

平成 29 年 1 月期 中間決算短信（平成 28 年 1 月 18 日～平成 28 年 7 月 17 日）

平成 28 年 8 月 15 日

ファンド名 国内金先物価格連動型上場投信 上場取引所 東証
 コード番号 1683
 連動対象指標 株式会社東京商品取引所の商品市場における金現物先物取引の期先限月の清算値
 主要投資資産 国債証券および連動対象指標に関連する商品投資等取引に係る権利
 売買単位 10 口
 管理会社 みずほ投信投資顧問株式会社 URL <http://www.mizuho-am.co.jp/>
 代表者名 代表取締役社長 中村 英剛
 問合せ先責任者 プロセス管理部長 三宅 裕司 TEL (03)5232-7607

半期報告書提出予定日 平成 28 年 10 月 17 日

I ファンドの運用状況

1. 平成 28 年 7 月中間期の運用状況（平成 28 年 1 月 18 日～平成 28 年 7 月 17 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	%
平成 28 年 7 月中間期	0	(0.0)	60	(100.0)	60	(100.0)
平成 28 年 1 月期	40	(73.3)	14	(26.7)	54	(100.0)

(2) 設定・解約実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	解約口数(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
平成 28 年 7 月中間期	14	0	0	14

(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 発行済口数)×1)
	百万円	百万円	百万円	円
平成 28 年 7 月中間期	60	0	60	4,218
平成 28 年 1 月期	55	0	54	3,826

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

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期計算期間 (平成28年1月17日現在)	第7期中間計算期間 (平成28年7月17日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,007,418	11,852,162
国債証券	40,001,740	-
派生商品評価勘定	-	2,371,400
現先取引勘定	-	40,000,000
未収利息	51	-
前払金	1,993,344	4,866,908
差入委託証拠金	1,286,400	1,206,000
流動資産合計	55,288,953	60,296,470
資産合計	55,288,953	60,296,470
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	584,600	-
未払受託者報酬	15,726	15,704
未払委託者報酬	125,796	125,556
未払利息	-	197
その他未払費用	3,207	3,008
流動負債合計	729,329	144,465
負債合計	729,329	144,465
純資産の部		
元本等		
元本	44,377,120	44,377,120
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	10,182,504	15,774,885
(分配準備積立金)	△6,027,371	△6,027,371
元本等合計	54,559,624	60,152,005
純資産合計	54,559,624	60,152,005
負債純資産合計	55,288,953	60,296,470

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期中間計算期間 (自平成27年1月18日 至平成27年7月17日)	第7期中間計算期間 (自平成28年1月18日 至平成28年7月17日)
営業収益		
受取利息	18,498	-
有価証券売買等損益	△19,270	△1,780
派生商品取引等損益	△1,964,282	5,749,164
その他収益	-	19
営業収益合計	△1,965,054	5,747,403

営業費用		
支払利息	-	10,218
受託者報酬	16,702	15,704
委託者報酬	133,562	125,556
その他費用	4,152	3,544
営業費用合計	154,416	155,022
営業利益又は営業損失（△）	△2,119,470	5,592,381
経常利益又は経常損失（△）	△2,119,470	5,592,381
中間純利益又は中間純損失（△）	△2,119,470	5,592,381
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（△）	18,832,800	10,182,504
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	16,713,330	15,774,885

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第7期中間計算期間 (自平成28年1月18日 至平成28年7月17日)
1 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引 原則として時価で評価しております。
2 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第6期計算期間 (平成28年1月17日現在)		第7期中間計算期間 (平成28年7月17日現在)	
1	計算期間末における受益権の総数 14,260 口	1	中間計算期間末における受益権の総数 14,260 口
2	計算期間末における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額 3,826 円	2	中間計算期間末における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額 4,218 円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

項目	第6期計算期間 (平成28年1月17日現在)	第7期中間計算期間 (平成28年7月17日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>国債証券</p> <p>①わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）（外貨建証券を除く）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）または価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>②時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> <p>先物取引</p> <p>デリバティブ取引等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</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> <p>先物取引</p> <p>同左</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には、合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	同左

--	--	--

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（商品関連）

第6期計算期間（平成28年1月17日現在）

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	商品先物取引				
	買建	55,149,400	—	54,564,800	△584,600
合計		55,149,400	—	54,564,800	△584,600

第7期中間計算期間（平成28年7月17日現在）

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	商品先物取引				
	買建	57,915,200	—	60,286,600	2,371,400
合計		57,915,200	—	60,286,600	2,371,400

（注）時価の算定方法

商品先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の帳入値段（清算値）により評価しております。

（その他の注記）

項目	期別	
	第6期計算期間 （平成28年1月17日現在）	第7期中間計算期間 （平成28年7月17日現在）
期首元本額	44,377,120円	44,377,120円
期中追加設定元本額	—円	—円
期中一部解約元本額	—円	—円