

運用報告書 (全体版)

第1期<決算日2016年6月2日>

DRC 日本株アクティブファンド

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	2015年12月4日から2020年12月2日までです。	
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。	
主要投資対象	DRC 日本株 アクティブファンド	「DIAM ツインアクティブ日本株マザーファンド2」受益証券および株価指数先物取引、短期金融資産等を主要投資対象とします。なお、上場投資信託証券(ETF)に投資する場合もあります。
	DIAM ツインアクティブ 日本株マザーファンド2	わが国の上場株式を主要投資対象とします。
運用方法	主として、マザーファンドおよび株価指数先物取引への投資を通じて、国内株式へ実質的に投資します。マザーファンドの運用においては、独自開発モデルによる計量分析および企業調査アナリストによる定性分析の結果を活用し、企業ファンダメンタルズおよび株価バリュエーションの両面で投資魅力度の高い銘柄を選定します。基準価額の水準や市場環境等に応じて、国内株式の実質組入比率を機動的に変更(*)することで、国内株式市場全体の上昇時には値上がり利益の獲得をめざし、市場下落時には基準価額の下落を一定水準(下値目安値(**))までに抑えることをめざします。なお、下値目安値は、6ヵ月毎の決算日に改定します。 (*) 国内株式の実質組入比率の変更に、信託財産の純資産総額の概ね5%~100%の範囲で行います。また、マザーファンドの組入比率は、信託財産の純資産総額の50%程度を基本とします。国内株式の実質組入比率の変更は、原則として株価指数先物取引への投資を通じて行いますが、市場環境や運用状況等によりマザーファンドの組入比率を引き下げる場合があります。 (**) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託者が保証するものではありません(相場急落時等には、基準価額が下値目安値を下回る場合があります)。また、当該水準は、委託者の判断により今後変更する場合があります。	
組入制限	マザーファンドの投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合は、制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。	
分配方針	決算日(原則として6月、12月の各2日。休業日の場合は翌営業日)に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額とし、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場合があります。	

愛称:「クルーズ」

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、「DRC 日本株アクティブファンド」は、2016年6月2日に第1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: 0120-506-860

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。

DIAMアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内3-3-1

(URL) <http://www.diam.co.jp/>

DRC 日本株アクティブファンド

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			東証株価指数		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(TOPIX) (参考指数)	期中騰落率					
(設定日) 2015年12月4日	円 10,000	円 -	% -	(12月3日) 1,602.94	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 13,855
1期(2016年6月2日)	9,575	0	△4.3	1,331.81	△16.9	50.9	△11.9	7.2	-	14,121

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(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」、「債券組入比率」、「債券先物比率」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。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 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、(株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)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、(株)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)。

■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		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率
	騰落率	(TOPIX) (参考指数)	騰落率					
(設定日) 2015年12月4日	円 10,000	% -	(12月3日) 1,602.94	% -	% -	% -	% -	% -
12月末	9,884	△1.2	1,547.30	△3.5	49.9	△15.1	3.4	-
2016年1月末	9,614	△3.9	1,432.07	△10.7	50.4	△41.1	6.9	-
2月末	9,539	△4.6	1,297.85	△19.0	48.4	△43.5	7.1	-
3月末	9,597	△4.0	1,347.20	△16.0	51.4	△45.8	7.1	-
4月末	9,599	△4.0	1,340.55	△16.4	50.4	△44.8	7.1	-
5月末	9,595	△4.1	1,379.80	△13.9	52.4	△46.3	7.1	-
(期末) 2016年6月2日	9,575	△4.3	1,331.81	△16.9	50.9	△11.9	7.2	-

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

(注2) 騰落率は設定日比です。

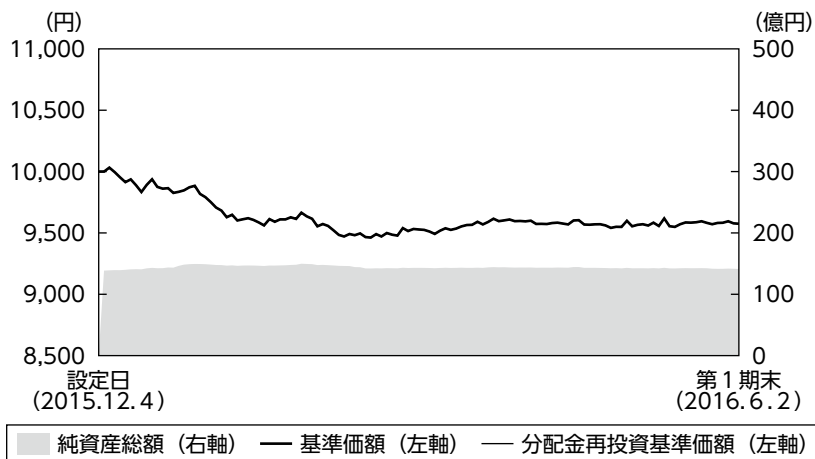
(注3) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2015年12月4日から2016年6月2日まで）

基準価額等の推移



設定日：10,000円
 第1期末：9,575円
 (既払分配金0円)
 騰落率：△4.3%
 (分配金再投資ベース)

(注) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

(注1) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。

(注2) 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3) 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

設定日から2016年2月中旬にかけて国内株式市場が大幅に下落したことから基準価額は下落しましたが、株式市場の下落局面に株価指数先物を含めた実質株式組入比率を徐々に引き下げたことで、株式市場よりも下落幅を大幅に抑制することができました。

なお、2月中旬以降は、国内株式市場のボラティリティ（価格の変動性）が高かったため、実質株式組入比率を低位に保ったことから基準価額は概ね横ばいの推移となりました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
DIAM ツインアクティブ日本株マザーファンド2	△13.4%

投資環境

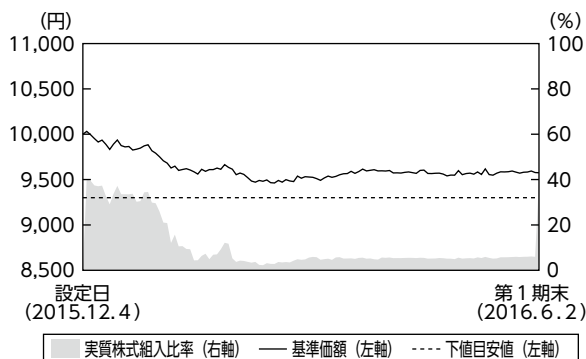
国内株式市場は大幅に下落しました。2016年1月末に日銀の金融政策決定会合でマイナス金利の導入が発表されたことを受けて上昇する場面もありましたが、中国の景気減速懸念や原油価格の急落などにより世界的に株式市場が大きく下落したことを背景に、2月中旬にかけて国内株式市場は大幅に下落しました。その後は、米国の経済指標が市場の事前予想を上回り景気の底堅さが確認されたこと、為替や原油市場の落ち着き等から緩やかに戻りを試す展開となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

マザーファンドの組入比率は期を通じて純資産総額の50%程度に維持しました。株価指数先物も含めた実質株式組入比率は、運用開始直後は約40%としていましたが、国内株式市場が下落基調で推移したことから、基準価額の下落リスク抑制のため実質株式組入比率を徐々に引き下げ、2月初旬には5%程度まで低下させました。その後は、基準価額が下値目安値に近付いたことから実質株式組入比率を低水準に維持しました。

＜基準価額と実質株式組入比率の推移＞



- ※1 実質株式組入比率はマザーファンドを通じた実質現物株式組入比率に当ファンドおよび当マザーファンドの実質的な株価指数先物組入比率を加えた純資産総額に対する比率です。
- ※2 基準価額は信託報酬控除後です。
- ※3 基準価額・下値目安値は1万口当たり。

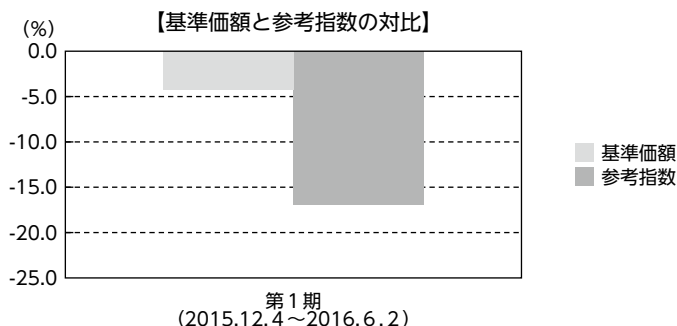
●D I A M ツインアクティブ日本株マザーファンド2

ベンチマークである東証株価指数 (TOPIX) を2.0%上回りました。

銘柄選択については、製品・サービスの競争力の高さ等により短・中期の業績の伸び率が高いと予想される銘柄、足元の業績が市場予想を上回っていると予想される銘柄等、中期成長性や短期業績の方向性等ファンダメンタルズが良好な銘柄や、株価バリュエーションが割安で投資魅力の高い銘柄、高配当利回りの銘柄等に投資しました。その結果、業種別では建設業、情報・通信業、サービス業等をオーバーウェイトとしました。

参考指数との差異

当ファンドはベンチマークを定めておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数である東証株価指数（TOPIX）の騰落率の対比です。



(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
	2015年12月4日 ～2016年6月2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	－
翌期繰越分配対象額	0

(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。

今後の運用方針

●当ファンド

マザーファンドおよび株価指数先物を通じて国内株式に実質的に投資を行い、市場全体の上昇トレンドをとらえながらも、相場下落時には基準価額の下落を一定水準（下値目安値）までに抑えることをめざした運用を行います。

●DIAM ツインアクティブ日本株マザーファンド2

国内株式市場は、短期的には米国の5月の雇用統計が低調だったことや6月23日に英国でEU（欧州連合）からの離脱を問う国民投票を控えていることから上値の重い展開が見込まれますが、その後は米国景気の堅調さが再度確認されることに加え、追加金融緩和や財政出動への期待などから底値を固める展開を予想します。投資銘柄は引き続き、高い中期成長性、短期業績の堅調さや回復の強さ等の企業ファンダメンタルズと、今期・来期の低PER（株価収益率）等の株価バリュエーションの両面に注目します。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第 1 期		項目の概要
	(2015年12月4日 ～2016年6月2日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	74円	0.773%	(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9,624円です。 投信会社分は、委託した資金の運用の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、 口座内でのファンドの管理等の対価 受託銀行分は、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
(投信会社)	(36)	(0.376)	
(販売会社)	(36)	(0.376)	
(受託銀行)	(2)	(0.021)	
(b) 売買委託手数料	4	0.046	(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)	(4)	(0.040)	
(先物・オプション)	(1)	(0.006)	
(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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の諸費用等（余資運用に対してかかる費用を含む）
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	79	0.821	

(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、売買委託手数料およびその他費用は、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。

(注2) 金額欄は各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（2015年12月4日から2016年6月2日まで）

公社債

			買 付 額	売 付 額
			千円	千円
国	内	特 殊 債 券	1,018,669	—

(注) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

■ 派生商品取引状況等

先物取引の銘柄別取引・残高状況

銘 柄 別			買 建		売 建		当 期 末 評 価 額		
			新 買 付 額	決 済 額	新 売 付 額	決 済 額	買 建 額	売 建 額	評 価 損 益
国	株 式	T O P I X	百万円 —	百万円 —	百万円 16,995	百万円 14,864	百万円 —	百万円 1,682	百万円 △0

(注) 金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2015年12月4日から2016年6月2日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
DIAM ツインアクティブ 日本株マザーファンド2	千口 8,749,549	千円 8,546,000	千口 332,707	千円 285,000

■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	DIAM ツインアクティブ日本株マザーファンド2
(a) 期中の株式売買金額	12,852,941千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	7,310,991千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	1.75

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■主要な売買銘柄（2015年12月4日から2016年6月2日まで）

国内公社債

買 付		売 付	
銘	柄 金額	銘	柄 金額
	千円		千円
37回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	206,056	—	—
36回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	205,334		
873回 政保公営企業債券	204,174		
193回 政保預金保険機構債券	200,630		
23回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	101,730		
14回 政保中部国際空港債券	100,745		

(注) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

■利害関係人との取引状況等（2015年12月4日から2016年6月2日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

■組入資産の明細

(1) 公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
特 殊 債 券	千円 1,000,000	千円 1,013,799	% 7.2	% -	% -	% -	% 7.2
合 計	1,000,000	1,013,799	7.2	-	-	-	7.2

(注) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘	柄	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券)		%	千円	千円	
23回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.7000	100,000	100,977	2016/12/28
873回	政保公営企業債券	1.7000	200,000	202,720	2017/03/17
36回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.9000	200,000	204,168	2017/06/20
37回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.9000	200,000	204,616	2017/07/31
193回	政保預金保険機構債券	0.2000	200,000	200,604	2017/10/20
14回	政保中部国際空港債券	0.4000	100,000	100,714	2018/03/07
合 計		-	1,000,000	1,013,799	-

(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	T	O P I X	百万円 -		百万円 1,682

(3) 親投資信託残高

	当 期		末
	□	数	評 価 額
D I A M ツインアクティブ日本株マザーファンド2		千□ 8,416,842	千円 7,287,302

<補足情報>

■D I A M ツインアクティブ日本株マザーファンド2の組入資産の明細

下記は、D I A M ツインアクティブ日本株マザーファンド2 (8,416,842,522口) の内容です。

国内株式

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
建設業 (6.8%)		
大林組	74	83,324
鹿島建設	93	67,425
大豊建設	92	47,104
大東建託	7.7	121,198
東洋建設	100	46,700
ライト工業	38	43,092
積水ハウス	43.5	82,497
食料品 (3.1%)		
明治ホールディングス	4.6	44,850
アサヒグループホールディングス	19.2	69,561
日本たばこ産業	24.3	105,632
化学 (6.9%)		
東ソー	84	44,604
信越化学工業	8	49,504
三菱ケミカルホールディングス	60	32,166
日立化成	23	46,920
花王	19.4	115,177
富士フイルムホールディングス	12.8	55,449
アイビー化粧品	50	27,100
ポーラ・オルビスホールディングス	13.3	126,084
医薬品 (6.8%)		
アステラス製薬	66.4	98,438
塩野義製薬	23.8	143,038
沢井製薬	12.1	92,565
大塚ホールディングス	34.6	155,008
石油・石炭製品 (1.1%)		
東燃ゼネラル石油	77	78,078
ゴム製品 (1.0%)		
東洋ゴム工業	54.5	70,904
鉄鋼 (1.2%)		
新日鐵住金	41.8	88,030
非鉄金属 (0.4%)		
住友金属鉱山	28	30,338
機械 (2.0%)		
三井海洋開発	15	26,250
日立建機	19	30,609
クボタ	40	61,780
ジェイテクト	17.5	25,567
電気機器 (11.6%)		
日立製作所	100	49,530
三菱電機	79	102,976
富士電機	50	22,000
日本電産	16.1	131,424
日新電機	47	61,335
ソニー	27.3	82,527
T D K	4.8	29,472
アルプス電気	26.9	59,449

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
キーエンス	1.4	96,936
イリソ電子工業	4.5	28,305
ファナック	3.4	55,080
村田製作所	5.5	68,392
S C R E E Nホールディングス	48	49,536
輸送用機器 (9.1%)		
日産自動車	100.8	108,864
いすゞ自動車	45	57,330
トヨタ自動車	42.3	239,798
アイシン精機	9.5	41,942
スズキ	7.5	21,420
富士重工業	28.3	112,803
ヤマハ発動機	38.3	71,621
精密機器 (0.8%)		
テルモ	12.6	57,456
その他製品 (0.9%)		
前田工業	29.5	31,211
日本写真印刷	13.2	31,099
陸運業 (3.1%)		
東京急行電鉄	84	76,608
西日本旅客鉄道	15.9	106,227
東海旅客鉄道	2.3	43,412
空運業 (1.5%)		
日本航空	28.9	104,762
情報・通信業 (11.9%)		
フールズ	14.5	30,073
I Tホールディングス	17	45,407
GMOペイメントゲートウェイ	10.9	72,594
デジタルガレージ	33.5	82,209
日本ユニシス	26	32,578
日本電信電話	36.7	171,756
K D D I	15.1	47,247
N T T ドコモ	61.5	166,603
GMOインターネット	30.5	39,619
S C S K	17.4	70,296
ソフトバンクグループ	16.2	97,864
卸売業 (3.7%)		
伊藤忠商事	73	96,579
三井物産	26	33,553
日立ハイテクノロジーズ	20	62,000
ミスミグループ本社	42.4	73,267
小売業 (6.0%)		
エービーシー・マート	10.2	72,012
アダストリア	5.9	21,387
セブン&アイ・ホールディングス	13.9	64,231
良品計画	1.5	37,560
日本瓦斯	28.2	67,821
しまむら	3.7	52,244

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
イズミ	7.2	29,448
ニトリホールディングス	7.7	84,854
銀行業 (7.5%)		
ゆうちょ銀行	37.7	48,670
あおぞら銀行	225	82,125
三菱UFJフィナンシャル・グループ	319	168,176
三井住友フィナンシャルグループ	42.8	145,562
みずほフィナンシャルグループ	549	92,177
保険業 (2.1%)		
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	11.6	35,240
第一生命保険	33.1	45,628
東京海上ホールディングス	18.4	67,712
その他金融業 (1.4%)		
全国保証	14.2	50,765
オリックス	32.6	48,345
不動産業 (2.3%)		
ユニゾホールディングス	7	36,820
三井不動産	40	105,300
スターツコーポレーション	11	24,860
サービス業 (8.9%)		
ミクシィ	15	65,250
テンブホールディングス	32.4	55,533
学情	50.6	53,332
ツクイ	36.5	56,027
アウトソーシング	31.9	144,188

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
セブテーニ・ホールディングス	15.1	49,905
ケネディクス	108	45,252
サイバーエージェント	9	46,260
テクノプロ・ホールディングス	14.7	48,142
イトクロ	8	24,520
日本郵政	36.8	51,115
合 計	千株	千円
株 数	4,286.9	7,192,634
銘 柄 数 < 比 率 >	104銘柄	<98.7%>

(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。

■投資信託財産の構成

2016年6月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	1,013,799	7.1
D I A M ツインアクティブ日本株マザーファンド2	7,287,302	51.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,964,829	41.8
投 資 信 託 財 産 総 額	14,265,930	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨ててあります。%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

(2016年6月2日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	14,265,272,254円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,544,052,452
公 社 債(評価額)	1,013,799,000
D I A M ツインアクティブ 日本株マザーファンド2(評価額)	7,287,302,255
未 収 入 金	10,092,552
未 収 利 息	3,972,995
差 入 委 託 証 拠 金	406,053,000
(B) 負 債	143,943,410
未 払 金	220,824
未 払 解 約 金	32,650,988
未 払 信 託 報 酬	110,773,332
そ の 他 未 払 費 用	298,266
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	14,121,328,844
元 本	14,747,603,201
次 期 繰 越 損 益 金	△626,274,357
(D) 受 益 権 総 口 数	14,747,603,201口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,575円

(注) 設定当初の投資元本額は13,855,557,811円、当期中における追加設定元本額は2,002,933,156円、同解約元本額は1,110,887,766円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月4日 至2016年6月2日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	5,857,340円
受 取 利 息	6,455,602
支 払 利 息	△598,262
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△919,433,063
売 買 益	59,134,682
売 買 損	△978,567,745
(C) 先 物 取 引 等 損 益	437,686,025
取 引 益	481,721,832
取 引 損	△44,035,807
(D) 信 託 報 酬 等	△111,071,598
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△586,961,296
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△39,313,061
(配 当 等 相 当 額)	(92,881)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△39,405,942)
(G) 合 計(E+F)	△626,274,357
次 期 繰 越 損 益 金(G)	△626,274,357
追 加 信 託 差 損 益 金	△39,313,061
(配 当 等 相 当 額)	(1,363,022)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△40,676,083)
繰 越 損 益 金	△586,961,296

(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) (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	0
(c) 収 益 調 整 金	1,363,022
(d) 分 配 準 備 積 立 金	0
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	1,363,022
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	0.92
(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 ツインアクティブ日本株マザーファンド2

「D I A M ツインアクティブ日本株マザーファンド2」は、「D R C 日本株アクティブファンド」の決算日（2016年6月2日）現在、決算を迎えていないため、運用報告書の添付は行っておりません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2015年12月4日から無期限です。
運 用 方 針	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。
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。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。