194,309,538,178
経常利益又は経常損失 (△)	△20,906,608,558	194,309,538,178
当期純利益又は当期純損失 (△)	△20,906,608,558	194,309,538,178
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△101,733,659,831	△185,521,600,456
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,859,241,811	8,186,053,294
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	15,859,241,811	8,186,053,294
剰余金減少額又は欠損金増加額	72,797,330,030	30,450,527,411
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	72,797,330,030	30,450,527,411
分配金 ※2	5,943,243,848	7,499,391,895
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△185,521,600,456	△20,975,928,290

(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 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 11 期	第 12 期
	平成 24 年 7 月 10 日現在	平成 25 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	344, 714, 716, 250 円 184, 193, 625, 000 円 49, 614, 482, 500 円	479, 293, 858, 750 円 531, 666, 737, 500 円 54, 405, 507, 500 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	383, 435, 087 口	765, 244, 071 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 185, 521, 600, 456 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 20, 975, 928, 290 円であります。
4. ※3 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 24, 842, 134, 227 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 24, 623, 111, 170 円
5. ※4 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 370, 320, 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 624, 590, 000 円

6. ※5 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 6, 194, 300 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 20, 711, 600 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 11 期 自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 日	第 12 期 自 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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 252, 994, 970 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 267, 128, 821 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 (6, 515, 292, 722 円) 及び分配準備積立金 (204, 632, 559 円) の合計額から、経費 (441, 882, 037 円) を控除して計算される分配対象額は 6, 278, 043, 244 円 (10 口当たり 163.7 円) であり、うち 5, 943, 243, 848 円 (10 口当たり 155.0 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 (8, 579, 467, 762 円) 及び分配準備積立金 (334, 799, 396 円) の合計額から、経費 (670, 956, 711 円) を控除して計算される分配対象額は 8, 243, 310, 447 円 (10 口当たり 107.7 円) であり、うち 7, 499, 391, 895 円 (10 口当たり 98.0 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 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 12 期 平成 25 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 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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 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	△25,062,627,929	176,354,232,646
合計	△25,062,627,929	176,354,232,646

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 11 期 平成 24 年 7 月 10 日 現在				第 12 期 平成 25 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	512,598,000	—	561,660,000	49,062,000	829,752,000	—	921,690,000	91,938,000
合計	512,598,000	—	561,660,000	49,062,000	829,752,000	—	921,690,000	91,938,000

（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 12 期 自 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	766.2 円	1,222.6 円
(10 口当たり純資産額)	(7,662 円)	(12,226 円)

平成25年7月期（平成24年7月11日～平成25年7月10日）決算短信

平成25年8月20日

ファンド名 ダイワ上場投信ートピックス・コア30 上場取引所 東証
 コード番号 1310
 連動対象指標 TOPIX Core30
 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 <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部担当部長 (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25年10月 3日
 分配金支払開始日 平成25年 8月16日

I ファンドの運用状況

1. 25年7月期の運用状況（平成24年7月11日～平成25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	%
25年 7月期	2,560	(99.8)	4	(0.2)	2,565	(100.0)
24年 7月期	4,484	(99.8)	8	(0.2)	4,492	(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
25年 7月期	11,438	-	7,340	4,098
24年 7月期	14,419	-	2,980	11,438

(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
25年 7月期	2,654	89	2,565	6,258.6
24年 7月期	4,636	144	4,492	3,927.5

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
25年 7月期	212
24年 7月期	121

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第11期 平成24年7月10日現在	第12期 平成25年7月10日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,366,205	23,021,541
株式	4,484,462,900	2,560,287,300
未収入金	81,290,229	68,576,242
未収配当金	6,684,200	2,854,000
流動資産合計	4,636,803,534	2,654,739,083
資産合計	4,636,803,534	2,654,739,083
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	138,408,003	86,885,507
未払受託者報酬	2,620,187	1,256,600
未払委託者報酬	3,144,240	1,507,943
その他未払費用	130,918	62,753
流動負債合計	144,303,348	89,712,803
負債合計	144,303,348	89,712,803
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	9,242,451,824	3,311,485,384
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△4,749,951,638	△746,459,104
（分配準備積立金）	7,314,434	3,027,040
元本等合計	4,492,500,186	2,565,026,280
純資産合計	4,492,500,186	2,565,026,280
負債純資産合計	4,636,803,534	2,654,739,083

(2) 損益及び剰余金計算書

	第11期 自 平成23年7月11日 至 平成24年7月10日 金 額 (円)	第12期 自 平成24年7月11日 至 平成25年7月10日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	148,555,780	90,237,972
受取利息	25,393	15,542
有価証券売買等損益	△868,615,015	1,357,436,888
その他収益	988	375
営業収益合計	△720,032,854	1,447,690,777
営業費用		
受託者報酬	5,590,374	3,402,611
委託者報酬	6,708,483	4,083,185
その他費用	279,339	169,980
営業費用合計	12,578,196	7,655,776
営業利益又は営業損失（△）	△732,611,050	1,440,035,001
経常利益又は経常損失（△）	△732,611,050	1,440,035,001
当期純利益又は当期純損失（△）	△732,611,050	1,440,035,001
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△5,024,105,561	△4,749,951,638
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,145,172,976	2,650,343,040
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,145,172,976	2,650,343,040
分配金 ※1	138,408,003	86,885,507
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△4,749,951,638	△746,459,104

(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 平成24年7月11日	至 平成25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。	
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11期	第12期
	平成24年7月10日現在	平成25年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	11,650,713,600 円	9,242,451,824 円
期中追加設定元本額	— 円	— 円
期中一部交換元本額	2,408,261,776 円	5,930,966,440 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	11,438,678 口	4,098,373 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4,749,951,638 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746,459,104 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11期	第12期
	自 平成23年7月11日 至 平成24年7月10日	自 平成24年7月11日 至 平成25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（148,582,161円）及び分配準備積立金（9,718,472円）の合計額から、経費（12,578,196円）を控除して計算される分配対象額は145,722,437円（100口当たり1,273円）であり、うち138,408,003円（100口当たり1,210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（90,253,889円）及び分配準備積立金（7,314,434円）の合計額から、経費（7,655,776円）を控除して計算される分配対象額は89,912,547円（100口当たり2,193円）であり、うち86,885,507円（100口当たり2,120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 平成24年7月11日 至 平成25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 平成25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 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 平成24年7月10日現在	第12期 平成25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	△685,043,394	965,201,090
合計	△685,043,394	965,201,090

（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 平成24年7月10日現在	第12期 平成25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 平成24年7月11日 至 平成25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 平成24年7月10日現在	第12期 平成25年7月10日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	392.75円 (39,275円)	625.86円 (62,586円)

平成25年7月期（平成24年7月11日～平成25年7月10日）決算短信

平成25年8月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－東証電気機器株価指数 上場取引所 東証
 コード番号 1610
 連動対象指標 東証電気機器株価指数
 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 <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部担当部長 (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25年10月 3日
 分配金支払開始日 平成25年 8月16日

I ファンドの運用状況

1. 25年7月期の運用状況（平成24年7月11日～平成25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	%
25年 7月期	1,432	(99.6)	6	(0.4)	1,439	(100.0)
24年 7月期	977	(99.5)	4	(0.5)	981	(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
25年 7月期	1,023	—	—	1,023
24年 7月期	1,023	—	—	1,023

(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
25年 7月期	1,459	20	1,439	14,057.5
24年 7月期	1,002	20	981	9,590.5

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
25年 7月期	181
24年 7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 11 期 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 年 7 月 10 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,980,519	9,373,311
株式	977,305,200	1,432,783,400
未収入金	11,046,308	13,765,300
未収配当金	2,983,500	3,207,200
流動資産合計	1,002,315,527	1,459,129,211
資産合計	1,002,315,527	1,459,129,211
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	19,245,560	18,528,970
未払受託者報酬	574,815	679,910
未払委託者報酬	689,787	815,894
その他未払費用	28,653	33,902
流動負債合計	20,538,815	20,058,676
負債合計	20,538,815	20,058,676
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,958,338,100	1,958,338,100
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△976,561,388	△519,267,565
（分配準備積立金）	3,055,739	3,242,459
元本等合計	981,776,712	1,439,070,535
純資産合計	981,776,712	1,439,070,535
負債純資産合計	1,002,315,527	1,459,129,211

(2) 損益及び剰余金計算書

	第11期 自 平成23年7月11日 至 平成24年7月10日 金 額 (円)	第12期 自 平成24年7月11日 至 平成25年7月10日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	21,831,409	21,379,158
受取利息	4,617	4,119
有価証券売買等損益	△343,689,689	457,107,103
その他収益	28	61
営業収益合計	△321,853,635	478,490,441
営業費用		
受託者報酬	1,154,880	1,185,701
委託者報酬	1,385,868	1,422,842
その他費用	57,576	59,105
営業費用合計	2,598,324	2,667,648
営業利益又は営業損失（△）	△324,451,959	475,822,793
経常利益又は経常損失（△）	△324,451,959	475,822,793
当期純利益又は当期純損失（△）	△324,451,959	475,822,793
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△632,863,869	△976,561,388
分配金 ※1	19,245,560	18,528,970
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△976,561,388	△519,267,565

(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 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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。
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 11 期 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	1,958,338,100 円 －円 －円	1,958,338,100 円 －円 －円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,023,700 口	1,023,700 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 976,561,388 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 519,267,565 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 11 期	第 12 期
	自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 日	自 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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（21,836,054 円）及び分配準備積立金(3,063,569 円)の合計額から、経費(2,598,324 円)を控除して計算される分配対象額は 22,301,299 円(100 口当たり 2,178 円)であり、うち 19,245,560 円(100 口当たり 1,880 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（21,383,338 円）及び分配準備積立金(3,055,739 円)の合計額から、経費(2,667,648 円)を控除して計算される分配対象額は 21,771,429 円(100 口当たり 2,126 円)であり、うち 18,528,970 円(100 口当たり 1,810 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 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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 平成 25 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 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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 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	△328, 663, 850	452, 306, 020
合計	△328, 663, 850	452, 306, 020

(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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 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 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額 (100 口当たり純資産額)	959.05 円 (95, 905 円)	1, 405.75 円 (140, 575 円)

平成25年7月期（平成24年7月11日～平成25年7月10日）決算短信

平成25年8月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－東証銀行業株価指数 上場取引所 東証
 コード番号 1612
 連動対象指標 東証銀行業株価指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 100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)白川 真
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部担当部長 (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25年10月 3日
 分配金支払開始日 平成25年 8月16日

I ファンドの運用状況

1. 25年7月期の運用状況（平成24年7月11日～平成25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	%
25年 7月期	811	(99.9)	0	(0.1)	811	(100.0)
24年 7月期	1,276	(99.9)	1	(0.1)	1,277	(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
25年 7月期	12,095	-	7,420	4,674
24年 7月期	12,095	-	-	12,095

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	100口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数) × 100
	百万円	百万円	百万円	円
25年 7月期	840	28	811	17,368
24年 7月期	1,318	41	1,277	10,562

(4) 分配金

	100口当たり分配金
	円
25年 7月期	595
24年 7月期	327

(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

(1) 貸借対照表

	第 11 期 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 年 7 月 10 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,813,708	11,007,773
株式	1,276,034,200	811,110,500
未収入金	18,787,312	18,407,300
流動資産合計	1,318,635,220	840,525,573
資産合計	1,318,635,220	840,525,573
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	39,551,323	27,812,394
未払受託者報酬	688,129	393,823
未払委託者報酬	825,741	472,593
その他未払費用	34,321	19,615
流動負債合計	41,099,514	28,698,425
負債合計	41,099,514	28,698,425
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,479,517,230	958,242,160
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	△1,201,981,524	△146,415,012
(分配準備積立金)	30,749	17,132
元本等合計	1,277,535,706	811,827,148
純資産合計	1,277,535,706	811,827,148
負債純資産合計	1,318,635,220	840,525,573

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 11 期 自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 日 金 額 (円)	第 12 期 自 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 年 7 月 10 日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	42,461,000	29,819,175
受取利息	7,735	5,360
有価証券売買等損益	△93,153,415	319,802,559
その他収益	5	1
営業収益合計	△50,684,675	349,627,095
営業費用		
受託者報酬	1,327,285	900,398
委託者報酬	1,592,733	1,080,494
その他費用	66,192	44,867
営業費用合計	2,986,210	2,025,759
営業利益又は営業損失（△）	△53,670,885	347,601,336
経常利益又は経常損失（△）	△53,670,885	347,601,336
当期純利益又は当期純損失（△）	△53,670,885	347,601,336
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△1,108,759,316	△1,201,981,524
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	735,777,570
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	735,777,570
分配金 ※1	39,551,323	27,812,394
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,201,981,524	△146,415,012

(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 平成 24 年 7 月 11 日	至 平成 25 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。	
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 11 期	第 12 期
	平成 24 年 7 月 10 日現在	平成 25 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	2,479,517,230 円	2,479,517,230 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	－円	1,521,275,070 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	12,095,206 口	4,674,352 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 1,201,981,524 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 146,415,012 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 11 期	第 12 期
	自 平成 23 年 7 月 11 日 至 平成 24 年 7 月 10 日	自 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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（42,468,740 円）及び分配準備積立金(99,542 円)の合計額から、経費(2,986,210 円)を控除して計算される分配対象額は 39,582,072 円（100 口当たり 327.2 円）であり、うち 39,551,323 円（100 口当たり 327.0 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（29,824,536 円）及び分配準備積立金(30,749 円)の合計額から、経費(2,025,759 円)を控除して計算される分配対象額は 27,829,526 円（100 口当たり 595.3 円）であり、うち 27,812,394 円（100 口当たり 595.0 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 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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 平成 25 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 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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 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	△88,893,241	321,421,365
合計	△88,893,241	321,421,365

(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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 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 平成 24 年 7 月 11 日 至 平成 25 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 平成 24 年 7 月 10 日現在	第 12 期 平成 25 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額 (100 口当たり純資産額)	105.62 円 (10,562 円)	173.68 円 (17,368 円)