

令和2年7月期（令和2年1月9日～令和2年7月8日）決算短信

令和2年8月20日

ファンド名 One ETF 日経225 上場取引所 東証
 コード番号 1369
 連動対象指標 日経平均株価
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 アセットマネジメントOne株式会社 URL <http://www.am-one.co.jp/>
 代表者名 取締役社長 菅野 暁
 問合せ先責任者 商品開発グループ長 酒井 隆 TEL (03)-6774-5100

有価証券報告書提出予定日 令和2年10月8日
 分配金支払開始日 令和2年8月14日

ファンドの運用状況

1. 令和2年7月期の運用状況(令和2年1月9日～令和2年7月8日)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
令和2年7月期	292,138	(98.9)	3,145	(1.1)	295,284	(100.0)
令和2年1月期	233,831	(98.8)	2,750	(1.2)	236,581	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数()	設定口数()	交換口数()	当計算期間末 発行済口数 (+ -)
	千口	千口	千口	千口
令和2年7月期	10,204	10,099	7,146	13,157
令和2年1月期	13,641	4,489	7,927	10,204

(3) 基準価額

	総資産 ()	負債 ()	純資産 ((-))	1口当たり基準価額 ((/ 当計算期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
令和2年7月期	417,730	122,446	295,284	22,443
令和2年1月期	324,674	88,092	236,581	23,185

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和2年7月期	210
令和2年1月期	219

2. 会計方針の変更

会計基準等の改正に伴う変更 無
 以外の変更 無

財務諸表等

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 令和2年1月8日現在	第11期 令和2年7月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	90,239,568,684	124,810,123,847
株式	233,831,333,490	292,138,466,640
派生商品評価勘定	-	7,014,060
未収配当金	398,320,600	375,856,950
未収利息	4,209,279	7,041,531
前払金	-	102,620,000
その他未収収益	46,492,460	60,643,140
差入委託証拠金	154,080,000	228,810,000
流動資産合計	324,674,004,513	417,730,576,168
資産合計		
	324,674,004,513	417,730,576,168
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	32,458,940	77,530,590
前受金	19,000,000	-
未払金	16,758,660	72,652,220
未払収益分配金	2,234,737,977	2,763,025,650
未払受託者報酬	80,195,019	86,135,233
未払委託者報酬	160,294,193	169,195,053
受入担保金	85,502,864,715	119,230,481,673
その他未払費用	46,070,635	47,231,495
流動負債合計	88,092,380,139	122,446,251,914
負債合計		
	88,092,380,139	122,446,251,914
純資産の部		
元本等		
元本	174,370,787,904	224,831,344,320
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	62,210,836,470	70,452,979,934
(分配準備積立金)	1,822,123	727,592
元本等合計	236,581,624,374	295,284,324,254
純資産合計		
	236,581,624,374	295,284,324,254
負債純資産合計		
	324,674,004,513	417,730,576,168

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 自 令和1年7月9日 至 令和2年1月8日	第11期 自 令和2年1月9日 至 令和2年7月8日
営業収益		
受取配当金	2,292,172,105	2,506,240,567
受取利息	19,942,815	24,861,792
有価証券売買等損益	18,305,869,604	7,258,256,183
派生商品取引等損益	290,840,290	381,021,990
その他収益	230,847,306	560,137,714
営業収益合計	21,139,672,120	3,785,994,120
営業費用		
支払利息	21,199,161	25,579,085
受託者報酬	80,195,019	86,135,233
委託者報酬	160,294,193	169,195,053
その他費用	49,320,109	48,399,583
営業費用合計	311,008,482	329,308,954
営業利益又は営業損失()	20,828,663,638	4,115,303,074
経常利益又は経常損失()	20,828,663,638	4,115,303,074
当期純利益又は当期純損失()	20,828,663,638	4,115,303,074
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額()	-	-
期首剰余金又は期首欠損金()	60,564,935,237	62,210,836,470
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,250,879,108	50,036,159,614
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	27,250,879,108	50,036,159,614
剰余金減少額又は欠損金増加額	44,198,903,536	34,915,687,426
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	44,198,903,536	34,915,687,426
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	2,234,737,977	2,763,025,650
期末剰余金又は期末欠損金()	62,210,836,470	70,452,979,934

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第11期	
	自	至
	令和2年1月9日	令和2年7月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第10期	第11期
	令和2年1月8日現在	令和2年7月8日現在
1. 期首元本額	233,111,915,712円	174,370,787,904円
期中追加設定元本額	76,721,223,936円	172,579,914,240円
期中一部交換元本額	135,462,351,744円	122,119,357,824円
2. 受益権の総数	10,204,283口	13,157,265口
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	81,403,022,460円	111,987,749,370円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期	第11期
	自 令和1年7月9日 至 令和2年1月8日	自 令和2年1月9日 至 令和2年7月8日
1. その他費用	その他費用の内訳は、監査費用(577,556円)、ライセンス料(36,318,598円)、その他(12,423,955円)となっております。	その他費用の内訳は、監査費用(541,450円)、ライセンス料(37,999,920円)、その他(9,858,213円)となっております。
2. 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額(2,521,763,065円)及び分配準備積立金(4,606,356円)の合計額から、経費(289,809,321円)を控除して計算される分配対象額は2,236,560,100円(1口当たり219円)であり、うち2,234,737,977円(1口当たり219円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額(3,065,660,988円)及び分配準備積立金(1,822,123円)の合計額から、経費(303,729,869円)を控除して計算される分配対象額は2,763,753,242円(1口当たり210円)であり、うち2,763,025,650円(1口当たり210円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第10期 自 令和1年7月9日 至 令和2年1月8日	第11期 自 令和2年1月9日 至 令和2年7月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 令和2年1月8日現在	第11期 令和2年7月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 令和2年1月8日現在	第11期 令和2年7月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	11,661,678,311	49,991,393
合計	11,661,678,311	49,991,393

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	第10期 令和2年1月8日現在			
	契約額等(円)	うち	時価(円)	評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	2,764,120,000	-	2,731,700,000	32,420,000
合計	2,764,120,000	-	2,731,700,000	32,420,000

種類	第11期 令和2年7月8日現在			
	契約額等(円)	うち	時価(円)	評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	3,224,640,000	-	3,154,170,000	70,470,000
合計	3,224,640,000	-	3,154,170,000	70,470,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
 2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第10期 令和2年1月8日現在	第11期 令和2年7月8日現在
1口当たり純資産額	23,185円	22,443円