

2018年7月期（2017年7月9日～2018年7月8日）決算短信

2018年8月17日

上場取引所 東証

ファンド名 金価格連動型上場投資信託
 コード番号 (1328)
 連動対象指標 1g(1グラム)当りの円表示の金価格
 主要投資資産 社債券
 売買単位 10口
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
 問合せ先責任者 商品企画部長 増田 真一 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 2018年9月27日
 分配金支払開始日 -

I ファンドの運用状況

1. 2018年7月期の運用状況（2017年7月9日～2018年7月8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	%
2018年7月期	4,703	(99.3)	35	(0.7)	4,739	(100)
2017年7月期	6,069	(99.3)	41	(0.7)	6,111	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2018年7月期	1,636	0	355	1,280
2017年7月期	1,636	0	0	1,636

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
2018年7月期	4,754	15	4,739	3,700
2017年7月期	6,128	16	6,111	3,735

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
2018年7月期	0.00
2017年7月期	0.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有 無
 ② ①以外の変更 有 無

II 財務諸表等

金価格連動型上場投資信託

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (2017年7月8日現在)	第11期 (2018年7月8日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	58,405,173	50,392,793
社債券	6,069,674,000	4,703,780,000
流動資産合計	6,128,079,173	4,754,172,793
資産合計	6,128,079,173	4,754,172,793
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,650,449	1,487,685
未払委託者報酬	14,853,926	13,389,081
未払利息	162	307
その他未払費用	324,102	293,997
流動負債合計	16,828,639	15,171,070
負債合計	16,828,639	15,171,070
純資産の部		
元本等		
元本	4,169,027,408	3,263,880,984
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,942,223,126	1,475,120,739
元本等合計	6,111,250,534	4,739,001,723
純資産合計	6,111,250,534	4,739,001,723
負債純資産合計	6,128,079,173	4,754,172,793

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 自 2016年7月9日 至 2017年7月8日	第11期 自 2017年7月9日 至 2018年7月8日
営業収益		
有価証券売買等損益	72,111,000	13,220,000
その他収益	2,428,815	2,413,511
営業収益合計	74,539,815	15,633,511
営業費用		
支払利息	32,294	29,485
受託者報酬	3,280,902	3,202,119
委託者報酬	29,527,914	28,818,882
その他費用	3,082,815	3,088,836
営業費用合計	35,923,925	35,139,322
営業利益又は営業損失(△)	38,615,890	△19,505,811

経常利益又は経常損失(△)	38,615,890	△19,505,811
当期純利益又は当期純損失(△)	38,615,890	△19,505,811
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換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(△)	1,903,607,236	1,942,223,126
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	-	447,596,576
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	447,596,576
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,942,223,126	1,475,120,739

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	社債券 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、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2017年7月9日から2018年7月8日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第10期 2017年7月8日現在	第11期 2018年7月8日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,636,196口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,280,958口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 3,735円	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 3,700円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自2016年7月9日 至2017年7月8日	第11期 自2017年7月9日 至2018年7月8日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>2,396,521円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>△684,599,256円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>△682,202,735円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>35,891,631円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>△718,094,366円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,636,196口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,396,521円	分配準備積立金	B	△684,599,256円	配当等収益合計額	C=A+B	△682,202,735円	経費	D	35,891,631円	収益分配可能額	E=C-D	0円	収益分配金	F	0円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	△718,094,366円	口数	H	1,636,196口	1口当たり分配金	I=F/H	0円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>2,384,026円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>△718,094,366円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>△715,710,340円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>35,109,837円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>△750,820,177円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,280,958口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,384,026円	分配準備積立金	B	△718,094,366円	配当等収益合計額	C=A+B	△715,710,340円	経費	D	35,109,837円	収益分配可能額	E=C-D	0円	収益分配金	F	0円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	△750,820,177円	口数	H	1,280,958口	1口当たり分配金	I=F/H	0円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	2,396,521円																																																											
分配準備積立金	B	△684,599,256円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	△682,202,735円																																																											
経費	D	35,891,631円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	0円																																																											
収益分配金	F	0円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	△718,094,366円																																																											
口数	H	1,636,196口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	0円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	2,384,026円																																																											
分配準備積立金	B	△718,094,366円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	△715,710,340円																																																											
経費	D	35,109,837円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	0円																																																											
収益分配金	F	0円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	△750,820,177円																																																											
口数	H	1,280,958口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	0円																																																											

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第10期 自2016年7月9日 至2017年7月8日	第11期 自2017年7月9日 至2018年7月8日

<p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその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、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、金価格の変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○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なっております。 ○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なっております。 ○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なっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>
---	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第10期 2017年7月8日現在	第11期 2018年7月8日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>2. 時価の算定方法 社債券 (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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第10期 自 2016年7月9日 至 2017年7月8日	第11期 自 2017年7月9日 至 2018年7月8日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第10期 自 2016年7月9日 至 2017年7月8日	第11期 自 2017年7月9日 至 2018年7月8日
期首元本額 4,169,027,408 円	期首元本額 4,169,027,408 円
期中追加設定元本額 0 円	期中追加設定元本額 0 円
期中一部交換元本額 0 円	期中一部交換元本額 905,146,424 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第10期 自 2016年7月9日 至 2017年7月8日	第11期 自 2017年7月9日 至 2018年7月8日
	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
社債券	△55,601,000	△203,765,000
合計	△55,601,000	△203,765,000

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年7月8日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2018年7月8日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	日本円	G) UBS AG LONDON BRANCH	4,910,000,000	4,703,780,000	
	小計	銘柄数:1 組入時価比率:99.3%	4,910,000,000	4,703,780,000 100.0%	
合計				4,703,780,000	

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。