

運用報告書 (全体版)

第13期<決算日2021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、2021年10月12日に第13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)	税金込み	騰落率	(配当込み)	騰落率			
	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
13期(2021年10月12日)	30,559	0	22.8	3,158.44	23.2	97.0	3.0	16,499

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

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(㈩東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、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				
(期首) 2020年10月12日	円	%	ポイント	%	%	%
	24,889	-	2,564.00	-	97.5	2.5
10月末	23,915	△3.9	2,464.21	△3.9	96.8	2.8
11月末	26,572	6.8	2,738.72	6.8	97.0	3.2
12月末	27,348	9.9	2,819.93	10.0	97.1	2.7
2021年1月末	27,401	10.1	2,826.50	10.2	97.6	2.4
2月末	28,253	13.5	2,914.58	13.7	99.0	1.1
3月末	29,856	20.0	3,080.87	20.2	96.2	4.0
4月末	29,005	16.5	2,993.46	16.7	96.5	3.5
5月末	29,395	18.1	3,034.76	18.4	96.6	3.4
6月末	29,734	19.5	3,070.81	19.8	96.0	4.0
7月末	29,082	16.8	3,003.91	17.2	97.2	2.8
8月末	29,993	20.5	3,099.08	20.9	97.1	2.9
9月末	31,297	25.7	3,234.08	26.1	96.3	3.8
(期末) 2021年10月12日	30,559	22.8	3,158.44	23.2	97.0	3.0

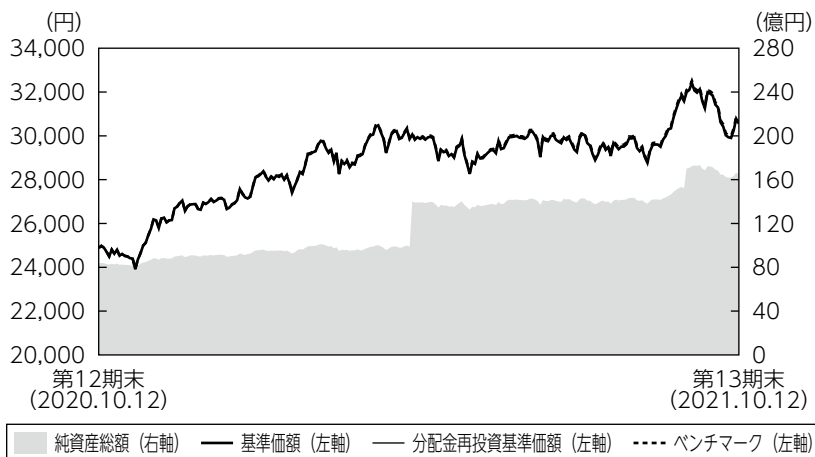
(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

基準価額等の推移



第13期首： 24,889円
第13期末： 30,559円
(既払分配金0円)
騰落率： 22.8%
(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、世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスのワクチン開発、ワクチン接種進展による経済正常化への期待などを要因として上昇したことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

期初は下落して始まりましたが、2020年11月から2021年3月半ばまでは世界的な低金利継続や新型コロナウイルスのワクチン開発期待などを受けて続伸しました。その後は、新型コロナウイルスの感染状況、ワクチン接種の進捗、米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月から期末にかけては、菅首相の退陣と共に上昇した後、岸田新首相の政策不安や米国の金利上昇などを要因として下落しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの組入比率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	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



期末

（単位：％）

No.	業種	組入比率
1	電気機器	17.7
2	情報・通信業	8.2
3	輸送用機器	7.7
4	化学	6.8
5	サービス業	5.9
6	機械	5.1
7	銀行業	5.0
8	医薬品	4.9
9	卸売業	4.8
10	小売業	4.2

○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	3.3
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



期末

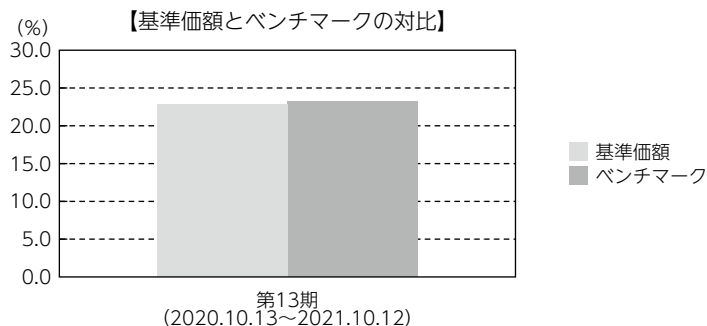
（単位：％）

No.	銘柄名	組入比率
1	トヨタ自動車	3.6
2	ソニーグループ	2.8
3	キーエンス	2.3
4	ソフトバンクグループ	1.7
5	リクルートホールディングス	1.7
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.6
7	日本電信電話	1.3
8	信越化学工業	1.2
9	HOYA	1.2
10	日立製作所	1.1

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23.2%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.4%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
	2020年10月13日 ～2021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	20,558円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

引き続き、ベンチマークのリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築します。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第13期		項目の概要
	(2020年10月13日 ～2021年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	79円	0.275%	(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28,781円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(63)	(0.220)	
(販売会社)	(6)	(0.022)	
(受託会社)	(9)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	1	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) その他費用 (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	80	0.278	

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

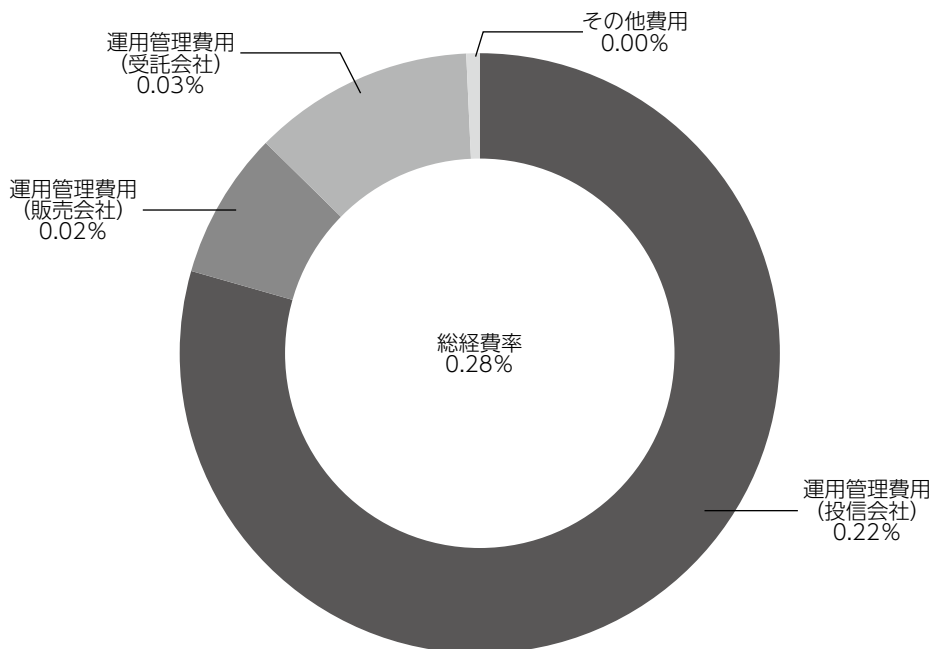
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.28%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年10月13日から2021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	2,262,491	7,295,697	373,525	1,152,580

■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	566,365,897千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	322,384,030千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.75

(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（2020年10月13日から2021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)	230千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	4千円
(B)／(A)	2.1%

(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 318,180	百万円 50,087	% 15.7	百万円 248,185	百万円 7,021	% 2.8

平均保有割合 3.5%

(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 2,570	百万円 1,904	百万円 3,236

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期	
	買 付 額	期 末 保 有 額
株 式		百万円 523

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	千□ 3,145,283	千□ 5,034,248	千円 16,498,743

■投資信託財産の構成

2021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	16,498,743	99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	36,875	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	16,535,619	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

(2021年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	16,535,619,344円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	21,011,972
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)	16,498,743,372
未 収 入 金	15,864,000
(B) 負 債	35,749,055
未 払 解 約 金	15,630,530
未 払 信 託 報 酬	20,004,993
そ の 他 未 払 費 用	113,532
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	16,499,870,289
元 本	5,399,416,123
次 期 繰 越 損 益 金	11,100,454,166
(D) 受 益 権 総 口 数	5,399,416,123口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	30,559円

(注) 期首における元本額は3,362,379,516円、当期中における追加設定元本額は2,521,321,530円、同解約元本額は484,284,923円です。

■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△2,297円
受 取 利 息	143
支 払 利 息	△2,440
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,835,084,557
売 買 益	1,985,459,094
売 買 損	△150,374,537
(C) 信 託 報 酬 等	△37,931,170
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,797,151,090
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	732,149,039
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,571,154,037
(配 当 等 相 当 額)	(6,214,965,294)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,356,188,743)
(G) 合 計(D+E+F)	11,100,454,166
次 期 繰 越 損 益 金(G)	11,100,454,166
追 加 信 託 差 損 益 金	8,571,154,037
(配 当 等 相 当 額)	(6,217,499,253)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,353,654,784)
分 配 準 備 積 立 金	2,529,300,129

- (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	256,459,608円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,540,691,482
(c) 収 益 調 整 金	8,571,154,037
(d) 分 配 準 備 積 立 金	732,149,039
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	11,100,454,166
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	20,558.62
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

■信託報酬率を年率0.25%（税込み0.275%）に引き下げる所要の約款変更を行いました。

(2021年1月13日)

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19期（決算日 2021年2月8日）

（計算期間 2020年2月8日～2021年2月8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19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	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落 中率			
15期 (2017年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
19期 (2021年2月8日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586

(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）。

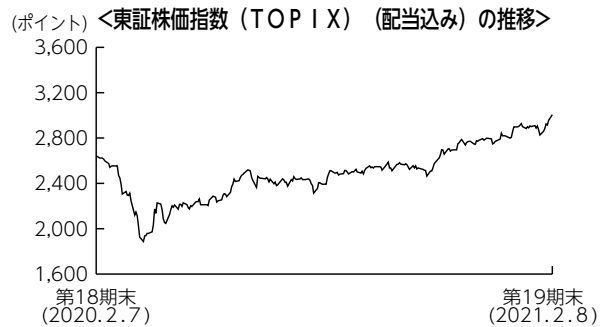
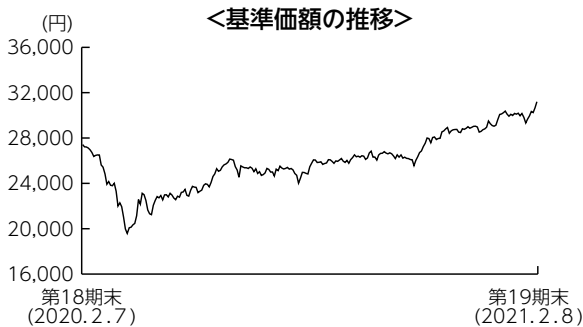
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX) (配当込み) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2020年 2月7日	27,423	% -	2,642.55	% -	97.6	2.4
2 月 末	23,926	△12.8	2,305.76	△12.7	97.8	1.9
3 月 末	22,498	△18.0	2,167.60	△18.0	100.1	3.3
4 月 末	23,470	△14.4	2,261.88	△14.4	97.1	3.0
5 月 末	25,068	△8.6	2,416.04	△8.6	92.2	2.2
6 月 末	25,027	△8.7	2,411.45	△8.7	97.4	2.6
7 月 末	24,020	△12.4	2,314.39	△12.4	98.2	1.8
8 月 末	25,983	△5.3	2,503.59	△5.3	97.8	2.4
9 月 末	26,316	△4.0	2,536.14	△4.0	96.6	3.4
10 月 末	25,569	△6.8	2,464.21	△6.7	96.8	2.8
11 月 末	28,422	3.6	2,738.72	3.6	97.0	3.2
12 月 末	29,264	6.7	2,819.93	6.7	97.1	2.7
2021年 1 月 末	29,330	7.0	2,826.50	7.0	97.6	2.4
(期 末) 2021年 2月8日	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3

(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（2020年2月8日から2021年2月8日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,202円となり、前期末比で13.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大による景気への影響が嫌気されて急落する場面もありましたが、世界各国での経済対策や金融政策、新型コロナウイルスのワクチン開発による感染収束への期待の高まりなどを要因として、基準価額は上昇しました。

投資環境

期初から2020年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への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。ただ、4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスのワクチン開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種
期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	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



期末

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

○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	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	



期末

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

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13.8%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	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)
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(25,909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 (2020年2月8日から2021年2月8日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 63,510.4 (△11,652.101)	千円 127,938,692 (-)	千株 55,403.199	千円 112,472,446

(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 71,359	百万円 71,662	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	240,411,139千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	237,278,032千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.01

(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（2020年2月8日から2021年2月8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 127,938	百万円 6,656	% 5.2	百万円 112,472	百万円 7,504	% 6.7

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,047	百万円 867	百万円 2,537

(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 250

(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)	3,691千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	207千円
(B) / (A)	5.6%

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

銘柄	期首(前期末)		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	株数	千円		株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千株
アイデンジニアリング	27.9	30.7	31,774		鶴見製作所	8.4	9.2	16,928		ブラザー工業	131.6	144.3	346,175	
滝澤鉄工所	3.3	3.9	4,102		住友精密工業	1.6	1.9	3,957		ミネベアミツミ	200.1	203.7	522,286	
F U J I	45.8	46.6	129,268		日本ギア工業	3.5	6	1,842		日立製作所	518.1	568.4	2,840,294	
牧野フライス製作所	12.4	13.7	57,677		酒井重工業	2	1.9	4,166		三菱電機	1,078.2	1,182.4	2,039,048	
オーエスジー	49.3	57.6	111,628		荏原製作所	44.6	49	185,465		富士電機	65	71.2	310,432	
ダイジェット工業	1.2	1	1,416		石井鐵工所	1.4	1.2	3,501		東洋電機製造	4.3	4.7	5,893	
旭ダイヤモロ工業	27.9	31	15,562		西島製作所	10.9	12.2	10,748		安川電機	116.1	127.3	731,975	
DMG森精機	67.4	73.9	126,960		北越工業	11.1	12.4	13,652		シフオニア テクノロジー	14	15.4	21,560	
ソディック	25.1	25.6	25,216		ダイキン工業	137.4	150.6	3,519,522		明電舎	19.8	20	48,920	
デスコ	14.5	15.9	539,805		オルガノ	3.9	3.8	24,662		オリジン	3	2.6	3,536	
日東工器	5.8	5.7	10,584		トーヨーカネツ	4.7	4.4	11,272		山洋電気	5.2	5.7	36,651	
日進工具	3.2	4.6	12,999		栗田工業	58.3	64	267,840		デンヨー	9.2	10.1	21,290	
パンチ工業	9.8	9.9	4,623		椿本チエイン	15.4	16.9	48,705		東芝テック	13.5	12.7	54,229	
富士ダイス	4.6	6.4	4,256		大同工業	5.2	4.6	3,666		芝浦メカトロニクス	1.9	2.1	10,122	
豊和工業	5.9	6.5	5,772		木村化工機	9	9.8	6,076		マブチモーター	29.9	32.7	156,142	
OK K	4.4	4.8	2,256		アネスト岩田	16.7	20	22,360		日本電産	129.7	284.6	4,044,166	
石川製作所	2.5	3	5,295		ダイフク	55.1	65.1	725,865		ユウ・ユキ・シマ・エレクトロニクス	6.5	7	4,137	
東洋機械金属	7.5	8.4	3,981		サムコ	3	2.9	10,643		トレスラフ・セミコンダクター	6.2	6.4	9,401	
津田駒工業	2	2.4	2,229		加藤製作所	5.9	6.4	6,412		東光高岳	6	6	9,564	
エンシュウ	2.5	2.4	2,174		油研工業	1.7	1.7	2,808		ダブル・スコープ	16.7	23.2	23,014	
島精機製作所	17.1	17.1	39,398		タダノ	52	57	57,342		宮越ホールディングス	4	4.4	3,445	
オプトラン	11.9	14.6	38,441		フジテック	39.2	40.8	103,224		ダイヘン	11.8	12.9	64,113	
NCホールディングス	3.3	3.1	2,011		C K D	30	27.4	65,677		ヤーマン	15.6	19.3	36,477	
イワキ	5.1	7.6	6,429		キトー	8.2	10	15,000		J V Cケンウッド	88	101.9	20,991	
フリュー	10.4	11.5	13,259		平和	30.1	32.9	52,113		ミキエンジニアリング	9.6	11	5,995	
ヤマシンフィルタ	23.2	23.5	19,928		理想科学工業	9.5	9.2	13,606		イー P E X	4	5.5	12,325	
日阪製作所	13.2	14.8	12,742		S A N K Y O	24	28	85,120		日新電機	25.3	27.7	36,010	
やまびこ	20.7	22.6	30,668		日本金銭機械	11.9	13.2	7,260		大崎電気工業	21.4	23.4	14,578	
平田機工	5	5.5	45,650		マースグループホールディングス	6.8	7.6	12,046		オムロン	96.7	98.4	954,480	
ベガサスミシヨ製造	10.7	12.2	5,014		フクシマガリレイ	6.6	8.1	36,652		日東工業	15.8	17.3	37,108	
マルエ	4.4	4.3	5,594		オーイズミ	4.6	5.1	2,136		I D E C	15.6	15.9	29,605	
タツモ	5	4.9	7,609		ダイコク電機	5	5.6	5,230		正興電機製作所	2.5	2.7	6,280	
ナプテスコ	62.8	68.9	337,265		竹内製作所	18.1	19.7	50,766		不二電機工業	1.2	2.3	2,983	
三井海洋開発	11.3	12.4	25,940		アmano	28.3	31	79,236		ジエス・ユア コーポレーション	36	42.4	146,068	
レオン自動車	10.5	11.4	14,113		J U K I	15	16.5	11,187		サクサホールディングス	2.5	2.8	3,984	
S M C	33.9	34.6	2,244,156		蛇谷ホールディングス	14.2	16.5	7,326		メルコホールディングス	3.8	4.1	15,785	
パワエターロフイグスターリングス	9.3	-	-		乾の目シシ工業	10.1	10.6	9,423		テクノメディアカ	2.4	2.8	4,536	
ホソカワミクロン	3.8	4.1	25,625		マックス	16.4	16.3	26,748		ダイモトドレックリソグラフィホールディングス	1.7	3.4	6,344	
ユニオンツール	4	4.4	15,180		グロリー	27.6	30.4	70,041		日本電気	130.9	150.2	949,264	
オイレ工業	13.8	16.5	28,726		新晃工業	10	11	21,417		富士通	103.9	106.4	1,710,380	
日精工・エス・ピー機械	3.6	3.4	20,604		大和冷機工業	15.6	19	21,584		沖電気工業	43.9	47.9	53,456	
サトールディングス	15.2	15.4	36,867		セガサミーホールディングス	107	107.5	184,470		若崎通信機	4.8	4.4	3,872	
技研製作所	9.4	10.3	52,530		日本ピストンリング	4	4.5	4,603		電気興業	5.2	5.7	16,569	
日本エアテック	3.4	3.8	5,688		リケン	5	5.5	12,375		サンケン電気	11.7	13.8	61,341	
カワタ	3.2	3.2	3,088		T P R	14.5	16	25,248		ナカヨ	1.9	1.9	2,850	
日精樹脂工業	9	9.2	8,675		ツバキ・ナカシマ	22	22.5	29,970		アイホン	6.1	6.8	12,124	
オカダアイオン	3.4	3.8	4,468		ホシザキ	31.5	37.2	398,040		ルネサスエレクトロニクス	514.9	508.7	611,966	
ワイエイシホールディングス	4.6	4.6	4,779		大豊工業	8.9	9.8	7,712		セイコーエプソン	133.8	146.6	273,115	
小松製作所	488.3	535.7	1,654,241		日本精工	203	242.6	254,972		ワコム	72.4	85.5	76,180	
住友重機械工業	61.7	67.6	213,278		NTN	249.6	272.6	84,506		アルバック	19.8	21.8	107,365	
日立建機	43.1	55.3	166,453		ジェイテクト	103.4	113.3	128,029		アクセル	4.5	4.9	3,748	
日工	14.8	17.6	13,217		不二越	10	11	48,235		E I Z O	8.4	10	38,250	
巴工業	4.6	4.8	9,936		日本トムソン	31.9	32.2	16,357		ジャパンディスプレイ	31.2	40.4	20,604	
井関農機	10.8	11.8	17,405		T H K	62.7	73.7	261,266		日本信号	27.4	27.6	27,048	
T O W A	10.9	11	22,066		ユーション精機	8.4	7.9	7,884		京三製作所	25.2	25.4	11,125	
丸山製作所	2.2	2.4	3,955		前澤給装工業	3.9	4.2	9,256		能美防災	14.3	15.7	36,816	
北川鉄工所	4.8	5.5	7,936		イーグル工業	13.3	14.7	17,772		ホーチキ	7.9	8.6	11,266	
ローツェ	4.7	5.2	40,352		前澤工業	7.1	7.3	4,358		星和電機	5.4	5.9	4,271	
タカキタ	3.7	4.3	3,074		日本ビラー工業	10.9	12.1	22,155		エレコム	11.7	13.5	68,445	
クボタ	572.1	621.2	1,568,530		キッツ	43.8	36.6	22,582		パナソニック	1,231.9	1,260.9	1,827,044	
荏原実業	2.7	2.9	11,861		マキタ	140.6	154.2	766,374		シャープ	124.7	136.8	306,568	
三菱化工機	3.8	3.7	11,340		日立造船	85.6	93.7	61,092		アンリツ	69.5	71	178,636	
月島機械	19.9	21.8	30,498		三菱重工業	180.7	185.7	590,154		富士通ゼネラル	29.3	36.2	115,840	
帝国電機製作所	8.9	8.3	10,557		I H I	77.6	79.5	166,791		ソニー	681.6	740.6	8,955,557	
東京機械製作所	4.7	4.3	1,345		スター精密	16.6	18.2	30,266		T D K	52	57.1	903,893	
新東工業	25.5	28.2	22,334		電気機器 (18.0%)					帝国通信工業	4.7	5.6	6,294	
瀬谷工業	9.4	10.4	37,024		日清紡ホールディングス	71.8	72	62,712		タムラ製作所	3.6	42.3	23,688	
アイチコーポレーション	18.7	20.5	19,249		イビデン	66	56.8	276,900		アルプスアルパイン	95.5	96.5	143,688	
小森コーポレーション	27.3	30.1	21,792		コニカミノルタ	235.6	239.4	131,430		池上通信機	3.5	4	3,468	

銘柄	前首(前期末)		当期		銘柄	前首(前期末)		当期		銘柄	前首(前期末)		当期	
	株	数	株	数		株	数	株	数		株	数	株	数
		千株		千円			千株		千円			千株		千円
プロネクサス		9.3	10.3	12,030	鴻池運輸	17.1	19	20,805	クロスキャット	2.8	3	3,690		
ホクシン		7.2	8.5	994	西日本鉄道	29.9	32.8	97,088	システナ	37.7	41.4	83,172		
ウッドワン		3.5	3.4	3,733	ハマコヨウレックス	8.3	9.1	30,667	デジタルアーツ	5.2	6.8	70,040		
大建工業		7.2	8	14,808	サイカイ越センター	5.7	5.5	29,095	日鉄ソリューションズ	15.9	17.3	60,896		
凸版印刷	152.2	179.6	290,952	近鉄グループホールディングス	102.1	111.9	536,001	キューブシステム	5.6	6.2	7,303			
大日本印刷	141.1	142.8	286,456	阪急阪神ホールディングス	136.2	149.3	555,396	エイジア	1.9	1.8	3,319			
共同印刷	3.4	3.7	13,597	南海電気鉄道	48.4	53.1	144,697	コア	4.5	4.9	7,599			
N I S S H A	22.1	24.3	35,235	京阪ホールディングス	45.5	49.9	257,983	ラクーンホールディングス	5.1	8.2	16,334			
光村印刷	0.9	0.8	1,436	神戸電鉄	2.4	2.8	10,500	ソリトンシステムズ	4.6	5.8	10,242			
TAKARA & COMPANY	5.2	5.8	10,440	名古屋鉄道	83.9	92.1	261,379	ソフトクリエホールディングス	4.6	4.5	12,123			
アシックス	89	104.6	204,702	山陽電気鉄道	7.3	8.1	17,074	T I S	35.3	116	283,272			
ツツミ	3.4	3	5,739	日本通運	36.1	38.8	299,536	JNSホールディングス	4.3	5.5	3,151			
ローランド	-	6.9	27,117	ヤマトホールディングス	179	157	449,962	電算システム	4.1	4.3	13,029			
小松ウオール工業	3.4	3.7	6,645	山九	28.4	28.7	128,289	グリー	64.9	71.1	43,726			
ヤマハ	64.2	70.3	447,108	丸連	5.9	7.6	1,968	GMOベバポ	-	0.8	4,624			
河合楽器製作所	3.4	3.3	10,065	丸全昭和運輸	8.3	9.1	32,396	コーエテクモホールディングス	21.6	23.7	149,073			
クリナップ	10.1	11.4	5,814	セコウグループホールディングス	56.3	61.9	62,828	三菱総合研究所	4.6	5	20,975			
ビジョン	65.2	75.9	340,411	トナミホールディングス	2.4	2.3	13,501	ボルテージ	1.9	2.8	1,512			
オリバー	2.2	2.4	6,345	ニコッホールディングス	36.5	37.6	85,540	電算	1.2	1	2,539			
兼松サステック	0.7	0.6	1,057	日本石油輸送	1.1	0.9	2,394	AGS	5.9	6.1	5,105			
キングジム	9	10.2	9,169	福山通運	13.1	14.4	65,232	フラインドックス	9	9.7	10,864			
リンテック	25.6	25.4	61,366	セイノールホールディングス	76.5	83.9	128,702	ブレインパッド	2.1	2.9	12,397			
イトーキ	22.9	23.3	8,108	エスライン	3.1	3	2,709	K L a b	20.4	21.2	20,966			
任天堂	66.1	67.7	4,295,565	神奈川中央交通	2.5	2.5	9,825	データクイン・ビートルホールディングス	12.7	15.4	18,587			
三菱鉛筆	17.7	19.5	27,865	日立物流	18.8	24.7	84,721	イブクワイニシアジブジャパン	1.5	1.9	4,727			
タカラスタンダード	22.2	24.5	40,400	丸和運輸機関	10.8	23.6	50,409	ネクソン	301.2	293.1	1,017,057			
ココヨ	51.7	56.6	82,239	C&Fジョホールディングス	10.3	11.4	23,210	アイスタイル	27.3	35.3	16,696			
ナカバヤシ	10.7	12.1	7,562	九州旅客鉄道	91.1	86.4	220,665	エムアールホールディングス	3.1	3	7,266			
グローバルライド	4.8	5.7	24,367	S Gホールディングス	107.2	211.7	544,492	エイチーム	7.2	8	9,792			
オカムラ	37.6	45.4	49,440	海運業 (0.2%)				エニジモ	7.5	10.9	14,137			
美津濃	9.8	11.7	27,144	日本郵船	85.4	93.6	276,120	テクノスジャパン	8.3	8.9	6,363			
電気・ガス業 (1.3%)				商船三井	64.6	66.4	204,844	e n i s h	4.7	5.9	2,979			
東京電力ホールディングス	860.8	1,002.3	407,936	川崎汽船	31.4	34.5	67,930	コロプラ	34.7	38	35,986			
中部電力	330	361.8	488,249	NSユニテッド海運	5.6	5.4	8,456	オルトプラス	7.9	6.8	2,944			
関西電力	408.6	448	479,360	明治海運	10.2	12.3	5,043	ブロードリーフ	52.5	57.4	37,424			
中国電力	149.1	170.7	223,787	飯野海運	48.1	52.4	22,741	クロス・マーケティンググループ	4.9	5.4	2,143			
北陸電力	98.6	108.1	75,886	共栄タンカー	1.8	2.2	2,085	デジタルハーツホールディングス	5.6	5.3	6,990			
東北電力	269.6	276.8	259,361	乾汽船	5.9	5.9	5,846	システム情報	5.4	8.5	10,081			
四国電力	97.2	98.2	74,533	空運業 (0.4%)				メディアアドヴ	3.4	4.4	27,236			
九州電力	222.3	261	246,123	日本航空	183.8	272.7	606,212	じげん	26.2	28.2	11,928			
北海道電力	101	110.3	51,841	ANAホールディングス	186.6	302.1	721,565	アイキューブ	6.5	6.3	19,246			
沖縄電力	20	23	33,281	パスコ	1.9	2.2	3,416	エンカレッジ・テクノロジ	1.7	2.2	1,471			
電源開発	85.9	94	164,970	倉庫・運輸関連業 (0.2%)				サイバーリンクス	1.6	3.8	8,208			
エフオン	5.1	7.2	8,071	トランコム	2.9	3.4	29,648	ディー・エル・イー	7.9	9.2	2,999			
イーレックス	15.3	17.3	30,396	日新	8.8	9	12,591	フィックスターズ	11.2	12.2	12,322			
レノバ	17.8	19.9	74,426	三菱倉庫	32.4	38.7	125,001	CARTA HOLDINGS	5.1	4.7	6,283			
東京瓦斯	207.5	227.3	527,676	三井倉庫ホールディングス	11.6	11.9	27,036	オプティム	2.8	8.1	26,365			
大阪瓦斯	209.3	214.1	432,053	住友倉庫	37.5	40.3	56,460	セレス	3.5	3.8	10,260			
東邦瓦斯	53	58.1	381,136	滋澤倉庫	5.6	6.3	14,565	S H I F T	2.8	5.2	67,288			
北海道瓦斯	5.8	6.6	10,791	東陽倉庫	18.5	16.8	5,796	ディーガイア	9.4	12.3	23,628			
広島ガス	22.4	25.4	9,804	日本トランスシティ	28.5	25.1	14,809	セック	1.5	1.7	4,836			
西部瓦斯	12.1	13.3	39,806	ケイヒン	1.8	1.7	2,327	日本アジアグループ	11.1	11.2	14,425			
静岡ガス	30.6	33.5	33,165	中央倉庫	6.2	6.4	7,628	豆蔵ホールディングス	7.2	-	-			
メタウォーター	5.2	13.4	30,860	川西倉庫	1.8	2.1	2,480	テックマトリックス	7.4	17.9	34,708			
陸運業 (3.6%)				安田倉庫	8.4	9.6	9,177	プロシップ	3.1	3.4	4,848			
SBSホールディングス	9.3	8.7	22,011	フアイズホールディングス	2.2	2	2,296	カホネ・オンライン・エンターテイメント	25.5	27.9	73,181			
東武鉄道	113.7	123.2	394,240	東洋埠頭	3.1	3	4,266	GMOペイメントゲートウェイ	17.4	24.6	378,594			
相鉄ホールディングス	34.5	40.5	106,393	宇徳	8.7	8.5	3,995	ザッパラス	5.6	4.6	2,093			
東急	271.9	298.1	432,245	上組	58.5	62.4	123,614	システムリサーチ	2.9	3.4	6,245			
京浜急行電鉄	138.5	151.8	268,230	サンリツ	2.3	2.3	1,649	インターネットイニシアティブ	15.6	30.9	70,050			
小田急電鉄	160.3	189.4	623,126	キムラユニティ	2.8	3.5	3,976	さくらインターネット	11.3	12.2	8,491			
京王電鉄	56	66	564,960	キューソー流通システム	2.5	2.9	4,663	ヴィンクス	3	3.2	3,843			
京成電鉄	75.1	88.6	352,628	近鉄エクスプレス	21.6	21.2	57,579	GMOグローバルサイン・ホールディングス	1.9	2.5	24,950			
富士急行	14.7	16.1	92,736	東海運	5.8	7.9	2,512	S R Aホールディングス	5.6	6.2	16,002			
新京成電鉄	2.8	3	6,873	エーアイティ	7.2	7.2	7,905	システムインテグレート	3.4	3.2	2,025			
東日本旅客鉄道	189.8	208.1	1,600,497	内外トランスライン	3.6	4.1	5,161	朝日ネット	7.5	9.4	8,262			
西日本旅客鉄道	96.1	105.3	680,448	日本コンセプト	3.3	3.7	6,397	e B A S E	6.3	13.8	14,172			
東海旅客鉄道	89.7	98.3	1,678,472	情報・通信業 (9.5%)				アバント	7.5	12.4	19,108			
西武ホールディングス	144.7	142.4	170,025	N E C ネットスアイ	10	38.3	76,408	アドソル日進	3.8	4.1	11,951			

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
		千株		千円			千株		千円			千株		千円
スターティアホールディングス		2.4		2,454	佐藤商事		8.8		9,850	スズケン		45		49.3
コマダホールディングス	23.2	25.4	50,342	菱洋エレクトロ	10.8	8.8	25,678	ジェコス	7.3	8.2	7.8	8.2	7,986	
ピーバンドットコム	-	1.5	1,426	東京産業	9.6	11	7,370	グローセル	9.4	12.9	9.4	12.9	6,566	
アセンテック	0.8	2.9	5,417	ユアサ商事	10.1	12	39,480	小売業 (4.7%)						
富士興産	3.3	3.5	4,665	神鋼商事	2.7	2.7	5,402	ローソン	26.8	29.5	26.8	29.5	158,710	
協栄産業	1.2	1.5	2,095	トルク	6.3	5.8	1,548	サンエー	8.9	8.8	8.9	8.8	37,708	
小野建	9.6	10.7	13,407	阪和興業	19.9	23.2	68,092	カワチ薬品	8.3	8.1	8.3	8.1	24,624	
南陽	2.1	2.1	3,540	正栄食品工業	6.8	7.5	29,437	イービーシー・マート	16.6	18.1	16.6	18.1	117,107	
佐島電機	7.9	7.4	5,638	カナデン	8.6	9.6	12,220	ハードオフコーポレーション	4.2	5.4	4.2	5.4	4,266	
エコトレーディング	2.3	2.6	1,799	菱電商事	7.6	8.4	13,784	アスフル	11.1	10.1	11.1	10.1	39,137	
伯東	6.5	7.1	9,201	フルサト工業	5.9	6.3	8,366	ゲオホールディングス	19.1	15.6	19.1	15.6	19,874	
コンドーテック	8.3	9.2	9,926	岩谷産業	23.6	27.9	180,234	アダストリア	14.7	16.1	14.7	16.1	34,212	
中山福	6.2	7.1	3,819	ナイス	4.6	4.7	7,764	ジーフット	6.4	7.6	6.4	7.6	3,268	
ナガイレーベン	15.4	15.5	48,205	昭光通商	3.5	3.4	2,291	シー・グレイ・エス・バイエリア	1.5	2	1.5	2	840	
三菱食品	11.6	12.9	37,474	ニチモウ	1.7	1.6	3,086	くら寿司	5.5	6.9	5.5	6.9	46,713	
松田産業	7.8	8.5	16,192	極東貿易	3.1	3	4,215	キャンドウ	5.1	5.6	5.1	5.6	10,651	
第一興商	15.8	17.3	69,373	イワキ	14	15.2	9,910	アイケイ	-	2.5	-	2.5	2,247	
メディアルホールディングス	114.6	116.7	261,174	三菱石油	26.1	28.7	32,344	バルブルーホールディングス	5.4	10.2	5.4	10.2	16,932	
S P K	2.2	5.2	6,812	稲畑産業	23.4	27.9	45,393	エディオン	48.8	49.3	48.8	49.3	53,441	
萩原電気ホールディングス	4	4.4	12,315	G S I クレオス	2.5	2.8	6,104	サウコーポレーション	21.6	23.9	21.6	23.9	14,005	
アズワン	6.9	8.3	127,820	明和産業	9.8	10.8	5,076	ワッツ	4.8	5.2	4.8	5.2	4,664	
スズデン	3.7	3.5	4,389	クワザホールディングス	3.8	4.4	2,961	ハロース	4	4.4	4	4.4	13,860	
尾家産業	3.1	3	3,978	ヤマエク野	-	8.5	9,613	フジフードグループ本社	9	9.8	9	9.8	12,828	
シモンヤ	6.5	6.5	9,145	ワキタ	22.6	22.9	23,541	あみやき亭	2.2	2.5	2.2	2.5	7,377	
ドウシヤ	10.1	11	20,680	東邦ホールディングス	34.1	37.3	77,994	ひらまつ	19.6	21.9	19.6	21.9	3,810	
小津産業	2.3	2.3	4,397	サンゲツ	29.2	31.5	52,542	大黒天物産	2.5	2.7	2.5	2.7	16,200	
高速	3.3	6.3	10,111	ミツロコグループホールディングス	15.7	17.1	21,665	ハニースホールディングス	9.4	9.1	9.4	9.1	9,236	
たけびし	6.5	3.5	5,565	シオネンホールディングス	4.4	4.3	14,061	ファーマリスホールディングス	2.5	3.3	2.5	3.3	2,577	
リックス	2.3	2.2	3,773	伊藤忠エネクス	23.5	26	26,910	アルペン	8.2	8.9	8.2	8.9	20,108	
丸文	9.4	10.6	5,989	サンリオー	29.8	32.6	55,452	ハブ	3.1	3.6	3.1	3.6	2,538	
ハピネット	8.9	9.7	16,266	サンワ テクノス	7.5	7.6	8,436	クオールホールディングス	15.6	15.7	15.6	15.7	22,011	
橋本総業ホールディングス	2.1	2	5,008	リョウサン	11.7	12.8	30,438	ジンスホールディングス	5.6	6.2	5.6	6.2	45,198	
日本ライフライン	31.4	37.6	55,384	新光商事	16.7	15.9	12,497	ビックカメラ	62.9	69	62.9	69	84,594	
タカショー	5.4	7.4	5,653	トーホー	4.8	5.4	10,303	DCMホールディングス	57.3	71.9	57.3	71.9	78,083	
エクセル	3.1	-	-	三信電気	5.7	6.4	13,344	ペッパードサービス	8.5	13.2	8.5	13.2	3,722	
マルカ	3.8	3.8	7,527	東陽テクノカ	12.2	12.2	14,554	MonotaRO	75.5	82.8	75.5	82.8	475,272	
I DOM	28.7	39.3	26,095	モスフードサービス	14	16.5	51,315	東京一番フーズ	2.7	2.6	2.7	2.6	1,534	
進和	6.3	7	15,638	加賀電子	10.6	10.5	26,901	DDホールディングス	4.2	5.2	4.2	5.2	3,556	
エスケイジャパン	2.2	2.7	1,236	ソーダニッカ	10.8	11.3	6,102	きちりホールディングス	2.9	3.4	2.9	3.4	2,080	
ダイトロン	4.5	5	8,300	立花エレテック	7.9	8.7	14,215	アークランドサービスホールディングス	7.8	9.7	7.8	9.7	21,262	
シークス	13.5	14.8	24,375	フォーバル	4.7	4.3	3,650	J. フロント リテイリング	126.8	139	126.8	139	139,139	
田中商事	3.4	3.1	2,176	P A L T A C	17	18.7	108,273	ドール・プレスホールディングス	16.9	18.4	16.9	18.4	30,875	
オーハシテクニカ	5.9	6.2	8,500	三谷産業	14.2	15.6	7,098	マツモトキヨシホールディングス	43.9	48.1	43.9	48.1	222,222	
白銅	3.9	3.6	5,320	太平洋興発	4.1	5.1	3,274	ブロンコビリー	5.5	6.1	5.5	6.1	14,139	
ダイコー通産	-	1.1	1,741	smelltacホールディングス	1.9	2.6	7,254	ZOZO	73	68.7	73	68.7	246,976	
伊藤忠商事	742.8	814.6	2,526,074	ヤマシタヘルスマタホールディングス	0.8	1.1	1,706	トレジャー・ファクトリー	3.2	3.4	3.2	3.4	2,760	
丸紅	1,105.3	1,148.1	853,956	コア商事ホールディングス	-	3.3	4,524	物語コーポレーション	2.7	3.1	2.7	3.1	37,541	
高島	1.6	1.6	2,710	国際紙パルプ商事	25.2	25.5	6,273	ココカラファイン	11.1	10.4	11.1	10.4	79,560	
長瀬産業	59.8	65.5	114,297	ヤマタネ	5.3	5.3	7,568	三協伊勢丹ホールディングス	185.6	203.4	185.6	203.4	150,516	
蝶理	6.8	7.5	12,412	丸紅建材リース	1	0.9	1,655	Hamee	3.3	2.9	3.3	2.9	5,121	
豊田通商	118.5	116.9	550,599	日鉄物産	7.5	8.3	32,079	ウエルシアホールディングス	31.6	61.5	31.6	61.5	222,630	
三共生興	16	18	9,396	泉州電業	3.3	3.3	11,022	クワイエSTDホールディングス	17.8	17.1	17.8	17.1	60,277	
兼松	39.6	46.5	67,378	トラスコ中山	22.1	26.7	76,655	丸善CHホールディングス	12.4	15.4	12.4	15.4	5,790	
ツカモトコーポレーション	1.8	1.7	2,585	オートバックスセブン	39.4	43.2	61,646	ミザウ	2.1	2.4	2.1	2.4	1,608	
三井物産	933.4	945.5	1,900,455	モリト	7.8	9	5,562	ディーライフ	1.4	1.7	1.4	1.7	2,055	
日本紙パルプ商事	6	6.1	22,539	加藤産業	16.6	16.9	60,671	イー・ピーホールディングス	2	1.9	2	1.9	805	
日立ハイテック	36.9	-	-	北恵	2	3.2	3,004	チムニー	3.3	3.5	3.3	3.5	4,938	
カメイ	13.9	15.2	18,939	イノテック	6.3	6.6	8,058	シュッピン	7.2	7.9	7.2	7.9	7,497	
東都水産	1.3	1.4	4,963	イエローハット	20.1	21.9	39,288	オインクス・ラ・大地	-	11.5	-	11.5	35,707	
OUGホールディングス	1.6	1.8	5,122	JKホールディングス	9.6	10.7	9,137	ネクステージ	15.2	19.9	15.2	19.9	33,969	
スターゼン	3.9	4.3	19,371	日伝	9.6	9.7	21,786	ジョイフル本田	31.1	34.2	31.1	34.2	49,384	
山善	41.4	45.5	47,502	北沢産業	7.8	7.3	1,934	鳥貴族ホールディングス	3.5	3.3	3.5	3.3	5,369	
橋本興業	1.9	1.7	6,230	杉本商事	5.7	5.9	14,059	キリン堂ホールディングス	4.2	-	4.2	-	-	
住友商事	670	734.9	1,094,633	東電電機産業	30.2	31.1	78,745	ホットランド	7.1	8.6	7.1	8.6	10,732	
内田洋行	4.5	4.6	20,447	因幡テック	3.5	3.9	11,111	すかいらくホールディングス	119	130.4	119	130.4	223,896	
三菱商事	745.2	709	2,012,142	ミスミグループ本社	133	146	525,600	SFPホールディングス	4.5	5.7	4.5	5.7	8,567	
第一実業	5.2	5.3	22,472	アルテック	8.6	8.8	2,525	綿半ホールディングス	4	8.8	4	8.8	11,897	
キャノンマーケティングジャパン	30.4	28.9	71,469	タキヒヨー	3.1	4	8,056	ヨシックス	1.7	2.3	1.7	2.3	5,048	
西華産業	6	6.2	8,872	蔵王産業	2.1	1.9	2,650	ヨシダ・スノー・マート・ホールディングス	30.9	33.9	30.9	33.9	39,188	

銘柄	前期末			当期末			銘柄	前期末			当期末			銘柄	前期末			当期末		
	株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株
ゴルフダイジェスト・オンライン B E E N O S あさひ 日本調剤 コスモ薬品 トーエル オンリー セブ&アイ・ホールディングス クワイート・レストラン・ホールディングス ツルハホールディングス サンマルクホールディングス フェリシモ トリドールホールディングス T O K Y O B A S E ウエルブラスホールディングス JMホールディングス サツドラホールディングス アレナホールディングス 株式会社中ホールディングス パロックスジャパンリミテッド グスアのリオホールディングス かの源ホールディングス スシロー・ホールディングス L I X I L ビバ メディカルシステムネットワーク はるやまホールディングス ノジマ カッパ・クワイート ライトオン ジーンズメイト 良品計画 三城ホールディングス アドヴァン アルビス コナカ ハウス オブ ローゼ G-7ホールディングス イオン北海道 ゴジマ ヒマラヤ コーナン商事 エコス ワタミ マルシェ リック・フック・インターナショナル・ホールディングス 西松屋チェーン ゼンショーホールディングス 幸楽苑ホールディングス ハウスレイ サイゼリヤ V Tホールディングス 魚力 ポプラ フジ・コーポレーション ユナイテッドアローズ ハイデイ日高 京都さきの友禅 コロナイド ピーシブゴコーポレーション 壺番屋 トップカルチャー P L A N T スギホールディングス 兼天堂ホールディングス ヴィア・ホールディングス スクロール ヨンドリーホールディングス ファミリーマート 木曽路	千株 4.9 8 4 3.3 4.7 5.2 1.8 415.4 28.6 23.1 8.4 2.3 13.2 9.6 1.6 5.4 1.5 1.5 5.3 1.6 1.5 6.3 7.3 9.5 4.8 11.6 10.5 10.3 4.5 18.9 14.9 3 4 8 3.6 141 11.5 16.2 4 12.5 1.3 6.2 10.7 18.3 3.5 15.1 3.9 12.5 2.9 233.4 23.3 50.9 6.7 2 17.5 44.1 3 2 3 2.9 11.1 15.3 7 35.3 14.1 7.4 3.9 2.8 21.2 4.6 13.1 16.3 10.8 84.9 13.9	千株 6 5.4 8.6 7.1 11.8 5.7 2.6 455.6 62.5 25.4 9.1 2.6 28.8 10.4 1.9 8.8 1.5 6.7 3 1.9 8.8 1.5 6.7 3 8.1 11.6 5.4 63.9 — 10.2 6.1 20.7 16.4 8.8 3.6 154.5 14.9 12 3.7 14.1 1.2 6.9 15.6 19.9 4.3 16.6 4.3 15.3 3 232.8 25.5 62.5 7.3 2 17.2 43.9 3.5 3.3 3.1 13.2 16.8 6.4 38.6 13.6 8.2 4.8 3.1 23.2 5.1 14.2 16.6 10.6 — — 15.3	千円 5,916 12,792 13,975 11,786 197,296 4,776 1,209 1,935,388 55,437 372,110 14,696 3,458 47,001 6,905 1,575 18,647 3,097 9,339 5,172 1,575 18,647 3,097 9,339 5,172 6,625 102,544 3,520 269,658 — 7,701 4,385 57,525 25,420 5,737 1,130 391,348 4,410 13,560 9,375 4,808 2,034 16,870 16,426 13,273 4,067 49,401 8,380 15,682 1,524 572,688 38,683 181,312 12,942 1,852 37,083 19,140 6,443 1,135 6,993 26,637 31,197 1,561 76,775 8,214 42,640 1,689 2,321 171,216 13,729 4,047 20,766 22,064 — — 36,857	S R Sホールディングス 千趣会 タカキュー リテールパートナーズ ケーヨー 上新電機 日本瓦斯 ロイヤルホールディングス 東天紅 しなげや 島忠 チヨダ ライフコーポレーション リンガーハット Mr M a x HD テンアライド AOKIホールディングス オークワ コメリ 青山商事 しまむら はせがわ 高島屋 松屋 エチ・ツー・オー リテイリング 近鉄百貨店 丸パルコ 丸井グループ アグシアル リテイリング 井筒屋 イオン イズミ 平和堂 フジ ヤオコー ゼビオホールディングス ケーズホールディングス O l y m p i cグループ 日産東京販売ホールディングス シルバーライフ 一家ダイニングプロジェクト Genky DrugStores ナルミヤ・インターナショナル 聡合メディカルホールディングス フクオクスグループホールディングス ギフト アインホールディングス 元氣寿司 ヤマダホールディングス アークランドサカモト ニトリホールディングス グルメ軒屋 愛眼 ケーユーホールディングス 吉野家ホールディングス 松屋フーズホールディングス サガミホールディングス 関西スーパーマーケット 王将フードサービス プレナス ミニストップ アークス パローホールディングス 藤久 ベルク 大 庄 ファーストリテイリング サンドラッグ サックスパー ホールディングス	千株 12.5 19.2 8.6 — 21.8 12.5 16.8 18.6 0.8 13.2 20 11.1 8.1 13.1 14.6 9.8 21.2 16.6 16.4 21.9 12.3 5.3 77.4 21.4 50.3 4 10.2 97.3 8.8 5.8 408.7 21.6 21.5 12.9 12 12.9 102.5 5.5 15.9 — — 5.2 1.1 687 20,145 2.3 9.3 6.2 13.1 2.7 323.6 16.6 46 7.5 8.3 5.5 34.9 5.1 14.2 8.9 7.8 11.9 7.9 21.7 23.5 0.9 5.2 5.7 14.2 40 9	千株 14.6 20.9 9.9 14.1 21.6 13.7 19.2 20.3 0.6 13 — 12.2 8.8 14.4 15.9 4.223 23.1 18.2 18 25.7 13.5 5.2 84.7 25.4 55 4.5 — — 98.5 9.7 6.3 448.1 23.6 21.5 14.1 13.2 14 103.7 6 14.3 1.6 1.1 5.1 2.3 — 1.1 16.9 3.2 390.2 18.2 46.3 8.4 7.6 6 38.2 5.6 15.7 8.8 7.7 13.2 8.7 22.1 23.8 2.7 5.8 6.3 15.6 43.8 10	千円 12,585 7,064 1,485 19,711 16,372 42,744 100,800 38,955 554 22,750 — 12,285 29,656 35,913 12,465 4,223 14,691 23,314 51,948 18,735 157,545 1,549 93,000 24,384 45,815 15,277 — — 207,539 48,694 1,417 1,543,704 95,580 47,558 28,482 92,004 13,440 153,683 5,526 3,875 3,393 687 20,145 2,263 — 2,302 122,525 8,102 214,610 28,301 954,011 8,509 1,770 5,088 84,956 20,524 19,106 10,419 46,354 26,386 12,693 53,238 60,618 2,119 35,438 6,684 1,460,628 191,844 5,900	ヤマザワ やまや ペルーナ 銀行業 (4.7%) 島根銀行 じもとホールディングス めがきフィナンシャルグループ 東京さほしフィナンシャルグループ 九州フィナンシャルグループ ゆうちょ銀行 富士第一銀行 コンコディア・フィナンシャルグループ 西日本フィナンシャルホールディングス 関西みらいフィナンシャルグループ 三井フィナンシャルグループ 新設東北フィナンシャルグループ ひろぎんホールディングス 新生銀行 あおぞら銀行 三井住友フィナンシャル・グループ りそなホールディングス 三井住友トラスト・ホールディングス 三井住友フィナンシャルグループ 千葉銀行 群馬銀行 武蔵野銀行 千葉興業銀行 筑波銀行 七十七銀行 青森銀行 秋田銀行 山形銀行 岩手銀行 東邦銀行 東北銀行 みちのく銀行 ふくおかフィナンシャルグループ 静岡銀行 十六銀行 スルガ銀行 八十二銀行 山梨中央銀行 大垣共立銀行 福井銀行 北國銀行 清水銀行 富士銀行 滋賀銀行 南都銀行 百五銀行 京都銀行 紀陽銀行 ほくほくフィナンシャルグループ 広島銀行 山陰合同銀行 中国銀行 鳥取銀行 伊予銀行 百十四銀行 四国銀行 阿波銀行 大分銀行 宮崎銀行 佐賀銀行 沖縄銀行 琉球銀行 セブン銀行 みずほフィナンシャルグループ 高知銀行	千株 2 2.1 2.5 2.1 72.2 552.6 14.4 174.5 301.3 25.4 625.3 72.5 62.4 9.9 18.5 — 78 63.3 7,320.8 1,167 201 735.5 365.7 209 15.8 29.2 44.4 35.9 8.3 6.8 11.9 6.9 95.1 5.1 6.8 89.5 263.3 13.4 108.8 256.7 12.3 21 9.1 10.9 4.4 2 21.3 17.6 95.7 38 37.6 70.7 157.1 63 91.5 3.7 151.7 11.3 16.1 17.3 6.1 7 6.4 9.7 24.6 355.3 14,451.2 4	千株 2.6 2.5 2.5 4.3 8 604.6 14.6 238 330.8 28.6 709.7 77.6 54.8 10.2 19 — 95.1 69.4 7,977.2 513,758 220.5 2,881.329 388.8 239.8 17.3 29.8 48.4 36.6 9 7.1 13.884 7.6 104.1 5.9 7.5 105.1 283.9 14.6 101.6 262.3 13.6 23 10.9 4.9 10.9 1.9 23.3 17 105.2 41.7 41.3 77.5 — 73.6 100.4 4 154.6 12.2 16.7 17.8 6.8 6.3 10.7 25.4 389 1,584.6 4.2	千円 4,555 5,577 26,350 2,906 6,648 130,593 17,052 105,196 318,560 8,608 291,686 53,388 31,181 13,637 44,270 110,380 131,428 148,169 4,149,953 513,758 771,529 2,881,329 250,776 81,532 28,233 9,688 7,002 51,715 22,077 10,089 13,884 15,481 22,069 6,578 7,792 216,716 230,526 29,127 34,645 97,051 11,655 47,817 19,210 28,797 8,374 5,449 46,157 30,685 32,401 254,787 58,728 75,950 — 36,652 86,344 4,480 99,717 19,202 12,007 40,441 14,518 16,498 9,065 30,291 19,761 95,694 2,423,645 3,229									

銘柄		当 期 末			銘柄		当 期 末			銘柄		当 期 末		
株数	千株	株数	千株	評価額	株数	千株	株数	千株	評価額	株数	千株	株数	千株	評価額
博報堂D.V.ホールディングス	143.3	157.2	266,454	千円	デザインワン・ジャパン	2	3.5	752	千円	ダイクマーケティングミックス	-	4.4	14,190	千円
ぐるなび	18	19.6	11,936		イー・ガーディアン	5.2	4.9	15,312		ポリズホールディングス	-	2.3	6,354	
タカキヤ	11	14.1	7,755		リブセンス	6.7	6.2	1,475		アドバテッジシステムマネジメント	5.2	5.7	4,218	
ジャパン・プレス・ケイ・システム	6.9	8.9	8,971		ジャパนมテリアル	31.7	34.8	53,278		リログループ	56.3	61.7	158,939	
フアンコミュニケーションズ	28.4	31.3	13,146		ベクトル	12.9	14	18,018		東祥	6.4	7.1	12,900	
ライク	4.1	3	6,102		ウチヤマホールディングス	5.2	5.8	2,088		エイチ・アイ・エス	16	16.4	33,767	
ビジネス・ブレークスルー	4.4	5.1	2,233		チャム・ケア・コーポレーション	7.5	8.4	11,440		ラックランド	2.1	3.2	7,657	
エスピーール	19.9	28.9	28,813		ライクキッズ	2.4	-	-		共立メンテナンス	17	18.7	73,210	
WDBホールディングス	4.7	5.2	14,346		キャリアリンク	3.4	3.6	11,340		イネンホールディングス	11.5	11.8	16,000	
手間いらす	-	1.1	5,852		I B J	7	9.1	8,881		建設技術研究所	7.1	7.3	18,374	
ティア	6.1	7.2	3,204		アサンテ	4.2	4.1	6,994		スペース	6.7	7.7	6,337	
CDG	1.1	1.3	1,999		N・フィールド	7.1	7.6	7,554		長 大	3.8	4.5	7,191	
アドウェイズ	-	13.7	9,809		バリュウHR	2	4.5	7,717		燦ホールディングス	4.5	4.7	5,687	
バリューコマース	5.8	7.5	23,175		M&Aキャピタルパートナーズ	7.3	9.3	46,267		スバル興業	0.6	0.7	5,705	
インフォマート	112.9	114.3	109,842		ライオンズクラブホールディングス	3.9	4.3	9,146		東京デアトル	4.1	4.6	6,016	
J Pホールディングス	32.4	32.6	9,682		ER Iホールディングス	3	2.8	1,789		ダナベ経営	4.9	2.2	3,102	
エコナックホールディングス	18.8	20.7	1,966		アビスト	1.6	1.8	5,351		ナガワ	3.3	3.6	41,364	
E P Sホールディングス	15.5	15.3	19,966		シグマクシス	7	6.2	11,749		よみうりランド	2.2	0.6	3,618	
レックス	2.5	2.7	4,887		ウィルグループ	6.7	8.2	8,552		東京都競馬	6.7	7.3	33,507	
プラスステージ・インナーナショナル	38.6	42.2	35,490		エスコロー・エージェンツ・ジャパン	14.5	16.6	5,063		常盤興産	4.2	4.7	6,396	
アミューズ	5.6	6.2	17,043		メディア	-	5.3	38,213		カナモト	16.8	19.9	47,978	
ドリームインキュベータ	3.2	3.5	4,291		レアジョブ	-	1.6	3,825		東京ドーム	41.8	44.5	57,716	
クイック	6.4	7	8,638		リクルートホールディングス	738	809.3	4,030,314		西尾レントオール	10.5	10.4	27,071	
T A C	6.7	6.3	1,701		エラン	6.1	15.6	23,478		アジウラ・ホスピタリティ・グループ	69	71.2	1,922	
ケネディクス	98	32.3	24,128		土木管理総合試験所	4.5	5.7	2,023		トランス・コスモス	9.8	10.8	30,974	
電通グループ	106.2	127	473,075		ネットマーケティング	3.8	5.4	3,699		乃村工藝社	44.2	48.3	39,992	
テイクアンドグヴ・ニーズ	4	5.2	3,468		日本郵政	844.5	855.3	754,716		藤田観光	4.5	4.4	7,290	
ぴあ	2.9	3.2	10,048		ベルシテム24ホールディングス	17.2	18.9	36,174		KNT-CTホールディングス	6.4	6	6,114	
イオンファンタジー	4	4.3	10,582		鎌倉新書	7.6	11.4	10,488		日本管財	11	12.2	25,607	
シーティーエス	11.6	12.6	12,020		SMN	1.6	2.4	1,855		トーカイ	10	11	24,684	
ネクシィーズグループ	3.6	3.5	3,367		一蔵	1.1	1.7	649		白洋舎	1.1	1	2,427	
H. U. グループホールディングス	28.9	31.7	98,587		L I T A L I C O	3.6	4.6	16,560		セコム	109.3	111.3	1,140,268	
アルプス技研	9.1	10	21,600		グローバルキッズCOMPANY	1.5	2.1	1,881		セントラル警備保障	5	5.4	19,008	
サンックス	18.1	17.7	6,000		エトリア	4.6	6.1	10,107		丹青社	19.5	21.1	17,048	
ダイオーズ	2	2.2	2,145		アトラエ	2.7	3.4	10,472		メイテック	12.7	13.8	77,142	
日本空調サービス	10.8	12.2	8,930		ストライク	3.9	4.2	20,223		応用地質	11.1	13.2	17,410	
オリエンタルランド	109.5	120.1	2,141,383		ソラスト	28.4	27.7	41,439		船井総研ホールディングス	21.3	23.1	59,736	
ダスキン	26.4	26.2	75,482		セラク	3.3	3.5	6,191		進学会ホールディングス	4.1	4.9	2,401	
朝光ネットワークジャパン	12.1	14.2	8,548		インソース	5	9.4	20,670		オオバ	8.1	7.9	5,925	
ファコホールディングス	5.7	5.4	9,763		ベイカレント・コンサルティング	6.2	7.4	130,684		いであ	1.9	2.7	4,884	
秀英予備校	2.3	2.8	1,226		Orchestra Holdings	2	2.5	5,897		学究社	3.1	3.4	4,831	
田谷	2	1.7	974		アイモバイル	3.3	4	4,900		ベネッセホールディングス	34.3	41.4	92,818	
ラウンドワン	28.8	38.5	38,808		キャリアインデックス	4.2	4.6	2,783		イオンデパート	12.7	13.9	40,991	
リゾートトラスト	47.2	51.7	88,045		MS - Japan	3.4	4.5	5,413		ナック	5.7	5.6	5,510	
ピー・エム・エル	13.3	14.6	51,465		船場	1.7	1.6	1,403		ニチイ学館	14.7	-	-	
ワタベウエディング	1.6	1.7	562		グレイステクノロジー	4.7	5.7	35,454		ダイセキ	17.2	18.9	64,638	
りらいコミュニケーションズ	18.7	17.1	24,504		シャロエビホールディングス	10.8	32.5	77,187		ステップ	3.8	4.3	6,712	
リソー教育	47.1	57.3	20,169		フルテック	1.2	1.8	2,534		合計	株数・金額	千株	千株	千円
早稲田アカデミー	3.4	4.4	4,307		グリーンズ	3.9	4.2	2,205		銘柄数<比率>	127,662.7	124,117.8	311,274.068	<97.7%>
ユー・エス・エス	115.4	126.4	274,920		ソナグループ・ホールディングス	1.2	1.7	603			2,151銘柄	2,183銘柄		
東京個別指導学院	3.7	9.9	6,672		G A M E W I T H	2.2	3.5	2,075						
サイバーエージェント	59.3	69.6	467,016		ソウルダウト	1.6	2.7	4,665						
楽天	480.2	526.6	583,999		MS&Consulting	1.4	1.9	1,181						
グリーグ・アンド・リパ社	5.3	5.8	7,105		エル・ティー・エス	-	0.8	3,336						
モーニングスター	-	12.4	6,001		ミダック	-	2.4	7,716						
デー・オー・ダブリュー	9	19.8	5,841		日総工業	-	8.7	7,786						
山田コンサルティンググループ	5	6.6	6,943		キュービーネットホールディングス	4.3	5.2	8,824						
セントラルスポーツ	3.9	4.2	10,243		R P Aホールディングス	5.8	12.8	8,652						
フルキャストホールディングス	10.3	9.8	18,247		スプリックス	3.5	3.2	2,646						
エン・ジャパン	18.4	20.1	68,239		マネジメントソリューションズ	1.1	5.5	9,916						
リソルホールディングス	1	0.9	3,555		プロレド・パートナーズ	-	1.6	5,624						
テクノプロ・ホールディングス	20.7	22.5	180,000		and factory	-	1	770						
アトラ	2.3	2.5	890		テノ・ホールディングス	-	0.9	1,140						
インターワークス	1.9	3.5	1,284		プロンティア・マネジメント	-	2	4,892						
アイ・フルキャストホールディングス	4.2	4.6	68,356		ピアラ	-	0.6	1,209						
Keeper 技研	3.9	7.3	14,899		コアロ・ホールディングス	-	0.6	2,265						
ファーストロジック	2.3	2.2	1,771		ギークス	-	1.5	2,359						
三機サービス	2.1	2.3	2,300		カープスホールディングス	-	31	29,884						
Gunosy	7.1	6.8	5,596		フォーラムエンジニアリング	-	5.8	5,945						

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。
(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(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 7,442		百万円 -

■投資信託財産の構成

2021年2月8日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 311,274,068		% 97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,511,950		2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	318,786,019		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

(2021年2月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	318,786,019,057円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	6,651,925,208
株 式(評価額)	311,274,068,500
未 収 入 金	391,827,620
未 収 配 当 金	389,312,729
差 入 委 託 証 拠 金	78,885,000
(B) 負 債	199,379,000
未 払 解 約 債 金	199,379,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	318,586,640,057
元 次 期 繰 越 損 益 金	102,105,610,506
(D) 受 益 権 総 口 数	216,481,029,551
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	102,105,610,506円
	31,202円

(注1) 期首元本額	98,370,254,055円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	19,134,149円
追加設定元本額	67,069,989,134円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	9,070,573円
一部解約元本額	63,334,632,683円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (D/C)	2,599,277円
(注2) 期末における元本の内訳		投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	42,338,447円
One DC 国内株式インデックスファンド	15,975,939,497円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	98,734,309円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	3,179,107,702円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,803,475,886円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,626,890円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	265,437,692円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	5,088,758円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	9,278,066円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	8,151,762円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	5,239,774円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	24,072,359円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	5,173,103円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	14,018,113円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,626,870円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	12,980,814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)	52,904,100円
たわらノーロード TOPIX	784,765,731円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	64,217,224円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	612,281,321円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	71,448,850円
たわらノーロード バランス (堅実型)	23,454,696円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	32,545,912円
たわらノーロード バランス (標準型)	140,720,417円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	41,658,362円
たわらノーロード バランス (積極型)	207,209,167円	日米東証分散戦略ファンド (インカム重視) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	562,668,029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)	1,707,448円	インカム重視マルチアセット運用ファンド	85,977,917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)	108,252,549円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	72,359,909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)	248,952,107円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	128,443,286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)	166,536,220円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	7,951,637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)	228,275,842円	DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	35,906,053円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	431,973円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	8,484,030円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,205,302円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,658,825円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	4,833,419円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	21,889,554円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,885,817円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	46,792,943円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	6,004,044円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	689,878,804円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,764,926,964円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	729,307,036円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,023,160,847円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,064,787,625円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,393,344,349円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	150,408,971円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,451,908,533円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	37,142,128円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	332,009,300円	DIAM 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)	373,020,041円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,152,607,788円	DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	102,439,732円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,085,041,257円	DIAM世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,576,268円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	35,744,954円	DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	468,054,341円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,112,139,190円	DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	24,008,365円
マネックス資産設計ファンド エゴリレーション	21,186,872円	DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	99,685,187円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	313,080,893円	DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	238,004,405円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	264,026,418円	DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	323,286,503円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	439,000,020円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	45,168,755円
投資のソムリエ	15,620,354,669円	DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	20,550,710円
グループコントロール	637,176,611円	DIAM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)	362,800,005円
投資のソムリエ<DC年金>	960,546,202円	DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	1,106,076,367円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	294,854,779円	DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	1,467,666,407円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	367,544,221円	DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	58,984,178円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	6,918,316円	期末元本合計	102,105,610,506円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	16,838,854円	(注3) 担保資産	
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	264,587,992円	代用として担保を提供している資産はありません。	
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,928,248,506円		

■損益の状況

当期 自2020年2月8日 至2021年2月8日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	5,192,079,491円	
	受取配当金	5,191,315,557	
	受取利息	7,434	
	その他の収益	3,319,941	
	支払利息	△2,563,441	
(B)	有価証券売買損益	32,654,345,029	
	売却益	50,944,545,133	
	売却損	△18,290,200,104	
(C)	先物取引等取引損益	1,230,944,200	
	取引益	2,753,684,220	
	取引損	△1,522,740,020	
(D)	当期損益金(A+B+C)	39,077,368,720	
(E)	前期繰越損益金	171,390,003,476	
(F)	解約差損益金	△99,083,661,761	
(G)	追加信託差損益金	105,097,319,116	
(H)	計(D+E+F+G)	216,481,029,551	
	次期繰越損益金(H)	216,481,029,551	

(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。