

運用報告書 (全体版)

第14期<決算日2022年10月12日>

D I A M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	D I A M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	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている (または採用予定の) 銘柄を主要投資対象とします。
運用方法	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、経費控除後の剰余金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、「D I A M国内株式パッシブ・ファンド」は、2022年10月12日に第14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)	期中騰落			
	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
14期 (2022年10月12日)	29,510	0	△3.4	3,057.47	△3.2	97.0	3.0	15,439

(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)	円	%	ポイント	%	%	%
2021年10月12日	30,559	-	3,158.44	-	97.0	3.0
10月末	30,843	0.9	3,188.28	0.9	96.8	3.4
11月末	29,721	△2.7	3,073.26	△2.7	84.8	1.0
12月末	30,746	0.6	3,179.28	0.7	97.1	3.4
2022年1月末	29,255	△4.3	3,025.69	△4.2	95.8	4.2
2月末	29,122	△4.7	3,012.57	△4.6	98.0	1.3
3月末	30,367	△0.6	3,142.06	△0.5	96.9	3.1
4月末	29,636	△3.0	3,066.68	△2.9	96.2	3.9
5月末	29,859	△2.3	3,090.73	△2.1	96.7	3.4
6月末	29,243	△4.3	3,027.34	△4.2	96.7	3.3
7月末	30,323	△0.8	3,140.07	△0.6	97.1	2.9
8月末	30,681	0.4	3,177.98	0.6	98.0	2.0
9月末	28,992	△5.1	3,003.39	△4.9	96.3	3.7
(期末)						
2022年10月12日	29,510	△3.4	3,057.47	△3.2	97.0	3.0

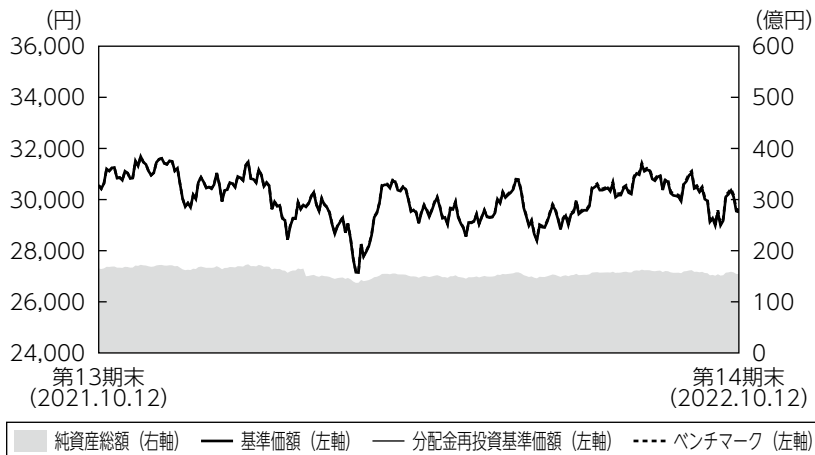
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2021年10月13日から2022年10月12日まで）

基準価額等の推移



第14期首：30,559円
第14期末：29,510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、米国での金融引き締め継続への警戒感の高まりや、円安米ドル高の進行、世界的なインフレの高進、新型コロナウイルスの感染状況、ウクライナ情勢などを材料に、一進一退の展開となりました。

投資環境

期初から2022年3月半ばまでは、新型コロナウイルスの国内新規感染者数の増加、米国の金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻を要因として、国内株式市場は下落しました。その後も、米国の金融引き締めや、円安米ドル高の進行、インフレの高進、国内の新型コロナウイルスの感染状況、ウクライナ情勢など懸念材料が多い中、国内株式は一進一退の展開となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

【運用状況】（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	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



期末

（単位：％）

No.	業種	組入比率
1	電気機器	15.9
2	情報・通信業	9.0
3	輸送用機器	7.5
4	化学	5.9
5	卸売業	5.6
6	医薬品	5.5
7	サービス業	5.3
8	銀行業	5.1
9	機械	5.0
10	小売業	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	3.6
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



期末

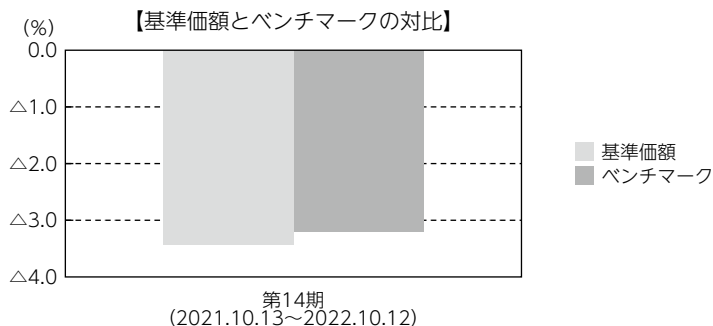
（単位：％）

No.	銘柄名	組入比率
1	トヨタ自動車	3.7
2	ソニーグループ	2.4
3	キーエンス	1.8
4	日本電信電話	1.8
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.5
6	任天堂	1.4
7	ソフトバンクグループ	1.3
8	第一三共	1.2
9	日立製作所	1.2
10	KDDI	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3.2%下落しました。

当ファンドはベンチマークを0.2%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
	2021年10月13日 ～2022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	19,509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14期		項目の概要
	(2021年10月13日 ～2022年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	83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30,028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)	(66)	(0.220)	
(販売会社)	(7)	(0.022)	
(受託会社)	(10)	(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	0	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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	83	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、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

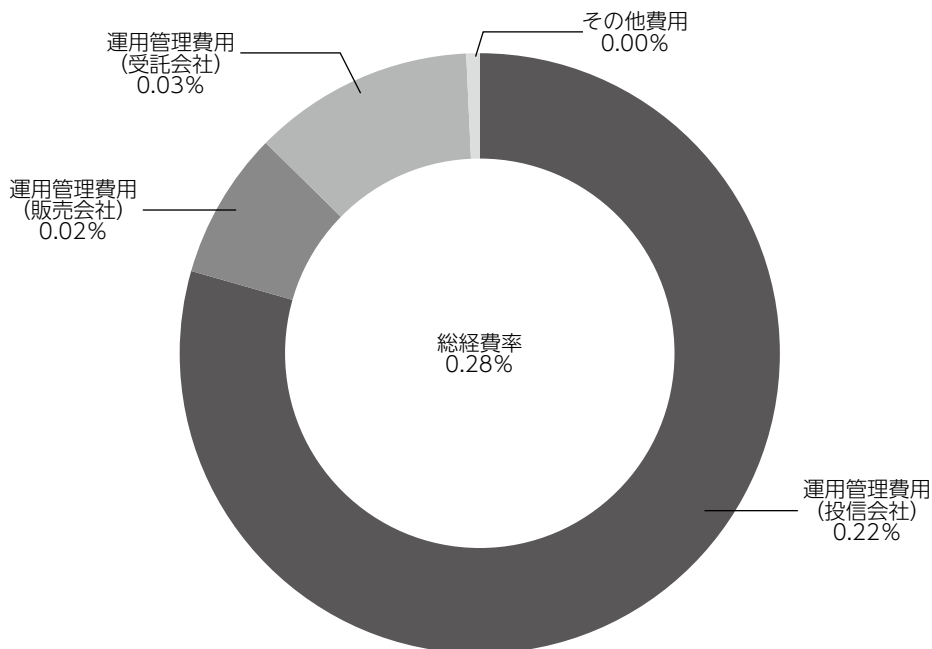
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.28%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（2021年10月13日から2022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	461,390	1,488,167	631,080	2,020,978

■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	1,067,234,936千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	396,936,901千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	2.68

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年10月13日から2022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

決 算 期 区 分	当			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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	0.002	0.002	100.0	0.002	0.002	100.0

(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)	209千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	12千円
(B)÷(A)	6.2%

(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

決 算 期 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 520,125	百万円 306,276	% 58.9	百万円 547,108	百万円 282,996	% 51.7
金 銭 信 託	1.380	1.380	100.0	1.380	1.380	100.0

平均保有割合 3.8%

(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 3,858	百万円 4,265	百万円 2,760

(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 895

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□ 5,034,248	千□ 4,864,559	千円 15,438,164

■投資信託財産の構成

2022年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	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	15,438,164	99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	24,187	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	15,462,352	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	15,462,352,722円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	24,187,772
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)	15,438,164,950
(B) 負 債	23,139,098
未 払 解 約 金	1,784,078
未 払 信 託 報 酬	21,234,496
そ の 他 未 払 費 用	120,524
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	15,439,213,624
元 本	5,231,873,254
次 期 繰 越 損 益 金	10,207,340,370
(D) 受 益 権 総 口 数	5,231,873,254口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	29,510円

(注) 期首における元本額は5,399,416,123円、当期中における追加設定元本額は732,628,384円、同解約元本額は900,171,253円です。

■損益の状況

当期 自2021年10月13日 至2022年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△3,979円
受 取 利 息	336
支 払 利 息	△4,315
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△465,938,926
売 買 損 益	63,287,658
売 買 損 益	△529,226,584
(C) 信 託 報 酬 等	△43,540,169
(D) 当 期 繰 越 損 益 金(A+B+C)	△509,483,074
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,130,824,670
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,585,998,774
(配 当 等 相 当 額)	(6,344,555,216)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,241,443,558)
(G) 合 計(D+E+F)	10,207,340,370
次 期 繰 越 損 益 金(G)	10,207,340,370
追 加 信 託 差 損 益 金	8,585,998,774
(配 当 等 相 当 額)	(6,346,157,075)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,239,841,699)
分 配 準 備 積 立 金	2,485,812,115
繰 越 損 益 金	△864,470,519

(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	354,987,445円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	7,721,528,255
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,130,824,670
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	10,207,340,370
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	19,509.92
(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》

約款変更のお知らせ

- 当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

(2022年3月15日)

- 当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、東京証券取引所の市場区分の再編に伴い、主要投資対象を「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。

(2022年4月4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20期（決算日 2022年2月7日）

（計算期間 2021年2月9日～2022年2月7日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物率	純資産額
	期騰落	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
20期 (2022年2月7日)	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

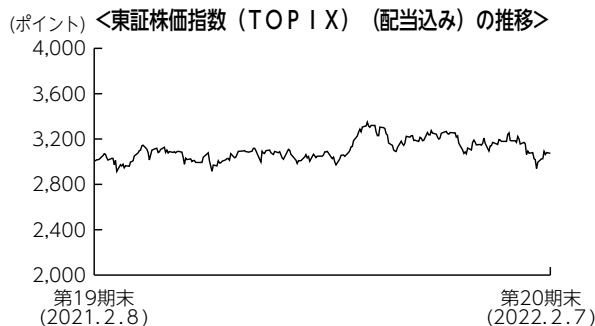
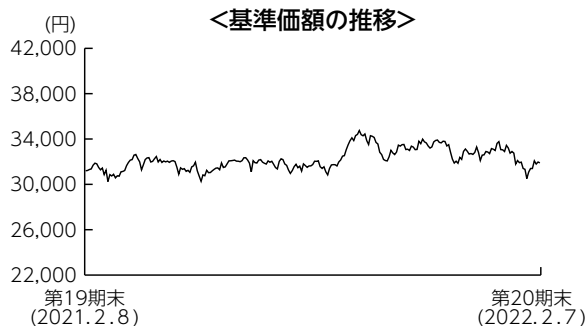
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月9日から2022年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,896円となり、前期末比で2.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種
 期首 (前期末)

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



期末

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

○組入上位10銘柄
 期首 (前期末)

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



期末

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.2%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年2月9日から2022年2月7日まで)

(1) 株 式

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 144,564	百万円 142,625	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	875,075,739千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	369,108,651千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	2.37

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月9日から2022年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 1,300

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

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

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

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	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株	株	数	千株																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																								
日本たばこ産業	636.5	791.4	1,851,876	共和レザー	6.8	9.2	6,127	トリケミカル研究所	9.8	14.9	44,342	ケンコーマヨネーズ	7.3	8.5	11,517	昭和電工	87.9	124.8	297,398	ADEKA	53.3	66.3	167,473	くわばや日洋ホールディングス	7.8	9.6	18,240	住友化学	911.2	1,057.7	619,812	日油	43.6	49.2	252,888	なとり	6.9	8.1	16,200	住友精化	5.7	6.4	21,184	新日本理化学	19	23.6	5,923	イフジ産業	2.3	2.5	2,350	日産化学	63.9	78.4	516,656	ハリマ化成グループ	8.7	11	8,987	ビッルスコーポレーション	2.8	7.2	11,419	ラサ工業	3.8	5	8,095	花王	283.1	325.3	1,709,126	ファーマフーズ	-	14	22,848	クレハ	9.9	11.5	103,960	第一工業製薬	3.9	5.4	15,660	ユーグレナ	51.2	75	54,750	多木化学	4.5	5.6	29,400	石原ケミカル	3	7.5	9,915	紀文食品	-	8.6	8,187	テイカ	8.4	10.8	14,850	日華化学	4.3	5	4,015	ミヨシ油脂	4.4	6.2	6,869	石原産業	20.6	23.8	27,631	ニイタカ	2.4	3	6,849	理研ビタミン	11.2	15.4	26,257	片倉コープアグリ	2.4	2.5	2,875	三洋化成工業	6.9	8.6	44,118	有機合成薬品工業	9.2	10.3	2,811	片倉工業	15.6	13.8	33,992	東ソー	178.9	207.7	396,083	大日本塗料	13.2	17.8	14,453	グンゼ	8.5	9.6	37,008	トクヤマ	34.3	46	90,666	日本ペイントホールディングス	95.5	541.2	459,478	東洋紡	45.8	56.9	74,254	セントラル硝子	22	23.5	49,514	関西ペイント	130.1	149.3	342,792	ユニチカ	33.8	39.2	11,956	東亜合成	70.7	80.1	90,352	神東塗料	9.3	10	1,540	富士紡ホールディングス	5.6	6.4	24,288	大阪ソーダ	11.9	13.5	40,567	中国塗料	27.9	34	30,668	倉敷紡績	10.7	12.3	23,579	関東電化工業	27.3	31.6	34,033	日本特殊塗料	8.7	10.9	9,156	シキボウ	6.6	7.9	7,244	デンカ	42.2	52.4	190,474	藤倉化成	16	18.3	8,820	日本毛織	38.1	43.4	38,929	信越化学工業	214.1	247.4	4,693,178	太陽ホールディングス	8.5	21.2	68,158	ダイトウボウ	19.3	23.8	2,118	日本カーバイド工業	4.2	5.2	7,082	DIC	48.9	60.9	182,517	トア紡コーポレーション	4.1	4.3	1,754	堺化学工業	8.1	10	20,310	サカタククス	25.3	28.7	28,183	ダイドーミテッド	16.6	20.5	2,870	第一稀元素化学工業	11.7	13.4	15,276	東キョウS Cホールディングス	24.5	30.5	58,712	帝国繊維	13	16.3	32,811	エア・ウォーター	118.1	136.2	238,350	T & K TOKA	9.4	11.7	10,120	帯人	109	135.4	187,393	日本薬業ホールディングス	95.3	138.5	316,195	富士フィルムホールディングス	207.8	258.5	1,967,702	東レ	838.4	1,042.5	699,309	日本化学工業	3.2	4.6	12,134	資生堂	235	273.9	1,642,578	サカイオーベックス	3.1	-	-	東邦アセチレン	1.9	2.6	3,302	ライオン	153.7	177.6	268,708	住江織物	2.1	3.4	6,504	日本パーカライジング	58.4	72.6	74,632	高砂香料工業	7.4	10.3	28,953	日本フェルト	5.5	5.9	2,643	高圧ガス工業	18.5	23.1	17,278	マンダム	24.7	30.9	39,644	イチカワ	1.3	1.4	1,937	チタン工業	1.5	1.7	2,774	ミルボン	15.8	18.3	99,735	日東製網	1.3	1.7	2,459	四国化成工業	15.5	19	26,600	ファンゲル	43	59.6	185,356	アツギ	9.3	11.5	6,704	戸田工業	2.4	3.2	9,968	コーセー	22.2	27.7	304,146	ダイニック	3.6	3.8	2,728	ステラ ケミファ	6.3	7.2	17,978	コタ	7	9.4	14,720	セーレン	28.5	29.6	61,952	保土社化学工業	3.4	4.6	24,012	シーボン	1.3	1.4	2,525	ソト	4	6.2	5,139	日本触媒	21	24.2	144,716	ポレラ・オルビスホールディングス	50.5	62.8	108,895	東海染工	1.3	1.4	1,605	大日精化工業	9.6	12	27,108	ノビアホールディングス	10	12.6	63,252	小松マテール	19.1	23.6	29,877	カナカ	30	37.3	145,843	アジパルホールディングス	3	3.5	3,846	ワコールホールディングス	28.9	35.9	73,738	三菱瓦斯化学	116	133.8	285,529	新日本製薬	2.4	4	5,300	ホギメディカル	15.6	19.5	61,425	三井化学	100	130.8	397,632	エステー	7.7	9.5	14,601	クラウディアホールディングス	2.4	2.5	590	J S R	116.2	134.4	463,680	アグロ カネシヨウ	4.5	5	6,515	T S Iホールディングス	34.7	47.9	15,807	東京応化工業	19.9	23.3	147,955	コニシ	19.5	24.1	38,222	マツカオコーポレーション	3.7	4.6	5,409	大阪有機化学工業	10.7	12.2	36,429	長谷川香料	20.5	25.5	61,786	ワールド	15.1	18.9	22,264	三菱ケミカルホールディングス	774.1	962.6	807,910	星光PMC	6.9	8.6	5,633	三陽商会	6	6.9	5,954	K Hネオケム	19.1	23.7	72,640	小林製薬	33.1	41.3	391,111	ナイガイ	3.8	4.1	1,160	ダイセル	155.5	207.2	181,507	荒川化学工業	9.9	12.3	13,849	オンワードホールディングス	69.3	86.3	25,631	住友ベークライト	18.2	22.8	121,752	メック	8.1	11	33,880	ルックホールディングス	4	4.6	6,076	積水化学工業	244.9	301.3	583,618	日本高純度化学	3.3	4.1	10,569	キムラタン	68.3	79.9	1,518	日本ゼオン	104.5	129.8	175,489	タカラバイオ	31	38.5	88,280	ゴールドウイン	19.1	26	158,340	アイカ工業	32.2	40.1	127,317	JCU	13.3	16.6	75,613	デサント	19.8	28.1	97,085	宇部興産	58.4	67.8	147,058	新田セラチン	7.7	9.3	6,045	キング	4.6	6.7	3,463	積水樹脂	19.1	21.9	43,843	OA Tアグリオ	2.3	3.2	6,425	ヤマインターナショナル	10.6	13.3	3,790	タキロンシーアイ	25.2	31.4	17,552	デクセラアルズ	33	38.2	118,420	パルプ・紙 (0.2%)	7.2	8.9	37,291	旭有機材	6.6	8.1	17,528	アース製薬	8.9	12.1	71,027	特種東海製紙	521.3	602.3	363,789	ニチバン	6.2	8.6	14,852	北興化学工業	10.9	13.8	10,874	王子ホールディングス	51.1	69	81,213	リケンテクノス	28.2	35.4	16,142	大成ラミック	3.7	4.6	12,962	三菱製紙	17.1	21.3	6,794	大倉工業	5.5	7.5	15,037	クミアイ化学工業	48.8	54.8	44,223	北越コーポレーション	82.9	94.7	74,244	積水化成工業	15.6	19.6	8,800	日本農業	21.2	26.4	14,018	中越パルプ工業	4.7	5.6	5,538	群栄化学工業	2.2	3.5	12,075	アキレス	8.2	9.4	11,637	巴川製紙所	3.7	4.6	3,762	タイガースポリマー	6.7	8.5	3,714	有沢製作所	16.5	21.5	21,414	大王製紙	56	69.6	133,284	ミライアル	3.7	4.7	6,974	日東電工	75.7	89	775,190	阿波製紙	3	4	1,324	ダイキアクシス	4.3	5.6	3,925	レック	14	19.1	18,106	レンゴ	119.4	136.3	117,763	ダイキョーニシカワ	24.5	30.7	18,696	三光合成	12.4	15.5	5,766	トーモク	7.2	9	15,849	竹本容器	4.2	5.3	4,202	きもと	18.9	22.9	4,854	ザ・パック	8.7	11	29,931	森六ホールディングス	6.3	7.9	15,634	藤森工業	10.6	13.2	54,978	化学 (6.6%)	41.4	51.4	11,205	恵和	1.7	3.6	18,504	前澤化成工業	7.8	9.5	11,789	北の達人コーポレーション	182.3	210.4	217,764	日本北薬	71.6	113.4	132,224	未来工業	4.3	5.5	8,475	クラレ	767.5	954.1	1,064,775	カーリットホールディングス	11.5	14.3	10,052	ウェーブリンクホールディングス	4	5.6	3,931	旭化成	767.5	954.1	1,064,775	日本精化	8.4	11.6	24,070	J S P	7	8.7	13,685	扶桑化学工業	9.1	12.9	61,081	エフピコ	21.8	27	91,125

銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
システムインテグレター	3.2	4.8	2,654	EDULAB	1.1	—	日本電信電話	1,357.1	1,509.2	5,054,310										
朝日ネット	9.4	13.3	8,246	東海ソフト	1.4	2.4	KDDI	930.4	1,051.8	3,938,991										
eBASE	13.8	17.2	9,718	ウイングーク1st	—	8.2	ソフトバンク	1,054.5	2,185.1	3,148,729										
アバント	12.4	15.5	17,654	ヒト・コミュニケーションズ	2	3.4	光通信	13.7	16.6	234,558										
アドソル日進	4.1	5.1	8,445	サバーワークス	—	2.6	エムティアアイ	11.4	14.2	8,037										
ODKソリューションズ	2	3	1,911	東名	0.6	1.5	GMOインターネット	41.5	51.1	127,443										
フリービット	6.9	8.6	7,808	ヴィッツ	0.4	1.2	ファイバーゲート	3.7	4.7	5,649										
コムチュア	10.7	16.2	47,968	トビラシステムズ	1.1	2.9	アドマルホールディング	2.9	3.5	1,004										
サイバーコム	2.1	2.4	2,613	Sansan	—	51.3	KADOKAWA	31.3	78.7	179,672										
アステリア	8.3	10.4	9,318	Link-U	0.7	2.7	学研ホールディングス	15.6	20.2	21,593										
アイル	6.5	8	10,040	ギフティ	5.2	12.6	ゼンリン	21	23.4	24,242										
マークライズ	4.8	7.4	17,915	ベース	1	2.6	昭文社ホールディングス	4.4	4.6	2,014										
メディカル・データ・ビジョン	13.2	18.3	18,702	JMDC	—	13.5	インプレスホールディングス	10	11.7	2,468										
gumi	16	20	11,720	フォーカスシステムズ	7.7	9.6	アイネット	6	7.6	9,750										
ショーケース	2.4	3.4	1,557	グレスコ	7.9	10.7	松竹	7.6	9.5	114,570										
モバイルファクトリー	2.4	3.3	3,392	フジ・メディア・ホールディングス	120.1	139	東宝	68.5	85.2	405,978										
テラスカイ	3.7	5.2	7,638	オービック	36.6	45.6	東映	3.8	4.7	82,720										
デジタル・インフレーション・テクノロジー	5.1	6.4	7,756	ジャストシステム	16.5	20.5	エヌ・ティ・ティ・データ	309	384.2	866,755										
PCIホールディングス	4.4	6.6	6,903	TDCソフト	10.2	12.6	ピー・シー・イー	1.7	8.6	13,261										
パイプHD	2.4	2.8	7,210	Zホールディングス	1,593.8	2,096.9	ビジネスブレイン太田昭和	4	5.1	8,828										
アイビシー	1.9	2.6	1,716	トレンドマイクロ	61.9	77.1	DTS	24	27.7	71,743										
ネオジャパン	2.2	4	4,300	IDホールディングス	4.5	9.4	スワフ・エンタース・ホールディングス	49.5	67.1	397,903										
PR TIMES	2.4	3.2	8,995	日本オラクル	23.5	23.4	シーイーシー	12.2	15.4	16,755										
ラクス	—	49.6	108,723	アルファシステムズ	3.1	3.3	カプコン	49.7	136.1	393,737										
ラウンドコンピュータ	1.5	2.5	2,052	フューチャー	14	30.5	アイ・エス・ビー	5.3	6.8	6,283										
ダブルスタンダード	1.5	4.5	11,101	CAC Holdings	7.5	8.6	ジャステック	7.3	8.6	8,969										
オープンドア	6.9	8.6	14,258	SBEテクノロジーズ	4.2	6.4	SCSK	26.8	100	195,600										
マイネット	3.8	5.1	2,565	トーセ	3.3	4.5	日本システムウエア	3.8	5.4	11,496										
アカツキ	4.6	6.4	18,835	オビックビジネスコンサルティング	11.9	13.9	アイネス	11.3	13.2	19,813										
ベネフィットジャパン	0.9	1.1	2,327	伊藤忠テクノソリューションズ	52.9	65.7	TAC	9.8	24.4	72,614										
Ubicomホールディングス	3	3.9	8,853	アイティフォー	15.1	17.4	富士ソフト	12.3	15.4	77,000										
カナミックネットワーク	10.6	15.4	6,976	東計電算	1.8	1.7	NSD	37.3	46.5	96,487										
ノムラシステムコーポレーション	5.1	7.6	1,938	エックスネット	2.2	2.5	コナミホールディングス	42.1	52.4	366,800										
チェンジ	16.2	26.5	37,683	大塚商会	62.8	78	群小コンピュータホールディングス	5.3	6.7	19,999										
シンクロ・フード	6.9	7.5	2,347	サイボウズ	13.5	19.4	JBCホールディングス	7.8	9.8	14,719										
オークネット	6.1	7.7	11,711	電通国際情報サービス	14.4	20.8	ミロク情報サービス	11.5	12.7	16,344										
キャピタル・アセット・プランニング	1.5	2.9	2,293	ACC ESS	10.8	16.4	ソフトバンクグループ	920.5	865	4,627,750										
セグエグループ	2.9	3.8	2,200	デジタルガレージ	19.1	23.8	卸売業 (5.6%)	—	—	—										
エイトレード	2.2	2.2	4,639	エイムシステムズ	19.2	24	ホウスイ	0.6	0.6	501										
AOI TYO HOLDINGS	12	—	—	ウェザード	3.4	4.5	高千穂交易	4.7	5.9	9,410										
マイクロミル	23.6	29.5	32,509	CII	7.9	9.8	オルパルステアホールディングス	1.6	1.7	2,502										
ビッグリー	2.3	3.4	3,910	ビジネスエンジニアリング	1.2	1.7	伊藤忠食品	2.4	3	14,835										
オロ	3.6	4.6	10,718	日本エンタープライズ	11.6	14.9	エレマテック	9.4	11.7	12,296										
ユーザローカル	1.8	4.5	6,570	WOWOW	5.7	7	JALUX	3.3	4.1	10,487										
テモナ	2.5	3.3	1,402	スカラ	10.3	12.7	あらた	9.3	11.6	44,660										
ニーズウェル	2.2	3.4	2,077	インテリジェント ウェイブ	6.9	8.7	トーマンデバイス	1.6	2.4	15,408										
マネーフォワード	—	22	109,340	IMAGICA GROUP	10	12.2	東京エレクトロニクス	3.8	4.2	22,638										
サインポスト	2.6	4.6	4,135	ネットワンシステムズ	47.3	55	フィールズ	10.2	12.6	6,363										
電算システムホールディングス	—	6	15,768	システムソフト	25.5	30.8	双日	641.6	159.9	306,368										
ソルクシーズ	4.4	12.2	5,099	アルゴグラフィックス	9	11.4	アルパッソ	120.7	160.8	272,877										
フェイス	3.6	4	2,664	マーベラス	18.2	22.8	横浜冷凍	30.8	41.4	35,728										
プロトコーポレーション	10.4	15.4	19,404	エイベックス	19.9	24.9	神栄	1.6	2	1,794										
ハイマックス	2.9	4	4,788	日本ユニシス	40.3	45.1	ラサ商事	6.5	8.2	8,495										
野村総合研究所	211.8	278.9	1,126,756	兼松エレクトロニクス	6.4	8	アルコニック	12.3	15.4	20,851										
サイバネットシステム	8.2	10.3	6,509	都築電気	4.3	7.5	神戸物産	80.4	112.5	396,562										
CEホールディングス	6.2	7.6	3,655	TBSホールディングス	76.9	87.7	ハイパー	2	2.3	1,101										
日本システム技術	2.1	2.9	6,342	日本テレビホールディングス	96.6	120.4	あい	16.7	20.6	36,647										
インテージホールディングス	14.4	16.6	30,892	朝日放送グループホールディングス	12.1	14.9	ティープイエックス	4	4.8	4,992										
東邦システムサイエンス	3	4.1	3,813	テレビ朝日ホールディングス	35.8	34.7	ダイワホールディングス	10.6	70.4	115,596										
ソースネクスト	54.7	61.7	9,810	スカパーJSATホールディングス	76.3	122	マクニコ・富士ホールディングス	27.7	34.5	93,046										
インフォコム	10.6	15.9	30,925	テレビ東京ホールディングス	8.5	10.6	ラクト・ジャパン	5.1	5	9,895										
ジップレックス・ホールディングス	—	16.8	34,809	日本BS放送	4.1	5.3	グリムス	2.5	6.6	14,031										
HEROZ	3.2	4	3,708	ビジョン	14.2	24.6	パスタワーク・エスター・ホールディングス	20.6	25.2	20,286										
ラクスル	9.4	15.9	57,876	スマートバリュー	3.1	3.6	八洲電機	9.2	11	10,527										
IPS	2.1	4	7,356	USEN-NEXT HOLDINGS	4.4	13.8	メディアスホールディングス	6.8	8.5	7,556										
FIG	12.6	16	4,528	ワイヤレスゲート	4.8	5.5	レスタールホールディングス	12.2	13.8	26,937										
システムサポート	3.4	4.3	4,136	コネクシオ	6.7	10.4	ジョテックホールディングス	2.3	3.6	4,186										
イーソル	6.2	8.7	4,732	日本通信	102	119.8	大光	4.9	6.8	4,583										
アルティアネットワーク	12.8	18.3	25,180	クロップス	2.3	2.9	OCHIホールディングス	3.5	3.6	4,755										

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		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円		
TOKAホールディングス	56.6	70.4	63,219	OUGホールディングス	1.8	2.3	6,175	J Kホールディングス	10.7	11.7	11,629			
黒谷	3.3	4	2,548	スターゼン	4.3	10.9	22,868	日伝	9.7	12.1	26,111			
Cominix	1.7	1.8	1,317	山善	45.5	60.9	60,839	北沢産業	7.3	7.6	1,725			
三洋貿易	11.6	14.7	15,199	椿本興業	1.7	2.3	9,487	杉本商事	5.9	6.6	14,242			
ビューティガレージ	1.9	2.5	7,800	住友商事	734.9	913.9	1,678,377	信越電機産業	31.1	38.7	99,962			
ワイン・パートナーズ	8.5	10.9	10,823	内田洋行	4.6	6.3	28,948	東テック	3.9	4.6	11,145			
ミタチ産業	3	4	3,604	三菱商事	709	1,085.1	4,289,400	ミスミグループ本社	14.6	181.7	630,499			
シップヘルスカホールディングス	20.6	46.5	119,551	第一実業	5.3	6.7	28,542	アルテック	8.8	10.3	3,162			
明治電機工業	3.1	4.7	5,757	キョーソマアテックジャパン	28.9	35.9	89,821	タキヒヨー	4	4.1	5,781			
デリカフーズホールディングス	5.2	6	3,222	西華産業	6.2	7.9	12,687	蔵玉産業	1.9	2.2	4,037			
スターティアホールディングス	2.3	3.4	2,590	佐藤商事	10	12.1	14,023	スズケン	49.3	56.6	200,647			
コマダホールディングス	25.4	31.6	67,782	菱洋エレクトロ	8.8	8.6	17,397	ジェコス	8.2	10.8	8,640			
ピーバンドットコム	1.5	2.4	1,521	東京産業	11	13.2	9,438	グローセール	12.9	17.1	7,609			
アセンテック	2.9	4.9	3,474	ユアサ商事	12	13.8	40,020	小売業 (4.2%)						
富士興産	3.5	3.8	3,689	神鋼商事	2.7	3.4	12,750	ローソン	29.5	32.1	154,240			
協栄産業	1.5	1.7	2,618	トルク	5.8	6	1,272	サンエー	8.8	11	44,935			
フルサト・マルカホールディングス	-	14	30,716	阪和興業	23.2	28.9	95,370	カワチ薬品	8.1	11.3	26,577			
ヤマエグループホールディングス	-	9.8	10,201	正栄食品工業	7.5	9.4	38,352	イービーシー・マート	18.1	22.7	118,040			
小野建	10.7	14.3	24,238	カナデン	9.6	12	12,060	ハードオフコーポレーション	5.4	6.9	5,319			
南陽	2.1	2.3	4,473	菱電商事	8.4	11.6	20,218	アスグル	10.1	32.7	54,249			
佐鳥電機	7.4	9.1	8,399	フルサト工業	6.3	-	-	ゲオホールディングス	15.6	19.4	22,445			
エコトレーディング	2.6	2.9	1,722	岩谷産業	27.9	34.8	183,744	アダストリア	16.1	15.5	27,125			
伯東	7.1	8.7	19,783	ナイス	4.7	5.1	9,205	ジーフト	7.6	10	3,170			
コンドーテック	9.2	11.6	11,982	昭光通商	3.4	-	-	シー・ヴィ・エス・バイエリア	2	2.3	869			
中山福	7.1	7.6	3,108	ニチモウ	1.6	2.4	6,182	くら寿司	6.9	15.1	55,115			
ナガイレベン	15.5	19.3	40,916	極東貿易	3	4.1	10,893	キャンドゥ	5.6	5.3	10,780			
三菱食品	12.9	14.2	45,298	アステナホールディングス	15.2	20.3	8,363	アイケイ	2.5	4	1,544			
松田産業	8.5	10.7	25,209	三菱石油	28.7	35.6	32,716	バルグループホールディングス	10.2	12.6	20,878			
第一興商	17.3	27.5	91,850	稲畑産業	27.9	31.8	64,617	エディオン	49.3	66.3	73,924			
メディアILホールディングス	116.7	156.2	339,266	G S I クレオス	2.8	6.9	7,741	サーラコーポレーション	23.9	29.6	18,766			
S P K	5.2	6	7,668	明和産業	10.8	13.3	14,856	ワッツ	5.2	7.2	4,960			
視原電気ホールディングス	4.4	5.4	10,675	クワサホールディングス	4.4	4.6	2,865	ハローズ	4.4	6.7	18,900			
アズワン	8.3	21.1	129,132	ヤマエク野	8.5	-	-	フジオフードグループ本社	9.8	12.3	16,605			
スズデン	3.5	5.3	10,732	ワキタ	22.9	31	31,434	あみやき亭	2.5	3.4	9,860			
尾家産業	3	3.2	3,184	東邦ホールディングス	37.3	46.5	87,373	ひらまつ	21.9	30.8	5,821			
シモジマ	6.5	9	9,117	サンゲツ	31.5	38.4	60,364	大黒天物産	2.7	4.7	22,419			
ドウシシャ	11	13.8	20,920	ミツロコグループホールディングス	17.1	21.3	21,917	ハニーズホールディングス	9.1	11.5	11,879			
小津産業	2.3	2.5	4,920	シナネンホールディングス	4.3	5.4	17,685	ファミリーホールディングス	3.3	4	2,860			
高速	6.3	8.8	12,944	伊藤忠エネクス	26	32.1	33,448	アルペン	8.9	11.2	23,990			
たけびし	3.5	5.6	8,092	サンリオ	32.6	44.9	105,290	ハブ	3.6	4.8	2,836			
リックス	2.2	2.5	3,875	サンワ テクノス	7.6	8.8	11,915	クオールホールディングス	15.7	17.8	23,745			
丸文	10.6	12.7	9,258	リョーサン	12.8	16	36,576	ジンスホールディングス	6.2	9.9	66,528			
ハピネット	9.7	12.1	18,452	新光商事	15.9	22	19,162	ビックカメラ	69	85.7	88,271			
根本総業ホールディングス	2	3	6,027	トナーホー	5.4	6.8	7,289	DCMホールディングス	71.9	89.3	98,578			
日本ライフライン	37.6	42.9	42,942	三信電気	6.4	6.8	11,131	ペッパーフードサービス	13.2	19.7	6,934			
タカショー	7.4	11	7,271	東陽テクニカ	12.2	14.3	15,015	Monotaro	82.8	183.1	337,087			
マルカ	3.8	-	-	モスフードサービス	16.5	19.1	57,777	東京一番フーズ	2.6	4	2,372			
I DOM	39.3	43.9	29,544	加賀電子	10.5	13.1	42,837	DDホールディングス	5.2	7.7	4,365			
進和	7	8.7	17,748	ソーダニッカ	11.3	15.1	13,423	きちりホールディングス	3.4	4.1	1,455			
エスケイジャパン	2.7	3.3	1,382	立花エレクトック	8.7	11.7	18,532	アークソービスホールディングス	9.7	10.8	23,727			
グイトロン	5	6.3	12,814	フォーバル	4.3	6.6	6,177	J. フロント リテリング	139	172.8	185,932			
シークス	14.8	20.6	27,047	P A L T A C	18.7	20.3	89,624	トール・プレスホールディングス	18.4	25	40,125			
田中商事	3.1	3.3	2,128	三谷産業	15.6	17.1	5,232	マツキョココカラ&カンパニー	48.1	89.1	363,528			
オーハンテックニカ	6.2	8.2	11,693	太平洋興発	5.1	5.6	3,662	ブロンコビリー	6.1	8.3	18,467			
白鋼	3.6	4.7	12,502	B&W smeltacホールディングス	2.6	3.4	10,642	ZOZO	68.7	99.8	306,386			
ダイコー通産	1.1	1.7	2,012	ヤマシタヘルスカホールディングス	1.1	1.2	2,354	トロジーア・ファクトリー	3.4	4.3	4,089			
伊藤忠商事	814.6	1,012.8	3,766,603	コア商事ホールディングス	3.3	10.9	6,714	物語コーポレーション	3.1	7.2	45,216			
丸紅	1,148.1	1,428.3	1,684,679	国際紙パルプ商事	25.5	30	9,450	ココカラファイン	10.4	-	-			
高島	1.6	2.3	5,444	ヤマダネ	5.3	6.9	11,102	三起伊勢丹ホールディングス	203.4	253.3	236,582			
長瀬産業	65.5	79.6	144,872	丸紅建材リース	0.9	1.1	1,967	Hamee	2.9	3.8	4,111			
蝶理	7.5	8.2	14,678	日鉄物産	8.3	10.4	55,224	マーケットインタープライズ	-	1.1	860			
豊田通商	116.9	145.3	717,782	泉州物産	3.3	4.1	25,953	ウエルシアホールディングス	61.5	76.6	239,758			
三共生興	18	19.6	11,074	トラスコ中山	26.7	30.2	75,349	クワイエットSDホールディングス	17.1	21.3	66,988			
兼松	46.5	53.9	69,800	オートバックセブン	43.2	48.8	68,954	丸藤CH1ホールディングス	15.4	18.9	6,898			
ツカモトコーポレーション	1.7	1.8	2,354	モリト	9	10.9	7,957	ミサワ	2.4	3	1,965			
三井物産	945.5	1,124.4	3,333,846	加藤産業	16.9	21	69,090	ティーライフ	1.7	2	2,630			
日本紙パルプ商事	6.1	7.7	30,684	北恵	3.2	4	3,472	イー・ビーホールディングス	1.9	2.2	965			
カメイ	15.2	17.1	17,698	イノテック	6.6	8.7	12,815	チームニー	3.5	4.6	5,349			
東都水産	1.4	0.6	2,361	イエローハット	21.9	25.1	42,017	シュッピン	7.9	12	12,948			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	千円	株	数	千円		株	数	千円	株	数	千円		株	数	千円	株	数	千円
阿波銀行							プレミアグループ						テオーシー							
大分銀行							ネットプロダクションホールディングス						東京楽天地							
宮崎銀行							クレディセゾン						レオパレス 2 1							
住信銀行							芙蓉総合リース						スターツコーポレーション							
沖縄銀行							みずほリース						フジ住友							
琉球銀行							東京センチュリー						空港施設							
セブ銀行							日本証券金融						明和地所							
みずほフィナンシャルグループ							アイフル						ゴールドフレスト							
高知銀行							リコーリース						エスリード							
山フィナンシャルグループ							イオンフィナンシャルサービス						日神グループホールディングス							
長野銀行							アコム						日本エスコ							
名古屋銀行							ジャックス						タカラレーベン							
北洋銀行							オリエントコーポレーション						AVANTIA							
愛知銀行							日立キャピタル						イオンモール							
中京銀行							オリックス						毎日コムネット							
大光銀行							三菱HCキャピタル						ファースト住建							
愛媛銀行							九州リースサービス						ランド							
トマト銀行							日本取引所グループ						カチタス							
京葉銀行							イー・キャランティ						トーセイ							
栃木銀行							アサックス						穴吹興産							
北日本銀行							NECキャピタルソリューション						サンフロンティア不動産							
東和銀行							不動産業 (1.9%)						FJネクストホールディングス							
福島銀行							いちご						インテリクス							
大東銀行							日本駐車場開発						ランドビジネス							
トモニホールディングス							スター・マイカ・ホールディングス						サンネクスタグループ							
フィデアホールディングス							SREホールディングス						グランディハウス							
池田泉州ホールディングス							ADワックスグループ						日本空港ビルデング							
証券・商品先物取引業 (0.8%)							ヒューリック						サービス業 (5.9%)							
F P G							三栄建築設計						明豊ファシリティアワークス							
ジャイアントバスタードバイザー							野村不動産ホールディングス						日本工営							
マーキュリアインバースメント							三菱投資グループホールディングス						LIFULL							
マーキュリアホールディングス							サムティ						ミクシィ							
SBIホールディングス							ディア・ライフ						ジェイシーリクルーメント							
日本アジア投資							コーセーアールイー						日メ&Aセンターホールディングス							
ジャフコ グループ							地主						メンバーズ							
大和証券グループ本社							フルサンスコーポレーション						中広							
野村ホールディングス							THEグループバル社						UTグループ							
岡三証券グループ							ハウスコム						アイティメディア							
丸三証券							日本管理センター						タケエイ							
東洋証券							サンセイランディック						E・Jホールディングス							
東証フィナンシャル・ホールディングス							エストラスト						興亜ビネックスグループ							
光世証券							フージャースホールディングス						コジダカホールディングス							
水戸証券							オープンハウスグループ						アルトナー							
いちよし証券							東急不動産ホールディングス						パソナグループ							
松井証券							協団グループホールディングス						CDS							
マネックスグループ							イーブランド						リングアンドモビーベーション							
極東証券							ムゲンエステート						GCA							
岩井コスモホールディングス							ビーロッド						エス・エム・エス							
アイザワ証券グループ							ファーストプラザーズ						サニサイドグループ							
マネーパートナーズグループ							And Doホールディングス						パソナホールディングス							
スパークス・グループ							シーアールイー						リニカル							
小林洋行							プロ/ティエージェンツ						クックパッド							
保険業 (2.3%)							ケイアイスター不動産						エスクリ							
かんぽ生命保険							アグレ都市デザイン						アイ・ケイ・ケイホールディングス							
SOMPOホールディングス							グッドコムアセット						学情							
アニコム ホールディングス							ジェイ・エス・ビー						スタジオアリス							
MS&ADインシュアランスグループホールディングス							テンポイノベーション						ジミックホールディングス							
第一生命ホールディングス							グローバル・リンク・マネジメント						エポコ							
東京海上ホールディングス							フェイスネットワーク						NJS							
T&Dホールディングス							パーク 2 4						総合整備保障							
アドバンスクリエイト							パラカ						カガクコム							
その他金融業 (1.2%)							宮越ホールディングス						アイロムグループ							
全国保証							三井不動産						セントケア・ホールディング							
あんしん保証							三菱地所						サイネックス							
ジェイリース							平和不動産						リネサンス							
イントラスト							東京建物						ディップ							
日本モーゲージサービス							ダイビル						デジタルホールディングス							
CASA							京阪神ビルディング						新日本科学							
アルヒ							住友不動産						ツクイホールディングス							

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

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

■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	399,670,143,174円
一 般 金 庫	11,420,891,042
株 式 (評 価 額)	387,140,847,090
未 収 入 金	11,243,540
未 収 入 金	655,237,202
未 収 入 金	441,924,300
(B) 負 債	2,333,527,720
未 払 金	909,720
未 払 金	2,332,618,000
(C) 純 資 産	397,336,615,454
元 本	124,570,625,521
次 期 繰 越 損 益	272,765,989,933
(D) 受 取 金	124,570,625,521円
1 万 円 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	31,896円

(注1) 期首元本額 102,109,610,506円
 追加設定元本額 163,175,331,486円
 一部解約元本額 140,714,316,471円

(注2) 期末における元本の内訳
 MHAMスリーウェイクオープン 561,857,238円
 MHAM TOP I X オープン 2,725,686,605円
 MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ) 7,087,968,915円
 One DC 国内株式インデックスファンド 20,422,344,253円
 D I AM国内株式バッシブ・ファンド 4,704,569,337円
 M I T O ラップ型ファンド (安定型) 3,424,028円
 M I T O ラップ型ファンド (中立的) 23,972,661円
 M I T O ラップ型ファンド (積極型) 78,308,323円
 グローバル8資産ラップファンド (安定型) 28,249,023円
 グローバル8資産ラップファンド (中立的) 21,103,225円
 グローバル8資産ラップファンド (積極型) 15,896,115円
 たわらノーロード TOP I X 1,306,069,812円
 たわらノーロード バランス (8資産均等型) 1,033,861,326円
 たわらノーロード バランス (堅実型) 40,906,841円
 たわらノーロード バランス (標準型) 262,619,504円
 たわらノーロード バランス (積極型) 394,664,404円
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) 3,669,806円
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) 174,139,464円
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) 434,342,242円
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) 283,511,087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) 405,598,982円
 たわらノーロード 最適化バランス (保守型) 705,164円
 たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 2,916,286円
 たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 36,588,931円
 たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 6,020,593円
 たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 19,092,798円
 D I AM国内株式インデックスファンド<DC年金> 34,009,153,068円
 Oneグローバルバランス 5,199,858円
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 1,065,319,872円
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 3,512,005,009円
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 3,794,173,475円
 D I AM DC バランス30インデックスファンド 3,343,318,358円
 D I AM DC バランス50インデックスファンド 1,113,385,483円
 D I AM DC バランス70インデックスファンド 1,115,312,187円
 マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 30,317,366円
 マネックス資産設計ファンド (育成型) 1,055,563,450円
 マネックス資産設計ファンド エゴリユーション 18,529,124円
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10) 304,544,955円
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20) 306,459,778円
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30) 545,764,310円
 投資のソムリエ 13,743,021,171円
 フルーズコントロール 128,837,057円
 投資のソムリエ<DC年金> 831,424,634円
 D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金> 337,759,108円
 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> 549,884,906円
 D I AMコア資産設計ファンド (堅実型) 1,701,235円
 D I AMコア資産設計ファンド (積極型) 5,513,567円
 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 559,030,369円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 3,846,898,552円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) 41,503,360円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) 20,515,309円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 4,618,660円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) 146,712,017円
 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> 348,653,940円
 リスクコントロール世界資産分散ファンド 2,393,008,159円
 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 279,145,423円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) 42,977,458円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) 17,916,384円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) 15,092,602円
 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> 105,875,155円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065) 985,477円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) 22,944,960円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) 23,431,080円
 マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) 21,508,092円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) 14,273,870円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) 22,637,856円
 インカム重視マルチアセット運用ファンドI2021-04 (適格機関投資家限定) 193,585,816円
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05 41,677,610円
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06 84,110,969円
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-07 68,984,011円
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-08 47,924,787円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) 22,733,018円
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-09 49,987,822円
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-12 70,694,127円
 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 329,597,803円
 D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) 34,825,039円
 日米興業総合戦略ファンド (インカム重視) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定) 116,640,502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) 39,121,859円
 リスクコントロール8資産/トランスファンド (FOF 5用) (適格機関投資家専用) 7,907,522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) 57,045,218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) 101,888,672円
 D I AM国際分散/トランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 4,956,036円
 D I AM国際分散/トランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 26,722,846円
 D I AM国内重視/トランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 5,712,676円
 D I AM国内重視/トランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 1,338,373円
 D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 7,152,634円
 D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 34,835,196円
 D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 557,427,217円
 D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) 634,827,723円
 D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 1,809,585,772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) 31,302,862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) 31,388,733円
 D I AM アサahi グローバル/トランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 301,727,248円
 D I AM世界アセット/トランスファンドVA (適格機関投資家限定) 74,733,048円
 D I AM世界/トランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 1,406,645円
 D I AM世界アセット/トランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 349,638,985円
 D I AM世界アセット/トランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 20,826,409円
 D I AM世界アセット/トランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 73,311,471円
 D I AM世界アセット/トランスファンド3VA (適格機関投資家限定) 173,199,524円
 D I AM世界アセット/トランスファンド4VA (適格機関投資家限定) 237,769,545円
 D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) 38,321,734円
 D I AM国内バランス30VA (適格機関投資家限定) 18,177,991円
 D I AM世界アセット/トランスファンド7VA(121) (適格機関投資家限定) 291,737,796円
 D I AM世界アセット/トランスファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定) 936,557,239円
 D I AM世界アセット/トランスファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定) 1,240,495,959円
 D I AM世界アセット/トランスファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定) 49,936,951円
 動的パッケージファンド<DC年金> 19,960,341円
 コア資産形成ファンド 13,478,680円
 MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用) 692,612,483円
 MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用) 65,067,902円
 MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定) 2,686,127,829円
 MHAM日本株式バッシブファンド (適格機関投資家限定) 2,050,559,819円
 期末元本合計 124,570,625,521円
 担保資産
 代用として担保を提供している資産はありません。

■損益の状況

当期 自2021年2月9日 至2022年2月7日

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

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

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

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