

運用報告書 (全体版)

第4期<決算日2024年6月5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、2024年6月5日に第4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

<https://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	込配	み金 期騰落 中率			
(設定日) 2020年6月5日	円 10,000		円 -	% -	% -	% -	百万円 300
1期 (2021年6月7日)	13,088		0	30.9	94.5	-	1,194
2期 (2022年6月6日)	13,973		0	6.8	96.9	-	2,467
3期 (2023年6月5日)	14,788		0	5.8	95.7	-	3,493
4期 (2024年6月5日)	17,056		0	15.3	97.6	-	4,859

(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、「株式組入比率」、「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		
(期首) 2023年6月5日	円 14,788		% -	% 95.7	% -
6月末	15,475	4.6		95.7	-
7月末	15,272	3.3		97.6	-
8月末	15,137	2.4		97.1	-
9月末	14,478	△2.1		97.8	-
10月末	13,924	△5.8		97.8	-
11月末	15,285	3.4		96.9	-
12月末	15,331	3.7		97.6	-
2024年1月末	16,246	9.9		98.0	-
2月末	16,849	13.9		97.6	-
3月末	17,284	16.9		96.9	-
4月末	17,322	17.1		96.5	-
5月末	17,086	15.5		97.5	-
(期末) 2024年6月5日	17,056	15.3		97.6	-

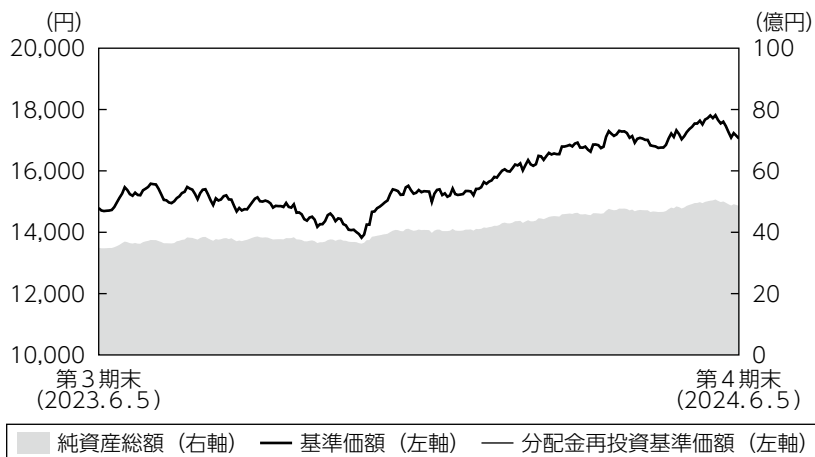
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「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（2023年6月6日から2024年6月5日まで）

基準価額等の推移



第4期首：14,788円
第4期末：17,056円
(既払分配金0円)
騰落率：15.3%
(分配金再投資ベース)

- (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

欧米の物価動向や金融政策への思惑、地政学リスクにより株価は一進一退となる場面も見られましたが、米国の金融引き締めが最終局面との観測や米経済は2024年以降も底堅いとの見方が高まり、期を通して見ると株価が上昇したことから、基準価額が上昇しました。また為替市場が主要通貨に対して前期末比で円安が進行したことも基準価額にプラスに寄与しました。

投資環境

外国株式市場は上昇しました。期初から2023年7月までは、主要企業の堅調な決算が好感され上昇しました。8月から10月にかけては、堅調な米経済指標を受けて長期金利が上昇する中、株価は下落しました。11月以降はテクノロジー関連株の大幅な上昇が牽引し上昇基調となりました。その後中東の情勢やインフレの高止まり懸念から下落する局面もありましたが、期末にかけては主要企業の堅調な決算を受け反発しました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。期初から2023年11月にかけては、日銀と米欧中央銀行の金融政策スタンスの違いを反映した内外金利差から、概ね円安基調で推移しました。その後、米欧における利下げ期待や日銀による金融政策の修正から円高に推移する局面も見られましたが、期末にかけては堅調な米経済指標の結果を受け、利下げ時期の後退観測などを背景に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りに注力しました。業種別では、生活必需品やヘルスケア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。また、組入銘柄のうちESGを主要な要素として選定する銘柄の組入比率を合計100%として運用を行いました。ESGに関する詳細は14ページ以降をご参照ください。

※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
	2023年6月6日 ～2024年6月5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	7,056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、各国の金融政策を巡る思惑や企業業績への懸念などから短期的には不安定な相場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4期		項目の概要
	(2023年6月6日 ～2024年6月5日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	213円	1.353%	(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15,721円です。
(投信会社)	(121)	(0.770)	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)	(86)	(0.550)	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	0.018	(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)	(0.018)	
(c) 有価証券取引税	6	0.037	(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)	(6)	(0.037)	
(d) その他費用	9	0.057	(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)	(8)	(0.053)	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)	(1)	(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	230	1.465	

(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。

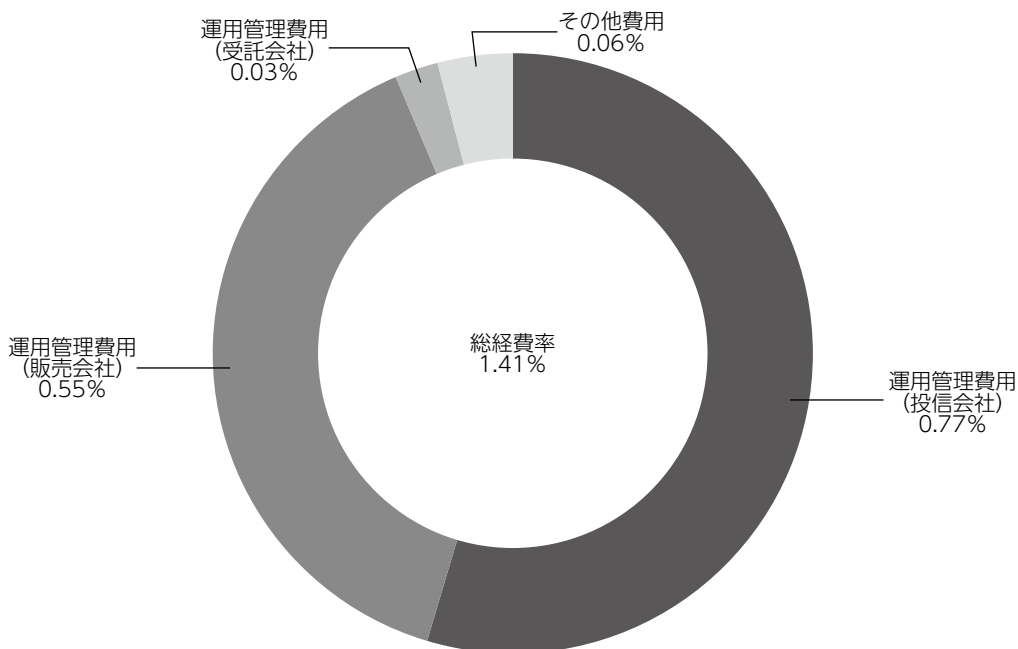
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.41%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（2023年6月6日から2024年6月5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□ 424,815	千円 704,189	千□ 2,001	千円 3,217

■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	4,334,232千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	4,083,620千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.06

(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（2023年6月6日から2024年6月5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

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□ 2,219,369	千□ 2,642,183	千円 4,800,847

■投資信託財産の構成

2024年6月5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	4,800,847	97.9
コール・ローン等、その他	100,729	2.1
投資信託財産総額	4,901,577	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、2024年6月5日現在、OneグローバルESG厳選株マザーファンドは4,788,913千円、99.7%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、2024年6月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=155.30円、1カナダ・ドル=113.54円、1台湾・ドル=4.791円、1イギリス・ポンド=198.36円、1スイス・フラン=174.36円、1ノルウェー・クローネ=14.71円、1ユーロ=169.01円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,901,577,159円
コール・ローン等	100,729,880
OneグローバルESG厳選株マザーファンド(評価額)	4,800,847,279
(B) 負 債	41,621,783
未払解約金	10,956,694
未払信託報酬	30,585,611
その他未払費用	79,478
(C) 純資産総額(A-B)	4,859,955,376
元 本	2,849,402,617
次期繰越損益金	2,010,552,759
(D) 受益権総口数	2,849,402,617口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,056円

(注) 期首における元本額は2,362,284,991円、当期中における追加設定元本額は1,042,067,629円、同解約元本額は554,950,003円です。

■損益の状況

当期 自2023年6月6日 至2024年6月5日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△3,247円
受 取 利 息	17,280
支 払 利 息	△20,527
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	614,671,960
売 買 損 益	661,699,957
買 入 損 益	△47,027,997
(C) 信 託 報 酬 等	△56,213,446
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	558,455,267
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	269,018,342
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,183,079,150
(配 当 等 相 当 額)	(541,687,578)
(売 買 損 益 相 当 額)	(641,391,572)
(G) 合 計(D+E+F)	2,010,552,759
次 期 繰 越 損 益 金(G)	2,010,552,759
追 加 信 託 差 損 益 金	1,183,079,150
(配 当 等 相 当 額)	(543,558,749)
(売 買 損 益 相 当 額)	(639,520,401)
分 配 準 備 積 立 金	827,473,609

(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	54,034,439円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	504,420,828
(c) 収 益 調 整 金	1,183,079,150
(d) 分 配 準 備 積 立 金	269,018,342
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	2,010,552,759
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	7,056.05
(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4期（決算日 2024年6月5日）

（計算期間 2023年6月6日～2024年6月5日）

OneグローバルESG厳選株マザーファンドの第4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
	円	騰落率 %			
(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
3期(2023年6月5日)	15,507	7.4	97.1	—	3,441
4期(2024年6月5日)	18,170	17.2	98.8	—	4,800

(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、ベンチマークは決めておりません。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

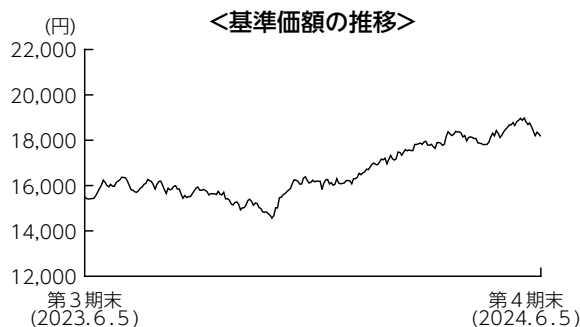
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		騰	落		
(期 首) 2023 年 6 月 5 日	円 15,507	% -		% 97.1	% -
6 月 末	16,254	4.8		97.1	-
7 月 末	16,056	3.5		99.1	-
8 月 末	15,934	2.8		99.0	-
9 月 末	15,249	△1.7		98.9	-
10 月 末	14,672	△5.4		98.9	-
11 月 末	16,140	4.1		97.8	-
12 月 末	16,207	4.5		98.9	-
2024 年 1 月 末	17,208	11.0		98.8	-
2 月 末	17,874	15.3		98.7	-
3 月 末	18,363	18.4		98.6	-
4 月 末	18,428	18.8		97.2	-
5 月 末	18,199	17.4		98.8	-
(期 末) 2024 年 6 月 5 日	18,170	17.2		98.8	-

(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（2023年6月6日から2024年6月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は18,170円となり、前期末比で17.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

欧米の物価動向や金融政策への思惑、地政学リスクにより株価は一進一退となる場面も見られましたが、米国の金融引き締めが最終局面との観測や米経済は2024年以降も底堅いとの見方が高まり、期を通して見ると株価が上昇したことから、基準価額が上昇しました。また為替市場が主要通貨に対して前期末比で円安が進行したことも基準価額にプラスに寄与しました。

投資環境

外国株式市場は上昇しました。期初から2023年7月までは、主要企業の堅調な決算が好感され上昇しました。8月から10月にかけては、堅調な米経済指標を受けて長期金利が上昇する中、株価は下落しました。11月以降はテクノロジー関連株の大幅な上昇が牽引し上昇基調となりました。その後中東の情勢やインフレの高止まり懸念から下落する局面もありましたが、期末にかけては主要企業の堅調な決算を受け反発しました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。期初から2023年11月にかけては、日銀と米欧中央銀行の金融政策スタンスの違いを反映した内外金利差から、概ね円安基調で推移しました。その後、米欧における利下げ期待や日銀による金融政策の修正から円高に推移する局面も見られましたが、期末にかけては堅調な米経済指標の結果を受け、利下げ時期の後退観測などを背景に円安基調で推移しました。

ポートフォリオについて

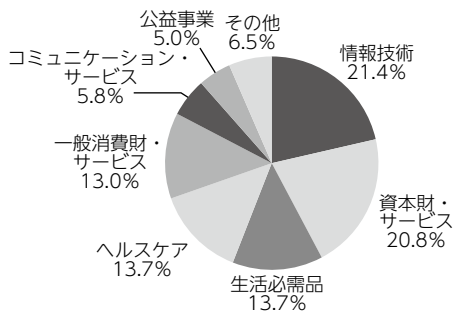
期を通じて、E S G課題へ積極的に取り組むことで中長期的な企業価値向上が期待できる銘柄の組入りに注力しました。業種別では、生活必需品やヘルスケアの投資比率を引き下げた一方、情報技術の投資比率を引き上げました。また、組入銘柄のうちE S Gを主要な要素として選定する銘柄の組入比率を合計100%として運用を行いました。E S Gに関する詳細は14ページ以降をご参照ください。

【運用状況】

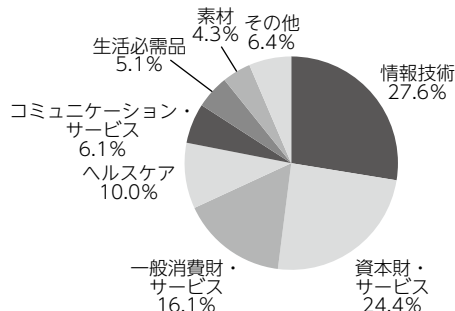
- (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。
 (注2) 業種は各決算日時点でのGICS（世界産業分類基準）によるものです。
 (注3) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。
 (注4) 現金等はその他として表示しています。

○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	COMPASS GROUP PLC	イギリス・ポンド	5.4%
2	XYLEM INC	アメリカ・ドル	5.2
3	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	5.1
4	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	アメリカ・ドル	4.7
5	VINCI S.A.	ユーロ	4.5
6	MCDONALD'S CORPORATION	アメリカ・ドル	4.2
7	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	アメリカ・ドル	4.1
8	KROGER CO	アメリカ・ドル	3.9
9	BOSTON SCIENTIFIC CORP	アメリカ・ドル	3.8
10	ELISA OYJ	ユーロ	3.5
組入銘柄数		34銘柄	

期末

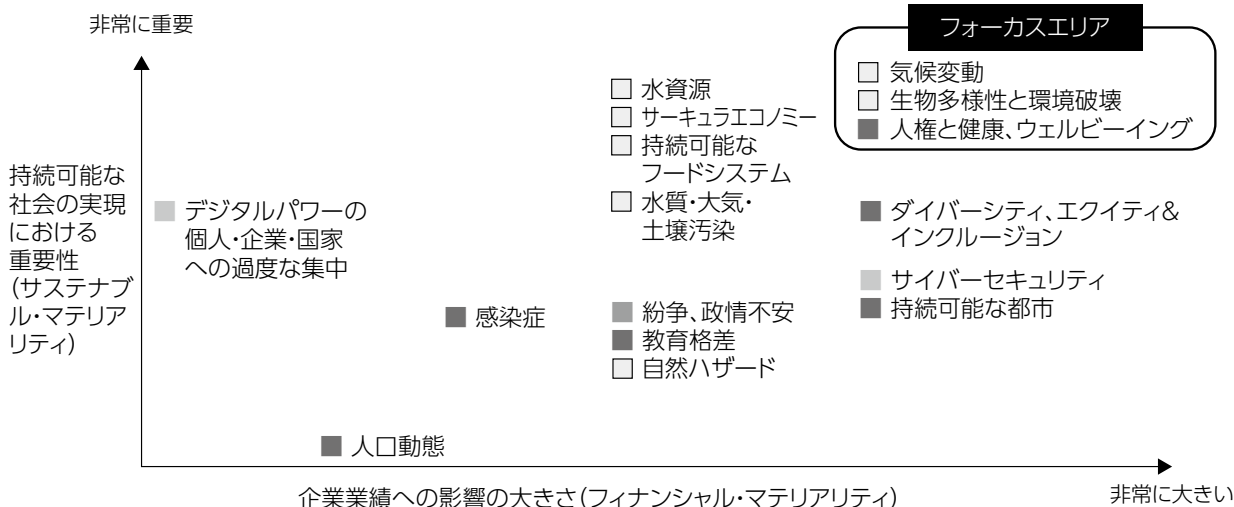
No.	銘柄名	通貨	比率
1	CINTAS CORP	アメリカ・ドル	5.6%
2	COMPASS GROUP PLC	イギリス・ポンド	5.2
3	BOSTON SCIENTIFIC CORP	アメリカ・ドル	5.1
4	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	5.1
5	XYLEM INC	アメリカ・ドル	4.9
6	BUREAU VERITAS SA	ユーロ	4.6
7	VINCI S.A.	ユーロ	4.0
8	GARTNER INC	アメリカ・ドル	3.7
9	FTI CONSULTING INC	アメリカ・ドル	3.7
10	INTUIT INC	アメリカ・ドル	3.5
組入銘柄数		33銘柄	

※以下のデータは決算日（2024年6月5日）時点のものです。

≪ ESGレーティング、ESGスコアを活用した組入銘柄選択 ≫

アセットマネジメントOne（以下、当社）が独自に算出したESGスコア（以下、ESGスコア）を活用してOneグローバルESG厳選株マザーファンド（以下、マザーファンド）の組入銘柄を選択しました。ESGスコアは、当社が定めるマテリアリティ・マップ（持続可能な社会の実現に向けた重要性と企業業績への影響の大きさを勘案し、当社として考える取り組むべき環境・社会の課題を捉えたもの）を基に、当社が重視するグローバルな環境・社会課題への企業の取り組みを評価し点数化したものです。算出されたESGスコア（10が最良で0まで付与）は、ESGレーティング（Aが最良でFまで付与）に変換されます。

マテリアリティ・マップ(イメージ図)



上記は、決算日現在の当社のマテリアリティ・マップにおいて当社がフォーカスエリアと位置付ける社会課題の全てと、その他の社会課題から一部抜粋した課題をもとに作成したイメージ図です。マテリアリティ・マップの内容は、社会環境等によって変更する場合があります。

※上記の内容は、決算日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ESGレーティング・ESGスコアは、サステナビリティの観点とフィナンシャルの観点の両方から投資において重要と判断された課題を評価対象としています。それらは主に下図に示される課題です。



※上記課題は、決算日時点のものであり、社会環境等によって変更する場合があります。

※なお、現在の評価では、持続可能なフードシステムを生物多様性の一部に組み込んでいます。

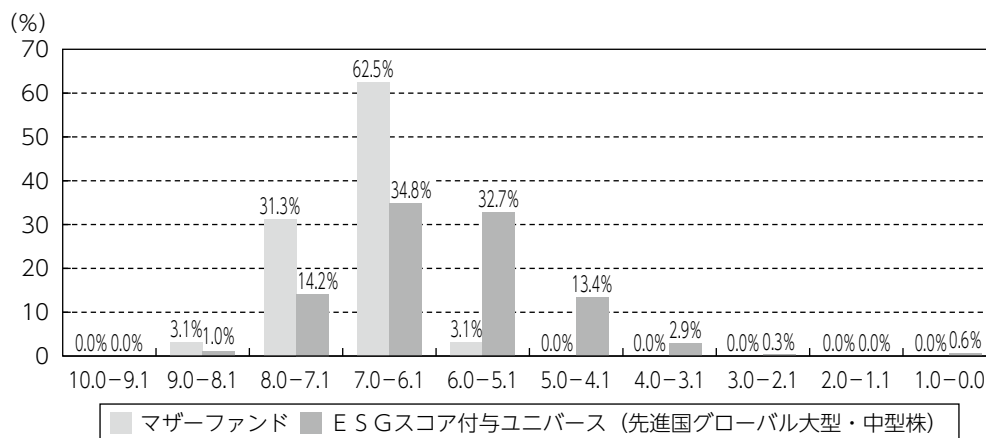
《E S Gスコアの分布》

E S Gスコアを用いたマザーファンドのE S Gスコア構成銘柄数分布は、上位スコアの9.0－7.1点の範囲において、E S Gスコア付与ユニバース（先進国グローバル大型・中型株）の分布に比較してその割合が大きく上回りました。これは、マザーファンドの投資プロセスにおいて、E S Gレーティングのスコア上位約1,000社を投資可能ユニバースとしていることが背景にあります。このことにより、E S Gの取り組みがより優れた企業群によってマザーファンドが構成されていることが確認できます。

なお、当期末の当ファンド投資対象のE S Gスコア付与ユニバース（先進国グローバル大型・中型株）の付与数は1,921社です。

また、上記の他、新興国の同様のランキング（付与数1,192社）においてE S Gスコアが9.0－8.1に該当する1銘柄を保有しています。

マザーファンドと当社E S Gスコアユニバース（先進国グローバル大型・中型株）のE S Gスコア分布比較（銘柄数の比率）



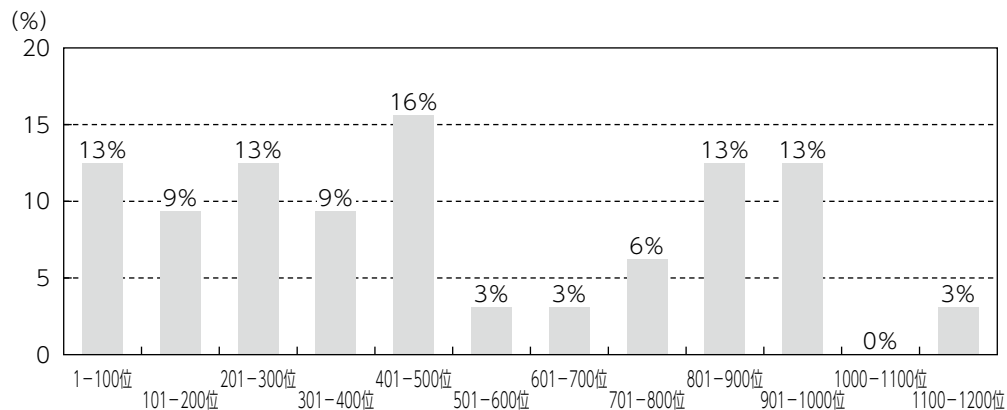
※比率 (%) は、マザーファンド組入銘柄数および当ファンド投資ユニバースのE S Gスコア付与銘柄数（先進国グローバル大型・中型株）をそれぞれの分母として算出

出所：アセットマネジメントOne

また、マザーファンド構成銘柄が、1銘柄（保有比率約3%）を除き上位1,000社以内であることが以下のE S Gスコアランキングの分布によって確認できます。上位1,000社に入っていない1社は売却のタイミングを計り売却予定です。なお、当ランキングはE S Gスコア付与ユニバース銘柄数（先進国グローバル大型・中型株）1,921社内でのランキングです。

このほか、新興国の同様のランキングにおいて1,192社中100位以内に該当する1銘柄を保有しています。

マザーファンド組入銘柄のE S Gスコアランキング分布



※比率 (%) は、マザーファンド組入銘柄数を分母として算出
出所：アセットマネジメントOne

《マザーファンド保有上位10銘柄のE S Gスコア・ランキング・レーティング》

No.	銘柄名	国	業種	比率	E S G総合 スコア	環境 (E)	社会 (S)	ガバナンス (G)	E S Gスコア ランキング ※	E S G総合 レーティング
2	COMPASS GROUP PLC	イギリス	一般消費財・サービス	5.2%	7.2	7.6	7.9	6.1	208	B
3	BOSTON SCIENTIFIC CORP	アメリカ	ヘルスケア	5.1%	6.4	7.5	6.2	5.6	697	B
4	MICROSOFT CORP	アメリカ	情報技術	5.1%	6.7	7.4	7.0	5.9	472	B
5	XYLEM INC	アメリカ	資本財・サービス	4.9%	7.0	6.8	7.3	7.1	308	B
6	BUREAU VERITAS SA	フランス	資本財・サービス	4.6%	6.8	7.2	8.7	4.4	458	B
7	VINCI S.A.	フランス	資本財・サービス	4.0%	6.2	5.9	6.9	6.0	827	C
8	GARTNER INC	アメリカ	情報技術	3.7%	6.1	9.0	4.7	4.6	916	C
9	FTI CONSULTING INC	アメリカ	資本財・サービス	3.7%	6.2	6.9	6.9	4.6	857	C
10	INTUIT INC	アメリカ	情報技術	3.5%	6.1	6.7	4.7	6.9	910	C

※ E S Gスコア付与ユニバース銘柄数（先進国グローバル大型・中型株）1,921社内でのランキング

※比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

出所：アセットマネジメントOne

《マザーファンド保有上位5銘柄の概要、ESGへの取り組み／企業価値との結びつき》

銘柄名	概要	ESGへの取り組み／企業価値との結びつき
CINTAS CORP シンタス	主に北米でユニフォームレンタルや企業向けにファーストエイド（急な病気や怪我をした人を助けるためにとる最初の行動）のソリューションを提供。	<ul style="list-style-type: none"> ・企業が自社でユニフォームの洗濯を行う場合に比べ、同社のオペレーションでは必要とする水の量、エネルギー、化学製品を少なく抑えて洗濯することが出来る。 ・同社は顧客企業の安全性に関するコンプライアンスに沿ったファーストエイドのパッケージを提供しており、顧客企業が従業員の安全性を高める上で重要なパートナーとなっている。
COMPASS GROUP PLC コンパスグループ	グローバルにオフィスの社食などの企業向けサービス、学校給食や教育機関向けの学食、病院や老人ホームでのフードサービスを提供。	<ul style="list-style-type: none"> ・特に米国や英国などでは肥満率が上昇する中、同社はバランスの取れた食事を提供するプログラムが充実しており、健康的で栄養価の高い食品を求める市場の拡大に対応できる体制が整っている。 ・同社はほぼすべての国で砂糖、塩、脂肪が少ないプログラムを通じて健康的な食の選択肢を提供し、健康的な製品に幅広く関わる小規模企業の買収にも力を入れている。 ・“Balanced Choices” というプログラムでは全商品に対して栄養表示を行っており、“Whole+Sum” と呼ばれるメニューではある一定のカロリーの下でタンパク質、炭水化物、野菜、果物を組み合わせて提供するなど、消費者の栄養ニーズに対して積極的に取り組んでいる。
BOSTON SCIENTIFIC CORP ボストンサイエンティフィック	循環器・消化器・泌尿器等の分野を中心に開発・販売する医療機器メーカー。創業より低侵襲医療（手術・検査などに伴う痛み、発熱・出血などをできるだけ少なくする方法）器具に注力しており、グローバルに事業を展開している。	<ul style="list-style-type: none"> ・医療費の抑制は医療システムの持続可能性を担保するために重要な要素であり、従来の開腹手術から低侵襲手術へ切り替えることで社会全体の医療費削減につながっている。 ・低侵襲医療では、術後の痛みが従来方法に比べて少ないこと、出血量の減少、入院期間の短縮などから、患者の生活の質を向上させることにつながっている。

銘柄名	概要	E S Gへの取り組み／企業価値との結びつき
MICROSOFT CORP マイクロソフト	多国籍コンピュータ企業。P CのOSである「Windows」や業務用ソフトウェアである「Office」が圧倒的なシェアを獲得しており、クラウドサービス「Azure」も提供。	<ul style="list-style-type: none"> ・ 2030年までにカーボンネガティブ（CO₂削減量が排出量を上回る）達成を目標に設定。オンデマンドでの計算処理や貯蔵のためにカーボンニュートラルなデータセンターへの投資やクリーンテクノロジーへの投資による収益拡大機会を提供している。 ・ また、顧客のサステナビリティに関するデータ収集や集約を効率化するクラウドサービスも提供。
XYLEM INC ザイレム	米国の「水」に関連する設備・計測機器のリーディングカンパニー。グローバルにビジネスを展開し、公益をはじめとする幅広い産業に顧客を有する。	<ul style="list-style-type: none"> ・ 売上高の100%がクリーンテック（水事業）関連であり、産業機械として様々なクリーンテクノロジー製品やサービスへのアクセスを提供することができる。 ・ ユネスコの報告書では、2050年までに世界人口の約半数が絶対的な水不足に陥ると予測されている中、同社の取り組みが改善に貢献すると期待できる。 ・ N P Oと協力し、水に関するノウハウを活かし、水災害リスクの軽減や新興国における水へのアクセスの提供などに取り組む。 ・ 同社は水問題の解決に取り組む企業として自分たちの水の使用量削減と環境影響モニタリング、サプライヤーとの協働による梱包材の削減、リサイクル・リユース活動の強化などをサステナビリティ戦略の中心に据えている。

※上記は個別銘柄の売買を推奨するものではありません。また、当ファンドにおいて今後も上記銘柄の保有を継続するとは限りません。

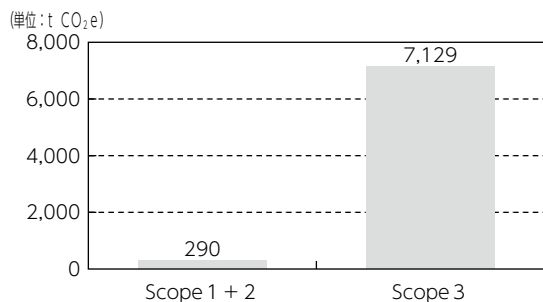
《マザーファンドにおけるカーボン排出量分析について》

当社では環境（E）の観点から、マザーファンドのカーボン排出量をモニタリングしており、ファンドベースで気候変動リスクの低減に努めています。カーボン排出量は、企業の自社事業活動から排出される温室効果ガスであるScope 1（燃料の使用や自社の輸送などによる）と、企業が購入した電力および熱によって排出された温室効果ガスであるScope 2、および企業のサプライチェーンである上流や製品・サービスの利用時に発生する下流の温室効果ガス（Scope 3）の3種類があります。

マザーファンドのScope 1 およびScope 2 の値は、290 t CO₂e であり、上流・下流の排出量（Scope 3）は7,129 t CO₂e でした（下記グラフ参照）。なお、カーボン排出量は I S S* のデータを利用して算出しています。（ I S S は企業開示がない場合には同社の算定基準によって推計された情報を使用しています。）

* Institutional Shareholder Services Inc.

マザーファンドにおけるカーボン排出量計測値 （Scope 1 + 2 およびScope 3）



(出所) I S S のデータを基に当社にて作成

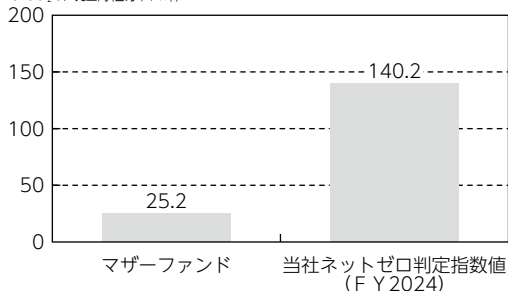
《マザーファンドにおけるカーボン排出量インテンシティについて》

環境（E）の観点から、当社がマザーファンドのネットゼロ適合性判定のためにモニタリングしている加重平均カーボン排出量インテンシティ*は、25.2 t CO₂e / 売上高（百万米ドル）でした。この数値は、当社がファンドごとのネットゼロ適合性判定のために定めているネットゼロ判定基準の指数値（マーケットのネットゼロ適合性を表す数値）の140.2 t CO₂e / 売上高（百万米ドル）よりも低く、当社のネットゼロ適合性判定手法に基づいて、ネットゼロに適合しているファンドであると判断されます。

*カーボン排出量インテンシティ：企業による二酸化炭素排出量を売上高（百万米ドル）で除したもの

マザーファンドにおける加重平均カーボン排出量インテンシティと 当社ネットゼロ判定指数値

（単位：t CO₂e / 売上高百万米ドル）



（出所）ISSのデータを基に当社にて作成

ISSのデータを基に作成した情報は、Institutional Shareholder Services Inc.に帰属します。書面による事前の許可なく、本情報の全部または一部の複製または再頒布を禁じます。また、本情報に関して明示的または黙示的な保証または表明を行うものではありません。

《当社のエンゲージメント*、議決権行使の考え方および実施した行動》

当社は、中長期的な企業価値の向上、持続可能な社会と経済、およびウェルビーイングの実現のため、投資先企業へのエンゲージメントが重要であると考えます。投資先企業へのエンゲージメントにあたっては、気候変動、生物多様性・環境破壊、人権・健康とウェルビーイングを含む社会課題の解決を通じた企業価値創造と、リスク面だけではなく「リターン＝事業機会の拡大」という観点を重視しており、実際にそのようにエンゲージメントを行ってきました。

また、当社は、エンゲージメントが実効的であること、すなわち企業の事業活動へ実際に変化をもたらすことを重視します。課題に応じて、当該企業のみならず、業界団体や官公庁等の関連したステークホルダーとの対話や、必要に応じて他の投資家と連携することにより、エンゲージメントの実効性を高めてきました。また、ESG課題についての対話の内容や進捗は、議決権行使に反映することで、実態に即した効果的な企業への働きかけを行ってきました。

当社では、スチュワードシップ活動を行い、社会の資源が最適に配分されることを促すことで、社会課題の解決と投資先企業の持続的な企業価値向上の実現を目指してまいります。スチュワードシップ責任を果たす上で、議決権行使を最も重要な取り組みの一つとして位置付けています。実際の議決権行使にあたっては、持続的な社会の発展と企業価値向上の同時実現に向け、企業経営が行われるよう議決権を行使しました。

* 「エンゲージメント」とは、企業と建設的な目的をもった対話を行うことで、企業価値の向上や持続的な成長、企業が抱える課題の解決などを促すための活動です。

※詳細については、以下の当社ホームページをご覧ください。

<https://www.am-one.co.jp/company/sscode/>

<https://www.am-one.co.jp/company/voting/>

今後の運用方針

今後の株式市場は、各国の金融政策を巡る思惑や企業業績への懸念などから短期的には不安定な相場展開が予想されます。当戦略ではE S G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E S G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)	0.018% (0.018)	(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)	6 (6)	0.037 (0.037)	(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)	9 (9) (0)	0.054 (0.054) (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	18	0.110	
期中の平均基準価額は16,615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 (2023年6月6日から2024年6月5日まで)

株 式

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外	ア メ リ カ	百株 408.38 (-)	千アメリカ・ドル 9,801 (-)	百株 939.84	千アメリカ・ドル 6,480	
	カ ナ ダ	百株 - (-)	千カナダ・ドル - (-)	百株 44.23	千カナダ・ドル 684	
	台 湾	百株 590 (-)	千台湾・ドル 21,616 (-)	百株 -	千台湾・ドル -	
	イ ギ リ ス	百株 103 (-)	千イギリス・ポンド 256 (-)	百株 326.21	千イギリス・ポンド 1,785	
	ス イ ス	百株 1.7 (-)	千スイス・フラン 84 (-)	百株 11.61	千スイス・フラン 392	
国	ユ	オ ラ ン ダ	百株 30.12 (-)	千ユーロ 889 (-)	百株 5.8	千ユーロ 231
		フ ラ ン ス	百株 324.85 (-)	千ユーロ 1,941 (-)	百株 13.58	千ユーロ 360
	イ	ド イ ツ	百株 292.54 (-)	千ユーロ 1,458 (-)	百株 -	千ユーロ -
		ス イ ス	百株 36.42 (-)	千ユーロ 370 (△16)	百株 -	千ユーロ -
		ス ペ イ ン	百株 183.05 (1,260.46)	千ユーロ 1,044 (-)	百株 1,282.68	千ユーロ 129
		フ ィ ン ラ ン ド	百株 26.69 (-)	千ユーロ 115 (-)	百株 178	千ユーロ 744
		オ ー ス ト リ ア	百株 2.84 (-)	千ユーロ 21 (-)	百株 67.12	千ユーロ 449

(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	4,334,232千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	4,083,620千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.06

(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 (2023年6月6日から2024年6月5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 末		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	55.73	39.32	651	101,250	情報技術サービス
ADOBE INC	11.62	19.7	883	137,174	ソフトウェア
AVERY DENNISON CORP	—	27.55	626	97,323	容器・包装
BAXTER INTERNATIONAL INC	56.43	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	179.05	209.68	1,591	247,220	ヘルスケア機器・用品
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	109.54	—	—	—	医薬品
CSX CORP	165.72	—	—	—	陸上運輸
CINTAS CORP	—	25.54	1,743	270,696	商業サービス・用品
THE WALT DISNEY CO	64.61	84.8	876	136,079	娯楽
EBAY INC	111.63	—	—	—	大規模小売り
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16.43	—	—	—	パーソナルケア用品
FTI CONSULTING INC	—	51.79	1,131	175,755	専門サービス
GARTNER INC	—	26.89	1,151	178,783	情報技術サービス
HP INC	132.86	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
HOME DEPOT INC	11.57	—	—	—	専門小売り
INTUIT INC	—	18.97	1,085	168,531	ソフトウェア
JOHNSON & JOHNSON	53.7	38.78	573	89,013	医薬品
KROGER CO	206.65	164.05	853	132,582	生活必需品流通・小売り
MCDONALD'S CORPORATION	35.92	33.4	877	136,273	ホテル・レストラン・レジャー
MICROSOFT CORP	37.58	37.91	1,577	244,958	ソフトウェア
QUALCOMM INC	43.93	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	136.42	106.25	723	112,352	食品
STANLEY BLACK & DECKER INC	—	57.75	479	74,457	機械
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	—	13.97	795	123,592	ライフサイエンス・ツール/サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	53.51	—	—	—	資本市場
MASTERCARD INC	—	17.04	757	117,700	金融サービス
XYLEM INC	122.06	110.88	1,520	236,081	機械
SERVICENOW INC	—	6.9	463	72,009	ソフトウェア
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	70.55	52.88	718	111,555	電子装置・機器・部品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率>	1,675.51 20銘柄	1,144.05 20銘柄	19,081 —	2,963,390 <61.7%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	44.23	—	—	—	陸上運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率>	44.23 1銘柄	— —銘柄	— —	— <—%>
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
DELTA ELECTRONICS INC	—	590	19,853	95,124	電子装置・機器・部品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率>	— —銘柄	590 1銘柄	19,853 —	95,124 <2.0%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASHTAD GROUP	108.86	—	—	—	商社・流通業
COMPASS GROUP PLC	479.8	576.43	1,256	249,262	ホテル・レストラン・レジャー
UNILEVER PLC	97.56	—	—	—	パーソナルケア用品
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	76.59	—	—	—	家庭用品

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	
(イギリス) SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	百株 36.83	百株 -	千イギリス・ポンド -	千円 -	機械
小計	株数・金額 799.64	株数 576.43	1,256	249,262	
	銘柄数<比率> 5銘柄	1銘柄	-	<5.2%>	
(スイス) LONZA GROUP AG-REG	百株 9.91	百株 -	千スイス・フラン -	千円 -	ライフサイエンス・ツール/サービス
小計	株数・金額 9.91	-	-	-	
	銘柄数<比率> 1銘柄	1銘柄	-	<-%>	
(ユーロ…オランダ) FERRARI NV	百株 -	百株 24.32	千ユーロ 919	千円 155,452	自動車
小計	株数・金額 -	24.32	919	155,452	
	銘柄数<比率> -銘柄	1銘柄	-	<3.2%>	
(ユーロ…フランス) CAPGEMINI SA LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE VINCI S.A. SARTORIUS STEDIM BIOTECH BUREAU VERITAS SA	百株 38.11 - 96.72 -	百株 35.59 6.61 100.99 6.05 475.58	千ユーロ 672 485 1,146 108 1,319	千円 113,654 82,110 193,725 18,333 222,967	情報技術サービス 繊維・アパレル・贅沢品 建設・土木 ライフサイエンス・ツール/サービス 専門サービス
小計	株数・金額 313.55	624.82	3,732	630,792	
	銘柄数<比率> 3銘柄	5銘柄	-	<13.1%>	
(ユーロ…ドイツ) INFINEON TECHNOLOGIES AG SCOUT24 SE	百株 -	百株 161.85 130.69	千ユーロ 594 916	千円 100,417 154,946	半導体・半導体製造装置 インタラクティブ・メディアおよびサービス
小計	株数・金額 -	292.54	1,510	255,364	
	銘柄数<比率> -銘柄	2銘柄	-	<5.3%>	
(ユーロ…スイス) DSM-FIRMENICH AG	百株 28.67	百株 65.09	千ユーロ 658	千円 111,328	化学
小計	株数・金額 28.67	65.09	658	111,328	
	銘柄数<比率> 1銘柄	1銘柄	-	<2.3%>	
(ユーロ…スペイン) IBERDROLA SA AMADEUS IT GROUP SA	百株 611.5 -	百株 638.51 133.82	千ユーロ 786 885	千円 132,842 149,678	電力 ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額 611.5	772.33	1,671	282,521	
	銘柄数<比率> 1銘柄	2銘柄	-	<5.9%>	
(ユーロ…フィンランド) ELISA OYJ	百株 151.31	百株 -	千ユーロ -	千円 -	各種電気通信サービス
小計	株数・金額 151.31	-	-	-	
	銘柄数<比率> 1銘柄	1銘柄	-	<-%>	
(ユーロ…オーストリア) VERBUND AG	百株 64.28	百株 -	千ユーロ -	千円 -	電力
小計	株数・金額 64.28	-	-	-	
	銘柄数<比率> 1銘柄	1銘柄	-	<-%>	
合計	株数・金額 3,698.6	4,089.58	-	4,743,236	
	銘柄数<比率> 34銘柄	33銘柄	-	<98.8%>	

(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

2024年6月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	4,743,236	98.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	57,716	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	4,800,952	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、4,788,913千円、99.7％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、2024年6月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=155.30円、1カナダ・ドル=113.54円、1台湾・ドル=4.791円、1イギリス・ポンド=198.36円、1スイス・フラン=174.36円、1ノルウェー・クローネ=14.71円、1ユーロ=169.01円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,800,952,776円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	53,039,951
株 式(評価額)	4,743,236,747
未 収 配 当 金	4,676,078
(B) 負 債	—
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,800,952,776
元 本	2,642,183,423
次 期 繰 越 損 益 金	2,158,769,353
(D) 受 益 権 総 口 数	2,642,183,423口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,170円

(注1) 期首元本額 2,219,369,670円

追加設定元本額 424,815,496円

一部解約元本額 2,001,743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>

2,642,183,423円

期末元本合計

2,642,183,423円

■損益の状況

当期 自2023年6月6日 至2024年6月5日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	61,872,139円
受 取 配 当 金	60,311,051
受 取 利 息	1,559,854
そ の 他 収 益 金	6,422
支 払 利 息	△5,188
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	598,760,339
売 買 益	888,425,304
売 買 損	△289,664,965
(C) そ の 他 費 用	△2,232,709
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	658,399,769
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,222,211,337
(F) 解 約 差 損 益 金	△1,215,257
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	279,373,504
(H) 合 計(D+E+F+G)	2,158,769,353
次 期 繰 越 損 益 金(H)	2,158,769,353

(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。