

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)

2020年1月期（2019年1月11日～2020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2020年1月期（2019年1月11日～2020年1月10日）決算短信をご報告します。

記

上場ETF銘柄（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

2020年1月期（2019年1月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20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 <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 2020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. 2020年1月期の運用状況（2019年1月11日～2020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	%
2020年 1月期	3,182	(54.6)	2,642	(45.4)	5,825	(100.0)
2019年 1月期	6,198	(50.4)	6,108	(49.6)	12,307	(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
2020年 1月期	1,005	1,620	2,290	335
2019年 1月期	455	2,460	1,910	1,005

(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
2020年 1月期	6,054	229	5,825	17,388.1
2019年 1月期	13,367	1,060	12,307	12,246.3

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	0
2019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

2020年1月期（2019年1月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20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 <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 2020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. 2020年1月期の運用状況（2019年1月11日～2020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	%
2020年 1月期	7,343	(56.3)	5,696	(43.7)	13,040	(100.0)
2019年 1月期	4,046	(57.2)	3,021	(42.8)	7,068	(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
2020年 1月期	1,980	11,930	8,127	5,782
2019年 1月期	2,670	3,390	4,080	1,980

(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
2020年 1月期	13,417	377	13,040	2,255.1
2019年 1月期	7,410	341	7,068	3,569.8

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	0
2019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

2020年1月期（2019年1月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20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 <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 2020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. 2020年1月期の運用状況（2019年1月11日～2020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	%
2020年 1月期	1,006	(54.6)	836	(45.4)	1,842	(100.0)
2019年 1月期	1,577	(55.6)	1,258	(44.4)	2,835	(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
2020年 1月期	254	250	380	124
2019年 1月期	140	1,480	1,366	254

(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
2020年 1月期	1,893	51	1,842	14,861.5
2019年 1月期	3,026	191	2,835	11,163.3

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	0
2019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

2020年1月期（2019年1月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20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 <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 2020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. 2020年1月期の運用状況（2019年1月11日～2020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	%
2020年 1月期	1,188	(55.6)	948	(44.4)	2,136	(100.0)
2019年 1月期	1,083	(55.2)	879	(44.8)	1,963	(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
2020年 1月期	470	1,440	1,160	750
2019年 1月期	380	570	480	470

(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
2020年 1月期	2,189	53	2,136	2,848.3
2019年 1月期	2,030	67	1,963	4,177.7

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	0
2019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

2020年1月期（2019年1月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20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 <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 2020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. 2020年1月期の運用状況（2019年1月11日～2020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	%
2020年 1月期	27,690	(75.2)	9,129	(24.8)	36,819	(100.0)
2019年 1月期	4,266	(66.8)	2,121	(33.2)	6,388	(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
2020年 1月期	848	36,291	31,034	6,106
2019年 1月期	1,104	6,389	6,645	848

(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
2020年 1月期	37,702	882	36,819	6,029.9
2019年 1月期	6,589	201	6,388	7,530.8

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	0
2019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

2020年1月期（2019年1月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20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 <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 2020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. 2020年1月期の運用状況（2019年1月11日～2020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	%
2020年 1月期	10,886	(65.0)	5,863	(35.0)	16,750	(100.0)
2019年 1月期	7,392	(70.4)	3,107	(29.6)	10,500	(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
2020年 1月期	1,286	4,911	3,724	2,473
2019年 1月期	1,549	1,866	2,129	1,286

(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
2020年 1月期	17,044	293	16,750	6,771.8
2019年 1月期	10,788	288	10,500	8,164.3

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	0
2019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

2020年1月期（2019年1月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－J P X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 J P X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 <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 2020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. 2020年1月期の運用状況（2019年1月11日～2020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	%
2020年 1月期	374	(53.3)	328	(46.7)	702	(100.0)
2019年 1月期	294	(56.8)	224	(43.2)	518	(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
2020年 1月期	60	20	20	60
2019年 1月期	60	—	—	60

(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
2020年 1月期	719	17	702	11,704.3
2019年 1月期	572	53	518	8,639.1

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	0
2019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

2020年1月期（2019年1月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20日

ファンド名 ダイワ上場投信－JPX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 JPX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 <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 2020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. 2020年1月期の運用状況（2019年1月11日～2020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	%
2020年 1月期	1,012	(58.0)	733	(42.0)	1,745	(100.0)
2019年 1月期	2,013	(61.8)	1,241	(38.2)	3,255	(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
2020年 1月期	402	110	250	262
2019年 1月期	945	30	573	402

(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
2020年 1月期	1,773	27	1,745	6,663.3
2019年 1月期	3,378	123	3,255	8,097.2

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	0
2019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

2020年1月期（2019年1月11日～2020年1月10日）決算短信

2020年2月20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 <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 2020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. 2020年1月期の運用状況（2019年1月11日～2020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	%
2020年 1月期	372	(57.7)	273	(42.3)	645	(100.0)
2019年 1月期	216	(55.5)	173	(44.5)	390	(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
2020年 1月期	67	270	170	167
2019年 1月期	67	10	10	67

(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
2020年 1月期	666	21	645	3,845.3
2019年 1月期	406	16	390	5,750.6

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 1月期	0
2019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