

運用報告書 (全体版)

第1期<決算日2021年6月7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、2021年6月7日に第1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 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		30.9	94.5	-	1,194

(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		
(設定日) 2020年6月5日	円 10,000	% -	% -	% -	% -
6月末	9,533	△4.7		94.8	-
7月末	9,870	△1.3		95.1	-
8月末	10,500	5.0		95.7	-
9月末	10,391	3.9		95.7	-
10月末	10,093	0.9		92.9	-
11月末	10,959	9.6		94.1	-
12月末	11,233	12.3		94.6	-
2021年1月末	11,515	15.2		95.6	-
2月末	11,629	16.3		94.6	-
3月末	12,508	25.1		94.0	-
4月末	12,795	28.0		94.6	-
5月末	13,033	30.3		95.3	-
(期末) 2021年6月7日	13,088	30.9		94.5	-

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

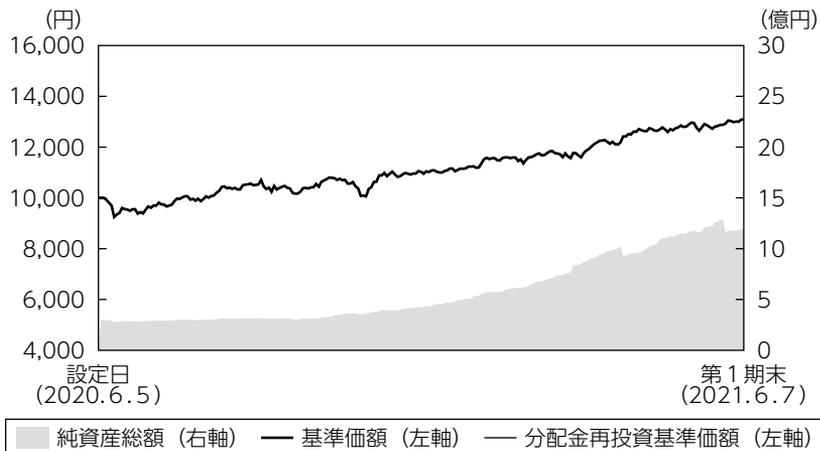
(注2) 騰落率は設定日比です。

(注3) 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4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2020年6月5日から2021年6月7日まで）

基準価額等の推移



設定日：10,000円
第1期末：13,088円
(既払分配金0円)
騰落率：30.9%
(分配金再投資ベース)

(注) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

- (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) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。
- (注5) 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

外国株式市場が各国の積極的な財政・金融政策や経済再開への期待に支えられて上昇する中、建設・産業機器のレンタル事業を手掛けるアシュテッド・グループや、米国自動車メーカーのゼネラル・モーターズなどを中心に、保有銘柄の株価が上昇したことが基準価額の主な上昇要因となりました。

投資環境

外国株式市場は、設定時から2020年8月末にかけては新型コロナウイルスの感染拡大ペースの鈍化や各国の積極的な財政・金融政策に支えられ、上昇基調で推移しました。その後、新型コロナウイルスの感染再拡大や米国大統領選挙を控えたリスク回避的な動きにより軟調に推移する局面も見られましたが、11月以降は、米国新政権による経済対策や新型コロナウイルスのワクチンの早期普及に対する期待感、良好な経済指標と企業業績を支援材料に再び上昇基調となり、設定日比で上昇して終わりました。

為替市場では、対米ドルでは小幅に円高が進みました。設定時から2020年12月末にかけては米金融緩和政策の長期化観測などから円高基調で推移しました。2021年1月以降は米長期金利の上昇などを背景に円安が進行し、設定日比では円安となりました。対ユーロ・対ポンドにおいても円安が進みました。一時的にリスク回避的な行動が見られたものの、欧州各国における積極的な財政政策や新型コロナウイルスの感染拡大ペースの鈍化を受け、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、素材や金融の投資比率を低めとした一方、資本財・サービスや生活必需品の投資比率を高めとしました。なお、不動産とエネルギーセクターの銘柄は期を通じて保有しておりません。

※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
	2020年6月5日 ～2021年6月7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	3,087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、各国中央銀行の大規模金融緩和や各国政府の財政出動、および新型コロナウイルスのワクチン普及への期待が支えになる一方、一部地域においては感染拡大状況に揺さぶられやすい相場展開を想定します。引き続き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を選別し、投資していく方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第1期		項目の概要
	(2020年6月5日 ～2021年6月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	152円	1.364%	(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11,150円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、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
(投信会社)	(87)	(0.776)	
(販売会社)	(62)	(0.555)	
(受託会社)	(4)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	4	0.039	(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)	(4)	(0.039)	
(c) 有価証券取引税	13	0.116	(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)	(13)	(0.116)	
(d) その他費用	48	0.426	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(40)	(0.363)	
(監査費用)	(0)	(0.004)	
(その他)	(7)	(0.059)	
合計	217	1.945	

(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。

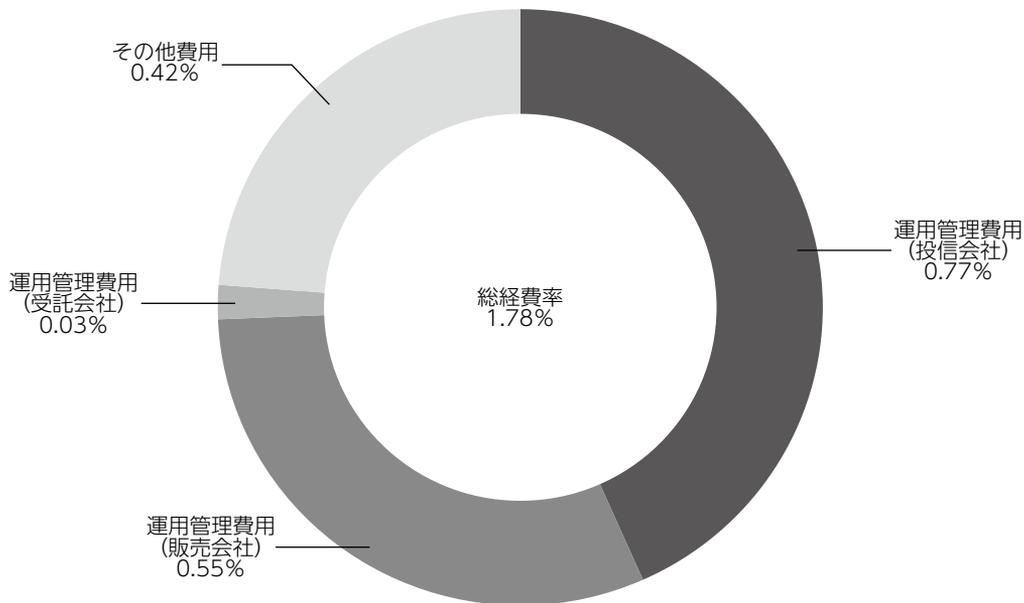
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.78%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（2020年6月5日から2021年6月7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□ 937,348	千円 1,058,500	千□ 67,780	千円 85,000

■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	1,076,010千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	563,503千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.90

(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（2020年6月5日から2021年6月7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 300	百万円 -	百万円 200	百万円 100	当初設定時又は当初運用時における取得とその処分

■組入資産の明細

親投資信託残高

	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
OneグローバルESG厳選株マザーファンド	千□ 869,568	千円 1,158,699

■投資信託財産の構成

2021年6月7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	1,158,699	96.1
コール・ローン等、その他	46,994	3.9
投資信託財産総額	1,205,694	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、2021年6月7日現在、OneグローバルESG厳選株マザーファンドは1,135,854千円、98.0%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、2021年6月7日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.57円、1カナダ・ドル=90.68円、1イギリス・ポンド=155.21円、1スイス・フラン=121.87円、1ノルウェー・クローネ=13.19円、1ユーロ=133.32円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,205,694,180円
コール・ローン等	46,994,773
OneグローバルESG厳選株マザーファンド(評価額)	1,158,699,407
(B) 負 債	11,388,296
未払解約金	5,635,754
未払信託報酬	5,737,692
その他未払費用	14,850
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,194,305,884
元 本	912,551,806
次期繰越損益金	281,754,078
(D) 受 益 権 総 口 数	912,551,806口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,088円

(注) 設定当初の投資元本額は300,000,000円、当期中における追加設定元本額は924,811,215円、同解約元本額は312,259,409円です。

■損益の状況

当期 自2020年6月5日 至2021年6月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△2,407円
受 取 利 息	596
支 払 利 息	△3,003
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	147,709,759
売 買 益	184,920,085
売 買 損	△37,210,326
(C) 信 託 報 酬 等	△7,947,981
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	139,759,371
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	141,994,707
(配 当 等 相 当 額)	(△2,444)
(売 買 損 益 相 当 額)	(141,997,151)
(F) 合 計(D+E)	281,754,078
次 期 繰 越 損 益 金(F)	281,754,078
追 加 信 託 差 損 益 金	141,994,707
(配 当 等 相 当 額)	(1,499,816)
(売 買 損 益 相 当 額)	(140,494,891)
分 配 準 備 積 立 金	139,759,371

(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) (E)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	9,721,629円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	130,037,742
(c) 収 益 調 整 金	141,994,707
(d) 分 配 準 備 積 立 金	0
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	281,754,078
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	3,087.54
(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1期（決算日 2021年6月7日）

（計算期間 2020年6月5日～2021年6月7日）

OneグローバルESG厳選株マザーファンドの第1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
	期騰落	中率			
(設定日) 2020年6月5日	円 10,000	% -	% -	% -	百万円 298
1期(2021年6月7日)	13,325	33.3	97.4	-	1,158

(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

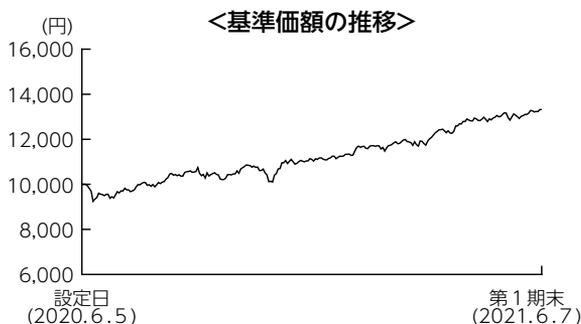
年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		騰	落		
(設定日) 2020年6月5日	円 10,000	% -		% -	% -
6 月 末	9,540	△4.6		95.2	-
7 月 末	9,890	△1.1		95.4	-
8 月 末	10,535	5.4		95.9	-
9 月 末	10,437	4.4		95.7	-
10 月 末	10,136	1.4		94.2	-
11 月 末	11,038	10.4		96.4	-
12 月 末	11,333	13.3		95.4	-
2021年1月 末	11,635	16.4		96.2	-
2 月 末	11,761	17.6		95.9	-
3 月 末	12,686	26.9		96.0	-
4 月 末	12,999	30.0		95.8	-
5 月 末	13,264	32.6		97.4	-
(期 末) 2021年6月7日	13,325	33.3		97.4	-

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

(注2) 騰落率は設定日比です。

(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（2020年6月5日から2021年6月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は13,325円となり、設定日比で33.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

外国株式市場が各国の積極的な財政・金融政策や経済再開への期待に支えられて上昇する中、建設・産業機器のレンタル事業を手掛けるアシュテッド・グループや、米国自動車メーカーのゼネラル・モーターズなどを中心に、保有銘柄の株価が上昇したことが基準価額の主な上昇要因となりました。

投資環境

外国株式市場は、設定時から2020年8月末にかけては新型コロナウイルスの感染拡大ペースの鈍化や各国の積極的な財政・金融政策に支えられ、上昇基調で推移しました。その後、新型コロナウイルスの感染再拡大や米国大統領選挙を控えたリスク回避的な動きにより軟調に推移する局面も見られましたが、11月以降は、米国新政権による経済対策や新型コロナウイルスのワクチンの早期普及に対する期待感、良好な経済指標と企業業績を支援材料に再び上昇基調となり、設定日比で上昇して終えました。

為替市場では、対米ドルでは小幅に円高が進みました。設定時から2020年12月末にかけては米金融緩和政策の長期化観測などから円高基調で推移しました。2021年1月以降は米長期金利の上昇などを背景に円安が進行し、設定日比では円安となりました。対ユーロ・対ポンドにおいても円安が進みました。一時的にリスク回避的な行動が見られたものの、欧州各国における積極的な財政政策や新型コロナウイルスの感染拡大ペースの鈍化を受け、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、素材や金融の投資比率を低めとした一方、資本財・サービスや生活必需品の投資比率を高めとしました。なお、不動産とエネルギーセクターの銘柄は期を通じて保有しておりません。

【運用状況】 2021年6月7日現在

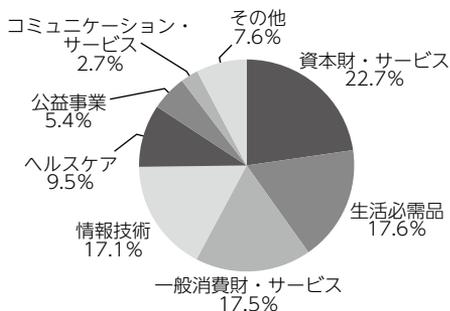
(注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

(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



○組入上位10銘柄

No.	銘柄名	通貨	比率
1	ASHTREAD 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	

今後の運用方針

今後の株式市場は、各国中央銀行の大規模金融緩和や各国政府の財政出動、および新型コロナウイルスのワクチン普及への期待が支えになる一方、一部地域においては感染拡大状況に揺さぶられやすい相場展開を想定します。引き続き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を選別し、投資していく方針です。

■ 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)	4円 (4)	0.039% (0.039)	(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)	13 (13)	0.118 (0.118)	(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)	48 (41) (7)	0.429 (0.369) (0.060)	(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	66	0.586	
期中の平均基準価額は11,245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 (2020年6月5日から2021年6月7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 770.99 (-)	千アメリカ・ドル 6,235 (-)	百株 42.09	千アメリカ・ドル 376	
	カ ナ ダ	百株 21.24 (-)	千カナダ・ドル 281 (-)	百株 1.15	千カナダ・ドル 16	
	イ ギ リ ス	百株 148.32 (-)	千イギリス・ポンド 765 (-)	百株 8.08	千イギリス・ポンド 45	
	ス イ ス	百株 4.15 (-)	千スイス・フラン 219 (△0.5895)	百株 0.22	千スイス・フラン 12	
	ノ ル ウ ェ ー	百株 219.94 (-)	千ノルウェー・クローネ 1,875 (-)	百株 11.63	千ノルウェー・クローネ 98	
	ユ ー ロ 圏	フ ラ ン ス	百株 27.27 (-)	千ユーロ 239 (-)	百株 1.49	千ユーロ 13
		ド イ ツ	百株 61.3 (-)	千ユーロ 373 (-)	百株 3.36	千ユーロ 22
	国 株 式	ス ペ イ ン	百株 201.34 (196.11)	千ユーロ 214 (-)	百株 207.14	千ユーロ 12
		フ ィ ン ラ ン ド	百株 49.92 (-)	千ユーロ 250 (-)	百株 2.74	千ユーロ 14
		オ ー ス ト リ ア	百株 38.22 (-)	千ユーロ 214 (-)	百株 2.1	千ユーロ 13

(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	1,076,010	千円
(b)	期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	563,503	千円
(c)	売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.90	

(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 (2020年6月5日から2021年6月7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	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		百株	千アメリカ・ドル	千円	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	22.59	333	36,489	情報技術サービス
	ADOBE INC	5.51	277	30,458	ソフトウェア
	BAXTER INTERNATIONAL INC	26.39	217	23,783	ヘルスケア機器・用品
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	33.32	216	23,708	医薬品
	CSX CORP	34.06	339	37,177	陸運・鉄道
	CLOROX COMPANY	15.86	283	31,108	家庭用品
	EBAY INC	52.35	341	37,415	インターネット販売・通信販売
	ESTEE LAUDER COS INC/THE	11.18	339	37,160	パーソナル用品
	HP INC	96.71	296	32,457	コンピュータ・周辺機器
	HOME DEPOT INC	9.87	306	33,634	専門小売り
	JOHNSON & JOHNSON	19.26	319	35,024	医薬品
	KROGER CO	82.9	320	35,070	食品・生活必需品小売り
	MCDONALD'S CORPORATION	12.21	284	31,222	ホテル・レストラン・レジャー
	MICROSOFT CORP	11.77	295	32,342	ソフトウェア
	QUALCOMM INC	18.86	253	27,761	半導体・半導体製造装置
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	39.86	255	27,960	食品
	STANLEY BLACK & DECKER INC	15.9	338	37,081	機械
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24.45	274	30,052	資本市場
	XYLEM INC	35.77	426	46,733	機械
	GENERAL MOTORS CO	62.94	398	43,702	自動車
	ARAMARK	73.63	264	29,011	ホテル・レストラン・レジャー
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	23.51	350	38,351	電子装置・機器・部品
小 計	株 数	728.9	6,732	737,708	
	銘 柄	22銘柄	-	<63.7%>	
(カナダ)		百株	千カナダ・ドル	千円	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	20.09	272	24,748	陸運・鉄道
小 計	株 数	20.09	272	24,748	
	銘 柄	1銘柄	-	<2.1%>	
(イギリス)		百株	千イギリス・ポンド	千円	
	ASHTAD GROUP	60.96	316	49,200	商社・流通業
	UNILEVER PLC	39.36	168	26,104	パーソナル用品
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	22.09	143	22,241	家庭用品
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	17.83	230	35,823	機械
小 計	株 数	140.24	859	133,369	
	銘 柄	4銘柄	-	<11.5%>	
(スイス)		百株	千スイス・フラン	千円	
	LONZA GROUP AG-REG	3.93	230	28,104	ライフサイエンス・ツール/サービス
小 計	株 数	3.93	230	28,104	
	銘 柄	1銘柄	-	<2.4%>	
(ノルウェー)		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
	ORKLA ASA	208.31	1,818	23,986	食品
小 計	株 数	208.31	1,818	23,986	
	銘 柄	1銘柄	-	<2.1%>	

銘	柄	当		期		業	種	等	
		株	数	評					額
				外貨建金額	邦貨換算金額				
(ユーロ…フランス)	VINCI S.A.	百株	千ユーロ	千円					
		25.78	240	32,118		建設・土木			
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	25.78	240	32,118					
		1銘柄	-	<2.8%>					
(ユーロ…ドイツ)	PUMA AG	百株	千ユーロ	千円					
	COVESTRO AG	22.11	204	27,283		繊維・アパレル・贅沢品			
		35.83	208	27,782		化学			
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	57.94	413	55,066					
		2銘柄	-	<4.8%>					
(ユーロ…スペイン)	IBERDROLA SA	百株	千ユーロ	千円					
		190.31	201	26,919		電力			
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	190.31	201	26,919					
		1銘柄	-	<2.3%>					
(ユーロ…フィンランド)	ELISA OYJ	百株	千ユーロ	千円					
		47.18	231	30,802		各種電気通信サービス			
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	47.18	231	30,802					
		1銘柄	-	<2.7%>					
(ユーロ…オーストリア)	VERBUND AG	百株	千ユーロ	千円					
		36.12	266	35,490		電力			
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	36.12	266	35,490					
		1銘柄	-	<3.1%>					
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,458.8	-	1,128,315					
		35銘柄	-	<97.4%>					

(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

2021年6月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 1,128,315	% 97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	30,354	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	1,158,670	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、1,135,854千円、98.0%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、2021年6月7日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.57円、1カナダ・ドル=90.68円、1イギリス・ポンド=155.21円、1スイス・フラン=121.87円、1ノルウェー・クローネ=13.19円、1ユーロ=133.32円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,158,670,258円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	28,208,446
株 式(評価額)	1,128,315,783
未 収 配 当 金	2,146,029
(B) 負 債	—
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,158,670,258
元 本	869,568,036
次 期 繰 越 損 益 金	289,102,222
(D) 受 益 権 総 口 数	869,568,036口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,325円

(注1) 設定当初元本額 298,500,000円

追加設定元本額 638,848,169円

一部解約元本額 67,780,133円

(注2) 期末における元本の内訳

OneグローバルE S G厳選株ファンド<DC年金>

869,568,036円

期末元本合計

869,568,036円

■損益の状況

当期 自2020年6月5日 至2021年6月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	10,520,774円
受 取 配 当 金	10,528,355
受 取 利 息	129
支 払 利 息	△7,710
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	177,072,389
売 買 損 益	182,158,891
売 買 損	△5,086,502
(C) そ の 他 費 用	△2,422,905
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	185,170,258
(E) 解 約 差 損 益 金	△17,219,867
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	121,151,831
(G) 合 計(D+E+F)	289,102,222
次 期 繰 越 損 益 金(G)	289,102,222

(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) (E)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) (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。