

平成 30 年 11 月期 中間決算短信 (平成 29 年 11 月 15 日～平成 30 年 5 月 14 日)

平成 30 年 6 月 18 日
上場取引所 東証

ファンド名 国際の E T F V I X 中期先物指数
コード番号 1561
連動対象指標 円換算した S&P500 VIX 中期先物指数
主要投資資産 指数連動有価証券
売買単位 1 口
管理会社 三菱 U F J 国際投信株式会社 URL <https://www.am.mufg.jp/>
代表者名 取締役社長 松田 通
問合せ先責任者 ディスクロージャー部 宇野 誠朗 TEL (03)6250-4910

半期報告書提出予定日 平成 30 年 8 月 13 日

I ファンドの運用状況

1. 平成 30 年 5 月中間期の運用状況 (平成 29 年 11 月 15 日～平成 30 年 5 月 14 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 5 月中間期	198	(99.5)	—	(0.5)	199	(100.0)
平成 29 年 11 月期	179	(99.7)	—	(0.3)	180	(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 5 月中間期	12	10	7	15

(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)
	百万円	百万円	百万円	円
平成 30 年 5 月中間期	199	—	199	12,528
平成 29 年 11 月期	180	—	180	13,984

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】

(単位：円)

	第6期 [平成29年11月14日現在]	第7期中間計算期間末 [平成30年5月14日現在]
資産の部		
流動資産		
預金	373,103	80,520
コール・ローン	546,353	1,216,076
社債券	179,809,521	198,262,710
その他未収収益	-	49,461
流動資産合計	180,728,977	199,608,767
資産合計	180,728,977	199,608,767
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	46,754	55,749
未払委託者報酬	289,848	345,597
未払利息	-	2
その他未払費用	3,682	4,400
流動負債合計	340,284	405,748
負債合計	340,284	405,748
純資産の部		
元本等		
元本	1,689,951,600	2,082,963,600
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△1,509,562,907	△1,883,760,581
(分配準備積立金)	△6,874,607	△6,874,607
元本等合計	180,388,693	199,203,019
純資産合計	180,388,693	199,203,019
負債純資産合計	180,728,977	199,608,767

(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 28 年 11 月 15 日 至 平成 29 年 5 月 14 日	第 7 期中間計算期間 自 平成 29 年 11 月 15 日 至 平成 30 年 5 月 14 日
営業収益		
受取利息	189	734
有価証券売買等損益	△60,317,665	△11,796,224
為替差損益	10,453,437	△9,770,419
その他収益	55,102	49,461
営業収益合計	△49,808,937	△21,516,448
営業費用		
支払利息	292	590
受託者報酬	45,307	55,749
委託者報酬	280,820	345,597
その他費用	128,950	229,290
営業費用合計	455,369	631,226
営業利益又は営業損失 (△)	△50,264,306	△22,147,674
経常利益又は経常損失 (△)	△50,264,306	△22,147,674
中間純利益又は中間純損失 (△)	△50,264,306	△22,147,674
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 (△)	△742,827,171	△1,509,562,907
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	820,149,000
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	820,149,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	333,348,000	1,172,199,000
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	333,348,000	1,172,199,000
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△1,126,439,477	△1,883,760,581

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第6期 [平成29年11月14日現在]	第7期中間計算期間末 [平成30年5月14日現在]
1. 期首元本額	903,927,600円	1,689,951,600円
期中追加設定元本額	786,024,000円	1,310,040,000円
期中一部解約元本額	—円	917,028,000円
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	1,509,562,907円	1,883,760,581円
3. 受益権の総数	12,900口	15,900口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期中間計算期間 自平成28年11月15日 至平成29年5月14日	第7期中間計算期間 自平成29年11月15日 至平成30年5月14日
1. その他費用 上場費用および商標使用料等を含んでおります。	1. その他費用 上場費用および商標使用料等を含んでおります。

(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	第6期 [平成29年11月14日現在]	第7期中間計算期間末 [平成30年5月14日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(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 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第6期 [平成29年11月14日現在]	第7期中間計算期間末 [平成30年5月14日現在]
1口当たり純資産額	13,984円	12,528円