

## 運用報告書（全体版）

第6期＜決算日2026年6月5日＞

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。） <sup>(*)</sup> を主要投資対象とします。<br>（*）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。 |
| 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。） <sup>※1※2</sup> に実質的に投資します。<br>※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書等を含みます。<br>※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。<br>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。<br>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   | OneグローバルESG厳選株ファンド＜DC年金＞                                                                                                                                                                                                                                                    | 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。<br>株式への実質投資割合には、制限を設けません。<br>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。                                  |
|        | OneグローバルESG厳選株マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                       | 株式への投資割合には、制限を設けません。<br>外貨建資産への投資割合には、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。）および売買取引（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。                                                        |                                                                                                                       |

## OneグローバルESG厳選株ファンド＜DC年金＞

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、2026年6月5日に第6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>

## ■最近5期の運用実績

| 決 算 期          | 基 準<br>(分配落) | 価 額    |          |           | 株 式 組 入 率<br>株 比 | 株 式 先 物 率<br>株 比 | 純 資 産 額 |
|----------------|--------------|--------|----------|-----------|------------------|------------------|---------|
|                |              | 税 込 分  | 込 配 金    | 期 騰 落 中 率 |                  |                  |         |
| 2期 (2022年6月6日) | 円<br>13,973  | 円<br>0 | %<br>6.8 | %<br>96.9 | %<br>－           | 百万円<br>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            |         |
| 5期 (2025年6月5日) | 17,770       | 0      | 4.2      | 98.1      | －                | 5,973            |         |
| 6期 (2026年6月5日) | 23,692       | 0      | 33.3     | 98.0      | －                | 9,276            |         |

(注1) 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適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

(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<br>月<br>日             | 基 準         | 価 額    | 株 式 組 入 率 | 株 式 先 物 率 |
|-------------------------|-------------|--------|-----------|-----------|
|                         |             | 騰 落 率  |           |           |
| (期 首)<br>2025 年 6 月 5 日 | 円<br>17,770 | %<br>— | %<br>98.1 | %<br>—    |
| 6 月 末                   | 18,467      | 3.9    | 96.9      | —         |
| 7 月 末                   | 19,323      | 8.7    | 96.5      | —         |
| 8 月 末                   | 18,831      | 6.0    | 98.4      | —         |
| 9 月 末                   | 19,358      | 8.9    | 97.7      | —         |
| 10 月 末                  | 20,396      | 14.8   | 96.8      | —         |
| 11 月 末                  | 20,272      | 14.1   | 95.4      | —         |
| 12 月 末                  | 20,533      | 15.5   | 94.8      | —         |
| 2026 年 1 月 末            | 20,840      | 17.3   | 97.0      | —         |
| 2 月 末                   | 21,406      | 20.5   | 98.2      | —         |
| 3 月 末                   | 19,570      | 10.1   | 97.1      | —         |
| 4 月 末                   | 22,212      | 25.0   | 97.3      | —         |
| 5 月 末                   | 23,442      | 31.9   | 96.9      | —         |
| (期 末)<br>2026 年 6 月 5 日 | 23,692      | 33.3   | 98.0      | —         |

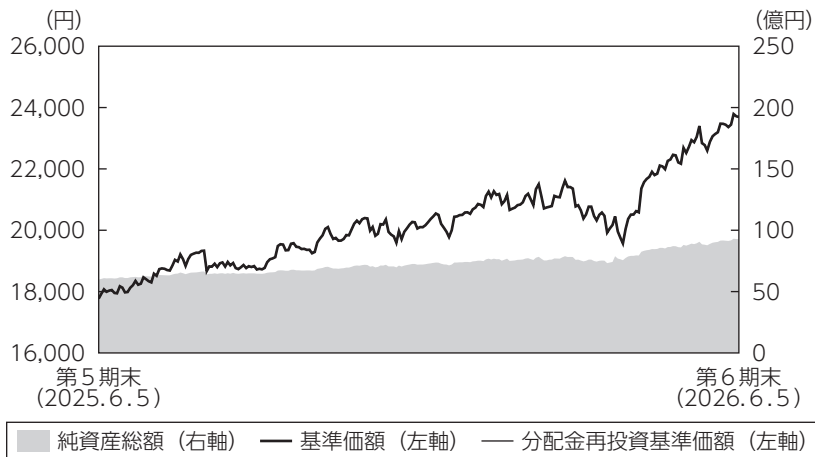
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2025年6月6日から2026年6月5日まで）

### 基準価額等の推移



第6期首：17,770円  
第6期末：23,692円  
(既払分配金0円)  
騰落率：33.3%  
(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

基準価額は上昇しました。中東情勢の緊迫化に伴う原油価格の上昇やインフレ再燃懸念などから大きく調整する局面もありましたが、堅調な企業決算やAI（人工知能）関連需要への期待の高まり、中東情勢の緊張緩和などを背景に、株式市場全体が上昇したことから、基準価額は上昇しました。為替市場においては、米ドルおよびユーロに対して円安が進行したことも、基準価額の押し上げ要因となりました。

## 投資環境

外国株式市場は上昇しました。期初から2026年初にかけては、堅調な企業決算やA I（人工知能）関連需要への期待、F R B（米連邦準備理事会）の利下げなどを背景に、上昇基調となりました。その後、中東情勢の緊迫化に伴う原油価格の上昇やインフレ再燃懸念、F R Bの利下げ観測の後退などから、3月下旬にかけて調整局面となりましたが、緊張緩和への期待や半導体関連銘柄の上昇などを背景に、反発して期末を迎えました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。12月には日本銀行が政策金利を引き上げたものの、高市政権の積極財政路線への懸念などから円安基調で推移しました。2月の衆院選で与党が圧勝し積極財政への観測が強まったことや、米国・イスラエルによるイランへの軍事攻撃に伴う原油価格の急騰を受け円安が一段と進みました。期末にかけては、政府・日本銀行による円買い為替介入を受けて一時円高に振れる場面も見られましたが、円安基調を維持して期末を迎えました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

OneグローバルE S G厳選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E S G厳選株マザーファンド

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に注力しました。業種別では、一般消費財・サービスの投資比率を引き下げ一方、情報技術や金融の投資比率を引き上げました。また運用にあたっては、E S Gを主要な要素として選定する銘柄の組入比率を高い水準で維持しました（期末時点で100%）。

※運用状況とE S Gに関する詳細については、後掲のマザーファンドのページをご参照ください。

分配金

収益分配金につきましては基準価額水準・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利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                      |
|------------|-------------------------|
|            | 2025年6月6日<br>～2026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  | 13,692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

OneグローバルESG厳選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

外国株式市場は、中東情勢や世界景気及び物価動向による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も想定され、銘柄選択の重要性がより高まると考えます。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6期                       |         | 項目の概要                                                                |
|-------------|---------------------------|---------|----------------------------------------------------------------------|
|             | (2025年6月6日<br>～2026年6月5日) |         |                                                                      |
|             | 金額                        | 比率      |                                                                      |
| (a) 信託報酬    | 274円                      | 1.353%  | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は20,242円です。                     |
| (投信会社)      | (156)                     | (0.770) | 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)      | (111)                     | (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)      | ( 7)                      | (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 | 8                         | 0.038   | (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<br>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)        | ( 8)                      | (0.038) |                                                                      |
| (c) 有価証券取引税 | 15                        | 0.072   | (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<br>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)        | (15)                      | (0.072) |                                                                      |
| (d) その他費用   | 13                        | 0.064   | (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)      | ( 9)                      | (0.045) | 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)       | ( 3)                      | (0.015) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等                                                 |
| 合計          | 309                       | 1.527   |                                                                      |

(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。

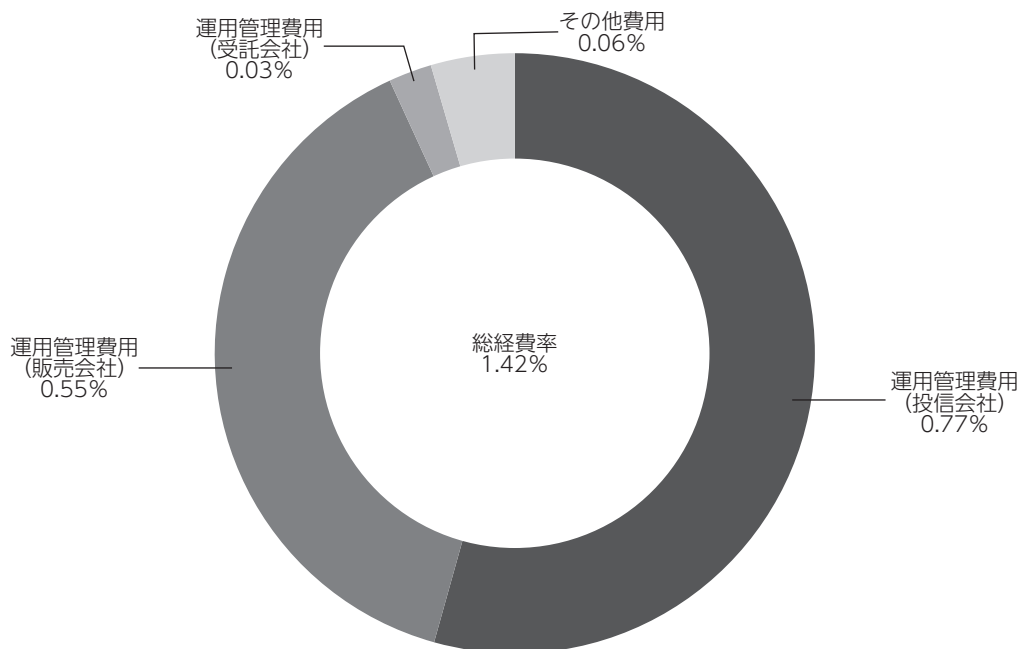
(注 2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.42%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（2025年6月6日から2026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 | 千口<br>455,122 | 千円<br>1,002,091 | 千口<br>－ | 千円<br>－ |

■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         | 17,123,243千円          |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 7,162,942千円           |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)         | 2.39                  |

(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（2025年6月6日から2026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 | 千口<br>3,072,166 | 千口<br>3,527,289 | 千円<br>9,183,650 |

■投資信託財産の構成

2026年6月5日現在

| 項 目                   | 当 期 末     |       |
|-----------------------|-----------|-------|
|                       | 評 価 額     | 比 率   |
|                       | 千円        | %     |
| OneグローバルESG厳選株マザーファンド | 9,183,650 | 98.4  |
| コール・ローン等、その他          | 149,540   | 1.6   |
| 投資信託財産総額              | 9,333,190 | 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OneグローバルESG厳選株マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、8,741,550千円、91.7%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、2026年6月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=160.04円、1カナダ・ドル=115.09円、1オーストラリア・ドル=114.06円、1香港・ドル=20.43円、1シンガポール・ドル=124.54円、1台湾・ドル=5.083円、1イギリス・ポンド=214.82円、1スイス・フラン=202.71円、1デンマーク・クローネ=24.86円、1ノルウェー・クローネ=17.11円、1スウェーデン・クローナ=17.06円、100韓国・ウォン=10.383円、1ユーロ=185.81円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2026年6月5日)現在

| 項 目                        | 当 期 末          |
|----------------------------|----------------|
| (A) 資 産                    | 9,333,190,566円 |
| コール・ローン等                   | 149,540,189    |
| OneグローバルESG厳選株マザーファンド(評価額) | 9,183,650,377  |
| (B) 負 債                    | 57,046,470     |
| 未払解約金                      | 3,376,935      |
| 未払信託報酬                     | 53,530,363     |
| その他未払費用                    | 139,172        |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B)         | 9,276,144,096  |
| 元 本                        | 3,915,249,528  |
| 次期繰越損益金                    | 5,360,894,568  |
| (D) 受 益 権 総 口 数            | 3,915,249,528口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)            | 23,692円        |

(注) 期首における元本額は3,361,697,241円、当期中における追加設定元本額は1,108,448,793円、同解約元本額は554,896,506円です。

■損益の状況

当期 自2025年6月6日 至2026年6月5日

| 項 目                  | 当 期             |
|----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益        | 785,118円        |
| 受 取 利 息              | 785,118         |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益  | 2,159,971,863   |
| 売 買 損 益              | 2,284,227,660   |
| 売 買 損 益              | △124,255,797    |
| (C) 信 託 報 酬 等        | △98,856,861     |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 2,061,900,120   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金    | 787,356,001     |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金  | 2,511,638,447   |
| (配 当 等 相 当 額)        | (1,324,264,303) |
| (売 買 損 益 相 当 額)      | (1,187,374,144) |
| (G) 合 計(D+E+F)       | 5,360,894,568   |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G)     | 5,360,894,568   |
| 追 加 信 託 差 損 益 金      | 2,511,638,447   |
| (配 当 等 相 当 額)        | (1,327,503,392) |
| (売 買 損 益 相 当 額)      | (1,184,135,055) |
| 分 配 準 備 積 立 金        | 2,849,256,121   |

(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      | 110,811,566円  |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 1,951,088,554 |
| (c) 収 益 調 整 金        | 2,511,638,447 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金    | 787,356,001   |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 5,360,894,568 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額    | 13,692.34     |
| (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・市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■当ファンドおよび当ファンドが投資対象とする「One グローバル ESG 厳選株マザーファンド」において、「一般社団法人投資信託協会」の名称変更に伴い、約款における記載を「一般社団法人資産運用業協会」に変更しました。

(2026年4月1日)

# OneグローバルESG厳選株マザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日 2026年6月5日）

（計算期間 2025年6月6日～2026年6月5日）

OneグローバルESG厳選株マザーファンドの第6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。） <sup>(*)</sup> を主要投資対象とします。<br>（*）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。<br>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。                                                                       |

## ■最近5期の運用実績

| 決 算 期         | 基 準    | 価 額 |       | 株 式 組 入 率<br>株 比 | 株 式 先 物 率<br>株 比 | 純 資 産 額 |
|---------------|--------|-----|-------|------------------|------------------|---------|
|               |        | 期 騰 | 落 中 率 |                  |                  |         |
| 2期（2022年6月6日） | 円      |     | %     | %                | %                | 百万円     |
|               | 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   |
| 5期（2025年6月5日） | 19,196 |     | 5.6   | 99.4             | —                | 5,897   |
| 6期（2026年6月5日） | 26,036 |     | 35.6  | 98.9             | —                | 9,183   |

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

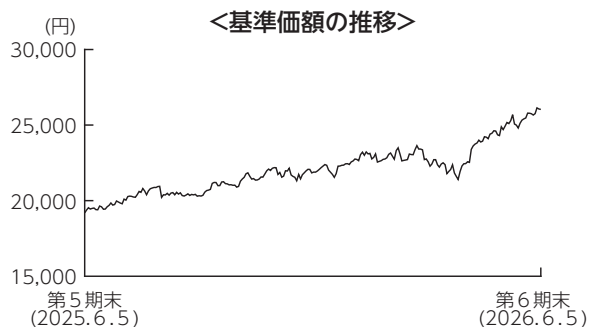
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日                   | 基 準    | 価 額 |        | 株 式 組 入 率 | 株 式 先 物 率 |
|-------------------------|--------|-----|--------|-----------|-----------|
|                         |        | 騰   | 落 率    |           |           |
| (期 首)<br>2025 年 6 月 5 日 | 円      |     | %<br>— | %<br>99.4 | %<br>—    |
| 6 月 末                   | 19,196 |     | 4.1    | 98.1      | —         |
| 7 月 末                   | 20,935 |     | 9.1    | 98.3      | —         |
| 8 月 末                   | 20,415 |     | 6.4    | 99.4      | —         |
| 9 月 末                   | 21,016 |     | 9.5    | 99.4      | —         |
| 10 月 末                  | 22,183 |     | 15.6   | 98.4      | —         |
| 11 月 末                  | 22,074 |     | 15.0   | 96.4      | —         |
| 12 月 末                  | 22,390 |     | 16.6   | 96.3      | —         |
| 2026 年 1 月 末            | 22,757 |     | 18.6   | 98.4      | —         |
| 2 月 末                   | 23,410 |     | 22.0   | 99.6      | —         |
| 3 月 末                   | 21,403 |     | 11.5   | 98.3      | —         |
| 4 月 末                   | 24,353 |     | 26.9   | 98.6      | —         |
| 5 月 末                   | 25,753 |     | 34.2   | 98.7      | —         |
| (期 末)<br>2026 年 6 月 5 日 | 26,036 |     | 35.6   | 98.9      | —         |

(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（2025年6月6日から2026年6月5日まで）



### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は26,036円となり、前期末比で35.6%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

基準価額は上昇しました。中東情勢の緊迫化に伴う原油価格の上昇やインフレ再燃懸念などから大きく調整する局面もありましたが、堅調な企業決算やA I（人工知能）関連需要への期待の高まり、中東情勢の緊張緩和などを背景に、株式市場全体が上昇したことから、基準価額は上昇しまし

た。為替市場においては、米ドルおよびユーロに対して円安が進行したことも、基準価額の押し上げ要因となりました。

## 投資環境

外国株式市場は上昇しました。期初から2026年初にかけては、堅調な企業決算やA I（人工知能）関連需要への期待、F R B（米連邦準備理事会）の利下げなどを背景に、上昇基調となりました。その後、中東情勢の緊迫化に伴う原油価格の上昇やインフレ再燃懸念、F R Bの利下げ観測の後退などから、3月下旬にかけて調整局面となりましたが、緊張緩和への期待や半導体関連銘柄の上昇などを背景に、反発して期末を迎えました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。12月には日本銀行が政策金利を引き上げたものの、高市政権の積極財政路線への懸念などから円安基調で推移しました。2月の衆院選で与党が圧勝し積極財政への観測が強まったことや、米国・イスラエルによるイランへの軍事攻撃に伴う原油価格の急騰をうけ円安が一段と進みました。期末にかけては、政府・日本銀行による円買い為替介入を受けて一時円高に振れる場面も見られましたが、円安基調を維持して期末を迎えました。

## ポートフォリオについて

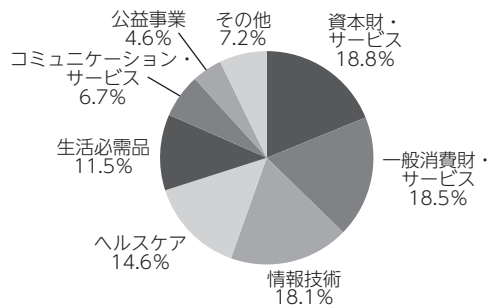
期を通じて、E S G課題へ積極的に取り組むことで中長期的な企業価値向上が期待できる銘柄の組入れに注力しました。業種別では、一般消費財・サービスの投資比率を引き下げるとともに、情報技術や金融の投資比率を引き上げました。また運用にあたっては、E S Gを主要な要素として選定する銘柄の組入比率を高い水準で維持しました（期末時点で100%）。

※ E S Gに関する詳細は後掲をご参照ください。

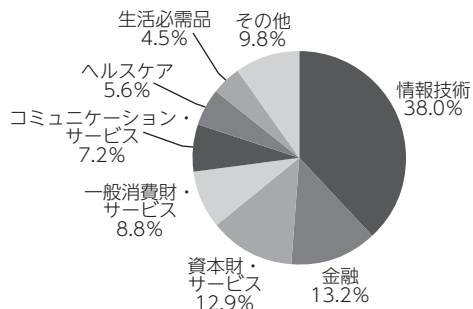
## 【運用状況】

### ○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 | 4.9% |
| 2     | BOSTON SCIENTIFIC CORP | アメリカ・ドル  | 4.8  |
| 3     | SERVICENOW INC         | アメリカ・ドル  | 4.7  |
| 4     | IBERDROLA SA           | ユーロ      | 4.6  |
| 5     | DOLLARAMA INC          | カナダ・ドル   | 4.6  |
| 6     | SCHNEIDER ELECTRIC SE  | ユーロ      | 4.5  |
| 7     | SCOUT24 SE             | ユーロ      | 4.4  |
| 8     | DANONE                 | ユーロ      | 3.7  |
| 9     | CENCORA INC            | アメリカ・ドル  | 3.6  |
| 10    | WALMART INC            | アメリカ・ドル  | 3.6  |
| 組入銘柄数 |                        | 33銘柄     |      |

期末

| No.   | 銘柄名                         | 通貨      | 比率   |
|-------|-----------------------------|---------|------|
| 1     | ALPHABET INC-CL A           | アメリカ・ドル | 6.2% |
| 2     | NVIDIA CORP                 | アメリカ・ドル | 5.6  |
| 3     | TAIWAN SEMICONDUCTOR SP ADR | アメリカ・ドル | 4.2  |
| 4     | CORNING INC                 | アメリカ・ドル | 3.5  |
| 5     | AMAZON.COM INC              | アメリカ・ドル | 3.1  |
| 6     | BROADCOM INC                | アメリカ・ドル | 3.0  |
| 7     | MICROSOFT CORP              | アメリカ・ドル | 3.0  |
| 8     | GE VERNOVA INC              | アメリカ・ドル | 2.9  |
| 9     | CISCO SYSTEMS INC           | アメリカ・ドル | 2.7  |
| 10    | WALMART INC                 | アメリカ・ドル | 2.5  |
| 組入銘柄数 |                             | 57銘柄    |      |

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

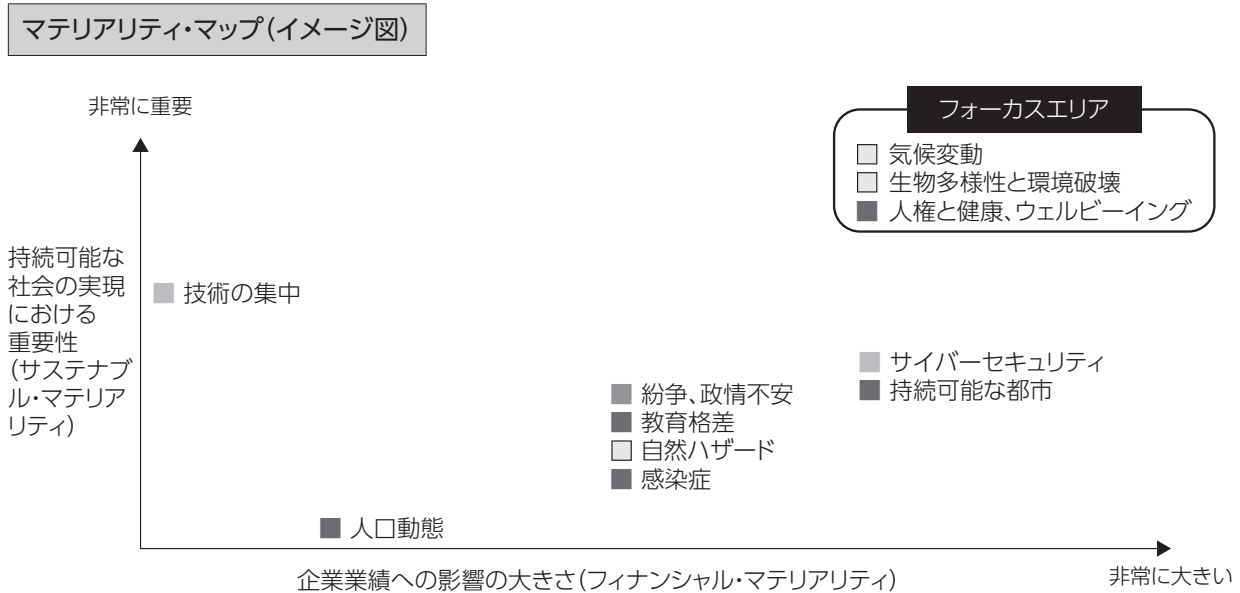
(注3) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

(注4) 現金等はその他として表示しています。

※以下のデータは決算日（2026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》

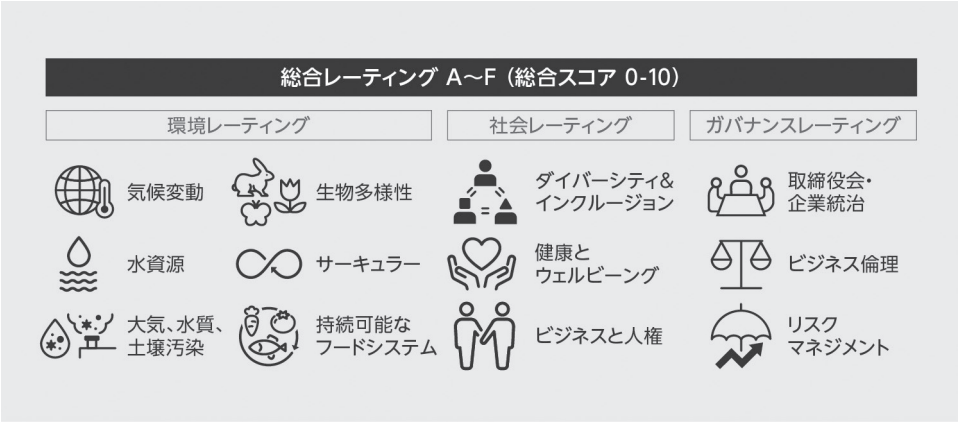
アセットマネジメントOne（以下、当社）が独自に算出したESGスコア（以下、ESGスコア）を活用してOneグローバルESG厳選株マザーファンド（以下、マザーファンド）の組入銘柄を選択しました。ESGスコアは、当社が定めるマテリアリティ・マップ（持続可能な社会の実現に向けた重要性和企業業績への影響の大きさを勘案し、当社として考える取り組むべき環境・社会の課題を捉えたもの）を基に、当社が重視するグローバルな環境・社会課題への企業の取り組みを評価し点数化したものです。算出されたESGスコア（10が最良で0まで付与）は、ESGレーティング（Aが最良でFまで付与）に変換されます。



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。

(注) 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。



(注 1) 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。  
(注 2) 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。

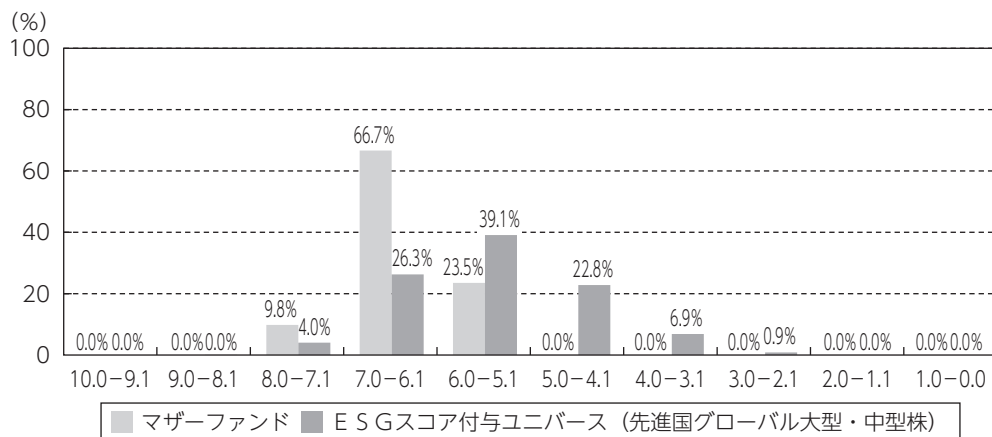
## 《E S Gスコアの分布》

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8.0－6.1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2,214社です。

また、上記の他、新興国の同様のランキング（付与数1,078社）においてE S Gスコアが8.0－7.1に該当する2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）



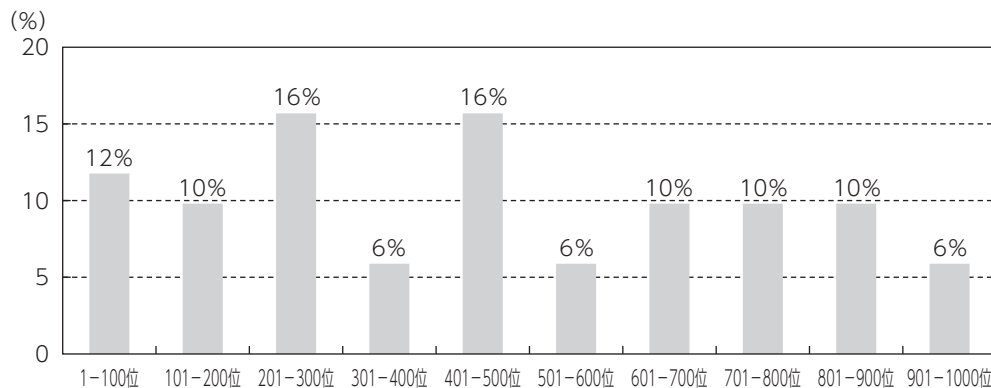
（注）比率（％）は、マザーファンド組入銘柄数および当ファンド投資ユニバースのE S Gスコア付与銘柄数（先進国グローバル大型・中型株）をそれぞれの分母として算出

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のすべてが同スコア上位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。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）2,214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1,078社中100位以内に該当する2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



(注) 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<br>スコア | ESG要素スコア  |           |              | ESGスコア<br>ランキング<br>※ | E S G総合<br>レーティング |
|-----|-----------------------------|------|----------------|------|----------------|-----------|-----------|--------------|----------------------|-------------------|
|     |                             |      |                |      |                | 環境<br>(E) | 社会<br>(S) | ガバナンス<br>(G) |                      |                   |
| 1   | ALPHABET INC-CL A           | アメリカ | コミュニケーション・サービス | 6.2% | 5.9            | 7.6       | 4.1       | 6.1          | 816                  | C                 |
| 2   | NVIDIA CORP                 | アメリカ | 情報技術           | 5.6% | 6.6            | 6.3       | 6.7       | 6.8          | 267                  | B                 |
| 3   | TAIWAN SEMICONDUCTOR SP ADR | 台湾   | 情報技術           | 4.2% | 7.4            | 7.3       | 6.2       | 8.7          | 94                   | A                 |
| 4   | CORNING INC                 | アメリカ | 情報技術           | 3.5% | 5.7            | 5.7       | 5.8       | 5.7          | 958                  | C                 |
| 5   | AMAZON.COM INC              | アメリカ | 一般消費財・サービス     | 3.1% | 6.1            | 7.1       | 5.1       | 6.2          | 620                  | B                 |
| 6   | BROADCOM INC                | アメリカ | 情報技術           | 3.0% | 5.7            | 4.6       | 4.3       | 8.2          | 994                  | C                 |
| 7   | MICROSOFT CORP              | アメリカ | 情報技術           | 3.0% | 5.9            | 5.9       | 5.7       | 6.1          | 826                  | C                 |
| 8   | GE VERNOVA INC              | アメリカ | 資本財・サービス       | 2.9% | 6.7            | 6.2       | 6.2       | 7.7          | 226                  | B                 |
| 9   | CISCO SYSTEMS INC           | アメリカ | 情報技術           | 2.7% | 6.2            | 8.5       | 5.0       | 5.3          | 518                  | B                 |
| 10  | WALMART INC                 | アメリカ | 一般消費財・サービス     | 2.5% | 6.1            | 5.8       | 4.7       | 7.6          | 625                  | B                 |

(注1) 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) 2,214社内でのランキング

(注2) 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、E S Gへの取り組み／企業価値との結びつき》

| 銘柄名                       | 概要                                                                                    | E S Gへの取り組み／企業価値との結びつき                                                                                                                                                                                   |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Alphabet<br>アルファベット       | 総合テクノロジー会社で、GoogleやYouTubeといったメディアやクラウドのほか、近年ではA Iや自動運転サービスなども展開。                     | <ul style="list-style-type: none"> <li>・自社オペレーションにおいてカーボンフリーなエネルギー調達を2030年までに達成する野心的な目標に取り組んでいる。</li> <li>・Googleマップ等のサービスにおいて、環境負荷の少ない移動手段を提案する等、ユーザーの環境配慮行動の支援も行っている。</li> </ul>                       |
| NVIDIA<br>エヌビディア          | 世界最大の半導体設計会社で、主力製品の画像処理用プロセッサ（G P U）は、A I・ゲーム等幅広い分野で活用されている。                          | <ul style="list-style-type: none"> <li>・同社のG P Uは従来の汎用計算プロセッサ（C P U）と比較して大幅にエネルギー効率が高く、A I・スーパーコンピューター分野での電力消費削減に貢献している。</li> <li>・自社オペレーションにおける電力使用を100%再生可能エネルギーで賄う目標を2025年に達成。</li> </ul>             |
| T S M C<br>台湾積体回路製造       | 世界最大の半導体製造受託会社。Apple、Nvidia、Qualcommといった大手設計企業から製造を請け負い、最先端の半導体を製造。                   | <ul style="list-style-type: none"> <li>・再生エネルギーの調達拡大による2030年までのネットゼロ排出の目標、水資源利用の改善を目指した半導体製造工場での節水・排水再利用、認証済みサプライヤーからの透明性のある材料調達といった幅広い取り組みを通じて、環境に配慮した製造を推進している。</li> </ul>                             |
| Corning<br>コーニング          | ガラス・セラミックス材料の技術を基盤に、ディスプレイ用ガラス、スマートフォン等向けカバーガラス、光ファイバー／通信部材、半導体関連材料、排ガス浄化等の環境技術製品を展開。 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・光ファイバー等を通じて通信の高度化・省電力化を下支えし、社会のデジタル化に伴うエネルギー効率改善に貢献。</li> <li>・培ったセラミック・材料技術を炭素回収（C C U S / C D R）など低炭素分野へ応用しており、世界的な脱炭素ニーズの高まりを新たな成長機会として取り込んでいる。</li> </ul>    |
| Amazon.com<br>アマゾン・ドット・コム | 世界最大級のテクノロジー企業で、オンライン小売（Eコマース）のほか、クラウド、広告、物流等も展開。                                     | <ul style="list-style-type: none"> <li>・再生可能エネルギーを100%使用するという目標を2023年に達成。</li> <li>・オンライン小売事業では、物流における電気自動車の導入、配送拠点の効率化、梱包材の削減や梱包材の循環型資材の活用に取り組む。クラウド事業においては、温室効果ガス排出の少ないインフラ施設を構築し顧客に導入している。</li> </ul> |

（注）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》

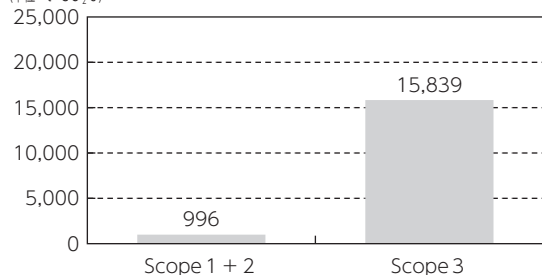
当社では環境（E）の観点から、マザーファンドのカーボン排出量をモニタリングしており、ファンドベースで気候変動リスクの低減に努めています。カーボン排出量は、企業の自社事業活動から排出される温室効果ガスであるScope 1（燃料の使用や自社の輸送などによる）と、企業が購入した電力および熱によって排出された温室効果ガスであるScope 2、および企業のサプライチェーンである上流や製品・サービスの利用時に発生する下流の温室効果ガス（Scope 3）の3種類があります。

マザーファンドのScope 1 およびScope 2 の値は、996 t CO<sub>2</sub>e であり、上流・下流の排出量（Scope 3）は15,839 t CO<sub>2</sub>e 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）

（単位：t CO<sub>2</sub>e）



（出所） I S S のデータを基に当社にて作成

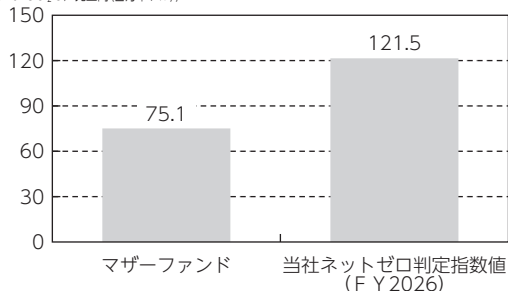
## 《マザーファンドにおけるカーボン排出量インテンシティについて》

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、75.1 t CO<sub>2</sub>e / 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121.5 t CO<sub>2</sub>e / 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 CO<sub>2</sub>e / 売上高（百万米ドル））



（出所） I S S のデータを基に当社にて作成

I S S 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、E S G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

外国株式市場は、中東情勢や世界景気及び物価動向による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も想定され、銘柄選択の重要性がより高まると考えます。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<br>(株 式)            | 9円<br>(9)         | 0.039%<br>(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<br>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<br>(株 式)            | 16<br>(16)        | 0.073<br>(0.073)            | (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<br>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<br>(保 管 費 用)<br>(そ の 他) | 14<br>(10)<br>(3) | 0.061<br>(0.046)<br>(0.016) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用<br>その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計                                   | 38                | 0.173                       |                                                                                 |
| 期中の平均基準価額は22,053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 (2025年6月6日から2026年6月5日まで)

株 式

|   |             |                            | 買                         |                     | 付                           |                      | 売              |              | 付                     |               |  |
|---|-------------|----------------------------|---------------------------|---------------------|-----------------------------|----------------------|----------------|--------------|-----------------------|---------------|--|
|   |             |                            | 株数                        |                     | 金額                          |                      | 株数             |              | 金額                    |               |  |
| 国 | 上           | 場                          | 千株<br>69<br>(－)           |                     | 千円<br>330,876<br>(－)        |                      | 千株<br>15       |              | 千円<br>66,631          |               |  |
| 外 | ア           | メ<br>リ<br>カ                | 百株<br>2,530.43<br>(30.48) |                     | 千アメリカ・ドル<br>35,312<br>(－)   |                      | 百株<br>1,870.38 |              | 千アメリカ・ドル<br>27,268    |               |  |
|   | カ           | ナ<br>ダ                     | 百株<br>134.09<br>(－)       |                     | 千カナダ・ドル<br>1,839<br>(－)     |                      | 百株<br>133.25   |              | 千カナダ・ドル<br>2,755      |               |  |
|   | オ           | ー<br>ス<br>ト<br>ラ<br>リ<br>ア | 百株<br>396.9<br>(－)        |                     | 千オーストラリア・ドル<br>1,640<br>(－) |                      | 百株<br>396.9    |              | 千オーストラリア・ドル<br>1,209  |               |  |
|   | 香           | 港                          | 百株<br>199<br>(－)          |                     | 千香港・ドル<br>8,293<br>(－)      |                      | 百株<br>97       |              | 千香港・ドル<br>3,984       |               |  |
|   | シ           | ン<br>ガ<br>ポ<br>ー<br>ル      | 百株<br>1,463<br>(－)        |                     | 千シンガポール・ドル<br>715<br>(－)    |                      | 百株<br>1,463    |              | 千シンガポール・ドル<br>707     |               |  |
|   | イ           | ギ<br>リ<br>ス                | 百株<br>1,492.62<br>(－)     |                     | 千イギリス・ポンド<br>2,764<br>(－)   |                      | 百株<br>626.95   |              | 千イギリス・ポンド<br>2,090    |               |  |
|   | ス           | イ<br>ス                     | 百株<br>213.95<br>(－)       |                     | 千スイス・フラン<br>2,305<br>(△8)   |                      | 百株<br>118.44   |              | 千スイス・フラン<br>1,453     |               |  |
|   | デ           | ン<br>マ<br>ー<br>ク           | 百株<br>60.08<br>(－)        |                     | 千デンマーク・クローネ<br>2,430<br>(－) |                      | 百株<br>60.08    |              | 千デンマーク・クローネ<br>1,466  |               |  |
|   | ス           | ウ<br>エ<br>ー<br>デ<br>ン      | 百株<br>－<br>(－)            |                     | 千スウェーデン・クローナ<br>－<br>(－)    |                      | 百株<br>625.42   |              | 千スウェーデン・クローナ<br>9,226 |               |  |
|   | イ           | ン<br>ド                     | 百株<br>－<br>(－)            |                     | 千インド・ルピー<br>－<br>(－)        |                      | 百株<br>690.84   |              | 千インド・ルピー<br>176,512   |               |  |
|   | 韓           | 国                          | 百株<br>9.43<br>(－)         |                     | 千韓国・ウォン<br>657,942<br>(－)   |                      | 百株<br>182.67   |              | 千韓国・ウォン<br>1,660,258  |               |  |
| 国 | ユ<br>ー<br>ロ | オ                          | ラ<br>ン<br>ダ               | 百株<br>94.33<br>(－)  |                             | 千ユーロ<br>624<br>(－)   |                | 百株<br>－      |                       | 千ユーロ<br>－     |  |
|   |             | フ                          | ラ<br>ン<br>ス               | 百株<br>200.84<br>(－) |                             | 千ユーロ<br>1,514<br>(－) |                | 百株<br>169.56 |                       | 千ユーロ<br>2,604 |  |
|   |             | ド                          | イ<br>ツ                    | 百株<br>485.44<br>(－) |                             | 千ユーロ<br>1,215<br>(－) |                | 百株<br>619.89 |                       | 千ユーロ<br>3,976 |  |
|   | ロ           | ス                          | イ<br>ス                    | 百株<br>－<br>(－)      |                             | 千ユーロ<br>－<br>(－)     |                | 百株<br>80.43  |                       | 千ユーロ<br>715   |  |

|     |           |             | 買 付                        |                      | 売 付            |               |
|-----|-----------|-------------|----------------------------|----------------------|----------------|---------------|
|     |           |             | 株 数                        | 金 額                  | 株 数            | 金 額           |
| 外 国 | ユ ー ロ ッ プ | ポ ル ト ガ ル   | 百株<br>306<br>(-)           | 千ユーロ<br>631<br>(-)   | 百株<br>-        | 千ユーロ<br>-     |
|     |           | ス ペ イ ン     | 百株<br>630.85<br>(1,606.34) | 千ユーロ<br>1,154<br>(-) | 百株<br>2,671.66 | 千ユーロ<br>1,904 |
|     |           | イ タ リ ア     | 百株<br>8,021.82<br>(-)      | 千ユーロ<br>1,784<br>(-) | 百株<br>-        | 千ユーロ<br>-     |
|     |           | フ ィ ン ラ ン ド | 百株<br>743.73<br>(-)        | 千ユーロ<br>951<br>(-)   | 百株<br>-        | 千ユーロ<br>-     |
|     |           | オ ー ス ト リ ア | 百株<br>67.98<br>(-)         | 千ユーロ<br>689<br>(-)   | 百株<br>67.98    | 千ユーロ<br>624   |

(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         | 17,123,243千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 7,162,942千円  |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)         | 2.39         |

(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（2025年6月6日から2026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

## (1) 国内株式

| 銘                 | 柄         | 期首(前期末) | 当    | 期   | 末       |
|-------------------|-----------|---------|------|-----|---------|
|                   |           | 株 数     | 株 数  | 評 価 | 額       |
|                   |           | 千株      | 千株   |     | 千円      |
| 非鉄金属 (31.8%)      |           |         |      |     |         |
| 住友電気工業            | —         |         | 6.5  |     | 84,565  |
| 機械 (27.3%)        |           |         |      |     |         |
| 三菱重工業             | —         |         | 19.2 |     | 72,768  |
| その他製品 (24.6%)     |           |         |      |     |         |
| アシックス             | —         |         | 14.8 |     | 65,475  |
| 銀行業 (16.3%)       |           |         |      |     |         |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | —         |         | 13.5 |     | 43,456  |
| 合 計               | 株 数 ・ 金 額 | 千株      | 千株   |     | 千円      |
|                   | 銘柄数<比率>   | —       | 54   |     | 266,264 |
|                   |           | —銘柄     | 4銘柄  |     | <2.9%>  |

(注1) 銘柄欄の（ ）内は、期末の国内株式評価額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

## (2) 外国株式

| 銘                           | 柄      | 期 首(前期末) | 当     |           | 期           | 未 | 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          |   |                         |
| AMAZON.COM INC              |        | 58.71    | 69.67 | 1,768     | 282,975     |   | 大規模小売り                  |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP |        | —        | 13.68 | 412       | 66,067      |   | 情報技術サービス                |
| ADVANCED MICRO DEVICES      |        | —        | 18.5  | 967       | 154,905     |   | 半導体・半導体製造装置             |
| ANALOG DEVICES              |        | —        | 19.55 | 838       | 134,149     |   | 半導体・半導体製造装置             |
| AVERY DENNISON CORP         | 45.13  | —        | —     | —         | —           |   | 容器・包装                   |
| BORGWARNER INC              | —      | —        | 72.58 | 559       | 89,475      |   | 自動車用部品                  |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR SP ADR | 61.22  | 53.98    | 2,401 | 384,364   |             |   | 半導体・半導体製造装置             |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP      | 192.23 | —        | —     | —         | —           |   | ヘルスケア機器・用品              |
| JPMORGAN CHASE & CO         | —      | 30.18    | 938   | 150,160   |             |   | 銀行                      |
| CISCO SYSTEMS INC           | —      | 117.72   | 1,530 | 244,918   |             |   | 通信機器                    |
| CORNING INC                 | —      | 102.16   | 2,019 | 323,233   |             |   | 電子装置・機器・部品              |
| BANK OF AMERICA CORP        | —      | 170.04   | 921   | 147,413   |             |   | 銀行                      |
| EATON CORP PLC              | 11.62  | —        | —     | —         | —           |   | 電気設備                    |
| EMERSON ELECTRIC CO         | 105.78 | 37.76    | 536   | 85,848    |             |   | 電気設備                    |
| GILEAD SCIENCES INC         | —      | 55.35    | 715   | 114,430   |             |   | バイオテクノロジー               |
| MCKESSON CORP               | 8.52   | —        | —     | —         | —           |   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| NVIDIA CORP                 | —      | 145.83   | 3,188 | 510,322   |             |   | 半導体・半導体製造装置             |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC     | —      | 7.72     | 843   | 134,992   |             |   | 資本市場                    |
| INTEL CORP                  | —      | 62.8     | 701   | 112,344   |             |   | 半導体・半導体製造装置             |
| KLA CORPORATION             | —      | 5.19     | 1,106 | 177,010   |             |   | 半導体・半導体製造装置             |
| KROGER CO                   | 81.05  | —        | —     | —         | —           |   | 生活必需品流通・小売り             |
| ELI LILLY & CO              | —      | 7.57     | 851   | 136,326   |             |   | 医薬品                     |
| MERCK & CO.INC.             | —      | 81.48    | 979   | 156,819   |             |   | 医薬品                     |
| MICROSOFT CORP              | —      | 40.83    | 1,747 | 279,706   |             |   | ソフトウェア                  |
| MICRON TECH INC             | —      | 12.24    | 1,219 | 195,105   |             |   | 半導体・半導体製造装置             |
| ROCKWELL AUTOMATION INC     | —      | 17.41    | 804   | 128,793   |             |   | 電気設備                    |

| 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                   |                         |
| CENCORA INC                  |                         | 51.37         | —                | —            | —                    | ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス |
| CHEVRON CORP                 |                         | —             | 49.88            | 939          | 150,355              | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WALMART INC                  |                         | 148.88        | 122.34           | 1,440        | 230,526              | 生活必需品流通・小売り             |
| MASTERCARD INC               |                         | 17.23         | —                | —            | —                    | 金融サービス                  |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  |                         | 66.26         | —                | —            | —                    | タバコ                     |
| XYLEM INC                    |                         | 81.85         | —                | —            | —                    | 機械                      |
| SERVICENOW INC               |                         | 19.27         | —                | —            | —                    | ソフトウェア                  |
| PALO ALTO NETWORKS INC       |                         | 62.92         | —                | —            | —                    | ソフトウェア                  |
| HOWMET AEROSPACE INC         |                         | —             | 22.4             | 558          | 89,382               | 航空宇宙・防衛                 |
| COMPASS GROUP PLC            |                         | —             | 202.62           | 658          | 105,421              | ホテル・レストラン・レジャー          |
| BAKER HUGHES CO              |                         | —             | 38.51            | 254          | 40,744               | エネルギー設備・サービス            |
| BROADCOM INC                 |                         | 31.36         | 41.75            | 1,748        | 279,901              | 半導体・半導体製造装置             |
| ARISTA NETWORKS INC          |                         | —             | 80.56            | 1,337        | 214,033              | 通信機器                    |
| GE VERNOVA INC               |                         | 16.34         | 17.23            | 1,659        | 265,637              | 電気設備                    |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC    |                         | 62.26         | —                | —            | —                    | 電子装置・機器・部品              |
| ALPHABET INC-CL A            |                         | —             | 95               | 3,535        | 565,870              | 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<br>銘 柄 数<比 率> | 1,122<br>18銘柄 | 1,812.53<br>30銘柄 | 37,185<br>—  | 5,951,240<br><64.8%> |                         |
| (カナダ)                        |                         | 百株            | 百株               | 千カナダ・ドル      | 千円                   |                         |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  |                         | —             | 85.99            | 1,303        | 150,022              | 銀行                      |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP |                         | —             | 29.68            | 530          | 61,004               | 金属・鉱業                   |
| DOLLARAMA INC                |                         | 145.33        | 88.59            | 1,558        | 179,313              | 大規模小売り                  |
| WSP GLOBAL INC               |                         | 58.09         | —                | —            | —                    | 建設・土木                   |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | 203.42<br>2銘柄 | 204.26<br>3銘柄    | 3,391<br>—   | 390,340<br><4.3%>    |                         |
| (香港)                         |                         | 百株            | 百株               | 千香港・ドル       | 千円                   |                         |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  |                         | —             | 102              | 4,088        | 83,521               | 資本市場                    |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | —<br>1銘柄      | 102<br>1銘柄       | 4,088<br>—   | 83,521<br><0.9%>     |                         |
| (イギリス)                       |                         | 百株            | 百株               | 千イギリス・ポンド    | 千円                   |                         |
| DIPLOMA PLC                  |                         | —             | 64.43            | 459          | 98,685               | 商社・流通業                  |
| NATIONAL GRID PLC            |                         | —             | 762.41           | 914          | 196,373              | 総合公益事業                  |
| COMPASS GROUP PLC            |                         | 582.82        | —                | —            | —                    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   |                         | —             | 621.65           | 814          | 175,074              | 水道                      |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | 582.82<br>1銘柄 | 1,448.49<br>3銘柄  | 2,188<br>—   | 470,133<br><5.1%>    |                         |
| (スイス)                        |                         | 百株            | 百株               | 千スイス・フラン     | 千円                   |                         |
| NOVARTIS AG-REG SHS          |                         | —             | 47.33            | 548          | 111,139              | 医薬品                     |
| HOLCIM LTD                   |                         | —             | 48.18            | 362          | 73,581               | 建設資材                    |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | —<br>1銘柄      | 95.51<br>2銘柄     | 911<br>—     | 184,721<br><2.0%>    |                         |
| (スウェーデン)                     |                         | 百株            | 百株               | 千スウェーデン・クローナ | 千円                   |                         |
| TELE2 AB-B SHS               |                         | 625.42        | —                | —            | —                    | 無線通信サービス                |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | 625.42<br>1銘柄 | —<br>1銘柄         | —<br>—       | —<br><—%>            |                         |

| 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                                        |                                                          |
| (インド)<br>APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD<br>CIPLA LTD/INDIA                       |                         | 百株<br>125.6<br>565.24                   | 百株<br>—<br>—                                | 千インド・ルピー<br>—<br>—                      | 千円<br>—<br>—                                       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス<br>医薬品                           |
| 小 計                                                                               | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | 690.84<br>2銘柄                           | —<br>—銘柄                                    | —<br>—                                  | —<br><—%>                                          |                                                          |
| (韓国)<br>COWAY CO LTD<br>SK HYNIX INC                                              |                         | 百株<br>182.67<br>—                       | 百株<br>—<br>9.43                             | 千韓国・ウォン<br>—<br>2,167,014               | 千円<br>—<br>225,016                                 | 家庭用耐久財<br>半導体・半導体製造装置                                    |
| 小 計                                                                               | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | 182.67<br>1銘柄                           | 9.43<br>1銘柄                                 | 2,167,014<br>—                          | 225,016<br><2.5%>                                  |                                                          |
| (ユーロ…オランダ)<br>NN GROUP NV                                                         |                         | 百株<br>—                                 | 百株<br>94.33                                 | 千ユーロ<br>671                             | 千円<br>124,795                                      | 保険                                                       |
| 小 計                                                                               | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | —<br>—銘柄                                | 94.33<br>1銘柄                                | 671<br>—                                | 124,795<br><1.4%>                                  |                                                          |
| (ユーロ…フランス)<br>AXA SA<br>DANONE<br>L'OREAL<br>SCHNEIDER ELECTRIC SE<br>HERMES INTL |                         | 百株<br>—<br>181.42<br>—<br>71.57<br>4.69 | 百株<br>179.39<br>55.51<br>16.5<br>37.56<br>— | 千ユーロ<br>707<br>353<br>611<br>1,058<br>— | 千円<br>131,463<br>65,660<br>113,712<br>196,703<br>— | 保険<br>食品<br>パーソナルケア用品<br>電気設備<br>繊維・アパレル・贅沢品             |
| 小 計                                                                               | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | 257.68<br>3銘柄                           | 288.96<br>4銘柄                               | 2,731<br>—                              | 507,540<br><5.5%>                                  |                                                          |
| (ユーロ…ドイツ)<br>DEUTSCHE POST AG-REG<br>SAP SE<br>MTU AERO ENGINES AG<br>SCOUT24 SE  |                         | 百株<br>—<br>40.69<br>30.82<br>132.14     | 百株<br>69.2<br>—<br>—<br>—                   | 千ユーロ<br>361<br>—<br>—<br>—              | 千円<br>67,247<br>—<br>—<br>—                        | 航空貨物・物流サービス<br>ソフトウェア<br>航空宇宙・防衛<br>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<br>銘 柄 数<比 率> | 203.65<br>3銘柄                           | 69.2<br>1銘柄                                 | 361<br>—                                | 67,247<br><0.7%>                                   |                                                          |
| (ユーロ…スイス)<br>DSM-FIRMENICH AG                                                     |                         | 百株<br>80.43                             | 百株<br>—                                     | 千ユーロ<br>—                               | 千円<br>—                                            | 化学                                                       |
| 小 計                                                                               | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | 80.43<br>1銘柄                            | —<br>—銘柄                                    | —<br>—                                  | —<br><—%>                                          |                                                          |
| (ユーロ…ポルトガル)<br>GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS                                        |                         | 百株<br>—                                 | 百株<br>306                                   | 千ユーロ<br>585                             | 千円<br>108,740                                      | 石油・ガス・消耗燃料                                               |
| 小 計                                                                               | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | —<br>—銘柄                                | 306<br>1銘柄                                  | 585<br>—                                | 108,740<br><1.2%>                                  |                                                          |
| (ユーロ…スペイン)<br>IBERDROLA SA<br>ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV<br>BANCO SANTANDER SA   |                         | 百株<br>1,034.16<br>—<br>—                | 百株<br>—<br>38.31<br>561.38                  | 千ユーロ<br>—<br>481<br>602                 | 千円<br>—<br>89,549<br>111,903                       | 電力<br>建設・土木<br>銀行                                        |
| 小 計                                                                               | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数<比 率> | 1,034.16<br>1銘柄                         | 599.69<br>2銘柄                               | 1,084<br>—                              | 201,453<br><2.2%>                                  |                                                          |
| (ユーロ…イタリア)<br>INTESA SANPAOLO<br>LEONARDO SPA                                     |                         | 百株<br>—<br>—                            | 百株<br>1,243.6<br>96.55                      | 千ユーロ<br>707<br>494                      | 千円<br>131,480<br>91,960                            | 銀行<br>航空宇宙・防衛                                            |

| 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 |           |
| (ユーロ…イタリア)         |            | 百株       | 百株        | 千ユーロ                  | 千円        |
| TELECOM ITALIA SPA |            | —        | 6,681.67  | 489                   | 91,003    |
| 小 計                | 株 数 ・ 金 額  | —        | 8,021.82  | 1,692                 | 314,444   |
|                    | 銘 柄 数<比 率> | —銘柄      | 3銘柄       | —                     | <3.4%>    |
| (ユーロ…フィンランド)       |            | 百株       | 百株        | 千ユーロ                  | 千円        |
| NOKIA OYJ          |            | —        | 743.73    | 1,033                 | 192,018   |
| 小 計                | 株 数 ・ 金 額  | —        | 743.73    | 1,033                 | 192,018   |
|                    | 銘 柄 数<比 率> | —銘柄      | 1銘柄       | —                     | <2.1%>    |
| 合 計                | 株 数 ・ 金 額  | 4,983.09 | 13,795.95 | —                     | 8,821,213 |
|                    | 銘 柄 数<比 率> | 33銘柄     | 53銘柄      | —                     | <96.1%>   |

(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

2026年6月5日現在

| 項 目                     | 当 期 末           |           |
|-------------------------|-----------------|-----------|
|                         | 評 価 額           | 比 率       |
| 株 式                     | 千円<br>9,087,478 | %<br>95.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 443,537         | 4.7       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 9,531,015       | 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、8,741,550千円、91.7%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、2026年6月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=160.04円、1カナダ・ドル=115.09円、1オーストラリア・ドル=114.06円、1香港・ドル=20.43円、1シンガポール・ドル=124.54円、1台湾・ドル=5.083円、1イギリス・ポンド=214.82円、1スイス・フラン=202.71円、1デンマーク・クローネ=24.86円、1ノルウェー・クローネ=17.11円、1スウェーデン・クローナ=17.06円、100韓国・ウォン=10.383円、1ユーロ=185.81円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2026年6月5日)現在

| 項 目                | 当 期 末          |
|--------------------|----------------|
| (A) 資 産            | 9,710,016,741円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等    | 199,748,719    |
| 株 式(評価額)           | 9,087,478,245  |
| 未 収 入 金            | 406,662,544    |
| 未 収 配 当 金          | 16,127,233     |
| (B) 負 債            | 526,324,845    |
| 未 払 金              | 526,324,845    |
| (C) 純 資 産 総 額(A－B) | 9,183,691,896  |
| 元 本                | 3,527,289,283  |
| 次 期 繰 越 損 益 金      | 5,656,402,613  |
| (D) 受 益 権 総 口 数    | 3,527,289,283口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)    | 26,036円        |

(注1) 期首元本額 3,072,166,971円  
追加設定元本額 455,122,312円  
一部解約元本額 0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>  
3,527,289,283円  
期末元本合計 3,527,289,283円

■損益の状況

当期 自2025年6月6日 至2026年6月5日

| 項 目                  | 当 期           |
|----------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益        | 118,222,027円  |
| 受 取 配 当 金            | 115,377,630   |
| 受 取 利 息              | 2,843,265     |
| そ の 他 収 益 金          | 1,132         |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益  | 2,170,382,894 |
| 売 買 益                | 3,017,206,140 |
| 売 買 損                | △846,823,246  |
| (C) そ の 他 費 用        | △4,367,007    |
| (D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C) | 2,284,237,914 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金    | 2,825,196,011 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金  | 546,968,688   |
| (G) 合 計(D＋E＋F)       | 5,656,402,613 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G)     | 5,656,402,613 |

(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)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。

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■「一般社団法人投資信託協会」の名称変更に伴い、約款における記載を「一般社団法人資産運用業協会」に変更しました。

(2026年4月1日)