

## 運用報告書 (全体版)

第18期<決算日2021年2月8日>

### DIAM 国内株式インデックスファンド<DC年金>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/株式 (インデックス型)				
信託期間	2002年11月15日から無期限です。				
運用方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に連動する投資成果を目標として運用を行います。				
主要投資対象	<table border="1"> <tr> <td>DIAM 国内株式インデックス ファンド&lt;DC年金&gt;</td> <td>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。</td> </tr> <tr> <td>国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド</td> <td>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。</td> </tr> </table>	DIAM 国内株式インデックス ファンド<DC年金>	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。	国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド	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。
DIAM 国内株式インデックス ファンド<DC年金>	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。				
国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド	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	最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。株式 (株価指数先物取引を含みます。) の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。				
組入制限	マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合には、制限を設けません。				
分配方針	毎決算時 (原則として2月7日。休業日の場合は翌営業日。) に経費控除後の利子、配当収入および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額を分配対象額として、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。				

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>」は、2021年2月8日に第18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国内株式インデックスファンド<DC年金>

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税込み 騰落率		東証株価指数(TOPIX) (配当込み) (ベンチマーク) 騰落率		株式組 入率	株式先 物比率	式 物率	純資 産額
		円	%	ポイント	%				
14期 (2017年2月7日)	22,799	0	12.0	2,161.36	12.3	97.6	2.3	%	百万円 82,440
15期 (2018年2月7日)	26,806	0	17.6	2,547.46	17.9	98.1	0.8	%	95,638
16期 (2019年2月7日)	24,513	0	△8.6	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	%	93,647
17期 (2020年2月7日)	27,679	0	12.9	2,642.55	13.2	97.5	2.4	%	99,688
18期 (2021年2月8日)	31,417	0	13.5	3,006.47	13.8	97.7	2.3	%	108,479

(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、(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) (配当込み) (ベンチマーク) 騰落率		株式組 入率	株式先 物比率
	円	%	ポイント	%		
(期首) 2020年2月7日	27,679	—	2,642.55	—	97.5	2.4
2月末	24,146	△12.8	2,305.76	△12.7	97.8	1.9
3月末	22,700	△18.0	2,167.60	△18.0	100.1	3.3
4月末	23,676	△14.5	2,261.88	△14.4	97.1	3.0
5月末	25,284	△8.7	2,416.04	△8.6	92.2	2.2
6月末	25,237	△8.8	2,411.45	△8.7	97.4	2.6
7月末	24,217	△12.5	2,314.39	△12.4	98.2	1.8
8月末	26,190	△5.4	2,503.59	△5.3	97.8	2.4
9月末	26,520	△4.2	2,536.14	△4.0	96.6	3.4
10月末	25,763	△6.9	2,464.21	△6.7	96.8	2.8
11月末	28,631	3.4	2,738.72	3.6	97.0	3.2
12月末	29,473	6.5	2,819.93	6.7	97.1	2.7
2021年1月末	29,534	6.7	2,826.50	7.0	97.6	2.4
(期末) 2021年2月8日	31,417	13.5	3,006.47	13.8	97.7	2.3

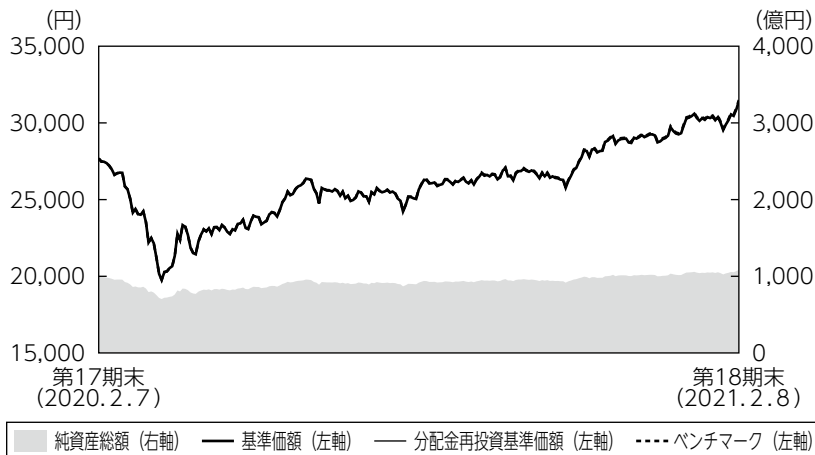
(注1) 騰落率は期首比です。

(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2月8日から2021年2月8日まで）

### 基準価額等の推移



第18期首：27,679円  
第18期末：31,417円  
(既払分配金0円)  
騰落率：13.5%  
(分配金再投資ベース)

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

### 基準価額の主な変動要因

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

### ●当ファンド

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

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

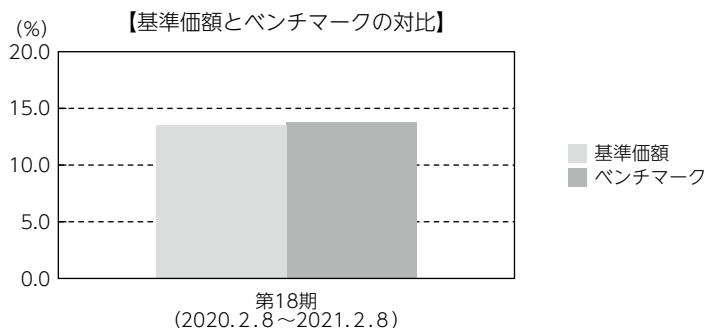
ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

※運用状況については14ページをご参照ください。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で13.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.3%下回りました。信託報酬の影響を除くと、ベンチマークにほぼ連動する投資成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2020年2月8日 ～2021年2月8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	21,416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18期		項目の概要
	(2020年2月8日 ～2021年2月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	63円	0.243%	(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26,118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)	(23)	(0.088)	
(販売会社)	(32)	(0.121)	
(受託会社)	( 9)	(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	0.001	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(監査費用)	( 0)	(0.001)	
合計	64	0.245	

(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。

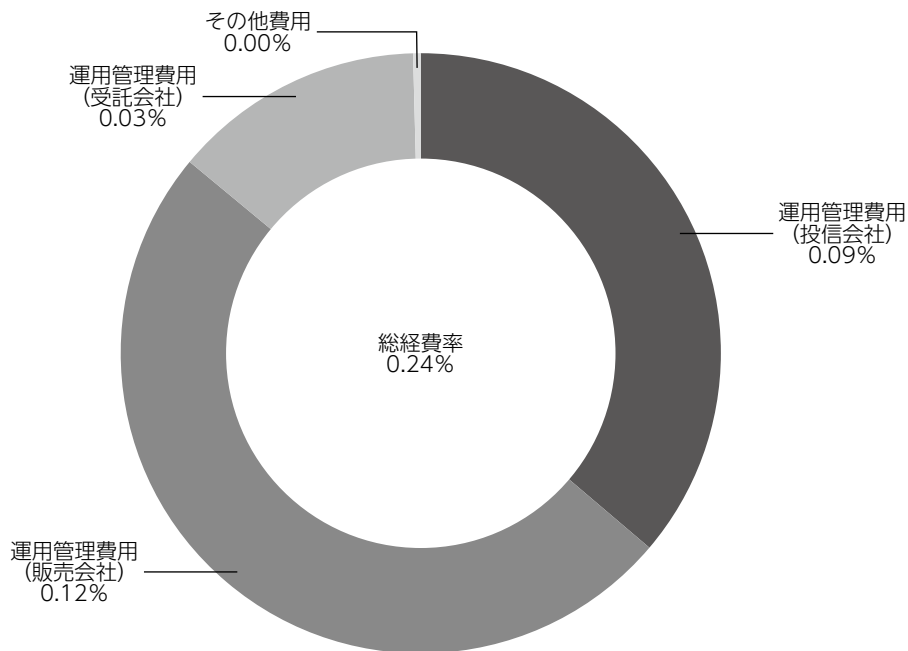
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.24%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年2月8日から2021年2月8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	2,814,544	7,046,174	4,398,764	11,558,554

## ■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	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）

### 【D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>における利害関係人との取引状況等】

#### (1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

#### (2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	1,411千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	78千円
(B)／(A)	5.6%

(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 127,938	百万円 6,656	% 5.2	百万円 112,472	百万円 7,504	% 6.7

平均保有割合 38.0%

(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		当 期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 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	期 末 保 有 額
株 式		百万円 250

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□ 36,349,147	千□ 34,764,926	千円 108,473,525

## ■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
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	108,473,525	99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	502,547	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	108,976,072	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	108,976,072,870円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	376,498,757
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)	108,473,525,113
未 収 入 金	126,049,000
(B) 負 債	496,185,597
未 払 解 約 金	376,125,780
未 払 信 託 報 酬	119,593,164
そ の 他 未 払 費 用	466,653
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	108,479,887,273
元 本	34,529,357,931
次 期 繰 越 損 益 金	73,950,529,342
(D) 受 益 権 総 口 数	34,529,357,931口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	31,417円

(注) 期首における元本額は36,015,594,875円、当期中における追加設定元本額は10,052,653,018円、同解約元本額は11,538,889,962円です。

## ■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	△117,731円
受 取 利 息	22,156
支 払 利 息	△139,887
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	14,893,037,193
売 買 損 益	16,067,306,834
売 買 損 益	△1,174,269,641
(C) 信 託 報 酬 等	△225,611,159
(D) 当 期 繰 越 損 益 金(A+B+C)	14,667,308,303
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	13,481,343,637
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	45,801,877,402
(配 当 等 相 当 額)	(44,385,096,918)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,416,780,484)
(G) 合 計(D+E+F)	73,950,529,342
次 期 繰 越 損 益 金(G)	73,950,529,342
追 加 信 託 差 損 益 金	45,801,877,402
(配 当 等 相 当 額)	(44,385,096,918)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,416,780,484)
分 配 準 備 積 立 金	28,148,769,671
繰 越 損 益 金	△117,731

(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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	14,667,300,867
(c) 収益調整金	45,801,877,402
(d) 分配準備積立金	13,481,468,804
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	73,950,647,073
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	21,416.75
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

# 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第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	株式先物率	純資産額
	期騰	期中落率	(配当込み) ベンチマーク	期中落率			
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）。

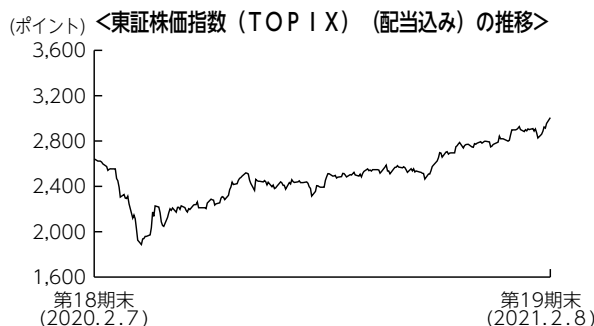
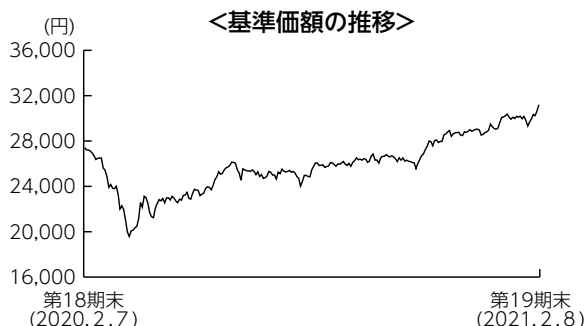
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2020年 2月7日	円 27,423	% -	ポイント 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	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円
バルカー				千株	日本山村硝子				千株	古河機械金属				千株
ユニ・チャーム	8.8	9.7	20,622		日本電気硝子	4.5	5.3	4,833		エス・サイエンス	19	19.3	25,765	
ジョーエコーポレーション	207.9	250.8	1,171,236		オハラ	43.3	43.8	107,397		大崎チタニウムテクノロジーズ	47.6	54.7	2,461	
<b>医薬品 (5.7%)</b>	1.2	2.6	2,727		住友大阪セメント	4.3	4.7	8,892		東邦チタニウム	11.1	12	9,972	
協和キリン	108.4	119	379,015		太平洋セメント	20.4	21.3	71,355		UACJ	19.1	20.9	19,395	
武田薬品工業	897.1	983.7	3,584,602		日本ヒューム	68.1	70	197,120		C Kサンエツ	16.2	17.7	40,656	
アステラス製薬	948.4	1,025.1	1,882,083		日本コクリート工業	10.8	11	8,690		古河電気工業	1.9	2.1	8,158	
大日本住友製薬	79.9	87.6	164,512		三谷セキサン	23.4	25.4	8,280		住友電気工業	33.1	36.4	106,142	
塩野義製薬	137.9	148.7	883,426		アジパイルホールディングス	5	5.5	27,775		フジクラ	398.6	407.9	652,232	
わかもと製薬	13	14.3	3,532		東海カーボン	15.3	18.5	9,342		昭栄ホールディングス	128.7	141.1	77,605	
あすか製薬	12.3	13.4	20,314		日本カーボン	112.9	115.5	180,988		東京特殊電線	12.3	11.3	21,470	
バイオフェルミン製薬	28.3	33.5	269,675		東洋炭素	5.5	6.5	27,072		タツタ電線	1.6	1.5	3,870	
中外製薬	1.7	2.2	5,658		ノリタケカンパニーリミテド	6.3	7	14,329		カナレ電気	21.1	20.6	14,440	
科研製薬	112.4	369.8	1,982,497		TOTO	5.9	6.6	24,156		平河ヒューテック	1.7	2.2	3,916	
イーザイ	18.5	20.2	83,426		日本硝子	77	84.5	612,625		リョービ	4	6.5	7,956	
ロート製薬	129	130.6	1,020,377		日本特殊陶業	131.6	130	248,430		アーレスティ	13.2	14.2	18,616	
小野薬品工業	55.3	56.3	181,849		ダントーホールディングス	83.9	90	179,910		アサヒホールディングス	14	14.6	5,956	
久光製薬	247.6	271.5	856,854		MARUWA	8	8.6	3,706		<b>金属製品 (0.6%)</b>	18.7	21.9	93,294	
持田製薬	28.5	34.4	226,008		品川フラクトリーズ	4.2	4.1	44,936		稲葉製作所	6	6.7	9,601	
参天製薬	15	16.4	69,946		黒崎播磨	2.9	2.8	8,066		豊地エンジニアリンググループ	3.3	3.8	8,759	
扶桑薬品工業	200.8	205.7	353,392		ユーティ	2.1	2	9,830		トーカロ	29.6	30.2	43,004	
日本ケミファ	3.8	3.8	10,598		イソライト工業	8.6	8.6	8,101		アルファ	3.8	4.5	4,761	
ソムラ	1.4	1.2	2,703		東京窯業	5.5	5.3	3,121		SUMCO	127.7	149.6	338,694	
日医工	33.5	39.5	138,842		ニッカトール	13.8	15.7	5,243		川田テクノロジーズ	2.1	2.4	10,896	
キッセイ薬品工業	30.6	33.4	35,971		フジミンコ-ポレーテッド	4.9	5.4	4,152		RS Technologies	3.1	3.8	24,472	
生化学工業	19.1	20.9	49,135		クニミネ工業	9.6	9.5	38,475		ジェイテックホールディングス	1	1	3,855	
栄研化学	20.8	20.9	23,345		エーアンドエーマテリアル	4.4	3.8	4,993		信和	3	3	4,588	
鳥居薬品	19	20.8	48,672		ニチアス	1.8	2.4	2,625		野鐵グループホールディングス	4.6	6.4	4,588	
JCRファーマ	4.6	4.6	4,696		<b>鉄鋼 (0.7%)</b>	29.5	29.9	76,514		ホッカンホールディングス	67.9	74.5	100,426	
東和薬品	6.7	7.4	23,495		日本製鉄	15	16.5	55,687		コロナ	5.9	6	8,946	
富士製薬工業	7.3	8.1	11,064		神戸製鋼所	477.3	558.1	819,848		横河アリジックホールディングス	5.9	6.8	6,473	
沢井製薬	22.1	25.9	127,557		中山製鋼所	195.1	213.7	135,508		駒井ハルテック	19.9	20.1	40,099	
ゼリア新薬工業	19.6	21.5	46,547		合同製鐵	14.9	17.1	6,788		高田機工	0.9	0.8	5,296	
第一三共	308.5	1,015	3,273,375		ジェイエフイーホールディングス	5.7	6.3	13,097		三和ホールディングス	102.3	110.2	146,566	
キョーリン製薬ホールディングス	23.8	26.1	51,025		東京製鐵	287.9	338.2	364,579		文化シャッター	31.5	34.6	33,873	
大幸薬品	4.4	14.5	23,229		共英製鋼	52	45.6	34,792		三協立山	14.8	15	13,065	
ダイト	6.3	7.5	28,537		大和工業	12	13.1	18,929		アルインコ	7.8	7.8	7,612	
大塚ホールディングス	205.4	245.8	1,165,829		東京製鋼	22.6	24.9	68,574		東洋シャッター	2.5	2.4	1,682	
大正製薬ホールディングス	22.7	28.1	200,634		大阪製鐵	4.4	4.5	8,824		LIXIL	157.4	161	464,485	
ペプチドリーム	54.6	60.1	391,251		淀川製鋼所	4.4	4.5	8,824		日本フイルコン	8.3	8.5	4,309	
<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>					丸一鋼管	14.4	15.9	36,395		ノーリツ	22.1	24.3	39,438	
日本コークス工業	92.1	100.5	10,050		モリ工業	34.6	37.9	92,097		長府製作所	10.8	12	25,860	
ニチレキ	12.7	14	21,910		大同特殊鋼	3.2	3.5	8,193		リンナイ	20.7	22.7	252,197	
ユシロ化学工業	6	6.8	7,922		日本高周波鋼業	17.4	19.1	92,730		ダイニチ工業	5.7	5.7	5,033	
ピーピー・カストロール	3.9	4.3	5,400		日本冶金工業	4.2	4	1,528		日東精工	14.7	15.1	7,368	
富士石油	29	28.8	6,681		山陽特殊製鋼	8.9	9.1	18,627		三洋工業	1.4	1.3	2,455	
MORESCO	4	4.5	5,301		愛知製鋼	7.6	14	23,282		岡部	21.6	24.1	19,207	
出光興産	121.3	131.2	339,414		日立金属	6	6.6	21,813		ジーテクト	13.3	14.6	23,038	
ENEOSホールディングス	1,621.8	1,778.3	788,498		日本金属	114.8	110.3	191,922		日本発条	19.9	21.9	35,565	
コスモエネルギーホールディングス	31.2	37.3	88,550		大平洋金属	2.4	2.9	3,503		高周波熱錬	20.5	22.3	12,532	
<b>ゴム製品 (0.6%)</b>					新日本電工	7.2	7.8	17,643		東京製鋼	7.6	8.2	11,873	
横浜ゴム	62.4	68.4	124,556		栗本鐵工所	69.2	75.3	21,234		サンコール	6.1	10.3	4,923	
TOYO TIRE	61.9	62.4	113,452		缸技	5.3	5.4	9,579		モリテックスチール	8.4	9	3,807	
ブリヂストン	331.4	314.4	1,301,930		日本鑄鉄管	1.6	1.3	1,492		パイオラックス	15.7	17.3	28,493	
住友ゴム工業	96.9	106	110,770		三菱製鋼	1.1	1.4	1,828		エイチワン	10.5	11.6	9,767	
藤倉コンポジット	9.5	10.8	4,762		日亜鋼業	8	8.8	6,151		日本発条	114.3	116.4	99,522	
オカモト	6.5	7.3	29,382		日本精線	15.7	17.8	5,340		中央発條	1.2	1	2,803	
フコク	4.7	4.4	3,132		エンビロ-ホールディングス	1.7	1.7	6,613		アドパネクス	1.3	1.6	2,606	
ニッタ	12.1	12.2	30,841		シン-ンタナ	4.1	5.1	3,529		立川プラインド工業	4.7	5.3	7,080	
住友理工工	20.9	22.8	15,572		新家工業	16.6	14.5	3,146		三益半導体工業	8.4	9.1	24,151	
三ツ星ベルト	14.2	14.4	25,531		<b>新鉄金属 (0.8%)</b>	2.4	3.1	4,417		日本ドライケミカル	2.7	3	4,746	
バンドー化学	19	20.9	14,818		大紀アルミニウム工業所	17.5	17.7	14,248		日本製鋼所	32.3	35.5	113,422	
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>					日本軽金属ホールディングス	270	31.9	67,915		三浦工業	46.1	50.6	300,514	
日東紡績	16	17.5	87,237		三井金属鉱業	28.8	31.6	125,768		タクマ	36.1	39.6	90,960	
AGC	106.6	108.6	407,793		東邦亜鉛	5.5	6.5	15,938		ツガミ	22	24.2	41,019	
日本板硝子	51.5	59.8	36,179		三菱マテリアル	70.5	77.2	195,007		オークマ	12.4	13.6	85,680	
石塚硝子	1.9	2.1	3,929		住友金属鉱山	136.3	149.4	747,747		芝浦機械	12	12.2	34,147	
					DOWAホールディングス	27	29.6	126,836		アマダ	135.5	171.2	220,848	



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 値 額	株	数	評 価 額		株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数
		千株	千円			千株	千円			千株	千円			千株	千円			千株	千円	
日本電波工業	9.8	11.5	8,372	太陽誘電	47.9	52.5	308,175	T B K	12.9	11.8	5,298									
鈴木	5.8	5.3	6,333	村田製作所	316.7	347.3	3,288,236	エフセディ	14.7	16	26,592									
日本トリム	1.4	2.5	11,500	双葉電子工業	17	20.3	20,320	豊田合成	34.8	38.2	114,600									
ローランド ディー. ジー.	5.9	7	12,838	北陸電気工業	4.3	4.6	4,443	愛三工業	16.9	18.5	11,322									
フォスター電機	11.3	12.4	18,910	ニチコン	36.6	37.1	52,756	盟和産業	1.6	1.6	1,465									
S M K	2.8	3.1	9,501	日本ケミコン	8.2	11.9	20,658	日本プラス	8.4	10.3	5,963									
ヨコオ	6.9	8.7	28,710	K O A	16.2	16.3	27,106	ヨロズ	10.1	10.2	14,280									
ティアック	8	7.3	985	市光工業	16.1	17.6	13,710	エフ・シー・シー	17.6	19.3	32,539									
ホンデン	29.5	32.2	36,225	小糸製作所	64.6	70.8	544,452	シマノ	40.4	44.3	1,087,786									
ヒロセ電機	16.7	18.2	297,024	ミツバ	19.9	21.7	11,001	テイ・エス テック	25	27.4	86,858									
日本航空電子工業	24.7	27	45,873	SCREENホールディングス	18.7	20.5	171,995	ジャムコ	5.4	7	5,306									
T O A	11.5	14	12,670	キャノン電子	11.3	10.9	19,227	<b>精密機器 (2.6%)</b>												
マクセルホールディングス	23.3	23.4	34,351	キャノン	580.4	587.5	1,395,312	テルモ	305.1	362.5	1,653,000									
古野電気	13.9	15.1	17,938	リコー	274.3	300.7	282,658	クリエートメディック	3.6	4.2	4,124									
ユニデンホールディングス	3	3	7,113	象印マホービン	31.6	31.9	59,621	日機装	32.3	38.2	42,058									
スマグラーホールディングス	8.3	10	10,410	MUTOHホールディングス	1.4	1.2	1,868	日本エム・ディ・エム	6.2	6.8	14,708									
アイコム	6	4.9	13,940	東京エレクトロン	71.9	69.3	2,851,695	島津製作所	128.8	152.2	637,718									
リオン	4.5	5	15,975	<b>輸送用機器 (7.0%)</b>				J M S	9.2	10	11,540									
本多通信工業	9.4	9.4	4,690	トヨタ紡織	31.4	34.5	64,618	クボテック	2.8	3.1	1,159									
船井電機	10.9	13.4	6,324	芦森工業	2.2	2.4	2,460	長野計器	7.8	8.5	8,185									
横河電機	98.9	118.3	282,855	ユニプレス	20.9	19.3	21,654	ブイ・テクノロジ	5	5.5	35,200									
新電元工業	3.8	4.5	13,360	豊田自動織機	87.3	95.7	912,021	東京計器	6.9	7.5	7,177									
アズビル	68	80	404,800	モリタホールディングス	18.9	19	34,827	愛知時計電機	1.3	1.2	5,334									
東亜ディーケーケー	5.3	6.1	5,264	三櫻工業	13.7	16.3	15,273	インターアクション	5.8	5.9	15,045									
日本光電工業	44.6	48.9	154,035	デンソー	237.4	260.4	1,749,627	オーバル	9.8	10.7	3,520									
チノー	3.7	3.8	5,506	東海理化電機製作所	28.4	31.2	60,091	東京精密	19.5	19.9	90,744									
共和電業	11.3	13	5,187	井E&Sホールディングス	39	45.7	20,245	マニー	42.9	47	134,843									
日本電子材料	4.3	4.3	8,376	川崎重工	83.9	91.9	221,019	ニコン	174.4	180.4	162,179									
堀場製作所	21.3	23.4	165,438	名村造船所	34.7	35.7	6,961	トプコン	54.3	59.5	81,158									
アドバンテスト	80.2	87.9	777,036	サナリスホールディングス	13.2	15.5	2,464	オリンパス	596.7	654.2	1,336,857									
小野測器	4.2	4.3	2,390	日本車輛製造	4	4.3	11,145	理研計器	9.5	10.5	32,182									
エスベック	9.5	10.5	21,231	三菱ロジスネクスト	14.3	15.7	18,698	ダムロン	8.7	9.5	20,510									
キーエンス	97.7	116	6,583,000	近畿車輛	1.6	1.6	2,035	HOYA	215.3	234.6	3,065,049									
日置電機	5.6	5.7	23,740	日産自動車	1,271.6	1,394.4	877,914	シード	4.6	5.2	3,354									
シスメックス	77	92.2	1,095,797	いすゞ自動車	312.4	342.6	393,304	ノーリツ鋼機	7.2	10.6	23,415									
日本マイクロニクス	18.8	20.6	32,774	トヨタ自動車	1,203.1	1,197.8	9,626,718	イー・アンド・デイ	9.8	9.9	13,087									
メガチップス	10	11.9	35,200	日野自動車	134.6	147.7	146,518	朝日インテック	91.6	124.4	414,252									
OBARA GROUP	5.6	7	29,050	三菱自動車工業	399	437.1	135,938	シチズン時計	126.3	149.2	54,010									
藤蔭電機	1.3	1.3	2,701	エフテック	7.5	8.4	5,955	リズム	3.4	3.1	2,263									
原田工業	5.1	5	4,550	レシップホールディングス	4.4	4.6	2,829	大研医器	7.5	9.5	5,443									
コーセル	13.2	14.4	17,121	G M B	2	2.2	2,305	メニコン	14.8	18.1	120,908									
イリソ電子工業	9.1	9.9	50,985	ファルテック	1.9	2.3	1,731	シンシア	1.1	1.2	824									
オプテックグループ	17.6	19.4	37,830	武蔵精密工業	24	26.4	43,612	松風	4.9	5.5	10,274									
千代田インテグレイ	5	5.1	9,327	日産車体	21.1	17.3	15,760	セイコーホールディングス	15.2	16.6	26,609									
アイ・オー・データ機器	4	4.4	4,549	新明和工業	29.1	33.3	32,267	ニプロ	74.7	88.1	117,525									
レーザータック	47.3	51.9	703,764	極東開発工業	20	20.4	32,762	<b>その他製品 (2.5%)</b>												
スタンレー電気	75.8	82.9	291,808	日信工業	21.9	—	—	中本パックス	2.8	3.1	5,418									
岩崎電気	4.2	4.3	6,811	トビー工業	8.9	9.8	14,131	スノーピーク	5.1	7	14,378									
ウシオ電機	62.6	60.6	84,840	ティラド	3.9	3.7	5,901	パダマントパッドホールディングス	11.4	11.4	54,663									
岡谷電機産業	8.5	8.9	3,408	曙ブレーキ工業	59.3	64.1	10,961	トランザクション	6.9	6.4	7,180									
ハリス テクノ ホールディング	9.9	11.2	3,998	タチエス	17.6	18.1	21,683	粒美堂	3.2	3	1,218									
エノモト	3.3	3.3	5,824	N O K	57.9	57.2	81,224	ニホンフラッシュ	5	10.1	12,796									
日本セラミック	10.9	12	36,360	フタバ産業	30.1	29.6	16,605	前田工業	11.8	13	37,388									
遠藤照明	5.4	6.7	3,912	K Y B	12	13.2	34,848	永大産業	14.3	16.8	5,292									
古河電池	7.6	8.4	14,086	大同メタル工業	20.7	24.6	13,677	アートネイチャー	11.5	11.6	7,992									
双信電機	5.4	5.8	2,615	プレス工業	53.5	58.5	20,884	パダイナムホールディングス	111.5	97.8	903,574									
山一電機	7.9	7.6	11,947	ミクニ	13.7	16.1	4,620	アイフィスジャパン	2.8	3.2	2,307									
図研	7	7.7	23,600	太平洋工業	22.5	24.8	30,975	共立印刷	18.4	21.9	2,825									
日本電子	21.2	21.6	90,504	ケーヒン	24.8	—	—	S H O E I	5.2	10.4	44,200									
カシオ計算機	95.4	95.1	190,580	河西工業	14.5	16.2	7,306	フラスワットホールディングス	15.3	15.5	15,138									
ファナック	102.4	103.8	2,932,869	アイシン精機	88.7	86.5	311,400	パイロットコーポレーション	17.5	20.9	67,402									
日本シイエムケイ	25.4	25.5	11,908	マツダ	317.2	370.8	358,192	萩原工業	6	6.7	9,922									
エンプラス	5.5	5.3	26,553	今仙電機製作所	10	10.4	7,904	トッパン・フォームズ	23.2	21.2	24,104									
大真空	4	4	9,624	本田技研工業	849	930.9	2,804,801	フジールインターナショナル	24.2	24.3	50,082									
ローム	47.8	49.2	551,532	スズキ	213.7	234.4	1,166,843	タカラトミー	48.3	52.9	50,731									
浜松ホトニクス	77.3	84.8	541,872	S U B A R U	334.7	338.8	717,239	廣済堂	7.5	8.1	6,868									
三井ハイテック	11.9	11.6	47,792	安永	5.2	5.7	7,119	エステールホールディングス	2.8	4	2,584									
新光電気工業	36.2	39.7	107,348	ヤマハ発動機	140.6	167.1	413,906	アーク	41.5	—	—									
京セラ	151.7	180.2	1,248,786	ショーワ	25.4	—	—	タカノ	4.2	4.5	2,704									







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
		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	2.3	2,454	佐藤商事	8.8	10	9,850	スズケン	45	49.3	212,236
コメ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	7,986
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	6,566
アセンテック	0.8	2.9	5,417	ユアサ商事	10.1	12	39,480	<b>小売業 (4.7%)</b>			
富士興産	3.3	3.5	4,665	神鋼商事	2.7	2.7	5,402	ロソーン	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	37,708
小野健	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	24,624
南陽	2.1	2.1	3,540	正栄食品工業	6.8	7.5	29,437	イーピーシー・マート	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	4,266
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	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	19,874
コンドレーテック	8.3	9.2	9,926	岩谷産業	23.6	27.9	180,234	アダストラリア	14.7	16.1	34,212
中山福	6.2	7.1	3,819	ナイス	4.6	4.7	7,764	ジープフト	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・ワイ・エス・バイエリア	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	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	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	2,247
メディバ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	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	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	サラクコーポレーション	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	4,664
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	ハローズ	4	4.4	13,860
尾家産業	3.1	3	3,978	ヤマエ久野	—	8.5	9,613	フジオフードグループ本社	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	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	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	16,200
高速	3.3	6.3	10,111	ミツ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	9,236
たけがし	6.5	3.5	5,565	シナ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	2,577
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	20,108
丸文	9.4	10.6	5,989	サンリオ	29.8	32.6	55,452	ハブ	3.1	3.6	2,535
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	22,011
橋本建築ホールディングス	2.1	2	5,008	リョーサン	11.7	12.8	30,438	ジンスホールディングス	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	6.9	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	78,083
エクセル	3.1	—	—	三信電気	5.7	6.4	13,344	ペッピーフードサービス	8.5	13.2	3,722
マルカ	3.8	3.8	7,527	東陽テクニカ	12.2	12.2	14,554	Monotaro	75.5	82.8	475,272
↑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	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	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	2,080
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	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	139,139
田中商事	3.4	3.1	2,176	PAL TAC	17	18.7	108,273	トール・ドレスホールディングス	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	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	14,139
ダイコー通産	—	1.1	1,741	smallsatcホールディングス	1.9	2.6	7,254	ZOZO	73	68.7	246,976
伊藤忠商事	742.8	814.6	2,526,074	ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.8	1.1	1,706	トレジャー・ファクトリー	3.2	3.4	2,760
丸紅	1,105.3	1,148.1	853,956	コー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	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	79,560
長瀬産業	59.8	65.5	114,297	ヤマタネ	5.3	5.3	7,568	三井伊勢丹ホールディングス	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	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	222,630
三共生興	16	18	9,396	泉州電業	3.3	3.3	11,022	クワイエSDホールディングス	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	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	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	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	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	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	7,497
東都水産	1.3	1.4	4,963	イエローハット	20.1	21.9	39,288	オイシックス・ラ・大地	—	11.5	35,707
OUGホールディングス	1.6	1.8	5,122	J Kホールディングス	9.6	10.7	9,137	ネクステージ	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	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	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	—	—
住友商事	670	734.9	1,094,633	東通電機産業	30.2	31.1	78,745	ホットランド	7.1	8.6	10,732
内田洋行	4.5	4.6	20,447	因テック	3.5	3.9	11,111	すかいらくホールディングス	119	130.4	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	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	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	5,048
西華産業	6	6.2	8,872	蔵王産業	2.1	1.9	2,650	2019年12月31日現在 株式会社	30.9	33.9	39,188



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
山口フィナンシャルグループ	132.8	145.4	92,474	213.7	234.5	110,684	日興グループホールディングス	15.7	17.6	7,990				
長野銀行	3.5	3.9	4,992	213.7	234.5	110,684	日本エスコ	19.2	21.1	16,521				
名古屋銀行	8.6	9.4	26,263	11.7	12.8	27,737	タカラレーベン	48.7	48.6	16,961				
北洋銀行	160.2	176	40,832	287.8	315.1	45,059	AVANTIA	6	6.6	6,072				
愛知銀行	3.9	3.9	11,352	25.1	27.5	79,227	イオンモール	53.3	58.4	108,215				
中京銀行	4.4	4.3	7,817	51.2	—	—	毎日コムネット	2.2	3.5	2,418				
大光銀行	3.7	3.5	4,501	665.2	723.4	1,331,779	ファースト住建	4.6	5	5,535				
愛媛銀行	14.9	16.5	16,153	269.9	262.4	149,830	ランド	589.5	624.6	6,246				
トマト銀行	4.1	4.5	4,810	5	6.5	4,257	カチタス	13.2	28.9	90,746				
京葉銀行	45.3	49.7	21,718	305.3	315	800,257	トーセイ	14.7	16.1	17,339				
栃木銀行	51.4	56.1	10,210	11.4	13.3	32,731	穴吹興産	2.2	2.7	4,514				
北日本銀行	3.4	3.7	7,078	5.5	6.5	4,888	サンフロンティア不動産	14.7	14.1	13,352				
東和銀行	18.7	20.5	14,022	NECキャピタルソリューション	4.3	4.8	9,777	エフ・ジー・ネクスト	9.3	11.6	13,282			
福島銀行	10.4	13.2	3,009	不動産業 (2.0%)	—	—	—	インテリックス	3.1	2.7	1,490			
大東銀行	5.6	5.9	3,829	いちご	135.3	129.6	41,990	ランドビジネス	4.3	4.4	1,491			
トモニホールディングス	82.3	90.1	29,012	日本駐車場開発	117.2	115.5	16,747	サンネクスタグループ	2.8	3.8	3,701			
フィデアホールディングス	103.6	114	13,224	スター・マイカ・ホールディングス	5.5	6.1	7,118	グランディハウス	8.3	8.1	3,636			
池田泉州ホールディングス	122.8	133.5	21,360	SREホールディングス	—	1.3	6,175	日本空港ビルデング	34	37.2	212,040			
証券・商品先物取引業 (0.8%)	—	—	—	ADワークスグループ	—	22.5	3,555	サードエフエス	—	5.3	3,614			
F P G	32.8	35.8	21,515	ヒューリック	227.1	247.2	303,314	明豊ファシリティワークス	—	6.9	7.1	19,716		
ジャフインベストメントアドバイザー	—	5.9	7,634	三栄建築設計	4.3	4.7	8,492	日本工営	6.9	7.1	19,716			
マセリアインベストメント	4.7	4.8	3,624	野村不動産ホールディングス	64.5	70.7	171,094	LIFULL	36	39.4	17,690			
SBIホールディングス	118.8	143	413,270	三菱東京UFJホールディングス	21.5	23.7	11,968	ミクシィ	—	21.6	54,367			
日本アジア投資	9.3	10.1	2,454	サムディ	15.1	16.5	28,578	ジェイエイ・リクルーメント	6.9	7.5	14,617			
ジャパコグループ	16.3	17.9	107,937	ディア・ライフ	13.7	16.4	7,412	日本M&Aセンター	77.8	92.6	561,156			
大和証券グループ本社	853.2	873.3	452,107	コーセーアー Lui	3.2	3.5	2,149	メンバーズ	3.1	3.3	8,556			
野村ホールディングス	1,871.3	1,780.3	1,072,986	イー・ディー・ワークス	201.8	—	—	中広	1.1	1.2	422			
岡三証券グループ	90.6	99.2	39,580	日本商業開発	6.7	7.3	12,629	UTグループ	12.1	16.3	58,680			
丸三証券	31.5	34.6	20,414	フルサンスホールディングス	17.4	19.1	28,650	アイティメディア	3.1	3.7	8,295			
東洋証券	38.2	38.2	5,882	ユニオンホールディングス	16	—	—	タケエイ	9.9	12.5	16,412			
親親フィナンシャルホールディングス	122	123.8	43,082	ハウスコム	1.4	1.2	1,588	E・Jホールディングス	1.2	4.4	4,422			
光世証券	2.5	3	1,962	日本管理センター	7	6.2	7,582	ビーネックスグループ	11.3	14.1	17,568			
水戸証券	30.8	31.2	8,455	サンセイランディング	3.2	3.5	2,618	コジカホールディングス	24.8	26.8	13,480			
いちよし証券	19.8	23.2	13,270	エストラスト	1.4	1.3	929	アルトナー	2.5	2.8	2,514			
松井証券	60.7	57.1	49,962	フージャースホールディングス	21.2	19	13,110	パソナグループ	11.1	12.2	25,010			
だいこう証券ビジネス	5.2	—	—	オープンハウス	30.9	36.7	164,049	CDS	2.5	2.4	3,492			
マネックスグループ	80.3	104.4	73,497	東急不動産ホールディングス	289.3	316.7	206,805	リソバンドモチベーション	22.7	20.7	13,579			
極東証券	14.3	15.7	12,607	飯田グループホールディングス	88.7	97.2	242,319	GCA	12.4	14.6	11,008			
岩井コスモホールディングス	10	11.9	17,980	イープランド	1.7	2.3	1,927	エス・エム・エス	32	38.4	145,344			
監理證券	19.1	21.7	17,913	ムゲンエステート	7.3	7.3	3,577	エス・サイドアップグループ	2.3	4	2,720			
マネポートナズグループ	11.5	12.8	2,777	ビーロット	2.4	5.4	3,531	パルニホールディングス	103	113	246,905			
スパークス・グループ	36.8	53.8	16,893	ファーストプラザーズ	2.4	2.2	2,206	リニカル	5	6.5	4,972			
小林洋行	3.2	3	822	ハウスドゥ	5.9	5.6	6,949	クックパッド	36.1	35.6	11,605			
保険業 (1.9%)	—	—	—	シーアールイー	2.7	3	3,777	エスクリ	3.3	3.6	1,299			
かんぽ生命保険	37.6	144.5	324,836	プロ/ティエージェンツ	1.6	1.9	2,603	アイ・ケイ・ケイ	5.1	5.6	3,500			
SOMPOホールディングス	200	205.6	897,855	ケイアイスター不動産	3.4	3.6	9,540	学情	3.7	3.9	5,541			
アコムホールディングス	8.8	32.8	36,932	アグリ都市デザイン	1.5	2.1	1,644	スタジオアリス	5.2	5.7	12,135			
MS&ADインフラストラクチャーホールディングス	278	283.3	906,560	グッドコムアセット	2.4	5.5	7,293	シミックスホールディングス	5.7	5.6	9,088			
ソニーフィナンシャルホールディングス	87.4	—	—	ジェイ・エス・ビー	1.1	2.2	7,821	エブコ	1.6	2.8	2,741			
第一生命ホールディングス	601.8	616	1,114,960	テンポイノベーション	2.4	3.3	3,111	NJS	2.2	2.8	5,656			
東京海上ホールディングス	380.3	386.6	2,135,965	グローバル・リク・マセジント	1.7	2	1,500	総合整備保障	41	45	237,150			
T&Dホールディングス	317.8	348.4	496,818	パーク24	57.1	62.5	142,937	カカココム	77.1	83.5	288,075			
アドバンスクリエイト	2.4	2.4	4,596	バラカ	2.8	3.1	5,118	アイロムグループ	3.7	4	7,684			
その他金融業 (1.1%)	—	—	—	三井不動産	524.5	531.4	1,279,079	セントケア・ホールディング	6.7	8.3	8,466			
全国保証	30	30.3	150,591	三菱地所	745.2	766	1,401,780	サイネックス	1.7	2.2	1,617			
ジェイリース	3	3.8	2,922	平和不動産	19.5	20	76,400	ルネサンス	5.7	7	7,938			
イントラスト	3.8	3.3	2,508	東京建物	116.3	114.9	183,495	ディップ	14.5	17.6	52,553			
日本モーゲージサービス	2.1	5.9	7,056	ダイビル	27.4	30.1	38,528	デジタルホールディングス	5.6	7.8	15,748			
CASA	3.7	3.2	3,257	京阪神ビルディング	17.2	20.1	31,778	新日本科学	11.2	13.7	9,439			
アルヒ	16.9	17.1	29,736	住友不動産	239.1	262.1	943,822	ツイクホールディングス	24.3	26.7	18,289			
プレミアアグループ	5.8	5.4	13,300	テオ・シー	20.9	22.9	17,518	キャリアデザインセンター	2.7	2.5	2,412			
クレディセゾン	74.5	68	91,868	東京楽天地	1.4	2	9,060	ペムフィット・フン	28.2	41.2	130,810			
芙蓉総合リース	11.1	12.2	93,330	レオパレス21	139.4	96.5	15,729	エムスリー	227.1	199.3	1,717,168			
みずほリース	16.4	18	61,290	スターツコーポレーション	14.5	13.8	39,633	ツカガ・グローバルホールディング	6.7	9.5	2,964			
東京センチュリー	21.4	27.1	237,125	フジ住宅	12.4	13.6	9,125	プラス	0.8	1.5	732			
日本証券金融	46.8	49.4	30,825	空港施設	10.8	12.1	6,497	アウトソーシング	59	64.7	96,532			
アイフル	162.3	195.2	55,436	明和地所	5.9	5.5	3,542	ウエルネット	9.8	11.5	5,681			
リコーリース	8.4	9.2	30,360	ゴールドクレスト	8.4	10.5	18,952	ワールドホールディングス	3.5	3.9	7,889			
イオンフィナンシャルサービス	65.1	71.3	99,748	エスリード	4.2	4.6	7,130	ディー・エヌ・エー	50.5	47.8	100,858			

銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																									
	株数	評価額	株数	評価額		株数	評価額	株数	評価額		株数	評価額	株数	評価額	株数	評価額																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																						
博報堂DVBホールディングス	143.3	266,454	157.2	11,936	デザインワン・ジャパン	2	3.5	2	752	ダイクマーケティングミックス	—	—	4.4	14,190																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																								
ぐるなび	18	11,936	19.6	7,755	イー・ガーディアン	5.2	4.9	5.2	15,312	ポピズホールディングス	—	—	2.3	6,354																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																								
タカミヤ	11	7,755	14.1	8,971	リブセンス	6.7	6.2	1.4	1,475	アドバテッジシステムマネジメント	5.2	5.7	4.7	4,218																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																								
ジャパネット東宝株式会社	6.9	8,971	8.9	13,146	ジャパンマテリアル	31.7	34.8	31.7	53,278	リログループ	56.3	61.7	158,939																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																									
フロンティアコミュニケーションズ	28.4	13,146	31.3	6,102	ベクトル	12.9	14	12.9	18,018	東祥	6.4	7.1	12,900																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																									
ライク	4.1	6,102	3	2,233	ウチヤマホールディングス	5.2	5.8	5.2	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	2,233	5.1	28,813	フォーラム・ケア・コーポレーション	7.5	8.4	7.5	11,440	ラックランド	2.1	3.2	7,657																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																									
エスピーール	19.9	28,813	28.9	14,346	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	14,346	5.2	5,852	キャリアリンク	3.4	3.6	11,340	イチネンホールディングス	11.5	11.8	16,000																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
手間いらず	—	5,852	1.1	3,204	IBJ	7	9.1	8,881	建設技術研究所	7.1	7.3	18,374																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
ティア	6.1	3,204	7.2	1,999	アサンテ	4.2	4.1	6,994	スペース	6.7	7.7	6,337																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
CDG	1.1	1,999	1.3	9,809	N・フィールド	7.1	7.6	7,554	スベア	3.8	4.5	7,191																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
アドウェイズ	—	9,809	13.7	23,175	バリュウHR	2	4.5	7,717	燐ホールディングス	4.5	4.7	5,687																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
バリューコマース	5.8	23,175	7.5	109,842	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	109,842	114.3	1,966	ライオン・システムホールディングス	3.9	4.3	9,146	東京テアトル	4.1	4.6	6,016																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
JPホールディングス	32.4	1,966	32.6	19,966	ER1ホールディングス	3	2.8	1,789	ダナベ経営	1.9	2.2	3,102																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
エナックホールディングス	18.8	19,966	20.7	4,887	アピスト	1.6	1.8	5,351	ナガワ	3.3	3.6	41,364																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
EPSホールディングス	15.5	4,887	15.3	35,490	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	35,490	2.7	17,043	ウィルグループ	6.7	8.2	8,552	東京都競馬	6.7	7.3	33,507																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
プラステジ・インターナショナル	38.6	17,043	42.2	4,291	エスクロー・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	4,291	6.2	8,638	メドピア	—	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	8,638	3.5	24,128	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	24,128	7	473,075	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																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
TAC	6.7	1,701	6.3	3,468	エラン	6.1	15.6	23,478	アジュラ・ホスビリティエー・グループ	69	71.2	1,922																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
ケネディクス	98	3,468	32.3	10,048	土手管理総合試験所	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	10,048	127	10,582	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																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
デイクアンドギブ・ニーズ	4	10,582	4.9	12,020	日本郵政	844.5	855.3	754,716	藤田観光	4.5	4.4	7,290																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
ぴあ	2.9	12,020	3.2	3,367	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	3,367	4.3	98,587	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	98,587	12.6	21,600	SMN	1.6	2.4	1,855	トローカイ	10	11	24,684																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
ネクシィーズグループ	3.6	21,600	3.5	6,000	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	6,000	31.7	2,145	LITALICO	3.6	4.6	16,560	セコム	109.3	111.3	1,140,268																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
アルプス技研	9.1	2,145	10	8,930	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	8,930	17.7	120,120	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	120,120	2.2	35,490	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	35,490	12.2	51,465	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	51,465	120.1	562	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	562	26.2	20,169	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	20,169	14.2	4,307	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	4,307	5.4	274,920	ペイカレント・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	274,920	2.8	6,672	Orchestra Holdings	2	2.5	5,897	学究社	3.1	3.4	4,831		田谷	2	6,672	1.7	8,930	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	8,930	38.5	5,413	キャリアインデックス	4.2	4.6	2,783	イオンテライイト	12.7	13.9	40,991		リゾートトラスト	47.2	5,413	51.7	1,403	MS・Japan	3.4	4.5	5,413	ナック	5.7	5.6	5,510		ビー・エム・エル	13.3	1,403	14.6	35,454	船場	1.7	1.6	1,403	ニチイ学館	14.7	—	—		ワタバウエディング	1.6	35,454	1.7	77,187	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		りらいコミュニティケーションズ	18.7	77,187	17.1	1.2	フレックス	10.8	32.5	77,187	ステップ	3.8	4.3	6,712		リソー教育	47.1	1.2	57.3	2,205	グリーンズ	1.2	1.8	2,534	合計	株数・金額	127,662.7	124,117.8	311,274.068		早稲田アカデミー	3.4	2,205	4.4	603	GAMEWITH	3.9	4.2	2,205	銘柄数<比率>	2,151銘柄	2,183銘柄	<97.7%>		ユー・エス・エス	115.4	603	126.4	2,075	ソウルダウト	1.2	1.7	603						東京個別指導学院	3.7	2,075	9.9	1,181	MS&Consulting	2.2	3.5	2,075						サイバーエージェント	59.3	1,181	69.6	—	エル・ティー・エス	1.6	2.7	4,665	(注1)	銘柄欄の( )内は、期末の国内株式評				楽天	480.2	—	526.6	—	ミダック	1.4	1.9	1,181						グリーク・アンド・リパ社	5.3	—	5.8	—	日総工業	—	0.8	3,336	(注2)	合計欄の< >内は、期末の純資産総額に				モーニングスター	—	—	12.4	—	ニュービネットホールディングス	—	2.4	7,716						デー・オー・ダブリュー	9	—	19.8	—	RPAホールディングス	6.8	8.7	7,786	(注3)	評価額の単位未満は切捨ててあります。				山田コンサルテインググループ	5	—	6.6	—	スプリックス	4.3	5.2	8,824						セントラルスポーツ	3.9	—	4.2	—	マネジментソリューションズ	5.8	12.8	8,652						フルキャストホールディングス	10.3	—	9.8	—	プロレド・パートナーズ	3.5	3.2	2,646						エン・ジャパン	18.4	—	20.1	—	and factory	1.1	5.5	9,916						リソルホールディングス	1	—	0.9	—	テノホールディングス	—	1.6	5,624						テクノプロ・ホールディングス	20.7	—	22.5	—	フロンティア・マネジメント	—	1	770						アトラ	2.3	—	2.5	—	ピアラ	—	0.9	1,140						インターワークス	1.9	—	3.5	—	コプロ・ホールディングス	—	2	4,892						アイ・フルキャストホールディングス	4.2	—	4.6	—	ギークス	—	0.6	1,209						Keeper 技研	3.9	—	7.3	—	カーブスホールディングス	—	31	29,884						ファーストロジック	2.3	—	2.2	—	フォーラムエン지니어リング	—	5.8	5,945						三機サービス	2.1	—	2.3	—										Gunosy	7.1	—	6.8	—									
田谷	2	6,672	1.7	8,930	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	8,930	38.5	5,413	キャリアインデックス	4.2	4.6	2,783	イオンテライイト	12.7	13.9	40,991																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
リゾートトラスト	47.2	5,413	51.7	1,403	MS・Japan	3.4	4.5	5,413	ナック	5.7	5.6	5,510																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
ビー・エム・エル	13.3	1,403	14.6	35,454	船場	1.7	1.6	1,403	ニチイ学館	14.7	—	—																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
ワタバウエディング	1.6	35,454	1.7	77,187	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																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
りらいコミュニティケーションズ	18.7	77,187	17.1	1.2	フレックス	10.8	32.5	77,187	ステップ	3.8	4.3	6,712																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
リソー教育	47.1	1.2	57.3	2,205	グリーンズ	1.2	1.8	2,534	合計	株数・金額	127,662.7	124,117.8	311,274.068																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																									
早稲田アカデミー	3.4	2,205	4.4	603	GAMEWITH	3.9	4.2	2,205	銘柄数<比率>	2,151銘柄	2,183銘柄	<97.7%>																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
ユー・エス・エス	115.4	603	126.4	2,075	ソウルダウト	1.2	1.7	603																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
東京個別指導学院	3.7	2,075	9.9	1,181	MS&Consulting	2.2	3.5	2,075																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
サイバーエージェント	59.3	1,181	69.6	—	エル・ティー・エス	1.6	2.7	4,665	(注1)	銘柄欄の( )内は、期末の国内株式評																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																												
楽天	480.2	—	526.6	—	ミダック	1.4	1.9	1,181																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
グリーク・アンド・リパ社	5.3	—	5.8	—	日総工業	—	0.8	3,336	(注2)	合計欄の< >内は、期末の純資産総額に																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																												
モーニングスター	—	—	12.4	—	ニュービネットホールディングス	—	2.4	7,716																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
デー・オー・ダブリュー	9	—	19.8	—	RPAホールディングス	6.8	8.7	7,786	(注3)	評価額の単位未満は切捨ててあります。																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																												
山田コンサルテインググループ	5	—	6.6	—	スプリックス	4.3	5.2	8,824																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
セントラルスポーツ	3.9	—	4.2	—	マネジментソリューションズ	5.8	12.8	8,652																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
フルキャストホールディングス	10.3	—	9.8	—	プロレド・パートナーズ	3.5	3.2	2,646																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
エン・ジャパン	18.4	—	20.1	—	and factory	1.1	5.5	9,916																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
リソルホールディングス	1	—	0.9	—	テノホールディングス	—	1.6	5,624																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
テクノプロ・ホールディングス	20.7	—	22.5	—	フロンティア・マネジメント	—	1	770																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
アトラ	2.3	—	2.5	—	ピアラ	—	0.9	1,140																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
インターワークス	1.9	—	3.5	—	コプロ・ホールディングス	—	2	4,892																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
アイ・フルキャストホールディングス	4.2	—	4.6	—	ギークス	—	0.6	1,209																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
Keeper 技研	3.9	—	7.3	—	カーブスホールディングス	—	31	29,884																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
ファーストロジック	2.3	—	2.2	—	フォーラムエン지니어リング	—	5.8	5,945																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
三機サービス	2.1	—	2.3	—																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																		
Gunosy	7.1	—	6.8	—																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																		

## (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  
 追加設定元本額 67,069,989,134円  
 一部解約元本額 63,334,632,683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	15,975,939,497円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	3,179,107,702円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,626,890円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,088,758円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,151,762円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	24,072,359円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	14,018,113円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,980,814円
たわらノーロード TOPIX	784,765,731円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	612,281,321円
たわらノーロード バランス(堅実型)	23,454,696円
たわらノーロード バランス(標準型)	140,720,417円
たわらノーロード バランス(積極型)	207,209,167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
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
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
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
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
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	431,973円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,205,302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
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,885,817円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,004,044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<DC年金>1安定型	1,023,160,847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バランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,451,908,533円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	332,009,300円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,152,607,788円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,085,041,257円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	35,744,954円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	1,112,139,190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 DC 8資産バランスファンド(新興国10)	313,080,893円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	264,026,418円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	439,000,020円
投資のソムリエ	15,620,354,669円
クルーズコントロール	637,176,611円
投資のソムリエ<DC年金>	960,546,202円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	294,854,779円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	367,544,221円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,918,316円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	16,838,854円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	264,587,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,928,248,506円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	19,134,149円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	9,070,573円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,599,277円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	42,338,447円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	98,734,309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
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	265,437,692円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	9,278,066円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	5,239,774円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	5,173,103円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,626,870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
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
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
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
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	41,658,362円
日米資産分散戦略ファンド(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
インカム重視マルチアセット運用ファンド	85,977,917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
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
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
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
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
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
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
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
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	689,878,804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50VA(適格機関投資家限定)	2,064,787,625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 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世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家限定)	102,439,732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
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
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
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世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	45,168,755円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	20,550,710円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(121)(適格機関投資家限定)	362,800,005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
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

(注3) 期末元本合計 102,105,610,506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)	合計(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。