

# 2021年1月期(2020年7月9日~2021年1月8日)決算短信

2021年2月19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 2021年4月8日  
 分配金支払開始日 2021年2月16日

## ファンドの運用状況

### 1. 2021年1月期の運用状況(2020年7月9日~2021年1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	%
2021年1月期	325,840	(98.8)	4,009	(1.2)	329,850	(100.0)
2020年7月期	292,138	(98.9)	3,145	(1.1)	295,284	(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
2021年1月期	13,157	6,639	8,080	11,715
2020年7月期	10,204	10,099	7,146	13,157

#### (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
2021年1月期	401,256	71,406	329,850	28,154
2020年7月期	417,730	122,446	295,284	22,443

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2021年1月期	188
2020年7月期	210

### 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11期 2020年7月8日現在	第12期 2021年1月8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	124,810,123,847	74,322,846,802
株式	292,138,466,640	325,840,569,070
派生商品評価勘定	7,014,060	226,943,140
未収入金	-	132,246,660
未収配当金	375,856,950	317,338,975
未収利息	7,041,531	276,961
前払金	102,620,000	-
その他未収収益	60,643,140	86,505,264
差入委託証拠金	228,810,000	330,000,000
流動資産合計	417,730,576,168	401,256,726,872
資産合計	417,730,576,168	401,256,726,872
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	77,530,590	-
前受金	-	207,150,000
未払金	72,652,220	-
未払収益分配金	2,763,025,650	2,202,559,496
未払受託者報酬	86,135,233	91,420,329
未払委託者報酬	169,195,053	180,121,313
未払利息	-	31,790
受入担保金	119,230,481,673	68,675,088,634
その他未払費用	47,231,495	50,229,882
流動負債合計	122,446,251,914	71,406,601,444
負債合計	122,446,251,914	71,406,601,444
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	224,831,344,320	200,198,599,296
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	70,452,979,934	129,651,526,132
(分配準備積立金)	727,592	3,369,287
元本等合計	295,284,324,254	329,850,125,428
純資産合計	295,284,324,254	329,850,125,428
負債純資産合計	417,730,576,168	401,256,726,872

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 自 2020年1月9日 至 2020年7月8日	第12期 自 2020年7月9日 至 2021年1月8日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	2,506,240,567	2,103,863,419
受取利息	24,861,792	21,034,098
有価証券売買等損益	7,258,256,183	63,880,649,763
派生商品取引等損益	381,021,990	1,202,115,410
その他収益	560,137,714	425,709,142
<b>営業収益合計</b>	<b>3,785,994,120</b>	<b>67,633,371,832</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	25,579,085	21,813,857
受託者報酬	86,135,233	91,420,329
委託者報酬	169,195,053	180,121,313
その他費用	48,399,583	52,049,969
<b>営業費用合計</b>	<b>329,308,954</b>	<b>345,405,468</b>
営業利益又は営業損失( )	4,115,303,074	67,287,966,364
経常利益又は経常損失( )	4,115,303,074	67,287,966,364
当期純利益又は当期純損失( )	4,115,303,074	67,287,966,364
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( )	62,210,836,470	70,452,979,934
剰余金増加額又は欠損金減少額	50,036,159,614	52,802,980,210
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	50,036,159,614	52,802,980,210
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,915,687,426	58,689,840,880
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,915,687,426	58,689,840,880
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	2,763,025,650	2,202,559,496
期末剰余金又は期末欠損金( )	70,452,979,934	129,651,526,132

## (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12期	
	自 2020年7月9日	至 2021年1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11期	第12期
	2020年7月8日現在	2021年1月8日現在
1. 期首元本額	174,370,787,904円	224,831,344,320円
期中追加設定元本額	172,579,914,240円	113,448,804,096円
期中一部交換元本額	122,119,357,824円	138,081,549,120円
2. 受益権の総数	13,157,265口	11,715,742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	111,987,749,370円	68,081,817,370円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期 自 2020年1月9日 至 2020年7月8日	第12期 自 2020年7月9日 至 2021年1月8日
1. その他費用	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。	その他費用の内訳は、監査費用(548,272円)、ライセンス料(40,274,151円)、その他(11,227,546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(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。	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(2,528,792,802円)及び分配準備積立金(727,592円)の合計額から、経費(323,591,611円)を控除して計算される分配対象額は2,205,928,783円(1口当たり188円)であり、うち2,202,559,496円(1口当たり188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11期 自 2020年1月9日 至 2020年7月8日	第12期 自 2020年7月9日 至 2021年1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11期 2020年7月8日現在	第12期 2021年1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11期 2020年7月8日現在	第12期 2021年1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	49,991,393	50,245,498,561
合計	49,991,393	50,245,498,561

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	第11期 2020年7月8日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
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

種類	第12期 2021年1月8日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	3,768,890,000	-	3,995,880,000	226,990,000
合計	3,768,890,000	-	3,995,880,000	226,990,000

## (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11期 2020年7月8日現在	第12期 2021年1月8日現在
1口当たり純資産額	22,443円	28,154円