

バランスポートフォリオ

運用報告書（全体版）

第36期（決算日 2023年11月7日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「バランスポートフォリオ」は、2023年11月7日に第36期の決算を行ないましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

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／資産複合		
信 託 期 間	1987年11月27日から原則無期限です。		
運 用 方 針	「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債に投資し、信託財産の長期的成長と安定した収益の確保をはかることをめざして運用を行ないます。		
主要運用対象	バ ラ ン ス ポ ー ト フ ォ リ オ	「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。	
	インデックス東証株式マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。	
組 入 制 限	バ ラ ン ス ポ ー ト フ ォ リ オ	「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。	
	インデックス東証株式マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行ないません。	
分 配 方 針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して安定した分配を行なう方針です。 ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。		

お知らせ

2023年2月7日をもって、ミリオン（従業員積立投資プラン）としての取扱いを終了いたしました。
これに伴ない、総称としての「ミリオン」を削除いたしました。

<109275>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 組 入 比 率	純 資 産 額
	円	円	%	%	%	%	百万円
32期(2019年11月 7 日)	9,565	5	1.3	50.9	0.6	24.8	217
33期(2020年11月 9 日)	9,545	5	△ 0.2	49.6	0.6	25.7	213
34期(2021年11月 8 日)	10,465	5	9.7	49.8	0.6	25.6	212
35期(2022年11月 7 日)	10,216	5	△ 2.3	49.0	0.8	31.1	174
36期(2023年11月 7 日)	11,333	5	11.0	49.4	0.8	19.8	132

(注) 基準価額および分配金は、1 万口あたりに換算して表示しています。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 信託財産の長期的な成長と安定した収益の確保をはかることをめざして運用しているため、適切なベンチマークおよび参考指数はございません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 組 入 比 率
	円	%	%	%	%
(期 首) 2022年11月 7 日	10,216	—	49.0	0.8	31.1
11月末	10,352	1.3	48.8	0.6	31.5
12月末	10,112	△ 1.0	48.9	0.5	24.2
2023年 1 月末	10,336	1.2	50.1	0.3	26.8
2 月末	10,382	1.6	49.6	0.5	27.7
3 月末	10,467	2.5	48.5	1.0	28.1
4 月末	10,604	3.8	50.0	1.1	28.1
5 月末	10,795	5.7	49.0	0.8	27.8
6 月末	11,200	9.6	49.3	0.5	27.0
7 月末	11,275	10.4	49.9	0.4	26.8
8 月末	11,295	10.6	50.1	0.3	26.7
9 月末	11,318	10.8	49.8	0.7	26.6
10 月末	11,140	9.0	49.4	0.8	19.7
(期 末) 2023年11月 7 日	11,338	11.0	49.4	0.8	19.8

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

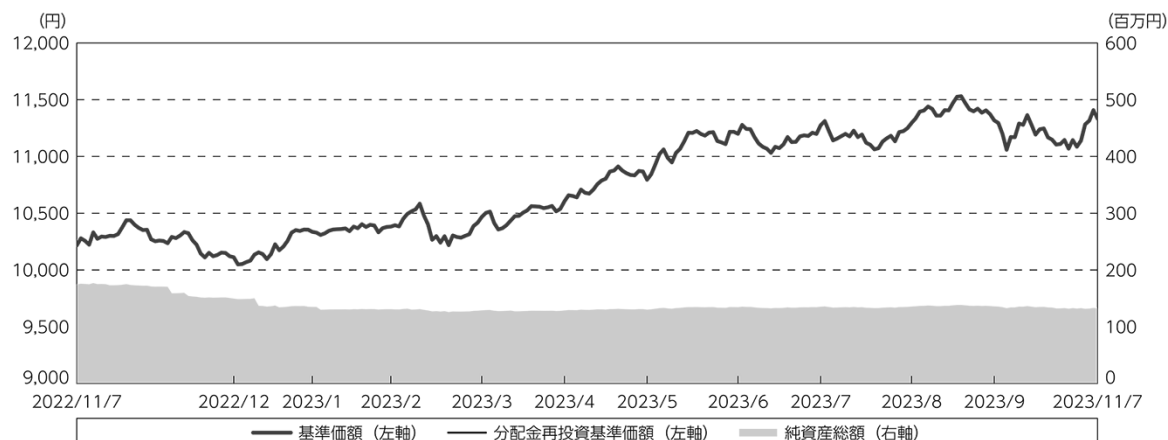
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2022年11月8日～2023年11月7日)

期中の基準価額等の推移



期 首：10,216円

期 末：11,333円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 11.0% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、期首(2022年11月7日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資を通じて、わが国の株式に50%程度投資を行ない、残りの50%程度は内外の公社債を中心に組み入れることで、信託財産の長期的成長と安定した収益の確保をはかることをめざして運用を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

(債券資産に対する要因)

- ・米国の地方銀行の経営破綻やスイスの大手金融グループの経営悪化への懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・日銀新総裁が就任会見において金融緩和政策を継続する考えを示したこと。

（株式資産に対する要因）

- ・ 中国で新型コロナウイルスを抑え込むゼロコロナ政策が解除され、中国景気の回復が期待されたこと。
- ・ 日銀新総裁が就任会見において金融緩和政策を継続する考えを示したこと。
- ・ 国内企業の概ね堅調な決算内容を受けて投資家心理が改善したことに加え、国内株式市場の相対的な割安感を背景に海外投資家の買いが膨らんだこと。

<値下がり要因>

（債券資産に対する要因）

- ・ 日銀が金融政策決定会合において長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）における長期金利の許容変動幅の拡大を決定したこと。
- ・ 米国連邦公開市場委員会（FOMC）後に公表されたFOMC参加者による政策金利の見通しの内容から、米国の金融引き締めが長期化が意識され米国長期金利が上昇したこと。
- ・ 日銀が金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用をさらに柔軟化することを決め、長期金利の上限の目途を1%として一定の上昇を容認したこと。

（株式資産に対する要因）

- ・ 欧米の金融機関の経営危機や破綻を契機とした欧米景気の悪化が警戒されたこと。
- ・ 米国の堅調な経済指標の発表などを背景に米国の金融引き締めが長期化するとの見方が強まったこと。
- ・ 中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。

投資環境

（国内株式市況）

国内株式市場では、東証株価指数（TOPIX）は、期間の初めと比べて上昇しました。

欧米の金融機関の経営危機や破綻を契機とした欧米景気の悪化が警戒されたことや、米国の堅調な経済指標の発表などを背景に米国の金融引き締めが長期化するとの見方が強まったこと、中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどが株価の重しとなりました。しかし、中国で新型コロナウイルスを抑え込むゼロコロナ政策が解除され、中国景気の回復が期待されたことや、米国の金融当局による預金者保護の表明や主要中央銀行による流動性供給などを受けて金融システムへの警戒感が和らいだこと、日銀新総裁が就任会見において金融緩和政策を継続する考えを示したこと、国内企業の概ね堅調な決算内容を受けて投資家心理が改善したこと、国内株式市場の相対的な割安感を背景に海外投資家の買いが膨らんだこと、FOMC後の米国連邦準備制度理事会（FRB）議長の記者会見を受けて米国の利上げサイクル終了への期待が強まったことなどが支援材料となり、TOPIXは上昇しました。

（国内債券市況）

国内債券市場では、国債利回りは、期間の初めと比べて総じて上昇（債券価格は下落）しました。

米国の地方銀行の経営破綻やスイスの大手金融グループの経営悪化への懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、日銀新総裁が就任会見において金融緩和政策を継続する考えを示したことなどから、利回りが低下（債券価格は上昇）する局面があったものの、日銀が金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールにおける長期金利の許容変動幅の拡大を決定したことや、米国の金融当局が預金者保護を表明したことおよび主要中央銀行による流動性供給などを受けて金融システムへの警戒感が和らいだこと、

F O M C後に公表されたF O M C参加者による政策金利の見通しの内容から、米国の金融引き締め長期化が意識され米国長期金利が上昇したこと、日銀が金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用をさらに柔軟化することを決め、長期金利の上限の目途を1%として一定の上昇を容認したことなどから、国債利回りは総じて上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

(当ファンド)

当ファンドは、信託財産の純資産総額の50%程度を国内株式へ投資する「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券、25%程度を短中期の国内債券、残りを短期金融資産で運用を行ないました。

(インデックス東証株式マザーファンド)

T O P I X（東証株価指数）配当込みに連動する投資成果を目標とし、「バーラ日本株式モデル」に基づいてポートフォリオを構築しました。期間を通じて、現物株式と株式先物取引を合わせた実質の株式組入比率を高位に保ちました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、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

(単位：円、1万円当たり、税込み)

項 目	第36期 2022年11月8日～ 2023年11月7日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.044%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,135

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、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合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資を継続し、原則として実質の株式組入比率を純資産総額の半分程度に維持する方針です。また、短中期の国内債券を純資産総額の4分の1程度組み入れ、残りを短期金融資産で運用する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

（インデックス東証株式マザーファンド）

引き続き、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込みとの連動をめざし、原則として「バーラ日本株式モデル」に基づいて構築したポートフォリオによる運用を継続します。また、一定期間ごとにポートフォリオの見直しなどを行ない、株式先物取引を含めた実質の株式組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年11月 8 日～2023年11月 7 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	62	0.572	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(26)	(0.242)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(26)	(0.242)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
(受 託 会 社)	(9)	(0.088)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.004	(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)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	62	0.576	
期中の平均基準価額は、10,773円です。			

(注) 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・解約により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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

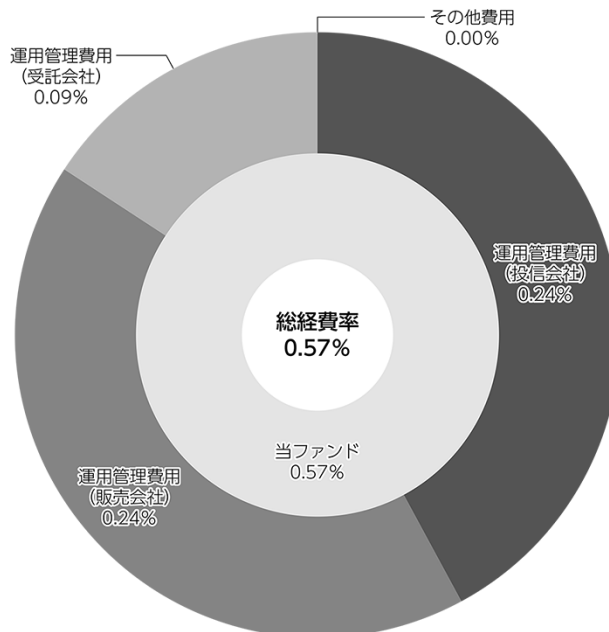
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（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除く。）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0.57%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 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) 「その他費用」には保管費用が含まれる場合があります。なお、「その他費用」の内訳は「1万口当たりの費用明細」にてご確認ください。ただし、期中の費用の総額と年率換算した値は一致しないことがあります。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2022年11月8日～2023年11月7日)

公社債

		買付額	売付額
国		千円	千円
内	地方債証券	—	18,023 (10,000)

(注) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
インデックス東証株式マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 15,710	千円 35,316

○株式売買比率

(2022年11月8日～2023年11月7日)

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
	インデックス東証株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,978,649千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,019,933千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.24

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2022年11月8日～2023年11月7日)

利害関係人の発行する有価証券等

<バランスポートフォリオ>

該当事項はございません。

<インデックス東証株式マザーファンド>

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	—	5	24

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、当ファンドに係る利害関係人とは三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2022年11月8日～2023年11月7日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況（2022年11月8日～2023年11月7日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細（2023年11月7日現在）

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
地方債証券	千円	千円	%	%	%	%	%
	26,000	26,124	19.8	—	—	—	19.8
	(26,000)	(26,124)	(19.8)	(—)	(—)	(—)	(19.8)
合 計	26,000	26,124	19.8	—	—	—	19.8
	(26,000)	(26,124)	(19.8)	(—)	(—)	(—)	(19.8)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第401回大阪府公募公債（10年）	0.477	15,000	15,078	2025/10/29
平成26年度第1回滋賀県公募公債	0.495	11,000	11,046	2024/11/28
合 計		26,000	26,124	

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
インデックス東証株式マザーファンド	40,905	25,194	66,438

(注) 親投資信託の2023年11月7日現在の受益権総口数は、3,211,761千口です。

○投資信託財産の構成

(2023年11月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	26,124	19.7
インデックス東証株式マザーファンド	66,438	50.1
コール・ローン等、その他	40,057	30.2
投資信託財産総額	132,619	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年11月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	132,619,751
コール・ローン等	40,031,168
公社債(評価額)	26,124,420
インデックス東証株式マザーファンド(評価額)	66,438,112
未収利息	26,051
(B) 負債	444,883
未払収益分配金	58,313
未払信託報酬	383,666
未払利息	5
その他未払費用	2,899
(C) 純資産総額(A－B)	132,174,868
元本	116,626,061
次期繰越損益金	15,548,807
(D) 受益権総口数	116,626,061口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,333円

(注) 当ファンドの期首元本額は170,903,379円、期中追加設定元本額は1,251,583円、期中一部解約元本額は55,528,901円です。

(注) 1口当たり純資産額は1,1333円です。

○損益の状況 (2022年11月8日～2023年11月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	128,379
受取利息	138,577
支払利息	△ 10,198
(B) 有価証券売買損益	13,749,651
売買益	14,652,266
売買損	△ 902,615
(C) 信託報酬等	△ 794,429
(D) 当期損益金(A+B+C)	13,083,601
(E) 前期繰越損益金	16,433,536
(F) 追加信託差損益金	△13,910,017
(配当等相当額)	(18,770,411)
(売買損益相当額)	(△32,680,428)
(G) 計(D+E+F)	15,607,120
(H) 収益分配金	△ 58,313
次期繰越損益金(G+H)	15,548,807
追加信託差損益金	△13,910,017
(配当等相当額)	(18,770,411)
(売買損益相当額)	(△32,680,428)
分配準備積立金	29,458,824

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 分配金の計算過程(2022年11月8日～2023年11月7日)は以下の通りです。

項 目	2022年11月8日～ 2023年11月7日
a. 配当等収益(経費控除後)	120,991円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	10,233,143円
c. 信託約款に定める収益調整金	18,770,411円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	19,163,003円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	48,287,548円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,140円
g. 分配金	58,313円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上し処理しています。

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	5円
-----------------	----

○お知らせ

約款変更について

2022年11月 8 日から2023年11月 7 日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、「ミリオン（従業員積立投資プラン）」制度の中で給与天引き専用にて取得申込を受け付けておりましたが、このたび販売会社においてミリオンを終了したことから、当社では商品性の見直しを行ない、販売会社を通じた累積投資専用の一般的な取得申込を受け付けるべく、2023年 2 月 8 日付けにて信託約款の一部に所要の変更を行ないました。
あわせて、分配金再投資時の適用基準価額は、決算日の基準価額であることを明確化するとともに、信託約款の附則にて所要の変更を行ないました。（第10条、附則第10条）

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

インデックス東証株式マザーファンド

運用報告書

第37期（決算日 2023年10月23日）
 （2022年10月22日～2023年10月23日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1986年10月22日から原則無期限です。
運用方針	わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（インデックス）をモデルとして運用を行ないます。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行ないません。

ファンド概要

投資成果をTOPIX（東証株価指数）配当込みの動きにできるだけ連動させるため、「バーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。

- ①投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行ないます。
- ②資金の流出入に伴う売買に当たっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、売却の場合は時価比率の低い銘柄から順番に行ないます。
- ③株式の組入比率は、高位を保ちます。

株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		TOPIX (東証株価指数) 配当込み		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 率			
	円	%		%	%	%	百万円
33期(2019年10月21日)	1,672	△ 1.5	2,480.43	△ 1.5	98.5	1.3	9,926
34期(2020年10月21日)	1,722	3.0	2,555.04	3.0	98.5	1.2	9,345
35期(2021年10月21日)	2,149	24.8	3,187.32	24.7	98.9	1.0	9,736
36期(2022年10月21日)	2,075	△ 3.4	3,078.70	△ 3.4	98.2	1.6	8,396
37期(2023年10月23日)	2,531	22.0	3,756.35	22.0	98.0	1.6	8,144

(注) 基準価額は1千口当たりです。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		TOPIX (東証株価指数) 配当込み		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2022年10月21日	2,075	—	3,078.70	—	98.2	1.6
10月末	2,127	2.5	3,156.44	2.5	98.0	1.6
11月末	2,190	5.5	3,249.61	5.6	98.5	1.2
12月末	2,090	0.7	3,101.25	0.7	98.9	1.0
2023年1月末	2,182	5.2	3,238.48	5.2	99.0	0.5
2月末	2,203	6.2	3,269.12	6.2	98.7	1.0
3月末	2,240	8.0	3,324.74	8.0	97.6	2.1
4月末	2,300	10.8	3,414.45	10.9	97.9	2.1
5月末	2,383	14.8	3,537.93	14.9	98.0	1.6
6月末	2,563	23.5	3,805.00	23.6	98.6	1.1
7月末	2,601	25.3	3,861.80	25.4	99.0	0.8
8月末	2,613	25.9	3,878.51	26.0	99.2	0.5
9月末	2,626	26.6	3,898.26	26.6	98.2	1.4
(期 末)						
2023年10月23日	2,531	22.0	3,756.35	22.0	98.0	1.6

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2022年10月22日～2023年10月23日)

基準価額の推移

期間の初め2,075円の基準価額は、期間末に2,531円となり、騰落率は+22.0%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・中国で新型コロナウイルスを抑え込むゼロコロナ政策が解除され、中国景気の回復が期待されたこと。
- ・日銀新総裁が就任会見において金融緩和政策を継続する考えを示したこと。
- ・国内企業の概ね堅調な決算内容を受けて投資家心理が改善したことに加え、国内株式市場の相対的な割安感を背景に海外投資家の買いが膨らんだこと。

<値下がり要因>

- ・欧米の金融機関の経営危機や破綻を契機とした欧米景気の悪化が警戒されたこと。
- ・日銀が金融政策決定会合において長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用の柔軟化を決定したことを背景に国内長期金利が上昇したこと。
- ・米国の堅調な経済指標を受けて米国の金融引き締め長期化が懸念されたこと。

(株式市況)

国内株式市場では、東証株価指数（TOPIX）は、期間の初めと比べて上昇しました。

期間の初めから2023年9月前半にかけては、欧米の金融機関の経営危機や破綻を契機とした欧米景気の悪化が警戒されたことや、日銀が金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用の柔軟化を決定したことを背景に国内長期金利が上昇したことなどが株価の重しとなりました。しかし、中国で新型コロナウイルスを抑え込むゼロコロナ政策が解除され、中国景気の回復が期待されたことや、米国の金融当局による預金者保護の表明や主要中央銀行による流動性供給などを受けて金融システムへの警戒感が和らいだこと、日銀新総裁が就任会見において金融緩和政策を継続する考えを示したこと、国内企業の概ね堅調な決算内容を受けて投資家心理が改善したこと、また、国内株式市場の相対的な割安感を背景に海外投資家の買いが膨らんだことなどが支援材料となり、TOPIXは上昇しました。9月後半から期間末にかけては、米国の堅調な経済指標を受けて米国の金融引き締め長期化が懸念されたことや、中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどが影響し、TOPIXは下落しました。



期 首	期中高値	期中安値	期 末
2022/10/21	2023/09/19	2023/01/04	2023/10/23
2,075円	2,723円	2,064円	2,531円

ポートフォリオ

ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込みに連動する投資成果を目標とし、「バーラ日本株式モデル」に基づいてポートフォリオを構築しました。期間を通じて、現物株式と株式先物取引を合わせた実質の株式組入比率を高位に保ちました。

当ファンドのベンチマークとの差異

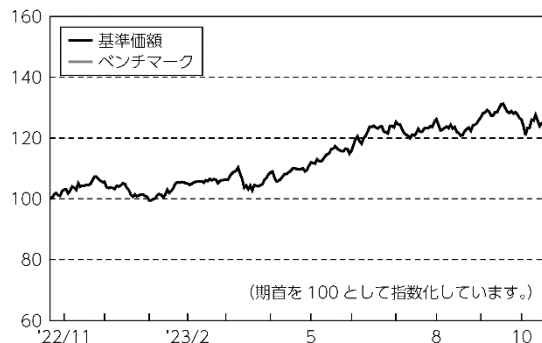
期間中における基準価額は、22.0%の値上がりとなり、ベンチマークである「ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込み」の上昇率22.0%と概ね同水準となりました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<マイナス要因>

- ・売買手数料などの諸費用。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○今後の運用方針

ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込みに連動する投資成果を目標とし、「バーラ日本株式モデル」に基づいてポートフォリオを構築します。期間を通じて、現物株式と株式先物取引を合わせた実質の株式組入比率を高位に保つ方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○ 1 千口当たりの費用明細

(2022年10月22日～2023年10月23日)

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)	円 0 (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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(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、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、2,343円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1千口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○ 売買及び取引の状況

(2022年10月22日～2023年10月23日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 173 (972)	千円 301,147 (120)	千株 824	千円 1,944,839

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) () 内は株式分割、予約権行使、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。

新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内		証 券 — (300)	千円 — (一)	証 券 — (300)	千円 — (一)

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) () 内は新株予約権の付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

先物取引の種類別取引状況

種 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 1,312	百万円 1,330	百万円 —	百万円 —

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2022年10月22日～2023年10月23日)

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	2,245,986千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,047,131千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.27

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2022年10月22日～2023年10月23日)

利害関係人の発行する有価証券等

種 別	買 付 額	売 付 額	当 期 未 保 有 額
株式	百万円 —	百万円 5	百万円 24

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、当ファンドに係る利害関係人とは三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2022年10月22日～2023年10月23日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2023年10月23日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	0.2	0.1	370
ニッスイ	4.3	3.7	2,607
マルハニチロ	0.6	0.5	1,229
雪国まいたけ	0.3	0.3	262
カネコ種苗	0.1	0.1	139
サカタのタネ	0.5	0.4	1,628
ホクト	0.3	0.3	537
ホクリヨウ	0.1	0.1	103
鉱業 (0.4%)			
住石ホールディングス	0.6	0.4	193
日鉄鉱業	0.2	0.1	450
三井松島ホールディングス	0.2	0.2	510
I N P E X	14.8	13	28,281
石油資源開発	0.5	0.4	2,088
K&Oエナジーグループ	0.2	0.2	475
建設業 (2.1%)			
ショーボンドホールディングス	0.5	0.5	2,796
ミライト・ワン	1.5	1.2	2,322
タマホーム	0.3	0.2	655
サンヨーホームズ	0.1	—	—
日本アクア	0.2	0.1	91
ファーストコーポレーション	0.1	0.1	73
ベステラ	0.1	0.1	100
キャンディル	0.1	0.1	54
ダイセキ環境ソリューション	0.1	0.1	96
第一カッター興業	0.1	0.1	120
安藤・間	2.1	2	2,278
東急建設	1.2	1	728
コムシスホールディングス	1.5	1.1	3,349
ビーアールホールディングス	0.6	0.6	216
高松コンストラクショングループ	0.3	0.2	553
東建コーポレーション	0.1	0.1	775
ソネット	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマウラ	0.2	0.2	241
オリエンタル白石	1.6	1.3	422
大成建設	3	2.3	11,240
大林組	10	8.8	10,960
清水建設	9.2	7	7,161
飛鳥建設	0.3	0.3	385
長谷工コーポレーション	2.9	2.5	4,593
松井建設	0.4	0.2	150
鹿島建設	7.3	5.5	13,068
不動テトラ	0.2	0.2	388
大木建設	0.1	0.1	142
鉄建建設	0.2	0.2	396
西松建設	0.7	0.4	1,383
三井住友建設	2.4	2	770
大豊建設	0.2	0.1	388
佐田建設	0.3	0.1	59
ナカノフドー建設	0.3	0.1	38
奥村組	0.5	0.4	1,736
東鉄工業	0.4	0.4	1,148
イチケン	0.1	—	—
富士ビー・エス	0.2	0.1	44
浅沼組	0.2	0.2	705
戸田建設	4.1	3	2,370
熊谷組	0.5	0.4	1,440
北野建設	0.1	—	—
植木組	0.1	0.1	142
矢作建設工業	0.4	0.3	370
ビーエス三菱	0.4	0.3	235
日本ハウスホールディングス	0.6	0.5	183
新日本建設	0.5	0.3	350
東亜道路工業	0.1	0.1	538
日本道路	0.1	0.3	546
東亜建設工業	0.2	0.2	719
日本国土開発	0.9	0.7	408

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
若築建設	0.2	0.1	288
東洋建設	1.2	0.8	980
五洋建設	4	3.5	2,920
世紀東急工業	0.6	0.3	465
福田組	0.1	0.1	478
住友林業	2.1	2.1	7,284
日本基礎技術	0.3	0.1	44
巴コーポレーション	0.4	0.2	113
大和ハウス工業	8.5	6.8	26,948
ライト工業	0.6	0.5	943
積水ハウス	10.2	7.5	21,300
日特建設	0.2	0.2	205
北陸電気工事	0.2	0.2	193
ユアテック	0.6	0.5	465
日本リーテック	0.2	0.2	249
四電工	0.1	0.1	286
中電工	0.4	0.4	947
関電工	1.8	1.3	1,703
きんでん	2.2	1.7	3,589
東京エネシス	0.3	0.2	190
トーエネック	0.1	0.1	402
住友電設	0.3	0.2	534
日本電設工業	0.5	0.4	798
エクシオグループ	1.5	1.1	3,278
新日本空調	0.2	0.1	231
九電工	0.7	0.6	2,665
三機工業	0.7	0.6	985
日揮ホールディングス	3	2.4	4,414
中外炉工業	0.1	0.1	208
ヤマト	0.3	0.2	178
太平電業	0.2	0.2	787
高砂熱学工業	0.8	0.6	1,657
朝日工業社	0.1	0.1	238
明星工業	0.5	0.4	394
大気社	0.5	0.3	1,321
ダイダン	0.2	0.3	429
日比谷総合設備	0.3	0.2	444
フィル・カンパニー	0.1	0.1	56

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
テスホールディングス	0.3	0.5	228
インフロニア・ホールディングス	3.7	2.6	3,983
東洋エンジニアリング	0.5	0.3	175
レイズネクスト	0.5	0.4	572
食料品 (3.5%)			
ニッポン	0.8	0.7	1,510
日清製粉グループ本社	3.2	2.3	4,197
日東富士製粉	0.1	—	—
昭和産業	0.3	0.2	589
鳥越製粉	0.3	0.1	68
中部飼料	0.3	0.3	321
フィード・ワン	0.4	0.3	224
東洋精糖	0.1	—	—
日本甜菜製糖	0.2	0.1	184
DM三井製糖ホールディングス	0.3	0.2	579
塩水港精糖	0.5	0.2	47
ウエルネオシュガー	0.2	0.1	200
森永製菓	0.7	0.4	2,093
中村屋	0.1	0.1	308
江崎グリコ	0.8	0.7	2,920
名糖産業	0.1	0.1	159
井村屋グループ	0.2	0.1	226
不二家	0.2	0.2	492
山崎製パン	1.9	1.7	4,620
第一屋製パン	0.1	—	—
モロゾフ	0.1	0.1	367
亀田製菓	0.2	0.2	799
寿スビリッツ	0.3	1.4	2,823
カルビー	1.6	1.1	2,976
森永乳業	0.6	0.5	2,771
六甲バター	0.2	0.2	273
ヤクルト本社	2.2	3.6	12,668
明治ホールディングス	1.9	3	11,100
雪印メグミルク	0.8	0.6	1,371
プリマハム	0.4	0.3	683
日本ハム	1.2	1	4,321
林兼産業	0.1	0.1	53
丸大食品	0.3	0.2	324

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
S F o o d s	0.3	0.3	918
柿安本店	0.1	0.1	246
伊藤ハム米久ホールディングス	2.2	0.3	1,221
サッポロホールディングス	0.9	0.8	4,008
アサヒグループホールディングス	6.5	5.7	30,210
麒麟ホールディングス	12.6	10.3	21,300
宝ホールディングス	1.9	1.7	2,064
オエノンホールディングス	0.8	0.7	260
養命酒製造	0.1	0.1	182
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	2.2	1.9	3,627
サントリー食品インターナショナル	2	1.8	7,812
ダイドーグループホールディングス	0.2	0.1	554
伊藤園	1	0.8	3,848
キーコーヒー	0.3	0.3	604
ユニカフェ	0.1	0.1	94
ジャパンフーズ	0.1	—	—
日清オイリオグループ	0.4	0.3	1,194
不二製油グループ本社	0.7	0.6	1,347
Jーオイルミルズ	0.3	0.2	342
キッコーマン	2.1	1.6	13,254
味の素	6.8	6	33,360
ブルドックソース	0.1	0.1	202
キュービー	1.5	1.3	3,303
ハウス食品グループ本社	1.1	0.8	2,508
カゴメ	1.3	1.1	3,386
焼津水産化学工業	0.2	0.1	119
アリアケジャパン	0.3	0.2	928
エバラ食品工業	0.1	0.1	287
ニチレイ	1.3	1.1	3,540
東洋水産	1.5	1.3	8,031
イートアンドホールディングス	0.1	0.1	195
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.2	0.2	187
日清食品ホールディングス	1.1	0.9	11,133
永谷園ホールディングス	0.2	0.1	219
一正蒲鉾	0.2	0.1	73
フジッコ	0.3	0.2	379
ロック・フィールド	0.4	0.3	452
日本たばこ産業	18.4	15	51,435

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ケンコーマヨネーズ	0.2	0.2	299
わらべや日洋ホールディングス	0.2	0.2	624
なとり	0.2	0.1	196
イフジ産業	0.1	—	—
ファーマフーズ	0.4	0.4	539
ユーグレナ	1.8	1.5	1,071
紀文食品	0.3	0.2	222
ビックルスホールディングス	0.2	0.1	115
ミヨシ油脂	0.1	0.1	121
理研ビタミン	0.2	0.2	434
繊維製品 (0.4%)			
片倉工業	0.3	0.3	511
ゲンゼ	0.2	0.2	895
東洋紡	1.3	1.1	1,101
ユニチカ	0.9	0.9	164
富士紡ホールディングス	0.1	0.1	348
倉敷紡績	0.2	0.2	452
シキボウ	0.1	0.1	106
日本毛織	0.8	0.7	959
ダイトウボウ	0.7	0.7	62
トーア紡コーポレーション	0.2	0.2	85
ダイドーリミテッド	0.4	0.4	136
帝国繊維	0.3	0.3	549
帝人	2.9	2.4	3,271
東レ	20.8	16.8	12,043
住江織物	0.1	—	—
日本フェルト	0.2	0.2	83
アツギ	0.2	0.2	83
ダイニック	0.1	—	—
セーレン	0.6	0.5	1,062
ソトー	0.1	—	—
東海染工	0.1	—	—
小松マテーレ	0.5	0.4	284
ワコールホールディングス	0.7	0.5	1,718
ホギメディカル	0.4	0.3	975
クラウディアホールディングス	0.1	—	—
T S I ホールディングス	1	0.8	612
マツオカコーポレーション	0.1	0.1	159

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ワールド	0.5	0.3	455
三陽商会	0.1	0.1	256
ナイガイ	0.2	—	—
オンワードホールディングス	1.9	1.6	736
ルックホールディングス	0.1	0.1	196
ゴールドウイン	0.6	0.4	3,884
デサント	0.6	0.4	1,728
キング	0.1	0.1	65
ヤマトインターナショナル	0.3	0.3	88
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	0.2	0.1	342
王子ホールディングス	12.9	10.4	6,432
日本製紙	1.4	1.3	1,677
三菱製紙	0.4	0.3	167
北越コーポレーション	2	1.6	1,675
中越パルプ工業	0.1	0.1	129
巴川製紙所	0.1	—	—
大王製紙	1.4	1.1	1,308
阿波製紙	0.1	0.1	46
レンゴー	2.6	2.3	2,258
トーモク	0.2	0.1	224
ザ・バック	0.2	0.2	638
化学 (5.8%)			
北の達人コーポレーション	1.2	1	187
クラレ	4.5	3.6	6,136
旭化成	20.7	15.7	14,287
共和レザー	0.2	0.1	58
巴川製紙所	—	0.1	64
レゾナック・ホールディングス	2.7	2.4	5,854
住友化学	22.8	18.6	7,395
住友精化	0.1	0.1	438
日産化学	1.5	1.2	7,569
ラサ工業	0.1	0.1	196
クレハ	0.2	0.2	1,810
多木化学	0.1	0.1	335
テイカ	0.2	0.2	323
石原産業	0.6	0.5	692
片倉コープアグリ	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本曹達	0.4	0.3	1,605
東ソー	4.1	3.3	5,946
トクヤマ	1	0.8	1,801
セントラル硝子	0.5	0.4	1,138
東亜合成	1.5	1.3	1,726
大阪ソーダ	0.3	0.1	835
関東電化工業	0.6	0.5	402
デンカ	1.1	0.9	2,428
信越化学工業	5.3	20.9	88,929
日本カーバイド工業	0.1	0.1	169
堺化学工業	0.2	0.2	403
第一稀元素化学工業	0.3	0.2	186
エア・ウォーター	2.7	2.4	4,365
日本酸素ホールディングス	2.8	2.4	8,784
日本化学工業	0.1	0.1	188
東邦アセチレン	0.1	—	—
日本バーカライジング	1.4	1.2	1,294
高圧ガス工業	0.5	0.4	302
四国化成ホールディングス	0.4	0.3	503
戸田工業	0.1	0.1	170
ステラ ケミファ	0.2	0.1	314
保土谷化学工業	0.1	0.1	295
日本触媒	0.5	0.4	2,164
大日精化工業	0.2	0.2	429
カネカ	0.7	0.6	2,232
三菱瓦斯化学	2.6	1.9	3,784
三井化学	2.6	2.1	7,572
J S R	2.9	2.3	9,246
東京応化工業	0.5	0.4	3,381
大阪有機化学工業	0.2	0.2	496
三菱ケミカルグループ	20.8	17	14,426
K H ネオケム	0.5	0.4	874
ダイセル	4.5	3.5	4,301
住友ペークライト	0.5	0.4	2,649
積水化学工業	6.4	5.1	10,253
日本ゼオン	2.4	1.5	2,252
アイカ工業	0.8	0.6	1,959
U B E	1.6	1.3	2,955

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
積水樹脂	0.4	0.4	956
タキロンシーアイ	0.7	0.5	280
旭有機材	0.2	0.2	700
ニチバン	0.2	0.2	357
リケンテクノス	0.7	0.5	355
大倉工業	0.1	0.1	258
積水化成成品工業	0.4	0.4	173
群栄化学工業	0.1	0.1	311
タイガースポリマー	0.2	0.1	61
ミライアル	0.1	0.1	135
ダイキアクシス	0.1	0.1	72
ダイキョーニシカワ	0.7	0.6	450
竹本容器	0.1	0.1	78
森六ホールディングス	0.2	0.1	230
恵和	0.1	0.2	258
日本化薬	2.3	1.9	2,377
カーリットホールディングス	0.3	0.2	188
日本精化	0.2	0.1	261
扶桑化学工業	0.3	0.2	809
トリケミカル研究所	0.3	0.3	988
ADEKA	1.3	0.9	2,338
日油	1	0.8	4,778
新日本理化	0.4	0.3	61
ハリマ化成グループ	0.2	0.1	79
花王	7.1	5.7	31,275
第一工業製薬	0.1	0.1	163
石原ケミカル	0.2	0.1	159
日華化学	0.2	0.1	89
ニイタカ	0.1	—	—
三洋化成工業	0.2	0.2	782
有機合成薬品工業	0.2	0.2	57
大日本塗料	0.4	0.3	280
日本ペイントホールディングス	12.6	13.3	12,752
関西ペイント	2.9	2	4,408
神東塗料	0.3	0.3	37
中国塗料	0.7	0.4	519
日本特殊塗料	0.2	0.1	119
藤倉化成	0.5	0.4	172

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
太陽ホールディングス	0.5	0.4	966
D I C	1.1	1	2,368
サカタインクス	0.6	0.6	718
東洋インキＳＣホールディングス	0.5	0.5	1,207
T&K TOKA	0.3	0.2	283
富士フイルムホールディングス	6	4.8	40,209
資生堂	5.9	5.3	25,789
ライオン	3.4	3.3	4,723
高砂香料工業	0.2	0.2	604
マンダム	0.7	0.5	681
ミルボン	0.4	0.3	1,209
ファンケル	1.4	1.1	2,479
コーセー	0.6	0.5	5,065
コタ	0.2	0.2	321
シーボン	0.1	—	—
ポーラ・オルビスホールディングス	1.5	1.3	2,173
ノエビアホールディングス	0.3	0.2	1,046
アジュバンホールディングス	0.1	—	—
新日本製薬	0.2	0.1	147
アクシージア	—	0.1	96
エステー	0.2	0.2	299
アグロ カネショウ	0.1	0.1	127
コニシ	0.5	0.4	871
長谷川香料	0.6	0.5	1,510
星光PMC	0.2	0.1	106
小林製薬	0.9	0.7	4,341
荒川化学工業	0.2	0.2	200
メック	0.2	0.2	694
日本高純度化学	0.1	0.1	246
タカラバイオ	0.9	0.7	895
J C U	0.3	0.3	946
新田ゼラチン	0.2	0.1	66
O A Tアグリオ	0.1	0.1	177
デクセリアルズ	0.9	0.7	2,579
アース製薬	0.3	0.2	1,010
北興化学工業	0.3	0.3	270
大成ラミック	0.1	0.1	296
クミアイ化学工業	1.1	1	1,125

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本農薬	0.6	0.5	322
アキレス	0.2	0.2	298
有沢製作所	0.5	0.4	425
日東電工	2.1	1.8	16,826
レック	0.4	0.4	388
三光合成	0.4	0.3	159
きもと	0.6	0.3	54
藤森工業	0.3	0.2	748
前澤化成工業	0.2	0.2	296
未来工業	0.1	0.1	351
ウェーブロックホールディングス	0.1	0.1	61
J S P	0.2	0.2	376
エフピコ	0.6	0.5	1,277
天馬	0.3	0.2	485
信越ポリマー	0.6	0.5	652
東リ	0.7	0.4	136
ニフコ	1.1	0.9	3,348
バルカー	0.3	0.2	776
ユニ・チャーム	5.9	5.2	26,358
ショーエイコーポレーション	0.1	0.1	58
医薬品 (5.1%)			
協和キリン	3.4	3	7,137
武田薬品工業	26.9	22.3	97,138
アステラス製薬	29.3	23.8	46,017
住友ファーマ	2.1	1.8	867
塩野義製薬	4	3.2	22,150
わかもと製薬	0.4	0.1	21
日本新薬	0.8	0.6	3,349
中外製薬	8.9	7.9	35,700
科研製薬	0.5	0.4	1,344
エーザイ	3.8	3.1	25,162
ロート製薬	1.6	2.4	8,227
小野薬品工業	6.6	4.8	12,650
久光製薬	0.7	0.6	2,916
持田製薬	0.4	0.3	997
参天製薬	6	4.5	5,791
扶桑薬品工業	0.1	0.1	191
ツムラ	1	0.8	2,099

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キッセイ薬品工業	0.5	0.4	1,286
生化学工業	0.6	0.5	387
栄研化学	0.5	0.4	577
鳥居薬品	0.2	0.1	379
J C R ファーマ	1	0.8	900
東和薬品	0.5	0.4	1,084
富士製薬工業	0.2	0.2	227
ゼリア新薬工業	0.5	0.3	598
そーせいグループ	—	0.8	1,059
第一三共	24.9	21.9	92,308
杏林製薬	0.6	0.5	894
大幸薬品	0.5	0.5	160
ダイト	0.2	0.2	380
大塚ホールディングス	6.5	5.2	26,067
大正製薬ホールディングス	0.6	0.6	3,593
ペプチドリーム	1.4	1.2	1,514
あすか製薬ホールディングス	0.3	0.2	336
サワイグループホールディングス	0.7	0.6	2,781
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	2.8	2.3	236
ニチレキ	0.3	0.2	406
ユシロ化学工業	0.2	0.1	144
ビービー・カストロール	0.1	0.1	89
富士石油	0.8	0.6	187
MORESCO	0.1	0.1	119
出光興産	3.5	2.8	9,108
ENEOSホールディングス	51.5	42.6	23,344
コスモエネルギーホールディングス	1.4	1	5,181
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	1.6	1.2	3,360
TOYO TIRE	1.6	1.4	3,133
ブリヂストン	9.1	7.4	42,564
住友ゴム工業	2.8	2.4	3,613
藤倉コンボジット	0.3	0.1	112
オカモト	0.2	0.1	509
フコク	0.1	0.1	143
ニッタ	0.3	0.3	1,011
住友理工	0.7	0.5	502

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三ツ星ベルト	0.4	0.4	1,732
バンドー化学	0.6	0.4	590
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日東紡績	0.4	0.3	1,059
A G C	2.9	2.4	12,261
日本板硝子	1.5	1.3	855
日本山村硝子	0.1	0.1	153
日本電気硝子	1.2	1	2,763
オハラ	0.1	0.1	131
住友大阪セメント	0.5	0.4	1,375
太平洋セメント	1.9	1.6	3,980
日本ヒューム	0.3	0.2	171
日本コンクリート工業	0.4	0.5	148
三谷セキサン	0.1	0.1	428
アジアパイルホールディングス	0.4	0.4	264
東海カーボン	2.4	2.3	2,579
日本カーボン	0.2	0.1	439
東洋炭素	0.2	0.2	1,018
ノリタケカンパニーリミテド	0.2	0.1	579
T O T O	2.1	1.7	6,147
日本碍子	3.4	2.9	5,130
日本特殊陶業	2.4	1.9	6,036
ダントーホールディングス	0.2	0.1	76
MARUWA	0.1	0.1	2,176
品川リフラクトリーズ	0.1	0.5	706
黒崎播磨	0.1	—	—
ヨータイ	0.2	0.1	140
東京窯業	0.3	0.1	32
ニッカトー	0.1	0.1	59
フジミインコーポレーテッド	0.3	0.6	1,710
クニミネ工業	0.1	—	—
エーアンドエーマテリアル	0.1	—	—
ニチアス	0.7	0.6	1,800
ニチハ	0.4	0.3	870
鉄鋼 (1.0%)			
日本製鉄	14.1	11.6	36,470
神戸製鋼所	5.9	5.2	9,066
中山製鋼所	0.5	0.6	493

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
合同製鐵	0.1	0.1	408
J F Eホールディングス	7.8	7.2	14,576
東京製鐵	1	0.7	1,130
共英製鋼	0.3	0.3	541
大和工業	0.6	0.4	2,740
東京鐵鋼	0.1	0.1	323
大阪製鐵	0.2	0.1	167
淀川製鋼所	0.4	0.3	1,030
中部鋼板	—	0.2	403
丸一鋼管	1	0.8	2,892
モリ工業	0.1	—	—
大同特殊鋼	0.5	0.3	1,718
日本高周波鋼業	0.1	0.2	123
日本冶金工業	0.2	0.2	816
山陽特殊製鋼	0.3	0.3	771
愛知製鋼	0.2	0.2	731
日立金属	3.7	—	—
日本金属	0.1	0.1	84
大平洋金属	0.2	0.2	244
新日本電工	1.7	1.4	393
栗本鐵工所	0.1	0.1	280
三菱製鋼	0.2	0.2	272
日亜鋼業	0.4	0.3	84
エンビプロ・ホールディングス	0.2	0.2	121
シンニッタン	0.4	0.3	72
新家工業	0.1	0.1	305
非鉄金属 (0.6%)			
大紀アルミニウム工業所	0.4	0.3	358
日本軽金属ホールディングス	0.8	0.7	1,085
三井金属鉱業	0.9	0.7	2,589
東邦亜鉛	0.2	0.1	157
三菱マテリアル	2	1.7	3,918
住友金属鉱山	3.7	3	12,192
DOWAホールディングス	0.8	0.6	2,672
古河機械金属	0.5	0.4	762
エス・サイエンス	1	0.5	11
大阪チタニウムテクノロジーズ	0.4	0.4	1,186
東邦チタニウム	0.6	0.5	869

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
UACJ	0.5	0.4	1,170
CKサンエツ	0.1	0.1	353
古河電気工業	1	0.8	1,814
住友電気工業	11.8	8.9	14,311
フジクラ	3.8	2.8	3,140
SWCC	0.3	0.3	591
東京特殊電線	0.1	—	—
タツタ電線	0.5	0.5	346
平河ヒューテック	0.2	0.1	144
リョービ	0.3	0.3	806
アーレスティ	0.3	0.2	134
AREホールディングス	1.3	1	1,838
金属製品 (0.5%)			
稲葉製作所	0.2	0.1	147
宮地エンジニアリンググループ	0.1	0.2	607
トーカロ	0.9	0.7	938
アルファC o	0.1	0.1	135
SUMCO	5.6	4.6	8,979
川田テクノロジーズ	0.1	0.1	622
RS Technologies	0.1	0.2	515
信和	0.2	0.1	74
東洋製織グループホールディングス	1.7	1.5	3,654
ホッカンホールディングス	0.1	0.1	152
コロナ	0.1	0.1	90
横河ブリッジホールディングス	0.5	0.3	792
駒井ハルテック	0.1	—	—
三和ホールディングス	3.2	2.4	4,748
文化シャッター	1	0.8	892
三協立山	0.4	0.3	228
アルインコ	0.2	0.2	191
東洋シャッター	0.1	—	—
LIXIL	4.9	3.8	6,178
日本フィルコン	0.2	0.1	47
ノーリツ	0.4	0.4	616
長府製作所	0.3	0.3	633
リンナイ	0.6	1.4	3,740
ダイニチ工業	0.2	0.1	70
日東精工	0.4	0.4	225

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
岡部	0.4	0.5	357
ジーテクト	0.4	0.3	519
東ブレ	0.5	0.5	795
高周波熱練	0.5	0.4	396
東京製綱	0.2	0.1	134
サンコール	0.3	0.1	48
モリテック スチール	0.3	0.1	28
パイオラックス	0.4	0.4	851
エイチワン	0.3	0.3	232
日本発條	2.8	2.3	2,408
中央発條	0.2	0.2	143
アドパネクス	0.1	—	—
立川ブラインド工業	0.1	0.1	136
三益半導体工業	0.3	0.2	501
機械 (5.3%)			
日本ドライケミカル	0.1	—	—
日本製鋼所	0.9	0.7	1,758
三浦工業	1.3	1.1	3,200
タクマ	1	0.8	1,156
ツガミ	0.7	0.6	660
オークマ	0.3	0.3	1,932
芝浦機械	0.4	0.3	1,146
アマダ	5.4	4.1	6,010
アイダエンジニアリング	0.8	0.6	542
TAKISAWA	0.1	—	—
FUJ I	1.4	1.1	2,551
牧野フライス製作所	0.3	0.3	1,848
オーエスジー	1.4	1.1	1,882
旭ダイヤモンド工業	0.9	0.7	562
DMG森精機	1.8	1.5	3,666
ソディック	0.8	0.7	533
ディスコ	0.5	1.2	34,290
日東工器	0.2	0.1	190
日進工具	0.3	0.2	214
パンチ工業	0.3	0.2	81
富士ダイス	0.2	0.1	63
豊和工業	0.2	0.1	74
ニデックオーケーケー	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
石川製作所	0.1	0.1	118
リケンNPR	—	0.2	339
東洋機械金属	0.2	0.2	132
エンシュウ	0.1	0.1	74
島精機製作所	0.5	0.4	647
オプトラン	0.4	0.4	712
NCホールディングス	0.1	—	—
イワキポンプ	0.2	0.2	360
ブリュー	0.3	0.3	441
ヤマシンフィルタ	0.6	0.7	206
日阪製作所	0.3	0.3	283
やまびこ	0.5	0.4	549
野村マイクロ・サイエンス	0.1	0.1	561
平田機工	0.1	0.1	678
PEGASUS	0.4	0.3	178
マルマエ	0.1	0.1	132
タツモ	0.2	0.2	574
ナブテスコ	1.8	1.6	4,275
三井海洋開発	0.4	0.3	496
レオン自動機	0.4	0.3	388
SMC	1	0.8	55,064
ホソカワミクロン	0.2	0.2	814
ユニオンツール	0.1	0.1	366
オイレス工業	0.4	0.4	761
日精エー・エス・ビー機械	0.1	0.1	450
サトーホールディングス	0.4	0.4	814
技研製作所	0.3	0.3	552
日本エアータック	0.1	0.1	131
カワタ	0.1	—	—
日精樹脂工業	0.2	0.2	204
オカダアイヨン	0.1	—	—
ワイエイシイホールディングス	0.1	0.1	237
小松製作所	15.5	11.9	44,315
住友重機械工業	1.8	1.5	5,311
日立建機	1.4	1	4,033
日工	0.4	0.4	259
巴工業	0.1	0.1	277
井関農機	0.3	0.3	324

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TOWA	0.3	0.3	1,593
丸山製作所	0.1	—	—
北川鉄工所	0.1	0.1	140
ローツェ	0.2	0.1	1,163
タカキタ	0.1	—	—
クボタ	15.3	13.4	26,746
荏原実業	0.1	0.1	258
三菱化工機	0.1	0.1	264
月島ホールディングス	0.5	0.4	494
帝国電機製作所	0.2	0.2	478
東京機械製作所	0.2	0.1	50
新東工業	0.7	0.5	520
澁谷工業	0.3	0.2	481
アイチ コーポレーション	0.5	0.4	367
小森コーポレーション	0.8	0.6	618
鶴見製作所	0.2	0.2	629
住友精密工業	0.1	—	—
日本ギア工業	0.1	0.2	73
酒井重工業	0.1	—	—
荏原製作所	1.2	1	6,532
西島製作所	0.3	0.2	356
北越工業	0.3	0.3	549
ダイキン工業	3.7	3	64,785
オルガノ	0.4	0.4	1,532
トーヨーカネツ	0.1	0.1	329
栗田工業	1.7	1.4	6,197
椿本チエイン	0.5	0.4	1,530
大同工業	0.1	—	—
木村化工機	0.3	0.2	138
アネスト岩田	0.5	0.5	555
ダイフク	1.6	4	10,144
サムコ	0.1	0.1	427
加藤製作所	0.2	0.1	117
油研工業	0.1	—	—
タダノ	1.7	1.5	1,710
フジテック	1.1	0.9	2,896
CKD	0.9	0.7	1,393
キトー	0.3	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
平和	1	0.9	1,884
理想科学工業	0.3	0.2	464
SANKYO	0.7	0.5	3,073
日本金銭機械	0.4	0.3	284
マースグループホールディングス	0.2	0.2	502
フクシマガリレイ	0.2	0.2	951
オーイズミ	0.1	—	—
ダイコク電機	0.2	0.1	416
竹内製作所	0.5	0.5	2,195
アマノ	0.9	0.7	2,167
JUKI	0.5	0.4	235
サンデン	0.5	0.5	91
ジャノメ	0.3	0.3	204
マックス	0.4	0.3	749
グローリー	0.8	0.6	1,648
新晃工業	0.3	0.3	634
大和冷機工業	0.5	0.4	524
セガサミーホールディングス	3.1	2.1	4,933
日本ビストンリング	0.1	—	—
リケン	0.1	—	—
TPR	0.4	0.3	517
ツバキ・ナカシマ	0.7	0.5	349
ホシザキ	1.9	1.5	7,155
大豊工業	0.3	0.3	238
日本精工	5.9	4.3	3,509
NTN	6.3	5.1	1,366
ジェイテクト	3	2.3	2,916
不二越	0.2	0.2	739
日本トムソン	0.8	0.7	379
THK	1.7	1.5	4,056
ユースイン精機	0.3	0.3	199
前澤給装工業	0.2	0.2	251
イーグル工業	0.4	0.3	491
前澤工業	0.2	0.1	87
日本ビラー工業	0.3	0.2	731
キッツ	1.1	0.9	899
マキタ	3.9	3.2	11,545
三井E&S	1.3	1.3	544

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立造船	2.7	2.1	1,644
三菱重工業	5	4.5	35,068
IHI	2.2	1.6	4,428
サノヤスホールディングス	0.4	0.5	66
スター精密	0.6	0.5	921
電気機器 (16.9%)			
日清紡ホールディングス	2.3	1.9	2,077
イビデン	1.6	1.5	10,785
コニカミノルタ	7	5.7	2,535
ブラザー工業	3.9	3.4	7,991
ミネベアミツミ	5.4	4.4	10,241
日立製作所	16.5	12.3	107,145
東芝	6	4.9	22,544
三菱電機	32	26.2	45,496
富士電機	1.9	1.5	9,241
東洋電機製造	0.1	0.1	93
安川電機	3.4	3	15,201
シンフォニアテクノロジー	0.4	0.3	457
明電舎	0.5	0.4	806
オリジン	0.1	0.1	124
山洋電気	0.1	0.1	608
デンヨー	0.2	0.2	418
PHCホールディングス	0.5	0.3	433
ソシオネクスト	—	0.4	5,724
東芝テック	0.4	0.4	1,270
芝浦メカトロニクス	0.1	—	—
マブチモーター	0.7	0.6	2,604
ニデック	7.6	6.2	41,540
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.1	0.2	86
トレックス・セミコンダクター	0.2	0.1	192
東光高岳	0.2	0.2	377
ダブル・スコープ	0.9	0.8	757
ダイヘン	0.3	0.2	938
ヤーマン	0.6	0.4	406
JVCケンウッド	2.9	2.3	1,453
ミマキエンジニアリング	0.3	0.3	221
IPEX	0.2	0.2	299
日新電機	0.8	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大崎電気工業	0.6	0.6	380
オムロン	2.8	2.3	14,089
日東工業	0.4	0.3	1,023
I D E C	0.4	0.4	1,086
正興電機製作所	0.1	0.1	112
不二電機工業	0.1	0.1	109
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1	0.8	1,943
サクサホールディングス	0.1	—	—
メルコホールディングス	0.1	0.1	326
テクノメディカ	0.1	0.1	219
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	0.1	0.1	79
日本電気	4.1	3.6	27,154
富士通	3.1	2.5	42,325
沖電気工業	1.3	1.1	1,007
岩崎通信機	0.1	0.1	78
電気興業	0.2	0.1	245
サンケン電気	0.3	0.2	1,544
ナカヨ	—	0.1	120
アイホン	0.2	0.2	596
ルネサスエレクトロニクス	18.7	16.5	36,110
セイコーエプソン	3.8	3.2	7,212
ワコム	2.6	1.9	1,010
アルバック	0.7	0.6	3,252
アクセル	0.1	0.1	179
E I Z O	0.2	0.2	958
日本信号	0.7	0.6	543
京三製作所	0.7	0.6	285
能美防災	0.4	0.3	528
ホーチキ	0.2	0.2	322
星和電機	0.1	0.1	47
エレコム	0.8	0.6	1,022
パナソニック ホールディングス	36.5	29.9	44,087
シャープ	3.3	3.1	2,905
アンリツ	2.2	1.8	1,770
富士通ゼネラル	0.9	0.7	1,821
ソニーグループ	21.5	17.8	221,432
TDK	5	4	22,400
帝国通信工業	0.1	0.1	179

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タムラ製作所	1.2	1.1	539
アルプスアルパイン	2.8	2.3	2,816
池上通信機	0.1	0.1	84
日本電波工業	0.4	0.3	364
鈴木	0.2	0.2	222
メイコー	0.4	0.3	958
日本トリム	0.1	0.1	295
ローランド ディー. ジー.	0.2	0.1	326
フォスター電機	0.3	0.3	280
SMK	0.1	0.1	233
ヨコオ	0.2	0.2	266
ティアック	0.3	0.6	65
ホシデン	0.8	0.6	1,048
ヒロセ電機	0.5	0.4	6,932
日本航空電子工業	0.7	0.5	1,433
T O A	0.4	0.3	309
マクセル	0.6	0.5	796
古野電気	0.4	0.3	489
スミダコーポレーション	0.3	0.3	385
アイコム	0.1	0.1	350
リオン	0.1	0.1	234
横河電機	3.1	2.8	7,574
新電元工業	0.1	0.1	291
アズビル	2	1.8	8,026
東亜ディーケーケー	0.2	0.1	85
日本光電工業	1.3	1.1	3,841
チノー	0.1	0.1	201
共和電業	0.2	0.2	74
日本電子材料	0.2	0.2	276
堀場製作所	0.6	0.5	3,807
アドバンテスト	2.5	7.9	32,642
小野測器	0.1	0.1	42
エスベック	0.3	0.2	433
キーエンス	3.1	2.5	133,300
日置電機	0.2	0.1	650
シスメックス	2.5	2.2	15,384
日本マイクロニクス	0.5	0.5	1,175
メガチップス	0.3	0.2	799

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
OBARA GROUP	0.1	0.1	358
原田工業	0.1	0.1	80
コーセル	0.4	0.3	343
イリソ電子工業	0.3	0.2	734
オブテックスグループ	0.5	0.5	807
千代田インテグレ	0.1	0.1	277
レーザーテック	1.4	1.2	31,560
スタンレー電気	2.2	1.7	4,043
岩崎電気	0.1	—	—
ウシオ電機	1.6	1.3	2,489
岡谷電機産業	0.2	0.3	86
ヘリオス テクノ ホールディング	0.3	0.2	74
エノモト	0.1	0.1	162
日本セラミック	0.3	0.2	532
遠藤照明	0.1	0.1	116
古河電池	0.2	0.2	181
双信電機	0.1	0.2	66
山一電機	0.2	0.2	343
図研	0.2	0.2	708
日本電子	0.7	0.6	2,778
カシオ計算機	2.1	1.9	2,245
ファナック	3	12.2	46,079
日本シイエムケイ	0.6	0.6	403
エンプラス	0.1	0.1	961
大真空	0.4	0.3	217
ローム	1.4	4.6	12,351
浜松ホトニクス	2.3	2	11,670
三井ハイテック	0.3	0.3	1,968
新光電気工業	1	0.9	4,811
京セラ	4.8	3.9	28,353
太陽誘電	1.5	1.2	4,116
村田製作所	9.3	22.8	59,188
双葉電子工業	0.6	0.5	250
北陸電気工業	0.1	0.1	129
ニチコン	0.9	0.5	628
日本ケミコン	0.3	0.3	390
KOA	0.5	0.4	646
市光工業	0.4	0.5	264

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小糸製作所	3.4	3	6,627
ミツバ	0.5	0.5	335
SCREENホールディングス	0.5	0.8	5,760
キャノン電子	0.3	0.3	543
キャノン	15.6	12.5	45,887
リコー	8.1	6.3	7,651
象印マホービン	0.9	0.7	1,058
東京エレクトロン	2.2	5.3	106,344
イノテック	0.2	0.2	312
輸送用機器 (8.8%)			
トヨタ紡織	1.2	1.1	2,792
芦森工業	0.1	—	—
ユニプレス	0.6	0.5	527
豊田自動織機	2.4	1.8	19,863
モリタホールディングス	0.5	0.5	770
三櫻工業	0.5	0.4	344
デンソー	6.7	20.7	47,516
東海理化電機製作所	0.9	0.7	1,555
川崎重工業	2.3	1.9	6,344
名村造船所	0.9	0.5	372
日本車輛製造	0.1	0.1	198
三菱ロジスネクスト	0.5	0.4	466
日産自動車	40.3	35.8	21,361
いすゞ自動車	9.9	7.3	12,891
トヨタ自動車	156.2	137.8	359,658
日野自動車	4.3	3.3	1,758
三菱自動車工業	12.7	9.8	5,034
エフテック	0.2	0.2	140
レシップホールディングス	0.1	0.1	49
GMB	0.1	—	—
ファルテック	0.1	0.1	55
武蔵精密工業	0.8	0.6	874
日産車体	0.5	0.5	406
新明和工業	0.9	0.8	956
極東開発工業	0.5	0.4	695
トピー工業	0.3	0.2	465
ティラド	0.1	0.1	205
タチエス	0.6	0.4	644

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
NOK	1.3	1	1,840
フタバ産業	0.8	0.7	485
カヤバ	0.3	0.2	873
大同メタル工業	0.7	0.5	257
プレス工業	1.5	1.2	766
ミクニ	0.4	0.3	129
太平洋工業	0.7	0.6	796
河西工業	0.4	—	—
アイシン	2.5	1.9	10,185
マツダ	10.1	8.3	12,462
今仙電機製作所	0.2	0.2	116
本田技研工業	25	61.3	98,846
スズキ	6.8	4.6	26,542
S U B A R U	9	8	21,340
安永	0.1	0.1	72
ヤマハ発動機	4.5	3.6	13,582
T B K	0.3	0.2	79
エクセディ	0.5	0.4	976
豊田合成	1	0.8	2,367
愛三工業	0.5	0.4	450
日本プラスト	0.2	0.2	85
ヨロズ	0.2	0.3	263
エフ・シー・シー	0.6	0.5	875
シマノ	1.2	1	20,355
テイ・エス テック	1.4	1.2	2,005
ジャムコ	0.2	0.1	142
精密機器 (2.3%)			
テルモ	9.7	7.8	30,154
クリエートメディック	0.1	—	—
日機装	0.7	0.6	555
日本エム・ディ・エム	0.2	0.1	70
島津製作所	4.1	3.1	11,327
J M S	0.2	0.2	104
長野計器	0.2	0.2	452
ブイ・テクノロジー	0.2	0.1	191
東京計器	0.2	0.2	286
愛知時計電機	0.1	0.1	190
インターアクション	0.2	0.1	101

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オーバル	0.3	0.1	42
東京精密	0.5	0.5	3,565
マニー	1.3	1	2,050
ニコン	4.9	3.6	5,346
トプコン	1.6	1.3	2,175
オリンパス	16.4	15.6	29,858
理研計器	0.2	0.2	1,166
タムロン	0.2	0.1	421
HOYA	6.5	5.3	76,850
シード	0.2	0.1	75
ノーリツ銅機	0.3	0.2	628
A&Dホロンホールディングス	0.4	0.4	602
朝日インテック	3.8	2.8	7,140
シチズン時計	3.1	2.3	2,007
リズム	0.1	—	—
大研医器	0.2	0.1	52
メニコン	1.1	0.9	1,520
シンシア	0.1	—	—
松風	0.1	0.1	222
セイコーグループ	0.5	0.4	943
ニプロ	2.4	2.1	2,306
その他製品 (2.3%)			
KYORITSU	0.1	0.2	32
スノーピーク	0.5	0.3	307
パラマウントベッドホールディングス	0.7	0.6	1,408
トランザクション	0.1	0.1	193
ニホンフラッシュ	0.2	0.2	170
前田工織	0.3	0.2	571
永大産業	0.2	0.2	43
アートネイチャー	0.2	0.2	161
パンダイナムコホールディングス	2.9	6.9	21,334
S H O E I	0.3	0.6	1,225
フランスベッドホールディングス	0.4	0.3	353
パイロットコーポレーション	0.4	0.4	2,053
萩原工業	0.1	0.2	340
フジシールインターナショナル	0.7	0.5	830
タカラトミー	1.4	1.1	2,229
広済堂ホールディングス	0.1	0.1	275

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タカノ	—	0.1	79
ブロネクス	0.2	0.2	230
ホクシン	—	0.1	11
大建工業	0.2	0.1	299
TOPPANホールディングス	4.5	3.1	10,223
大日本印刷	3.7	2.7	10,467
共同印刷	0.1	0.1	299
N I S S H A	0.5	0.4	625
TAKARA & COMPANY	0.2	0.2	455
アシックス	2.6	2.1	9,983
ローランド	0.2	0.2	833
小松ウオール工業	0.1	0.1	285
ヤマハ	2	1.6	6,224
河合楽器製作所	0.1	0.1	398
クリナップ	0.2	0.3	203
ビジョン	1.8	1.6	2,570
キングジム	0.2	0.2	177
リンテック	0.6	0.5	1,245
イトーキ	0.4	0.5	685
任天堂	19.4	15.9	96,465
三菱鉛筆	0.4	0.3	558
タカラスタンダード	0.5	0.5	891
コクヨ	1.4	1	2,333
ナカバヤシ	0.1	0.3	151
グローブライド	0.2	0.2	377
オカムラ	0.9	0.7	1,477
美津濃	0.3	0.3	1,309
電気・ガス業 (1.4%)			
東京電力ホールディングス	25.6	22.6	14,337
中部電力	9.7	9.3	16,767
関西電力	12	9.7	18,832
中国電力	5	4	3,722
北陸電力	2.9	2.3	1,768
東北電力	7.5	6.1	5,749
四国電力	2.9	2.1	2,145
九州電力	6.6	5.7	5,457
北海道電力	3	2.4	1,537
沖縄電力	0.7	0.6	647

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電源開発	2.5	1.9	4,370
エフオン	0.2	0.2	90
イーレックス	0.4	0.4	288
レノバ	0.7	0.7	732
東京瓦斯	6	5.3	17,914
大阪瓦斯	5.8	5.1	12,594
東邦瓦斯	1.4	1	2,574
北海道瓦斯	0.2	0.2	461
広島ガス	0.6	0.5	193
西部ガスホールディングス	0.3	0.2	386
静岡ガス	0.6	0.5	500
メタウォーター	0.3	0.3	538
陸運業 (2.8%)			
S B S ホールディングス	0.2	0.2	518
東武鉄道	3.1	2.8	9,805
相鉄ホールディングス	1	0.8	2,109
東急	8	7	11,441
京浜急行電鉄	3.8	2.9	3,594
小田急電鉄	4.3	3.8	7,837
京王電鉄	1.5	1.3	5,670
京成電鉄	2	1.6	8,611
富士急行	0.4	0.3	1,201
東日本旅客鉄道	5.2	4.3	32,873
西日本旅客鉄道	3.6	3.2	17,846
東海旅客鉄道	2.4	9.5	31,416
西武ホールディングス	4.2	3	4,263
鴻池運輸	0.5	0.4	755
西日本鉄道	0.8	0.7	1,665
ハマキョウレックス	0.2	0.2	748
サカイ引越センター	0.2	0.2	498
近鉄グループホールディングス	3	2.5	10,292
阪急阪神ホールディングス	3.8	3.3	15,180
南海電気鉄道	1.4	1.2	3,369
京阪ホールディングス	1.3	1.4	4,982
神戸電鉄	0.1	0.1	277
名古屋鉄道	3.2	2.8	5,761
山陽電気鉄道	0.2	0.2	411
アルプス物流	0.2	0.2	330

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマトホールディングス	4.5	3.2	7,600
山九	0.8	0.6	3,024
丸運	0.2	0.1	24
丸全昭和運輸	0.2	0.2	743
センコーグループホールディングス	1.5	1.3	1,341
トナミホールディングス	0.1	0.1	428
ニッコンホールディングス	1	0.8	2,599
福山通運	0.4	0.2	811
セイノーホールディングス	1.8	1.4	3,003
エスライングループ本社	0.1	—	—
神奈川中央交通	0.1	0.1	302
日立物流	0.6	—	—
AZ—COM丸和ホールディングス	0.5	0.6	1,214
C&Fロジホールディングス	0.3	0.2	264
九州旅客鉄道	2.2	1.8	5,403
SGホールディングス	5.5	4.8	9,120
NIPPON EXPRESSホールディングス	1.1	0.9	6,857
海運業 (0.7%)			
日本郵船	8.2	6.8	25,928
商船三井	5.1	4.4	17,714
川崎汽船	3	1.9	9,910
NSユナイテッド海運	0.1	0.1	418
飯野海運	1.3	1	1,019
乾汽船	0.2	0.3	363
空運業 (0.4%)			
日本航空	7	6.2	16,368
ANAホールディングス	7.7	6.8	19,495
倉庫・運輸関連業 (0.1%)			
トランコム	0.1	0.1	716
日新	0.2	0.2	510
三菱倉庫	0.8	0.5	1,934
三井倉庫ホールディングス	0.3	0.2	827
住友倉庫	0.9	0.7	1,636
滋澤倉庫	0.2	0.1	292
東陽倉庫	0.5	—	—
日本トランスシティ	0.5	0.5	323
ケイヒン	0.1	—	—
中央倉庫	0.2	0.1	106

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川西倉庫	0.1	—	—
安田倉庫	0.2	0.2	215
ファイズホールディングス	0.1	—	—
東洋埠頭	0.1	0.1	136
上組	1.5	1.2	3,638
サンリツ	0.1	—	—
キムラユニティ	0.2	0.1	119
キューソー流通システム	0.2	0.1	94
東海運	0.2	0.1	28
エーアイテイ	0.2	0.2	321
内外トランスライン	0.1	0.1	237
日本コンセプト	0.1	0.1	169
情報・通信業 (8.0%)			
NEC ネットエスアイ	1.1	0.8	1,561
クロスキャット	0.2	0.1	98
システナ	4.8	4.2	1,037
デジタルアーツ	0.2	0.2	820
日鉄ソリューションズ	0.6	0.4	1,628
キューブシステム	0.2	0.2	209
コア	0.1	0.1	164
ラクーンホールディングス	0.3	0.2	136
ソリトシステムズ	0.1	0.1	107
ソフトクリエイトホールディングス	0.1	0.2	337
T I S	2.9	2.8	8,624
テクミラホールディングス	0.2	0.1	40
グリー	1.5	0.7	387
コーエーテクモホールディングス	2.1	1.6	3,225
三菱総合研究所	0.1	0.1	477
ボルテージ	0.1	0.1	26
A G S	0.1	0.1	67
ファインデックス	0.2	0.2	176
ブレインパッド	0.3	—	—
K L a b	0.5	0.5	131
ボールトゥウィンホールディングス	0.5	0.4	186
ネクソン	7.4	5.6	13,916
アイスタイル	0.9	0.7	288
エムアップホールディングス	0.4	0.3	338
エイチーム	0.2	0.2	109

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エニグモ	0.4	0.3	97
テクノスジャパン	0.3	0.1	69
e n i s h	0.3	0.1	17
コロブラ	1.1	1	579
ブロードリーフ	1.6	1.2	602
クロス・マーケティンググループ	0.1	0.1	63
デジタルハーツホールディングス	0.1	0.2	176
システム情報	0.3	0.2	185
メディアドゥ	0.1	0.1	120
じげん	0.9	0.7	336
ブイキューブ	0.3	0.3	102
エンカレッジ・テクノロジー	0.1	—	—
サイバーリンクス	0.1	0.1	70
フィックスターズ	0.3	0.3	294
CARTA HOLDINGS	0.1	0.1	116
オブティム	0.3	0.2	155
セレス	0.1	0.1	90
SHIFT	0.2	0.2	5,262
ティーガイア	0.3	0.3	520
セック	0.1	—	—
テクマトリックス	0.6	0.5	729
プロシップ	0.1	0.1	129
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.9	0.7	1,599
GMOベイメントゲートウェイ	0.7	0.5	3,028
ザッパラス	0.2	0.1	43
システムリサーチ	0.1	0.1	301
インターネットイニシアティブ	1.8	1.4	3,404
さくらインターネット	0.4	0.3	323
ヴィンクス	0.1	—	—
GMOグローバルサイン・ホールディングス	0.1	0.1	251
SRAホールディングス	0.2	0.1	332
システムインテグレータ	0.1	0.1	40
朝日ネット	0.3	0.3	179
eBASE	0.4	0.3	186
アバントグループ	0.4	0.3	359
アドソル日進	0.1	0.1	153
ODKソリューションズ	0.1	—	—
フリービット	0.2	0.1	102

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コムチュア	0.4	0.3	628
サイバーコム	0.1	—	—
アステリア	0.2	0.2	130
アイル	0.2	0.1	356
マークライنز	0.2	0.1	268
メディカル・データ・ビジョン	0.4	0.3	199
g u m i	0.5	0.4	170
ショーケース	0.1	—	—
モバイルファクトリー	0.1	—	—
テラスカイ	0.1	0.1	143
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.1	0.1	157
P C I ホールディングス	0.1	0.1	99
アイビーシー	0.1	—	—
ネオジャパン	0.1	0.1	93
P R T I M E S	0.1	0.1	159
ラクス	1.5	1.2	2,086
ランドコンピュータ	0.1	—	—
ダブルスタンダード	0.1	0.1	139
オープンドア	0.2	0.2	145
マイネット	0.1	0.1	32
アカツキ	0.1	0.1	203
U b i c o mホールディングス	0.1	0.1	104
カナミックネットワーク	0.4	0.3	135
ノムラシステムコーポレーション	0.4	0.2	21
チェンジホールディングス	0.7	0.6	857
シンクロ・フード	0.2	0.1	53
オークネット	0.1	0.1	167
キャピタル・アセット・プランニング	0.1	—	—
エイトレッド	0.1	—	—
マクロミル	0.6	0.5	322
ビーグリー	0.1	—	—
オロ	0.1	0.1	203
ユーザローカル	0.1	0.1	152
テモナ	0.1	0.1	25
ニーズウェル	0.1	0.1	61
マネーフォワード	0.7	0.6	2,191
サインポスト	0.1	0.1	47
S u n A s t e r i s k	—	0.2	226

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電算システムホールディングス	0.1	0.1	268
Appier Group	—	0.9	1,177
ソルクシーズ	0.3	0.1	39
フェイス	0.1	0.1	48
プロトコーポレーション	0.4	0.3	334
ハイマックス	0.1	0.1	136
野村総合研究所	5.8	5	18,375
サイバネットシステム	0.2	0.2	152
CEホールディングス	0.2	0.1	52
日本システム技術	0.1	0.1	213
インタージホールディングス	0.4	0.3	511
東邦システムサイエンス	0.1	—	—
ソースネクスト	1.5	1.2	204
インフォコム	0.4	0.3	770
シンプレクス・ホールディングス	0.5	0.4	1,025
HEROZ	0.1	0.1	133
ラクスル	0.4	0.6	658
メルカリ	1.3	1.5	4,454
I P S	0.1	0.1	233
F I G	0.4	0.2	66
システムサポート	0.1	0.1	179
イーソル	0.2	0.2	133
アルテリア・ネットワークス	0.3	—	—
東海ソフト	0.1	—	—
ウイングアーク1st	0.3	0.3	782
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	0.1	0.1	120
サーバーワークス	0.1	0.1	346
トピラシステムズ	0.1	—	—
Sansan	1.1	0.8	880
Link-U	0.1	—	—
ギフティ	0.3	0.2	250
メドレー	—	0.3	1,240
ベース	—	0.1	408
JMDC	0.4	0.4	1,909
フォーカスシステムズ	0.2	0.2	190
クレスコ	0.2	0.2	318
フジ・メディア・ホールディングス	3	2.4	3,580
オービック	1.1	0.8	17,424

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジャストシステム	0.5	0.4	1,054
TDCソフト	0.3	0.2	302
LINEヤフー	48.4	35.9	13,537
トレンドマイクロ	1.6	1.2	6,726
IDホールディングス	0.2	0.2	284
日本オラクル	0.5	0.5	5,242
アルファシステムズ	0.1	0.1	278
フューチャー	0.7	0.6	859
CAC Holdings	0.2	0.1	173
SBテクノロジー	0.1	0.1	210
トーセ	0.1	0.1	70
オービックビジネスコンサルタント	0.3	0.5	3,005
伊藤忠テクノソリューションズ	1.5	0.7	3,023
アイティフォー	0.4	0.3	313
エクスネット	0.1	—	—
大塚商会	1.6	1.3	7,658
サイボウズ	0.4	0.3	497
電通国際情報サービス	0.3	0.3	1,527
ACCESS	0.4	0.3	212
デジタルガレージ	0.6	0.5	1,426
EMシステムズ	0.5	0.4	280
ウェザーニューズ	0.1	0.1	576
C I J	0.3	0.4	208
ビジネスエンジニアリング	0.1	—	—
日本エンタープライズ	0.4	0.2	23
WOWOW	0.1	0.2	216
スカラ	0.3	0.2	148
インテリジェント ウェイブ	0.2	0.1	89
WOW WORLD GROUP	0.1	—	—
IMAGICA GROUP	0.2	0.2	115
ネットワンシステムズ	1.2	1	2,594
システムソフト	1.1	0.8	52
アルゴグラフィックス	0.3	0.2	611
マーベラス	0.5	0.4	273
エイバックス	0.6	0.4	528
B I P R O G Y	1.1	0.9	3,216
兼松エレクトロニクス	0.2	—	—
都築電気	0.2	0.1	213

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TBSホールディングス	1.6	1.3	3,108
日本テレビホールディングス	2.8	2.3	3,381
朝日放送グループホールディングス	0.3	0.2	132
テレビ朝日ホールディングス	0.8	0.6	964
スカパーJ S A Tホールディングス	2.9	2.2	1,526
テレビ東京ホールディングス	0.2	0.2	577
日本BS放送	0.1	0.1	88
ビジョン	0.4	0.4	505
スマートバリュー	0.1	—	—
USEN-NEXT HOLDINGS	0.3	0.3	982
コネクシオ	0.2	—	—
日本通信	2.9	2.3	450
クロップス	0.1	—	—
日本電信電話	37.7	806.7	139,801
KDDI	24.5	19.5	87,067
ソフトバンク	50.9	40.5	67,776
光通信	0.4	0.3	6,256
エムティーアイ	0.2	0.2	112
GMOインターネットグループ	1.1	0.9	1,918
ファイバーゲート	0.1	0.1	109
アйдママーケティングコミュニケーション	0.1	—	—
KADOKAWA	1.8	1.3	3,838
学研ホールディングス	0.5	0.4	327
ゼンリン	0.6	0.4	370
昭文社ホールディングス	0.2	0.1	35
インプレスホールディングス	0.3	0.2	34
アイネット	0.1	0.1	166
松竹	0.2	0.1	895
東宝	2	1.6	7,761
東映	0.1	0.1	1,766
N T Tデータグループ	8.9	7.9	13,726
ビー・シー・エー	0.2	0.1	112
ビジネスブレイン太田昭和	0.1	0.1	201
D T S	0.6	0.5	1,585
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1.6	1.3	6,492
シーイーシー	0.4	0.3	455
カブコン	3.1	2.5	13,182
アイ・エス・ビー	0.2	0.1	129

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジャステック	0.2	0.2	298
S C S K	2.3	2.1	5,155
N S W	0.1	0.1	264
アイネス	0.3	0.2	315
T K C	0.5	0.4	1,388
富士ソフト	0.3	0.5	2,700
N S D	1.1	0.9	2,403
コナミグループ	1.2	1.1	8,947
福井コンピュータホールディングス	0.2	0.2	515
J B C Cホールディングス	0.2	0.2	560
ミロク情報サービス	0.3	0.2	305
ソフトバンクグループ	20.2	12.4	76,012
卸売業 (6.8%)			
高千穂交易	0.1	0.1	314
オルパヘルスケアホールディングス	0.1	—	—
伊藤忠食品	0.1	0.1	668
エレマテック	0.3	0.2	347
あらた	0.3	0.2	1,072
トーメンデバイス	0.1	—	—
東京エレクトロン デバイス	0.1	0.3	1,203
円谷フィールズホールディングス	0.3	0.5	761
双日	3.5	2.7	8,267
アルフレッサ ホールディングス	3.5	2.7	6,436
横浜冷凍	0.8	0.7	801
神栄	0.1	—	—
ラサ商事	0.2	0.1	163
アルコニックス	0.4	0.3	399
神戸物産	2.3	2.1	7,721
ハイパー	0.1	0.1	32
あい ホールディングス	0.5	0.4	908
ディーブイエックス	0.1	0.1	105
ダイワボウホールディングス	1.4	1.1	3,000
マクニカホールディングス	0.8	0.6	4,260
ラクト・ジャパン	0.1	0.1	184
グリムス	0.2	0.1	192
パイタルケーエスケー・ホールディングス	0.6	0.3	295
八洲電機	0.3	0.2	246
メディアスホールディングス	0.2	0.2	140

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
レスターホールディングス	0.3	0.3	743
ジオリーブグループ	0.1	—	—
大光	0.2	0.1	66
OCH I ホールディングス	0.1	—	—
TOKAI ホールディングス	1.7	1.3	1,231
黒谷	0.1	0.1	58
C o m i n i x	0.1	—	—
三洋貿易	0.3	0.3	381
ビューティガレージ	0.1	—	—
ウイン・パートナーズ	0.3	0.2	215
ミタチ産業	0.1	0.1	100
シップヘルスケアホールディングス	1	1	2,164
明治電機工業	0.1	0.1	136
デリカフーズホールディングス	0.2	0.1	60
スターティアホールディングス	0.1	—	—
コメダホールディングス	0.7	0.7	1,849
ビーバンドットコム	0.1	—	—
アセンテック	0.1	0.1	47
富士興産	0.1	—	—
フルサト・マルカホールディングス	0.3	0.2	546
ヤマエグループホールディングス	0.2	0.2	630
小野建	0.3	0.3	493
南陽	0.1	—	—
佐島電機	0.2	0.1	185
エコートレーディング	0.1	—	—
伯東	0.2	0.2	1,004
コンドーテック	0.3	0.2	222
中山福	0.2	0.1	35
ナガイレーベン	0.4	0.3	621
三菱食品	0.3	0.3	1,168
松田産業	0.2	0.2	498
第一興商	0.6	1	2,226
メディパルホールディングス	3.1	2.6	6,487
S P K	0.1	0.1	180
萩原電気ホールディングス	0.1	0.1	403
アズワン	0.5	0.4	1,854
スズデン	0.1	0.1	212
尾家産業	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シモジマ	0.2	0.2	223
ドウシシャ	0.3	0.3	647
小津産業	0.1	—	—
高速	0.2	0.1	203
たけびし	0.1	0.1	179
リックス	0.1	—	—
丸文	0.3	0.2	222
ハビネット	0.3	0.2	488
橋本総業ホールディングス	0.2	0.1	116
日本ライフライン	1	0.8	876
タカショー	0.3	0.2	120
I D O M	1	0.8	680
進和	0.2	0.2	483
エスケイジャパン	0.1	0.1	73
ダイトロン	0.1	0.1	287
シークス	0.4	0.4	557
田中商事	0.1	0.1	66
オーハシテクニカ	0.2	0.1	163
白銅	0.1	0.1	212
ダイコー通産	0.1	—	—
伊藤忠商事	19.8	16	83,824
丸紅	29.2	20.7	44,991
高島	0.1	—	—
長瀬産業	1.6	1.2	2,733
蝶理	0.2	0.1	289
豊田通商	3	2.4	19,058
三共生興	0.4	0.4	320
兼松	1.2	1	1,927
ツカモトコーポレーション	0.1	—	—
三井物産	23.7	18.7	100,811
日本紙パルプ商事	0.2	0.1	455
カメイ	0.4	0.3	420
O U G ホールディングス	0.1	—	—
スターゼン	0.2	0.2	494
山善	1.2	0.7	836
椿本興業	0.1	—	—
住友商事	20	16.2	47,004
内田洋行	0.1	0.1	664

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱商事	22.1	16.2	111,002
第一実業	0.1	0.3	564
キヤノンマーケティングジャパン	0.7	0.6	2,287
西華産業	0.1	0.1	212
佐藤商事	0.2	0.2	286
菱洋エレクトロ	0.2	0.2	694
東京産業	0.3	0.2	160
ユアサ商事	0.3	0.2	792
神鋼商事	0.1	0.1	532
トルク	0.3	0.1	27
阪和興業	0.6	0.5	2,177
正栄食品工業	0.2	0.2	875
カナデン	0.3	0.2	289
RYODEN	0.3	0.2	461
岩谷産業	0.8	0.6	4,221
ナイス	0.1	0.1	141
極東貿易	0.2	0.2	347
アステナホールディングス	0.5	0.5	264
三愛オブリ	0.8	0.7	1,099
稲畑産業	0.7	0.5	1,512
G S I クレオス	0.2	0.1	198
明和産業	0.3	0.4	254
クワザワホールディングス	0.2	0.1	51
ワキタ	0.6	0.5	750
東邦ホールディングス	0.9	0.7	2,274
サンゲツ	0.8	0.7	1,993
ミツウロコグループホールディングス	0.4	0.3	380
シナネンホールディングス	0.1	0.1	388
伊藤忠エネクス	0.7	0.7	1,025
サンリオ	1	0.8	5,086
サンワテクノス	0.2	0.1	206
リョーサン	0.3	0.3	1,380
新光商事	0.5	0.4	456
トーホー	0.1	0.1	277
三信電気	0.1	0.1	219
東陽テクニカ	0.3	0.3	377
モスフードサービス	0.4	0.4	1,284
加賀電子	0.3	0.2	1,216

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソーダニッカ	0.3	0.1	98
立花エレテック	0.2	0.2	523
フォーバル	0.1	0.1	109
P A L T A C	0.5	0.4	1,812
三谷産業	0.5	0.5	157
太平洋興発	0.1	0.1	76
西本W i s m e t t a cホールディングス	0.1	0.1	510
コーア商事ホールディングス	0.2	0.2	143
K P P グループホールディングス	0.7	0.6	368
ヤマタネ	0.2	0.1	214
日鉄物産	0.2	—	—
泉州電業	0.1	0.1	315
トラスコ中山	0.6	0.6	1,375
オートバックスセブン	1.1	0.9	1,350
モリト	0.2	0.2	259
加藤産業	0.4	0.3	1,189
北恵	0.1	0.1	93
イエローハット	0.5	0.5	895
J Kホールディングス	0.2	0.2	186
日伝	0.2	0.2	508
北沢産業	0.2	0.1	25
杉本商事	0.2	0.1	211
因幡電機産業	0.8	0.7	2,198
東テク	0.1	0.1	484
ミスミグループ本社	4.2	4	9,230
アルテック	0.2	0.1	26
タキヒヨー	0.1	—	—
蔵王産業	0.1	—	—
スズケン	1.2	0.8	3,642
ジェコス	0.3	0.2	188
グローセル	0.4	0.2	91
小売業 (4.3%)			
ローソン	0.7	0.7	4,746
サンエー	0.2	0.2	941
カワチ薬品	0.3	0.2	492
エービーシー・マート	0.5	1.2	2,758
ハードオフコーポレーション	0.1	0.1	140
アスクル	0.7	0.5	991

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゲオホールディングス	0.4	0.3	627
アダストリア	0.4	0.3	897
ジーフット	0.2	0.2	55
くら寿司	0.3	0.3	973
キャンドウ	0.1	0.1	244
I Kホールディングス	0.1	0.1	36
バルグループホールディングス	0.3	0.5	865
エディオン	1.5	1	1,473
サーラコーポレーション	0.6	0.6	430
ワッツ	0.2	0.1	55
ハローズ	0.2	0.1	399
フジオフードグループ本社	0.2	0.3	414
あみやき亭	0.1	0.1	357
ひらまつ	0.6	0.4	95
大黒天物産	0.1	0.1	623
ハニーズホールディングス	0.3	0.2	297
ファーマライズホールディングス	0.1	0.1	64
アルベン	0.2	0.2	385
ハブ	0.1	0.1	69
クオールホールディングス	0.4	0.4	672
ジンズホールディングス	0.2	0.2	806
ビックカメラ	2	1.4	1,509
DCMホールディングス	2	1.5	1,764
ベッパーフードサービス	0.5	0.6	66
Monotaro	4.2	3.7	4,395
東京一番フーズ	0.1	0.1	50
アークランドサービスホールディングス	0.2	—	—
J. フロント リテイリング	3.7	3.3	4,537
ドトール・日レスホールディングス	0.5	0.5	1,048
マツキヨココカラ&カンパニー	2	4.8	12,331
ブロンコビリー	0.2	0.2	593
ZOZO	2.3	1.7	4,631
トレジャー・ファクトリー	0.1	0.1	107
物語コーポレーション	0.2	0.4	1,504
三越伊勢丹ホールディングス	5.1	4.5	7,323
Hamee	0.1	0.1	90
ウエルシアホールディングス	1.8	1.4	3,381
クリエイティSDホールディングス	0.5	0.4	1,302

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸善CH Iホールディングス	0.3	0.2	64
ミサワ	0.1	—	—
シュッピン	0.3	0.2	193
オイシックス・ラ・大地	0.5	0.4	446
ネクステージ	0.7	0.6	1,242
ジョイフル本田	1	0.8	1,398
鳥貴族ホールディングス	0.1	0.1	288
ホットランド	0.2	0.2	376
すかいらくホールディングス	4.1	3.6	7,551
SFPホールディングス	0.2	0.1	209
綿半ホールディングス	0.2	0.2	258
ヨシックスホールディングス	0.1	—	—
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1	0.9	944
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.1	0.1	66
BEENOS	0.2	0.1	140
あさひ	0.3	0.2	249
日本調剤	0.2	0.2	273
コスモス薬品	0.3	0.3	4,335
トーエル	0.1	0.1	73
セブン&アイ・ホールディングス	11.3	9.2	48,106
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	2.2	2	1,976
ツルハホールディングス	0.7	0.6	6,318
サンマルクホールディングス	0.3	0.2	369
フェリシモ	0.1	0.1	93
トリドールホールディングス	0.8	0.7	2,404
TOKYO BASE	0.3	0.3	84
ウイルプラスホールディングス	0.1	—	—
JMホールディングス	0.3	0.2	387
サツドラホールディングス	0.1	0.1	74
アレンザホールディングス	0.2	0.2	197
串カツ田中ホールディングス	0.1	0.1	163
パロックジャパンリミテッド	0.2	0.2	154
クスリのアオキホールディングス	0.3	0.2	1,866
力の源ホールディングス	0.1	0.1	175
FOOD & LIFE COMPANIES	1.7	1.4	3,373
メディカルシステムネットワーク	0.3	0.3	130
一家ホールディングス	0.1	0.1	65
ジャパンクラフトホールディングス	0.1	0.1	21

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
はるやまホールディングス	0.1	0.1	51
ノジマ	1	0.8	1,041
カップ・クリエイト	0.5	0.4	615
ライトオン	0.2	0.1	42
良品計画	3.9	2.9	5,711
バリミキホールディングス	0.4	0.2	66
アドヴァングループ	0.3	0.3	302
アルビス	0.1	0.1	238
コナカ	0.4	0.2	75
G-7ホールディングス	0.4	0.3	346
イオン北海道	0.4	0.4	344
コジマ	0.5	0.4	253
ヒマラヤ	0.1	0.1	92
コーナン商事	0.5	0.4	1,570
エコス	0.1	0.1	207
ワタミ	0.4	0.3	332
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	6.7	5.4	15,255
西松屋チェーン	0.6	0.6	1,106
ゼンショーホールディングス	1.6	1.4	9,870
幸楽苑ホールディングス	0.2	—	—
ハークスレイ	0.1	0.1	68
サイゼリヤ	0.5	0.4	2,260
VTホールディングス	1.2	1	496
魚力	0.1	0.1	213
フジ・コーポレーション	0.2	0.1	166
ユナイテッドアローズ	0.3	0.3	559
ハイデイ日高	0.5	0.4	1,023
YU-WA Creation Holdings	0.1	0.2	32
コロワイド	1.4	1.2	2,703
ピーシーデポコーポレーション	0.4	—	—
売番屋	0.2	0.2	1,044
トップカルチャー	0.1	0.1	18
PLANT	0.1	0.1	95
スギホールディングス	0.7	0.5	2,845
薬王堂ホールディングス	0.2	0.1	269
スクロール	0.5	0.4	414
ヨンドシーホールディングス	0.3	0.2	376
木曾路	0.4	0.4	1,004

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SRSホールディングス	0.5	0.4	408
千趣会	0.5	0.5	199
リテールパートナーズ	0.4	0.4	678
ケーヨー	0.6	0.4	519
上新電機	0.3	0.2	466
日本瓦斯	1.6	1.4	3,073
ロイヤルホールディングス	0.6	0.5	1,217
いなげや	0.3	0.3	477
チヨダ	0.3	0.3	243
ライフコーポレーション	0.3	0.2	695
リンガーハット	0.4	0.3	686
MrMaxHD	0.4	0.4	241
AOKIホールディングス	0.6	0.5	478
オークワ	0.5	0.4	330
コメリ	0.5	0.4	1,238
青山商事	0.6	0.6	841
しまむら	0.4	0.3	4,363
はせがわ	0.2	0.1	32
高島屋	2.3	2	3,954
松屋	0.6	0.5	448
エイチ・ツー・オー リテイリング	1.4	1.3	2,059
近鉄百貨店	0.1	0.1	279
丸井グループ	2.4	1.9	4,425
アクシアル リテイリング	0.2	0.2	746
井筒屋	0.2	0.1	34
イオン	11.1	9	27,423
イズミ	0.5	0.4	1,520
平和堂	0.5	0.4	960
フジ	0.7	0.4	728
ヤオコー	0.4	0.3	2,251
ゼビオホールディングス	0.5	0.4	382
ケーズホールディングス	2.9	1.9	2,627
Olympicグループ	0.1	0.1	49
日産東京販売ホールディングス	0.4	0.2	89
シルバーライフ	0.1	0.1	101
Genky Drug Stores	0.1	0.1	509
ナルミヤ・インターナショナル	0.1	—	—
ブックオフグループホールディングス	0.2	0.1	102

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ギフトホールディングス	0.1	0.2	414
アインホールディングス	0.4	0.4	1,619
元気寿司	0.1	0.1	494
ヤマダホールディングス	11.9	10.8	4,958
アークランズ	0.5	0.7	1,071
ニトリホールディングス	1.3	1.1	17,022
グルメ杵屋	0.3	0.2	208
愛眼	0.2	0.2	33
ケーユーホールディングス	0.2	0.2	217
吉野家ホールディングス	1.2	1	3,156
松屋フーズホールディングス	0.2	0.1	409
サガミホールディングス	0.5	0.4	520
関西フードマーケット	0.3	0.2	268
王将フードサービス	0.2	0.2	1,380
ブレナス	0.4	—	—
ミニストップ	0.2	0.2	295
アークス	0.6	0.5	1,393
バローホールディングス	0.7	0.5	1,095
ベルク	0.1	0.1	698
大庄	0.2	0.1	118
ファーストリテイリング	0.5	1.2	39,972
サンドラッグ	1.3	1	3,956
サックスパー ホールディングス	0.3	0.3	246
ヤマザワ	0.1	—	—
やまや	0.1	—	—
ベルーナ	0.7	0.6	375
銀行業 (7.2%)			
いよぎんホールディングス	3.8	2.9	3,097
しずおかフィナンシャルグループ	7	5.5	6,809
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	2.4	2.1	2,415
楽天銀行	—	0.8	1,898
京都フィナンシャルグループ	—	0.8	6,880
島根銀行	0.1	0.1	51
じもとホールディングス	0.2	0.1	40
めぶきフィナンシャルグループ	13.9	12.1	5,209
東京きらばしフィナンシャルグループ	0.4	0.3	1,287
九州フィナンシャルグループ	5.9	4.3	3,854
ゆうちょ銀行	8	6.8	9,132

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
富山第一銀行	0.7	0.8	757
コンコルディア・フィナンシャルグループ	16.7	13.2	9,044
西日本フィナンシャルホールディングス	1.8	1.5	2,565
三十三フィナンシャルグループ	0.3	0.2	370
第四北越フィナンシャルグループ	0.5	0.4	1,522
ひろぎんホールディングス	4.3	3.2	3,017
おきなわフィナンシャルグループ	0.3	0.2	484
十六フィナンシャルグループ	0.4	0.3	1,135
北國フィナンシャルホールディングス	0.3	0.3	1,521
プロクレアホールディングス	0.3	0.3	567
あいちフィナンシャルグループ	0.4	0.3	701
S B I 新生銀行	2.2	—	—
あおぞら銀行	1.9	1.5	4,286
三菱UFJフィナンシャル・グループ	197.8	154.8	189,397
りそなホールディングス	35.7	31	24,731
三井住友トラスト・ホールディングス	5.7	4.5	24,943
三井住友フィナンシャルグループ	21.9	17.6	125,875
千葉銀行	9.5	6.9	7,489
群馬銀行	5.4	4.8	3,301
武蔵野銀行	0.4	0.3	816
千葉興業銀行	0.7	0.4	359
筑波銀行	1.3	1	280
七十七銀行	0.9	0.8	2,576
秋田銀行	0.2	0.2	399
山形銀行	0.3	0.3	338
岩手銀行	0.2	0.2	529
東邦銀行	2.4	1.9	522
東北銀行	0.1	0.1	112
ふくおかフィナンシャルグループ	2.4	2	7,534
スルガ銀行	3	2.1	1,320
八十二銀行	6.3	5.2	4,264
山梨中央銀行	0.3	0.2	351
大垣共立銀行	0.6	0.5	985
福井銀行	0.3	0.2	308
清水銀行	0.1	0.1	161
富山銀行	0.1	—	—
滋賀銀行	0.6	0.4	1,500
南都銀行	0.5	0.4	1,037

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
百五銀行	2.8	2.3	1,235
京都銀行	1.1	—	—
紀陽銀行	1	0.9	1,327
ほくほくフィナンシャルグループ	1.9	1.6	2,639
山陰合同銀行	1.9	1.5	1,486
鳥取銀行	0.1	—	—
百十四銀行	0.3	0.2	535
四国銀行	0.4	0.4	409
阿波銀行	0.4	0.3	705
大分銀行	0.2	0.1	271
宮崎銀行	0.2	0.2	545
佐賀銀行	0.2	0.1	195
琉球銀行	0.8	0.6	711
セブン銀行	10.1	8.8	2,580
みずほフィナンシャルグループ	40.5	35.7	90,053
高知銀行	0.1	—	—
山口フィナンシャルグループ	3.4	2.4	3,106
長野銀行	0.1	—	—
名古屋銀行	0.2	0.2	1,080
北洋銀行	4.2	3.7	1,376
大光銀行	0.1	—	—
愛媛銀行	0.4	0.3	315
トマト銀行	0.1	0.1	115
京葉銀行	1.4	1.1	726
栃木銀行	1.5	1.1	355
北日本銀行	0.1	0.1	221
東和銀行	0.5	0.4	260
福島銀行	0.4	0.2	49
大東銀行	0.2	0.1	75
トモニホールディングス	2.4	2	946
フィデアホールディングス	0.3	0.3	471
池田泉州ホールディングス	3.5	3.2	1,052
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	1.1	0.8	1,012
ジャパンインベストメントアドバイザー	0.2	0.2	317
マーキュリアホールディングス	0.2	0.1	72
S B I ホールディングス	4.2	3.6	11,188
日本アジア投資	0.3	0.2	47

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジャフコ グループ	1.2	0.8	1,219
大和証券グループ本社	21.7	17.7	15,027
野村ホールディングス	51.5	44.5	25,721
岡三証券グループ	2.4	2.1	1,480
丸三証券	1	0.8	634
東洋証券	1	0.8	254
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	3.3	2.6	1,292
光世証券	0.1	—	—
水戸証券	0.8	0.7	311
いちよし証券	0.6	0.5	351
松井証券	1.7	1.4	1,043
マネックスグループ	2.8	2.6	1,651
極東証券	0.4	0.3	299
岩井コスモホールディングス	0.3	0.3	512
アイザワ証券グループ	0.5	0.4	454
マネーパートナーズグループ	0.4	0.2	57
スパークス・グループ	0.3	0.3	428
小林洋行	0.1	0.2	46
保険業 (2.5%)			
かんぽ生命保険	3.4	2.9	7,866
S O M P O ホールディングス	4.8	4.3	27,154
アニコム ホールディングス	0.9	0.8	437
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	6.9	5	26,950
第一生命ホールディングス	16.5	12.1	37,389
東京海上ホールディングス	28.2	24.4	80,690
T & D ホールディングス	7.5	6.6	16,787
アドバンスクリエイト	0.1	0.2	189
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	0.8	0.6	2,892
あんしん保証	0.2	0.1	27
ジェイリース	0.1	0.1	178
イントラスト	0.1	0.1	83
日本モーゲージサービス	0.2	0.1	52
C a s a	0.1	0.1	81
アルヒ	0.5	0.3	243
プレミアグループ	0.5	0.4	553
ネットプロテクションズホールディングス	1.1	0.8	219
クレディセゾン	2	1.6	3,551

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
芙蓉総合リース	0.3	0.2	2,320
みずほリース	0.4	0.4	1,856
東京センチュリー	0.5	0.5	2,873
日本証券金融	1.3	0.9	1,301
アイフル	5.8	4.1	1,566
リコーリース	0.3	0.2	867
イオンフィナンシャルサービス	1.9	1.4	1,692
アコム	6.8	4.4	1,550
ジャックス	0.3	0.3	1,524
オリエントコーポレーション	0.9	0.6	663
オリックス	20.1	16.2	43,610
三菱HCキャピタル	10.9	9.6	9,149
九州リースサービス	0.2	0.1	92
日本取引所グループ	7.9	7	20,622
イー・ギランティ	0.5	0.4	693
アサックス	0.2	0.1	64
NECキャピタルソリューション	0.1	0.1	303
不動産業 (2.0%)			
大東建託	1.1	0.9	13,788
いちご	3.8	2.9	971
日本駐車場開発	3.4	2.5	512
スター・マイカ・ホールディングス	0.1	0.3	179
SREホールディングス	0.1	0.1	212
ADワークスグループ	0.9	0.6	154
ヒューリック	6.5	5.8	7,737
三栄建築設計	0.1	—	—
野村不動産ホールディングス	1.8	1.5	5,533
三重交通グループホールディングス	0.7	0.6	320
サムティ	0.5	0.4	966
ディア・ライフ	0.5	0.5	370
コーセーアールイー	0.1	0.1	94
地主	0.2	0.2	387
ブレサンスコーポレーション	0.4	0.4	660
THEグローバル社	0.3	0.2	69
ハウスコム	0.1	0.1	86
JPMC	0.2	0.2	224
サンセイランディック	0.1	0.1	100
エストラスト	0.1	0.1	62

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フージャースホールディングス	0.5	0.4	412
オープンハウスグループ	1	0.9	4,256
東急不動産ホールディングス	9.2	7.4	6,523
飯田グループホールディングス	2.8	2.1	4,849
イーランド	0.1	—	—
ムゲンエステート	0.2	0.1	99
ビーロッド	0.3	0.2	160
ファーストブラザーズ	0.1	0.1	110
And Doホールディングス	0.2	0.2	192
シーアールイー	0.1	0.2	310
ケイアイスター不動産	0.2	0.1	430
アグレ都市デザイン	0.1	—	—
グッドコムアセット	0.1	0.3	285
ジェイ・エス・ビー	0.1	0.1	470
ロードスターキャピタル	0.1	0.2	361
テンポイノベーション	0.1	0.1	110
グローバル・リンク・マネジメント	0.1	0.1	182
フェイスネットワーク	0.1	0.1	132
パーク24	2.2	1.6	2,674
バラカ	0.1	0.1	189
宮越ホールディングス	0.1	0.1	115
三井不動産	13.2	10.5	34,461
三菱地所	19.2	14.9	29,040
平和不動産	0.5	0.4	1,588
東京建物	2.7	2.1	4,237
京阪神ビルディング	0.5	0.4	544
住友不動産	6.1	4.5	16,681
テアオーシー	0.5	0.5	319
東京楽天地	0.1	—	—
スターツコーポレーション	0.5	0.4	1,109
フジ住宅	0.4	0.4	284
空港施設	0.4	0.4	222
明和地所	0.2	0.1	114
ゴールドクレスト	0.3	0.2	469
エスリード	0.1	0.1	298
日神グループホールディングス	0.6	0.4	207
日本エスコ	0.7	0.5	446
MIRARTHホールディングス	1.5	1.2	554

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
AVANTIA	0.2	0.1	81
イオンモール	1.7	1.3	2,221
毎日コムネット	0.1	0.1	72
ファースト住建	0.1	0.1	116
カチタス	0.8	0.7	1,445
トーセイ	0.5	0.4	694
サンフロンティア不動産	0.5	0.4	570
FJネクストホールディングス	0.3	0.3	310
インテリックス	0.1	0.1	50
ランドビジネス	0.2	0.2	60
サンネクスタグループ	0.1	0.1	98
グランディハウス	0.3	0.2	124
日本空港ビルデング	1.1	0.9	5,624
サービス業 (4.6%)			
明豊ファシリティワークス	0.1	0.1	78
日本工営	0.2	—	—
LIFULL	1.1	0.9	198
MIXI	0.8	0.6	1,355
ジェイエイシーリクルートメント	0.3	0.2	463
日本M&Aセンターホールディングス	5.4	4.4	2,857
メンバーズ	0.1	0.1	115
UTグループ	0.5	0.4	766
アイティメディア	0.2	0.1	106
E・Jホールディングス	0.2	0.2	300
オープンアップグループ	1.1	0.8	1,492
コシダカホールディングス	0.9	0.8	799
アルトナー	0.1	—	—
パソナグループ	0.4	0.3	399
CDS	0.1	—	—
リンクアンドモチベーション	0.8	0.7	260
エス・エム・エス	1.1	1	2,255
サニーサイドアップグループ	0.1	0.1	78
パーソルホールディングス	3.3	28.5	6,084
リニカル	0.2	0.1	57
クックパッド	0.8	0.8	84
エスクリ	0.1	0.1	27
アイ・ケイ・ケイホールディングス	0.1	0.1	69
学情	0.1	0.1	162

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スタジオアリス	0.1	0.1	202
シミックホールディングス	0.2	0.1	165
エブコ	0.1	0.1	76
NJS	0.1	0.1	274
総合警備保障	1.2	4.8	4,078
カカココム	2.4	1.9	2,631
アイロムグループ	0.1	0.1	163
セントケア・ホールディング	0.2	0.2	162
サイネックス	0.1	—	—
ルネサンス	0.2	0.2	169
ディップ	0.6	0.5	1,475
デジタルホールディングス	0.2	0.1	100
新日本科学	0.4	0.3	501
キャリアデザインセンター	0.1	—	—
ベネフィット・ワン	1.2	1.2	1,140
エムスリー	5.8	5.1	11,898
ツカダ・グローバルホールディング	0.2	0.1	37
アウトソーシング	1.7	1.7	1,824
ウエルネット	0.3	0.1	55
ワールドホールディングス	0.1	0.1	226
ディー・エヌ・エー	1.2	1	1,431
博報堂DYホールディングス	4.2	3.3	4,037
ぐるなび	0.5	0.5	125
タカミヤ	0.4	0.4	195
ジャパンベストレスキューシステム	0.2	0.1	59
ファンコミュニケーションズ	0.6	0.4	159
ライク	0.1	0.1	133
Aoba-BBT	0.1	0.1	38
エスプール	0.8	0.8	255
WDBホールディングス	0.2	0.1	202
ティア	0.2	0.1	44
アドウェイズ	0.4	0.4	211
パリュエコマース	0.2	0.2	236
インフォマート	3.1	2.7	936
JPホールディングス	0.8	0.8	263
エコナックホールディングス	0.5	0.2	27
CLホールディングス	0.1	0.1	79
プレステージ・インターナショナル	1.2	1.1	652

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アミューズ	0.2	0.1	145
ドリームインキュベータ	0.1	0.1	278
クイック	0.2	0.2	397
T A C	0.2	0.2	39
電通グループ	3.1	2.5	10,847
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.2	0.1	91
びあ	0.1	0.1	342
イオンファンタジー	0.1	0.1	267
シーティーエス	0.4	0.3	198
ネクシィーズグループ	0.1	0.1	81
H. U. グループホールディングス	0.9	0.8	1,956
アルプス技研	0.3	0.3	744
サニックス	0.6	0.5	154
ダイオーズ	0.1	—	—
日本空調サービス	0.3	0.3	227
オリエンタルランド	3.5	13.7	62,746
ダスキン	0.7	0.6	1,948
明光ネットワークジャパン	0.4	0.3	210
ファルコホールディングス	0.1	0.1	194
秀英予備校	0.1	0.1	39
ラウンドワン	2.7	2.2	1,163
リゾートトラスト	1.4	1	2,068
ビー・エム・エル	0.4	0.3	831
りらいあコミュニケーションズ	0.5	—	—
リソー教育	1.6	1.1	282
早稲田アカデミー	0.2	0.1	136
ユー・エス・エス	3.7	2.7	6,913
東京個別指導学院	0.3	0.3	149
サイバーエージェント	7	5.7	4,436
楽天グループ	13.5	22.1	12,493
クリーク・アンド・リバー社	0.2	0.1	185
S B I グローバルアセットマネジメント	0.6	0.4	212
デー・オー・ダブリュ	0.7	0.6	184
山田コンサルティンググループ	0.2	0.1	151
セントラルスポーツ	0.1	0.1	235
フルキャストホールディングス	0.3	0.2	332
エン・ジャパン	0.6	0.5	1,057
テクノプロ・ホールディングス	2	1.5	4,253

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アトラグループ	0.1	0.1	19
インターワークス	0.1	—	—
アイ・アールジャパンホールディングス	0.2	0.1	132
K e e P e r 技研	0.2	0.2	1,070
三機サービス	0.1	—	—
G u n o s y	0.2	0.2	140
デザインワン・ジャパン	0.1	0.1	15
イー・ガーディアン	0.1	0.1	168
リブセンス	0.1	0.1	28
ジャパンマテリアル	1	0.8	1,876
ベクトル	0.5	0.4	424
ウチヤマホールディングス	0.1	0.1	33
チャーム・ケア・コーポレーション	0.2	0.2	212
キャリアリンク	0.1	0.1	238
I B J	0.2	0.2	124
アサンテ	0.1	0.1	156
バリュエーHR	0.3	0.2	239
M&Aキャピタルパートナーズ	0.3	0.2	498
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.1	0.1	99
ER I ホールディングス	0.1	—	—
シグマクシス・ホールディングス	0.4	0.4	566
ウィルグループ	0.2	0.2	215
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	0.3	0.3	40
メドビア	0.2	0.2	179
レアジョブ	0.1	—	—
リクルートホールディングス	23.4	19.1	84,517
エラン	0.4	0.3	223
土木管理総合試験所	0.1	0.1	32
ネットマーケティング	0.2	—	—
日本郵政	35.7	31.1	39,979
ベルシステム24ホールディングス	0.5	0.4	590
鎌倉新書	0.4	0.3	167
SMN	0.1	0.1	37
エアトリ	0.2	0.2	331
アトラエ	0.2	0.2	198
ストライク	0.1	0.1	312
ソラスト	0.8	0.7	385
セラク	0.1	0.1	114

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
インソース	0.4	0.6	504
ペイカレント・コンサルティング	0.2	2	7,994
Orchestra Holdings	0.1	0.1	90
アイモバイル	0.2	0.1	133
キャリアインデックス	0.1	0.1	26
MS-Japan	0.1	0.1	111
船場	0.1	—	—
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1	0.9	1,760
グリーンズ	—	0.1	134
ツナググループ・ホールディングス	0.1	0.1	69
GameWith	0.1	0.1	28
ウェルビー	0.2	0.2	113
ミダックホールディングス	0.2	0.2	338
日総工産	0.3	—	—
キュービーネットホールディングス	0.2	0.1	155
RPAホールディングス	0.4	0.4	116
スプリックス	0.1	0.1	78
マネジメントソリューションズ	0.2	0.1	229
プロレド・パートナーズ	0.1	0.1	40
and factory	0.1	0.1	36
フロンティア・マネジメント	0.1	0.1	151
ピアラ	0.1	—	—
コプロ・ホールディングス	0.1	—	—
ギークス	0.1	—	—
アンビスホールディングス	—	0.3	638
カーブスホールディングス	0.9	0.7	444
フォーラムエンジニアリング	0.2	0.2	253
Fast Fitness Japan	0.1	0.1	117
ダイレクトマーケティングミックス	0.3	0.3	121
LITALICO	0.3	0.2	362
アドバンテッジリスクマネジメント	0.1	0.1	41
リログループ	1.8	1.4	2,011
東祥	0.3	0.2	192
ID&Eホールディングス	—	0.2	653
ビーウィズ	0.1	0.1	194
TREホールディングス	0.6	0.6	667
人・夢・技術グループ	0.1	0.1	158
NISSOホールディングス	—	0.2	141

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大栄環境	—	0.7	1,400
日本管財ホールディングス	—	0.3	738
エイチ・アイ・エス	0.8	0.8	1,304
ラックランド	0.1	0.1	280
共立メンテナンス	0.6	0.4	2,233
イチネンホールディングス	0.3	0.3	405
建設技術研究所	0.2	0.1	437
スペース	0.2	0.2	178
燦ホールディングス	0.1	0.2	207
東京テアトル	0.1	0.1	107
タナベコンサルティンググループ	0.1	0.1	110
ナガワ	0.1	0.1	653
東京都競馬	0.2	0.2	764
常磐興産	0.1	0.1	122
カナモト	0.5	0.4	940
ニシオホールディングス	0.3	0.3	964
アゴーラ ホスピタリティー グループ	2.1	1.8	43
トランス・コスモス	0.4	0.3	919
乃村工藝社	1.4	1.2	1,016
藤田観光	0.1	0.1	400
KNT-CTホールディングス	0.2	0.2	244
日本管財	0.4	—	—
トーカイ	0.3	0.2	372
セコム	3.2	2.6	26,286
セントラル警備保障	0.2	0.1	245
丹青社	0.6	0.5	409
メイテックグループホールディングス	1.2	1	2,530
応用地質	0.3	0.2	443
船井総研ホールディングス	0.6	0.5	1,231
進学会ホールディングス	0.1	0.1	28
オオバ	0.2	0.1	88
いであ	0.1	—	—
学究社	0.1	0.1	198
ベネッセホールディングス	1.1	1	1,747
イオンディライト	0.4	0.3	973
ナック	0.2	0.1	95
ダイセキ	0.6	0.5	1,975

銘柄		期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数	評 価 額
ステップ		千株 0.1	千株 0.1	千円 169
合 計	株 数 ・ 金 額	3,512	3,833	7,984,466
	銘柄数 < 比率 >	2,066	1,934	< 98.0% >

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期	末
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	T O P I X先物	百万円 134	百万円 —

○投資信託財産の構成 (2023年10月23日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
株式	千円 7,984,466	% 98.0
コール・ローン等、その他	166,594	2.0
投資信託財産総額	8,151,060	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年10月23日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,258,744,209
コール・ローン等	83,355,291
株式(評価額)	7,984,466,830
未収配当金	77,718,488
差入委託証拠金	113,203,600
(B) 負債	113,933,067
未払金	6,243,300
未払解約金	6,150
未払利息	17
差入委託証拠金代用有価証券	107,683,600
(C) 純資産総額(A－B)	8,144,811,142
元本	3,218,063,246
次期繰越損益金	4,926,747,896
(D) 受益権総口数	3,218,063,246口
1千口当たり基準価額(C／D)	2,531円

(注) 当ファンドの期首元本額は4,046,296,164円、期中追加設定元本額は45,130円、期中一部解約元本額は828,278,048円です。

(注) 2023年10月23日現在の元本の内訳は以下の通りです。

- ・インデックスポートフォリオ 3,191,863,606円
- ・バランスポートフォリオ 26,199,640円

(注) 1口当たり純資産額は2,531円です。

(注) 2023年10月23日現在、先物取引などに係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は以下の通りです。

- ・株式 128,688千円

○損益の状況 (2022年10月22日～2023年10月23日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	202,317,144
受取配当金	202,272,656
受取利息	9
その他収益金	80,993
支払利息	△ 36,514
(B) 有価証券売買損益	1,385,948,017
売買益	1,628,333,548
売買損	△ 242,385,531
(C) 先物取引等取引損益	20,819,050
取引益	30,505,550
取引損	△ 9,686,500
(D) 保管費用等	△ 35
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	1,609,084,176
(F) 前期繰越損益金	4,350,581,223
(G) 追加信託差損益金	62,956
(H) 解約差損益金	△1,032,980,459
(I) 計(E＋F＋G＋H)	4,926,747,896
次期繰越損益金(I)	4,926,747,896

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

(注) 損益の状況の中で(H)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。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上し処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2022年10月22日から2023年10月23日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、2023年8月8日付けにて運用目標とするベンチマークを「東証株価指数」から「TOPIX（東証株価指数）配当込み」に変更いたしました。
当ファンドに関して、実際の運用においては保有資産から配当を受け取るため、当ファンドの基準価額は「配当込み」の値動きとなる一方で、運用目標とするベンチマークを構成する指数については、一般に広く認知されている指数が配当を含まないものであったことなどを理由として、「配当抜き」の値動きとなる指数を採用して参りました。こうしたことが要因の一つとなって、当ファンドの基準価額とベンチマークの値動きに乖離が生じておりました。このたび、当該乖離を是正することが受益者にとってより適切な投資判断につながるとの考えから、運用実態に則して当ファンドのベンチマークを「配当込み」の指数へ変更いたしました。（付表）