

# 運用報告書 (全体版)

第16期<決算日2024年10月15日>

## D I A M国内株式パッシブ・ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/株式 (インデックス型)	
信託期間	2009年1月30日から無期限です。	
運用方針	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要投資対象	D I A M国内株式パッシブ・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	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている (または採用予定の) 銘柄を主要投資対象とします。
運用方法	原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。マザーファンドにおいては、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。) の組入比率は、原則として高位を保ちます。	
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。外貨建資産への投資は行いません。	
分配方針	決算日 (原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の剰余金等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

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、「D I A M国内株式パッシブ・ファンド」は、2024年10月15日に第16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

<https://www.am-one.co.jp/>

## DIAM国内株式パッシブ・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)	税金	み騰	(配当込み)	騰落率			
12期 (2020年10月12日)	円 24,889	円 0	% 3.4	ポイント 2,564.00	% 3.9	% 97.5	% 2.5	百万円 8,368
13期 (2021年10月12日)	30,559	0	22.8	3,158.44	23.2	97.0	3.0	16,499
14期 (2022年10月12日)	29,510	0	△3.4	3,057.47	△3.2	97.0	3.0	15,439
15期 (2023年10月12日)	37,831	0	28.2	3,930.31	28.5	96.6	3.3	17,958
16期 (2024年10月15日)	44,895	0	18.7	4,677.71	19.0	97.6	2.3	21,933

(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)の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」という。)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・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません(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)	騰落率			
(期首) 2023年10月12日	円 37,831	% -	ポイント 3,930.31	% -	% 96.6	% 3.3
10月末	36,393	△3.8	3,781.64	△3.8	97.3	2.7
11月末	38,355	1.4	3,986.65	1.4	97.7	2.4
12月末	38,264	1.1	3,977.63	1.2	96.9	3.2
2024年1月末	41,244	9.0	4,288.36	9.1	97.8	2.1
2月末	43,265	14.4	4,499.61	14.5	97.3	2.7
3月末	45,172	19.4	4,699.20	19.6	97.6	2.4
4月末	44,758	18.3	4,656.27	18.5	97.0	3.2
5月末	45,253	19.6	4,710.15	19.8	97.0	3.0
6月末	45,899	21.3	4,778.56	21.6	96.4	3.6
7月末	45,641	20.6	4,752.72	20.9	96.8	3.3
8月末	44,313	17.1	4,615.06	17.4	97.6	2.3
9月末	43,622	15.3	4,544.38	15.6	97.4	2.7
(期末) 2024年10月15日	44,895	18.7	4,677.71	19.0	97.6	2.3

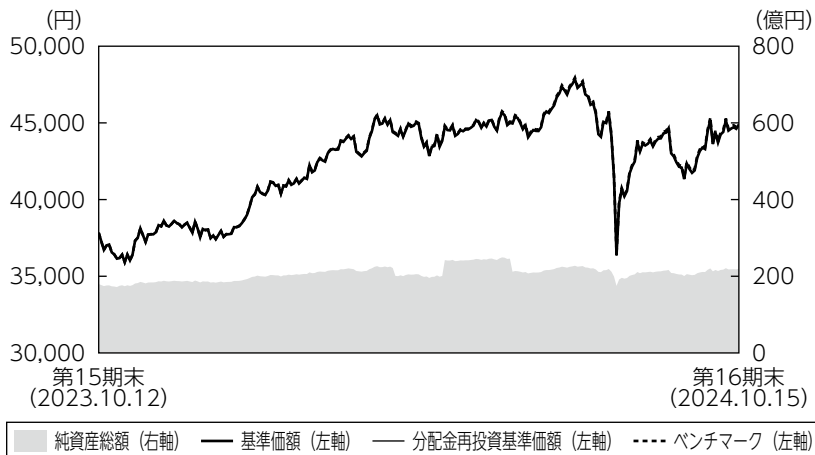
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2023年10月13日から2024年10月15日まで）

### 基準価額等の推移



第16期首： 37,831円  
第16期末： 44,895円  
(既払分配金0円)  
騰落率： 18.7%  
(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

期を通して見ると、国内株式市場が円安米ドル高の進行や海外市場の堅調などを要因として上昇したことから、基準価額も上昇しました。ただし、2024年8月上旬には、円高米ドル安の進行や米国景気の先行き不安などを受けて一時的に急落する場面もありました。

### 投資環境

期初から2023年末までは、一進一退の動きとなりました。2024年1月から3月にかけては、円安米ドル高の進行や海外株式市場の堅調などを要因として上昇しました。その後、ほぼ横ばいの推移となりましたが、8月上旬には円高米ドル安の進行や米国景気の先行き不安などを受けて急落しました。期末にかけては、米国経済指標の改善などを受けて金融市場全体が徐々に落ち着きを取り戻し、緩やかに値を戻す展開となりました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

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】**（注1）組入比率は純資産総額に対する実質組入比率です。  
（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）

（単位：％）

No.	業種	組入比率
1	電気機器	16.6
2	輸送用機器	8.6
3	情報・通信業	7.7
4	銀行業	6.9
5	卸売業	6.5
6	化学	5.6
7	機械	5.2
8	医薬品	4.9
9	サービス業	4.5
10	小売業	4.1



##### 期末

（単位：％）

No.	業種	組入比率
1	電気機器	17.4
2	銀行業	7.5
3	情報・通信業	7.4
4	卸売業	7.1
5	輸送用機器	6.9
6	化学	5.6
7	機械	5.4
8	サービス業	4.8
9	医薬品	4.6
10	小売業	4.4

#### ○組入上位10銘柄

##### 期首（前期末）

（単位：％）

No.	銘柄名	組入比率
1	トヨタ自動車	4.4
2	ソニーグループ	2.7
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.3
4	キーエンス	1.7
5	日本電信電話	1.6
6	三井住友フィナンシャルグループ	1.5
7	三菱商事	1.4
8	日立製作所	1.3
9	東京エレクトロン	1.3
10	本田技研工業	1.2



##### 期末

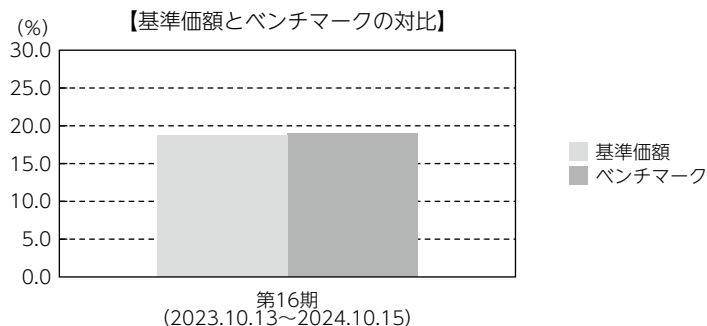
（単位：％）

No.	銘柄名	組入比率
1	トヨタ自動車	3.5
2	ソニーグループ	2.5
3	日立製作所	2.5
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.4
5	リクルートホールディングス	1.9
6	キーエンス	1.8
7	三井住友フィナンシャルグループ	1.7
8	三菱商事	1.5
9	東京エレクトロン	1.4
10	信越化学工業	1.4

## 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19.0%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.3%下回りました。信託報酬などの影響を除くと、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運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

## ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2023年10月13日 ～2024年10月15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	34,894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す。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第16期		項目の概要
	(2023年10月13日 ～2024年10月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	117円	0.277%	(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42,372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)	( 94)	(0.222)	
(販売会社)	( 9)	(0.022)	
(受託会社)	( 14)	(0.033)	
(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	1	0.002	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(監査費用)	( 1)	(0.002)	
(その他)	( 0)	(0.000)	
合計	119	0.280	

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

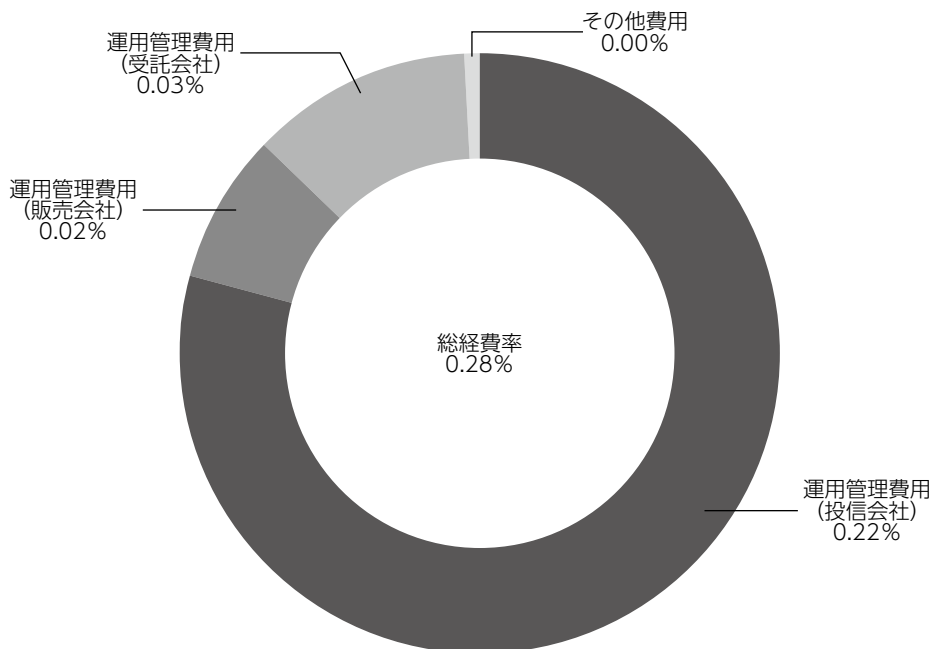
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.28%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（2023年10月13日から2024年10月15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	1,326,355	6,145,143	1,210,455	5,839,109

## ■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	253,817,954千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	542,954,940千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.46

(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（2023年10月13日から2024年10月15日まで）

### 【D I A M国内株式パッシブ・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)	200千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	3千円
(B)／(A)	1.8%

(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 146,325	百万円 48,109	% 32.9	百万円 107,492	百万円 43,412	% 40.4

平均保有割合 3.8%

(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		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,492	百万円 1,322	百万円 6,162

### (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 384

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループ、みずほリソース、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□ 4,401,330	千□ 4,517,230	千円 21,931,607

## ■投資信託財産の構成

2024年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	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	21,931,607	99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	35,752	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	21,967,359	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

(2024年10月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	21,967,359,975円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	35,752,796
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)	21,931,607,179
(B) 負 債	34,274,126
未 払 解 約 金	3,706,337
未 払 信 託 報 酬	30,402,344
そ の 他 未 払 費 用	165,445
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	21,933,085,849
元 本	4,885,459,689
次 期 繰 越 損 益 金	17,047,626,160
(D) 受 益 権 総 口 数	4,885,459,689口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	44,895円

(注) 期首における元本額は4,746,893,588円、当期中における追加設定元本額は1,708,151,755円、同解約元本額は1,569,585,654円です。

## ■損益の状況

当期 自2023年10月13日 至2024年10月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	19,739円
受 取 利 息	20,676
支 払 利 息	△937
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,770,300,506
売 買 損 益	3,612,110,294
売 買 損 益	△841,809,788
(C) 信 託 報 酬 等	△57,835,319
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	2,712,484,926
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,137,861,262
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,197,279,972
(配 当 等 相 当 額)	(7,804,274,742)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,393,005,230)
(G) 合 計(D+E+F)	17,047,626,160
次 期 繰 越 損 益 金(G)	17,047,626,160
追 加 信 託 差 損 益 金	11,197,279,972
(配 当 等 相 当 額)	(7,808,077,584)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,389,202,388)
分 配 準 備 積 立 金	5,850,346,188

(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	485,902,499円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,226,582,427
(c) 収 益 調 整 金	11,197,279,972
(d) 分 配 準 備 積 立 金	3,137,861,262
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	17,047,626,160
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	34,894.62
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

# 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22期（決算日 2024年2月7日）

（計算期間 2023年2月8日～2024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22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	主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、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	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄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
	期騰落率	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
20期 (2022年2月7日)	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336
21期 (2023年2月7日)	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9	396,982
22期 (2024年2月7日)	44,494	31.8	4,286.44	31.8	97.6	2.5	542,130

(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）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません（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）。

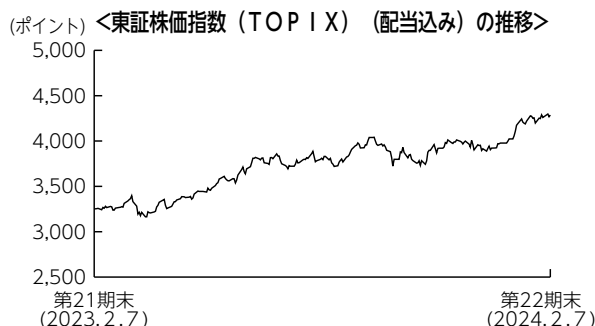
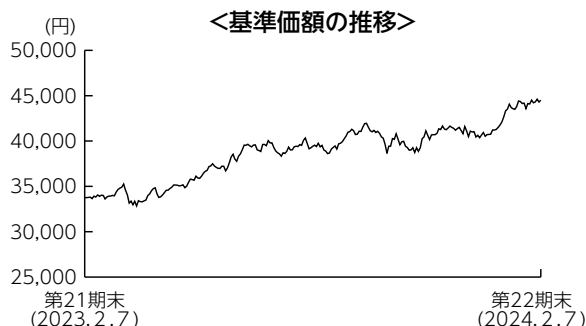
## ■当期中の基準価額と市況の推移

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	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2023年 2月7日	円	%	ポイント	%	%	%
	33,751	—	3,251.81	—	98.0	1.9
2 月 末	33,931	0.5	3,269.12	0.5	98.8	1.3
3 月 末	34,508	2.2	3,324.74	2.2	96.1	4.4
4 月 末	35,438	5.0	3,414.45	5.0	97.9	2.4
5 月 末	36,715	8.8	3,537.93	8.8	97.3	2.8
6 月 末	39,491	17.0	3,805.00	17.0	98.4	1.7
7 月 末	40,083	18.8	3,861.80	18.8	97.5	2.5
8 月 末	40,253	19.3	3,878.51	19.3	97.5	2.6
9 月 末	40,464	19.9	3,898.26	19.9	97.6	2.6
10 月 末	39,253	16.3	3,781.64	16.3	97.3	2.7
11 月 末	41,378	22.6	3,986.65	22.6	97.7	2.4
12 月 末	41,289	22.3	3,977.63	22.3	96.9	3.2
2024年 1 月 末	44,516	31.9	4,288.36	31.9	97.8	2.1
(期 末) 2024年 2月7日	44,494	31.8	4,286.44	31.8	97.6	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（2023年2月8日から2024年2月7日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は44,494円となり、前期末比で31.8%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

日米の長期金利差などを要因として円安ドル高が進行したことや、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や海外投資家による日本株買いなどを要因として日本株が大きく上昇したことから、基準価額も上昇しました。

### 投資環境

国内株式市場は、期初から2023年3月末までは、日米の金融政策、欧米での金融機関の破綻などを要因として一進一退の展開となりました。その後、4月から9月半ばまでは、円安ドル高の進行、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や欧米投資家による日本株買いなどを要因として大きく上昇しました。その後、中東情勢の緊迫化などを要因として一時的に下落する場面もありましたが、期末にかけては円安ドル高の流れを受けて上昇しました。

### 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	17.3%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.3
4	銀行業	6.4
5	化学	6.1
6	卸売業	5.9
7	医薬品	5.2
8	サービス業	5.2
9	機械	5.2
10	小売業	4.4



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	16.9%
2	輸送用機器	8.9
3	情報・通信業	7.4
4	卸売業	7.1
5	銀行業	6.9
6	化学	5.8
7	機械	5.2
8	サービス業	4.5
9	医薬品	4.4
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	3.6%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.1
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.0
5	日本電信電話	日本・円	1.7
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.4
7	武田薬品工業	日本・円	1.3
8	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
9	第一三共	日本・円	1.2
10	任天堂	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,161銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.8%
2	ソニーグループ	日本・円	2.7
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.3
4	キーエンス	日本・円	1.7
5	東京エレクトロン	日本・円	1.6
6	三菱商事	日本・円	1.6
7	日立製作所	日本・円	1.5
8	日本電信電話	日本・円	1.5
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.5
10	信越化学工業	日本・円	1.4
組入銘柄数		2,148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31.8%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		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)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (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
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	1	0.001	
期中の平均基準価額は38,764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 (2023年2月8日から2024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
		68,285.4 (56,521.786)	152,756,646 (-)	58,527.986	124,543,615

(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 122,918	百万円 121,163	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	277,300,261千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	438,574,353千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.63

(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（2023年2月8日から2024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 152,756	百万円 103,694	% 67.9	百万円 124,543	百万円 58,472	% 46.9

### (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 1,537	百万円 1,475	百万円 5,468

### (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 198

### (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)	4,122千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2千円
(B) / (A)	0.1%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、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。









銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)		
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
トレックス・セミコンダクター		千株	千円	マクセル	千株	千株	千円	キャノン電子	千株	千株	千円
東光高岳	6.5	7.6	13,056	古野電気	29.9	32.6	51,182	キャノン	15.1	16.2	33,712
ダブル・スコープ	8.4	8.9	21,119	スマダコポレーション	18	19.2	39,052	リコー	749	729.3	2,980,649
ダイヘン	45.1	42.3	30,709	アイコム	12.6	19.8	22,928	象印マホービン	342.2	366.6	465,398
ヤーマン	12.5	14.8	95,756	リオン	5.4	5.7	20,491	MUTOHホールディングス	40.8	39.7	56,413
JVCケンウッド	23.8	28.7	28,814	横河電機	5.7	6.1	15,512	東京エレクトロン	1.7	0.9	1,874
ミマキエンジニアリング	125.5	116.6	76,606	新電元工業	150.9	161.6	472,356	イノテック	96.3	309.5	8,814,560
IPEX	13.1	14	13,440	アズビル	5.3	5.6	17,640	輸送用機器(9.1%)	9.1	9.7	18,119
日新電機	7.6	10.2	17,911	東亜ディーケーケー	95.4	100.6	463,061	トヨタ紡織	57.5	61.6	145,468
大崎電気工業	33	-	-	日本光電工業	5.9	3.1	2,935	芦森工業	2.3	1.3	3,120
オムロン	32.5	32.3	21,899	チノー	63.1	62.7	249,984	ユニプレス	24.5	26.2	29,055
日東工業	126.3	112.8	625,137	共和電業	5.7	6.1	14,609	豊田自動織機	99.8	124.7	1,685,320
IDEC	18.6	19.9	84,973	日本電子材料	11.6	6.1	2,580	モリタホールディングス	24	25.7	39,603
トク	20.3	21.8	60,669	堀場製作所	9	9	17,208	三櫻工業	20.9	22.3	19,824
正興電機製作所	4.6	2.2	2,457	アドバンテスト	30.3	27.9	344,983	デンソー	281.6	1,206.3	3,042,891
不二電機工業	2.5	1.3	1,492	小野測器	107.5	418.9	2,561,573	東海理化電機製作所	38.6	41.2	94,677
ジーエス・ユアサ コーポレーション	45.3	57.6	148,348	エスベック	4.5	2.7	1,242	川崎重工業	102.9	119.4	418,735
サクサホールディングス	2.6	1.5	4,252	キーエンス	10.9	11.7	29,881	名村造船所	31.2	36.4	49,140
メルコホールディングス	3.7	4.6	14,950	日置電機	136.5	146.3	9,389,534	日本車輛製造	5.3	4.8	10,972
テクノメディカ	3.3	3.5	6,685	シスメックス	7.1	6.9	45,126	三菱ロジスネクスト	21.8	23.3	36,441
ダイキンエレクトリックホールディングス	4.5	5.5	3,839	日本マイクロニクス	117.7	126.2	960,760	近畿車輛	1.5	0.9	1,806
日本電気	195	193.9	1,835,069	メガチップス	22.5	26.3	109,934	日産自動車	1,939.1	1,973.1	1,211,680
富士通	137.4	135.9	3,125,020	OBARA GROUP	11.2	11.6	55,100	いすゞ自動車	396.9	425.1	868,904
沖電気工業	62.3	66.8	71,876	澤藤電機	6.4	8	31,520	トヨタ自動車	7,495.9	8,028.6	26,173,236
岩崎通信機	5.4	3.1	2,154	原田工業	1.4	0.8	1,047	日野自動車	175.8	219.9	102,473
電気興業	5.5	6.6	15,635	コーセル	5.5	2.9	2,180	三菱自動車工業	532.6	570.4	259,931
サンケン電気	12.8	13.7	106,860	イリソ電子工業	16.4	15.6	22,807	エフテック	8.3	4.5	3,091
ナカヨ	2.1	1.1	1,261	オプテックスグループ	12.6	13.4	40,803	レップホールディングス	4.7	2.8	1,878
アイホン	8.4	8	22,936	千代田インテグレ	25.1	26.8	47,168	GMB	2.4	1.3	1,675
ルネサスエレクトロニクス	899.7	963.8	2,288,061	レーザーテック	4.7	5.7	15,600	ファルテック	2.1	1.3	726
セイコーエプソン	183.6	189.5	448,546	スタンレー電気	62.5	67	2,674,640	武蔵精密工業	33.3	35.7	61,368
ワコム	109.2	112.3	83,438	岩崎電機	97.1	93.6	248,929	日産車体	24.1	14.8	14,518
アルバック	32.7	32.4	244,911	ウシオ電機	4.4	-	-	新明和工業	42.9	42.1	49,088
アクセル	4.5	5.9	13,440	岡谷電機産業	71.3	74.3	152,835	極東開発工業	24	24.2	58,007
EIZO	10.1	10.8	53,460	ハリオス テクノ ホールディング	9.8	5	1,430	トビー工業	11.1	11.9	34,867
ジャパディスプレイ	528.8	636.3	12,726	エノモト	11.1	6.5	3,458	ティラド	3.4	3.2	12,080
日本信号	31.4	33.7	32,183	日本セラミック	3.1	1.8	2,921	曙ブレーキ工業	83.3	89.1	10,157
京三製作所	29.9	30.9	14,368	遠藤照明	13.9	11.9	31,475	タチエス	21.6	27	53,460
能美防災	18.7	20	46,040	古河電池	5.4	2.9	4,428	NOK	53	56.8	116,553
ホーチキ	10.3	11	23,386	双信電機	10.1	10.7	10,047	フタバ産業	36.5	39.2	38,376
星和電機	5.2	2.9	1,392	山一電機	5	2.6	767	カヤバ	13.1	14.1	71,064
エレコム	32.9	35.3	59,551	図研	11.9	13.1	28,767	大同メタル工業	13.1	14.1	71,064
パナソニック ホールディングス	1,628.6	1,744.5	2,495,507	日本電子	11.9	12.7	51,752	プレス工業	26.6	28.6	16,330
シャープ	166	248.9	214,576	カシオ計算機	34.2	36.6	243,353	ミクニ	60.8	58.4	39,303
アンリツ	97.1	104	121,108	ファナック	101.6	105.6	133,108	太平洋工業	14	8.2	4,108
富士通ゼネラル	39.1	41.9	87,990	日本シイエムケイ	133.9	713	2,812,785	河西工業	31.3	33.5	50,116
ソニーグループ	965.7	1,034.3	14,790,490	エンプレス	29	31.1	23,387	アイシン	16.1	10.3	1,936
TDK	218.4	233.8	1,776,646	大真空	4	4.3	46,827	マツダ	105.4	112.8	595,358
帝国通信工業	6.2	6.5	12,668	ROOM	16.6	21.8	19,140	今仙電機製作所	451.5	483.6	919,807
タムラ製作所	59.1	58.8	31,810	浜松ホトニクス	63.1	270.3	719,538	本田技研工業	7.7	4.1	3,075
アルプスアルパイン	123.1	131.9	141,133	三井ハイテック	109.5	117.3	661,102	スズキ	1,109.7	3,565.6	6,098,958
池上通信機	4	2	1,796	新光電気工業	14.1	12.9	95,382	SUBARU	250.8	268.5	1,942,597
日本電波工業	16.5	17.7	21,169	京セラ	48.3	51.7	281,765	安永	432	453.4	1,403,273
鈴木	7.4	7.9	9,875	太陽誘電	212.1	908.5	1,887,408	ヤマハ発動機	5.4	2.8	1,909
メイコー	15.1	14.7	67,326	村田製作所	66.5	71.2	244,287	豊田合成	214.5	631.9	896,982
日本トリム	3.1	3.3	10,923	双葉電子工業	414	1,330.3	3,976,931	三菱工業	11.7	7	2,961
ローランド ディー・ジー	7.7	8.1	31,509	北陸電気工業	25.8	27.8	14,066	エグゼディ	22.2	23.9	68,712
フォスター電機	12.8	10.9	12,327	ニチコン	4.5	2.4	3,381	豊田合成	39.8	41.9	123,730
S/MK	3.3	3.8	9,500	日本ケミコン	27.9	38.4	48,384	愛三工業	22.6	24.2	35,283
ヨコオ	10.9	13	18,564	KOA	13.5	15.6	21,871	盟和産業	1.5	0.9	931
ティアック	18.8	10.6	1,049	市光工業	20.6	22.1	32,199	日本プラスト	9.5	5.5	3,327
ホシデン	33	33.6	60,312	小糸製作所	19.7	26.4	15,892	ヨロズ	12.6	13.7	13,672
ヒロセ電機	22.8	21.8	354,032	ミツバ	164.2	151.5	305,727	エフ・シー・シー	24.3	25.9	54,131
日本航空電子工業	28.3	35.3	86,732	SCREENホールディングス	25.6	27.4	30,907	シマノ	55.8	59.1	1,245,532
TOA	15.7	16.8	18,900		23.3	50	817,250	ティ・エス テック	62.5	52	100,568

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	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
精密機器 (2.3%)	6.6	7.1	10,792	共同印刷	3.8	4.1	13,940	サカイ引越センター	6.5	16.2	42,816
テルモ	426.5	408.8	2,073,842	NISSHA	26	25	39,500	近畿グループホールディングス	136.3	146	657,146
クリエートメディック	4.2	2.1	1,871	光村印刷	0.6	0.5	779	飯島船神ホールディングス	181.7	194.7	887,832
日機装	34.1	34.1	38,396	TAKARA & COMPANY	8.8	8.6	24,355	南海電気鉄道	65.1	65.1	193,867
日本エム・ディ・エム	8	11.6	8,444	アシックス	126	124.6	585,620	京阪ホールディングス	56.3	80.5	288,914
島津製作所	166.2	194.3	750,386	ツツミ	2.4	2.4	5,220	神戸電鉄	3.7	4	11,508
JMS	12.8	13.4	6,994	ローランド	10	10.8	52,164	名古屋鉄道	150.6	150.6	340,657
フボテック	3.2	1.8	459	小松ウオール工業	5.1	6	19,410	山陽電気鉄道	10.3	11	24,057
長野計器	9.9	10.6	24,348	河合楽器製作所	86.1	92.2	316,891	アルプス物流	10.9	11.7	22,101
ブイ・テクノロジーズ	6.6	7.7	20,713	クリナップ	3.7	4.4	15,422	ヤマトホールディングス	174.5	186.9	451,550
東京計器	10.4	11.2	20,798	ピジョン	15.4	14.3	11,096	山九	34.7	37.1	199,820
愛知時計電機	5.4	6.3	16,304	兼松サステック	86.9	93.1	149,565	丸連	6.5	3.7	1,036
インターアクション	6.4	8.8	9,900	キングジム	0.6	—	—	丸全昭和運輸	8.5	9	37,350
オーバル	10.7	5.7	3,100	リントック	12.2	13	11,323	セコグループホールディングス	72.2	77.3	87,194
東京精密	29.9	29.9	283,631	イトーキ	27.4	29.4	82,114	トナミホールディングス	2.5	3.2	14,864
マニー	60.1	58.5	120,217	任天堂	27.9	30	46,920	ニッコンホールディングス	43.7	46.7	148,926
ニコン	212.3	211.4	319,108	三菱鉛筆	861.9	923.1	7,725,423	日本石油輸送	0.8	0.7	2,009
トプコン	71.8	71.1	122,043	タカラスタンダード	19.4	20.8	40,996	福山通運	10.4	16.7	71,309
オリンパス	853.3	900	1,930,500	コクヨ	26.4	30.8	57,934	セイノーホールディングス	84.9	82.1	177,294
理研計器	8.5	10.4	82,472	ナカバヤシ	65.7	59.9	141,573	エスライングループ本社	3.7	1.8	1,564
タムロン	10.2	9	51,570	グロープライド	15	15.7	8,478	神奈川中央交通	3.9	4	12,440
HOYA	291.5	287.8	5,295,520	オカムラ	11	13.1	27,248	AZ-COM(現)丸ホールディングス	32.9	37.3	56,770
シード	6.2	3.3	2,646	美津濃	41.1	44.1	96,005	C&Fホールディングス	13.2	14.1	24,745
ノーリツ鋼機	12.9	13.9	45,592	電気・ガス業 (1.4%)	13.5	14.5	63,945	九州旅客鉄道	96.3	103.2	348,093
A&Dホールディングス	19.9	21.3	45,156	東京電力ホールディングス	1,230.6	1,318	1,005,502	S Gホールディングス	261.6	245.1	460,910
朝日インテック	152.5	178.2	515,176	中部電力	503.1	538.8	1,057,395	NIFFRON EXPRESSホールディングス	50.9	49.5	429,066
シチズン時計	149.9	134.5	130,868	関西電力	527.1	564.6	1,080,362	海運業 (0.9%)			
リズム	3.8	1.5	5,355	中国電力	217.4	254	251,053	日本郵船	364.6	418.4	2,048,068
大研医器	9.3	5.6	3,029	北陸電力	128.7	149.5	106,279	商船三井	240.2	316.8	1,674,288
メニコン	46.9	50.3	107,013	東北電力	333.7	384.9	386,632	川崎汽船	116.1	117.2	823,330
シンシャ	1.2	0.8	468	四国電力	116.5	136.2	140,830	NSユニテッド海運	7.3	7.9	40,211
松風	6.2	6.6	17,721	九州電力	315	337	389,403	明海グループ	11.8	7.1	5,530
セイコーグループ	21.2	20.4	54,835	北海道電力	131.7	141.2	89,873	飯野海運	50	53.6	72,306
ニプロ	113.8	121.9	146,462	沖縄電力	31.9	37.3	40,768	共栄タンカー	2.2	1.2	1,225
その他製品 (2.4%)				電源開発	102.8	120.1	308,596	乾汽船	17.3	17.1	18,365
KYORITSU	17.6	9.7	1,959	エフオン	8.9	10.6	4,706	空運業 (0.4%)			
中本パックス	3.8	2.1	3,645	イーレックス	24.3	26	19,994	日本航空	334.8	358.5	1,001,111
スノーピーク	23.3	20.8	17,700	レノバ	36.3	39	47,697	ANAホールディングス	370.8	397.2	1,287,722
パワマウントヘッドホールディングス	31.6	30.4	81,016	東京瓦斯	288.6	309.1	1,021,575	パスコ	2.5	1.3	2,442
トランザクション	10.5	9.6	23,654	大阪瓦斯	276.6	296.2	918,516	倉庫・運輸関連業 (0.1%)			
粧美堂	3.5	1.8	1,398	東邦瓦斯	53.8	63.3	189,108	トランコム	3.9	4.2	29,232
ニホンフラッシュ	12.9	13.7	13,110	北海道瓦斯	8.2	8.7	19,992	日新	10.3	11.1	29,903
前田工業	11.6	12.4	38,750	広島ガス	28.8	30.9	12,174	三菱倉庫	29.3	35.9	158,498
永大産業	13	7.5	1,770	西部ガスホールディングス	12.8	15.3	29,024	三井倉庫ホールディングス	12.7	13.6	64,872
アートネイチャー	14.1	13.2	10,520	静岡ガス	31.2	29.2	29,784	住友倉庫	37.5	39.4	99,169
フルヤ金属	—	3.5	32,690	メタウオーター	17	17.5	37,275	滋野倉庫	5.5	6.7	20,937
バウダイナムホールディングス	124.7	400.6	1,212,215	陸運業 (2.7%)				東陽倉庫	16.4	1.7	2,669
アイフイスジャパン	3.5	1.9	1,145	SBSホールディングス	12.2	13	32,162	日本トランスシティ	27.6	29.4	18,610
SHOEI	14.4	33.1	64,611	東武鉄道	150	160.6	628,749	ケイヒン	2.2	1.1	2,125
フランスベッドホールディングス	16.8	19	26,448	相鉄ホールディングス	45.1	52.3	148,139	中央倉庫	6.7	7.8	9,063
パイロットコーポレーション	21.4	20.6	82,523	東急	382.7	410	704,995	川西倉庫	2.1	1.3	1,463
萩原工業	9.1	9.8	14,592	京浜急行電鉄	154.8	180.9	234,265	安田倉庫	9.5	10	12,110
フジセールインターナショナル	27.7	29.6	51,504	小田急電鉄	206.9	241.8	533,289	フィズホールディングス	2.3	0.9	1,191
タカラトミー	62.9	66.6	158,474	京王電鉄	72.2	70.3	294,416	東洋埠頭	3.5	1.9	2,644
広済堂ホールディングス	8.2	37.6	27,786	京成電鉄	88	94.3	650,670	上組	65.3	67.4	228,620
エステールホールディングス	2.9	1.7	1,113	富士急行	16.8	18	78,570	サンリツ	2.8	1.6	1,259
タカノ	4.6	2.4	2,412	東日本旅客鉄道	231.6	268.6	2,417,400	キムラユニティ	5.9	3.1	5,031
プロネクサス	11.4	15.2	19,319	西日本旅客鉄道	174.3	173.4	1,112,361	キューソー流通システム	7.3	6.6	6,039
ホクシン	9.4	4.8	552	東海旅客鉄道	105.2	563.2	2,124,390	東海運	7.5	3.8	1,113
ウッドワン	4	2.4	2,464	西武ホールディングス	165.1	176.9	375,028	エアイテイ	8.6	9.2	17,056
大建工業	8.3	—	—	鴻池運輸	23.3	24.9	47,484	内外トランスライン	5	5.8	14,018
TOPPANホールディングス	178.5	179.7	708,018	日本本紙	36.4	39.1	96,264	日本コンセプト	4.2	5.3	9,306
大日本印刷	162	159.8	668,763	ハマキョウレックス	10.7	12.5	50,187	情報・通信業 (7.6%)			
								NECネットエスアイ	45.7	57.2	133,218













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	
バリューHR		千株	千円		千株	千円	日総工業		千株	千円		千株	千円	タナホコンサルティンググループ		千株	千株	千円		千株	千円
M&Aキャピタルパートナーズ	13	12.2	29,206	6	6,222	18,222	キュービネットホールディングス	10.5	—	—	5	5.2	5,610	ナガワ	3.7	4.7	33,793	5	5.2	5,610	
ライオンエクスプレスホールディングス	5.1	6	6,222	19	20.4	5,385	SPAホールディングス	6.6	8.6	12,728	11.8	12.6	57,708	東京都競馬	4.3	2.5	3,092	3.7	4.7	33,793	
ERIホールディングス	3.2	1.9	3,562	4.3	1.9	1,508	スプリックス	7.7	6.4	18,022	25.7	23.3	67,104	常磐興産	13	14	55,090	11.8	12.6	57,708	
アビスト	2	1	3,115	3.3	3.5	1,242	マネジメントソリューションズ	3.6	2	622	70.2	43.4	998	カナモト	17.4	18.7	55,165	4.3	2.5	3,092	
シグマクシス・ホールディングス	21.3	20.3	34,185	2.1	2.2	3,577	プロレド・パートナーズ	1.5	0.8	414	61.2	65.6	56,940	ニシオホールディングス	6.2	6	40,200	25.7	23.3	67,104	
ウィルグループ	11.7	12.5	14,900	2.2	0.9	452	and factory	4.7	3.8	5,909	6.2	6	40,200	アゴラ ホスピタリティグループ	8.4	9	11,763	13	14	55,090	
エスコロー・エージェンツ・ジャパン	13.5	7.9	1,106	1.8	0.9	452	テノ・ホールディングス	2	1.2	376	14.8	—	—	トランス・コスモス	12.5	13.3	28,209	70.2	43.4	998	
メドピア	11	13.2	9,081	—	16.1	44,355	フロントティア・マネジメント	4.7	3.8	5,909	12.5	13.3	28,209	乃村工藝社	1.1	1	2,736	17.4	18.7	55,165	
レジャジョブ	2.4	1.3	1,186	43.1	41.1	30,866	ピアラ	2	1.2	376	1.1	1	2,736	藤田観光	142.9	153.1	1,639,701	61.2	65.6	56,940	
リクルートホールディングス	1,039	1,112.8	6,435,322	8.3	20.5	16,338	ゴロ・ホールディングス	2.1	2.2	3,577	7.5	8.1	20,841	KNT-CTホールディングス	55.9	54.1	164,680	8.4	9	11,763	
エラン	18.6	19.9	21,074	4.7	5.1	5,630	ギークス	1.8	0.9	452	27	29.1	23,483	日本管財	13.1	14	30,184	14.8	—	—	
土木管理総合試験所	5.3	3.1	1,010	16.8	15.5	6,851	アンビスホールディングス	—	16.1	44,355	29.1	29.1	23,483	トーカイ	55.9	54.1	164,680	14.8	—	—	
日本郵政	1,839.2	1,766.2	2,500,939	2.1	2.2	3,000	カープスホールディングス	43.1	41.1	30,866	55.9	54.1	164,680	白洋舎	13.1	14	30,184	12.5	13.3	28,209	
ベルシステム24ホールディングス	18.8	16.1	28,802	10.9	11.7	25,353	フォーラムエンジニアリング	8.3	20.5	16,338	1.1	1	2,736	セコム	142.9	153.1	1,639,701	1.1	1	2,736	
鎌倉新書	15.9	12.8	7,936	2.1	2.2	3,000	FAST FITNESS JAPAN	4.7	5.1	5,630	7.5	8.1	20,841	セントラル警備保障	55.9	54.1	164,680	142.9	153.1	1,639,701	
SAMN	3.2	1.3	421	16.8	15.5	6,851	ダイレクトマーケティングミックス	16.8	15.5	6,851	27	29.1	23,483	丹青社	13.1	14	30,184	7.5	8.1	20,841	
一蔵	1.5	0.8	494	2.1	2.2	3,000	LITALICO	10.9	11.7	25,353	55.9	54.1	164,680	メイテックグループホールディングス	13.1	14	30,184	27	29.1	23,483	
グローバルキッズCOMPANY	1.9	1.2	786	2.1	2.2	3,000	コンフィデンス・インタワークス	—	0.6	963	13.1	14	30,184	応用地質	29.5	31.3	77,373	55.9	54.1	164,680	
エアトリ	9.1	11	20,009	5.7	3.4	1,547	アドバンテッジリスクマネジメント	5.7	3.4	1,547	4.2	1.7	433	船井総研ホールディングス	29.5	31.3	77,373	29.5	31.3	77,373	
アトリエ	11	8.9	5,918	78.1	75.3	118,635	リロググループ	78.1	75.3	118,635	7.9	4.5	4,540	進学会ホールディングス	7.9	4.5	4,540	4.2	1.7	433	
ストライク	6.9	6.4	30,976	9.8	10.5	8,158	東祥	9.8	10.5	8,158	2.8	1.8	3,834	オオバ	7.9	4.5	4,540	7.9	4.5	4,540	
ソラスト	38.7	41.4	23,598	—	9.1	33,488	ID&Eホールディングス	—	9.1	33,488	5.6	6	12,486	いであ	2.8	1.8	3,834	2.8	1.8	3,834	
セラク	5	4.6	5,147	2.7	3.1	5,614	ビーウィズ	2.7	3.1	5,614	5.6	6	12,486	学究社	5.6	6	12,486	5.6	6	12,486	
インソース	34.8	32.6	25,395	29.5	28.8	36,316	TREホールディングス	29.5	28.8	36,316	52.3	50.5	131,249	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	52.3	50.5	131,249	
ペイカレント・コンサルティング	111	110.5	345,754	6.3	5.7	10,807	人・夢・技術グループ	6.3	5.7	10,807	15.5	16.1	60,455	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	15.5	16.1	60,455	
Orchestra Holdings	3	3.2	3,168	—	13	10,647	NISSOホールディングス	—	13	10,647	6.5	12.8	6,937	ナック	6.5	12.8	6,937	6.5	12.8	6,937	
アイモパイル	7.3	20.1	9,105	26.7	27.3	68,058	大栄環境	26.7	27.3	68,058	28.7	30.7	123,874	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	28.7	30.7	123,874	
キャリアインデックス	4.2	2.3	457	—	15.8	40,416	日本管財ホールディングス	—	15.8	40,416	5.8	5.5	11,088	ステッパ	5.8	5.5	11,088	5.8	5.5	11,088	
MS-Japan	4.1	5.5	6,963	—	7.2	42,840	M&A総研ホールディングス	—	7.2	42,840	—	—	—	株数：金額	159,799.8	226,079	528,947,749	—	—	—	
船場	1.5	1.4	1,379	36.7	43.7	77,523	エイチ・アイ・エス	36.7	43.7	77,523	—	—	—	銘柄数<比率>	2,161銘柄	2,148銘柄	<97.6%>	—	—	—	
ジョビエレベーターサービスホールディングス	50	48.7	105,386	4.4	6.8	17,761	ラックランド	4.4	6.8	17,761	—	—	—	(注1) 銘柄欄の( )内は、期末の国内株式評							
フルテック	1.7	1	1,128	24	23.6	145,706	共立メンテナンス	24	23.6	145,706	—	—	—	(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に							
グリーンズ	4.2	2.4	4,917	15	16	25,536	イチネンホールディングス	15	16	25,536	—	—	—	に対する評価額の比率です。							
ツナググループ・ホールディングス	3.5	1.9	1,649	7.2	7.7	46,893	建設技術研究所	7.2	7.7	46,893	—	—	—	(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。							
GAME WITH	3.7	2.8	873	10	9.8	9,261	スペース	10	9.8	9,261	—	—	—								
MS&Consulting	1.4	1	590	6	14.1	15,777	燎ホールディングス	6	14.1	15,777	—	—	—								
ウェルビー	10.3	7.5	6,382	0.6	3	9,420	スバル興業	0.6	3	9,420	—	—	—								
エル・ティール・エス	1.9	1.7	4,867	4.6	2.4	2,726	東京テアトル	4.6	2.4	2,726	—	—	—								
ミダグホールディングス	8.6	9.1	15,388																		

## (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 13,328		百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2024年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 528,947,749		% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,775,214		2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	542,722,964		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

(2024年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	542,722,857,274円
一 般 株 式	12,373,197,806
株 式 (評価額)	528,947,749,730
未 収 入 金	569,015,410
未 収 入 委 託 証 拠 金	703,427,711
未 収 入 委 託 証 拠 金	129,466,617
(B) 負 債	592,021,000
未 払 解 約 金	592,021,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	542,130,836,274
元 本	121,842,817,407
次 期 繰 越 損 益	420,288,018,867
(D) 受 取 金 額 (C / D)	121,842,817,407円
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	44,494円

(注1) 期首元本額 117,622,712,134円  
 追加設定元本額 59,907,077,380円  
 一部解約元本額 55,686,972,107円

(注2) 期末における元本の内訳  
 MHAMスリーウェイクオープン 234,935,632円  
 MHAM TOP I Xオープン 2,457,094,087円  
 たわらノーロード 国内株式<ラップ専用> 3,281,412,558円  
 One DC 国内株式インデックスファンド 30,809,632,061円  
 DIAM国内株式バッシブ・ファンド 4,610,201,313円  
 M I T O ラップ型ファンド (安定型) 1,572,967円  
 M I T O ラップ型ファンド (中立型) 9,370,446円  
 M I T O ラップ型ファンド (積極型) 21,079,024円  
 グローバル8資産ラップファンド (安定型) 21,608,149円  
 グローバル8資産ラップファンド (中立型) 28,800,675円  
 グローバル8資産ラップファンド (積極型) 17,989,649円  
 たわらノーロード TOP I X 2,226,070,109円  
 たわらノーロード バランス (8資産均等型) 1,698,970,509円  
 たわらノーロード バランス (堅実型) 49,358,924円  
 たわらノーロード バランス (標準型) 360,326,830円  
 たわらノーロード バランス (積極型) 607,683,019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) 2,285,856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) 141,103,494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) 406,039,337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) 347,897,665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) 481,585,965円  
 たわらノーロード 最適化バランス (保守型) 365,246円  
 たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 1,354,848円  
 たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 27,592,829円  
 たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 4,404,483円  
 たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 12,596,334円  
 DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金> 33,412,337,171円  
 Oneグローバルバランス 41,793,827円  
 DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 914,089,355円  
 DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 3,328,302,554円  
 DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 3,866,884,412円  
 DIAM DC バランス30インデックスファンド 294,884,221円  
 DIAM DC バランス50インデックスファンド 964,080,357円  
 DIAM DC バランス70インデックスファンド 1,090,311,381円  
 マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 28,196,964円  
 マネックス資産設計ファンド (育成型) 1,070,522,519円  
 マネックス資産設計ファンド エコリユージョン 14,869,106円  
 DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10) 283,994,414円  
 DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20) 332,963,584円  
 DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30) 563,739,113円  
 投資のソムリエ 8,462,984,252円  
 フルーズコントロール 331,322,523円  
 投資のソムリエ<DC年金> 830,639,366円  
 DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> 315,192,706円  
 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> 1,094,963,321円  
 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 940,176,992円  
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 3,070,818,810円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 79,256,153円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 40,575,661円  
 リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 8,224,319円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 177,810,319円  
 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> 506,888,540円  
 リスクコントロール世界分散ファンド 1,363,308,339円  
 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 230,928,569円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 80,685,240円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 43,107,354円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 26,468,340円  
 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> 499,441,883円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) 6,256,314円  
 Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け> 1,630,752円  
 Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け> 32,054,533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) 1,852,453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) 1,973,535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) 1,168,075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) 1,140,102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) 21,514,902円  
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04 (適格機関投資家限定) 4,850,093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) 21-06 179,053,363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) 1,676,651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) 22-05 82,171,987円  
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (日本資産投信) 22-10 373,974,618円  
 予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定) 3,244,839円  
 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 271,164,256円  
 AMIOneマルチアセット・インカム戦略 (適格機関投資家限定) 13,265,462円  
 DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) 22,573,361円  
 日興資産運用戦略ファンド(インカム重視) (儲蓄型) (適格機関投資家限定) 42,437,517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) 3,180,848円  
 リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF型) (適格機関投資家限定) 3,641,563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) 34,738,163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) 67,464,810円  
 DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 2,592,055円  
 DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 10,658,140円  
 DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 3,391,442円  
 DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 80,001円  
 DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 1,346,974円  
 DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 17,271,356円  
 DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 278,577,105円  
 DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) 397,261,876円  
 DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 1,219,167,945円  
 DIAMグローバル・セット・バランスVA (適格機関投資家限定) 10,308,559円  
 DIAMグローバル・セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) 14,774,714円  
 DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 148,488,928円  
 DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家限定) 28,546,667円  
 DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 53,149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) 157,074,573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) 8,107,544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) 38,324,573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) 100,737,648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) 130,670,328円  
 DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) 17,344,200円  
 DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定) 7,096,700円  
 動的パッケージファンド<DC年金> 26,832,017円  
 コア資産形成ファンド 13,890,277円  
 MHAMトピックスファンド 785,854,154円  
 MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用) 44,680,531円  
 MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定] 3,152,105,329円  
 MHAM日本株バッシブファンド [適格機関投資家限定] 1,885,462,391円  
 期末元本合計 121,842,817,407円  
 担保資産 121,842,817,407円

(注3) 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2023年2月8日 至2024年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	10,425,561,919	円
	受取配当金	10,381,192,543	
	受取利息	112,936	
	その他の収益	47,949,906	
	支払利息	△3,693,466	
(B)	有価証券売買損益	111,503,767,553	
	売却益	123,369,784,497	
	売却損	△11,866,016,944	
(C)	先物取引等取引損益	3,953,117,580	
	取引益	4,399,997,660	
	取引損	△446,880,080	
(D)	その他費用	△2,081,296	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	125,880,365,756	
(F)	前期繰越損益金	279,360,210,690	
(G)	解約差損益金	△154,955,776,199	
(H)	追加信託差損益金	170,003,218,620	
(I)	合計(E+F+G+H)	420,288,018,867	
	次期繰越損益金(I)	420,288,018,867	

(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) (G)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) (H)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。

## 《お知らせ》

■当投資信託において保有していた株式会社東芝の株式について、同社による有価証券報告書等の虚偽記載により当投資信託が被った損失の回復を図るために提訴した損害賠償請求訴訟が和解により終結したため、2023年12月に当該和解金を計上いたしました。

(2023年12月20日)