

運用報告書 (全体版)

第2期<決算日2022年6月6日>

OneグローバルESG厳選株ファンド <DC年金>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/株式	
信託期間	2020年6月5日から無期限です。	
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。	
主要投資対象	OneグローバルESG厳選株ファンド<DC年金>	OneグローバルESG厳選株マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	OneグローバルESG厳選株マザーファンド	日本を含む世界の金融商品取引所に上場する株式（上場予定を含みます。） ^(*) を主要投資対象とします。 （*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。
運用方法	主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界の金融商品取引所に上場する株式（上場予定を含みます。） ^{*1*2} に実質的に投資します。 ※1 DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。 ※2 株式のほかに、日本を含む世界の不動産投資信託（REIT）にも実質的に投資する場合があります。 マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	決算日（原則として6月5日。休業日の場合は翌営業日。）に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「OneグローバルESG厳選株ファンド<DC年金>」は、2022年6月6日に第2期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

OneグローバルESG厳選株ファンド<DC年金>

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	価額			株式組入率 株比	株式先物率 株比	純資産額
		税金 込	み 金	騰 落 中 率			
(設定日) 2020年6月5日	円 10,000	円 -	円 -	% -	% -	% -	百万円 300
1期(2021年6月7日)	13,088	0	0	30.9	94.5	-	1,194
2期(2022年6月6日)	13,973	0	0	6.8	96.9	-	2,467

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 当ファンドのコンセプトに合った適切な指数が存在しないため、ベンチマークは定めておりません。

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額	騰落率		株式組入率 株比	株式先物率 株比
		騰落率	騰落率		
(期首) 2021年6月7日	円 13,088	% -	% -	% 94.5	% -
6月末	13,321	1.8	1.8	94.1	-
7月末	13,395	2.3	2.3	95.4	-
8月末	13,676	4.5	4.5	96.4	-
9月末	13,287	1.5	1.5	96.4	-
10月末	14,127	7.9	7.9	97.5	-
11月末	14,254	8.9	8.9	95.3	-
12月末	14,852	13.5	13.5	96.1	-
2022年1月末	13,670	4.4	4.4	97.9	-
2月末	13,301	1.6	1.6	97.7	-
3月末	14,188	8.4	8.4	96.3	-
4月末	13,886	6.1	6.1	96.1	-
5月末	13,767	5.2	5.2	97.1	-
(期末) 2022年6月6日	13,973	6.8	6.8	96.9	-

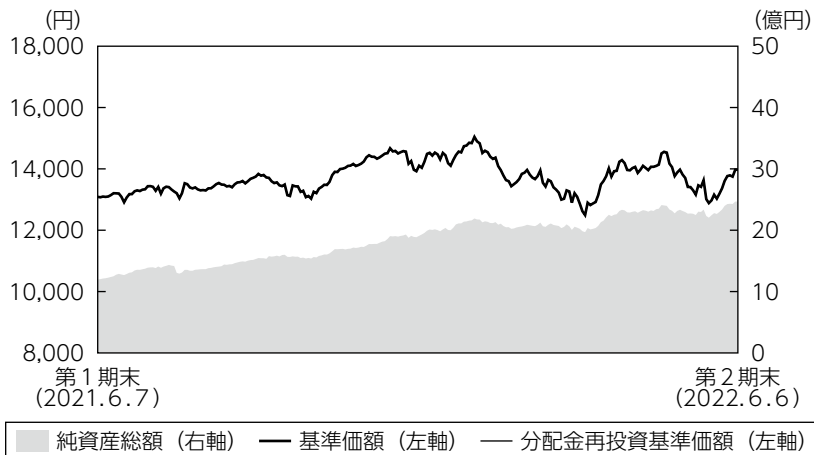
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2021年6月8日から2022年6月6日まで）

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

期初から2021年末までは経済活動正常化への期待などを背景に上昇しました。2022年1月以降は金融引き締め加速への懸念やロシアによるウクライナ侵攻などを受けて、株式市場全体が下落基調で推移したものの、為替市場において主要通貨に対して円安が進行したことで基準価額は上昇しました。

投資環境

外国株式市場は下落しました。期初から2021年末にかけては、米バイデン政権による経済対策や新型コロナウイルスのワクチン普及を背景にした経済活動正常化への期待感、良好な経済指標と企業業績等に支えられながら上昇しました。しかしその後は、インフレを背景とした金融引き締め加速への懸念に加え、ロシアによるウクライナ侵攻、さらには中国における行動制限措置などから景気減速に対する警戒感が強まり、下落基調で推移しました。

為替市場では主要通貨に対し円安が進みました。対米ドルでは、期初から2021年9月にかけては一進一退の推移となりましたが、その後は米国における良好な経済指標への好感や早期利上げ観測から円安基調で推移しました。対ユーロや対ポンドは、期初から2022年3月中旬にかけて欧州での新型コロナウイルス感染再拡大やウクライナ情勢の悪化から概ね円高基調で推移しましたが、その後は欧州の金融政策の正常化観測から円安基調で推移しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

OneグローバルESG厳選株マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用を行いました。

●OneグローバルESG厳選株マザーファンド

期を通じて、ESG課題へ積極的に取り組むことで中長期的な企業価値向上が期待できる銘柄の組入れに注力しました。業種別では、生活必需品の投資比率を引き下げた一方、情報技術の投資比率を引き上げました。

※運用状況については13ページをご参照ください。

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった収益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2021年6月8日 ～2022年6月6日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	3,972円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、OneグローバルESG厳選株マザーファンドの組入比率を高位に維持するよう運用を行います。

●OneグローバルESG厳選株マザーファンド

今後の株式市場は、各国中央銀行の金融政策やインフレ懸念、ロシア・ウクライナ情勢などの不透明感から値動きの荒い展開が予想されます。当戦略ではESGの観点から銘柄を選別して投資するスタイルを堅持しており、今後もESG課題に積極的に取り組む企業への投資を通じて、将来的な企業価値向上と中長期的な株価リターンが享受できるとの投資哲学に基づいた運用を継続していきます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第2期		項目の概要
	(2021年6月8日 ～2022年6月6日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	185円	1.349%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,727円です。
(投信会社)	(105)	(0.768)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(75)	(0.548)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(5)	(0.033)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	3	0.024	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(3)	(0.024)	
(c) 有価証券取引税	11	0.080	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(11)	(0.080)	
(d) その他費用	23	0.164	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(22)	(0.161)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	222	1.618	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

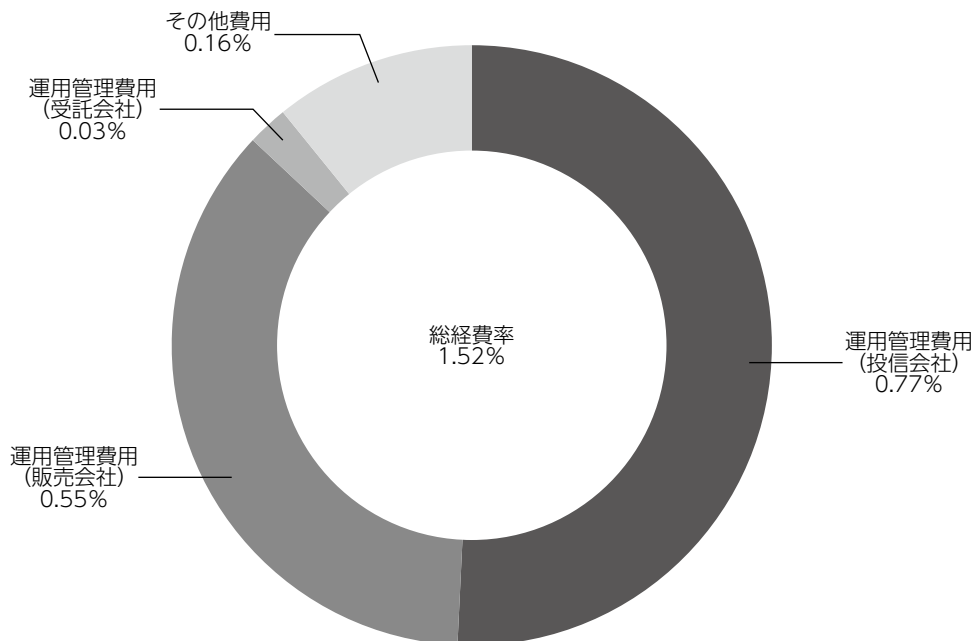
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.52%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年6月8日から2022年6月6日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
OneグローバルESG厳選株マザーファンド	千□ 898,533	千円 1,265,000	千□ 88,111	千円 120,000

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	OneグローバルESG厳選株マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	1,769,261千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,831,316千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.96

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年6月8日から2022年6月6日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高 (元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高 (元本)	取 引 の 理 由
百万円 100	百万円 -	百万円 100	百万円 -	当初設定時又は当初運用時における取得の処分

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
OneグローバルESG厳選株マザーファンド	千□ 869,568	千□ 1,679,989	千円 2,424,728

■投資信託財産の構成

2022年6月6日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
OneグローバルESG厳選株マザーファンド	2,424,728	97.5
コール・ローン等、その他	61,179	2.5
投資信託財産総額	2,485,908	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2022年6月6日現在、OneグローバルESG厳選株マザーファンドは2,413,023千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年6月6日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=130.84円、1カナダ・ドル=103.95円、1イギリス・ポンド=163.30円、1スイス・フラン=135.91円、1ノルウェー・クローネ=13.85円、1ユーロ=140.22円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,485,908,340円
コール・ローン等	61,179,860
OneグローバルESG厳選株マザーファンド(評価額)	2,424,728,480
(B) 負 債	18,785,826
未 払 解 約 金	4,140,352
未 払 信 託 報 酬	14,607,557
そ の 他 未 払 費 用	37,917
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,467,122,514
元 本	1,765,651,103
次 期 繰 越 損 益 金	701,471,411
(D) 受 益 権 総 口 数	1,765,651,103口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,973円

(注) 期首における元本額は912,551,806円、当期中における追加設定元本額は1,433,012,566円、同解約元本額は579,913,269円です。

■損益の状況

当期 自2021年6月8日 至2022年6月6日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△6,695円
受 取 利 息	1,526
支 払 利 息	△8,221
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	103,208,184
買 入 損 益	123,944,869
売 出 損 益	△20,736,685
(C) 信 託 報 酬 等	△25,116,544
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	78,084,945
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	88,886,089
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	534,500,377
(配 当 等 相 当 額)	(184,424,098)
(売 買 損 益 相 当 額)	(350,076,279)
(G) 合 計(D+E+F)	701,471,411
次 期 繰 越 損 益 金(G)	701,471,411
追 加 信 託 差 損 益 金	534,500,377
(配 当 等 相 当 額)	(186,714,006)
(売 買 損 益 相 当 額)	(347,786,371)
分 配 準 備 積 立 金	166,971,034

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	23,636,496円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	54,448,449
(c) 収 益 調 整 金	534,500,377
(d) 分 配 準 備 積 立 金	88,886,089
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	701,471,411
(f) 1万口当たり当期分配対象額	3,972.88
(g) 分 配 金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

OneグローバルESG厳選株マザーファンド

運用報告書

第2期（決算日 2022年6月6日）

（計算期間 2021年6月8日～2022年6月6日）

OneグローバルESG厳選株マザーファンドの第2期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2020年6月5日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。
主要投資対象	日本を含む世界の金融商品取引所に上場する株式（上場予定を含みます。） ^(*) を主要投資対象とします。 (*) DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額		株式組入率 株比	株式先物率 株比	純資産額 純総
	円	騰落中率 %			
（設定日） 2020年6月5日	10,000	—	—	—	百万円 298
1期（2021年6月7日）	13,325	33.3	97.4	—	1,158
2期（2022年6月6日）	14,433	8.3	98.6	—	2,424

（注1）設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

（注2）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注3）当ファンドのコンセプトに合った適切な指数が存在しないため、ベンチマークは定めておりません。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

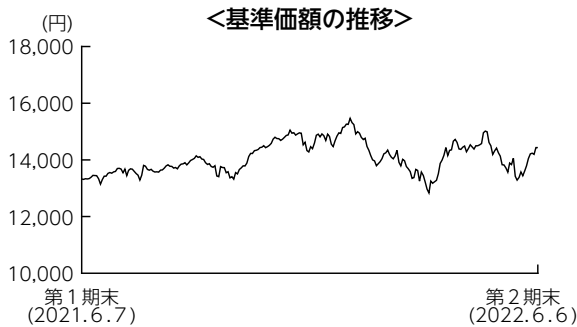
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		騰	落		
(期 首) 2021年 6 月 7 日	円 13,325	% -		% 97.4	% -
6 月 末	13,577	1.9		95.2	-
7 月 末	13,667	2.6		96.8	-
8 月 末	13,977	4.9		97.0	-
9 月 末	13,583	1.9		97.6	-
10 月 末	14,467	8.6		98.4	-
11 月 末	14,622	9.7		96.1	-
12 月 末	15,261	14.5		97.7	-
2022年 1 月 末	14,042	5.4		98.8	-
2 月 末	13,663	2.5		98.8	-
3 月 末	14,617	9.7		98.7	-
4 月 末	14,320	7.5		98.4	-
5 月 末	14,213	6.7		98.7	-
(期 末) 2022年 6 月 6 日	14,433	8.3		98.6	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年6月8日から2022年6月6日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は14,433円となり、前期末比で8.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

期初から2021年末までは経済活動正常化への期待などを背景に上昇しました。2022年1月以降は金融引き締め加速への懸念やロシアによるウクライナ侵攻などを受けて、株式市場全体が下落基調で推移したものの、為替市場において主要通貨に対して円安が進行したことで基準価額は上昇しました。

投資環境

外国株式市場は下落しました。期初から2021年末にかけては、米バイデン政権による経済対策や新型コロナウイルスのワクチン普及を背景にした経済活動正常化への期待感、良好な経済指標と企業業績等に支えられながら上昇しました。しかしその後は、インフレを背景とした金融引き締め加速への懸念に加え、ロシアによるウクライナ侵攻、さらには中国における行動制限措置などから景気減速に対する警戒感が強まり、下落基調で推移しました。

為替市場では主要通貨に対し円安が進みました。対米ドルでは、期初から2021年9月にかけては一進一退の推移となりましたが、その後は米国における良好な経済指標への好感や早期利上げ観測から円安基調で推移しました。対ユーロや対ポンドは、期初から2022年3月中旬にかけて欧州での新型コロナウイルス感染再拡大やウクライナ情勢の悪化から概ね円高基調で推移しましたが、その後は欧州の金融政策の正常化観測から円安基調で推移しました。

ポートフォリオについて

期を通じて、ESG課題へ積極的に取り組むことで中長期的な企業価値向上が期待できる銘柄の組入れに注力しました。業種別では、生活必需品の投資比率を引き下げた一方、情報技術の投資比率を引き上げました。

【運用状況】

(注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

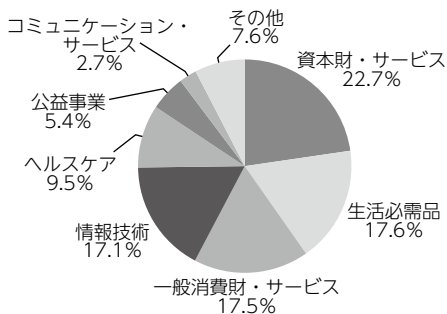
(注2) 業種は各決算日時点でのGICS（世界産業分類基準）によるものです。

(注3) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

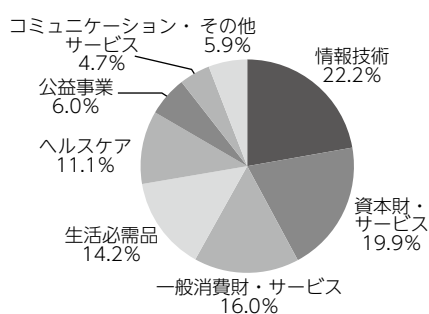
(注4) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

○業種別組入比率

期首（前期末）



期末



○組入上位10銘柄

期首（前期末）

No.	銘柄名	通貨	比率
1	ASHTED GROUP	イギリス・ポンド	4.2%
2	XYLEM INC	アメリカ・ドル	4.0
3	GENERAL MOTORS CO	アメリカ・ドル	3.8
4	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	アメリカ・ドル	3.3
5	EBAY INC	アメリカ・ドル	3.2
6	CSX CORP	アメリカ・ドル	3.2
7	ESTEE LAUDER COS INC/THE	アメリカ・ドル	3.2
8	STANLEY BLACK & DECKER INC	アメリカ・ドル	3.2
9	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ・ドル	3.1
10	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	イギリス・ポンド	3.1
組入銘柄数		35銘柄	

期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	KROGER CO	アメリカ・ドル	4.6%
2	HP INC	アメリカ・ドル	4.2
3	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ・ドル	3.8
4	CSX CORP	アメリカ・ドル	3.7
5	VERBUND AG	ユーロ	3.7
6	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	アメリカ・ドル	3.6
7	XYLEM INC	アメリカ・ドル	3.4
8	MCDONALD'S CORPORATION	アメリカ・ドル	3.4
9	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	3.2
10	HOME DEPOT INC	アメリカ・ドル	3.2
組入銘柄数		35銘柄	

今後の運用方針

今後の株式市場は、各国中央銀行の金融政策やインフレ懸念、ロシア・ウクライナ情勢などの不透明感から値動きの荒い展開が予想されます。当戦略ではESGの観点から銘柄を選別して投資するスタイルを堅持しており、今後もESG課題に積極的に取り組む企業への投資を通じて、将来的な企業価値向上と中長期的な株価リターンが享受できるとの投資哲学に基づいた運用を継続していきます。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式)	3円 (3)	0.024% (0.024)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (株 式)	11 (11)	0.082 (0.082)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保 管 費 用) (そ の 他)	23 (23) (0)	0.163 (0.163) (0.000)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	38	0.269	
期中の平均基準価額は14,075円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2021年6月8日から2022年6月6日まで)

株 式

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国 株 式	ア メ リ カ	百株 853.13 (80.42)	千アメリカ・ドル 7,613 (-)	百株 336.71	千アメリカ・ドル 1,900	
	カ ナ ダ	百株 24.9 (-)	千カナダ・ドル 370 (-)	百株 1.84	千カナダ・ドル 24	
	イ ギ リ ス	百株 405.57 (-)	千イギリス・ポンド 1,332 (-)	百株 13.2	千イギリス・ポンド 85	
	ス イ ス	百株 3.85 (-)	千スイス・フラン 266 (△1)	百株 0.37	千スイス・フラン 24	
	ノ ル ウ ェ ー	百株 169.89 (-)	千ノルウェー・クローネ 1,429 (-)	百株 378.2	千ノルウェー・クローネ 3,115	
	ユ ー ロ 圏 株 式	フ ラ ン ス	百株 61.67 (-)	千ユーロ 1,056 (-)	百株 2.43	千ユーロ 21
		ド イ ツ	百株 67.71 (-)	千ユーロ 489 (-)	百株 5.3	千ユーロ 39
		ス ペ イ ン	百株 209.88 (533.66)	千ユーロ 214 (-)	百株 551.57	千ユーロ 18
		フ ィ ン ラ ン ド	百株 48.49 (-)	千ユーロ 259 (-)	百株 4.44	千ユーロ 23
		オ ー ス ト リ ア	百株 32.69 (-)	千ユーロ 288 (-)	百株 3.4	千ユーロ 27

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項	目	当	期
(a)	期 中 の 株 式 売 買 金 額	1,769,261	千円
(b)	期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,831,316	千円
(c)	売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.96	

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2021年6月8日から2022年6月6日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細
外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	22.59	41.81	590	77,231	情報技術サービス
ADOBE INC	5.51	11.7	502	65,788	ソフトウェア
BAXTER INTERNATIONAL INC	26.39	53.92	391	51,176	ヘルスケア機器・用品
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	33.32	70.94	533	69,771	医薬品
CSX CORP	34.06	211.67	679	88,928	陸運・鉄道
CLOROX COMPANY	15.86	—	—	—	家庭用品
THE WALT DISNEY CO	—	31.74	344	45,129	娯楽
EBAY INC	52.35	101.9	479	62,783	インターネット販売・通信販売
ESTEE LAUDER COS INC/THE	11.18	19.23	508	66,479	パーソナル用品
HP INC	96.71	197.82	787	103,039	コンピュータ・周辺機器
HOME DEPOT INC	9.87	19.47	593	77,717	専門小売り
JOHNSON & JOHNSON	19.26	39.45	695	91,061	医薬品
KROGER CO	82.9	163.07	856	112,099	食品・生活必需品小売り
MCDONALD'S CORPORATION	12.21	25.2	625	81,888	ホテル・レストラン・レジャー
MICROSOFT CORP	11.77	22.27	601	78,678	ソフトウェア
QUALCOMM INC	18.86	34.91	492	64,503	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	39.86	80.94	505	66,093	食品
STANLEY BLACK & DECKER INC	15.9	30.12	344	45,135	機械
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24.45	49.44	499	65,295	資本市場
XYLEM INC	35.77	74.18	634	82,964	機械
GENERAL MOTORS CO	62.94	—	—	—	自動車
ARAMARK	73.63	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	23.51	45.96	674	88,234	電子装置・機器・部品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	728.9 22銘柄	1,325.74 20銘柄	11,342 —	1,483,999 <61.2%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	20.09	43.15	637	66,232	陸運・鉄道
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	20.09 1銘柄	43.15 1銘柄	637 —	66,232 <2.7%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASHTED GROUP	60.96	108.93	436	71,348	商社・流通業
COMPASS GROUP PLC	—	259.95	459	75,093	ホテル・レストラン・レジャー
UNILEVER PLC	39.36	75.69	280	45,794	パーソナル用品
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	22.09	53.89	333	54,385	家庭用品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	17.83	34.15	357	58,443	機械
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	140.24 4銘柄	532.61 5銘柄	1,868 —	305,066 <12.6%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
LONZA GROUP AG-REG	3.93	7.41	417	56,719	ライフサイエンス・ツール/サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3.93 1銘柄	7.41 1銘柄	417 —	56,719 <2.3%>

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ノルウェー) ORKLA ASA	百株 208.31	百株 -	千ノルウェー・クローネ -	千円 -	食品
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	- 1銘柄	- -	- <-%>	
(ユーロ…フランス) CAPGEMINI SA VINCI S.A. KERING	百株 - 25.78 -	百株 24.27 55.45 5.3	千ユーロ 436 499 276	千円 61,239 70,085 38,718	情報技術サービス 建設・土木 繊維・アパレル・贅沢品
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	85.02 3銘柄	1,212 -	170,044 <7.0%>	
(ユーロ…ドイツ) PUMA AG COVESTRO AG	百株 22.11 35.83	百株 51.34 69.01	千ユーロ 361 302	千円 50,665 42,383	繊維・アパレル・贅沢品 化学
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	120.35 2銘柄	663 -	93,049 <3.8%>	
(ユーロ…スペイン) IBERDROLA SA	百株 190.31	百株 382.28	千ユーロ 413	千円 57,945	電力
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	382.28 1銘柄	413 -	57,945 <2.4%>	
(ユーロ…フィンランド) ELISA OYJ	百株 47.18	百株 91.23	千ユーロ 487	千円 68,336	各種電気通信サービス
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	91.23 1銘柄	487 -	68,336 <2.8%>	
(ユーロ…オーストリア) VERBUND AG	百株 36.12	百株 65.41	千ユーロ 631	千円 88,599	電力
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	65.41 1銘柄	631 -	88,599 <3.7%>	
合 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	1,458.8 35銘柄	2,653.2 -	2,389,992 <98.6%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

■投資信託財産の構成

2022年6月6日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 2,389,992	% 98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	34,763	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	2,424,756	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2,413,023千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年6月6日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=130.84円、1カナダ・ドル=103.95円、1イギリス・ポンド=163.30円、1スイス・フラン=135.91円、1ノルウェー・クローネ=13.85円、1ユーロ=140.22円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,424,756,013円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	29,010,080
株 式(評価額)	2,389,992,016
未 収 配 当 金	5,753,917
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,424,756,013
元 本	1,679,989,247
次 期 繰 越 損 益 金	744,766,766
(D) 受 益 権 総 口 数	1,679,989,247口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,433円

(注1) 期首元本額 869,568,036円

追加設定元本額 898,533,143円

一部解約元本額 88,111,932円

(注2) 期末における元本の内訳

OneグローバルESG厳選株ファンド<DC年金>

1,679,989,247円

期末元本合計

1,679,989,247円

■損益の状況

当期 自2021年6月8日 至2022年6月6日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	33,604,666円
受 取 配 当 金	33,610,364
受 取 利 息	3,328
支 払 利 息	△9,026
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	90,514,407
売 買 益	394,323,621
売 買 損	△303,809,214
(C) そ の 他 費 用	△3,033,318
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	121,085,755
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	289,102,222
(F) 解 約 差 損 益 金	△31,888,068
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	366,466,857
(H) 合 計(D+E+F+G)	744,766,766
次 期 繰 越 損 益 金(H)	744,766,766

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。