

運用報告書 (全体版)

第17期<決算日2021年1月15日>

きらめきジャパン

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 | 2004年2月10日から2024年1月15日までです。 | |
| 運用方針 | 中長期で信託財産の成長をはかることを目標として積極的な運用を行います。 | |
| 主要投資対象 | きらめきジャパン | DIAM日本株オープン・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | DIAM日本株オープン・マザーファンド | わが国の株式を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | マザーファンドにおいては、景気動向、金融情勢、海外情勢等の調査に基づいた相場環境分析による相場想定(トップダウン・アプローチ)により、株価の値上がり期待が高いと考えられる銘柄を厳選して組入れます。株式全体の組入比率は、0%から100%の範囲で弾力的に調整します。株式の実質組入比率を調整するため、株価指数先物取引やオプション取引の利用を行うことがあります。株式の組入比率が50%をきる場合には、短期国債等を組入れることで有価証券の組入比率を50%以上に維持します。外貨建資産への投資は行いません。 | |
| 組入制限 | 株式への実質投資割合には、制限を設けません。マザーファンド受益証券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1月15日。休業日の場合は翌営業日。)に、経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)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ことがあります。 | |

愛称：きらめき

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、「きらめきジャパン」は、2021年1月15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 (分配落) | 基準価額 | | | 株式組入率 比 | 株式先物率 比 | 純資産額 |
|------------------|---------------|------|--------|-----------|------------|------------|--------------|
| | | 税分 | 込配 | み金 騰落率 | | | |
| 13期 (2017年1月16日) | 円 23,996 | | 円 0 | % 14.0 | % 93.8 | % - | 百万円 1,276 |
| 14期 (2018年1月15日) | 30,084 | | 0 | 25.4 | 96.1 | 1.4 | 1,374 |
| 15期 (2019年1月15日) | 25,142 | | 0 | △16.4 | 85.9 | 7.2 | 1,072 |
| 16期 (2020年1月15日) | 28,359 | | 0 | 12.8 | 95.5 | 3.4 | 1,025 |
| 17期 (2021年1月15日) | 35,061 | | 0 | 23.6 | 96.5 | 1.6 | 1,143 |

(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) 当ファンドは、少数銘柄に絞り、実質組入比率を弾力的に調整する積極運用を行うため、特定のベンチマークは設けません。

(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

| 年月日 | 基準価額 | 基準価額 | | | 株式組入率 比 | 株式先物率 比 |
|--------------------|-------------|-------|--------|-----------|------------|------------|
| | | 騰 | 落 | 率 | | |
| (期首) 2020年1月15日 | 円 28,359 | | % - | % 95.5 | % 3.4 | |
| 1月 末 | 27,133 | △4.3 | | 94.6 | △5.2 | |
| 2月 末 | 23,853 | △15.9 | | 93.3 | △3.5 | |
| 3月 末 | 23,174 | △18.3 | | 92.3 | - | |
| 4月 末 | 25,005 | △11.8 | | 93.2 | 4.9 | |
| 5月 末 | 27,063 | △4.6 | | 97.4 | △1.6 | |
| 6月 末 | 27,955 | △1.4 | | 95.2 | - | |
| 7月 末 | 27,750 | △2.1 | | 93.1 | - | |
| 8月 末 | 29,638 | 4.5 | | 96.2 | 3.2 | |
| 9月 末 | 30,325 | 6.9 | | 95.0 | 3.2 | |
| 10月 末 | 29,966 | 5.7 | | 96.2 | - | |
| 11月 末 | 32,935 | 16.1 | | 97.7 | - | |
| 12月 末 | 33,761 | 19.0 | | 97.7 | - | |
| (期末) 2021年1月15日 | 35,061 | 23.6 | | 96.5 | 1.6 | |

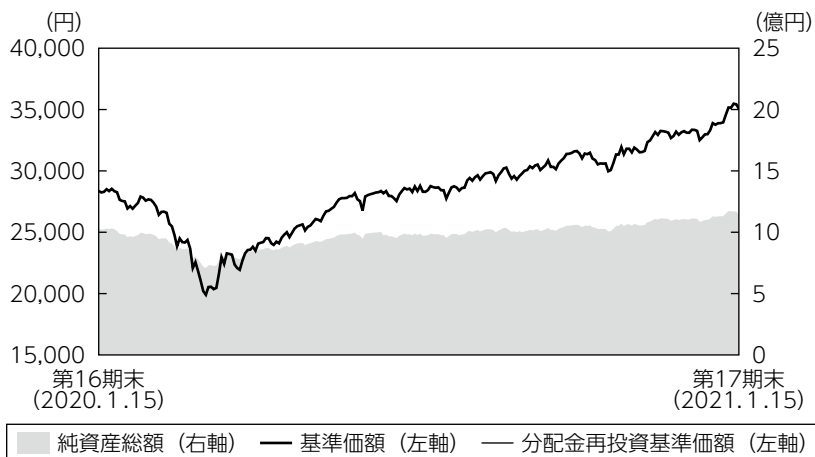
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2020年1月16日から2021年1月15日まで）

基準価額等の推移



第17期首：28,359円
第17期末：35,061円
(既払分配金0円)
騰落率：23.6%
(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

新型コロナウイルスの感染拡大による急激な経済の落ち込みに対し、主要国が財政・金融の政策対応を総動員して支えたことを背景に国内株式市場が上昇したことに加え、市場動向を踏まえたグロース株や中小型株への投資が奏功したことなどから、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。前期末から2020年3月にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて、急落しました。その後、10月にかけては、主要国による大規模な財政支出や金融緩和に支えられ、回復基調となりました。11月から当期末にかけては、新型コロナウイルスワクチン開発の進展を受けて景気回復期待が高まり、上昇基調が強まりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

D I AM日本株オープン・マザーファンドの組入比率は原則として高位に維持するよう運用しました。

●D I AM日本株オープン・マザーファンド

市場動向の変化に応じて機動的な運用を行いました。構成銘柄は、過剰流動性相場となったことを背景に、業績成長の確度の高いグロース株、並びに個別の成長要因を有する中小型株の比率を高めた構成を基本としながらも、2020年11月以降の景気回復期待が高まる局面では、大型株や景気敏感株などのバリュー株の比率を引き上げました。株式組入比率は、高位を基本としつつ、相場局面に応じて引き下げを行うことで市場全体の下落に備える対応を行いました。

※運用状況については13～14ページをご参照ください。

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 |
|------------|---------------------------|
| | 2020年1月16日 ～2021年1月15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 | 25,060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

引き続き、D I AM日本株オープン・マザーファンドを高位に組入れ、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。

●D I AM日本株オープン・マザーファンド

当面の国内株式市場は、堅調な展開を予想します。主要国の中央銀行による大規模な金融緩和政策が市場を支える構図が継続し、世界経済も緩やかに回復すると想定しています。運用方針としては、各国の政策動向や世界経済の回復状況などを注視しつつ、株式組入比率、組入銘柄共に柔軟に調整する方針で臨みます。

■ 1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第17期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------------------------|---------|--|
| | (2020年1月16日 ～2021年1月15日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 498円 | 1.752% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は28,447円です。 |
| (投信会社) | (234) | (0.821) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 |
| (販売会社) | (234) | (0.821) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| (受託会社) | (31) | (0.109) | 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 | 42 | 0.147 | (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) | (41) | (0.143) | |
| (先物・オプション) | (1) | (0.004) | |
| (c) その他費用 | 0 | 0.002 | (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) | (0) | (0.002) | 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 | 541 | 1.901 | |

(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せん。

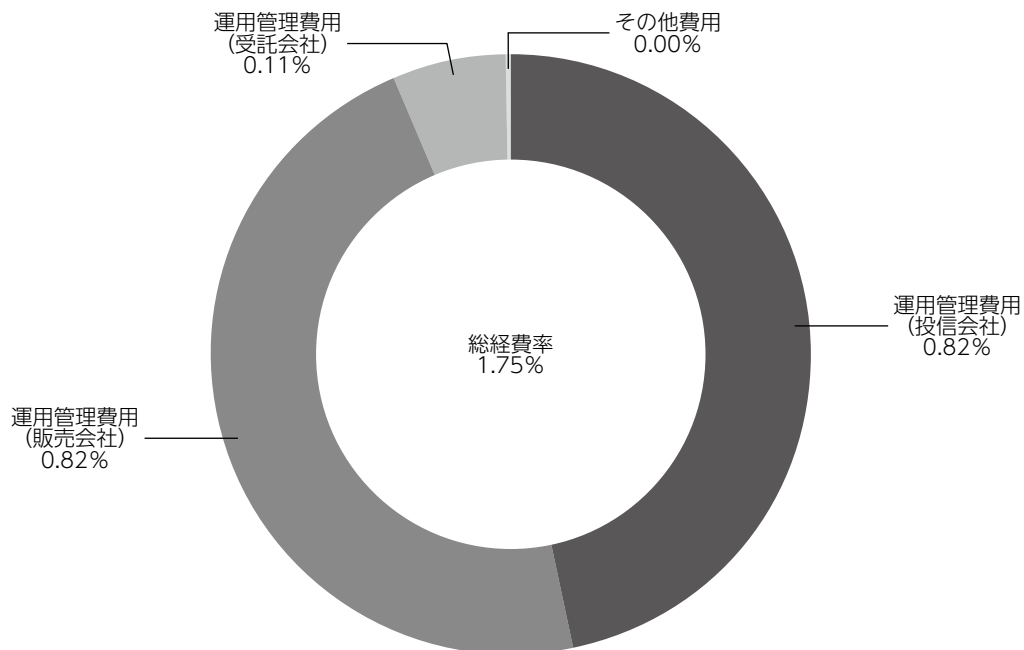
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.75%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（2020年1月16日から2021年1月15日まで）

| | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------------------------|-------------|-------------|--------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| D I A M 日 本 株 オープン・マザーファンド | 千□ 1,297 | 千円 7,770 | 千□ 17,649 | 千円 110,880 |

■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 | D I A M 日 本 株 オープン・マザーファンド |
|-------------------------------|----------------------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 2,634,788千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 927,446千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b) | 2.84 |

(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（2020年1月16日から2021年1月15日まで）

【きらめきジャパンにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 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) | 1,450千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 590千円 |
| (B) / (A) | 40.7% |

(注) 売買委託手数料総額は、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。

【D I A M日本株オープン・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(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 1,271 | 百万円 566 | % 44.5 | 百万円 1,363 | 百万円 508 | % 37.3 |

平均保有割合 100.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 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 23 |

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 |
| D I A M日本株オープン・マザーファンド | 千□ 169,215 | 千□ 152,862 | 千円 1,155,750 |

■投資信託財産の構成

2021年1月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| D I A M日本株オープン・マザーファンド | 1,155,750 | 98.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 22,433 | 1.9 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,178,184 | 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

(2021年1月15日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,178,184,261円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 22,433,476 |
| D I A M日本株オープン・マザーファンド(評価額) | 1,155,750,785 |
| (B) 負 債 | 34,769,739 |
| 未 払 解 約 金 | 25,505,137 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 9,256,425 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 8,177 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 1,143,414,522 |
| 元 本 | 326,122,078 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 817,292,444 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 326,122,078口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D) | 35,061円 |

(注) 期首における元本額は361,620,490円、当期中における追加設定元本額は291,588円、同解約元本額は35,790,000円です。

■損益の状況

当期 自2020年1月16日 至2021年1月15日

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △1,693円 |
| 受 取 利 息 | 107 |
| 支 払 利 息 | △1,800 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 235,814,783 |
| 売 買 損 益 | 243,977,478 |
| 売 買 損 益 | △8,162,695 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △17,257,701 |
| (D) 当 期 繰 越 損 益 金(A+B+C) | 218,555,389 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 545,751,399 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 52,985,656 |
| (配 当 等 相 当 額) | (30,183,870) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (22,801,786) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 817,292,444 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 817,292,444 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 52,985,656 |
| (配 当 等 相 当 額) | (30,183,870) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (22,801,786) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 764,308,481 |
| 繰 越 損 益 金 | △1,693 |

(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 | 0円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 162,486,866 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 52,985,656 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 601,821,615 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 817,294,137 |
| (f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額 | 25,060.99 |
| (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。

D I A M日本株オープン・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日 2021年1月15日）

（計算期間 2020年1月16日～2021年1月15日）

D I A M日本株オープン・マザーファンドの第17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 | 2004年2月10日から無期限です。 |
| 運用方針 | 中長期で信託財産の成長をはかることを目標として積極的な運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資には、制限を設けません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 期騰落 | | 株式組入率 比 | 株式先物率 比 | 純資産額 |
|------------------|-------------|-----------|---|------------|------------|--------------|
| | | 騰 | 落 | | | |
| 13期 (2017年1月16日) | 円 48,305 | % 15.8 | | % 94.6 | % - | 百万円 1,405 |
| 14期 (2018年1月15日) | 61,591 | 27.5 | | 96.2 | 1.4 | 1,373 |
| 15期 (2019年1月15日) | 52,355 | △15.0 | | 86.1 | 7.2 | 1,069 |
| 16期 (2020年1月15日) | 60,113 | 14.8 | | 96.3 | 3.4 | 1,017 |
| 17期 (2021年1月15日) | 75,607 | 25.8 | | 95.5 | 1.6 | 1,155 |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 当ファンドは、少数銘柄に絞り、実質組入比率を弾力的に調整する積極運用を行うため、特定のベンチマークは設けません。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

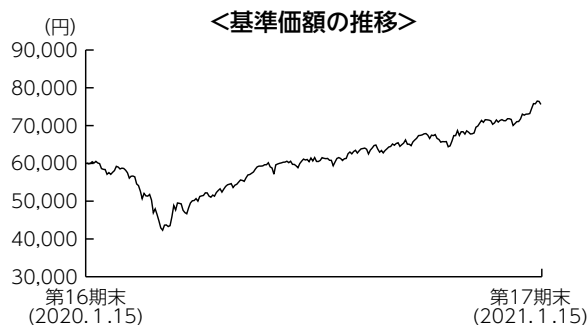
■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | |
|--------------------------|-------------|-----------|-----------|--------|
| | | 株 式 組 入 率 | 株 式 先 物 率 | 騰 落 率 |
| (期 首) 2020 年 1 月 15 日 | 円 60,113 | % 96.3 | % 3.4 | % - |
| 1 月 末 | 57,556 | 94.7 | △5.2 | △4.3 |
| 2 月 末 | 50,664 | 93.3 | △3.5 | △15.7 |
| 3 月 末 | 49,298 | 92.3 | - | △18.0 |
| 4 月 末 | 53,270 | 93.2 | 4.9 | △11.4 |
| 5 月 末 | 57,728 | 97.5 | △1.6 | △4.0 |
| 6 月 末 | 59,729 | 95.3 | - | △0.6 |
| 7 月 末 | 59,376 | 93.1 | - | △1.2 |
| 8 月 末 | 63,510 | 96.3 | 3.2 | 5.7 |
| 9 月 末 | 65,069 | 95.0 | 3.2 | 8.2 |
| 10 月 末 | 64,391 | 96.2 | - | 7.1 |
| 11 月 末 | 70,873 | 97.7 | - | 17.9 |
| 12 月 末 | 72,751 | 97.8 | - | 21.0 |
| (期 末) 2021 年 1 月 15 日 | 75,607 | 95.5 | 1.6 | 25.8 |

(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（2020年1月16日から2021年1月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は75,607円となり、前期末比で25.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの感染拡大による急激な経済の落ち込みに対し、主要国が財政・金融の政策対応を総動員して支えたことを背景に国内株式市場が上昇したことに加え、市場動向を踏まえたグロース株や中小型株への投資が奏功したことなどから、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。前期末から2020年3月にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて、急落しました。その後、10月にかけては、主要国による大規模な財政支出や金融緩和に支えられ、回復基調となりました。11月から当期末にかけては、新型コロナウイルスワクチン開発の進展を受けて景気回復期待が高まり、上昇基調が強まりました。

ポートフォリオについて

市場動向の変化に応じて機動的な運用を行いました。構成銘柄は、過剰流動性相場となったことを背景に、業績成長の確度の高いグロース株、並びに個別の成長要因を有する中小型株の比率を高めた構成を基本としながらも、2020年11月以降の景気回復期待が高まる局面では、大型株や景気敏感株などのバリュー株の比率を引き上げました。株式組入比率は、高位を基本としつつ、相場局面に応じて引き下げを行うことで市場全体の下落に備える対応を行いました。

【運用状況】

(注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

○組入上位10業種

期首 (前期末)

| No. | 業種 | 組入比率 |
|-----|--------|-------|
| 1 | 電気機器 | 21.1% |
| 2 | 情報・通信業 | 11.9 |
| 3 | 化学 | 11.0 |
| 4 | サービス業 | 7.7 |
| 5 | 医薬品 | 6.0 |
| 6 | 機械 | 5.7 |
| 7 | 銀行業 | 4.5 |
| 8 | その他製品 | 4.1 |
| 9 | 小売業 | 3.8 |
| 10 | 不動産業 | 2.9 |



期末

| No. | 業種 | 組入比率 |
|-----|--------|-------|
| 1 | 電気機器 | 22.3% |
| 2 | 情報・通信業 | 12.3 |
| 3 | 機械 | 6.9 |
| 4 | 輸送用機器 | 6.6 |
| 5 | 化学 | 6.0 |
| 6 | 医薬品 | 5.7 |
| 7 | サービス業 | 4.3 |
| 8 | 銀行業 | 3.5 |
| 9 | 小売業 | 3.4 |
| 10 | 不動産業 | 2.7 |

○組入上位10銘柄

期首 (前期末)

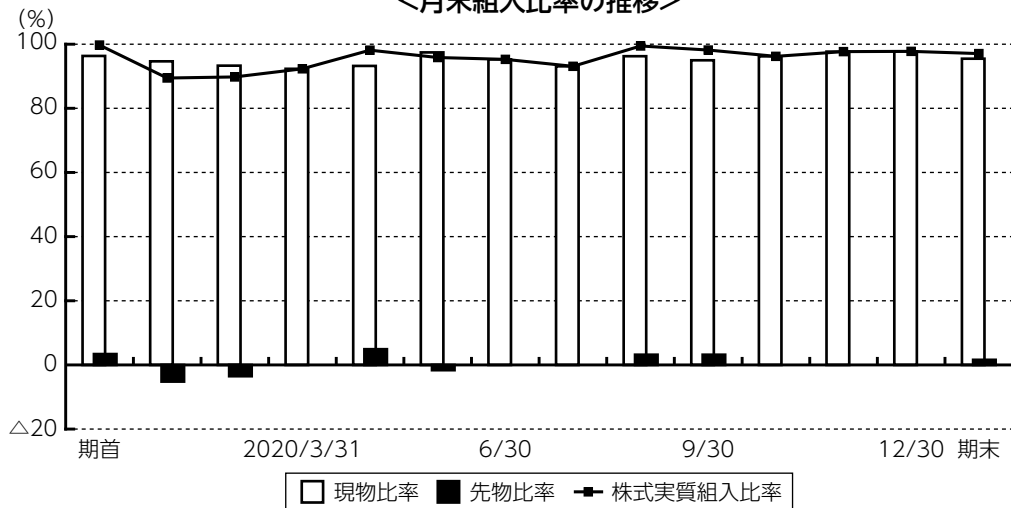
| No. | 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------|----------|-------|------|
| 1 | ソニー | 日本・円 | 4.1% |
| 2 | バリューコマース | 日本・円 | 2.7 |
| 3 | アドバンテスト | 日本・円 | 2.4 |
| 4 | ジオスター | 日本・円 | 2.1 |
| 5 | 村田製作所 | 日本・円 | 2.1 |
| 6 | ニホンフラッシュ | 日本・円 | 2.0 |
| 7 | 第一工業製薬 | 日本・円 | 1.9 |
| 8 | 日立製作所 | 日本・円 | 1.9 |
| 9 | TDK | 日本・円 | 1.8 |
| 10 | トクヤマ | 日本・円 | 1.8 |
| 組入銘柄数 | | 107銘柄 | |



期末

| No. | 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------|------------|-------|------|
| 1 | ソニー | 日本・円 | 3.1% |
| 2 | イビデン | 日本・円 | 2.5 |
| 3 | 日本電産 | 日本・円 | 2.3 |
| 4 | 東京エレクトロン | 日本・円 | 2.3 |
| 5 | エムスリー | 日本・円 | 2.2 |
| 6 | ソフトバンクグループ | 日本・円 | 2.1 |
| 7 | アドバンテスト | 日本・円 | 2.1 |
| 8 | 日本製鉄 | 日本・円 | 1.9 |
| 9 | 信越化学工業 | 日本・円 | 1.8 |
| 10 | 商船三井 | 日本・円 | 1.7 |
| 組入銘柄数 | | 105銘柄 | |

＜月末組入比率の推移＞



今後の運用方針

当面の国内株式市場は、堅調な展開を予想します。主要国の中央銀行による大規模な金融緩和政策が市場を支える構図が継続し、世界経済も緩やかに回復すると想定しています。運用方針としては、各国の政策動向や世界経済の回復状況などを注視しつつ、株式組入比率、組入銘柄共に柔軟に調整する方針で臨みます。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|-------------|------|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 売買委託手数料 | 90円 | 0.147% |
| (株 式) | (87) | (0.143) |
| (先物・オプション) | (2) | (0.004) |
| 合 計 | 90 | 0.147 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(60,854円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については4ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2020年1月16日から2021年1月15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 |
| | | 523.9 (24.7) | 1,271,561 (-) | 599.7 | 1,363,227 |

(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 314 | 百万円 332 | 百万円 603 | 百万円 593 |

(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 | 2,634,788千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 927,446千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b) | 2.84 |

(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 (2020年1月16日から2021年1月15日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 1,271 | 百万円 566 | % 44.5 | 百万円 1,363 | 百万円 508 | % 37.3 |

(2) 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 23 |

(3) 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) | 1,450千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 590千円 |
| (B)／(A) | 40.7% |

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 | 千円 |
| 鉱業 (-%) | | | | |
| 国際石油開発帝石 | 4.9 | - | - | - |
| 建設業 (0.9%) | | | | |
| コムシスホールディングス | 3.4 | 1.9 | 6,251 | |
| 大成建設 | 1.2 | - | - | |
| 清水建設 | 4.9 | 4.3 | 3,332 | |
| 西松建設 | 1.6 | - | - | |
| 五洋建設 | 5.5 | - | - | |
| 食料品 (0.6%) | | | | |
| 森永乳業 | 1 | - | - | |
| STIフードホールディングス | - | 1.3 | 6,110 | |
| 繊維製品 (1.1%) | | | | |
| 東レ | - | 19.4 | 12,507 | |
| 化学 (6.3%) | | | | |
| 石原産業 | 4.5 | - | - | |
| トクヤマ | 6.4 | - | - | |
| 信越化学工業 | 0.7 | 1.1 | 20,845 | |
| 保土谷化学工業 | 2.1 | - | - | |
| 三井化学 | 3.6 | 3.7 | 10,826 | |
| 大阪有機化学工業 | - | 4.3 | 17,135 | |
| 三菱ケミカルホールディングス | 5.2 | - | - | |
| 扶桑化学工業 | 1.9 | - | - | |
| 第一工業製薬 | 4.4 | 0.4 | 1,652 | |
| 富士フィルムホールディングス | 0.7 | - | - | |
| ミルボン | 0.4 | - | - | |
| 長谷川香料 | 0.5 | - | - | |
| メック | 3.6 | - | - | |
| タカラバイオ | 2.8 | 3.7 | 10,389 | |
| クミアイ化学工業 | 9.2 | - | - | |
| レック | 3.6 | - | - | |
| ユニ・チャーム | - | 1.7 | 8,498 | |
| 医薬品 (6.0%) | | | | |
| 武田薬品工業 | 1 | - | - | |
| 塩野義製薬 | - | 1 | 5,790 | |
| 中外製薬 | 0.4 | 1.4 | 8,251 | |
| エーザイ | 0.5 | 0.5 | 3,894 | |
| 栄研化学 | 2.8 | - | - | |
| JCRファーマ | 0.9 | 2.5 | 6,287 | |
| 第一三共 | 0.8 | 2.4 | 8,817 | |
| 大幸薬品 | - | 6.1 | 9,882 | |
| ペプチドリーム | 3.1 | 2 | 11,540 | |
| ヘリオス | - | 4.8 | 8,275 | |
| ステムリム | 10.9 | - | - | |
| モダリス | - | 1.5 | 3,532 | |
| 石油・石炭製品 (-%) | | | | |
| 出光興産 | 1.3 | - | - | |
| ガラス・土石製品 (1.1%) | | | | |
| AGC | - | 3.3 | 12,672 | |
| ジオスター | 40.5 | - | - | |

| 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 | 千円 |
| 鉄鋼 (2.0%) | | | | |
| 日本製鉄 | - | 15.8 | 21,946 | |
| 非鉄金属 (2.3%) | | | | |
| 住友金属鉱山 | 4.7 | 3.7 | 18,363 | |
| 住友電気工業 | 5.8 | 4.9 | 7,090 | |
| 機械 (7.2%) | | | | |
| オークマ | - | 0.9 | 5,535 | |
| 岡本工作機械製作所 | 3 | - | - | |
| 牧野フライス製作所 | 1.8 | - | - | |
| NITTOKU | 0.8 | 2.6 | 11,297 | |
| デイスコ | - | 0.2 | 7,590 | |
| エステック | 0.9 | - | - | |
| 自律制御システム研究所 | 2.2 | - | - | |
| SMC | 0.2 | 0.2 | 13,592 | |
| 日精エー・エス・ビー機械 | - | 2.5 | 16,050 | |
| クボタ | - | 6.1 | 14,322 | |
| ダイキン工業 | 0.3 | - | - | |
| 三菱重工業 | - | 3.4 | 10,941 | |
| スター精密 | 4.3 | - | - | |
| 電気機器 (23.4%) | | | | |
| イビデン | 6 | 5.8 | 29,174 | |
| 日立製作所 | 4.2 | 3.7 | 16,072 | |
| 富士電機 | 3.1 | 4 | 16,300 | |
| 安川電機 | 4 | 2 | 11,780 | |
| 日本電産 | 0.3 | 2 | 27,100 | |
| 日本電気 | - | 1.2 | 6,912 | |
| 富士通 | - | 0.4 | 6,378 | |
| アンリツ | 4 | 1.5 | 3,837 | |
| ソニー | 5.3 | 3.4 | 35,904 | |
| TDK | 1.5 | 0.8 | 13,560 | |
| アドバンテスト | 4 | 2.7 | 24,138 | |
| 日置電機 | 2.7 | - | - | |
| レーザーテック | - | 1 | 14,760 | |
| ローム | 0.4 | - | - | |
| 村田製作所 | 3.1 | 1.5 | 15,060 | |
| 小糸製作所 | - | 1.6 | 10,800 | |
| SCREENホールディングス | 1.1 | - | - | |
| 東京エレクトロン | 0.4 | 0.6 | 26,340 | |
| 輸送用機器 (7.0%) | | | | |
| 豊田自動織機 | 0.7 | 1.1 | 9,262 | |
| デンソー | - | 2.7 | 15,495 | |
| 川崎重工業 | - | 4.3 | 10,818 | |
| トヨタ自動車 | 2.3 | 2.4 | 18,559 | |
| 本田技研工業 | - | 3.3 | 9,355 | |
| SUBARU | 0.8 | - | - | |
| 豊田合成 | - | 4.7 | 13,263 | |
| 精密機器 (1.0%) | | | | |
| HOYA | 0.9 | 0.8 | 11,160 | |
| 朝日インテック | 0.7 | - | - | |

| 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 | |
| その他製品 (2.2%) | | | | |
| ブロッコリー | 2.9 | — | — | |
| ブシロード | 1 | 0.6 | 1,338 | |
| ニホンフラッシュ | 7 | 7.1 | 9,478 | |
| 大日本印刷 | 1.7 | — | — | |
| 任天堂 | 0.2 | 0.2 | 13,138 | |
| 陸運業 (2.2%) | | | | |
| 西日本旅客鉄道 | 0.3 | — | — | |
| 東海旅客鉄道 | — | 1.2 | 17,466 | |
| 西武ホールディングス | 2.2 | 6.8 | 6,834 | |
| 海運業 (1.8%) | | | | |
| 商船三井 | 1.7 | 6.4 | 20,032 | |
| 空運業 (0.5%) | | | | |
| 日本航空 | — | 2.7 | 5,108 | |
| 情報・通信業 (12.9%) | | | | |
| システナ | 2 | — | — | |
| T I S | 0.5 | — | — | |
| コーエーテクモホールディングス | — | 1.8 | 10,872 | |
| GMOペイメントゲートウェイ | 2 | 1 | 14,630 | |
| コムチュア | 1.5 | — | — | |
| チェンジ | — | 0.5 | 1,690 | |
| ユーザベース | 7.1 | — | — | |
| ニューラルポケット | — | 0.1 | 588 | |
| ブレイド | — | 2.9 | 10,150 | |
| ココペリ | — | 0.7 | 4,417 | |
| ヤプリ | — | 0.9 | 5,571 | |
| 野村総合研究所 | — | 3.2 | 12,432 | |
| I P S | — | 2.2 | 6,047 | |
| ミンカブ・ジ・インフォノイド | — | 0.5 | 1,755 | |
| S a n s a n | 1.6 | — | — | |
| B A S E | 8.5 | 0.4 | 4,044 | |
| マクアケ | — | 0.2 | 1,600 | |
| J M D C | 3.4 | 0.4 | 2,000 | |
| Zホールディングス | — | 16.6 | 11,908 | |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 2.4 | 1.5 | 5,685 | |
| オリコン | 0.6 | — | — | |
| ネットワンシステムズ | — | 2.5 | 9,112 | |
| K D D I | — | 2.7 | 8,850 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 1.8 | — | — | |
| T K C | 0.6 | 0.8 | 5,928 | |
| ソフトバンクグループ | 2.8 | 2.9 | 24,702 | |
| 卸売業 (2.7%) | | | | |
| 伊藤忠商事 | 2.4 | 2.4 | 7,531 | |
| 三菱商事 | 1.7 | — | — | |
| 岩谷産業 | — | 2.1 | 14,511 | |
| パリュエンスホールディングス | — | 2.4 | 7,356 | |
| 小売業 (3.6%) | | | | |
| くら寿司 | — | 0.9 | 5,436 | |
| ウエルシアホールディングス | 0.4 | 1 | 3,510 | |
| スシローグローバルホールディングス | 1.7 | — | — | |
| パル・パシフィック・インターナショナルホールディングス | 1.7 | 3.9 | 8,950 | |
| フジ・コーポレーション | — | 2.8 | 6,076 | |

| 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 | |
| ニトリホールディングス | 0.4 | 0.3 | 6,729 | |
| ファーストリテイリング | 0.1 | 0.1 | 9,099 | |
| サンドラッグ | 0.7 | — | — | |
| 銀行業 (3.6%) | | | | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 30.2 | 36.7 | 18,272 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 3.6 | 5.1 | 17,972 | |
| 千葉銀行 | 10.8 | — | — | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 3.5 | 2 | 3,968 | |
| 証券・商品先物取引業 (0.8%) | | | | |
| S B Iホールディングス | 3.5 | 3.3 | 8,979 | |
| 保険業 (2.2%) | | | | |
| ライフネット生命保険 | — | 2.6 | 4,030 | |
| 第一生命ホールディングス | 9.4 | 11.3 | 19,854 | |
| その他金融業 (1.4%) | | | | |
| オリックス | 2.8 | 8.6 | 15,535 | |
| 不動産業 (2.8%) | | | | |
| オープンハウス | 2.2 | 3.5 | 14,840 | |
| GA technologies | — | 0.3 | 816 | |
| 三井不動産 | 1.9 | — | — | |
| 三菱地所 | — | 6.9 | 11,502 | |
| カチタス | 3.8 | 1.2 | 3,720 | |
| サービス業 (4.5%) | | | | |
| 日本M&Aセンター | — | 0.6 | 3,444 | |
| セントケア・ホールディング | — | 3.3 | 2,970 | |
| エムスリー | 2.7 | 2.5 | 25,075 | |
| パリュエ・コマース | 10.9 | 2.4 | 7,704 | |
| リソー教育 | 48.4 | 29.9 | 8,820 | |
| 弁護士ドットコム | — | 0.1 | 992 | |
| Keep Per 技研 | 7.4 | 0.5 | 1,066 | |
| I B J | 4 | — | — | |
| ウェルビー | 2.7 | — | — | |
| キュービーネットホールディングス | 1.2 | — | — | |
| 合 計 | 株 数・金 額 | 株 数 | 金 額 | 金 額 |
| | 413.7 | 362.6 | 1,103,389 | 1,103,389 |
| | 銘柄数<比率> | 107銘柄 | 105銘柄 | <95.5%> |

(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 | 18 | — |

■投資信託財産の構成

2021年1月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 1,103,389千円 | 95.2% |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 55,599 | 4.8 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,158,988 | 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

(2021年1月15日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,158,988,862円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 38,224,099 |
| 株 式(評価額) | 1,103,389,150 |
| 未 収 入 金 | 15,849,913 |
| 未 収 配 当 金 | 1,090,700 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 435,000 |
| (B) 負 債 | 3,241,676 |
| 未 払 金 | 3,241,676 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 1,155,747,186 |
| 元 本 | 152,862,934 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 1,002,884,252 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 152,862,934口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 75,607円 |

(注1) 期首元本額 169,215,106円
 追加設定元本額 1,297,747円
 一部解約元本額 17,649,919円

(注2) 期末における元本の内訳
 さらめきジャパン 152,862,934円
 期末元本合計 152,862,934円

■損益の状況

当期 自2020年1月16日 至2021年1月15日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 14,772,853円 |
| 受 取 配 当 金 | 14,782,430 |
| 受 取 利 息 | 17 |
| そ の 他 収 益 金 | 6,504 |
| 支 払 利 息 | △16,098 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 215,231,521 |
| 売 買 益 | 373,054,071 |
| 売 買 損 | △157,822,550 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | 11,643,070 |
| 取 引 益 | 25,886,890 |
| 取 引 損 | △14,243,820 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 241,647,444 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 847,994,636 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △93,230,081 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 6,472,253 |
| (H) 合 計(D+E+F+G) | 1,002,884,252 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 1,002,884,252 |

(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) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(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。