

運用報告書 (全体版)

第19期<決算日2023年1月16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、2023年1月16日に第19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			
15期 (2019年1月15日)	円 25,142		円 0	% △16.4	% 85.9	% 7.2	百万円 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
18期 (2022年1月17日)	35,692		0	1.8	96.1	—	1,061
19期 (2023年1月16日)	33,441		0	△6.3	95.8	2.1	888

(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) 2022年1月17日	円 35,692			% —	% 96.1	% —
1月 末	33,716		△5.5		94.1	△13.3
2月 末	33,214		△6.9		96.5	2.0
3月 末	34,876		△2.3		96.1	△1.9
4月 末	33,737		△5.5		95.7	1.9
5月 末	34,243		△4.1		95.5	1.9
6月 末	32,928		△7.7		96.1	△2.0
7月 末	34,039		△4.6		96.0	△2.0
8月 末	34,697		△2.8		95.9	△4.0
9月 末	32,833		△8.0		95.5	2.0
10月 末	34,494		△3.4		96.1	2.1
11月 末	35,354		△0.9		96.2	—
12月 末	33,511		△6.1		95.8	2.1
(期末) 2023年1月16日	33,441		△6.3		95.8	2.1

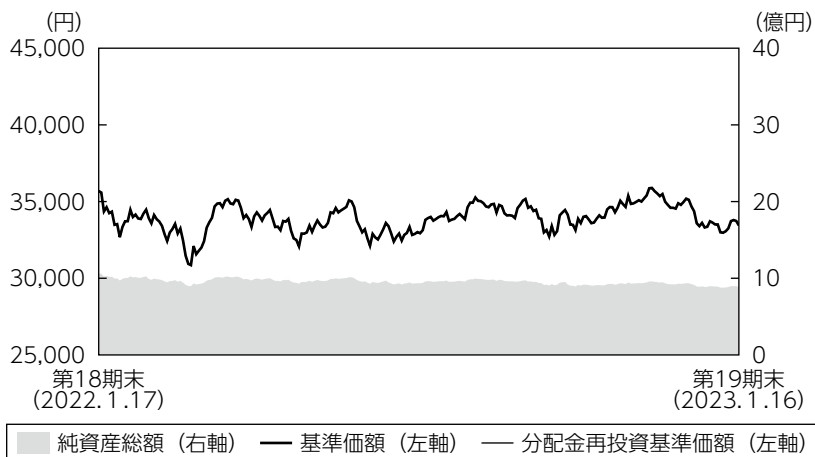
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2022年1月18日から2023年1月16日まで）

基準価額等の推移



第19期首：35,692円
第19期末：33,441円
(既払分配金0円)
騰落率：△6.3%
(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はありません。
- (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

米国において金融引き締めが急速なペースで進められ、景気後退リスクが警戒されたことなどを背景に国内株式市場が下落したことから、基準価額は下落しました。金融引き締めに伴う株価バリュエーションの低下の影響を受け、組入れていたグロース株の株価が軟調に推移したこともマイナス要因となりました。

投資環境

国内株式市場は下落しました。前期末から2022年3月半ばにかけては、インフレ進行を受けて米金融政策の引き締め転換が鮮明となったことに加え、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻が悪材料となり、リスク回避の動きが強まりました。その後、当期末にかけては、急速な米金融引き締めに伴う景気後退リスクが懸念された一方で、為替市場での円安進行やコロナ禍からの経済再開が企業業績をサポートするとの期待から、株価は一進一退の推移となりました。

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。組入銘柄は、米金融政策の引き締めが急速に進む局面ではバリュー株や大型株を組入れて運用リスクを引き下げた一方で、インフレのピークアウト後はグロース株や小型株の比率を高めて運用リスクを引き上げるなどの対応を行いました。株式組入比率は、高位を基本としつつ、レンジ相場での推移を想定した比率調整を行いました。

※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
	2022年1月18日 ～2023年1月16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	24,991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

今後の株式市場は、当面は米欧を中心に景気後退懸念が燃り続けると見ていますが、インフレの鈍化に伴い米金融政策の引き締めプロセスが終盤に差し掛かる中で、次第に回復感が出るフェーズに移っていくと予想します。運用方針としては、各国の政策動向や経済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19期		項目の概要
	(2022年1月18日 ～2023年1月16日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	595円	1.754%	(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33,897円です。 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)	(279)	(0.822)	
(販売会社)	(279)	(0.822)	
(受託会社)	(37)	(0.110)	
(b) 売買委託手数料	41	0.122	(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)	(0.120)	
(先物・オプション)	(1)	(0.003)	
(c) その他費用	1	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
(監査費用)	(1)	(0.002)	
合計	637	1.878	

(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。

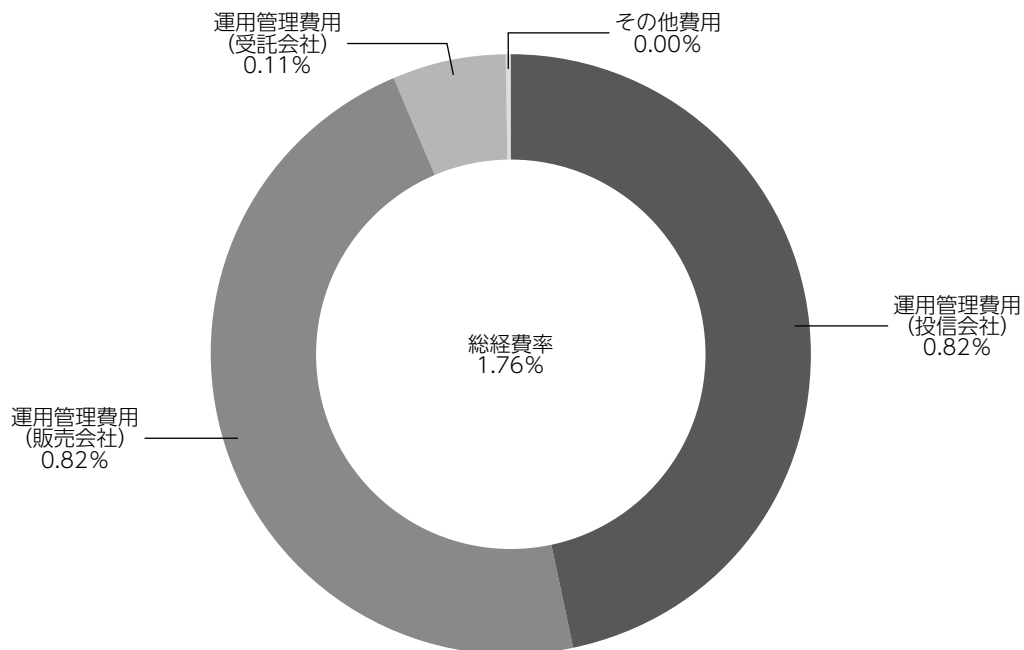
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.76%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（2022年1月18日から2023年1月16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□ -	千円 -	千□ 16,591	千円 124,800

■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	2,120,782千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	916,934千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	2.31

(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（2022年1月18日から2023年1月16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

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
金 銭 信 託	百万円 0.000	百万円 0.000	% 100.0	百万円 0.000	百万円 0.000	% 100.0

(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)	1,168千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	200千円
(B) / (A)	17.1%

(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

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 1,007	百万円 202	% 20.1	百万円 1,112	百万円 161	% 14.5
金 銭 信 託	0.002	0.002	100.0	0.002	0.002	100.0

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 3

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、みずほ信託銀行です。

■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□ 135,454	千□ 118,862	千円 887,918

■投資信託財産の構成

2023年1月16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	887,918	98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,306	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	898,224	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

(2023年1月16日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	898,224,796円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	10,306,629
D I A M日本株オープン・マザーファンド(評価額)	887,918,167
(B) 負 債	10,027,546
未 払 解 約 金	1,681,200
未 払 信 託 報 酬	8,339,032
そ の 他 未 払 費 用	7,314
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	888,197,250
元 本	265,599,998
次 期 繰 越 損 益 金	622,597,252
(D) 受 益 権 総 口 数	265,599,998口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	33,441円

(注) 期首における元本額は297,361,057円、当期中における追加設定元本額は278,941円、同解約元本額は32,040,000円です。

■損益の状況

当期 自2022年1月18日 至2023年1月16日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,818円
受 取 利 息	96
支 払 利 息	△1,914
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△42,951,427
売 買 益	3,955,565
売 買 損	△46,906,992
(C) 信 託 報 酬 等	△16,776,266
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△59,729,511
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	638,081,238
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	44,245,525
(配 当 等 相 当 額)	(25,695,548)
(売 買 損 益 相 当 額)	(18,549,977)
(G) 合 計(D+E+F)	622,597,252
次 期 繰 越 損 益 金(G)	622,597,252
追 加 信 託 差 損 益 金	44,245,525
(配 当 等 相 当 額)	(25,695,548)
(売 買 損 益 相 当 額)	(18,549,977)
分 配 準 備 積 立 金	638,082,118
繰 越 損 益 金	△59,730,391

(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	0
(c) 収 益 調 整 金	25,695,548
(d) 分 配 準 備 積 立 金	638,082,118
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	663,777,666
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	24,991.63
(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19期（決算日 2023年1月16日）

（計算期間 2022年1月18日～2023年1月16日）

D I A M日本株オープン・マザーファンドの第19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	期騰落中率		株式組入率 株比	株式先物率 株比	純資産額
		期騰	落中率			
15期（2019年1月15日）	円 52,355	% △15.0	% 86.1	% 7.2	百万円 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	
18期（2022年1月17日）	78,343	3.6	96.1	—	1,061	
19期（2023年1月16日）	74,701	△4.6	95.8	2.1	887	

（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）。

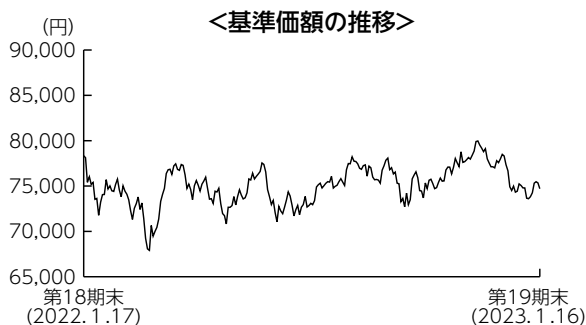
■当期中の基準価額の推移

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) 2022 年 1 月 17 日	円 78,343	% 96.1	% -	% -
1 月 末	74,054	94.1	△5.5	△13.3
2 月 末	73,064	96.1	△6.7	2.0
3 月 末	76,837	96.1	△1.9	△1.9
4 月 末	74,429	95.7	△5.0	1.9
5 月 末	75,668	95.5	△3.4	1.9
6 月 末	72,873	96.1	△7.0	△2.0
7 月 末	75,436	96.0	△3.7	△2.0
8 月 末	77,014	96.0	△1.7	△4.0
9 月 末	72,953	95.5	△6.9	2.0
10 月 末	76,766	96.2	△2.0	2.1
11 月 末	78,795	96.2	0.6	-
12 月 末	74,795	95.8	△4.5	2.1
(期 末) 2023 年 1 月 16 日	74,701	95.8	△4.6	2.1

(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（2022年1月18日から2023年1月16日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は74,701円となり、前期末比で4.6%下落しました。

基準価額の主な変動要因

米国において金融引き締めが急速なペースで進められ、景気後退リスクが警戒されたことなどを背景に国内株式市場が下落したことから、基準価額は下落しました。金融引き締めに伴う株価バリュエーションの低下の影響を受け、組入れていたグロース株の株価が軟調に推移したこともマイナス要因となりました。

投資環境

国内株式市場は下落しました。前期末から2022年3月半ばにかけては、インフレ進行を受けて米金融政策の引き締め転換が鮮明となったことに加え、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻が悪材料となり、リスク回避の動きが強まりました。その後、当期末にかけては、急速な米金融引き締めに伴う景気後退リスクが懸念された一方で、為替市場での円安進行やコロナ禍からの経済再開が企業業績をサポートするとの期待から、株価は一進一退の推移となりました。

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。組入銘柄は、米金融政策の引き締めが急速に進む局面ではバリュー株や大型株を組入れて運用リスクを引き下げた一方で、インフレのピークアウト後はグロース株や小型株の比率を高めて運用リスクを引き上げるなどの対応を行いました。株式組入比率は、高位を基本としつつ、レンジ相場での推移を想定した比率調整を行いました。

【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	21.8%
2	情報・通信業	9.6
3	化学	9.6
4	輸送用機器	8.8
5	サービス業	5.1
6	銀行業	4.9
7	機械	4.7
8	卸売業	3.7
9	保険業	3.3
10	医薬品	2.6



期末

No.	業種	組入比率
1	電気機器	16.5%
2	情報・通信業	15.8
3	小売業	8.4
4	銀行業	7.3
5	医薬品	6.1
6	機械	4.9
7	サービス業	4.9
8	化学	4.1
9	卸売業	4.1
10	輸送用機器	3.5

○組入上位10銘柄

期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	ソニーグループ	日本・円	4.3%
2	トヨタ自動車	日本・円	4.0
3	デンソー	日本・円	2.5
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.3
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	2.1
6	富士フィルムホールディングス	日本・円	2.0
7	富士電機	日本・円	2.0
8	イビデン	日本・円	2.0
9	第一生命ホールディングス	日本・円	2.0
10	日立製作所	日本・円	2.0
組入銘柄数		106銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	ソニーグループ	日本・円	3.3%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	3.2
3	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	2.8
4	キーエンス	日本・円	2.5
5	ダイキン工業	日本・円	2.2
6	東レ	日本・円	2.0
7	任天堂	日本・円	1.8
8	ニトリホールディングス	日本・円	1.7
9	日本電信電話	日本・円	1.7
10	日立製作所	日本・円	1.7
組入銘柄数		99銘柄	

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	92円 (90) (2)	0.122% (0.119) (0.003)	(a) 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
合 計	92	0.122	
期中の平均基準価額は75,069円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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 (2022年1月18日から2023年1月16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
		482.6 (23.6)	1,007,980 (-)	501.9	1,112,802

(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 132	百万円 115	百万円 642	百万円 649

(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	2,120,782千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	916,934千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	2.31

(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 (2022年1月18日から2023年1月16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 1,007	百万円 202	% 20.1	百万円 1,112	百万円 161	% 14.5
金 銭 信 託	0.002	0.002	100.0	0.002	0.002	100.0

(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	額
株 式		百万円 3

(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)	1,168千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	200千円
(B)／(A)	17.1%

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、みずほ信託銀行です。

■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 (0.9%)				
INPEX	15.9	5.4	7,614	
建設業 (1.8%)				
ウエストホールディングス	1.4	2.3	9,499	
西松建設	—	1.5	5,797	
ライト工業	5.6	—	—	
エクシオグループ	4	—	—	
食料品 (2.1%)				
森永乳業	0.6	—	—	
アサヒグループホールディングス	1.3	—	—	
味の素	2.2	1.7	6,939	
ニチレイ	—	4	10,832	
STIフードホールディングス	0.1	—	—	
繊維製品 (2.1%)				
東レ	18.8	24.6	18,194	
化学 (4.3%)				
クレハ	—	1.1	8,811	
信越化学工業	0.9	0.8	13,124	
三菱瓦斯化学	2.6	—	—	
J S R	2.9	1.6	4,408	
大阪有機化学工業	1.8	—	—	
恵和	2.1	—	—	
ADEKA	4.4	—	—	
富士フイルムホールディングス	2.6	1.6	10,417	
上村工業	2.1	—	—	
タカラバイオ	1.2	—	—	
医薬品 (6.4%)				
武田薬品工業	—	1.7	6,975	
アステラス製薬	—	3.1	5,900	
塩野義製薬	1.5	—	—	
中外製薬	1.4	1.7	5,484	
エーザイ	—	0.3	2,481	
ロート製薬	—	2.2	4,712	
第一三共	4.2	3.4	13,909	
ペプチドリーム	—	4.6	9,333	
坪田ラボ	—	6.2	5,239	
鉄鋼 (—%)				
日本製鉄	3.8	—	—	
非鉄金属 (1.1%)				
住友金属鉱山	0.6	—	—	
大阪チタニウムテクノロジーズ	—	1.4	5,250	
フジクラ	18.8	4.1	3,808	
金属製品 (—%)				
LIXIL	1.7	—	—	
機械 (5.1%)				
芝浦機械	1.9	1.7	4,540	
ディスコ	—	0.1	3,850	
SMC	0.1	0.1	6,061	
TOWA	4	—	—	
ダイキン工業	0.4	0.9	19,111	
CKD	2.2	—	—	

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
ホシザキ	—	2.3	10,039	
日本ビラー工業	2.6	—	—	
電気機器 (17.3%)				
イビデン	3.1	1.1	5,412	
日立製作所	3.1	2.3	14,662	
富士電機	3.4	2.3	11,592	
安川電機	—	1	4,470	
日本電産	1.1	—	—	
JVCケンウッド	—	26.1	8,952	
リバーエレクトック	1.9	—	—	
ソニーグループ	3.2	2.7	29,308	
TDK	2.5	1.3	5,512	
日本トリム	—	1.6	4,344	
横河電機	—	3.6	7,488	
キーエンス	0.3	0.4	21,960	
日電電機	1.2	0.6	3,672	
シスメックス	0.3	—	—	
レーザーテック	0.3	0.3	7,653	
ファナック	0.5	—	—	
ローム	0.6	—	—	
浜松ホトニクス	1.5	1.3	8,567	
村田製作所	0.9	—	—	
東京エレクトロン	0.3	0.3	13,206	
輸送用機器 (3.7%)				
豊田自動織機	1.5	—	—	
デンソー	2.7	1.1	7,165	
トヨタ自動車	17.4	7.2	13,086	
本田技研工業	2.8	1.4	4,250	
スズキ	—	1.6	6,657	
精密機器 (2.5%)				
ナカニシ	—	1.9	4,780	
オリンパス	4.7	3	6,961	
HOYA	0.7	0.7	9,177	
朝日インテック	2	—	—	
その他製品 (3.3%)				
パラマウントベッドホールディングス	—	2.5	6,180	
広済堂ホールディングス	—	3.5	6,006	
任天堂	0.3	3	16,239	
電気・ガス業 (0.6%)				
関西電力	—	3.9	4,742	
イーレックス	0.6	—	—	
陸運業 (2.0%)				
東海旅客鉄道	0.8	0.8	12,360	
西武ホールディングス	—	3.6	5,018	
海運業 (—%)				
商船三井	1.2	—	—	
空運業 (—%)				
日本航空	1.4	—	—	
情報・通信業 (16.5%)				
GMOペイメントゲートウェイ	0.3	0.8	9,016	
PCIホールディングス	—	4.2	4,187	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
チェンジ	2.2	—	—
ニューラルポケット	—	5.4	5,545
プラスアルファ・コンサルティング	—	4	10,264
ココベリ	0.1	—	—
ビジョナル	—	0.8	7,320
サスメド	—	4	5,592
野村総合研究所	3.8	3.5	11,042
シンプレクス・ホールディングス	3.3	4.1	8,618
メルカリ	—	2.3	6,543
IPS	5	2.7	7,144
アクリート	—	1.8	5,400
ミンカブ・ジ・インフォノイド	2.3	—	—
JMDC	0.5	1.3	5,258
Zホールディングス	10	—	—
トレンドマイクロ	1.3	—	—
ネットワンシステムズ	—	2.7	9,288
日本電信電話	4.2	4	14,900
KDDI	2.8	2.2	8,441
ソフトバンク	—	3.4	4,957
エヌ・ティ・ティ・データ	—	3.3	6,220
ソフトバンクグループ	2.6	1.8	10,522
卸売業 (4.3%)			
コマダホールディングス	—	3.6	8,460
フーディソン	—	2	6,010
松田産業	0.2	—	—
伊藤忠商事	3	3.2	12,905
三菱商事	3.7	2.1	8,977
ミスミグループ本社	3.2	—	—
小売業 (8.8%)			
J. フロント リテイリング	—	5.5	6,050
ウエルシアホールディングス	0.5	1.5	4,311
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	3	4,416
セブン&アイ・ホールディングス	0.9	—	—
FOOD & LIFE COMPANIES	1.3	2.4	7,224
HYUGA PRIMARY CARE	2	0.5	2,800
h.v. / パピフィック・インターナショナルホールディングス	—	5.8	13,311
サイゼリヤ	—	2.7	8,491
交換できるくん	0.1	2.1	8,935
ブックオフグループホールディングス	—	3.7	4,181
ニトリホールディングス	—	0.9	14,931
銀行業 (7.6%)			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	33.9	29.5	27,995
三井住友フィナンシャルグループ	5.2	4.4	24,468
ふくおかフィナンシャルグループ	2.3	4.1	12,525
証券、商品先物取引業 (-%)			
ジャフコ グループ	0.8	—	—
保険業 (2.5%)			
ライフネット生命保険	—	6.4	7,040
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3.7	1.5	6,279
第一生命ホールディングス	7.7	2.7	8,058

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
その他金融業 (0.5%)			
日本リビング保証	—	2.2	4,505
オリックス	5.4	—	—
不動産業 (1.6%)			
オープンハウスグループ	0.1	—	—
アグレ都市デザイン	0.1	—	—
アズーム	0.6	2.2	10,659
三井不動産	2.2	1.3	2,921
東京建物	6.3	—	—
カチタス	0.8	—	—
サービス業 (5.1%)			
日本M&Aセンターホールディングス	0.4	—	—
UTグループ	1.2	—	—
ディップ	—	2.4	8,688
エムスリー	—	2.8	10,046
タカミヤ	—	9.2	3,321
ジャパンベストレスキューシステム	5.8	—	—
ラウンドワン	9.3	—	—
リソー教育	2	—	—
サイバーエージェント	1.8	—	—
Keeper 技研	0.5	1.7	5,610
リクルートホールディングス	2.6	—	—
エアトリ	0.5	—	—
インソース	—	6.4	9,638
ペイカレント・コンサルティング	0.1	1.2	6,156
LITALICO	1.3	—	—
リベロ	0.6	—	—
合 計	株 数	千株	千円
	・ 金 額	322.5	326.8
	銘柄数<比率>	106銘柄	99銘柄
			850,936
			<95.8%>

(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

2023年1月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 850,936	% 94.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	47,587	5.3
投 資 信 託 財 産 総 額	898,523	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

(2023年1月16日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	898,523,724円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	36,095,942
株 式(評価額)	850,936,010
未 収 入 金	9,490,072
未 収 配 当 金	566,700
差 入 委 託 証 拠 金	1,435,000
(B) 負 債	10,610,784
未 払 金	10,610,784
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	887,912,940
元 本	118,862,956
次 期 繰 越 損 益 金	769,049,984
(D) 受 益 権 総 口 数	118,862,956口
1万口当たり基準価額(C/D)	74,701円

(注1) 期首元本額 135,454,187円
 追加設定元本額 0円
 一部解約元本額 16,591,231円
 (注2) 期末における元本の内訳
 きらめきジャパン 118,862,956円
 期末元本合計 118,862,956円

■損益の状況

当期 自2022年1月18日 至2023年1月16日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	20,837,538円
受 取 配 当 金	20,848,781
受 取 利 息	236
そ の 他 収 益 金	877
支 払 利 息	△12,356
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△64,519,635
売 買 益	111,161,640
売 買 損	△175,681,275
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△4,790,730
取 引 益	8,793,780
取 引 損	△13,584,510
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△48,472,827
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	925,731,580
(F) 解 約 差 損 益 金	△108,208,769
(G) 合 計(D+E+F)	769,049,984
次 期 繰 越 損 益 金(G)	769,049,984

(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。