

運用報告書 (全体版)

第26期<決算日2024年3月11日>

MHAM TOPIXオープン

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	1998年10月22日から無期限です。	
運用方針	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）銘柄に投資を行い、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。	
主要投資対象	MHAM TOPIX オープン	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。なお、株式等に直接投資する場合があります。
	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	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）銘柄を組入対象銘柄とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組み入れません。 現物株への投資よりTOPIX先物等を活用の方が有利と認められるときは、TOPIX先物等を活用することがあります。	
組入制限	MHAM TOPIX オープン	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎年原則として3月10日に決算を行い、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の中から、委託会社が基準価額水準および市場動向等を勘案し、原則として配当等収益を中心に分配を決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は、分配を行わない場合もあります。収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。	

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、「MHAM TOPIXオープン」は、2024年3月11日に第26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/>

MHAM TOPIXオープン

■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)		株式組入比率	株式先物比率	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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
22期 (2020年3月10日)	9,339	180	△9.4	12,745.61	△11.1	99.1	0.8	6,843
23期 (2021年3月10日)	12,812	150	38.8	17,394.33	36.5	98.7	2.8	8,814
24期 (2022年3月10日)	12,194	190	△3.3	16,755.21	△3.7	96.8	3.1	8,083
25期 (2023年3月10日)	13,566	250	13.3	19,107.65	14.0	98.1	1.8	8,938
26期 (2024年3月11日)	17,894	250	33.7	25,718.10	34.6	99.3	0.7	11,202

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(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。

(注4) ベンチマークは、1999年1月4日のファンドの基準価額 (9,649円) に合わせて指数化しています (以下同じ)。

(注5) ベンチマークは、2021年7月1日までは東証株価指数 (TOPIX)、2021年7月2日以降は東証株価指数 (TOPIX、配当込み) のデータを使用しています (以下同じ)。

(注6) 東証株価指数 (TOPIX) の指数値および同指数にかかる標準または商標は、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準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7) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		東証株価指数(TOPIX、 配当込み) (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2023年3月10日	13,566	－	19,107.65	－	98.1	1.8
3月末	13,532	△0.3	19,066.41	△0.2	96.1	4.4
4月末	13,890	2.4	19,580.87	2.5	97.9	2.4
5月末	14,382	6.0	20,289.00	6.2	97.3	2.8
6月末	15,461	14.0	21,820.56	14.2	98.3	1.7
7月末	15,683	15.6	22,146.30	15.9	97.5	2.5
8月末	15,741	16.0	22,242.12	16.4	97.4	2.6
9月末	15,815	16.6	22,355.38	17.0	97.6	2.6
10月末	15,333	13.0	21,686.60	13.5	97.3	2.7
11月末	16,154	19.1	22,862.27	19.6	97.7	2.4
12月末	16,111	18.8	22,810.55	19.4	96.8	3.2
2024年1月末	17,360	28.0	24,592.49	28.7	97.8	2.1
2月末	18,205	34.2	25,803.95	35.0	97.3	2.7
(期末)						
2024年3月11日	18,144	33.7	25,718.10	34.6	99.3	0.7

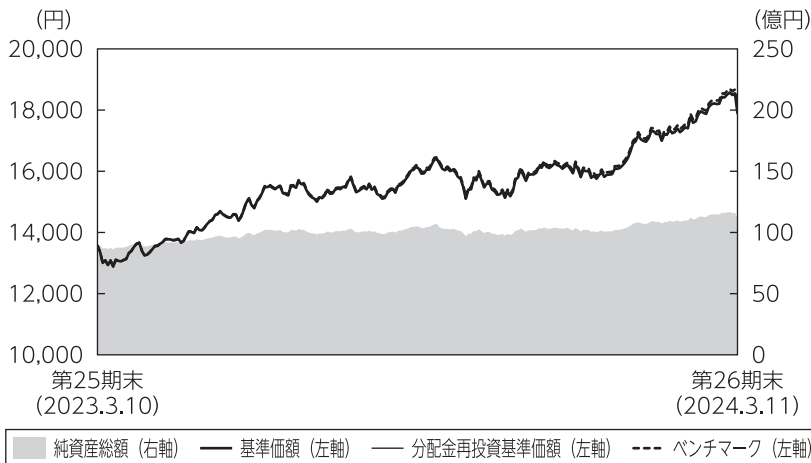
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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3月11日から2024年3月11日まで)

基準価額等の推移



第26期首 : 13,566円
第26期末 : 17,894円
(既払分配金250円)
騰落率 : 33.7%
(分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

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ました。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は大きく上昇しました。

投資環境

期初から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、好調な企業決算や海外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。その後も、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、2024年1月から期末にかけては円安ドル高の進行や海外株式市場の堅調さ、海外投資家による日本株買いの継続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

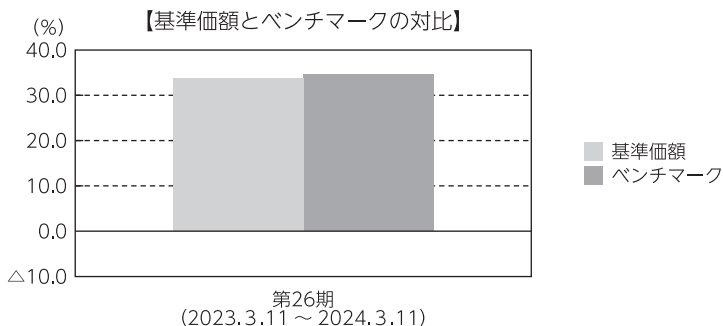
当ファンドの主要投資対象は国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドであり、マザーファンドの組入比率を高位に維持するよう運用しました。

●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。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークである東証株価指数（TOPIX、配当込み）は前期末比で34.6%上昇しました。当ファンドはベンチマークを0.8%下回りました。この差異は、主に信託報酬などによるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金は、基準価額水準および市場動向等を勘案して、下記のとおりといたしました。なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2023年3月11日 ～2024年3月11日
当期分配金（税引前）	250円
対基準価額比率	1.38%
当期の収益	250円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	13,015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

当ファンドの運用方針については、引き続き国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドを組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。今後も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26期		項目の概要
	(2023年3月11日 ～2024年3月11日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	103円	0.662%	(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15,572円です。
(投信会社)	(46)	(0.292)	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)	(47)	(0.303)	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)	(10)	(0.066)	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
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	0	0.002	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.002)	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)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	103	0.665	

(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。

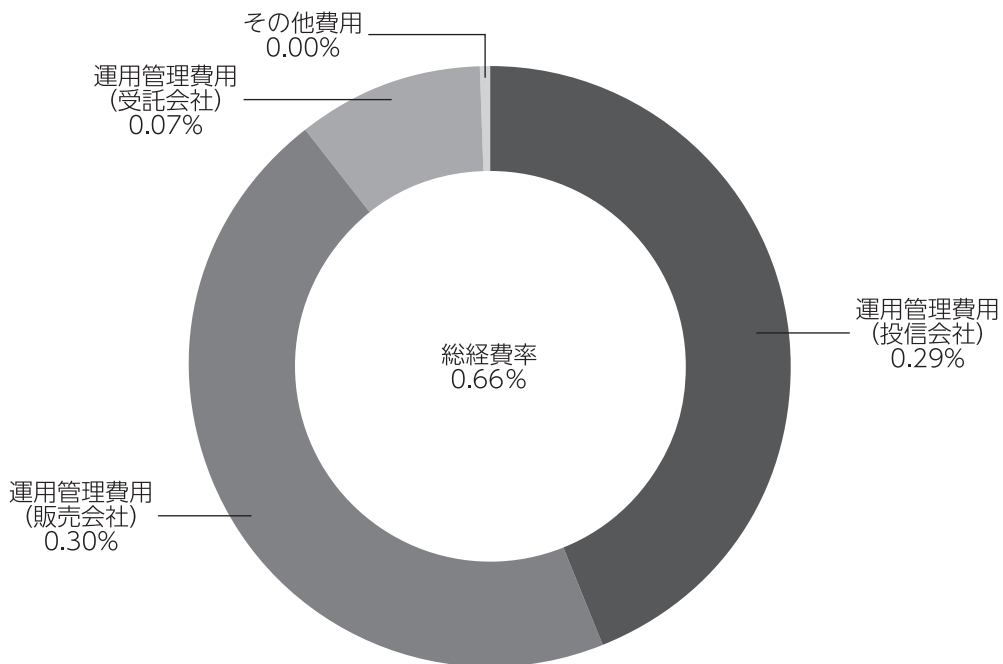
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.66%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3月11日から2024年3月11日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 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□ 139,366	千円 530,012	千□ 317,784	千円 1,307,043

■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	267,867,294千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	452,193,543千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.59

(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3月11日から2024年3月11日まで）

【MHAM TOPIXオープン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)	89千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.052千円
(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					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株 式	百万円 142,729	百万円 103,694	% 72.7	百万円 125,137	百万円 58,475	% 46.7

平均保有割合 2.2%

(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 1,428	百万円 1,475	百万円 6,011

(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

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、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	
	□ 数	□ 数	評 価 額
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	千□ 2,584,575	千□ 2,406,156	千円 11,200,659

■投資信託財産の構成

2024年3月11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	11,200,659	97.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	249,526	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	11,450,185	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3月11日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	11,450,185,943円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	87,643,296
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)	11,200,659,647
未 収 入 金	161,883,000
(B) 負 債	247,661,369
未 払 収 益 分 配 金	156,508,217
未 払 解 約 金	56,446,156
未 払 信 託 報 酬	34,625,132
そ の 他 未 払 費 用	81,864
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	11,202,524,574
元 本	6,260,328,714
次 期 繰 越 損 益 金	4,942,195,860
(D) 受 益 権 総 口 数	6,260,328,714口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	17,894円

(注) 期首における元本額は6,588,988,344円、当期中における追加設定元本額は951,775,933円、同解約元本額は1,280,435,563円です。

■損益の状況

当期 自2023年3月11日 至2024年3月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	44,677円
受 取 利 息	1,206
そ の 他 収 益 金	56,623
支 払 利 息	△13,152
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,771,801,493
売 買 損 益	3,037,726,792
売 買 損 益	△265,925,299
(C) 信 託 報 酬 等	△66,864,511
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	2,704,981,659
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,777,385,789
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	616,336,629
(配 当 等 相 当 額)	(3,820,529,868)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,204,193,239)
(G) 合 計 (D + E + F)	5,098,704,077
(H) 収 益 分 配 金	△156,508,217
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	4,942,195,860
追 加 信 託 差 損 益 金	616,336,629
(配 当 等 相 当 額)	(3,822,281,733)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,205,945,104)
分 配 準 備 積 立 金	4,325,859,231

(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	224,637,109円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,480,344,550
(c) 収 益 調 整 金	3,822,281,733
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,777,385,789
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	8,304,649,181
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	13,265.52
(g) 分 配 金	156,508,217
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	250

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金 250円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。
※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■新NISA制度の成長投資枠の要件に沿った表記に改めるため、デリバティブの使用目的を明確化しました。
(2023年12月9日)

その他のお知らせ

■当投資信託が組入っていた「MHAM TOPIXマザーファンド」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、当投資信託において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)

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			
18期 (2020年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
19期 (2021年2月8日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
20期 (2022年2月7日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
21期 (2023年2月7日)	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336
22期 (2024年2月7日)	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9	396,982
	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）。

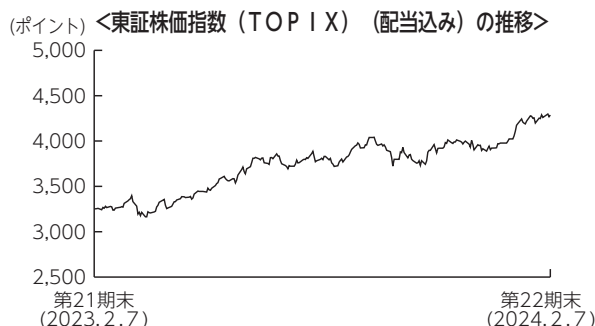
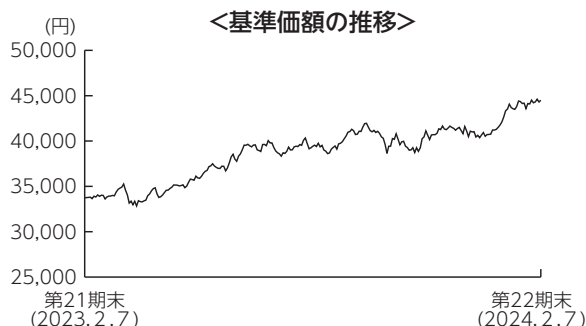
■当期中の基準価額と市況の推移

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	(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

決 算 期		当 期				
区 分	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

(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
株 式	百万円 1,537	百万円 1,475
		当 期 末 保 有 額 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。

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
ケンコーマヨネーズ		千株	千円	クラレ		千株	千円	ダイキョーニシカワ		千株	千円		千株	千円	
からばや日洋ホールディングス	9.3	9.9	18,087	旭化成	217.3	213.4	331,410		30.1	32.4	24,008		30.1	32.4	
なとり	9.9	9.6	27,273	共和レザー	853.9	990.8	1,028,945		4.1	2.6	2,038		4.1	2.6	
イフジ産業	8.6	9.1	19,810	巴川コーポレーション	7.1	3.8	3,066		6.9	7.6	21,976		6.9	7.6	
ファーマフーズ	2.2	1.2	1,696	レナック・ホールディングス	3.8	1.8	1,713		8.9	10.5	15,004		8.9	10.5	
ユーグレナ	20.7	20.7	20,637	住友化学	132.1	141.5	417,778		104.3	111.9	142,616		104.3	111.9	
紀文食品	86.6	89.6	58,956	住友精化	1,014.5	1,086.7	334,160		12.3	15.8	15,452		12.3	15.8	
ビックルホールディングス	10.5	12.5	14,650	日産化学	5.8	6.9	34,362		7.8	9.7	27,460		7.8	9.7	
ミヨシ油脂	7.9	8.4	10,878	ラサ工業	64.9	68.8	422,569		12.7	15.5	71,145		12.7	15.5	
理研ビタミン	4.2	2.5	3,312	クレハ	5.3	5.6	12,773		18.3	17.8	67,551		18.3	17.8	
繊維製品 (0.4%)	11.6	12.5	29,025	多木化学	11.7	32	90,400		47.7	51.1	146,989		47.7	51.1	
片倉工業				テイカ	5.4	5.7	18,069		42.3	44.2	313,820		42.3	44.2	
グンゼ	12.6	13.5	24,124	石原産業	9.2	12.7	17,957		16.8	8.9	1,797		16.8	8.9	
東洋紡	10.2	10.4	57,824	片倉コープアグリ	24.7	24.3	38,078		8.7	9.1	8,153		8.7	9.1	
ユニチカ	59	63.3	70,516	日本曹達	2.5	1.6	1,788		333	331.2	1,903,737		333	331.2	
富士紡ホールディングス	41.4	47.3	7,804	東ソー	14.7	17.3	99,821		5	5.8	17,202		5	5.8	
倉敷紡績	5.4	6.4	27,392	トクヤマ	182.6	195.5	374,089		6.3	6.6	12,526		6.3	6.6	
シキボウ	10.2	10.4	31,824	セントラル硝子	44.1	47.3	106,827		5	2.6	2,371		5	2.6	
日本毛織	6.8	7.7	9,255	東亜合成	21.9	15.6	45,411		2.2	1.3	2,459		2.2	1.3	
ダイトウボウ	36	37.5	52,650	大阪ソーダ	68.5	70.5	108,534		8.5	9	37,620		8.5	9	
トア紡コーポレーション	21.5	10.4	936	関東電化工業	8.2	10.2	111,078		9.2	5.2	1,497		9.2	5.2	
ダイドーリミテッド	4.2	2.5	1,085	デンカ	26.4	28.3	25,724		16.9	16.3	18,842		16.9	16.3	
帝国繊維	18.6	9.4	5,499	信越化学工業	49.7	53.3	130,105		605.1	777.7	905,242		605.1	777.7	
帝人	15.4	16.5	35,475	日本カーバイド工業	230.7	1,328.1	7,740,166		125.3	143.5	336,507		125.3	143.5	
東レ	131.6	140.7	191,914	堺化学工業	4.6	6.2	9,684		10.4	5.3	673		10.4	5.3	
住江織物	916.3	981.2	732,465	第一稀元素化学工業	10.4	11.1	21,356		22.4	30.1	58,604		22.4	30.1	
日本フェルト	2.5	1.3	3,140	エア・ウォーター	12.5	16	15,536		7.7	4.7	6,392		7.7	4.7	
イチカワ	6.7	3.7	1,602	日本薬業ホールディングス	129	138.2	281,098		18.6	16.8	7,879		18.6	16.8	
日東製網	1.5	0.8	1,420	日本化学工業	132.6	142.1	589,430		20.7	25.5	78,030		20.7	25.5	
アツギ	1.3	0.7	1,096	東邦アセチレン	4.5	5.3	10,414		53.5	57.2	160,245		53.5	57.2	
ダイニック	7.1	4.5	2,493	日本パーカライジング	2.6	6.9	2,587		30.3	32.6	46,324		30.3	32.6	
セーレン	3	2.1	1,478	高圧ガス工業	67.8	65.3	80,580		26.7	31.9	88,426		26.7	31.9	
ソトー	26.4	28.3	69,561	チタン工業	20.1	21.4	18,489		12.2	14	19,698		12.2	14	
東海染工	3.9	2.1	1,446	四国化成ホールディングス	1.4	0.9	1,011		262.7	272	2,674,304		262.7	272	
小松マテール	1.3	0.6	493	戸田工業	16.2	18.7	32,893		285.8	306.2	1,292,164		285.8	306.2	
ワコールホールディングス	19.9	21.2	16,620	ステラ ケミファ	3.1	3.3	5,336		164.3	191.9	250,333		164.3	191.9	
ホギメディカル	26.3	30	104,220	保土谷化学工業	8	7.9	25,991		9.3	11	39,985		9.3	11	
クラウディアホールディングス	18.4	19.3	65,523	日本触媒	3.9	4.6	16,491		29.5	31.7	41,685		29.5	31.7	
T S Iホールディングス	2.7	1.5	609	大日精化工業	20.8	21.3	118,917		20.3	19.9	69,291		20.3	19.9	
マツカコーポレーション	48.8	47.6	32,368	カネカ	9.6	10.2	27,907		59.9	64.1	142,109		59.9	64.1	
ワールド	3.3	2	3,420	三井化学	31.3	37.2	132,990		27.9	29.8	279,643		27.9	29.8	
三陽商会	17.5	20.7	41,193	J S R	102.1	109.4	257,746		11.6	13.5	21,181		11.6	13.5	
ナイガイ	4.6	5.5	15,581	東京応化工業	112.7	120.8	501,320		1.5	0.9	1,342		1.5	0.9	
オンワードホールディングス	4.1	2.1	548	大阪有機化学工業	127.7	159.5	634,810		70.2	75.2	115,657		70.2	75.2	
キムラタン	88.5	86.3	46,774	三菱ケミカルグループ	23.9	69.9	245,978		12.2	13.1	67,858		12.2	13.1	
ゴルドウイン	3.5	4.1	11,020	K Hネオケム	10.3	12.3	36,961		3	1.6	1,489		3	1.6	
デサント	72.8	42.8	770	ダイセル	922.8	1,070.7	921,123		7.8	8.4	15,002		7.8	8.4	
キング	24.3	25.9	244,159	住友ベークライト	22.7	22.3	52,851		-	2.9	6,820		-	2.9	
ヤマトインターナショナル	23.5	25.2	83,160	積水化学工業	201	188.3	272,281		-	7.2	6,098		-	7.2	
パルプ・紙 (0.2%)	9.8	2.5	1,740	日本ゼオン	20.2	20.5	153,114		10.6	11.3	17,277		10.6	11.3	
特種東海製紙	5.4	5.1	1,545	アイカ工業	279.7	294.3	606,258		5.5	5.9	7,782		5.5	5.9	
王子ホールディングス	6.1	8	31,520	UBE	82	100.4	128,662		22.9	42.4	55,925		22.9	42.4	
日本製紙	569.8	610	351,482	積水樹脂	34.5	37	128,760		28.4	28	92,820		28.4	28	
三菱製紙	71.1	82.6	113,657	タキロンシーアイ	70.4	69.7	176,166		6.4	-	-		6.4	-	
北越コーポレーション	15.1	8.8	5,447	旭有機材	19.9	21.9	56,414		39.8	42.7	271,572		39.8	42.7	
中越パルプ工業	86.4	72	98,856	リケンテクノス	30.2	37.4	23,262		11.7	12.4	13,912		11.7	12.4	
大王製紙	4.7	2.6	5,220	大倉工業	9.1	9.7	36,908		11.2	12.1	52,574		11.2	12.1	
阿波製紙	60.3	64.7	73,952	群栄化学工業	8.5	7.9	13,919		3.4	3.3	8,880		3.4	3.3	
レンゴー	2.9	1.8	864	ダイガースポリマー	29.5	31.6	30,999		36.9	39.5	48,506		36.9	39.5	
トーモク	124.6	133.4	137,402	ミライアル	6.4	6.8	20,400		15.5	16.4	62,238		15.5	16.4	
ザ・パップ	7.9	8.5	19,507	ダイキアクシス	18.7	20.7	9,480		7.5	4.4	3,335		7.5	4.4	
化学 (5.9%)	10.1	10.9	36,842		2.7	3.4	11,900		5	4.8	9,115		5	4.8	
北の達人コーポレーション	57.6	61.7	14,314		5.8	3	2,946		39.5	36.8	197,395		39.5	36.8	
					3.7	2.2	3,344		12.4	13.3	61,047		12.4	13.3	
					4.4	2.7	1,935		13.8	14.8	15,554		13.8	14.8	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	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		近畿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		飯島神ホールディングス	181.7	194.7	887,832	
日機装	34.1	34.1	38,396		アシックス	126	124.6	585,620		南海電気鉄道	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		京阪ホールディングス	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		神戸電鉄	3.7	4	11,508	
J M S	12.8	13.4	6,994		小松ウオール工業	5.1	6	19,410		名古屋鉄道	150.6	150.6	340,657	
フボテック	3.2	1.8	459		ヤマハ	86.1	92.2	316,891		山陽電気鉄道	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		アルプス物流	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		ヤマトホールディングス	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		山九	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		リンテック	27.4	29.4	82,114		セノールホールディングス	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		トナミホールディングス	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		ニコソホールディングス	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		日本石油輸送	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		福山通運	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		セイノールホールディングス	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		エスライングループ本社	3.7	1.8	1,564	
タムロン	10.2	9	51,570		グローブライド	11	13.1	27,248		神奈川中央交通	3.9	4	12,440	
HOYA	291.5	287.8	5,295,520		オカムラ	41.1	44.1	96,005		AZ-COM ^株 ホールディングス	32.9	37.3	56,770	
シード	6.2	3.3	2,646		美津濃	13.5	14.5	63,945		C&Fホールディングス	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		<small>NIPPON EXPRESSホールディングス</small>	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		商船三井	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		川崎汽船	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		NSユニテッド海運	7.3	7.9	40,211	
松風	6.2	6.6	17,721		九州電力	315	337	389,403		明海グループ	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		飯野海運	50	53.6	72,306	
ニプロ	113.8	121.9	146,462		沖縄電力	31.9	37.3	40,768		共栄タンカー	2.2	1.2	1,225	
その他製品 (2.4%)					電源開発	102.8	120.1	308,596		乾汽船	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	
<small>パシフィックパワードホールディングス</small>	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		日新	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		三菱倉庫	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		三井倉庫ホールディングス	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		住友倉庫	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		滋賀倉庫	5.5	6.7	20,937	
<small>パシフィックダイナミックホールディングス</small>	124.7	400.6	1,212,215		陸運業 (2.7%)				東陽倉庫	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		日本トランスシティ	27.6	29.4	18,610	
S H O E I	14.4	33.1	64,611		東武鉄道	150	160.6	628,749		ケイヒン	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		中央倉庫	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		川西倉庫	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		安田倉庫	9.5	10	12,110	
フジシー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		フィズホールディングス	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		東洋埠頭	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		上組	65.3	67.4	228,620	
エステールホールディングス	2.9	1.7	1,113		富士急行	16.8	18	78,570		サンリツ	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		キムラユニティ	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		キューソー流通システム	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		東海運	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		エアージェイ	8.6	9.2	17,056	
大建工業	8.3	-	-		鴻池運輸	23.3	24.9	47,484		内外トランスライン	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		日本コンセプト	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	評 価 額		株	数	評 価 額		株	数	評 価 額		株	数	評 価 額
クロスキャット		千株	千円	アドソル日進		千株	千円	FIG		千株	千円		千株	千円	
システナ	230.2	9.3	10,918	ODKソリューションズ	2.7	1.3	782	システマサポート	5.3	5.7	10,847	5.3	5.7	10,847	
デジタルアーツ	8.7	9.3	39,246	フリービット	7.1	6.4	9,158	イーソル	8.8	10.6	6,190	8.8	10.6	6,190	
日鉄ソリューションズ	23.4	25	124,375	コムチュア	18.1	21.2	38,859	アルテリア・ネットワークス	12.7	-	-	12.7	-	-	
キューブシステム	8.3	7.8	8,884	サイバーコム	2	-	-	東海ソフト	1.9	1.1	1,283	1.9	1.1	1,283	
コア	5.9	6.5	11,648	アステリア	10.7	11.5	7,233	ウイングワーク1st	14.1	15.2	43,350	14.1	15.2	43,350	
手間いらず	2.3	2.5	6,695	アイル	7.6	6.8	21,964	ホコエソリューションズ・ホールディングス	3.7	3.9	4,539	3.7	3.9	4,539	
ラクーンホールディングス	11.4	10.9	7,542	マークラインズ	7.4	7.9	23,700	サーバーワークス	2.8	3	12,120	2.8	3	12,120	
ソリトンシステムズ	7	7.6	10,716	メディカル・データ・ビジョン	20.4	17.5	11,095	東名	0.9	0.5	1,140	0.9	0.5	1,140	
ソフトクリエイトホールディングス	5.7	12.1	21,634	gumi	21.1	23.8	9,496	ヴィッツ	1.2	0.6	493	1.2	0.6	493	
T I S	153.9	160.4	546,803	ショーケース	3	1.5	499	トビラシステムズ	3.1	1.9	1,654	3.1	1.9	1,654	
テクミラホールディングス	5.6	3	1,422	モバイルファクトリー	2.6	1.4	1,016	Sansan	44.7	48.1	67,772	44.7	48.1	67,772	
グロリー	36.7	49.1	28,428	テラスカイ	5.9	6.3	9,620	Link-U	2.3	1.6	1,014	2.3	1.6	1,014	
GMIOペパボ	2	1.8	2,149	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7.9	7.6	13,512	ギフティ	14.9	12.9	19,866	14.9	12.9	19,866	
コアエテックモホールディングス	85.8	91.9	165,098	PCIホールディングス	5.1	2.4	2,433	メドレー	13.7	19.7	90,915	13.7	19.7	90,915	
三菱総合研究所	6.7	7.2	35,352	アイビーシー	1.9	1	468	ペース	4.6	5.1	16,294	4.6	5.1	16,294	
ホルテージ	3.6	1.8	487	ネオジャパン	4.5	4.9	5,169	JMDC	22.5	25	91,900	22.5	25	91,900	
電算	0.8	0.8	1,197	PR TIME S	3.4	2.9	6,223	フォーカスシステムズ	10	9.8	10,280	10	9.8	10,280	
AGS	5.3	2.7	2,459	ラクス	64.7	69.4	165,484	グレスコ	10.5	12	23,604	10.5	12	23,604	
ファンデックス	10.7	11.6	11,774	ランドコンピュータ	3	3.1	2,749	フブ・メディア・ホールディングス	131.4	140.9	276,938	131.4	140.9	276,938	
ブレインパッド	10.2	12.2	15,396	ダブルスタンダード	5.6	4.5	7,389	オービック	45.7	49	1,099,315	45.7	49	1,099,315	
K L a b	27.2	26.9	9,657	オーブントピア	9.6	8.5	8,007	ジャストシステム	19.7	21.1	62,329	19.7	21.1	62,329	
ホルトウインホールディングス	23.4	25	12,125	マイネット	4	2.1	583	TDCソフト	11.6	13.7	29,085	11.6	13.7	29,085	
ネクソン	354	328.2	948,662	アカツキ	6.5	7	17,528	LINEヤフー	1,948.4	2,087.7	904,600	1,948.4	2,087.7	904,600	
アイスタイル	39.8	47.8	19,550	ベネフィットジャパン	0.8	0.4	498	トレンドマイクロ	79	69.3	572,279	79	69.3	572,279	
エムアップホールディングス	16.7	18	17,964	Ubicomホールディングス	4.2	4.6	7,369	IDホールディングス	9.3	9.9	16,780	9.3	9.9	16,780	
エイチーム	9.9	8.7	4,863	カナミックネットワーク	19.7	15.8	6,699	日本オラクル	26.2	28.1	316,827	26.2	28.1	316,827	
エニゴモ	17.4	18.6	6,510	ノムラシステムコーポレーション	11.7	7.1	809	アルファシステムズ	4.3	3.9	12,246	4.3	3.9	12,246	
テクノスジャパン	10	5.8	3,700	チェンジホールディングス	33.5	31.9	43,830	フューチャー	34.1	31.3	53,303	34.1	31.3	53,303	
enish	9.2	6.6	1,214	シンクロ・フード	7.6	4.1	2,681	CAC Holdings	8.6	7.9	14,180	8.6	7.9	14,180	
コプラ	53.2	56.9	35,676	オークネット	6.7	5.4	11,485	S B テックノロジー	5.8	6.2	13,615	5.8	6.2	13,615	
オルトプラス	9.2	5.8	881	キャピタル・アセット・プランニング	2.4	1.3	978	トーセ	3.2	1.9	1,345	3.2	1.9	1,345	
ブロードリーフ	79.9	69.6	43,708	セブエグループ	3.3	2.1	1,936	オービックビジネスコンсалタント	26.9	20.6	145,477	26.9	20.6	145,477	
クロス・マナテインググループ	7.3	3.1	1,779	エイトレッド	1.9	1	1,416	伊藤テクノソリューションズ	73.5	-	-	73.5	-	-	
デジタルハーツホールディングス	8.6	9.1	9,500	マクロミル	26.8	28.8	22,320	アイティフォー	18.2	18.8	22,729	18.2	18.8	22,729	
システム情報	12.1	-	-	ビーグリー	2.1	1.4	1,785	東計電算	2	4.1	15,088	2	4.1	15,088	
メディアアドゥ	5.5	6.6	8,210	オロ	4.1	5.3	15,184	エックスネット	1.8	1	1,105	1.8	1	1,105	
じげん	39.9	42.8	22,256	ユーザーローカル	5	6.2	12,920	大塚商会	77.6	72.7	434,964	77.6	72.7	434,964	
ブイキューブ	16.4	17.5	5,285	テモナ	2.3	1.5	384	サイボウズ	18.9	20.2	45,510	18.9	20.2	45,510	
エンカレッジ・テクノロジ	2.9	1.5	958	ニーズウェル	3.7	3.6	2,862	電通総研	16.6	17.8	96,654	16.6	17.8	96,654	
サイバーリンクス	3.9	2.5	2,022	マネーフォワード	32.9	32.7	187,567	ACCESS	16.2	15.2	12,768	16.2	15.2	12,768	
ディー・エル・イー	8.8	4.6	846	サインポスト	4.7	2.5	1,280	デジタルガレージ	24.3	23.4	82,251	24.3	23.4	82,251	
フィックスターズ	15.5	16.5	26,383	SUN ASTERISK	7.2	10.4	9,994	イーエムシステムズ	22.8	24.5	16,709	22.8	24.5	16,709	
CARTA HOLDINGS	6.4	6.9	10,736	プラスアルファ・コンサルティブ	-	8.7	21,228	ウェザーニューズ	4.2	4.5	22,995	4.2	4.5	22,995	
オプティム	11.2	15.1	13,816	電算システムホールディングス	6.6	6.5	19,220	C I J	11.4	24.4	16,714	11.4	24.4	16,714	
セレス	5.5	5.9	7,351	APPIER GROUP	38.9	50.1	85,671	ビジネスエンジニアリング	2.6	2.8	12,474	2.6	2.8	12,474	
S H I F T	10	9.7	266,604	ビジョナル	-	11.2	102,816	日本エンタープライズ	12.4	6.6	818	12.4	6.6	818	
ティーガイア	14.3	15.4	31,339	ソルクシーズ	10.2	5.3	2,141	WOWOW	7.6	11	12,760	7.6	11	12,760	
セック	1.7	1.8	9,180	フェイス	3.4	1.8	874	スカラ	12.7	13.5	10,260	12.7	13.5	10,260	
テクマトリックス	25	26.8	50,946	プロトコムポレーション	17.1	16.1	21,960	インテリジェント ウェイ	6.5	3.5	3,934	6.5	3.5	3,934	
プロシップ	6	7.1	9,989	ハイマックス	4.3	4.5	6,309	ANY COLOR	-	15.5	52,390	-	15.5	52,390	
カホホ・ワトライフ・エンターテインメント	41.9	38.2	94,984	野村総合研究所	280.9	324.9	1,374,327	WOW WORLD GROUP	2.2	-	-	2.2	-	-	
GMOペイメントゲートウェイ	31.3	29.3	258,250	サイバネットシステム	11.5	-	-	IMAGICA GROUP	11.2	14.7	10,216	11.2	14.7	10,216	
ザップパラ	3.4	1.5	649	CEホールディングス	6.2	3.4	2,067	ネットワークシステムズ	51	59.2	160,106	51	59.2	160,106	
システムリサーチ	4.2	5	17,125	日本システム技術	5.1	5.4	17,577	システムソフト	46	50.8	2,946	46	50.8	2,946	
インターネットエンシアティブ	76.4	70.1	198,207	インテックホールディングス	15.5	16.6	28,552	アルゴラフィックス	12.6	13.5	56,025	12.6	13.5	56,025	
さくらインターネット	15.3	16.5	62,452	東邦システムサイエンス	3.5	5.5	6,897	マーベラス	22.3	23.8	17,635	22.3	23.8	17,635	
ヴィンクス	3.6	-	-	ソースネクスト	69.6	67.1	9,662	エイベックス	23.2	25	35,225	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	インフォコム	17.6	18.9	41,598	B I P R O G Y	50.4	48	215,760	50.4	48	215,760	
SRAホールディングス	7	7.5	29,100	シンプルクス・ホールディングス	23	22.1	55,581	兼松エレクトロニクス	8.5	-	-	8.5	-	-	
システムインテグレータ	3.7	2	868	HEROZ	4.5	5.8	9,094	都築電気	7.2	7.7	18,641	7.2	7.7	18,641	
朝日ネット	14.8	15.8	9,938	ラクスル	38.7	35.3	37,523	TBSホールディングス	70.2	73.7	297,748	70.2	73.7	297,748	
e B A S E	19.3	20.7	14,717	マルカリ	61.8	71.4	174,037	日本テレビホールディングス	121.3	129.8	290,946	121.3	129.8	290,946	
アバントグループ	17.3	18.5	25,326	I P S	4.4	4.2	8,513	朝日放送グループホールディングス	13	13.7	9,617	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	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	田中商事	20.5	22	20.5	22	34,342			
テレビ東京ホールディングス	121.3	113.9	94,878	ディー・ブイエックス	23.1	24.8	オー・ハシテクニカ	3.9	1.9	3.9	1.9	1,575			
日本BS放送	9.8	10.6	35,139	ダイワボウホールディングス	3.5	1.9	白銅	7.2	8.1	7.2	8.1	15,106			
ビジョン	4.4	2.4	2,186	マツコホールディングス	59	68.5	ダイコー通産	5.3	4.5	5.3	4.5	11,092			
スマートバリュー	18.1	22.1	25,061	ラクト・ジャパン	35.4	36.6	伊藤忠商事	1.4	0.7	1.4	0.7	845			
USEN-NEXT HOLDINGS	3	1.9	750	グリムス	5.7	6	丸紅	890.1	1,039.9	1,140.3	1,289.8	7,004,766			
ワイヤレスゲート	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	高島	2.1	4.7	2.1	4.7	6,363			
コネクショ	5.5	2.8	800	メディアスホールディングス	21.1	23.4	長瀬産業	67.9	70.9	67.9	70.9	170,620			
日本通信	8.9	—	—	レスタールホールディングス	11.8	12.5	蝶理	7.8	9.7	7.8	9.7	28,624			
クロップス	126.2	144.3	34,199	ジオリーブグループ	13.8	13.2	豊田通商	126.5	135.5	126.5	135.5	1,260,150			
日本電信電話	2.1	0.9	918	大光	2.7	1.6	三共生興	20.7	21.5	20.7	21.5	16,748			
KDDI	1,754.4	43,620.3	7,999,963	オチノチホールディングス	5.2	3.6	兼松	56	64.7	56	64.7	150,492			
ソフトバンク	1,058	1,133.2	5,211,586	TOKAIホールディングス	2.9	1.6	ツカモトコーポレーション	1.9	1	1.9	1	1,224			
光通信	2,199.3	2,360	4,589,020	黒谷	71.3	84	日本紙パルプ商事	1,056.8	1,165.6	1,056.8	1,165.6	6,807,104			
エムティーアイ	16.1	14.8	385,170	Cominix	3.7	2.2	カメイ	7.6	7.4	7.6	7.4	37,518			
GMOインターネットグループ	12.5	10.1	6,201	三洋貿易	2.4	1.4	東都水産	15.4	16.4	15.4	16.4	31,504			
ファイバーゲート	50.9	54.2	141,733	ビューティガレージ	14.9	17.5	OUGホールディングス	0.6	0.4	0.6	0.4	2,560			
アドマークeting&コミュニケーション	7.3	7.9	7,394	ワイン・パートナーズ	2.3	4.9	スターゼン	2	1	2	1	2,435			
KADOKAWA	3.1	1.8	423	ミタチ産業	10.5	10.1	山善	11	10.7	11	10.7	29,157			
学研ホールディングス	72.3	77.5	250,945	ショップハルスケアホールディングス	3.3	1.9	椿本興業	38.9	46.9	38.9	46.9	58,953			
ゼンリン	22.8	24.4	24,644	明治電機工業	51.9	55.6	住友商事	2.1	3.1	2.1	3.1	21,142			
昭文社ホールディングス	23.3	25.1	21,435	デリカフーズホールディングス	5.5	5.8	内田洋行	894.6	936.3	894.6	936.3	3,143,159			
インプレスホールディングス	5.6	2.9	1,078	スターティアホールディングス	5.2	3	三菱商事	6.4	6.3	6.4	6.3	49,329			
アイネット	10.8	6.6	1,168	コメダホールディングス	2.5	1.8	第一実業	903.1	3,065.3	903.1	3,065.3	8,527,664			
松竹	8.4	8.9	17,132	ピーバンドコム	35.3	37.9	キヤノンマーケティングジャパン	5.1	14.6	5.1	14.6	27,302			
東宝	7.8	7.6	77,558	アセンテック	1.7	0.9	西華産業	33.4	35.8	33.4	35.8	155,157			
東映	85.7	81.6	386,294	富士興産	4.7	5.9	佐藤商事	5.7	6.1	5.7	6.1	19,581			
NTTデータグループ	3.8	4.8	96,624	協栄産業	2.9	1.9	菱洋エレフトロ	10.1	10.9	10.1	10.9	18,519			
ピー・シー・エー	429.6	383.4	800,730	フルサト・マルカホールディングス	1.1	0.7	東京産業	12.3	14.7	12.3	14.7	56,815			
ビジネスブレイン太田昭宏	7.8	8.4	13,255	ヤマエグループホールディングス	14.3	13.8	ユアサ商事	13.3	14.1	13.3	14.1	10,560			
DT S	5.9	5.7	12,768	小野建	8.2	8.7	神鋼商事	13	12.1	13	12.1	60,076			
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29.1	30.9	112,630	南陽	13.4	15.4	トルク	3.6	3.9	3.6	3.9	26,235			
シーイーシー	68.8	18.5	30,691	佐島電機	2.5	1.4	阪和興業	6.6	3.7	6.6	3.7	1,087			
カプコン	19.2	131.1	738,617	エコトレーディング	8	8.6	正栄食品工業	25.9	27.8	25.9	27.8	149,842			
アイ・エス・ピー	136	7.5	11,790	伯東	2.5	1.3	カナデン	9.6	10.3	9.6	10.3	47,122			
ジャストテック	7	9	11,934	コンドレーテック	8.3	8.9	RYODEN	11.7	11.6	11.7	11.6	17,400			
SCSK	111.7	102.6	272,043	中山福	11.1	11.9	岩谷産業	11.6	12.5	11.6	12.5	32,900			
NSW	5.4	6.3	18,685	ナガイレーベン	6.6	3.9	ナイス	32.9	35.2	32.9	35.2	246,118			
アイネス	9.5	11.4	16,917	三菱食品	18.2	19.6	ニチモウ	3.5	2.1	3.5	2.1	3,332			
T KC	24.6	23.3	88,307	松田産業	13.4	14.3	極東貿易	1.4	2.2	1.4	2.2	4,952			
富士ソフト	15.5	29.5	188,800	第一興商	10.9	11.8	アステナホールディングス	8.7	9.2	8.7	9.2	20,460			
NSD	48.8	52.3	140,373	メディバルホールディングス	27.9	59.9	三愛オプリー	25	29	25	29	13,688			
コナミグループ	58.6	54.9	507,111	S P K	149.7	157.3	稲畑産業	39.8	37.2	39.8	37.2	64,356			
番井コンピュータホールディングス	9.5	9.1	23,241	萩原電気ホールディングス	6.4	6.9	G S Iクレオス	29.2	30.6	29.2	30.6	96,696			
JBCホールディングス	9.9	9.7	38,121	アズワン	5.5	6.6	明和産業	8.5	8.3	8.5	8.3	19,812			
ミロク情報サービス	12.5	13.3	25,961	スズデン	21.2	24.2	クワザールホールディングス	19.2	18.3	19.2	18.3	13,139			
ソフトバンクグループ	791.6	723.4	4,787,461	尾家産業	5.1	5.4	ワキタ	4.4	2.5	4.4	2.5	1,755			
卸売業 (7.3%)				シモジマ	3.1	1.6	東邦ホールディングス	26.5	25.6	26.5	25.6	40,857			
高千穂交易	4.5	4.9	19,526	ドウシシャ	9.9	10.4	サンゲツ	35.9	42.8	35.9	42.8	136,403			
オルパルシステムホールディングス	2	1.1	2,060	高速	15.3	14.3	サンリオ	36.3	35.6	36.3	35.6	116,056			
伊藤忠食品	2.7	3.5	27,405	丸文	2.9	1.5	サンワ テクノス	18.6	19.8	18.6	19.8	32,353			
エレマテック	1.3	13.9	25,117	ハビネット	7.5	9.2	リョーサン	4.6	4.3	4.6	4.3	17,630			
あらた	11	23.7	73,588	機本総業ホールディングス	5.6	5.9	新光商事	17.6	20.8	17.6	20.8	59,827			
トーマンデバイス	2.1	2.2	11,726	日本ライフライン	2.7	2.6	トーホー	41	43.8	41	43.8	274,582			
東京エレクトロン デバイス	5.4	15.4	100,562	タカショー	12.9	13.8	三信電気	7.4	7.9	7.4	7.9	17,822			
円谷フィーズホールディングス	12.4	26.6	47,507	IDOM	12.3	13.2	東陽テクニカ	15.4	10.9	15.4	10.9	54,445			
双日	153.3	172.3	641,300	進和	5.8	6.1	モスフードサービス	19.4	20.8	19.4	20.8	25,272			
アルフレックス ホールディングス	144.9	155.3	371,865	エスケイジャパン	42.3	45.4	加賀電子	6.2	6	6.2	6	17,664			
横浜冷凍	39.4	42.1	46,731	ダイトロン	12.5	13.5	ソーダニッカ	5.8	6.2	5.8	6.2	14,365			
神栄	1.8	1	1,712		43.7	40.9		15.9	15.7	15.9	15.7	22,780			
ラサ商事	5.8	6.3	10,621		9.6	9.5		21.3	22.8	21.3	22.8	78,432			
アルコニック	19	20.4	28,580		3.2	1.7		11.8	14.1	11.8	14.1	95,739			
神戸物産	111.8	119.7	443,847		5.7	6.1		9.4	13.1	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	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
立花エレクトック		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	東京一番フーズ	204.7	219.3	302,962	アルビス	13.8	14.7	15,611
PALTAC	5.5	6.1	8,430	DDグループ	3.1	1.7	904	コナカ	4.7	5	13,345
三谷産業	22.7	20.9	91,667	きぢりホールディングス	8.3	4.4	6,688	ハウス オブ ローゼ	14	7.4	3,145
太平洋興発	25.3	27	10,449	アフランドサービスホールディングス	3.1	1.8	1,848	G-7ホールディングス	1.7	0.9	1,457
西Wi Smettacホールディングス	4.4	2.5	2,085	J.フロント リテイリング	11.8	-	-	イオン北海道	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	ドール・日レスホールディングス	179.5	177.5	266,871	コジマ	21.4	45.7	42,546
コア商事ホールディングス	1	0.6	1,345	マツキョコカラ&カンパニー	25.6	27.4	58,882	ヒマラヤ	28	25.6	18,790
KPPグループホールディングス	8.2	10.9	8,120	プロンコビルー	87.6	281.4	781,588	コーナン商事	4.1	2.2	2,057
ヤマタネ	33.6	40	28,720	ZOZO	7.6	9.1	30,348	エコス	19.5	19	75,240
丸紅建材リース	6.4	6.8	16,694	トレジャー・ファクトリー	95.5	98.6	331,986	ワタミ	5.4	5.7	14,335
日鉄物産	0.8	0.5	1,429	物語コーポレーション	3.9	8.5	12,316	マルシェ	17.4	16.4	16,613
泉州電業	9.9	-	-	三越伊勢丹ホールディングス	8	25.8	136,224	丸の内ホールディングス	4	2.5	607
トラスコ中山	7.2	7.2	27,252	Hamee	243.1	260.5	509,928	西松屋チェーン	291.5	312.4	1,032,482
オートバックスセブン	30.3	32.5	79,040	マーケットエンタープライズ	5	6.2	6,776	サンヨーホールディングス	32	30.4	64,873
モリト	50.2	53.9	87,587	ウエルシアホールディングス	1.3	0.6	616	幸福苑ホールディングス	79	78.8	580,046
加藤産業	10.4	11.1	15,717	クリエイティブSDホールディングス	74.9	80.2	210,244	ハーグスレイ	9.5	11.4	14,979
北恵	17.5	19.2	89,376	丸善CHIホールディングス	23.8	21.9	70,737	サイゼリヤ	4.5	2.4	2,179
イエローハット	2.9	1.7	1,463	ミサワ	15.4	8.3	2,705	V Tホールディングス	24	22.9	111,866
JKホールディングス	25.5	24.6	46,321	ティーライフ	2.4	1.5	928	魚力	54.8	58.8	31,281
日伝	11.4	11.9	12,316	イー・ピーホールディングス	1.7	0.9	1,268	ポップラ	4.5	5.4	13,046
北沢産業	8.6	10.5	28,602	チームニー	1.9	1.7	1,654	フジ・コーポレーション	3.2	1.8	439
杉本商事	7.1	4.2	1,302	シュッピン	4	2.1	3,059	ユニテッドアローズ	8.2	7.4	13,090
因幡電機産業	6.2	7.3	16,439	オイシックス・ラ・大地	10.7	14	14,182	ハイデイド白濁	15.4	18.2	35,672
東テック	37.4	40.1	140,350	ネクステージ	19.4	20.8	28,579	YU-WA CREATION HOLDINGS	21.4	22.9	65,494
ミスミグループ本社	4.9	5.1	33,507	ジョイフル本田	32.9	35.3	84,296	コロワイド	7.1	3.7	536
アルテック	217.9	233.6	542,302	鳥貴族ホールディングス	42.8	45	87,390	ビシーデポコーポレーション	66.6	66.5	154,047
タキヒヨー	7.1	3.7	925	ホットランド	5.4	5.7	21,004	トッポカルチャー	15.7	-	-
蔵王産業	3.1	1.6	1,929	SFPホールディングス	11	11.8	23,847	PLANT	11.5	12.2	76,738
スズケン	2.2	1.2	3,084	縮半ホールディングス	197.4	211.4	501,652	スギホールディングス	4.2	2.2	345
ジェコス	44.9	58.9	271,941	ヨシダホールディングス	7.9	8.5	18,062	薬王堂ホールディングス	3.2	1.5	2,422
グローセル	7.1	9.3	11,085	コフダ・エス・エー・ホールディングス	11.4	12	17,760	ヴァア・ホールディングス	29.1	31.2	217,807
小売業 (4.2%)	3.2	1.1	1,358	ゴルフダイジェスト・オンライン	2.6	3.2	9,478	スクロール	8	7.6	19,486
ローソン	35.8	32.9	337,883	BEENOS	47.2	43.1	43,143	ヨドバツホールディングス	17.9	10.2	1,560
サンエー	11	11.8	54,044	あさひ	6.5	7	4,340	木曾路	21.5	23	22,264
カワチ薬品	11.4	12.1	32,827	エドビーシー・マート	8.2	6.3	9,097	SRSホールディングス	12.4	14.6	28,776
ハードオフコーポレーション	21.1	67.7	176,561	コスモス薬品	12.1	14.3	18,661	千趣会	21.9	23.4	61,167
アスフル	5.2	5.5	10,092	トーエル	9.9	10.5	15,330	ダカキュー	23.8	25.5	29,860
ゲオホールディングス	29.8	37.3	73,854	セブン&アイ・ホールディングス	14.2	13.1	209,600	リテールパートナーズ	27.1	28.4	7,838
アズストリア	15.2	17.4	41,394	クリート・レストラン・ホールディングス	5.8	3.1	2,458	ケーヨー	9.2	-	-
ジューソフト	17.4	18.7	67,600	ツルハホールディングス	497.8	533.1	3,238,049	上新電機	21.5	23	39,951
シー・ヴィ・エス・バイエリア	6.8	5.7	1,692	サンマルクホールディングス	108.7	104.7	114,332	日本瓦斯	23.4	-	-
くら寿司	1.7	0.9	686	フェリシモ	30.3	32.5	357,662	ロイヤルホールディングス	12.9	15.3	36,352
キャンドゥ	16.9	18.1	71,314	トリドールホールディングス	11.7	12.5	28,000	いなげや	77.4	82	195,693
1Kホールディングス	5.2	5.5	14,778	TOKYO BASE	2.9	1.5	1,375	チヨダ	28	27.3	69,560
バルグループホールディングス	4	2.3	878	ワイブルラスホールディングス	35.9	43.4	195,213	ライフコーポレーション	0.6	0.5	421
エディオン	14.1	30.4	69,403	JMホールディングス	14.8	18.5	5,716	リンガーハット	14.1	15	19,110
サラーコーポレーション	57.2	61.2	94,186	サツドラホールディングス	2.1	1.4	1,440	Mr Ma x HD	13.8	14.8	13,246
ワッツ	30.3	32.5	26,097	アレナザホールディングス	12.3	11.7	27,565	テンアライド	12.6	16.2	60,993
ハローズ	6.3	3.3	1,940	フロッピーホールディングス	5.8	2.8	2,251	アオキホールディングス	18.6	20	48,060
フジオフードグループ本社	6.6	7	30,065	パロックスホールディングス	10.8	11.6	13,502	オークワ	20.4	19.5	12,285
あみやき亭	12.1	17.4	25,021	クリのアオキホールディングス	3.8	4.1	8,077	コメリ	13.7	9.1	2,884
ひらまつ	3.5	3.7	16,668	力の源ホールディングス	9.4	12	9,828	青山商事	26.8	33.2	39,441
大黒天物産	27.2	16.4	4,428	フード & LIFE COMPANIES	12.9	46.6	146,277	しまむら	23	22.2	20,024
ハニースホールディングス	4.4	4.8	42,096	メディカルシステムネットワーク	7.4	7.9	11,502	はせがわ	22.3	23.8	77,588
ファーマライズホールディングス	11.4	13.7	23,235	一家ホールディングス	83	82.5	235,578	高島屋	16.9	18.2	293,475
アルペン	2.9	1.6	1,046	ジャパコラフトホールディングス	2.8	1.7	1,196	松屋	6.2	3.3	1,191
ハブ	11.9	12.7	25,501	はるやまホールディングス	4	4.9	823	近鉄百貨店	108.9	106.9	235,393
クォールホールディングス	4.1	2.2	1,610	カッツァ・フリエイト	47.2	44.9	72,199	丸井グループ	24.5	26.2	25,361
ジンスホールディングス	19.9	21.3	34,655	ライトオン	5.3	3.3	1,966	アグナル リテイリング	70.3	68.5	124,533
ピックカメラ	8.6	9.2	37,996	良品計画	47.2	5.2	2,168	井筒屋	4.6	6.6	16,962
DCMホールディングス	96	82.3	110,693	パルミキホールディングス	9.7	5.2	2,168		106.5	102.7	250,177
ベッパフードサービス	88.1	81.8	112,311		186.3	168.9	356,885		9.9	10.6	41,605
	30.2	35.8	3,329		16.5	8.6	4,222		6.1	3.2	1,139

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
野村不動産ホールディングス	84	80.1	千円 299,493	インテリックス	3.1	1.5	千円 847	CDG	1.4	0.8	千円 989	アドウェイズ	19.3	20.7	10,577
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	パリュエーコマース	10.5	13.2	16,209	インフォーマート	145.6	156	60,684
サムティ	21.4	22.9	57,295	サンクススタグループ	3.6	2.1	2,007	J Pホールディングス	40.3	38.4	16,627	エコナックホールディングス	22	5.8	748
ディ・ライフ	20.7	24.5	24,010	グランディハウス	10.1	10.8	7,106	CLホールディングス	3.9	3.5	3,272	プレステージ・インターナショナル	59	70.4	41,184
コーセーホールイー	3.7	2	1,826	日本空港ビルディング	47.6	50.9	299,444	AMユーズ	7.6	9.2	14,766	ドリムインキュベータ	4.3	5.2	15,782
地主	10.2	11	24,882	サービス業 (4.6%)				クイック	10.7	10.4	25,126	TAC	6.8	3.3	627
アピックスコーポレーション	17.6	22.9	39,021	明豊ファシリティワークス	6.3	3.3	3,111	電通グループ	137.9	147.7	585,187	イオンファンタジー	6.1	5.4	13,224
THEグローバル社	7	4.3	1,659	日本工営	8.5	—	—	アマミューズ	4.2	5.8	6,948	シーティーエス	15.6	19	13,946
ハウスコム	2	1	907	L I F U L L	48	51.3	9,849	ティフアンドギヴ・ニーズ	4.7	5	16,800	NEXYZ Group	3.8	2.1	1,465
JPMC	6.8	8.3	9,495	M I X I	31.9	32.2	80,789	ぴあ	4.7	5	16,800	H.U.グループホールディングス	41.1	44	117,832
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	アルプス技研	12.2	14.3	41,384	サニックス	22.7	24.1	6,940
エストラスト	1.5	0.7	451	日研&Aセンターホールディングス	240.8	239.5	219,286	日本空調サービス	15.4	16.2	14,515	オリエンタルランド	148.5	795.4	4,066,084
フージャースホールディングス	20.6	22.2	25,374	メンパーズ	4.1	5.1	4,855	ダ斯克	31.3	33.5	115,742	明光ネットワークジャパン	18.4	18.2	13,031
オープンハウスグループ	49.2	52.7	246,688	中広	1	1	413	ファルコホールディングス	6.1	6.8	13,980	秀英予備校	3.1	1.5	462
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	田谷	1.7	1.2	506	ラウンドワン	117.3	141.4	97,000
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	ライゾートトラスト	55.4	65.3	167,102	ピー・エム・エル	17.4	18.5	52,836
イーブランド	1.9	1	1,587	ケアネット	—	23.1	16,331	りららひらひらコミュニケーションズ	23.2	—	—	リソー教育	63.8	76.8	18,432
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	早稲田アカデミー	7.8	8.3	14,508	イー・エス・エス	144.3	168.6	453,196
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	東京個別指導学院	16.7	17.9	8,055	サイバーエージェント	335.7	332.1	339,738
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	楽天グループ	649.5	1,288.3	818,070	クリーク・アンド・リバー社	8.3	7.6	15,184
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	S&Iグループホールディングス	23	23	29,4	デー・オー・ダブリュー	27.2	29.4	10,084
シーアールイー	6.1	8	11,104	パソナグループ	17	18.2	49,231	山田コンサルティンググループ	7.1	6.5	11,381	セントラルスポーツ	5.3	5.6	13,938
プロパティエージェン	1.5	—	—	C D S	3.2	1.7	2,908	セトラルススポーツ	13.4	14.4	25,776	フィルキャストホールディングス	25.4	24.5	67,154
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	イー・エル	1.1	0.6	3,666	エン・ジャパン	3.7	1.6	212
アグレ都市デザイン	2.2	1.1	1,782	エス・エム・エス	53.4	52.7	129,694	テノフコ・ホールディングス	83.1	88	296,120	リソルホールディングス	3	2	362
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	アトラグループ	3	2	362	インターワークス	3.2	—	—
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	インターワークス	7.3	7.8	10,303	ファイナルジャパホールディングス	8.7	9.3	60,636
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	Keeper 技研	2	1.6	804	ファーストロジック	2	1.2	1,615
テンポインバージョン	3.7	1.9	1,778	クックパッド	38.4	41.1	4,932	三機サービス	11.1	11.9	8,687	Gunosy	3.7	1.6	212
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	イー・ガーディアン	5.3	5.7	8,031	リブセンス	5.8	3.1	753
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	ジャパバスターレシキョウシステム	42.9	46	118,450	チャーム・コア・コーポレーション	11.7	12.5	17,162
霞ヶ関キャピタル	—	3.9	45,552	学情	6.4	7.7	13,898	ランド	22	18.4	21,804	キャリアリオン	5.2	5.5	14,470
パーク24	104.7	93.5	179,940	スタジオアリス	7	7.5	15,735	カチタス	36.1	28.2	1,072	I B J	8.6	11.5	7,820
パラカ	4.7	5.1	10,225	シミックホールディングス	7.7	—	—	トーセイ	22.3	24	48,840	アサンテ	7	7.4	12,321
ミガロホールディングス	—	1	1,481	エプコ	2.7	1.8	1,699	穴吹興産	2.4	1.5	3,198				
宮越ホールディングス	6.2	6.6	7,134	N J S	2.6	3.3	9,025	サンフロンティア不動産	22.4	21.3	36,593				
三井不動産	584.3	665.9	2,661,602	総合警備保障	52.1	251.1	200,553	FJネットホールディングス	14.1	15.2	19,547				
三菱地所	811.2	941.3	1,974,847	カカココム	104.7	99.3	177,796								
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								
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								
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								
住友不動産	243	208.2	993,322	ルネサンス	9.8	11.7	10,869								
テオーシー	24.5	25.7	17,193	デジッパ	24.6	23	61,157								
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								
レオパレス21	151.4	144.1	56,631	新日本科学	14.9	13.7	21,330								
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								
フジ住宅	18.8	18.1	12,887	ベネフィット・ワン	65	52.2	109,463								
空港施設	16.2	20.3	12,525	エムスリー	277.3	297	587,317								
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								
ゴールドクレスト	12.8	11.7	26,933	プラス	1.7	0.7	503								
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								
日研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								
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								
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								
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	178.9	191.7	228,793								
イオンモール	69.7	74.6	138,271	ぐるなび	25.8	28	7,392								
毎日コムネット	4.5	2.4	1,783	タカミヤ	19.2	20.4	9,934								
ファースト住建	5	2.5	2,770	ジャパバスターレシキョウシステム	8.7	—	—								
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								
カチタス	36.1	38.7	69,040	ライク	5.3	5.6	8,540								
トーセイ	22.3	24	48,840	A o b a - B B T	4.6	2.5	1,030								
穴吹興産	2.4	1.5	3,198	エスプール	40.3	43.2	13,262								
サンフロンティア不動産	22.4	21.3	36,593	WD Bホールディングス	7.1	7.7	17,594								
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								

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	3,562	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	5	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	6.6	8.6	12,728	11.8	12.6	57,708	東京都競馬	11.8	12.6	57,708	4.3	2.5	3,092
ERIホールディングス	3.2	1.9	3,115	4.3	1.9	1,508	スプリックス	7.7	6.4	18,022	25.7	23.3	67,104	カナモト	25.7	23.3	67,104	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	3.6	2	622	13	14	55,090	ニシオホールディングス	13	14	55,090	70.2	43.4	998
シグマクシス・ホールディングス	21.3	20.3	34,185	1.5	0.8	414	プロレド・パートナーズ	4.7	3.8	5,909	70.2	43.4	998	アゴラ ホスピタリティー グループ	70.2	43.4	998	17.4	18.7	55,165
ウィルグループ	11.7	12.5	14,900	4.7	3.8	5,909	and factory	2	1.2	376	61.2	65.6	56,940	トラंस・コスモス	17.4	18.7	55,165	61.2	65.6	56,940
エスコロー・エージェンツ・ジャパン	13.5	7.9	1,106	2	2.2	3,577	テノ・ホールディングス	2.1	2.2	3,577	6.2	6	40,200	乃村工藝社	61.2	65.6	56,940	6.2	6	40,200
メドピア	11	13.2	9,081	1.8	0.9	452	フロントティア・マネジメント	1.8	0.9	452	8.4	9	11,763	藤田観光	6.2	6	40,200	8.4	9	11,763
レアジョブ	2.4	1.3	1,186	—	16.1	44,355	ピアラ	43.1	41.1	30,866	14.8	—	—	日本管財	14.8	—	—	14.8	—	—
リクルートホールディングス	1,039	1,112.8	6,435,322	—	16.1	44,355	ゴロ・ホールディングス	8.3	20.5	16,338	12.5	13.3	28,209	トーカイ	12.5	13.3	28,209	1.1	1	2,736
エラン	18.6	19.9	21,074	8.3	20.5	16,338	ギークス	4.7	5.1	5,630	1.1	1	2,736	白洋舎	1.1	1	2,736	142.9	153.1	1,639,701
土木管理総合試験所	5.3	3.1	1,010	16.8	15.5	6,851	アンピスホールディングス	10.9	11.7	25,353	7.5	8.1	20,841	セコム	142.9	153.1	1,639,701	7.5	8.1	20,841
日本郵政	1,839.2	1,766.2	2,500,939	2.1	2.2	3,000	カープスホールディングス	10.9	11.7	25,353	27	29.1	23,483	セントラル警備保障	7.5	8.1	20,841	55.9	54.1	164,680
ベルシテム24ホールディングス	18.8	16.1	28,802	2.1	2.2	3,000	フォーラムエンジニアリング	10.9	11.7	25,353	29.1	29.1	23,483	丹青社	27	29.1	23,483	13.1	14	30,184
鎌倉新書	15.9	12.8	7,936	2.1	2.2	3,000	FAST FITNESS JAPAN	10.9	11.7	25,353	55.9	54.1	164,680	メイテックグループホールディングス	55.9	54.1	164,680	29.5	31.3	77,373
SMM	3.2	1.3	421	5.7	3.4	1,547	ダイレクマーケティングミックス	10.9	11.7	25,353	4.2	1.7	433	応用地質	13.1	14	30,184	4.2	1.7	433
一蔵	1.5	0.8	494	78.1	75.3	118,635	ロビピンズ	10.9	11.7	25,353	7.9	4.5	4,540	船井総研ホールディングス	29.5	31.3	77,373	7.9	4.5	4,540
グローバルキッズCOMPANY	1.9	1.2	786	9.8	10.5	8,158	LITALICO	10.9	11.7	25,353	2.8	1.8	3,834	進学会ホールディングス	4.2	1.7	433	5.6	6	12,486
エアトリ	9.1	11	20,009	9.8	10.5	8,158	コンフィデンス・インタワークス	10.9	11.7	25,353	5.6	6	12,486	オオバ	7.9	4.5	4,540	52.3	50.5	131,249
アトリエ	11	8.9	5,918	29.5	28.8	36,316	アドビレテッジリスクマネジメント	10.9	11.7	25,353	6.5	12.8	6,937	いであ	2.8	1.8	3,834	15.5	16.1	60,455
ストライク	6.9	6.4	30,976	6.3	5.7	10,807	リロググループ	10.9	11.7	25,353	28.7	30.7	123,874	ナック	6.5	12.8	6,937	6.5	12.8	6,937
ソラスト	38.7	41.4	23,598	—	13	10,647	東祥	10.9	11.7	25,353	5.8	5.5	11,088	学究社	5.6	6	12,486	28.7	30.7	123,874
セラク	5	4.6	5,147	26.7	27.3	68,058	ID&E ホールディングス	10.9	11.7	25,353	5.8	5.5	11,088	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	5.8	5.5	11,088
インソース	34.8	32.6	25,395	—	15.8	40,416	ビーウィズ	10.9	11.7	25,353	5.8	5.5	11,088	ステップ	5.8	5.5	11,088	—	—	—
ペイカレント・コンサルティング	111	110.5	345,754	—	15.8	40,416	TREホールディングス	10.9	11.7	25,353	—	—	—	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	—	—	—
Orchestra Holdings	3	3.2	3,168	—	7.2	42,840	人・夢・技術グループ	10.9	11.7	25,353	—	—	—	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	—	—	—
アイモパイル	7.3	20.1	9,105	—	13	10,647	NISSOホールディングス	10.9	11.7	25,353	—	—	—	ナック	6.5	12.8	6,937	—	—	—
キャリアインデックス	4.2	2.3	457	26.7	27.3	68,058	大栄環境	10.9	11.7	25,353	—	—	—	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	—	—	—
MS-Japan	4.1	5.5	6,963	—	15.8	40,416	日本管財ホールディングス	10.9	11.7	25,353	—	—	—	ステッパ	5.8	5.5	11,088	—	—	—
船場	1.5	1.4	1,379	—	7.2	42,840	M&A総研ホールディングス	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ジョビ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	エイチ・アイ・エス	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
フルテック	1.7	1	1,128	—	4.4	6.8	ラックランド	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
グリーンズ	4.2	2.4	4,917	—	24	23.6	共立メンテナンス	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ツナググループ・ホールディングス	3.5	1.9	1,649	—	15	16	イチネンホールディングス	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
GAMEWITH	3.7	2.8	873	—	7.2	7.7	建設技術研究所	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
MS&Consulting	1.4	1	590	—	10	9.8	スペース	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ウエルビー	10.3	7.5	6,382	—	6	14.1	燎ホールディングス	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
エック・ティール・エス	1.9	1.7	4,867	—	0.6	3	スバル興業	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ミダグホールディングス	8.6	9.1	15,388	—	4.6	2.4	東京テアトル	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

合計	株数・金額	159,799.8	226,079	528,947,749
	銘柄数<比率>	2,161銘柄	2,148銘柄	<97.6%>

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	T O P I X	百万円 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 金 額 (C / D)	121,842,817,407円
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	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)	12,596,331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資産分散ファンド	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>	1,630,750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)	1,168,057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)	1,140,141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
AMIOネットアセット・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
日興資産戦略ファンド (インカム重視型) (儲蓄型) (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資産バランス (FOF 5年) (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)	2,592,055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・アセット・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 (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)