

運用報告書 (全体版)

第17期<決算日2017年8月29日>

D I A M国内株オープン

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／国内／株式
信託期間	2000年8月30日から無期限です。
運用方針	マクロの投資環境の変化に応じて、その時々で最適と判断される投資スタイルで運用を行います。
主要投資対象	わが国の上場株式を主要投資対象とします。
運用方法	「東証株価指数 (TOPIX)」を運用に当たってのベンチマークとし、ベンチマークを上回る投資効果をめざします。通貨動向、市場関係指標、景気指標等の調査に基づき、マクロ投資環境を見極めます。投資環境の変化に応じて、成長系 (グロース系)、割安系 (バリュ系)、大型、中小型といった視点等から、その時々で最適と思われる投資スタイルを採用します。個別銘柄の選択は、利益成長、資本効率、キャッシュフローベースの企業価値等の視点から、成長力および割安性その他の要因を見極めて行います。
組入制限	株式への投資には、制限を設けません。
分配方針	決算日 (原則として8月29日。休業日の場合は翌営業日。) に、配当収入および売買益 (評価益を含みます。) 等については信託財産に留保することを基本としつつ、市場金利水準、市況動向、基準価額水準等を勘案した上で、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。

愛称：自由演技

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、「D I A M国内株オープン」は、2017年8月29日に第17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/>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			東証株価指数 (TOPIX) (ベンチマーク)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	(分配落)	税金 分配	み 金 騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
13期 (2013年8月29日)	円 8,771	円 0	% 55.7	ポイント 1,116.51	% 48.9	% 86.7	% 7.0	百万円 1,588
14期 (2014年8月29日)	10,973	0	25.1	1,277.97	14.5	93.6	4.1	1,570
15期 (2015年8月31日)	14,195	0	29.4	1,537.05	20.3	87.9	7.9	3,089
16期 (2016年8月29日)	14,387	0	1.4	1,313.24	△14.6	95.5	3.9	2,699
17期 (2017年8月29日)	19,857	0	38.0	1,597.76	21.7	92.4	6.5	21,048

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (㈩東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、(㈩東京証券取引所) が有しています。なお、本商品は、(㈩東京証券取引所) により提供、保証又は販売されるものではなく、(㈩東京証券取引所) は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

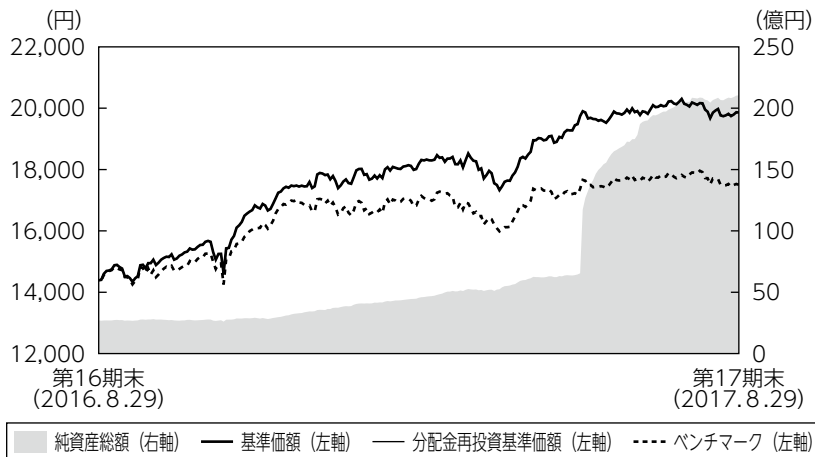
年月日	基準価額		東証株価指数 (TOPIX) (ベンチマーク)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2016年8月29日	円 14,387	% -	ポイント 1,313.24	% -	% 95.5	% 3.9
8月末	14,601	1.5	1,329.54	1.2	96.2	3.0
9月末	14,887	3.5	1,322.78	0.7	96.0	2.9
10月末	15,673	8.9	1,393.02	6.1	97.0	1.0
11月末	16,731	16.3	1,469.43	11.9	99.3	-
12月末	17,451	21.3	1,518.61	15.6	90.8	7.0
2017年1月末	17,826	23.9	1,521.67	15.9	89.7	8.6
2月末	18,015	25.2	1,535.32	16.9	92.3	3.8
3月末	18,288	27.1	1,512.60	15.2	96.2	-
4月末	18,360	27.6	1,531.80	16.6	92.7	4.1
5月末	19,480	35.4	1,568.37	19.4	94.9	3.9
6月末	19,871	38.1	1,611.90	22.7	79.1	19.8
7月末	20,111	39.8	1,618.61	23.3	83.7	15.4
(期末) 2017年8月29日	19,857	38.0	1,597.76	21.7	92.4	6.5

(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（2016年8月30日から2017年8月29日まで）

基準価額等の推移



第17期首： 14,387円
第17期末： 19,857円
(既払分配金0円)
騰落率： 38.0%
(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利用するコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2016年11月の米国大統領選挙で、共和党代表のドナルド・トランプ氏が次期大統領に決まると、新政権の政策への期待が高まり、世界的に株高基調になったことや、為替が円安に推移し、外需関連企業の業績に追い風になったことから、国内株式市場全体が上昇しました。加えて、組入れていた独自の成長力を持つ企業の株価が上昇したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は上昇しました。2016年11月の米国大統領選挙で、共和党代表のドナルド・トランプ氏が次期大統領に決まると、新政権の政策への期待が高まり、米国株式市場が上昇し、国内株式市場も連れて上昇しました。為替市場でもドル高・円安が進んだことが、株価上昇のサポート要因になりました。その一方で、北朝鮮によるミサイル発射実験は地政学リスクとして煽り続け、一時的に株式市場の下押し要因となりました。

ポートフォリオについて

期初は、大型割安銘柄の組入比率を引き上げておりましたが、2016年9月以降は、大型株から中小型株への入れ替えを行い、超過収益の獲得に努めました。株式市場が大きく上昇した12月以降は、中小型株の組入比率をさらに引き上げましたが、年明け後に中小型株の株価が一貫して堅調に推移したことから、2017年4月以降は徐々に中小型株から大型株への入れ替えを行いました。

【運用状況】 (注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

○組入上位10業種

期首 (前期末)

No.	業種	組入比率
1	電気機器	15.3%
2	情報・通信業	13.1
3	輸送用機器	8.2
4	銀行業	6.9
5	化学	5.1
6	卸売業	4.5
7	サービス業	3.6
8	その他製品	3.4
9	陸運業	3.2
10	医薬品	3.0



期末

No.	業種	組入比率
1	電気機器	16.6%
2	情報・通信業	12.7
3	機械	5.8
4	輸送用機器	5.1
5	銀行業	5.0
6	化学	4.9
7	サービス業	4.6
8	建設業	4.2
9	卸売業	3.9
10	精密機器	3.2

○組入上位10銘柄

期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.6%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.8
3	日本電信電話	日本・円	2.3
4	オリックス	日本・円	2.1
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	2.0
6	ソニー	日本・円	1.9
7	ソフトバンクグループ	日本・円	1.8
8	三菱商事	日本・円	1.8
9	三菱電機	日本・円	1.8
10	KDDI	日本・円	1.7
組入銘柄数		126銘柄	



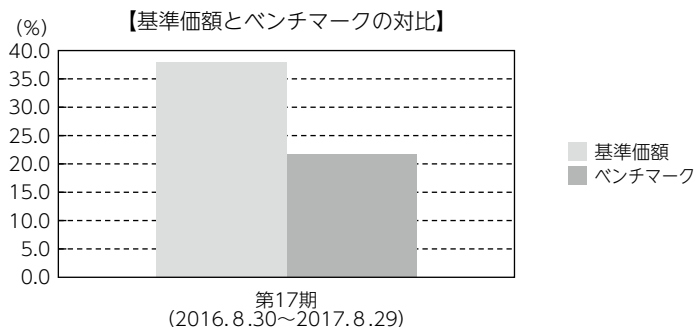
期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.4%
2	トヨタ自動車	日本・円	2.3
3	日本電信電話	日本・円	2.0
4	ソフトバンクグループ	日本・円	1.7
5	安藤・間	日本・円	1.6
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.6
7	SRAホールディングス	日本・円	1.6
8	ソニー	日本・円	1.4
9	オリックス	日本・円	1.2
10	日本たばこ産業	日本・円	1.2
組入銘柄数		153銘柄	

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で21.7%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを16.4%上回りました。好調な株式市場を背景に底堅い推移をした「三菱UFJフィナンシャル・グループ」や「ソフトバンクグループ」などの大型株のほか、中小型株では、スマートフォンアプリの開発に対して期待が広がった「イグニス」、「エムアップ」のほか、デリバリー総合ウェブサイトを運営する「夢の街創造委員会」、製造業派遣・請負の「UTグループ」等の上昇がプラスに寄与しました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、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
	2016年8月30日 ～2017年8月29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	9,857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

引き続きマクロの投資環境の変化に応じて、投資スタイルを適宜変更します。業績拡大期待の高い銘柄や、収益性、資産価値、配当を含む株主還元姿勢の面から見て株価バリュエーションが割安な銘柄の組入比率を高めていく方針です。大型株・小型株の組入比率、バリュー（割安）株・グロース（成長）株の組入比率も、相場環境を見ながら柔軟に比率を変更していく方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第17期 (2016年8月30日 ～2017年8月29日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	308円	
(投信会社)	(147)	(0.824)	
(販売会社)	(147)	(0.824)	
(受託銀行)	(14)	(0.081)	
(b) 売買委託手数料	69	0.386	(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)	(67)	(0.377)	
(先物・オプション)	(2)	(0.008)	
(c) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.003 (0.003)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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
合計	377	2.116	

(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。

(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。

■ 売買及び取引の状況（2016年8月30日から2017年8月29日まで）

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		14,472.2 (116.6)	23,931,078 (-)	5,640.4	8,333,162

(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。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		13,667	12,492	-	-

(注) 金額は受渡代金です。

■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	32,264,241千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,783,894千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	5.57

(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 (2016年8月30日から2017年8月29日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 23,931	百万円 7,052	% 29.5	百万円 8,333	百万円 2,033	% 24.4

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 -	百万円 -	百万円 31

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 47

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	24,256千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	5,027千円
(B)／(A)	20.7%

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループです。

■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	評 価 額
	千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.5%)				
日本水産	—	160	97,280	
鉱業 (0.6%)				
国際石油開発帝石	—	120	126,000	
建設業 (4.6%)				
安藤・間	—	440	344,080	
コムシスホールディングス	—	50	112,950	
鹿島建設	22	—	—	
西松建設	25	—	—	
田辺工業	—	62	64,170	
大和ハウス工業	10	—	—	
積水ハウス	—	110	206,085	
中電工	9	—	—	
日揮	—	95	163,020	
食料品 (2.1%)				
アサヒグループホールディングス	—	33.4	156,646	
不二製油グループ本社	6	—	—	
ニチレイ	20	—	—	
日本たばこ産業	9.7	70	259,910	
繊維製品 (—%)				
東レ	24	—	—	
化学 (5.4%)				
住友化学	—	220	145,860	
トクヤマ	30	—	—	
関東電化工業	—	100	105,300	
信越化学工業	1.8	19	182,818	
第一稀元素化学工業	1.1	—	—	
東京応化工業	—	30	115,650	
三菱ケミカルホールディングス	25	—	—	
KHネオケム	—	20	57,580	
日立化成	10.5	—	—	
大倉工業	40	—	—	
ロンシール工業	—	18	44,280	
日油	—	60	92,580	
花王	2.5	32	215,840	
日本特殊塗料	—	45	81,000	
富士フィルムホールディングス	6.8	—	—	
J S P	8	—	—	
医薬品 (2.3%)				
武田薬品工業	2.5	25	149,350	
アステラス製薬	18.5	—	—	
中外製薬	—	27	115,290	
小野薬品工業	5	—	—	
アンジェス	—	30	20,040	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
第一三共	—	70	167,650	
大塚ホールディングス	6	—	—	
石油・石炭製品 (0.6%)				
J X T Gホールディングス	72	218	117,632	
ゴム製品 (1.0%)				
ブリヂストン	3.5	41	192,044	
ガラス・土石製品 (1.2%)				
日本碍子	—	60.5	121,847	
MARUWA	—	20	112,000	
鉄鋼 (0.5%)				
ジェイ エフ イー ホールディングス	—	50	104,050	
日新製鋼	10	—	—	
非鉄金属 (2.2%)				
三井金属鉱業	—	142	81,508	
住友金属鉱山	16	75	143,475	
DOWAホールディングス	20	—	—	
U A C J	40	—	—	
古河電気工業	—	10	59,300	
住友電気工業	17	—	—	
タツタ電線	—	150	107,550	
平河ヒューテック	—	24	36,144	
金属製品 (0.2%)				
東洋製罐グループホールディングス	12	—	—	
中西製作所	—	36	46,584	
機械 (6.3%)				
日本製鋼所	—	50	109,450	
ツガミ	—	100	88,800	
S M C	—	3.8	141,550	
小松製作所	10	47	138,274	
クボタ	9	50	94,775	
ダイキン工業	4.1	15.6	169,026	
ダイフク	—	30	150,300	
加藤製作所	—	37	125,245	
竹内製作所	—	65	129,480	
J U K I	—	50	76,000	
電気機器 (18.0%)				
日立製作所	52	310	224,440	
三菱電機	37	140	226,870	
マブチモーター	—	20	103,000	
日本電産	3.6	15.6	195,624	
トレックス・セミコンダクター	—	60	103,620	
東光高岳	10	—	—	
ダブル・スコープ	—	25.7	58,750	
ダイヘン	30	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メルコホールディングス	6	—	—
富士通	20	190	151,050
アルパック	—	10	58,900
パナソニック	12	110	159,170
日立国際電気	6	—	—
ソニー	15.6	72	302,400
TDK	2.4	—	—
アルプス電気	—	40	119,200
メイコー	30	—	—
ホシデン	—	53	95,082
日立マクセル	—	50	125,700
新電元工業	—	300	202,500
堀場製作所	4	14.5	95,120
アドバンテスト	6	—	—
キーエンス	0.4	3.3	186,483
シスメックス	1.9	—	—
フェローテックホールディングス	9	—	—
レーザーテック	—	40	81,080
スタンレー電気	—	30	109,500
ファナック	—	4.5	94,725
大真空	—	60	109,560
ローム	—	18	155,700
京セラ	—	24	157,008
村田製作所	2.9	11.7	194,629
SCREENホールディングス	8	—	—
キヤノン	3	50	190,000
象印マホービン	4	—	—
輸送用機器 (5.5%)			
デンソー	3.3	—	—
日産自動車	22.5	158	171,509
トヨタ自動車	15.7	80	487,200
エフテック	—	26	44,486
東京ラヂエーター製造	—	19	19,513
本田技研工業	11.3	45.3	137,712
スズキ	9	—	—
SUBARU	5.6	21.6	82,792
ヤマハ発動機	—	43	133,085
精密機器 (3.5%)			
テルモ	—	30	126,900
島津製作所	—	40	79,360
ニコン	—	50	90,000
オリンパス	6	29	110,200
HOYA	—	28	174,720
朝日インテック	1.2	—	—
ニプロ	20	67.5	98,617
その他製品 (2.5%)			
パンダイナムコホールディングス	7	40	146,800

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タカラトミー	15	54	79,272
日本写真印刷	—	20	59,760
イトーキ	60.1	—	—
任天堂	0.4	5.6	204,400
グローブライド	8	—	—
電気・ガス業 (1.0%)			
東京電力ホールディングス	30	—	—
中部電力	12	—	—
関西電力	—	100	152,650
イーレックス	4	47	48,457
陸運業 (2.5%)			
東日本旅客鉄道	3.8	20	200,900
西日本旅客鉄道	3.8	10	79,180
東海旅客鉄道	1	11	201,135
西日本鉄道	18	—	—
C&Fロジホールディングス	6	—	—
海運業 (0.5%)			
日本郵船	—	420	89,880
川崎汽船	50	—	—
空運業 (0.6%)			
ANAホールディングス	—	270	108,648
スターフライヤー	3	—	—
情報・通信業 (13.7%)			
デジタルアーツ	7	—	—
夢の街創造委員会	14	—	—
T I S	—	25	80,250
K L a b	—	55	123,750
ネクソン	—	40	108,000
アイスタイル	15	—	—
エムアップ	—	25	37,050
エニグモ	6	30	51,270
ハーツユナイテッドグループ	3.5	—	—
ディー・エル・イー	7.5	—	—
イグニス	—	8	28,280
C R I ・ミドルウェア	2	—	—
GMOペイメントゲートウェイ	—	8.3	59,511
S R Aホールディングス	—	115	328,670
g u m i	15	40	49,000
マクロミル	—	20	48,240
ビーグリー	—	69.7	127,202
UUUM	—	2.4	4,920
インフォコム	13	40	107,920
フジ・メディア・ホールディングス	—	80	127,440
デジタルガレージ	9.5	48.5	106,603
アルゴグラフィックス	—	20	57,760
日本電信電話	13.5	78	417,924
K D D I	14.4	54	159,462

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
NTTドコモ	5	—	—
エムティーアイ	11	—	—
アйдママーケティングコミュニケーション	—	41	27,757
カドカワ	—	40	52,240
カプコン	10.5	36	99,648
日本システムウエア	—	46	101,798
福井コンピュータホールディングス	4.5	—	—
ミロク情報サービス	8	—	—
ソフトバンクグループ	7.3	42	366,828
卸売業 (4.2%)			
ラクーン	—	145	96,280
伊藤忠商事	—	110	192,610
三井物産	15	44	70,730
日立ハイテクノロジーズ	3.5	—	—
住友商事	10	73	110,814
三菱商事	23.2	80	202,120
リョーサン	8.5	—	—
新光商事	—	80	149,360
小売業 (2.5%)			
ビックカメラ	—	80	106,240
セブン&アイ・ホールディングス	8.8	45	195,705
ベガコーポレーション	3	—	—
デファクトスタンダード	2.9	—	—
LIXILビバ	—	54	106,380
ニトリホールディングス	—	5	85,850
ファーストリテイリング	0.5	—	—
銀行業 (5.4%)			
ゆうちょ銀行	—	130	178,880
三菱UFJフィナンシャル・グループ	141.4	760	498,788
りそなホールディングス	60	—	—
三井住友フィナンシャルグループ	15.7	85	342,550
みずほフィナンシャルグループ	170	170	31,875
証券、商品先物取引業 (—%)			
大和証券グループ本社	20	—	—
保険業 (2.8%)			
SOMPOホールディングス	4	43	174,924
アニコム ホールディングス	—	40	116,320
第一生命ホールディングス	18	74	129,463
東京海上ホールディングス	8.5	30	130,410
その他金融業 (2.1%)			
ジャックス	—	280	152,040
オリックス	39.5	150	262,125
不動産業 (2.4%)			
日本商業開発	—	53.5	91,378
プレサンスコーポレーション	3	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニゾホールディングス	—	49	124,215
ハウスドゥ	6.5	—	—
三井不動産	10	44	103,334
三菱地所	12	36	67,464
レオパレス21	14	—	—
シノケングループ	—	32	79,392
サービス業 (5.0%)			
夢真ホールディングス	15	—	—
オプトホールディング	—	20	25,020
ウェルネット	11	—	—
ディー・エヌ・エー	3.9	43	102,383
博報堂D.Y.ホールディングス	12	—	—
ぐるなび	3	—	—
ティア	—	48	40,944
ユナイテッド	—	15	41,190
E.P.S.ホールディングス	10	—	—
セプテーニ・ホールディングス	6.5	—	—
クイック	—	39	62,946
サニックス	—	350	114,800
オリエンタルランド	—	8	65,800
デザインワン・ジャパン	—	33	41,052
ベクトル	9	—	—
ライクキッズネクスト	—	21	34,860
リクルートホールディングス	—	51	111,792
メタップス	—	16	50,880
日本郵政	—	150	201,600
グレイステクノロジー	—	6	33,600
セコム	—	6	47,874
合 計	株 数 ・ 金 額	千株	千株
	銘柄数 < 比率 >	1,912.6	10,861
		126銘柄	153銘柄
			<92.4%>

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総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) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
T O P I X	1,358	—

■投資信託財産の構成

2017年8月29日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	19,441,214	90.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,987,261	9.3
投 資 信 託 財 産 総 額	21,428,475	100.0

(注) 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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年8月29日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	21,425,493,343円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,754,352,216
株 式(評価額)	19,441,214,300
未 収 入 金	166,037,027
未 収 配 当 金	19,019,800
差 入 委 託 証 拠 金	44,870,000
(B) 負 債	376,517,341
未 払 金	206,030,236
未 払 解 約 金	68,489,696
未 払 信 託 報 酬	101,870,153
そ の 他 未 払 費 用	127,256
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	21,048,976,002
元 本	10,600,057,033
次 期 繰 越 損 益 金	10,448,918,969
(D) 受 益 権 総 口 数	10,600,057,033口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	19,857円

(注) 期首における元本額は1,876,436,560円、当期中における追加設定元本額は11,059,803,884円、同解約元本額は2,336,183,411円です。

■損益の状況

当期 自2016年8月30日 至2017年8月29日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	69,977,745円
受 取 配 当 金	71,029,212
受 取 利 息	67
そ の 他 収 益	124,481
支 払 利 息	△1,176,015
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	944,878,428
売 買 損 益	1,794,086,551
買 入 損 益	△849,208,123
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	66,003,930
取 引 損 益	108,349,652
取 引 損 益	△42,345,722
(D) 信 託 報 酬 等	△129,861,990
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	950,998,113
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	184,337,159
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,313,583,697
(配 当 等 相 当 額)	(6,290,798,528)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,022,785,169)
(H) 合 計(E+F+G)	10,448,918,969
次 期 繰 越 損 益 金(H)	10,448,918,969
追 加 信 託 差 損 益 金	9,313,583,697
(配 当 等 相 当 額)	(6,290,798,528)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,022,785,169)
分 配 準 備 積 立 金	1,135,335,272

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (D)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) (G)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	61,575,674円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	889,422,439
(c) 収 益 調 整 金	9,313,583,697
(d) 分 配 準 備 積 立 金	184,337,159
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	10,448,918,969
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	9,857.42
(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運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

■D I AMアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。なお、当該統合に伴い、ファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。

■委託会社の統合により、約款に所要の変更を行いました。

(平成28年10月1日)