

運用報告書 (全体版)

第11期<決算日2019年10月15日>

DIAM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	DIAM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	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	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、経費控除後の利子配当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、「DIAM国内株式パッシブ・ファンド」は、2019年10月15日に第11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)	税込分配金	期中騰落率	(配当込み) 騰落率 (ベンチマーク)	期中騰落率			
7期(2015年10月13日)	円 20,908	円 0	% 25.3	ポイント 2,092.65	% 26.1	% 94.4	% 6.0	百万円 3,717
8期(2016年10月12日)	18,950	0	△9.4	1,910.89	△8.7	97.3	2.5	3,124
9期(2017年10月12日)	24,352	0	28.5	2,471.06	29.3	97.5	2.4	5,490
10期(2018年10月12日)	24,781	0	1.8	2,527.66	2.3	97.1	1.7	5,758
11期(2019年10月15日)	24,073	0	△2.9	2,467.63	△2.4	97.2	2.7	7,445

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

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、(株東京証券取引所)が有しています。なお、本商品は、(株東京証券取引所)により提供、保証または販売されるものではなく、(株東京証券取引所)は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません(以下同じ)。

(注4) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	(配当込み) 騰落率 (ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2018年10月12日	円 24,781	% -	ポイント 2,527.66	% -	% 97.1	% 1.7
10月末	23,960	△3.3	2,444.11	△3.3	96.3	3.7
11月末	24,269	△2.1	2,475.92	△2.0	97.2	2.7
12月末	21,774	△12.1	2,223.11	△12.0	95.9	4.5
2019年1月末	22,834	△7.9	2,332.52	△7.7	98.5	1.5
2月末	23,419	△5.5	2,393.08	△5.3	97.7	2.3
3月末	23,430	△5.5	2,395.21	△5.2	97.0	2.9
4月末	23,809	△3.9	2,434.82	△3.7	97.3	2.3
5月末	22,251	△10.2	2,275.96	△10.0	97.8	2.2
6月末	22,850	△7.8	2,338.89	△7.5	97.7	1.9
7月末	23,049	△7.0	2,360.18	△6.6	98.9	0.8
8月末	22,262	△10.2	2,280.58	△9.8	97.9	1.8
9月末	23,597	△4.8	2,418.29	△4.3	96.9	3.1
(期末) 2019年10月15日	24,073	△2.9	2,467.63	△2.4	97.2	2.7

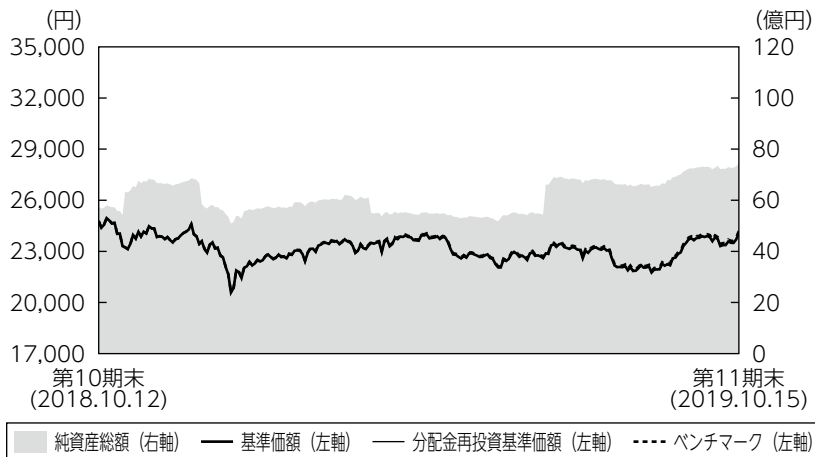
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2018年10月13日から2019年10月15日まで）

基準価額等の推移



(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

米中貿易摩擦問題の激化、世界景気の減速懸念や米国株式市場の下落などを受けて国内株式市場が下落したことにより、基準価額は下落しました。

投資環境

期初から2018年12月下旬にかけては、米国長期金利の上昇を受けて米国株式市場が下落したことや、世界景気の減速懸念や米中貿易摩擦の激化などを嫌気し、日本株式市場は急落しました。その後は、2019年2月にかけて大幅下落の反動で反発した後、米中貿易問題の進捗、世界の景況感、ブレグジット（英国の欧州連合からの離脱）問題、為替動向などを要因として期末にかけて一進一退の展開となりました。

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を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	12.6
2	輸送用機器	8.1
3	情報・通信業	7.7
4	化学	7.1
5	銀行業	6.7
6	機械	5.1
7	医薬品	4.9
8	卸売業	4.9
9	小売業	4.9
10	サービス業	4.6



期末

(単位：%)

No.	業種	組入比率
1	電気機器	13.6
2	情報・通信業	8.3
3	輸送用機器	7.7
4	化学	7.2
5	銀行業	5.6
6	医薬品	5.4
7	サービス業	5.0
8	機械	4.9
9	小売業	4.7
10	卸売業	4.7

○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	3.2
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.9
3	ソフトバンクグループ	1.8
4	ソニー	1.7
5	日本電信電話	1.4
6	三井住友フィナンシャルグループ	1.3
7	キーエンス	1.1
8	本田技研工業	1.1
9	みずほフィナンシャルグループ	1.0
10	リクルートホールディングス	1.0



期末

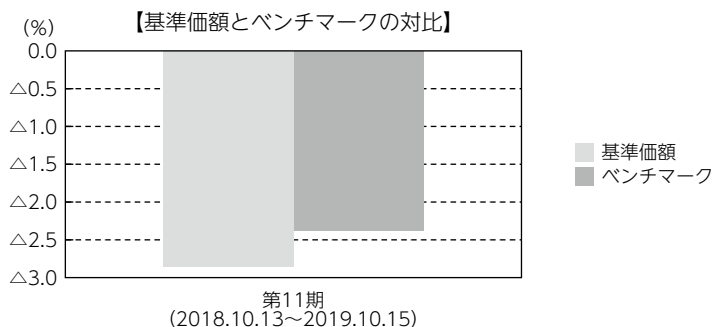
(単位：%)

No.	銘柄名	組入比率
1	トヨタ自動車	3.4
2	ソニー	1.8
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.5
4	日本電信電話	1.5
5	ソフトバンクグループ	1.4
6	武田薬品工業	1.4
7	キーエンス	1.3
8	三井住友フィナンシャルグループ	1.1
9	本田技研工業	1.0
10	KDDI	1.0

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2.4%下落しました。

当ファンドはベンチマークを0.5%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
	2018年10月13日 ～2019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	14,072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11期		項目の概要
	(2018年10月13日 ～2019年10月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	113円	0.490%	(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23,135円です。
(投信会社)	(101)	(0.436)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(5)	(0.022)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(8)	(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	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(c) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.002 (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
合計	114	0.494	

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

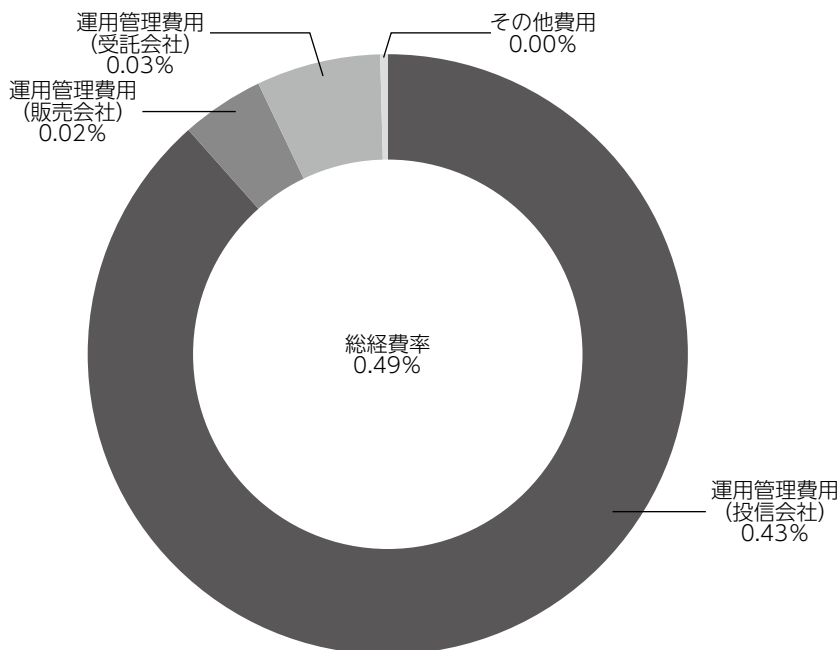
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.49%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（2018年10月13日から2019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	1,487,624	3,627,824	771,558	1,911,060

■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	130,928,699千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	258,216,742千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.50

(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（2018年10月13日から2019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)	107千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.461千円
(B)／(A)	0.4%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

【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 51,464	百万円 24	% 0.0	百万円 79,464	百万円 5,933	% 7.5

平均保有割合 2.3%

(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 486	百万円 755	百万円 2,337

(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
株 式		百万円 25

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	千□ 2,191,345	千□ 2,907,412	千円 7,444,428

■投資信託財産の構成

2019年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	千円 7,444,428	% 99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	16,341	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	7,460,769	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

(2019年10月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	7,460,769,593円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	16,341,106
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)	7,444,428,487
(B) 負 債	15,666,005
未 払 信 託 報 酬	15,613,356
そ の 他 未 払 費 用	52,649
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	7,445,103,588
元 本	3,092,725,388
次 期 繰 越 損 益 金	4,352,378,200
(D) 受 益 権 総 口 数	3,092,725,388口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	24,073円

(注) 期首における元本額は2,323,784,774円、当期中における追加設定元本額は1,644,306,045円、同解約元本額は875,365,431円です。

■損益の状況

当期 自2018年10月13日 至2019年10月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△10,464円
受 取 利 息	1,329
支 払 利 息	△11,793
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	73,243,795
売 買 損 益	146,166,115
売 買 損 益	△72,922,320
(C) 信 託 報 酬 等	△30,077,522
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	43,155,809
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	462,306,185
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,846,916,206
(配 当 等 相 当 額)	(2,987,668,980)
(売 買 損 益 相 当 額)	(859,247,226)
(G) 合 計(D+E+F)	4,352,378,200
次 期 繰 越 損 益 金(G)	4,352,378,200
追 加 信 託 差 損 益 金	3,846,916,206
(配 当 等 相 当 額)	(2,990,621,778)
(売 買 損 益 相 当 額)	(856,294,428)
分 配 準 備 積 立 金	643,849,709
繰 越 損 益 金	△138,387,715

(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	124,578,875円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	3,708,528,491
(d) 分 配 準 備 積 立 金	519,270,834
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	4,352,378,200
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	14,072.95
(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17期（決算日 2019年2月7日）

（計算期間 2018年2月8日～2019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17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	(配当込み) ベンチマーク	期中騰落率			
13期 (2015年2月9日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期 (2016年2月8日)	20,237	22.2	1,949.47	22.3	99.0	0.9	324,677
15期 (2017年2月7日)	19,981	△1.3	1,925.17	△1.2	98.2	1.7	286,897
16期 (2018年2月7日)	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3	284,249
17期 (2019年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

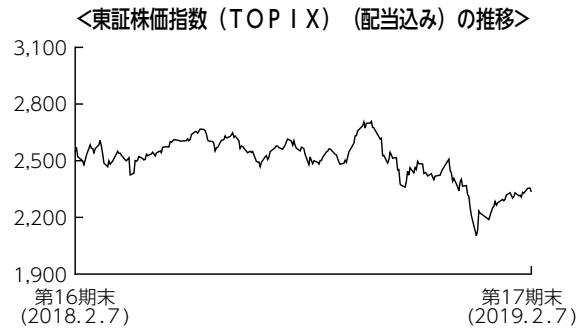
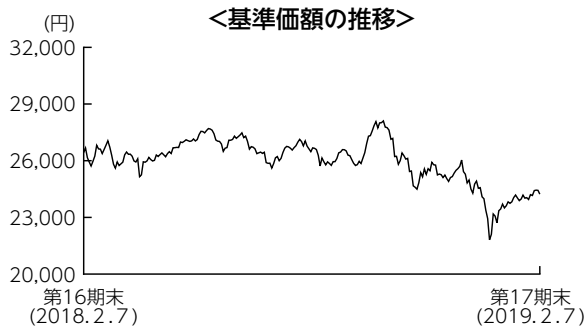
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物率
	円	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク) ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2018年 2 月 7 日	26,432	% -	2,547.46	% -	% 98.1	% 0.8
2 月 末	26,718	1.1	2,574.87	1.1	97.9	2.7
3 月 末	26,174	△1.0	2,522.26	△1.0	95.2	4.6
4 月 末	27,108	2.6	2,611.85	2.5	98.4	1.5
5 月 末	26,665	0.9	2,568.21	0.8	97.4	2.2
6 月 末	26,446	0.1	2,548.78	0.1	96.3	3.7
7 月 末	26,787	1.3	2,581.96	1.4	96.4	3.6
8 月 末	26,523	0.3	2,556.25	0.3	95.9	4.0
9 月 末	28,001	5.9	2,698.09	5.9	97.4	2.5
10 月 末	25,366	△4.0	2,444.11	△4.1	96.4	3.7
11 月 末	25,703	△2.8	2,475.92	△2.8	97.2	2.7
12 月 末	23,069	△12.7	2,223.11	△12.7	95.9	4.5
2019年 1 月 末	24,204	△8.4	2,332.52	△8.4	98.5	1.5
(期 末) 2019年 2 月 7 日	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5

(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（2018年2月8日から2019年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は24,228円となり、前期末に比べ8.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

米中貿易摩擦の激化、米国トランプ大統領の保護貿易主義の高まり、世界景気の減速懸念、米国長期金利の上昇などを要因に国内株式市場が下落したことから、基準価額は下落しました。

投資環境

期初から2018年3月下旬にかけては、円高進行、米国株安、安倍政権の不安定さなどを嫌気し、国内株式市場は下落しました。その後は、米中貿易摩擦、為替動向、シリアや北朝鮮などの地政学リスクなどの動向次第で、一進一退の展開となりました。10月以降は、米国長期金利の上昇を受けて米国株式が下落したこと、世界景気の減速懸念や米中貿易摩擦の激化などを嫌気し、国内株式市場は急落しました。しかし、期末にかけては大幅下落の反動もあり、やや値を戻しました。

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	13.7%
2	輸送用機器	9.0
3	銀行業	7.4
4	情報・通信業	7.1
5	化学	7.0
6	機械	5.6
7	卸売業	4.6
8	小売業	4.6
9	医薬品	4.4
10	食料品	4.2



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	12.8%
2	情報・通信業	8.2
3	輸送用機器	8.0
4	化学	7.2
5	銀行業	6.3
6	医薬品	5.3
7	卸売業	5.0
8	機械	4.9
9	小売業	4.8
10	サービス業	4.7

○組入上位10銘柄
 期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.5%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.2
3	ソフトバンクグループ	日本・円	1.5
4	ソニー	日本・円	1.4
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.4
6	日本電信電話	日本・円	1.4
7	本田技研工業	日本・円	1.4
8	キーエンス	日本・円	1.2
9	任天堂	日本・円	1.1
10	みずほフィナンシャルグループ	日本・円	1.0
組入銘柄数		2,049銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.2%
2	ソフトバンクグループ	日本・円	1.8
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
4	ソニー	日本・円	1.4
5	日本電信電話	日本・円	1.4
6	キーエンス	日本・円	1.3
7	武田薬品工業	日本・円	1.2
8	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.2
9	本田技研工業	日本・円	1.1
10	みずほフィナンシャルグループ	日本・円	1.0
組入銘柄数		2,113銘柄	

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8.3%下落しました。
 当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマークに沿ったパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)
合 計	0	0.001

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(25,984円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については5ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。(b) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数です。その他は、信託事務の処理に要する諸費用等です。

■ 売買及び取引の状況 (2018年2月8日から2019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
		26,354.1 (△6,682.321)	50,317,509 (-)	14,521.779	31,359,523

(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 100,959	百万円 98,142	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	81,677,032千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	281,533,266千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	0.29

(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（2018年2月8日から2019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 50,317	百万円 -	% -	百万円 31,359	百万円 5	% 0.0

(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 502	百万円 273	百万円 2,902

(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	額
株 式		百万円 55

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、オリエントコーポレーションです。

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	株数
日清食品ホールディングス		千株		千円	レンゴー		千株		千円	ミライアル		千株		千円
永谷園ホールディングス	49.6	52.4	383,044		トモク	114.5	124	114,824		ダイキョウクス	3.9	3.5	3,993	
一正蒲鉾	12	6.6	15,919		ザ・パック	6.8	7.4	11,766		ダイキョーニシカフ	4	4.3	4,145	
フジッコ	4.4	4.9	5,081		化学 (7.3%)	8.4	9.1	27,982		竹本容器	23.4	25.4	29,718	
ロック・フィールド	12.3	13.4	30,471		クラレ		199.9	202.9	331,944	森六ホールディングス	1.3	4.3	6,054	
日本たばこ産業	12.3	13.4	20,595		旭化成	199.9	202.9	331,944		日本化薬	4.5	6.5	16,542	
ケンコーマヨネーズ	704.1	711.1	1,938,814		昭和レザー	740.7	855	986,242		カリットホールディングス	77.1	76.4	98,097	
からばや日洋ホールディングス	7.5	6.9	14,545		昭和電工	6.9	7.5	5,467		日本精化	11	12.8	10,393	
なとり	7.5	8	14,992		住友化学	79.1	79.8	285,684		扶桑化学工業	9.9	9.7	10,864	
イフジ産業	6.4	6.9	11,212		住友精工	874	946	518,408		トリケミカル研究所	8.4	12.2	25,144	
ピュウスクーパーション	2	2.1	1,386		日産化学	4.9	5.8	24,766		A D E K A	-	2.7	12,879	
北の達人コーポレーション	1.7	3	6,078		ラサ工業	69.1	73.8	408,852		日油	51.1	59.3	100,572	
ユープレナ	10.9	48.4	19,698		クラレ	4.2	4.3	5,921		新日本理化	45.9	46.2	165,627	
ミヨシ油脂	43.9	48.9	29,095		多木化学	10.3	11.1	74,148		ハリマ化成グループ	18.9	21.9	4,182	
理研ビタミン	4.4	5	5,240		テイカ	1.6	3.4	18,394		第一工業製薬	9.2	10	10,960	
繊維製品 (0.7%)	4.3	5.8	20,242		石原産業	9.1	9.8	19,649		石原ケミカル	278.8	297.9	2,397,797	
片倉工業	13.7	14.8	17,197		片倉コープアグリ	21.3	23.2	25,404		日華化学	23	4.5	12,613	
グンゼ	8.9	8	41,440		日東エフシー	2.9	3	3,507		ニイタカ	-	3.1	5,499	
東洋紡	43.9	50.8	82,804		日本曹達	6.9	7.7	5,882		三洋化成工業	3.8	4	3,796	
ユニチカ	34.6	35.2	17,283		東ソー	82	19	56,468		有機合成薬品工業	1.7	1.9	2,846	
富士紡ホールディングス	6.6	6.3	17,671		トクヤマ	171.7	185.7	291,734		大日本塗料	7.5	8	40,720	
倉敷紡績	120	11.5	27,128		セントラル硝子	34.5	34.6	97,987		日本ペイントホールディングス	8	8.3	1,726	
シキボウ	6	6.3	6,552		東亞合成	24.2	26.2	65,788		関西ペイント	13.6	13.7	14,385	
日本毛織	33.4	39.4	33,923		大阪ソーダ	69.7	75.4	95,607		神東塗料	91.7	99.1	367,661	
ダイトウボウ	18.8	19	1,634		関東電化工業	10.7	12.9	32,688		中国塗料	124.8	135	257,445	
トア紡コーポレーション	5.1	5	2,265		デンカ	28.4	28.5	25,564		藤倉化成	9	9.4	1,616	
ダイドーリミテッド	13.5	15	5,175		信越化学工業	43.6	47.2	157,176		日本特殊塗料	34.1	39.4	37,627	
帝国繊維	12.4	13.5	33,615		日本カーバイド工業	197.8	211.8	1,957,879		太陽ホールディングス	7.5	9	11,475	
帯人	97	98	178,458		堺化学工業	3.8	4.1	7,129		D I C	15	16.4	9,266	
東レ	861.5	932.2	742,870		第一稀元素化学工業	8.1	7.9	18,264		サカタクインクス	9.1	9.9	34,551	
サカイオーベックス	3	3	5,889		エア・ウォーター	-	9.8	8,839		サカイタクインクス	46.9	54.4	188,768	
住江織物	3.1	3.2	8,019		大陽日酸	97.9	98.5	179,762		三菱ケミカルホールディングス	24.2	26.2	32,226	
日本ファルコ	6.4	6.6	2,943		日本化学工業	91.5	99	156,816		T & K TOKA	11.7	25.4	61,442	
イチワフ	8	1.8	2,469		東邦アセチレン	4.4	4.1	10,721		豊田オイルホールディングス	7.9	9.4	9,315	
日東製綱	1.3	1.4	1,792		日本パーカライズン	1.7	1.9	2,580		資生堂	235.5	254.8	1,188,387	
アツギ	7.9	10	9,520		高圧ガス工業	60.7	65.6	90,068		ライオン	211.2	243.8	1,755,360	
ダイニチ	4.6	4.7	3,468		チタン工業	17.6	19.2	14,630		高砂香料工業	158	171	405,783	
セーレン	27.3	29.5	55,460		四国化成工業	1.3	1.5	3,769		マンダム	7.1	8.5	29,877	
ソトー	4.4	4.6	4,296		戸田工業	17.1	20.2	25,876		ミルボン	22.1	27.6	73,002	
東海染工	1.7	1.8	1,791		ステラ ケミファ	2.4	2.6	5,829		ファンケル	15.2	15.1	68,554	
小松マテール	18.2	19.7	15,070		保土谷化学工業	6.1	7	20,762		コーセー	27.5	54.6	130,384	
ワコールホールディングス	32.8	35	95,830		日本触媒	3.9	4.2	11,743		コタ	19.2	20.8	355,264	
ホギメディカル	7.5	14.9	55,428		大日精化工業	18.7	20.2	150,490		シーズ・ホールディングス	4.9	5.8	8,439	
レナウン	32.3	35	3,465		三菱瓦斯化学	9.2	9.9	29,284		シーボン	15.4	-	-	
クラウディアホールディングス	2.9	2.9	1,374		J S R	160	32	137,920		ポーラ・オルビスホールディングス	1.4	1.4	3,725	
T S Iホールディングス	44.8	44.3	30,744		東京応化工業	97.9	123.7	217,588		アビエホールディングス	48.4	52.4	173,182	
マツカコーポレーション	2.1	3.9	10,221		大阪有機化学工業	108	109	300,404		アジエパルスメジャパン	7.2	7.7	39,578	
ワールド	-	12.4	24,093		K Hネオケム	119.4	120.6	217,924		エステー	2.6	2.8	2,671	
三陽商会	6.2	7.2	12,600		ダイセル	20.6	20.6	65,405		アグロ カネシオウ	8.1	8.8	16,016	
ナイガイ	4.4	4.6	2,428		住友ベークライト	7.7	11.1	12,742		コニシ	4.6	5	10,770	
オンワードホールディングス	70.9	72.3	46,127		積水化学工業	795.4	803.4	680,078		長谷川香料	18.6	21.8	39,087	
ルックホールディングス	20	4.4	4,809		日本ゼオン	18.2	18.3	48,092		メック	15.2	15.1	68,554	
キムラタン	55.5	57.1	1,313		アイカ工業	160.2	186.7	199,208		タカラバイオ	6.5	8.1	6,228	
ゴールドウイン	3.4	10.9	117,284		宇都興産	96	20.8	85,176		J C U	31.8	34.4	283,800	
デサント	27.1	29.3	77,293		積水樹脂	246.7	262.6	444,581		新田ゼラチン	10.2	11.1	14,474	
キング	5.8	6.2	3,490		タキロンシーアイ	100.2	108.4	122,166		O A Tアグリオ	7.8	8.5	9,469	
ヤマトインターナショナル	8.1	7.9	3,231		旭有機材	33.3	36	136,620		デクセリアルズ	3.1	3.2	7,136	
パルプ・紙 (0.3%)					日立化成	59.8	60.6	152,166		アース製薬	29.7	32.1	74,953	
特種東海製紙	6.5	7.6	30,438		リケンテクノス	18.3	19.8	40,728		北興化学工業	7	15.9	28,111	
王子ホールディングス	500	541	330,010		大倉工業	24	26	15,938		大成ラミック	7.8	7.7	5,320	
日本製紙	53.2	57.5	118,162		積水化成成品工業	7	8.3	13,495		クミアイ化学工業	1.6	1.8	3,796	
三菱製紙	16.9	19.7	10,421		群栄化学工業	58.7	55.5	106,671		日本農業	29.9	31.6	24,964	
北越コーポレーション	66.3	79.7	47,501		タイガースポリマー	5.8	6.3	12,883		アキレス	8.5	9.3	48,081	
中越パルプ工業	4.7	5.1	6,823			25.6	32.9	14,837			11.7	12.8	6,745	
巴川製紙所	18	4.1	4,202			28	6.2	11,488			3.5	3.7	10,448	
大王製紙	47.3	58.5	82,777			14.9	17.8	16,927			51.6	50.7	33,816	
阿波製紙	2.9	3	1,416			2.8	2.9	7,737			29.6	29.4	14,229	

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
シード	1.2		千株	5.2		千円	電気・ガス業 (2.0%)						SGホールディングス	76.1		千株	109.8		千円	327,423
ノーリツ鋼機	11.5		9.7	18,274		東京電力ホールディングス	905.1	979.5	658,224	海運業 (0.2%)			日本郵船	89.8	97.1	175,945				
エー・アンド・デイ	10.4		11.2	7,873		中部電力	346.9	375.4	627,481	商船三井	67.9	69	182,712							
朝日インテック	-	52	254,280			関西電力	462.7	500.7	792,107	川崎汽船	49.6	35.8	55,704							
シチズン時計	135.3	134.2	77,567			中国電力	156.7	169.6	249,481	NSユナイテッド海運	5.1	6.4	16,832							
リズム時計工業	4.3	4.1	7,080			北陸電力	111.1	120.1	105,808	明治海運	11.4	12.1	4,271							
大研医器	10.1	9.8	5,870			東北電力	265.5	287.4	408,108	飯野海運	54.7	55	21,835							
メニコン	15.6	16.8	45,578			四国電力	102.1	110.5	157,020	共栄タンカー	0.8	0.8	1,216							
シンシア	-	1.9	934			九州電力	250.4	252.9	334,839	乾汽船	8.3	10.4	7,415							
松風	5.6	6.2	7,526			北海道電力	113.7	114.8	89,544	空運業 (0.6%)										
セイコーホールディングス	17.5	19	44,384			沖縄電力	18.3	22.7	46,716	日本航空	199.2	212.8	856,732							
ニプロ	78.5	84.9	118,605			電源開発	90.2	97.7	269,358	ANAホールディングス	210.5	212.5	862,112							
その他製品 (2.0%)						エフオン	5.7	7.3	6,635	パスコ	10	2.3	1,948							
中本パックス	1.1	3.4	5,531			イーレックス	17.8	21.3	14,079	倉庫・運輸関連業 (0.2%)										
スノーピーク	3.5	4.5	5,598			レノバ	-	12.7	13,881	トランコム	3	3.3	21,912							
パワマウントベッドホールディングス	12	14.1	65,071			東京瓦斯	241.9	240.7	699,835	日新	9.3	10	19,050							
トランザクション	5.1	6.7	4,817			大阪瓦斯	220	238	514,318	三菱倉庫	37.1	40.2	106,610							
S H O - B I	3.9	3.5	1,221			東邦瓦斯	56.2	60.7	279,220	三井倉庫ホールディングス	61	14.3	28,585							
ニホンフラッシュ	5.3	5.2	10,618			北海道瓦斯	31	6.6	9,490	住友倉庫	74	43.7	63,496							
前田工織	11.4	13.6	37,848			広島ガス	23.4	25.5	8,746	澁澤倉庫	5.9	6.5	10,192							
永大産業	15	16.4	7,314			西部瓦斯	13.8	13.9	34,597	東陽倉庫	19.5	20.5	6,088							
アートネイチャー	12.1	13.1	8,017			静岡ガス	32.2	37.7	33,628	日本トランスシティ	26	25.7	11,256							
パシフィックホールディングス	117.2	126.8	571,234			メタウォーター	6.4	5.9	18,349	ケイヒン	2.1	2.2	2,824							
アイフィスジャパン	2.4	2.7	1,657			陸運業 (4.7%)				中央倉庫	6.6	6.9	6,906							
共立印刷	18.9	20.8	4,846			SBSホールディングス	11.2	12.2	20,081	川西倉庫	2.2	2.3	2,716							
S H O E I	5.1	5.8	22,823			東武鉄道	121.2	129.4	390,141	安田倉庫	9.7	9.7	8,516							
フランスベッドホールディングス	13.4	17.4	15,068			相鉄ホールディングス	36.3	42.2	135,884	東洋埠頭	3.2	3.3	4,719							
パイロットコーポレーション	19.8	21.4	113,848			東京急行電鉄	308	333.3	609,272	宇徳	9.4	10.1	5,514							
萩原工業	6.3	6.8	11,240			京浜急行電鉄	155.3	168.1	300,562	上組	67.6	71.8	174,545							
トッパン・フォームズ	24.3	26.3	23,538			小田急電鉄	168.6	196.6	476,165	サンリツ	2.8	2.9	2,012							
フジテレビインターナショナル	25.4	27.4	110,148			京王電鉄	63.4	68.6	420,518	キムラユニティ	2.9	3.2	3,484							
タカラトミー	47.5	51.4	61,731			京成電鉄	78.9	92	324,760	キューソー流通システム	3.1	3	6,171							
廣済堂	10.6	11.4	8,835			富士急行	15.5	16.7	59,118	近鉄エクスプレス	20.3	22	36,630							
エステールホールディングス	3.4	3.5	2,310			新京成電鉄	2.9	3.1	6,441	東海運	6.1	6.3	1,764							
アーク	47.9	46.7	4,529			東日本旅客鉄道	203.7	218.2	2,216,912	エーアイティ	7.7	7.5	7,627							
タカノ	5	4.9	4,135			西日本旅客鉄道	102.3	110	864,490	内外トランスライン	3.8	3.8	5,449							
プロネクサス	10.6	10.5	12,201			東海旅客鉄道	101.5	109.9	2,596,387	日本コンセプト	2.1	3.2	3,206							
ホクシン	8.2	7.7	1,054			西武ホールディングス	144.5	156.3	302,284	情報・通信業 (8.4%)										
ウッドワン	3.8	4	4,148			鴻池運輸	16	19.6	32,594	NECネットエスアイ	12.3	13.4	33,567							
大建工業	8.8	9.3	17,688			西日本鉄道	31.4	34	91,358	システナ	8.9	43	46,784							
凸版印刷	320	173.2	309,335			ハマキョウレックス	8	9.4	35,720	デジタルアーツ	5.5	6.5	52,195							
大日本印刷	148.4	172.9	435,362			サイキ引越センター	6	6.5	40,365	新日鉄住金ソリューションズ	17.5	18	52,776							
図書印刷	7.6	11.5	11,097			近鉄グループホールディングス	107.4	116.1	553,797	キューブシステム	6.5	6.4	5,331							
共同印刷	3.5	3.9	9,126			阪急阪神ホールディングス	143.2	155	599,850	エイジア	1.7	2.4	2,786							
N I S S H A	23.3	25.1	36,545			南海電気鉄道	50.9	51.9	151,288	コア	4.7	5.1	6,732							
光村印刷	1	1	1,964			京阪ホールディングス	47.8	51.8	232,582	ソリトンシステムズ	3.7	6.8	5,691							
宝印刷	5.9	6.4	10,208			神戸電鉄	2.6	3	11,685	ソフトウエアホールディングス	5.4	5.2	7,753							
アックス	112.6	121.9	200,891			名古屋鉄道	83.3	93.1	269,338	T I S	37.1	40.1	199,898							
ツツミ	3.5	3.9	7,569			山陽電気鉄道	8.3	9	18,972	ネオス	3.4	4.1	4,239							
小松ウォール工業	3.8	3.8	7,087			日本通運	42.2	45.6	298,680	電算システム	3.9	4.6	11,012							
ヤマハ	76.4	73	382,520			ヤマトホールディングス	188.3	203.7	572,600	グリー	5.6	83.1	38,059							
河合楽器製作所	3.8	3.8	12,711			丸運	27.6	32.3	166,345	コーエーテックホールディングス	18.9	24.6	44,722							
クリナップ	10.5	11.5	7,130			丸全昭和運輸	38	9.4	25,774	三菱総合研究所	4.8	4.7	15,345							
ビジョン	68.5	74.2	325,738			セコグループホールディングス	64.6	64.1	54,933	ポルテージ	2.1	2.4	1,360							
兼松サステック	0.9	0.8	1,240			トナミホールディングス	2.6	2.8	16,576	電算	1.3	1.3	2,797							
キングダム	9.4	10.2	8,047			ニッコンホールディングス	40.8	44.2	120,003	A G S	6.3	6.8	4,549							
リンテック	26.9	29.2	71,335			日本石油輸送	1.3	1.4	3,977	ファインデックス	9.3	10.1	6,787							
イトーキ	23.9	22.6	12,723			福山通運	15.7	14.9	63,325	ヒト・コミュニケーションズ	2.5	2.8	4,390							
任天堂	69.8	75.5	2,213,282			セイノールホールディングス	80.4	87	130,761	ブレインパッド	2.4	2.6	13,390							
三菱鉛筆	18.7	20.2	46,460			エスライン	-	3.1	3,468	K L a b	21.6	21.4	18,254							
タカラスタンダード	23.4	25.4	43,357			神奈川中央交通	2.7	2.9	10,866	ホトクワイクビシオリアティブジャパン	8.1	16	13,872							
コクヨ	54.4	58.9	94,416			日立物流	23.6	25.6	77,440	イーブイコミュニケーションズ	1.8	2	3,054							
ナカバヤシ	11.1	12.3	6,678			丸和運輸機関	5.7	6.1	20,831	ネクソン	12.4	306.6	512,022							
グローブライド	5.1	5.9	15,027			C&Fロジホールディングス	11.8	11.9	14,053	アイスタイル	27.9	30.6	25,214							
オカムラ	39.6	42.9	54,483			九州旅客鉄道	90.1	97.6	348,920	エムアップ	3.7	4.2	7,492							
美津濃	11.2	12.2	31,280																	

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			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
ティールライフ	千株	千株	千円	VTホールディングス	千株	千株	千円	愛眼	千株	千株	千円
1.5	1.6	1,427	37.8	41	41	17,015	9.1	9.7	9.7	2,919	
イー・ピーカンパニー	2.2	2.3	1,053	鯨魚	3.1	3.4	4,851	5.8	6.2	4,848	
3.4	3.8	9,591	ポプラ	3	3.1	1,819	36.7	42.3	74,659		
シュッピン	6.8	8.1	5,904	フジ・コーポレーション	1.9	2.5	5,120	5.4	5.8	20,590	
ネクステージ	11.4	18.6	17,279	ユナイテッドアローズ	13.8	13.9	52,333	14.9	16.2	21,448	
ジョイフル本田	16.4	35.4	48,568	ハイデイ日高	12.2	15.9	34,757	8.4	9.2	9,089	
扇貴族	4.1	4	7,024	京都きもの友禅	7.3	7.7	3,226	8.2	8.9	63,813	
キリン堂ホールディングス	3.9	4.8	6,897	コウロウド	37.1	40.2	94,952	12.5	13.6	24,792	
ホットランド	6.5	6.3	7,938	ピーチデゴコーポレーション	16.7	16	6,960	8.3	9	17,379	
すかいらーくホールディングス	69.3	112.6	204,256	壹番屋	7.9	8.6	39,259	20.9	22.7	55,319	
綿半ホールディングス	4.2	4.5	9,103	トップカルチャー	4.1	4.6	1,329	26	26.1	70,835	
ヨシックス	1.8	2	6,060	P L A N T	2.6	2.9	2,917	0.9	0.9	674	
コナカド・スーパーマーケットホールディングス	37.1	35.2	41,360	スキホールディングス	24.5	26.5	121,502	5	5.9	28,674	
ブックオフコーポレーション	6.4	-	-	ヴィア・ホールディングス	9.8	14.8	9,723	6	6.5	9,925	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.5	4.9	3,332	スクロール	17.4	18.6	7,235	18.7	16.2	777,924	
B E E N O S	1.5	2.8	3,029	ヨンドシホールディングス	11.4	13.5	29,038	47.3	45.4	157,084	
あさひ	8.3	10	15,080	ユニ・ファミリーマートホールディングス	35.7	33.8	425,880	10.5	10.2	11,046	
日本調剤	3.9	4.3	16,813	木曾路	13.7	14.8	36,570	2.3	2.4	4,260	
コスモス薬品	5.6	5.3	109,816	S R Sホールディングス	13.2	14.3	14,271	2.3	2.1	4,741	
トーエル	5.5	5.8	4,007	千趣会	20.2	21.9	5,037	27.4	29.6	25,633	
一六堂	2.5	-	-	タカキュー	9	9.2	1,692	-	-	-	
オンリー	1.7	2.2	2,217	ケーヨー	20.7	22.4	11,760	2.4	2.7	1,871	
セブン&アイ・ホールディングス	468.1	506.6	2,415,468	上新電機	13.2	14.3	33,161	75.7	82.1	9,852	
薬王堂	4.9	5.2	13,119	日本瓦斯	20.5	19.6	81,046	58.1	62.6	184,808	
クワイエット・レストランホールディングス	30	32.6	40,424	ロイヤルホールディングス	19.8	21.4	56,538	15.1	16.3	25,313	
ツルハホールディングス	24.2	26.2	259,380	東天虹	0.8	0.8	1,038	183.4	198.5	87,538	
サンマルクホールディングス	8.8	9.5	23,674	いなげや	12.4	13.6	18,890	316.8	343.1	430,247	
フェリシモ	2.9	2.7	2,926	島忠	27	27.3	83,811	28.5	29.2	11,008	
トリドールホールディングス	13.8	14.9	29,338	チヨダ	13.2	12.7	23,583	68.0	77.0	339,878	
TOKYO BASE	2.2	10.7	9,223	ライフコーポレーション	8.5	9.2	22,512	75.8	77.4	74,304	
ウィルプラスホールディングス	-	1.1	843	リンガーハット	13.8	14.9	34,985	-	56.8	45,326	
ジャパネット	-	4.6	7,787	さが美グループホールディングス	10	-	-	-	10.4	16,650	
サツドラホールディングス	1.5	2	3,666	M r M a x H D	14	16.6	8,316	-	21	62,958	
デファクトスタンダード	-	0.7	277	テナアライド	10.6	11.5	4,531	96.8	88.8	128,582	
ダイエー・リゾナーホールディングス	5.2	6.5	6,376	AOKIホールディングス	22.3	24.2	30,371	66.6	67.5	210,600	
パロックスジャパンリミテッド	8.9	9.7	8,778	オーワーク	16	17.2	17,905	7,901.7	8,428.8	4,872,689	
グスリのアオキホールディングス	8.9	12	86,520	コメリ	17.2	18.7	51,574	1,227.4	1,328	687,505	
カの源ホールディングス	-	3.4	2,652	青山商事	21.4	21.1	57,265	219.9	237.9	971,107	
スローローバルホールディングス	10.7	13.3	86,450	しまむら	13	14.1	133,950	846.5	853	3,350,584	
L I X I L ビバ	10.6	10.2	14,983	はせがわ	5.9	6.1	2,403	13.7	-	-	
メディカルシステムネットワーク	12.7	12.9	5,830	高島屋	175	94.7	135,610	11.2	-	-	
総合メディカル	4.9	-	-	松屋	22.5	24.3	25,636	401	428.7	288,943	
はるやまホールディングス	5.2	5.5	4,526	エチ・ツー・オー リテイリング	52.9	62.1	95,261	227.1	242	112,046	
ノジマ	19.6	21.6	42,098	近鉄百貨店	4.3	4.7	15,933	17.8	18	43,182	
カッパ・クリエイト	13.9	16.9	23,085	パルコ	10.7	11.7	12,343	30.8	33.3	11,322	
ライトオン	9.4	10.2	8,282	丸井グループ	107	102.3	206,134	46.6	50.4	10,735	
ジーンズメイト	3.4	3.7	1,439	アクシアル リテイリング	9.3	10	34,350	35.1	37.9	68,182	
良品計画	14.8	17.1	458,622	井筒屋	6.3	6.4	1,267	8.7	9.4	24,947	
三城ホールディングス	13.8	15.1	6,160	イオン	429.7	465.1	1,040,196	7.2	7.7	16,285	
アドヴァン	11.4	18.6	18,432	イズミ	20.2	24.5	130,830	12.6	13.7	26,098	
アルビス	2.5	4.6	10,925	東武ストア	1.3	-	-	7.8	8.5	27,497	
コナカ	14.3	15.7	6,923	平和堂	22.7	24.5	61,127	99.9	108.2	32,676	
ハウス オブ ローゼ	1.4	1.5	2,755	フジ	13.1	14.6	26,980	5.8	6.3	6,659	
G-7ホールディングス	3.3	3.5	8,011	ヤオコー	12.7	13.8	80,454	7.2	7.7	12,435	
イオン北海道	11.2	12.3	9,692	ゼビオホールディングス	15.2	14.6	18,746	454	98.3	229,235	
コジマ	19.3	17.7	10,389	ケーズホールディングス	47.3	125.5	122,864	29.5	30.45	263,088	
ヒマラヤ	3.1	3.9	3,900	O l y m p i c グループ	6.6	7.1	4,671	15	16.2	36,693	
コーナン商事	15.9	15.9	43,375	日産東京販売ホールディングス	16.4	18.2	5,733	114.4	123.7	56,407	
エコス	4.5	4.5	7,533	Genky DrugStores	4.4	4.7	12,464	202.4	218.9	98,286	
ワタミ	13.2	15.9	22,371	総合メディカルホールディングス	-	10.5	20,065	69	15	19,980	
マルシェ	3	3.3	2,557	フックオフグループホールディングス	-	6.4	4,876	17.7	19.1	42,764	
パルティフィイング・システムホールディングス	72.4	72.5	475,600	アインホールディングス	15	16.2	125,712	9.6	10.3	15,851	
西松屋チェーン	24.5	26.5	23,691	元氣寿司	2.8	3.4	12,920	12.7	12.9	42,183	
センショーホールディングス	57.9	57	133,608	ヤマダ電機	374.3	368	193,568	3.8	5	8,075	
幸楽苑ホールディングス	7.1	7.6	17,145	アークランドサカモト	18.9	20.5	29,048	2.2	2.3	7,003	
ハウクズレイ	2.7	2.7	3,015	ニトリホールディングス	44.3	52.4	739,364	105	24.2	59,532	
サイゼリヤ	16.6	19.9	40,755	グルメ軒屋	8	8.8	9,970	13.1	14.2	31,012	

(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 4,121		百万円 -

■投資信託財産の構成

2019年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
株 式	千円 275,040,369		% 98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,522,857		1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	279,563,227		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

(2019年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	281,168,547,397円
一 等 株 式 (評 価 額)	4,125,464,360
未 収 入 金 当 金	275,040,369,410
未 入 収 委 託 配 入 証 拠	89,044,788
未 入 収 委 託 配 入 証 拠	424,228,839
(B) 負 債	1,984,233,000
未 入 収 委 託 配 入 証 拠	1,489,440,000
未 入 収 委 託 配 入 証 拠	376,733,000
(C) 純 資 産	279,184,314,397
元 本	115,232,523,115
次 期 繰 越 損 益	163,951,791,282
(D) 受 取 金 数	115,232,523,115円
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)	24,228円

(注1) 期首元本額 109,428,148,369円
 追加設定元本額 39,063,771,527円
 一部解約元本額 33,259,396,781円

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M D C 国内株式インデックスファンド	12,470,165,201円
D I A M国内株式バシッパ・ファンド	2,422,782,745円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,584,623円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	7,945,181円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	13,986,982円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	29,918,491円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	21,960,170円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	16,943,092円
たわらノーロード TOP I X	392,245,080円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	110,161,759円
たわらノーロード バランス (堅実型)	2,948,338円
たわらノーロード バランス (標準型)	20,703,269円
たわらノーロード バランス (積極型)	40,994,687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)	224,069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)	11,759,993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)	36,734,333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)	27,744,281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)	74,154,128円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	66,600円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	177,452円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	1,070,868円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	690,488円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,408,866円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	38,649,342,706円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	937,399,472円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	3,139,647,393円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,204,466,039円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	360,910,846円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,178,711,664円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,114,346,617円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	40,917,509円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,087,561,549円
マネックス資産設計ファンド エゴリユーション	25,501,335円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	297,908,998円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	199,184,916円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	344,970,555円
投資のソムリエ	4,315,294,876円
クルーズコントロール	1,257,278,344円
投資のソムリエ<DC年金>	401,357,411円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	222,726,425円
D I A M D C バランス・F (成長型)	277,618,478円
クルーズコントロール<DC年金>	891,895円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	12,880,608円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	33,987,494円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	55,644,561円
ダイナミック・ナビゲーション	534,098円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	935,961,743円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	2,300,413円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	1,690,960円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C)	363,286円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	3,177,605円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	15,276,644円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	133,194,060円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	18,666円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	70,041,061円
日米資産分散戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	14,119,938円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	116,779,397円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	280,053,245円
D I A M国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	15,178,664円
D I A M国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	64,049,107円
D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	16,881,660円
D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	13,764,104円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	26,737,416円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	55,134,608円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,036,891,666円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	979,267,957円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,714,393,012円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	197,056,346円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	52,699,951円
D I A M 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)	565,823,049円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	356,264,357円
D I A Mグローバル8私募ファンド (適格機関投資家向け)	10,473,598円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	7,863,601円
D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	51,727,826円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	9,107,706,646円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	163,483,865円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,823,334,497円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	10,421,255,147円
D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)	4,948,207円
D I A Mバランス50VA (適格機関投資家限定)	296,109円
D I A Mバランス70VA (適格機関投資家限定)	3,683,923円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	9,276,101,711円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	66,616,336円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	28,932,320円
D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)	26,843,008円
D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)	107,564円
D I A Mバランス60VA (適格機関投資家限定)	120,467円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212) (適格機関投資家限定)	426,124,037円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	1,366,625,210円
D I A M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)	1,837,729,242円
D I A M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)	72,976,941円
期末元本合計	115,232,523,115円

(注3) 担保資産計
 代用として担保を提供している資産は次の通りです。

3,287,500,000円

■損益の状況

当期 自2018年2月8日 至2019年2月7日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	金 配 当 益	6,275,204,545円
受 取	金	6,228,808,737
そ の 他 収 益	金	52,719,900
支 払 利 息	息	△6,324,092
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	買 損 益	△27,670,046,291
売 買	損	11,457,593,174
売 買	損	△39,127,639,465
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	引 損 益	△882,002,368
取 引	益	1,171,869,352
取 引	損	△2,053,871,720
(D) そ の 他 費 用	用	△6,516
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)		△22,276,850,630
(F) 前 期 繰 越 損 益 金		179,810,421,658
(G) 解 約 差 損 益 金		△53,943,765,219
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金		60,361,985,473
(I) 合 計(E + F + G + H)		163,951,791,282
次 期 繰 越 損 益 金(I)		163,951,791,282

(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》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)