

2020年8月21日

各 位

委託会社名 大和アセットマネジメント株式会社
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 岩崎 論
(連絡先 03-5555-4821)

2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日)

大和アセットマネジメント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2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日) 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

*各銘柄の中間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、各銘柄の中間決算短信が表示されます。

以上

2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日)

2020年8月21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 大和アセットマネジメント株式会社 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)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

半期報告書提出予定日 2020年10月2日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月中間期の運用状況 (2020年1月11日～2020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	%
2020年7月中間期	3,280	(58.8)	2,301	(41.2)	5,582	(100.0)
2020年1月期	3,182	(54.6)	2,642	(45.4)	5,825	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年7月中間期	335	1,092	1,045	382

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年7月中間期	5,827	245	5,582	14,614.1
2020年1月期	6,054	229	5,825	17,388.1

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020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	2,278,463,186	1,987,550,562
親投資信託受益証券	3,182,071,498	3,280,918,590
派生商品評価勘定	243,378,600	39,014,850
前払金	—	80,124,000
差入委託証拠金	350,640,000	440,220,000
流動資産合計	6,054,553,284	5,827,828,002
資産合計	6,054,553,284	5,827,828,002
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,988,150	214,994,950
前受金	192,939,400	—
未払金	—	444,400
未払受託者報酬	2,036,601	1,869,958
未払委託者報酬	28,513,060	26,180,181
その他未払費用	4,068,527	1,735,429
流動負債合計	229,545,738	245,224,918
負債合計	229,545,738	245,224,918
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	3,350,000,000	3,820,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	2,475,007,546	1,762,603,084
(分配準備積立金)	△761,543,335	△761,543,335
元本等合計	5,825,007,546	5,582,603,084
純資産合計	5,825,007,546	5,582,603,084
負債純資産合計	6,054,553,284	5,827,828,002

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	当中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	403	12,543
有価証券売買等損益	△1,515,453	△1,152,908
派生商品取引等損益	2,101,189,266	307,536,850
営業収益合計	2,099,674,216	306,396,485
営業費用		
支払利息	1,362,771	591,837
受託者報酬	2,719,795	1,869,958
委託者報酬	38,077,687	26,180,181
その他費用 ※1	2,837,889	1,755,071
営業費用合計	44,998,142	30,397,047
営業利益	2,054,676,074	275,999,438
経常利益	2,054,676,074	275,999,438
中間純利益	2,054,676,074	275,999,438
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	2,257,509,955	2,475,007,546
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,065,482,000	2,559,981,700
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,065,482,000	2,559,981,700
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,896,049,000	3,548,385,600
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	4,896,049,000	3,548,385,600
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	2,481,619,029	1,762,603,084

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	10,050,000,000円	3,350,000,000円
期中追加設定元本額	16,200,000,000円	10,920,000,000円
期中一部交換元本額	22,900,000,000円	10,450,000,000円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	335,000口	382,000口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
※1 その他費用	主に、日経平均レバレッジ・インデックスの商標の使用料であります。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はあります。
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>
--	--

(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	前計算期間末 2020年1月10日 現在				当中間計算期間末 2020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	11,396,540,600	—	11,638,200,000	241,659,400	11,365,284,000	—	11,189,580,000	△175,704,000
合計	11,396,540,600	—	11,638,200,000	241,659,400	11,365,284,000	—	11,189,580,000	△175,704,000

- (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。
原則として中間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、中間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。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	17,388.1円	14,614.1円
(10口当たり純資産額)	(173,881円)	(146,141円)

2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日)

2020年8月21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 大和アセットマネジメント株式会社 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)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

半期報告書提出予定日 2020年10月2日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月中間期の運用状況 (2020年1月11日～2020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	%
2020年7月中間期	8,191	(54.1)	6,944	(45.9)	15,135	(100.0)
2020年1月期	7,343	(56.3)	5,696	(43.7)	13,040	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年7月中間期	5,782	10,289	8,767	7,304

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年7月中間期	15,476	341	15,135	2,072.0
2020年1月期	13,417	377	13,040	2,255.1

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020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	5,055,879,092	5,602,892,613
親投資信託受益証券	7,343,395,449	8,191,255,643
派生商品評価勘定	7,945,000	536,026,500
前払金	211,127,600	—
差入委託証拠金	799,200,000	1,146,660,000
流動資産合計	13,417,547,141	15,476,834,756
資産合計	13,417,547,141	15,476,834,756
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	203,042,850	20,197,900
前受金	—	265,250,000
未払金	127,530,500	—
未払受託者報酬	2,824,487	3,504,598
未払委託者報酬	39,543,562	49,064,971
その他未払費用	4,212,047	3,263,146
流動負債合計	377,153,446	341,280,615
負債合計	377,153,446	341,280,615
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	57,825,000,000	73,048,750,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△44,784,606,305	△57,913,195,859
(分配準備積立金)	△342,269,776	△342,269,776
元本等合計	13,040,393,695	15,135,554,141
純資産合計	13,040,393,695	15,135,554,141
負債純資産合計	13,417,547,141	15,476,834,756

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	当中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	355	46,418
有価証券売買等損益	△1,231,298	△2,139,806
派生商品取引等損益	△1,223,859,045	△1,133,723,150
営業収益合計	△1,225,089,988	△1,135,816,538
営業費用		
支払利息	954,535	1,140,115
受託者報酬	2,043,412	3,504,598
委託者報酬	28,608,237	49,064,971
その他費用 ※1	2,147,798	3,186,657
営業費用合計	33,753,982	56,896,341
営業損失 (△)	△1,258,843,970	△1,192,712,879
経常損失 (△)	△1,258,843,970	△1,192,712,879
中間純損失 (△)	△1,258,843,970	△1,192,712,879
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△12,731,836,273	△44,784,606,305
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,743,459,000	65,470,112,100
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	18,743,459,000	65,470,112,100
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,235,477,000	77,405,988,775
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	26,235,477,000	77,405,988,775
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△21,482,698,243	△57,913,195,859

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	19,800,000,000円	57,825,000,000円
期中追加設定元本額	119,300,000,000円	102,893,750,000円
期中一部交換元本額	81,275,000,000円	87,670,000,000円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	5,782,500口	7,304,875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44,784,606,305円であります。	中間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57,913,195,859円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
※1 その他費用	主に、日経平均ダブルインバース・インデックスの商標の使用料であります。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

（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	前計算期間末 2020年1月10日 現在				当中間計算期間末 2020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								
売 建	20,154,372,400	—	20,349,000,000	△194,627,600	30,563,490,000	—	30,046,920,000	516,570,000
合計	20,154,372,400	—	20,349,000,000	△194,627,600	30,563,490,000	—	30,046,920,000	516,570,000

（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。

原則として中間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、中間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。

（1口当たり情報）

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	2,255.1円	2,072.0円
（10口当たり純資産額）	(22,551円)	(20,720円)

2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日)

2020年8月21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 大和アセットマネジメント株式会社 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)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

半期報告書提出予定日 2020年10月2日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月中間期の運用状況 (2020年1月11日～2020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	%
2020年7月中間期	806	(61.4)	507	(38.6)	1,313	(100.0)
2020年1月期	1,006	(54.6)	836	(45.4)	1,842	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年7月中間期	124	100	110	114

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年7月中間期	1,456	143	1,313	11,523.5
2020年1月期	1,893	51	1,842	14,861.5

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020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	740,493,700	444,972,714
親投資信託受益証券	1,006,588,039	806,309,481
派生商品評価勘定	40,972,150	—
未収入金	3,551,300	—
前払金	—	110,090,000
差入委託証拠金	102,240,000	95,460,000
流動資産合計	1,893,845,189	1,456,832,195
資産合計	1,893,845,189	1,456,832,195
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	374,950	135,159,050
前受金	42,145,000	—
未払金	—	801,100
未払受託者報酬	478,027	437,875
未払委託者報酬	6,693,075	6,130,825
その他未払費用	1,332,914	620,855
流動負債合計	51,023,966	143,149,705
負債合計	51,023,966	143,149,705
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,240,000,000	1,140,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	602,821,223	173,682,490
（分配準備積立金）	△132,326,524	△132,326,524
元本等合計	1,842,821,223	1,313,682,490
純資産合計	1,842,821,223	1,313,682,490
負債純資産合計	1,893,845,189	1,456,832,195

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	当中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	53	2,647
有価証券売買等損益	△339,452	△278,558
派生商品取引等損益	277,053,097	△239,509,150
営業収益合計	276,713,698	△239,785,061
営業費用		
支払利息	247,198	134,571
受託者報酬	568,342	437,875
委託者報酬	7,957,460	6,130,825
その他費用 ※1	826,553	598,401
営業費用合計	9,599,553	7,301,672
営業利益又は営業損失 (△)	267,114,145	△247,086,733
経常利益又は経常損失 (△)	267,114,145	△247,086,733
中間純利益又は中間純損失 (△)	267,114,145	△247,086,733
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	295,489,270	602,821,223
剰余金増加額又は欠損金減少額	269,658,000	41,436,000
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	269,658,000	41,436,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	556,929,000	223,488,000
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	556,929,000	223,488,000
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	275,332,415	173,682,490

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額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。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	2,540,000,000円	1,240,000,000円
期中追加設定元本額	2,500,000,000円	1,000,000,000円
期中一部交換元本額	3,800,000,000円	1,100,000,000円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	124,000口	114,000口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	当中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
※1 その他費用	主に、対象指数の商標の使用料 であります。	主に、対象指数の商標の使用料 であります。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 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、中間貸借対照表計上 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>
--	--

(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	前計算期間末 2020年1月10日 現在				当中間計算期間末 2020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	3,352,055,000	—	3,392,760,000	40,705,000	2,766,755,000	—	2,631,690,000	△135,065,000
合計	3,352,055,000	—	3,392,760,000	40,705,000	2,766,755,000	—	2,631,690,000	△135,065,000

(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。
原則として中間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、中間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。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	14,861.5円	11,523.5円
(10口当たり純資産額)	(148,615円)	(115,235円)

2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日)

2020年8月21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 大和アセットマネジメント株式会社 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)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

半期報告書提出予定日 2020年10月2日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月中間期の運用状況 (2020年1月11日～2020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	%
2020年7月中間期	2,217	(54.4)	1,855	(45.6)	4,073	(100.0)
2020年1月期	1,188	(55.6)	948	(44.4)	2,136	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年7月中間期	750	1,715	1,120	1,345

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年7月中間期	4,224	151	4,073	3,027.1
2020年1月期	2,189	53	2,136	2,848.3

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020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	840,797,060	1,508,445,322
親投資信託受益証券	1,188,182,781	2,217,661,091
派生商品評価勘定	1,017,450	214,534,800
前払金	41,395,000	—
差入委託証拠金	118,560,000	284,160,000
流動資産合計	2,189,952,291	4,224,801,213
資産合計	2,189,952,291	4,224,801,213
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	45,018,300	10,632,500
前受金	—	127,041,600
未払受託者報酬	495,775	856,546
未払委託者報酬	6,941,444	11,992,384
その他未払費用	1,239,328	1,139,316
流動負債合計	53,694,847	151,662,346
負債合計	53,694,847	151,662,346
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	7,500,000,000	13,455,710,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△5,363,742,556	△9,382,571,133
(分配準備積立金)	△66,531,835	△66,531,835
元本等合計	2,136,257,444	4,073,138,867
純資産合計	2,136,257,444	4,073,138,867
負債純資産合計	2,189,952,291	4,224,801,213

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 2019 年 1 月 11 日 至 2019 年 7 月 10 日	当中間計算期間 自 2020 年 1 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	59	10,099
有価証券売買等損益	△268,559	△521,690
派生商品取引等損益	△233,659,500	△506,654,850
営業収益合計	△233,928,000	△507,166,441
営業費用		
支払利息	173,943	280,399
受託者報酬	407,546	856,546
委託者報酬	5,706,254	11,992,384
その他費用 ※1	658,369	1,091,386
営業費用合計	6,946,112	14,220,715
営業損失 (△)	△240,874,112	△521,387,156
経常損失 (△)	△240,874,112	△521,387,156
中間純損失 (△)	△240,874,112	△521,387,156
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△2,736,493,992	△5,363,742,556
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,934,922,000	7,539,395,000
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,934,922,000	7,539,395,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,679,298,000	11,036,836,421
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,679,298,000	11,036,836,421
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△2,721,744,104	△9,382,571,133

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	4,700,000,000円	7,500,000,000円
期中追加設定元本額	14,400,000,000円	17,155,710,000円
期中一部交換元本額	11,600,000,000円	11,200,000,000円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	750,000口	1,345,571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5,363,742,556円であります。	中間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9,382,571,133円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
※1 その他費用	主に、対象指数の商標の使用料であります。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

（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	前計算期間末 2020年1月10日現在				当中間計算期間末 2020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								
売 建	4,231,705,000	—	4,275,570,000	△43,865,000	8,299,331,600	—	8,095,140,000	204,191,600
合計	4,231,705,000	—	4,275,570,000	△43,865,000	8,299,331,600	—	8,095,140,000	204,191,600

（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。

原則として中間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、中間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。

（1口当たり情報）

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	2,848.3円	3,027.1円
（10口当たり純資産額）	（28,483円）	（30,271円）

2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日)

2020年8月21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 大和アセットマネジメント株式会社 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)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

半期報告書提出予定日 2020年10月2日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月中間期の運用状況 (2020年1月11日～2020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	%
2020年7月中間期	9,585	(52.7)	8,606	(47.3)	18,192	(100.0)
2020年1月期	27,690	(75.2)	9,129	(24.8)	36,819	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年7月中間期	6,106	5,004	8,058	3,053

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年7月中間期	18,469	276	18,192	5,958.7
2020年1月期	37,702	882	36,819	6,029.9

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020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	8,470,504,667	7,853,396,986
親投資信託受益証券	27,690,382,518	9,585,982,389
派生商品評価勘定	1,793,150	335,184,150
前払金	414,878,000	—
差入委託証拠金	1,124,640,000	695,130,000
流動資産合計	37,702,198,335	18,469,693,525
資産合計	37,702,198,335	18,469,693,525
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	563,763,250	68,371,850
前受金	—	115,000,000
未払金	9,778,000	—
未払受託者報酬	18,962,685	5,886,514
未払委託者報酬	265,478,366	82,411,813
その他未払費用	24,458,177	5,301,818
流動負債合計	882,440,478	276,971,995
負債合計	882,440,478	276,971,995
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	61,061,680,000	30,531,380,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△24,241,922,143	△12,338,658,470
(分配準備積立金)	△902,893,603	△902,893,603
元本等合計	36,819,757,857	18,192,721,530
純資産合計	36,819,757,857	18,192,721,530
負債純資産合計	37,702,198,335	18,469,693,525

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	当中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	2,324	39,841
有価証券売買等損益	△10,272,815	△4,400,129
派生商品取引等損益	△3,977,717,333	2,309,071,500
営業収益合計	△3,987,987,824	2,304,711,212
営業費用		
支払利息	4,034,650	1,605,299
受託者報酬	10,056,058	5,886,514
委託者報酬	140,785,454	82,411,813
その他費用	9,873,548	5,548,779
営業費用合計	164,749,710	95,452,405
営業利益又は営業損失 (△)	△4,152,737,534	2,209,258,807
経常利益又は経常損失 (△)	△4,152,737,534	2,209,258,807
中間純利益又は中間純損失 (△)	△4,152,737,534	2,209,258,807
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△2,094,545,184	△24,241,922,143
剰余金増加額又は欠損金減少額	64,797,661,100	23,695,824,500
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	64,797,661,100	23,695,824,500
剰余金減少額又は欠損金増加額	96,148,804,590	14,001,819,634
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	96,148,804,590	14,001,819,634
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△37,598,426,208	△12,338,658,470

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	8,482,680,000円	61,061,680,000円
期中追加設定元本額	362,919,000,000円	50,049,700,000円
期中一部交換元本額	310,340,000,000円	80,580,000,000円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	6,106,168口	3,053,138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24,241,922,143円であります。	中間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12,338,658,470円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 2019年1月11日	至 2019年7月10日	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
	該当事項はありません。		該当事項はありません。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

（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	前計算期間末 2020年1月10日現在				当中間計算期間末 2020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								
売 建	36,138,478,000	—	36,699,600,000	△561,122,000	18,411,320,000	—	18,144,060,000	267,260,000
合計	36,138,478,000	—	36,699,600,000	△561,122,000	18,411,320,000	—	18,144,060,000	267,260,000

（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。

原則として中間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、中間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。

（1口当たり情報）

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	6,029.9円	5,958.7円
（10口当たり純資産額）	(60,299円)	(59,587円)

2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日)

2020年8月21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 大和アセットマネジメント株式会社 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)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

半期報告書提出予定日 2020年10月2日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月中間期の運用状況 (2020年1月11日～2020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	%
2020年7月中間期	11,183	(54.8)	9,224	(45.2)	20,408	(100.0)
2020年1月期	10,886	(65.0)	5,863	(35.0)	16,750	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年7月中間期	2,473	2,983	2,591	2,866

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年7月中間期	21,088	680	20,408	7,120.1
2020年1月期	17,044	293	16,750	6,771.8

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末 2020 年 1 月 10 日現在	当中間計算期間末 2020 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	5,487,684,738	8,383,829,780
親投資信託受益証券	10,886,843,605	11,183,722,231
派生商品評価勘定	471,250	801,308,400
前払金	204,695,000	—
差入委託証拠金	464,640,000	719,835,000
流動資産合計	17,044,334,593	21,088,695,411
資産合計	17,044,334,593	21,088,695,411
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	215,387,450	12,612,250
前受金	—	594,476,000
未払受託者報酬	4,650,279	4,682,074
未払委託者報酬	65,104,597	65,549,485
その他未払費用	8,405,501	3,097,697
流動負債合計	293,547,827	680,417,506
負債合計	293,547,827	680,417,506
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	24,736,000,000	28,663,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△) ※2	△7,985,213,234	△8,254,722,095
(分配準備積立金)	△338,255,074	△338,255,074
元本等合計	16,750,786,766	20,408,277,905
純資産合計	16,750,786,766	20,408,277,905
負債純資産合計	17,044,334,593	21,088,695,411

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 2019 年 1 月 11 日 至 2019 年 7 月 10 日	当中間計算期間 自 2020 年 1 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	830	41,801
有価証券売買等損益	△2,492,568	△3,121,374
派生商品取引等損益	△960,205,935	585,162,750
営業収益合計	△962,697,673	582,083,177
営業費用		
支払利息	1,873,033	1,489,889
受託者報酬	4,023,801	4,682,074
委託者報酬	56,333,928	65,549,485
その他費用 ※1	5,731,378	6,267,310
営業費用合計	67,962,140	77,988,758
営業利益又は営業損失 (△)	△1,030,659,813	504,094,419
経常利益又は経常損失 (△)	△1,030,659,813	504,094,419
中間純利益又は中間純損失 (△)	△1,030,659,813	504,094,419
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△2,360,928,504	△7,985,213,234
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,218,794,198	6,024,803,800
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	5,218,794,198	6,024,803,800
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,345,066,883	6,798,407,080
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	7,345,066,883	6,798,407,080
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△5,517,861,002	△8,254,722,095

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020 年 1 月 11 日	至 2020 年 7 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	2020 年 1 月 10 日現在	2020 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	12,861,000,000 円	24,736,000,000 円
期中追加設定元本額	49,117,100,000 円	29,837,000,000 円
期中一部交換元本額	37,242,100,000 円	25,910,000,000 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	2,473,600 口	2,866,300 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 7,985,213,234 円であります。	中間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 8,254,722,095 円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 2019 年 1 月 11 日 至 2019 年 7 月 10 日	自 2020 年 1 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日
※1 その他費用	主に、対象指数の商標の使用料であります。	主に、対象指数の商標の使用料であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020 年 7 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

（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	前計算期間末 2020 年 1 月 10 日 現在				当中間計算期間末 2020 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								
売 建	16,818,665,000	—	17,033,040,000	△214,375,000	21,211,956,000	—	20,422,530,000	789,426,000
合計	16,818,665,000	—	17,033,040,000	△214,375,000	21,211,956,000	—	20,422,530,000	789,426,000

（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。

原則として中間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、中間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。

(1 口当たり情報)

	前計算期間末 2020 年 1 月 10 日現在	当中間計算期間末 2020 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	6,771.8 円	7,120.1 円
(10 口当たり純資産額)	(67,718 円)	(71,201 円)

2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日)

2020年8月21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 大和アセットマネジメント株式会社 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)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

半期報告書提出予定日 2020年10月2日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月中間期の運用状況 (2020年1月11日～2020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	%
2020年7月中間期	323	(58.4)	230	(41.6)	554	(100.0)
2020年1月期	374	(53.3)	328	(46.7)	702	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年7月中間期	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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年7月中間期	611	56	554	9,245.6
2020年1月期	719	17	702	11,704.3

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020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	291,173,401	204,053,254
親投資信託受益証券	374,020,703	323,928,638
派生商品評価勘定	16,747,260	—
前払金	—	43,741,200
差入委託証拠金	38,052,000	39,543,000
流動資産合計	719,993,364	611,266,092
資産合計	719,993,364	611,266,092
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	129,640	53,351,790
前受金	14,907,500	—
未払金	—	555,560
未払受託者報酬	168,328	151,073
未払委託者報酬	2,357,266	2,115,750
その他未払費用	175,391	356,601
流動負債合計	17,738,125	56,530,774
負債合計	17,738,125	56,530,774
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	600,000,000	600,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	102,255,239	△45,264,682
(分配準備積立金)	△36,756,924	△36,756,924
元本等合計	702,255,239	554,735,318
純資産合計	702,255,239	554,735,318
負債純資産合計	719,993,364	611,266,092

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	当中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	17	917
有価証券売買等損益	△90,074	△92,065
派生商品取引等損益	46,700,420	△144,917,550
営業収益合計	46,610,363	△145,008,698
営業費用		
支払利息	68,970	45,492
受託者報酬	149,495	151,073
委託者報酬	2,093,514	2,115,750
その他費用 ※1	215,329	198,908
営業費用合計	2,527,308	2,511,223
営業利益又は営業損失 (△)	44,083,055	△147,519,921
経常利益又は経常損失 (△)	44,083,055	△147,519,921
中間純利益又は中間純損失 (△)	44,083,055	△147,519,921
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△81,656,542	102,255,239
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,794,000	—
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,794,000	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,852,000	—
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	2,852,000	—
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△36,631,487	△45,264,682

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	600,000,000 円	600,000,000 円
期中追加設定元本額	200,000,000 円	－円
期中一部交換元本額	200,000,000 円	－円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	60,000 口	60,000 口
3. ※2 元本の欠損	—	中間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45,264,682円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
※1 その他費用	主に、対象指数の商標の使用料であります。	主に、対象指数の商標の使用料であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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	<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>

（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	前計算期間末 2020年1月10日 現在				当中間計算期間末 2020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	1,388,866,500	—	1,405,584,000	16,717,500	1,164,273,400	—	1,111,009,500	△53,263,900
合計	1,388,866,500	—	1,405,584,000	16,717,500	1,164,273,400	—	1,111,009,500	△53,263,900

（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。

原則として中間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、中間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。

(1 口当たり情報)

	前計算期間末 2020 年 1 月 10 日現在	当中間計算期間末 2020 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	11,704.3 円	9,245.6 円
(10 口当たり純資産額)	(117,043 円)	(92,456 円)

2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日)

2020年8月21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 大和アセットマネジメント株式会社 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)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

半期報告書提出予定日 2020年10月2日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月中間期の運用状況 (2020年1月11日～2020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	%
2020年7月中間期	612	(62.1)	373	(37.9)	985	(100.0)
2020年1月期	1,012	(58.0)	733	(42.0)	1,745	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年7月中間期	262	110	230	142

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年7月中間期	1,022	36	985	6,942.2
2020年1月期	1,773	27	1,745	6,663.3

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末 2020 年 1 月 10 日現在	当中間計算期間末 2020 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	693,706,611	338,571,114
親投資信託受益証券	1,012,545,166	612,271,820
派生商品評価勘定	497,720	37,189,550
前払金	19,225,000	—
差入委託証拠金	47,544,000	34,055,000
流動資産合計	1,773,518,497	1,022,087,484
資産合計	1,773,518,497	1,022,087,484
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	22,115,990	1,002,600
前受金	—	27,557,000
未払受託者報酬	351,232	454,297
未払委託者報酬	4,917,720	6,360,737
その他未払費用	355,642	914,860
流動負債合計	27,740,584	36,289,494
負債合計	27,740,584	36,289,494
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,620,000,000	1,420,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△) ※2	△874,222,087	△434,202,010
(分配準備積立金)	△172,056,238	△172,056,238
元本等合計	1,745,777,913	985,797,990
純資産合計	1,745,777,913	985,797,990
負債純資産合計	1,773,518,497	1,022,087,484

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 2019 年 1 月 11 日 至 2019 年 7 月 10 日	当中間計算期間 自 2020 年 1 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	38	3,081
有価証券売買等損益	△363,160	△273,346
派生商品取引等損益	△223,173,909	173,870,560
営業収益合計	△223,537,031	173,600,295
営業費用		
支払利息	192,104	132,047
受託者報酬	528,480	454,297
委託者報酬	7,399,253	6,360,737
その他費用 ※1	747,363	597,137
営業費用合計	8,867,200	7,544,218
営業利益又は営業損失 (△)	△232,404,231	166,056,077
経常利益又は経常損失 (△)	△232,404,231	166,056,077
中間純利益又は中間純損失 (△)	△232,404,231	166,056,077
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△764,935,738	△874,222,087
剰余金増加額又は欠損金減少額	629,094,000	540,804,000
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	629,094,000	540,804,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,346,000	266,840,000
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	22,346,000	266,840,000
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△390,591,969	△434,202,010

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	4,020,000,000円	2,620,000,000円
期中追加設定元本額	1,100,000,000円	1,100,000,000円
期中一部交換元本額	2,500,000,000円	2,300,000,000円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	262,000口	142,000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874,222,087円であります。	中間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434,202,010円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
※1 その他費用	主に、対象指数の商標の使用料であります。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

（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	前計算期間末 2020年1月10日現在				当中間計算期間末 2020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								
売 建	1,924,356,000	—	1,945,836,000	△21,480,000	1,016,567,000	—	980,302,500	36,264,500
合計	1,924,356,000	—	1,945,836,000	△21,480,000	1,016,567,000	—	980,302,500	36,264,500

（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。

原則として中間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、中間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。

（1口当たり情報）

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	6,663.3円	6,942.2円
（10口当たり純資産額）	(66,633円)	(69,422円)

2021年1月期 中間決算短信 (2020年1月11日～2020年7月10日)

2020年8月21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 大和アセットマネジメント株式会社 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)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

半期報告書提出予定日 2020年10月2日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月中間期の運用状況 (2020年1月11日～2020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	%
2020年7月中間期	717	(52.3)	654	(47.7)	1,371	(100.0)
2020年1月期	372	(57.7)	273	(42.3)	645	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年7月中間期	167	422	240	350

(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/当中間計算期間末(前計算期間末) 発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年7月中間期	1,443	71	1,371	3,916.7
2020年1月期	666	21	645	3,845.3

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 中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

	前計算期間末 2020 年 1 月 10 日現在	当中間計算期間末 2020 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	243,684,002	543,184,771
親投資信託受益証券	372,334,184	717,095,329
派生商品評価勘定	11,020	89,070,160
前払金	15,721,310	—
差入委託証拠金	35,154,000	93,786,000
流動資産合計	666,904,516	1,443,136,260
資産合計	666,904,516	1,443,136,260
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,393,900	4,836,500
前受金	—	60,468,600
未払金	110,050	—
未払受託者報酬	237,924	368,269
未払委託者報酬	3,331,483	5,156,259
その他未払費用	212,863	672,055
流動負債合計	21,286,220	71,501,683
負債合計	21,286,220	71,501,683
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,679,000,000	3,502,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△) ※2	△1,033,381,704	△2,130,365,423
(分配準備積立金)	△26,714,591	△26,714,591
元本等合計	645,618,296	1,371,634,577
純資産合計	645,618,296	1,371,634,577
負債純資産合計	666,904,516	1,443,136,260

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間 自 2019 年 1 月 11 日 至 2019 年 7 月 10 日	当中間計算期間 自 2020 年 1 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	50	4,654
有価証券売買等損益	△100,974	△238,855
派生商品取引等損益	△82,160,282	△751,133,980
営業収益合計	△82,261,206	△751,368,181
営業費用		
支払利息	74,411	120,717
受託者報酬	158,819	368,269
委託者報酬	2,223,940	5,156,259
その他費用 ※1	221,323	486,693
営業費用合計	2,678,493	6,131,938
営業損失 (△)	△84,939,699	△757,500,119
経常損失 (△)	△84,939,699	△757,500,119
中間純損失 (△)	△84,939,699	△757,500,119
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△288,532,429	△1,033,381,704
剰余金増加額又は欠損金減少額	148,541,000	1,402,005,000
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	148,541,000	1,402,005,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,260,094,000	1,741,488,600
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,260,094,000	1,741,488,600
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△1,485,025,128	△2,130,365,423

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	679,000,000円	1,679,000,000円
期中追加設定元本額	2,700,000,000円	4,223,000,000円
期中一部交換元本額	1,700,000,000円	2,400,000,000円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	167,900口	350,200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1,033,381,704円であります。	中間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2,130,365,423円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
※1 その他費用	主に、対象指数の商標の使用料であります。	主に、対象指数の商標の使用料であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

（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	前計算期間末 2020年1月10日現在				当中間計算期間末 2020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								
売 建	1,270,644,640	—	1,287,936,000	△17,291,360	2,801,485,600	—	2,717,037,000	84,448,600
合計	1,270,644,640	—	1,287,936,000	△17,291,360	2,801,485,600	—	2,717,037,000	84,448,600

（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。

原則として中間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、中間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。

（1口当たり情報）

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	3,845.3円	3,916.7円
（10口当たり純資産額）	（38,453円）	（39,167円）