

運用報告書 (全体版)

第14期<決算日2021年2月8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。	

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、2021年2月8日に第14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			東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(配当込み) ベンチマーク	期中 騰落率			
10期 (2017年2月7日)	円 11,107	円 0	% 12.1	ポイント 2,161.36	% 12.3	% 97.6	% 2.3	百万円 13,968
11期 (2018年2月7日)	13,067	0	17.6	2,547.46	17.9	98.1	0.8	22,544
12期 (2019年2月7日)	11,958	0	△8.5	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	30,214
13期 (2020年2月7日)	13,513	0	13.0	2,642.55	13.2	97.5	2.4	37,717
14期 (2021年2月8日)	15,351	0	13.6	3,006.47	13.8	97.7	2.3	49,849

(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(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)		株式組入率	株式先物比率
	騰落率	(配当込み) ベンチマーク	騰落率	騰落率		
(期首) 2020年2月7日	円 13,513	% -	ポイント 2,642.55	% -	% 97.5	% 2.4
2月末	11,789	△12.8	2,305.76	△12.7	97.8	1.9
3月末	11,084	△18.0	2,167.60	△18.0	100.1	3.3
4月末	11,561	△14.4	2,261.88	△14.4	97.1	3.0
5月末	12,347	△8.6	2,416.04	△8.6	92.2	2.2
6月末	12,325	△8.8	2,411.45	△8.7	97.4	2.6
7月末	11,827	△12.5	2,314.39	△12.4	98.2	1.8
8月末	12,792	△5.3	2,503.59	△5.3	97.8	2.4
9月末	12,955	△4.1	2,536.14	△4.0	96.6	3.4
10月末	12,585	△6.9	2,464.21	△6.7	96.8	2.8
11月末	13,988	3.5	2,738.72	3.6	97.0	3.2
12月末	14,400	6.6	2,819.93	6.7	97.1	2.7
2021年1月末	14,431	6.8	2,826.50	7.0	97.6	2.4
(期末) 2021年2月8日	15,351	13.6	3,006.47	13.8	97.7	2.3

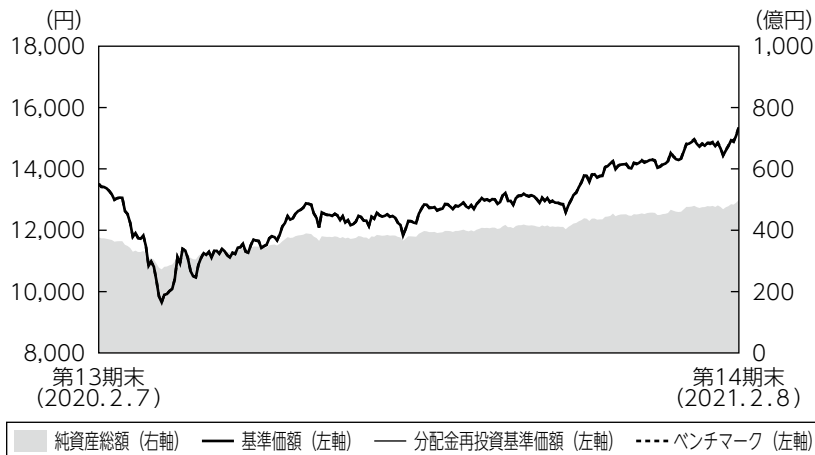
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2020年2月8日から2021年2月8日まで）

基準価額等の推移



第14期首：13,513円
第14期末：15,351円
(既払分配金0円)
騰落率：13.6%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額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

2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大による景気への影響が嫌気されて急落する場面もありましたが、世界各国での経済対策や金融政策、新型コロナウイルスのワクチン開発による感染収束への期待の高まりなどを要因として、基準価額は上昇しました。

投資環境

期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。ただ、4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスのワクチン開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

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

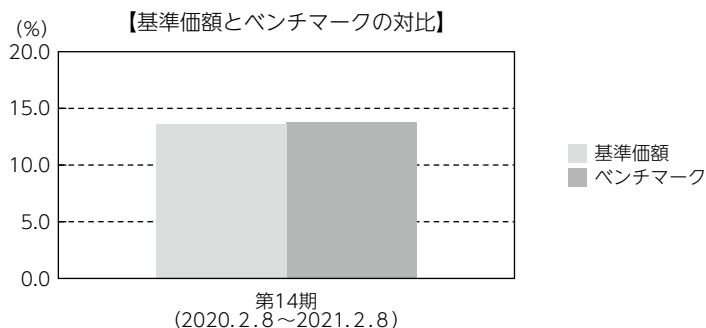
ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

※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13.8%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
	2020年2月8日 ～2021年2月8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	8,553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14期		項目の概要
	(2020年2月8日 ～2021年2月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	20円	0.154%	(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12,757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)	(0.066)	
(販売会社)	(8)	(0.066)	
(受託会社)	(3)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(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)	(0.001)	
(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	20	0.157	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みません。

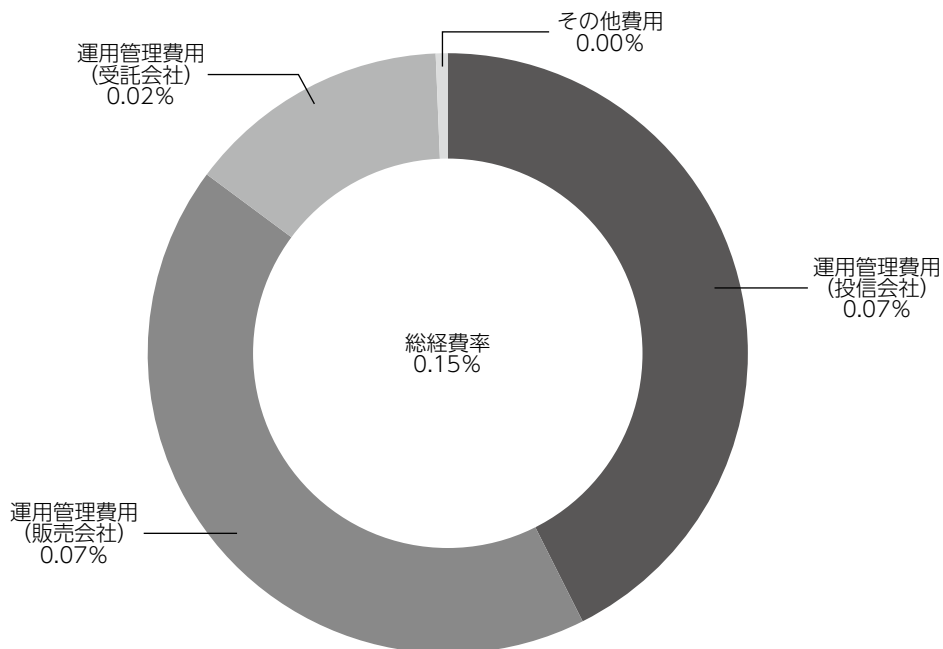
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は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（2020年2月8日から2021年2月8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	3,149,483	7,978,699	926,669	2,498,996

■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	240,411,139千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	237,278,032千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.01

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年2月8日から2021年2月8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)	597千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	33千円
(B)／(A)	5.6%

(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。

【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 127,938	百万円 6,656	% 5.2	百万円 112,472	百万円 7,504	% 6.7

平均保有割合 16.0%

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

(2) 利害関係人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 1,047	百万円 867	百万円 2,537

(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 250

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□ 13,753,125	千□ 15,975,939	千円 49,848,126

■投資信託財産の構成

2021年2月8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	49,848,126	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	181,789	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	50,029,915	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	50,029,915,527円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	158,721,109
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)	49,848,126,418
未 収 入 金	23,068,000
(B) 負 債	179,928,609
未 払 解 約 金	146,083,004
未 払 信 託 報 酬	33,595,391
そ の 他 未 払 費 用	250,214
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	49,849,986,918
元 本	32,473,165,156
次 期 繰 越 損 益 金	17,376,821,762
(D) 受 益 権 総 口 数	32,473,165,156口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	15,351円

(注) 期首における元本額は27,912,059,019円、当期中における追加設定元本額は13,421,884,000円、同解約元本額は8,860,777,863円です。

■損益の状況

当期 自2020年2月8日 至2021年2月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△46,715円
受 取 利 息	7,709
支 払 利 息	△54,424
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	7,041,852,617
売 買 益	7,395,774,522
売 買 損	△353,921,905
(C) 信 託 報 酬 等	△60,918,574
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	6,980,887,328
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,748,121,740
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,647,812,694
(配 当 等 相 当 額)	(18,017,546,707)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,369,734,013)
(G) 合 計(D+E+F)	17,376,821,762
次 期 繰 越 損 益 金(G)	17,376,821,762
追 加 信 託 差 損 益 金	7,647,812,694
(配 当 等 相 当 額)	(18,047,633,321)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,399,820,627)
分 配 準 備 積 立 金	9,729,009,068

(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	855,898,824円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	6,124,988,504
(c) 収 益 調 整 金	18,047,633,321
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,748,121,740
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	27,776,642,389
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	8,553.72
(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。

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19期（決算日 2021年2月8日）

（計算期間 2020年2月8日～2021年2月8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19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	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			
15期 (2017年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
19期 (2021年2月8日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586

(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）。

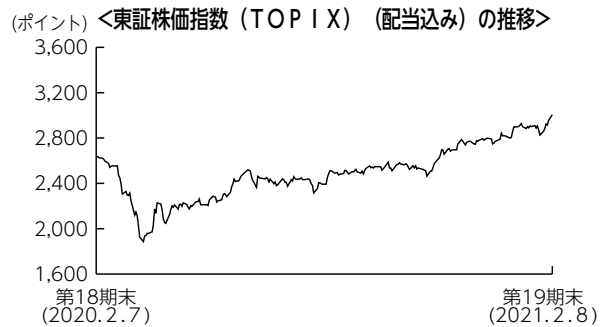
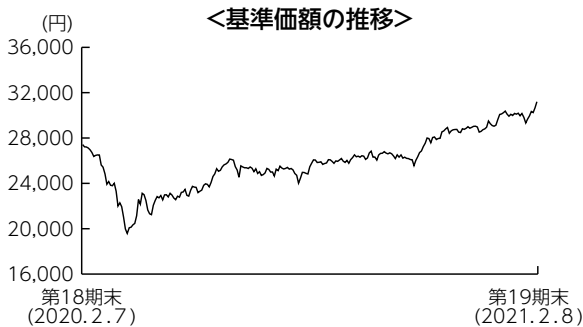
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2020年 2月7日	円 27,423	% -	ポイント 2,642.55	% -	% 97.6	% 2.4
2 月 末	23,926	△12.8	2,305.76	△12.7	97.8	1.9
3 月 末	22,498	△18.0	2,167.60	△18.0	100.1	3.3
4 月 末	23,470	△14.4	2,261.88	△14.4	97.1	3.0
5 月 末	25,068	△8.6	2,416.04	△8.6	92.2	2.2
6 月 末	25,027	△8.7	2,411.45	△8.7	97.4	2.6
7 月 末	24,020	△12.4	2,314.39	△12.4	98.2	1.8
8 月 末	25,983	△5.3	2,503.59	△5.3	97.8	2.4
9 月 末	26,316	△4.0	2,536.14	△4.0	96.6	3.4
10 月 末	25,569	△6.8	2,464.21	△6.7	96.8	2.8
11 月 末	28,422	3.6	2,738.72	3.6	97.0	3.2
12 月 末	29,264	6.7	2,819.93	6.7	97.1	2.7
2021年 1 月 末	29,330	7.0	2,826.50	7.0	97.6	2.4
(期 末) 2021年 2月8日	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月8日から2021年2月8日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,202円となり、前期末比で13.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大による景気への影響が嫌気されて急落する場面もありましたが、世界各国での経済対策や金融政策、新型コロナウイルスのワクチン開発による感染収束への期待の高まりなどを要因として、基準価額は上昇しました。

投資環境

期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。ただ、4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスのワクチン開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

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	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



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

○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	3.5%
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	



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	

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13.8%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)	0.001% (0.000) (0.001)
合 計	0	0.001

(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(25,909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 (2020年2月8日から2021年2月8日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株 63,510.4 (△11,652.101)	千円 127,938,692 (-)	千株 55,403.199	千円 112,472,446

(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 71,359	百万円 71,662	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	240,411,139千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	237,278,032千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.01

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年2月8日から2021年2月8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 127,938	百万円 6,656	% 5.2	百万円 112,472	百万円 7,504	% 6.7

(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 1,047	百万円 867	百万円 2,537

(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 250

(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)	3,691千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	207千円
(B) / (A)	5.6%

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。

(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 7,442		百万円 -

■投資信託財産の構成

2021年2月8日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 311,274,068		% 97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,511,950		2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	318,786,019		100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	318,786,019,057円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	6,651,925,208
株 式(評価額)	311,274,068,500
未 収 入 金	391,827,620
未 収 配 当 金	389,312,729
差 入 委 託 証 拠 金	78,885,000
(B) 負 債	199,379,000
未 払 解 約 債 金	199,379,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	318,586,640,057
元 次 期 繰 越 損 益 金	102,105,610,506
(D) 受 益 権 総 口 数	216,481,029,551
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	102,105,610,506円
	31,202円

(注1) 期首元本額	98,370,254,055円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	19,134,149円
追加設定元本額	67,069,989,134円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	9,070,573円
一部解約元本額	63,334,632,683円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (D/C)	2,599,277円
(注2) 期末における元本の内訳		投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	42,338,447円
One DC 国内株式インデックスファンド	15,975,939,497円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	98,734,309円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	3,179,107,702円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,803,475,886円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,626,890円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	265,437,692円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	5,088,758円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	9,278,066円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	8,151,762円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	5,239,774円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	24,072,359円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	5,173,103円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	14,018,113円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,626,870円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	12,980,814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)	52,904,100円
たわらノーロード TOPIX	784,765,731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)	64,217,224円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	612,281,321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)	71,448,850円
たわらノーロード バランス (堅実型)	23,454,696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)	32,545,912円
たわらノーロード バランス (標準型)	140,720,417円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	41,658,362円
たわらノーロード バランス (積極型)	207,209,167円	日米東証分散戦略ファンド (インカム重視) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	562,668,029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)	1,707,448円	インカム重視マルチアセット運用ファンド	85,977,917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)	108,252,549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)	72,359,909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)	248,952,107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)	128,443,286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)	166,536,220円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	7,951,637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)	228,275,842円	DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	35,906,053円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	431,973円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	8,484,030円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,205,302円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,658,825円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	4,833,419円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	21,889,554円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,885,817円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	46,792,943円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	6,004,044円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	689,878,804円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,764,926,964円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	729,307,036円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,023,160,847円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,064,787,625円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,393,344,349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)	150,408,971円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,451,908,533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)	37,142,128円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	332,009,300円	DIAM 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)	373,020,041円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,152,607,788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)	102,439,732円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,085,041,257円	DIAM世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,576,268円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	35,744,954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)	468,054,341円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,112,139,190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)	24,008,365円
マネックス資産設計ファンド エゴリレーション	21,186,872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)	99,685,187円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	313,080,893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)	238,004,405円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	264,026,418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)	323,286,503円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	439,000,020円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	45,168,755円
投資のソムリエ	15,620,354,669円	DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	20,550,710円
グループコントロール	637,176,611円	DIAM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)	362,800,005円
投資のソムリエ<DC年金>	960,546,202円	DIAM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)	1,106,076,367円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	294,854,779円	DIAM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)	1,467,666,407円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	367,544,221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)	58,984,178円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	6,918,316円	期末元本合計	102,105,610,506円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	16,838,854円	(注3) 担保資産	
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	264,587,992円	代用として担保を提供している資産はありません。	
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,928,248,506円		

■損益の状況

当期 自2020年2月8日 至2021年2月8日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	5,192,079,491円	
	受取配当金	5,191,315,557	
	受取利息	7,434	
	その他の収益	3,319,941	
	支払利息	△2,563,441	
(B)	有価証券売買損益	32,654,345,029	
	売却益	50,944,545,133	
	売却損	△18,290,200,104	
(C)	先物取引等取引損益	1,230,944,200	
	取引益	2,753,684,220	
	取引損	△1,522,740,020	
(D)	当期損益金(A+B+C)	39,077,368,720	
(E)	前期繰越損益金	171,390,003,476	
(F)	解約差損益金	△99,083,661,761	
(G)	追加信託差損益金	105,097,319,116	
(H)	合計(D+E+F+G)	216,481,029,551	
	次期繰越損益金(H)	216,481,029,551	

(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。