

令和2年10月期(令和2年4月9日~令和2年10月8日)決算短信

令和2年11月20日

ファンド名 One ETF 高配当日本株 上場取引所 東証
 コード番号 1494
 連動対象指標 S&P/JPX 配当貴族指数
 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3年1月8日
 分配金支払開始日 令和2年11月16日

ファンドの運用状況

1. 令和2年10月期の運用状況(令和2年4月9日~令和2年10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10月期	14,130	(97.6)	340	(2.4)	14,470	(100.0)
令和2年4月期	16,342	(96.3)	626	(3.7)	16,968	(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10月期	1,153	0	270	883
令和2年4月期	668	538	53	1,153

(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10月期	18,965	4,494	14,470	16,387
令和2年4月期	21,527	4,558	16,968	14,709

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和2年10月期	281
令和2年4月期	286

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6期 令和2年4月8日現在	第7期 令和2年10月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,475,271,840	4,534,085,008
株式	16,342,625,000	14,130,253,270
派生商品評価勘定	3,138,740	4,722,530
未収入金	330,620,050	10,995,600
未収配当金	291,576,938	219,279,500
未収利息	196,278	202,138
前払金	2,118,570	1,200,942
その他未収収益	42,805,033	38,844,962
差入委託証拠金	38,940,000	26,250,000
流動資産合計	21,527,292,449	18,965,833,950
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,407,260	15,330
前受金	11,746,000	12,913,800
未払収益分配金	329,944,472	248,148,009
未払受託者報酬	4,194,754	4,867,398
未払委託者報酬	17,960,033	20,483,317
受入担保金	4,189,804,132	4,205,686,526
その他未払費用	2,578,422	2,759,374
流動負債合計	4,558,635,073	4,494,873,754
負債合計		
	4,558,635,073	4,494,873,754
純資産の部		
元本等		
元本	20,718,436,268	15,859,395,351
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,749,778,892	1,388,435,155
(分配準備積立金)	897,823	483,583
元本等合計	16,968,657,376	14,470,960,196
純資産合計		
	16,968,657,376	14,470,960,196
負債純資産合計		
	21,527,292,449	18,965,833,950

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期 自 令和1年10月9日 至 令和2年4月8日	第7期 自 令和2年4月9日 至 令和2年10月8日
営業収益		
受取配当金	311,666,238	238,828,850
受取利息	837,745	1,331,928
有価証券売買等損益	1,520,914,545	1,720,260,300
派生商品取引等損益	41,278,970	89,231,240
その他収益	46,309,473	40,268,118
営業収益合計	1,203,380,059	2,089,920,436
営業費用		
支払利息	911,893	1,444,570
受託者報酬	4,194,754	4,867,398
委託者報酬	17,960,033	20,483,317
その他費用	5,309,772	5,899,842
営業費用合計	28,376,452	32,695,127
営業利益又は営業損失()	1,231,756,511	2,057,225,309
経常利益又は経常損失()	1,231,756,511	2,057,225,309
当期純利益又は当期純損失()	1,231,756,511	2,057,225,309
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()	764,802,938	3,749,778,892
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	552,266,437
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	552,266,437
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,423,274,971	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	18,563,992	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,404,710,979	-
分配金	329,944,472	248,148,009
期末剰余金又は期末欠損金()	3,749,778,892	1,388,435,155

(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7期	
	自 令和2年4月9日 至 令和2年10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6期	第7期
	令和2年4月8日現在	令和2年10月8日現在
1. 期首元本額	12,007,459,236円	20,718,436,268円
期中追加設定元本額	9,673,974,530円	- 円
期中一部交換元本額	962,997,498円	4,859,040,917円
2. 受益権の総数	1,153,652口	883,089口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,749,778,892円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,388,435,155円であります。
4. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	4,077,671,050円	4,015,717,990円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期	第7期
	自 令和1年10月9日 至 令和2年4月8日	自 令和2年4月9日 至 令和2年10月8日
1. その他費用	その他費用の内訳は、監査費用(70,598円)、ライセンス料(4,160,178円)、その他(1,078,996円)となっております。	その他費用の内訳は、監査費用(77,954円)、ライセンス料(4,745,754円)、その他(1,076,134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(357,901,563円)及び分配準備積立金(405,291円)の合	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(278,984,326円)及び分配準備積立金(897,823円)の合

	計額から、経費(27,464,559円)を控除して計算される分配対象額は330,842,295円(1口当たり286円)であり、うち329,944,472円(1口当たり286円)を分配金額としております。	計額から、経費(31,250,557円)を控除して計算される分配対象額は248,631,592円(1口当たり281円)であり、うち248,148,009円(1口当たり281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6期	第7期
	自 令和1年10月9日 至 令和2年4月8日	自 令和2年4月9日 至 令和2年10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6期	第7期
	令和2年4月8日現在	令和2年10月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその	貸借対照表上の金融商品は原則とし	同左

差額	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。	
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6期 令和2年4月8日現在	第7期 令和2年10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	1,562,841,930	1,132,624,262
合計	1,562,841,930	1,132,624,262

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	第6期 令和2年4月8日現在		
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)
市場取引			

先物取引 買建	612,834,000	-	613,580,000	746,000
合計	612,834,000	-	613,580,000	746,000

種類	第7期 令和2年10月8日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	326,386,200	-	331,100,000	4,713,800
合計	326,386,200	-	331,100,000	4,713,800

(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6期 令和2年4月8日現在	第7期 令和2年10月8日現在
	1口当たり純資産額	14,709円