

## 運用報告書 (全体版)

第22期<決算日2025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	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	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	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、2025年2月7日に第22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			東証株価指数(TOPIX) (配当込み) (ベンチマーク)		株組比	式入率	株先比	式物率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(配当込み) 期中 騰落率	期中 騰落率					
18期 (2021年2月8日)	円 31,417	円 0	% 13.5	ポイント 3,006.47	% 13.8	% 97.7	% 97.4	% 2.3	百万円 108,479	
19期 (2022年2月7日)	32,038	0	2.0	3,073.66	2.2	97.4	97.4	2.5	108,482	
20期 (2023年2月7日)	33,819	0	5.6	3,251.81	5.8	98.0	98.0	1.9	113,414	
21期 (2024年2月7日)	44,474	0	31.5	4,286.44	31.8	97.6	97.6	2.5	148,673	
22期 (2025年2月7日)	48,742	0	9.6	4,709.46	9.9	98.1	98.1	2.0	158,964	

(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)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章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(T O P I X) ( 配 当 込 み ) ( ベ ン チ マ ー ク )		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
	円	騰 落 率 %	ポ イ ン ト	騰 落 率 %		
(期 首) 2024年 2 月 7 日	44,474	—	4,286.44	—	97.6	2.5
2 月 末	46,680	5.0	4,499.61	5.0	97.3	2.7
3 月 末	48,738	9.6	4,699.20	9.6	97.6	2.4
4 月 末	48,293	8.6	4,656.27	8.6	97.0	3.2
5 月 末	48,829	9.8	4,710.15	9.9	97.0	3.0
6 月 末	49,528	11.4	4,778.56	11.5	96.4	3.6
7 月 末	49,250	10.7	4,752.72	10.9	96.8	3.3
8 月 末	47,818	7.5	4,615.06	7.7	97.6	2.3
9 月 末	47,074	5.8	4,544.38	6.0	97.4	2.7
10 月 末	47,948	7.8	4,629.83	8.0	97.4	2.6
11 月 末	47,691	7.2	4,606.07	7.5	97.3	2.7
12 月 末	49,599	11.5	4,791.22	11.8	97.1	3.0
2025年 1 月 末	49,660	11.7	4,797.95	11.9	97.1	2.9
(期 末) 2025年 2 月 7 日	48,742	9.6	4,709.46	9.9	98.1	2.0

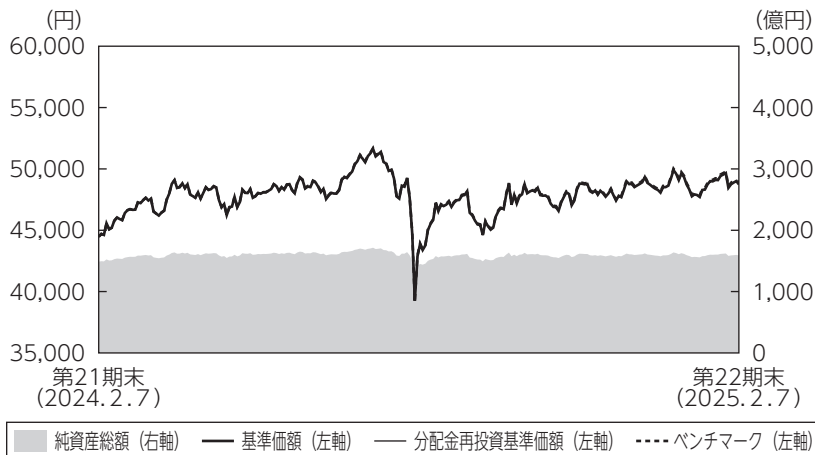
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2024年2月8日から2025年2月7日まで）

### 基準価額等の推移



第22期首：44,474円  
第22期末：48,742円  
(既払分配金0円)  
騰落率：9.6%  
(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

円安ドル高の進行や海外株式市場の上昇、良好な企業業績、資本効率改善に向けた動きなどを要因として基準価額は上昇しました。2024年8月上旬には、円高ドル安の進行や米国景気の先行き不安などを要因として一時的に急落する場面もありました。

## 投資環境

国内株式市場は、期初から2024年3月にかけては、円安ドル高の進行や海外株式市場の堅調さなどを要因として上昇しました。その後は、良好な企業業績や資本効率改善に向けた動きが株価の支えになり上昇しましたが、8月上旬には円高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する場面もありました。期末にかけては、自民党総裁選挙、トランプ次期米国大統領の政策や為替動向などを材料にしつつ、一進一退の値動きとなりました。

## 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

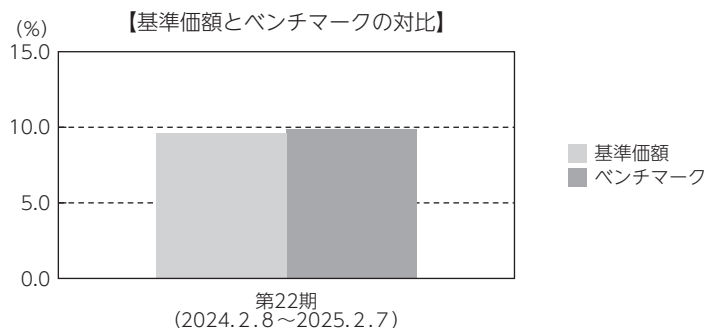
ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

※運用状況については15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9.9%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

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
	2024年2月8日 ～2025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	38,741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22期		項目の概要
	(2024年2月8日 ～2025年2月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	116円	0.242%	(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47,884円です。
(投信会社)	( 42)	(0.088)	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)	( 58)	(0.121)	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)	( 16)	(0.033)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(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	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)	( 0)	(0.001)	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	117	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。

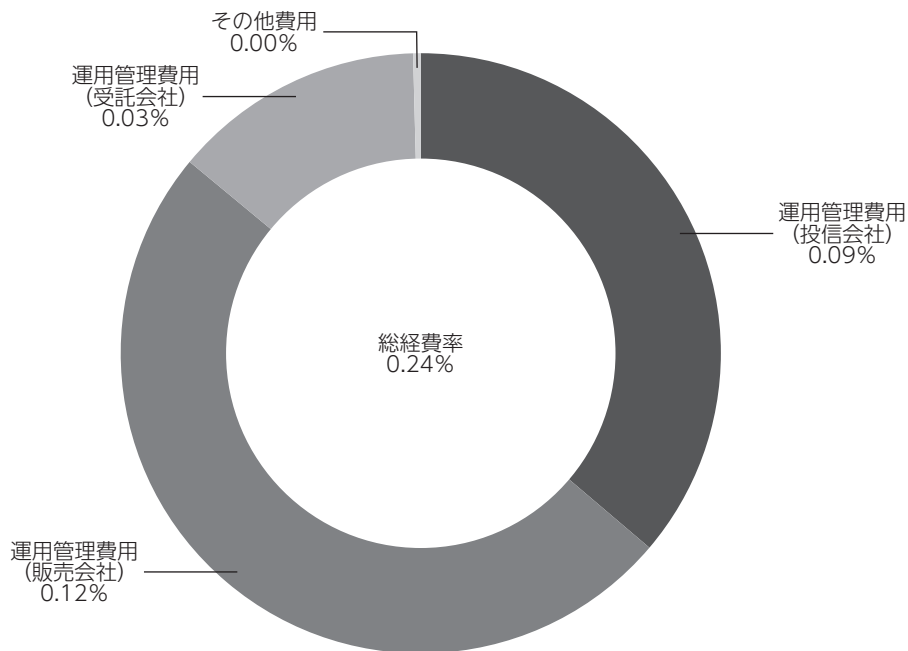
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.24%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（2024年2月8日から2025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	1,970,258	9,271,448	2,865,068	13,604,721

## ■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	201,201,370千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	575,426,729千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.34

(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（2024年2月8日から2025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)	1,512千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	149千円
(B)／(A)	9.9%

(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 116,964	百万円 1,114	% 1.0	百万円 84,236	百万円 12,515	% 14.9

平均保有割合 27.2%

(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		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,191	百万円 769	百万円 8,637

### (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 387

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、みずほりース、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□ 33,412,337	千□ 32,517,526	千円 158,952,175

## ■投資信託財産の構成

2025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	158,952,175	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	447,230	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	159,399,406	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

(2025年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	159,399,406,255円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	447,230,838
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)	158,952,175,417
(B) 負 債	434,506,913
未 払 解 約 金	241,403,444
未 払 信 託 報 酬	192,404,102
そ の 他 未 払 費 用	699,367
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	158,964,899,342
元 本	32,613,853,306
次 期 繰 越 損 益 金	126,351,046,036
(D) 受 益 権 総 口 数	32,613,853,306口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	48,742円

(注) 期首における元本額は33,429,356,248円、当期中における追加設定元本額は7,064,341,502円、同解約元本額は7,879,844,444円です。

## ■損益の状況

当期 自2024年2月8日 至2025年2月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	640,601円
受 取 利 息	643,751
支 払 利 息	△3,150
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	12,393,602,014
売 買 益	14,901,049,167
売 買 損	△2,507,447,153
(C) 信 託 報 酬 等	△386,809,901
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	12,007,432,714
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	40,250,404,121
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	74,093,209,201
(配 当 等 相 当 額)	(66,290,794,790)
(売 買 損 益 相 当 額)	(7,802,414,411)
(G) 合 計(D+E+F)	126,351,046,036
次 期 繰 越 損 益 金(G)	126,351,046,036
追 加 信 託 差 損 益 金	74,093,209,201
(配 当 等 相 当 額)	(66,290,794,790)
(売 買 損 益 相 当 額)	(7,802,414,411)
分 配 準 備 積 立 金	52,257,836,835

(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	601,920円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	12,006,728,043
(c) 収 益 調 整 金	74,093,209,201
(d) 分 配 準 備 積 立 金	40,250,506,872
(e) 当 期 配 対 象 額(a+b+c+d)	126,351,046,036
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 配 対 象 額	38,741.53
(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23期（決算日 2025年2月7日）

（計算期間 2024年2月8日～2025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23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
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
23期 (2025年2月7日)	48,882	9.9	4,709.46	9.9	98.1	2.0	610,026

(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）。

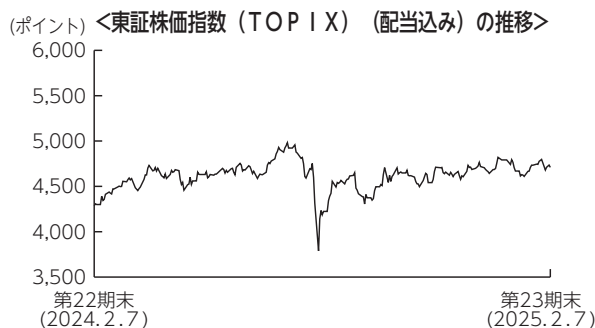
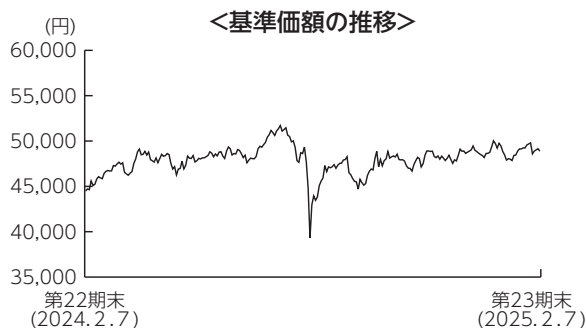
## ■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2024年 2月7日	円	%	ポイント	%	%	%
	44,494	—	4,286.44	—	97.6	2.5
2 月 末	46,708	5.0	4,499.61	5.0	97.3	2.7
3 月 末	48,777	9.6	4,699.20	9.6	97.6	2.4
4 月 末	48,342	8.6	4,656.27	8.6	97.0	3.2
5 月 末	48,888	9.9	4,710.15	9.9	97.0	3.0
6 月 末	49,597	11.5	4,778.56	11.5	96.4	3.6
7 月 末	49,330	10.9	4,752.72	10.9	96.8	3.3
8 月 末	47,905	7.7	4,615.06	7.7	97.6	2.3
9 月 末	47,169	6.0	4,544.38	6.0	97.4	2.7
10 月 末	48,055	8.0	4,629.83	8.0	97.4	2.6
11 月 末	47,806	7.4	4,606.07	7.5	97.3	2.7
12 月 末	49,729	11.8	4,791.22	11.8	97.1	3.0
2025年 1 月 末	49,801	11.9	4,797.95	11.9	97.1	2.9
(期 末) 2025年 2月7日	48,882	9.9	4,709.46	9.9	98.1	2.0

(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（2024年2月8日から2025年2月7日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は48,882円となり、前期末比で9.9%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

円安ドル高の進行や海外株式市場の上昇、良好な企業業績、資本効率改善に向けた動きなどを要因として基準価額は上昇しました。2024年8月上旬には、円高ドル安の進行や米国景気の先行き不安などを要因として一時的に急落する場面もありました。

### 投資環境

国内株式市場は、期初から2024年3月にかけては、円安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。その後は、良好な企業業績や資本効率改善に向けた動きが株価の支えになり上昇しましたが、8月上旬には円高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する場面もありました。期末にかけては、自民党総裁選挙、トランプ次期米国大統領の政策や為替動向などを材料にしつつ、一進一退の値動きとなりました。

### ポートフォリオについて

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

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

### ○組入上位10業種

#### 期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	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



#### 期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.7%
2	銀行業	8.8
3	情報・通信業	7.6
4	輸送用機器	7.3
5	卸売業	6.3
6	機械	5.4
7	サービス業	5.1
8	化学	4.8
9	小売業	4.5
10	医薬品	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	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	



#### 期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.8%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	3.0
3	ソニーグループ	日本・円	3.0
4	日立製作所	日本・円	2.7
5	リクルートホールディングス	日本・円	2.2
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.9
7	任天堂	日本・円	1.7
8	キーエンス	日本・円	1.6
9	みずほフィナンシャルグループ	日本・円	1.4
10	東京エレクトロン	日本・円	1.4
組入銘柄数		1,687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9.9%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
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は47,965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 (2024年2月8日から2025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 52,078.5 (51,703.578)	千円 116,964,724 (-)	千株 39,939.978	千円 84,236,645

(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 165,626	百万円 169,623	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	201,201,370千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	575,426,729千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.34

(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（2024年2月8日から2025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 116,964	百万円 1,114	% 1.0	百万円 84,236	百万円 12,515	% 14.9

### (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 1,191	百万円 769	百万円 8,637

### (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 387

### (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)	5,559千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	556千円
(B) / (A)	10.0%

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、みずほ証券、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)			銘柄	当 期 末					
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額			
JVCケンウッド	千株	千株	千円	新電元工業	千株	千株	千円	輸送用機器 (7.4%)		千株	千株	千円	トヨタ紡織	61.6	64.4	126,095		
三菱エンジニアリング	116.6	122.1	191,147	アズビル	5.6	6	14,988		トヨタ紡織	61.6	64.4	126,095	森霖工業	1.3	-	-		
イー PEX	14	12.8	17,894	東亜ディーケーケー	100.6	417.9	495,002		ユニプロセス	26.2	27.5	29,782	豊田自動織機	124.7	130.8	1,657,236		
大崎電気工業	10.2	-	-	日本光電工業	3.1	-	-		モリタホールディングス	25.7	24.2	52,538	三櫻工業	22.3	21.2	15,391		
オムロン	32.3	33.4	28,690	チノ	62.7	137.2	309,111		デンソー	1,206.3	1,502.1	2,950,124	東海理化電機製作所	41.2	43.3	97,901		
日東工業	112.8	141.8	690,566	共同電業	6.1	6.4	14,457		川崎重工業	119.4	115.4	823,840	名村造船所	36.4	43.7	86,963		
IDEC	19.9	20.7	59,719	日本電子材料	6.1	-	-		日本車輛製造	4.8	5.9	12,808	三菱ロジスネクスト	23.3	24.4	46,750		
正興電機製作所	21.8	23	58,006	堀場製作所	9	9.5	21,413		いすゞ自動車	1,973.1	1,916.4	854,522	トヨタ自動車	8,028.6	8,150.9	23,022,217		
不二電機工業	2.2	-	-	アドバンテスト	27.9	29	281,010		日野自動車	425.1	473.6	949,094	日野自動車	219.9	230.7	109,167		
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1.3	-	-	小野測器	418.9	483.3	4,159,279		三菱自動車工業	570.4	586.2	231,490	エフテック	4.5	-	-		
サクサ	57.6	69.1	171,126	エスピーック	2.7	-	-		レシップホールディングス	2.8	-	-	GMB	1.3	-	-		
メルコホールディングス	1.5	-	-	キーエンス	11.7	13.7	34,674		武蔵精密工業	35.7	37.5	111,787	日産車体	14.8	23.4	24,499		
テクノメディカ	4.6	-	-	日置電機	146.3	153.4	9,679,540		新明和工業	42.1	44	59,268	極東開発工業	24.2	20.6	51,026		
ダイヤモノエレクトロニクスホールディングス	3.5	2.9	5,118	シスメックス	6.9	8	58,720		トビー工業	11.9	12.4	26,796	フタバ産業	39.2	46.2	36,960		
日本電気	5.5	6.3	3,307	日本マイクロニクス	126.2	396.9	1,114,098		カヤバ	14.1	26.2	75,980	大同メタル工業	28.6	29.9	14,920		
富士通	193.9	219	3,395,595	メガチップス	26.3	25.2	99,036		大岡メタル工業	58.4	60	34,080	プレス工業	58.4	60	34,080		
沖電気工業	135.9	1,425.1	4,262,474	OBARA GROUP	11.6	11.7	67,275		ミックニ	8.2	-	-	エプソン	10.9	10.9	56,565		
岩崎通信機	66.8	75.1	71,720	澤藤電機	8	9.6	34,560		太平洋工業	33.5	35.1	52,650	河西工業	10.3	-	-		
電気興業	3.1	-	-	原田工業	0.8	-	-		河西工業	112.8	324.7	570,335	アイシン	483.6	471	487,014		
サンケイ電気	6.6	6.3	10,602	コーセル	2.9	-	-		今仙電機製作所	4.1	-	-	本田技研工業	3,565.6	3,633	5,218,804		
ナカヨ	13.7	15.9	94,732	イリソ電子工業	15.6	16.4	16,777		本田技研工業	268.5	1,239.2	2,379,264	スズキ	268.5	1,239.2	2,379,264		
アイホン	1.1	-	-	オプテックスグループ	13.4	15.6	44,085		SUBARU	453.4	462.3	1,345,293	安永	2.8	-	-		
ルネサエレクトロニクス	8	9.5	25,346	千代田インテグレーション	26.8	28.1	46,140		ヤマハ発動機	631.9	647.3	786,469	T B K	7	-	-		
セイコエプソン	963.8	1,179.8	2,909,976	キーエンス	5.7	5.4	15,282		エクセディ	23.9	25	117,625	豊田合成	49.3	43.8	120,493		
ワコム	189.5	198.6	496,400	ライザーテック	67	59.5	906,780		三菱工業	24.2	29.1	56,715	盟和産業	0.9	-	-		
アルバック	112.3	108.9	70,567	スタンレー電気	93.6	96	250,512		日本プラス	5.5	-	-	ヨロズ	13.7	15.9	16,472		
アールセル	32.4	34	206,244	ウシオ電機	74.3	67.8	138,888		エフ・シー・シー	59.1	66.4	1,389,088	シマノ	59.1	66.4	1,389,088		
E I Z O	5.9	7.7	10,140	岡谷電機産業	5	-	-		ティ・エス・テック	52	62.3	110,115	ジャムコ	7.1	9.3	16,693		
ジャパンディスプレイ	10.8	20.1	42,370	ハリオス テクノ ホールディング	6.5	-	-		精密機器 (2.3%)		-	77.4	75,465	リガク・ホールディングス	-	77.4	75,465	
日本信号	636.3	667	126,73	エノモト	1.8	-	-		デルモ	408.8	1,025.7	2,897,089	日機装	34.1	39.8	39,441		
京三製作所	30.9	36	18,432	日本セラミック	11.9	14.1	36,378		日機装	34.1	39.8	39,441	日本エム・ディ・エム	11.6	12.1	7,550		
能美防災	20	20.8	64,896	遠藤照明	2.9	-	-											





銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
コア		千株	千円	マークラインズ		千株	千円	ヴィッツ		千株	千円		千株	千円	
手間いらす	6.5	6.8	12,682	メディカル・データ・ビジョン	7.9	9.2	20,819	トビラシステムズ	0.6	—	—	0.6	—	—	
ラウンホールディングス	2.5	2.5	8,025	gumi	17.5	18.4	10,304	Sansan	1.9	—	—	48.1	43.4	108,109	
ソリトンシステムズ	10.9	11.5	10,430	ショーケース	23.8	25.1	10,993	Link-Uグループ	—	1.6	—	—	—	—	
ソフトウエアホールディングス	7.6	7.9	9,148	モバイルファクトリー	—	—	—	ギフティ	12.9	13.6	19,053	—	—	—	
T I S	12.1	11	23,980	テラスカイ	1.4	—	—	メドレー	19.7	16.9	62,868	—	—	—	
テクミラホールディングス	160.4	162.5	611,000	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6.3	6	14,832	ベース	5.1	7.5	22,147	—	—	—	
グリーホールディングス	3	—	—	PC Iホールディングス	7.6	7.9	16,921	JMDC	25	18.7	60,008	—	—	—	
GMOペパボ	49.1	51.5	27,707	アイビーシー	2.4	—	—	フォーカスシステムズ	9.8	10.3	11,433	—	—	—	
コーエーテックホールディングス	1.8	1.9	2,680	ネオジャパン	1	—	—	グレスコ	12	25.1	29,718	—	—	—	
三菱総合研究所	91.9	115.5	239,373	PR TIME S	4.9	4	6,860	フジ・メディア・ホールディングス	140.9	147.8	371,864	—	—	—	
ボルテージ	7.2	7.5	35,400	ラクス	2.9	3.1	6,919	オービック	49	285.6	1,325,469	—	—	—	
電算	1.8	—	—	ランドコンピュータ	69.4	72.5	142,897	ジャストシステム	21.1	22.3	76,266	—	—	—	
AG S	0.8	—	—	ダブルスタンダード	3.1	—	—	TDCソフト	13.7	25.9	35,224	—	—	—	
ファインデックス	2.7	—	—	オーブントピア	4.5	5.5	9,647	LINEヤフー	2,087.7	2,459.8	1,222,274	—	—	—	
プレインパッド	11.6	12.3	11,389	マイネット	8.5	10.7	6,783	トレンドマイクロ	69.3	80.7	736,871	—	—	—	
K L a b	12.2	12.7	14,960	アカツキ	2.1	—	—	IDホールディングス	69.3	10.4	18,844	—	—	—	
ホルトウインホールディングス	26.9	38.4	5,990	ベネフィットジャパン	7	7.5	22,987	日本オラクル	9.9	29.4	418,803	—	—	—	
ネクソ	25	22	9,482	Ubicomホールディングス	0.4	—	—	アルファシステムズ	28.1	4.9	16,929	—	—	—	
アイスタイル	328.2	337.8	696,543	カナミックネットワーク	4.6	4.9	7,021	フューチャー	3.9	38.1	72,123	—	—	—	
エムアップホールディングス	47.8	46.7	23,443	ノムラシステムコーポレーション	15.8	19.4	8,865	CAC Holdings	31.3	9.5	16,948	—	—	—	
エイチーム	18	18.8	30,249	チェンジホールディングス	7.1	—	—	S Bテック/ロジ	7.9	6.2	—	—	—	—	
セルシス	8.7	10.3	9,568	シンクロ・フード	31.9	37.9	55,068	トーセ	6.2	1.9	—	—	—	—	
エニゴモ	—	21.9	28,798	オークネット	4.1	—	—	オービックビジネスコンサルタント	20.6	25.9	196,166	—	—	—	
テクノスジャパン	18.6	17.1	5,899	キャピタル・アセット・プランニング	5.4	7.1	17,813	アイティフォー	18.8	18	25,740	—	—	—	
enish	5.8	—	—	セグエグループ	1.3	—	—	東計電算	4.1	4.2	18,858	—	—	—	
コロプラ	6.6	—	—	エイトレッド	2.1	—	—	エクسسネット	1	—	—	—	—	—	
オルトプラス	56.9	52.2	26,256	マクロミル	1	—	—	大家商会	72.7	174.2	630,604	—	—	—	
ブロードリーフ	5.8	—	—	ビーグリー	28.8	29.4	37,073	サイボウズ	20.2	21.1	57,603	—	—	—	
クロス・マーケティンググループ	69.6	61.7	40,228	オロ	1.4	—	—	電通総研	17.8	14.9	92,529	—	—	—	
デジタルハーツホールディングス	3.1	—	—	ユーザローカル	5.3	6.5	17,121	ACCESS	15.2	16.1	17,082	—	—	—	
メディアアドバ	9.1	10.9	11,434	テモナ	6.2	6.5	12,311	デジタルガレージ	23.4	24.5	100,082	—	—	—	
じげん	6.6	6.9	11,302	ニーズウェル	1.5	—	—	イーエムシステムズ	24.5	25.6	19,942	—	—	—	
ブイキューブ	42.8	38.3	17,618	PKSHA Technology	3.6	—	—	ウェザーニューズ	4.5	12.2	42,029	—	—	—	
エンカレッジ・テクノロジー	17.5	20.9	4,389	マネーフォワード	—	12.3	48,585	C I J	24.4	38.2	18,641	—	—	—	
サイバーリンクス	1.5	—	—	サインポスト	32.7	37.5	167,175	ビジネスエンジニアリング	2.8	3.6	13,644	—	—	—	
ディー・エル・イー	2.5	—	—	SUN ASTERISK	2.5	—	—	日本エンタープライズ	6.6	—	—	—	—	—	
フィックスターズ	4.6	—	—	プラスアルファ・コンサルティング	10.4	10.9	7,749	WOWOW	11	11.5	11,592	—	—	—	
CART A HOLDINGS	16.5	15.5	30,690	電算システムホールディングス	8.7	19.4	34,900	スカラ	13.5	14.2	5,580	—	—	—	
オプティム	6.9	8.7	12,728	APPIER GROUP	6.5	6.8	16,061	インテリジェント ウェブ	3.5	—	—	—	—	—	
セレス	15.1	15.9	12,258	ビジョナル	50.1	46.8	75,722	ANY COLOR	15.5	20.7	69,552	—	—	—	
S H I F T	5.9	6.9	20,803	ソルクシーズ	11.2	18.1	133,306	IMAGI CA GROUP	14.7	15.5	8,292	—	—	—	
ティーガイア	9.7	152.5	215,711	フェイス	5.3	—	—	ネットワンシステムズ	59.2	—	—	—	—	—	
セック	15.4	—	—	ハイマックス	1.8	—	—	システムソフト	50.8	53.2	3,298	—	—	—	
テクマトリックス	1.8	2.6	13,052	野村総合研究所	4.5	4.7	6,420	アルゴラフィックス	13.5	14.2	70,858	—	—	—	
プロシップ	26.8	33.3	79,886	CEホールディングス	3.4	—	—	マーベラス	23.8	28.4	14,995	—	—	—	
カネホ・オンライン・エンターテイン	7.1	6.8	10,363	日本システム技術	5.4	14.3	25,539	エイベックス	25	28.9	41,616	—	—	—	
GMOペイメントゲートウェイ	38.2	38	127,908	インテージホールディングス	5.4	8.6	15,136	B I P R O G Y	48	52	226,980	—	—	—	
ザップラス	29.3	35	298,025	東邦システムサイエンス	16.6	7.1	8,981	都築電気	7.7	9.3	23,724	—	—	—	
システムリサーチ	1.5	—	—	ソースネクスト	5.5	78.1	18,119	T B Sホールディングス	7.7	75.9	322,726	—	—	—	
インターネットインシアティブ	5	10.5	17,608	インフォコム	67.1	—	—	日本テレビホールディングス	73.7	136.2	385,173	—	—	—	
さくらインターネット	70.1	84.1	243,805	シンプルクス・ホールディングス	18.9	—	—	テレビ朝日ホールディングス	129.8	13.7	14.4	9,374	—	—	
GMOグローバルサイン・ホールディング	16.5	24.1	117,005	HEROZ	22.1	30	84,210	スカパーJ SATホールディングス	13.7	11.9	129,896	—	—	—	
S R Aホールディングス	4.5	4.8	11,750	ラクスル	5.8	6.1	6,032	テレビ東京ホールディングス	35.6	37.2	95,120	—	—	—	
システムインテグレータ	7.5	8.7	38,758	メルカリ	35.3	37.1	46,857	日本B S放送	113.9	19.5	129,896	—	—	—	
朝日ネット	2	—	—	I P S	71.4	84.8	195,633	ビジョン	10.6	9.5	30,685	—	—	—	
e B A S E	15.8	16.5	10,972	システムサポートホールディングス	4.2	4.6	11,794	スマートパリュウ	2.4	—	—	—	—	—	
アパントグループ	20.7	21.8	13,167	イーソール	7.6	—	—	U-NEXT HOLDINGS	22.1	23.2	27,283	—	—	—	
アドソル日進	18.5	19.4	38,780	東海ソフト	5.7	6	12,210	ワイヤレスゲート	1.9	—	—	—	—	—	
ODKソリューションズ	6.2	6.5	13,357	ウイングアーク1 s t	10.6	10.4	6,988	日本通信	16.4	51.6	92,467	—	—	—	
フリービット	1.3	—	—	ロト・コミュニケーションズ・ホールディング	1.1	—	—	クロップス	2.8	—	—	—	—	—	
コムチュア	6.4	6.7	10,184	サンバーワークス	15.2	16.1	56,269	日本電信電話	144.3	123.6	17,551	—	—	—	
アステリア	21.2	20.2	40,642	東名	3.9	5.3	4,780	KDD I	0.9	—	—	—	—	—	
アイル	11.5	12	7,224		3	2.6	6,500		43,620.3	45,743.3	6,719,690				
	6.8	8.6	22,471		0.5	—	—		1,133.2	1,131	5,512,494				

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
ソフトバンク		千株	千円		千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		
光通信	2,360	24,605.2	4,918,579				OCHIホールディングス	1.6	—	—		ツカモトコーポレーション	1	—	—					
エムティアーアイ	14.8	17.7	639,678				TOKAIホールディングス	84	88.1	81,492		三井物産	1,165.6	2,383.4	6,832,016					
GMOインターネットグループ	10.1	10.5	11,256				M E R F	2.2	—	—		日本紙パルプ商事	7.4	77.6	48,655					
ファイバーゲート	54.2	50.1	141,206				C o m i n i x	1.4	—	—		カメイ	16.4	17.2	29,566					
アイドマーケティングコミュニケーション	7.9	8.1	7,597				三洋貿易	17.5	16.7	25,367		東都水産	0.4	—	—					
KADOKAWA	1.8	—	—				ビューティガレージ	4.9	5.2	7,207		OUGホールディングス	1	—	—					
学研ホールディングス	77.5	81.3	287,802				ウイン・パートナーズ	10.1	11.7	15,596		スターゼン	10.7	11.1	32,556					
インプレスホールディングス	24.4	28.1	28,549				ミタチ産業	1.9	—	—		山善	46.9	54.5	71,231					
センリン	25.1	26.2	24,601				シッパルスクエアホールディングス	55.6	64	131,168		椿本興業	3.1	8.9	19,330					
昭文社ホールディングス	2.9	—	—				明治電機工業	5.8	6.1	9,125		住友商事	936.3	972.2	3,286,036					
インプレスホールディングス	6.6	—	—				デリカフーズホールディングス	3	—	—		内田洋行	6.3	6.6	44,880					
アイネット	8.9	9.4	18,856				スターティアホールディングス	1.8	—	—		三菱商事	3,065.3	2,998.1	7,559,709					
松竹	7.6	8.8	107,536				コメダホールディングス	37.9	42.5	115,600		第一実業	14.6	15.4	37,345					
東宝	81.6	96.2	678,594				ピーバンドトコム	0.9	—	—		キャノンマーケティングジャパン	35.8	31.9	163,583					
東映	4.8	25.3	145,981				アセンテック	5.9	6.2	5,741		西華産業	6.1	7.7	35,651					
NTTデータグループ	383.4	402.1	1,230,426				富士興産	1.9	—	—		佐藤商事	10.9	11.3	17,221					
ピー・シー・エー	8.4	10.1	19,816				協栄産業	0.7	—	—		菱洋エレフトロ	14.7	—	—					
ビジネスブレイン太田昭和	5.7	6.6	15,114				マルサト・マルカホールディングス	13.8	13.1	30,876		東京産業	14.1	16.5	12,210					
D T S	30.9	27	115,425				ヤマエグループホールディングス	8.7	17.5	38,465		ユアサ商事	12.1	14	61,740					
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67	77.3	525,640				小野建	15.4	17.8	27,091		神鋼商事	3.9	3.5	21,315					
シーイーシー	18.5	19.4	37,810				南陽	1.4	—	—		トルク	3.7	—	—					
カブコン	131.1	305.7	1,156,768				佐島電機	8.6	11.3	18,938		阪和興業	27.8	26.6	132,601					
アイ・エス・ピー	7.5	7.2	9,748				エコーレーディング	1.3	—	—		正栄食品工業	10.3	10.7	43,923					
ジャズテック	9	—	—				伯東	8.9	9.3	42,547		カナデン	11.6	12.2	18,568					
S C S K	102.6	125.7	449,377				コンドーテック	11.9	12.4	16,678		R Y O D E N	12.5	13.2	32,234					
N S W	6.3	6.8	20,366				中山福	3.9	—	—		岩谷産業	35.2	161.2	266,141					
アイネス	11.4	12	21,396				ナガイレイベン	19.6	20.4	40,208		ナイス	2.1	—	—					
T K C	23.3	27.4	102,750				三菱食品	14.3	14.9	72,041		ニチモウ	2.2	—	—					
富士ソフト	29.5	42.6	425,148				松田産業	11.8	12.3	39,114		極東貿易	9.2	9.7	14,879					
N S D	52.3	59.2	207,140				第一興商	59.9	62.8	111,972		アステナホールディングス	29	30.6	13,647					
コナミグループ	54.9	57.7	1,064,276				メディカルホールディングス	157.3	175.9	386,804		三菱オプリー	37.2	37.7	67,897					
福井コンピュータホールディングス	9.1	10.7	32,266				S P K	6.9	6.6	14,124		稲畑産業	30.6	43.8	137,970					
J B C Cホールディングス	9.7	10.2	50,745				萩原電気ホールディングス	6.6	7	24,710		G S Iクレオス	8.3	8.7	19,157					
ミロク情報サービス	13.3	14	25,830				アズワン	24.2	50.3	125,875		明和産業	18.3	24	17,112					
ソフトバンクグループ	723.4	758.6	7,345,523				スズデン	5.4	6.9	13,206		クワザワホールディングス	2.5	—	—					
卸売業 (6.4%)							尾家産業	1.6	—	—		ウキタ	25.6	24	43,032					
リョーサン豊洋ホールディングス	—	24.7	62,194				シモジマ	10.4	10.8	14,526		東邦ホールディングス	42.8	43.7	180,306					
高千穂交易	4.9	6.4	25,760				ドウシシャ	14.3	14.9	31,319		サンゲツ	35.6	40.8	121,788					
オルパルスクエアホールディングス	1.1	—	—				小津産業	1.5	—	—		ミツコグループホールディングス	19.8	20.6	37,430					
伊藤忠食品	3.5	3.6	27,360				高速	9.2	9.7	23,415		シナンホールディングス	4.3	4.6	28,704					
エレマテック	13.9	—	—				たげびし	5.9	6.9	13,213		伊藤忠エネクス	38.4	40.3	66,333					
あらた	23.7	24.8	79,856				リックス	2.6	3.7	10,789		サンリオ	43.8	131.7	768,601					
トーマンデバイス	2.2	2.3	13,984				丸文	13.8	14.5	16,399		サンワ テクノス	7.9	7.3	16,154					
東亜エレクトロ デバイス	15.4	16.2	51,435				ハピネット	13.2	12.4	60,326		リョーサン	10.9	—	—					
日陽ウィルズホールディングス	26.6	26.2	50,566				徳本総業ホールディングス	6.1	6.4	7,916		新光商事	20.8	21.9	21,527					
双日	172.3	180.5	604,314				日本ライフライン	45.4	43.5	68,904		トーホー	6	6.9	18,574					
アルフレッサ ホールディングス	155.3	151.3	300,179				タカショー	13.5	13.2	5,319		三信電気	6.2	6.6	14,196					
横浜冷凍	42.1	40.9	35,255				I D O M	40.9	55	61,545		東陽テクノカピ	15.7	14.9	21,009					
神栄	1	—	—				進和	9.5	9.9	28,541		モスフードサービス	22.8	23.9	83,291					
ラサ商事	6.3	8.9	12,646				エスケイジャパン	1.7	—	—		加賀電子	14.1	33.1	93,606					
アルコニック	20.4	23.3	35,206				ダイトロン	6.1	7	21,945		ソーダニッカ	13.1	15.9	18,269					
神戸物産	119.7	125.6	442,237				シークス	22	23.3	26,841		立花エレテック	10.3	9.7	25,384					
ハイパー	1.6	—	—				田中商事	1.9	—	—		フォーバル	6.1	6.4	8,774					
あい ホールディングス	24.8	25.9	50,997				オーハシテクニカ	8.1	7.7	15,176		P A L T A C	20.9	25.2	105,310					
ディー・ブイエックス	1.9	—	—				白銅	4.5	4.8	11,390		三谷産業	27	28.3	9,452					
ダイボウホールディングス	68.5	71.8	211,020				ダイコー通産	0.7	—	—		太平洋興発	2.5	—	—					
マクニカホールディングス	36.6	125.7	224,877				伊藤忠商事	1,039.9	1,090.5	7,287,811		西井Smittacホールディングス	3.9	—	—					
ラクト・ジャパン	6	6.9	20,320				丸紅	1,289.8	1,333.1	3,146,116		ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.6	—	—					
バイタルカーエアクー・ホールディングス	23.4	22.5	26,145				高島	4.7	—	—		コア商事ホールディングス	10.9	11.8	7,257					
八洲電機	12.5	13.2	23,350				長瀬産業	70.9	72.4	202,249		K P Pグループホールディングス	40	33.7	21,669					
メディアスホールディングス	9	9.5	8,531				蝶理	9.7	8.7	28,144		ヤマタネ	6.8	6.5	25,025					
レスタ	13.2	13.9	34,736				豊田通商	135.5	487.4	1,228,004		丸紅建材リース	0.5	—	—					
ジオリーアップグループ	1.6	—	—				三共生興	21.5	21.1	12,871		泉州電業	7.2	10.6	56,180					
大光	3.6	—	—				兼松	64.7	67.8	176,076		トラスコ中山	32.5	34.1	68,200					

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額
オートバックスセブン		千株		千円	マーケットエンタープライズ		千株		千円	ゼンショーホールディングス		千株		千円
モリト	53.9	56.5	84,750		ウエルシアホールディングス	0.6	—	—	—	幸楽苑	78.8	92.1	806,151	
加藤産業	11.1	12.8	19,993		クリエイティブ5Dホールディングス	80.2	84.2	180,777		ハーグスレイ	11.4	12	12,732	
北恵	19.2	20	90,200		丸善CHIホールディングス	21.9	23.1	65,049		サイゼリヤ	2.4	—	—	
イエローハット	1.7	—	—		ミサワ	8.3	—	—	—	V Tホールディングス	22.9	24.1	110,980	
J Kホールディングス	24.6	28.5	82,137		ティーライフ	1.5	—	—	—	魚力	58.8	63.1	33,379	
日伝	11.9	12.4	12,796		エー・ピーホールディングス	0.9	—	—	—	ボブア	5.4	5.7	13,851	
北沢産業	10.5	9.3	26,700		チムニー	1.7	—	—	—	フジ・コーポレーション	1.8	—	—	
杉本商事	4.2	—	—		シュッピン	2.1	—	—	—	ユナイテッドアローズ	7.4	7.4	14,637	
因幡電機産業	7.3	14.4	18,777		オイシックス・ラ・大地	14	16	18,096		ハイデイド高	18.2	17.3	39,322	
東テク	40.1	45.2	173,432		ネクステージ	20.8	26.1	36,957		京都きもの友禅ホールディングス	22.9	26.2	72,967	
ミスミグループ本社	5.1	16.3	37,946		ジョイフル本田	35.3	37	56,240		コロワイド	3.7	—	—	
アルテック	233.6	245	577,465		エターナルホスピタリティーグループ	45	45	85,500		トッパカルチャー	66.5	91.6	155,720	
タキヒヨー	3.7	—	—		すかいらーくホールディングス	5.7	6	16,038		P L A N T	12.2	64	62,272	
蔵王産業	1.6	—	—		S F Pホールディングス	11.8	12.4	25,296		スギホールディングス	2.2	—	—	
スズケン	1.2	—	—		ヨシックスホールディングス	211.4	221.8	538,197		ヴァア・ホールディングス	1.5	—	—	
ジェコス	58.9	53.4	248,897		ヨシックス・スーパーマーケット・ホールディングス	8.5	9.2	19,936		スクロール	31.2	87.2	227,853	
グローセル	9.3	9.7	9,884		ゴルフダイジェスト・オンライン	12	12.6	21,029		木曽路	7.6	7.9	15,405	
小売業 (4.6%)	18.1	—	—		BEENOS	3.2	5.4	15,881		S R Sホールディングス	10.2	—	—	
インターメスティック	—	9.3	19,781		あさひ	43.1	69.2	53,837		千趣会	23	24.2	25,143	
ローソン	—	—	—		日本調剤	7	9.5	3,391		リテールパートナーズ	14.6	15.4	28,890	
サンエー	32.9	—	—		トーエル	6.3	10.1	40,147		上新電機	23.4	24.5	52,920	
カワチ薬品	11.8	27.5	82,500		セブン&アイ・ホールディングス	14.3	13.6	19,774		日本瓦斯	25.5	26.7	33,882	
エービーシー・マート	12.1	12.6	33,604		トリドールホールディングス	10.5	10.7	14,669		ライオンホールディングス	28.4	32.8	7,740	
ハードオフコーポレーション	67.7	71	220,171		TOKYO B A S E	13.1	32.1	229,194		Mr Ma x H D	23	24.1	31,281	
アスクル	5.5	6.4	12,115		ワイルダラスホールディングス	3.1	—	—	—	デンアライド	15.3	16.1	36,917	
グオホールディングス	37.3	38.2	64,252		JMホールディングス	533.1	1,792.1	4,275,054		AOKIホールディングス	82	77.6	169,362	
アダストリア	17.4	18.1	33,304		サツドラホールディングス	104.7	121.9	162,980		オークワ	27.3	28.5	74,185	
ジフット	18.7	22.6	71,529		サマルクホールディングス	32.5	28.4	259,434		コムレ	0.5	—	—	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	5.7	—	—		フェリスシモ	12.5	13.2	33,211		青山商事	15	—	—	
くら寿司	0.9	—	—		トリドールホールディングス	1.5	—	—	—	しまむら	14.8	15.6	18,688	
キャンドウ	18.1	19	51,281		TOKYO B A S E	43.4	45.4	172,701		はせがわ	16.2	17	61,880	
IKホールディングス	5.5	5.8	19,546		JMホールディングス	18.5	17.4	5,933		丸井グループ	20	20.8	47,257	
バルグループホールディングス	2.3	—	—		サツドラホールディングス	1.4	—	—	—	アクシア リテイリング	19.5	20.3	13,986	
エディオン	30.4	37.1	122,986		アルペン	11.7	12.2	28,670		近鉄百貨店	9.1	—	—	
サラーコーポレーション	61.2	70.7	128,391		ハブ	2.8	—	—	—	イズミ	33.2	34.7	45,075	
ワッツ	32.5	34.1	26,904		クオールホールディングス	11.6	12.1	13,322		イズミ	22.2	25.9	20,253	
ハローズ	3.3	—	—		パロックジャパンリミテッド	4.1	4.9	6,433		平和堂	23.8	21.9	64,298	
フジオフードグループ本社	7	6.5	24,277		パルティオホールディングス	12	18.9	14,874		フジ	33.1	34.6	72,867	
あみやき亭	17.4	18.2	20,475		スリのアオキホールディングス	46.6	42.2	135,577		井筒屋	18.2	37.9	336,817	
ひらまつ	3.7	11.7	18,275		カスリの源ホールディングス	7.9	12.1	14,798		高島屋	3.3	—	—	
大黒天物産	16.4	—	—		FOOD & LIFE COMPANIES	82.5	86.5	358,110		松屋	106.9	225.4	288,624	
ハニースホールディングス	4.8	5	36,200		メディカルシステムネットワーク	16.8	15.9	6,375		エイチ・ツー・オー リテイリング	26.2	27.5	29,342	
ファーマライズホールディングス	13.7	14.4	24,508		一家ホールディングス	1.7	—	—	—	丸井グループ	68.5	78.9	178,235	
アルペン	1.6	—	—		ジャパングラフトホールディングス	4.9	—	—	—	アクシア リテイリング	6.6	9.3	20,720	
ハブ	12.7	13.5	29,727		はるやまホールディングス	3.3	—	—	—	イズミ	102.7	107.8	273,326	
クオールホールディングス	2.2	—	—		ノジマ	44.9	53	121,052		フジ	10.6	44.2	41,238	
ジーンズホールディングス	21.3	20	30,460		コジマ	24.3	25.5	36,286		ヤオコー	3.2	—	—	
ビックカメラ	9.2	12.3	87,453		ライトオン	5.2	—	—	—	イズミ	524.4	600	2,199,600	
DCMホールディングス	82.3	97.1	161,817		良品計画	168.9	193.1	755,986		イズミ	27.4	24.6	75,276	
ベッパーフードサービス	81.8	84	117,096		パリミキホールディングス	8.6	—	—	—	平和堂	25.9	27.1	63,766	
Monotaro	35.8	47.8	7,934		アドヴァングループ	14.7	13.9	13,622		フジ	23.7	29.8	62,729	
東京一番フーズ	219.3	230	625,600		アルビス	5	5.4	14,299		ヤオコー	17.5	19.2	172,281	
DDグループ	1.7	—	—		コナカ	7.4	—	—	—	ゼビオホールディングス	21	22.2	27,794	
きちりホールディングス	4.4	—	—		ハウス オブ ローゼ	0.9	—	—	—	ケーズホールディングス	103.9	109	157,723	
J.フロント リテイリング	1.8	—	—		G-7ホールディングス	16.9	17.7	24,603		Olympicグループ	3	—	—	
ドトール・日レスホールディングス	177.5	186.3	390,391		イオン北海道	45.7	40.1	34,686		日産東京販売ホールディングス	10.3	—	—	
マツキヨココカラ&カンパニー	27.4	28.7	66,957		ヒマラヤ	25.6	31.3	31,738		シルバーライフ	3	4.6	3,330	
プロンコビルー	281.4	285.9	633,268		コーナン商事	2.2	—	—	—	Genky DrugStores	6.8	14.3	41,770	
ZOZO	9.1	9.6	34,128		エコス	19	17.8	62,923		ナルミヤ・インターナショナル	1.1	—	—	
トレジャー・ファクトリー	98.6	120.7	598,551		ワタミ	5.7	6.1	12,297		ブックオフグループホールディングス	9	11.7	15,678	
物語コーポレーション	8.5	11.1	17,582		マルシェ	16.4	19.5	17,881		ギフトホールディングス	6.5	7.9	28,993	
三遊伊勢丹ホールディングス	25.8	31.5	106,312		西松屋チェーン	312.4	327.8	1,412,162		アインホールディングス	21.3	16.3	74,181	
Hamee	260.5	242.4	606,484							GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS	8.7	9.2	29,486	
	6.2	6.6	8,580							ヤマダホールディングス	475.7	498.7	219,428	

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	評 価 額	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額	株	数	評 価 額
アー克蘭ズ		千株	千円		千株	千円	大垣共立銀行		千株	千株	千円	アコム ホールディングス		千株	千株	千円		千株	千円	
ニトリホールディングス	46	48.3	80,467	56.3	59.1	1,071,187	清水銀行	12.9	13.6	25,064	MS&ADインシニアグループホールディングス	322.4	1,106.9	3,583,035	48.9	51.3	32,729			
グルメ杵屋	12.6	13.3	14,536				福井銀行	5.7	6	9,300	第一生命ホールディングス	703.6	710.4	2,998,598						
愛眼	5	-	-				富士銀行	1.1	-	-	東京海上ホールディングス	1,423.4	1,474.3	7,427,523						
ケユーホールディングス	7.3	9.5	10,744				滋賀銀行	24	23	106,260	T&Dホールディングス	386.7	405.5	1,220,149						
吉野家ホールディングス	57	63.4	185,857				南都銀行	21.7	22.9	80,264	アドバンスクリエイティブ	8.3	11.7	6,364						
樫屋フーズホールディングス	7.3	7.6	45,068				百五銀行	135.5	142.2	96,127	その他金融業 (1.2%)									
サガミホールディングス	23.2	26	45,942				紀陽銀行	51.5	53.9	118,310	NEXYZ Group	2.1	-	-						
関西フードマーケット	10.5	-	-				ほくほくフィナンシャルグループ	89.1	84.9	186,737	全国保証	37.7	39.7	217,714						
王将フードサービス	11.5	32.1	97,905				山陰合同銀行	90.2	94.6	119,290	あんしん保証	2.9	-	-						
ミニストップ	11.2	13.6	23,133				鳥取銀行	2.2	-	-	ジェイリース	4.3	11.2	14,817						
アークス	28.4	27.3	74,201				百十四銀行	14.2	14.7	50,127	イントラスト	2.5	-	-						
パローホールディングス	29.5	31	67,518				四国銀行	21.2	22.4	26,320	日本モーゲージサービス	3.5	-	-						
ベルク	7.7	8	52,000				阿波銀行	20.2	21.1	56,442	CASA	2.5	-	-						
大 庄	7.4	9.8	10,780				大分銀行	8.7	9.2	28,934	SBIアルビ	13.8	15.5	13,082						
ファーストリテイリング	69.6	91.2	4,456,032				宮崎銀行	8.7	9.9	31,828	プレミアグループ	24.3	25.5	63,979						
サンドラッグ	52.2	54.6	221,730				佐賀銀行	8.5	8.8	20,389	ネットプロテクションホールディングス	47.7	50.3	24,395						
ザグスパー ホールディングス	13.1	15.5	13,981				琉球銀行	30.7	34.6	39,790	クレディセゾン	91.3	95.6	345,785						
ヤマザウ	1.4	-	-				セブン銀行	451.4	540.9	161,296	芙蓉総合リース	13.3	14	156,870						
やまや	1.5	-	-				みずほフィナンシャルグループ	1,943.7	2,038.2	8,478,912	みずほリース	24.1	113.4	118,503						
ペルーナ	37.2	39.2	34,104				高知銀行	2.2	-	-	東京センチューリー	107.6	112.8	173,035						
<b>銀行業 (9.0%)</b>							山口フィナンシャルグループ	141.2	148.1	248,733	日本証券金融	52.9	55.3	102,139						
いざぎホールディングス	171.4	197.7	311,476				名古屋銀行	9.3	9.5	70,395	アイフル	212	250.1	87,535						
しずおかフィナンシャルグループ	320	332.8	453,440				北洋銀行	218.2	205.9	103,155	オリックス	13.7	14.4	74,160						
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	121.3	127.2	198,940				大光銀行	2.1	-	-	イオンフィナンシャルサービス	82.7	86.7	108,244						
楽天銀行	50.1	70.1	341,947				愛媛銀行	19.4	22.3	24,886	アコム	257.1	359.3	141,240						
京都フィナンシャルグループ	182.5	190	409,355				トマト銀行	2.3	-	-	ジャックス	15.3	18	69,480						
島根銀行	1.9	-	-				京葉銀行	60.4	67.8	55,596	オリエントコポレーション	47	49.4	39,915						
じもとホールディングス	5.6	-	-				栃木銀行	71.9	69.1	20,799	オリックス	877.7	905.5	2,917,521						
めがきフィナンシャルグループ	714.5	758.2	498,971				北日本銀行	4.7	5.4	17,010	三菱HCキャピタル	641.6	757	769,869						
東京ほほフィナンシャルグループ	18.4	19.3	101,904				東和銀行	26.4	27.7	18,226	九州リースサービス	2.6	-	-						
九州フィナンシャルグループ	278.7	265.7	201,666				福島銀行	6.6	-	-	日本取引所グループ	375.7	898.3	1,439,974						
ゆうちょ銀行	1,582.4	1,244.6	1,961,489				大東銀行	2.7	-	-	イー・ギャランティ	23.4	24.6	42,410						
富士第一銀行	45.7	48	48,864				トモニホールディングス	136.3	144.3	62,770	アサックス	3	-	-						
ココロケア・フィナンシャルグループ	772.7	803.3	692,685				フィデアホールディングス	14.9	15.7	23,424	NECキャピタルソリューション	7.1	7.4	28,601						
西日本フィナンシャルホールディングス	81.3	93	186,000				池田泉州ホールディングス	199.7	209.4	88,785	<b>不動産業 (1.8%)</b>									
北國フィナンシャルホールディングス	12.9	13.6	32,476				<b>証券・商品先物取引業 (1.0%)</b>				robot home	39.9	41.7	6,046						
北越フィナンシャルグループ	22.6	47.5	133,617				F P G	48.7	53.8	132,617	大東建託	52.8	51.4	803,382						
ひろぎんホールディングス	205	212.5	252,237				ジャロインベストメントアドバイザー	23.4	24.5	29,890	いちご	165.9	127.8	46,008						
おきなわフィナンシャルグループ	12.3	11.8	30,314				マキキアホールディングス	3.3	-	-	日本駐車場開発	152.4	179.7	37,377						
十六フィナンシャルグループ	18.7	21.1	98,115				SBIホールディングス	211	243	1,059,480	スター・マイカ・ホールディングス	16.7	15.6	13,338						
北陽フィナンシャルホールディングス	15.2	14.7	77,322				日本アジア投資	4.7	-	-	SREホールディングス	6.2	5.6	21,168						
プロレアホールディングス	16.5	17.2	29,119				ジャフコ グループ	42.9	44.8	100,934	ADワークスグループ	16.1	-	-						
あいちフィナンシャルグループ	22.2	28.1	75,870				大和証券グループ本社	1,115.5	1,079.9	1,148,473	ヒューリック	335.9	352.3	471,553						
あおぞら銀行	103.5	104.1	233,496				野村ホールディングス	2,421.5	2,539.5	2,630,922	野村不動産ホールディングス	80.1	94.7	393,573						
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,769.7	9,686.2	18,510,328				岡三証券グループ	126.5	119.4	76,057	三菱UFJホールディングス	30.9	32.4	16,588						
りそなホールディングス	1,679.2	1,865	2,121,437				丸三証券	47.9	50.3	50,300	サムディ	22.9	-	-						
三井住友トラストグループ	517.5	537.6	2,059,545				東洋証券	38.2	45	26,100	ディア・ライフ	24.5	25.7	26,316						
三井住友フィナンシャルグループ	1,023.9	3,150.3	11,801,023				東海証券フィナンシャル・ホールディングス	171	179.3	90,905	コーセーアールイー	2	-	-						
千葉銀行	401.3	467.6	609,984				光世証券	1.4	-	-	地主	11	13.5	29,430						
群馬銀行	279.5	262.3	274,496				水戸証券	42.5	41.5	23,904	プレサンスコーポレーション	22.9	20	47,720						
武蔵野銀行	20.1	23.1	72,649				いちよし証券	27	30.6	25,581	THEグローバル社	4.3	-	-						
千葉興業銀行	27.2	35.7	52,443				松井証券	70.9	104	83,512	ハウスコム	1	-	-						
筑波銀行	63.1	66.3	16,177				マネックスグループ	141	147.9	128,525	JPMC	8.3	8.7	9,787						
七十七銀行	41.9	48.4	220,413				極東証券	19.7	18.8	30,832	サンセイランディック	1.9	-	-						
秋田銀行	9.6	10.1	22,866				岩井コスモホールディングス	16.4	17.2	42,174	エストラスト	0.7	-	-						
山形銀行	16	16.8	22,276				アイザワ証券グループ	20.8	21.9	38,062	フージャースホールディングス	22.2	23.4	25,318						
岩手銀行	9.1	9.6	29,376				マネーパートナーズグループ	6.7	-	-	オープンハウスグループ	52.7	55.2	278,042						
東邦銀行	113.7	130.1	39,420				スパークス・グループ	16.1	16.8	25,452	東急不動産ホールディングス	432.9	454.1	451,012						
東北銀行	3.1	-	-				小林洋行	2.9	-	-	飯田グループホールディングス	138	144.7	335,052						
ふくおかフィナンシャルグループ	125.4	131.4	517,453				<b>保険業 (3.2%)</b>				イーグランド	1	-	-						
スルガ銀行	126.9	101.7	131,599				かんぽ生命保険	146.6	175.7	527,627	ムゲンエステート	4.3	-	-						
八十二銀行	309	353.4	342,550				F P パートナー	2.9	6.6	14,836	ピーロット	4.4	-	-						
山梨中央銀行	16.1	16.9	37,061				SOMPOホールディングス	216.6	738.4	3,173,643	ファーストブラザーズ	1.3	-	-						



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
アイモバイル	千株	千株	千円				LITALICO	千株	千株	千円				トランス・コスモス	千株	千株	千円			
ディスラプターズ	20.1	19.9	9,611				コフィデンス・インターワークス	11.7	14.4	16,516				18.7	20	64,900				
MS-Japan	2.3	-	-				アドバンテッジリスクマネジメント	0.6	-	-				乃村工藝社	65.6	68.7	61,555			
船場	5.5	8.6	9,451				リログループ	3.4	-	-				藤田観光	6	7	69,650			
ジョビエレベーターサービスホールディングス	1.4	-	-				東祥	75.3	87.8	168,576				KNT-CTホールディングス	9	9.4	11,374			
フルテック	48.7	61.3	184,819				ID&Eホールディングス	10.5	13.3	9,376				トーカイ	13.3	14	30,618			
グリーンズ	1	-	-				ビーウィズ	9.1	-	-				白洋舎	1	-	-			
ツナグループ・ホールディングス	2.4	-	-				サンウェルズ	3.1	3.2	4,499				セコム	153.1	321.1	1,660,729			
GAMEWITH	1.9	-	-				TREホールディングス	-	6.1	4,117				セントラル警備保障	8.1	8.5	25,440			
MS&Consulting	2.8	-	-				人・夢・技術グループ	28.8	36.2	53,539				丹青社	29.1	33.5	30,384			
ウエルビー	1	-	-				NISSOホールディングス	5.7	6.5	10,406				メイテックグループホールディングス	54.1	58.2	173,406			
エル・ティール・エス	7.5	-	-				大栄環境	13	13.7	10,658				応用地質	14	14.6	42,851			
ミダックホールディングス	1.7	2.1	5,449				GENOVA	27.3	34.3	100,121				船井総研ホールディングス	31.3	31.6	76,788			
キュービネットホールディングス	9.1	9.6	15,513				日本管財ホールディングス	-	5.4	7,371				進学会ホールディングス	1.7	-	-			
オープングループ	8.6	9.1	9,373				M&A総研ホールディングス	15.8	16.5	43,147				オオバ	4.5	-	-			
スプリックス	20.4	24.9	6,897				エイチ・アイ・エス	7.2	17	25,143				いであ	1.8	-	-			
マネジメントソリューションズ	1.9	-	-				ラックランド	43.7	50.4	75,146				学究社	6	6.3	12,852			
プロレド・パートナーズ	6.4	7.7	12,774				共立メンテナンス	6.8	6.6	12,177				ベネッセホールディングス	50.5	-	-			
and factory	3.5	3.9	1,579				イチネンホールディングス	23.6	49.6	151,379				イオンデイライト	16.1	16.9	67,262			
テノホールディングス	2	-	-				建設技術研究所	16	15.4	26,703				ナック	12.8	16.1	9,772			
フロンティア・マネジメント	0.8	-	-				スパース	7.7	16.2	41,909				ダイセキ	30.7	37.9	147,431			
ピアラ	3.8	4.8	3,696				燦ホールディングス	9.8	11.4	12,654				ステップ	5.5	5.8	12,748			
コプロ・ホールディングス	1.2	-	-				スバル興業	14.1	13.3	13,712				合計	株数・金額	千株	千円			
ギークス	2.2	-	-				東京テアトル	3	6.1	21,807				株数<比率>	2,148	289,921.1	598,618,921			
アンビスホールディングス	0.9	-	-				タナベコンサルティンググループ	2.4	-	-				銘柄数<比率>	1,687	1,687	<98.1%>			
カープスホールディングス	16.1	33.9	26,069				ナガワ	5.2	6.8	8,275				(注1)	銘柄欄の( )内は、期末の国内株式評					
フォーラムエンジニアリング	41.1	43.1	31,592				東京都競馬	4.7	4.2	27,258				価総額に対する各業種の比率です。						
FAST FITNESS JAPAN	20.5	18.3	18,903				常磐興産	12.6	11.5	52,037				(注2)	合計欄の< >内は、期末の純資産総額に					
Macbee Planet	5.1	5.5	7,001				カナモト	2.5	-	-				対する評価額の比率です。						
ダイレクトマーケティングミックス	-	4.5	15,210				ニシオホールディングス	23.3	24.4	75,518				(注3)	評価額の単位未満は切捨ててあります。					
ポピーズ	15.5	19	5,244				アゴラ 楽天クリティカルグループ	14	13.2	55,374										
	2.2	2.8	3,376						43.4	-	-									

## (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 12,007		百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2025年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 598,618,921		% 97.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,953,309		2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	611,572,231		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

(2025年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	611,559,712,930円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	11,539,856,613
株 式(評価額)	598,618,921,730
未 収 入 金	133,335,460
未 収 配 当 金	811,375,293
差 入 委 託 証 拠	456,223,834
(B) 負 債	1,532,780,755
未 払 金	13,385,755
未 払 解 約 金	1,519,395,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	610,026,932,175
元 本	124,795,594,506
次 期 繰 越 損 益 金	485,231,337,669
(D) 受 益 権 総 口 数	124,795,594,506口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	48,882円

(注1) 期首元本額 121,842,817,407円  
 追加設定元本額 39,116,739,635円  
 一部解約元本額 36,163,962,536円

(注2) 期末における元本の内訳

MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,306,286,110円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	5,343,245,152円
One DC 国内株式インデックスファンド	34,679,343,223円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	4,647,398,779円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,766,612円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	7,624,240円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	18,097,816円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	22,133,733円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	21,327,804円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	9,314,618円
たわらノーロード TOPIX	3,617,657,018円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,108,051,598円
たわらノーロード バランス (堅実型)	49,956,149円
たわらノーロード バランス (標準型)	422,906,378円
たわらノーロード バランス (積極型)	803,080,825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)	2,726,787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)	203,478,248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)	573,408,822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)	505,960,792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)	701,372,312円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	487,091円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,220,602円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	41,212,960円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	12,746,898円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	22,669,316円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (安定型)	26,773円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (バランス型)	948,918円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (積極型)	1,024,575円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	32,517,526,987円
Oneグローバルバランス	108,782,427円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	904,774,120円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,289,880,560円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,092,701,273円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	248,418,366円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	858,537,729円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,063,726,385円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25,142,933円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	967,311,894円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,368,768円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	258,478,733円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	326,821,886円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	595,002,065円
投資のソムリエ	6,619,003,667円
フルズコントロール	219,955,581円
投資のソムリエ<DC年金>	897,766,879円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	374,200,639円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,417,555,736円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	299,836,496円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	755,779,553円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	102,627,430円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	55,249,962円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	3,089,514円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	218,849,573円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	664,959,163円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	84,763,449円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	228,955,300円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	82,321,725円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	60,369,693円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	36,193,761円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	769,406,611円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	10,440,211円
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,430,158円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	36,440,266円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2070)	62,281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)	4,732,014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)	4,718,912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)	4,900,475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)	2,880,816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)	7,866,964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)	12,009,087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	75,346,240円
日本株40・外債60配分戦略ファンド2021-07	349,581,656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)	3,217,510円
マルチアセット・インカム戦略F (内外株式債券型) 22-05	71,685,880円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日米資産投資) 22-10	344,907,996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)	7,741,425円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日米資産投資) 24-05	348,851,836円
TOPIXインデックスファンド2025-01 (適格機関投資家限定)	330,103,543円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	130,509,834円
AMOneマルチアセット・インカム戦略 (適格機関投資家限定)	3,806,397円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	19,207,562円



日米資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	93,890,674円	D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	50,296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)	7,879,425円	D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	92,130,245円
リスクコントロール世界8資産/バランスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)	3,366,821円	D I AM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	6,740,199円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	27,932,176円	D I AM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	19,897,555円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	59,041,780円	D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	42,118,287円
D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,167,529円	D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	56,042,180円
D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	8,837,011円	D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	14,155,767円
D I AM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,815,726円	D I AM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	5,135,204円
D I AM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	77,102円	動的パッケージファンド<DC年金>	24,347,592円
D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	40,947円	コア資産形成ファンド	9,446,067円
D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	953,425円	MH AMトピックスファンド	732,195,084円
D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	197,036,871円	MH AM T O P I XファンドVA (適格機関投資家専用)	41,437,680円
D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	335,978,730円	MH AM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	2,562,634,765円
D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,063,955,401円	MH AM日本株式バッシュファンド [適格機関投資家限定]	2,943,207,375円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	8,584,282円	期末元本合計	124,795,594,506円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	12,110,443円	(注3) 担保資産	
D I AM 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)	107,245,800円	代用として担保を提供している資産はありません。	
D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向)	21,932,365円		

## ■損益の状況

当期 自2024年2月8日 至2025年2月7日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	金 当	13,335,604,423円
受 取	利 息	13,314,997,970
受 取	利 息	18,927,557
そ の 他 収 益	金 当	1,734,228
支 払 利 息	金 当	△55,332
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	益 金	36,943,093,232
売 買	益 金	78,187,104,067
売 買	損 益	△41,244,010,835
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	益 金	2,675,726,650
取 引	益 金	4,153,923,810
取 引	損 益	△1,478,197,160
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	益 金	52,954,424,305
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	益 金	420,288,018,867
(F) 解 約 差 損 益 金	益 金	△134,953,850,868
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	益 金	146,942,745,365
(H) 合 計(D + E + F + G)	益 金	485,231,337,669
次 期 繰 越 損 益 金(H)	益 金	485,231,337,669

(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。