

運用報告書 (全体版)

第13期<決算日2020年2月7日>

One DC 国内株式インデックスファンド

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（インデックス型）	
信託期間	2007年9月27日から無期限です。	
運用方針	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要投資対象	One DC 国内株式インデックスファンド	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主要投資対象とします。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	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。
運用方法	最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	毎決算時（原則として2月7日。休業日の場合は翌営業日。）に経費控除後の利子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て、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。	

(旧ファンド名称：DIAM DC 国内株式インデックスファンド)

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、「One DC 国内株式インデックスファンド」は、2020年2月7日に第13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/

One DC 国内株式インデックスファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税込み 分配金		東証株価指数(TOPIX) (配当込み) (ベンチマーク)		株式組入率	株式先物比率	純資産額
		円	騰落率	ポイント	騰落率			
9期 (2016年2月8日)	9,911	円	△1.4	ポイント	%	%	1.7	百万円
10期 (2017年2月7日)	11,107	0	12.1	1,925.17	△1.2	98.2	2.3	11,225
11期 (2018年2月7日)	13,067	0	17.6	2,161.36	12.3	97.6	0.8	13,968
12期 (2019年2月7日)	11,958	0	△8.5	2,547.46	17.9	98.1	1.5	22,544
13期 (2020年2月7日)	13,513	0	13.0	2,334.81	△8.3	98.5	2.4	30,214
				2,642.55	13.2	97.5		37,717

(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) 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、(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)		株式組入率	株式先物比率
	円	騰落率	ポイント	騰落率		
(期首) 2019年2月7日	11,958	—	2,334.81	—	98.5	1.5
2月末	12,255	2.5	2,393.08	2.5	97.7	2.3
3月末	12,264	2.6	2,395.21	2.6	97.0	2.9
4月末	12,466	4.2	2,434.82	4.3	97.4	2.3
5月末	11,654	△2.5	2,275.96	△2.5	97.8	2.2
6月末	11,971	0.1	2,338.89	0.2	97.7	1.9
7月末	12,078	1.0	2,360.18	1.1	98.9	0.8
8月末	11,669	△2.4	2,280.58	△2.3	97.9	1.8
9月末	12,372	3.5	2,418.29	3.6	96.9	3.1
10月末	12,989	8.6	2,539.02	8.7	97.3	2.6
11月末	13,240	10.7	2,588.40	10.9	97.7	2.3
12月末	13,430	12.3	2,625.91	12.5	97.8	1.9
2020年1月末	13,140	9.9	2,569.77	10.1	97.2	2.8
(期末) 2020年2月7日	13,513	13.0	2,642.55	13.2	97.5	2.4

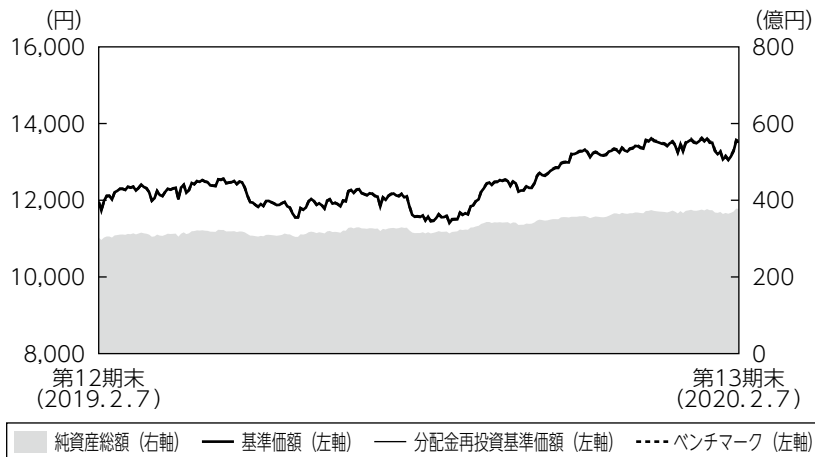
(注1) 騰落率は期首比です。

(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 (2019年2月8日から2020年2月7日まで)

基準価額等の推移



第13期首： 11,958円
第13期末： 13,513円
(既払分配金0円)
騰落率： 13.0%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまが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およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

米中貿易協議の状況次第の相場展開となりましたが、期末にかけては貿易協議が再開し、第1段階の合意に達したことが好感され、国内株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2019年4月までは、米中貿易問題の進展期待などを要因として上昇しました。しかし、5月に入ると世界景気の後退懸念が広がり、反落しました。その後はほぼ横ばいとなりましたが、8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され、下落しました。9月から2020年1月前半までは、欧米の中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどが好感され、上昇しました。期末にかけては、新型コロナウイルス感染拡大が嫌気され、下落する局面がありました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

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比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

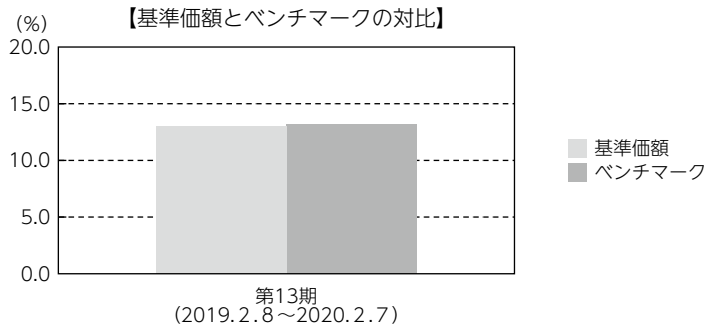
ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

※運用状況については14ページをご参照ください。

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13.2%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.2%下回りました。信託報酬の影響を除くと、ベンチマークにほぼ連動する投資成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、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
	2019年2月8日 ～2020年2月7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	6,394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、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比率を高位に維持します。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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13期		項目の概要
	(2019年2月8日 ～2020年2月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	19円	0.152%	(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12,462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)	(8)	(0.065)	
(販売会社)	(8)	(0.065)	
(受託会社)	(3)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(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)	(0.002)	
(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	19	0.155	

(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す。

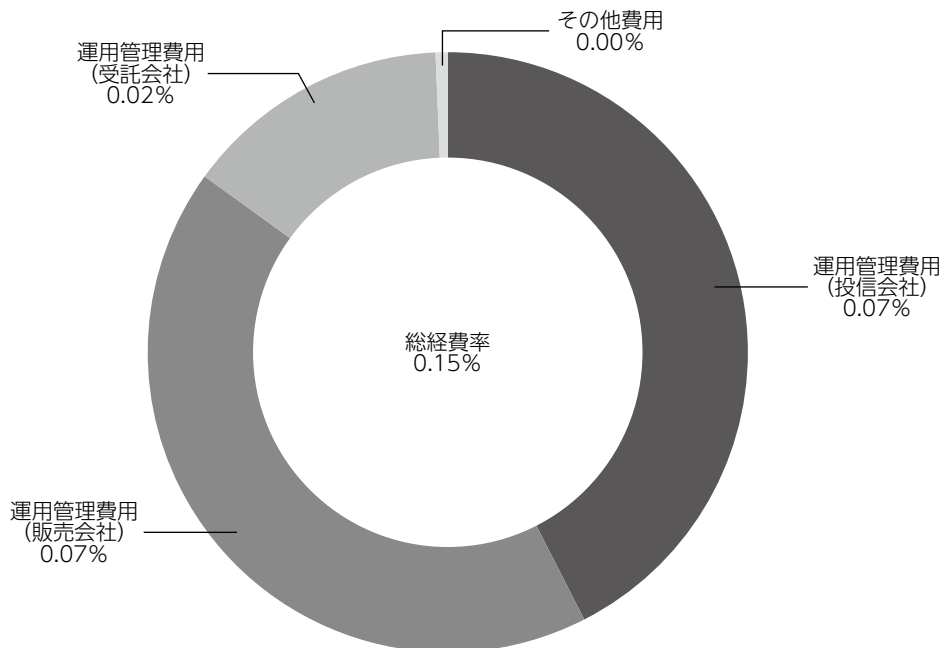
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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0.15%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（2019年2月8日から2020年2月7日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	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	2,525,978	6,356,480	1,243,018	3,189,931

■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	145,863,512千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	254,160,767千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.57

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年2月8日から2020年2月7日まで）

【One DC 国内株式インデックス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

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)	570千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2千円
(B)／(A)	0.4%

(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まず。

【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	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 54,443	百万円 24	% 0.0	百万円 91,420	百万円 5,933	% 6.5

平均保有割合 12.8%

(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		当 期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
株 式	百万円 497	百万円 856	百万円 2,492

(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	期 末 保 有 額
株 式		百万円 98

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、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

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	千□ 12,470,165	千□ 13,753,125	千円 37,715,195

■投資信託財産の構成

2020年2月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	千円 37,715,195	% 99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	188,508	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	37,903,703	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

(2020年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	37,903,703,718円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	188,508,121
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)	37,715,195,597
(B) 負 債	186,318,811
未 払 解 約 金	158,424,584
未 払 信 託 報 酬	27,665,352
そ の 他 未 払 費 用	228,875
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	37,717,384,907
元 本	27,912,059,019
次 期 繰 越 損 益 金	9,805,325,888
(D) 受 益 権 総 口 数	27,912,059,019口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	13,513円

(注) 期首における元本額は25,267,322,187円、当期中における追加設定元本額は10,454,492,002円、同解約元本額は7,809,755,170円です。

■損益の状況

当期 自2019年2月8日 至2020年2月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△66,419円
受 取 利 息	10,872
支 払 利 息	△77,291
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,899,818,697
売 買 益	4,360,827,094
売 買 損	△461,008,397
(C) 信 託 報 酬 等	△53,666,082
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,846,086,196
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△168,870,912
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,128,110,604
(配 当 等 相 当 額)	(14,157,524,018)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△8,029,413,414)
(G) 合 計(D+E+F)	9,805,325,888
次 期 繰 越 損 益 金(G)	9,805,325,888
追 加 信 託 差 損 益 金	6,128,110,604
(配 当 等 相 当 額)	(14,171,772,228)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△8,043,661,624)
分 配 準 備 積 立 金	3,677,215,284

(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	792,893,825円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	823,029,269
(c) 収 益 調 整 金	14,171,772,228
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,061,292,190
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	17,848,987,512
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	6,394.72
(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基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

■信託報酬を年率0.15%（税込み0.162%）に引き下げる所要の約款変更を行いました。

（2019年4月1日）

■信託報酬を年率0.14%（税込み0.154%）に引き下げる所要の約款変更を行いました。

■ファンド名称を「D I A M D C 国内株式インデックスファンド」から「O n e D C 国内株式インデックスファンド」に変更しました。

（2019年10月1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18期（決算日 2020年2月7日）

（計算期間 2019年2月8日～2020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18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	期中 落率	(配当込み) ベンチマーク	期中 落率			
14期 (2016年2月8日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期 (2016年2月8日)	19,981	△1.3	1,925.17	△1.2	98.2	1.7	286,897
15期 (2017年2月7日)	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3	284,249
16期 (2018年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
17期 (2019年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
18期 (2020年2月7日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760

(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）。

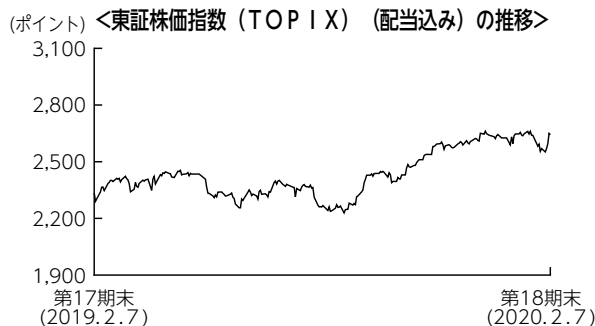
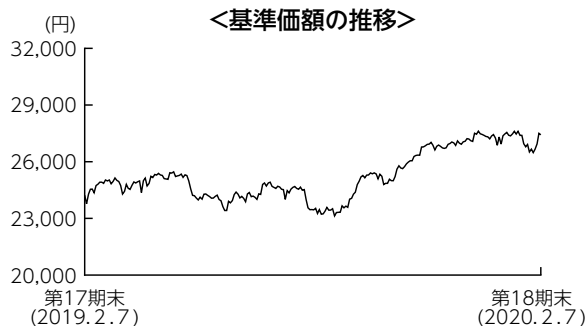
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物比率
	円	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク) ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2019年 2月7日	24,228	% -	2,334.81	% -	% 98.5	% 1.5
2 月 末	24,833	2.5	2,393.08	2.5	97.7	2.3
3 月 末	24,854	2.6	2,395.21	2.6	97.1	2.9
4 月 末	25,266	4.3	2,434.82	4.3	97.4	2.3
5 月 末	23,624	△2.5	2,275.96	△2.5	97.8	2.2
6 月 末	24,269	0.2	2,338.89	0.2	97.7	1.9
7 月 末	24,491	1.1	2,360.18	1.1	98.9	0.8
8 月 末	23,664	△2.3	2,280.58	△2.3	97.9	1.8
9 月 末	25,094	3.6	2,418.29	3.6	96.9	3.1
10 月 末	26,349	8.8	2,539.02	8.7	97.3	2.6
11 月 末	26,861	10.9	2,588.40	10.9	97.7	2.3
12 月 末	27,250	12.5	2,625.91	12.5	97.8	1.9
2020年 1 月 末	26,665	10.1	2,569.77	10.1	97.2	2.8
(期 末) 2020年 2月7日	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4

(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（2019年2月8日から2020年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は27,423円となり、前期末比で13.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米中貿易協議の状況次第の相場展開となりましたが、期末にかけては貿易協議が再開し、第1段階の合意に達したことが好感され、国内株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2019年4月までは、米中貿易問題の進展期待などを要因として上昇しました。しかし、5月に入ると世界景気の後退懸念が広がり、反落しました。その後はほぼ横ばいとなりましたが、8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され、下落しました。9月から2020年1月前半までは、欧米の中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどが好感され、上昇しました。期末にかけては、新型コロナウイルス感染拡大が嫌気され、下落する局面がありました。

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	12.8%
2	情報・通信業	8.2
3	輸送用機器	8.0
4	化学	7.2
5	銀行業	6.3
6	医薬品	5.3
7	卸売業	5.0
8	機械	4.9
9	小売業	4.8
10	サービス業	4.7



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	14.2%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.4
4	化学	6.9
5	医薬品	6.1
6	銀行業	5.5
7	サービス業	5.1
8	機械	5.0
9	卸売業	4.9
10	小売業	4.4

○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	3.2%
2	ソフトバンクグループ	日本・円	1.8
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
4	ソニー	日本・円	1.4
5	日本電信電話	日本・円	1.4
6	キーエンス	日本・円	1.3
7	武田薬品工業	日本・円	1.2
8	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.2
9	本田技研工業	日本・円	1.1
10	みずほフィナンシャルグループ	日本・円	1.0
組入銘柄数		2,113銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.5%
2	ソニー	日本・円	2.0
3	ソフトバンクグループ	日本・円	1.6
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.6
5	武田薬品工業	日本・円	1.5
6	日本電信電話	日本・円	1.5
7	キーエンス	日本・円	1.4
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.2
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.1
10	KDDI	日本・円	1.0
組入銘柄数		2,151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13.2%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、ベンチマークに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	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.002% (0.000) (0.002)
合 計	0	0.002

(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(25,270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5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 (2019年2月8日から2020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
		29,008.8 (2,820.619)	54,443,054 (-)	46,738.519	91,420,458

(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 106,543	百万円 104,700	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	145,863,512千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	254,160,767千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.57

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年2月8日から2020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 54,443	百万円 24	% 0.0	百万円 91,420	百万円 5,933	% 6.5

(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 497	百万円 856	百万円 2,492

(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 98

(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)	4,389千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	17千円
(B)/(A)	0.4%

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、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	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額
水産・農林業 (0.1%)		千株	千株	千円	植木組		千株	千株	千円	東洋精糖		千株	千株	千円
極洋	5.4	5.1	14,728		矢作建設工業	18.8	14.9	12,814		日本甜菜製糖	7	5.7	11,126	
日本水産	166.5	146.5	89,218		ピーエス三菱	14.5	11.1	8,347		三井製糖	9.7	9.5	20,995	
マルハニチロ	24.1	21.2	55,035		日本ハウスホールディングス	26.2	23.2	10,973		塩水港精糖	14.4	11.3	2,610	
カネコ種苗	4.6	4.5	5,998		大東建設	49	40.5	524,880		日新製糖	5.8	5.1	10,449	
サカタのタネ	20.2	17.4	60,639		新日本建設	16.4	14.4	13,392		森永製菓	31	25.4	137,414	
ホクフ	14	11.2	22,512		NIPPO	36.4	27.9	76,473		中村屋	3	2.8	11,424	
ホクリヨウ	2.3	2.3	1,805		東亜道路工業	2.6	2.1	7,539		江崎グリコ	36.9	32.1	157,290	
鉱業 (0.3%)					前田道路	43.1	35.8	132,281		名糖産業	5.9	5.2	7,342	
住石ホールディングス	35.9	30.1	4,244		日本道路	3.8	3.3	25,080		井村屋グループ	5.2	4.6	8,960	
日鉄鉱業	3.9	3.4	15,249		東亜建設工業	12.1	10.5	18,417		不二家	6.9	6	13,728	
三井鉱山ホールディングス	6.9	5.7	6,606		日本国土開発	-	19.8	12,137		山崎製パン	100.8	81.2	170,601	
国際石油開発帝石	668.6	587.5	633,031		若築建設	6.9	6.1	10,174		第一屋建設	2.1	1.8	1,683	
石油資源開発	24	19.2	53,836		東洋建設	50.3	37.9	19,897		モロゾフ	2	1.8	9,090	
K&Oエナジーグループ	8	7.1	11,892		五洋建設	163.3	134	92,460		亀田製菓	7.6	6.2	31,682	
建設業 (2.8%)					世紀東急工業	20.1	16.2	14,985		寿スピリッツ	13	10.4	71,968	
ヒノキヤグループ	3.5	3.7	7,588		福田組	4.5	3.9	19,695		カルビー	56.1	49.4	160,797	
ショーボンドホールディングス	11.9	22.7	105,668		住友林業	97.5	85.7	141,319		森永乳業	24.6	20	90,600	
ミライト・ホールディングス	46.9	43.6	72,070		日本基礎技術	14.4	11.4	4,582		六甲バター	9	7.1	11,715	
タマホーム	10.3	6.9	9,942		バコーポレーション	17.1	15.2	6,460		ヤクルト本社	91.3	74.5	427,630	
サンヨーホームズ	2.5	1.2	853		大和ハウス工業	380.8	334.5	1,204,200		明治ホールディングス	87.2	71.6	529,840	
日本アーク	4.1	5.8	3,584		ライト工業	26.4	19.4	30,458		雪印メグミルク	29.6	26.1	68,042	
ファーストコーポレーション	4.6	4.5	2,691		積水ハウス	420.8	369.9	903,295		プリマハム	17.3	16.9	45,139	
ベステラ	3.2	2.5	2,920		日特建設	11.8	8.9	7,698		日本ハム	53.2	41.4	198,099	
TATERU	20.2	30.3	6,393		北陸電気工事	6.7	5.8	6,722		林業産業	4.3	3.7	2,660	
スペースリニューホールディングス	20.3	17.8	10,021		ユアテック	22.1	19.4	13,153		丸大食品	13.3	11.6	25,566	
ダイセキ環境ソリューション	3.2	2.9	3,285		四電工	2	1.7	4,610		S Foods	11.1	8.7	23,298	
第一カッター興業	1.9	1.8	3,211		中電工	17.6	13.7	35,072		柿安本店	-	3.8	12,369	
安藤・間	106.4	87.2	80,834		関電工	62.6	48.1	50,697		伊勢ハム株式会社ホールディングス	79.3	69.8	49,627	
東急建設	48.8	42.9	33,933		きんでん	91.5	80.4	150,508		サッポロホールディングス	45.1	36.9	99,740	
コムシスホールディングス	59.1	51.9	165,042		東京エネシス	14.2	11.2	10,057		アサヒグループホールディングス	257.9	226.6	1,158,379	
ミサフホーム	13.1	-	-		トーエネック	3.8	3.4	12,750		キリンホールディングス	557.2	459	1,147,041	
ビアールホールディングス	13.8	16	7,600		住友建設	9.5	9.6	24,240		宝ホールディングス	92.2	81	81,486	
髙松コンストラクショングループ	10.3	9.1	24,670		日本電設工業	23.5	18.6	44,007		オエノホールディングス	35.2	28.7	11,307	
東建コーポレーション	5.1	4.5	35,100		協和エクスオ	53.8	51.3	144,153		養命酒製造	3.9	3.4	6,742	
ソネック	1.8	1.5	1,210		新日本空調	11.7	9	19,260		コトコト トキチコトホールディングス	94.3	76	228,760	
ヤマウラ	6.5	6.4	6,163		九電工	27	23.8	76,993		サントリー食品インターナショナル	82.4	72.4	341,728	
大成建設	136.8	112.8	503,652		三機工業	31.6	24.4	36,746		ダイドーグループホールディングス	6.9	5.6	23,184	
大林組	412.3	338.1	428,034		日揮ホールディングス	118.4	104.1	162,396		伊藤園	37.4	32.8	178,760	
清水建設	420.5	343.2	399,828		中外炉工業	3.9	3.7	6,352		キーコーヒー	12.2	10.7	24,556	
飛鳥建設	11.8	9.7	14,006		ヤマト	12.4	10.8	8,953		ユニカフェ	3.9	2.9	2,810	
長谷工コーポレーション	171.9	130.9	195,564		太平電業	9.3	8.2	19,852		ジャパンフーズ	1.8	1.5	1,885	
松井建設	15.2	13.4	10,465		高砂熱学工業	34.6	29.4	57,947		日清オйлリテラルグループ	15.9	14	53,060	
錢高組	1.8	1.4	5,635		三晃金属工業	1.5	1.4	3,733		不二製油グループ本社	30.1	26.4	76,586	
鹿島建設	322.2	265.5	385,240		朝日工業社	2.7	2.2	7,645		かどや製油	1.3	1.1	4,295	
不動テトラ	9.4	8.9	15,290		明星工業	24.9	21.8	18,355		J-Oilミルズ	6.4	5.6	24,584	
大末建設	4.9	4	3,996		大気社	18.8	16.4	65,108		キョーマン	81.3	77.9	444,809	
鉄建建設	8.3	7.3	20,564		ダイダテ	9.2	8.1	24,210		味の素	271.9	239	467,603	
西松建設	29.6	26	66,846		日比谷総合設備	13.1	10.9	21,255		キューピー	68.6	60.3	135,916	
三井住友建設	99.1	81.7	52,778		東芝プラントシステム	29.7	-	-		ハウス食品グループ本社	47	40.5	147,825	
大豊建設	9.3	7.6	21,150		フィル・カンパニー	-	1.4	5,607		カゴメ	49.4	41.1	112,217	
前田建設工業	98.1	84.7	92,746		OSJホールディングス	60.8	53.1	15,186		焼津水産化学工業	6.1	5.3	5,469	
佐田建設	8.8	7.4	3,233		東洋エンジニアリング	16.2	14.2	8,406		アリアケジャパン	11.3	9.9	71,874	
ナカノフドール建設	10.5	9.3	4,566		千代田化工建設	99.1	-	-		ピエトロ	1.6	1.4	2,298	
奥村組	22.6	18.4	53,433		レイズネクスト	24.7	18.2	25,534		エバラ食品工業	2.6	2.5	5,450	
東鉄工業	16.5	14.5	47,632		食料品 (3.8%)					やまみ	-	0.5	1,077	
イチケン	2.6	2.4	4,336		日本製粉	40.9	31.6	53,909		ニチレイ	64	51.5	144,303	
富士ビー・エス	4.3	5	2,925		日清製粉グループ本社	139.1	122.3	236,283		東洋水産	63.3	55.7	265,967	
浅沼組	4.9	3.8	19,570		日東富士製粉	0.8	0.7	4,410		イートアンド	4.3	3.8	7,227	
戸田建設	159.8	140.3	105,786		昭和産業	11.4	10	31,150		大冷	1.5	1.4	2,777	
熊谷組	19.6	15.7	51,888		鳥越製粉	11.1	9.7	8,099		ヨシムラ・フード・ホールディングス	3.3	5.9	7,085	
青木あすなろ建設	6.8	-	-		中部飼料	15	13.3	22,889		日清食品ホールディングス	52.4	46	421,820	
北野建設	2.9	2	5,090		フィード・ワン	83	72.9	13,632		永谷園ホールディングス	6.6	5.3	11,649	

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	千円		株数	株数	千円	株数	株数	千円		株数	株数	千円	株数	株数	千円	
一正蒲鉾		千株			千株	千円	化学 (7.1%)		千株		千株	千円	森六ホールディングス		千株		千株	千円			
フジッコ	4.9	4	3,936							6.5	5.7	12,887	日本化薬	6.5	76.4	65.4	86,785				
ロック・フィールド	13.4	11.7	23,013			202.9		旭化成	855	700	770,000	カリットホールディングス	12.8	11.1	12.8	11.3	6,655				
日本たばこ産業	711.1	624.9	1,437,894					共和レザー	7.5	5.8	4,576	日本精化	9.7	8.6	11.4	9.7	8.6	11,429			
ケンコーマヨネーズ	6.9	6.1	15,213					昭和電工	79.8	75.2	207,176	扶桑化学工業	12.2	10.7	38,413						
わすばや日洋ホールディングス	8	7.1	13,837					住友化学	946	776	360,064	トリケミカル研究所	2.7	2.3	27,439						
なとり	6.9	6.1	10,620					住友精化	5.8	4.7	14,781	ADEKA	59.3	48.7	80,744						
イフジ産業	2.1	1.9	1,442					日産化学	73.8	59.1	286,044	日油	46.2	39.8	157,608						
ピルッルスコーポレーション	3	2.3	6,497					ラサ工業	4.3	3.8	5,703	新日本理化	21.9	18	3,962						
北の達人コーポレーション	48.4	37.7	24,391					クレハ	11.1	9.1	57,330	ハリマ化成グループ	10	8.8	9,744						
ユーグレナ	48.9	46.2	41,949					多木化学	3.4	3.1	14,089	花王	297.9	258.1	2,238,501						
ミヨシ油脂	5	4.4	5,337					テイカ	9.8	7.8	14,944	第一工業製薬	4.5	4	18,660						
理研ビタミン	5.8	5.1	20,884					石原産業	23.2	19	18,373	石原ケミカル	3.1	3	5,529						
繊維製品 (0.6%)								片倉コープアグリ	3	3	3,735	日華化学	4	3.7	3,193						
片倉工業	14.8	15.4	19,943					日東エフシー	7.7	—	—	ニイタカ	1.9	1.6	3,662						
グンゼ	8	7.8	34,515					日本曹達	19	15.6	53,196	三洋化成工業	8	6.3	31,500						
東洋紡	50.8	41.7	65,886					東ソー	185.7	163.3	280,549	有機合成薬品工業	8.3	8.5	2,303						
ユニチカ	35.2	31.2	10,951					トクヤマ	34.6	30.5	86,833	大日本塗料	13.7	12	13,980						
富士紡ホールディングス	6.3	5.1	19,048					セントラル硝子	26.2	21.6	52,358	日本ペイントホールディングス	99.1	87.2	475,240						
倉敷紡績	11.5	10.9	26,705					東亜合成	75.4	66.4	86,452	関西ペイント	135	118.7	304,584						
シキボウ	6.3	5.6	7,179					大阪ソーダ	12.9	10.8	32,227	神東塗料	9.4	8.8	1,821						
日本毛織	39.4	34.8	37,723					関東電化工業	28.5	25.1	26,028	中国塗料	39.4	30.1	30,762						
ダイトウボウ	9	17.8	2,937					デンカ	47.2	38.6	117,730	日本特殊塗料	9	8	11,240						
トーア紡コーポレーション	15	4.1	2,177					信越化学工業	211.8	181.3	2,473,838	藤倉化成	16.4	14.5	8,410						
グアドーリミテッド	15	14.1	3,821					日本カーバイド工業	4.1	3.7	5,065	太陽ホールディングス	9.9	7.8	40,092						
帝国繊維	13.5	11.8	29,677					堺化学工業	7.9	6.8	15,762	DIC	54.4	44.7	133,206						
帝人	98	86.2	179,985					第一稀元素化学工業	9.8	11.5	10,902	サカタインクス	26.2	23.2	28,605						
東レ	932.2	764.7	556,778					エア・ウォーター	98.5	90.2	140,982	東洋インキSCホールディングス	25.4	22.4	57,836						
サカイオーベックス	3	2.9	5,208					太陽日酸	99	101.5	231,623	T&K TOKA	9.4	8.4	8,610						
住江織物	3.2	2.3	5,713					日本化学工業	4.1	3.3	9,639	富士フイルムホールディングス	254.8	206.7	1,121,967						
日本フルト	6.6	5.7	2,861					東邦アセチレン	1.9	1.5	2,074	資生堂	243.8	214.3	1,523,244						
イチカワ	1.8	1.5	2,133					日本パーカライズン	65.6	53.3	63,107	ライオン	171	140.2	297,083						
日東製網	1.4	1.2	2,040					高圧ガス工業	19.2	16.9	13,790	高砂香料工業	8.5	6.8	16,578						
アツギ	10	8.8	6,820				チタン工業	1.5	1.3	3,136	マンダム	27.6	24.3	65,051							
ダイニチク	4.7	3.9	3,162				四国化成工業	20.2	16.3	21,369	ミルボン	15.1	14.4	81,648							
セーレン	29.5	26	41,756				戸田工業	2.6	2.4	5,176	ファンケル	54.6	43.7	135,907							
ソトー	4.6	3.8	3,697				ステラ ケミファ	7	5.8	18,270	コーサー	20.8	20.3	301,861							
東海染工	1.8	1.4	1,590				保土谷化学工業	4.2	4	18,100	コタ	5.8	5.7	8,498							
小松マテール	19.7	17.3	14,359				日本融媒	20.2	16.4	102,172	シーボン	1.4	1.2	2,959							
ワコルホールディングス	35	27.5	82,637				大日精化学工業	9.9	9.4	27,993	ノーラ・オルビスホールディングス	52.4	46	113,206							
ホギメディカル	14.9	12	43,440				カナカ	32	27.3	96,096	ノビアホールディングス	7.7	10.3	55,208							
レナウン	35	28.2	3,017				三菱瓦斯化学	123.7	99.7	186,439	アジパコムスジャパン	2.8	2.3	2,288							
クラウディアホールディングス	2.9	2.9	1,403				三井化学	109	96	252,864	エステー	8.8	6.9	11,743							
TSIホールディングス	44.3	35.5	19,063				JSR	120.6	98.4	212,839	アグロ カネシヨウ	5	3.4	4,913							
マツオカコーポレーション	3.9	3.1	5,986				東京応化工業	20.6	18.2	86,177	コニシ	21.8	17.7	28,638							
ワールド	12.4	15	38,985				大阪有機化学工業	11.1	9.8	17,806	長谷川香料	14.6	14.4	32,688							
三陽商会	7.2	5.5	7,089				三菱ケミカルホールディングス	803.4	706.2	560,157	星光PMC	8.1	6.3	6,041							
ナイガイ	4.6	4	1,756				KHネオケム	18.3	18.6	45,253	小林製薬	34.4	30.2	276,028							
オンワードホールディングス	72.3	63.5	39,941				ダイヤセル	186.7	144.5	151,436	荒川化学工業	11.1	9.7	15,035							
ルックホールディングス	4.4	3.6	3,873				住友ベークライト	20.8	16.6	68,973	メック	8.5	7.4	12,683							
キムラタン	57.1	57.9	1,679				積水化学工業	262.6	227.1	425,585	日本高純度化学	3.2	3.1	8,363							
ゴールドウイン	10.9	19.2	127,680				日本ゼオン	108.4	95.3	120,554	タカラバイオ	32.1	28.2	68,159							
デサント	29.3	20.6	36,606				アイカ工業	36	31.7	114,754	JCU	15.9	13.1	41,396							
キング	6.2	5	2,890				宇部興産	60.6	53.3	119,178	新田セラチン	7.7	6.7	4,502							
ヤマトインターナショナル	7.9	6.3	2,601				積水樹脂	19.8	19	48,051	OA Tアグリオ	1.8	1.8	2,622							
パルプ・紙 (0.2%)							タキロンシーアイ	26	22.8	15,732	デクセリアルズ	31.6	27.8	25,909							
特種東海製紙	7.6	6.7	27,604				旭有機材	8.3	6	10,326	アース製薬	9.3	8.2	49,282							
王子ホールディングス	541	441.3	270,516				日立化成	55.5	48.9	225,184	北興化学工業	12.8	11.1	7,270							
日本製紙	57.5	46.7	86,908				ニチパン	6.3	5.6	9,979	大成ラミック	3.7	3.3	9,464							
三菱製紙	19.7	12	5,676				リケンテクノス	32.9	26.7	12,896	グミアイ化学工業	50.7	44.7	40,051							
北越コーポレーション	79.7	70	36,890				大倉工業	6.2	5	8,815	日本農業	29.4	19.4	11,310							
中越パルプ工業	5.1	4.5	7,200				積水化成成品工業	17.8	14.2	10,124	アキレス	9	7.4	12,987							
巴川製紙所	4.1	3.2	3,017				群栄化学工業	2.9	2.4	5,892	有沢製作所	19.3	17	17,442							
大王製紙	58.5	46.3	68,662				タイガースポリマー	6.5	5.6	3,259	日東電工	92.7	74.5	470,095							
阿波製紙	3	2.8	1,570				ミライアル	3.5	3.8	4,727	レック	13.1	11.5	12,604							
レンゴウ	124	99.9	90,609				ダイキアクシス	4.3	3.8	3,321	三光化成	9.5	12.4	4,488							
トーモク	7.4	6.5	11,986				ダイキョーニシカワ	25.4	22.2	17,959	きもと	20.9	18.5	3,182							
ザ・パック	9.1	8	33,320				竹本容器	4.3	3.8	3,423	藤森工業	11	9.7	33,756							

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
前澤化成工業	千株	千株	千円	藤倉コンポジット	千株	千株	千円	日亜鋼業	千株	千株	千円	大紀アルミニウム工業新	千株	千株	千円					
8.6	6.9	8,211	10.9	9.5	4,199	17.2	15.7	5,118												
6.6	5.8	12,325	8.6	6.5	25,610	1.8	1.7	6,443												
ウェーブプロックホールディングス	2.6	3.9	2,839	オカモト	5.5	4.7	3,313	エンビロ・ホールディングス	2.5	4.1	3,054									
J S P	7.1	6.3	12,537	フコク	13.9	12.1	39,627	シンニッタン	19	16.6	7,685									
エフピコ	10.1	11.8	80,358	ニッタ	23.9	20.9	18,412	新家工業	2.7	2.4	3,496									
天馬	8.6	7.1	14,590	住友理工	16.2	14.2	27,888													
信越ポリマー	22.1	19.4	19,458	三ツ星ベルト	23.5	19	16,074	非鉄金属 (0.7%)												
東リ	30.7	27.1	8,238	パナソニック化学				大紀アルミニウム工業新	19.9	17.5	12,302									
ニフコ	49.1	39.6	115,592	ガス・土製品 (0.8%)				日本軽金属ホールディングス	330.6	270	57,780									
バルカー	9.9	8.8	21,621	日東紡績	18.3	16	76,960	三井金属鉱業	32.8	28.8	77,443									
ユニ・チャーム	260.2	207.9	780,040	A G C	121.4	106.6	385,892	東邦亜鉛	6.7	5.5	10,752									
ショーエイコーポレーション	-	1.2	1,011	日本板硝子	58.6	51.5	30,797	三菱マテリアル	80.1	70.5	203,463									
医薬品 (6.3%)				石塚硝子	1.6	1.9	5,038	住友金属鉱山	166.1	136.3	438,204									
協和ケリン	153.7	108.4	306,880	日本山村硝子	5.2	4.5	5,553	DOW Aホールディングス	28.4	27	109,890									
武田薬品工業	777.5	897.1	4,035,155	日本電気硝子	53.1	43.3	95,173	古河機械金属	20	19	26,410									
アステラス製薬	1,131.4	948.4	1,882,099	オハラ	4.8	4.3	5,413	エス・サイエンス	53.7	47.6	2,189									
大日本住友製薬	91	79.9	153,168	住友大阪セメント	24.7	20.4	92,616	大崎チタニウムプロジェクト	14.1	11.1	15,218									
塩野義製薬	160.6	137.9	933,996	太平洋セメント	77.4	68.1	207,024	東邦チタニウム	21.8	19.1	16,597									
田辺三菱製薬	128.3	-	-	日本ビヒュム	12.4	10.8	8,769	U A C J	18.5	16.2	37,632									
わかもと製薬	14.3	13	3,354	日本コンクリート工業	26.6	23.4	6,645	C K サンエツ	2.3	1.9	6,308									
あすか製薬	15.1	12.3	14,747	三谷セキサン	5.7	5	19,575	古河電気工業	35	33.1	86,357									
日本新薬	32.1	28.3	264,888	アジアパイルホールディングス	17.3	15.3	8,858	住友電気工業	453.6	398.6	605,074									
ビオフェルミン製薬	2	1.7	4,047	東海カーボン	28.4	112.9	115,948	フジクラ	146.4	128.7	48,906									
中外製薬	127.9	112.4	1,379,148	日本カーボン	5.8	5.5	21,092	昭和電線ホールディングス	14.1	12.3	16,740									
科研製薬	22.2	18.5	113,590	東洋炭素	7.2	6.3	13,532	東京特殊電線	1.6	1.6	4,049									
エーザイ	146.8	129	1,206,150	リタケガンバにーリミテド	7.3	5.9	26,520	タツタ電線	24.1	21.1	12,491									
ロート製薬	62.9	55.3	180,554	TOTO	94.4	77	385,770	カナレ電気	2	1.7	3,117									
小野薬品工業	289.9	247.6	666,167	日本碍子	149.7	131.6	251,092	平河ビューテック	5	4	5,636									
久光製薬	36.2	28.5	166,155	日本特殊陶業	103.5	83.9	165,031	リョービ	14.9	13.2	24,195									
持田製薬	9.3	15	65,550	ダントーホールディングス	9.4	8	920	アーレスティ	14.9	14	7,378									
参天製薬	232.6	200.8	421,680	M A R U W A	4.3	4.2	34,020	アサヒホールディングス	22.9	18.7	51,200									
扶桑薬品工業	4.2	3.8	7,543	品川フランク特リーズ	3.2	2.9	9,004	金属製品 (0.6%)												
日本ケミファ	1.6	1.4	3,696	黒崎播磨	2.5	2.1	13,797	稲葉製作所	6.9	6	8,316									
ツムラ	38.1	33.5	103,347	ヨウタイ	10.7	8.6	5,891	宮地エンジニアリンググループ	3.8	3.3	6,890									
日医工	30.1	30.6	41,187	ヨシトライト工業	6.3	5.5	3,272	トーカーロ	31.3	29.6	36,230									
キッセイ薬品工業	21.8	19.1	59,496	東京薬業	15.7	13.8	4,388	アルファ	4.3	3.8	5,069									
生化学工業	23.8	20.8	26,187	ニッカトー	5.5	4.9	3,312	S U M C O	134.1	127.7	225,773									
栄研化学	21.6	19	44,080	フジミコルーポレートド	11	9.6	29,616	川田テクノロジーズ	2.7	2.1	13,944									
日水製薬	5.2	4.6	6,154	クニミネ工業	4.2	4.4	5,988	R S Technologies	2.5	3.1	9,017									
鳥居薬品	6.6	6.7	24,957	エーアンドエマテリアル	2.6	1.8	2,793	信和	-	4.6	5,069									
J C R ファーマ	8.7	7.6	76,380	ニチアス	33.6	29.5	80,918	群製薬グループホールディングス	77.2	67.9	133,695									
東和薬品	5.8	13.8	35,466	ニチハ	17	15	41,655	ホクサンホールディングス	6.2	5.9	11,623									
富士製薬工業	8.3	7.3	10,059	鉄鋼 (0.7%)				コロナ	6.8	5.9	6,136									
沢井製薬	25.1	22.1	163,319	日本製鉄	563.9	477.3	740,769	横浜ブリッジホールディングス	22.6	19.9	45,431									
ゼリア新薬工業	24.3	19.6	41,846	神戸製鋼所	222	195.1	98,330	駒井ハルテック	2.4	1.9	3,556									
第一三共	351.1	308.5	2,523,530	中山製鋼所	16.8	14.9	7,375	高田機工	1	0.9	2,540									
キョーリン製薬ホールディングス	27	23.8	52,955	合同製鐵	5.8	5.7	16,809	三和ホールディングス	125.3	102.3	124,294									
大幸薬品	5.4	4.4	17,358	ジェイ エフ イー ホールディングス	327.7	287.9	388,089	文化シヤッター	35.8	31.5	27,405									
ダイト	7.1	6.3	23,751	東京製鐵	64.9	52	44,148	三協立山	16.8	14.8	22,140									
大塚ホールディングス	233.7	205.4	1,045,896	共英製鐵	13.7	12	22,920	アルインコ	9.7	7.8	9,180									
大正製薬ホールディングス	27.4	22.7	188,410	大和工業	25.8	22.6	59,189	東洋シヤッター	3	2.5	1,687									
ペプチドリーム	61.2	54.6	294,840	東京製鐵	5	4.4	6,564	L I X I L グループ	179.1	157.4	294,967									
大阪ホールディングス	233.7	205.4	1,045,896	大阪製鐵	8	5.7	9,279	日本アイルコン	9.4	8.3	4,407									
石油・石炭製品 (0.5%)				淀川製鋼所	16.4	14.4	28,900	ノーリツ	27	22.1	30,807									
日本コークス工業	104.2	92.1	7,091	丸一鋼管	43	34.6	109,682	長府製作所	12.4	10.8	25,498									
昭和シェル石油	113.5	-	-	モリ工業	3.7	3.2	9,632	リン製作	21.7	20.7	162,909									
ニシレキ	15.8	12.7	17,665	大同特殊鋼	19.8	17.4	78,648	ダイニチ工業	6.4	5.7	3,978									
ユシロ化学工業	6.4	6	8,466	日本高周波鋼業	4.6	4.2	1,818	日東精工	16.7	14.7	8,952									
ビービー・カストロール	4.4	3.9	5,733	日本冶金工業	100.3	8.9	19,108	三洋工業	1.5	1.4	2,809									
富士石油	29.7	29	6,583	山陽特殊製鐵	15.2	7.6	10,830	岡部	24.6	21.6	19,094									
M O R E S C O	4.5	4	5,672	愛知製鐵	6.8	6	21,390	ジーテクト	13.5	13.3	21,200									
出光興産	95.1	121.3	343,885	日立金属	130.8	114.8	205,492	中国工業	1.9	-	-									
J X T Gホールディングス	2,063.9	1,621.8	783,329	日本金属	2.8	2.4	2,044	東ブレ	22.6	19.9	34,566									
コスモエネルギーホールディングス	35.5	31.2	67,922	大太平洋金属	8.1	7.2	16,430	高周波熱錬	23.5	20.5	18,716									
ゴム製品 (0.7%)				新日本電工	72.6	69.2	11,902	東京製鋼	7.4	7.6	8,641									
横浜ゴム	71.2	62.4	118,185	栗本鐵工所	6.2	5.3	11,617	サンコール	6.9	6.1	3,287									
TOYO TIRE	63	61.9	87,588	虹 技	1.8	1.6	2,128	モリテックスチール	9.5	8.4	3,217									
ブリヂストン	377.1	331.4	1,329,576	日本鋳鉄管	1.3	1.1	1,652	パイオラックス	19.4	15.7	30,976									
住友ゴム工業	110.2	96.9	121,028	三菱製鐵	9.1	8	8,664	エイチワン	12	10.5	7,518									

銘柄			当 期 末			銘柄			当 期 末			銘柄			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	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円	
日本発条	120.9	114.3	107,099	TOWA	10.4	10.9	12,131	THK	76.5	62.7	182,519							
中央発條	1.4	1.2	3,578	丸山製作所	2.6	2.2	3,405	ユージン精機	9.5	8.4	7,986							
アドパネクス	1.6	1.3	2,242	北川鉄工業	5.5	4.8	10,651	前澤給装工業	4.8	3.9	8,719							
立川ブラインド工業	5.4	4.7	6,044	ロウテック	5.3	4.7	19,575	イーグル工業	15.1	13.3	13,193							
三益半導体工業	9.5	8.4	20,344	タカキタ	4.4	3.7	2,086	前澤工業	9.1	7.1	2,811							
機械 (5.1%)				クボタ	658.2	572.1	1,024,917	日本ピラー工業	12.4	10.9	17,352							
日本ドライケミカル	3.4	2.7	4,749	荏原実業	3.5	2.7	5,526	キツク	49.7	43.8	34,076							
日本製鋼所	36.7	32.3	69,380	三菱化工機	4.3	3.8	7,695	マキタ	149.3	140.6	605,986							
三浦工業	52.6	46.1	195,003	月島機械	24.3	19.9	28,835	日立造船	97.1	85.6	36,551							
タクマ	44.2	36.1	45,161	帝国電機製作所	8.6	8.9	12,513	三菱重工業	205.6	180.7	724,426							
ツガミ	27.1	22	23,188	東京機械製作所	4.7	4.7	1,701	HIH	94.3	77.6	222,712							
オーコム	15.4	12.4	64,852	新東工業	29.1	25.5	23,511	スター精密	21.1	16.6	23,688							
東芝機械	13.7	12	40,560	澁谷工業	10.7	9.4	29,375	電気機器 (14.6%)										
アマダホールディングス	187.2	135.5	159,483	アイチコーポレーション	21.2	18.7	13,669	日清紡ホールディングス	68.1	71.8	73,738							
アイエンジニアリング	33.7	27.9	25,444	小森コーポレーション	33.2	27.3	27,163	イビデン	75.1	66	178,992							
滝澤鉄工所	3.9	3.3	4,484	鶴見製作所	9.6	8.4	15,531	コニカミノルタ	268.1	235.6	165,155							
F U J I	36.3	45.8	84,638	住友精製工業	2	1.6	5,208	ブラザー工業	159.9	131.6	305,312							
牧野フライス製作所	14.2	12.4	53,258	日本ギア工業	—	3.5	1,396	ミネベアミツミ	227.8	200.1	448,824							
オーエスジ	59.7	49.3	94,705	酒井重工業	2.3	2	5,508	日立製作所	552.4	518.1	2,211,768							
ダイジェット工業	1.4	1.2	1,716	住原製作所	54.4	44.6	156,323	立製製作所	1,227	1,078.2	1,759,622							
旭ダイヤモンド工業	31.8	27.9	17,019	石井鐵工所	1.9	1.4	3,960	富士電機	79.6	65	233,675							
DMG森精機	76.7	67.4	110,333	西島製作所	12.6	10.9	9,777	東洋電機製造	4.8	4.3	6,467							
ソディック	26.4	25.1	22,037	北越工業	12.7	11.1	14,718	安川電機	142.2	116.1	458,595							
ディスコ	16.4	14.5	383,815	ダイキン工業	167.5	137.4	2,245,803	シンフオニア テクノロジー	17	14	17,626							
日東工器	6.6	5.8	14,871	オルガン	4.5	3.9	28,821	明電舎	24.3	19.8	41,085							
日進工具	3.7	3.2	9,193	トーヨーカネツ	4.6	4.7	10,415	オリジン	3.3	3	4,617							
パンチ工業	8.5	9.8	4,635	栗田工業	66.4	58.3	203,758	山洋電気	5.9	5.2	28,600							
富士ダイス	5.4	4.6	3,330	椿本チエイン	16	15.4	54,362	デンヨー	11.3	9.2	19,660							
豊和工業	6.7	5.9	4,867	大同工業	5.8	5.2	4,201	東芝テック	15.3	13.5	59,332							
OKK	5	4.4	2,736	木村化工機	10.2	9	5,454	芝浦メカトロニクス	2.2	1.9	6,944							
石川製作所	2.9	2.5	4,057	アネスト岩田	19.1	16.7	17,401	マブチモーター	33.9	29.9	120,048							
東洋機械金属	8.8	7.5	3,945	ダイフク	67.4	55.1	380,741	日本電産	147.7	129.7	1,931,881							
津田駒工業	2.6	2	2,274	サムコ	3.4	3	9,988	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.6	6.5	2,762							
エンシェウ	3.2	2.5	3,107	加藤製作所	6.3	5.9	9,823	トックス・セミコンダクター	4.2	6.2	9,405							
島精機製作所	16.7	17.1	37,431	油研工業	2.2	1.7	2,915	東光高岳	6.2	6	7,152							
オプトラン	11.9	11.9	35,819	タダノ	59.2	52	55,536	ダブル・スコープ	17.8	16.7	12,909							
NCホールディングス	3.8	3.3	2,247	フジテック	44.6	39.2	69,776	宮越ホールディングス	4.6	4	3,584							
イワキ	—	5.1	6,262	CKD	34.1	30	57,300	ダイヘン	13.5	11.8	42,657							
フリユー	9.7	10.4	12,282	キトー	9.3	8.2	14,013	田淵電機	16.5	—	—							
ヤマシンフィルタ	21.1	23.2	18,003	平和	34.2	30.1	68,266	ヤーマン	17.7	15.6	10,654							
日阪製作所	15	13.2	12,500	理想科学工業	10.9	9.5	17,888	JVCケンウッド	89.9	88	21,912							
やまびこ	23.6	20.7	23,039	SANKYO	30.7	24	92,400	ミキエンジニアリング	11	9.6	4,963							
平田機工	5.7	5	32,800	日本金銭機械	13.6	11.9	10,091	第一精工	5.1	4	9,630							
ベガサスミシン製造	11.4	10.7	5,157	マズグループホールディングス	7.7	6.8	13,525	日新電機	28.8	25.3	30,815							
マルマエ	3.3	4.4	4,452	フクシマガリレイ	7.5	6.6	27,687	大崎電気工業	24.4	21.4	13,524							
タツモ	3.9	5	6,315	オーイズミ	5	4.6	2,580	オムロン	130.3	96.7	661,428							
ナプテスコ	66.7	62.8	200,646	ダイコク電機	5.6	5	7,865	日東工業	19.6	15.8	36,545							
三井海洋開発	12.9	11.3	23,560	竹内製作所	20.5	18.1	35,530	I D E C	16.4	15.6	31,200							
レオン自動機	12	10.5	15,456	アマノ	35.1	28.3	85,324	正興電機製作所	—	2.5	2,842							
S M C	35.9	33.9	1,720,425	J U K I	17	15	12,030	不二電機工業	1.3	1.2	1,490							
ヤマホーロータリーホーリングス	9.2	9.3	4,780	サンデンホールディングス	14.9	14.2	9,372	ジェーエス・エプソ コーポレーション	44.1	36	80,820							
ホソカワミクロン	4.3	3.8	19,342	蛇の目シミン工業	11.2	10.1	4,161	サクサホールディングス	3	2.5	5,137							
ユニオントール	5.2	4	12,160	マックス	18.9	16.4	34,177	メルコホールディングス	5.1	3.8	10,389							
オイレス工業	16.9	13.8	22,273	グローリー	34	27.6	88,182	テクノメディカ	2.8	2.4	4,958							
日精イー・エス・ピー農機	3.5	3.6	14,148	新晃工業	11.4	10	17,640	ダイヤモンドレクテックホールディングス	—	1.7	1,662							
サトーホールディングス	14.6	15.2	47,956	大和冷機工業	17.6	15.6	18,345	日本電気	158.8	130.9	655,809							
技研製作所	8.5	9.4	45,825	セガサミーホールディングス	121.8	107	169,381	富士通	118.3	103.9	1,321,088							
日本エアーテック	3.8	3.4	2,954	日本ビストンリング	4.5	4	5,920	沖電機工業	53.2	43.9	61,460							
カワタ	2.5	3.2	3,184	リケン	5.6	5	18,350	岩崎通信機	5.8	4.8	3,988							
日精樹脂工業	10.2	9	8,694	T P R	16.5	14.5	27,332	電気興業	6.4	5.2	19,058							
オカダアイオン	4.2	3.4	4,229	ツバキ・ナカシマ	18.5	22	29,480	サンケン電気	14.3	11.7	34,304							
ワイエイシイホールディングス	4.9	4.6	3,026	ホシザキ	35.8	31.5	332,640	ナカヨ	2.3	1.9	3,157							
小松製作所	555.5	488.3	1,171,187	大豊工業	10	8.9	6,470	アイホン	7	6.1	10,729							
住友重機械工業	70.2	61.7	178,991	日本精工	252	203	193,053	ルネサスエレクトロニクス	127	514.9	383,085							
日立建機	49.1	43.1	130,377	NTN	263.7	249.6	74,630	セイコーエプソン	152.2	133.8	230,403							
日工	3.4	14.8	11,988	ジェイテクト	117.7	103.4	125,010	ワコム	88.9	72.4	28,815							
巴工業	5.2	4.6	10,248	不二越	11.4	10	42,700	アルバック	24.5	19.8	80,091							
井関農機	12.3	10.8	16,405	日本トムソン	36.4	31.9	14,897	アクセル	5	4.5	3,753							

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	千株	千円		株数	株数	千株	千円		株数	株数	千株	千円
EIYO			千株	千円	ウシオ電機			千株	千円	日信工業			千株	千円
ジャパンディスプレイ	290.1		11.3	8.4	33,054	74.5	62.6	101,036		22.4	21.9	49,056		
日本信号	31.2		31.2	23,088	岡谷電機産業	8.8	8.5	3,162		10.1	8.9	16,278		
京三製作所	26.3		27.4	39,538	ハリオス テクノ ホールディング	11.3	9.9	4,405		4.5	3.9	7,203		
能美防災	16.2		25.2	14,288	エノモト	2.6	3.3	4,319		67.3	59.3	13,994		
ホーチキ	7.7		14.3	35,750	日本セラミック	12.5	10.9	27,489		20.8	17.6	24,992		
星和電機	4.1		7.9	11,699	遠藤照明	6.3	5.4	3,812		65.9	57.9	91,366		
エレコム	11.1		5.4	3,191	古河電池	8.8	7.6	5,806		34.1	30.1	20,016		
パナソニック	1,401.8	1,231.9	11.7	50,017	双信電機	5.9	5.4	2,386		12.8	12	36,720		
シャープ	121.8	1,522.628			山一電機	8.9	7.9	15,191		19.9	20.7	14,117		
アンリツ	79	124.7	69.5	192,910	図研	7.9	7	18,487		60.8	53.5	20,169		
富士通ゼネラル	37.4	69.5	29.3	149,355	日本電子	24.2	21.2	77,698		15.5	13.7	4,699		
ソニー	822.6	72.898	681.6	5,334,201	カシオ計算機	108.5	95.4	193,757		25.7	22.5	30,555		
TDK	64.2	116.6	52	627,640	ファナック	116.6	102.4	2,139,648		28.2	24.8	64,033		
帝国通信工業	5.4	31.2	4.7	5,870	日本シイエムケイ	31.2	25.4	13,716		15	14.5	12,020		
タムラ製作所	47.2	5.5	36	23,256	エンプラス	5.5	5.5	16,885		101.1	88.7	335,286		
アルプスアルパイン	127.7	4.5	95.5	191,764	大真空	4.5	4	7,084		385.1	317.2	289,286		
池上通信機	3.9	59.3	3.5	3,888	ローム	59.3	47.8	410,124		11.4	10	9,030		
パイオニア	204.5	88.1	—	—	浜松ホトニクス	88.1	77.3	376,064		1,035.2	849	2,426,017		
日本電波工業	11.2	13.6	9.8	4,753	三井ハイテック	13.6	11.9	20,396		224.5	213.7	1,094,357		
鈴木	2.1	41.1	5.8	4,547	新光電気工業	41.1	36.2	48,942		381	334.7	950,882		
日本トリム	6.4	187.1	1.4	6,167	京セラ	187.1	151.7	1,111,657		5.9	5.2	6,193		
ローランド ディー・ジー	6.3	54.6	5.9	12,000	太陽誘電	54.6	47.9	167,650		173.2	140.6	295,822		
フォスター電機	14.4	128.8	11.3	18,543	村田製作所	128.8	316.7	2,096,554		29	25.4	58,039		
クラリオン	10.7	19.4	—	—	ユーシン	19.4	—	—		14.8	12.9	6,011		
SMK	3.4	20	2.8	8,764	双葉電子工業	20	17	22,865		16.6	14.7	34,104		
ヨコオ	8.8	4.6	6.9	20,838	北陸電気工業	4.6	4.3	5,022		39.7	34.8	85,990		
ティアック	8.6	38.6	8	1,592	ニチコン	38.6	36.6	35,062		19.2	16.9	12,168		
ホシデン	36.1	8.2	29.5	37,229	日本ケミコン	8.2	8.2	14,546		1.9	1.6	1,740		
ヒロセ電機	17.5	18.6	16.7	232,965	KOA	18.6	16.2	20,250		9.6	8.4	5,812		
日本航空電子工業	28.2	16.1	24.7	50,412	市光工業	18.4	16.1	11,157		11.5	10.1	14,705		
TOA	13.3	73.6	11.5	12,420	小糸製作所	73.6	64.6	321,708		22.1	17.6	39,564		
マクセルホールディングス	26.4	22.6	23.3	34,181	ミツバ	22.6	19.9	15,064		49.5	40.4	727,200		
古野電気	15.8	18.7	13.9	15,429	SCREENホールディングス	21.3	18.7	122,672		28.5	25	78,875		
ユニデンホールディングス	3.7	11.3	3	6,306	キャノン電子	11.3	11.3	23,843		6.2	5.4	7,759		
スミダコーポレーション	10.4	660.6	8.3	9,777	キャノン	660.6	580.4	1,716,823						
アイコム	6.8	369	6	15,990	リコー	369	274.3	342,600						
リオン	5.6	22.9	4.5	14,917	象印マホービン	22.9	31.6	72,206		173.6	305.1	1,202,399		
本多通信工業	10.5	1.6	9.4	5,094	MUTOHホールディングス	1.6	1.4	2,438		4.2	3.6	3,888		
船井電機	12.5	81.9	10.9	7,662	東京エレクトロン	81.9	71.9	1,750,765		39.7	32.3	44,251		
横河電機	122.8	42.9	98.9	197,008	トヨタ紡織	42.9	31.4	52,783		7	6.2	12,499		
新電元工業	4.4	31.4	3.8	13,338	芦森工業	31.4	2.2	3,018		157.9	128.8	390,908		
アズビル	79.2	2.6	68	204,680	ユニプレス	2.6	2.2	3,018		11.1	9.2	8,050		
東亜ディーケーケー	6.1	23.8	5.3	5,469	豊田自動織機	99.3	87.3	545,625		2.6	2.8	1,145		
日本光電工業	54.1	21.4	44.6	155,654	モリタホールディングス	21.4	18.9	33,207		9.6	7.8	7,332		
チノー	4.3	15.5	3.7	5,154	三菱工業	15.5	13.7	14,371		2.9	5	25,150		
共和電業	13	237.4	11.3	4,892	デンソー	270.2	237.4	1,075,184		7.7	6.9	7,024		
日本電子材料	4.7	32.8	4.3	4,588	東海理化電機製作所	32.8	28.4	54,698		1.6	1.3	5,609		
堀場製作所	24.3	44.3	21.3	153,573	E&Sホールディングス	44.3	39	37,167		6.5	5.8	15,433		
アドバンテスト	83.6	83.9	80.2	453,130	川崎重工	95.5	83.9	191,375		11.7	9.8	2,489		
小野測器	5.7	36.8	4.2	2,553	名村造船所	36.8	34.7	8,744		22.2	19.5	78,975		
エスベック	10.9	34.7	9.5	22,600	サノリスホールディングス	16.3	13.2	2,349		14.9	42.9	123,981		
キーエンス	60.2	4.5	97.7	3,743,864	日本車輦製造	4.5	4	12,340		213.8	174.4	233,347		
日置電機	6.4	14.6	5.6	23,072	三菱ロジスネクスト	14.6	14.3	22,880		65.8	54.3	69,829		
シスメックス	95.6	1.9	77	631,554	近畿車輛	1.9	1.6	2,579		182.8	596.7	1,231,588		
日本マイクロニクス	19.8	1,447.3	18.8	24,289	日産自動車	1,447.3	1,271.6	758,000		10.9	9.5	21,755		
メガチップス	9.7	312.4	10	18,290	いすゞ自動車	387.9	312.4	356,292		10.9	8.7	20,584		
OBARA GROUP	7.1	1,367.5	5.6	20,608	トヨタ自動車	1,367.5	1,203.1	9,458,772		247.1	215.3	2,190,677		
滝藤電機	1.5	153.2	1.3	2,802	日野自動車	153.2	134.6	142,003		5.2	4.6	4,793		
原田工業	3.8	454.2	5.1	5,100	三菱自動車工業	454.2	399	169,575		9.7	7.2	11,124		
コーセル	17	8.7	13.2	15,272	エフテック	8.7	7.5	5,505		11.2	9.8	9,898		
イリソ電子工業	11.2	4.5	9.1	39,084	レシップホールディングス	4.5	4.4	3,022		52	91.6	291,288		
オペテックスグループ	21.6	2.5	17.6	27,385	GMB	2.5	2	1,612		134.2	126.3	68,075		
千代田インテグレイ	5.1	2.1	5	10,630	ファルテック	2.1	1.9	2,050		4.1	3.4	3,107		
アイ・オー・データ機器	5.1	28.9	4	4,172	武蔵精密工業	28.9	24	32,112		9.8	7.5	5,167		
レーザーテック	25.1	24	47.3	259,677	日産車体	24	21.1	22,387		16.8	14.8	78,144		
スタンレー電気	86.9	57.1	75.8	234,601	新明和工業	57.1	29.1	39,023		1.9	1.1	749		
岩崎電気	4.8	24.4	4.2	6,997	極東開発工業	24.4	20	29,720		6.2	4.9	9,770		
										19	15.2	41,100		
										84.9	74.7	99,052		

銘柄	前期(前期末)			当 期 末			銘柄	前期(前期末)			当 期 末			銘柄	前期(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
その他製品 (2.2%)	千株	千株	千円				レンオバ	千株	千株	千円			三菱倉庫	千株	千株	千円				
中本パックス	3.4	2.8	4,631				東京瓦斯	240.7	207.5	509,723			三井倉庫ホールディングス	14.3	11.6	21,750				
スノーピーク	4.5	5.1	5,298				大阪瓦斯	238	209.3	404,995			住友倉庫	43.7	37.5	56,362				
パナソニックホールディングス	14.1	11.4	52,611				東邦瓦斯	60.7	53	226,045			滋陽倉庫	6.5	5.6	12,572				
トランザクション	6.7	6.9	7,741				北海道瓦斯	6.6	5.8	9,744			東陽倉庫	20.5	18.5	6,012				
粧美堂	3.5	3.2	1,270				広島ガス	25.5	22.4	8,086			日本トランスシティ	25.7	22.5	11,047				
ニホンフラッシュ	5.2	5	13,760				西部瓦斯	13.9	12.1	29,645			ケイヒン	2.2	1.8	2,408				
前田工織	13.6	11.8	26,432				静岡ガス	37.7	30.6	29,345			中央倉庫	6.9	6.2	7,278				
永大産業	16.4	14.3	4,876				メタウオーター	5.9	5.2	22,204			川西倉庫	2.3	1.8	1,873				
アートネイチャー	13.1	11.5	8,487				陸運業 (4.3%)						安田倉庫	9.7	8.4	9,382				
パンダナムホールディングス	126.8	111.5	701,892				SBSホールディングス	12.2	9.3	17,725			ファースホールディングス	—	2.2	1,023				
アイフィスジャパン	2.7	2.8	2,038				東武鉄道	129.4	113.7	432,060			東洋埠頭	3.3	3.1	4,380				
共立印刷	20.8	18.4	3,091				相鉄ホールディングス	42.2	34.5	100,153			宇徳	10.1	8.7	4,724				
S H O E I	5.8	5.2	28,288				東京	333.3	271.9	531,292			上組	71.8	58.5	141,043				
フラスパッドホールディングス	17.4	15.3	14,504				京浜急行電鉄	168.1	138.5	289,326			サンリツ	2.9	2.3	1,616				
パイロットコーポレーション	21.4	17.5	78,487				小田急電鉄	196.6	160.3	390,490			キムラユニティ	3.2	2.8	3,166				
秋原工業	6.8	6	9,966				京王電鉄	6.6	56	349,440			キユーソー流通システム	3	2.5	4,997				
トップラン・フォームズ	26.3	23.2	28,327				京成電鉄	92	75.1	307,159			近鉄エクスプレス	22	21.6	39,614				
フジシールインターナショナル	27.4	24.2	52,441				富士急行	16.7	14.7	53,508			東海運	6.3	5.8	1,664				
タカラトミー	51.4	48.3	56,849				新京成電鉄	3.1	2.8	6,860			エーアイティ	7.5	7.2	7,113				
廣済堂	11.4	7.5	7,830				東日本旅客鉄道	218.2	189.8	1,850,550			内外トランスライン	3.8	3.6	4,644				
エステールホールディングス	3.5	2.8	1,971				西日本旅客鉄道	110	96.1	891,904			日本コンセプト	3.2	3.3	5,200				
アーク	46.7	41.5	3,776				東海旅客鉄道	109.9	89.7	1,987,303			情報・通信業 (9.0%)							
タカノ	4.9	4.2	3,486				西武ホールディングス	156.3	144.7	263,064			NECネットエスアイ	13.4	10	42,150				
プロネクサス	10.5	9.3	11,206				鴻池運輸	19.6	17.1	27,018			クロスキャット	—	2.8	3,539				
ホクシン	7.7	7.2	1,130				西日本鉄道	34	29.9	78,427			システナ	43	37.7	63,147				
ウッドワン	4	3.5	4,000				ハマキョウレックス	9.4	8.3	28,884			デジタルアーツ	6.5	5.2	29,068				
大建工業	9.3	7.2	13,701				サイイ引越センター	6.5	5.7	35,397			日鉄ソリューションズ	18	15.9	52,072				
凸版印刷	173.2	152.2	336,362				近鉄グループホールディングス	116.1	102.1	594,222			キューブシステム	6.4	5.6	4,362				
大日本印刷	172.9	141.1	433,882				阪急阪神ホールディングス	155	136.2	591,108			エイジア	2.4	1.9	2,958				
図書印刷	11.5	—	—				南海電気鉄道	51.9	48.4	135,326			コア	5.1	4.5	6,426				
共同印刷	3.9	3.4	10,121				京阪ホールディングス	51.8	45.5	227,500			ソリトンシステムズ	6.8	4.6	5,828				
N I S S H A	25.1	22.1	23,249				神戸電鉄	3	2.4	9,552			ソフトクリエイティブホールディングス	5.2	4.6	8,234				
光村印刷	1	0.9	1,498				名古屋鉄道	93.1	83.9	274,353			T I S	40.1	35.3	250,277				
TAKARA & COMPANY	6.4	5.2	8,996				山陽電気鉄道	9	7.3	16,016			ネオス	4.1	4.3	3,173				
アシックス	121.9	89	142,578				日本通運	45.6	36.1	221,654			電算システム	4.6	4.1	11,533				
ツツミ	3.9	3.4	7,650				ヤマトホールディングス	203.7	179	352,630			グリー	83.1	64.9	31,930				
小松ウォール工業	3.8	3.4	7,524				山丸	32.3	28.4	161,596			ユーエックモホールディングス	24.6	21.6	68,148				
ヤマハ	73	64.2	364,014				丸連	6.2	5.9	1,911			三菱総合研究所	4.7	4.6	21,183				
河合楽器製作所	3.8	3.4	11,356				丸全昭和運輸	9.4	8.3	24,543			ボルテージ	2.4	1.9	969				
クリナップ	11.5	10.1	7,029				セコグループホールディングス	64.1	56.3	50,163			電算	1.3	1.2	2,691				
ピジョン	74.2	65.2	259,822				トナミホールディングス	2.8	2.4	12,528			AGS	6.8	5.9	5,032				
オリバー	—	2.2	7,546				ニッコンホールディングス	44.2	36.5	94,973			ファインデックス	10.1	9	11,007				
兼松サステック	0.8	0.7	1,283				日本石油輸送	1.4	1.1	3,432			ピト・コミュニケーションズ	2.8	—	—				
キングジム	10.2	9	8,091				福山通運	14.9	13.1	50,173			ブレインパッド	2.6	2.1	12,075				
リンテック	29.2	25.6	63,385				セイノーホールディングス	87	76.5	112,761			K L a b	21.4	20.4	16,748				
イトーキ	22.6	22.9	11,335				エスライン	3.1	3.1	3,239			ホトウイン・ビストロホールディングス	16	12.7	12,509				
任天堂	75.5	66.1	2,677,050				神奈川中央交通	2.9	2.5	10,075			イーブイケイニクスジャパン	2	1.5	2,634				
三菱鉛筆	20.2	17.7	29,789				日立物流	25.6	18.8	60,912			ネクソン	306.6	301.2	497,281				
タカラスタンダード	25.4	22.2	41,358				丸和運輸機関	6.1	10.8	25,153			アイスタイル	30.6	27.3	12,285				
コクヨ	58.9	51.7	86,028				C&Fホールディングス	11.9	10.3	13,348			エムアップ	4.2	3.1	9,293				
ナカバヤシ	12.3	10.7	6,805				九州旅客鉄道	97.6	91.1	330,693			エイチーム	7.5	7.2	6,955				
グローブライド	5.9	4.8	11,731				S Gホールディングス	109.8	107.2	258,459			エニゴモ	—	7.5	6,802				
オカムラ	42.9	37.6	41,059				海運業 (0.2%)					テクノスジャパン	10.1	8.3	4,332					
美津濃	12.2	9.8	27,557				日本郵船	97.1	85.4	153,549			e n i s h	4.2	4.7	2,608				
電気・ガス業 (1.5%)							商船三井	69	64.6	168,864			コロプラ	34.7	34.7	32,895				
東京電力ホールディングス	979.5	860.8	388,220				川崎汽船	35.8	31.4	47,162			オルトプラス	7.3	7.9	7,102				
中部電力	375.4	330	517,440				N Sユニテッド海運	6.4	5.6	11,228			ブロードリーフ	59.7	52.5	33,180				
関西電力	500.7	408.6	533,835				明治海運	12.1	10.2	3,712			クロス・マーケティンググループ	3.3	4.9	1,768				
中国電力	169.6	149.1	225,141				飯野海運	55	48.1	17,941			デジタルホールディングス	5.4	5.6	5,420				
北陸電力	120.1	98.6	87,359				共栄タンカー	0.8	1.8	1,683			システム情報	—	5.4	5,437				
東北電力	287.4	269.6	284,967				乾汽船	10.4	5.9	7,262			メディアドックホールディングス	3.5	3.4	10,931				
四国電力	110.5	97.2	90,882				空運業 (0.5%)						じげん	12.8	26.2	13,466				
九州電力	252.9	222.3	204,738				日本航空	212.8	183.8	582,094			アイキューブ	6.3	6.5	4,147				
北海道電力	114.8	101	52,318				A N Aホールディングス	212.5	186.6	645,449			エンカレッジ・テクノロジ	—	1.7	1,496				
沖縄電力	22.7	20	41,820				パスコ	2.3	1.9	4,187			サイバーリンクス	1.9	1.6	1,832				
電源開発	97.7	85.9	217,842				食料・運輸関連業 (0.2%)						ディー・エル・イー	7.5	7.9	1,540				
エフオン	7.3	5.1	3,901				トラコンム	3.3	2.9	23,113			フィックスターズ	11.5	11.2	17,080				
イーレックス	21.3	15.3	26,285				日新	10	8.8	14,528			C A R T A HOLDINGS	6.4	5.1	5,502				

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	評価額	株	数	評価額		株	数	評価額	株	数	評価額		株	数	評価額	株	数	評価額
オプティム			千株			千円	野村総合研究所			千株			千円	日本通信			千株			千円
セラレ	2.7	2.8	13,020				サイバネットシステム	76.5	149.9	409,826				クロスパス	102.6	81.8	18,895			
S H I F T	—	3.5	4,140				C E ホールディングス	9.9	7.5	6,135				日本電信電話	2.3	1.9	1,664			
ベリサーブ	4	2.8	22,876				日本システム技術	3.2	6.1	3,013				K D D I	823.5	1,414.3	4,031,462			
ティーガイア	1.1	—	—				インテジホールディングス	2	1.7	2,342				ソフトバンク	1,061.1	788.5	2,689,573			
セック	12.1	9.4	24,120				東邦システムサイエンス	15.4	13.3	12,089				光通信	957.3	961.6	1,457,785			
日本アジアグループ	2	1.5	5,887				ソフスコム	3.7	2.9	2,633				NT T ドコモ	14.2	10.9	295,717			
豆蔵ホールディングス	12.8	11.1	4,184				インフォコム	46.4	50.2	24,849				エムティーアイ	864.6	781.6	2,451,097			
テクノマトリックス	8.1	7.2	13,550				HEROZ	4.9	11.5	34,845				GMO インターネット	14.1	10.2	7,221			
プロシップ	8.6	7.4	21,186				ラクスル	—	0.5	2,670				ファイバーゲート	43.8	41.7	89,363			
カネー・オンライン・エンターテイン	3.6	3.1	4,231				F I G	—	5.6	20,804				アドマーテックコムコミュニケーション	—	2	2,584			
GMO ベイメントゲートウェイ	290.2	25.5	53,626				イーソール	10.6	11.6	3,480				K A D O K A W A	2.5	3.2	1,955			
ザッパラス	19.8	17.4	127,890				アルテリア・ネットワークス	—	0.9	2,337				学研ホールディングス	35.1	28.5	52,212			
システムリサーチ	5.9	5.6	2,156				ヒト・コミュニティ・ソリューションズ	—	3.8	9,245				ゼンリン	4.1	3.6	25,560			
インターネットインシアティブ	1.6	2.9	5,594				フォーカスシステムズ	9.9	11.7	23,341				昭文社	24	21.1	33,422			
さくらインターネット	19.6	15.6	50,700				フジ・メディア・ホールディングス	—	2.4	4,106				インプレスホールディングス	5.4	5	1,900			
ヴィンクス	14.4	11.3	7,356				オービック	8	6.5	6,838				アイネット	9.7	8.8	1,689			
GMO クラウド	4.1	3	3,375				Z ホールディングス	3.7	6.5	12,200				松竹	6.8	5.4	8,694			
S R A ホールディングス	2.7	1.9	4,921				TD C ソフト	124.9	101.9	157,129				東宝	7.9	7	106,260			
M I N O R I リソリューションズ	6.4	5.6	15,372				Z ホールディングス	41.8	36.7	575,456				東映	79.2	63.2	265,756			
システムインテグレータ	2.4	—	—				トレンドマイクロ	17.1	17.2	99,072				エヌ・ティ・ティ・データ	5.1	4	61,920			
朝日ネット	3.4	3.4	3,097				ID ホールディングス	10.5	9.3	9,030				ビー・シー・イー	320.7	281.7	416,634			
e B A S E	10.1	7.5	5,385				日本オラクル	785.1	1,452.9	634,917				ビジネスプレイス木田昭利	1.6	1.3	5,785			
アバント	3.7	6.3	11,050				アルファシステムズ	64.2	47	284,350				D T S	2.1	1.8	5,202			
アドソル日進	3.2	7.5	7,912				フォーチャ	3.4	4.1	6,490				S C S K	13.5	23.7	55,126			
フリービット	4.3	3.8	9,610				C A C Holdings	24.4	21.4	211,218				ソフトバンクホールディングス	56	45.1	232,716			
コムチュア	7.9	6.3	5,600				S B テクノロジー	4	3.3	9,603				シーイーシー	12.9	11.3	24,069			
サイバーコム	6.7	11.8	28,508				オービックビジネスコンサルタント	16.3	12.7	23,863				カブコム	51.6	49.9	163,921			
アステリア	2.2	1.8	3,697				伊藤忠テクノソリューションズ	9.1	6.8	10,159				アイ・エス・ピー	2.4	2	3,918			
アール	5.9	6.4	3,673				アイティフォー	5.1	3.8	9,222				ジャストテック	7	6.7	7,323			
マークラインズ	—	3.8	7,311				東計電算	3.3	2.9	2,726				S C S K	31.8	24.4	149,572			
メディカル・データ・ビジョン	4.2	5.3	10,838				エクセスネット	12.4	10.8	47,250				日本システムウエア	4	3.5	8,330			
g u m i	10.6	8.1	7,290				大塚商会	54.9	48.2	161,229				アイネス	15.2	10.4	18,106			
ショーケース	13.9	13.6	10,132				エックスネット	14.6	12.9	10,203				T K C	10.1	9	50,760			
モバイルファクトリー	2.6	2.4	1,706				エックスネット	1.8	1.5	6,442				富士ソフト	18	13.6	62,832			
テラスカイ	3.3	2.3	4,179				サイボウズ	2.3	1.6	1,545				N S D	19.7	34.8	65,110			
デジタル・インフレーション・ラボ	0.7	3.8	11,970				ソフトブレイン	65.1	57.2	291,148				コナミホールディングス	49.3	38.5	169,015			
P C I ホールディングス	5.3	4.7	8,149				電通国際情報サービス	14.1	12.3	25,694				豊コビューホールディングス	4	4.2	14,112			
パイプHD	2.2	2.1	5,210				デジタルガレージ	9.5	6.2	3,546				J B C C ホールディングス	9.5	7.1	15,030			
アイビシー	2	1.3	2,509				ニューザーニューズ	7.4	6.5	30,745				ミロク情報サービス	12	9.3	26,709			
ネオジャパン	2	1.9	2,707				エムシステムズ	23.5	19.1	81,079				ソフトバンクグループ	503.2	839.5	4,251,228			
P R T I M E S	2.3	1.9	2,354				C I J	9.7	14.9	13,737			卸売業 (5.0%)							
ランドコンピュータ	0.7	0.9	2,310				ビジネスエンジニアリング	4.1	3.6	14,058				ホウスイ	0.9	0.9	846			
ダブルスタンダード	1.4	1.6	1,865				日本エンタープライズ	9.5	7.9	6,904				高千穂交易	4.7	4.1	4,805			
オーブンドア	0.7	1.3	5,635				W O W O W	1.1	1.2	4,068				伊藤忠食品	2.9	2.4	12,480			
マイネット	5.9	5.2	6,994				スカラ	12.7	10.8	2,862				エレマテック	5.6	9.9	10,355			
アカツキ	3.9	3.5	2,411				インテリジェント ウェブ	5.7	5.1	13,851				J A L U X	3.4	3.1	7,402			
ベネフィットジャパン	4.3	3.8	20,102				I M A G I C A G R O U P	9.7	7.5	5,670				あらた	6.7	8.5	39,525			
U b i c o m ホールディングス	0.6	0.8	1,412				ネットワンシステムズ	—	4	3,096				トーマンデバイス	1.9	1.6	6,368			
L I N E	2.2	2.3	3,521				システムソフト	10.2	9	4,626				東エレクトロニクス	4.4	3.9	10,288			
カナミックネットワーク	36.6	24.2	130,196				アルゴグラフィックス	42.7	40.3	77,617				フィールズ	10.5	8.2	4,682			
ナムラシステムコーポレーション	1.9	6.4	4,358				イーベックス	29.1	26.3	2,630				双日	667.4	586.6	208,829			
チェンジ	0.9	2.3	1,166				日本ユニシス	5.1	9	35,820				アルフレックホールディングス	134.3	118	280,486			
シンクロ・フード	1.5	2.1	7,833				マールベラス	18.4	16.1	11,414				横浜冷凍	31.7	29.9	29,571			
オークネット	5.1	4.6	2,534				エィベックス	20.7	18.2	23,587				神栄	1.6	1.5	1,194			
セグエグループ	6.3	6.5	8,040				兼松エレクトロニクス	37.6	33	126,060				ラサ商事	6.5	5.6	5,264			
エイトレッド	—	1.7	1,490				日本エンタープライズ	6.5	5.7	20,605				ラクーンホールディングス	7.1	5.1	4,166			
A O I T Y O H O L D I N G S	—	1.3	1,808				日本エンタープライズ	79.8	64.4	135,368				アルコニック	12.8	11.2	14,907			
マクロミル	13.1	10.7	7,639				報道放送グループホールディングス	110.5	88.3	137,218				神戸物産	18.3	36.6	159,942			
ビーグリ	21.3	18.9	19,202				朝日放送グループホールディングス	12.1	10.5	7,896				あいホールディングス	17.2	15.2	28,484			
オロ	2.3	2	2,576				テレビ朝日ホールディングス	33.1	29.1	63,292				ディー・ピー・エックス	4.2	3.8	3,587			
テモナ	1.1	2.8	9,800				スカパーJSATホールディングス	92	69.6	33,756				ダイワホリホールディングス	11	9.1	58,149			
ニーズウェル	—	1.3	725				テレビ東京ホールディングス	9.9	8.7	21,341				マクニコ・富士エレクトロニクス	33.5	25.3	45,109			
サインポスト	—	1.2	992				日本B S 放送	4.2	3.6	4,478				ラクト・ジャパン	2.7	4	17,060			
ソルクシーズ	—	1.6	3,208				ビジョン	3.8	9.9	13,988				パイオニア・エレクトロニクス	22.9	20	21,300			
フェイス	5.1	4.5	4,072				スマートパリユー	—	3.1	2,563				八洲電機	9.5	8.3	7,660			
プロトコーポレーション	4.2	3.8	3,081				USEN-NEXT HOLDINGS	4.6	4	7,148				メディアスホールディングス	6.7	6	4,920			
ハイマックス	—	9.5	13,414				ワイヤレスゲート	5.3	5	3,985				レスタールホールディングス	7.7	11.1	21,101			
	1.5	1.2	2,365				コネクシオ	8.6	6	9,450				ジュテックホールディングス	2.7	2.3	2,674			

(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 6,514	百万円 -

■投資信託財産の構成

2020年2月7日現在

項目	当期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 263,153,477		% 95.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,850,991		4.3
投 資 信 託 財 産 総 額	275,004,469		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

(2020年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	275,805,961,791円
コ ー ル ・ 口 ー ン	11,473,389,265
株 式(評価額)	263,153,477,450
未 収 入	140,926,920
未 収 入	415,029,156
差 入 委 託 証 拠	623,139,000
(B) 負 債	6,045,704,260
未 払 金	5,048,362,260
未 払 金	193,592,000
差 入 委 託 証 拠 代 用 約 有 価 証 券	803,750,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	269,760,257,531
元 本	98,370,254,055
次 期 繰 越 損 益	171,390,003,476
(D) 受 取 益 権 総 額	98,370,254,055円
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	27,423円

(注1) 期首元本額	115,232,523,115円
追加設定元本額	39,816,140,869円
一部解約元本額	56,678,409,929円
(注2) 期末における元本の内訳	
One DC 国内株式インデックスファンド	13,753,125,332円
D I AM国内株式パッシブ・ファンド	2,300,256,155円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,872,943円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	5,009,685円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	7,743,904円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,418,134円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	18,818,754円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	10,586,919円
たわらノーロード TOP I X	545,594,662円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	324,239,506円
たわらノーロード バランス(堅実型)	10,938,893円
たわらノーロード バランス(標準型)	67,669,431円
たわらノーロード バランス(積極型)	103,376,978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)	439,198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)	31,315,589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)	98,543,681円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	66,484,262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)	135,912,579円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	193,848円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	830,832円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,814,864円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,287,993円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,036,718円
D I AM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,349,147,451円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	994,502,045円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,256,411,336円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,366,803,245円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	348,375,776円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	1,182,324,299円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	1,119,029,562円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	38,945,261円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	1,120,067,435円
マネックス資産設計ファンド エゴリ ューション	25,180,737円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	307,430,970円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	239,536,588円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	419,353,751円
投資のソムリエ	8,729,703,223円
クルーズコントロール	410,638,853円
投資のソムリエ<DC年金>	829,749,325円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	261,682,155円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	316,105,471円
クルーズコントロール<DC年金>	412,795円
D I AMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,507,282円
D I AMコア資産設計ファンド(積極型)	7,001,423円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	474,307,956円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,017,761,432円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	5,883,416円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,725,965円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,914,158円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	13,386,629円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	35,525,818円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,093,711,974円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	217,750,260円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	900,539円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	766,807円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	889,213円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	197,398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)	97,721,972円
D I AMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	53,537,910円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	748,659,317円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	42,276,864円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	90,882,753円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	205,217,487円
D I AM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,081,740円
D I AM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	49,099,169円
D I AM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	14,085,281円
D I AM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	11,090,446円
D I AM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,577,334円
D I AM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,241,538円
D I AMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	856,834,056円
D I AMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	856,427,853円
D I AMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,443,533,162円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	174,658,821円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	48,206,798円
D I AM アスク グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	469,721,881円
D I AM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家限定)	125,441,570円
D I AM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,312,004円
D I AM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	35,583,091円
D I AM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	490,063,850円
D I AM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	37,551,836円
D I AM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	134,171,540円
D I AM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	347,374,438円
D I AM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	876,490,927円
D I AM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	53,451,662円
D I AM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	23,728,407円
D I AMバランス20VA(適格機関投資家限定)	13,986,618円
D I AMバランス40VA(適格機関投資家限定)	104,317円
D I AMバランス60VA(適格機関投資家限定)	121,717円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	380,720,505円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,210,952,937円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,605,155,025円
D I AM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)	65,047,821円
期末元本合計	98,370,254,055円
(注3) 担保資産	
代用として担保を提供している資産は次の通りです。	
株式	1,965,500,000円

■損益の状況

当期 自2019年2月8日 至2020年2月7日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	受 取 配 当 金	6,474,619,048円
	そ の 他 収 益 金	6,470,932,929
	支 払 利 息	6,596,035
		△2,909,916
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	買 入 損 益	25,090,512,011
	売 出 損 益	37,376,506,942
		△12,285,994,931
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	取 引 損 益	549,897,040
	取 引 損	1,316,074,846
		△766,177,806
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		32,115,028,099
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		163,951,791,282
(F) 解 約 差 損 益 金		△85,804,876,036
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		61,128,060,131
(H) 合 計(D + E + F + G)		171,390,003,476
次 期 繰 越 損 益 金(H)		171,390,003,476

(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。