

令和2年1月期 中間決算短信（平成31年1月18日～令和1年7月17日）

令和1年8月16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 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 上野 圭子 TEL (03)6774-5100

半期報告書提出予定日 令和1年10月17日

I ファンドの運用状況

1. 令和1年7月中間期の運用状況（平成31年1月18日～令和1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	%
令和1年7月中間期	0	(0.0)	64	(100.0)	64	(100.0)
平成31年1月期	0	(0.0)	59	(100.0)	59	(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
令和1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
令和1年7月中間期	64	0	64	4,490
平成31年1月期	59	0	59	4,171

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9期計算期間 (平成31年1月17日現在)	第10期中間計算期間 (令和1年7月17日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	45,035,644	44,875,262
前払金	13,827,120	-
差入委託証拠金	1,029,600	19,569,480
流動資産合計	59,892,364	64,444,742
資産合計	59,892,364	64,444,742
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	264,000	263,800
未払受託者報酬	15,778	16,360
未払委託者報酬	126,166	130,781
未払利息	121	107
その他未払費用	1,953	2,045
流動負債合計	408,018	413,093
負債合計	408,018	413,093
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(△)	15,107,226	19,654,529
(分配準備積立金)	△6,998,445	△6,998,445
元本等合計	59,484,346	64,031,649
純資産合計	59,484,346	64,031,649
負債純資産合計	59,892,364	64,444,742

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	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)	第10期中間計算期間 (自平成31年1月18日 至令和1年7月17日)
営業収益		
受取利息	-	108
派生商品取引等損益	△3,431,588	4,712,960
その他収益	124	-
営業収益合計	△3,431,464	4,713,068
営業費用		
支払利息	17,276	15,931
受託者報酬	16,195	16,360
委託者報酬	129,457	130,781
その他費用	2,685	2,693
営業費用合計	165,613	165,765
営業利益又は営業損失(△)	△3,597,077	4,547,303

経常利益又は経常損失 (△)	△3,597,077	4,547,303
中間純利益又は中間純損失 (△)	△3,597,077	4,547,303
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 (△)	18,359,635	15,107,226
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 (△)	14,762,558	19,654,529

(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10期中間計算期間 (自平成31年1月18日 至令和1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9期計算期間 (平成31年1月17日現在)		第10期中間計算期間 (令和1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	4,171 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	4,490 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9期計算期間 (平成31年1月17日現在)	第10期中間計算期間 (令和1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	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

2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>ありません。</p> <p>(1)デリバティブ取引 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>額はありません。</p> <p>(1)デリバティブ取引 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>	<p>同左</p>

(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9期計算期間 (平成31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	59,862,000	—	59,598,000	△264,000
合計		59,862,000	—	59,598,000	△264,000

第10期中間計算期間 (令和1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	64,600,600	—	64,336,800	△263,800
合計		64,600,600	—	64,336,800	△263,800

(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9期計算期間 (平成31年1月17日現在)	第10期中間計算期間 (令和1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