

運用報告書 (全体版)

第19期<決算日2022年2月7日>

DIAM 国内株式インデックスファンド<DC年金>

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	2002年11月15日から無期限です。				
運用方針	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標として運用を行います。				
主要投資対象	<table border="1"> <tr> <td>DIAM 国内株式インデックス ファンド<DC年金></td> <td>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。</td> </tr> <tr> <td>国内株式パッシブ・ ファンド（最適化法）・ マザーファンド</td> <td>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。</td> </tr> </table>	DIAM 国内株式インデックス ファンド<DC年金>	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。
DIAM 国内株式インデックス ファンド<DC年金>	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	マザーファンドの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、配当収入および売買益（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、「DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>」は、2022年2月7日に第19期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税込み 騰落率		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	式物率	純資産 総額
		円	%	ポイント	%				
15期 (2018年2月7日)	26,806	0	17.6	2,547.46	17.9	98.1	0.8	%	百万円 95,638
16期 (2019年2月7日)	24,513	0	△8.6	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	%	93,647
17期 (2020年2月7日)	27,679	0	12.9	2,642.55	13.2	97.5	2.4	%	99,688
18期 (2021年2月8日)	31,417	0	13.5	3,006.47	13.8	97.7	2.3	%	108,479
19期 (2022年2月7日)	32,038	0	2.0	3,073.66	2.2	97.4	2.5	%	108,482

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 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	%	ポイント	%		
(期首) 2021年2月8日	31,417	—	3,006.47	—	97.7	2.3
2月末	30,453	△3.1	2,914.58	△3.1	99.0	1.1
3月末	32,181	2.4	3,080.87	2.5	96.2	4.0
4月末	31,265	△0.5	2,993.46	△0.4	96.5	3.5
5月末	31,686	0.9	3,034.76	0.9	96.6	3.4
6月末	32,053	2.0	3,070.81	2.1	96.0	4.0
7月末	31,351	△0.2	3,003.91	△0.1	97.2	2.8
8月末	32,333	2.9	3,099.08	3.1	97.1	2.9
9月末	33,740	7.4	3,234.08	7.6	96.3	3.8
10月末	33,251	5.8	3,188.28	6.0	96.8	3.4
11月末	32,042	2.0	3,073.26	2.2	84.8	1.0
12月末	33,149	5.5	3,179.28	5.7	97.1	3.4
2022年1月末	31,542	0.4	3,025.69	0.6	95.8	4.2
(期末) 2022年2月7日	32,038	2.0	3,073.66	2.2	97.4	2.5

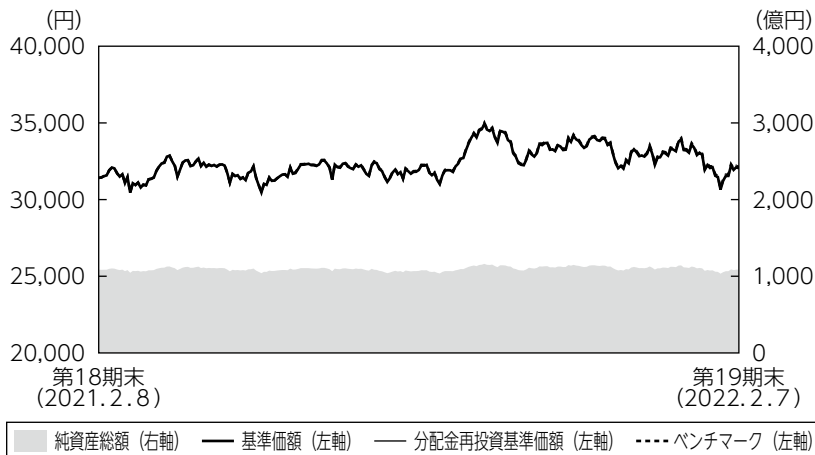
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月9日から2022年2月7日まで）

基準価額等の推移



第19期首： 31,417円
第19期末： 32,038円
(既払分配金0円)
騰落率： 2.0%
(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

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

●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

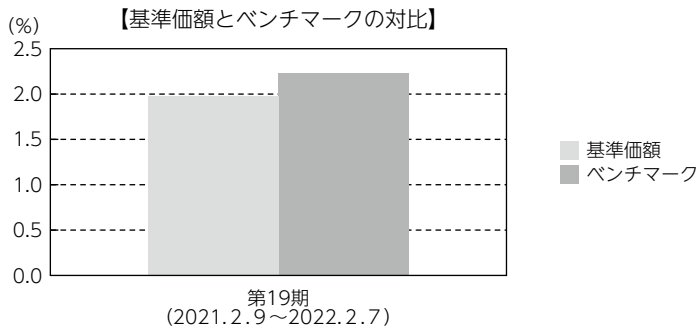
ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

※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2.2%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
	2021年2月9日 ～2022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	22,037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19期		項目の概要
	(2021年2月9日 ～2022年2月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	78円	0.241%	(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32,420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)	(28)	(0.088)	
(販売会社)	(39)	(0.121)	
(受託会社)	(11)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	1	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)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	0	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
(監査費用)	(0)	(0.001)	
合計	79	0.244	

(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。

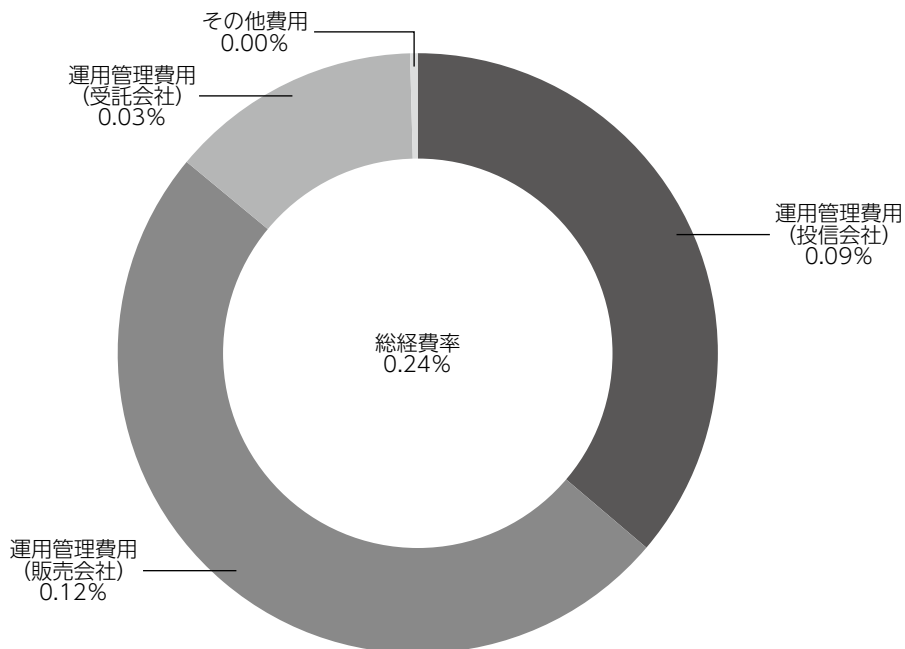
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.24%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（2021年2月9日から2022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	2,692,955	8,652,884	3,448,729	11,113,768

■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	875,075,739千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	369,108,651千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	2.37

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月9日から2022年2月7日まで）

【D I AM国内株式インデックスファンド<DC年金>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)	2,041千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	36千円
(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 479,219	百万円 130,245	% 27.2	百万円 395,856	百万円 59,442	% 15.0

平均保有割合 28.2%

(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		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 3,678	百万円 3,163	百万円 3,133

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 1,300

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

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□ 34,764,926	千□ 34,009,153	千円 108,475,594

■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	108,475,594	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	311,068	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	108,786,663	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	108,786,663,225円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	311,068,600
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)	108,475,594,625
(B) 負 債	304,579,393
未 払 解 約 金	171,160,913
未 払 信 託 報 酬	132,912,171
そ の 他 未 払 費 用	506,309
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	108,482,083,832
元 本	33,860,754,291
次 期 繰 越 損 益 金	74,621,329,541
(D) 受 益 権 総 口 数	33,860,754,291口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	32,038円

(注) 期首における元本額は34,529,357,931円、当期中における追加設定元本額は8,534,876,943円、同解約元本額は9,203,480,583円です。

■損益の状況

当期 自2021年2月9日 至2022年2月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△65,981円
受 取 利 息	9,162
支 払 利 息	△75,143
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,617,867,478
売 買 損 益	2,507,514,305
売 買 損 益	△889,646,827
(C) 信 託 報 酬 等	△265,699,740
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,352,101,757
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	21,446,878,819
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	51,822,348,965
(配 当 等 相 当 額)	(49,682,419,322)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,139,929,643)
(G) 合 計(D+E+F)	74,621,329,541
次 期 繰 越 損 益 金(G)	74,621,329,541
追 加 信 託 差 損 益 金	51,822,348,965
(配 当 等 相 当 額)	(49,682,419,322)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,139,929,643)
分 配 準 備 積 立 金	22,799,046,557
繰 越 損 益 金	△65,981

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,352,078,040
(c) 収 益 調 整 金	51,822,348,965
(d) 分 配 準 備 積 立 金	21,446,968,517
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	74,621,395,522
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	22,037.72
(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20期（決算日 2022年2月7日）

（計算期間 2021年2月9日～2022年2月7日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年10月30日から無期限です。
運用方針	主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

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

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈩東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

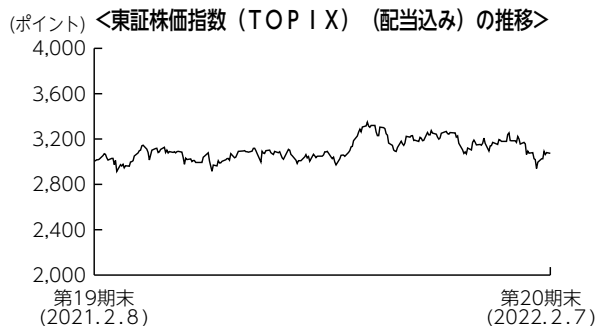
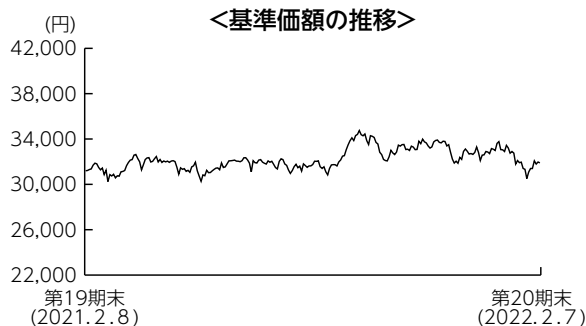
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月9日から2022年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,896円となり、前期末比で2.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】 (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。
(注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

○組入上位10業種

期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	17.6%
2	情報・通信業	9.2
3	化学	7.3
4	輸送用機器	6.9
5	医薬品	5.6
6	機械	5.6
7	サービス業	5.5
8	銀行業	4.6
9	小売業	4.6
10	卸売業	4.4



期末

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

○組入上位10銘柄

期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.0%
2	ソニー	日本・円	2.8
3	ソフトバンクグループ	日本・円	2.7
4	キーエンス	日本・円	2.1
5	任天堂	日本・円	1.3
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.3
7	日本電産	日本・円	1.3
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.3
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	日本電信電話	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,183銘柄	



期末

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.2%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	1円 (0) (0)	0.002% (0.001) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
合 計	1	0.002	
期中の平均基準価額は32,238円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2021年2月9日から2022年2月7日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		192,672.8 (6,584.913)	479,219,336 (-)	161,731.513	395,856,402

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 144,564	百万円 142,625	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	875,075,739千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	369,108,651千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	2.37

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月9日から2022年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 479,219	百万円 130,245	% 27.2	百万円 395,856	百万円 59,442	% 15.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 3,678	百万円 3,163	百万円 3,133

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 1,300

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	7,278千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	148千円
(B) / (A)	2.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

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

銘柄				銘柄				銘柄			
期首(前期末)		当 期 末		期首(前期末)		当 期 末		期首(前期末)		当 期 末	
株	数	株	数	株	数	株	数	株	数	株	数
		評 価 額				評 価 額				評 価 額	
	千株		千円		千株		千円		千株		千円
シャープ	136.8	167.6	208,997	カシオ計算機	95.1	106.5	148,780	本田技研工業	930.9	1,157.5	3,938,972
アンリツ	71	94.6	149,562	ファナック	103.8	129.1	2,875,057	スズキ	234.4	336.2	1,614,768
富士通ゼネラル	36.2	39.9	97,994	日本シイエムケイ	25.5	28.9	16,241	SUBARU	338.8	421.2	847,665
ソニーグループ	740.6	921.1	11,661,126	エンプラス	5.3	3.6	9,478	安永	5.7	7.2	6,278
T D K	57.1	213	970,215	大真空	4	19.9	24,297	ヤマハ発動機	167.1	191.9	532,906
帝國通信工業	5.6	6.7	9,112	ローム	49.2	65.8	604,044	T B K	11.8	16.9	6,929
タムラ製作所	42.3	56.8	36,749	浜松ホトニクス	84.8	105.5	612,955	エグセディ	16	22.3	37,664
アルプスアルパイン	96.5	129.9	164,713	三井ハイテック	11.6	14.6	124,100	豊田合成	38.2	47.4	106,507
池上通信機	4	5	3,215	新光電気工業	39.7	43.2	214,920	三菱工業	18.5	23.1	17,094
日本電波工業	11.5	13.3	16,651	京セラ	180.2	206.9	1,416,437	盟和産業	1.6	1.7	1,723
鈴木	5.3	6.8	5,882	太陽誘電	52.5	71.3	377,177	日本プラスチック	10.3	11.5	6,428
メイコー	—	12	44,700	村田製作所	347.3	431.9	3,556,264	ヨロズ	10.2	13.9	14,011
日本トリアム	2.5	2.9	8,816	双葉電子工業	20.3	25.1	16,892	エフ・シー・シー	19.3	24	34,248
ローランド ディー・ジエ	7	8.7	22,985	北陸電気工業	4.6	5.5	6,897	シマノ	44.3	59.1	1,533,054
フォスター電機	12.4	14.8	11,928	ニチコン	37.1	46.3	55,467	ティ・エス テック	27.4	62.1	97,000
S M K	3.1	3.5	7,570	日本ケミコン	11.9	14	26,082	ジャムコ	7	8.6	7,146
ヨコオ	8.7	10.9	28,656	K O A	16.3	22.3	32,290	精密機器 (2.7%)			
ティアク	7.3	23.5	3,125	市光工業	17.6	17.7	9,062	テルモ	362.5	416	1,724,320
ホンデン	32.2	35.4	42,480	小糸製作所	70.8	80.7	472,095	クリエートメディック	4.2	4.3	4,166
ヒロセ電機	18.2	22.8	393,984	ミツバ	21.7	27	11,205	日機装	38.2	44.1	37,529
日本航空電子工業	27.7	33.7	61,738	S C R E E Nホールディングス	20.5	25.6	288,000	日本エム・ディ・エム	6.8	8.6	13,837
T O A	14	16	12,432	キャノン電子	10.9	13.7	22,084	島津製作所	152.2	189.3	779,916
マクセル	23.4	29.3	36,039	キャノン	587.5	730.5	2,043,939	J M S	10	12.3	7,576
古野電気	15.1	17.4	18,339	リコー	300.7	408.1	400,754	グボテック	3.1	3.3	858
ユニテホールディングス	3	3.3	11,913	象印マホービン	31.9	39.8	58,625	長野計器	8.5	10.8	14,450
スミダコーポレーション	10	13.9	13,538	MUTOHホールディングス	1.2	1.2	2,510	ブイ・テクノロジ	5.5	6.4	21,760
アイコム	4.9	5.5	12,980	東京エレクトロン	69.3	93.3	5,156,691	東京計器	7.5	9.4	9,559
リオン	5	5.6	12,280	輸送用機器 (8.7%)				愛知時計電機	1.2	3.7	7,074
本多通信工業	9.4	11.9	5,712	トヨタ紡織	34.5	60	130,800	インターアクション	5.9	7.5	14,685
船井電機	13.4	—	—	芦森工業	2.4	2.5	2,242	オーバル	10.7	13.3	3,564
横河電機	118.3	147.2	274,969	ユニプレス	19.3	21.9	17,936	東京精密	19.9	24.8	112,592
新元元工業	4.5	5.6	18,900	豊田自動織機	95.7	119.2	1,060,880	マニー	47	58.6	96,865
アズビル	80	86.2	359,023	モリタホールディングス	19	23.6	29,854	ニコン	180.4	224.5	292,972
東亜ディーケーケー	6.1	7.6	6,878	三機工業	16.3	20.2	16,846	トプコン	59.5	69.1	102,682
日本光電工業	48.9	60.9	188,790	デンソー	260.4	323.7	2,751,450	オリンパス	654.2	771.1	1,744,999
チノー	3.8	4.8	7,862	東海理化電機製作所	31.2	38.8	59,946	理研計器	10.5	12	63,000
共和電業	13	14.9	5,632	川崎重工業	91.9	107.3	233,055	ダムロン	9.5	11.5	28,911
日本電子材料	4.3	7.2	16,516	名村造船所	35.7	43.7	8,827	H O Y A	234.6	287	4,439,890
堀場製作所	23.4	27.3	165,165	日本車輛製造	4.3	5.5	11,000	シード	5.2	6.9	3,608
アドバンテスト	87.9	109.3	1,007,746	三菱ロジスネクスト	15.7	19.5	19,929	ノーリツ鋼機	10.6	13.2	27,508
小野測器	4.3	6.9	3,312	近畿車輛	1.6	1.7	1,847	イー・アンド・デー	9.9	13.4	12,730
エスベック	10.5	12	24,168	日産自動車	1,394.4	1,733.9	1,038,432	朝日インテック	124.4	161.2	312,728
キーエンス	11.6	133.2	7,826,832	いすゞ自動車	342.6	461.4	687,947	シチズン時計	149.2	172.1	86,910
日置電機	5.7	7	44,240	トヨタ自動車	1,197.8	7,450.7	16,954,067	リズム	3.1	4.6	6,026
シスメックス	92.2	124.4	1,316,774	日野自動車	147.7	183.6	194,616	大研医器	9.5	12	6,324
日本マイクロニクス	20.6	25.6	38,476	三菱自動車工業	437.1	544.1	171,935	メニコン	18.1	48.8	132,540
メガチップス	11.9	13.8	57,339	エフテック	8.4	10.3	5,562	シンシア	1.2	1.8	957
O B A R A GROUP	7	6.8	22,236	レシップホールディングス	4.6	5.7	3,192	松風	5.5	6.4	12,268
澤藤電機	1.3	1.8	2,649	G M B	2.2	2.8	2,282	セイコーホールディングス	16.6	20.7	45,602
原田工業	5	7.5	7,357	ファルテック	2.3	2.9	2,105	ニプロ	88.1	109.6	117,052
コーセル	14.4	16.3	13,219	武蔵精密工業	26.4	32.7	57,421	その他製品 (2.3%)			
イリソ電子工業	9.9	12.3	52,152	日産車体	17.3	21.7	15,428	中本パックス	3.1	4.2	7,274
オプテックスグループ	19.4	24	35,256	新明和工業	33.3	41.7	38,072	スノーピーク	7	19.3	44,544
千代田インテグレ	5.1	6.4	11,936	極東開発工業	20.4	27.3	39,666	パタマンヘッドホールディングス	11.4	28.2	54,538
アイ・オー・データ機器	4.4	5.5	4,713	トビー工業	9.8	12.1	13,467	トランザクション	6.4	8.1	8,245
レーザータック	51.9	64.5	1,435,447	テラドラ	3.7	4.2	11,919	粧美堂	3	5	2,065
スタンレー電気	82.9	102.8	274,064	曙ブレーキ工業	64.1	80.6	13,863	ニホンフラッシュ	10.1	12.6	13,393
岩崎電気	4.3	5.4	12,144	タッチエス	18.1	25.7	31,122	前田工織	13	16.3	51,426
ウシオ電機	60.6	75.3	1,397,079	N O K	57.2	71.2	91,207	永大産業	16.8	20.5	6,293
岡谷電機産業	8.9	9.3	2,929	フタバ産業	29.6	36.8	15,124	アートネイチャー	11.6	12.7	8,801
ヘリオス デザインホールディング	11.2	12.9	3,715	K Y B	13.2	15.4	47,124	パンダナホホールディングス	97.8	131.8	1,124,385
エノモト	3.3	4	6,408	大同メタル工業	24.6	28.5	18,126	アイフィスジャパン	3.2	4.3	2,893
日本セラミック	12	13.8	34,610	プレス工業	58.5	73	27,813	共立印刷	21.9	25.1	3,614
遠藤照明	6.7	6.9	6,817	ミクニ	16.1	19.6	8,976	S H O E I	10.4	13.9	60,812
古河電池	8.4	10.7	13,171	太平洋工業	24.8	30.8	33,140	フラスベッドホールディングス	15.4	19.3	17,427
双信電機	5.8	6.4	3,718	河西工業	16.2	17.7	5,557	パイロットコーポレーション	20.9	24.9	104,829
山一電機	7.6	10.8	23,630	アイシン	86.5	107.7	487,342	萩原工業	6.7	9.6	11,529
図研	7.7	9.5	28,376	マツダ	370.8	461.4	406,954	トップラン・フォームズ	21.2	—	—
日本電子	21.6	30.8	192,500	今仙電機製作所	10.4	9.6	5,712	フジールインターナショナル	24.3	35.7	76,540

銘柄	期首(前期末) 当期 末				銘柄	期首(前期末) 当期 末				銘柄	期首(前期末) 当期 末			
	株数	株数	評価	金額		株数	株数	評価	金額		株数	株数	評価	金額
	千株	千株	千円	千円	千株	千株	千円	千円	千株	千株	千円	千円		
TOKAIホールディングス	56.6	70.4	63,219	6,175	OUGホールディングス	1.8	2.3	6,175	J Kホールディングス	10.7	11.7	11,629		
黒谷	3.3	4	2,548	スターゼン	4.3	10.9	22,868	日伝	9.7	12.1	26,111			
Cominix	1.7	1.8	1,317	山善	45.5	60.9	60,839	北沢産業	7.3	7.6	1,725			
三洋貿易	11.6	14.7	15,199	椿本興業	1.7	2.3	9,487	杉本商事	5.9	6.6	14,242			
ビューティガレージ	1.9	2.5	7,800	住友商事	734.9	913.9	1,678,377	杉崎電機産業	31.1	38.7	99,962			
ワイン・パートナーズ	8.5	10.9	10,823	内田洋行	4.6	6.3	28,948	東テック	3.9	4.6	11,145			
ミタチ産業	3	4	3,604	三菱商事	709	1,085.1	4,289,400	ミスミグループ本社	14.6	181.7	630,499			
シッパルスホールディングス	20.6	46.5	119,551	第一実業	5.3	6.7	28,542	アルテック	8.8	10.3	3,162			
明治電機工業	3.1	4.7	5,757	キヤノンマーケティングジャパン	28.9	35.9	89,821	タキヒヨー	4	4.1	5,781			
デリカフーズホールディングス	5.2	6	3,222	西華産業	6.2	7.9	12,687	戴玉産業	1.9	2.2	4,037			
スターティアホールディングス	2.3	3.4	2,590	佐藤商事	10	12.1	14,023	スズケン	49.3	56.6	200,647			
コマダホールディングス	25.4	31.6	67,782	菱洋エレクトロ	8.8	8.6	17,397	ジェコス	8.2	10.8	8,640			
ピーバンドットコム	1.5	2.4	1,521	東京産業	11	13.2	9,438	グローセール	12.9	17.1	7,609			
アセンテック	2.9	4.9	3,474	ユアサ商事	12	13.8	40,020	小売業 (4.2%)						
富士興産	3.5	3.8	3,689	神鋼商事	2.7	3.4	12,750	ローソン	29.5	32.1	154,240			
協栄産業	1.5	1.7	2,618	トルク	5.8	6	1,272	サンエー	8.8	11	44,935			
フルサト・マルカホールディングス	—	14	30,716	阪和興業	23.2	28.9	95,370	カワチ薬品	8.1	11.3	26,577			
ヤマエグループホールディングス	—	9.8	10,201	正栄食品工業	7.5	9.4	38,352	イービーシー・マート	18.1	22.7	118,040			
小野建	10.7	14.3	24,238	カナデン	9.6	12	12,060	ハードオフコーポレーション	5.4	6.9	5,319			
南陽	2.1	2.3	4,473	菱電商事	8.4	11.6	20,218	アスクル	10.1	32.7	54,249			
佐鳥電機	7.4	9.1	8,399	フルサト工業	6.3	—	—	ゲオホールディングス	15.6	19.4	22,445			
エコトレーディング	2.6	2.9	1,722	岩谷産業	27.9	34.8	183,744	アダストリア	16.1	15.5	27,125			
伯東	7.1	8.7	19,783	ナイス	4.7	5.1	9,205	ジーフット	7.6	10	3,170			
コンドーテック	9.2	11.6	11,982	昭光通商	3.4	—	—	シー・ヴィン・エス・バイエリア	2	2.3	869			
中山福	7.1	7.6	3,108	ニチモウ	1.6	2.4	6,182	くら寿司	6.9	15.1	55,115			
ナガイレーベン	15.5	19.3	40,916	極東貿易	3	4.1	10,893	キャンドウ	5.6	5.3	10,780			
三菱食品	12.9	14.2	45,298	アステナホールディングス	15.2	20.3	8,363	アイケイ	2.5	4	1,544			
松田産業	8.5	10.7	25,209	三菱石油	28.7	35.6	32,716	バルグループホールディングス	10.2	12.6	20,878			
第一興商	17.3	27.5	91,850	稲畑産業	27.9	31.8	64,617	エディオン	49.3	66.3	73,924			
メディアルホールディングス	116.7	156.2	339,266	G S I クレオス	2.8	6.9	7,741	サークルコーポレーション	23.9	29.6	18,766			
S P K	5.2	6	7,668	明和産業	10.8	13.3	14,856	ワッツ	5.2	7.2	4,960			
視原電気ホールディングス	4.4	5.4	10,675	クワサホールディングス	4.4	4.6	2,865	ハローズ	4.4	6.7	18,900			
アズワン	8.3	21.1	129,132	ヤマエク野	8.5	—	—	フジオフードグループ本社	9.8	12.3	16,605			
スズケン	3.5	5.3	10,732	ワキタ	22.9	31	31,434	あみやき亭	2.5	3.4	9,860			
尾家産業	3	3.2	3,184	東邦ホールディングス	37.3	46.5	87,373	ひらまつ	21.9	30.8	5,821			
シモジマ	6.5	9	9,117	サンゲツ	31.5	38.4	60,364	大黒天物産	2.7	4.7	22,419			
ドウシシャ	11	13.8	20,920	ミツロコグループホールディングス	17.1	21.3	21,917	ハニースホールディングス	9.1	11.5	11,879			
小津産業	2.3	2.5	4,920	シオネンホールディングス	4.3	5.4	17,685	フーマライホールディングス	3.3	4	2,860			
高速	6.3	8.8	12,944	伊藤忠エネクス	26	32.1	33,448	アルペン	8.9	11.2	23,990			
たけびし	3.5	5.6	8,092	サンリオ	32.6	44.9	105,290	ハブ	3.6	4.8	2,836			
リックス	2.2	2.5	3,875	サンウ テクノス	7.6	8.8	11,915	クオールホールディングス	15.7	17.8	23,745			
丸文	10.6	12.7	9,258	リョーサン	12.8	16	36,576	ジンスホールディングス	6.2	9.9	66,528			
ハピネット	9.7	12.1	18,452	新光商事	15.9	22	19,162	ビックカメラ	69	85.7	88,271			
橋本総業ホールディングス	2	3	6,027	ト一ホー	5.4	6.8	7,289	DCMホールディングス	71.9	89.3	98,578			
日本ライフライン	37.6	42.9	42,942	三信電気	6.4	6.8	11,131	ペッパーフードサービス	13.2	19.7	6,934			
タカショー	7.4	11	7,271	東陽テクノカ	12.2	14.3	15,015	MonotaRO	82.8	183.1	337,087			
マルカ	3.8	—	—	モスフードサービス	16.5	19.1	57,777	東京一番ファーズ	2.6	4	2,372			
IDOM	39.3	43.9	29,544	加賀電子	10.5	13.1	42,837	DDホールディングス	5.2	7.7	4,365			
進和	7	8.7	17,748	ソーダニッカ	11.3	15.1	13,423	きちりホールディングス	3.4	4.1	1,455			
エスケイジャパン	2.7	3.3	1,382	立花エレクトク	8.7	11.7	18,532	アークソービスホールディングス	9.7	10.8	23,727			
グイトロン	5	6.3	12,814	フォーバル	4.3	6.6	6,177	J・フロント リテイリング	139	172.8	185,932			
シークス	14.8	20.6	27,047	P A L T A C	18.7	20.3	89,624	トール・ベルスホールディングス	18.4	25	40,125			
田中商事	3.1	3.3	2,128	三谷産業	15.6	17.1	5,232	マツキョコカラ&カンパニー	48.1	89.1	363,528			
オーハンテクノカ	6.2	8.2	11,693	太平洋興発	5.1	5.6	3,662	プロコンピリー	6.1	8.3	18,467			
白鋼	3.6	4.7	12,502	B&W smeltacホールディングス	2.6	3.4	10,642	ZOZO	68.7	99.8	306,386			
ダイヤコー産産	1.1	1.7	2,012	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.1	1.2	2,354	トリジャー・ファクトリー	3.4	4.3	4,089			
伊藤忠商事	814.6	1,012.8	3,766,603	コア商事ホールディングス	3.3	10.9	6,714	物語コーポレーション	3.1	7.2	45,216			
丸紅	1,148.1	1,428.3	1,684,679	国際紙パルプ商事	25.5	30	9,450	ココカラファイン	10.4	—	—			
高島	1.6	2.3	5,444	ヤマタネ	5.3	6.9	11,102	三樹伊勢丹ホールディングス	203.4	253.3	236,582			
長瀬産業	65.5	79.6	144,872	丸紅建材リース	0.9	1.1	1,967	Hamee	2.9	3.8	4,111			
蝶理	7.5	8.2	14,678	日鉄物産	8.3	10.4	55,224	マーケットエンタープライズ	—	1.1	860			
豊田通商	116.9	145.3	717,782	泉州物産	3.3	4.1	25,953	ウエルシアホールディングス	61.5	76.6	239,578			
三共生興	18	19.6	11,074	トラスコ中山	26.7	30.2	75,349	クレイイトSDホールディングス	17.1	21.3	66,988			
兼松	46.5	53.9	69,800	オートバックセブン	43.2	48.8	68,954	丸善CH1ホールディングス	15.4	18.9	6,898			
ツカモトコーポレーション	1.7	1.8	2,354	モリト	9	10.9	7,957	ミサワ	2.4	3	1,965			
三井物産	945.5	1,124.4	3,333,846	加藤産業	16.9	21	69,090	ティエライフ	1.7	2	2,630			
日本紙パルプ商事	6.1	7.7	30,684	北恵	3.2	4	3,472	イー・ピーホールディングス	1.9	2.2	965			
カメイ	15.2	17.1	17,698	イノテック	6.6	8.7	12,815	チームニー	3.5	4.6	5,349			
東部水産	1.4	0.6	2,361	イエローハット	21.9	25.1	42,017	シュッピング	7.9	12	12,948			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	千円	株	数	千円		株	数	千円	株	数	千円		株	数	千円	株	数	千円
阿波銀行	17.8		52,895				プレミアグループ	5.4		28,575			テーオーシー	22.9		19,807				
大分銀行	6.8		17,277				ネットプロダクションホールディングス	—		33,345			東京楽天地	2		2.3			8,878	
宮崎銀行	7.3		20,138				クレディセゾン	68		122,999			レオパレス 2 1	96.5		150.2			30,640	
住信銀行	6.7		13,330				芙蓉総合リース	12.2		118,116			スターツコーポレーション	13.8		19.9			50,426	
沖縄銀行	10.7		—				みずほリース	18		74,015			フジ住友	13.6		17.2			11,438	
琉球銀行	25.4		26,923				東京センチュリー	27.1		165,228			空港施設	12.1		15			8,220	
セブ銀行	389		109,321				日本証券金融	49.4		57.1			明和地所	5.5		7			4,305	
みずほフィナンシャルグループ	1,584.6		3,001,346				アイフル	195.2		243			ゴールドフレスト	10.5		11.5			21,781	
高知銀行	4.2		3,388				リコーリース	9.2		12.8			エスリード	4.6		5.7			9,707	
山フィナンシャルグループ	145.4		124,669				イオンフィナンシャルサービス	71.3		78.8			日興グループホールディングス	17.6		23.6			11,634	
長野銀行	3.9		4,443				アコム	234.5		286			日本エスコ	21.1		27.3			20,857	
名古屋銀行	9.4		34,989				ジャックス	12.8		16.1			タカラレーベン	48.6		61			19,398	
北洋銀行	176		58,200				オリエンコーポレーション	315.1		391.5			AVANTIA	6.6		7.7			6,545	
愛知銀行	3.9		25,758				日立キャピタル	27.5		—			イオンモール	58.4		72.7			121,336	
中京銀行	4.3		9,227				オリックス	723.4		880.3			毎日コムネット	3.5		5.4			3,704	
大光銀行	3.5		5,623				三菱HCキャピタル	262.4		535.7			ファースト住建	5		5.6			6,552	
愛媛銀行	16.5		19,987				九州リースサービス	6.5		7.9			ランド	624.6		787.3			7,873	
トマト銀行	4.5		6,218				日本取引所グループ	315		367.1			カチタス	28.9		35.9			120,624	
京葉銀行	49.7		32,625				イー・キャランティ	13.3		21.2			トーセイ	16.1		20			20,820	
栃木銀行	56.1		16,779				アサックス	6.5		8.5			穴吹興産	2.7		3.4			6,616	
北日本銀行	3.7		8,347				NECキャピタルソリューション	4.8		6.2			サンフロンティア不動産	14.1		20			20,840	
東和銀行	20.5		14,892				不動産業 (1.9%)						FJネクストホールディングス	11.6		14.6			14,483	
福島銀行	13.2		4,233				いちご	129.6		161.7			インテリックス	2.7		3.5			2,163	
大東銀行	5.9		5,624				日本駐車場開発	115.5		158			ランドビジネス	4.4		6			1,452	
トモニホールディングス	90.1		38,968				スター・マイカ・ホールディングス	6.1		8			サンネクスタグループ	3.8		5			5,290	
フィデアホールディングス	114		18,994				SREホールディングス	1.3		3.5			グランディハウス	8.1		10.3			5,222	
池田泉州ホールディングス	133.5		32,828				ADワークスグループ	22.5		30			日本空港ビルデング	37.2		55.3			290,878	
証券・商品先物取引業 (0.8%)							ヒューリック	24.0		346.1			サービス業 (5.9%)							
F P G	35.8		43,724				三栄建築設計	4.7		5.9			明豊ファシリティアワークス	5.3		6.6			4,831	
ジャイアントバスタードバイザー	5.9		13,164				野村不動産ホールディングス	70.7		75			日本工営	7.1		8.3			25,024	
マーキュリアンバスタード	4.8		—				三菱投資グループホールディングス	23.7		29.9			LIFULL	39.4		43			9,933	
マーキュリアンホールディングス	—		2,789				サムティ	16.5		23.4			ミクシィ	21.6		32.1			75,691	
SBIホールディングス	143		543,856				ディア・ライフ	16.4		18.9			ジェイシーリクルーメント	7.5		11.5			23,230	
日本アジア投資	10.1		2,058				コーセーアールイー	3.5		4.6			日興MS&Aセンターホールディングス	92.6		230.5			398,073	
ジャフコ グループ	17.9		96,639				地主	7.3		9.2			メンバーズ	3.3		4.2			11,806	
大和証券グループ本社	873.3		777,684				フルサンスコーポレーション	19.1		18.9			中広	1.2		1.2			462	
野村ホールディングス	1,780.3		1,198,935				THEグループバル社	7.3		9.1			UTグループ	16.3		20.3			71,354	
岡三証券グループ	99.2		44,268				ハウスコム	1.2		1.2			アイティメディア	3.7		6.7			10,994	
丸三証券	34.6		23,423				日本管理センター	6.2		7			タケエイ	12.5		—			—	
東洋証券	38.2		7,394				サンセイラントディック	3.5		4.6			E・Jホールディングス	4.4		7.5			8,595	
東海証券	123.8		69,428				エストラスト	1.3		1.4			興亜ビネックスグループ	14.1		45.7			76,227	
光世証券	3		1,383				フージャースホールディングス	19		18.8			コジダカホールディングス	26.8		37.5			24,112	
水戸証券	31.2		10,874				オープンハウスグループ	36.7		46.1			アルトナー	2.8		3.6			3,200	
いちよし証券	23.2		18,591				東急不動産ホールディングス	316.7		426.9			パソナグループ	12.2		15.3			38,295	
松井証券	57.1		58,170				協団グループホールディングス	97.2		121			CDS	2.4		2.5			3,945	
マネックスグループ	104.4		62,658				イーブランド	2.3		2.5			リングアンドモーション	20.7		31			14,570	
極東証券	15.7		14,917				ムゲンエステート	7.3		9.4			GCA	14.6		—			—	
岩井コスモホールディングス	11.9		19,289				ビーロッド	5.4		9.9			エス・エム・エス	38.4		47.8			152,482	
アイザワ証券グループ	21.1		22,056				ファーストプラザーズ	2.2		3.5			サニサイドグループ	4		5.1			3,717	
マネーパートナーズグループ	12.8		3,341				And Doホールディングス	5.6		7.2			パソナホールディングス	113		140.5			417,285	
スパークス・グループ	53.8		17,342				シーアールイー	3		4			リニカル	6.5		8.1			5,532	
小林洋行	3		678				プロ/ティエージェンツ	1.9		1.7			クックパッド	35.6		44.1			11,554	
保険業 (2.3%)							ケイアイスター不動産	3.6		6.6			エスクリ	3.6		6.2			2,132	
かんぽ生命保険	144.5		315,435				アグレ都市デザイン	2.1		2.5			アイ・ケイ・ケイホールディングス	5.6		6.7			3,912	
SOMPOホールディングス	205.6		1,338,122				グッドコムアセット	5.5		6.4			学情	3.9		5.6			5,516	
アニコム ホールディングス	32.8		34,010				ジェイ・エス・ビー	2.2		3			スタジオアリス	5.7		6.4			13,785	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	283.3		1,349,580				テンポイノベーション	3.3		4.1			ジミックホールディングス	5.6		8			12,528	
第一生命ホールディングス	616		1,973,737				グローバル・リンク・マネジメント	2		2.7			エポコ	2.8		3.3			2,336	
東京海上ホールディングス	386.6		3,384,751				フェイスネットワーク	—		1.4			NJS	2.8		2.9			5,713	
T&Dホールディングス	348.4		687,123				パーク 2 4	62.5		77.8			総合整備保障	45		55.9			228,072	
アドバンスクリエイト	2.4		7,161				バラカ	3.1		4			カガクコム	83.5		103.1			259,812	
その他金融業 (1.2%)							宮越ホールディングス	4.4		5.5			アイロムグループ	4		5			9,995	
全国保証	30.3		176,623				三井不動産	531.4		660.9			セントレア・ホールディング	8.3		9.1			7,034	
あんしん保証	—		1,396				三菱地所	766		952.8			サイネックス	2.2		2.5			1,517	
ジェイリース	3.8		7,967				平和不動産	20		24.9			リネサンス	7		9.8			10,495	
イントラスト	3.3		3,893				東京建物	114.9		143.1			ディップ	17.6		24.7			82,374	
日本モーゲージサービス	5.9		8,724				ダイビル	30.1		—			デジタルホールディングス	7.8		9.6			12,758	
CASA	3.2		4,309				京阪神ビルディング	20.1		22.6			新日本科学	13.7		17.1			28,659	
アルヒ	17.1		23,004				住友不動産	262.1		304.3			ツクイホールディングス	26.7		—			—	

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	T O P I X	百万円 10,035		百万円 -

■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 387,140,847		% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,580,070		3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	399,720,917		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月7日)現在

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

(注1) 期首元本額	102,109,610,506円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	42,977,458円
追加設定元本額	163,175,331,486円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	17,916,384円
一部解約元本額	140,714,316,471円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	15,092,602円
(注2) 期末における元本の内訳		4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	105,875,155円
MHAMスリーウェイクオープン	561,857,238円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	985,477円
MHAM TOP I Xオープン	2,725,686,605円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	22,944,960円
MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ)	7,087,968,915円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	23,431,080円
One DC 国内株式インデックスファンド	20,422,344,253円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	21,508,092円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	4,704,569,337円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	14,273,870円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	3,424,028円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	22,637,856円
MITO ラップ型ファンド (中立的)	23,972,661円	インカム重視マルチアセット運用ファンドI2021-04 (適格機関投資家限定)	193,585,816円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	78,308,323円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05	41,677,610円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	28,249,023円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	84,110,969円
グローバル8資産ラップファンド (中立的)	21,103,225円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-07	68,984,011円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	15,896,115円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-08	47,924,787円
たわらノーロード TOP I X	1,306,069,812円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	22,733,018円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,033,861,326円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-09	49,987,822円
たわらノーロード バランス (堅実型)	40,906,841円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-12	70,694,127円
たわらノーロード バランス (標準型)	262,619,504円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	329,597,803円
たわらノーロード バランス (積極型)	394,664,404円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	34,825,039円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	3,669,806円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	116,640,502円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	174,139,046円	日米兼重み戦略ファンド (インカム重視) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	39,121,859円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	434,342,242円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (FOF 5用) (適格機関投資家専用)	7,907,522円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	283,511,087円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	57,045,218円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	405,598,982円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	101,888,672円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	705,164円	DIAM国際分散/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	4,956,036円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,916,286円	DIAM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	26,722,846円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	36,588,931円	DIAM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	5,712,676円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	6,020,593円	DIAM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,338,373円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	19,092,798円	DIAM世界/バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	7,152,634円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,009,153,068円	DIAM世界/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	34,835,196円
Oneグローバルバランス	5,199,858円	DIAM/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	557,427,217円
DIAM/バランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,065,319,872円	DIAM/バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	634,827,723円
DIAM/バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,512,005,009円	DIAM/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,809,585,772円
DIAM/バランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,794,173,475円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	31,302,862円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	349,318,358円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	31,388,733円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,113,385,483円	DIAM アサヒグローバル/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	301,727,248円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,115,312,187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)	74,733,048円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	30,317,366円	DIAM世界/バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,406,645円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,055,563,450円	DIAM世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	349,638,985円
マネックス資産設計ファンド エゴリユーション	18,529,124円	DIAM世界アセット/バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	20,826,409円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	304,544,955円	DIAM世界アセット/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	73,311,471円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	306,459,778円	DIAM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	173,199,524円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	545,764,310円	DIAM世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	237,769,545円
投資のソムリエ	13,743,021,171円	DIAM世界/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	38,321,734円
フルズコントロール	128,837,057円	DIAM国内/バランス30VA (適格機関投資家限定)	18,177,991円
投資のソムリエ<DC年金>	831,424,634円	DIAM世界アセット/バランスファンド7VA(121) (適格機関投資家限定)	291,737,796円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	337,759,108円	DIAM世界アセット/バランスファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	936,557,239円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	549,884,906円	DIAM世界アセット/バランスファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,701,235円	DIAM世界アセット/バランスファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	49,936,951円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	5,513,567円	動的パッケージファンド<DC年金>	19,960,341円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	559,030,369円	コア資産形成ファンド	13,478,680円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,846,898,552円	MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用)	692,612,483円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	41,503,360円	MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用)	65,067,902円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	20,515,309円	MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定)	2,686,127,829円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,618,660円	MHAM日本株式バッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,050,559,819円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	146,712,017円	期末元本合計	124,570,625,521円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	348,653,940円	(注3) 担保資産	
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,393,008,159円	代用として担保を提供している資産はありません。	
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	279,145,423円		

■損益の状況

当期 自2021年2月9日 至2022年2月7日

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

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。