

運用状況

設定日	2010年2月12日	信託期間	無期限	決算日	1月17日
当初設定元本	200百万円				
基準日	2018年10月31日	前月末比	基準価額は、1口当たりです。		
基準価額	4,086円	+100円	設定来高値	4,870円	2013年2月7日
純資産総額	58百万円	+1.4百万円	設定来安値	3,100円	2010年2月25日

◆運用実績 – ファンドの基準価額とベンチマーク、純資産総額の推移 –

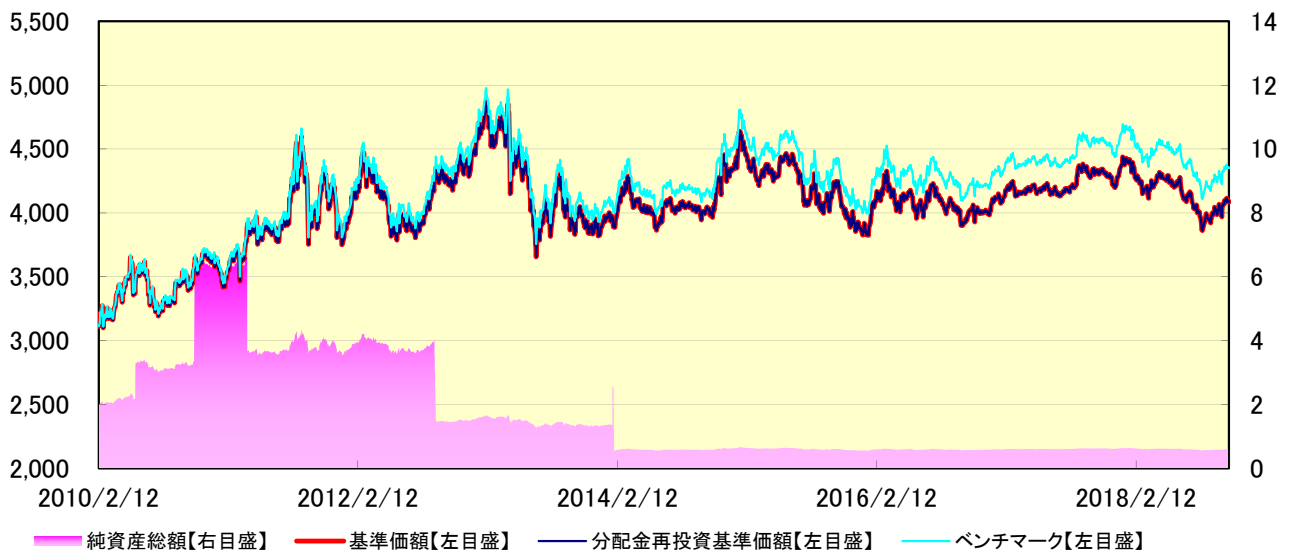
(期間:2010年2月12日～2018年10月31日)

ベンチマーク:設定日を3,112円としてTOCOM(東京商品取引所)の金先物価格の累積騰落率と等しくなるように指数化したもの。

注:対象とする金先物価格は期先限月(受渡日が最も遠い限月)とし、新たな期先限月への切替は取引開始日の翌月の最初の営業日とします。

(円)

(億円)



- ・基準価額および分配金再投資基準価額は、信託報酬控除後の値です。
- ・分配金再投資基準価額は、決算時に収益分配があった場合にその分配金(税引前)を再投資したものととして算出した収益率に基づきます。
- ・基準価額、分配金再投資基準価額およびベンチマークは、2010年2月12日の当ファンドの基準価額(3,112円)に合わせて指数化しております。

◆期間別騰落率

	ファンド	ベンチマーク
1ヵ月	2.5%	2.6%
3ヵ月	1.2%	1.4%
6ヵ月	-4.5%	-4.1%
1年	-5.0%	-4.3%
3年	-2.1%	-0.1%
5年	1.6%	5.2%
10年		
設定来	31.3%	39.8%

ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額より算出しており、実際の投資家利回りとは異なります。
ベンチマーク:上記をご参照。

◆分配等実績 (分配金は1口当たり、税引前)

決算期	日付	分配金	決算期	日付	分配金
第1期	2011/01/17	0円			
第2期	2012/01/17	0円			
第3期	2013/01/17	0円			
第4期	2014/01/17	0円			
第5期	2015/01/17	0円			
第6期	2016/01/17	0円			
第7期	2017/01/17	0円			
第8期	2018/01/17	0円			
設定来分配金累計額					0円

設定来高値および設定来安値にて、各々、同一の基準価額が複数存在する場合、直近の日付を表示しています。
運用実績および分配実績は、過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
当資料の作成において、投資信託説明書(交付目論見書)に記載する運用実績とは作成基準が異なる場合があります。
そのため、両者の表記内容が一致しないことがあります。

当資料はファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。後述の「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

資産組入状況・運用コメント

◆ポートフォリオの状況

国内債現物	0.0%
債券現先	0.0%
国内金先物	100.1%
その他資産	100.0%

国内金先物とは、TOCOMの金先物を表しています。
その他資産は、100%より国内債現物・債券現先の組入比率を減じて算出したものです。

◆公社債現物組入上位5銘柄の組入比率

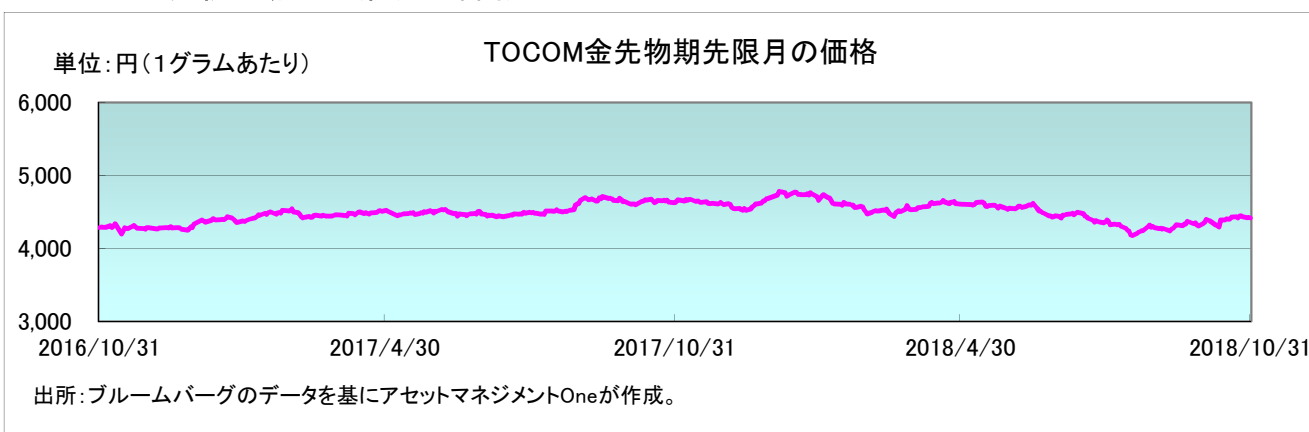
順位	銘柄名	利率	償還日	比率
1				
2				
3				
4				
5				

◆国内金先物組入上位5銘柄の組入比率

順位	銘柄名	限月	比率
1	国内金先物	2019/10	98.5%
2	国内金先物	2019/10	1.5%
3			
4			
5			

各表の組入比率は、純資産総額に対する比率を表示しています。

◆TOCOM金先物の動き (直近2年間)



◆運用概況

【運用概況】

わが国の短期公社債等に投資するとともに、TOCOM金先物を信託財産の純資産総額と同額程度になるように買い建て、TOCOM金先物取引価格の値動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。なお、連動の対象とするTOCOM金先物価格は、期先限月(受渡日が最も遠い限月)とし、新たな期先限月への切替は取引開始日の翌月の最初の営業日です。

【今後の運用方針】

今後も、わが国の短期公社債等に投資するとともに、TOCOM金先物を信託財産の純資産総額と同額程度になるように買い建て、TOCOM金先物取引価格の値動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

◆お知らせ

今月のお知らせはありません。

ファンドの特色(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

One ETF 国内金先物は、対象指標である商品先物取引価格(清算値)の値動きに連動する投資成果(基準価額の変動率が対象指標の変動率に一致することをいいます。以下同じ。)を目指します。

◆投資対象

原則として、わが国の短期公社債等を主要投資対象とし、対象指標[※]に関連する商品投資等取引に係る権利(以下「商品先物等」といいます。)を主要取引対象とします。

※対象指標は、株式会社東京商品取引所(以下「TOCOM」といいます。)の商品市場における金現物先物取引(金(標準取引))(以下「TOCOM金先物」といいます。)の期先限月の清算値(帳入値段)(終値)です。ただし、対象指標とする限月の切替えは、新甫発会日の翌月の最初の営業日とします。

TOCOM金先物とは

株式会社東京商品取引所(Tokyo Commodity Exchange, Inc.)は、貴金属や石油などの市場を運営する商品先物取引所です。TOCOM金先物取引は、毎偶数月末日(12月は28日。休業日または大納会に当たるときは順次繰り上げ)を受渡日とする6限月制(12か月以内の各偶数月)で取引が行われます。期先限月とは、受渡日が最も先である限月をいいます。各限月は、受渡日から起算して4営業日前に当たる日まで取引が行われ、その翌営業日が新しい限月(新甫)の発会日となります。

◆投資態度

①主として、わが国の短期国債等に投資を行うとともに、対象指標に関連する商品先物等の取引を通じ、信託財産の一口当たり純資産額の変動率を対象指標の変動率に一致させる投資成果を目指します。

②追加設定時には、設定後の信託財産が上記①に沿うよう、信託財産を組成します。

③次の場合等には、上記①に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行うことがあります。なお、これにより、信託財産における商品先物等の買い建玉の時価総額の合計金額が純資産総額を超えることとなる運用の指図を行う場合があります。

- a. 対象指標の定義が変更された場合もしくは当該変更が公表された場合
- b. 信託財産に属する有価証券の償還等に伴う、銘柄入替えを行う場合
- c. その他基準価額と対象指標の連動性を維持するために必要な場合

----当ファンドは、以下の点で通常の投資信託とは異なる商品設計となっております。----

◆受益権が東京証券取引所に上場されています。

売買単位:10口以上10口単位

手数料:お申込みの取扱会社が独自に定める金額

※取引方法は原則として株式と同様です。詳しくは取扱会社へお問い合わせください。

◆追加設定は一定口数以上[※]のお申込みでないとは行うことはできません。

対象指標に連動する投資成果を目的とする運用の支障とならないようにするために、追加設定を一定以上の金額による場合に限定するものです。

◆一定口数以上[※]の受益権を有する投資家は、信託契約の一部解約の実行を請求することができます。

基準価額と取引所での時価との間に乖離が生じたときに、合理的な裁定が入り、そうした乖離が収斂することにより、取引所での円滑な価格形成が行われることを期待するものです。

※一定口数以上となる単位については、販売会社が定める単位とします。

◆収益分配金の支払いは、名義登録によって投資者(受益者)を確定する方法で行われます。

当資料はファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。後述の「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

主な投資リスクと費用(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資するとともに、商品先物等(当ファンドにおいては金先物が該当します。以下同じ。)の取引を主要取引対象としますので、組み入れた公社債や商品先物等の価格変動ならびに商品先物等取引固有の要因等により、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
また、投資信託は預貯金と異なります。

商品先物等の価格変動リスク

当ファンドが投資する商品先物等の市場価格が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。商品先物等の取引価格は、商品の需給関係の変化のほか、貿易動向、為替レート、政治的・経済的事由、技術発展等さまざまな要因により変動します。

商品先物等取引固有の要因にかかる留意事項

●商品先物等取引の限月間の価格差(スプレッド)が基準価額に与える影響

商品先物等取引の価格には商品の需給見通しに加え、保管費用や金利負担等のコストが織り込まれ、各限月毎に価格が形成されます。これらの商品先物等の価格の限月毎の価格差は、一般的に以下のようにファンドの基準価額に影響を及ぼします。

- ・現在取引している限月より新たに取引される期先の限月の方が価格が高い場合、ファンドの基準価額にマイナスの要因となります。
- ・現在取引している限月より新たに取引される期先の限月の方が価格が低い場合、ファンドの基準価額にプラスの要因となります。

上記の影響は、現在取引している商品先物等取引から、新たに取引される期先の限月に乗換える(ロールオーバー)際に、現在取引している商品先物等の取引価格より新たに取引される期先の限月の取引価格の方が高い場合には、ロールオーバーにより新たに取得できる商品先物等取引の数量(先物取引の契約枚数)が少なくなり、逆に、現在取引している商品先物等の取引価格より新たに取引される期先の限月の取引価格の方が安い場合には、新たに取得できる商品先物等取引の数量(先物取引の契約枚数)が多くなるなどロールオーバーにより保有する商品先物等取引の数量が変化することで、その後商品先物等価格が変化した場合にファンドの基準価額にそれぞれ影響を与えることなどにより起こります。このように、現在取引している限月より新たに取引される期先の限月の価格の方が高い局面や現在取引している限月より新たに取引される期先の限月の価格の方が安い局面が長期間にわたり一方的に続いた場合、マイナス要因、プラス要因とも一方的に累積されることとなります。したがって、当ファンドの基準価額の値動きは、この間の商品の現物価格やロールオーバーの影響を考慮しない商品先物等価格の値動きとは大きな乖離が生じ、その期間が長いほど影響も大きくなる可能性があり、基準価額と対象指標の清算値(帳入値段)が大きく乖離する可能性があります。

●原資産の価格を利用する指標との差異

当ファンドが連動対象とする指標は、現物の金の商品価格ではなく、金の商品先物取引の価格を参照しています。商品先物取引の価格には、保管費用や金利負担等のコストが織り込まれますので、現物の商品価格を参照する場合と比べて価値が下回るおそれがあります。

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではなく、上記以外に「金利変動リスク」、「流動性リスク」、「信用リスク」、「公社債の貸付等におけるリスク」などがあります。

当ファンドへの投資に伴う主な費用は購入時手数料、信託報酬などです。

費用の詳細につきましては、当資料中の「ファンドの費用」および投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

その他の留意事項

◆当ファンドは、対象指標であるTOCOM金先物取引の期先限月の清算値の値動きに連動する投資成果を目指しますが、次のような要因により意図した投資成果が得られない場合があります。

1. 追加設定、一部解約および対象指標とする限月の切替(ロールオーバー)時の金先物取引の約定価格と当ファンドの評価に使用する金先物取引の当日清算値(帳入値段)に差が生じた場合の影響
2. 追加設定、一部解約があった場合における資金の流出入から実際に金先物取引を行うまでのタイミングのずれや、解約資金を手当てする際、市場実勢から乖離した価格での決済を余儀なくされた場合等の影響
3. 市場の大幅な変動や流動性の低下等により金先物取引が成立せず、当ファンドが行う金先物取引の全部または一部が成立しなかった場合の影響
4. 運用管理費用(信託報酬)、売買委託手数料等の費用の負担による影響
5. 金先物取引の最低取引単位による影響
6. 金先物取引の証拠金率の変動により目標とする買建てが行えなかった場合の影響
7. 当局、公的機関または取引所の規制等の変更や金先物取引の制度変更、上場廃止等により、目標とする運用が行えなかった場合の影響
8. 投資している公社債等の利息収入、償還差益等による影響

◆当ファンドの信託期間は無期限となっておりますが、繰上償還を行う場合があります。その際には、当ファンドの受益権は、金融商品取引所において上場廃止となります。また、上場廃止となった場合の換金(解約)請求は信託終了日の3営業日前までの毎営業日に行うことができます。

◆商品先物等取引市場に急激な変化が生じた場合、または予想される場合には、信託財産を保全するため、商品先物等取引の建玉を縮小またはすべて決済することがあります。このような場合には、目標とする投資成果が十分に得られないこと、または全く得られないことがあります。当ファンドが取引を行う取引所の取引規制などの影響により、ファンドの目的を達成するために十分な先物取引を行えないなどの理由により、ファンドの投資目的を達成できない場合があります。

当資料はファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。後述の「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

お申込みメモ(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

購入単位	販売会社が定める単位
購入価額	購入申込受付日の基準価額(基準価額は1口当たりで表示しています。)
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払いください。
換金単位	販売会社が定める単位
換金価額	換金申込受付日の基準価額
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して4営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として営業日の午後1時までに委託会社において受理されたものを当日分のお申込みとします。 ※一度受理されたお申込みは、その後、中止または取り消すことは原則できません。
購入・換金申込不可日	委託会社は次のいずれかに該当する場合には、原則として当該申込みの受付を停止します。 ・委託会社が約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認められたとき。 ・委託会社が信託財産または受益者に影響をおよぼすと判断する期日および期間。
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。
購入・換金申込受付の中止および取消し	商品市場、外国商品市場および取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、組入有価証券および商品先物等の取引の換金にかかる事情その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取り消すことがあります。
信託期間	無期限(2010年2月12日設定)
繰上償還	受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場を廃止することとなる場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了(繰上償還)させます。 次のいずれかに該当する場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了(繰上償還)することがあります。 ・対象指標に関連する商品等がその主たる取引所(商品取引所を含みます。)において上場廃止になったとき、対象指標が廃止されたとき、対象指標の公示性または市場性が失われたとき、対象指標に継続性を失わせるような改定が行われたとき等で、それに代わる新たな対象指標を定めることができない場合。 ・信託契約の一部解約により、受益権の総口数が30万口を下回ることとなるとき。 ・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき。 ・やむを得ない事情が発生したとき。
決算日	毎年1月17日
収益分配	年1回の毎決算日に、収益分配方針に基づいて収益分配を行います。
課税関係	課税上は上場証券投資信託として取り扱われます。 上場証券投資信託は税法上、少額投資非課税制度および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。 ※原則、収益分配金の普通分配金ならびに換金時の値上がり益および償還時の償還差益に対して課税されます。 ※税法が改正された場合等には、上記内容が変更となる場合があります。

当資料はファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。後述の「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

(551683)

ファンドの費用(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

下記の手数料等の合計額、その上限額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。
※税法が改正された場合等には、税込手数料等が変更となることがあります。

●投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	購入価額に対して、 販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額
信託財産留保額	ありません。
換金時手数料	販売会社が別に定める額 ※詳細は販売会社までお問い合わせください。

●投資者が信託財産で間接的に負担する費用

運用管理費用 (信託報酬)	運用管理費用(信託報酬)の総額は次の1.により計算した額に、2.により計算した額を加算して得た額とします。 1.ファンドの日々の純資産総額に対して 年0.486%(税抜0.45%)以内の率 を乗じて得た額 2.公社債の貸付を行った場合は、その品貸料の 54%(税抜50%)以内の額 ※運用管理費用(信託報酬)は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき ファンドから支払われます。
その他の費用・手数料	◆受益権の上場にかかる費用(2018年7月末現在) ・上場手数料:追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して、 0.0081%(税抜0.0075%) ・上場の年賦課金:毎年末または上場日の純資産総額に対して、 最大0.0081%(税抜0.0075%) また、その他の費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。 ・組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料 ・信託事務の処理に要する諸費用 ・監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用等 監査費用は毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、その他の費用等は その都度ファンドから支払われます。 ※これらの費用等は、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示す ことができません。

当資料はファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。後述の「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

