

運用報告書 (全体版)

第12期<決算日2020年10月12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、2020年10月12日に第12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)	税込み	期中騰落	(配当込み) 騰落率	(ベンチマーク) 騰落率			
8期(2016年10月12日)	円 18,950	円 0	% △9.4	ポイント 1,910.89	% △8.7	% 97.3	% 2.5	百万円 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
12期(2020年10月12日)	24,889	0	3.4	2,564.00	3.9	97.5	2.5	8,368

(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) 2019年10月15日	円 24,073	% -	ポイント 2,467.63	% -	% 97.2	% 2.7
10月末	24,767	2.9	2,539.02	2.9	97.3	2.6
11月末	25,238	4.8	2,588.40	4.9	97.7	2.3
12月末	25,593	6.3	2,625.91	6.4	97.8	1.9
2020年1月末	25,032	4.0	2,569.77	4.1	97.2	2.8
2月末	22,453	△6.7	2,305.76	△6.6	97.7	1.9
3月末	21,104	△12.3	2,167.60	△12.2	100.1	3.3
4月末	22,007	△8.6	2,261.88	△8.3	97.1	3.0
5月末	23,496	△2.4	2,416.04	△2.1	92.2	2.2
6月末	23,447	△2.6	2,411.45	△2.3	97.4	2.6
7月末	22,494	△6.6	2,314.39	△6.2	98.2	1.8
8月末	24,322	1.0	2,503.59	1.5	97.8	2.4
9月末	24,624	2.3	2,536.14	2.8	96.6	3.4
(期末) 2020年10月12日	24,889	3.4	2,564.00	3.9	97.5	2.5

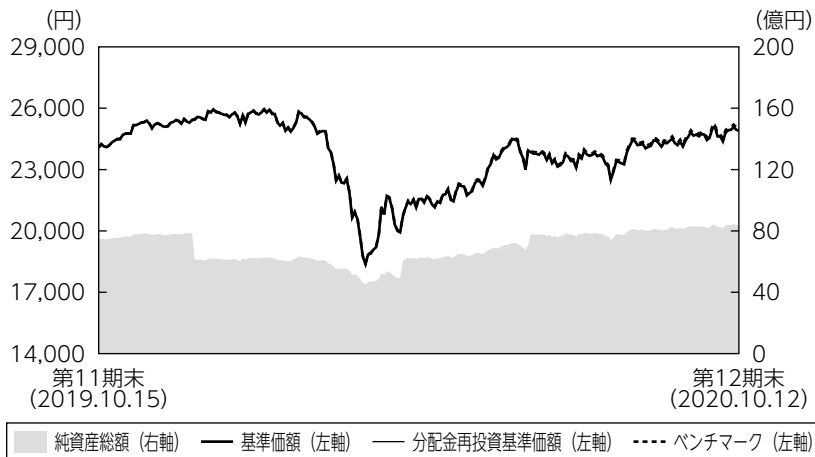
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2019年10月16日から2020年10月12日まで）

基準価額等の推移



第12期首： 24,073円
第12期末： 24,889円
(既払分配金0円)
騰落率： 3.4%
(分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

国内株式市場は、2020年2月半ばから3月半ばにかけて、新型コロナウイルスの感染拡大懸念等から大幅に下落しましたが、その後は経済活動正常化への期待感などにより回復したことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

期初から2020年1月前半にかけては、米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどを好感し、国内株式市場は上昇しました。しかし、2月から3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気や企業業績への影響が深刻になるとの見方が広がり、国内株式市場は急落しました。その後は、感染に鈍化の兆しが見られたことや各国の景気対策などを要因として値を戻す展開となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの組入比率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	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



期末

(単位：%)

No.	業種	組入比率
1	電気機器	15.1
2	情報・通信業	10.2
3	化学	7.2
4	輸送用機器	6.9
5	医薬品	6.0
6	サービス業	5.7
7	機械	5.3
8	小売業	5.0
9	銀行業	4.6
10	卸売業	4.5

○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	3.4
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



期末

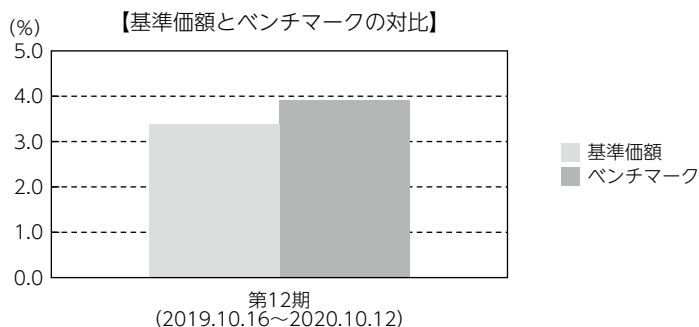
(単位：%)

No.	銘柄名	組入比率
1	トヨタ自動車	3.3
2	ソフトバンクグループ	2.4
3	ソニー	2.1
4	キーエンス	1.9
5	任天堂	1.5
6	武田薬品工業	1.3
7	日本電信電話	1.3
8	リクルートホールディングス	1.2
9	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.2
10	NTTドコモ	1.2

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3.9%上昇しました。

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
	2019年10月16日 ～2020年10月12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	14,889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12期		項目の概要
	(2019年10月16日 ～2020年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	117円	0.491%	(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23,795円です。 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)	(104)	(0.436)	
(販売会社)	(5)	(0.022)	
(受託会社)	(8)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) その他費用 (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	118	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。

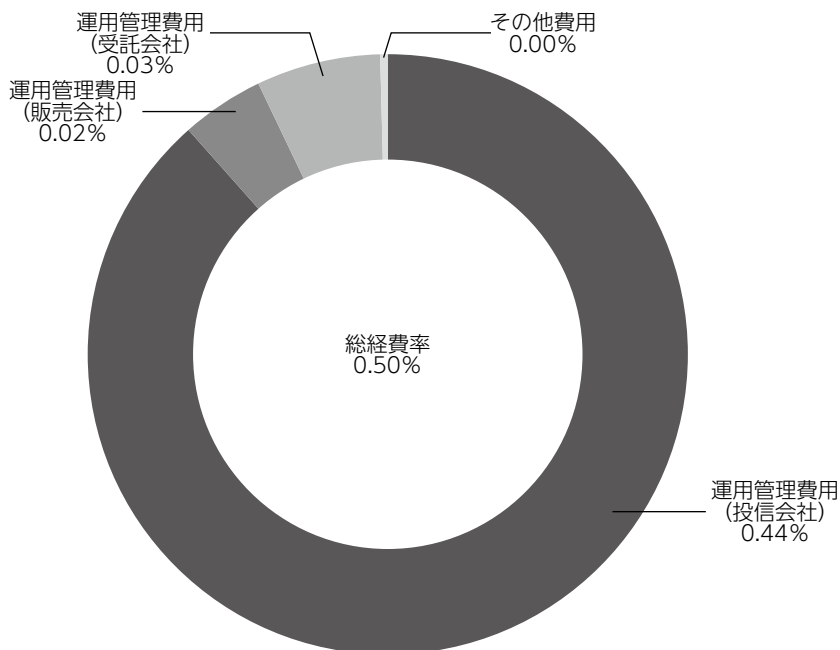
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.50%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（2019年10月16日から2020年10月12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	1,082,103	2,576,627	844,232	2,252,599

■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	193,064,940千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	228,461,146千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.84

(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（2019年10月16日から2020年10月12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)	103千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	3千円
(B)／(A)	3.0%

(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 111,270	百万円 57	% 0.1	百万円 81,794	百万円 536	% 0.7

平均保有割合 2.9%

(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 983	百万円 710	百万円 2,174

(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 233

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□ 2,907,412	千□ 3,145,283	千円 8,367,711

■投資信託財産の構成

2020年10月12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	8,367,711	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	23,971	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	8,391,682	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

(2020年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	8,391,682,687円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	19,072,510
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)	8,367,711,177
未 収 入 金	4,899,000
(B) 負 債	22,946,919
未 払 解 約 金	4,670,397
未 払 信 託 報 酬	18,218,370
そ の 他 未 払 費 用	58,152
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,368,735,768
元 本	3,362,379,516
次 期 繰 越 損 益 金	5,006,356,252
(D) 受 益 権 総 口 数	3,362,379,516口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	24,889円

(注) 期首における元本額は3,092,725,388円、当期中における追加設定元本額は1,205,686,297円、同解約元本額は936,032,169円です。

■損益の状況

当期 自2019年10月16日 至2020年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△4,324円
受 取 利 息	213
支 払 利 息	△4,537
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	507,158,276
売 買 益	626,689,000
売 買 損	△119,530,724
(C) 信 託 報 酬 等	△34,086,265
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	473,067,687
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	360,393,769
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,172,894,796
(配 当 等 相 当 額)	(3,492,272,544)
(売 買 損 益 相 当 額)	(680,622,252)
(G) 合 計(D+E+F)	5,006,356,252
次 期 繰 越 損 益 金(G)	5,006,356,252
追 加 信 託 差 損 益 金	4,172,894,796
(配 当 等 相 当 額)	(3,492,705,075)
(売 買 損 益 相 当 額)	(680,189,721)
分 配 準 備 積 立 金	833,461,456

(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	143,836,894円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	230,560,521
(c) 収 益 調 整 金	4,172,894,796
(d) 分 配 準 備 積 立 金	459,064,041
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	5,006,356,252
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	14,889.33
(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18期（決算日 2020年2月7日）

（計算期間 2019年2月8日～2020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18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰	期中 落率	(配当込み) ベンチマーク	期中 落率			
14期 (2016年2月8日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期 (2016年2月8日)	19,981	△1.3	1,925.17	△1.2	98.2	1.7	286,897
15期 (2017年2月7日)	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3	284,249
16期 (2018年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
17期 (2019年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
18期 (2020年2月7日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760

(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（㈱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、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱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、㈱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）。

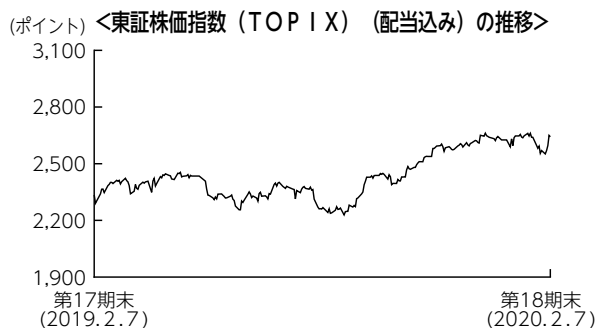
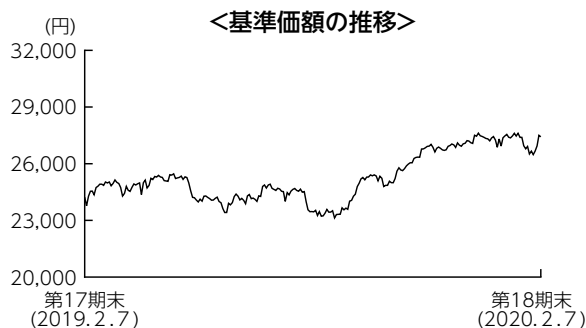
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物比率
	円	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク) ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2019年 2月7日	24,228	% -	2,334.81	% -	% 98.5	% 1.5
2月 末	24,833	2.5	2,393.08	2.5	97.7	2.3
3月 末	24,854	2.6	2,395.21	2.6	97.1	2.9
4月 末	25,266	4.3	2,434.82	4.3	97.4	2.3
5月 末	23,624	△2.5	2,275.96	△2.5	97.8	2.2
6月 末	24,269	0.2	2,338.89	0.2	97.7	1.9
7月 末	24,491	1.1	2,360.18	1.1	98.9	0.8
8月 末	23,664	△2.3	2,280.58	△2.3	97.9	1.8
9月 末	25,094	3.6	2,418.29	3.6	96.9	3.1
10月 末	26,349	8.8	2,539.02	8.7	97.3	2.6
11月 末	26,861	10.9	2,588.40	10.9	97.7	2.3
12月 末	27,250	12.5	2,625.91	12.5	97.8	1.9
2020年 1月 末	26,665	10.1	2,569.77	10.1	97.2	2.8
(期 末) 2020年 2月7日	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4

(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（2019年2月8日から2020年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は27,423円となり、前期末比で13.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米中貿易協議の状況次第の相場展開となりましたが、期末にかけては貿易協議が再開し、第1段階の合意に達したことが好感され、国内株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2019年4月までは、米中貿易問題の進展期待などを要因として上昇しました。しかし、5月に入ると世界景気の後退懸念が広がり、反落しました。その後はほぼ横ばいとなりましたが、8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され、下落しました。9月から2020年1月前半までは、欧米の中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどが好感され、上昇しました。期末にかけては、新型コロナウイルス感染拡大が嫌気され、下落する局面がありました。

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	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



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	14.2%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.4
4	化学	6.9
5	医薬品	6.1
6	銀行業	5.5
7	サービス業	5.1
8	機械	5.0
9	卸売業	4.9
10	小売業	4.4

○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	3.2%
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	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.5%
2	ソニー	日本・円	2.0
3	ソフトバンクグループ	日本・円	1.6
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.6
5	武田薬品工業	日本・円	1.5
6	日本電信電話	日本・円	1.5
7	キーエンス	日本・円	1.4
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.2
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.1
10	KDDI	日本・円	1.0
組入銘柄数		2,151銘柄	

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で13.2%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)	0円 (0)	0.002% (0.000)
(先物・オプション)	(0)	(0.002)
合 計	0	0.002

(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(25,270円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については5ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2019年2月8日から2020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
		29,008.8 (2,820.619)	54,443,054 (-)	46,738.519	91,420,458

(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 106,543	百万円 104,700	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	145,863,512千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	254,160,767千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.57

(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（2019年2月8日から2020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 54,443	百万円 24	% 0.0	百万円 91,420	百万円 5,933	% 6.5

(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 497	百万円 856	百万円 2,492

(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 98

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	4,389千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	17千円
(B)/(A)	0.4%

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

(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		千株		千円	植木組	1.8	1.5	3,957	東洋精糖	2.1	1.7	2,031	日本甜菜製糖	7	5.7	11,126	三井製糖	9.7	9.5	20,995	塩水港精糖	14.4	11.3	2,610	日新製糖	5.8	5.1	10,449	森永製菓	31	25.4	137,414	中村屋	3	2.8	11,424	江崎グリコ	36.9	32.1	157,290	名糖産業	5.9	5.2	7,342	井村屋グループ	5.2	4.6	8,960	不二家	6.9	6	13,728	山崎製パン	100.8	81.2	170,601	第一屋建設	2.1	1.8	1,683	モロゾフ	2	1.8	9,090	亀田製菓	7.6	6.2	31,682	寿スピリッツ	13	10.4	71,968	カルビー	56.1	49.4	160,797	森永乳業	24.6	20	90,600	六甲バター	9	7.1	11,715	ヤクルト本社	91.3	74.5	427,630	明治ホールディングス	87.2	71.6	529,840	雪印メグミルク	29.6	26.1	68,042	プリマハム	17.3	16.9	45,139	日本ハム	53.2	41.4	198,099	林業産業	4.3	3.7	2,660	丸大食品	13.3	11.6	25,566	S Foods	11.1	8.7	23,298	柿安本店	-	3.8	12,369	伊藤園	37.4	32.8	178,760	キーコーヒー	12.2	10.7	24,556	ユニカフェ	3.9	2.9	2,810	ジャパンフーズ	1.8	1.5	1,885	日清オイルグループ	15.9	14	53,060	不二製油グループ本社	30.1	26.4	76,586	かどや製油	1.3	1.1	4,295	J-オイルミルズ	6.4	5.6	24,584	キッコーマン	81.3	77.9	444,809	味の素	271.9	239	467,603	キユーピー	68.6	60.3	135,916	ハウス食品グループ本社	47	40.5	147,825	カゴメ	49.4	41.1	112,717	焼津水産化学工業	6.1	5.3	5,469	アリアケジャパン	11.3	9.9	71,874	ピエトロ	1.6	1.4	2,298	エバラ食品工業	2.6	2.5	5,450	やまみ	-	0.5	1,077	ニチレイ	64	51.5	144,303	東洋水産	63.3	55.7	265,967	イートアンド	4.3	3.8	7,227	大冷	1.5	1.4	2,777	ヨシムラ・フード・ホールディングス	3.3	5.9	7,085	日清食品ホールディングス	52.4	46	421,820	永谷園ホールディングス	6.6	5.3	11,649																
鉱業 (0.3%)		千株		千株		千円	日本建設	18.8	14.9	12,814	新日本建設	16.4	14.4	13,392	NIPPO	36.4	27.9	76,473	東亜道路工業	2.6	2.1	7,539	前田道路	43.1	35.8	132,281	日本道路	3.8	3.3	25,080	東亜建設工業	12.1	10.5	18,417	日本国土開発	-	19.8	12,137	若築建設	6.9	6.1	10,174	東洋建設	50.3	37.9	19,897	五洋建設	163.3	134	92,460	世紀東急工業	20.1	16.2	14,985	福田組	4.5	3.9	19,695	住友林業	97.5	85.7	141,319	日本基礎技術	14.4	11.4	4,582	巴コーポレーション	17.1	15.2	6,460	大和ハウス工業	380.8	334.5	1,204,200	ライト工業	26.4	19.4	30,458	積水ハウス	420.8	369.9	903,295	日特建設	11.8	8.9	7,698	北陸電気工事	6.7	5.8	6,722	ユアテック	22.1	19.4	13,153	四電工	2	1.7	4,610	中電工	17.6	13.7	35,072	関電工	62.6	48.1	50,697	さんでん	91.5	80.4	150,508	東京エネシス	14.2	11.2	10,057	トーエネック	3.8	3.4	12,750	住友建設	9.5	9.6	24,240	日本電設工業	23.5	18.6	44,007	協和エクスオ	53.8	51.3	144,153	新日本空調	11.7	9	19,260	九電工	27	23.8	76,993	三機工業	31.6	24.4	36,746	日揮ホールディングス	118.4	104.1	162,396	中外炉工業	3.9	3.7	6,352	ヤマト	12.4	10.8	8,953	太平電業	9.3	8.2	19,852	高砂熱学工業	34.6	29.4	57,947	三晃金属工業	1.5	1.4	3,733	朝日工業社	2.7	2.2	7,645	明星工業	24.9	21.8	18,355	大氣社	18.8	16.4	65,108	ダイダシ	9.2	8.1	24,210	日比谷総合設備	13.1	10.9	21,255	東芝プラントシステム	29.7	-	-	フィル・カンパニー	-	1.4	5,607	OSJホールディングス	60.8	53.1	15,186	東洋エンジニアリング	16.2	14.2	8,406	千代田化工建設	99.1	-	-	レイズネクスト	24.7	18.2	25,534	日本製粉	40.9	31.6	53,909	日清製粉グループ本社	139.1	122.3	236,283	日東富士製粉	0.8	0.7	4,410	昭和産業	11.4	10	31,150	鳥越製粉	11.1	9.7	8,099	中部飼料	15	13.3	22,889	フィード・ワン	83	72.9	13,632
建設業 (2.8%)		千株		千株		千円	住友建設	97.5	85.7	141,319	日本基礎技術	14.4	11.4	4,582	巴コーポレーション	17.1	15.2	6,460	大和ハウス工業	380.8	334.5	1,204,200	ライト工業	26.4	19.4	30,458	積水ハウス	420.8	369.9	903,295	日特建設	11.8	8.9	7,698	北陸電気工事	6.7	5.8	6,722	ユアテック	22.1	19.4	13,153	四電工	2	1.7	4,610	中電工	17.6	13.7	35,072	関電工	62.6	48.1	50,697	さんでん	91.5	80.4	150,508	東京エネシス	14.2	11.2	10,057	トーエネック	3.8	3.4	12,750	住友建設	9.5	9.6	24,240	日本電設工業	23.5	18.6	44,007	協和エクスオ	53.8	51.3	144,153	新日本空調	11.7	9	19,260	九電工	27	23.8	76,993	三機工業	31.6	24.4	36,746	日揮ホールディングス	118.4	104.1	162,396	中外炉工業	3.9	3.7	6,352	ヤマト	12.4	10.8	8,953	太平電業	9.3	8.2	19,852	高砂熱学工業	34.6	29.4	57,947	三晃金属工業	1.5	1.4	3,733	朝日工業社	2.7	2.2	7,645	明星工業	24.9	21.8	18,355	大氣社	18.8	16.4	65,108	ダイダシ	9.2	8.1	24,210	日比谷総合設備	13.1	10.9	21,255	東芝プラントシステム	29.7	-	-	フィル・カンパニー	-	1.4	5,607	OSJホールディングス	60.8	53.1	15,186	東洋エンジニアリング	16.2	14.2	8,406	千代田化工建設	99.1	-	-	レイズネクスト	24.7	18.2	25,534	日本製粉	40.9	31.6	53,909	日清製粉グループ本社	139.1	122.3	236,283	日東富士製粉	0.8	0.7	4,410	昭和産業	11.4	10	31,150	鳥越製粉	11.1	9.7	8,099	中部飼料	15	13.3	22,889	フィード・ワン	83	72.9	13,632																																																				

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
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
一正蒲鉾	4.9	4	3,936	化学 (7.1%)				森六ホールディングス	6.5	5.7	12,887
フジッコ	13.4	11.7	23,013	クラレ	202.9	166.4	228,633	日本化薬	76.4	65.4	86,785
ロック・フィールド	13.4	11.7	17,386	旭化成	855	700	770,000	カリットホールディングス	12.8	11.3	6,655
日本たばこ産業	711.1	624.9	1,437,894	共和レザー	7.5	5.8	4,576	日本精化	9.7	8.6	11,429
ケンコーマヨネーズ	6.9	6.1	15,213	昭和電工	79.8	75.2	207,176	扶桑化学工業	12.2	10.7	38,413
わらばりホールディングス	8	7.1	13,837	住友化学	946	776	360,064	トリケミカル研究所	2.7	2.3	27,439
なとり	6.9	6.1	10,620	住友精化	5.8	4.7	14,781	ADEKA	59.3	48.7	80,744
イフジ産業	2.1	1.9	1,442	日産化学	73.8	59.1	286,044	日油	46.2	39.8	157,608
ビュルスコオペレーション	3	2.3	6,497	ラサ工業	4.3	3.8	5,703	新日本理化	21.9	18	3,762
北の達人コーポレーション	48.4	37.7	24,391	クレハ	11.1	9.1	57,330	ハリマ化成グループ	10	8.8	9,944
ユーグレナ	48.9	46.2	41,949	多木化学	3.4	3.1	14,089	花王	297.9	258.1	2,238,501
ミヨシ油脂	5	4.4	5,337	テイカ	9.8	7.8	14,944	第一工業製薬	4.5	4	18,660
理研ビタミン	5.8	5.1	20,884	石原産業	23.2	19	18,373	石原ケミカル	3.1	3	5,529
繊維製品 (0.6%)				片倉コープアグリ	3	3	3,735	日華化学	4	3.7	3,193
片倉工業	14.8	15.4	19,943	日東エフシー	7.7	-	-	ニイタカ	1.9	1.6	3,662
グンゼ	8	7.8	34,515	日本曹達	19	15.6	53,196	三洋化成工業	8	6.3	31,500
東洋紡	50.8	41.7	65,886	東ソー	185.7	163.3	280,549	有機合成薬品工業	8.3	8.5	2,303
ユニチカ	35.2	31.2	10,951	トクヤマ	34.6	30.5	86,833	大日本塗料	13.7	12	13,980
富士紡ホールディングス	6.3	5.1	19,048	セントラル硝子	26.2	21.6	52,358	日本ペイントホールディングス	99.1	87.2	475,240
倉敷紡績	11.5	10.9	26,705	東亜合成	75.4	66.4	86,452	関西ペイント	135	118.7	304,584
シキボウ	6.3	5.6	7,179	大阪ソーダ	12.9	10.8	32,227	神東塗料	9.4	8.8	1,821
日本毛織	39.4	34.8	37,723	関東電化工業	28.5	25.1	26,028	中国塗料	39.4	30.1	30,762
ダイトウボウ	19	17.8	2,937	デンカ	47.2	38.6	117,730	日本特殊塗料	9	8	11,240
トア紡コーポレーション	5	4.1	2,177	信越化学工業	211.8	181.3	2,473,838	藤倉化成	16.4	14.5	8,410
グアドーリミテッド	15	14.1	3,821	日本カーバイド工業	4.1	3.7	5,065	太陽ホールディングス	9.9	7.8	40,092
帝国繊維	13.5	11.8	29,677	堺化学工業	7.9	6.8	15,762	DIC	54.4	44.7	133,206
帝人	98	86.2	179,985	第一稀元素化学工業	9.8	11.5	10,902	サカタインクス	26.2	23.2	28,605
東レ	932.2	764.7	556,778	エア・ウォーター	98.5	90.2	140,982	東洋インキ(株)ホールディングス	25.4	22.4	57,836
サカイオーベックス	3	2.9	5,208	太陽日酸	99	101.5	231,623	T&K TOKA	9.4	8.4	8,610
住江織物	3.2	2.3	5,713	日本化学工業	4.1	3.3	9,639	富士フィルムホールディングス	254.8	206.7	1,121,967
日本フルト	6.6	5.7	2,861	東邦アセチレン	1.9	1.5	2,074	資生堂	243.8	214.3	1,523,244
イチカワ	1.8	1.5	2,133	日本パーカライジング	65.6	53.3	63,107	ライオン	171	140.2	297,083
日東製網	1.4	1.2	2,040	高圧ガス工業	19.2	16.9	13,790	高砂香料工業	8.5	6.8	16,578
アツギ	10	8.8	6,820	チタン工業	1.5	1.3	3,136	マンダム	27.6	24.3	65,051
ダイニック	4.7	3.9	3,162	四国化成工業	20.2	16.3	21,369	ミルボン	15.1	14.4	81,648
セーレン	29.5	26	41,756	戸田工業	2.6	2.4	5,176	ファンケル	54.6	43.7	135,907
ソトー	4.6	3.8	3,697	ステラ ケミファ	7	5.8	18,270	コーセー	20.8	20.3	301,861
東海染工	1.8	1.4	1,590	保土谷化学工業	4.2	4	18,100	コタ	5.8	5.7	8,498
小松マテール	19.7	17.3	14,359	日本融媒	20.2	16.4	102,172	シーボン	1.4	1.2	2,959
ワコルホールディングス	35	27.5	82,637	大日精化工業	9.9	9.4	27,993	ノーラ・オルビスホールディングス	52.4	46	113,206
ホギメディカル	14.9	12	43,440	カネカ	32	27.3	96,096	ノビアホールディングス	7.7	10.3	55,208
レナウン	35	28.2	3,017	三菱瓦斯化学	123.7	99.7	186,439	アジパンコスメジャパン	2.8	2.3	2,288
クラウディアホールディングス	2.9	2.9	1,403	三井化学	109	96	252,864	エステー	8.8	6.9	11,743
TSIホールディングス	44.3	35.5	19,063	JSR	120.6	98.4	212,839	アグロ カネショウ	5	3.4	4,913
マツカコーポレーション	3.9	3.1	5,986	東京応化工業	20.6	18.2	86,177	コニシ	21.8	17.7	28,638
ワールド	12.4	15	38,985	大阪有機化学工業	11.1	9.8	17,806	長谷川香料	14.6	14.4	32,688
三陽商会	7.2	5.5	7,089	三菱ケミカルホールディングス	803.4	706.2	560,157	星光PMC	8.1	6.3	6,041
ナイガイ	4.6	4	1,756	KHネオケム	18.3	18.6	45,253	小林製薬	34.4	30.2	276,028
オンワードホールディングス	72.3	63.5	39,941	ダイヤセル	186.7	144.5	151,436	荒川化学工業	11.1	9.7	15,035
ルックホールディングス	4.4	3.6	3,873	住友バークライト	20.8	16.6	68,973	メック	8.5	7.4	12,683
キムラタン	57.1	57.9	1,679	積水化学工業	262.6	227.1	425,585	日本高純度化学	3.2	3.1	8,363
ゴールドウイン	10.9	19.2	127,680	日本ゼオン	108.4	95.3	120,554	タカラバイオ	32.1	28.2	68,159
デサント	29.3	20.6	36,606	アイカ工業	36	31.7	114,754	JCU	15.9	13.1	41,396
キング	6.2	5	2,890	宇部興産	60.6	53.3	119,178	新田セラチン	7.7	6.7	4,502
ヤマインターナショナル	7.9	6.3	2,601	積水樹脂	19.8	19	48,051	OA Tアグリオ	1.8	1.8	2,622
パルプ・紙 (0.2%)				タキロンシーアイ	26	22.8	15,732	デクセリアルズ	31.6	27.8	25,909
特種東海製紙	7.6	6.7	27,604	旭有機材	8.3	6	10,326	アース製薬	9.3	8.2	49,282
王子ホールディングス	541	441.3	270,516	日立化成	55.5	48.9	225,184	北興化学工業	12.8	11.1	7,270
日本製紙	57.5	46.7	86,908	ニチパン	6.3	5.6	9,979	大成ラミック	3.7	3.3	9,464
三菱製紙	19.7	12	5,676	リケンテクノス	32.9	26.7	12,896	グミア化学工業	50.7	44.7	40,051
北越コーポレーション	79.7	70	36,890	大倉工業	6.2	5	8,815	日本農業	29.4	19.4	11,310
中越パルプ工業	5.1	4.5	7,200	積水化成成品工業	17.8	14.2	10,124	アキレス	9	7.4	12,987
巴川製紙所	4.1	3.2	3,017	群栄化学工業	2.9	2.4	5,892	有沢製作所	19.3	17	17,442
大王製紙	58.5	46.3	68,662	タイガースポリマー	6.5	5.6	3,259	日東電工	92.7	74.5	470,095
阿波製紙	3	2.8	1,570	ミライアル	3.5	3.8	4,727	レック	13.1	11.5	12,604
レンゴウ	124	99.9	90,609	ダイキアクシス	4.3	3.8	3,321	三光化成	9.5	12.4	4,488
トーモク	7.4	6.5	11,986	ダイキョーニシカワ	25.4	22.2	17,959	きもと	20.9	18.5	3,182
ザ・パック	9.1	8	33,320	竹本容器	4.3	3.8	3,423	藤森工業	11	9.7	33,756

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
前澤化成工業		千株	千円	藤倉コンポジット		千株	千円	日亜鋼業		千株	千円	大紀アルミニウム工業		千株	千円
未来工業		8.6	8,211	オカモト		10.9	4,199	日本精線		17.2	15.7	日本軽金属ホールディングス		15.7	5,118
ウェーブプロクホールディングス		6.6	12,325	フコク		8.6	25,610	エンビロ・ホールディングス		1.8	1.7	三井金属鉱業		4.1	6,443
J S P		2.6	2,839	ニッタ		5.5	3,313	シンニッタン		2.5	4.1	東邦亜鉛		2.5	3,054
エフピコ		7.1	12,537	住友理工		13.9	39,627	新東工業		19	16.6	三菱マテリアル		19	7,685
天馬		10.1	80,358	三ツ星ベルト		23.9	20,918	住友金属鉱山		2.7	2.4	DOW Aホールディングス		2.7	3,496
信越ポリマー		8.6	14,590	パナソニック化学		16.2	27,888	非鉄金属 (0.7%)				大紀アルミニウム工業		19.9	17.5
東リ		22.1	19,458	ガラス・土製品 (0.8%)		23.5	16,074	大紀アルミニウム工業		19.9	17.5	日本軽金属ホールディングス		330.6	270
ニフコ		30.7	8,238	日東紡績		18.3	76,960	三井金属鉱業		32.8	28.8	三井金属鉱業		32.8	77,443
バルカー		49.1	115,592	AGC		121.4	106.6	東邦亜鉛		6.7	5.5	東邦亜鉛		6.7	10,752
ユニ・チャーム		9.9	21,621	日本板硝子		58.6	51.5	三菱マテリアル		80.1	70.5	三菱マテリアル		80.1	203,463
ショーエイコーポレーション		260.2	780,040	石塚硝子		1.6	1.9	住友金属鉱山		166.1	136.3	住友金属鉱山		166.1	438,204
医薬品 (6.3%)		1.2	1,011	日本山村硝子		5.2	4.5	DOW Aホールディングス		28.4	27	DOW Aホールディングス		28.4	109,890
協和キリン		153.7	306,880	日本電気硝子		53.1	43.3	古河機械金属		20	19	古河機械金属		20	26,410
武田薬品工業		777.5	4,035,155	オハラ		4.8	4.3	エス・サイエンス		53.7	47.6	エス・サイエンス		53.7	2,189
アステラス製薬		1,131.4	1,882,099	住友大阪セメント		24.7	20.4	大前チタニウムテクノロジー		14.1	11.1	大前チタニウムテクノロジー		14.1	15,218
大日本住友製薬		91	153,168	太平洋セメント		77.4	68.1	東邦チタニウム		21.8	19.1	東邦チタニウム		21.8	16,597
塩野義製薬		160.6	933,996	日本ビヒウム		12.4	10.8	U A C J		18.5	16.2	U A C J		18.5	37,632
田辺三菱製薬		128.3	—	日本コンクリート工業		26.6	23.4	C K サン工業		2.3	1.9	C K サン工業		2.3	6,308
わかもと製薬		14.3	3,354	三谷セキサン		5.7	5	古河電気工業		35	33.1	古河電気工業		35	86,357
あすか製薬		15.1	14,747	アジアパイルホールディングス		17.3	15.3	住友電気工業		453.6	398.6	住友電気工業		453.6	605,074
日本新薬		32.1	264,888	東海カーボン		21.4	112.9	フジクラ		146.4	128.7	フジクラ		146.4	48,906
ビオフェルミン製薬		2	4,047	日本カーボン		5.8	5.5	昭和電線ホールディングス		14.1	12.3	昭和電線ホールディングス		14.1	16,740
中外製薬		127.9	1,379,148	東洋炭素		7.2	6.3	東京特殊電線		1.6	1.6	東京特殊電線		1.6	4,049
科研製薬		22.2	113,590	リタケカンパニーリミテド		7.3	5.9	タツタ電線		24.1	21.1	タツタ電線		24.1	12,491
ユーザイ		146.8	1,206,150	TOTO		94.4	77	カナレ電気		2	1.7	カナレ電気		2	3,117
ロート製薬		62.9	180,554	日本碍子		149.7	131.6	平河ヒューテック		5	4	平河ヒューテック		5	5,636
小野薬品工業		289.9	666,167	日本特殊陶業		103.5	83.9	リョービ		14.9	13.2	リョービ		14.9	24,195
久光製薬		36.2	166,155	ダントーホールディングス		9.4	8	アーレスティ		14.9	14	アーレスティ		14.9	7,378
持田製薬		9.3	65,550	M A R U W A		4.3	4.2	アサヒホールディングス		22.9	18.7	アサヒホールディングス		22.9	51,200
参天製薬		232.6	421,680	品川フラクトリーズ		3.2	2.9	稲葉製作所		6.9	6	稲葉製作所		6.9	8,316
扶桑薬品工業		4.2	7,543	黒崎播磨		2.5	2.1	宮地エンジニアリンググループ		3.8	3.3	宮地エンジニアリンググループ		3.8	6,890
日本ケミファ		1.6	3,696	ヨータイ		10.7	8.6	トーカロ		31.3	29.6	トーカロ		31.3	36,230
ツムラ		38.1	103,347	ヨソライト工業		6.3	5.5	アルファ		4.3	3.8	アルファ		4.3	5,069
日医工		30.1	41,187	東京薬業		15.7	13.8	S U M C O		134.1	127.7	S U M C O		134.1	225,773
キッセイ薬品工業		21.8	59,496	ニッカトー		5.5	4.9	川田テクノロジーズ		2.7	2.1	川田テクノロジーズ		2.7	13,944
生化学工業		23.8	26,187	フジミコーポレートッド		11	9.6	R S Technologies		2.5	3.1	R S Technologies		2.5	9,017
栄研化学		21.6	44,080	クニミネ工業		4.2	4.4	信和		—	4.6	信和		—	5,069
日水製薬		5.2	6,154	エンドエーマテリアル		2.6	1.8	野村建設グループホールディングス		77.2	67.9	野村建設グループホールディングス		77.2	133,695
鳥居薬品		6.6	24,957	ニチアス		33.6	29.5	ホクサンホールディングス		6.2	5.9	ホクサンホールディングス		6.2	11,623
J C R ファーマ		8.7	76,380	ニチハ		17	15	コロナ		6.8	5.9	コロナ		6.8	6,136
東和薬品		5.8	35,466	鉄鋼 (0.7%)				横河ブリッジホールディングス		22.6	19.9	横河ブリッジホールディングス		22.6	45,431
富士製薬工業		8.3	10,059	日本製鉄		563.9	477.3	駒井ハルテック		2.4	1.9	駒井ハルテック		2.4	3,556
沢井製薬		25.1	163,319	神戸製鋼所		222	195.1	高田機工		1	0.9	高田機工		1	2,540
ゼリア新薬工業		24.3	41,846	中山製鋼所		16.8	14.9	三和ホールディングス		125.3	102.3	三和ホールディングス		125.3	124,294
第一三共		351.1	2,523,530	合同製鐵		5.8	5.7	文化シヤッター		35.8	31.5	文化シヤッター		35.8	27,405
キョーリン製薬ホールディングス		27	52,955	ジェイエフイーホールディングス		327.7	287.9	三協立山		16.8	14.8	三協立山		16.8	22,140
大幸薬品		5.4	17,358	東京製鐵		64.9	52	アルインコ		9.7	7.8	アルインコ		9.7	9,180
ダイト		7.1	23,751	共英製鐵		13.7	12	東洋シヤッター		3	2.5	東洋シヤッター		3	1,687
大塚ホールディングス		233.7	1,045,896	大和工業		25.8	22.6	I X I L グループ		179.1	157.4	I X I L グループ		179.1	294,967
大正製薬ホールディングス		27.4	188,410	東京製鐵		5	4.4	日本フイルコン		9.4	8.3	日本フイルコン		9.4	4,407
ペプチドリーム		61.2	294,840	大阪製鐵		8	5.7	ノーリツ		27	22.1	ノーリツ		27	30,807
石油・石炭製品 (0.5%)				淀川製鋼所		16.4	14.4	長府製作所		12.4	10.8	長府製作所		12.4	25,498
日本コークス工業		104.2	7,091	丸一鋼管		43	34.6	リン製作所		21.7	20.7	リン製作所		21.7	162,909
昭和シェル石油		113.5	—	モリ工業		3.7	3.2	ダイニチ工業		6.4	5.7	ダイニチ工業		6.4	3,978
ニシレキ		15.8	17,665	大同特殊鋼		19.8	17.4	日東精工		16.7	14.7	日東精工		16.7	8,952
ユシロ化学工業		6.4	8,466	日本高周波鋼業		4.6	4.2	三洋工業		1.5	1.4	三洋工業		1.5	2,809
ビービー・カストロール		4.4	5,733	日本冶金工業		100.3	8.9	岡部		24.6	21.6	岡部		24.6	19,094
富士石油		29.7	6,583	山陽特殊製鐵		15.2	7.6	ジーテクト		13.5	13.3	ジーテクト		13.5	21,200
M O R E S C O		4.5	5,672	愛知製鐵		6.8	6	中国工業		1.9	—	中国工業		1.9	—
出光興産		95.1	343,885	日立金属		130.8	114.8	東ブレ		22.6	19.9	東ブレ		22.6	34,566
J X T Gホールディングス		2,063.9	783,329	日本金属		2.8	2.4	高周波熱錬		23.5	20.5	高周波熱錬		23.5	18,716
コスエネジーホールディングス		35.5	67,922	大太平洋金属		8.1	7.2	東京製鋼		7.4	7.6	東京製鋼		7.4	8,641
ゴム製品 (0.7%)				新日本電工		72.6	69.2	サンコール		6.9	6.1	サンコール		6.9	3,287
横浜ゴム		71.2	118,185	栗本鐵工所		6.2	5.3	モリテックスチール		9.5	8.4	モリテックスチール		9.5	3,217
TOYO TIRE		63	87,588	虹 技		1.8	1.6	パイオラックス		19.4	15.7	パイオラックス		19.4	30,976
ブリヂストン		377.1	1,329,576	日本鉄鋼管		1.3	1.1	エイチワン		12	10.5	エイチワン		12	7,518
住友ゴム工業		110.2	121,028	三菱製鋼		9.1	8								

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	千株	千株	千円		株数	千株	千株	千円		株数	千株	千株	千円
EIZO		11.3	8.4	33,054	ウシオ電機		74.5	62.6	101,036	日信工業		22.4	21.9	49,056
ジャパンディスプレイ	290.1	312	312	23,088	岡谷電機産業		8.8	8.5	3,162	トビー工業		10.1	8.9	16,278
日本信号	31.2	27.4	27.4	39,538	ハリオス テクノ ホールディング	11.3	9.9	4,405	ティラド		4.5	3.9	7,203	
京三製作所	26.3	25.2	25.2	14,288	エノモト	2.6	3.3	4,319	曙ブレーキ工業		67.3	59.3	13,994	
能美防災	16.2	14.3	14.3	35,750	日本セラミック	12.5	10.9	27,489	タチエス		20.8	17.6	24,992	
ホーチキ	7.7	7.9	7.9	11,699	遠藤照明	6.3	5.4	3,812	NOK		65.9	57.9	91,366	
星和電機	4.1	5.4	5.4	3,191	古河電池	8.8	7.6	5,806	フタバ産業		34.1	30.1	20,016	
エレコム	11.1	11.7	11.7	50,017	双信電機	5.9	5.4	2,386	K Y B		12.8	12	36,720	
パナソニック	1,401.8	1,231.9	1,522.628		山一電機	8.9	7.9	15,191	大同メタル工業		19.9	20.7	14,117	
シャープ	121.8	124.7	192,910		図研	7.9	7	18,487	プレス工業		60.8	53.5	20,169	
アンリツ	79	69.5	149,355		日本電子	24.2	21.2	77,698	ミクニ		15.5	13.7	4,699	
富士通ゼネラル	37.4	29.3	72,898		カシオ計算機	108.5	95.4	193,757	太平洋工業		25.7	22.5	30,555	
ソニー	822.6	681.6	5,334,201		ファナック	116.6	102.4	2,139,648	ケーヒン		28.2	24.8	64,033	
T D K	64.2	52	627,640		日本シイエムケイ	31.2	25.4	13,716	河西工業		15	14.5	12,020	
帝国通信工業	5.4	4.7	5,870		エンプラス	5.5	5.5	16,885	アイシン精機		101.1	88.7	335,286	
タムラ製作所	47.2	36	23,256		大真空	4.5	4	7,084	マツダ		385.1	317.2	289,286	
アルプスアルパイン	127.7	95.5	191,764		ローム	59.3	47.8	410,124	今仙電機製作所		11.4	10	9,030	
池上通信機	3.9	3.5	3,888		浜松ホトニクス	88.1	77.3	376,064	本田技研工業	1,035.2	849	2,426,017		
パイオニア	204.5	—	—		三井ハイテック	13.6	11.9	20,396	スズキ		224.5	213.7	1,094,357	
日本電波工業	11.2	9.8	4,753		新光電気工業	41.1	36.2	48,942	S U B A R U		381	334.7	950,882	
鈴木	2.1	5.8	4,547		京セラ	187.1	151.7	1,111,657	安永		5.9	5.2	6,193	
日本トリム	6.4	1.4	6,167		太陽誘電	54.6	47.9	167,650	ヤマハ発動機		173.2	140.6	295,822	
ロランド ディー. ジー.	6.3	5.9	12,000		村田製作所	128.8	316.7	2,096,554	ショーワ		29	25.4	58,039	
フォスター電機	14.4	11.3	18,543		ユーシン	19.4	—	—	T B K		14.8	12.9	6,011	
クラリオン	10.7	—	—		双葉電子工業	20	17	22,865	エクセディ		16.6	14.7	34,104	
SMK	3.4	2.8	8,764		北陸電気工業	4.6	4.3	5,022	豊田合成		39.7	34.8	85,990	
ヨコオ	8.8	6.9	20,838		ニチコン	38.6	36.6	35,062	菱三工業		19.2	16.9	12,168	
ティアック	8.6	8	1,592		日本ケミコン	8.8	8.2	14,546	盟和産業		1.9	1.6	1,740	
ホシデン	36.1	29.5	37,229		K O A	18.6	16.2	20,250	日本プラスト		9.6	8.4	5,812	
ヒロセ電機	17.5	16.7	232,965		市光工業	18.4	16.1	11,157	ヨロフ		11.5	10.1	14,705	
日本航空電子工業	28.2	24.7	50,412		小糸製作所	73.6	64.6	321,708	エフ・シー・シー		22.1	17.6	39,564	
T O A	13.3	11.5	12,420		ミツバ	22.6	19.9	15,064	シマノ		49.5	40.4	727,200	
マクセルホールディングス	26.4	23.3	34,181		SCREENホールディングス	21.3	18.7	122,672	ティ・エス テック		28.5	25	78,875	
古野電気	15.8	13.9	15,429		キャノン電子	11.3	11.3	23,843	ジャムコ		6.2	5.4	7,759	
ユニデンホールディングス	3.7	3	6,306		キャノン	660.6	580.4	1,716,823	精密機器 (2.4%)					
スミダコーポレーション	10.4	8.3	9,777		リコー	369	274.3	342,600	テルモ	173.6	305.1	1,202,399		
アイコム	6.8	6	15,990		象印マホービン	22.9	31.6	72,206	クリエートメディック		4.2	3.6	3,888	
リオン	5.6	4.5	14,917		MUTOHホールディングス	1.6	1.4	2,438	日機装		39.7	32.3	44,251	
本多通信工業	10.5	9.4	5,094		東京エレクトロン	81.9	71.9	1,750,765	日本エム・ディ・エム		7	6.2	12,499	
船井電機	12.5	10.9	7,662		輸送用機器 (7.6%)				島津製作所	157.9	128.8	390,908		
横河電機	122.8	98.9	197,008		トヨタ紡織	42.9	31.4	52,783	J M S		11.1	9.2	8,050	
新電元工業	4.4	3.8	13,338		芦森工業	2.6	2.2	3,018	クボテック		2.6	2.8	1,145	
アズビル	79.2	68	204,680		ユニプレス	23.8	20.9	30,305	長野計器		9.6	7.8	7,332	
東亜ディーケーケー	6.1	5.3	5,469		豊田自動織機	99.3	87.3	545,625	パイ・テクノロジ		2.9	5	25,150	
日本光電工業	54.1	44.6	155,654		モリタホールディングス	21.4	18.9	33,207	東京計器		7.7	6.9	7,024	
チノー	4.3	3.7	5,154		三櫻工業	15.5	13.7	14,371	愛知時計電機		1.6	1.3	5,609	
共和電業	13	11.3	4,892		デンソー	270.2	237.4	1,075,184	インターアクション		6.5	5.8	15,433	
日本電子材料	4.7	4.3	4,588		東海理化電機製作所	32.8	28.4	54,698	オーバル		11.7	9.8	2,489	
堀場製作所	24.3	21.3	153,573		E&Sホールディングス	44.3	39	37,167	東京精密		22.2	19.5	78,975	
アドバンテスト	83.6	80.2	453,130		川崎重工	95.5	83.9	191,375	マニ		14.9	42.9	123,981	
小野測器	5.7	4.2	2,553		名村造船所	36.8	34.7	8,744	ニコン	213.8	174.4	233,347		
エスベック	10.9	9.5	22,600		サノリスホールディングス	16.3	13.2	2,349	トプコン		65.8	54.3	69,829	
キーエンス	60.2	97.7	3,743,864		日本車輦製造	4.5	4	12,340	オリンパス		182.8	596.7	1,231,588	
日置電機	6.4	5.6	23,072		三菱ロジスネクスト	14.6	14.3	22,880	理研計器		10.9	9.5	21,755	
シスメックス	95.6	77	631,554		近畿車輛	1.9	1.6	2,579	タムロン		10.9	8.7	20,584	
日本マイクロニクス	19.8	24.289			日産自動車	1,447.3	1,271.6	758,000	HOYA	247.1	215.3	2,190,677		
メガチップス	9.7	10	18,290		いすゞ自動車	387.9	312.4	356,292	シード		5.2	4.6	4,793	
OBARA GROUP	7.1	5.6	20,608		トヨタ自動車	1,367.5	1,203.1	9,458,772	ノーリツ鋼機		9.7	7.2	11,124	
滝藤電機	1.5	1.3	2,802		日野自動車	153.2	134.6	142,003	イー・アンド・デイ		11.2	9.8	9,898	
原田工業	3.8	5.1	5,100		三菱自動車工業	454.2	399	169,575	朝日インテック		52	91.6	291,288	
コーセル	17	13.2	15,272		エフテック	8.7	7.5	5,505	シチズン時計		134.2	126.3	68,075	
イリソ電子工業	11.2	9.1	39,084		レシップホールディングス	4.5	4.4	3,022	リズム時計工業		4.1	3.4	3,107	
オプテックスグループ	21.6	17.6	27,385		GMB	2.5	2	1,612	大研医器		9.8	7.5	5,167	
千代田インテグレ	5.1	5	10,630		ファルテック	2.1	1.9	2,050	メニコン		16.8	14.8	78,144	
アイ・オー・データ機器	5.1	4	4,172		武蔵精密工業	28.9	24	32,112	シンシア		1.9	1.1	749	
レーザーテック	25.1	47.3	259,677		日産車体	24	21.1	22,387	松風		6.2	4.9	9,770	
スタンレー電気	86.9	75.8	234,601		新明和工業	57.1	29.1	39,023	セイコーホールディングス		19	15.2	41,100	
岩崎電気	4.8	4.2	6,997		極東開発工業	24.4	20	29,720	ニプロ		84.9	74.7	99,052	

銘柄	前期(前期末)			当 期 末			銘柄	前期(前期末)			当 期 末			銘柄	前期(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
その他製品 (2.2%)		千株	千円		千株	千円	レノバ	千株	千株	千円	三菱倉庫	千株	千株	千円		千株	千株	千円		
中本パックス	3.4	2.8	4,631	東京瓦斯	240.7	207.5	三井倉庫ホールディングス	40.2	32.4	94,316		14.3	11.6	21,750						
スノーピーク	4.5	5.1	5,298	大阪瓦斯	238	209.3	住友倉庫	43.7	37.5	56,362		43.7	37.5	56,362						
パワソフベッドホールディングス	14.1	11.4	52,611	東邦瓦斯	60.7	53	滋陽倉庫	6.5	5.6	12,572		6.5	5.6	12,572						
トランザクション	6.7	6.9	7,741	北海道瓦斯	6.6	5.8	東陽倉庫	20.5	18.5	6,012		20.5	18.5	6,012						
粧美堂	3.5	3.2	1,270	広島ガス	25.5	22.4	日本トランスシティ	25.7	22.5	11,047		25.7	22.5	11,047						
ニホンフラッシュ	5.2	5	13,760	西部瓦斯	13.9	12.1	ケイヒン	2.2	1.8	2,408		2.2	1.8	2,408						
前田工業	13.6	11.8	26,432	静岡ガス	37.7	30.6	中央倉庫	6.9	6.2	7,278		6.9	6.2	7,278						
永大産業	16.4	14.3	4,876	メタウオーター	5.9	5.2	川西倉庫	2.3	1.8	1,873		2.3	1.8	1,873						
アートネイチャー	13.1	11.5	8,487	陸運業 (4.3%)			安田倉庫	9.7	8.4	9,382		9.7	8.4	9,382						
バンダイナムコホールディングス	126.8	111.5	701,892	SBSホールディングス	12.2	9.3	フェイスホールディングス	-	2.2	1,023		-	2.2	1,023						
アイフィスジャパン	2.7	2.8	2,038	東武鉄道	129.4	113.7	東洋埠頭	3.3	3.1	4,380		3.3	3.1	4,380						
共立印刷	20.8	18.4	3,091	相鉄ホールディングス	42.2	34.5	宇徳	10.1	8.7	4,724		10.1	8.7	4,724						
S H O E I	5.8	5.2	28,288	東急	333.3	271.9	上組	71.8	58.5	141,043		71.8	58.5	141,043						
フランスベッドホールディングス	17.4	15.3	14,504	京浜急行電鉄	168.1	138.5	サンリツ	2.9	2.3	1,616		2.9	2.3	1,616						
パイロットコーポレーション	21.4	17.5	78,487	小田急電鉄	196.6	160.3	キムラユニティ	3.2	2.8	3,166		3.2	2.8	3,166						
萩原工業	6.8	6	9,966	京王電鉄	9.6	56	キューソー流通システム	3	2.5	4,997		3	2.5	4,997						
トップラン・フォームズ	26.3	23.2	28,327	京成電鉄	92	75.1	近鉄エクスプレス	22	21.6	39,614		22	21.6	39,614						
フジシールインターナショナル	27.4	24.2	52,441	富士急行	16.7	14.7	東海運	6.3	5.8	1,664		6.3	5.8	1,664						
タカラトミー	51.4	48.3	56,849	新京成電鉄	3.1	2.8	エーアイティ	7.5	7.2	7,113		7.5	7.2	7,113						
廣済堂	11.4	7.5	7,830	東日本旅客鉄道	218.2	189.8	内外トランスライン	3.8	3.6	4,644		3.8	3.6	4,644						
エステールホールディングス	3.5	2.8	1,971	西日本旅客鉄道	110	96.1	日本コンセプト	3.2	3.3	5,200		3.2	3.3	5,200						
アーク	46.7	41.5	3,776	東海旅客鉄道	109.9	89.7	情報・通信業 (9.0%)													
タカノ	4.9	4.2	3,486	西武ホールディングス	156.3	144.7	NECネットエスアイ	13.4	10	42,150		13.4	10	42,150						
プロネクサス	10.5	9.3	11,206	鴻池運輸	19.6	17.1	クロスキャット	-	2.8	3,539		-	2.8	3,539						
ホクシン	7.7	7.2	1,130	西日本鉄道	34	29.9	システナ	43	37.7	63,147		43	37.7	63,147						
ウッドウ	4	3.5	4,000	ハマキョウレックス	9.4	8.3	デジタルアーツ	6.5	5.2	29,068		6.5	5.2	29,068						
大建工業	9.3	7.2	13,701	サイ引越センター	6.5	5.7	日鉄ソリューションズ	18	15.9	52,072		18	15.9	52,072						
凸版印刷	173.2	152.2	336,362	近鉄グループホールディングス	116.1	102.1	キューブシステム	6.4	5.6	4,362		6.4	5.6	4,362						
大日本印刷	172.9	141.1	433,882	阪急阪神ホールディングス	155	136.2	エイジア	2.4	1.9	2,958		2.4	1.9	2,958						
図書印刷	11.5	-	-	南海電気鉄道	51.9	48.4	コア	5.1	4.5	6,426		5.1	4.5	6,426						
共同印刷	3.9	3.4	10,121	京阪ホールディングス	51.8	45.5	ソリトンシステムズ	6.8	4.6	5,828		6.8	4.6	5,828						
N I S S H A	25.1	22.1	23,249	神戸電鉄	3	2.4	ソフトレイトホールディングス	9.2	5.6	8,234		9.2	5.6	8,234						
光村印刷	1	0.9	1,498	名古屋鉄道	93.1	83.9	T I S	40.1	35.3	250,277		40.1	35.3	250,277						
TAKARA & COMPANY	6.4	5.2	8,996	山陽電気鉄道	9	7.3	ネオス	4.1	4.3	3,173		4.1	4.3	3,173						
アシックス	121.9	89	142,578	日本通運	45.6	36.1	電算システム	4.6	4.1	11,533		4.6	4.1	11,533						
ツツミ	3.9	3.4	7,650	ヤマトホールディングス	203.7	179	グリー	83.1	64.9	31,930		83.1	64.9	31,930						
小松ウォール工業	3.8	3.4	7,524	山丸	32.3	28.4	コエテクモホールディングス	24.6	21.6	68,148		24.6	21.6	68,148						
ヤマハ	73	64.2	364,014	丸連	6.2	5.9	三菱総合研究所	4.7	4.6	21,183		4.7	4.6	21,183						
河合楽器製作所	3.8	3.4	11,356	丸全昭和運輸	9.4	8.3	ボルテージ	2.4	1.9	969		2.4	1.9	969						
クリナップ	11.5	10.1	7,029	セコグループホールディングス	64.1	56.3	電算	1.3	1.2	2,691		1.3	1.2	2,691						
ピジーン	74.2	65.2	259,822	トナミホールディングス	2.8	2.4	AGS	6.8	5.9	5,032		6.8	5.9	5,032						
オリバー	-	2.2	7,546	ニッコンホールディングス	44.2	36.5	ファインデックス	10.1	9	11,007		10.1	9	11,007						
兼松サステック	0.8	0.7	1,283	日本石油輸送	1.4	1.1	ビットコミュニケーションズ	2.8	-	-		2.8	-	-						
キングジム	10.2	9	8,091	福山通運	14.9	13.1	ブレインパッド	2.6	2.1	12,075		2.6	2.1	12,075						
リンテック	29.2	25.6	63,385	セイノーホールディングス	87	76.5	K L a b	21.4	20.4	16,748		21.4	20.4	16,748						
イトーキ	22.6	22.9	11,335	エスライン	3.1	3.1	ホトウィン・ビストロホールディングス	16	12.7	12,509		16	12.7	12,509						
任天堂	75.5	66.1	2,677,050	神奈川中央交通	2.9	2.5	イーブクイニシアティブジャパン	2	1.5	2,634		2	1.5	2,634						
三菱鉛筆	20.2	17.7	29,789	日物流	25.6	18.8	ネクソン	306.6	301.2	497,281		306.6	301.2	497,281						
タカラスタンダード	25.4	22.2	41,358	丸和運輸機関	6.1	10.8	アイスタイル	30.6	27.3	12,285		30.6	27.3	12,285						
コクヨ	58.9	51.7	86,028	C&Fホールディングス	11.9	10.3	エムアップ	4.2	3.1	9,293		4.2	3.1	9,293						
ナカバヤシ	12.3	10.7	6,805	九州旅客鉄道	97.6	91.1	エイチーム	7.5	7.2	6,955		7.5	7.2	6,955						
グローブライド	5.9	4.8	11,731	SGホールディングス	109.8	107.2	エニグモ	-	7.5	6,802		-	7.5	6,802						
オカムラ	42.9	37.6	41,059	海運業 (0.2%)			テクノスジャパン	10.1	8.3	4,332		10.1	8.3	4,332						
美津濃	12.2	9.8	27,557	日本郵船	97.1	85.4	e n i s h	4.2	4.7	2,608		4.2	4.7	2,608						
電気・ガス業 (1.5%)				商船三井	69	64.6	コロブラ	34.3	34.7	32,895		34.3	34.7	32,895						
東京電力ホールディングス	979.5	860.8	388,220	川崎汽船	35.8	31.4	オルトプラス	7.3	7.9	7,102		7.3	7.9	7,102						
中部電力	375.4	330	517,440	NSユニテッド海運	6.4	5.6	ブロードリーフ	59.7	52.5	33,180		59.7	52.5	33,180						
関西電力	500.7	408.6	533,835	明治海運	12.1	10.2	クロス・マーケティンググループ	3.3	4.9	1,768		3.3	4.9	1,768						
中国電力	169.6	149.1	225,141	飯野海運	55	48.1	デジタルホールディングス	5.4	5.6	5,420		5.4	5.6	5,420						
北陸電力	120.1	98.6	87,359	共栄タンカー	0.8	1.8	システム情報	-	5.4	5,437		-	5.4	5,437						
東北電力	287.4	269.6	284,967	乾汽船	10.4	5.9	メディアドックホールディングス	3.5	3.4	10,931		3.5	3.4	10,931						
四国電力	110.5	97.2	90,882	空運業 (0.5%)			じげん	12.8	26.2	13,466		12.8	26.2	13,466						
九州電力	252.9	222.3	204,738	日本航空	212.8	183.8	アイキューブ	6.3	6.5	4,147		6.3	6.5	4,147						
北海道電力	114.8	101	52,318	ANAホールディングス	212.5	186.6	エンカレッジ・テクノロジ	-	1.7	1,496		-	1.7	1,496						
沖縄電力	22.7	20	41,820	パスコ	2.3	1.9	サイバーリンクス	1.9	1.6	1,832		1.9	1.6	1,832						
電源開発	97.7	85.9	217,842	倉庫・運輸関連業 (0.2%)			ディー・エル・イー	7.5	7.9	1,540		7.5	7.9	1,540						
エフオン	7.3	5.1	3,901	トラロコム	3.3	2.9	フィックスターズ	11.5	11.2	17,080		11.5	11.2	17,080						
イーレックス	21.3	15.3	26,285	日新	10	8.8	CARTA HOLDINGS	6.4	5.1	5,502		6.4	5.1	5,502						

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	株	数		株	数	株	数
オプティム	2.7	千株	2.8	千円	野村総合研究所	76.5	千株	149.9	千円	日本通信	102.6	千株	81.8	千円
セレス	4		3.5		サイバネットシステム	9.9		7.5		クロスパス	2.3		1.9	
S H I F T	—		2.8		CEホールディングス	3.2		6.1		日本電信電話	823.5		1,414.3	
ペリサーブ	1.1		—		日本システム技術	2		1.7		KDD I	1,061.1		788.5	
ティーガイア	12.1		9.4		インテジホールディングス	15.4		13.3		ソフトバンク	957.3		961.6	
セック	2		1.5		東邦システムサイエンス	3.7		2.9		光通信	14.2		10.9	
日本アジアグループ	12.8		11.1		ソースコム	46.4		50.2		NTTドコモ	864.6		781.6	
豆蔵ホールディングス	8.1		7.2		インフォコム	4.9		11.5		EMティーアイ	14.1		10.2	
テクマトリックス	8.6		7.4		HEROZ	—		0.5		GMOインターネット	43.8		41.7	
プロシップ	3.6		3.1		ラクスル	—		5.6		ファイバーゲート	—		2	
カネー・オンライン・エンターテイン	290.2		25.5		FIG	10.6		11.6		アドマーケティングコミュニケーション	2.5		3.2	
GMOベイメントゲートウェイ	19.8		17.4		システムサポート	—		0.9		KADOKAWA	35.1		28.5	
ザッパラス	5.9		5.6		イーンソル	—		3.8		学研ホールディングス	4.1		3.6	
システムリサーチ	1.6		2.9		アルテリア・ネットワークス	9.9		11.7		ゼンリン	24		21.1	
インターネットインシアタイプ	19.6		15.6		ビットコムエフエスホールディングス	—		2.4		昭文社	5.4		5	
さくらインターネット	14.4		11.3		フォーカスシステムズ	8		6.5		インプレスホールディングス	9.7		8.8	
ヴィンクス	4.1		3		クレスコ	3.7		6.5		アイネット	6.8		5.4	
GMOクラウド	2.7		1.9		フジ・メディア・ホールディングス	124.9		101.9		松竹	7.9		7	
SRAホールディングス	6.4		5.6		オービック	41.8		36.7		東宝	79.2		63.2	
MINOR1ソリューションズ	2.4		—		ジャストシステム	17.1		17.2		東映	5.1		4	
システムインテグレータ	3.4		3.4		TDCソフト	10.5		9.3		エヌ・ティ・ティ・データ	320.7		281.7	
朝日ネット	10.1		7.5		Zホールディングス	785.1		1,452.9		ビー・シー・イー	1.6		1.3	
eBASE	3.7		6.3		トレンジマイクロ	64.2		47		ビジネスプレイング水田昭利	2.1		1.8	
アバント	3.2		7.5		IDホールディングス	3.4		4.1		D T S	13.5		23.7	
アドソル日進	4.3		3.8		日本オラクル	24.4		21.4		ソフトバンク・エンタテインメント	56		45.1	
フリービット	7.9		6.3		アルファシステムズ	4		3.3		シーイーシー	12.9		11.3	
コムチュア	6.7		11.8		フューチャー	16.3		12.7		カブコム	51.6		49.9	
サイバーコム	2.2		1.8		CAC Holdings	9.1		6.8		アイ・エス・ビー	2.4		2	
アステリア	5.9		6.4		S Bテックノロジー	5.1		3.8		ジャズテック	7		6.7	
アール	—		3.8		トーセ	3.3		2.9		S C S K	31.8		24.4	
マークラインズ	4.2		5.3		オービックビジネスコンサルタント	12.4		10.8		日本システムウエア	4		3.5	
メディカル・データ・ビジョン	10.6		8.1		伊藤忠テクノソリューションズ	54.9		48.2		アイネス	15.2		10.4	
gumi	13.9		13.6		アイティフォー	14.6		12.9		T K C	10.1		9	
ショーケース	2.6		2.4		東計電算	1.8		1.5		富士ソフト	18		13.6	
モバイルファクトリー	3.3		2.3		エックスネット	2.3		1.6		N S D	19.7		34.8	
テラスカイ	0.7		3.8		大塚商会	65.1		57.2		コナミホールディングス	49.3		38.5	
デジタル・インフォメーション・テクノロ	5.3		4.7		サイボウズ	14.1		12.3		豊科コンピュータホールディングス	4		4.2	
P C Iホールディングス	2.2		2.1		ソフトブレイン	9.5		6.2		J B C Cホールディングス	9.5		7.1	
パイプHD	2		1.3		電通国際情報サービス	7.4		6.5		ミロク情報サービス	12		9.3	
アイビシー	2		1.9		デジタルガレージ	23.5		19.1		ソフトバンクグループ	503.2		839.5	
ネオジャパン	2.3		1.9		インターネットシステムズ	9.7		14.9		卸売業 (5.0%)				
P R T I M E S	0.7		0.9		ウェザーニューズ	4.1		3.6		ホウスイ	0.9		0.9	
ランドコンピュータ	1.4		1.6		C I J	9.5		7.9		高千穂交易	4.7		4.1	
ダブルスタンダード	0.7		1.3		ビジネスエンジニアリング	1.1		1.2		伊藤忠食品	2.9		2.4	
オーブンドア	5.9		5.2		日本エンタープライズ	12.7		10.8		エレマテック	5.6		9.9	
マイネット	3.9		3.5		WOWOW	5.7		5.1		J A L U X	3.4		3.1	
アカツキ	4.3		3.8		スカラ	9.7		7.5		あらた	6.7		8.5	
ベネフィットジャパン	0.6		0.8		インテリジェント ウェブ	—		4		トーマンデバイス	1.9		1.6	
Ubi comホールディングス	2.2		2.3		IMAGICA GROUP	10.2		9		東レエレクトロニクス	4.4		3.9	
L I N E	36.6		24.2		ネットワンシステムズ	42.7		40.3		フィールズ	10.5		8.2	
カナミックネットワーク	1.9		6.4		システムソフト	29.1		26.3		双日	667.4		586.6	
ナムラシステムコーポレーション	0.9		2.3		アルゴグラフィックス	5.1		9		アルフレックスホールディングス	134.3		118	
チェンジ	1.5		2.1		マーベラス	18.4		16.1		横浜冷凍	31.7		29.9	
シンクロ・フード	5.1		4.6		エイベックス	20.7		18.2		神栄	1.6		1.5	
オークネット	6.3		6.5		日本ユニシス	37.6		33		ラサ商事	6.5		5.6	
セグエグループ	—		1.7		兼松エレクトロニクス	6.5		5.7		ラクーンホールディングス	7.1		5.1	
エイトレッド	—		1.3		東京放送ホールディングス	79.8		64.4		アルコニックス	12.8		11.2	
AOI TYO HOLDINGS	13.1		10.7		日本テレビホールディングス	110.5		88.3		神戸物産	18.3		36.6	
マクロミル	21.3		18.9		朝日放送グループホールディングス	12.1		10.5		あいホールディングス	17.2		15.2	
ビーブリー	2.3		2		テレビ朝日ホールディングス	33.1		29.1		ディープイェックス	4.2		3.8	
オロ	1.1		2.8		スカパーJSATホールディングス	92		69.6		ダイワホールディングス	11		9.1	
テモナ	—		1.3		テレビ東京ホールディングス	9.9		8.7		マクニコ・富士エレクトロニクス	33.5		25.3	
ニーズウェル	—		1.2		日本BS放送	4.2		3.6		ラクト・ジャパン	2.7		4	
サインポスト	—		1.6		ビジョン	3.8		9.9		バスターエクスプレスホールディングス	22.9		20	
ソルクシーズ	5.1		4.5		スマートパリュウ	—		3.1		八洲電機	9.5		8.3	
フェイス	4.2		3.8		USEN-NEXT HOLDINGS	4.6		4		メディアスホールディングス	6.7		6	
プロトコーポレーション	—		9.5		ワイヤレスゲート	5.3		5		レスタールホールディングス	7.7		11.1	
ハイマックス	1.5		1.2		コネクシオ	8.6		6		ジュテックホールディングス	2.7		2.3	
			2,365					6					2,674	

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
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
ネクステージ	18.6	15.2	16,248	京都きもの友禅	7.7	7	2,373	プレナス	13.6	11.9	23,919
ジョイフル本田	35.4	31.1	42,855	コロナワイド	40.2	35.3	78,366	ミニストップ	9	7.9	12,829
鳥貴族	4	3.5	8,925	ピーシーデポコーポレーション	16	14.1	7,896	アークス	22.7	21.7	43,638
キリンホールディングス	4.8	4.2	7,564	壱番屋	8.6	7.4	42,994	パローホールディングス	26.1	23.5	46,788
ホットランド	6.3	7.1	9,251	トップカルチャー	4.6	3.9	1,294	藤久	0.9	0.9	648
すいらーくホールディングス	112.6	119	245,616	P L A N T	2.9	2.8	1,582	ベルフ	5.9	5.2	31,824
SFPホールディングス	-	4.5	10,111	スキホールディングス	26.5	21.2	117,872	大庄	6.5	5.7	9,547
綿半ホールディングス	4.5	4	7,804	箕王堂ホールディングス	-	4.6	10,363	ファーストリテイリング	16.2	14.2	830,984
ヨシックス	2	1.7	4,807	ヴィア・ホールディングス	14.8	13.1	8,803	サンドラッグ	45.4	40	149,800
コイト・スノーマーク・ホールディングス	35.2	30.9	30,312	スクロール	18.6	16.3	5,900	サックスパーホールディングス	10.2	9	7,731
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.9	4.9	3,155	ヨンドシホールディングス	13.5	10.8	26,784	ヤマザフ	2.4	2	3,380
BEENOS	2.8	4	5,100	ファミリーマート	33.8	84.9	212,844	やまや	2.1	2.1	4,735
あさひ	10	8	10,792	木曾路	14.8	13.9	41,769	ペルーナ	29.6	22.7	14,709
日本調剤	4.3	3.3	12,490	SRSホールディングス	14.3	12.5	13,175	銀行業 (5.6%)			
コスモス薬品	5.3	4.7	117,970	千趣会	21.9	19.2	9,388	島根銀行	2.7	2.1	1,365
トーエル	5.8	5.2	4,284	タカキュー	9.2	8.6	1,599	じもとホールディングス	82.1	72.2	7,581
オンリー	2.2	1.8	1,429	ケーヨー	22.4	21.8	12,164	めぶきフィナンシャルグループ	628.6	552.6	138,702
セブ&アイ・ホールディングス	506.6	415.4	1,814,051	上新電機	14.3	12.5	28,912	東京きほしフィナンシャルグループ	16.3	14.4	18,561
薬王堂	5.2	-	-	日本瓦斯	19.6	16.8	61,236	九州フィナンシャルグループ	198.5	174.5	81,666
クワイート・レストラン・ホールディングス	32.6	28.6	67,467	ロイヤルホールディングス	21.4	18.6	44,993	ゆうちょ銀行	343.1	301.3	315,461
ツルハホールディングス	26.2	23.1	313,236	東天虹	0.8	0.8	1,017	富士第一銀行	29.2	25.4	8,458
サンマルクホールディングス	9.5	8.4	18,740	いなげや	13.6	13.2	19,892	コンコディア・フィナンシャルグループ	770.7	625.3	273,256
フェリシモ	2.7	2.3	2,288	島忠	27.3	20	65,900	西宮フィナンシャルホールディングス	77.4	72.5	53,505
トリドールホールディングス	14.9	13.2	35,204	チヨダ	12.7	11.1	16,772	麗晶らいふフィナンシャルグループ	56.8	62.4	38,313
TOKYO BASE	10.7	9.6	4,992	ライフコーポレーション	9.2	8.1	22,113	十三フィナンシャルグループ	10.4	9.9	16,077
ウィルplasホールディングス	1.1	1.6	1,456	リンガーハット	14.9	13.1	32,619	舞鶴越フィナンシャルグループ	21	18.5	50,412
JMホールディングス	4.6	5.4	12,630	MrMa x HD	16.6	14.6	6,978	新生銀行	88.8	78	134,862
サツドラホールディングス	2	1.5	2,820	テアライド	11.5	9.8	4,380	あおぞら銀行	67.5	63.3	196,230
デファクトスタンダード	0.7	-	-	AOKIホールディングス	24.2	21.2	22,493	三井住友フィナンシャルグループ	8,428.8	7,320.8	4,241,671
アレンザホールディングス	6.5	5.3	5,353	オークワ	17.2	16.6	25,564	りそなホールディングス	1,328	1,167	544,288
豊川田中ホールディングス	-	1.6	3,780	コメリ	18.7	16.4	39,064	三井住友トラスト・ホールディングス	237.9	201	823,899
パロクジャパンリミテッド	9.7	7.3	7,248	青山商事	21.1	21.9	30,922	三井住友フィナンシャルグループ	853	735.5	2,908,167
グスリのアオキホールディングス	12	9.5	66,690	しまむら	14.1	12.3	101,967	千葉銀行	428.7	365.7	228,522
力の源ホールディングス	3.4	4.8	4,944	はせがわ	6.1	5.3	2,120	群馬銀行	242	209	76,494
スノーグローバルホールディングス	13.3	11.6	113,680	高島屋	94.7	77.4	93,499	武蔵野銀行	18	18	27,792
LIXILビバ	10.2	10.5	23,425	松屋	24.3	21.4	16,692	千葉興業銀行	33	29.2	10,482
メディアカルシステムネットワーク	12.9	10.3	5,191	イチ・ツー・オー リテイリング	62.1	50.3	50,853	筑波銀行	50.4	44.4	9,590
はるやまホールディングス	5.5	4.5	3,955	近鉄百貨店	4.7	4	14,440	七十七銀行	17.9	35.9	60,778
ノジマ	21.6	18.9	43,791	パルコ	11.7	10.2	18,849	青森銀行	34.9	8.3	22,858
カッパ・クリエイティブ	16.9	14.9	22,156	丸井グループ	102.3	97.3	232,255	秋田銀行	7.7	6.8	13,878
ライトオン	10.2	8	4,792	アフリアル リテイリング	10	8.8	34,056	山形銀行	13.7	11.9	17,695
ジーンズメイト	3.7	3.4	1,016	井筒屋	6.4	5.8	1,421	岩手銀行	8.5	6.9	18,126
良品計画	17.1	14.1	263,952	イオン	465.1	408.7	958,197	東邦銀行	108.2	95.1	24,250
三城ホールディングス	15.1	11.5	3,967	イズミ	24.5	21.6	77,112	東北銀行	6.3	5.1	5,293
アドヴァン	18.6	16.2	20,930	平和堂	24.5	21.5	42,462	みちのく銀行	7.7	6.8	9,676
アルビス	4.6	4	8,936	フジ	14.6	12.9	24,355	ふくおかフィナンシャルグループ	98.3	89.5	178,821
コナカ	15.7	12.5	5,100	ヤオコー	13.8	12	69,720	静岡銀行	304.5	263.3	207,480
ハウス オブ ローゼ	1.5	1.3	2,204	ゼビオホールディングス	14.6	12.9	15,531	十六銀行	16.2	13.4	30,337
G-7ホールディングス	3.5	6.2	15,276	ケーズホールディングス	125.5	102.5	144,627	スルガ銀行	123.7	108.8	47,219
イオン北海道	12.3	10.7	8,923	Olympicグループ	7.1	5.5	3,371	八十二銀行	218.9	256.7	110,381
コジマ	17.7	18.3	9,497	日産東京販売ホールディングス	18.2	15.9	4,436	山梨中央銀行	15	12.3	12,915
ヒマラヤ	3.9	3.5	2,901	Genky DrugStores	4.7	5.2	10,634	大垣共立銀行	19.1	21	48,384
コーナン商事	15.9	15.1	37,463	ナルミヤ・インターナショナル	-	1.8	2,201	福井銀行	10.3	9.1	15,233
エコス	4.5	3.9	6,704	総合メディカルホールディングス	10.5	9.3	23,696	北國銀行	12.9	10.9	34,662
ワタミ	15.9	12.5	16,162	フクオクグループホールディングス	6.4	6.2	6,237	清水銀行	5	4.4	9,332
マルシェ	3.3	2.9	2,273	アインホールディングス	16.2	13.1	91,700	富士銀行	2.3	2	4,382
バルクオウ・リテーナ・ホールディングス	72.5	233.4	470,067	元氣寿司	3.4	2.7	8,410	滋賀銀行	24.2	21.3	57,211
西松屋チェーン	26.5	23.3	22,694	ヤマダ電機	368	323.6	189,953	南都銀行	14.2	17.6	46,622
センショーホールディングス	57	50.9	122,770	アークランドサカモト	20.5	16.6	20,484	百五銀行	108.8	95.7	32,155
幸楽苑ホールディングス	7.6	6.7	13,004	ニトリホールディングス	52.4	46	809,600	京都銀行	43.4	38	173,470
ハウズレイ	2.7	2	2,494	グルメリクス	8.8	7.5	9,067	紀陽銀行	42.9	37.6	61,250
サイゼリヤ	19.9	17.5	44,135	愛眼	9.7	8.3	2,116	ほくほくフィナンシャルグループ	80.6	70.7	75,861
VTホールディングス	41	44.1	19,977	ケーユーホールディングス	6.2	5.5	5,109	広島銀行	178.5	157.1	85,148
魚カ	3.4	3	4,821	吉野家ホールディングス	42.3	34.9	89,972	山陰合同銀行	71.8	63	39,627
ポプラ	3.1	2.8	1,430	松屋フーズホールディングス	5.8	5.1	24,505	中国銀行	78.1	91.5	93,970
フジ・コーポレーション	2.5	2.9	6,148	サガミホールディングス	16.2	14.2	19,894	鳥取銀行	4.3	3.7	4,876
ユナイテッドアローズ	13.9	11.1	31,956	関西スーパーマーケット	9.2	8.9	9,238	伊予銀行	160.3	151.7	87,379
ハイデイ日高	15.9	15.3	31,043	王将フードサービス	8.9	7.8	51,324	百十四銀行	12.9	11.3	23,345

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	価 額	株	数	評 価 額		株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数
新日本科学	千株	15.9	11.2	7,033	千株	1.3	千株	1	4,255	東祥	千株	7.2	6.4	13,836						
ツツイ	27.6	24.3	14,045	テクノ/プロ・ホールディングス	23.6	20.7	160,425	エイチ・アイ・エス	20.9	16	42,672									
キャリアデザインセンター	3	2.7	3,310	アトラ	2.3	2.3	731	ラックランド	2.3	2.1	4,653									
ベネフィット・ワン	16.2	28.2	56,823	インターワークス	2.3	1.9	1,035	共立メンテナンス	17.8	17	77,860									
エムスリー	246.9	227.1	717,636	アイ・アール・ホールディングス	3.8	4.2	25,620	イネンホールディングス	12.3	11.5	17,342									
ツカガ・グローバルホールディング	7.5	6.7	3,906	KeepPer 技研	3.9	3.9	4,917	建設技術研究所	8	7.1	17,366									
プラス	0.8	0.8	642	ファーストロジック	2.3	2.3	1,389	スペース	7.6	6.7	8,220									
アウトソーシング	61.8	59	58,705	三機サービズ	1.9	2.1	2,230	長 大	4.7	3.8	4,742									
ウェルネット	11.9	9.8	6,967	Gunosy	7.2	7.1	8,889	燦ホールディングス	2.6	4.5	7,650									
ワールドホールディングス	3.2	3.5	5,992	デザインワン・ジャパン	2.3	2	612	スバル興業	0.7	0.6	5,682									
ディー・エヌ・エー	63.2	50.5	77,416	イー・ガーディアン	5.5	5.2	10,826	東京テアトル	4.6	4.1	5,629									
博報堂DYホールディングス	16.3	143.3	230,283	リブセンス	6.3	6.7	1,943	タナベ経営	2.3	1.9	2,447									
ぐるなび	16.6	18	15,588	ジャパンマテリアル	32.1	31.7	51,956	ナガワ	3.3	3.3	22,968									
タカミヤ	12.2	11	6,743	ベクトル	14.3	12.9	15,763	よみうりランド	2.6	2.2	9,779									
ジャパンバスストレスキョウシテム	9.3	6.9	6,575	ウチヤマホールディングス	5.9	5.2	2,631	東京都競馬	7.6	6.7	21,105									
ファンコミュニケーションズ	32.2	28.4	13,546	チャーム・ケア・コーポレーション	-	7.5	6,787	常盤興産	4.8	4.2	7,123									
ライク	4.6	4.1	8,019	ライクキッズ	2.5	2.4	2,056	カナモト	17.4	16.8	47,107									
ビジネス・ブレークスルー	4.9	4.4	1,760	キャリアリンク	4.3	3.4	1,989	東京ドーム	43.8	41.8	43,555									
エスプール	-	19.9	16,954	I B J	7.8	7	8,890	西尾レントオール	12	10.5	31,657									
WDBホールディングス	5.3	4.7	12,925	Aサンテ	4.7	4.2	8,211	アソナ・ホスピタリティ・グループ	63	69	2,139									
ティア	5.4	6.1	3,684	N・フィールド	7.5	7.1	4,409	トランス・コスモス	13	9.8	28,586									
CDG	1	1.1	1,548	パリュウHR	2.5	2	6,080	乃村工藝社	27.3	44.2	57,902									
パリュウコマース	7.8	5.8	15,549	M&Aキャピタルパートナーズ	3	7.3	28,141	藤田観光	4.7	4.5	12,325									
インフォーマート	64.3	112.9	99,803	ライドオクエアスペースホールディングス	4.8	3.9	7,335	KNT-CTホールディングス	6.3	6.4	8,499									
J Pホールディングス	33.5	32.4	10,335	ERIホールディングス	3.3	3	2,391	日本管財	12.6	11	21,307									
Eコナックホールディングス	22.2	18.8	2,838	アビスト	1.9	1.6	4,214	トーカイ	11.3	10	28,110									
E P Sホールディングス	17.6	15.5	21,002	シグマクシス	5.5	7	12,964	白洋舎	1.3	1.1	3,098									
レックス	2.9	2.5	3,937	ウィルグループ	7.5	6.7	7,376	セコム	124.4	109.3	1,066,002									
プラスター・インターナショナル	2.2	38.6	39,951	エスコロー・エージェンシー・ジャパン	16.1	14.5	3,175	セントラル警備保障	5.6	5	29,800									
アミューズ	7.1	5.6	15,870	日本ビューホテル	3.8	-	-	丹青社	22.2	19.5	24,960									
ドリームインキュベータ	3.5	3.2	5,635	リクルートホールディングス	839.9	738	3,335,760	メイテック	14.8	12.7	79,756									
クイック	7.2	6.4	9,516	エラン	8	6.1	10,553	応用地質	12.6	11.1	15,784									
T A C	6.8	6.7	1,413	土木管理総合試験所	5.1	4.5	1,917	船井総研ホールディングス	24.3	21.3	68,905									
ケネディクス	103	98	57,036	ネットマーケティング	-	3.8	3,792	進学会ホールディングス	5.2	4.1	2,099									
電通グループ	142.9	106.2	388,692	日本郵政	961.1	844.5	870,257	オオバ	9.3	8.1	6,285									
ティファンドギザ・ニーズ	4.5	4	4,084	ベルシテム24ホールディングス	19.6	17.2	27,124	いであ	2.3	1.9	4,081									
びあ	3.3	2.9	13,006	鎌倉新書	8.6	7.6	13,026	学究社	4	3.1	4,532									
イオンファンタジー	3.8	4	9,696	SMN	-	1.6	1,408	ベネッセホールディングス	43	34.3	107,016									
シーティーエス	13.3	11.6	8,096	一蔵	1.5	1.1	759	イオンテイライト	14.3	12.7	48,895									
ネクシイズグループ	3.7	3.6	5,770	L I T A L I C O	2.7	3.6	10,090	ナック	7.4	5.7	6,526									
みらかホールディングス	32.9	28.9	87,422	グローバルキッズCOMPANY	1.4	1.5	1,191	ニチ学館	16.7	14.7	22,402									
アルプス技研	10.2	9.1	19,383	エアトリ	3.3	4.6	7,433	ダイセキ	19.6	17.2	51,600									
サニックス	20.5	18.1	5,792	アトラエ	2.3	2.7	10,233	ステップ	4.4	3.8	6,456									
ダイオーズ	2.8	2	2,758	ストライク	3	3.9	20,358													
日本空調サービス	13.4	10.8	8,121	ソラスト	28.5	28.4	32,972	株数・金額	142,571.8	127,662.7	263,153,477									
オリエンタルランド	138.6	109.5	1,605,270	セラク	2.6	3.3	4,217	銘柄数<比率>	2,113銘柄	2,151銘柄	<97.6%>									
ダスキン	31.6	26.4	80,784	インソース	3.9	5	16,325													
明光ネットワークジャパン	14.8	12.1	11,567	ベイカレント・コンサルティング	6.2	6.2	51,398	(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評												
ファルコホールディングス	6.5	5.7	12,323	Orchestra Holdings	-	2	2,392	価総額に対する各業種の比率です。												
秀英予備校	2.5	2.3	1,051	アイモバイル	2.8	3.3	2,293	(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に												
田谷	2.1	2	1,272	キャリアインデックス	4	4.2	1,575	対する評価額の比率です。												
ラウンドワン	36.3	28.8	30,441	MS-Japan	4.7	3.4	4,399	(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。												
リゾートトラスト	49.6	47.2	83,449	船場	2.1	1.7	1,762													
ビー・エム・エル	15.1	13.3	42,227	グレイステクノロジー	3.2	4.7	14,476													
ワタベウエディング	1.9	1.6	864	ジャパネットホリデーホールディングス	6.9	10.8	26,470													
りらこコミュニケーションズ	21.2	18.7	27,788	フルテック	1.3	1.2	1,422													
リソー教育	59.5	47.1	17,662	グリーンズ	2.6	3.9	3,634													
早稲田アカデミー	1.6	3.4	3,678	ツガグループ・ホールディングス	1	1.2	882													
ユー・エス・エス	143.3	115.4	231,492	GAMEWI TH	-	2.2	1,630													
東京個別指導学院	4.2	3.7	2,641	ソウルダアウト	-	1.6	3,478													
サイバーエージェント	72.3	59.3	259,437	MS&Consulting	-	1.4	1,568													
楽天	546.6	480.2	419,694	日総工産	2.9	6.8	5,718													
グリーク・アンド・リパブリ	6.8	5.3	5,575	キューベネットホールディングス	5.9	4.3	10,311													
デー・オー・ダブリュー	11.2	9	8,361	RPAホールディングス	-	5.8	6,119													
山田コンサルティンクグループ	-	5	7,390	スプリックス	3.3	3.5	3,941													
セントラルスポーツ	4.4	3.9	11,973	マネジメントソリューションズ	-	1.1	3,982													
フルキャストホールディングス	11.8	10.3	25,544	アドバテックシステムズ	4.6	5.2	4,680													
エン・ジャパン	12.8	18.4	85,560	リログループ	64.1	56.3	171,996													

(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 6,514		百万円 -

■投資信託財産の構成

2020年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 263,153,477		% 95.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,850,991		4.3
投 資 信 託 財 産 総 額	275,004,469		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

(2020年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	275,805,961,791円
コ ー ル ・ ー ン	11,473,389,265
株 式(評価額)	263,153,477,450
未 収 入 金	140,926,920
差 入 収 配 入 当 金	415,029,156
入 委 託 証 拠 金	623,139,000
(B) 負 債	6,045,704,260
未 払 金	5,048,362,260
差 入 委 託 証 拠 金	193,592,000
入 委 託 証 拠 金 代 用 約 有 価 証 券	803,750,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	269,760,257,531
元 本	98,370,254,055
次 期 繰 越 損 益	171,390,003,476
(D) 受 益 権 総 額	98,370,254,055円
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	27,423円

(注1) 期首元本額	115,232,523,115円
追加設定元本額	39,816,140,869円
一部解約元本額	56,678,409,929円
(注2) 期末における元本の内訳	
One DC 国内株式インデックスファンド	13,753,125,332円
D I AM国内株式パッシブ・ファンド	2,300,256,155円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,872,943円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	5,009,685円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	7,743,904円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,418,134円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	18,818,754円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	10,586,919円
たわらノーロード TOP I X	545,594,662円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	324,239,506円
たわらノーロード バランス(堅実型)	10,938,893円
たわらノーロード バランス(標準型)	67,669,431円
たわらノーロード バランス(積極型)	103,376,978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)	439,198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)	31,315,589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)	98,543,681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)	66,484,262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)	135,912,579円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	193,848円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	830,832円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,814,864円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,287,993円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,036,718円
D I AM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,349,147,451円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	994,502,045円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,256,411,336円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,366,803,245円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	348,375,776円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	1,182,324,299円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	1,119,029,562円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	38,945,261円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	1,120,067,435円
マネックス資産設計ファンド エゴリ ューション	25,180,737円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	307,430,970円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	239,536,588円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	419,353,751円
投資のソムリエ	8,729,703,223円
クルーズコントロール	410,638,853円
投資のソムリエ<DC年金>	829,749,325円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	261,682,155円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	316,105,471円
クルーズコントロール<DC年金>	412,795円
D I AMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,507,282円
D I AMコア資産設計ファンド(積極型)	7,001,423円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	474,307,956円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,017,761,432円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	5,883,416円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,725,965円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,914,158円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	13,386,629円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	35,525,818円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,093,711,974円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	217,750,260円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	900,539円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	766,807円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	889,213円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	197,398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)	97,721,972円
D I AMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	53,537,910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)	748,659,317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)	42,276,864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)	90,882,753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)	205,217,487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)	13,081,740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)	49,099,169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)	14,085,281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)	11,090,446円
D I AM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,577,334円
D I AM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,241,538円
D I AMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	856,834,056円
D I AMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	856,427,853円
D I AMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,443,533,162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)	174,658,821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)	48,206,798円
D I AM アスク グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	469,721,881円
D I AM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家限定)	125,441,570円
D I AM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,312,004円
D I AM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	35,583,091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)	490,063,850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)	37,551,836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)	134,171,540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)	347,374,438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)	876,490,927円
D I AM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	53,451,662円
D I AM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	23,728,407円
D I AMバランス20VA(適格機関投資家限定)	13,986,618円
D I AMバランス40VA(適格機関投資家限定)	104,317円
D I AMバランス60VA(適格機関投資家限定)	121,717円
D I AM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)	380,720,505円
D I AM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)	1,210,952,937円
D I AM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)	1,605,155,025円
D I AM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)	65,047,821円
期末元本合計	98,370,254,055円
(注3) 担保資産	
代用として担保を提供している資産は次の通りです。	
株式	1,965,500,000円

■損益の状況

当期 自2019年2月8日 至2020年2月7日

項	目	当	期
(A) 配	当 等 収 益	6,474,619,048円	
受	取 配 当 金	6,470,932,929	
そ	の 他 収 益	6,596,035	
支	払 利 息	△2,909,916	
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	25,090,512,011	
売	買 益	37,376,506,942	
売	買 損	△12,285,994,931	
(C) 先	物 取 引 等 取 引 損 益	549,897,040	
取	引 益	1,316,074,846	
取	引 損	△766,177,806	
(D) 当	期 損 益 金(A + B + C)	32,115,028,099	
(E) 前	期 繰 越 損 益 金	163,951,791,282	
(F) 解	約 差 損 益 金	△85,804,876,036	
(G) 追	加 信 託 差 損 益 金	61,128,060,131	
(H) 合	計(D + E + F + G)	171,390,003,476	
次	期 繰 越 損 益 金(H)	171,390,003,476	

(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。