

運用報告書 (全体版)

第1期<決算日2017年10月12日>

たわらノーロード TOPIX

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	2017年3月21日から無期限です。	
運用方針	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要投資対象	たわらノーロード TOPIX	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
運用方法	主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内の株式に実質的に投資します。東証株価指数（TOPIX）（配当込み）への運動性を高めるため、有価証券先物取引等を活用する場合があります。マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。	
分配方針	決算日（原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。）に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額を分配対象額とし、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「たわらノーロード TOPIX」は、2017年10月12日に第1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。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

<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。

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 込 み 期 中 分 配 金 騰 落 率			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	株 式 先 物 率	純 資 産 総 額
		円	円	%	ポイント (3月17日)	%			
(設 定 日) 2017年3月21日	10,000	—	—	—	2,233.40	—	—	—	1
1 期 (2017年10月12日)	11,069	0	10.7	10.7	2,471.06	10.6	97.5	2.4	210

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

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

(注5) △ (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	騰 落 率			株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		円	%	騰 落 率		
(設定日) 2017年3月21日	10,000	—	—	—	—	—
3 月末	9,762	△2.4	2,176.87	△2.5	97.6	2.1
4 月末	9,886	△1.1	2,204.51	△1.3	96.0	3.8
5 月末	10,126	1.3	2,257.27	1.1	97.6	2.2
6 月末	10,417	4.2	2,324.06	4.1	97.1	2.8
7 月末	10,459	4.6	2,333.91	4.5	97.5	2.4
8 月末	10,453	4.5	2,332.80	4.5	98.3	1.6
9 月末	10,905	9.1	2,434.16	9.0	97.2	2.7
(期 末) 2017年10月12日	11,069	10.7	2,471.06	10.6	97.5	2.4

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

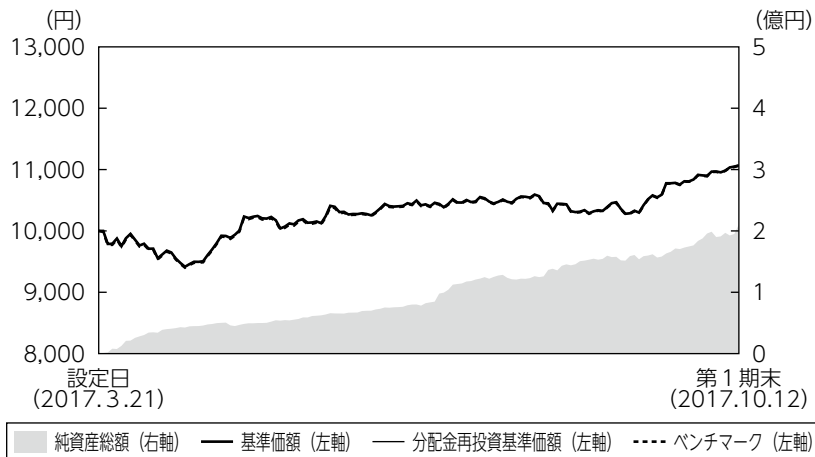
(注2) 騰落率は設定日比です。

(注3) 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4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2017年3月21日から2017年10月12日まで）

基準価額等の推移



設 定 日： 10,000円

第 1 期 末： 11,069円

（既払分配金 0 円）

騰 落 率： 10.7%

（分配金再投資ベース）

（注）設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

（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）基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。

（注4）分配金再投資基準価額およびベンチマークは、設定日前日を10,000として指数化しています。

基準価額の主な変動要因

設定当初には地政学リスクの高まりを受けて下落しましたが、その後は地政学リスクが落ち着くと共に、企業業績の好調さや日銀の緩和的な金融政策の継続、米国株式市場の上昇などを要因として国内株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

設定当初から4月半ばまでは、北朝鮮および中東情勢などの地政学リスクの高まりなどを受けて国内株式市場は下落しました。その後、地政学リスクが後退し、フランス大統領選でマクロン氏が当選したことで欧州政治に対する不透明感が低下したこともあり、5月上旬にかけて上昇しました。それ以降も、企業業績の好調さや日銀の緩和的な金融政策の継続、米国株式市場の上昇などを要因として続伸する展開となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持しました。

●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。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの運用状況】2017年10月12日現在

（注1）比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（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

（単位：％）

No.	業種	比率
1	電気機器	13.1
2	輸送用機器	8.7
3	情報・通信業	7.7
4	銀行業	7.3
5	化学	6.8
6	機械	5.3
7	小売業	4.5
8	食料品	4.4
9	卸売業	4.4
10	医薬品	4.4

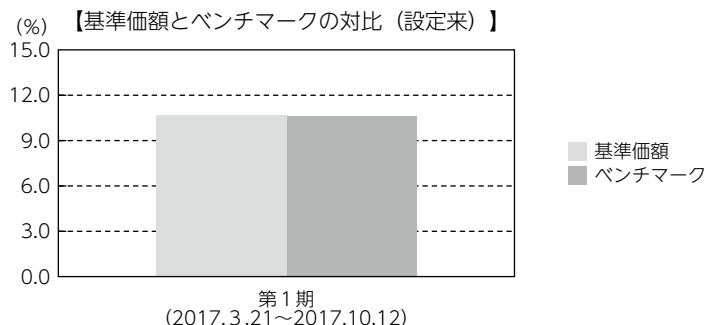
○組入上位10銘柄

（単位：％）

No.	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.3
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.1
3	ソフトバンクグループ	1.7
4	日本電信電話	1.6
5	三井住友フィナンシャルグループ	1.3
6	本田技研工業	1.2
7	ソニー	1.1
8	KDDI	1.1
9	キーエンス	1.1
10	任天堂	1.1

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは設定来で10.6%上昇し、当ファンドはベンチマークを0.05%上回りました。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ましたので、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきました。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
	2017年3月21日 ～2017年10月12日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	1,069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 1 期		項目の概要
	(2017年3月21日 ～2017年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	11円	0.110%	(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10,291円です。
(投信会社)	(5)	(0.049)	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)	(5)	(0.049)	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
(受託銀行)	(1)	(0.012)	受託銀行分は、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)	(0.001)	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)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用
合計	12	0.112	

(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。

■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況（2017年3月21日から2017年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 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	千口 106,988	千円 256,640	千口 24,854	千円 60,349

■ 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	16,513,328千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	285,719,409千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.05

(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**（2017年3月21日から2017年10月12日まで）
【たわらノーロード TOPIXにおける利害関係人との取引状況等】
期中の利害関係人との取引等はありません。

【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) 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 －	百万円 142
		当 期 末 保 有 額 百万円 3,249

(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	売 付 額
株 式		百万円 443

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、オリエントコーポレーションです。

■**自社による当ファンドの設定・解約状況**

期首残高 (元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高 (元本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 －	百万円 1	百万円 －	当初設定時又は当初運用時における取得とその処分

■**組入資産の明細**
親投資信託残高

	当 期 末	
	□ 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□ 82,133	千円 210,599

■投資信託財産の構成

2017年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	210,599	95.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,174	4.2
投 資 信 託 財 産 総 額	219,774	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

(2017年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	219,774,107円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,174,880
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)	210,599,227
(B) 負 債	9,000,903
未 払 解 約 金	8,979,006
未 払 信 託 報 酬	21,665
そ の 他 未 払 費 用	232
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	210,773,204
元 本	190,416,259
次 期 繰 越 損 益 金	20,356,945
(D) 受 益 権 総 口 数	190,416,259口
1 万口当たり基準価額(C／D)	11,069円

(注) 設定当初の投資元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は325,646,539円、同解約元本額は136,230,280円です。

■損益の状況

当期 自2017年3月21日 至2017年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△860円
受 取 利 息	462
支 払 利 息	△1,322
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	10,597,246
売 買 益	14,067,914
売 買 損	△3,470,668
(C) 信 託 報 酬 等	△107,590
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	10,488,796
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,868,149
(配 当 等 相 当 額)	(△2,106)
(売 買 損 益 相 当 額)	(9,870,255)
(F) 合 計(D＋E)	20,356,945
次 期 繰 越 損 益 金(F)	20,356,945
追 加 信 託 差 損 益 金	9,868,149
(配 当 等 相 当 額)	(636,877)
(売 買 損 益 相 当 額)	(9,231,272)
分 配 準 備 積 立 金	10,488,796

(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) (E)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	1,823,116円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	8,665,680
(c) 収 益 調 整 金	9,868,149
(d) 分 配 準 備 積 立 金	0
(e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	20,356,945
(f) 1 万口当たり当期分配対象額	1,069.08
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきました。

《お知らせ》

■当ファンドおよび当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

（平成29年9月29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15期（決算日 2017年2月7日）

（計算期間 2016年2月9日～2017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15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	(配当込み) ベンチマーク	期 騰 落 率			
11期（2013年2月7日）	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
	13,243	28.4	1,274.81	28.4	99.3	0.7	303,106
12期（2014年2月7日）	16,556	25.0	1,594.55	25.1	96.5	3.6	312,225
13期（2015年2月9日）	20,237	22.2	1,949.47	22.3	99.0	0.9	324,677
14期（2016年2月8日）	19,981	△1.3	1,925.17	△1.2	98.2	1.7	286,897
15期（2017年2月7日）	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3	284,249

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

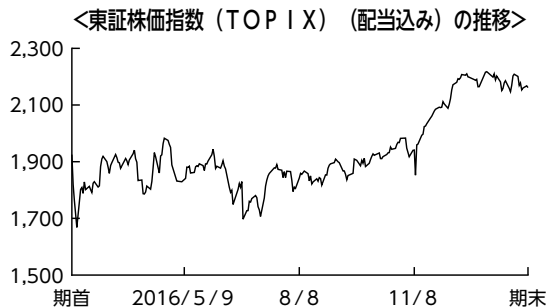
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
		騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2016年 2 月 8 日	円	%	ポイント	%	%	%
	19,981	－	1,925.17	－	98.2	1.7
2 月 末	18,788	△6.0	1,810.63	△5.9	96.6	3.5
3 月 末	19,692	△1.4	1,898.02	△1.4	96.9	3.1
4 月 末	19,592	△1.9	1,888.68	△1.9	98.5	1.5
5 月 末	20,175	1.0	1,944.06	1.0	97.0	3.0
6 月 末	18,243	△8.7	1,757.69	△8.7	97.6	2.5
7 月 末	19,372	△3.0	1,866.36	△3.1	97.9	2.1
8 月 末	19,476	△2.5	1,876.60	△2.5	98.7	1.2
9 月 末	19,537	△2.2	1,883.03	△2.2	97.0	2.9
10 月 末	20,576	3.0	1,983.08	3.0	96.2	3.8
11 月 末	21,710	8.7	2,091.95	8.7	97.6	2.3
12 月 末	22,463	12.4	2,164.57	12.4	96.9	3.1
2017年 1 月 末	22,509	12.7	2,169.23	12.7	96.3	3.6
(期 末) 2017年 2 月 7 日	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2016年2月9日から2017年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は22,429円となり、前期末に比べ12.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

欧州、中国、日本での金融緩和、トランプ米国新大統領の政策への期待や、為替市場で主要通貨に対して円安が進行したことなどから国内株式市場が上昇し、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2016年7月末までは、英国のEU（欧州連合）離脱の決定や各国の金融政策などを材料に一進一退の相場展開となりました。8、9月は小幅な値動きとなりましたが、10月には米国の経済指標が好調であったことや円安進行などを要因として上昇しました。その後、米国大統領選挙への不透明感の高まりから急落する場面もありましたが、トランプ氏の勝利が決まると政策への期待から米国株式市場が上昇すると共に円安が進行し、国内株式市場も上昇しました。

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）の構成銘柄に投資し、組入比率を期を通じて高位に維持しました。

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	比率
1	電気機器	10.8%
2	輸送用機器	10.0
3	情報・通信業	8.1
4	銀行業	7.4
5	化学	6.0
6	医薬品	5.7
7	食料品	5.1
8	小売業	4.9
9	陸運業	4.8
10	機械	4.3



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	12.3%
2	輸送用機器	9.1
3	銀行業	8.4
4	情報・通信業	7.8
5	化学	6.6
6	機械	5.0
7	医薬品	4.6
8	小売業	4.5
9	卸売業	4.4
10	食料品	4.3

○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	3.9%
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	日本・円	2.1
3	日本電信電話	日本・円	1.9
4	KDDI	日本・円	1.5
5	日本たばこ産業	日本・円	1.5
6	ソフトバンクグループ	日本・円	1.4
7	本田技研工業	日本・円	1.4
8	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.3
9	みずほフィナンシャルグループ	日本・円	1.2
10	武田薬品工業	日本・円	1.2
組入銘柄数		1,928銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.4%
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	日本・円	2.5
3	日本電信電話	日本・円	1.7
4	ソフトバンクグループ	日本・円	1.7
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.6
6	本田技研工業	日本・円	1.4
7	KDDI	日本・円	1.3
8	みずほフィナンシャルグループ	日本・円	1.2
9	ソニー	日本・円	1.1
10	日本たばこ産業	日本・円	1.0
組入銘柄数		1,968銘柄	

（注）組入比率は純資産総額に対する割合です。

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12.3%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマーク比△0.0%とベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.002% (0.000) (0.002)
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)
合計	0	0.002

(注) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(20,058円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については5ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2016年2月9日から2017年2月7日まで)

(1) 株 式

			買 付		売 付	
			株 数	金 額	株 数	金 額
			千株	千円	千株	千円
国 内	上 場		21,602.4 (△16,344.877)	25,493,337 (-)	44,271.978	57,645,755

(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 95,610	百万円 94,983	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	83,139,092千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	276,464,062千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.30

(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（2016年2月9日から2017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					
	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 25,493	百万円 －	% －	百万円 57,645	百万円 14	% 0.0

(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 －	百万円 603	百万円 3,583

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、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)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	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	31.6	28.7	14,522	昭和産業	64	58	34,220
極洋	67	5.7	15,566	大東建設	57.8	51.7	806,261	鳥越製粉	12.6	11.6	8,966
日本水産	178.2	182.8	107,669	新日本建設	18.4	16.8	15,103	中部飼料	14.4	15.5	16,740
マルハニチロ	31.6	26.7	90,246	N I P P O	36	33	70,191	フィード・ワン	93.7	85.7	14,826
カネコ種苗	—	4.9	7,119	東亜道路工業	29	27	9,045	東洋精糖	25	23	2,645
サカタのタネ	22.8	20.8	65,312	前田道路	48	44	83,424	日本甜菜製糖	80	7.3	17,228
ホクト	15.8	14.4	30,686	日本道路	46	42	19,194	三井製糖	61	10	25,360
ホクリヨウ	—	1.6	1,176	東亜建設工業	135	11.4	20,588	塩水港精糖	17.2	16.3	4,075
鉱業 (0.3%)				若菜建設	90	82	12,300	日新製糖	2.2	6	10,176
住石ホールディングス	45.9	39.8	3,860	東洋建設	48.7	40.5	16,281	森永製菓	139	27.5	133,100
日鉄鉱業	43	3.9	23,049	五洋建設	171.7	156.2	85,285	中村屋	35	3.4	17,204
三井松島産業	102	8.7	13,093	大林道路	18	14.6	9,796	江崎グリコ	35.7	35.2	180,928
国際石油開発帝石	814.8	740.9	796,097	世紀東急工業	24.4	20.4	10,036	名糖産業	7.1	6.3	8,712
日本海洋掘削	4.6	4.9	11,216	福田組	25	23	25,415	不二家	90	81	18,144
石油資源開発	24.5	22.2	54,345	住友林業	106.5	96.7	151,045	山崎製パン	113	103.1	232,387
K&Oエナジーグループ	10.4	9.5	16,767	日本基礎技術	17.2	15.8	5,545	第一屋製パン	26	23	2,967
建設業 (2.9%)				日成ビルド工業	43	42	23,940	モロゾフ	24	22	11,176
ジョーパンドールディングス	16.3	13.6	65,416	ヤマダ・エスバイエルホーム	80	74	5,846	亀田製菓	8.6	7.9	39,579
ミライト・ホールディングス	47.6	43.3	47,067	巴コーポレーション	19.7	17.6	6,248	寿スブリッツ	3.7	10.1	26,704
タマホーム	12	10.8	5,875	パナホーム	58	53	50,774	カルビー	57.3	57.4	207,501
サンヨーホームズ	3.4	3.2	2,096	大和ハウス工業	456.9	415.4	1,259,908	森永乳業	139	126	99,666
インベスターズクラウド	—	1.3	4,946	ライト工業	29.8	27.1	32,547	六甲バター	6.9	6.3	15,176
ダイセキ環境ソリューション	3.6	3.3	5,448	積水ハウス	517.1	442.4	796,762	ヤクルト本社	83	75.5	471,875
安藤・間	103.2	101.1	80,576	日特建設	17.2	12.2	5,502	明治ホールディングス	91.6	83.3	728,042
東急建設	50.3	49.9	44,161	北陸電気工事	5.7	6.9	5,940	雪印メグミルク	36.4	30.4	90,956
コムシホールディングス	66.5	55	110,825	ユアテック	24	22	17,820	プリマハム	98	89	38,804
ミサワホーム	18.3	16.6	17,546	西部電気工業	12	2.4	5,299	日本ハム	114	95	289,750
ピーアールホールディングス	—	13.2	3,907	四電工	6	6	2,502	伊藤ハム	74	—	—
高松コンストラクショングループ	11.7	10.6	27,273	中電工	22.4	17.7	41,435	林業産業	50	4.7	4,089
東建コーポレーション	6.4	5.2	41,340	関電工	62	56	52,864	丸大食品	80	68	32,844
ヤマウラ	7.2	6.9	4,167	きんでん	93.6	93.6	136,749	米久	5	—	—
大成建設	803	715	572,000	東京エネシス	18	15	14,550	S Foods	9.7	7.6	23,674
大林組	463.9	421.8	454,278	トーエネック	22	20	11,060	伊藤ハム米久ホールディングス	—	81.3	86,584
清水建設	473	430	442,470	住友電設	12.3	9.7	12,095	サッポロホールディングス	237	46.1	134,197
飛鳥建設	117.3	135.5	24,119	日本電設工業	25.2	22.9	46,532	アサヒグループホールディングス	290.2	263.9	1,031,849
長谷工コーポレーション	180.5	164.1	202,663	協和エクシオ	60.7	55.1	86,562	キリンホールディングス	626.9	605.7	1,113,882
松井建設	17.1	15.5	16,523	新日本空調	13.2	10.9	14,660	宝ホールディングス	112.1	102	107,508
銭高組	22	20	9,560	ND S	25	2.2	6,318	オエノホールディングス	44	37	10,027
鹿島建設	725	618	480,804	九電工	28	27.3	76,412	養命酒製造	4.9	4.5	8,343
不動産トラ	109.6	113.8	23,670	三機工業	34.4	31.2	29,702	コカ・コーラウエスト	52.4	47.7	150,016
大末建設	5.8	5.1	4,962	日揮	155	131.2	249,017	コカ・コーライストジャパン	54.8	54.8	128,122
鉄建建設	94	85	28,475	中外炉工業	47	43	9,761	サントリー食品インターナショナル	106	96.4	455,008
西松建設	179	162	91,530	ヤマト	14.1	12.9	6,785	ダイドールグループホールディングス	7.9	6.5	36,075
三井住友建設	592.5	538.3	67,287	太平電業	23	19	20,634	伊藤園	45.9	41.8	155,287
大豊建設	60	51	26,265	高砂熱学工業	46.2	38.7	59,559	キーコーヒー	13.7	12.5	26,087
前田建設工業	95	87	85,521	三晃金属工業	16	1.3	4,127	ユニカフェ	4.5	4.2	4,044
佐田建設	10.7	9.8	4,135	朝日工業社	16	3.2	9,337	ジャパンフーズ	2.6	2.1	2,786
ナノフドー建設	11.8	10.8	5,907	明星工業	28.3	25.6	15,641	日清オイリオグループ	82	81	43,821
奥村組	147	115	80,615	大気社	19	18.6	52,154	不二製油グループ本社	41.3	37.6	83,848
東鉄工業	18.6	16.9	55,516	ダイダン	20	19	17,898	Jーオイルミルズ	65	6.6	26,235
イチケン	17	13	6,058	日比谷総合設備	18.7	15.7	26,046	キッコーマン	117	98	327,810
浅沼組	50	45	16,020	東芝プラントシステム	25.1	22.8	36,890	味の素	331	289.8	663,207
戸田建設	180	163	103,668	OS J Bホールディングス	31.8	43.3	10,521	キューピー	78.7	71.6	204,489
熊谷組	226	221	71,162	東洋エンジニアリング	83	83	25,232	ハウス食品グループ本社	52.9	52.1	125,821
青木あすなろ建設	10.3	9.2	7,323	千代田化工建設	112	101	74,538	カゴメ	55.6	50.6	147,549
北野建設	33	29	9,048	新興プランテック	31.8	28.8	25,344	焼津水産化学工業	7.8	7	8,176
植木組	19	18	4,590	食料品 (4.4%)				アリアケジャパン	12.7	11.5	66,815
三井ホーム	20	18	9,990	日本製粉	102	41.9	67,081	ピエトロ	1.4	1.7	2,776
矢作建設工業	21.1	19.2	21,043	日清製粉グループ本社	169.6	154.3	255,520	エバラ食品工業	3.9	3.6	7,426
ピーエス三菱	18.6	14.9	5,602	日東富士製粉	8	0.8	3,096	ニチレイ	165	69.3	162,508

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
東洋水産	千株	千株	千円	大王製紙	千株	千株	千円	リケンテクノス	千株	千株	千円
イトアンド	76.1	69.2	274,032	トンゴ	64	52.5	66,990	大倉工業	23.5	28.4	15,194
日清食品ホールディングス	1.7	1.7	3,762	レーモク	128	127	83,439	積水化成工業	35	32	17,440
永谷園ホールディングス	65.5	55	325,050	ザ・バック	46	42	13,734	群衆化学工業	37	18.2	14,705
一正蒲鉾	7	7	9,835	化学 (6.7%)	10.2	9.3	27,481	ダイキアクシス	39	3.1	10,710
フジッコ	5.5	5	5,685	旭化成	228.2	221.2	393,957	ミライアル	7.2	6.5	5,499
ロック・フィールド	15	13.7	33,181	昭和電工	902	820	862,640	日本精化	5.3	5	4,675
日本たばこ産業	8.1	14.7	24,034	住友化学	7.7	6.899	592,416	日華化学	2.7	2.2	2,600
ケンコーマヨネーズ	914.4	779.5	2,831,144	住友精化	9.5	5.5	25,520	扶桑化学工業	18.6	23.1	33,518
わらべや日洋ホールディングス	5.1	5	13,895	日産化学工業	963	87.5	162,662	ADEKA	94	85	128,010
なとり	8.3	8.3	20,260	ラサ工業	1,064	968	592,416	日本塗料	13.6	12.3	6,961
北の達人コーポレーション	7.8	7.2	12,780	クレハ	28	—	—	日本ペイントホールディングス	12	11	9,933
ユーグレナ	2.1	3.1	1,751	多木化学	30	5.5	25,520	関西ペイント	9.1	9.4	26,705
ミヨシ油脂	52.2	45.3	53,454	テイカ	86.9	72	269,640	第一工業製薬	71.1	56.5	89,496
理研ビタミン	54	50	6,950	石原産業	55	51	7,191	日華化学	110	106	123,596
繊維製品 (0.7%)	4.6	4.2	17,871	倉庫コプアグリ	109	9.9	46,678	三洋化成工業	22.4	21.6	3,348
片倉工業	18.2	16.5	21,631	日本曹達	8	8	6,736	有機化成薬品工業	12.4	11.3	8,768
グンゼ	117	98	40,866	東ソー	24	20	13,280	大日本塗料	388.9	333.9	1,957,655
東洋紡	573	521	94,301	トクヤマ	260	23.6	21,759	日本ペイントホールディングス	32	29	12,296
ユニチカ	420	361	29,963	セントラル硝子	18	17	4,046	日華化学	—	4.1	4,809
富士紡ホールディングス	70	6.4	20,736	東亜合成	8.5	7.7	7,068	三洋化成工業	45	8.2	40,836
倉敷紡績	148	132	30,492	大阪ソーダ	93	79	42,344	有機化成薬品工業	10	9.4	2,528
シキボウ	89	72	10,872	関東電化工業	390	380	340,860	大日本塗料	83	75	17,400
日本毛織	44	37	32,560	デンカ	240	205	109,470	日本特殊塗料	111.6	101.5	342,562
ダイトウボウ	22	20	1,440	信越化学工業	157	134	69,010	藤倉化成	163.6	138.1	318,458
トーア紡コーポレーション	6.3	5.5	2,997	日本カーバイド工業	90.6	82.2	96,667	神東塗料	11	10	2,130
ダイドーリミテッド	16.6	15	6,570	堺化学工業	62	57	27,645	中国塗料	41	37.7	31,291
帝国繊維	15.1	13.8	21,017	堺化学工業	34	27	29,214	日本特殊塗料	10.1	9.2	16,127
帝人	591	107.4	238,213	堺化学工業	300	272	154,224	藤倉化成	19.8	17.9	11,760
東レ	1,049	954	929,768	日本カーバイド工業	259.3	235.8	2,241,279	太陽ホールディングス	10.6	10.7	49,273
サカイオーベックス	38	3.3	5,850	堺化学工業	49	45	6,795	DIC	579	51.9	184,764
住江織物	36	33	8,910	堺化学工業	59	49	19,747	サカタインクス	29.5	26.8	38,672
日本フェルト	7.8	7.9	4,068	ア・ウォーター	119	108.4	225,363	東洋インキSCホールディングス	143	130	70,850
イチカフ	10	9	2,691	大陽日酸	111.4	101.3	131,791	T&K TOKA	10.5	9.5	9,899
日東製綱	18	1.5	2,857	日本化学工業	54	49	11,711	富士フイルムホールディングス	330.9	260.7	1,108,496
アツギ	118	108	13,500	日本カーバイド工業	73.9	67.1	95,013	資生堂	274.3	249.5	784,927
ダイニツク	28	26	4,992	高圧ガス工業	20	19.5	14,098	ライオン	167	163	332,194
セーレン	36	32.8	45,362	チタン工業	18	16	3,056	高砂香料工業	9.5	8.6	25,972
ソート	—	5	5,785	四国化成工業	20	19	20,862	マンダム	13.5	13.2	69,036
東海染工	22	19	2,698	戸田工業	29	26	7,436	ミルボン	8.5	7.1	35,784
小松精練	22.1	18.6	13,020	ステラ ケミファ	7.4	6.2	21,545	ファンケル	33.6	28	43,484
ワコールホールディングス	86	78	109,200	保土谷化学工業	43	4.6	14,973	コーセー	23.4	21.3	198,090
ホギメディカル	9.1	8.3	55,112	日本触媒	21	20.7	154,215	コタ	4.5	5	6,715
レナウン	38.8	35.7	4,105	大日精化工業	56	54	36,018	シー・ホールディングス	19	17.1	55,062
クラウディア	3.6	3.4	1,812	カナカ	195	177	170,451	シーボン	1.6	1.6	3,995
T S Iホールディングス	64.5	54.1	44,145	三菱瓦斯化学	249	122.5	276,727	ボレー・オルビスホールディングス	14.7	13.4	144,988
三陽商会	81	69	11,592	三井化学	613	597	301,485	ノビアホールディングス	9.1	8.3	33,490
ナイガイ	52	49	3,087	J S R	135.7	132.1	264,596	アジパコシステムジャパン	2.9	2.8	2,685
オノードホールディングス	96	85	70,720	東京応化工業	29	24.6	88,068	エステー	10	9.1	16,316
ルック	26	24	4,224	大阪有機化学工業	10.4	8.7	7,682	アグロ カネショウ	5.7	5.2	6,552
キムラタン	588	566	3,962	三菱ケミカルホールディングス	968.5	885.6	686,251	コニシ	11.3	20.6	26,738
ゴールドウイン	6.1	5.6	31,304	K Hネオケム	—	16.1	21,992	長谷川香料	18.3	16.6	32,702
デサント	32.9	30	35,670	日本合成化学工業	34	—	—	星光PMC	7.9	7.2	8,524
キング	6.9	6.6	2,686	ダイセル	203.3	177.3	241,128	小林製薬	21.9	36.5	189,800
ヤマトインターナショナル	9.2	8.3	3,386	住友ベークライト	135	116	77,836	荒川化学工業	12.4	11.3	21,526
パルプ・紙 (0.2%)				積水化学工業	328.2	298.4	551,443	メック	11.2	10.2	10,710
特種東海製紙	84	7.7	30,877	日本ゼオン	124	111	141,969	日本高純度化学	4.2	3.8	9,473
王子ホールディングス	593	514	258,542	アイカ工業	43.5	42.1	122,679	タカラバイオ	—	28.2	43,907
日本製紙	74.7	58.9	120,803	宇部興産	774	662	168,810	JCU	4.2	4.1	25,502
三菱製紙	221	18.9	14,534	積水樹脂	22.4	20.3	35,991	新田ゼラチン	9.7	8.2	6,100
北越紙工製紙	89.7	73.5	50,200	タキロン	34	28	15,120	OATアグリオ	1.3	1.6	2,121
中越パルプ工業	57	52	12,844	旭有機材	47	42	9,912	デクセリアルズ	32.4	34.4	42,449
巴川製紙所	21	21	4,809	日立化成	71.4	73.1	234,285	アース製薬	10.4	9.5	45,885
				ニチバン	14	13	11,271	イハラケミカル工業	22.2	18.2	18,527

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
北興化学工業	千株	千株	千円	東燃ゼネラル石油	千株	千株	千円	大和工業	千株	千株	千円
大成ラミック	16	13	6,110	ユシロ化学工業	218	214	283,336	東京製鋼	31.9	26.4	86,196
クマイイ化学工業	4.1	3.8	11,666	ビービー・カストロール	7.8	7.1	9,940	大阪製鋼	30	27	12,096
日本農業	29.8	27.2	17,652	富士石油	5.9	5.4	8,974	淀川製鋼所	9.1	8.2	17,400
アキレス	33	30	18,060	MORESCO	33.5	30.6	11,781	東洋鋼板	21.5	18.1	60,635
有沢製作所	120	10.7	17,676	出光興産	4.6	4.5	7,740	丸一鋼管	34.6	31.4	13,219
日東電工	21.3	22	15,796	JXホールディングス	75.5	62.4	219,648	モリ工業	48.4	43.9	165,503
レック	111.7	94.8	877,753	コスモエスジーホールディングス	1,711.4	1,458.2	774,158	大同特殊鋼	21	4.2	10,248
きもと	4.6	4.1	20,356	ゴム製品 (0.9%)	43.6	39.7	74,675	日本高周波鋼業	242	220	123,200
藤森工業	23.9	23.4	5,405	横浜ゴム	87.2	79.3	156,538	日本冶金工業	56	46	3,864
前澤化成工業	12.4	9.8	28,567	東洋ゴム工業	65.4	69.4	90,775	山陽特殊製鋼	106.2	108.8	22,195
JSP	10.3	8.7	10,092	ブリヂストン	487.9	443.6	1,798,354	愛知製鋼	86	78	47,580
エフピコ	9.4	6.1	15,292	住友ゴム工業	135.3	123	216,234	日立金属	85	7.7	36,652
天馬	12.8	11.7	60,138	藤倉ゴム工業	12.2	11.1	7,303	日立金属	165.4	133.7	215,524
信越ポリマー	11.1	8.7	17,373	オカモト	45	40	42,960	日本金属	38	3.2	4,044
東リ	28.4	25.8	21,439	フコク	5.3	5.3	4,807	大平洋金属	101	84	31,584
ニフコ	36	31.5	12,442	ニッタ	15.6	11.8	35,577	新日本電工	81.9	74.4	22,840
日本バルカー工業	27.6	23	127,650	住友理工	31.2	24.3	27,361	栗本鐵工所	69	6.3	15,025
ユニ・チャーム	57	10.1	18,462	三ツ星ベルト	35	32	31,328	虹 技	21	19	4,959
医薬品 (4.8%)	292.7	266.2	687,461	バンドー化学	53	23.8	23,609	日本鋳鉄管	16	14	2,688
協和発酵キリン	173	157.3	252,309	ガラス・土石製品 (1.0%)				三菱製鋼	101	91	22,932
武田薬品工業	575.8	492.9	2,474,850	日東紡績	96	106	51,622	日亜鋼業	18.8	18.4	5,152
アステラス製薬	1,619.1	1,343.1	2,001,890	旭硝子	763	647	538,304	日本精練	10	9	5,589
大日本住友製薬	102.4	93.1	180,055	日本板硝子	696	59.9	48,219	シンニッタン	13.1	10.8	7,506
塩野義製薬	210.7	177.9	997,129	石塚硝子	20	19	4,788	新家工業	30	29	4,756
田辺三菱製薬	168.5	153.2	355,577	日本山村硝子	58	52	11,284	非鉄金属 (1.0%)			
わかもと製薬	7	7	1,813	日本電気硝子	299	271	189,158	大紀アルミニウム工業所	23	22	10,846
あすか製薬	18.4	14.3	25,339	オハラ	5.8	5.2	4,513	日本軽金属ホールディングス	327	320.3	87,441
日本新薬	33.1	30.1	170,366	住友大阪セメント	286	244	111,264	三井金属鉱業	368	357	113,526
ピオフェルミン製薬	2.3	2.2	6,549	太平洋セメント	902	793	320,372	東邦亜鉛	76	74	40,552
中外製薬	144	130.9	481,712	デイ・シー	13.2	-	-	三菱マテリアル	902	82	312,830
科研製薬	24.9	24.5	134,015	日本ヒューム	14	12.7	8,877	住友金属鉱山	399	340	552,840
エーザイ	178	161.8	993,290	日本コンクリート工業	29.8	29.5	9,882	DOWAホールディングス	186	145	131,805
ロート製薬	70.8	64.4	131,054	三谷セキサン	7.3	6.6	17,866	古河機械金属	225	205	47,560
小野薬品工業	65.7	298.6	730,375	アジアパイルホールディングス	17.8	16.3	9,356	エス・サイエンス	65.1	65.1	2,473
久光製薬	44.9	37.1	220,003	東海カーボン	125	122.8	51,207	太極チタニウムテクノロジーズ	14.2	14.4	26,438
持田製薬	10	9	73,890	日本カーボン	71	65	19,630	東邦チタニウム	24.4	22.2	19,624
参天製薬	266.1	237.3	358,323	東洋炭素	8	7.3	13,548	UACJ	20.2	167	50,434
扶桑薬品工業	49	4.5	12,762	リタケカパニ-リミテド	82	7.4	21,326	古河電気工業	454	44.1	175,959
日本ケミファ	18	1.8	9,954	TOTO	106.2	96.6	409,101	住友電気工業	578.5	495	875,902
ツムラ	45.5	44.1	145,530	日本碍子	183	165.9	385,385	フジクラ	201	172.9	141,778
日医工	33.8	30.7	49,703	日本特殊陶業	124.6	113.3	279,511	昭和電線ホールディングス	174	157	14,130
キッセイ薬品工業	25.6	23.3	63,515	ダント-ホールディングス	17	11	2,090	東京特殊電線	1.9	1.9	2,855
生化学工業	27.7	24.4	39,674	MARUWA	5.3	4.8	17,832	タツタ電線	30.3	24.7	11,115
栄研化学	12.1	11	32,153	品川リフラクトリーズ	37	33	9,636	沖電線	17	14	3,388
日水製薬	5.9	5.3	6,868	黒崎播磨	31	28	11,816	カナレ電気	2.3	1.9	4,286
鳥居薬品	9.9	9	24,174	ヨータイ	8	7	2,569	平河ヒューテック	6.8	6.2	7,130
JCRファーマ	11.1	10.1	27,502	イソライト工業	7.1	6.8	2,856	リョービ	88	80	38,640
東和薬品	6.6	6	25,950	東京薬業	17	16	3,152	アーレスティ	16.7	15.2	18,027
富士製薬工業	4.1	4.3	12,022	ニッカト-	5.5	4.8	2,011	アサヒホールディングス	21.8	19.8	39,501
沢井製薬	24.5	22.3	130,232	フジミンコーポレートド	12.7	11.2	28,761	金属製品 (0.7%)			
ゼリア新薬工業	29.6	26.9	48,070	エーアンドエーマテリアル	30	28	3,696	稲葉製作所	7.8	7.1	9,272
第一三共	486.3	386.9	992,205	ニチアス	74	69	80,454	宮地エンジニアリンググループ	45	38	7,980
キョーリン製薬ホールディングス	38.6	32.1	74,311	ニチハ	19.2	17.5	53,112	トーカロ	10.2	8.6	23,426
大幸薬品	7.1	6.6	12,045	鉄鋼 (1.4%)				アルファ	4.9	4.5	5,404
ダイト	6.2	7.4	16,309	新日鐵住金	651.7	592.6	1,629,650	SUMCO	113.1	137.2	239,962
大塚ホールディングス	310.9	282.7	1,482,196	神戸製鋼所	2,655	227.1	231,187	川田テクノロジーズ	2.7	2.5	20,825
大正製薬ホールディングス	34.8	28.1	263,578	中山製鋼所	162	14.7	11,554	東地エンジニアリングホールディングス	102.7	93.3	196,489
ペプチドリ-ム	17.8	24.6	138,990	合同製鐵	81	7.3	13,475	ホッカンホールディングス	35	34	16,626
石油・石炭製品 (0.6%)				ジェイ エフ イー ホールディングス	395	359.2	750,907	コロナ	7.7	6.9	7,941
日本コークス工業	117	107	10,914	日新製鋼	65.9	59.9	92,845	横河ブリッジホールディングス	27.4	23.1	32,432
昭和シェル石油	145.4	117.5	124,315	東京製鐵	79.7	66.5	67,830	駒井ハルテック	26	2.5	5,222
ニチレキ	17.8	16.1	14,763	共英製鋼	15.4	14	31,444	高田機工	12	12	2,796
								三和ホールディングス	146.4	130.4	134,833

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
文化シャッター	千株	千株	千円	SMC	千株	千株	千円	ダイコク電機	千株	千株	千円
三協立山	40.3	36.6	31,073	新川	43.3	39.4	1,216,672	竹内製作所	5.7	5.2	9,027
アルインコ	19	17.2	29,566	ホソカワミクロン	12.9	11	9,042	アマノ	20.5	22.9	52,578
東洋シャッター	8.3	9.1	9,327	ユニオンツール	24	22	17,402	JUKI	42.7	38.9	82,273
LIIXILグループ	3.6	3.4	2,176	オイスエ工業	6.2	5.7	17,727	サンデンホールディングス	20.5	19.8	23,621
日本フィルコン	201.3	183	522,282	日精エー・エス・ビー機械	18.7	16.9	34,492	蛇の目ミシン工業	84	77	26,257
ノーリツ	10.7	9.8	5,576	サトーホールディングス	5.3	4.2	8,950	マックス	13.4	12.2	10,040
長府製作所	28.3	25.7	50,192	日本エアーテック	19.5	16.3	39,527	グローリー	20	19	28,443
リンナイ	15.4	14	35,728	日精樹脂工業	5	4.4	2,882	新晃工業	47.1	40.1	146,766
ダイニチ工業	26.9	22.4	213,920	オカダアイヨン	10.5	10.4	10,660	大和冷機工業	9.6	8.8	12,487
日東精工	7.7	7	5,033	小松製作所	—	2.8	3,063	セガサミーホールディングス	22.2	20.1	19,738
三洋工業	20	19	7,676	住友重機械工業	5.7	5	7,730	日本ビストンリング	148.3	124.5	209,160
岡部	19	17	3,366	日立建機	708.3	606.1	1,679,200	リケン	5.8	4.9	9,868
ジーテクト	30.1	27.3	25,634	巴工業	421	383	301,804	ホシザキ	64	5.8	24,447
中国工業	15.1	13.7	28,290	井関農機	64.6	58.7	152,972	大豊工業	17	14.1	43,498
東プレ	2.5	2.3	1,582	TOWA	19	4	8,592	日本精工	12.8	14.1	26,719
高周波熱錬	27.8	25.3	70,587	丸山製作所	6	5.4	10,222	NTN	30.3	27.5	246,125
東京製鋼	26.9	24.4	22,130	北川鉄工所	148	134	30,150	ジェイテクト	11.1	10.2	15,453
サンコール	98	8.9	17,141	ローツエ	13.9	10.8	17,442	不二越	283.5	257.8	374,067
モリテックスチール	7.8	7.1	3,834	タカキタ	31	28	5,488	日本トムソン	342	290	148,480
パイオラックス	7.5	7.2	2,059	クボタ	66	6	14,754	THK	147.1	133.7	235,846
日本発条	7.3	6.6	46,728	荏原実業	—	4.7	10,039	ユージン精機	128	126	69,426
中央発條	136	123.5	149,311	三菱化工機	3.6	3.6	1,983	前澤給装工業	47	40.1	20,932
アドパネクス	17	15	4,995	月島機械	693.7	628.7	1,145,491	イーグル工業	91.8	88.7	243,570
立川ブラインド工業	2.7	2.3	4,531	帝国電機製作所	4.4	3.7	4,969	前澤工業	5.4	5.6	15,629
三益半導体工業	6.1	5.5	5,043	東京機械製作所	47	43	9,245	キッツ	5.8	4.8	7,272
機械 (5.1%)	10.7	9.7	16,955	新東工業	27.4	24.9	30,278	日立工機	17.1	13.6	20,590
日本ドライケミカル	1.9	1.7	3,933	澁谷工業	10.5	9.6	9,561	マキタ	9.9	9.3	3,329
日本製鋼所	239	43.4	88,058	アイチコーポレーション	54	50	3,800	日立造船	14	12.7	19,989
三浦工業	64.5	53.7	94,512	小森コーポレーション	32.8	29.7	30,056	三菱重工工業	67.2	60.1	39,666
タクマ	53	42.1	40,542	鶴見製作所	12.1	11	25,564	IHI	37	33.6	29,131
ツガミ	42	35	24,115	住友精密工業	20.5	18.6	16,740	スター精密	90	81.8	604,502
オークマ	94	85	97,240	酒井重工業	35.1	31.5	47,880	電気機器 (12.6%)	109.5	99.3	60,175
東芝機械	79	78	37,830	石井鐵工所	10.7	9.8	14,484	日清紡ホールディングス	2,458	2,103	985,045
アマダホールディングス	210.7	176.7	231,477	西島製作所	23	21	7,413	イビデン	1,061	965	309,765
アイデンエンジニアリング	37.9	37.3	40,470	北越工業	28	25	8,425	コニカミノルタ	26.2	22	36,982
滝澤鉄工所	45	39	6,435	ダイキン工業	319	59.5	207,357	ブラザー工業	76.6	69.6	73,010
富士機械製造	47.2	40	57,680	オルガノ	15.4	12.9	14,319	ミネベアミツミ	84.5	87.8	156,371
牧野フライス製作所	72	65	64,805	トーヨーカネツ	15.6	14.1	12,492	日立製作所	344.8	293.8	309,077
オーエスジー	65.8	59.8	139,513	栗田工業	201	171.4	1,927,393	東芝	178.5	162.3	339,856
ダイジェット工業	17	17	2,992	樫本チエイン	25	25	11,975	三菱電機	222	228.345	263,053
旭ダイヤモンド工業	39.6	37.6	31,584	大同工業	77	60	20,580	富士電機	3,522	3,014	2,026,312
DMG森精機	79.7	77.7	116,316	日本コンベヤ	86.8	74.3	198,232	東洋電機製造	2,906	2,808	675,324
ソディック	27.4	33.3	32,867	木村化工機	82	75	65,625	安川電機	1,473	1,338.9	2,153,620
ディスコ	18.4	15.4	249,788	アネスト岩田	27	26	7,098	シフoniaテクノロジー	416	378	252,504
日東工器	8.4	7.6	18,772	ダイフク	48	—	—	明電舎	27	5	8,025
パンチ工業	5.7	4.8	4,512	サムコ	12.4	11.5	3,933	オリジン電気	171.4	145.5	299,002
豊和工業	8.1	7.6	5,190	加藤製作所	23.3	22.8	24,190	山洋電気	90	81	24,300
OKK	56	48	5,952	油研工業	74.2	62.7	156,373	デンヨー	127	115	41,055
石川製作所	35	3.5	2,712	タダノ	2.3	3.3	3,461	東芝テック	20	18	5,544
東洋機械金属	10.8	8.9	5,037	フジテック	33	6.9	20,734	芝浦メカトロニクス	36	33	27,258
津田駒工業	36	30	5,400	CKD	27	24	5,256	マブチモーター	12.7	11.6	18,815
エンシュウ	35	34	3,366	キトー	67	65.6	92,889	日本電産	99	79	48,980
島精機製作所	20.4	17.1	63,954	平和	40.2	36.5	47,815	ユエ・エム・シー・エレクトロニクス	22	21	5,796
NCホールディングス	—	4.4	4,078	理想科学工業	38.4	37.6	55,460	ダブル・スコープ	39.5	35.4	203,196
フリュー	2.1	2.6	12,805	SANKYO	17.4	15.8	19,102	宮越ホールディングス	166.1	162.7	1,692,893
ヤマシンフィルタ	—	2.6	4,381	日本金銭機械	42.8	38.9	104,835	ダイヘン	—	1.5	4,426
日阪製作所	18.3	17.8	16,465	マースエンジニアリング	15.3	12.5	25,087	田淵電機	7.7	6.4	14,144
やまびこ	26.5	24.1	37,282	福島工業	38.4	34.8	135,894	ヤーマン	4.1	12.1	22,203
ベガススミシン製造	14.9	12.7	10,045	オーイズミ	12.7	11.6	17,272		4.6	4.5	2,205
ナプテスコ	75.1	68.3	199,777		7.9	7.1	16,067		81	69	48,507
三井海洋開発	16.9	13.2	24,129		8.5	7.8	27,300		15.6	19.1	7,640
レオン自動機	12.2	11.1	12,087		5.8	5.5	3,756		1.8	1.6	9,856

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
JVCケンウッド	千株	千株	千円	エニデンホールディングス	千株	千株	千円	日本ケミコン	千株	千株	千円
ミマキエンジニアリング	101.2	92.2	28,028	アルパイン	43	37	6,105	KOA	112	108	31,320
第一精工	9.3	11.3	7,537	スミダコーポレーション	32.9	29.9	51,099	市光工業	19.1	17.4	22,515
日新電機	5.7	5.9	7,782	アイコム	11.3	10.3	12,638	小糸製作所	33	26	10,712
大崎電気工業	32.3	25.2	33,339	リオン	7.7	6.9	15,366	ミツバ	82.7	75.2	435,408
オムロン	25	25	26,950	本多通信工業	5.3	4.9	7,663	SCREENホールディングス	23.4	23.1	43,797
日東工業	158.4	133.4	644,989	船井電機	—	3.6	4,359	キャノン電子	141	25.7	181,185
IDEC	22.1	18.4	27,857	横河電機	13.9	13.8	12,268	リコー	12.7	11.4	19,813
不二電機工業	18.1	16.4	18,351	新電元工業	138.2	136.1	242,121	MUTOHホールディングス	743.2	675.7	2,197,376
ジェエス・ユアサ コーポレーション	1.5	1.4	1,972	アズビル	49	48	20,352	東京エレクトロン	447.1	377.3	361,453
サクサホールディングス	266	242	113,498	東亜ディーケーケー	45.1	38	135,280	輪送用機器 (9.4%)	17	16	4,112
メルコホールディングス	35	32	7,200	日本光電工業	5.8	6.4	3,475	トヨタ紡織	123.9	83.7	944,973
テクノメディカ	7.6	7	22,785	チノー	57.7	52.5	123,270	戸森工業	48.2	43.9	101,935
日本電気	3	2.9	6,072	共和電業	5.1	4.6	5,524	鬼怒川ゴム工業	31	29	4,611
富士通	1,898	1,725	457,125	日本電子材料	17	14.4	5,788	ユニプレス	32	—	—
沖電気工業	1,331	1,210	819,533	堀場製作所	5.5	5.1	3,320	豊田自動織機	28.6	24.2	54,909
岩崎通信機	598	54.3	84,002	アドバンテスト	25.5	24.9	145,416	モリタホールディングス	125.7	114.3	595,503
電気興業	66	56	4,872	小野測器	94.1	85.6	173,254	三機工業	24.2	22	34,980
サンケン電気	36	36	20,412	エスベック	6.7	6.3	5,455	デンソー	17.6	16.1	13,862
ナカヨ	75	73	36,062	パソニック デバイスSUNX	14.3	11.1	14,074	東海理化電機製作所	341	309.5	1,506,336
アイホン	13	13	5,408	キーエンス	12.1	11.1	8,880	三井造船	40.4	33	69,696
ルネサスエレクトロニクス	7.8	7.2	13,082	日置電機	31.3	56.9	2,496,772	川崎重工業	534	453	81,993
セイコーエプソン	71.5	65.1	64,644	シスメックス	7.2	6.6	14,335	名村造船所	1,074	977	342,927
ワコム	205.5	186.9	452,111	日本マイクロニクス	107.1	97.5	603,525	サノリスホールディングス	41.4	37.6	29,102
アルバック	108.7	97.5	33,150	メガチップス	18	23.4	21,902	日本車輻製造	17.3	15.3	4,406
アクセル	25.4	21.2	84,058	OBARA GROUP	14.4	11.7	33,731	ニチ三菱フォークリフト	57	46	12,834
EIZO	6.5	5.3	4,319	澤藤電機	8.9	7.3	37,960	近畿車輛	16.1	14.5	9,961
ジャパンディスプレイ	13.7	12.4	39,866	コーセル	8	8	1,768	日産自動車	20	1.9	4,839
日本信号	257.7	234.5	75,509	イリソ電子工業	19.2	17.4	22,828	いすゞ自動車	1,937.7	1,480.3	1,662,376
京三製作所	38.1	34.6	36,779	新日本無線	—	4	26,720	トヨタ自動車	400	363.7	533,184
能美防災	32	29	11,339	オプテックスグループ	10	9.9	4,068	日野自動車	1,716.9	1,526	9,683,996
ホーチキ	15.7	14.2	23,671	千代田インテグレ	10.2	9.5	26,942	三菱自動車工業	197	179.1	226,382
エレコム	10	9.1	12,594	アイ・オー・データ機器	7.3	6.6	15,826	エフテック	548.2	460.1	307,806
日本無線	11.9	10.9	21,015	レーザーテック	—	4	5,004	レシップホールディングス	7.3	6.7	9,011
パナソニック	35	7.7	10,741	スタンレー電気	16.1	13.8	36,887	GMB	4.7	4.3	3,848
シャープ	1,577.2	1,434	1,685,667	岩崎電機	99.1	89.5	272,527	ファルテック	2.2	2.1	2,633
アンリツ	1,167	—	—	岡谷電機産業	47	46	8,188	武蔵精密工業	2.5	2.3	3,180
富士通ゼネラル	82.9	91.4	74,034	ヘリオス テクノ ホールディング	83.8	76.2	109,575	日産車体	14.7	14.6	44,019
日立国際電気	42	43	90,730	遠藤照明	7.8	7	2,863	新明和工業	67.4	55.1	58,406
ソニー	32	32.9	81,822	日本デジタル研究所	11.8	11.8	6,844	極東開発工業	60	51	59,874
TDK	974	886.2	3,189,433	古河電池	7.9	10.3	21,207	日信工業	27.5	25	42,375
帝国通信工業	83.3	70.7	534,492	双信電機	7	6.4	5,952	トピー工業	30.9	28	53,788
ミツミ電機	33	27	4,752	山一電機	11.7	—	—	ティラド	114	10.3	33,629
タムラ製作所	52.5	—	—	図研	10	9	6,669	曙ブレーキ工業	54	49	14,455
アルプス電気	53	48	21,936	日本電子	6.9	6.5	1,904	タチエス	70	58.5	15,561
池上通信機	117.1	115.9	359,869	カシオ計算機	11.9	11.8	14,219	NOK	21.9	21.3	38,616
パイオニア	44	40	5,920	ファナック	54	46	25,576	フタバ産業	66.8	60.7	148,715
日本電波工業	223.3	188.7	46,986	日本シイエムケイ	101	149,783	2,745,224	KYB	42.1	38.3	26,771
鈴木	12.6	12.2	10,321	エンブラス	141.2	127.3	17,886	シロキ工業	155	140	75,320
日本トリム	4	3.1	12,152	大真空	29.6	27.1	17,886	大同メタル工業	34	—	—
ローランド ディー・ジー	3.7	6.4	21,472	ローム	7	5.7	18,867	プレス工業	19.3	15.8	16,274
フォスター電機	6.8	14.7	25,563	浜松ホトニクス	26	4.6	6,297	ミクニ	73.3	66.6	34,099
クラリオン	17.3	66	28,380	三井ハイテック	68	60.7	453,429	河西工業	13.2	16	6,272
SMK	73	32	13,088	新光電気工業	107.7	97.9	310,343	カルソニックカンセイ	105	85	153,425
ヨコオ	41	9	9,639	京セラ	20	16.6	14,110	太平洋工業	30.7	25.8	36,403
東光	9.7	—	—	太陽誘電	52.1	47.4	34,696	ケーヒン	31.7	28.8	52,012
ティアック	28	92	4,140	村田製作所	226.6	206	1,243,622	今仙電機製作所	16.9	16.7	21,309
ヒロセ電機	99	38.1	38,442	ユーション	67.1	61	84,851	本田技研工業	138.9	114.8	614,180
日本航空電子工業	22.3	20.3	294,553	双葉電子工業	144.8	131.7	2,026,204	富士機工	16	12.5	6,225
TOA	40	36	52,380	北陸電気工業	18.3	16.8	14,044	マツダ	437.1	397.4	618,354
日立マクセル	16.3	14.8	15,110	ニチコン	23.6	20.5	39,954	ダイハツ工業	164.7	—	—
古野電気	22.8	18.7	41,532		55	51	7,038		12.7	11.5	11,396
	16.5	16.2	11,971		43.5	39.5	37,367		1,242.3	1,129.5	3,999,559

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	千 円		株 数	株 数	評 価 額	千 円		株 数	株 数	評 価 額	千 円
スズキ	288.6	248.8	1,094,720		トッパン・フォームズ	24.7	22.4	24,147		相鉄ホールディングス	237	201	112,962	
富士重工業	436.2	389.7	1,687,011		フジシールインターナショナル	16.8	28.2	65,959		東京急行電鉄	804	682	551,738	
安永	4.3	4.3	7,095		タカラトミー	45.4	48.9	57,946		京浜急行電鉄	378	344	437,224	
ヤマハ発動機	195	177.3	411,867		廣済堂	12.9	12.7	5,308		小田急電鉄	442	201.1	440,610	
ショーワ	35.8	32.7	30,639		アーク	58.3	53.5	5,992		京王電鉄	386	351	306,072	
T B K	16.5	16.3	8,003		タカノ	6	5.7	5,175		京成電鉄	207	94.1	243,624	
エクセディ	18.8	17	52,530		プロネクサス	12.9	11.8	14,879		富士急行	38	34	35,394	
豊田合成	50.2	40.5	109,309		ホクシン	11.9	9.7	2,114		新京成電鉄	18	16	6,560	
愛三工業	24.2	22	20,328		ウッドワン	23	22	6,226		東日本旅客鉄道	252.4	242.8	2,426,786	
盟和産業	1.7	1.8	2,163		大建工業	54	8.9	18,707		西日本旅客鉄道	132.9	120.8	864,807	
ヨロズ	12.9	11.7	18,170		凸版印刷	390	354	386,922		東海旅客鉄道	123.6	104.4	1,878,678	
エフ・シー・シー	22.6	20.5	43,603		大日本印刷	408	362	414,852		西武ホールディングス	110	173.3	315,579	
シマノ	55.6	50.6	873,356		図書印刷	26	17	7,854		鴻池運輸	19.5	17.7	25,452	
タカタ	24.9	22.7	10,555		共同印刷	47	39	15,639		西日本鉄道	179	151	72,329	
ティ・エス テック	32.1	29.1	80,112		日本写真印刷	23.2	21.1	64,249		ハマキョウレックス	10.6	8.2	16,547	
ジャムコ	6	7.4	18,181		光村印刷	3	3	795		サカイ引越センター	5.4	4.3	12,964	
精密機器 (1.5%)					宝印刷	7	6.2	9,262		近鉄グループホールディングス	1,390	1,263	532,986	
テルモ	211.6	192.4	782,106		アックス	128.6	124.7	256,009		阪急阪神ホールディングス	927	158.5	590,412	
クリエートメディック	4.9	4.4	4,136		ツツミ	6.9	4.7	9,033		南海電気鉄道	310	265	143,100	
日機装	51.6	43.4	45,309		小松ウオール工業	4.7	4.3	8,346		京阪ホールディングス	309	281	207,659	
島津製作所	178	161.5	306,850		ヤマハ	101.5	84.6	248,639		神戸電鉄	33	31	11,687	
J M S	24	23	7,406		河合楽器製作所	5.2	5	10,585		名古屋鉄道	503	457	247,694	
クボテック	3	2.8	1,590		クリナップ	16.3	14.8	12,165		山陽電気鉄道	47	46	27,876	
モリテックス	3	—	—		ビジョン	78.2	75.9	231,874		日本通運	534	485	281,785	
長野計器	8.9	8.5	5,848		兼松サステック	14	14	2,870		ヤマトホールディングス	255.1	224.4	505,685	
アイ・テクノロジ	3.3	2.5	46,275		キングジム	11.6	10.6	8,935		山九	182	165	114,180	
東京計器	44	43	10,621		リンテック	32.8	29.8	74,410		丸連	8.6	7.1	1,789	
愛知時計電機	18	1.7	6,392		T A S A K I	2.6	2.7	4,147		丸全昭和運輸	45	42	18,900	
オーバル	13.7	12.5	3,687		イトーキ	29.1	26.5	18,868		センコー	62	56.4	41,115	
東京精密	26.6	24.2	90,871		任天堂	85	77.3	1,795,679		トナミホールディングス	28	26	9,516	
マニ	12.6	16.7	45,006		三菱鉛筆	10.3	10.3	60,667		ニッコンホールディングス	45.2	42.5	96,857	
ニコン	257.8	218.7	394,534		タカラスタンダード	57	25.9	46,153		日本石油輸送	17	1.4	3,432	
トプコン	46.3	63.2	120,838		コクヨ	71.8	65.2	87,107		福山通運	84	76	48,640	
オリンパス	205.6	200.3	778,165		ナカバヤシ	28	23	6,164		セイノーホールディングス	97.9	88.9	112,280	
理研計器	11.2	11	18,106		グローブライド	6.7	6.2	11,215		神奈川中央交通	16	15	10,725	
タムロン	11.1	11.1	22,488		岡村製作所	48.2	43.9	44,646		日立物流	28.7	26.1	57,263	
HOYA	321.2	258.2	1,259,757		美津濃	74	68	40,120		丸和運輸機関	3.1	3.2	8,137	
ノーリツ銅機	12.6	12.3	12,546		アデランス	23.9	—	—		C&Fホールディングス	13.2	13.1	16,427	
エー・アンド・ディ	12.6	11.6	5,521		電気・ガス業 (1.8%)					九州旅客鉄道	—	93.5	289,382	
シチズン時計	170	137.2	96,451		東京電力ホールディングス	1,170.9	1,064.8	450,410		海運業 (0.2%)				
リズム時計工業	61	51	9,231		中部電力	422.4	413.5	620,250		日本郵船	1,239	1,060	246,980	
大研医器	10.9	10.8	8,596		関西電力	563.3	512.3	613,991		商船三井	672	658	225,694	
メニコン	6.9	8.6	28,208		中国電力	190.8	173.4	214,149		川崎汽船	604	476	132,804	
松風	6.8	6.6	8,857		北陸電力	135.2	122.8	139,623		N Sユナイテッド海運	62	56	11,928	
セイコーホールディングス	89	89	35,867		東北電力	344.9	313.5	435,451		明治海運	12.3	11.4	4,788	
ニプロ	102.9	86.8	107,198		四国電力	124.3	113	121,249		飯野海運	71.5	64.9	30,438	
その他製品 (1.7%)					九州電力	304.8	277.3	336,364		共栄タンカー	12	11	2,508	
スノーピーク	1.1	1.6	4,587		北海道電力	129.2	117.5	94,822		乾汽船	10.9	9.2	8,638	
パワースタンドベッドホールディングス	14.6	12	53,040		沖縄電力	14.7	18.5	48,211		空運業 (0.6%)				
トラネザクション	2.2	2.8	5,465		電源開発	117.7	99.8	272,454		日本航空	264.3	226.1	797,002	
S H O - B I	5	5	2,075		エフオン	—	5.3	5,172		ANAホールディングス	2,563	2,330	774,958	
ニホンフラッシュ	4	5.3	6,640		イーレックス	2.6	5.3	17,702		バスコ	13	12	5,124	
前田工織	15.2	12.6	16,329		東京瓦斯	1,541	1,346	670,711		倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
永大産業	19	16	8,080		大阪瓦斯	1,429	1,218	525,079		トランコム	4	3.6	19,440	
アートネイチャー	11.1	13.4	10,036		東邦瓦斯	348	316	257,856		日新	57	51	16,932	
ダンロップスポーツ	8.8	8	8,200		北海道瓦斯	34	31	8,556		三菱倉庫	98	82	129,068	
パナソニックホールディングス	142.7	138.4	417,276		広島ガス	24.1	26	9,412		三井倉庫ホールディングス	80	73	24,090	
アイフィスジャパン	2.4	2.4	998		西部瓦斯	156	142	36,352		住友倉庫	101	91	53,690	
共立印刷	23.3	21.6	7,063		静岡ガス	39.3	38.6	27,869		滋濃倉庫	36	33	11,253	
S H O E I	6.6	5.7	15,344		メタウオーター	8.9	7.1	20,440		東陽倉庫	24	22.2	6,526	
フラッシュベッドホールディングス	19.4	15.8	14,472		陸運業 (4.1%)					日本トランスシティ	31	29	12,325	
パイロットコーポレーション	24.1	21.9	96,141		S B Sホールディングス	13.6	12.4	9,622		ケイヒン	26	23	3,473	
萩原工業	2.9	3.5	8,956		東武鉄道	738	670	376,540		中央倉庫	7.9	7.4	7,836	

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
安田倉庫	千株	千株	千円	さくらインターネット	千株	千株	千円	エイベックス・グループ・ホールディングス	千株	千株	千円
東洋埠頭	10.8	9.7	7,197	GMOクラウド	6.7	8.8	10,480	日本ユニシス	25.1	22.8	38,486
宇徳	40	37	6,771	\$ R A ホールディングス	3	2.8	4,880	兼松エレクトロニクス	37.6	34.2	51,607
上組	11.3	10.4	4,160	MINORITソリューションズ	7.8	6.6	16,625	東京放送ホールディングス	8.6	7.8	20,131
サンリツ	165	150	160,200	システムインテグレータ	2	2.7	3,388	日本テレビホールディングス	81.6	81.6	162,710
キムラユニティー	1.7	1.7	877	朝日ネット	1.8	2	1,292	朝日放送	124.4	113	230,859
キューソー流通システム	3.5	3.3	3,946	アドソル日進	12.6	11.7	5,896	テレビ朝日ホールディングス	13.5	12.1	9,062
郵船ロジスティクス	3.8	3.9	9,449	フリービット	—	2.5	3,335	スカパーJ SATホールディングス	37.2	33.8	76,590
近鉄エクスプレス	12.7	11.5	13,052	コムチュア	—	6.9	6,334	テレビ東京ホールディングス	103.4	80.4	38,270
東海運	24.7	22.5	33,660	サイバーコム	2.3	2.1	7,413	日本BS放送	12.3	10.1	25,371
エーアイティー	8.3	7.2	3,283	メディアカル・データ・ビジョン	—	1.6	1,563	ビジョン	2.3	2.8	2,984
内外トラストライン	6.4	7.7	8,416	gumi	—	2.1	6,098	U-NEXT	—	1.4	4,851
情報・通信業 (8.0%)	3.4	3.8	4,047	PCIホールディングス	14	12.8	16,755	ワイヤレスゲート	3.2	3.4	2,451
NECネットエスアイ	—	—	—	パブドHD	—	1.5	4,171	コネクショ	—	4.1	6,912
システナ	17.2	13.6	28,260	オープンドア	1.7	1.8	2,007	日本通信	12.1	10.9	15,728
デジタルアーツ	13.3	9.9	16,117	LINE	—	1.2	4,158	クロップス	72.2	104.2	18,547
新日鉄住金ソリューションズ	6.6	5.5	17,242	AOI TYO HOLDINGS	—	20.7	74,313	日本電信電話	1.4	1.4	855
キューブシステム	22.7	20.7	47,858	フェイス	—	10.2	8,853	KDDI	1,053.1	994.5	4,847,193
コア	6.1	5.6	3,864	野村総合研究所	3.6	3.4	4,508	NTTドコモ	1,384.1	1,225.6	3,611,843
ソフトクリエイトホールディングス	5.8	5.3	6,937	サイバネットシステム	95.5	92.6	354,658	エムティーアイ	16.4	14.9	155,556
TIS	5	6.1	8,137	CEホールディングス	11.1	10.2	6,660	GMOインターネット	1,050.8	925.7	2,490,133
ネオス	45.2	41.1	109,654	インテージホールディングス	1.8	1.8	2,025	カドカワ	17.4	19	13,452
電算システム	4	3.9	1,708	東邦システムサイエンス	7.1	7.1	15,073	学研ホールディングス	50.4	45.3	68,720
グリー	4.7	4.3	7,009	ティー・ワイ・オー	4.1	4.3	2,760	ゼンリン	42.5	35.9	61,496
三菱総合研究所	82.6	75.5	49,905	フォーカスシステムズ	6.8	6.8	4,562	昭文社	46	41	12,464
ボルテージ	32.3	29.4	57,947	クレスコ	18.6	—	—	インプレスホールディングス	18	16.4	35,719
電算	5.3	4.8	15,576	フジ・メディア・ホールディングス	—	5.1	2,998	アイネット	7.4	6.9	4,795
AGS	2.6	2.5	2,627	オービック	3.1	2.9	7,000	東宝	11.1	11.1	1,653
ファインデックス	1.6	1.5	3,540	ジャストシステム	141.9	128.9	198,119	東映	7.6	7.1	8,704
ビット・コミュニケーションズ	2.4	2.6	4,313	TDCONソフトウェアエンジニアリング	47	42.7	225,456	AOI Pro.	90	82	108,896
ブレインパッド	8.9	9.2	8,510	ヤフー	24.8	20.1	22,692	エヌ・ティ・ティ・データ	97.2	81	257,580
K Lab	3.1	2.8	4,530	トレンドマイクロ	3	5.5	7,067	ピー・シー・エー	51	46	43,516
ホムックウイ・ビッドホールディングス	2	1.9	2,405	インフォメーション・ディベロップメント	976.4	888.5	470,905	ビジネスブレイン太田昭昭	6.9	—	—
インクワンシアティパブリッシング	21	23.7	14,812	日本オラクル	66.1	65.6	286,016	DT S	84.2	76.5	441,405
ネクソン	8.9	8.9	9,478	アルファシステムズ	2.9	3.7	4,155	シーイーシー	1.8	1.8	2,827
アイスタイル	3	2.1	2,083	フューチャー	21.8	19.9	127,758	カブコン	1.7	1.7	1,769
エムアップ	130.2	135.6	234,994	CAC Holdings	4.5	4.1	7,863	アイ・エス・ピー	15.1	12.8	32,486
エイチーム	22.4	26.1	22,028	ソフトバンク・テクノロジー	16.4	16.8	13,675	ジャステック	57.6	47.7	148,108
テクノスジャパン	3.5	3.7	3,026	イーエムシステムズ	10.2	9.3	8,900	S C S K	8.9	7.4	13,120
enish	5	6.9	14,358	ウェザーニューズ	3.7	3	12,330	日本システムウエア	34.8	29	64,554
コロプラ	1.5	9.6	11,539	オビックビジネスコンサルティング	3.6	3.6	2,948	T K C	1.6	2.3	2,017
モバイルクリエイト	4	3.8	2,002	伊藤忠テクノソリューションズ	6.9	6.3	35,091	富士ソフト	8.6	7.9	8,176
オルトプラス	37.6	34.5	34,120	アイティフォー	30.8	28.1	89,498	N S D	32.4	33.7	141,877
ブロードリーフ	8.9	8.6	3,723	東計電算	17.7	16.4	10,184	コナミホールディングス	5	4.1	6,629
ハーツユニテッドグループ	5	5.3	3,339	エックスネット	2.4	2.3	5,135	番井コンピュータホールディングス	19.3	15.6	17,659
メディアアッド	14.1	30.6	21,297	大塚商会	1.6	1.3	2,791	ミロク情報サービス	12.6	11.5	40,135
パイキューブ	4.1	6.6	10,302	サイボウズ	36.6	33.3	196,137	ソフトバンクグループ	20.2	18.4	50,949
サイバーリンクス	—	2.7	4,411	ソフトブレーン	18.5	16.8	7,828	ホウスイ	28.9	26.3	46,419
ディー・エル・イー	6.6	6.9	4,498	電通国際情報サービス	19.9	17.1	7,489	伊藤忠食品	61.5	55.9	250,991
フィックスターズ	1.5	2	2,044	デジタルガレージ	8.4	7.7	16,016	エレマテック	2.9	3.6	10,926
VOYAGE GROUP	—	3.8	2,546	イーエムシステムズ	—	18	34,128	J B C Cホールディングス	11.5	10.5	8,337
オプティム	—	1.8	6,237	ウェザーニューズ	2.3	4.3	7,056	ミロク情報サービス	10.1	9.2	16,541
セレス	3	4.3	7,310	C I J	4.6	4.2	14,469	フィールズ	772	557.7	4,831,912
ベリサーブ	0.9	1.1	6,710	東洋ビジネスエンジニアリング	12.3	11.6	6,066	卸売業 (4.5%)	—	—	—
ティーガイア	—	2.2	3,786	日本エンタープライズ	1.5	1.4	2,151	高千穂交易	12	12	1,500
日本アジアグループ	1.5	1.5	4,206	WOWOW	13.8	13.4	3,725	伊藤忠食品	5.4	4.9	5,032
豆蔵ホールディングス	13.5	12.4	22,493	スカラ	6.5	5.9	21,358	J A L U X	3.3	3.1	13,485
テクノマトリックス	11.5	14.1	6,105	日本コロムビア	7.7	7.8	6,341	あらた	6.3	4.9	9,241
カホー・エンタテインメント	10.6	9.2	9,227	ネットワンシステムズ	4.8	3.9	2,616	トーメンデバイス	4.4	5.6	15,775
GMOペイメントゲートウェイ	5.8	3.9	9,309	システムソフト	11.4	10.5	7,854	東京エレクトロン	1.9	1.9	3,919
ザッパラス	238	259.9	64,715	アルゴグラフィックス	58.9	53.5	47,133	双日	5	4.6	7,337
インターネットインシアティ	11.8	10.2	64,056	マーベラス	—	22.8	3,420	—	8.9	9.4	11,468
	7.8	7.5	3,337		6.2	5.7	13,925		857.9	731.2	210,585
	22	18.3	33,342		22.9	20.9	19,019				

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
アルフレック ホールディングス	171.3	146.6	275,314	田中商事	4.4	3.9	2,710	立花エレクトック	10.1	8.4	10,827
横浜冷凍	33.9	30.9	31,857	オーハシテクニカ	7.7	7	9,842	フォーバル	5.2	5.5	3,910
神栄	19	18	3,186	白銅	4	3.1	5,167	PAL TAC	21.8	19.8	60,093
山下医科器械	1.2	1.1	1,966	伊藤忠商事	1,069.1	907.3	1,436,709	三谷産業	14.5	13.3	4,987
ラサ商事	6.7	5.8	3,880	丸紅	1,340.8	1,219.1	847,762	太平洋興発	58	53	5,565
ラクーン	—	5.6	2,816	高島	26	21	4,179	ヤマタネ	64	63	10,105
アルコニックス	7.7	7.1	12,559	長瀬産業	82	74.2	117,458	丸紅建材リース	12	12	2,724
神戸物産	8.8	6.7	24,019	蝶理	8.7	7.9	15,491	日鉄住金物産	90	10.8	51,354
あい ホールディングス	24.3	17.6	37,276	豊田通商	151.8	137.9	447,485	トラスコ中山	15.6	28.3	74,825
ディービーエックス	3.7	4.5	5,553	三共生興	20.5	18.8	7,783	オートバックスセブン	52.2	45.8	80,195
ダイワボウホールディングス	124	105	29,400	兼松	290	263	50,233	モリト	—	9.9	9,504
マクニカ・富士エレホールディングス	24.5	22.9	37,922	ツカモトコーポレーション	25	23	2,898	加藤産業	21.3	19.4	52,457
パイタルケー・エスケー・ホールディングス	23.8	23.3	23,509	三井物産	1,232	1,120.1	1,852,645	イノテック	12.4	10.8	6,642
八洲電機	10.7	9.8	6,203	日本紙パルプ商事	71	65	23,595	オートバックス	12.9	11.7	31,613
UKCホールディングス	8.7	8	17,680	日立ハイテクノロジーズ	47.2	43	209,195	JKホールディングス	13.9	12.4	7,316
OCHIホールディングス	3.3	3.3	4,514	カメイ	17.7	16.1	20,221	日伝	5.5	5.1	16,549
TOKAIホールディングス	60	54.6	46,464	東都水産	24	2	3,836	北沢産業	11	11	2,431
三洋貿易	7.5	6.8	11,281	OUGホールディングス	20	20	5,180	杉本商事	7.9	7.2	11,116
ビュリティガレージ	—	1.1	1,238	スターゼン	4.9	5.2	24,752	因幡電機産業	19.1	17.3	68,767
ワイン・パートナーズ	4.9	9	8,325	山善	52.3	47.5	45,790	バйтеックホールディングス	4.2	5.1	6,466
ミタチ産業	3.6	3.3	2,039	椿本興業	15	14	5,320	ミスミグループ本社	152.9	139.2	286,056
シッパヘルスケアホールディングス	27.7	23.8	69,281	住友商事	857.6	779.8	1,126,031	アルテック	11.7	11.2	2,408
明治電機工業	4.3	4.3	5,164	内田洋行	34	6.1	15,591	タキヒヨー	22	19	9,006
デリカフーズ	3.1	2.9	3,050	三菱商事	1,022.3	929.6	2,362,113	蔵王産業	2.4	2	2,988
スターティア	2.6	2.6	1,385	第一実業	31	28	20,244	スズケン	62	56.4	209,808
コメダホールディングス	—	16.7	31,178	キヤノンマーケティングジャパン	38.8	35.3	78,577	ジェコス	9.4	8.6	9,941
富士興産	5.5	4.6	2,125	西華産業	45	39	14,469	ルネサスイストン	8.6	11.2	6,451
協栄産業	15	16	2,672	佐藤商事	12.3	11.1	9,590	小売業 (4.6%)			
小野建	11.9	10.8	14,882	菱洋エレクトロ	15.7	11.8	17,464	ローソン	51.6	43	351,310
佐島電機	10.8	9.8	7,252	東京産業	13.7	12.5	5,750	サンエー	9.3	9.3	47,244
エコーレーディング	3.4	3.2	2,246	ユアサ商事	12.9	11.7	35,275	ダイユーエイト	3.7	—	—
伯東	10.4	8.4	8,584	神鋼商事	31	3.1	7,573	カワチ薬品	10.6	9.6	27,945
コンドーテック	10.9	9.9	8,523	小林産業	9.8	9.4	2,528	エービーシー・マート	17.4	22.5	146,025
中山福	8.7	7.5	6,150	阪和興業	136	124	94,736	ハードオフコーポレーション	6.6	5.5	6,506
ナガイレーベン	19.6	17.9	45,215	カナデン	13.1	11.9	12,042	アスクル	16.6	12.9	45,214
三菱食品	15	13.6	45,356	菱電商事	22	20	14,460	ゲオホールディングス	25.8	20.7	27,241
松田産業	10	9	13,716	フルサト工業	7.5	6.8	11,458	アダストリア	12.5	19	55,860
第一興商	24.1	20.1	88,440	岩谷産業	162	137	87,406	ジーフット	8.1	7.5	6,127
メビアルホールディングス	136.3	123.9	232,932	すてきなイスグループ	59	53	7,950	シー・グレイ・エス・バイエリア	20	1.9	1,349
S P K	3.2	2.8	6,820	昭光通商	50	46	4,692	くらコーポレーション	8	8.1	36,936
萩原電気	3.5	4.2	8,878	ニチモウ	21	18	3,150	キャンドウ	7.3	6.6	11,820
アズワン	10.6	9.7	48,403	極東貿易	19	19	4,560	パルグループホールディングス	7.9	6.3	17,514
スズデン	4.4	4.4	4,628	イワキ	21	19	5,719	エディオン	57.6	48	50,160
尾家産業	4.8	4.4	4,928	三菱石油	35	33.2	28,220	サトーコーポレーション	11.7	15.5	9,532
シモジマ	9.5	7.7	8,932	稲畑産業	32.7	29.6	38,776	ワッツ	5.4	5.5	6,154
ドウシシャ	16	14.6	30,119	G S Iクレオス	36	31	4,309	ハローズ	4.1	4.1	9,229
小津産業	3	2.8	6,070	明和産業	12.6	11.6	4,466	あみやき亭	2.6	2.4	9,372
高速	8.2	7.5	8,100	ワキタ	29	26.3	27,141	ひらまつ	18.8	17.2	11,248
たけびし	4.9	4.3	5,731	東邦ホールディングス	43.6	39.6	97,138	ガンキー	2.7	2.5	15,075
黒田電気	25.3	16.9	38,143	サンゲツ	49.2	42.4	80,602	サッポロドラッグストア	1.3	—	—
リックス	—	2.9	4,712	ミツロコグループホールディングス	22	20	14,340	大黒天物産	3.3	3	16,320
丸文	12	11	7,491	シナネンホールディングス	28	5.3	11,887	ハニーズ	11.9	10.9	11,728
ハピネット	12.4	10.4	13,353	伊藤忠エネクス	35.1	27.3	24,952	ファーマライズホールディングス	2.9	3.1	1,574
橋本総業ホールディングス	2.6	2.6	3,910	サンリオ	42	38.2	86,332	アルペン	12.2	9.5	18,867
日本ライフライン	—	10.6	19,716	サンワ テクノス	8.7	7.3	7,227	クオール	13.8	14	20,790
エクセル	6.6	5.3	7,859	リョーサン	21.6	18.4	64,400	ジェイアイエヌ	9.2	8.4	49,308
マルカキカイ	4.4	4	7,400	新光商事	16	13.5	17,050	ビックカメラ	70.4	71.1	75,081
！DOM	36.6	33.4	24,415	トナーホー	6.2	5.7	14,124	DCMホールディングス	66.9	75.2	73,545
日本エム・ディ・エム	11.4	9.4	7,632	三信電気	18.8	13.7	17,522	MonotaRO	48	43.9	136,090
進和	8	7.3	12,869	東陽テクニカ	20	16.4	16,203	東京一番フーズ	2.1	2.4	1,375
エスケイジャパン	3.2	2.7	823	モスフードサービス	17.8	16.2	53,703	ダイヤモンドダイニング	2.1	2.8	4,485
ダイトロン	6.1	5.7	5,899	加賀電子	12.3	11.2	22,198	きちり	3.7	3.6	2,379
シークス	8.6	8.8	35,596	ソーダニッカ	14.4	13.1	6,667	アークランドサービスホールディングス	4.3	3.9	11,739

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	千円		株 数	株 数	評 価 額	千円		株 数	株 数	評 価 額	千円
J. フロント リテイリング	172.4	156.7	246,175	エコス	5	4.8	5,812	東武ストア	17	1.5	4,348			
ドットル・日レシホールディングス	23.9	21.7	46,763	ワタミ	16.2	14.7	16,552	平和堂	27.6	25.1	64,908			
マツトホシヨシホールディングス	28.1	23.4	125,892	マルシェ	3.7	3.1	2,563	フジ	15.2	13.8	32,126			
ブロンコビリー	5.3	6.5	17,368	ドンキホーテホールディングス	88.1	80.1	304,780	ヤオコー	15.4	14	61,880			
スタートトゥデイ	41.4	113.1	271,213	西松屋チェーン	26.9	21.7	28,578	ゼビオホールディングス	18.5	16.8	28,375			
トレジャー・ファクトリー	3.8	3.7	3,052	セシヨホールディングス	70.1	64.2	124,162	ケーズホールディングス	28.8	57.1	116,141			
物語コーポレーション	3.7	3.3	13,233	幸楽苑ホールディングス	8.7	8	12,960	Olympicグループ	7.2	7.4	4,543			
ココカラファイン	14.2	12.9	59,082	ハークスレイ	3.8	3	3,285	日星東京販売ホールディングス	22.9	18.3	6,002			
三越伊勢丹ホールディングス	270.9	246.4	327,465	サイゼリヤ	22.4	20.4	52,550	アインホールディングス	16.4	16.2	130,572			
Hamee	—	1.9	1,710	VTホールディングス	46	42	22,974	元気寿司	3.8	3.2	7,059			
ウエルシアホールディングス	11.8	12.3	75,768	魚力	4.2	3.9	5,054	ヤマダ電機	414.2	414.3	238,222			
クリエイトSDホールディングス	20	18.2	45,026	ボブラ	3.5	3.5	1,806	アークランドサカモト	11.5	21	27,930			
丸善CH1ホールディングス	16	14.8	5,372	フジ・コーポレーション	—	1.9	3,746	ニトリホールディングス	58.9	53.5	660,190			
ミサワ	1.8	1.8	846	ユナイテッドアローズ	19.4	16.5	55,605	グリメサ屋	9	9	9,171			
エー・ピーカンパニー	2.3	2.3	1,752	ハイデイド日高	10.3	11.3	30,385	愛眼	10.8	9.7	1,891			
テムニー	3.3	3.4	9,564	京都きもの友禅	9.4	8.1	7,921	ケユーホールディングス	7.1	6.5	5,596			
シュッピン	3.8	4.7	6,081	コロワイド	45.2	41.1	78,131	吉野家ホールディングス	50.3	43.1	70,253			
ネクステージ	2.2	2.2	5,409	ピーシードポコポレーション	11.2	16.5	10,230	松屋フーズ	6.6	6	24,990			
ジョイフル本田	22.1	20.1	61,908	壹番屋	6.2	8.7	32,625	サガミチェーン	18.2	15.6	20,482			
鳥貴族	—	3.1	7,077	トップカルチャー	5.9	5	2,395	関西スーパーマーケット	11.4	10.2	15,402			
キリン堂ホールディングス	4.4	4.1	3,464	P L A N T	3.1	2.8	3,337	王将フードサービス	10	9.1	38,948			
ホットランド	3.5	4.9	5,203	スギホールディングス	24.4	27.1	139,565	プレナス	15.2	13.9	33,985			
すかいらーく	41.7	53.2	81,662	ヴィア・ホールディングス	—	9.4	10,311	ミニストップ	10.1	9.1	18,891			
綿半ホールディングス	3.8	5	7,940	スクロール	20.5	18.8	6,486	アークス	25.5	23.2	58,904			
ユニクロ・スポーツウェア・ホールディングス	45.2	40.9	40,981	ヨンドシーホールディングス	10.4	9.4	23,058	パローホールディングス	29.4	26.7	73,264			
ブックオフコーポレーション	7.7	7.3	5,920	ユニ・ファミマートホールディングス	41.9	54.3	387,702	ベルク	6.7	5.5	23,567			
ゴルフダイジェスト・オンライン	2.8	3.9	3,045	木曽路	16.7	15.2	35,796	大 庄	6.5	6.7	10,425			
B E E N O S	—	1.5	2,190	サトレストラシシステムズ	16.1	14.8	12,565	ファーストリテイリング	27.3	20.7	730,503			
あさひ	10.1	9.2	11,923	千趣会	27	22.3	16,814	サンドラッグ	28.8	23.6	179,124			
日本調剤	3.4	4.4	15,642	タカキュー	9.9	10.7	2,268	サックスバー ホールディングス	12.8	11.7	14,004			
コスモス薬品	6.9	6.2	129,704	ケーユー	23.3	21	12,054	ヤマザワ	2.9	2.6	4,742			
トーエル	7.2	6.2	5,716	上新電機	32	29	31,465	やまや	2.8	2.6	4,386			
一六堂	3.6	3.3	1,306	日本瓦斯	15.6	22.7	75,818	ペルルーナ	34	31	26,257			
セブン&アイ・ホールディングス	569.9	518.5	2,295,918	ベスト電器	44.2	40.3	5,682	銀行業 (8.6%)						
薬王堂	1.9	6.2	11,897	ロイヤルホールディングス	22.6	20.5	39,032	島根銀行	3.1	2.8	3,883			
クワイ・レストラン・ホールディングス	12.2	33.3	33,266	東天紅	10	10	1,640	じもとホールディングス	97.9	89.2	17,215			
ツルハホールディングス	31.3	24.8	257,672	いなげや	15.2	13.8	21,155	ぬびきフィナンシャルグループ	99.9	597.3	266,395			
サンマルクホールディングス	10.7	8	27,040	島忠	35.2	32	87,456	東京TVフィナンシャルグループ	18.8	17.9	69,899			
フェリシモ	3.9	3.6	3,661	チヨダ	16	14.6	39,055	九州フィナンシャルグループ	208.5	203.1	161,667			
トリドールホールディングス	16.7	15.2	36,875	ライフコーポレーション	8.6	9.4	30,832	ゆうちょ銀行	261.9	350.8	491,821			
クスリのアオキ	12.1	—	—	リンガーハット	12.3	13.1	30,523	富山第一銀行	—	31.6	16,716			
サツドラホールディングス	—	1.7	3,316	さが美	10	11	1,364	コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	811.1	490,796			
ダイユー・リックホールディングス	—	4.2	3,318	MR MAX	11.6	15.6	6,099	西日本フィナンシャルホールディングス	—	84	101,808			
パロクジャパンリミテッド	—	7.3	11,249	テンアライド	13	12.5	4,875	新生銀行	1,179	1,179	236,979			
クスリのアオキホールディングス	—	9.8	44,296	AOKIホールディングス	31.1	24.7	33,592	あおぞら銀行	862	784	318,304			
メディカルシステムネットワーク	15.4	14.1	5,809	オークワ	20	18	20,592	三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,931.6	9,387.8	7,052,115			
総合メディカル	6.6	6	23,280	コメリ	21	19.1	49,583	りそなホールディングス	1,594	1,449.4	859,784			
はるやまホールディングス	5.7	5.7	5,226	青山商事	26.1	25.9	100,233	三井住友トラスト・ホールディングス	2,844	258.6	1,047,847			
ノジマ	—	14.4	17,913	しまむら	15.8	14.4	205,920	三井住友フィナンシャルグループ	1,091	992	4,443,168			
カッパ・クリエイト	19.1	17.5	23,117	はせがわ	4.8	4.8	2,126	第四銀行	172	152	77,976			
ライトオン	10.1	9.3	9,104	高島屋	198	208	197,808	北越銀行	147	13.4	36,113			
ジーンズメイト	4.6	4.6	1,163	松屋	27.4	27	26,487	西日本シティ銀行	443	—	—			
良品計画	15.6	16.4	331,772	エイチ・ツー・オー リテイリング	69.8	63.4	115,451	千葉銀行	525	478	371,406			
三城ホールディングス	17.3	15.5	7,099	近鉄百貨店	53	47	16,732	横浜銀行	914	—	—			
アドヴァン	13.8	12.6	13,633	丸栄	29	26	2,262	常陽銀行	492	—	—			
アルビス	3.6	3.3	10,428	ニッセンホールディングス	20.4	—	—	群馬銀行	303	275.2	177,779			
コナカ	16	15.7	9,137	パルコ	13.1	11.8	13,027	武蔵野銀行	21.7	19.7	67,374			
ハウス オブ ローゼ	1.7	1.7	2,638	丸井グループ	167.2	130.3	198,446	千葉興業銀行	37.3	34.1	20,391			
G-7ホールディングス	4	3.7	7,633	アクリル リテイリング	10.5	9.6	42,720	筑波銀行	56.6	51.6	17,956			
イオン北海道	9.4	12.4	7,526	井筒屋	75	7	2,709	七十七銀行	213	194	103,014			
コジマ	20.2	18.4	4,986	イオン	560.6	509.6	827,845	青森銀行	100	96	36,960			
ヒマラヤ	4.3	3.9	3,334	ユニグループ・ホールディングス	130.5	—	—	秋田銀行	89	81	29,484			
コーナン商事	19.3	17.6	37,224	イズミ	27.1	24.6	116,112	山形銀行	77	70	34,580			

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
岩手銀行	千株	千株	千円	SBIホールディングス	千株	千株	千円	ディア・ライフ	千株	千株	千円
東邦銀行	9.5	8.1	37,138	日本アジア投資	163.6	140	217,700	イー・ディー・ワークス	6.8	8.8	3,396
東北銀行	122	111	48,618	ジャフコ	8.9	12.2	5,502	日本商業開発	92	116.1	4,876
みちのく銀行	70	65	10,140	大和証券グループ本社	22.8	20.7	78,039	パルサンスホールディングス	4.5	6.9	13,344
ひくおかフィナンシャルグループ	69	63	11,970	野村ホールディングス	1,275	1,159	818,833	ユニゾホールディングス	4.6	19.3	26,518
静岡銀行	589	503	252,003	丸三証券	2,621.5	2,532.8	1,866,926	THEグローバル社	8.5	10.2	31,416
十六銀行	399	337	324,868	東洋証券	116	105	77,175	日本管理センター	—	4.9	2,224
スルガ銀行	171	166	65,238	光世証券	40.4	39.4	37,193	サンセイランディック	8.9	8.9	11,258
八十二銀行	129.3	126.7	337,528	水戸証券	53	44	11,660	エストラスト	3.1	2.7	1,976
山梨中央銀行	246	238.9	164,602	いちよし証券	156.2	142	87,614	フージャースホールディングス	2.4	2.4	1,840
大垣共立銀行	84	77	40,964	だいたい証券ビジネス	33	30	5,550	東急不動産ホールディングス	18.9	16.1	9,643
福井銀行	182	165	74,580	マネックスグループ	42.3	38.5	11,742	オーブハウス	19.7	17.9	47,596
北國銀行	117	106	30,422	カブドットコム証券	30.5	27.7	24,320	エコナックホールディングス	329.6	299.5	195,573
清水銀行	152	131	59,605	極東証券	69.3	70.6	66,505	三井不動産	126.2	103.3	208,562
富山銀行	4.7	4.2	15,225	岩井コスモホールディングス	6.6	6.2	3,757	三菱地所	—	4	2,696
滋賀銀行	2.6	2.4	10,104	藍澤證券	160.1	132.9	39,870	平和不動産	—	1.3	2,173
南都銀行	128	116	74,356	マネーパートナーズグループ	120.7	92.3	35,166	東京建物	—	1.8	2,804
百五銀行	132	12	55,980	小林洋行	18.3	16.6	26,892	ダイビル	43	44	2,112
京都銀行	123	111	53,058	かんば生命保険	12.9	11.7	12,460	京阪神ビルディング	68.7	62.8	193,110
紀陽銀行	260	222	206,460	SOMPOホールディングス	19.1	23.2	14,824	住友不動産	4.7	3.6	6,566
三重銀行	53.5	46.5	86,443	アニコムホールディングス	4.7	—	—	ゴールドクレスト	722	657	1,704,915
ほくほくフィナンシャルグループ	61	5.6	13,496	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	12.6	15.9	8,299	日本エスリード	1,013	921	2,021,134
広島銀行	926	82.4	164,470	ソニーフィナンシャルホールディングス	4.7	4.3	1,242	日神不動産	25.8	23.4	36,082
山陰合同銀行	402	365	196,370	東京海上ホールディングス	34.6	46.8	125,049	日本エスコン	148.8	143.7	220,435
中国銀行	82.5	74.4	73,953	T&Dホールディングス	41.6	34.9	125,116	サンヨーハウジング名古屋	35.1	31.9	33,782
鳥取銀行	96.5	87.8	153,474	アドバンスクリエイト	302.7	259	1,041,439	イオンモール	22.8	20.6	12,566
伊予銀行	44	4	7,472	その他金融業 (1.3%)	9.2	8.4	19,748	ファースト住建	326	297	901,098
百十四銀行	145.6	132.4	102,212	全国保証	407.2	370.2	1,396,764	ランド	253	230	51,520
四国銀行	150	136	53,584	クレディセゾン	130.6	118.7	230,752	タカラレーベン	52.8	48.1	43,819
阿波銀行	105	96	28,320	アクリシティ	872.9	747.1	1,562,933	エフ・ジェー・ネクスト	23	21	10,836
大分銀行	112	106	77,486	芙蓉総合リース	552	501.9	2,361,439	ランドビジネス	160.4	156.3	100,188
宮崎銀行	78	71	30,885	興銀リース	496.6	451.5	768,678	サンフロンティア不動産	15.6	12.6	24,431
佐賀銀行	83	75	22,350	東京センチュリー	—	3	6,003	日本空港ビルデング	17.5	15.8	11,660
十八銀行	84	76	26,676	アイフル	35.4	34.9	125,116	空港施設	16.6	15.1	8,818
沖縄銀行	10.8	12	49,680	ポケットカード	103.3	93.9	191,837	明和地所	7.4	7	5,068
琉球銀行	28.1	25.5	39,346	リコーリース	11.1	10.6	4,187	住友不動産販売	9.8	11.1	28,171
セブン銀行	510.4	464.4	149,072	イオンフィナンシャルサービス	15.6	14.2	73,698	ゴールドクレスト	10.7	11.2	22,691
みずほフィナンシャルグループ	19,193.3	16,819.1	3,506,782	アコム	25.6	23.3	57,271	日本エスリード	5.4	4.9	6,801
高知銀行	53	47	6,345	ジャックス	25.6	23.3	57,271	日神不動産	18.3	14.7	7,820
山口フィナンシャルグループ	127	116	147,668	オリエントコーポレーション	32	24.9	91,756	日本エスコン	—	16.7	6,262
長野銀行	46	4.1	8,282	日立キャピタル	60.1	54.3	33,231	タカラレーベン	60.3	54.1	30,512
名古屋銀行	114	10.4	43,836	アプラスフィナンシャル	227.9	207.7	68,333	サンヨーハウジング名古屋	7.7	6.4	6,419
北洋銀行	205.1	202	94,334	オリックス	13.7	9.4	5,649	イオンモール	87.9	79.7	130,070
愛知銀行	4.6	4.2	28,392	三菱UFJリース	10.7	9.7	33,125	ファースト住建	5.1	4.7	6,518
第三銀行	78	7.1	12,283	日本取引所グループ	89.4	79.1	158,753	ランド	64.4	64.4	1,094
中京銀行	56	5.1	11,694	イー・ギヤランティ	273.6	249	117,030	トーセイ	20.7	17	12,682
東日本銀行	65	—	—	アサックス	75	68	33,524	穴吹興産	13	1.4	3,684
大光銀行	49	44	10,956	NECキャピタルソリューション	589	267.6	56,463	エヌ・ティ・ティ都市開発	84.7	76.9	78,284
愛媛銀行	81	14.7	20,756	日エントキャピタル	32.1	29.2	82,314	サンフロンティア不動産	16.4	13.3	13,379
トマト銀行	54	4.9	7,776	アプラスフィナンシャル	65.7	60.1	7,091	エフ・ジェー・ネクスト	11.9	10.9	8,371
みなと銀行	123	11.2	23,643	オリックス	964.7	877.3	1,497,989	ランドビジネス	9.4	8	2,280
京葉銀行	112	101	53,227	三菱UFJリース	345.6	314.2	180,979	グランディハウス	11.9	11.1	4,595
関西アーバン銀行	19	17.3	25,725	日本取引所グループ	400.1	385.2	627,490	日本空港ビルデング	43.4	39.5	155,827
栃木銀行	73	68.3	40,638	イー・ギヤランティ	4.4	3.7	10,341	サビス業 (3.6%)			
北日本銀行	4.3	3.9	12,265	アサックス	2.4	2.3	3,703	日本工営	48	8.8	21,929
東和銀行	191	233	27,727	NECキャピタルソリューション	5.6	5	8,670	ネクスト	40.7	32.5	24,700
福島銀行	168	136	13,192	不動産業 (2.5%)				ジェイエスターリクルートメント	6.6	8.1	11,988
大東銀行	82	65	11,050	いちご	112.9	117.8	41,819	日本M&Aセンター	22.3	37.9	125,828
トモニホールディングス	104.5	102.2	63,466	日本駐車場開発	148.7	149.6	22,739	ノバレーゼ	3.8	—	—
フィデアホールディングス	82.9	120.4	25,163	ヒューリック	284	258.4	285,790	アコーディア・ゴルフ	40	—	—
池田泉州ホールディングス	144.3	131.4	67,539	三栄建設設計	5.4	5	7,540	中広	1.4	1.4	971
証券・商品先物取引業 (1.3%)				野村不動産ホールディングス	90.3	82.2	154,864	タケエイ	12.4	11.6	11,913
F P G	40.4	44.2	43,448	三菱愛知グループホールディングス	24.5	22.1	8,552	トラスト・テック	2.9	5.4	9,676
				サムティ	7.2	10	11,270	コジダホールディングス	—	4.5	10,458

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
パソナグループ	12.5	11.4	9,006	秀英予備校	2.5	2.9	1,374	トランス・コスモス	16.7	15.2	39,170
CD S	3.3	3.2	3,299	田谷	3	2.6	1,695	乃村工務社	30.8	28.1	53,361
リングアンドモチベーション	29.2	29.8	13,916	ラウンドワン	45	41	33,005	藤田観光	52	43	14,792
G C A	12.7	11.7	9,558	リゾートトラスト	60.5	50.8	104,444	KNT-CTホールディングス	70	72	10,728
エス・エム・エス	17.9	18.5	47,693	ビー・エム・エル	8.5	17.2	46,147	日本管財	12.4	11.3	20,057
テンブホールディングス	101	101.4	201,481	ワタベウエディング	4.3	2.1	1,083	トーカイ	6.4	5.8	22,388
リニカル	8.5	7.8	10,241	りらいぬこみこエージェンシー	23.8	21.7	23,392	白洋舎	5	0.5	1,345
クックパッド	32	29.3	29,212	リソー教育	26.7	22.4	13,529	セコム	150	136.4	1,111,523
エスクリ	6.1	4.7	2,923	早稲田アカデミー	2.4	1.9	2,101	セントラル警備保障	6.4	5.8	11,153
アイ・ケイ・ケイ	7.8	6	4,182	ユー・エス・エス	174.5	158.7	311,052	丹青社	26.9	22.7	19,249
学情	5.3	5.5	6,457	東京個別指導学院	6.9	4.4	4,074	メイテック	17.9	15.9	66,700
スタジオアリス	6.7	5.4	11,550	サイバーエージェント	35.2	69	201,618	アサツー ディ・ケイ	25.3	21.4	62,552
シミックスホールディングス	6.5	6.7	10,143	楽天	674.4	670	730,300	応用地質	15.1	12.4	17,595
N J S	3	3	4,110	クリーク・アンド・リバー社	—	4.7	4,869	船井総研ホールディングス	20	16.9	31,062
総合警備保障	48.1	47.7	209,880	デー・オー・ダブルユー	8.6	10.6	6,943	進学会	6.9	5.5	3,107
カカココム	104.5	93.6	148,449	セントラルスポーツ	5	4.5	13,882	オオバ	7.9	9.7	4,520
アイロムグループ	4.1	3.9	5,304	フルキャストホールディングス	13.1	13.5	12,622	学究社	2.1	3.5	5,278
ルネサンス	7.4	6.8	10,363	リソルホールディングス	14	13	4,459	ベネッセホールディングス	48.3	43.9	138,724
ディップ	15.9	17	39,542	テクノロ・ホールディングス	23.4	21.3	83,709	イオンディライト	13.9	14.8	48,396
オプトホールディング	9	9.3	6,854	インターワークス	1.9	2.6	3,016	ナック	8.9	8.1	7,776
新日本科学	13.6	13.9	7,784	KeepPer 技研	—	1.5	2,908	ニチイ学館	25.1	22.8	18,171
ツクイ	17.1	31.2	20,810	ファーストロジック	—	0.7	1,555	ダイセキ	27.1	22.9	50,586
キャリアデザインセンター	3.9	2.8	3,234	イー・ガーディアン	—	4.3	8,260	ステップ	4.9	4.5	6,187
エムスリー	124.8	113.6	334,892	リブセンス	9.3	9.3	4,203	合計	株数・金額	228,873.9	189,859.445
ツカガ・グローバルホールディング	10.6	9.6	5,980	ジャパンマテリアル	6	9.6	15,772	銘柄数<比率>	1,928銘柄	1,968銘柄	<97.6%>
アウトソーシング	6.7	7.5	26,925	ベクトル	4.5	10.7	12,508				
ウェルネット	5.4	9.9	12,414	ウチヤマホールディングス	7.5	6.3	2,721				
ワールドホールディングス	—	3	6,000	サクスホールディングス	1.3	1.1	1,548				
ディー・エヌ・エー	64.6	58.8	145,353	キャリアリンク	1.9	3.1	2,331				
情報堂DYホールディングス	199.9	181.8	238,339	I B J	8.4	10.3	5,860				
ぐるなび	16.7	19	41,268	アサンテ	5.3	4.9	8,315				
エスアルジータカミヤ	11.7	14.3	8,236	N フィールド	5.1	6.2	9,014				
ジャパネットホスピタリティ	16.7	17.3	4,273	M&Aキャピタルパートナーズ	1.2	1.7	7,063				
フロンコミュニケーションズ	33.2	33.4	24,482	ライオン・エクスプレス	2.3	3.1	2,656				
ライク	3.3	2.8	6,832	ERIホールディングス	3.8	3.7	2,956				
WDBホールディングス	5.2	4.8	6,120	アビスト	1.5	2.1	7,875				
ティア	6.1	6.5	4,569	ウィルグループ	3.3	5.4	3,920				
パリュウコマース	13.3	12.9	4,411	日本ビューホテル	1.6	1.9	2,580				
インフォマート	20.8	55.7	33,030	リクルートホールディングス	290.8	286.5	1,464,015				
J Pホールディングス	35.8	37.8	9,336	エラン	1.2	1.7	2,125				
E P Sホールディングス	16.1	16.3	24,058	日本郵政	318	341.9	489,258				
レッグス	2.1	3	2,649	ベルシステム24ホールディングス	21.2	20	19,560				
プラスター・インターナショナル	12.1	18.7	15,053	ソラスト	—	6	8,220				
アミューズ	4	7.3	12,928	リロググループ	5.4	4.9	81,438				
ドリームインキュベータ	4.8	4	7,820	東祥	4.3	2.8	13,888				
クイック	7.4	6.8	7,969	エイチ・アイ・エス	23.5	21.4	61,097				
T A C	8.2	7.7	1,747	ラックランド	2	2.2	4,164				
ケネディクス	193.4	166.2	68,973	共立メンテナンス	10.8	10.6	75,366				
電通	160.7	146.1	758,259	イチネンホールディングス	15.2	13.9	16,068				
テイクアンドグ・ニーズ	6.8	6.3	5,607	建設技術研究所	8.5	8.4	8,542				
ぴあ	4.3	4	11,384	スペース	7.8	7	8,673				
イオンファンタジー	5.1	3.9	11,856	燦ホールディングス	2.9	2.6	4,079				
シーティーエス	3.3	3.6	5,616	スバル興業	3	10	5,270				
ネクシィーズグループ	5	4.7	7,078	東京テアトル	57	52	8,684				
みらかホールディングス	36.8	33.5	172,190	タナベ経営	—	2.7	3,515				
アルプス技研	5.3	5.3	14,045	ナガワ	2.6	2.4	10,608				
サニックス	23.1	22	3,872	よみうりランド	29	26	11,726				
ダイオーズ	2.6	2.6	2,787	東京都競馬	99	90	23,220				
日本空調サービス	7.1	12.8	8,128	常磐興産	54	5	8,005				
オリエンタルランド	155.9	141.7	871,455	カナモト	20.1	18.3	53,289				
ダスキン	40.8	33.6	84,302	東京ドーム	115	52.3	54,862				
明光ネットワークジャパン	16.7	16.3	19,902	西尾レントオール	11.6	10.6	34,503				
ファルコホールディングス	6.3	6.3	9,254	アゴラ・ホスピタリティ・グループ	72	72	2,664				

(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		期末
		買建額	売建額	額
国内	T O P I X	百万円 6,572		百万円 －

■投資信託財産の構成

2017年2月7日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	
株式	千円 277,454,420		% 97.5
コール・ローン等、その他	7,139,930		2.5
投資信託財産総額	284,594,351		100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨ててあります。％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

(2017年2月7日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資 産	産 等	286,201,851,246円
コ ー ル ・ ロ ー ン	式(評価額)	6,578,745,130
株 未 収 配 当	金	277,454,420,930
差 入 委 託 証 拠	金	416,723,486
(B) 負 債	債	1,751,961,700
未 払 解 約	金	1,952,419,740
未 払 委 託 証 拠 金 代 用 有 価 証 券	金	160,125,740
差 入 委 託 証 拠 金 代 用 有 価 証 券	金	184,794,000
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	額(A－B)	1,607,500,000
元 次 期 繰 越 損 益 本 金	本 金	126,730,528,618
(D) 受 益 権 総 口 数	口 数	157,518,902,888
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	基 準 価 額(C/D)	126,730,528,618口
		22,429円

(注1) 期首元本額 143,582,065,487円
 追加設定元本額 31,895,226,101円
 一部解約元本額 48,746,762,970円

(注2) 期末における元本の内訳
 D I A M D C 国内株式インデックスファンド 6,225,361,204円
 D I A M 国内株式パッシブ・ファンド 1,668,812,063円
 M I T O ラップ型ファンド (安定型) 4,626,916円
 M I T O ラップ型ファンド (中立型) 12,027,439円
 M I T O ラップ型ファンド (積極型) 25,367,529円
 グローバル8資産ラップファンド (安定型) 14,362,796円
 グローバル8資産ラップファンド (中立型) 11,463,058円
 グローバル8資産ラップファンド (積極型) 14,507,613円
 D I A M 国内株式インデックスファンド<DC年金> 36,751,622,753円
 D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1安定型 831,977,748円
 D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型 2,911,107,155円
 D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3成長型 2,958,943,396円
 D I A M D C バランス30インデックスファンド 382,522,985円
 D I A M D C バランス50インデックスファンド 1,247,411,604円
 D I A M D C バランス70インデックスファンド 1,101,637,707円
 マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 59,530,357円
 マネックス資産設計ファンド (育成型) 1,323,202,308円
 マネックス資産設計ファンド エボリューション 29,654,177円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) 35,207,524円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) 68,501,796円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) 138,115,824円
 投資のソムリエ 737,581,150円
 クルーズコントロール 994,925,241円
 投資のソムリエ<DC年金> 21,909,381円
 D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> 114,690,983円
 D I A M D C バランス・F (成長型) 122,403,177円
 クルーズコントロール<DC年金> 362,468円
 D I A M コア資産設計ファンド (堅実型) 8,655,666円
 D I A M コア資産設計ファンド (積極型) 24,905,651円
 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 5,679,470円
 ダイナミック・ナビゲーション 1,959,663円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 13,656,955円
 D I A M アクティブアロケーション私募ファンド (適) 313,751,716円
 D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) 88,264,704円
 D I A M グローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 215,433,771円
 D I A M グローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 404,699,772円

D I A M 国際分散/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 27,745,336円
 D I A M 国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 121,678,076円
 D I A M 国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 30,140,688円
 D I A M 国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 33,363,257円
 D I A M 世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 1,086,480,641円
 D I A M 世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 462,558,924円
 D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 1,499,138,856円
 D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) 1,318,666,795円
 D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 3,594,704,089円
 D I A M グローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) 279,956,927円
 D I A M グローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定) 475,695,865円
 D I A M 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) 813,891,427円
 D I A M 世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け) 3,192,555,936円
 D I A M グローバルβ私募ファンド (適格機関投資家向け) 44,963,165円
 D I A M 世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 1,068,353,473円
 D I A M 世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定) 4,854,751,930円
 D I A M 世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 18,832,685,135円
 D I A M 世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 686,951,680円
 D I A M 世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 2,144,274,950円
 D I A M 世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) 11,925,835,750円
 D I A M バランス30VA (適格機関投資家限定) 6,826,388円
 D I A M バランス50VA (適格機関投資家限定) 328,366円
 D I A M バランス70VA (適格機関投資家限定) 4,672,150円
 D I A M 世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定) 10,678,056,698円
 D I A M 世界バランス25VA (適格機関投資家限定) 95,074,077円
 D I A M 国内バランス30VA (適格機関投資家限定) 34,152,004円
 D I A M バランス20VA (適格機関投資家限定) 36,517,217円
 D I A M バランス40VA (適格機関投資家限定) 73,509円
 D I A M バランス60VA (適格機関投資家限定) 119,539円
 D I A M 世界アセットバランスファンド7VA (1212) (適格機関投資家限定) 621,830,741円
 D I A M 世界アセットバランスファンド7VA (1303) (適格機関投資家限定) 1,622,373,744円
 D I A M 世界アセットバランスファンド7VA (1306) (適格機関投資家限定) 2,159,696,264円
 D I A M 世界アセットバランスファンド7VA (1309) (適格機関投資家限定) 91,571,301円
 期末元本合計 126,730,528,618円

(注3) 担保資産
 代用として担保を提供している資産は次の通りです。
 株式 3,173,000,000円

■損益の状況

当期 自2016年2月9日 至2017年2月7日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	益	6,113,275,232円
受 取 配 当 金		6,110,004,644
受 取 利 息		61,263
そ の 他 収 益		6,235,367
支 払 利 息		△3,026,042
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	益	27,775,078,654
売 買 損 益		41,315,651,580
売 買 損		△13,540,572,926
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	益	1,069,164,976
取 取 引 損 益		2,099,315,204
取 引 損		△1,030,150,228
(D) そ の 他 費 用		△9,664
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)		34,957,509,198
(F) 前 期 繰 越 損 益 金		143,315,324,821
(G) 解 約 差 損 益 金		△50,703,008,030
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金		29,949,076,899
(I) 合 計(E + F + G + H)		157,518,902,888
次 期 繰 越 損 益 金(I)		157,518,902,888

(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》

■D I AMアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。なお、当該統合に伴い、ファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。

■委託会社の統合により、約款に所要の変更を行いました。

(平成28年10月1日)