

平成 31 年 1 月期 中間決算短信 (平成 30 年 1 月 18 日～平成 30 年 7 月 17 日)

平成 30 年 8 月 15 日

ファンド名 One ETF 国内金先物 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 アセットマネジメント One 株式会社 URL <http://www.am-one.co.jp/>
 代表者名 代表取締役社長 菅野 暁
 問合せ先責任者 投資信託ディスクロージャー部長 三木谷 正直 TEL (03)6774-5100

半期報告書提出予定日 平成 30 年 10 月 17 日

I ファンドの運用状況

1. 平成 30 年 7 月中間期の運用状況 (平成 30 年 1 月 18 日～平成 30 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 30 年 7 月中間期	0	(0.0)	59	(100.0)	59	(100.0)
平成 30 年 1 月期	0	(0.0)	62	(100.0)	62	(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 30 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 30 年 7 月中間期	59	0	59	4,147
平成 30 年 1 月期	62	0	62	4,399

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8期計算期間 (平成30年1月17日現在)	第9期中間計算期間 (平成30年7月17日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	45,373,288	45,203,303
派生商品評価勘定	718,500	438,600
前払金	15,919,480	12,767,792
差入委託証拠金	877,800	877,800
流動資産合計	62,889,068	59,287,495
資産合計	62,889,068	59,287,495
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	16,643	16,195
未払委託者報酬	133,090	129,457
未払利息	67	119
その他未払費用	2,513	2,046
流動負債合計	152,313	147,817
負債合計	152,313	147,817
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(△)	18,359,635	14,762,558
(分配準備積立金)	△6,669,096	△6,669,096
元本等合計	62,736,755	59,139,678
純資産合計	62,736,755	59,139,678
負債純資産合計	62,889,068	59,287,495

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期中間計算期間 (自平成29年1月18日 至平成29年7月17日)	第9期中間計算期間 (自平成30年1月18日 至平成30年7月17日)
営業収益		
派生商品取引等損益	382,996	△3,431,588
その他収益	10	124
営業収益合計	383,006	△3,431,464
営業費用		
支払利息	14,859	17,276
受託者報酬	15,934	16,195
委託者報酬	127,382	129,457
その他費用	3,482	2,685
営業費用合計	161,657	165,613
営業利益又は営業損失(△)	221,349	△3,597,077
経常利益又は経常損失(△)	221,349	△3,597,077

中間純利益又は中間純損失 (△)	221,349	△3,597,077
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 (△)	14,327,431	18,359,635
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 (△)	14,548,780	14,762,558

(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 9 期中間計算期間 (自 平成 30 年 1 月 18 日 至 平成 30 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	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 8 期計算期間 (平成 30 年 1 月 17 日現在)		第 9 期中間計算期間 (平成 30 年 7 月 17 日現在)	
1 計算期間末日における受益権の総数	14,260 口	1 中間計算期間末日における受益権の総数	14,260 口
2 計算期間末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産の額	4,399 円	2 中間計算期間末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産の額	4,147 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 8 期計算期間 (平成 30 年 1 月 17 日現在)	第 9 期中間計算期間 (平成 30 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す。	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す。

2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)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>(2)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)デリバティブ取引</p> <p>先物取引</p> <p>同左</p> <p>(2)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	<p>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。</p> <p>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。</p>	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8期計算期間(平成30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	62,336,800	—	63,055,300	718,500
合計		62,336,800	—	63,055,300	718,500

第9期中間計算期間(平成30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	59,118,800	—	59,557,400	438,600
合計		59,118,800	—	59,557,400	438,600

(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8期計算期間 (平成30年1月17日現在)	第9期中間計算期間 (平成30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