

運用報告書 (全体版)

第52期<決算日2022年3月10日>

MHAMスリーウェイオープン

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/資産複合	
信託期間	1993年11月26日から無期限です。	
運用方針	わが国の株式、債券および短期金融資産に分散投資し、資産の組入比率の変更を原則としてタクティカル・アセット・アロケーション・モデルの指示により機動的に行い、信託財産の安定的な成長を目指します。	
主要投資対象	MHAMスリーウェイオープン	わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている株式・公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。なお、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券を組入れることもあります。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
運用方法	3資産（株式・債券・短期金融資産）の組入比率を機動的に変更し、様々な景気・金利局面において適切な資産配分を目指します。株式の組入れは、信託財産の純資産総額の30%を上限とします。債券運用部分は債券市場全体の動きに沿った投資成果を目指します。有価証券の組入比率を変動させる場合、有価証券先物取引等も利用します。	
組入制限	MHAMスリーウェイオープン	株式（新株引受権証券を含む。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎年原則として3月10日および9月10日に決算を行い、配当等収益のほかに売買益等の中から運用実績に応じて分配を行います。収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。※分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

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、「MHAMスリーウェイオープン」は、2022年3月10日に第52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/>

MHAMスリーウェイオープン

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指標			東証株価指数(TOPIX、配当込み)		NOMURA-BPI総合		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配) 税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率							
48期(2020年3月10日)	円	円	%	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
49期(2020年9月10日)	10,083	0	△1.8	15,179.59	△1.8	2,147.07	△8.6	392.66	△0.7	17.9	△2.6	57.8	△55.1	8,120	
50期(2021年3月10日)	10,158	20	0.9	15,424.97	1.6	2,513.93	17.1	386.72	△1.5	19.4	1.3	60.2	9.6	7,877	
51期(2021年9月10日)	10,387	100	3.2	15,784.20	2.3	3,000.94	19.4	384.66	△0.5	25.5	△13.2	56.3	△51.6	7,908	
52期(2022年3月10日)	10,557	10	1.7	16,069.46	1.8	3,306.07	10.2	387.92	0.8	23.9	4.2	57.0	11.6	7,839	
52期(2022年3月10日)	10,130	0	△4.0	15,671.17	△2.5	2,921.72	△11.6	382.02	△1.5	22.2	△7.1	47.4	△36.4	7,436	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは、国内株式運用部分についてマザーファンドを組入れることがありますので、「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。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 参考指標は、東証株価指数(TOPIX、配当込み)を15%、NOMURA-BPI総合を50%、短期金融資産(無担保コール翌日物金利)を35%で合成したものを、設定日の前営業日(1993年11月25日)を10,000として指数化したものです。なお、東証株価指数(TOPIX、配当込み)については、2021年7月1日までは東証株価指数(TOPIX)、2021年7月2日以降は東証株価指数(TOPIX、配当込み)のデータを使用しています(以下同じ)。

(注6) 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)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・ノウハウおよびTOPIXの商標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、保証または販売されるものではなく、(株東京証券取引所)は、ファンドの発行また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7) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している日本の公債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません(以下同じ)。

(注8) △(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		参考指標		東証株価指数(TOPIX、配当込み)		NOMURA-BPI総合		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率						
(期首) 2021年9月10日	円	%	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%	%
9月末	10,557	-	16,069.46	-	3,306.07	-	387.92	-	23.9	4.2	57.0	11.6
10月末	10,473	△0.8	16,001.39	△0.4	3,234.08	△2.2	387.12	△0.2	23.3	4.4	57.4	11.7
11月末	10,400	△1.5	15,961.04	△0.7	3,188.28	△3.6	386.72	△0.3	23.4	△12.1	57.8	15.7
12月末	10,391	△1.6	15,894.37	△1.1	3,073.26	△7.0	387.65	△0.1	19.7	△14.7	58.0	9.9
2022年1月末	10,454	△1.0	15,961.03	△0.7	3,179.28	△3.8	386.84	△0.3	23.4	△6.4	57.7	9.8
2月末	10,225	△3.1	15,789.54	△1.7	3,025.69	△8.5	384.06	△1.0	22.5	△0.5	53.8	2.0
(期末) 2022年3月10日	10,175	△3.6	15,741.67	△2.0	3,012.57	△8.9	382.13	△1.5	23.0	△9.3	53.8	△22.2
2022年3月10日	10,130	△4.0	15,671.17	△2.5	2,921.72	△11.6	382.02	△1.5	22.2	△7.1	47.4	△36.4

(注1) 騰落率は期首比です。

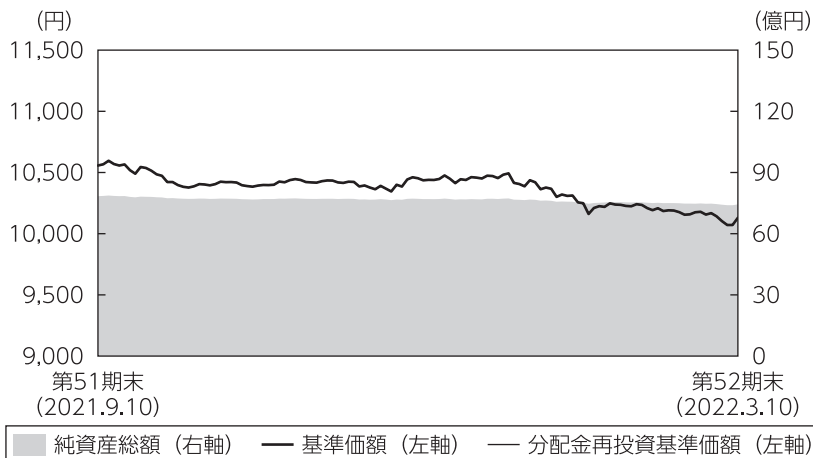
(注2) 当ファンドは、国内株式運用部分についてマザーファンドを組入れることがありますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過 (2021年9月11日から2022年3月10日まで)

基準価額等の推移



第52期首： 10,557円
第52期末： 10,130円
(既払分配金0円)
騰落率： △4.0%
(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

主要投資対象の3資産（国内の株式・公社債・短期金融資産）について、当社独自の定量モデル（TAA（タクティカル・アセット・アロケーション＝戦術的資産配分）モデル）を活用して組入比率の変更を行いました。株式市場が下落したことなどから、基準価額は下落しました。

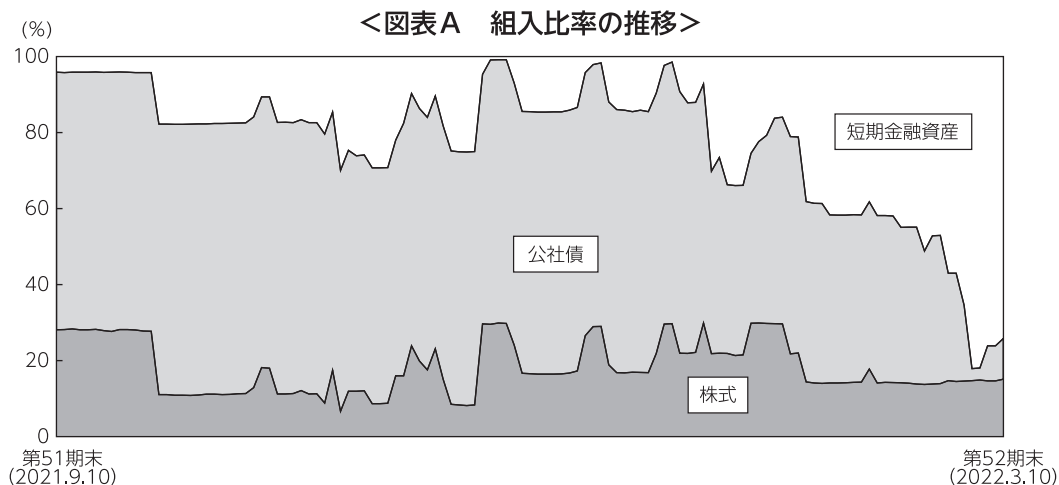
投資環境

国内株式市場は下落しました。世界的なインフレ懸念や新型コロナウイルス変異株の感染拡大、先進国の金融政策正常化への警戒感やウクライナ情勢の悪化などが下落要因となりました。

国内債券市場は下落しました。欧米の中央銀行が金融緩和の縮小もしくはそのペースを速めることを決定し、海外金利が上昇したことや、日銀が物価見通しを引き上げたことで、金融緩和政策を修正するとの思惑が強まったことなどが下落要因となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド



(注) 公社債は、NOMURA-BPI総合のデレージョンを基準に調整を加えた組入比率です。また、短期金融資産については100%から株式および公社債を控除した比率を示しています。

■TAA (タクティカル・アセット・アロケーション=戦術的資産配分) モデルの活用

主要投資対象の3資産について、TAAモデルを活用して組入比率の変更を行いました。当期の3資産の組入比率は、図表Bの月次モデル基本組入比率をベースに、日次モデルによる組入比率調整(株式は±15%、公社債は±50%の範囲で調整)を行い、図表Aのように推移させました。組入比率の変更には、主に先物取引を用いました。

・図表B：当期の月次モデル基本組入比率（単位：％）

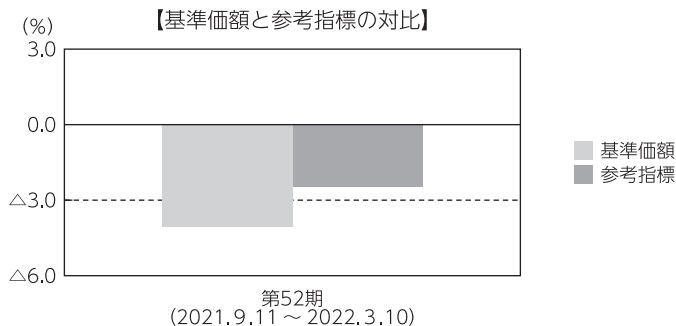
	2021.9月	10月	11月	12月	2022.1月	2月	3月
株 式	13	11	9	17	22	14	15
公 社 債	40	40	30	50	40	30	20
短期金融資産	47	49	61	33	38	56	65

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

ベンチマークであるTOPIX（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指標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

当期の収益分配金は、配当等収益や売買益等の水準、基準価額の水準等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2021年9月11日 ～2022年3月10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	1,105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

原則としてT A Aモデルの指示に基づいて株式・公社債・短期金融資産の組入比率の変更を行う方針です。使用する運用モデルにつきましては、今後も適宜修正・改良を行って参ります。

株式運用部分につきましては、先物に加えて、T O P I X（配当込み）に連動する国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの組入を継続する方針です。

債券運用部分につきましては、債券市場全体の値動きに沿った投資成果を目標として運用を行う方針です。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第52期		項目の概要
	(2021年9月11日 ～2022年3月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	48 円	0.463%	(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10,367円です。
(投信会社)	(23)	(0.218)	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)	(20)	(0.191)	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)	(6)	(0.054)	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	0	0.005	(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)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.005)	
(c) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.001 (0.001)	(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	49	0.469	

(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まず。

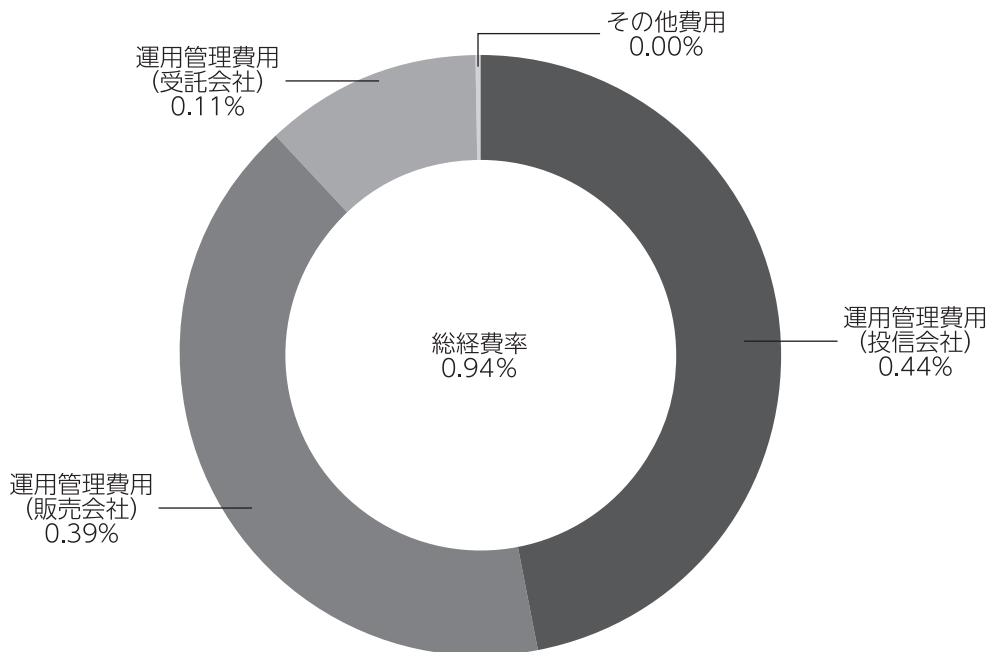
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.94%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。

■売買及び取引の状況 (2021年9月11日から2022年3月10日まで)

(1) 公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 301,134	千円 1,160,587 (-)

(注1) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) () 内は償還による減少分で、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 2,222	百万円 2,472	百万円 7,579	百万円 6,961
	債 券 先 物 取 引	1,668	2,574	5,120	2,412

(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 (2021年9月11日から2022年3月10日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
MHAM TOPIXマザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 1,493	千円 3,763

■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	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	667,386,472千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	403,018,234千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.65

(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 (2021年9月11日から2022年3月10日まで)

【MHAMスリーウェイオープ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	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公 社 債	百万円 301	百万円 -	% -	百万円 1,160	百万円 300	% 25.9
株 式 先 物 取 引	9,184	9,184	100.0	10,052	10,052	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)	366千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	322千円
(B)÷(A)	88.0%

(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。

【MHAM TOP I Xマザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

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	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
株 式 先 物 取 引	百万円 -	百万円 -	% -	百万円 60	百万円 60	% 100.0

平均保有割合 5.9%

(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。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・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	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
株 式	百万円 302,258	百万円 173,610	% 57.4	百万円 365,127	百万円 178,129	% 48.8

平均保有割合 0.4%

(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) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	百万円 2,229	百万円 2,897	百万円 2,394

(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 980

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、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

■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 B B 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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	3,370,000	3,525,231	47.4	—	25.4	14.1	7.9
合 計	3,370,000	3,525,231	47.4	—	25.4	14.1	7.9

(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	当 期			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)		%	千円	千円	
3 2 9 回	利付国庫債券（10年）	0.8000	280,000	283,110	2023/06/20
1 3 7 回	利付国庫債券（5年）	0.1000	300,000	300,732	2023/09/20
3 3 3 回	利付国庫債券（10年）	0.6000	130,000	131,671	2024/03/20
7 1 回	利付国庫債券（20年）	2.2000	200,000	210,136	2024/06/20
7 3 回	利付国庫債券（20年）	2.0000	100,000	105,600	2024/12/20
3 4 2 回	利付国庫債券（10年）	0.1000	600,000	602,532	2026/03/20
9 7 回	利付国庫債券（20年）	2.2000	100,000	112,008	2027/09/20
1 0 0 回	利付国庫債券（20年）	2.2000	140,000	158,221	2028/03/20
1 0 2 回	利付国庫債券（20年）	2.4000	100,000	114,811	2028/06/20
1 0 5 回	利付国庫債券（20年）	2.1000	100,000	113,451	2028/09/20
3 6 4 回	利付国庫債券（10年）	0.1000	100,000	99,343	2031/09/20
1 4 0 回	利付国庫債券（20年）	1.7000	20,000	23,045	2032/09/20
1 4 1 回	利付国庫債券（20年）	1.7000	150,000	173,190	2032/12/20
1 4 2 回	利付国庫債券（20年）	1.8000	100,000	116,512	2032/12/20
1 0 回	利付国庫債券（30年）	1.1000	100,000	109,119	2033/03/20
1 4 5 回	利付国庫債券（20年）	1.7000	100,000	115,839	2033/06/20
1 4 8 回	利付国庫債券（20年）	1.5000	60,000	68,395	2034/03/20
1 5 回	利付国庫債券（30年）	2.5000	100,000	126,124	2034/06/20
1 5 1 回	利付国庫債券（20年）	1.2000	10,000	11,059	2034/12/20
1 5 6 回	利付国庫債券（20年）	0.4000	100,000	99,867	2036/03/20
1 6 7 回	利付国庫債券（20年）	0.5000	100,000	99,308	2038/12/20
1 7 0 回	利付国庫債券（20年）	0.3000	100,000	95,241	2039/09/20
1 7 1 回	利付国庫債券（20年）	0.3000	120,000	114,032	2039/12/20
6 5 回	利付国庫債券（30年）	0.4000	100,000	88,987	2049/12/20
1 2 回	利付国庫債券（40年）	0.5000	60,000	52,894	2059/03/20
合 計		—	3,370,000	3,525,231	—

(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 580
	長期国債	-	2,709

(3) 親投資信託残高

	期首(前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
MHAM TOPIXマザーファンド	千口 1,493	千口 -	千円 -
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	561,857	561,857	1,703,832

■投資信託財産の構成

2022年3月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 3,525,231	% 47.1
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	1,703,832	22.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,249,333	30.1
投 資 信 託 財 産 総 額	7,478,397	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

(2022年3月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	7,477,035,275円
コール・ローン等	2,213,688,793
公 社 債(評価額)	3,525,231,700
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法) ・マザーファンド(評価額)	1,703,832,074
未 収 入 金	4,342,510
未 収 利 息	10,429,925
前 払 費 用	20,273
差 入 委 託 証 拠 金	19,490,000
(B) 負 債	40,153,893
未 払 金	260,770
未 払 解 約 金	4,320,180
未 払 信 託 報 酬	35,509,530
そ の 他 未 払 費 用	63,413
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	7,436,881,382
元 本	7,341,514,895
次 期 繰 越 損 益 金	95,366,487
(D) 受 益 権 総 口 数	7,341,514,895口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	10,130円

■損益の状況

当期 自2021年9月11日 至2022年3月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	18,786,866円
受 取 利 息	18,927,233
支 払 利 息	△140,367
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△305,619,214
売 買 益	5,246,989
売 買 損	△310,866,203
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	12,966,378
取 引 益	119,896,806
取 引 損	△106,930,428
(D) 信 託 報 酬 等	△35,572,943
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)	△309,438,913
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	444,304,983
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△39,499,583
(配 当 等 相 当 額)	(365,681,120)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△405,180,703)
(H) 合 計(E + F + G)	95,366,487
次 期 繰 越 損 益 金(H)	95,366,487
追 加 信 託 差 損 益 金	△39,499,583
(配 当 等 相 当 額)	(365,736,650)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△405,236,233)
分 配 準 備 積 立 金	445,793,653
繰 越 損 益 金	△310,927,583

(注) 期首における元本額は7,425,544,544円、当期中における追加設定元本額は230,074,406円、同解約元本額は314,104,055円です。

(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	1,488,670円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	365,736,650
(d) 分配準備積立金	444,304,983
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	811,530,303
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	1,105.40
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

当期の収益分配金は、配当等収益や売買益等の水準、基準価額の水準等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。

《お知らせ》

■当ファンドの主要投資対象から「MHAM TOPIXマザーファンド」を削除することに伴い、所要の約款変更を行いました。

(2021年12月17日)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第20期（決算日 2022年2月7日）

（計算期間 2021年2月9日～2022年2月7日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第20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	2002年10月30日から無期限です。
運用方針	主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている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。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落 中率			
16期 (2018年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期 (2019年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
18期 (2020年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
19期 (2021年2月8日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
20期 (2022年2月7日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336

(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・ノウハウおよびTOPIXの商標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、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行また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）。

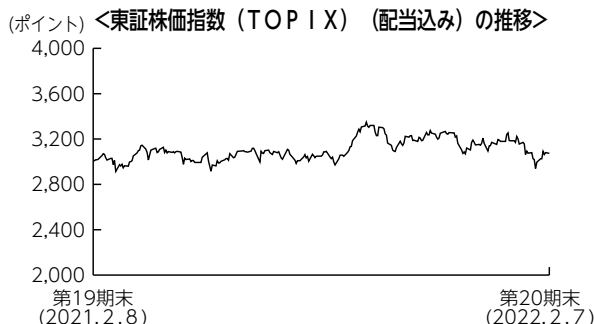
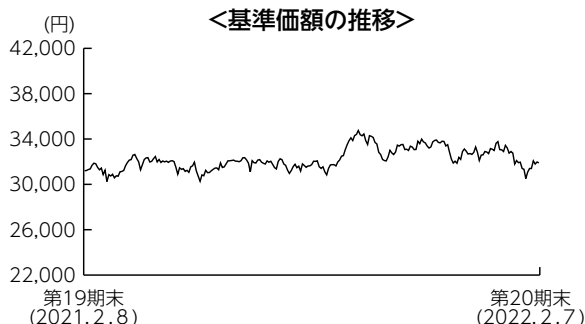
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX) (配当込み) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年 2月 8日	円 31,202	% -	ポイント 3,006.47	% -	% 97.7	% 2.3
2 月 末	30,248	△3.1	2,914.58	△3.1	99.0	1.1
3 月 末	31,972	2.5	3,080.87	2.5	96.2	4.0
4 月 末	31,068	△0.4	2,993.46	△0.4	96.5	3.5
5 月 末	31,493	0.9	3,034.76	0.9	96.6	3.4
6 月 末	31,864	2.1	3,070.81	2.1	96.0	4.0
7 月 末	31,172	△0.1	3,003.91	△0.1	97.2	2.8
8 月 末	32,156	3.1	3,099.08	3.1	97.1	2.9
9 月 末	33,562	7.6	3,234.08	7.6	96.3	3.8
10 月 末	33,082	6.0	3,188.28	6.0	96.8	3.4
11 月 末	31,886	2.2	3,073.26	2.2	84.8	1.0
12 月 末	32,994	5.7	3,179.28	5.7	97.1	3.4
2022年 1 月 末	31,401	0.6	3,025.69	0.6	95.8	4.2
(期 末) 2022年 2月 7日	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5

(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（2021年2月9日から2022年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,896円となり、前期末比で2.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

2021年9月には菅前首相の自民党総裁選への不出馬表明を受けて、新たな政策への期待の高まりから基準価額は上昇しました。その後は、中国不動産開発大手の中国恒大集団の信用リスク懸念、米国での金融引き締めによる金利上昇への警戒感の高まり、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大等を要因として基準価額は下落しました。

投資環境

期初から2021年8月までは、国内の感染状況や米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月には、菅前首相の退陣表明を受けて上昇しました。その後、中国恒大集団の信用リスク懸念や米国の金利上昇などを要因として反落しました。その後も、新型コロナウイルスの感染拡大懸念や金融引き締めへの警戒感の高まりなどを受けて下落する場面もありましたが、期末にかけては好決算銘柄を中心に反発しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

【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	比率
1	電気機器	17.6%
2	情報・通信業	9.2
3	化学	7.3
4	輸送用機器	6.9
5	医薬品	5.6
6	機械	5.6
7	サービス業	5.5
8	銀行業	4.6
9	小売業	4.6
10	卸売業	4.4



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.5%
2	輸送用機器	8.5
3	情報・通信業	7.8
4	化学	6.4
5	サービス業	5.7
6	卸売業	5.5
7	銀行業	5.4
8	機械	5.1
9	医薬品	4.7
10	小売業	4.1

○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	3.0%
2	ソニー	日本・円	2.8
3	ソフトバンクグループ	日本・円	2.7
4	キーエンス	日本・円	2.1
5	任天堂	日本・円	1.3
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.3
7	日本電産	日本・円	1.3
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.3
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	日本電信電話	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,183銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.3%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.0
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
5	リクルートホールディングス	日本・円	1.5
6	東京エレクトロン	日本・円	1.3
7	日本電信電話	日本・円	1.3
8	任天堂	日本・円	1.2
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,174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2.2%上昇しました。

当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマーク沿ったパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 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)	1円 (0) (0)	0.002% (0.001) (0.001)	(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	1	0.002	
期中の平均基準価額は32,238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 (2021年2月9日から2022年2月7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
		192,672.8 (6,584.913)	479,219,336 (-)	161,731.513	395,856,402

(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 144,564	百万円 142,625	百万円 -	百万円 -

(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	875,075,739千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	369,108,651千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	2.37

(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（2021年2月9日から2022年2月7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 479,219	百万円 130,245	% 27.2	百万円 395,856	百万円 59,442	% 15.0

(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 3,678	百万円 3,163	百万円 3,133

(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 1,300

(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)	7,278千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	148千円
(B) / (A)	2.0%

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、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額	
水産・農林業 (0.1%)		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
極洋	5.4	7.2	22,224				矢作建設工業	16.7	20.5	15,641	DM三井製糖ホールディングス	9.5	13.7	27,578							
日本水産	148.6	199.7	103,844				ビーエス三菱	12.2	15.4	9,548	塩水海精糖	14.4	19.9	4,258							
マルハニチロ	25.2	31.4	78,468				日本ハウスホールディングス	25.6	31.7	14,360	日新製糖	4.5	7.6	13,148							
雪国まいたけ	9.9	14.8	17,863				大東建託	40.5	47.2	636,256	森永製菓	27.8	34.8	128,412							
カネコ種苗	4.6	4.9	7,408				新日本建設	15.9	19.9	15,004	中村屋	2.5	2.6	8,710							
サカタのタネ	19.2	24	78,600				N I P P O	30.8	—	—	江崎グリコ	32.7	40.7	153,846							
ホクト	13.6	17	33,320				東亜道路工業	2.4	2.6	13,052	名糖産業	5.6	6.9	11,460							
ホクリヨウ	2.3	3.4	2,363				日本道路	3.6	4.6	38,180	井村屋グループ	6.8	8.6	19,169							
鉱業 (0.3%)							東亜建設工業	9.9	11.5	27,933	不二家	7.6	8.5	19,371							
住石ホールディングス	27.8	35.1	4,773				日本国土開発	36.3	45.5	24,115	山崎製パン	89	110.7	179,887							
日鉄鉱業	3.7	4.6	28,474				若築建設	6.7	7.7	13,213	第一屋製パン	2.9	3.5	1,858							
三井松島ホールディングス	6.7	8.3	12,640				東洋建設	41.6	51.7	29,882	モロゾフ	1.7	3.7	10,175							
I N P E X	590.1	800.9	940,256				五洋建設	157.5	182.7	116,745	寿スビリッツ	11.4	14.3	78,364							
石油資源開発	21	23.5	66,951				世紀東急工業	17.9	22.4	18,256	カルビー	54.1	67.3	164,817							
K&Oエナジーグループ	7.7	9.9	15,246				福田組	4.3	5	21,950	森永乳業	21.9	27.4	149,604							
建設業 (2.3%)							住友林業	87.2	118	240,602	六甲バター	8	11	16,280							
ヒノキヤグループ	4	4.5	9,292				日本基礎技術	11.7	12.7	7,975	ヤグルト本社	81.6	109.4	633,422							
ショーボンドホールディングス	22.9	28.5	143,925				巴コーポレーション	16.8	20.7	10,060	明治ホールディングス	78.5	97.6	704,676							
ミライト・ホールディングス	55.7	64.4	121,265				大和ハウス工業	342.4	425.6	1,442,358	雪印メグミルク	28.6	35.6	73,407							
タマホーム	9.7	12.1	29,717				ライト工業	21.3	29	53,679	プリマハム	16.8	18.6	44,807							
サンヨーホームズ	2.2	2.5	1,827				積水ハウス	402.2	500	1,164,500	日本ハム	45.4	56.5	237,865							
日本アーク	6.4	8.1	5,070				日特建設	9.9	9.8	6,997	林兼産業	3.6	3.8	1,919							
ファーストコーポレーション	4.9	6.4	4,454				北陸電気工事	6.6	9.8	8,065	丸大食品	11.8	14.8	22,555							
ベステラ	3	4	5,024				ユアテック	21.3	26.5	18,470	S Foods	10.7	13.3	43,424							
Robot Home	29.9	33.3	7,425				日本リーテック	7.7	9.6	13,468	柿安本店	4.1	5.2	13,577							
キャンディル	2.8	3.8	1,862				四電工	1.7	5.2	8,361	伊藤ハム&ポークホールディングス	76.7	95.7	64,310							
スペースリョーホールディングス	19.6	—	—				中電工	17.1	21.3	45,219	サッポロホールディングス	40.5	50.4	112,644							
ダイセキ環境ソリューション	3.1	3.9	4,555				関電工	60.4	75.2	65,424	アサヒグループホールディングス	259.3	347.2	1,656,144							
第一カッター興業	4	5.1	7,063				きんでん	80.2	103.1	166,506	キリンホールディングス	503.3	542.4	1,020,796							
安藤・間	102.9	99.1	86,514				東京エネシス	12.3	15.5	15,035	宝ホールディングス	87.9	100.4	111,845							
東急建設	47	58.5	40,131				トーエネック	3.8	4.7	15,110	オノンホールディングス	34.2	43	14,534							
コムシスホールディングス	56.9	64.4	175,683				住友電設	10.5	11.5	25,587	養命酒製造	4	5.1	8,981							
ビーアールホールディングス	19	27.1	9,674				日本電設工業	20.4	25.4	37,134	コトヨシキチホールディングス	90.8	103.7	141,757							
福山コンストラクショングループ	10.1	12.6	25,263				エクシオグループ	56.2	69.8	162,424	サントリー食品インターナショナル	79.5	98.7	443,163							
東建コーポレーション	4.9	5.5	50,655				新日本空調	9.8	12.2	24,790	ダイドールホールディングス	6.7	7.7	37,345							
ソネック	1.7	2.3	2,366				九電工	26.1	35.6	109,470	伊藤園	36.1	45	279,900							
ヤマウラ	7.2	10.3	10,186				三機工業	26.3	30.2	42,823	キーコーヒー	11.8	14.8	30,532							
オリエンタル白石	—	67.8	16,339				日揮ホールディングス	123.6	141.9	160,914	ユニカフェ	3.9	5	4,790							
大成建設	115.4	133.2	508,158				中外炉工業	4.1	4.7	7,562	ジャパンフーズ	1.5	1.7	2,050							
大林組	370.8	460.9	434,167				ヤマト	11.9	13.8	9,784	日清オйлグループ	15.3	18.7	56,287							
清水建設	347.3	431.8	338,099				太平電業	8.2	10.4	28,797	不二製油グループ本社	29	32	74,560							
飛鳥建設	10.5	12.3	13,161				高砂熱学工業	33.5	41.7	79,104	かどや製油	1	1.1	4,411							
長谷工コーポレーション	121.3	137.3	200,183				三晃金属工業	1.6	1.7	4,236	Jーオイルミルズ	5.6	14.2	24,026							
松井建設	14.7	18.4	13,082				朝日工業社	2.1	3.3	9,543	キッコーマン	85.4	106.3	932,251							
鹿高組	1.2	1.7	6,834				大気社	24.1	29.9	20,989	味の素	282.3	325.9	1,055,590							
鹿島建設	271.6	337.9	465,964				明星工業	18	22.6	63,777	ブルドックソース	—	6.4	12,524							
不動テトラ	9.1	9.8	15,278				ダイダイン	8.2	10.3	23,257	キュービー	66	77.6	186,007							
大東建設	4.9	5	6,680				日比谷総合設備	12.2	14.9	28,161	ハウス食品グループ本社	44.4	55.3	161,531							
鉄建建設	7.5	10.3	18,797				フィル・カンパニー	2.1	2.8	3,166	カゴメ	48.5	56	161,840							
西松建設	26.5	28	104,580				テスホールディングス	—	8.5	11,313	焼津水産化学工業	4.8	5.1	4,625							
三井住友建設	89.4	103.8	44,426				インフロエ・ホールディングス	—	196.5	207,111	アリアケジャパン	10.9	13.5	77,625							
大豊建設	8.1	6.8	25,092				OS J Bホールディングス	54.1	—	—	ビエトロ	1.2	1.2	2,152							
前田建設工業	92.9	—	—				東洋エンジニアリング	15.4	19.4	12,959	エバラ食品工業	2.4	2.5	7,075							
佐田建設	6.7	10.2	4,773				レイズネクスト	20	22.6	25,515	やまみ	1.1	1.7	3,010							
ナカノフード建設	9.7	10.9	3,738				食料品 (3.4%)				ニチレイ	56.5	67.3	176,056							
奥村組	20.4	27.1	86,584				ニッポン	35	43.5	72,949	東洋水産	61	71	342,220							
東鉄工業	16	21.5	52,481				日清製粉グループ本社	134.1	167	273,212	イートランドホールディングス	4.2	5.7	13,110							
イチケン	2.7	3.5	6,594				日東富士製粉	0.6	1.6	6,392	大冷	1.5	2	3,816							
富士ビー・エス	5	5.9	2,891				昭和産業	10.1	14.3	38,181	ソシム・フード・ホールディングス	6.7	7.9	4,005							
浅沼組	4.4	5.2	28,132				鳥越製粉	10.8	13.7	8,863	日清食品ホールディングス	46.5	57.9	518,784							
戸田建設	154.1	191.4	142,401				中部飼料	14.6	16.7	16,983	永谷園ホールディングス	6	6.9	13,461							
熊谷組	17.1	23.5	69,842				フィード・ワン	16.2	20.2	14,503	一正蒲鉾	4	6.2	4,811							
北野建設	1.9	2.9	6,194				東洋精糖	1.7	1.8	1,845	フジッコ	13	13.8	26,896							
榎木組	1.6	4.1	6,076				日本甜菜製糖	6.4	8.1	13,737	ロック・フィールド	12.8	16	24,704							

銘柄	期首(前期末)		当期		株数	株数	評価額	銘柄	期首(前期末)		当期		株数	株数	評価額	銘柄	期首(前期末)		当期																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																									
	株数	千株	千株	千円					株数	株数	株数	千株					千株	千株	千円	株数	株数	株数	千株	千株	千株	千円																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																		
日本たばこ産業	636.5	791.4	1,851,876	共和レザー	6.8	9.2	6,127	トリケミカル研究所	9.8	14.9	44,342	ケンコーマヨネーズ	7.3	8.5	11,517	昭和電工	87.9	124.8	297,398	ADEKA	53.3	66.3	167,473	くわばや日洋ホールディングス	7.8	9.6	18,240	住友化学	911.2	1,057.7	619,812	日油	43.6	49.2	252,888	なとり	6.9	8.1	16,200	住友精化	5.7	6.4	21,184	新日本理化	19	23.6	5,923	イフジ産業	2.3	2.5	2,350	日産化学	63.9	78.4	516,656	ハリマ化成グループ	8.7	11	8,987	ビッグルスコーポレーション	2.8	7.2	11,419	ラサ工業	3.8	5	8,095	花王	283.1	325.3	1,709,126	ファーマフーズ	-	14	22,848	クレハ	9.9	11.5	103,960	第一工業製薬	3.9	5.4	15,660	ユーグレナ	51.2	75	54,750	多木化学	4.5	5.6	29,400	石原ケミカル	3	7.5	9,915	紀文食品	-	8.6	8,187	テイカ	8.4	10.8	14,850	日華化学	4.3	5	4,015	ミヨシ油脂	4.4	6.2	6,869	石原産業	20.6	23.8	27,631	ニイタカ	2.4	3	6,849	理研ビタミン	11.2	15.4	26,257	片倉コープアグリ	2.4	2.5	2,875	三洋化成工業	6.9	8.6	44,118	織維製品 (0.5%)	片倉工業	15.6	13.8	33,092	日本書達	16.2	18.4	63,204	有機合成薬品工業	9.2	10.3	2,811	グンゼ	8.5	9.6	37,008	東ソー	178.9	207.7	396,083	大日本塗料	13.2	17.8	14,453	東洋紡	45.8	56.9	74,254	トクヤマ	34.3	46	90,666	日本ペイントホールディングス	95.5	541.2	459,478	ユニチカ	33.8	39.2	11,956	セントラル硝子	22	23.5	49,514	関西ペイント	130.1	149.3	342,792	富士紡ホールディングス	5.6	6.4	24,288	東亜合成	70.7	80.1	90,352	神東塗料	9.3	10	1,540	倉敷紡績	10.7	12.3	23,579	大阪ソーダ	11.9	13.5	40,567	中国塗料	27.9	34	30,668	シキボウ	6.6	7.9	7,244	関東電化工業	27.3	31.6	34,033	日本特殊塗料	8.7	10.9	9,156	日本毛織	38.1	43.4	38,929	デンカ	42.2	52.4	190,474	藤倉化成	16	18.3	8,820	ダイトウボウ	19.3	23.8	2,118	信越化学工業	214.1	247.4	4,693,178	太陽ホールディングス	8.5	21.2	68,158	トア紡コーポレーション	4.1	4.3	1,754	日本カーバイド工業	4.2	5.2	7,082	DIC	48.9	60.9	182,517	ダイドーミテッド	16.6	20.5	2,870	堺化学工業	8.1	10	20,310	サカタククス	25.3	28.7	28,183	帝国繊維	13	16.3	32,811	第一稀元素化学工業	11.7	13.4	15,276	東ネックスCホールディングス	9.5	30.5	58,712	帯人	109	135.4	187,393	エア・ウォーター	118.1	136.2	238,350	T&K TOKA	24.1	11.7	10,120	東レ	838.4	1,042.5	699,309	日本薬研ホールディングス	95.3	138.5	316,195	富士フィルムホールディングス	207.8	258.5	1,967,702	サカイオーベックス	3.1	-	-	資生堂	235	273.9	1,642,578	住江織物	2.1	3.4	6,504	東邦アセチレン	1.9	2.6	3,302	ライオン	153.7	177.6	268,708	日本フェルト	5.5	5.9	2,643	日本パーカライジング	58.4	72.6	74,632	高砂香料工業	7.4	10.3	28,953	イチカワ	1.3	1.4	1,937	高圧ガス工業	18.5	23.1	17,278	マンダム	24.7	30.9	39,644	日東製網	1.3	1.7	2,459	チタン工業	1.5	1.7	2,774	ミルボン	15.8	18.3	99,735	アツギ	9.3	11.5	6,704	四国化成工業	15.5	19	26,600	ファンゲル	43	59.6	185,356	ダイニック	3.6	3.8	2,728	戸田工業	2.4	3.2	9,968	コーセー	22.2	27.7	304,146	セーレン	28.5	29.6	61,952	ステラ ケミファ	6.3	7.2	17,978	コタ	7	9.4	14,720	ソト	4	6.2	5,139	保土谷化学工業	3.4	4.6	24,012	シーボン	1.3	1.4	2,525	東海染工	1.3	1.4	1,605	日本触媒	21	24.2	144,716	ポレラ・オルビスホールディングス	50.5	62.8	108,895	小松マテール	19.1	23.6	29,877	大日精化工業	9.6	12	27,108	ノビアホールディングス	10	12.6	63,252	ワコールホールディングス	28.9	35.9	73,738	カネカ	30	37.3	145,843	アジパルホールディングス	3	3.5	3,846	ホギメディカル	15.6	19.5	61,425	三菱瓦斯化学	116	133.8	285,529	新日本製薬	2.4	4	5,300	クラウディアホールディングス	2.4	2.5	590	三井化学	100	130.8	397,632	エステー	7.7	9.5	14,601	T S Iホールディングス	34.7	47.9	15,807	J S R	116.2	134.4	463,680	アグロ カネシヨウ	4.5	5	6,515	マツカコーポレーション	3.7	4.6	5,409	東京応化工業	19.9	23.3	147,955	コニシ	19.5	24.1	38,222	ワールド	15.1	18.9	22,264	大阪有機化学工業	10.7	12.2	36,429	長谷川香料	20.5	25.5	61,786	三陽商会	6	6.9	5,954	三菱ケミカルホールディングス	774.1	962.6	807,910	星光PMC	6.9	8.6	5,633	ナイガイ	3.8	4.1	1,160	K Hネオケム	19.1	23.7	72,640	小林製薬	33.1	41.3	391,111	オンワードホールディングス	69.3	86.3	25,631	ダイセル	155.5	207.2	181,507	荒川化学工業	9.9	12.3	13,849	ルックホールディングス	4	4.6	6,076	住友ベークライト	18.2	22.8	121,752	メック	8.1	11	33,880	キムラタン	68.3	79.9	1,518	積水化学工業	244.9	301.3	583,618	日本高純度化学	3.3	4.1	10,569	ゴールドウイン	19.1	26	158,340	日本ゼオン	104.5	129.8	175,489	タカラバイオ	31	38.5	88,280	デサント	19.8	28.1	97,085	アイカ工業	32.2	40.1	127,317	JCU	13.3	16.6	75,613	キング	4.6	6.7	3,463	宇部興産	58.4	67.8	147,058	新田セラチン	7.7	9.3	6,045	ヤマインターナショナル	10.6	13.3	3,790	積水樹脂	19.1	21.9	43,843	O A Tアグリオ	2.3	3.2	6,425	パルパ・紙 (0.2%)	特種東海製紙	7.2	8.9	37,291	タキロンシーアイ	25.2	31.4	17,552	デクセラアルズ	33	38.2	118,420	王子ホールディングス	521.3	602.3	363,789	旭有機材	6.6	8.1	17,528	アース製薬	8.9	12.1	71,027	日本製紙	51.1	69	81,213	ニチバン	6.2	8.6	14,852	北興化学工業	10.9	13.8	10,874	三菱製紙	17.1	21.3	6,794	リケンテクノス	28.2	35.4	16,142	大成ラミック	3.7	4.6	12,962	北越コーポレーション	82.9	94.7	74,244	大倉工業	5.5	7.5	15,037	クミアイ化学工業	48.8	54.8	44,223	中越パルプ工業	4.7	5.6	5,538	積水化成工業	15.6	19.6	8,800	日本農業	21.2	26.4	14,018	巴川製紙所	3.7	4.6	3,762	群栄化学工業	2.2	3.5	12,075	アキレス	8.2	9.4	11,637	大王製紙	56	69.6	133,284	タイガースポリマー	6.7	8.5	3,714	有沢製作所	16.5	21.5	21,414	阿波製紙	3	4	1,324	ミライアル	3.7	4.7	6,974	日東電工	75.7	89	775,190	レンゴ	119.4	136.3	117,763	ダイキアクシス	4.3	5.6	3,925	レック	14	19.1	18,106	トモク	7.2	9	15,849	ダイキョーニシカワ	24.5	30.7	18,696	三光合成	12.4	15.5	5,766	ザ・パック	8.7	11	29,931	竹本容器	4.2	5.3	4,202	きもと	18.9	22.9	4,854	化学 (6.6%)	北の達人コーポレーション	41.4	51.4	11,205	森六ホールディングス	6.3	7.9	15,634	藤森工業	10.6	13.2	54,978	クラレ	182.3	210.4	217,764	恵和	1.7	3.6	18,504	前澤化成工業	7.8	9.5	11,789	旭化成	767.5	954.1	1,064,775	日本化薬	71.6	113.4	132,224	未来工業	4.3	5.5	8,475	扶桑化学工業	9.1	12.9	61,081	ウェーブリンクホールディングス	4	5.6	3,931				J S P	7	8.7	13,685				エフピコ	21.8	27	91,125

銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
三浦工業	50.6	63	207,585	帝国電機製作所	8.3	10.6	13,939	三菱重工業	185.7	231	737,583									
タフマ	39.6	49.2	70,060	東京機械製作所	4.3	-	-	IHI	79.5	91.8	214,353									
ツガミ	24.2	31.9	41,629	新東工業	28.2	32.6	22,689	サノヤホールディングス	15.5	17	2,227									
オークマ	13.6	16.9	81,458	澁谷工業	10.4	12.8	32,256	スター精密	18.2	22.8	33,288									
芝浦機械	12.2	16.5	50,902	アイチコーポレーション	20.5	21.7	17,967	電気機器 (18.0%)												
アマダ	171.2	229.4	251,651	小森コーポレーション	30.1	37.5	26,100	日清紡ホールディングス		72	89.8									
アイダエンジニアリング	30.7	38.2	39,498	鶴見製作所	9.2	11.5	19,630	イビデン		56.8	77.2	465,516								
滝澤鉄工所	3.9	4.8	5,726	住友精密工業	1.9	2.4	4,524	コニカミノルタ	239.4	320.9	159,808									
FUJI	46.6	67	168,103	日本ギア工業	6	6	1,578	ブラザー工業	144.3	179.5	398,490									
牧野フライス製作所	10.7	16	60,320	酒井重工業	1.9	2.7	7,641	ミネベアミツミ	203.7	253.4	676,831									
オーエスジー	57.6	67.3	136,551	荏原製作所	49	61.1	338,494	日立製作所	568.4	707.2	4,163,937									
ダイジェット工業	1	1.1	1,083	石井鐵工所	1.2	1.2	3,584	東芝	-	256.9	1,233,120									
旭ダイヤモンド工業	31	38.3	23,133	西島製作所	12.2	13.5	12,433	三菱電機	1,182.4	1,470.1	2,072,841									
DMG森精機	73.9	86.3	149,557	北越工業	12.4	14	12,600	富士電機		71.2	88.6	526,284								
ソディック	25.6	32.2	25,599	ダイキン工業	150.6	187.4	4,194,949	東洋電機製造		4.7	5.9	5,658								
ディスコ	15.9	21.5	693,375	オルガノ	3.8	4.2	32,550	安川電機	127.3	158.4	760,320									
日東工器	5.7	8.1	13,024	トーヨーカネツ	4.4	5.5	14,069	シニアテクノロジ	15.4	17.7	22,319									
日進工具	4.6	11.6	16,576	栗田工業	64	79.7	379,770	明電舎		20	24.9	61,104								
パンチ工業	9.9	12.2	5,990	榑本チエイン	16.9	19.4	62,856	オリジン		2.6	4	5,032								
富士ダイス	6.4	6.8	4,182	大同工業	4.6	6.7	6,231	山洋電気		5.7	6.6	32,802								
豊和工業	6.5	7.9	6,557	木村化工機	9.8	12.2	9,064	デンヨー		10.1	12.6	21,092								
OKK	4.8	5.6	4,244	アネスト岩田	20	23	18,653	PHCホールディングス		-	16.9	27,124								
石川製作所	3	3.9	5,752	ダイフク	65.1	81	690,930	東芝テック		12.7	16	79,120								
東洋機械金属	8.4	9.9	5,613	サムコ	2.9	3.6	8,067	芝浦メカトロニクス		2.1	2.7	22,464								
津田駒工業	2.4	3.4	1,975	加藤製作所	6.4	6.9	5,837	マブチモーター		32.7	34.1	122,760								
エンシュウ	2.4	3.5	2,289	油研工業	1.7	1.8	3,117	日本産産		284.6	381.1	3,803,759								
島精機製作所	17.1	21.2	37,078	タダノ	57	77	74,998	ユニコム・システム・エレクトロニクス		7	6.6	2,534								
オプトラン	14.6	18.3	42,016	フジテック	40.8	54.6	147,420	トレックス・セミコンダクター		6.4	7.5	19,740								
NCホールディングス	3.1	4.1	6,629	CKD	27.4	43.4	89,317	東光高岳		6	8.2	11,783								
イワキ	7.6	9.4	9,428	キトー	10	12.6	21,256	ダブル・スコープ		23.2	42.3	33,163								
フリュー	11.5	12.8	16,473	平和	32.9	41.1	78,090	ダイヘン		12.9	16.1	64,319								
ヤマシンフィルタ	23.5	29.3	11,221	理想科学工業	9.2	12.3	27,416	ヤーマン		19.3	24	21,456								
日阪製作所	14.8	18.3	15,060	SANKYO	28	31.8	96,513	JVCケンウッド	101.9	119.5	22,346									
やまびこ	22.6	28.3	29,941	日本金銭機械	13.2	15	9,660	ミキエンジニアリング		11	13.3	10,874								
野村マクロ・サイエンス	-	3.9	16,282	マースグループホールディングス	7.6	9.4	15,199	イーPEX		5.5	6.9	11,354								
平田機工	5.5	6.9	39,054	フクシマガリレイ	8.1	10.3	43,105	日新電機		27.7	34.7	50,696								
ベガサスミシン製造	12.2	15	8,565	オーイズミ	5.1	5.4	2,133	大崎電気工業		23.4	26.8	12,810								
マルマエ	4.3	6	14,268	ダイコク電機	5.6	6.9	8,583	オムロン		98.4	122.4	1,006,984								
タツモ	4.9	6.9	9,694	竹内製作所	19.7	22.4	63,212	日東工業		17.3	19.6	30,830								
ナプテスコ	68.9	82.9	290,564	アマノ	31	38.5	84,199	IDEC		15.9	18.3	42,639								
三井海洋開発	12.4	15.5	18,693	JUKI	16.5	20.5	15,723	正興電機製作所		2.7	4.6	4,774								
レオン自動機	11.4	15.6	16,270	サンデン	16.5	20.4	3,957	不二電機工業		2.3	3.4	3,672								
SMC	34.6	43.1	2,754,521	ジャノメ	10.6	12.5	9,062	ジーエス・ユアサ コーポレーション		42.4	47.9	108,733								
ホソカワミクロン	4.1	10.3	29,530	マックス	16.3	19.7	34,947	ザクサホールディングス		2.8	2.9	3,822								
ユニオンツール	4.4	5.5	20,405	グローリー	30.4	37.7	78,755	メルコホールディングス		4.1	3.3	12,490								
オイレ工業	16.5	20.5	33,066	新晃工業	11	13.8	25,267	テクノメディカ		2.8	3.5	5,533								
日精工・エス・ビー機械	3.4	4.9	14,327	大和冷機工業	19	21.2	23,977	ダイキモトシロトリックホールディングス		3.4	4.1	4,374								
サトーホールディングス	15.4	19.3	39,121	セガサミーホールディングス	107.5	145.9	302,158	日本電気		150.2	186.9	949,452								
技研製作所	10.3	12.8	49,792	日本ビストロリング	4.5	5.4	7,225	富士通		106.4	132.4	2,133,626								
日本エアテック	3.8	6.8	7,459	リケン	5.5	6.4	17,299	沖電気工業		47.9	59.8	53,521								
カワタ	3.2	4.7	5,010	T P R	16	19.9	29,631	岩崎通信機		4.4	6.3	5,134								
日精樹脂工業	9.2	10.4	10,649	ツバキ・ナカシマ	22.5	32.2	46,657	電気興業		5.7	7.9	18,264								
オカダアイオン	3.8	4.7	6,909	ホシザキ	37.2	43	373,240	サンケン電気		13.8	13.8	65,274								
ワイエイシイホールディングス	4.6	5.7	7,022	大豊工業	9.8	12	8,592	ナカヨ		1.9	2.2	2,494								
小松製作所	535.7	666.1	1,878,068	日本精工	242.6	276.6	206,620	アイホン		6.8	8.5	18,156								
住友重機械工業	67.6	84.1	249,356	NTN	272.6	314.8	73,348	ルネサスエレクトロニクス		508.7	796.7	1,000,655								
日立建機	55.3	58.9	172,577	ジェイテクト	113.3	140.9	147,663	セイコーエプソン		146.6	182.4	335,980								
日工	17.6	20.4	12,444	不二越	11	12.6	53,109	ワコム		85.5	114	101,688								
巴工業	4.8	5.9	13,044	日本トムソン	32.2	40.2	24,964	アルバック		21.8	29.3	172,870								
井関農機	11.8	13.7	18,303	T H K	73.7	83	233,977	アクセル		4.9	6.3	6,545								
TOWA	11	12.6	30,769	ユーシン精機	7.9	11.7	8,154	EIZO		10	11.5	42,435								
丸山製作所	2.4	3.2	4,793	前澤給装工業	4.2	11.4	11,149	ジャパンディスプレイ		404	500	19,000								
北川鉄工所	5.5	6.8	9,526	イーグル工業	14.7	18.3	19,599	日本信号		27.6	37.5	33,975								
ローツェ	5.2	7.4	75,924	前澤工業	7.3	8.9	5,936	京三製作所		25.4	31.6	13,272								
タカキタ	4.3	5	3,050	日本ビラール工業	12.1	14.9	46,190	能美防災		15.7	19.5	40,540								
クボタ	621.2	712.6	1,707,745	キッツ	36.6	49.7	33,000	ホーチキ		8.6	10.9	13,178								
荏原実業	2.9	6.9	15,035	マキタ	154.2	179	711,883	星和電機		5.9	7.2	3,916								
三菱化工機	3.7	4.7	9,494	三井E&Sホールディングス	45.7	53	19,610	エレコム		13.5	33.7	46,000								
月島機械	21.8	27.3	28,310	日立造船	93.7	124.3	92,354	パナソニック		1,260.9	1,568.1	1,884,072								

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株	数	株	数		株	数	株	数		株	数	株	数
シャープ	千株		千株		カシオ計算機	千株		千株		本田技研工業	千株		千株	
アンリツ	136.8	167.6	208,997		ファナック	103.8	129.1	2,875,057		スズキ	234.4	336.2	1,614,768	
富士通ゼネラル	36.2	39.9	97,994		日本シイエムケイ	25.5	28.9	16,241		S U B A R U	338.8	421.2	847,665	
ソニーグループ	740.6	921.1	11,661,126		エンプラス	5.3	3.6	9,478		安永	5.7	7.2	6,278	
T D K	57.1	213	970,215		大真空	4	19.9	24,297		ヤマハ発動機	167.1	191.9	532,906	
帝国通信工業	5.6	6.7	9,112		ローム	49.2	65.8	604,044		T B K	11.8	16.9	6,929	
タムラ製作所	42.3	56.8	36,749		浜松ホトニクス	84.8	105.5	612,955		エグセディ	16	22.3	37,664	
アルプスアルパイン	96.5	129.9	164,713		三井ハイテック	11.6	14.6	124,100		豊田合成	38.2	47.4	106,507	
池上通信機	4	5	3,215		新光電気工業	39.7	43.2	214,920		菱三工業	18.5	23.1	17,094	
日本電波工業	11.5	13.3	16,651		京セラ	180.2	206.9	1,416,437		盟和産業	1.6	1.7	1,723	
鈴木	5.3	6.8	5,882		太陽誘電	52.5	71.3	377,177		日本プラス	10.3	11.5	6,428	
メイコー	—	12	44,700		村田製作所	347.3	431.9	3,556,264		ヨロズ	10.2	13.9	14,011	
日本トリム	2.5	2.9	8,816		双葉電子工業	20.3	25.1	16,892		エフ・シー・シー	19.3	24	34,248	
ローランド ディー・ジエ	7	8.7	22,985		北陸電気工業	4.6	5.5	6,897		シマノ	44.3	59.1	1,533,054	
フォスター電機	12.4	14.8	11,928		ニチコン	37.1	46.3	55,467		ティ・エス テック	27.4	62.1	97,000	
S M K	3.1	3.5	7,570		日本ケミコン	11.9	14	26,082		ジャムコ	7	8.6	7,146	
ヨコオ	8.7	10.9	28,656		K O A	16.3	22.3	32,290		精密機器 (2.7%)				
ティアク	7.3	23.5	3,125		市光工業	17.6	17.7	9,062		テルモ	362.5	416	1,724,320	
ホンデン	32.2	35.4	42,480		小糸製作所	70.8	80.7	472,095		クリエートメディック	4.2	4.3	4,166	
ヒロセ電機	18.2	22.8	393,984		ミツバ	21.7	27	11,205		日機装	38.2	44.1	37,529	
日本航空電子工業	27	33.7	61,738		S C R E E Nホールディングス	20.5	25.6	288,000		日本エム・ディ・エム	6.8	8.6	13,837	
T O A	14	16	12,432		キャノン電子	10.9	13.7	22,084		島津製作所	152.2	189.3	779,916	
マクセル	23.4	29.3	36,039		キャノン	587.5	730.5	2,043,939		J M S	10	12.3	7,576	
古野電気	15.1	17.4	18,339		リコー	300.7	408.1	400,754		クボテック	3.1	3.3	858	
ユニテホールディングス	3	3.3	11,913		象印マホービン	31.9	39.8	58,625		長野計器	8.5	10.8	14,450	
スミダコーポレーション	10	13.9	13,538		M U T O Hホールディングス	1.2	1.2	2,510		ブイ・テクノロジ	5.5	6.4	21,760	
アイコム	4.9	5.5	12,980		東京エレクトロン	69.3	93.3	5,156,691		東京計器	7.5	9.4	9,559	
リオン	5	5.6	12,280		輸送用機器 (8.7%)				愛知時計電機	1.2	3.7	7,074		
本多通信工業	9.4	11.9	5,712		トヨタ紡織	34.5	60	130,800		インターアクション	5.9	7.5	14,685	
船井電機	13.4	—	—		芦森工業	2.4	2.5	2,242		オーバル	10.7	13.3	3,564	
横河電機	118.3	147.2	274,969		ユニプレス	19.3	21.9	17,936		東京精密	19.9	24.8	112,592	
新元元工業	4.5	5.6	18,900		豊田自動織機	95.7	119.2	1,060,880		マニ	47	58.6	96,865	
アズビル	80	86.2	359,023		モリタホールディングス	19	23.6	29,854		ニコン	180.4	224.5	292,972	
東亜ディーケーケー	6.1	7.6	6,878		三機工業	16.3	20.2	16,846		トプコン	59.5	69.1	102,682	
日本光電工業	48.9	60.9	188,790		デンソー	260.4	323.7	2,751,450		オリンパス	654.2	771.1	1,744,999	
チノー	3.8	4.8	7,862		東海理化電機製作所	31.2	38.8	59,946		理研計器	10.5	12	63,000	
共和電業	13	14.9	5,632		川崎重工業	91.9	107.3	233,055		ダムロン	9.5	11.5	28,911	
日本電子材料	4.3	7.2	16,516		名村造船所	35.7	43.7	8,827		H O Y A	234.6	287	4,439,890	
堀場製作所	23.4	27.3	165,165		日本車輛製造	4.3	5.5	11,900		シード	5.2	6.9	3,608	
アドバンテスト	87.9	109.3	1,007,746		三菱ロジスネクスト	15.7	19.5	19,229		ノーリツ鋼機	10.6	13.2	27,508	
小野測器	4.3	6.9	3,312		近畿車輛	1.6	1.7	1,847		イー・アンド・デイ	9.9	13.4	12,730	
エスピー	10.5	12	24,168		日産自動車	1,394.4	1,733.9	1,038,432		朝日インテック	124.4	161.2	312,728	
キーエンス	11.6	133.2	7,826,832		いすゞ自動車	342.6	461.4	687,947		シチズン時計	149.2	172.1	86,910	
日置電機	5.7	7	44,240		トヨタ自動車	1,197.8	7,450.7	16,954,067		リズム	3.1	4.6	6,026	
シスメックス	92.2	124.4	1,316,774		日野自動車	147.7	183.6	194,616		大研医器	9.5	12	6,324	
日本マイクロニクス	20.6	25.6	38,476		三菱自動車工業	437.1	544.1	171,935		メニコン	18.1	48.8	132,540	
メガチップス	11.9	13.8	57,339		エフテック	8.4	10.3	5,562		シンシア	1.2	1.8	957	
O B A R A G R O U P	7	6.8	22,236		レシップホールディングス	4.6	5.7	3,192		松風	5.5	6.4	12,268	
澤藤電機	1.3	1.8	2,649		G M B	2.2	2.8	2,282		セイコーホールディングス	16.6	20.7	45,602	
原田工業	5	7.5	7,357		ファルテック	2.3	2.9	2,105		ニプロ	88.1	109.6	117,052	
コーセル	14.4	16.3	13,219		武蔵精密工業	26.4	32.7	57,421		その他製品 (2.3%)				
イリソ電子工業	9.9	12.3	52,152		日産車体	17.3	21.7	15,428		中本パックス	3.1	4.2	7,274	
オプテックスグループ	19.4	24	35,256		新明和工業	33.3	41.7	38,072		スノーピーク	7	19.3	44,544	
千代田インテグレ	5.1	6.4	11,936		極東開発工業	20.4	27.3	39,666		バタワンヘッドホールディングス	11.4	28.2	54,538	
アイ・オー・データ機器	4.4	5.5	4,713		トビー工業	9.8	12.1	13,467		トランザクション	6.4	8.1	8,245	
レーザーテック	51.9	64.5	1,435,447		ティラド	3.7	4.2	11,919		粧美堂	3	5	2,065	
スタンレー電気	82.9	102.8	274,064		曙ブレーキ工業	64.1	80.6	13,863		二ホンフラッシュ	10.1	12.6	13,393	
岩崎電気	4.3	5.4	12,144		タチエス	18.1	25.7	31,122		前田工織	13	16.3	51,426	
ウシオ電機	60.6	75.3	1,397,079		N O K	57.2	71.2	91,207		永大産業	16.8	20.5	6,293	
岡谷電機産業	8.9	9.3	2,929		フタバ産業	29.6	36.8	15,124		アートネイチャー	11.6	12.7	8,801	
ヘリオス テクノホールディング	11.2	12.9	3,715		K Y B	13.2	15.4	47,124		バンダイナムコホールディングス	97.8	131.8	1,124,385	
エノモト	3.3	4	6,408		大同メタル工業	24.6	28.5	18,126		アイフィスジャパン	3.2	4.3	2,893	
日本セラミック	12	13.8	34,610		プレス工業	58.5	73	27,813		共立印刷	21.9	25.1	3,614	
遠藤照明	6.7	6.9	6,817		ミクニ	16.1	19.6	8,976		S H O E I	10.4	13.9	60,812	
古河電池	8.4	10.7	13,171		太平洋工業	24.8	30.8	33,140		フランスベッドホールディングス	15.4	19.3	17,427	
双信電機	5.8	6.4	3,718		河西工業	16.2	17.7	5,557		パイロットコーポレーション	20.9	24.9	104,829	
山一電機	7.6	10.8	23,630		アイシン	86.5	107.7	487,342		萩原工業	6.7	9.6	11,529	
図研	7.7	9.5	28,376		マツダ	370.8	461.4	406,954		トッパン・フォームズ	21.2	—	—	
日本電子	21.6	30.8	192,500		今仙電機製作所	10.4	9.6	5,712		フジローインダナショナル	24.3	35.7	76,540	

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	千円	株	数	千円		株	数	千円	株	数	千円		株	数	千円	株	数	千円
阿波銀行							プレミアグループ						テーオーシー							
大分銀行							ネットプロダクションホールディングス						東京楽天地							
宮崎銀行							クレディセゾン						レオパレス 2 1							
住信銀行							芙蓉総合リース						スターツコーポレーション							
沖縄銀行							みずほリース						フジ住友							
琉球銀行							東京センチュリー						空港施設							
セブ銀行							日本証券金融						明和地所							
みずほフィナンシャルグループ							アイフル						ゴールドフレスト							
高知銀行							リコーリース						エスリード							
山フィナンシャルグループ							イオンフィナンシャルサービス						日神グループホールディングス							
長野銀行							アコム						日本エスコ							
名古屋銀行							ジャックス						タカラレーベン							
北洋銀行							オリエントコーポレーション						AVANTIA							
愛知銀行							日立キャピタル						イオンモール							
中京銀行							オリックス						毎日コムネット							
大光銀行							三菱HCキャピタル						ファースト住建							
愛媛銀行							九州リースサービス						ランド							
トマト銀行							日本取引所グループ						カチタス							
京葉銀行							イー・キャランティ						トーセイ							
栃木銀行							アサックス						穴吹興産							
北日本銀行							NECキャピタルソリューション						サンフロンティア不動産							
東和銀行							不動産業 (1.9%)						FJネクストホールディングス							
福島銀行							いちご						インテリクス							
大東銀行							日本駐車場開発						ランドビジネス							
トモニホールディングス							スター・マイカ・ホールディングス						サンクスグループ							
フィデアホールディングス							SREホールディングス						グランディハウス							
池田泉州ホールディングス							ADワックスグループ						日本空港ビルデング							
証券・商品先物取引業 (0.8%)							ヒューリック						サービス業 (5.9%)							
F P G							三栄建築設計						明豊ファシリティアワークス							
ジャパンインベストメントアドバイザー							野村不動産ホールディングス						日本工営							
マーキュリアンバースメント							三菱実業グループホールディングス						L I F U L L							
マーキュリアンホールディングス							サムティ						ミクシィ							
S B Iホールディングス							ディア・ライフ						ジェイエイシールグループメント							
日本アジア投資							コーセーアールイー						日興MS&Aセンターホールディングス							
ジャフコ グループ							地主						メンバーズ							
大和証券グループ本社							フルサンスコーポレーション						中広							
野村ホールディングス							T H E グローバル社						U T グループ							
岡三証券グループ							ハウスコム						アイティメディア							
丸三証券							日本管理センター						タケエイ							
東洋証券							サンセイランディック						E・Jホールディングス							
東証証券フィナンシャル・ホールディングス							エストラスト						興銀ビネックスグループ							
光世証券							フージャースホールディングス						コジダカホールディングス							
水戸証券							オープンハウスグループ						アルトナー							
いちよし証券							東急不動産ホールディングス						パソナグループ							
松井証券							協団グループホールディングス						C D S							
マネックスグループ							イーブランド						リングアンドモチベーション							
極東証券							ムゲンエステート						G C A							
岩井コスモホールディングス							ビーロッド						エス・エム・エス							
アイザワ証券グループ							ファーストプラザーズ						サニサイドグループ							
マネーパートナーズグループ							And Doホールディングス						パソナホールディングス							
スパークス・グループ							シーアールイー						リニカル							
小林洋行							プロ/ティエージェンツ						クックパッド							
保険業 (2.3%)							ケイアイスター不動産						エスクリ							
かんぽ生命保険							アグレ都市デザイン						アイ・ケイ・ケイホールディングス							
SOMPOホールディングス							グッドコムアセット						学情							
アニコム ホールディングス							ジェイ・エス・ビー						スタジオアリス							
MS&ADインシュアランスグループホールディングス							テンポイノベーション						ジミックホールディングス							
第一生命ホールディングス							グローバル・リンク・マネジメント						エポコ							
東京海上ホールディングス							フェイスネットワーク						N J S							
T & Dホールディングス							パーク 2 4						総合整備保障							
アドバンスクリエイト							バラカ						カガクコム							
その他金融業 (1.2%)							宮越ホールディングス						アイロムグループ							
全国保証							三井不動産						セントレア・ホールディング							
あんしん保証							三菱地所						サイネックス							
ジェイリース							平和不動産						リネサンス							
イントラスト							東京建物						ディップ							
日本モーゲージサービス							ダイビル						デジタルホールディングス							
C A S A							京阪神ビルディング						新日本科学							
アルヒ							住友不動産						ツクイホールディングス							

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	株 数	株 数	評 価	額		株 数	株 数	評 価	額		株 数	株 数	評 価	額		
		千株		千円			千株		千円			千株		千円		
キャリアデザインセンター		2.5		4,194	リソルホールディングス		0.9		1.6	7,000	プロレド・パートナーズ		1.6		3	2,436
ベネフィット・ワン		41.2		153,548	テクノプロ・ホールディングス		22.5		84.1	295,191	and factory		1		3.3	1,214
エムスリー		199.3		1,042,667	アトラグループ		2.5		2.6	676	テノ・ホールディングス		0.9		2	1,206
ツカガ・グローバルホールディング		9.5		2,380	インターワークス		3.5		4.5	1,687	7フンティア・マネジメント		2		3.6	2,350
プラス		1.5		1,392	アイ・アールジャパンホールディングス		4.6		6.6	32,505	ピアラ		0.6		2.3	1,258
アウトソーシング		64.7		108,514	Keep Per 技研		7.3		9	16,929	ゴブ・ホールディングス		0.6		2.9	3,204
ウエルネット		11.5		6,263	ファーストロジック		2.2		2.9	2,166	ギョクス		1.5		2.6	3,803
ワールドホールディングス		3.9		13,484	三機サービズ		2.3		3	2,907	カーブホールディングス		31		38.7	27,244
ディー・エヌ・エー		47.8		95,783	Gunosy		6.8		8.8	6,274	フォーラムエンジニアリング		5.8		9.9	8,613
博報堂DYホールディングス		157.2		350,124	デザインワン・ジャパン		3.5		3.6	673	FAST FITNESS JAPAN		-		2	4,224
ぐるなび		19.6		8,724	イー・ガーディアン		4.9		5.6	14,795	ダイレクトマーケティングミックス		4.4		15.2	21,964
タカミヤ		14.1		7,128	リブセムス		6.2		8.7	1,400	ポピュラスホールディングス		2.3		3.4	8,493
ジャロバベストレスキューシステム		8.9		8,610	ジャパンマテリアル		34.8		43.2	71,625	L I T A L I C O		-		11.5	35,190
ファンコミュニケーションズ		31.3		13,267	ベクトル		14		19.7	20,448	アドバレッジシステムマネジメント		5.7		7.2	5,184
ライク		3		6,805	ウチヤマホールディングス		5.8		7.4	2,412	リリコグループ		61.7		76.9	158,337
ビジネス・ブレークスルー		5.1		2,304	チャーム・ケア・コーポレーション		8.4		10.6	12,084	東祥		7.1		10.6	16,472
エスグループ		28.9		39,342	キャリアリンク		3.6		5.1	8,573	TREホールディングス		-		19.4	28,731
WDBホールディングス		5.2		18,513	I B J		9.1		11.5	8,728	人・夢・技術グループ		-		5.6	10,102
手間いらず		1.1		8,496	アサンテ		4.1		6.4	10,419	エイチ・エイ・エス		16.4		31.3	64,165
ティア		7.2		3,801	N・フィールド		7.6		-	-	ラックランド		3.2		4.1	11,836
CDG		1.3		1,912	バリュウHR		4.5		5.6	13,904	共立メンテナン		18.7		25	103,875
アドウェイズ		13.7		15,863	M&Aキャピタルパートナーズ		9.3		11.6	55,042	イチネスホールディングス		11.8		14.6	18,804
パリュウ・コマース		7.5		39,032	ライオンシステムホールディングス		4.3		5.4	8,262	建設技術研究所		7.3		8.5	20,102
インフォマート		114.3		97,880	ER Iホールディングス		2.8		4	4,660	スペース		7.7		10.4	9,505
J Pホールディングス		32.6		8,246	アビスト		1.8		2.2	6,435	長 大		4.5		-	-
Eコナックホールディングス		20.7		2,288	ジグマシス・ホールディングス		6.2		8.6	19,049	燦ホーディングス		4.7		6.3	9,714
E P Sホールディングス		15.3		-	ウィルグループ		8.2		10.4	13,176	スバル興業		0.7		0.7	5,537
C Lホールディングス		2.7		3,594	エスコロー・エージェンツ・ジャパン		16.6		18.9	3,553	東京データル		4.6		5.4	6,615
プラステック・インターナショナル		42.2		37,832	メドピア		5.3		10.9	30,498	タナベ経営		2.2		4.8	3,028
アマユーズ		6.2		16,216	レアジョブ		1.6		2.8	2,282	ナガワ		3.6		4.6	43,608
ドリームインキュベータ		3.5		8,088	リクルートホールディングス		809.3		1,083.7	6,140,244	よみうりランド		0.6		-	-
クイック		7		15,801	エラン		15.6		19.4	19,826	東京競馬		7.3		10.7	46,224
T A C		6.3		1,952	土木管理総合試験所		5.7		6.9	2,187	常磐興産		4.7		5.4	7,317
ケネディクス		32.3		-	ネットマーケティング		5.4		6.9	3,029	カナモト		19.9		24.8	57,015
電通グループ		127		605,988	日本郵政		855.3		1,834.3	1,880,157	東京ドーム		44.5		-	-
デアアンドガ・ニーズ		5.2		6,880	ベルシスチーム24ホールディングス		18.9		20.1	28,642	西尾レントオール		10.4		12.9	36,894
びあ		3.2		16,415	鎌倉新書		11.4		16	8,400	アゴラ ホスピタリティ・グループ		71.2		75.2	1,654
イオンファンタジー		4.3		11,718	SMN		2.4		3.4	2,046	トランス・コスモス		10.8		17.9	57,101
シーティーエス		12.6		12,976	一蔵		1.7		2.3	899	乃村工藝社		48.3		60.2	57,671
ネクシースグループ		3.5		3,445	L I T A L I C O		4.6		-	-	藤田観光		4.4		6.2	15,196
H. U. グループホールディングス		31.7		108,411	グローバルケックCOMPANY		2.1		2.7	2,130	KNT-CTホールディングス		6		8.7	12,754
アルプス技研		10		23,347	エアトリ		6.1		9	27,270	日本管財		12.2		15.1	42,083
サンックス		17.7		4,733	アトラエ		3.4		9.8	20,482	トーカイ		11		12.5	22,887
ダイオーズ		2.2		3,475	ストライク		4.2		5.3	21,995	白洋舎		1		1.7	2,050
日本空調サービス		12.2		11,730	ソラスト		27.7		34.5	36,570	セコム		111.3		138.5	1,147,749
オリエンタルランド		120.1		3,474,812	セラク		3.5		4.6	5,602	セントラル警備保障		5.4		6.8	16,109
ダスキン		26.2		89,650	インソース		9.4		13.7	26,112	丹青社		21.1		28.7	20,635
明光ネットワークジャパン		14.2		9,322	ベイカレント・コンサルティング		7.4		9.9	402,435	メイテック		13.8		17	113,900
ファルコホールディングス		5.4		14,048	Orchestra Holdings		2.5		2.8	7,834	応用地質		13.2		16	34,160
秀英予備校		2.8		1,519	アイモバイル		4		4	4,660	船井総研ホールディングス		23.1		28.8	66,643
田谷		1.7		991	キャリアインデックス		4.6		4.8	3,609	進学会ホールディングス		4.9		5.1	1,672
ラウンドワン		38.5		57,310	MS-Japan		4.5		5.7	5,061	オオバ		7.9		10.2	7,405
リゾートトラスト		51.7		123,390	船場		1.6		1.7	1,269	いであ		2.7		3.9	6,953
ビー・エム・エル		14.6		66,339	グレイステクノロジー		5.7		-	-	学究社		3.4		4.7	7,219
ワタベウェディング		1.7		-	ジャロバエンターテインメントホールディングス		32.5		44.5	71,422	ベネットホールディングス		41.4		46.8	106,516
りらいあコミュニケーションズ		17.1		21,917	フルテック		1.8		2.2	2,893	イオンデパート		13.9		17.3	52,332
リソー教育		57.3		26,105	グリーンズ		4.2		5.3	2,501	ナック		5.6		7.4	7,266
早稲田アカデミー		4.4		8,104	ツナグループ・ホールディングス		1.7		3.4	1,030	ダイセキ		18.9		26	127,270
ユー・エス・エス		126.4		299,656	GAMEWITH		3.5		4.3	1,917	ステップ		4.3		5.3	9,481
東京個別指導学院		9.9		7,699	ソウルドアウト		2.7		3.5	3,174						
サイバーエージェント		69.6		508,221	MS&Consulting		1.9		2.4	1,576						
楽天グループ		526.6		705,529	ウエルビー		-		9.1	11,129						
クリーグ・アンド・リバー社		5.8		13,087	エル・ディー・エス		0.8		1.8	4,152						
モーニングスター		12.4		14,424	ミダックホールディングス		2.4		6.2	15,710						
デー・オー・ダブリュー		19.8		7,489	日総工業		8.7		11	8,558						
山田コンサルティンググループ		6.6		8,565	キューベネットホールディングス		5.2		6.6	11,180						
セントラルスポーツ		4.2		12,844	RPAホールディングス		12.8		19.7	7,052						
フルキャストホールディングス		9.8		26,460	スプリックス		3.2		4	5,788						
エン・ジャパン		20.1		66,341	マネジメントソリューションズ		5.5		6.9	22,770						
合計											株数・金額					
											銘柄数<比率>					

(注1) 銘柄柄の()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	額
国内	T O P I X	百万円 10,035		百万円 -

■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 387,140,847		% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,580,070		3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	399,720,917		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

(2022年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	399,670,143,174円
一 般 金 庫	11,420,891,042
株 式 (評 価 額)	387,140,847,090
未 収 入 金	11,243,540
未 収 配 当 金	655,237,202
未 収 委 託 証 拠	441,924,300
(B) 負 債	2,333,527,720
未 払 金	909,720
未 払 解 約 金	2,332,618,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	397,336,615,454
元 本	124,570,625,521
次 期 繰 越 損 益	272,765,989,933
(D) 受 益 権 総 額	124,570,625,521円
1 万 円 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	31,896円

(注1) 期首元本額	102,109,610,506円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	42,977,458円
追加設定元本額	163,175,331,486円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	17,916,384円
一部解約元本額	140,714,316,471円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	15,092,602円
(注2) 期末における元本の内訳		4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	105,875,155円
MHAMスリーウェイオープン	561,857,238円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	985,477円
MHAM TOP I Xオープン	2,725,686,605円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	22,944,960円
MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ)	7,087,968,915円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	23,431,080円
One DC 国内株式インデックスファンド	20,422,344,253円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	21,508,092円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	4,704,569,337円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	14,273,870円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	3,424,028円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	22,637,856円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	23,972,661円	インカム重視マルチアセット運用ファンドI2021-04 (適格機関投資家限定)	193,585,816円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	78,308,323円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05	41,677,610円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	28,249,023円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	84,110,969円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	21,103,225円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-07	68,984,011円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	15,896,115円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-08	47,924,787円
たわらノーロード TOP I X	1,306,069,812円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	22,733,018円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,033,861,326円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-09	49,987,822円
たわらノーロード バランス (堅実型)	40,906,841円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-12	70,694,127円
たわらノーロード バランス (標準型)	262,619,504円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	329,597,803円
たわらノーロード バランス (積極型)	394,664,404円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	34,825,039円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	3,669,806円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	116,640,502円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	174,139,466円	日米兼重マルチアセット運用ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	39,121,859円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	434,342,242円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (FOF5用) (適格機関投資家専用)	7,907,522円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	283,511,087円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	57,045,218円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	405,598,982円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	101,888,672円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	705,164円	DIAM国際分散(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定)	4,956,036円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	2,916,286円	DIAM国際分散(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定)	26,722,846円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	36,588,931円	DIAM国内重視(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定)	5,712,676円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	6,020,593円	DIAM国内重視(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,338,373円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,009,153,068円	DIAM世界(バランス)ファンド40VA (適格機関投資家限定)	7,152,634円
Oneグローバルバランス	5,199,858円	DIAM世界(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定)	34,835,196円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,065,319,872円	DIAM(バランス)ファンド25VA (適格機関投資家限定)	557,427,217円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,512,005,009円	DIAM(バランス)ファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	634,827,723円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,794,173,475円	DIAM(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,809,585,772円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	3,343,318,358円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	31,302,862円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,113,385,483円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	31,388,733円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,115,312,187円	DIAM アサahi グローバル(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定)	301,727,248円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	30,317,366円	DIAM世界アセット(バランス)ファンドVA (適格機関投資家向け)	74,733,048円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,055,563,450円	DIAM世界(バランス)ファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,406,645円
マネックス資産設計ファンド エゴリユーション	18,529,124円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド2VA (適格機関投資家限定)	349,638,985円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	304,544,955円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド40VA (適格機関投資家限定)	20,826,409円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	306,459,778円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド25VA (適格機関投資家限定)	73,311,471円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	545,764,310円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド3VA (適格機関投資家限定)	173,199,524円
投資のソムリエ	13,743,021,171円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド4VA (適格機関投資家限定)	237,769,545円
フルズコントロール	128,837,057円	DIAM世界(バランス)ファンド25VA (適格機関投資家限定)	38,321,734円
投資のソムリエ<DC年金>	831,424,634円	DIAM国内(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定)	18,177,991円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	337,759,108円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド7VA(121) (適格機関投資家限定)	291,737,796円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	549,884,906円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド7VA(130) (適格機関投資家限定)	936,557,239円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,701,235円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド7VA(136) (適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	5,513,567円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	49,936,951円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	559,030,369円	動的パッケージファンド<DC年金>	19,960,341円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,846,898,552円	コア資産形成ファンド	13,478,680円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	41,503,360円	MHAMトピックスファンド	692,612,483円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	20,515,309円	MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用)	65,067,902円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,618,660円	MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定)	2,686,127,829円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	146,712,017円	MHAM日本株式バッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,050,559,819円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	348,653,940円	期末元本合計	124,570,625,521円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,393,008,159円	担保資産	
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	279,145,423円	代用として担保を提供している資産はありません。	

■損益の状況

当期 自2021年2月9日 至2022年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	7,296,744,510円	
	受取配当金	7,292,821,896	
	受取利息	44,549	
	その他の収益	6,677,036	
	支払利息	△2,798,971	
(B)	有価証券売買損益	△7,496,155,473	
	売却益	39,449,298,775	
	売却損	△46,945,454,248	
(C)	先物取引等取引損益	654,522,360	
	取引益	1,686,367,190	
	取引損	△1,031,844,830	
(D)	当期損益金(A+B+C)	455,111,397	
(E)	前期繰越損益金	216,481,029,551	
(F)	解約差損益金	△309,165,756,529	
(G)	追加信託差損益金	364,995,605,514	
(H)	合計(D+E+F+G)	272,765,989,933	
	次期繰越損益金(H)	272,765,989,933	

(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。