

運用報告書 (全体版)

第21期<決算日2024年2月7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	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	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	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、2024年2月7日に第21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

<https://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			東証株価指数(TOPIX) (配当込み) (ベンチマーク)		株組比	式入率	株先比	式物率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(配当込み) (ベンチマーク)	期中騰落率					
17期 (2020年2月7日)	円 27,679	円 0	% 12.9	ポイント 2,642.55	% 13.2	% 97.5	% 97.7	% 2.3	百万円 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		
19期 (2022年2月7日)	32,038	0	2.0	3,073.66	2.2	97.4	2.5	108,482		
20期 (2023年2月7日)	33,819	0	5.6	3,251.81	5.8	98.0	1.9	113,414		
21期 (2024年2月7日)	44,474	0	31.5	4,286.44	31.8	97.6	2.5	148,673		

(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)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」という。)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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません(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(T O P I X) (配 当 込 み) (ベ ン チ マ ー ク)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
	円	騰 落 率 %	ポ イ ン ト	騰 落 率 %		
(期 首) 2023年 2 月 7 日	33,819	—	3,251.81	—	98.0	1.9
2 月 末	33,994	0.5	3,269.12	0.5	98.8	1.3
3 月 末	34,565	2.2	3,324.74	2.2	96.1	4.4
4 月 末	35,490	4.9	3,414.45	5.0	97.9	2.4
5 月 末	36,761	8.7	3,537.93	8.8	97.3	2.8
6 月 末	39,532	16.9	3,805.00	17.0	98.3	1.7
7 月 末	40,116	18.6	3,861.80	18.8	97.5	2.5
8 月 末	40,278	19.1	3,878.51	19.3	97.4	2.6
9 月 末	40,481	19.7	3,898.26	19.9	97.6	2.6
10 月 末	39,262	16.1	3,781.64	16.3	97.3	2.7
11 月 末	41,379	22.4	3,986.65	22.6	97.7	2.4
12 月 末	41,282	22.1	3,977.63	22.3	96.9	3.2
2024年 1 月 末	44,498	31.6	4,288.36	31.9	97.8	2.1
(期 末) 2024年 2 月 7 日	44,474	31.5	4,286.44	31.8	97.6	2.5

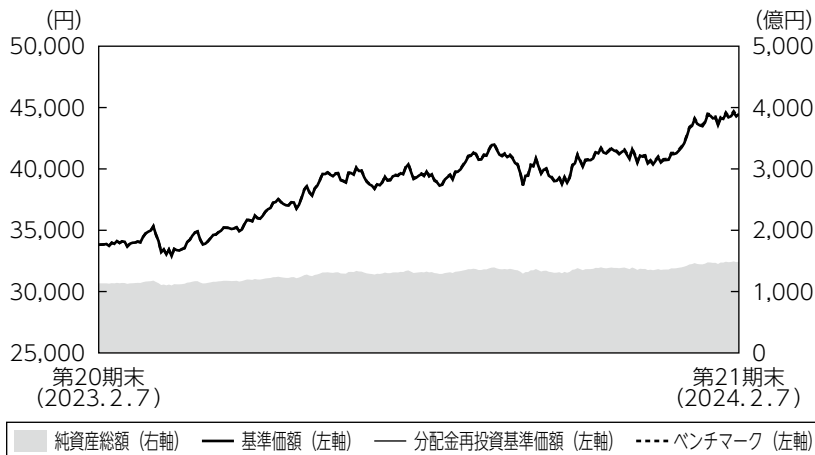
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「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（2023年2月8日から2024年2月7日まで）

基準価額等の推移



第21期首：33,819円
第21期末：44,474円
(既払分配金0円)
騰落率：31.5%
(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

日米の長期金利差などを要因として円安ドル高が進行したことや、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や海外投資家による日本株買いなどを要因として日本株が大きく上昇したことから、基準価額も上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2023年3月末までは、日米の金融政策、欧米での金融機関の破綻などを要因として一進一退の展開となりました。その後、4月から9月半ばまでは、円安ドル高の進行、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や欧米投資家による日本株買いなどを要因として大きく上昇しました。その後、中東情勢の緊迫化などを要因として一時的に下落する場面もありましたが、期末にかけては円安ドル高の流れを受けて上昇しました。

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

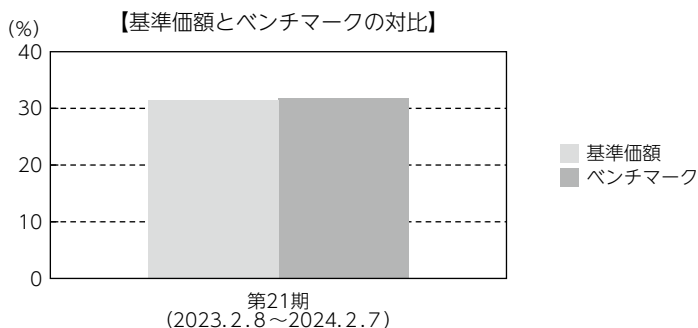
ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

※運用状況については15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31.8%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
	2023年2月8日 ～2024年2月7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	34,474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21期		項目の概要
	(2023年2月8日 ～2024年2月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	94円	0.242%	(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38,792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)	(34)	(0.088)	
(販売会社)	(47)	(0.121)	
(受託会社)	(13)	(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	1	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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	95	0.244	

(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。

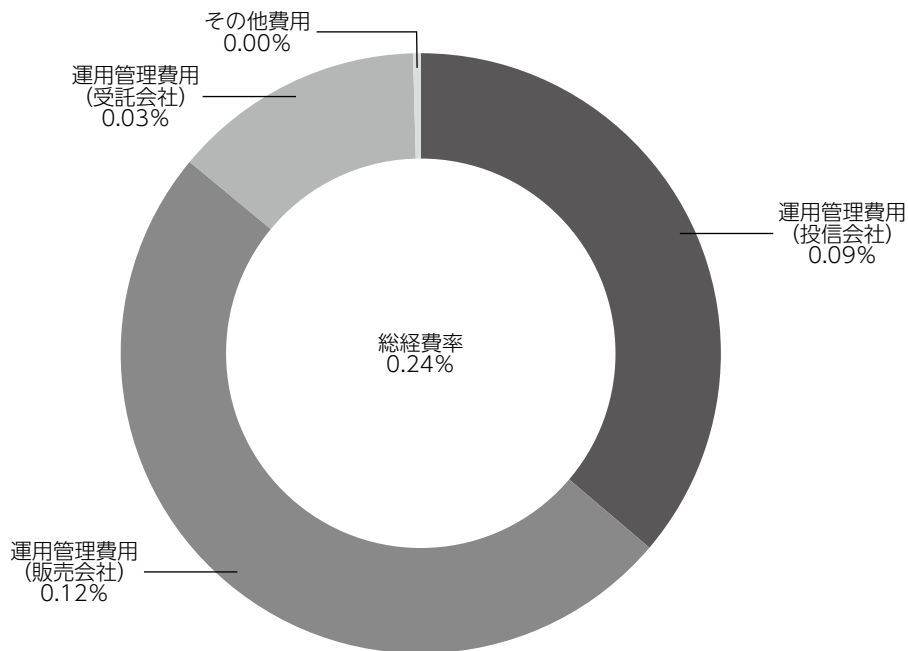
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.24%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（2023年2月8日から2024年2月7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	2,426,841	9,449,077	2,615,824	10,091,879

■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	277,300,261千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	438,574,353千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.63

(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（2023年2月8日から2024年2月7日まで）

【D I AM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)	1,191千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.688千円
(B)／(A)	0.1%

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

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 152,756	百万円 103,694	% 67.9	百万円 124,543	百万円 58,472	% 46.9

平均保有割合 29.0%

(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		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,537	百万円 1,475	百万円 5,468

(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 198

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□ 33,601,320	千□ 33,412,337	千円 148,664,853

■投資信託財産の構成

2024年2月7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	148,664,853	99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	682,561	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	149,347,414	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

(2024年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	149,347,414,936円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	510,767,928
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)	148,664,853,008
未 収 入 金	171,794,000
(B) 負 債	673,727,965
未 払 解 約 金	505,986,562
未 払 信 託 報 酬	167,123,417
そ の 他 未 払 費 用	617,986
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	148,673,686,971
元 本	33,429,356,248
次 期 繰 越 損 益 金	115,244,330,723
(D) 受 益 権 総 口 数	33,429,356,248口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	44,474円

(注) 期首における元本額は33,536,193,378円、当期中における追加設定元本額は7,865,057,046円、同解約元本額は7,971,894,176円です。

■損益の状況

当期 自2023年2月8日 至2024年2月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△130,209円
受 取 利 息	20,622
支 払 利 息	△150,831
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	32,161,079,677
売 買 損 益	35,849,877,950
売 買 損 益	△3,688,798,273
(C) 信 託 報 酬 等	△313,983,943
(D) 当 期 繰 越 損 益 金(A+B+C)	31,846,965,525
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	19,158,833,728
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	64,238,531,470
(配 当 等 相 当 額)	(58,199,389,080)
(売 買 損 益 相 当 額)	(6,039,142,390)
(G) 合 計(D+E+F)	115,244,330,723
次 期 繰 越 損 益 金(G)	115,244,330,723
追 加 信 託 差 損 益 金	64,238,531,470
(配 当 等 相 当 額)	(58,199,389,080)
(売 買 損 益 相 当 額)	(6,039,142,390)
分 配 準 備 積 立 金	51,005,929,462
繰 越 損 益 金	△130,209

(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	31,847,024,171
(c) 収 益 調 整 金	64,238,531,470
(d) 分 配 準 備 積 立 金	19,158,905,291
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	115,244,460,932
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	34,474.03
(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22期（決算日 2024年2月7日）

（計算期間 2023年2月8日～2024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22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	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。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
21期 (2023年2月7日)	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9	396,982
22期 (2024年2月7日)	44,494	31.8	4,286.44	31.8	97.6	2.5	542,130

(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）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません（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）。

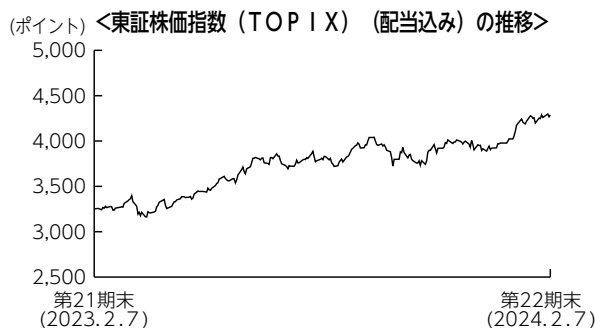
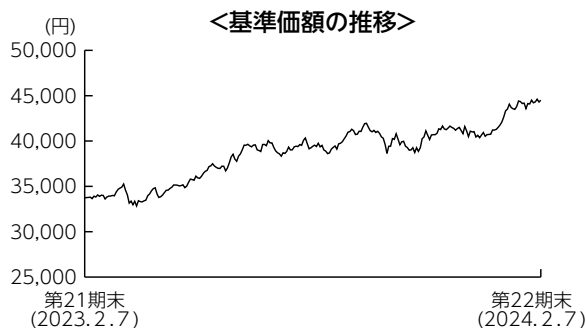
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2023年 2月7日	円	%	ポイント	%	%	%
	33,751	—	3,251.81	—	98.0	1.9
2 月 末	33,931	0.5	3,269.12	0.5	98.8	1.3
3 月 末	34,508	2.2	3,324.74	2.2	96.1	4.4
4 月 末	35,438	5.0	3,414.45	5.0	97.9	2.4
5 月 末	36,715	8.8	3,537.93	8.8	97.3	2.8
6 月 末	39,491	17.0	3,805.00	17.0	98.4	1.7
7 月 末	40,083	18.8	3,861.80	18.8	97.5	2.5
8 月 末	40,253	19.3	3,878.51	19.3	97.5	2.6
9 月 末	40,464	19.9	3,898.26	19.9	97.6	2.6
10 月 末	39,253	16.3	3,781.64	16.3	97.3	2.7
11 月 末	41,378	22.6	3,986.65	22.6	97.7	2.4
12 月 末	41,289	22.3	3,977.63	22.3	96.9	3.2
2024年 1 月 末	44,516	31.9	4,288.36	31.9	97.8	2.1
(期 末) 2024年 2月7日	44,494	31.8	4,286.44	31.8	97.6	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（2023年2月8日から2024年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は44,494円となり、前期末比で31.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

日米の長期金利差などを要因として円安ドル高が進行したことや、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や海外投資家による日本株買いなどを要因として日本株が大きく上昇したことから、基準価額も上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2023年3月末までは、日米の金融政策、欧米での金融機関の破綻などを要因として一進一退の展開となりました。その後、4月から9月半ばまでは、円安ドル高の進行、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や欧米投資家による日本株買いなどを要因として大きく上昇しました。その後、中東情勢の緊迫化などを要因として一時的に下落する場面もありましたが、期末にかけては円安ドル高の流れを受けて上昇しました。

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	17.3%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.3
4	銀行業	6.4
5	化学	6.1
6	卸売業	5.9
7	医薬品	5.2
8	サービス業	5.2
9	機械	5.2
10	小売業	4.4



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	16.9%
2	輸送用機器	8.9
3	情報・通信業	7.4
4	卸売業	7.1
5	銀行業	6.9
6	化学	5.8
7	機械	5.2
8	サービス業	4.5
9	医薬品	4.4
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	3.6%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.1
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.0
5	日本電信電話	日本・円	1.7
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.4
7	武田薬品工業	日本・円	1.3
8	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
9	第一三共	日本・円	1.2
10	任天堂	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,161銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.8%
2	ソニーグループ	日本・円	2.7
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.3
4	キーエンス	日本・円	1.7
5	東京エレクトロン	日本・円	1.6
6	三菱商事	日本・円	1.6
7	日立製作所	日本・円	1.5
8	日本電信電話	日本・円	1.5
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.5
10	信越化学工業	日本・円	1.4
組入銘柄数		2,148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31.8%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		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)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (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
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	1	0.001	
期中の平均基準価額は38,764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 (2023年2月8日から2024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
		68,285.4 (56,521.786)	152,756,646 (-)	58,527.986	124,543,615

(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 122,918	百万円 121,163	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	277,300,261千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	438,574,353千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.63

(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（2023年2月8日から2024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 152,756	百万円 103,694	% 67.9	百万円 124,543	百万円 58,472	% 46.9

(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 1,537	百万円 1,475	百万円 5,468

(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 198

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	4,122千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2千円
(B) / (A)	0.1%

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千円						千株	千株	千円					千株	千株	千円		
水産・農林業 (0.1%)							日本ハウスホールディングス									中村屋				
極洋	7.3	7.8	32,019				新日本建設	26.6	30.5	9,241						江崎グリコ	2.8	3.5	10,955	
ニッスイ	191.5	205	184,869				東亜道路工業	18.8	20.1	25,607						名糖産業	38.5	41.2	175,512	
マルハニチロ	28.4	30.4	91,139				日本道路	2.3	5.7	39,159						井村屋グループ	5.5	5.7	10,032	
雪国まいたけ	16.3	17.5	16,887				東亜建設工業	2.7	16.8	35,028						不二家	7.2	8.6	21,224	
カネコ種苗	5.9	5.8	8,305				日本国土開発	11.5	11.1	42,013						山崎製パン	9.3	9.9	24,363	
サカタのタネ	21.8	23.3	81,550				若築建設	40.2	40.8	21,583						第一屋製パン	90	96.4	344,244	
ホフト	17	16.4	29,208				東洋建設	6	5	15,375						モロゾフ	2.2	1.2	933	
ホグリヨウ	2.5	1.5	1,576				五洋建設	43.4	36.1	45,377						亀田製菓	4.3	4.6	18,446	
							世紀東急工業	189.9	203.3	164,754						寿スピリッツ	8.6	8.2	37,228	
鉱業 (0.3%)							福田組	17.7	18.4	36,340						カルビー	14.3	68.1	131,092	
住石ホールディングス	26.4	23.2	41,644				住友林業	5.1	5.4	29,106						森永乳業	61.5	65.9	207,321	
日鉄鉱業	7.6	8.2	42,230				日本基礎技術	102.7	123.9	536,363						六甲バター	24.5	50.3	150,472	
三井鉱山ホールディングス	8.7	12.1	33,807				巴コーポレーション	7.2	3.8	1,862						ヤクルト本社	9.9	10.6	14,034	
I N P E X	707.9	758.2	1,534,975				大和ハウス工業	13.5	8.1	4,957						明治ホールディングス	96.1	205.7	645,898	
石油資源開発	22.2	23.8	143,514				ライト工業	374.1	396.6	1,745,040						雪印メグミルク	83.4	176.5	638,047	
K&Oエナジーグループ	8.7	9.3	21,259				積水ハウス	25.5	29.5	60,770						プリマハム	32.6	34.8	80,179	
							日特建設	419.4	434.9	1,419,078						日本ハム	18.2	19.3	44,911	
建設業 (2.1%)							北陸電気工事	12.9	13.7	16,618						林兼産業	52.6	61.9	322,994	
ショーボンドホールディングス	26.1	27.9	181,935				ユアテック	9.3	9.8	12,475						丸大食品	3.7	2.2	1,295	
ミライト・ワン	66.5	67.8	133,599				日本リーテック	29.9	31.6	43,418						S Foods	13.5	14.5	24,490	
タマホーム	12.1	12.9	51,729				四電工	8.9	11.2	14,772						柿安本店	14.9	15.9	51,357	
サンヨーホームズ	2.2	1.1	841				中電工	5.7	6	23,520						伊藤ハム&久ホールディングス	5.3	5.6	14,504	
日本アーク	7.1	3.8	3,940				関電工	20.8	22.3	64,224						サッポロホールディングス	104.7	2.2	92,730	
ファーストコーポレーション	4.3	2.6	2,080				さんでん	73.6	89.9	145,368						アサヒグループホールディングス	44.3	47.4	317,817	
バステラ	3.7	2.2	2,156				東京エネシス	94.5	101	269,114						キリンホールディングス	310.6	332.7	1,863,120	
キャンディル	3.7	1.7	994				トーエネック	13.3	14.3	16,459						宝ホールディングス	606.7	599.7	1,274,962	
ダイセイ興業ソリューション	2.4	1.8	1,864				住友電設	4.4	4.7	25,380						オノンホールディングス	91.8	98.3	120,859	
第一カッター興業	5.1	5.9	8,673				日本電設工業	12.8	13.7	43,771						養命酒製造	40.1	43	15,867	
安藤・間	110.9	118.7	146,831				エフシオグループ	22	26.9	56,221						ココロ・ホリタ・グループホールディングス	4.4	4.8	9,004	
東急建設	54.6	64.2	53,286				新日本空調	61.5	70.1	231,750						ライフドリンク カンパニー	105.3	112.8	224,697	
コムシスホールディングス	64.8	65.5	209,534				九電工	7.4	9.3	24,914						サントリー食品インターナショナル	-	2.1	12,558	
ビールホールディングス	30.5	30.1	11,197				三機工業	32.6	31	180,358						ダイドールグループホールディングス	94.7	101.4	499,090	
藤本コンストラクショングループ	12.5	15.2	45,113				日揮ホールディングス	29.7	31	58,218						伊藤園	7.6	16.3	47,449	
東建コーポレーション	5.5	5.2	49,712				ヤマト	132.4	141.9	247,757						キーコーヒー	45.5	48.8	206,619	
ソネック	2	1	946				太平電業	4.4	4.7	12,520						ユニカフェ	15.1	16.1	33,182	
ヤマウラ	9.8	10.4	16,421				高砂熟学工業	10.1	5.3	5,262						ジャパンフーズ	4.1	2.2	1,991	
オリエンタル白石	68.7	75.8	27,288				三晃金属工業	8.4	8.9	39,382						日清オイログループ	1.5	1	1,408	
大成建設	133.2	134.2	750,446				朝日工業社	32.3	38.4	140,352						不二製油グループ本社	19	20.3	93,583	
大林組	478.7	512.8	733,816				明星工業	1.4	0.9	4,432						かどや製油	31.3	33.5	78,993	
清水建設	402.5	406.6	426,116				大気社	5.6	6.7	21,373						キッコーマン	1.2	0.8	3,048	
飛鳥建設	14.9	14.8	22,362				ダイダ	23	27.8	31,580						味の素	13.7	16.5	34,419	
長谷工コーポレーション	138.2	131.6	252,408				日比谷総合設備	16.1	16.5	74,002						ブルドックソース	89.1	95.4	865,468	
松井建設	12.6	13.4	11,390				フィル・カンパニー	8.9	18.9	32,470						キュービー	329	342.1	1,935,601	
銭高組	1.5	1	4,605				テスホールディングス	11.5	10.4	27,716						ハウス食品グループ本社	5.4	7.6	16,036	
鹿島建設	296.9	318	882,132				インフリア・ホールディングス	2.4	2.2	1,720						カゴメ	72.2	77.4	203,368	
不動テトラ	9.3	9.9	22,423				東洋エンジニアリング	14.4	30.9	13,812						焼津水産化学工業	41.3	49.6	155,843	
大木建設	4.3	2.5	3,622				レイズネクスト	140.2	165.3	253,900						ピエトロ	62.7	61.9	225,192	
鉄建建設	9.6	10.3	22,845				ニッパン	17.7	21.1	17,069						エバラ食品工業	5.6	2.8	3,774	
西松建設	22.7	27.4	122,149				日清製粉グループ本社	19.4	20.8	32,760						アリアケジャパン	11.8	14.4	66,384	
三井住友建設	107.5	106.6	44,025				日東富士製粉	36.3	43.1	98,871						やまみ	1.7	0.9	1,627	
大豊建設	5.6	4.9	18,791				昭和産業	124.3	133.1	277,779						ユニフーズ	3.3	3.4	9,999	
佐田建設	7.7	4.1	2,972				超越製粉	2.2	2.3	11,983						ニチレイ	1.2	0.9	3,676	
ナカノフードー建設	8.5	4.5	2,344				日和製業	2.2	2.3	11,983						東洋水産	61.6	66	247,500	
奥村組	21.7	23.2	122,264				昭栄製粉	11.8	14	46,550						イトアンドホールディングス	67.9	72.8	586,258	
東鉄工業	18.5	17.8	53,186				中部飼料	9.8	5.6	3,964						大冷	5.8	6.8	14,531	
イチケン	2.7	1.6	3,854				フィード・ワン	18.7	19.9	23,979						ヨシムラ・フード・ホールディングス	1.7	1	1,945	
富士ビー・エス	6.1	2.9	1,290				東洋精糖	19.7	21	20,748						日清食品ホールディングス	8.6	6.5	7,618	
淺沼組	10.7	10.6	45,421				日本甜菜製糖	2.4	1.2	2,784						永谷園ホールディングス	47.3	151.9	718,942	
戸田建設	164.6	194.1	185,773				DME三井製糖ホールディングス	8	8.4	18,093						一正蒲鉾	6.7	7.1	16,109	
熊谷組	23.2	23.7	93,378				塩水港精糖	13.3	14.3	46,761						フジッコ	5.2	2.8	2,066	
北野建設	2.3	1.2	3,720				ウエルネオシユガー	14.9	8.4	2,553						ロック・フィールド	13.9	14.8	29,096	
植木組	3.4	1.8	3,162				森永製菓	7	7.2	16,653						日本たばこ産業	15.1	17.6	28,424	
矢作建設工業	18.4	19.5	28,431						24.9	61.6	174,328									
ピーエス三菱	17.2	18.2	18,345																	

銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末				
	株数	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		
ケンコーマヨネーズ		千株	千円		千株	千円			千株	千円					千株	千株	千円			千株	千株	千円
わらばや日洋ホールディングス	9.3	9.9	18,087	9.9	9.9	18,087	クラレ	217.3	213.4	331,410	ダイキョーニシカワ	30.1	30.1	32.4	30.1	32.4	24,008					
なとり	8.6	9.1	19,810	9.6	9.6	27,273	旭化成	853.9	990.8	1,028,945	竹本容器	4.1	4.1	2.6	4.1	2.6	2,038					
イフジ産業	2.2	1.2	1,696	9.1	9.1	19,810	共和レザー	7.1	3.8	3,066	森六ホールディングス	6.9	6.9	7.6	6.9	7.6	21,936					
ファーマフーズ	20.7	20.7	20,637	1.2	1.2	1,696	巴川コーポレーション	3.8	1.8	1,713	恵和	8.9	8.9	10.5	8.9	10.5	15,004					
ユーグレナ	86.6	89.6	58,956	20.7	20.7	20,637	レナック・ホールディングス	132.1	141.5	417,778	日本化薬	104.3	111.9	142,616								
紀文食品	10.5	12.5	14,650	89.6	89.6	58,956	住友化学	1,014.5	1,086.7	334,160	カーリットホールディングス	12.3	15.8	15,452								
ビックルホールディングス	7.9	8.4	10,878	10.5	12.5	14,650	住友精化	5.8	6.9	34,362	日本精化	7.8	9.7	27,460								
ミヨシ油脂	4.2	2.5	3,312	7.9	8.4	10,878	日産化学	64.9	68.8	422,569	扶桑化学工業	12.7	15.5	71,145								
理研ビタミン	11.6	12.5	29,025	4.2	2.5	3,312	ラサ工業	5.3	5.6	12,773	トリケミカル研究所	18.3	17.8	67,551								
繊維製品 (0.4%)				11.6	12.5	29,025	クレハ	11.7	32	90,400	ADEKA	47.7	51.1	146,989								
片倉工業	12.6	13.5	24,124	7.9	8.4	10,878	多木化学	5.4	5.7	18,069	日油	42.3	44.2	313,820								
グンゼ	10.2	10.4	57,824	4.2	2.5	3,312	テイカ	9.2	12.7	17,957	新日本理化学	16.8	8.9	1,797								
東洋紡	59	63.3	70,516	10.2	10.4	57,824	石原産業	24.7	24.3	38,078	ハリマ化成グループ	8.7	9.1	8,153								
ユニチカ	41.4	47.3	7,804	59	63.3	70,516	片倉コープアグリ	2.5	1.6	1,788	花王	333	331.2	1,903,737								
富士紡ホールディングス	5.4	6.4	27,392	41.4	47.3	7,804	日本曹達	14.7	17.3	99,821	第一工業製薬	5	5.8	17,202								
倉敷紡績	10.2	10.4	31,824	5.4	6.4	27,392	東ソー	182.6	195.5	374,089	石原ケミカル	6.3	6.6	12,526								
シキボウ	6.8	7.7	9,255	10.2	10.4	31,824	トクヤマ	44.1	47.3	106,827	日華化学	5	2.6	2,371								
日本毛織	36	37.5	52,650	6.8	7.7	9,255	セントラル硝子	21.9	15.6	45,411	ニイタカ	2.2	1.3	2,459								
ダイトウボウ	21.5	10.4	936	36	37.5	52,650	東亜合成	68.5	70.5	108,534	三洋化成工業	8.5	9	37,620								
トア紡コーポレーション	4.2	2.5	1,085	21.5	10.4	936	大阪ソーダ	8.2	10.2	111,078	有機合成薬品工業	9.2	5.2	1,497								
ダイドーリミテッド	18.6	9.4	5,499	4.2	2.5	1,085	関東電化工業	26.4	28.3	25,724	大日本塗料	16.9	16.3	18,842								
帝国繊維	15.4	16.5	35,475	18.6	9.4	5,499	デンカ	49.7	53.3	130,105	日本ペイントホールディングス	605.1	777.7	905,242								
帝人	131.6	140.7	191,914	15.4	16.5	35,475	信越化学工業	230.7	1,328.1	7,740,166	関西ペイント	125.3	143.5	336,507								
東レ	916.3	981.2	732,465	131.6	140.7	191,914	日本カーバイド工業	4.6	6.2	9,684	神東塗料	10.4	5.3	673								
住江織物	2.5	1.3	3,140	916.3	981.2	732,465	堺化学工業	10.4	11.1	21,356	中国塗料	22.4	30.1	58,604								
日本フエルト	6.7	3.7	1,602	2.5	1.3	3,140	第一稀元素化学工業	12.5	16	15,536	日本特殊塗料	7.7	4.7	6,392								
イチカワ	1.5	0.8	1,420	6.7	3.7	1,602	エア・ウォーター	129	138.2	281,098	藤倉化成	18.6	16.8	7,879								
日東製網	1.3	0.7	1,096	1.5	0.8	1,420	日本薬業ホールディングス	132.6	142.1	589,430	太陽ホールディングス	20.7	25.5	78,030								
アツギ	7.1	4.5	2,493	1.3	0.7	1,096	日本化学工業	4.5	5.3	10,414	DIC	53.5	57.2	160,245								
ダイニック	3	2.1	1,478	7.1	4.5	2,493	東邦アセチレン	2.6	6.9	2,587	サカダイインクス	30.3	32.6	46,324								
セーレン	26.4	28.3	69,561	3	2.1	1,478	日本パーカライジング	67.8	65.3	80,580	artience	26.7	31.9	88,426								
ソトー	3.9	2.1	1,446	26.4	28.3	69,561	高圧ガス工業	20.1	21.4	18,489	T&K TOKA	12.2	14	19,698								
東海染工	1.3	0.6	493	3.9	2.1	1,446	チタン工業	1.4	0.9	1,011	富士フイルムホールディングス	262.7	272	2,674,304								
小松マテーレ	19.9	21.2	16,620	1.3	0.6	493	四国化成ホールディングス	16.2	18.7	32,893	資生堂	285.8	306.2	1,292,164								
ワコールホールディングス	26.3	30	104,220	19.9	21.2	16,620	戸田工業	3.1	3.3	5,336	ライオン	164.3	191.9	250,333								
ホギメディカル	18.4	19.3	65,523	26.3	30	104,220	ステラ ケミファ	8	7.9	25,991	高砂香料工業	9.3	11	39,985								
クラウディアホールディングス	2.7	1.5	609	18.4	19.3	65,523	保土谷化学工業	3.9	4.6	16,491	マンダム	29.5	31.7	41,685								
TSIホールディングス	48.8	47.6	32,368	2.7	1.5	609	日本触媒	20.8	21.3	118,917	ミルボン	20.3	19.9	69,291								
マツカコーポレーション	3.3	2	3,420	48.8	47.6	32,368	大日精化工業	9.6	10.2	27,907	ファンゲル	59.9	64.1	142,109								
ワールド	17.5	20.7	41,193	3.3	2	3,420	カネカ	31.3	37.2	132,990	コーセー	27.9	29.8	279,643								
三陽商会	4.6	5.5	15,581	17.5	20.7	41,193	三菱瓦斯化学	102.1	109.4	257,746	コタ	11.6	13.5	21,181								
ナイガイ	4.1	2.1	548	4.6	5.5	15,581	三井化学	112.7	120.8	501,320	シーボン	1.5	0.9	1,342								
オンワードホールディングス	88.5	86.3	46,774	4.1	2.1	548	JSR	127.7	159.5	634,810	ホーラ・オルビスホールディングス	70.2	75.2	115,657								
トックホールディングス	3.5	4.1	11,020	88.5	86.3	46,774	東京応化工業	23.9	69.9	245,978	ノビアホールディングス	12.2	13.1	67,858								
キムラタン	72.8	42.8	770	3.5	4.1	11,020	大阪有機化学工業	10.3	12.3	36,961	アジパンホールディングス	3	1.6	1,489								
ゴールドウイン	24.3	25.9	244,159	72.8	42.8	770	三菱ケミカルグループ	922.8	1,070.7	921,123	新日本製薬	7.8	8.4	15,002								
デサント	23.5	25.2	83,160	24.3	25.9	244,159	KHネオケム	22.7	22.3	52,851	l-one	-	2.9	6,820								
キング	9.4	2.5	1,740	23.5	25.2	83,160	ダイセル	201	188.3	272,281	アクシーシア	-	7.2	6,098								
ヤマトインターナショナル	5.8	5.1	1,545	9.4	2.5	1,740	住友ベークライト	20.2	20.5	153,114	エステー	10.6	11.3	17,277								
パルプ・紙 (0.2%)				5.8	5.1	1,545	積水化学工業	279.7	294.3	606,258	アグロ カネシヨウ	5.5	5.9	7,782								
特種東海製紙	6.1	8	31,520				日本ゼオン	82	100.4	128,662	コニシ	22.9	42.4	55,925								
王子ホールディングス	569.8	610	351,482	6.1	8	31,520	アイカ工業	34.5	37	128,760	長谷川香料	28.4	28	92,820								
日本製紙	71.1	82.6	113,657	569.8	610	351,482	UBE	70.4	69.7	176,166	星光PMC	6.4	-	-								
三菱製紙	15.1	8.8	5,447	71.1	82.6	113,657	積水樹脂	19.9	21.9	56,414	小林製薬	39.8	42.7	271,572								
北越コーポレーション	86.4	72	98,856	15.1	8.8	5,447	タキロンシーアイ	30.2	37.4	23,262	荒川化学工業	11.7	12.4	13,912								
中越パルプ工業	4.7	2.6	5,220	86.4	72	98,856	旭有機材	9.1	9.7	36,908	メック	11.2	12.1	52,574								
大王製紙	60.3	64.7	73,952	4.7	2.6	5,220	ニチパン	8.5	7.9	13,919	日本高純度化学	3.4	3.3	8,880								
阿波製紙	2.9	1.8	864	60.3	64.7	73,952	リケンテクノス	29.5	31.6	30,999	タカラバイオ	36.9	39.5	48,506								
レンゴー	124.6	133.4	137,402	2.9	1.8	864	大倉工業	6.4	6.8	20,400	JCU	15.5	16.4	62,238								
トーモク	7.9	8.5	19,507	124.6	133.4	137,402	積水化成成品工業															

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
大成ラミック		千株	千円	ビービー・カストロール		千株	千円	丸一鋼管		千株	千円		千株	千円	
クミアイ化学工業	4.3	4.2	12,978	富士石油	4.6	2.5	2,165	モリ工業	42.9	46	175,766	42.9	46	175,766	
日本農業	54.5	58.3	49,088	MORESCO	27.9	42.7	15,799	大同特殊鋼	2.9	2.6	12,701	2.9	2.6	12,701	
アキレス	25.1	26.9	18,372	出光興産	4	2.3	3,302	日本高周波鋼業	10.7	95.1	159,625	10.7	95.1	159,625	
有沢製作所	8.9	9.3	14,563	ENEOSホールディングス	152.1	814.3	663,328	日本冶金工業	4.2	2.7	1,495	4.2	2.7	1,495	
日東電工	22.4	25.7	28,861	コスモエネルギーホールディングス	2,473.4	2,321.7	1,380,714	山陽特殊製鋼	10.3	11	46,860	10.3	11	46,860	
レック	99.4	94.2	1,211,412	ゴム製品 (0.7%)	54.1	43.5	262,522	愛知製鋼	13.9	15	33,135	13.9	15	33,135	
三光合成	19.5	18.8	19,627	横浜ゴム	77.9	74.2	263,039	日本金属	8.2	8.7	30,145	8.2	8.7	30,145	
さかもと	17.1	18.5	12,358	TOYO TIRE	77.9	74.2	263,039	大平洋金属	2.8	1.9	1,675	2.8	1.9	1,675	
藤森工業	18.1	10.7	2,257	ブリヂストン	78.6	84.3	215,470	新日本電工	10	12.9	17,518	10	12.9	17,518	
前澤化成工業	8.8	11.6	46,458	住友ゴム工業	437.2	429.2	2,721,557	栗本鐵工所	9.0	75.4	21,338	9.0	75.4	21,338	
未来工業	10.8	9.4	15,087	藤倉コンポジット	134.2	143.8	250,212	虹 技	6.7	7	25,690	6.7	7	25,690	
ウェアロックホールディングス	5	5.3	25,943	オカモト	8.7	11.3	16,283	日本鋳鉄管	1.7	0.9	1,345	1.7	0.9	1,345	
J S P	3.7	2.4	1,634	フコク	7.6	6.9	33,637	三菱製鋼	1.4	0.8	942	1.4	0.8	942	
エフピコ	9.6	10.3	22,000	ニッタ	7.2	7.7	11,526	日亜鋼業	8.8	11.2	18,715	8.8	11.2	18,715	
天馬	25.9	27.7	81,659	住友理工	13.9	14.9	55,055	エンビロ・ホールディングス	13.3	7.4	2,464	13.3	7.4	2,464	
信越ポリマー	11.7	10.7	24,695	ミツ星ベルト	26.7	22.8	27,405	シンニッタン	2	2.1	11,571	2	2.1	11,571	
東リ	25.4	31.6	50,876	パンドー化学	20	17.8	84,995	新家工業	8.7	11.9	7,032	8.7	11.9	7,032	
ニフコ	27.6	14.4	5,745	日東紡績	21.8	21.8	38,368	大紀アルミニウム工業所	13.7	8.6	2,356	13.7	8.6	2,356	
バルカー	49.4	43.9	166,468	AGC	16.3	18.6	93,372	日本軽金属ホールディングス	2.7	1.5	4,807	2.7	1.5	4,807	
ユニ・チャーム	285.2	305.5	1,605,402	日本板硝子	139.3	130.8	742,551	三井金属鉱業	20	19.2	23,596	20	19.2	23,596	
ショーエイコーポレーション	3.8	2.1	1,289	石塚硝子	69.8	69.9	42,499	東邦亜鉛	38.1	44.2	76,112	38.1	44.2	76,112	
医薬品 (4.5%)				日本山村硝子	1.9	1.1	3,861	三菱マテリアル	4.1	43.9	213,529	4.1	43.9	213,529	
協和キリン	165.4	177.2	401,889	日本電気硝子	4.4	2.4	3,508	住友金属鉱山	8.4	9.8	10,966	8.4	9.8	10,966	
武田薬品工業	1,211.6	1,297.8	5,475,418	オハラ	55.8	59.8	210,675	DOWAホールディングス	94	108	299,268	94	108	299,268	
アステラス製薬	1,312.1	1,286.3	2,085,735	住友大阪セメント	6.5	7	8,085	古河機械金属	163.4	174.9	700,299	163.4	174.9	700,299	
住友ファーマ	101.5	108.8	37,536	太平洋セメント	19.3	24.4	91,378	エス・サイエンス	31.7	37.3	189,633	31.7	37.3	189,633	
塩野義製薬	175	184.9	1,303,360	日本ヒューム	87.2	86.7	269,897	大板テグメック/ロジーズ	20.6	20	38,400	20.6	20	38,400	
わかもと製薬	11.5	6.8	1,421	日本コンクリート工業	12.5	12.8	11,571	東邦チタニウム	76.5	41.9	921	76.5	41.9	921	
日本新薬	32.3	38.4	196,224	三谷セキサン	27.3	28.4	13,433	UACJ	20.6	26.2	73,124	20.6	26.2	73,124	
中外製薬	428.6	459	2,383,587	アジアパイルホールディングス	5.8	5.9	30,916	C K サンエツ	25.5	31.2	58,032	25.5	31.2	58,032	
科研製薬	23.4	25.1	88,126	東海カーボン	21.8	20.8	16,889	古河電気工業	19.7	21.2	87,874	19.7	21.2	87,874	
エーザイ	166.6	178.4	1,163,346	日本カーボン	114.9	135.3	139,494	住友電気工業	2.6	2.7	10,395	2.6	2.7	10,395	
ルート製薬	132.6	142.1	428,857	東洋炭素	7.8	7.8	34,476	フジクラ	46.9	50.2	138,526	46.9	50.2	138,526	
小野薬品工業	264.2	311.2	783,446	MA R U W A	8.6	10.3	51,706	SWCC	486.4	564.4	1,170,283	486.4	564.4	1,170,283	
久光製薬	30.4	32.6	135,746	品川フラクトリーズ	6.8	8.1	63,909	タツタ電線	151.1	177.9	220,951	151.1	177.9	220,951	
持田製薬	16.4	16.9	53,573	日本硝子	90.4	96.8	362,322	カナレ電気	15.8	16.9	52,728	15.8	16.9	52,728	
参天製薬	257.6	267.2	383,031	ダントーホールディングス	162	170.6	317,316	平河ヒューテック	28.8	26.8	18,438	28.8	26.8	18,438	
扶桑薬品工業	4.3	5.2	11,502	MARUWA	104.2	122.8	519,321	リョービー	2	1.1	1,860	2	1.1	1,860	
日本ケミファ	1.2	0.7	1,123	品川フラクトリーズ	8.7	4.3	4,076	AREホールディングス	8.2	9.6	13,113	8.2	9.6	13,113	
ツムラ	43.1	46.2	135,527	黒崎播磨	5.1	5.4	165,780	稲葉製作所	15	16.1	44,452	15	16.1	44,452	
キッセイ薬品工業	21.2	24.3	76,788	ヨータイ	3.8	18.1	36,905	空地エンジニアリンググループ	13.8	7.4	5,683	13.8	7.4	5,683	
生化学工業	26.2	24.9	19,247	東京薬業	2.8	3	38,670	トーカロ	57.1	56.8	110,135	57.1	56.8	110,135	
栄研化学	22.2	26.9	52,159	ニッカトール	9.2	9.1	13,276	アルファ	8.3	7.5	11,377	8.3	7.5	11,377	
鳥居薬品	7.3	7.9	29,032	フジミコーポレートッド	11.6	7	3,619	SUMCO	3.9	7.6	26,676	3.9	7.6	26,676	
J C R ファーマ	46.3	49.6	49,600	クニミネ工業	5.6	3	1,746	川田テクノロジーズ	38.7	43.6	66,664	38.7	43.6	66,664	
東和薬品	21.1	22.5	60,007	エーアンドイーマテリアル	3.6	1.9	1,934	RS Technologies	4.5	2.4	3,844	4.5	2.4	3,844	
富士製薬工業	8.9	10.8	21,330	ニチハ	2.4	1.4	1,939	ジェイテックコーポレーション	268.1	268	605,680	268.1	268	605,680	
ゼリア新薬工業	19	20.3	44,883	鉄鋼 (1.0%)	34.6	37.1	127,624	信和	3.3	3.6	27,324	3.3	3.6	27,324	
そーせいグループ	-	48.1	68,783	日本製鉄	17.1	18.4	60,812	野村ホールディングス	9.4	10.1	28,300	9.4	10.1	28,300	
第一三共	1,192.7	1,277.5	5,764,080	神戸製鋼所	630.7	675.6	2,408,514	三和ホールディングス	1.7	1.2	2,440	1.7	1.2	2,440	
杏林製薬	29.7	31.8	56,095	中山製鋼所	283.2	303.4	627,431	文化シヤッター	6.8	4.3	3,276	6.8	4.3	3,276	
大幸薬品	24.8	30.3	9,271	合同製鐵	29	34.6	32,627	三協立山	93.2	86.6	208,186	93.2	86.6	208,186	
ダイト	9.6	11.3	22,328	J F Eホールディングス	7	8.5	49,810	アルインコ	7.5	7.4	13,704	7.5	7.4	13,704	
大家ホールディングス	313.3	305	1,717,150	東京製鐵	376.4	419.6	973,681	高田機工	7.8	8.6	8,195	7.8	8.6	8,195	
大正製薬ホールディングス	30.4	32.6	280,294	共英製鋼	39.6	42.5	73,992	東洋シヤッター	18.6	23.6	67,189	18.6	23.6	67,189	
ペプチドリーム	66.4	71.1	92,536	大和工業	16.1	17.3	37,056	三協立山	2.1	1.2	2,511	2.1	1.2	2,511	
セルソース	-	4.1	5,362	東京製鐵	23.2	28.5	241,366	三協立山	0.6	0.5	1,832	0.6	0.5	1,832	
あすか製薬ホールディングス	14	15	28,530	共英製鋼	6.7	6.7	36,046	文化シヤッター	129.6	151.6	357,548	129.6	151.6	357,548	
サワグルホールディングス	31.3	33.5	190,782	大阪製鐵	6.6	7	15,456	三協立山	40.6	39.5	58,776	40.6	39.5	58,776	
石油・石炭製品 (0.5%)				淀川製鋼所	16.1	17.2	67,768	アルインコ	16.1	19	17,347	16.1	19	17,347	
日本コープス工業	123.5	148.7	19,033	中部鋼板	11.7	9.9	24,146	東洋シヤッター	10.8	11.5	11,994	10.8	11.5	11,994	
ニチレキ	16.3	19.1	46,699												
ユシロ化学工業	7.1	7.6	15,716												

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当期末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当期末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
LIXIL	205.2	235.5	461,580	タツモ	7.5	8.9	27,501	マースグループホールディングス	8.2	7.5	20,287		8.2	7.5	20,287
日本フィルコン	8.2	4.4	2,415	ナプテスコ	86.5	92.7	261,367	フクシマガリレイ	10.1	9.7	49,567		10.1	9.7	49,567
ノーリツ	20.7	25	39,425	三井海洋開発	17.3	18.7	42,710	オーイズミ	4.6	2.5	1,125		4.6	2.5	1,125
長府製作所	14.1	15	31,575	レオン自動車	14.6	17.1	25,667	ダイコク電機	7.5	7.3	26,207		7.5	7.3	26,207
リンナイ	25.5	72.2	234,577	S M C	44.7	44.2	3,495,336	竹内製作所	25	26.8	136,144		25	26.8	136,144
ダイニチ工業	6.5	3.5	2,467	ホンコワミクロン	10.6	9.5	43,937	アマノ	19.1	41.9	153,521		19.1	41.9	153,521
日東精工	20.6	21.9	11,979	ユニオンツール	6.1	6.5	21,287	J U K I	21.4	22.8	10,510		21.4	22.8	10,510
三洋工業	1.4	0.8	2,628	瑞光	-	10.6	19,758	サンデン	18.3	9.8	1,871		18.3	9.8	1,871
岡部	22.6	26.9	21,439	オイレス工業	19.3	20.1	41,767	ジャノメ	14.1	15	10,785		14.1	15	10,785
ジーテクト	15.7	19.2	40,569	日精イー・エス・ピー機械	6.3	5.9	24,750	マックス	17	20.8	65,312		17	20.8	65,312
東プレ	24.9	26.6	59,451	サトーホールディングス	19.6	21	44,604	グローリー	35.7	35.4	104,500		35.7	35.4	104,500
高周波熱練	22.8	23.3	24,651	技研製作所	14.3	13.9	28,592	新晃工業	13.8	14.9	43,746		13.8	14.9	43,746
東京製綱	8.4	9.8	13,308	日本エアータック	7	6.9	8,438	大和冷機工業	21.2	22.7	34,640		21.2	22.7	34,640
サンコール	11.1	13.4	6,432	カワタ	3.6	2	2,056	セガサミーホールディングス	110.8	131.9	288,069		110.8	131.9	288,069
モリテックスチール	9.4	6.1	1,756	日精樹脂工業	10.3	11	12,848	日本ピストンリング	4.2	-	-		4.2	-	-
パイオラックス	19.4	18.7	49,816	オカダアイヨン	3.8	2.2	5,992	リケン	5.5	-	-		5.5	-	-
エイチワン	14.7	15.5	13,919	ワイエイシホールディングス	5.2	5.5	12,787	T P R	15.8	18.7	39,344		15.8	18.7	39,344
日本発条	124.7	133.5	165,540	小松製作所	646	692.2	2,975,767	ツバキ・ナカシマ	34	29.7	22,156		34	29.7	22,156
中央発條	7.8	11.2	8,366	住友重機械工業	81.5	87.4	343,744	ホシザキ	88.7	87.1	468,336		88.7	87.1	468,336
アドパネクス	1.5	0.8	859	日立建機	54.9	58.8	248,547	大豊工業	12.1	12.8	10,636		12.1	12.8	10,636
立川ブラインド工業	6.4	6.8	10,077	日工	20.6	21.9	16,665	日本精工	253	273.4	217,981		253	273.4	217,981
三益半導体工業	10.8	13.6	43,588	巴工業	6	5.8	21,054	N T N	271.8	320.3	90,773		271.8	320.3	90,773
機械 (5.3%)				井関農機	12.9	13.8	16,449	ジェイテクト	122.7	131.4	182,974		122.7	131.4	182,974
日本ドライケミカル	3	1.6	4,659	T O W A	14	16.4	126,772	不二越	10.2	10.9	36,951		10.2	10.9	36,951
日本製鋼所	38	40.7	95,461	丸山製作所	2.2	1.1	3,053	日本トムソン	33.7	40.3	23,938		33.7	40.3	23,938
三浦工業	57.6	61.7	172,358	北川鉄工所	5.4	5.8	8,642	T H K	79.6	85.2	229,230		79.6	85.2	229,230
タクマ	42.4	49.9	86,227	ローツエ	7.2	7.7	140,294	ユースン精機	10.8	11.8	8,106		10.8	11.8	8,106
ツガミ	30.6	32.8	39,655	タカカタ	3.6	2.2	1,093	前澤給装工業	9.8	11.3	15,368		9.8	11.3	15,368
オークマ	13.8	12.9	89,113	クボタ	729.6	772	1,711,910	イーグル工業	15.3	16.3	28,036		15.3	16.3	28,036
芝浦機械	13.7	14.7	49,612	荏原実業	6.6	7.8	25,038	前澤工業	7.1	4.2	4,544		7.1	4.2	4,544
アマダ	220	235.6	374,368	三菱化工機	4.4	5.2	19,162	日本ビラー工業	12.8	13.7	63,568		12.8	13.7	63,568
アイデンエンジニアリング	28.4	34.2	28,864	月島ホールディングス	18.7	20	27,160	キッツ	50.7	49.5	60,439		50.7	49.5	60,439
T A K I S A W A	3.3	-	-	帝国電機製作所	10	10.4	30,014	マキタ	171.5	168.4	641,267		171.5	168.4	641,267
F U J I	60	69.5	171,943	東京機械製作所	2.9	1.7	795	三井 E & S	63.2	73.3	55,194		63.2	73.3	55,194
牧野フライス製作所	15.3	16.3	93,073	新東工業	28.2	29.9	33,308	日立造船	113	130.3	131,212		113	130.3	131,212
オーエスジー	65.8	65.1	130,427	澁谷工業	12.9	13.9	34,485	三菱重工業	241.1	258.2	2,674,952		241.1	258.2	2,674,952
ダイジェット工業	1.3	0.7	578	イチコーポレーション	19.6	20.6	22,783	I H I	86.9	109.9	302,719		86.9	109.9	302,719
旭ダイヤモンド工業	38.5	34	29,444	小森コーポレーション	31.9	36.4	46,555	サノヤホールディングス	16.8	9.6	1,392		16.8	9.6	1,392
DMG森精機	83.6	89.5	292,844	鶴見製作所	10.5	11.3	40,115	スター精密	26	27.5	47,630		26	27.5	47,630
ソディック	37.9	35.9	25,848	日本ギア工業	4	2.5	1,667	電気機器 (17.3%)							
ディスコ	22.1	71.1	3,046,635	酒井重工業	2	2.3	15,663	日清紡ホールディングス	112.1	111	138,139		112.1	111	138,139
日東工器	6.8	7.2	14,212	荏原製作所	56.4	60.6	574,912	イビデン	79	77	556,094		79	77	556,094
日進工具	11.6	13.7	14,138	石井鐵工所	1	0.8	2,166	コニカミノルタ	307.8	329.8	158,996		307.8	329.8	158,996
パンチ工業	10.7	6.4	2,771	西島製作所	12	12.7	31,686	ブラザー工業	184.2	197.3	520,378		184.2	197.3	520,378
富士ダイス	5.9	8.7	6,194	北越工業	13.8	14.8	36,304	ミネベアミツミ	239.8	256.9	749,248		239.8	256.9	749,248
豊和工業	6.6	3.6	2,782	ダイキン工業	164.6	176.3	3,731,389	日立製作所	670.5	709.7	8,317,684		670.5	709.7	8,317,684
ニテックオーケーケー	5	-	-	オルガノ	19	17.7	113,811	東芝	265.3	-	-		265.3	-	-
石川製作所	3.1	1.7	1,955	トーヨーカネツ	5.3	5	21,375	三菱電機	1,425	1,643.6	3,311,854		1,425	1,643.6	3,311,854
リケンN P R	-	16	43,872	栗田工業	77.1	82.6	454,217	富士電機	83.8	89.8	726,482		83.8	89.8	726,482
東洋機械金属	8.5	5.4	3,877	榎本チエイン	19.5	20.9	97,498	東洋電機製造	3.9	2.3	2,410		3.9	2.3	2,410
津田駒工業	2.3	1.2	465	大同工業	5	2.9	2,177	安川電機	163.4	160.4	852,686		163.4	160.4	852,686
エンシユウ	2.6	1.5	1,059	木村化工機	10.5	11.3	8,226	シフオニア テクノロジー	15.2	16.3	35,925		15.2	16.3	35,925
島精機製作所	21.9	23.5	32,994	アネスト岩田	23.4	22.8	29,617	明電舎	20.9	27.4	76,062		20.9	27.4	76,062
オプトラン	20.4	24.3	42,330	ダイフク	71.1	249.2	714,581	オリジン	2.8	1.5	1,830		2.8	1.5	1,830
NCホールディングス	2.5	1.6	2,560	サムコ	4.5	4	18,840	山洋電気	6	6.4	37,248		6	6.4	37,248
イワキ	9.3	9.8	22,628	加藤製作所	5.8	3.3	5,016	デンヨー	10.5	11.3	25,820		10.5	11.3	25,820
フリーユ	14.4	13.9	17,903	油研工業	1.7	1.1	2,550	P H Cホールディングス	19.2	27.6	41,565		19.2	27.6	41,565
ヤマシンフィルタ	32.8	35.5	12,815	タダノ	72.6	85	99,917	K O K U S A I E L E C T R I C	-	57.1	227,258		-	57.1	227,258
日阪製作所	13.3	16.1	16,051	フジテック	50.5	34.5	125,925	ソシオネクスト	14.1	107.2	393,745		14.1	107.2	393,745
やまびこ	22.5	24.1	38,969	C K D	38.1	40.9	103,027	東芝テック	20.6	18.9	60,669		20.6	18.9	60,669
野村マイクロ・サイエンス	4.6	5	66,250	平和	45.8	43.7	95,877	芝浦メカトロニクス	2.7	8.4	63,924		2.7	8.4	63,924
平田機工	6.6	7.1	49,629	理想科学工業	12.3	11.8	35,636	マブチモーター	34.3	72.6	184,186		34.3	72.6	184,186
P E G A S U S	15.3	16.3	7,237	S A N K Y O	27.1	34	306,000	ニテック	334.9	326	1,782,894		334.9	326	1,782,894
マルマエ	6.7	6.4	11,532	日本金銭機	15.2	17.8	25,703	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9.9	9.3	3,227		9.9	9.3	3,227

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
		千株		千株		千円		千株		千円		千株		千株		千円		千株		千円
トレッサ・セミコンダクター		6.5		7.6		13,056	マクセル		29.9		32.6		51,182	キヤノン電子		15.1		16.2		33,712
東光高岳		8.4		8.9		21,119	古野電気		18		19.2		39,052	キヤノン		749		729.3		2,980,649
ダブル・スコープ		45.1		42.3		30,709	スミダコーポレーション		12.6		19.8		22,928	リコー		342.2		366.6		465,398
ダイヘン		12.5		14.8		95,756	アイコム		5.4		5.7		20,491	象印マホービン		40.8		39.7		56,413
ヤーマン		23.8		28.7		28,814	リオン		5.7		6.1		15,512	MUTOHホールディングス		1.7		0.9		1,874
JVCケンウッド		125.5		116.6		76,606	横河電機		150.9		161.6		472,356	東京エレクトロン		96.3		309.5		8,814,560
ミマキエンジニアリング		13.1		14		13,440	新電元工業		5.3		5.6		17,640	イノテック		9.1		9.7		18,119
I P E X		7.6		10.2		17,911	アズビル		95.4		100.6		463,061	輸送用機器 (9.1%)						
日新電機		33		-		-	東亜ディーケーケー		5.9		3.1		2,935	トヨタ紡織		57.5		61.6		145,468
大崎電気工業		32.5		32.3		21,899	日本光電工業		63.1		62.7		249,984	芦森工業		2.3		1.3		3,120
オムロン		126.3		112.8		625,137	チノー		5.7		6.1		14,609	ユニプレス		24.5		26.2		29,055
日東工業		18.6		19.9		84,973	共和電業		11.6		6.1		2,580	豊田自動織機		99.8		124.7		1,685,320
I D E C		20.3		21.8		60,669	日本電子材料		9		9		17,208	モリタホールディングス		24		25.7		39,603
正興電機製作所		4.6		2.2		2,457	堀場製作所		30.3		27.9		344,983	三機工業		20.9		22.3		19,824
不二電機工業		2.5		1.3		1,492	アドバンテスト		107.5		418.9		2,561,573	デンソー		281.6		1,206.3		3,042,891
ジーエス・ユアサ コーポレーション		45.3		57.6		148,348	小野測器		4.5		2.7		1,242	東海理化電機製作所		38.6		41.2		94,677
サクサホールディングス		2.6		1.5		4,252	エスベック		10.9		11.7		29,881	川崎重工業		102.9		119.4		418,735
メルコホールディングス		3.7		4.6		14,950	キーエンス		136.5		146.3		9,389,534	名村造船所		31.2		36.4		49,140
テクノメディカ		3.3		3.5		6,685	日置電機		7.1		6.9		45,126	日本車輛製造		5.3		4.8		10,972
ダイキンエレクトリックホールディングス		4.5		5.5		3,839	シスメックス		117.7		126.2		960,760	三菱ロジスネクスト		21.8		23.3		36,441
日本電気		195		193.9		1,835,069	日本マイクロニクス		22.5		26.3		109,934	近畿車輛		1.5		0.9		1,806
富士通		137.4		135.9		3,125,020	メガチップス		11.2		11.6		55,100	日産自動車		1,939.1		1,973.1		1,211,680
沖電気工業		62.3		66.8		71,876	OBARA GROUP		6.4		8		31,520	いすゞ自動車		396.9		425.1		868,904
岩崎通信機		5.4		3.1		2,154	澤藤電機		1.4		0.8		1,047	トヨタ自動車		7,495.9		8,028.6		26,173,236
電気興業		5.5		6.6		15,635	原田工業		5.5		2.9		2,180	日野自動車		175.8		219.9		102,473
サンケン電気		12.8		13.7		106,860	コーセル		16.4		15.6		22,807	三菱自動車工業		532.6		570.4		259,931
ナカヨ		2.1		1.1		1,261	イリソ電子工業		12.6		13.4		40,803	エフテック		8.3		4.5		3,091
アイホン		8.4		8		22,936	オプテックスグループ		25.1		26.8		47,168	レップホールディングス		4.7		2.8		1,878
ルネサスエレクトロニクス		899.7		963.8		2,288,061	千代田インテグレ		4.7		5.7		15,600	GMB		2.4		1.3		1,675
セイコーエプソン		183.6		189.5		448,546	レーザーテック		62.5		67		2,674,640	ファルテック		2.1		1.3		726
ワコム		109.2		112.3		83,438	スタンレー電気		97.1		93.6		248,929	武蔵精密工業		33.3		35.7		61,368
アルバック		32.7		32.4		244,911	岩崎電機		4.4		-		-	日産車体		24.1		14.8		14,518
アクセル		4.5		5.9		13,440	ウシオ電機		71.3		74.3		152,835	新明和工業		42.9		42.1		49,088
E I Z O		10.1		10.8		53,460	岡谷電機産業		9.8		5		1,430	極東開発工業		24		24.2		58,007
ジャパニーズブレイ		528.8		636.3		12,726	ハリオス テクノ ホールディング		11.1		6.5		3,458	トピー工業		11.1		11.9		34,867
日本信号		31.4		33.7		32,183	エノモト		3.1		1.8		2,921	ティラド		3.4		3.2		12,080
京三製作所		29.9		30.9		14,368	日本セラミック		13.9		11.9		31,475	曙ブレーキ工業		83.3		89.1		10,157
能美防災		18.7		20		46,040	遠藤照明		5.4		2.9		4,428	タチエス		21.6		27		53,460
ホーチキ		10.3		11		23,386	古河電池		10.1		10.7		10,047	NOK		53		56.8		116,553
星和電機		5.2		2.9		1,392	双信電機		5		2.6		767	フタバ産業		36.5		39.2		38,376
エレコム		32.9		35.3		59,551	山一電機		11.9		13.1		28,767	カヤバ		13.1		14.1		71,064
パナソニック ホールディングス		1,628.6		1,744.5		2,495,507	図研		11.9		12.7		51,752	大同メタル工業		26.6		28.6		16,330
シャープ		166		248.9		214,576	日本電子		34.2		36.6		243,353	プレス工業		60.8		58.4		39,303
アンリツ		97.1		104		121,108	カシオ計算機		101.6		105.6		133,108	ミクニ		14		8.2		4,108
富士通ゼネラル		39.1		41.9		87,990	ファナック		133.9		713		2,812,785	太平洋工業		31.3		33.5		50,116
ソニーグループ		965.7		1,034.3		14,790,490	日本シイエムケイ		29		31.1		23,387	河西工業		16.1		10.3		1,936
T D K		218.4		233.8		1,776,646	エンプラス		4		4.3		46,827	アイシン		105.4		112.8		595,358
帝国通信工業		6.2		6.5		12,668	大真空		16.6		21.8		19,140	マツダ		451.5		483.6		919,807
タムラ製作所		59.1		58.8		31,810	ローム		63.1		270.3		719,538	今仙電機製作所		7.7		4.1		3,075
アルプスアルパイン		123.1		131.9		141,133	浜松ホトニクス		109.5		117.3		661,102	本田技研工業		1,109.7		3,565.6		6,098,958
池上通信機		4		2		1,796	三井ハイテック		14.1		12.9		95,382	スズキ		250.8		268.5		1,942,597
日本電波工業		16.5		17.7		21,169	新光電気工業		48.3		51.7		281,765	S U B A R U		432		453.4		1,403,273
鈴木		7.4		7.9		9,875	京セラ		212.1		908.5		1,887,408	安永		5.4		2.8		1,909
メイコー		15.1		14.7		67,326	太陽誘電		66.5		71.2		244,287	ヤマハ発動機		214.5		631.9		896,982
日本トリム		3.1		3.3		10,923	村田製作所		414		1,330.3		3,976,931	T B K		11.7		7		2,961
ローランド ディー・ジー		7.7		8.1		31,509	双葉電子工業		25.8		27.8		14,066	エクセディ		22.2		23.9		68,712
フォスター電機		12.8		10.9		12,327	北陸電気工業		4.5		2.4		3,381	豊田合成		39.8		41.9		123,730
S M K		3.3		3.8		9,500	ニチコン		27.9		38.4		48,384	愛三工業		22.6		24.2		35,283
ヨコオ		10.9		13		18,564	日本ケミコン		13.5		15.6		21,871	盟和産業		1.5		0.9		931
ティアック		18.8		10.6		1,049	K O A		20.6		22.1		32,199	日本ブラスト		9.5		5.5		3,327
ホシデン		33		33.6		60,312	市光工業		19.7		26.4		15,892	ヨロズ		12.6		13.7		13,672
ヒロセ電機		22.8		21.8		354,032	小糸製作所		164.2		151.5		305,727	エフ・シー・シー		24.3		25.9		54,131
日本航空電子工業		28.3		35.3		86,732	ミツバ		25.6		27.4		30,907	シマノ		55.8		59.1		1,245,532
T O A		15.7		16.8		18,900	SCREENホールディングス		23.3		50		817,250	ティ・エス テック		62.5		52		100,568

銘柄	期首(前期末)		当期 末		銘柄	期首(前期末)		当期 末		銘柄	期首(前期末)		当期 末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
ジャムコ		千株		千円	共同印刷		千株		千円	サカイ引越センター		千株		千円
精密機器 (2.3%)	6.6	7.1	10,792		N I S S H A	3.8	4.1	13,940		近海グループホールディングス	6.5	16.2	42,816	
テルモ	426.5	408.8	2,073,842		光村印刷	0.6	0.5	39,500		136.3	146	657,146		
クリエートメディック	4.2	2.1	1,871		TAKARA & COMPANY	8.8	8.6	24,355		181.7	194.7	887,832		
日機装	34.1	34.1	38,396		アッシュクス	126	124.6	585,620		65.1	65.1	193,867		
日本エム・ディ・エム	8	11.6	8,444		ツツミ	2.4	2.4	5,220		56.3	80.5	288,914		
島津製作所	166.2	194.3	750,386		ローランド	10	10.8	52,164		3.7	4	11,508		
JMS	12.8	13.4	6,994		小松ウオール工業	5.1	6	19,410		150.6	150.6	340,657		
クボテック	3.2	1.8	459		86.1	92.2	316,891		10.3	11	24,057			
長野計器	9.9	10.6	24,348		河合楽器製作所	3.7	4.4	15,422		10.9	11.7	22,101		
ブイ・テクノロジ	6.6	7.7	20,713		クリナップ	15.4	14.3	11,096		174.5	186.9	451,550		
東京計器	10.4	11.2	20,798		ピジョン	86.9	93.1	149,565		34.7	37.1	199,820		
愛知時計電機	5.4	6.3	16,304		兼松サステック	0.6	-	-		丸連	6.5	3.7	1,036	
インターアクション	6.4	8.8	9,900		キングジム	12.2	13	11,323		丸全昭和運輸	8.5	9	37,350	
オーバル	10.7	5.7	3,100		リントック	27.4	29.4	82,114		72.2	77.3	87,194		
東京精密	29.9	29.9	283,631		イトーキ	27.9	30	46,920		2.5	3.2	14,864		
マニー	60.1	58.5	120,217		任天堂	861.9	923.1	7,725,423		43.7	46.7	148,926		
ニコン	212.3	211.4	319,108		三菱鉛筆	19.4	20.8	40,996		0.8	0.7	2,009		
トプコン	71.8	71.1	122,043		タカラスタンダード	26.4	30.8	57,934		10.4	16.7	71,309		
オリンパス	853.3	900	1,930,500		コクヨ	65.7	59.9	141,573		84.9	82.1	177,294		
理研計器	8.5	10.4	82,472		ナカバヤシ	15	15.7	8,478		3.7	1.8	1,564		
タムロン	10.2	9	51,570		グロープライド	11	13.1	27,248		3.9	4	12,440		
HOYA	291.5	287.8	5,295,520		オカムラ	41.1	44.1	96,005		32.9	37.3	56,770		
シード	6.2	3.3	2,646		美津濃	13.5	14.5	63,945		13.2	14.1	24,745		
ノーリツ鋼機	12.9	13.9	45,592		電気・ガス業 (1.4%)					九州旅客鉄道	96.3	103.2	348,093	
A&Dホロンホールディングス	19.9	21.3	45,156		東京電力ホールディングス	1,230.6	1,318	1,005,502		SGホールディングス	261.6	245.1	460,910	
朝日インテック	152.5	178.2	515,176		中部電力	503.1	538.8	1,057,395		50.9	49.5	429,066		
シチズン時計	149.9	134.5	130,868		関西電力	527.1	564.6	1,080,362		海運業 (0.9%)				
リズム	3.8	1.5	5,355		中国電力	217.4	254	251,053		日本郵船	364.6	418.4	2,048,068	
大研医器	9.3	5.6	3,029		北陸電力	128.7	149.5	106,279		240.2	316.8	1,674,288		
メニコン	46.9	50.3	107,013		東北電力	333.7	384.9	386,632		116.1	117.2	823,330		
シンシア	1.2	0.8	468		四国電力	116.5	136.2	140,830		7.3	7.9	40,211		
松風	6.2	6.6	17,721		九州電力	315	337	389,403		11.8	7.1	5,530		
セイコーグループ	21.2	20.4	54,835		北海道電力	131.7	141.2	89,873		50	53.6	72,306		
ニプロ	113.8	121.9	146,462		沖縄電力	31.9	37.3	40,768		2.2	1.2	1,225		
その他製品 (2.4%)					電源開発	102.8	120.1	308,596		17.3	17.1	18,365		
KYORITSU	17.6	9.7	1,959		エフオン	8.9	10.6	4,706		空運業 (0.4%)				
中本パックス	3.8	2.1	3,645		イーレックス	24.3	26	19,994		日本航空	334.8	358.5	1,001,111	
スノーピーク	23.3	20.8	17,700		レノバ	36.3	39	47,697		ANAホールディングス	370.8	397.2	1,287,722	
パワフロントホールディングス	31.6	30.4	81,016		東京瓦斯	288.6	309.1	1,021,575		パスコ	2.5	1.3	2,442	
トランザクション	10.5	9.6	23,654		大阪瓦斯	276.6	296.2	918,516		倉庫・運輸関連業 (0.1%)				
粧美堂	3.5	1.8	1,398		東邦瓦斯	53.8	63.3	189,108		トランコム	3.9	4.2	29,232	
ニホンフラッシュ	12.9	13.7	13,110		北海道瓦斯	8.2	8.7	19,992		10.3	11.1	29,903		
前田工織	11.6	12.4	38,750		広島ガス	28.8	30.9	12,174		29.3	35.9	158,498		
永大産業	13	7.5	1,770		西部ガスホールディングス	12.8	15.3	29,024		12.7	13.6	64,872		
アートネイチャー	14.1	13.2	10,520		静岡ガス	31.2	29.2	29,784		37.5	39.4	99,169		
フルヤ金属	-	3.5	32,690		メタウオーター	17	17.5	37,275		5.5	6.7	20,937		
パナソニックホールディングス	124.7	400.6	1,212,215		陸運業 (2.7%)					16.4	1.7	2,669		
アイフィスジャパン	3.5	1.9	1,145		SBSホールディングス	12.2	13	32,162		27.6	29.4	18,610		
S HOE I	14.4	33.1	64,611		東武鉄道	150	160.6	628,749		2.2	1.1	2,125		
フランスベッドホールディングス	16.8	19	26,448		相鉄ホールディングス	45.1	52.3	148,139		6.7	7.8	9,063		
パイロットコーポレーション	21.4	20.6	82,523		東急	382.7	410	704,995		2.1	1.3	1,463		
萩原工業	9.1	9.8	14,592		京浜急行電鉄	154.8	180.9	234,265		9.5	10	12,110		
フジシルインターナショナル	27.7	29.6	51,504		小田急電鉄	206.9	241.8	533,289		2.3	0.9	1,191		
タカラトミー	62.9	66.6	158,474		京王電鉄	72.2	70.3	294,416		3.5	1.9	2,644		
広済堂ホールディングス	8.2	37.6	27,786		京成電鉄	88	94.3	650,670		65.3	67.4	228,620		
エステルホールディングス	2.9	1.7	1,113		富士急行	16.8	18	78,570		2.8	1.6	1,259		
タカノ	4.6	2.4	2,412		東日本旅客鉄道	231.6	268.6	2,417,400		5.9	3.1	5,031		
プロネクサス	11.4	15.2	19,319		西日本旅客鉄道	174.3	173.4	1,112,361		7.3	6.6	6,039		
ホクシン	9.4	4.8	552		東海旅客鉄道	105.2	563.2	2,124,390		7.5	3.8	1,113		
ウッドワン	4	2.4	2,464		西武ホールディングス	165.1	176.9	375,028		8.6	9.2	17,056		
大建工業	8.3	-	-		鴻池運輸	23.3	24.9	47,484		5	5.8	14,018		
TOPPANホールディングス	178.5	179.7	708,018		日本本紙	36.4	39.1	96,264		4.2	5.3	9,306		
大日本印刷	162	159.8	668,763		ハマキョウレックス	10.7	12.5	50,187		情報・通信業 (7.6%)				
										NECネットエスアイ	45.7	57.2	133,218	

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
クロスキャット		千株	千円	アドソル日進	千株	千株	千円	FIG		千株	千株	千円			
システナ	7.8	9.3	10,918	ODKソリューションズ	5.8	6.2	9,901	システマサポート	14.1	7.6	2,287				
デジタルアーツ	230.2	221.9	63,907	フリービット	2.7	1.3	782	イーノム	5.3	5.7	10,847				
日鉄ソリューションズ	8.7	9.3	39,246	コムチュア	7.1	6.4	9,158	アルテリア・ネットワークス	8.8	10.6	6,190				
キューブシステム	23.4	25	124,375	サイバコム	18.1	21.2	38,859	東海ソフト	1.9	1.1	1,283				
T I S	8.3	7.8	8,884	アステリア	2	-	-	ウイングワーク1st	14.1	15.2	43,350				
手間いらず	5.9	6.5	11,648	アイル	10.7	11.5	7,233	ホコエコーポレーション・ホールディングス	3.7	3.9	4,539				
ラクーンホールディングス	2.3	2.5	6,695	マークライズ	7.6	6.8	21,964	サーバーワークス	2.8	3	12,120				
ソリトンシステムズ	11.4	10.9	7,542	メディカル・データ・ビジョン	7.4	7.9	23,700	東名	0.9	0.5	1,140				
ソフトクリエイトホールディングス	7	7.6	10,716	g u m i	20.4	17.5	11,095	ヴィッツ	1.2	0.6	493				
TEC	5.7	12.1	21,634	ショーケース	21.1	23.8	9,496	トビラシステムズ	3.1	1.9	1,654				
テクミラホールディングス	153.9	160.4	546,803	モバイルファクトリー	3	1.5	499	Sansan	44.7	48.1	67,772				
グリー	5.6	3	1,422	テラスカイ	2.6	1.4	1,016	Link-U	2.3	1.6	1,014				
GMOペパボ	36.7	49.1	28,428	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5.9	6.3	9,620	ギフティ	14.9	12.9	19,866				
コーエーテックホールディングス	2	1.8	2,149	PCIホールディングス	7.9	7.6	13,512	メドレー	13.7	19.7	90,915				
三菱総合研究所	85.8	91.9	165,098	アイビーシー	5.1	2.4	2,433	JMDC	4.6	5.1	16,294				
ボルテージ	6.7	7.2	35,352	ネオジャパン	1.9	1	468	フォーカスシステムズ	22.5	25	91,900				
電算	3.6	1.8	487	PR TIME S	4.5	4.9	5,169	グレスコ	10	9.8	10,280				
AGS	0.8	0.8	1,197	ラクス	3.4	2.9	6,223	フブ・メディア・ホールディングス	10.5	12	23,604				
ファンデックス	5.3	2.7	2,459	ランドコンピュータ	64.7	69.4	165,484	オービック	13.4	140.9	276,938				
ブレインパッド	10.7	11.6	11,774	ダブルスタンダード	3	3.1	2,749	ジャストシステム	45.7	49	1,099,315				
K L a b	10.2	12.2	15,396	オーブントピア	5.6	4.5	7,389	TDCソフト	19.7	21.1	62,329				
ホルトウィンホールディングス	27.2	26.9	9,657	マイネット	9.6	8.5	8,007	LINEヤフー	11.6	13.7	29,085				
ネクソン	23.4	25	12,125	アカツキ	4	2.1	583	トレンドマイクロ	1,948.4	2,087.7	904,600				
アイスタイル	354	328.2	948,662	ベネフィットジャパン	6.5	7	17,528	IDホールディングス	79	69.3	572,279				
エムアップホールディングス	39.8	47.8	19,550	Ubicomホールディングス	0.8	0.4	498	日本オラクル	9.3	9.9	16,780				
イーチーム	16.7	18	17,964	カナミックネットワーク	4.2	4.6	7,369	アルファシステムズ	26.2	28.1	316,827				
エニゴモ	9.9	8.7	4,863	チェンジホールディングス	19.7	15.8	6,699	フューチャー	4.3	3.9	12,246				
テクノスジャパン	17.4	18.6	6,510	シンクロ・フード	11.7	7.1	809	CAC Holdings	34.1	31.3	53,303				
enish	10	5.8	3,700	オークネット	33.5	31.9	43,830	S B テクノロジー	8.6	7.9	14,180				
コロプラ	9.2	6.6	1,214	キャピタル・アセット・プランニング	7.6	4.1	2,681	トーテ	5.8	6.2	13,615				
オルトプラス	53.2	56.9	35,676	セブエグループ	6.7	5.4	11,485	オービックビジネスコンсалタント	3.2	1.9	1,345				
ブロードリーフ	9.2	5.8	881	エイトレッド	2.4	1.3	978	伊藤テクノソリューションズ	26.9	20.6	145,477				
クロス・マーケティンググループ	79.9	69.6	43,708	マクロミル	1.9	1	1,416	アイティフォー	73.5	-	-				
デジタルハーツホールディングス	7.3	3.1	1,779	ビーグリー	26.8	28.8	22,320	東計電算	18.2	18.8	22,729				
システム情報	8.6	9.1	9,500	ユーザローカル	2.1	1.4	1,785	エックスネット	2	4.1	15,088				
メディアアドゥ	12.1	-	-	テモナ	4.1	5.3	15,184	大塚商会	1.8	1	1,105				
じげん	5.5	6.6	8,210	ニーズウェル	5	6.2	12,920	サイボウズ	77.6	72.7	434,964				
ブイキューブ	39.9	42.8	22,256	マネーフォワード	2.3	1.5	384	電通総研	18.9	20.2	45,510				
エンカレッジ・テクノロジ	16.4	17.5	5,285	サインポスト	3.7	3.6	2,862	ACCESS	16.6	17.8	96,654				
サイバーリンクス	2.9	1.5	958	SUN ASTERISK	32.9	32.7	187,567	デジタルガレージ	16.2	15.2	12,768				
ディー・エル・イー	3.9	2.5	2,022	プラスアルファ・コンсалティング	4.7	2.5	1,280	イーエムシステムズ	24.3	23.4	82,251				
フィックスターズ	8.8	4.6	846	電算システムホールディングス	7.2	10.4	9,994	ウェザーニューズ	22.8	24.5	16,709				
CARTA HOLDINGS	15.5	16.5	26,383	アプリエーグループ	-	8.7	21,228	C I J	4.2	4.5	22,995				
オプティム	6.4	6.9	10,736	ビジョナル	6.6	6.5	19,220	ビジネスエンジニアリング	11.4	24.4	16,714				
セレス	11.2	5.9	7,351	ソルクシーズ	38.9	50.1	85,671	日本エンタープライズ	2.6	2.8	12,474				
S H I F T	5.5	9.7	266,604	フェイス	-	11.2	102,816	WOWOW	12.4	6.6	818				
ティーガイア	10	15.4	31,339	プロトコム・ポレーション	10.2	5.3	2,141	スカラ	7.6	11	12,760				
セック	14.3	1.7	1,800	ハイマックス	3.4	1.8	874	インテリジェント ウェイ	12.7	13.5	10,260				
テクマトリックス	2.5	26.8	50,946	野村総合研究所	17.1	16.1	21,960	ANY COLOR	6.5	3.5	3,934				
プロシップ	6	7.1	9,989	サイバネットシステム	4.3	4.5	6,309	WOW WORLD GROUP	-	15.5	52,390				
カホー・ワトライフ・エンターテインメント	41.9	38.2	94,984	CEホールディングス	280.9	324.9	1,374,327	IMAGICA GROUP	2.2	-	-				
GMOペイメントゲートウェイ	31.3	29.3	258,250	日本システム技術	11.5	-	-	ネットワンシステムズ	11.2	14.7	10,216				
ザップパラ	3.4	1.5	649	インテックホールディングス	6.2	3.4	2,067	システムソフト	51	59.2	160,106				
システムリサーチ	4.2	5	17,125	東邦システムサイエンス	5.1	5.4	17,577	アルゴラフィックス	46	50.8	2,946				
インターネットエンターテイ	76.4	70.1	198,207	ソースネクスト	15.5	16.6	28,552	マーベラス	12.6	13.5	56,025				
さくらインターネット	15.3	16.5	62,452	インフォコム	3.5	5.5	6,897	エイベックス	22.3	23.8	17,635				
ヴィンクス	3.6	-	-	シンプルクス・ホールディングス	69.6	67.1	9,662	B I P R O G Y	23.2	25	35,225				
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4.2	4.5	12,370	HEROZ	17.6	18.9	41,598	兼松エレクトロニクス	50.4	48	215,760				
SRAホールディングス	7	7.5	29,100	ラクスル	23	22.1	55,581	都築電気	8.5	-	-				
システムインテグレイター	4.7	2	868	メルカリ	4.5	5.8	9,094	TBSホールディングス	7.2	7.7	18,641				
朝日ネット	14.8	15.8	9,938	IPS	38.7	35.3	37,523	日本テレビホールディングス	70.2	73.7	297,748				
e B A S E	19.3	20.7	14,717		61.8	71.4	174,037	朝日放送グループホールディングス	121.3	129.8	290,946				
アバントグループ	17.3	18.5	25,326		4.4	4.2	8,513		13	13.7	9,617				

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
テレビ朝日ホールディングス		千株	千円	ハイパー	千株	千円	シークス	千株	千円		千株	千円			
スカパーJ SATホールディングス	33.3	35.6	78,498	あい ホールディングス	2.5	1.6	20.5	20.5	22	34,342	20.5	22	34,342		
日本BS放送	121.3	113.9	94,878	ディーピーエックス	23.1	24.8	61,032	田中商事	3.9	1.9	1,575	3.9	1.9	1,575	
ビジョン	9.8	10.6	35,139	ダイワボウホールディングス	3.5	1.9	2,036	オーハシテクニカ	7.2	8.1	15,106	7.2	8.1	15,106	
スマートバリュー	4.4	2.4	2,186	マツコホールディングス	59	68.5	215,364	白鋼	5.3	4.5	11,092	5.3	4.5	11,092	
USEN-NEXT HOLDINGS	18.1	22.1	25,061	ラクト・ジャパン	35.4	36.6	295,179	ダイコー通産	1.4	0.7	845	1.4	0.7	845	
ワイヤレスゲート	3	1.9	750	グリムス	5.7	6	13,512	伊藤忠商事	890.1	1,039.9	7,004,766	890.1	1,039.9	7,004,766	
コネクショ	12.3	16.4	68,634	バイタルケアエスターホールディングス	6	6.5	13,351	丸紅	1,140.3	1,289.8	3,077,462	1,140.3	1,289.8	3,077,462	
日本通信	5.5	2.8	800	メディアスホールディングス	21.1	23.4	27,963	高島	2.1	4.7	6,363	2.1	4.7	6,363	
クロップス	8.9	-	-	ハ洲電機	11.8	12.5	16,175	長瀬産業	67.9	70.9	170,620	67.9	70.9	170,620	
日本電信電話	126.2	144.3	34,199	メデアスホールディングス	9.2	9	6,705	蝶理	7.8	9.7	28,624	7.8	9.7	28,624	
KDDI	2.1	0.9	918	レスターホールディングス	13.8	13.2	39,930	豊田通商	126.5	135.5	1,260,150	126.5	135.5	1,260,150	
ソフトバンク	1,754.4	43,620.3	7,999,963	ジオリーブグループ	2.7	1.6	2,134	三共生興	20.7	21.5	16,748	20.7	21.5	16,748	
光通信	1,058	1,133.2	5,211,586	大光	5.2	3.6	2,300	兼松	56	64.7	150,492	56	64.7	150,492	
エムティーアイ	2,199.3	2,360	4,589,020	OCHIホールディングス	2.9	1.6	2,560	ツカモトコーポレーション	1.9	1	1,224	1.9	1	1,224	
GMOインターネットグループ	16.1	14.8	385,170	TOKAIホールディングス	71.3	84	84,420	三井物産	1,056.8	1,165.6	6,807,104	1,056.8	1,165.6	6,807,104	
ファイバーゲート	12.5	10.1	6,201	黒谷	3.7	2.2	1,344	日本紙パルプ商事	7.6	7.4	37,518	7.6	7.4	37,518	
アドマークetingofコミュニケーション	50.9	54.2	141,733	Cominix	2.4	1.4	1,188	カメイ	15.4	16.4	31,504	15.4	16.4	31,504	
KADOKAWA	7.3	7.9	7,394	三洋貿易	14.9	17.5	22,505	東都水産	0.6	0.4	2,560	0.6	0.4	2,560	
学研ホールディングス	3.1	1.8	423	ビューティガレージ	2.3	4.9	10,520	OUGホールディングス	2	1	2,435	2	1	2,435	
ゼンリン	72.3	77.5	250,945	ウイン・パートナーズ	10.5	10.1	12,726	スターゼン	11	10.7	29,157	11	10.7	29,157	
昭文社ホールディングス	22.8	24.4	24,644	ミタチ産業	3.3	1.9	2,133	山善	38.9	46.9	58,953	38.9	46.9	58,953	
インプレスホールディングス	23.3	25.1	21,435	シッパルスケアホールディングス	51.9	55.6	123,320	椿本興業	2.1	3.1	21,142	2.1	3.1	21,142	
アイネット	5.6	2.9	1,078	明治電機工業	5.5	5.8	8,479	住友商事	894.6	936.3	3,143,159	894.6	936.3	3,143,159	
松竹	10.8	6.6	1,168	デリカフーズホールディングス	5.2	3	1,782	内田洋行	6.4	6.3	49,329	6.4	6.3	49,329	
東宝	8.4	8.9	17,132	スターティアホールディングス	2.5	1.8	2,842	三菱商事	903.1	3,065.3	8,527,664	903.1	3,065.3	8,527,664	
東映	7.8	7.6	77,558	コメダホールディングス	35.3	37.9	104,869	第一実業	5.1	14.6	27,302	5.1	14.6	27,302	
NTTデータグループ	85.7	81.6	386,294	ピーバンドコム	1.7	0.9	363	キャノンマーケティングジャパン	33.4	35.8	155,157	33.4	35.8	155,157	
ピー・シー・エー	3.8	4.8	96,624	アセンテック	4.7	5.9	3,363	西華産業	5.7	6.1	19,581	5.7	6.1	19,581	
ビジネスブレイン太田昭宏	429.6	383.4	800,730	富士興産	2.9	1.9	4,145	佐藤商事	10.1	10.9	18,519	10.1	10.9	18,519	
DT S	7.8	8.4	13,255	協栄産業	1.1	0.7	2,093	菱洋エレクトロ	12.3	14.7	56,815	12.3	14.7	56,815	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5.9	5.7	12,768	フルサト・マルカホールディングス	14.3	13.8	34,099	東京産業	13.3	14.1	10,560	13.3	14.1	10,560	
シーイーシー	29.1	30.9	112,630	ヤマエグループホールディングス	8.2	8.7	27,013	ユアサ商事	13	12.1	60,076	13	12.1	60,076	
カプコン	68.8	67	416,606	小野建	13.4	15.4	28,490	神鋼商事	3.6	3.9	26,235	3.6	3.9	26,235	
アイ・エス・ピー	19.2	18.5	30,691	南陽	2.5	1.4	3,102	トルク	6.6	3.7	1,087	6.6	3.7	1,087	
ジャストテック	136	131.1	738,617	佐島電機	8	8.6	19,986	阪和興業	25.9	27.8	149,842	25.9	27.8	149,842	
S C S K	7	7.5	11,790	エコトレーディング	2.5	1.3	1,602	正栄食品工業	9.6	10.3	47,122	9.6	10.3	47,122	
N S W	8.4	9	11,934	伯東	8.3	8.9	51,798	カナデン	11.7	11.6	17,400	11.7	11.6	17,400	
アイネス	111.7	102.6	272,043	コンドーテック	11.1	11.9	14,399	R Y O D E N	11.6	12.5	32,900	11.6	12.5	32,900	
T K C	5.4	6.3	18,685	中山福	6.6	3.9	1,407	岩谷産業	32.9	35.2	246,118	32.9	35.2	246,118	
富士ソフト	9.5	11.4	16,917	ナガイレーベン	18.2	19.6	45,942	ナイス	3.5	2.1	3,332	3.5	2.1	3,332	
N S D	24.6	23.3	88,307	三菱食品	13.4	14.3	72,644	ニチモウ	1.4	2.2	4,952	1.4	2.2	4,952	
コナミグループ	15.5	29.5	188,800	松田産業	10.9	11.8	31,222	極東貿易	8.7	9.2	20,460	8.7	9.2	20,460	
番井コンピュータホールディングス	48.8	52.3	140,373	第一興商	27.9	59.9	120,279	アステナホールディングス	25	29	13,688	25	29	13,688	
J B C Cホールディングス	58.6	54.9	507,111	メディパルホールディングス	149.7	157.3	373,194	三菱オプリア	39.8	37.2	64,356	39.8	37.2	64,356	
ミロク情報サービス	9.5	9.1	23,241	S P K	6.4	6.9	13,882	稲畑商事	29.2	30.6	96,696	29.2	30.6	96,696	
ソフトバンクグループ	9.9	9.7	38,121	萩原電気ホールディングス	5.5	6.6	33,990	G S I クレオス	8.5	8.3	19,812	8.5	8.3	19,812	
卸売業 (7.3%)	12.5	13.3	25,961	アズワン	21.2	24.2	133,027	明和産業	19.2	18.3	13,139	19.2	18.3	13,139	
高千穂交易	791.6	723.4	4,787,461	スズデン	5.1	5.4	12,123	クワザワホールディングス	4.4	2.5	1,755	4.4	2.5	1,755	
オルパルスケアホールディングス	4.5	4.9	19,526	尾家産業	3.1	1.6	2,945	ワキタ	26.5	25.6	40,857	26.5	25.6	40,857	
伊藤忠食品	2	1.1	2,060	シモジマ	9.9	10.4	13,478	東邦ホールディングス	35.9	42.8	136,403	35.9	42.8	136,403	
エレマテック	2.7	3.5	27,405	ドウシシャ	15.3	14.3	30,358	サンゲツ	36.3	35.6	116,056	36.3	35.6	116,056	
あらた	1.3	13.9	25,117	小津産業	2.9	1.5	2,479	ミヨウコグループホールディングス	18.6	19.8	32,353	18.6	19.8	32,353	
トーメンデバイス	11	23.7	73,588	高速	7.5	9.2	21,675	シナネンホールディングス	4.6	4.3	17,630	4.6	4.3	17,630	
東京エレクトロン デバイス	2.1	2.2	11,726	たげびし	5.6	5.9	11,859	伊藤忠エネクス	35.8	38.4	59,827	35.8	38.4	59,827	
円谷フーズホールディングス	5.4	15.4	100,562	リックス	2.7	2.6	9,282	サンリオ	41	43.8	274,582	41	43.8	274,582	
双日	12.4	26.6	47,507	丸文	12.9	13.8	21,307	サンワ テクノス	7.4	7.9	17,822	7.4	7.9	17,822	
アルフレックス ホールディングス	153.3	172.3	641,300	ハビネット	12.3	13.2	37,501	リョーサン	15.4	10.9	54,445	15.4	10.9	54,445	
横浜冷凍	144.9	155.3	371,865	機本総業ホールディングス	5.8	6.1	7,917	新光商事	19.4	20.8	25,272	19.4	20.8	25,272	
神栄	39.4	42.1	46,731	日本ライフライン	42.3	45.4	59,519	トーホー	6.2	6	17,664	6.2	6	17,664	
ラサ商事	1.8	1	1,712	タカショー	12.5	13.5	6,709	三信電気	5.8	6.2	14,365	5.8	6.2	14,365	
アルコニック	5.8	6.3	10,621	I D O M	43.7	40.9	36,932	東陽テクニカ	15.9	15.7	22,780	15.9	15.7	22,780	
神戸物産	19	20.4	28,580	進和	9.6	9.5	23,132	モスフードサービス	21.3	22.8	78,432	21.3	22.8	78,432	
	111.8	119.7	443,847	エスケイジャパン	3.2	1.7	1,207	加賀電子	11.8	14.1	95,739	11.8	14.1	95,739	
				ダイトロン	5.7	6.1	18,788	ソーダニッカ	9.4	13.1	15,418	9.4	13.1	15,418	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額	
立花エレクトック		千株	千株	千円	MonotaRO	千株	千株	千円	アドヴァングループ	千株	千株	千円			
フォーバル	10.5	10.3	32,136		204.7	219.3	302,962		13.8	14.7	15,611				
PAL TAC	5.5	6.1	8,430		3.1	1.7	904		4.7	5	13,345				
三谷産業	22.7	20.9	91,667		DDグループ	8.3	4.4	6,688		14	7.4	3,145			
太平洋興発	25.3	27	10,449		きぢりホールディングス	3.1	1.8	1,848		ハウス オブ ローゼ	1.7	0.9	1,457		
西WISMETACホールディングス	4.4	2.5	2,085		アークランドサービスホールディングス	11.8	—	—		G-7ホールディングス	18	16.9	23,474		
ヤマタシメタカホールディングス	3.6	3.9	24,921		J.フロント リテイリング	179.5	177.5	266,871		イオン北海道	21.4	45.7	42,546		
コア商事ホールディングス	1	0.6	1,345		ドール・日レスホールディングス	25.6	27.4	58,882		コジマ	28	25.6	18,790		
KPPグループホールディングス	8.2	10.9	8,120		マツコヨコカラ&カンパニー	87.6	281.4	781,588		ヒマラヤ	4.1	2.2	2,057		
ヤマタネ	33.6	40	28,720		プロンコピレー	7.6	9.1	30,348		コーナン商事	19.5	19	75,240		
丸紅建材リース	6.4	6.8	16,694		ZOZO	95.5	98.6	331,986		エコス	5.4	5.7	14,335		
日鉄物産	0.8	0.5	1,429		トレジャー・ファクトリー	3.9	8.5	12,316		ワタミ	17.4	16.4	16,613		
泉州電業	9.9	—	—		物語コーポレーション	8	25.8	136,224		マルシェ	4	2.5	607		
トラスコ中山	7.2	7.2	27,252		三越伊勢丹ホールディングス	243.1	260.5	509,928		丸ノ内ホールディングス	291.5	312.4	1,032,482		
オートバックスセブン	30.3	32.5	79,040		Hamee	5	6.2	6,776		西松屋チェーン	32	30.4	64,873		
モリト	50.2	53.9	87,587		マーケットエンタープライズ	1.3	0.6	616		ゼンショーホールディングス	79	78.8	580,046		
加藤産業	10.4	11.1	15,717		ウエルシアホールディングス	74.9	80.2	210,244		幸楽苑ホールディングス	9.5	11.4	14,979		
北恵	17.5	19.2	89,376		クリエイトSDホールディングス	23.8	21.9	70,737		ハーグスレイ	4.5	2.4	2,179		
イエローハット	2.9	1.7	1,463		丸善CHIホールディングス	15.4	8.3	2,705		サイゼリヤ	24	22.9	111,866		
J Kホールディングス	25.5	24.6	46,321		ミサワ	2.4	1.5	928		V Tホールディングス	54.8	58.8	31,281		
日伝	11.4	11.9	12,316		ティーライフ	1.7	0.9	1,268		魚力	4.5	5.4	13,046		
北沢産業	8.6	10.5	28,602		イー・ピーホールディングス	1.9	1.7	1,654		ポプラ	3.2	1.8	439		
杉本商事	7.1	4.2	1,302		チムニー	4	2.1	3,059		フジ・コーポレーション	8.2	7.4	13,090		
因幡電機産業	6.2	7.3	16,439		シュッピン	10.7	14	14,182		ユナイテッドアローズ	15.4	18.2	35,672		
東テック	37.4	40.1	140,350		オイシックス・ラ・大地	19.4	20.8	28,579		ハイデイド白濁	21.4	22.9	65,494		
ミスミグループ本社	4.9	5.1	33,507		ネクステージ	32.9	35.3	84,296		YU-WA CREATION HOLDINGS	7.1	3.7	536		
アルテック	217.9	233.6	542,302		ジョイフル本田	42.8	45	87,390		コロワイド	66.6	66.5	154,047		
タキヒヨー	7.1	3.7	925		鳥貴族ホールディングス	5.4	5.7	21,004		ピーシーデココーポレーション	15.7	—	—		
蔵王産業	3.1	1.6	1,929		ホットランド	11	11.8	23,847		香雪屋	11.5	12.2	76,738		
スズケン	2.2	1.2	3,084		すかいらーくホールディングス	197.4	211.4	501,652		トップカルチャー	4.2	2.2	345		
ジェコス	44.9	58.9	271,941		SFPホールディングス	7.9	8.5	18,062		P L A N T	3.2	1.5	2,422		
グローセル	9.4	9.3	11,085		縮半ホールディングス	11.4	12	17,760		スギホールディングス	29.1	31.2	217,807		
小売業 (4.2%)	15.4	18.1	13,538		ヨシダホールディングス	2.6	3.2	9,478		葉玉堂ホールディングス	8	7.6	19,486		
ローソン	35.8	32.9	337,883		コナチキス・スーパーマーケットホールディングス	47.2	43.1	43,143		ヴィア・ホールディングス	17.9	10.2	1,560		
サンエー	11	11.8	54,044		ゴルフダイジェスト・オンライン	6.5	7	4,340		スクロール	21.5	23	22,264		
カワチ薬品	11.4	12.1	32,827		B E E N O S	8.2	6.3	9,097		ヨドショーホールディングス	12.4	14.6	28,776		
イービーシー・マート	21.1	67.7	176,561		あさひ	12.1	14.3	18,661		木曾路	21.9	23.4	61,167		
ハードオフコーポレーション	5.2	5.5	10,092		日本調剤	9.9	10.5	15,330		S R Sホールディングス	23.8	25.5	29,860		
アスコム	29.8	37.3	73,854		コスモス薬品	14.2	13.1	209,600		千趣会	27.1	28.4	7,838		
ゲオホールディングス	15.2	17.4	41,394		トーエル	5.8	3.1	2,458		タカキュー	9.2	—	—		
アズストリア	17.4	18.7	67,600		セブン&アイ・ホールディングス	497.8	533.1	3,238,049		リテールパートナーズ	21.5	23	39,951		
ジーフット	6.8	5.7	1,692		クワイエット・レストラン・ホールディングス	108.7	104.7	114,332		ケーヨー	23.4	—	—		
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1.7	0.9	686		ツルハホールディングス	30.3	32.5	357,662		上新電機	12.9	15.3	36,352		
くら寿司	16.9	18.1	71,314		サンマルクホールディングス	11.7	12.5	28,000		日本瓦斯	77.4	82	195,693		
キャンドゥ	5.2	5.5	14,778		フェリシモ	2.9	1.5	1,375		ロイヤルホールディングス	28	27.3	69,560		
I Kホールディングス	4	2.3	878		トリドールホールディングス	35.9	43.4	195,213		東天紅	0.6	0.5	421		
バルグループホールディングス	14.1	30.4	69,403		TOKYO BASE	14.8	18.5	5,716		いなげや	14.1	15	19,110		
エディオン	57.2	61.2	94,186		ウエルブラスホールディングス	2.1	1.4	1,440		チヨダ	13.8	14.8	13,246		
サウコーポレーション	30.3	32.5	26,097		JMホールディングス	12.3	11.7	27,565		ライフコーポレーション	12.6	16.2	60,993		
ワッツ	6.3	3.3	1,940		サツドラホールディングス	5.8	2.8	2,251		リンガーハット	18.6	20	48,060		
ハローズ	6.6	7	30,065		アレックスホールディングス	10.8	11.6	13,502		Mr Ma x HD	20.4	19.5	12,285		
フジオフードグループ本社	12.1	17.4	25,021		華かつ田中ホールディングス	3.8	4.1	8,077		テンアライド	13.7	9.1	2,884		
あみやき亭	3.5	3.7	16,668		パロックスパブリシティ	9.4	12	9,828		AOKIホールディングス	26.8	33.2	39,441		
ひらまつ	27.2	16.4	4,428		クスリのアオキホールディングス	12.9	46.6	146,277		オークワ	2.3	22.2	20,024		
大黒天物産	4.4	4.8	42,096		力の源ホールディングス	7.4	7.9	11,502		コムレ	22.3	23.8	77,588		
ハニースホールディングス	11.4	13.7	23,235		FOOD & LIFE COMPANIES	83	82.5	235,578		青山商事	30.9	33.1	60,275		
ファーマライズホールディングス	2.9	1.6	1,046		メディカルシステムネットワーク	12.6	16.8	9,727		しまむら	16.9	18.2	293,475		
アルパ	11.9	12.7	25,501		一家ホールディングス	2.8	1.7	1,196		はせがわ	6.2	3.3	1,191		
ハブ	4.1	2.2	1,610		ジャパックスラフホールディングス	4	4.9	823		高島屋	108.9	106.9	235,393		
クオールホールディングス	19.9	21.3	34,655		はるやまホールディングス	5.3	3.3	1,966		松屋	24.5	26.2	25,361		
ジンスホールディングス	8.6	9.2	37,996		ノジマ	47.2	44.9	72,199		エイチ・ツー・オー リテイリング	70.3	68.5	124,533		
ビックカメラ	96	82.3	110,693		カツパ・クワイエット	22.8	24.3	41,917		近鉄百貨店	4.6	6.6	16,962		
DCMホールディングス	88.1	81.8	112,311		ライトオン	9.7	5.2	2,168		丸井グループ	106.5	102.7	250,177		
ベッパードサービス	30.2	35.8	3,329		良品計画	186.3	168.9	356,885		アックス リテイリング	9.9	10.6	41,605		
					パルミキホールディングス	16.5	8.6	4,222		井筒屋	6.1	3.2	1,139		

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
		千株	千円		千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		
イオン	489.7	524.4	1,878,925	1,716	1,679.2	1,366,197	野村ホールディングス	2,476.6	2,421.5	1,955,845										
イズミ	22	27.4	95,543	244.4	517.5	1,501,526	岡三証券グループ	118.4	126.5	89,182										
平和堂	24	25.9	57,342	982.5	1,023.9	7,870,719	丸三証券	44.7	47.9	44,163										
フジ	22.2	23.7	46,333	374.7	401.3	438,219	東洋証券	44.6	38.2	12,644										
ヤオコー	16.3	17.5	149,677	260.6	279.5	213,705	光世証券	146.2	171	97,470										
ゼビオホールディングス	19.7	21	21,084	17.1	20.1	54,571	水戸証券	2.7	1.4	821										
ケーズホールディングス	114.9	103.9	135,277	28	27.2	23,147	いちよし証券	36.2	42.5	19,167										
Olympicグループ	5.2	3	1,644	59.1	63.1	15,270	松井証券	24.6	27	20,196										
日産東京販売ホールディングス	16.4	10.3	5,088	43	41.9	153,982	マネックスグループ	79.5	70.9	60,265										
シルバーライフ	3.3	3	2,511	9	9.6	19,641	極東証券	150.1	141	102,930										
Genky DrugStores	6.3	6.8	43,724	15	16	17,968	岩井コスモホールディングス	16.8	19.7	19,660										
ナルミヤ・インターナショナル	2.1	1.1	1,333	9.2	9.1	22,704	アイザワ証券グループ	15.3	16.4	34,653										
ブックオフグループホールディングス	8.4	9	11,205	107.2	113.7	35,247	マネーパートナーズグループ	19.4	20.8	25,168										
ギフトホールディングス	3.1	6.5	18,265	6	3.1	3,825	スパークス・グループ	12.5	6.7	1,996										
アインホールディングス	19.9	21.3	100,812	107.3	125.4	463,729	小林洋行	15	16.1	28,529										
元気寿司	4.1	8.7	30,972	118.5	126.9	102,281	保険業(2.4%)	2.8	2.9	739										
ヤマダホールディングス	592.4	475.7	211,591	275.5	309	245,284	かんぽ生命保険	163.3	146.6	400,951										
アークランズ	21.2	46	76,728	13.7	16.1	27,611	F P パートナー	-	2.9	18,850										
ニトリホールディングス	58.4	56.3	1,108,828	25.7	27.4	53,594	SOMPOホールディングス	230.7	216.6	1,666,737										
ブルメザン	11.8	12.6	13,595	12	12.9	22,355	アコム ホールディングス	45.7	48.9	28,508										
愛眼	7.6	5	915	5.4	5.7	8,931	MS&ADインテグリティグループホールディングス	273.6	322.4	1,931,498										
ケユーホールディングス	8.5	7.3	8,752	1.9	1.1	1,898	第一生命ホールディングス	684.5	703.6	2,156,534										
吉野家ホールディングス	56.4	57	187,074	22.4	24	92,400	東京海上ホールディングス	1,353.8	1,423.4	5,519,945										
松屋ホールディングス	6.8	7.3	40,953	20.2	21.7	56,984	T&Dホールディングス	360.9	386.7	902,751										
サガミホールディングス	23.2	23.2	35,867	126.6	135.5	76,015	アドバンスクリエイト	7.8	8.3	8,540										
関西フードマーケット	13	10.5	16,054	42.6	-	-	その他金融業(1.2%)													
王将フードサービス	9.5	11.5	89,470	48.1	51.5	89,198	全国保証	35.2	37.7	206,633										
ミニストップ	10.4	11.2	18,065	85.4	89.1	141,535	あんしん保証	6	2.9	725										
アークス	26.5	28.4	82,757	84	90.2	91,733	ジェイリース	4	4.3	10,023										
パローホールディングス	27.6	29.5	74,576	3.9	2.2	3,086	イントラスト	4.5	2.5	1,962										
ペルコ	7.2	7.7	50,358	12.2	14.2	38,695	日本モーゲージサービス	6.7	3.5	1,865										
大 庄	6.9	7.4	9,916	21.2	21.2	22,450	CASA	4.5	2.5	2,077										
ファーストリテイリング	21.7	69.6	2,697,000	19.9	20.2	48,298	S B I アルビ	16.5	13.8	12,544										
サンドラッグ	54.8	52.2	233,803	8	8.7	23,124	プレミアグループ	22.6	24.3	40,969										
サクスパー	13.7	13.1	11,056	8.8	8.7	23,855	ネットプロテクションホールディングス	44.4	47.7	7,441										
ヤマザワ	2.3	1.4	1,769	7.8	8.5	16,456	クレディセゾン	85.1	91.3	248,427										
やまや	2.8	1.5	4,942	30.5	30.7	35,028	芙蓉総合リース	12.4	13.3	179,882										
ペルナ	33.8	37.2	22,952	481.4	451.4	136,819	みずほリース	20	24.1	132,068										
銀行業(7.1%)				1,944.5	1,943.7	5,286,864	東京センチューリー	25.1	107.6	175,495										
いざぎホールディングス	160.1	171.4	174,656	4.1	2.2	2,059	日本証券金融	54	52.9	82,629										
しずおかフィナンシャルグループ	303.9	320	449,440	148.5	141.2	202,692	アイフル	222.6	212	81,408										
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	113.2	121.3	130,700	3.7	-	-	リコーリース	12.7	13.7	69,185										
楽天銀行	-	50.1	116,883	8.9	9.3	52,545	イオンフィナンシャルサービス	77.1	82.7	110,693										
京都フィナンシャルグループ	-	182.5	444,570	204.1	218.2	82,261	アコム	240.2	257.1	93,275										
島根銀行	4.2	1.9	984	3.5	2.1	2,931	ジャックス	14.3	15.3	84,456										
じもとホールディングス	7.9	5.6	3,152	18.1	19.4	20,156	オリエントコーポレーション	35.1	47	50,055										
めぐみフィナンシャルグループ	666.7	714.5	309,449	4	2.3	2,783	オリックス	899.2	877.7	2,525,142										
東京海上ホールディングス	17.2	18.4	76,912	62.5	60.4	42,823	三菱HCキャピタル	523.8	641.6	670,792										
九州フィナンシャルグループ	236.8	278.7	267,133	61.6	71.9	22,001	九州リースサービス	5.6	2.6	3,112										
ゆうちょ銀行	382.9	1,582.4	2,379,138	4.7	4.7	10,485	日本取引所グループ	377.7	375.7	1,249,202										
富士第一銀行	33.4	45.7	38,799	24.9	26.4	17,344	イー・ギャランティ	21.7	23.4	43,266										
コトクドリア・フィナンシャルグループ	740.9	772.7	540,658	12.8	6.6	15,531	アサックス	5.5	3	2,157										
西日本フィナンシャルホールディングス	85	81.3	138,860	4.6	2.7	2,014	NECキャピタルリソリューション	6.7	7.1	25,595										
三十三フィナンシャルグループ	12.1	12.9	24,600	109	136.3	53,293	不動産業(2.0%)													
第四北越フィナンシャルグループ	21.2	22.6	91,417	13.8	14.9	23,271	Robot Home	32.7	39.9	6,783										
ひろぎんホールディングス	175.5	205	201,515	170.8	199.7	68,896	大東建託	49.2	52.8	896,808										
おきなわフィナンシャルグループ	12.8	12.3	30,528	証券、商品先物取引業(0.9%)																
十六フィナンシャルグループ	17.4	18.7	78,072	F P G	54.5	48.7	86,491	いちご	154.8	165.9	64,037									
北越フィナンシャルホールディングス	11.4	15.2	64,600	ジャパロインベストメントアドバイザー	10.9	23.4	22,113	日本駐車場開発	160.1	152.4	27,279									
プロレアホールディングス	16.6	16.5	30,376	マークキリアホールディングス	7.1	3.3	2,359	スター・マイカ・ホールディングス	12.2	16.7	9,101									
あいちフィナンシャルグループ	18.8	22.2	57,653	S B I ホールディングス	194.6	211	796,525	SREホールディングス	6.6	6.2	20,584									
S B I 新生銀行	39.7	-	-	9.6	4.7	1,316	ADワークスグループ	30	16.1	3,767										
あおぞら銀行	84.4	103.5	225,992	ジャフコ	44.9	42.9	74,302	ヒーリック	313.4	335.9	535,424									
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,536.5	8,769.7	12,312,658	961.3	1,115.5	1,123,866	三栄建築設計	6.5	-	-										

銘柄	期首(前期末)		当期		銘柄	期首(前期末)		当期		銘柄	期首(前期末)		当期	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	株数
		千株		千円			千株		千円			千株		千円
野村不動産ホールディングス	84	80.1	299,493		インテリックス	3.1	1.5	847		CDG	1.4	0.8	989	
三菱UFJホールディングス	28.8	30.9	18,849		ランドビジネス	4.4	2.4	662		アドウェイズ	19.3	20.7	10,577	
サムディ	21.4	22.9	57,295		サンクススタグループ	3.6	2.1	2,007		パリュエーコマース	10.5	13.2	16,209	
ダイヤモンド	20.7	24.5	24,010		グランディハウス	10.1	10.8	7,106		インフォーマート	145.6	156	60,684	
コーセーホールディング	3.7	2	1,826		日本空港ビルデング	47.6	50.9	299,444		J Pホールディングス	40.3	38.4	16,627	
地主	10.2	11	24,882		サービス業 (4.6%)					エコナックホールディングス	22	5.8	748	
アピスコーポレーション	17.6	22.9	39,021		明豊ファシリテイワークス	6.3	3.3	3,111		CLホールディングス	3.9	3.5	3,272	
THEグローバル社	7	4.3	1,659		日本工営	8.5	—	—		プレステージ・インターナショナル	59	70.4	41,184	
ハウスコム	2	1	907		LIFFULL	48	51.3	9,849		アミューズ	7.6	9.2	14,766	
JPMC	6.8	8.3	9,495		MIXI	31.9	32.2	80,789		ドリムインキュベータ	4.3	5.2	15,782	
サンセイラニディック	3.7	1.9	2,093		ジェイエイシークルメント	12.7	54.3	37,412		クイック	10.7	10.4	25,126	
エストラスト	1.5	0.7	451		日経M&Aセンターホールディングス	240.8	239.5	219,286		TAC	6.8	3.3	627	
フージャースホールディングス	20.6	22.2	25,374		メンバーズ	4.1	5.1	4,855		電通グループ	137.9	147.7	585,187	
オープンハウスグループ	49.2	52.7	246,688		中広	1	1	413		テイクアンドグヴィーニーズ	4.2	5.8	6,948	
東急不動産ホールディングス	404.1	432.9	430,735		UTグループ	20.6	19.4	48,306		びあ	4.7	5	16,800	
船橋グループホールディングス	117.8	138	295,251		アイティメディア	5.4	5.7	11,280		イオンファンタジー	6.1	5.4	13,224	
イェーランド	1.9	1	1,587		ケアネット	—	23.1	16,331		シーティーエス	15.6	19	13,946	
ムゲンエステート	7.9	4.3	4,949		E・Jホールディングス	8.2	8.8	14,722		NEXYZ Group	3.8	2.1	1,465	
ピーロット	8.3	4.4	4,628		オープンアップグループ	42	45.1	104,541		H.U.グループホールディングス	41.1	44	117,832	
ファーストブラザーズ	2.3	1.3	1,632		コシダカホールディングス	42	45	42,120		アルプス技研	12.2	14.3	41,384	
And Doホールディングス	8	8.7	9,726		アルトナー	3.1	2.8	6,168		サニックス	22.7	24.1	6,940	
シーアールイー	6.1	8	11,104		パソナグループ	17	18.2	49,231		日本空調サービス	15.4	16.2	14,515	
プロパティエージェンツ	1.5	—	—		CDS	3.2	1.7	2,908		オリエンタルランド	148.5	795.4	4,066,084	
ケイアイスター不動産	6.5	6.9	23,529		リンクランドモチベーション	40.3	43.3	24,594		ダスキン	31.3	33.5	115,742	
アグロ都市デザイン	2.2	1.1	1,782		エス・エム・エス	53.4	52.7	129,694		明光ネットワークジャパン	18.4	18.2	13,031	
グッドコムアセット	12.5	13.4	10,559		サニーサイドアップグループ	3.8	2.3	1,368		ファルコホールディングス	6.1	6.8	13,980	
ジェイ・エス・ビー	3.3	7.2	19,519		パソルホールディングス	157.1	1,530.1	363,857		秀英予備校	3.1	1.5	462	
ロードスターキャピタル	5.8	9.4	18,273		リニカル	7.1	4.3	2,236		田谷	1.7	1.2	506	
テンポインベション	3.7	1.9	1,778		クックパッド	38.4	41.1	4,932		ラウンドワン	117.3	141.4	97,000	
グローバル・リンク・マネジメント	2.3	1.2	2,977		エスクリ	5.2	2.7	774		リゾートトラスト	55.4	65.3	167,102	
フェイスネットワーク	1.7	1.7	2,687		アイ・ケイ・ケイホールディングス	6.2	3.3	2,399		ビー・エム・エル	17.4	18.5	52,836	
霞ヶ関キャピタル	—	3.9	45,552		学情	6.4	7.7	13,898		りらひらひらコミュニケーションズ	23.2	—	—	
パーク24	104.7	93.5	179,940		スタジオアリス	7	7.5	15,735		リソー教育	63.8	76.8	18,432	
パラカ	4.7	5.1	10,225		シミックホールディングス	7.7	—	—		早稲田アカデミー	7.8	8.3	14,508	
ミガロホールディングス	—	1	1,481		エプコ	2.7	1.8	1,699		ユー・エス・エス	144.3	168.6	453,196	
宮越ホールディングス	6.2	6.6	7,134		NJS	2.6	3.3	9,025		東京個別指導学院	16.7	17.9	8,055	
三井不動産	584.3	665.9	2,661,602		総合警備保障	52.1	251.1	200,553		サイバーエージェント	335.7	332.1	339,738	
三菱地所	811.2	941.3	1,974,847		カカココム	104.7	99.3	177,796		楽天グループ	649.5	1,288.3	818,070	
平和不動産	21.8	23.4	88,218		アイロムグループ	5.1	6.1	12,547		クリーク・アンド・リバー社	8.3	7.6	15,184	
東京建物	128.1	125.8	279,590		セントケア・ホールディング	9.1	11	10,714		S&Iグループホールディング	23	29.4	20,433	
京阪神ビルディング	16.9	26.9	38,009		サイネックス	2.2	1.1	917		テー・オー・ダブリュー	27.2	29.4	10,084	
住友不動産	243	208.2	993,322		リネサンス	9.8	11.7	10,869		山田コンサルティンググループ	7.1	6.5	11,381	
テーオーシー	24.5	25.7	17,193		ディップ	24.6	23	61,157		セントラルスポーツ	5.3	5.6	13,938	
東京楽天地	2.4	—	—		デジタルホールディングス	10.9	7.8	9,742		フィルキャストホールディングス	13.4	14.4	25,776	
レオパレス21	151.4	144.1	56,631		新日本科学	14.9	13.7	21,330		エン・ジャパン	25.4	24.5	67,154	
スターツコーポレーション	19.3	20.7	62,307		キャリアデザインセンター	2.6	1.4	2,521		リソルホールディングス	1.1	0.6	3,666	
フジ住宅	18.8	18.1	12,887		ベネフィット・ワン	65	52.2	109,463		テノフコ・ホールディングス	83.1	88	296,120	
空港施設	16.2	20.3	12,525		エムスリー	277.3	297	587,317		アトラグループ	3	2	362	
明和地所	6.1	8.2	10,791		フカダ・グローバルホールディング	7.8	4.3	1,840		インターワークス	3.2	—	—	
ゴールドクレスト	12.8	11.7	26,933		プラス	1.7	0.7	503		アイ・アルジャパンホールディングス	7.3	7.8	10,303	
エスリード	6.4	6.8	23,120		アウトソーシング	83.6	96.5	167,958		Keeper 技研	8.7	9.3	60,636	
日神グループホールディングス	21.7	23.1	11,619		ウエルネット	9.5	5.9	3,280		ファーストロジック	2	1.6	804	
日本エスコン	30.3	26.9	26,577		ワールドホールディングス	6.3	6.8	20,672		三機サービス	2	1.2	1,615	
MIRARTHホールディングス	67.7	66.1	33,182		ディー・エヌ・エー	59.9	53.4	81,621		Gunosy	11.1	11.9	8,687	
A V A N T I A	5.9	3.5	3,164		情報堂DYホールディングス	3.9	191.7	228,793		デザインワン・ジャパン	3.7	1.6	212	
イオンモール	69.7	74.6	138,271		ぐるなび	25.8	28	7,392		イー・ガーディアン	5.3	5.7	8,031	
毎日コムネット	4.5	2.4	1,783		タカミヤ	19.2	20.4	9,934		リアセンス	5.8	3.1	753	
ファースト住建	5	2.5	2,770		ジャパネット東宝システム	8.7	—	—		ジャパマテリアル	42.9	46	118,450	
ランド	810.9	798.5	5,589		ファンコミュニケーションズ	27.8	21	8,379		ベクトル	22	18.4	21,804	
カチタス	36.1	38.7	69,040		ライク	5.3	5.6	8,540		ウチヤマホールディングス	5.6	2.8	1,072	
トーセイ	22.3	24	48,840		Aoba - BBT	4.6	2.5	1,030		チャム・ケア・コーポレーション	11.7	12.5	17,162	
穴吹興産	2.4	1.5	3,198		エスプール	40.3	43.2	13,262		キャリアアリンク	5.2	5.5	14,470	
サンフロンティア不動産	22.4	21.3	36,593		WDBホールディングス	7.1	7.7	17,594		I B J	8.6	11.5	7,820	
FJネットホールディングス	14.1	15.2	19,547		ティア	7.4	3.9	1,887		アサンテ	7	7.4	12,321	

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	
バリューHR		千株	千円		千株	千円	日総工業		千株	千円		千株	千円	タナホコンサルティンググループ		千株	千円		千株	千円	
M&Aキャピタルパートナーズ	13	12.2	29,206	6	6,222	18,222	キュービネットホールディングス	10.5	—	—	5	5.2	5,610	ナガワ	3.7	4.7	33,793	3.7	4.7	33,793	
ライオンエクスプレスホールディングス	5.1	6	6,222	19	20.4	5,385	RPAホールディングス	19	20.4	5,385	東京都競馬	11.8	12.6	57,708	常磐興産	4.3	2.5	3,092	4.3	2.5	3,092
ERIホールディングス	3.2	1.9	3,562	4.3	1.9	1,508	スプリックス	7.7	6.4	18,022	カナモト	25.7	23.3	67,104	ニシオホールディングス	13	14	55,090	13	14	55,090
アビスト	2	1	3,115	3.3	3.5	1,242	マネジメントソリューションズ	3.3	3.5	1,242	アゴラ ホスピタリティグループ	70.2	43.4	998	トラंस・コスモス	17.4	18.7	55,165	70.2	43.4	998
シグマクス・ホールディングス	21.3	20.3	34,185	2.1	2.2	3,577	テノホールディングス	1.5	0.8	414	乃村工藝社	61.2	65.6	56,940	藤田観光	6.2	6	40,200	61.2	65.6	56,940
ウィルグループ	11.7	12.5	14,900	2	2	622	プロレド・パートナーズ	4.7	3.8	5,909	日本管財	14.8	—	—	トーカイ	12.5	13.3	28,209	14.8	—	—
エスコロー・エージェンツ・ジャパン	13.5	7.9	1,106	1.8	0.9	452	and factory	3.6	2	622	白洋舎	1.1	1	2,736	セコム	142.9	153.1	1,639,701	1.1	1	2,736
メドピア	11	13.2	9,081	4.7	5.1	5,630	テノホールディングス	1.5	0.8	414	セントラル警備保障	7.5	8.1	20,841	メイテックグループホールディングス	55.9	54.1	164,680	7.5	8.1	20,841
レジャジョブ	2.4	1.3	1,186	2.1	2.2	3,577	プロンティア・マネジメント	4.7	3.8	5,909	丹青社	27	29.1	23,483	応用地質	13.1	14	30,184	27	29.1	23,483
リクルートホールディングス	1,039	1,112.8	6,435,322	2.1	2.2	3,577	ピアラ	2	1.2	376	メイトックグループホールディングス	55.9	54.1	164,680	船井総研ホールディングス	29.5	31.3	77,373	55.9	54.1	164,680
エラン	18.6	19.9	21,074	1.8	0.9	452	ゴロ・ホールディングス	2.1	2.2	3,577	進学会ホールディングス	4.2	1.7	433	オオバ	7.9	4.5	4,540	4.2	1.7	433
土木管理総合試験所	5.3	3.1	1,010	—	16.1	44,355	ギークス	1.8	0.9	452	いであ	2.8	1.8	3,834	学究社	5.6	6	12,486	2.8	1.8	3,834
日本郵政	1,839.2	1,766.2	2,500,939	43.1	41.1	30,866	アンビスホールディングス	—	16.1	44,355	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	52.3	50.5	131,249
ベルシテム24ホールディングス	18.8	16.1	28,802	8.3	20.5	16,338	カープスホールディングス	43.1	41.1	30,866	ナック	6.5	12.8	6,937	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	6.5	12.8	6,937
鎌倉新書	15.9	12.8	7,936	4.7	5.1	5,630	フォーラムエンジニアリング	8.3	20.5	16,338	ステッパ	5.8	5.5	11,088	ステップ	5.8	5.5	11,088	5.8	5.5	11,088
SAMN	3.2	1.3	421	16.8	15.5	6,851	FAST FITNESS JAPAN	4.7	5.1	5,630											
一蔵	1.5	0.8	494	2.1	2.2	3,000	ダイレクトマーケティングミックス	16.8	15.5	6,851											
グローバルキッズCOMPANY	1.9	1.2	786	10.9	11.7	25,353	ロビピンズ	2.1	2.2	3,000											
エアトリ	9.1	11	20,009	—	0.6	963	LITALICO	10.9	11.7	25,353											
アトリエ	11	8.9	5,918	5.7	3.4	1,547	コンフィデンス・インタワークス	—	0.6	963											
ストライク	6.9	6.4	30,976	78.1	75.3	118,635	アドバンテッジリスクマネジメント	5.7	3.4	1,547											
ソラスト	38.7	41.4	23,598	9.8	10.5	8,158	リロググループ	78.1	75.3	118,635											
セラク	5	4.6	5,147	—	9.1	33,488	東祥	9.8	10.5	8,158											
インソース	34.8	32.6	25,395	—	3.1	5,614	ID&Eホールディングス	—	9.1	33,488											
ベイカレント・コンサルティング	111	110.5	345,754	2.7	3.1	5,614	ビーウィズ	2.7	3.1	5,614											
Orchestra Holdings	3	3.2	3,168	29.5	28.8	36,316	TREホールディングス	29.5	28.8	36,316											
アイモバイル	7.3	20.1	9,105	6.3	5.7	10,807	人・夢・技術グループ	6.3	5.7	10,807											
キャリアインデックス	4.2	2.3	457	—	13	10,647	NISSOホールディングス	—	13	10,647											
MS-Japan	4.1	5.5	6,963	26.7	27.3	68,058	大栄環境	26.7	27.3	68,058											
船場	1.5	1.4	1,379	—	7.2	42,840	日本管財ホールディングス	—	15.8	40,416											
ジョイエレベーターサービスホールディングス	50	48.7	105,386	—	7.2	42,840	M&A総研ホールディングス	—	7.2	42,840											
フルテック	1.7	1	1,128	36.7	43.7	77,523	エイチ・アイ・エス	36.7	43.7	77,523											
グリーンズ	4.2	2.4	4,917	4.4	6.8	17,761	ラックランド	4.4	6.8	17,761											
ツナググループ・ホールディングス	3.5	1.9	1,649	24	23.6	145,706	共立メンテナンス	24	23.6	145,706											
GAMEWITH	3.7	2.8	873	15	16	25,536	イチネンホールディングス	15	16	25,536											
MS&Consulting	1.4	1	590	7.2	7.7	46,893	建設技術研究所	7.2	7.7	46,893											
ウエルビー	10.3	7.5	6,382	10	9.8	9,261	スペース	10	9.8	9,261											
エル・ティール・エス	1.9	1.7	4,867	6	14.1	15,777	燦ホールディングス	6	14.1	15,777											
ミダグホールディングス	8.6	9.1	15,388	0.6	3	9,420	Sバル興業	0.6	3	9,420											
				4.6	2.4	2,726	東京テアトル	4.6	2.4	2,726											
合計																					

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期		末
	買	建 額	売 建 額
国内	T	O P I X	
		百万円 13,328	百万円 -

■投資信託財産の構成

2024年2月7日現在

項目	当期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 528,947,749		% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,775,214		2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	542,722,964		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

(2024年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	542,722,857,274円
一 般 株 式	12,373,197,806
株 式 (評価額)	528,947,749,730
未 収 入 金	569,015,410
未 収 入 委 託 証 拠 金	703,427,711
未 収 入 委 託 証 拠 金	129,466,617
(B) 負 債	592,021,000
未 払 解 約 金	592,021,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	542,130,836,274
元 本	121,842,817,407
次 期 繰 越 損 益	420,288,018,867
(D) 受 取 益 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	121,842,817,407円 44,494円

(注1) 期首元本額 117,622,712,134円
追加設定元本額 59,907,077,380円
一部解約元本額 55,686,972,107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	234,935,632円
MHAM TOP I Xオープン	2,457,094,087円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	3,281,412,558円
One DC 国内株式インデックスファンド	30,809,632,061円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	4,610,201,313円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,572,967円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	9,370,446円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	21,079,024円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,608,149円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	28,800,675円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	17,989,649円
たわらノーロード TOP I X	2,226,070,109円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,698,970,509円
たわらノーロード バランス (堅実型)	49,358,924円
たわらノーロード バランス (標準型)	360,326,830円
たわらノーロード バランス (積極型)	607,683,019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)	2,285,856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)	141,103,494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)	406,039,337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)	347,897,665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)	481,585,965円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	365,246円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,354,848円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	27,592,829円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,404,483円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,596,334円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,412,337,171円
Oneグローバルバランス	41,793,827円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	914,089,355円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,328,302,554円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,866,884,412円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	294,884,221円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	964,080,357円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,090,311,381円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	28,196,964円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,070,522,519円
マネックス資産設計ファンド エコリユージョン	14,869,106円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	283,994,414円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	332,963,584円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	563,739,113円
投資のソムリエ	8,462,984,252円
フルーズコントロール	331,322,523円
投資のソムリエ<DC年金>	830,639,366円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	315,192,706円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,094,963,321円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	940,176,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,070,818,810円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	79,256,153円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	40,575,661円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	8,224,319円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	177,810,319円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	506,888,540円
リスクコントロール世界分散ファンド	1,363,308,339円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	230,928,569円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	80,685,240円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	43,107,354円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	26,468,340円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	499,441,883円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	6,256,314円
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,630,752円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	32,054,533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)	1,852,453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)	1,973,535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)	1,168,075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)	1,140,101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)	21,514,902円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04 (適格機関投資家限定)	4,850,093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	179,053,363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)	1,676,651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) 22-05	82,171,987円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日本資産分配) 22-10	373,974,618円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	3,244,839円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	271,164,256円
AMIONeマルチアセット・インカム戦略 (適格機関投資家限定)	13,265,462円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	22,573,361円
日本興産証券株ファンド(インカム重視型) 儲蓄(ネットリ) (適格機関投資家限定)	42,437,517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)	3,180,848円
リスクコントロール世界8資産(債券・Fof) (適格機関投資家限定)	3,641,563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)	34,738,163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)	67,464,810円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,592,051円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	10,658,140円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	3,391,442円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	80,001円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,346,974円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	17,271,356円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	278,577,105円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	397,261,876円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,219,167,945円
DIAMグローバル・セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	10,308,559円
DIAMグローバル・セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	14,774,714円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	148,488,928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)	28,546,667円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	53,149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)	157,074,573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)	8,107,544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)	38,324,573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)	100,737,648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)	130,670,328円
DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	17,344,200円
DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	7,096,700円
動的パッケージファンド<DC年金>	26,832,017円
コア資産形成ファンド	13,890,277円
MHAMトピックスファンド	785,854,154円
MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用)	44,680,531円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,152,105,329円
MHAM日本株バッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,885,462,391円
期末元本合計	121,842,817,407円
担保資産	

(注3) 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2023年2月8日 至2024年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	10,425,561,919	円
	受取配当金	10,381,192,543	
	受取利息	112,936	
	その他の収益	47,949,906	
	支払利息	△3,693,466	
(B)	有価証券売買損益	111,503,767,553	
	売却益	123,369,784,497	
	売却損	△11,866,016,944	
(C)	先物取引等取引損益	3,953,117,580	
	取引益	4,399,997,660	
	取引損	△446,880,080	
(D)	その他費用	△2,081,296	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	125,880,365,756	
(F)	前期繰越損益金	279,360,210,690	
(G)	解約差損益金	△154,955,776,199	
(H)	追加信託差損益金	170,003,218,620	
(I)	計(E+F+G+H)	420,288,018,867	
	次期繰越損益金(I)	420,288,018,867	

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

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

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

《お知らせ》

■当投資信託において保有していた株式会社東芝の株式について、同社による有価証券報告書等の虚偽記載により当投資信託が被った損失の回復を図るために提訴した損害賠償請求訴訟が和解により終結したため、2023年12月に当該和解金を計上いたしました。

(2023年12月20日)