

平成 29 年 2 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 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 29 年 1 月期 (平成 28 年 1 月 11 日～平成 29 年 1 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 29 年 1 月期 (平成 28 年 1 月 11 日～平成 29 年 1 月 10 日) 決算短信をご報告します。

記

上場ETF (9銘柄)

銘柄名	銘柄 コード	上場取引所
ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス	1365	東
ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス	1366	東
ダイワ上場投信－TOPIX レバレッジ (2 倍) 指数	1367	東
ダイワ上場投信－TOPIX ダブルインバース (－2 倍) 指数	1368	東
ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス	1456	東
ダイワ上場投信－TOPIX インバース (－1 倍) 指数	1457	東
ダイワ上場投信－J P X 日経 400 レバレッジ・インデックス	1464	東
ダイワ上場投信－J P X 日経 400 インバース・インデックス	1465	東
ダイワ上場投信－J P X 日経 400 ダブルインバース・インデックス	1466	東

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

以上

平成29年1月期（平成28年1月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス 上場取引所 東証
 コード番号 1365
 連動対象指標 日経平均レバレッジ・インデックス
 主要投資資産 親投資信託受益証券、株価指数先物取引
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)岩本 信之
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年4月3日
 分配金支払開始日 分配金の支払いは行いません。

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年1月11日～平成29年1月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
29年 1月期	13,067	(53.6)	11,290	(46.4)	24,358	(100.0)
28年 1月期	15,721	(57.1)	11,828	(42.9)	27,549	(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
29年 1月期	2,765	6,100	6,710	2,155
28年 1月期	—	5,285	2,520	2,765

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
29年 1月期	26,930	2,572	24,358	11,303.2
28年 1月期	32,985	5,435	27,549	9,963.8

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	0
28年 1月期	0

(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

平成29年1月期（平成28年1月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス 上場取引所 東証
 コード番号 1366
 連動対象指標 日経平均ダブルインバース・インデックス
 主要投資資産 親投資信託受益証券、株価指数先物取引
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)岩本 信之
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年4月3日
 分配金支払開始日 分配金の支払いは行いません。

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年1月11日～平成29年1月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
29年 1月期	6,183	(59.5)	4,211	(40.5)	10,394	(100.0)
28年 1月期	2,385	(59.1)	1,648	(40.9)	4,034	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
29年 1月期	500	4,458	2,910	2,048
28年 1月期	—	2,625	2,125	500

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
29年 1月期	11,345	951	10,394	5,075.6
28年 1月期	4,854	820	4,034	8,068.4

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	0
28年 1月期	0

(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

平成29年1月期（平成28年1月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ（2倍）指数 上場取引所 東証
 コード番号 1367
 連動対象指標 TOPIXレバレッジ（2倍）指数
 主要投資資産 親投資信託受益証券、株価指数先物取引
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)岩本 信之
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年4月3日
 分配金支払開始日 分配金の支払いは行いません。

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年1月11日～平成29年1月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
29年 1月期	1,289	(56.9)	978	(43.1)	2,267	(100)
28年 1月期	2,140	(66.5)	1,079	(33.5)	3,220	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
29年 1月期	310	410	520	200
28年 1月期	—	530	220	310

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
29年 1月期	2,459	191	2,267	11,340.0
28年 1月期	3,718	498	3,220	10,387.4

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	0
28年 1月期	0

(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

平成29年1月期（平成28年1月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース（-2倍）指数 上場取引所 東証
 コード番号 1368
 連動対象指標 TOPIXダブルインバース（-2倍）指数
 主要投資資産 親投資信託受益証券、株価指数先物取引
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)岩本 信之
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年4月3日
 分配金支払開始日 分配金の支払いは行いません。

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年1月11日～平成29年1月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
29年 1月期	759	(60.5)	495	(39.5)	1,255	(100.0)
28年 1月期	800	(56.3)	621	(43.7)	1,421	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
29年 1月期	180	390	330	240
28年 1月期	—	290	110	180

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
29年 1月期	1,344	88	1,255	5,231.6
28年 1月期	1,605	183	1,421	7,898.3

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	0
28年 1月期	0

(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

平成29年1月期（平成28年1月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス 上場取引所 東証
 コード番号 1456
 連動対象指標 日経平均インバース・インデックス
 主要投資資産 親投資信託受益証券、株価指数先物取引
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)岩本 信之
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年4月3日
 分配金支払開始日 分配金の支払いは行いません。

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年1月11日～平成29年1月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
29年 1月期	11,095	(57.3)	8,279	(42.7)	19,375	(100.0)
28年 1月期	37,200	(58.9)	25,960	(41.1)	63,160	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
29年 1月期	5,884	9,176	12,865	2,194
28年 1月期	—	6,719	835	5,884

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
29年 1月期	20,137	762	19,375	8,828.7
28年 1月期	68,901	5,741	63,160	10,734.3

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	0
28年 1月期	0

(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

平成29年1月期（平成28年1月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－TOPIXインバース（-1倍）指数 上場取引所 東証
 コード番号 1457
 連動対象指標 TOPIXインバース（-1倍）指数
 主要投資資産 親投資信託受益証券、株価指数先物取引
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)岩本 信之
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年4月3日
 分配金支払開始日 分配金の支払いは行いません。

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年1月11日～平成29年1月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
29年 1月期	3,588	(58.1)	2,590	(41.9)	6,179	(100.0)
28年 1月期	2,600	(58.1)	1,872	(41.9)	4,472	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
29年 1月期	420	638	370	688
28年 1月期	—	630	210	420

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
29年 1月期	6,339	160	6,179	8,981.1
28年 1月期	4,786	314	4,472	10,648.8

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	0
28年 1月期	0

(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

平成29年1月期（平成28年1月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス 上場取引所 東証
 コード番号 1464
 連動対象指標 JPX日経400レバレッジ・インデックス
 主要投資資産 親投資信託受益証券、株価指数先物取引
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)岩本 信之
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年4月3日
 分配金支払開始日 分配金の支払いは行いません。

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年1月11日～平成29年1月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
29年 1月期	514	(52.4)	466	(47.6)	981	(100)
28年 1月期	590	(54.8)	487	(45.2)	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
29年 1月期	130	100	120	110
28年 1月期	—	270	140	130

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
29年 1月期	1,065	83	981	8,922.6
28年 1月期	1,236	159	1,077	8,285.8

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	0
28年 1月期	0

(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

平成29年1月期（平成28年1月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－J P X日経400インバース・インデックス 上場取引所 東証
 コード番号 1465
 連動対象指標 J P X日経400インバース・インデックス
 主要投資資産 親投資信託受益証券、株価指数先物取引
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)岩本 信之
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年4月3日
 分配金支払開始日 分配金の支払いは行いません。

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年1月11日～平成29年1月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
29年 1月期	4,618	(56.9)	3,501	(43.1)	8,119	(100.0)
28年 1月期	310	(59.2)	213	(40.8)	523	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
29年 1月期	50	1,430	560	920
28年 1月期	—	100	50	50

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
29年 1月期	8,428	308	8,119	8,825.9
28年 1月期	563	40	523	10,468.0

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	0
28年 1月期	0

(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

平成29年1月期（平成28年1月11日～平成29年1月10日）決算短信

平成29年2月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－J P X日経400ダブルインバース・インデックス 上場取引所 東証
 コード番号 1466
 連動対象指標 J P X日経400ダブルインバース・インデックス
 主要投資資産 親投資信託受益証券、株価指数先物取引
 売買単位 1口
 管理会社 大和証券投資信託委託株式会社 URL <http://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)岩本 信之
 問合せ先責任者 (役職名)経営企画部 (氏名)近藤 龍一郎 TEL (03)5555-4946

有価証券報告書提出予定日 平成29年4月3日
 分配金支払開始日 分配金の支払いは行いません。

I ファンドの運用状況

1. 29年1月期の運用状況（平成28年1月11日～平成29年1月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
29年 1月期	294	(61.3)	186	(38.7)	481	(100.0)
28年 1月期	665	(56.6)	509	(43.4)	1,174	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
29年 1月期	110	—	42	67
28年 1月期	—	220	110	110

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
29年 1月期	517	36	481	7,086.2
28年 1月期	1,331	156	1,174	10,677.7

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
29年 1月期	0
28年 1月期	0

(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