

平成 28 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 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 中間決算短信 (平成 28 年 1 月 11 日～平成 28 年 7 月 10 日)

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 中間決算短信 (平成 28 年 1 月 11 日～平成 28 年 7 月 10 日) 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

平成29年1月期 中間決算短信（平成28年1月11日～平成28年7月10日）

平成28年8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

半期報告書提出予定日 平成28年10月3日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月中間期の運用状況（平成28年1月11日～平成28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	%
28年 7月中間期	17,817	(55.7)	14,144	(44.3)	31,961	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 7月中間期	2,765	4,610	2,790	4,585

(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
28年 7月中間期	38,450	6,489	31,961	6,970.9
28年 1月期	32,985	5,435	27,549	9,963.8

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	当中間計算期間末
	平成28年1月10日現在	平成28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	9,798,960,868	11,901,876,402
親投資信託受益証券	15,721,047,748	17,817,219,320
未収利息	38,036	—
前払金	5,410,250,000	5,653,763,000
差入委託証拠金	2,055,240,000	3,078,000,000
流動資産合計	32,985,536,652	38,450,858,722
資産合計	32,985,536,652	38,450,858,722
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,321,349,905	6,173,644,068
未払金	—	80,754,017
未払解約金	—	71,023,000
未払受託者報酬	7,074,666	10,290,357
未払委託者報酬	99,045,958	144,065,566
未払利息	—	38,268
その他未払費用	8,167,710	9,371,869
流動負債合計	5,435,638,239	6,489,187,145
負債合計	5,435,638,239	6,489,187,145
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	27,650,000,000	45,850,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△100,101,587	△13,888,328,423
(分配準備積立金)	△141,539,827	△141,539,827
元本等合計	27,549,898,413	31,961,671,577
純資産合計	27,549,898,413	31,961,671,577
負債純資産合計	32,985,536,652	38,450,858,722

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成27年1月5日 至 平成27年7月4日	自 平成28年1月11日 至 平成28年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	908,640	924,641
有価証券売買等損益	611,534	△3,828,428
派生商品取引等損益	2,905,960,078	△10,360,866,984
営業収益合計	2,907,480,252	△10,363,770,771
営業費用		
支払利息	—	2,115,122
受託者報酬	2,254,265	10,290,357
委託者報酬	31,560,440	144,065,566
その他費用	2,026,360	9,220,020
営業費用合計	35,841,065	165,691,065
営業利益又は営業損失 (△)	2,871,639,187	△10,529,461,836
経常利益又は経常損失 (△)	2,871,639,187	△10,529,461,836
中間純利益又は中間純損失 (△)	2,871,639,187	△10,529,461,836
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	—	△100,101,587
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,730,166,000	3,822,001,000
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	3,822,001,000
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	2,730,166,000	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,619,083,000	7,080,766,000
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,619,083,000	—
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	7,080,766,000
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	3,982,722,187	△13,888,328,423

(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 平成28年1月11日	至 平成28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
	平成28年1月10日現在	平成28年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	2,000,000,000円	27,650,000,000円
期中追加設定元本額	50,850,000,000円	46,100,000,000円
期中一部交換元本額	25,200,000,000円	27,900,000,000円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	2,765,000口	4,585,000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100,101,587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13,888,328,423円あります。

(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 平成27年1月5日 至 平成27年7月4日	自 平成28年1月11日 至 平成28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 平成28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 平成28年1月10日 現在				当中間計算期間末 平成28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	60,545,010,000	—	55,228,180,000	△5,316,830,000	70,053,363,000	—	63,882,000,000	△6,171,363,000
合計	60,545,010,000	—	55,228,180,000	△5,316,830,000	70,053,363,000	—	63,882,000,000	△6,171,363,000

(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 平成28年1月10日現在	当中間計算期間末 平成28年7月10日現在
1口当たり純資産額	9,963.8円	6,970.9円
(10口当たり純資産額)	(99,638円)	(69,709円)

平成29年1月期 中間決算短信（平成28年1月11日～平成28年7月10日）

平成28年8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

半期報告書提出予定日 平成28年10月3日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月中間期の運用状況（平成28年1月11日～平成28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	%
28年 7月中間期	2,994	(60.1)	1,989	(39.9)	4,984	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 7月中間期	500	1,520	1,470	550

(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
28年 7月中間期	6,495	1,510	4,984	9,063.6
28年 1月期	4,854	820	4,034	8,068.4

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	当中間計算期間末
	平成28年1月10日現在	平成28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	1,382,267,947	2,162,352,399
親投資信託受益証券	2,385,538,920	2,994,984,076
派生商品評価勘定	783,842,051	867,685,437
未収入金	1,338,840	—
未収利息	5,364	—
差入委託証拠金	301,620,000	470,160,000
流動資産合計	4,854,613,122	6,495,181,912
資産合計	4,854,613,122	6,495,181,912
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	345,993	3,240
前受金	799,473,000	776,618,000
未払金	42,247	—
未払解約金	—	713,287,000
未払受託者報酬	1,228,271	1,276,414
未払委託者報酬	17,196,376	17,870,267
未払利息	—	6,952
その他未払費用	2,128,411	1,167,443
流動負債合計	820,414,298	1,510,229,316
負債合計	820,414,298	1,510,229,316
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	5,000,000,000	5,500,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	△965,801,176	△515,047,404
(分配準備積立金)	△38,219,517	△38,219,517
元本等合計	4,034,198,824	4,984,952,596
純資産合計	4,034,198,824	4,984,952,596
負債純資産合計	4,854,613,122	6,495,181,912

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成27年1月5日 至 平成27年7月4日	自 平成28年1月11日 至 平成28年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	453,226	68,352
有価証券売買等損益	323,747	△554,844
派生商品取引等損益	△1,617,047,276	1,425,928,530
営業収益合計	△1,616,270,303	1,425,442,038
営業費用		
支払利息	—	300,977
受託者報酬	1,280,492	1,276,414
委託者報酬	17,927,492	17,870,267
その他費用	1,151,142	1,169,608
営業費用合計	20,359,126	20,617,266
営業利益又は営業損失 (△)	△1,636,629,429	1,404,824,772
経常利益又は経常損失 (△)	△1,636,629,429	1,404,824,772
中間純利益又は中間純損失 (△)	△1,636,629,429	1,404,824,772
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	—	△965,801,176
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,899,287,500	2,020,757,000
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,899,287,500	2,020,757,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,281,997,500	2,974,828,000
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,281,997,500	2,974,828,000
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△3,019,339,429	△515,047,404

(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 平成28年1月11日	至 平成28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
	平成28年1月10日現在	平成28年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	1,000,000,000円	5,000,000,000円
期中追加設定元本額	25,250,000,000円	15,200,000,000円
期中一部交換元本額	21,250,000,000円	14,700,000,000円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	500,000口	550,000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965,801,176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515,047,404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 平成27年1月5日 至 平成27年7月4日	自 平成28年1月11日 至 平成28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 平成28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 平成28年1月10日 現在				当中間計算期間末 平成28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	8,815,683,000	—	8,031,260,000	784,423,000	10,832,118,000	—	9,964,080,000	868,038,000
合計	8,815,683,000	—	8,031,260,000	784,423,000	10,832,118,000	—	9,964,080,000	868,038,000

(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 平成28年1月10日現在	当中間計算期間末 平成28年7月10日現在
1口当たり純資産額	8,068.4円	9,063.6円
(10口当たり純資産額)	(80,684円)	(90,636円)

平成29年1月期 中間決算短信（平成28年1月11日～平成28年7月10日）

平成28年8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

半期報告書提出予定日 平成28年10月3日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月中間期の運用状況（平成28年1月11日～平成28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	%
28年 7月中間期	1,490	(53.2)	1,312	(46.8)	2,802	(100.0)
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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 7月中間期	310	390	300	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
28年 7月中間期	3,392	590	2,802	7,005.8
28年 1月期	3,718	498	3,220	10,387.4

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	当中間計算期間末
	平成28年1月10日現在	平成28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	907,887,352	1,121,396,189
親投資信託受益証券	2,140,442,287	1,490,117,531
未収利息	3,524	—
前払金	448,779,000	514,526,000
差入委託証拠金	221,760,000	266,760,000
流動資産合計	3,718,872,163	3,392,799,720
資産合計	3,718,872,163	3,392,799,720
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	475,340,023	569,006,019
未払金	3,235,300	6,665,399
未払受託者報酬	1,180,896	906,839
未払委託者報酬	16,533,056	12,696,251
未払利息	—	3,604
その他未払費用	2,474,764	1,201,943
流動負債合計	498,764,039	590,480,055
負債合計	498,764,039	590,480,055
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	3,100,000,000	4,000,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△) ※2	120,108,124	△1,197,680,335
(分配準備積立金)	△30,023,015	△30,023,015
元本等合計	3,220,108,124	2,802,319,665
純資産合計	3,220,108,124	2,802,319,665
負債純資産合計	3,718,872,163	3,392,799,720

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成27年1月5日 至 平成27年7月4日	自 平成28年1月11日 至 平成28年7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	282,438	91,557
有価証券売買等損益	224,139	△324,756
派生商品取引等損益	778,972,004	△1,144,516,696
営業収益合計	779,478,581	△1,144,749,895
営業費用		
支払利息	—	166,649
受託者報酬	737,989	906,839
委託者報酬	10,332,400	12,696,251
その他費用 ※1	1,013,536	1,122,825
営業費用合計	12,083,925	14,892,564
営業利益又は営業損失(△)	767,394,656	△1,159,642,459
経常利益又は経常損失(△)	767,394,656	△1,159,642,459
中間純利益又は中間純損失(△)	767,394,656	△1,159,642,459
期首剰余金又は期首欠損金(△)	—	120,108,124
剰余金増加額又は欠損金減少額	656,097,000	418,456,000
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	418,456,000
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	656,097,000	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	224,567,000	576,602,000
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	224,567,000	—
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	576,602,000
中間剰余金又は中間欠損金(△)	1,198,924,656	△1,197,680,335

(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 平成 28 年 1 月 11 日	至 平成 28 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
	平成 28 年 1 月 10 日現在	平成 28 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	1,000,000,000 円	3,100,000,000 円
期中追加設定元本額	4,300,000,000 円	3,900,000,000 円
期中一部交換元本額	2,200,000,000 円	3,000,000,000 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	310,000 口	400,000 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 1,197,680,335 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 平成 27 年 1 月 5 日 至 平成 27 年 7 月 4 日	自 平成 28 年 1 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日
※1 その他費用	主に、TOPIX レバレッジ (2 倍) 指数の商標の使用料であります。	主に、TOPIX レバレッジ (2 倍) 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 平成28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 平成28年1月10日 現在				当中間計算期間末 平成28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	6,913,866,000	—	6,439,150,000	△474,716,000	6,175,686,000	—	5,606,930,000	△568,756,000
合計	6,913,866,000	—	6,439,150,000	△474,716,000	6,175,686,000	—	5,606,930,000	△568,756,000

（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 平成28年1月10日現在	当中間計算期間末 平成28年7月10日現在
1口当たり純資産額	10,387.4円	7,005.8円
（10口当たり純資産額）	（103,874円）	（70,058円）

平成29年1月期 中間決算短信（平成28年1月11日～平成28年7月10日）

平成28年8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

半期報告書提出予定日 平成28年10月3日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月中間期の運用状況（平成28年1月11日～平成28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	%
28年 7月中間期	900	(54.0)	766	(46.0)	1,667	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 7月中間期	180	250	250	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
28年 7月中間期	2,047	380	1,667	9,261.3
28年 1月期	1,605	183	1,421	7,898.3

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	当中間計算期間末
	平成 28 年 1 月 10 日現在	平成 28 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	521,696,744	767,441,222
親投資信託受益証券	800,204,206	900,039,833
派生商品評価勘定	187,785,147	228,037,900
未収利息	2,024	—
差入委託証拠金	95,535,000	152,190,000
流動資産合計	1,605,223,121	2,047,708,955
資産合計	1,605,223,121	2,047,708,955
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	25,004	5,897,940
前受金	175,938,000	187,499,000
未払解約金	—	180,360,000
未払受託者報酬	427,148	420,330
未払委託者報酬	5,980,634	5,885,170
未払利息	—	2,466
その他未払費用	1,151,443	607,639
流動負債合計	183,522,229	380,672,545
負債合計	183,522,229	380,672,545
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,800,000,000	1,800,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△) ※2	△378,299,108	△132,963,590
(分配準備積立金)	△12,732,639	△12,732,639
元本等合計	1,421,700,892	1,667,036,410
純資産合計	1,421,700,892	1,667,036,410
負債純資産合計	1,605,223,121	2,047,708,955

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成 27 年 1 月 5 日 至 平成 27 年 7 月 4 日 金額 (円)	自 平成 28 年 1 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日 金額 (円)
営業収益		
受取利息	120,606	30,757
有価証券売買等損益	104,595	△164,373
派生商品取引等損益	△482,515,106	346,405,859
営業収益合計	△482,289,905	346,272,243
営業費用		
支払利息	—	95,753
受託者報酬	376,662	420,330
委託者報酬	5,273,871	5,885,170
その他費用 ※1	574,245	581,472
営業費用合計	6,224,778	6,982,725
営業利益又は営業損失 (△)	△488,514,683	339,289,518
経常利益又は経常損失 (△)	△488,514,683	339,289,518
中間純利益又は中間純損失 (△)	△488,514,683	339,289,518
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	—	△378,299,108
剰余金増加額又は欠損金減少額	28,105,000	322,696,000
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	28,105,000	322,696,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	268,446,000	416,650,000
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	268,446,000	416,650,000
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△728,855,683	△132,963,590

(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 平成28年1月11日	至 平成28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
	平成28年1月10日現在	平成28年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	1,000,000,000円	1,800,000,000円
期中追加設定元本額	1,900,000,000円	2,500,000,000円
期中一部交換元本額	1,100,000,000円	2,500,000,000円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	180,000口	180,000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378,299,108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132,963,590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 平成27年1月5日 至 平成27年7月4日	自 平成28年1月11日 至 平成28年7月10日
※1 その他費用	主に、TOPIX ダブルインバース（-2倍）指数の商標の使用料であります。	主に、TOPIX ダブルインバース（-2倍）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 平成28年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対	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

照表計上額との差額	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 平成 28 年 1 月 10 日 現在				当中間計算期間末 平成 28 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	3,039,073,000	—	2,850,590,000	188,483,000	3,564,649,000	—	3,342,360,000	222,289,000
合計	3,039,073,000	—	2,850,590,000	188,483,000	3,564,649,000	—	3,342,360,000	222,289,000

- (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。
- 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。
 - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
 - 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 平成 28 年 1 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 28 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	7,898.3 円	9,261.3 円
(10 口当たり純資産額)	(78,983 円)	(92,613 円)

平成29年1月期 中間決算短信（平成28年1月11日～平成28年7月10日）

平成28年8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

半期報告書提出予定日 平成28年10月3日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月中間期の運用状況（平成28年1月11日～平成28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	%
28年 7月中間期	10,998	(57.4)	8,153	(42.6)	19,152	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 7月中間期	5,884	5,447	9,693	1,638

(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
28年 7月中間期	41,167	22,015	19,152	11,692.5
28年 1月期	68,901	5,741	63,160	10,734.3

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	当中間計算期間末
	平成28年1月10日現在	平成28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	23,783,214,921	18,077,005,587
親投資信託受益証券	37,200,318,755	10,998,755,058
派生商品評価勘定	5,577,018,187	695,978,481
未収入金	—	10,500,000,000
未収利息	92,316	—
差入委託証拠金	2,341,020,000	895,680,000
流動資産合計	68,901,664,179	41,167,419,126
資産合計	68,901,664,179	41,167,419,126
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,204,014	58,374,719
前受金	5,683,880,000	464,028,000
未払解約金	—	21,426,027,100
未払受託者報酬	3,292,459	4,197,113
未払委託者報酬	46,094,669	58,760,203
未払利息	—	58,122
その他未払費用	3,529,955	3,686,913
流動負債合計	5,741,001,097	22,015,132,170
負債合計	5,741,001,097	22,015,132,170
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	58,840,000,000	16,380,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	4,320,663,082	2,772,286,956
(分配準備積立金)	△60,688,350	△60,688,350
元本等合計	63,160,663,082	19,152,286,956
純資産合計	63,160,663,082	19,152,286,956
負債純資産合計	68,901,664,179	41,167,419,126

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成27年4月24日 至 平成27年10月23日	自 平成28年1月11日 至 平成28年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	277,610	358,421
有価証券売買等損益	318,755	△1,563,697
派生商品取引等損益	75,280,084	5,378,934,177
営業収益合計	75,876,449	5,377,728,901
営業費用		
支払利息	—	928,350
受託者報酬	708,572	4,197,113
委託者報酬	9,920,619	58,760,203
その他費用	637,571	3,609,261
営業費用合計	11,266,762	67,494,927
営業利益	64,609,687	5,310,233,974
経常利益	64,609,687	5,310,233,974
中間純利益	64,609,687	5,310,233,974
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	—	4,320,663,082
剰余金増加額又は欠損金減少額	225,000	4,894,323,400
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	225,000	4,894,323,400
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,525,000	11,752,933,500
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	20,525,000	11,752,933,500
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	44,309,687	2,772,286,956

(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 平成28年1月11日	至 平成28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
	平成28年1月10日現在	平成28年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	2,500,000,000円	58,840,000,000円
期中追加設定元本額	64,690,000,000円	54,470,000,000円
期中一部交換元本額	8,350,000,000円	96,930,000,000円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	5,884,000口	1,638,000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 平成27年4月24日 至 平成27年10月23日	自 平成28年1月11日 至 平成28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
	平成28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 平成28年1月10日 現在				当中間計算期間末 平成28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	68,589,350,000	－	63,011,780,000	5,577,570,000	19,795,328,000	－	19,157,040,000	638,288,000
合計	68,589,350,000	－	63,011,780,000	5,577,570,000	19,795,328,000	－	19,157,040,000	638,288,000

- (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 平成28年1月10日現在	当中間計算期間末 平成28年7月10日現在
1口当たり純資産額 (10口当たり純資産額)	10,734.3円 (107,343円)	11,692.5円 (116,925円)

平成29年1月期 中間決算短信（平成28年1月11日～平成28年7月10日）

平成28年8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

半期報告書提出予定日 平成28年10月3日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月中間期の運用状況（平成28年1月11日～平成28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	%
28年 7月中間期	3,589	(57.1)	2,693	(42.9)	6,282	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 7月中間期	420	130	20	530

(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
28年 7月中間期	6,746	463	6,282	11,854.6
28年 1月期	4,786	314	4,472	10,648.8

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	当中間計算期間末
	平成 28 年 1 月 10 日現在	平成 28 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	1,711,757,974	2,361,107,893
親投資信託受益証券	2,600,328,717	3,589,603,628
派生商品評価勘定	324,111,135	506,189,916
未収利息	6,644	—
差入委託証拠金	150,480,000	289,560,000
流動資産合計	4,786,684,470	6,746,461,437
資産合計	4,786,684,470	6,746,461,437
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	81,233	7,096,180
前受金	305,240,000	433,289,000
未払受託者報酬	491,974	1,481,095
未払委託者報酬	6,887,884	20,735,953
未払利息	—	7,590
その他未払費用	1,472,790	926,177
流動負債合計	314,173,881	463,535,995
負債合計	314,173,881	463,535,995
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	4,200,000,000	5,300,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	272,510,589	982,925,442
(分配準備積立金)	△11,617,331	△11,617,331
元本等合計	4,472,510,589	6,282,925,442
純資産合計	4,472,510,589	6,282,925,442
負債純資産合計	4,786,684,470	6,746,461,437

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成 27 年 4 月 24 日 至 平成 27 年 10 月 23 日	自 平成 28 年 1 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取利息	269,231	113,912
有価証券売買等損益	328,715	△725,089
派生商品取引等損益	47,435,507	634,574,527
営業収益合計	48,033,453	633,963,350
営業費用		
支払利息	—	284,052
受託者報酬	707,826	1,481,095
委託者報酬	9,910,247	20,735,953
その他費用 ※1	904,460	1,941,397
営業費用合計	11,522,533	24,442,497
営業利益	36,510,920	609,520,853
経常利益	36,510,920	609,520,853
中間純利益	36,510,920	609,520,853
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	—	272,510,589
剰余金増加額又は欠損金減少額	162,000	119,860,000
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	162,000	119,860,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	27,357,000	18,966,000
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	27,357,000	18,966,000
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	9,315,920	982,925,442

(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 平成 28 年 1 月 11 日	至 平成 28 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
	平成 28 年 1 月 10 日現在	平成 28 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	2,500,000,000 円	4,200,000,000 円
期中追加設定元本額	3,800,000,000 円	1,300,000,000 円
期中一部交換元本額	2,100,000,000 円	200,000,000 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	420,000 口	530,000 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 平成 27 年 4 月 24 日 至 平成 27 年 10 月 23 日	自 平成 28 年 1 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日
※1 その他費用	主に、TOPIX インバース（-1 倍）指数の商標の使用料であります。	主に、TOPIX インバース（-1 倍）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 平成 28 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 平成 28 年 1 月 10 日 現在				当中間計算期間末 平成 28 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	4,796,180,000	—	4,471,230,000	324,950,000	6,784,464,000	—	6,285,090,000	499,374,000
合計	4,796,180,000	—	4,471,230,000	324,950,000	6,784,464,000	—	6,285,090,000	499,374,000

(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 平成 28 年 1 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 28 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	10,648.8 円	11,854.6 円
(10 口当たり純資産額)	(106,488 円)	(118,546 円)

平成29年1月期 中間決算短信（平成28年1月11日～平成28年7月10日）

平成28年8月23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 <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

半期報告書提出予定日 平成28年10月3日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月中間期の運用状況（平成28年1月11日～平成28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	%
28年 7月中間期	634	(54.3)	534	(45.7)	1,169	(100.0)
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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 7月中間期	130	100	20	210

(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
28年 7月中間期	1,419	249	1,169	5,569.3
28年 1月期	1,236	159	1,077	8,285.8

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	当中間計算期間末
	平成 28 年 1 月 10 日現在	平成 28 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	405,893,140	456,816,845
親投資信託受益証券	590,104,582	634,960,660
未収入金	20,000,000	—
未収利息	1,574	—
前払金	145,944,600	217,093,300
差入委託証拠金	74,700,000	110,568,000
流動資産合計	1,236,643,896	1,419,438,805
資産合計	1,236,643,896	1,419,438,805
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	153,210,141	240,456,052
未払金	554,950	2,879,984
未払受託者報酬	351,752	377,282
未払委託者報酬	4,924,987	5,282,450
未払利息	—	1,468
その他未払費用	442,763	897,982
流動負債合計	159,484,593	249,895,218
負債合計	159,484,593	249,895,218
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,300,000,000	2,100,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△) ※2	△222,840,697	△930,456,413
(分配準備積立金)	△5,458,181	△5,458,181
元本等合計	1,077,159,303	1,169,543,587
純資産合計	1,077,159,303	1,169,543,587
負債純資産合計	1,236,643,896	1,419,438,805

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成 28 年 1 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日 金額 (円)
営業収益	
受取利息	30,700
有価証券売買等損益	△143,922
派生商品取引等損益	△458,832,279
営業収益合計	△458,945,501
営業費用	
支払利息	79,334
受託者報酬	377,282
委託者報酬	5,282,450
その他費用 ※1	493,149
営業費用合計	6,232,215
営業損失 (△)	△465,177,716
経常損失 (△)	△465,177,716
中間純損失 (△)	△465,177,716
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△222,840,697
剰余金増加額又は欠損金減少額	51,700,000
中間一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	51,700,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	294,138,000
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	294,138,000
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△930,456,413

(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 平成 28 年 1 月 11 日	至 平成 28 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
	平成 28 年 1 月 10 日現在	平成 28 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	2,500,000,000 円	1,300,000,000 円
期中追加設定元本額	200,000,000 円	1,000,000,000 円
期中一部交換元本額	1,400,000,000 円	200,000,000 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	130,000 口	210,000 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 222,840,697 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 930,456,413 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	当中間計算期間	
	自 平成 28 年 1 月 11 日	至 平成 28 年 7 月 10 日
※1 その他費用	主に、J P X日経 400 レバレッジ・インデックス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 平成 28 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 平成 28 年 1 月 10 日 現在				当中間計算期間末 平成 28 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	2,308,858,900	—	2,155,989,000	△152,869,900	2,578,256,500	—	2,338,032,000	△240,224,500
合計	2,308,858,900	—	2,155,989,000	△152,869,900	2,578,256,500	—	2,338,032,000	△240,224,500

(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 平成 28 年 1 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 28 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	8,285.8 円	5,569.3 円
(10 口当たり純資産額)	(82,858 円)	(55,693 円)

平成29年1月期 中間決算短信（平成28年1月11日～平成28年7月10日）

平成28年8月23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 <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

半期報告書提出予定日 平成28年10月3日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月中間期の運用状況（平成28年1月11日～平成28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	%
28年 7月中間期	349	(60.2)	230	(39.8)	580	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 7月中間期	50	460	460	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
28年 7月中間期	604	24	580	11,609.5
28年 1月期	563	40	523	10,468.0

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	当中間計算期間末
	平成 28 年 1 月 10 日現在	平成 28 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	196,499,319	209,432,731
親投資信託受益証券	310,059,762	349,720,170
派生商品評価勘定	39,349,763	19,151,177
未収利息	762	—
差入委託証拠金	17,775,000	26,520,000
流動資産合計	563,684,606	604,824,078
資産合計	563,684,606	604,824,078
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,439	323,656
前受金	37,751,500	12,640,000
未払受託者報酬	155,131	687,419
未払委託者報酬	2,172,290	9,624,416
未払利息	—	672
その他未払費用	195,754	1,073,808
流動負債合計	40,282,114	24,349,971
負債合計	40,282,114	24,349,971
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	500,000,000	500,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	23,402,492	80,474,107
(分配準備積立金)	△2,404,069	△2,404,069
元本等合計	523,402,492	580,474,107
純資産合計	523,402,492	580,474,107
負債純資産合計	563,684,606	604,824,078

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成 28 年 1 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日 金額 (円)
営業収益	
受取利息	13, 270
有価証券売買等損益	△339, 592
派生商品取引等損益	342, 795, 126
営業収益合計	342, 468, 804
営業費用	
支払利息	211, 756
受託者報酬	687, 419
委託者報酬	9, 624, 416
その他費用 ※1	901, 598
営業費用合計	11, 425, 189
営業利益	331, 043, 615
経常利益	331, 043, 615
中間純利益	331, 043, 615
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	23, 402, 492
剰余金増加額又は欠損金減少額	339, 342, 000
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	339, 342, 000
剰余金減少額又は欠損金増加額	613, 314, 000
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	613, 314, 000
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	80, 474, 107

(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 平成 28 年 1 月 11 日	至 平成 28 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
	平成 28 年 1 月 10 日現在	平成 28 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	1,000,000,000 円	500,000,000 円
期中追加設定元本額	－円	4,600,000,000 円
期中一部交換元本額	500,000,000 円	4,600,000,000 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	50,000 口	50,000 口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成 28 年 1 月 11 日	至 平成 28 年 7 月 10 日
※1 その他費用	主に、J P X日経 400 インバース・インデックス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 平成 28 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 平成 28 年 1 月 10 日 現在				当中間計算期間末 平成 28 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	563,532,500	—	524,007,000	39,525,500	599,031,000	—	580,146,000	18,885,000
合計	563,532,500	—	524,007,000	39,525,500	599,031,000	—	580,146,000	18,885,000

(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 平成 28 年 1 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 28 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	10,468.0 円	11,609.5 円
(10 口当たり純資産額)	(104,680 円)	(116,095 円)

平成29年1月期 中間決算短信（平成28年1月11日～平成28年7月10日）

平成28年8月23日

ファンド名 ダイワ上場投信－JPX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 JPX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

半期報告書提出予定日 平成28年10月3日

I ファンドの運用状況

1. 28年7月中間期の運用状況（平成28年1月11日～平成28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	%
28年 7月中間期	485	(50.1)	483	(49.9)	968	(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)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
28年 7月中間期	110	—	32	77

(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
28年 7月中間期	1,083	114	968	12,434.3
28年 1月期	1,331	156	1,174	10,677.7

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	当中間計算期間末
	平成 28 年 1 月 10 日現在	平成 28 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	427,962,315	379,817,414
親投資信託受益証券	665,134,463	485,044,805
派生商品評価勘定	158,801,736	130,522,976
未収利息	1,660	—
差入委託証拠金	79,515,000	87,873,000
流動資産合計	1,331,415,174	1,083,258,195
資産合計	1,331,415,174	1,083,258,195
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	27,205	2,907,458
前受金	151,353,000	107,170,500
未払受託者報酬	337,589	254,860
未払委託者報酬	4,726,729	3,568,598
未払利息	—	1,220
その他未払費用	427,056	724,558
流動負債合計	156,871,579	114,627,194
負債合計	156,871,579	114,627,194
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,100,000,000	779,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	74,543,595	189,631,001
(分配準備積立金)	△5,257,756	△5,257,756
元本等合計	1,174,543,595	968,631,001
純資産合計	1,174,543,595	968,631,001
負債純資産合計	1,331,415,174	1,083,258,195

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成 28 年 1 月 11 日 至 平成 28 年 7 月 10 日 金額 (円)
営業収益	
受取利息	26, 845
有価証券売買等損益	△89, 658
派生商品取引等損益	193, 171, 448
営業収益合計	193, 108, 635
営業費用	
支払利息	44, 900
受託者報酬	254, 860
委託者報酬	3, 568, 598
その他費用 ※1	332, 501
営業費用合計	4, 200, 859
営業利益	188, 907, 776
経常利益	188, 907, 776
中間純利益	188, 907, 776
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	74, 543, 595
剰余金減少額又は欠損金増加額	73, 820, 370
中間一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	73, 820, 370
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	189, 631, 001

(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 平成 28 年 1 月 11 日	至 平成 28 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
	平成 28 年 1 月 10 日現在	平成 28 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	2,000,000,000 円	1,100,000,000 円
期中追加設定元本額	200,000,000 円	－円
期中一部交換元本額	1,100,000,000 円	321,000,000 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	110,000 口	77,900 口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成 28 年 1 月 11 日	至 平成 28 年 7 月 10 日
※1 その他費用	主に、J P X日経 400 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。	

(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 平成 28 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 平成 28 年 1 月 10 日 現在				当中間計算期間末 平成 28 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	2,508,204,000	—	2,348,907,000	159,297,000	2,061,263,500	—	1,933,456,500	127,807,000
合計	2,508,204,000	—	2,348,907,000	159,297,000	2,061,263,500	—	1,933,456,500	127,807,000

(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 平成 28 年 1 月 10 日現在	当中間計算期間末 平成 28 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	10,677.7 円	12,434.3 円
(10 口当たり純資産額)	(106,777 円)	(124,343 円)