

令和2年1月期（平成31年1月18日～令和2年1月17日）決算短信

令和2年2月28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

有価証券報告書提出予定日 令和2年4月17日
 分配金支払開始日 令和2年1月23日

ファンドの運用状況

1. 令和2年1月期の運用状況(平成31年1月18日～令和2年1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2年1月期	0	(0.0)	72	(100.0)	72	(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()	設定口数()	解約口数()	当計算期間末 発行済口数 (+ -)
	千口	千口	千口	千口
令和2年1月期	14	0	0	14
平成31年1月期	14	0	0	14

(3) 基準価額

	総資産 ()	負債 ()	純資産 ((-))	1口当たり基準価額 ((/ 当計算期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
令和2年1月期	72	0	72	5,053
平成31年1月期	59	0	59	4,171

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和2年1月期	0
平成31年1月期	0

2. 会計方針の変更

会計基準等の改正に伴う変更 無
 以外の変更 無

財務諸表等

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第9期 平成31年1月17日現在	第10期 令和2年1月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	45,035,644	44,712,508
派生商品評価勘定	-	2,488,900
前払金	13,827,120	-
差入委託証拠金	1,029,600	25,024,198
流動資産合計	59,892,364	72,225,606
資産合計	59,892,364	72,225,606
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	264,000	-
未払受託者報酬	15,778	18,632
未払委託者報酬	126,166	149,258
未払利息	121	-
その他未払費用	1,953	2,322
流動負債合計	408,018	170,212
負債合計	408,018	170,212
純資産の部		
元本等		
元本	44,377,120	44,377,120
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	15,107,226	27,678,274
(分配準備積立金)	6,998,445	7,347,775
元本等合計	59,484,346	72,055,394
純資産合計	59,484,346	72,055,394
負債純資産合計	59,892,364	72,225,606

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期		第10期	
	自	平成30年1月18日 至 平成31年1月17日	自	平成31年1月18日 至 令和2年1月17日
営業収益				
受取利息		63		108
派生商品取引等損益		2,923,060		12,920,378
その他収益		124		-
営業収益合計		2,922,873		12,920,486
営業費用				
支払利息		36,625		28,823
受託者報酬		31,973		34,992
委託者報酬		255,623		280,039
その他費用		5,315		5,584
営業費用合計		329,536		349,438
営業利益又は営業損失()		3,252,409		12,571,048
経常利益又は経常損失()		3,252,409		12,571,048
当期純利益又は当期純損失()		3,252,409		12,571,048
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期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		-		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期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		-		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		15,107,226		27,678,274

(3) 【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	
	自 平成31年1月18日	至 令和2年1月17日
1. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	商品先物取引 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商品取引所の発表する帳入値段(清算値)によっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第9期	第10期
	平成31年1月17日現在	令和2年1月17日現在
1. 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
2. 受益権の総数	14,260口	14,260口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期	第10期
	自 平成30年1月18日 至 平成31年1月17日	自 平成31年1月18日 至 令和2年1月17日
1. 分配金の計算過程	該当事項はありません。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額(28,715円)及び分配準備積立金(6,998,445円)の合計額から、経費(320,615円)を控除して計算される分配対象額がないため、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第9期	第10期
	自 平成30年1月18日 至 平成31年1月17日	自 平成31年1月18日 至 令和2年1月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 なお、詳細は附属明細表をご参照下	当ファンドが保有する金融商品の種類は、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リス

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>さい。 これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、商品先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>ク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、商品先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、商品相場の変動によるリスクを有しております。</p> <p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p>
--------------------------	---	---

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期 平成31年1月17日現在	第10期 令和2年1月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)デリバティブ取引 先物取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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。	(1)有価証券 該当事項はありません。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価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。
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。	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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(デリバティブ取引等に関する注記)

商品関連

種類	第9期 平成31年1月17日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
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

種類	第10期 令和2年1月17日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 商品先物取引 買建	69,600,400	-	72,089,300	2,488,900
合計	69,600,400	-	72,089,300	2,488,900

(注) 時価の算定方法

商品先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる商品取引所の発表する帳入値段(清算値)で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第9期 平成31年1月17日現在	第10期 令和2年1月17日現在
1口当たり純資産額	4,171円	5,053円