

バランスポートフォリオ

運用報告書（全体版）

第37期（決算日 2024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、2024年11月7日に第37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わないこともあります。	

<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)	標準価額			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	純資産額
		税込分配金	騰落	騰落率				
33期(2020年11月9日)	円 9,545	円 5	△ 0.2	% 49.6	% 0.6	% 25.7	百万円 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	
37期(2024年11月7日)	12,487	5	10.2	49.9	0.9	20.4	127	

(注) 基準価額および分配金は、1万口当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	標準価額		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率
		騰落	騰落率			
(期首) 2023年11月7日	円 11,333		% -	% 49.4	% 0.8	% 19.8
11月末	11,437		0.9	50.3	0.7	19.8
12月末	11,416		0.7	49.6	0.4	21.1
2024年1月末	11,854		4.6	49.5	0.4	20.3
2月末	12,138		7.1	50.8	0.3	19.8
3月末	12,409		9.5	49.4	0.9	19.3
4月末	12,346		8.9	50.3	0.9	19.9
5月末	12,411		9.5	50.7	0.9	19.8
6月末	12,501		10.3	49.6	0.9	19.8
7月末	12,461		10.0	48.7	0.6	20.4
8月末	12,371		9.2	50.1	0.1	20.6
9月末	12,272		8.3	49.0	0.9	20.8
10月末	12,381		9.2	49.5	0.9	20.6
(期末) 2024年11月7日	12,487		10.2	49.9	0.9	20.4

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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。

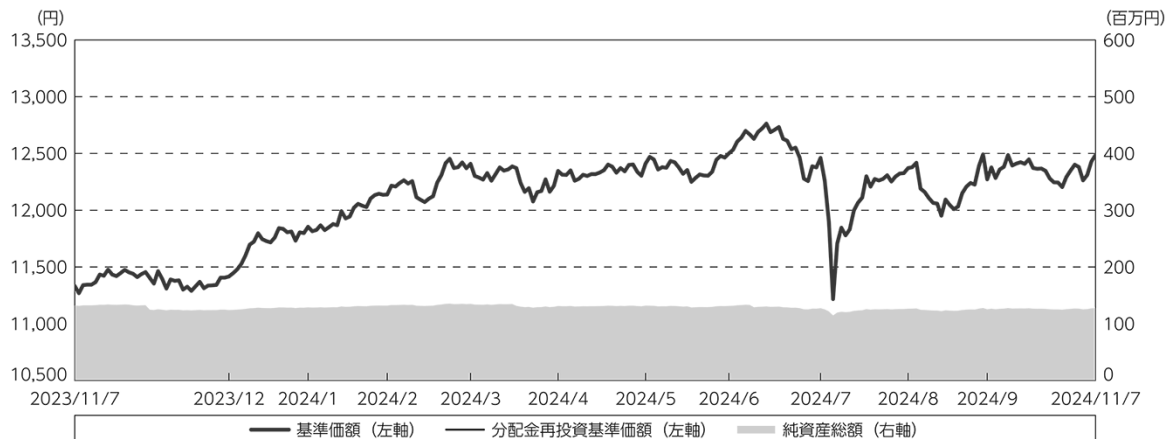
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2023年11月8日～2024年11月7日)

期中の基準価額等の推移



期首：11,333円

期末：12,487円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：10.2% (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(2023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)

- ・米国連邦公開市場委員会(FOMC)の結果を背景に米国連邦準備制度理事会(FRB)が2024年に利下げに動くとの観測が強まったこと。
- ・FRBがFOMCにおいて大幅な利下げに踏み切ったこと(2024年9月中旬)。
- ・日銀総裁の記者会見を受けて早期の追加利上げ観測が後退したこと(2024年9月下旬)。

(株式資産に対する要因)

- ・ FOMCの結果を受けてFRBが2024年に利下げに動くことと期待されたこと。
- ・ 国内企業の好調な業績を受けて海外の投資家が日本株式への関心を高めていたこと。
- ・ 米国の大手半導体企業の好決算などを背景として半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったこと。

<値下がり要因>

(債券資産に対する要因)

- ・ 企業から高い水準の回答が相ついだ春季労使交渉(春闘)を受けて日銀が金融政策決定会合でマイナス金利を解除するとの観測が強まったことやその後にマイナス金利政策の解除を行なったこと。
- ・ 円安/アメリカドル高が進行するなか日銀による国債購入の減額や追加利上げが意識されたこと。
- ・ 米国の雇用情勢の底堅さを受けてFRBの追加の利下げ観測が後退したこと。

(株式資産に対する要因)

- ・ 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。
- ・ 米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念が強まったこと(2024年8月上旬)。
- ・ 新首相が衆議院の解散・総選挙を表明し政治的不透明感が高まったこと。

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。

期間の初めから2024年7月上旬にかけては、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ったものの、FOMCの結果を受けてFRBが2024年に利下げに動くことと期待されたことや、国内企業の好調な業績を受けて海外の投資家が日本株式への関心を高めていたこと、米国の大手半導体企業の好決算などを背景として半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったこと、円安/アメリカドル高が進行し輸出企業の好調な業績が期待されたことなどが支援材料となり、TOPIXは上昇しました。7月中旬から期間末にかけては、FRBが利下げを開始し米国経済の下支えになるとの期待感が強まったことや、日銀総裁の金融政策決定会合後の記者会見での発言から早期の追加利上げ観測が後退したことなどが株価の上昇要因となったものの、日銀が金融政策決定会合において利上げを決定したことを受けて円高/アメリカドル安が進み、輸出関連企業の業績への期待が一時後退したことや、米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念が強まったこと、新首相が衆議院の解散・総選挙を表明し政治的不透明感が高まったことなどが重しとなり、TOPIXは下落しました。

(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。

期間の初めから2024年1月前半にかけては、FOMCの結果を背景にFRBが2024年に利下げに動くとの観測が強まったことなどから、国債利回りは総じて低下(債券価格は上昇)しました。1月後半から7月上旬にかけては、企業から高い水準の回答が相ついだ春闘を受けて日銀が金融政策決定会合でマイナス金利を解除するとの観測が強まったことやその後にマイナス金利政策の解除を行なったこと、円安/アメリカドル高が進行するなか日銀による国債購入の減額や追加利上げが意識されたことなどから、国債利回りは総じて上

昇しました。7月中旬から9月下旬にかけては、日銀が金融政策決定会合で利上げを決定したことが利回りの上昇要因となったものの、FRBがFOMCで大幅な利下げに踏み切ったことや、日銀総裁の記者会見を受けて早期の追加利上げ観測が後退したことなどから、国債利回りは総じて低下しました。10月上旬から期間末にかけては、米国の雇用情勢の底堅さを受けてFRBの追加の利下げ観測が後退したことや、衆議院選挙における与党の過半数割れを受けて、財政拡張的な政策が打ち出されるとの思惑が強まったこと、米国大統領選挙で共和党候補の勝利を受けて米国の財政悪化懸念から米国の長期金利が上昇したことなどから、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)

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

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、1万口当たり、税込み)

項 目	第37期
	2023年11月8日～ 2024年11月7日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.040%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	5,288

(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「バール日本株式モデル」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

(2023年11月8日～2024年11月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	70	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 ）	(29)	(0.242)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(29)	(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 ）	(11)	(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	1	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 ）	(1)	(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	71	0.576	
期中の平均基準価額は、12,166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。

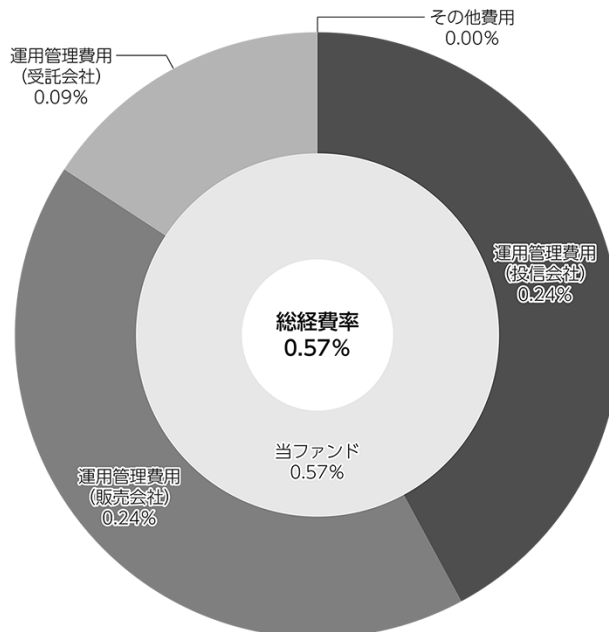
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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」にてご確認いただけますが、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

(2023年11月8日～2024年11月7日)

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 2,770	千円 7,361	千口 7,499	千円 22,255

○株式売買比率

(2023年11月8日～2024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	1,435,295千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	9,165,240千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.15

(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

(2023年11月8日～2024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
株式	百万円 -	百万円 2	百万円 29

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グループ株式会社です。

○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 (2023年11月8日～2024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

(2023年11月8日～2024年11月7日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024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 26,000	千円 26,014	% 20.4	% —	% —	% —	% 20.4
	(26,000)	(26,014)	(20.4)	(—)	(—)	(—)	(20.4)
合 計	26,000 (26,000)	26,014 (26,014)	20.4 (20.4)	— (—)	— (—)	— (—)	20.4 (20.4)

(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		償 還 年 月 日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	額	
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	15,011		2025/10/29
平成26年度第1回滋賀県公募公債	0.495	11,000	11,003		2024/11/28
合 計		26,000	26,014		

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	25,194	20,465	64,937

(注) 親投資信託の2024年11月7日現在の受益権総口数は、2,946,574千口です。

○投資信託財産の構成

(2024年11月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	26,014	20.3
インデックス東証株式マザーファンド	64,937	50.7
コール・ローン等、その他	37,065	29.0
投資信託財産総額	128,016	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 (2024年11月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	128,016,406
コール・ローン等	37,038,466
公社債(評価額)	26,014,448
インデックス東証株式マザーファンド(評価額)	64,937,206
未収利息	26,286
(B) 負債	420,034
未払収益分配金	51,091
未払信託報酬	366,187
その他未払費用	2,756
(C) 純資産総額(A-B)	127,596,372
元本	102,183,711
次期繰越損益金	25,412,661
(D) 受益権総口数	102,183,711口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,487円

(注) 当ファンドの期首元本額は116,626,061円、期中追加設定元本額は59,864円、期中一部解約元本額は14,502,214円です。

(注) 1口当たり純資産額は1,2487円です。

○損益の状況 (2023年11月8日～2024年11月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	157,071
受取利息	157,757
支払利息	△ 686
(B) 有価証券売買損益	12,422,795
売買益	13,361,143
売買損	△ 938,348
(C) 信託報酬等	△ 741,181
(D) 当期損益金(A+B+C)	11,838,685
(E) 前期繰越損益金	25,796,896
(F) 追加信託差損益金	△12,171,829
(配当等相当額)	(16,459,778)
(売買損益相当額)	(△28,631,607)
(G) 計(D+E+F)	25,463,752
(H) 収益分配金	△ 51,091
次期繰越損益金(G+H)	25,412,661
追加信託差損益金	△12,171,829
(配当等相当額)	(16,459,778)
(売買損益相当額)	(△28,631,607)
分配準備積立金	37,584,490

(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(2023年11月8日～2024年11月7日)は以下の通りです。

項 目	2023年11月8日～ 2024年11月7日
a. 配当等収益(経費控除後)	147,806円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	11,690,879円
c. 信託約款に定める収益調整金	16,459,778円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	25,796,896円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	54,095,359円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	5,293円
g. 分配金	51,091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

2023年11月8日から2024年11月7日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

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38期（決算日 2024年10月21日）
 (2023年10月24日～2024年10月21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 (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	期騰落	期中率	期騰落	期中率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
38期(2024年10月21日)	3,099	22.4	4,602.72	22.5	98.6	1.2	9,216

(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 (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落	率	騰落	率		
(期首) 2023年10月23日	円	%		%	%	%
	2,531	—	3,756.35	—	98.0	1.6
10月末	2,548	0.7	3,781.64	0.7	98.1	1.6
11月末	2,686	6.1	3,986.65	6.1	98.3	1.4
12月末	2,680	5.9	3,977.63	5.9	98.9	0.8
2024年1月末	2,888	14.1	4,288.36	14.2	98.9	0.8
2月末	3,030	19.7	4,499.61	19.8	99.0	0.6
3月末	3,164	25.0	4,699.20	25.1	97.9	1.7
4月末	3,136	23.9	4,656.27	24.0	97.9	1.7
5月末	3,172	25.3	4,710.15	25.4	98.0	1.7
6月末	3,218	27.1	4,778.56	27.2	98.0	1.7
7月末	3,200	26.4	4,752.72	26.5	98.9	1.2
8月末	3,107	22.8	4,615.06	22.9	99.6	0.3
9月末	3,060	20.9	4,544.38	21.0	98.1	1.7
(期末) 2024年10月21日	3,099	22.4	4,602.72	22.5	98.6	1.2

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2023年10月24日～2024年10月21日)

基準価額の推移

期間の初め2,531円の基準価額は、期間末に3,099円となり、騰落率は+22.4%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>

- ・米国連邦公開市場委員会（FOMC）の結果を受けて米国連邦準備制度理事会（FRB）が2024年に利下げに動くことが期待されたこと。
- ・国内企業の好調な業績を受けて海外の投資家が日本株式への関心を高めていたこと。
- ・米国の大手半導体企業の好決算などを背景として半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったこと。

<値下がり要因>

- ・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。
- ・米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念が強まったこと。
- ・新首相が衆議院の解散・総選挙を表明し政治的不透明感が高まったこと。

(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2024年7月上旬にかけては、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ったものの、FOMCの結果を受けてFRBが2024年に利下げに動くことが期待されたことや、国内企業の好調な業績を受けて海外の投資家が日本株式への関心を高めていたこと、米国の大手半導体企業の好決算などを背景として半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったこと、円安／アメリカドル高が進行し輸出企業の好調な業績が期待されたことなどが支援材料となり、TOPIXは上昇しました。7月中旬から期間末にかけては、FRBが利下げを開始し米国経済の下支えになるとの期待感が強まったことや、日銀総裁の金融政策決定会合後の記者会見での発言から早期の追加利上げ観測が後退したことなどが上昇要因となったものの、日銀が金融政策決定会合において利上げを決定したことを受けて円高／アメリカドル安が進み、輸出関連企業の業績への期待が一時後退したことや、米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念が強まったこと、新首相が衆議院の解散・総選挙を表明し政治的不透明感が高まったことなどが重しとなり、TOPIXは下落しました。



期首	期中高値	期中安値	期末
2023/10/23	2024/07/11	2023/10/26	2024/10/21
2,531円	3,354円	2,515円	3,099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

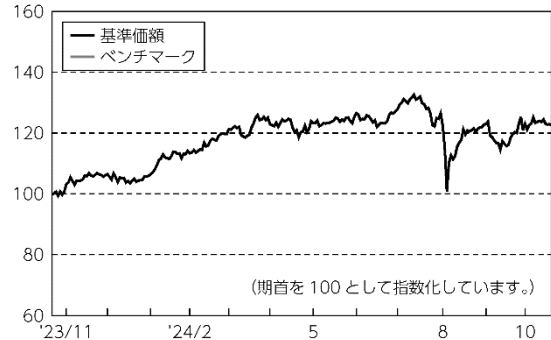
期間中における基準価額は、22.4%の値上がりとなり、ベンチマークである「ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込み」の上昇率22.5%を概ね0.1%下回りました。

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>

- ・未ヘッジのキャッシュの影響。

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

(2023年10月24日～2024年10月21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)	% 0.000 (0.000) (0.000)	(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	0.000	
期中の平均基準価額は、2,990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

(2023年10月24日～2024年10月21日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 176 (904)	千円 369,881 (71)	千株 436	千円 837,956

(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 — (200)	千円 — (ー)	証券 — (200)	千円 — (ー)	

(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 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 874	百万円 918	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2023年10月24日～2024年10月21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	1,207,837千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	9,084,146千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.13

(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

(2023年10月24日～2024年10月21日)

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 -	百万円 1	百万円 28

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グループ株式会社です。

○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 (2023年10月24日～2024年10月21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

(2024年10月21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	0.1	0.1	418
ニッスイ	3.7	3.4	3,123
マルハニチロ	0.5	0.5	1,514
雪国まいたけ	0.3	0.3	309
カネコ種苗	0.1	0.1	137
サカタのタネ	0.4	0.4	1,434
ホクト	0.3	0.3	549
ホクリヨウ	0.1	—	—
鉱業 (0.2%)			
住石ホールディングス	0.4	0.5	427
日鉄鉱業	0.1	0.1	438
三井松島ホールディングス	0.2	—	—
I N P E X	13	9.1	18,190
石油資源開発	0.4	2	2,286
K&Oエナジーグループ	0.2	0.2	652
建設業 (2.2%)			
ショーボンドホールディングス	0.5	0.5	2,742
ミライト・ワン	1.2	1	2,151
タマホーム	0.2	0.2	765
日本アクア	0.1	0.1	82
ファーストコーポレーション	0.1	—	—
ベステラ	0.1	—	—
キャンディル	0.1	—	—
ダイセキ環境ソリューション	0.1	—	—
第一カッター興業	0.1	0.1	148
安藤・間	2	2	2,270
東急建設	1	1.1	770
コムシスホールディングス	1.1	1.1	3,419
ピーアールホールディングス	0.6	0.5	176
高松コンストラクショングループ	0.2	0.3	879
東建コーポレーション	0.1	0.1	1,069
ヤマウラ	0.2	0.2	246
オリエンタル白石	1.3	1.2	452

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大成建設	2.3	2.2	13,620
大林組	8.8	8.5	15,793
清水建設	7	6.7	6,561
飛鳥建設	0.3	—	—
長谷工コーポレーション	2.5	2.2	4,176
松井建設	0.2	0.2	163
鹿島建設	5.5	5.2	13,806
不動テトラ	0.2	0.2	431
大末建設	0.1	—	—
鉄建建設	0.2	0.2	481
西松建設	0.4	0.5	2,495
三井住友建設	2	1.7	671
大豊建設	0.1	0.1	346
佐田建設	0.1	0.1	85
ナカノフドー建設	0.1	—	—
奥村組	0.4	0.4	1,764
東鉄工業	0.4	0.3	985
富士ビー・エス	0.1	—	—
浅沼組	0.2	1	681
戸田建設	3	3.2	2,991
熊谷組	0.4	0.4	1,424
植木組	0.1	—	—
矢作建設工業	0.3	0.3	453
ビーエス・コンストラクション	0.3	0.3	304
日本ハウスホールディングス	0.5	0.5	168
新日本建設	0.3	0.3	479
東亜道路工業	0.1	0.4	512
日本道路	0.3	0.3	484
東亜建設工業	0.2	0.7	707
日本国土開発	0.7	0.6	306
若築建設	0.1	0.1	350
東洋建設	0.8	0.6	796
五洋建設	3.5	3.4	2,186
世紀東急工業	0.3	0.3	450

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
福田組	0.1	0.1	575
住友林業	2.1	2	13,078
日本基礎技術	0.1	—	—
巴コーポレーション	0.2	0.1	86
大和ハウス工業	6.8	6.5	29,380
ライト工業	0.5	0.4	905
積水ハウス	7.5	7.2	27,612
日特建設	0.2	0.2	204
北陸電気工事	0.2	0.1	121
ユアテック	0.5	0.5	752
日本リーテック	0.2	0.2	211
四電工	0.1	0.3	381
中電工	0.4	0.4	1,302
関電工	1.3	1.5	3,342
きんでん	1.7	1.6	5,180
東京エネシス	0.2	0.2	237
トーエネック	0.1	0.5	461
住友電設	0.2	0.2	900
日本電設工業	0.4	0.4	743
エクシオグループ	1.1	2.3	3,577
新日本空調	0.1	0.1	344
九電工	0.6	0.5	3,091
三機工業	0.6	0.5	1,233
日揮ホールディングス	2.4	2.3	3,002
中外炉工業	0.1	0.1	265
ヤマト	0.2	0.1	92
太平電業	0.2	0.1	534
高砂熱学工業	0.6	0.6	2,940
朝日工業社	0.1	0.2	263
明星工業	0.4	0.4	504
大気社	0.3	0.3	1,450
ダイダン	0.3	0.3	910
日比谷総合設備	0.2	0.2	734
飛島ホールディングス	—	0.2	310
フィル・カンパニー	0.1	—	—
テスホールディングス	0.5	0.5	144
インフロニア・ホールディングス	2.6	2.7	3,181
東洋エンジニアリング	0.3	0.4	307

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
レイズネクスト	0.4	0.3	475
食料品 (3.2%)			
ニッポン	0.7	0.7	1,534
日清製粉グループ本社	2.3	2.2	3,876
昭和産業	0.2	0.2	575
鳥越製粉	0.1	0.2	136
中部飼料	0.3	0.3	420
フィード・ワン	0.3	0.4	342
日本甜菜製糖	0.1	0.1	257
DM三井製糖ホールディングス	0.2	0.2	644
塩水港精糖	0.2	0.2	54
ウェルネオシュガー	0.1	0.1	221
森永製菓	0.4	1	2,871
中村屋	0.1	0.1	329
江崎グリコ	0.7	0.7	3,105
名糖産業	0.1	0.1	185
井村屋グループ	0.1	0.1	242
不二家	0.2	0.2	537
山崎製パン	1.7	1.6	4,348
モロゾフ	0.1	0.1	463
亀田製菓	0.2	0.1	426
寿スピリッツ	1.4	1.1	2,191
カルビー	1.1	1.1	3,734
森永乳業	0.5	0.8	2,792
六甲バター	0.2	0.2	301
ヤクルト本社	3.6	3.4	11,379
明治ホールディングス	3	2.9	10,266
雪印メグミルク	0.6	0.6	1,575
プリマハム	0.3	0.3	678
日本ハム	1	1	5,216
林兼産業	0.1	0.1	47
丸大食品	0.2	0.2	337
S F o o d s	0.3	0.3	843
柿安本店	0.1	0.1	262
伊藤ハム米久ホールディングス	0.3	0.4	1,534
サッポロホールディングス	0.8	0.8	5,853
アサヒグループホールディングス	5.7	17.7	31,010
キリンホールディングス	10.3	9.9	21,854

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シマダヤ	—	0.1	151
宝ホールディングス	1.7	1.6	1,938
オエノンホールディングス	0.7	0.8	332
養命酒製造	0.1	0.1	250
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	1.9	1.7	3,299
サントリー食品インターナショナル	1.8	1.7	8,933
ダイドーグループホールディングス	0.1	0.3	909
伊藤園	0.8	0.8	2,653
キーコーヒー	0.3	0.3	604
ユニカフェ	0.1	0.1	94
日清オイリオグループ	0.3	0.3	1,575
不二製油グループ本社	0.6	0.6	1,905
J-オイルミルズ	0.2	0.3	624
キッコーマン	1.6	7.9	13,204
味の素	6	5.6	31,522
ブルドックソース	0.1	0.1	173
キューピー	1.3	1.3	4,590
ハウス食品グループ本社	0.8	0.8	2,400
カゴメ	1.1	1	3,198
焼津水産化学工業	0.1	—	—
アリアケジャパン	0.2	0.2	1,054
エバラ食品工業	0.1	0.1	293
ニチレイ	1.1	1.1	4,713
東洋水産	1.3	1.2	10,554
イートアンドホールディングス	0.1	0.1	220
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.2	0.1	149
日清食品ホールディングス	0.9	2.5	10,187
永谷園ホールディングス	0.1	—	—
一正蒲鉾	0.1	0.1	74
フジッコ	0.2	0.2	342
ロック・フィールド	0.3	0.3	440
日本たばこ産業	15	14.4	58,953
ケンコーマヨネーズ	0.2	0.2	439
わらべや日洋ホールディングス	0.2	0.1	211
なとり	0.1	0.2	424
ファーマフーズ	0.4	0.3	256
ユーグレナ	1.5	1.6	686
紀文食品	0.2	0.2	221

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビックスホールディングス	0.1	0.2	216
ミヨシ油脂	0.1	—	—
理研ビタミン	0.2	0.2	522
繊維製品 (0.4%)			
片倉工業	0.3	0.2	401
グンゼ	0.2	0.2	1,080
東洋紡	1.1	1	976
ユニチカ	0.9	0.7	204
富士紡ホールディングス	0.1	0.1	466
倉敷紡績	0.2	0.2	947
シキボウ	0.1	0.2	202
日本毛織	0.7	0.6	760
ダイトウボウ	0.7	0.3	30
トーア紡コーポレーション	0.2	0.1	39
ダイドーリミテッド	0.4	0.1	86
帝国繊維	0.3	0.3	812
帝人	2.4	2.3	3,218
東レ	16.8	16.2	13,345
日本フェルト	0.2	0.1	47
アツギ	0.2	0.1	89
セーレン	0.5	0.5	1,286
小松マテーレ	0.4	0.4	308
ワコールホールディングス	0.5	0.4	1,856
ホギメディカル	0.3	0.3	1,444
T S I ホールディングス	0.8	0.7	683
マツオカコーポレーション	0.1	—	—
ワールド	0.3	0.3	613
三陽商会	0.1	0.1	271
オンワードホールディングス	1.6	1.5	789
ルックホールディングス	0.1	0.1	254
ゴールドウイン	0.4	0.4	3,368
デサント	0.4	0.4	1,738
キング	0.1	—	—
ヤマトインターナショナル	0.3	0.1	31
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	0.1	0.1	366
王子ホールディングス	10.4	10.1	5,736
日本製紙	1.3	1.4	1,288

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱製紙	0.3	0.1	50
北越コーポレーション	1.6	1.2	1,857
中越パルプ工業	0.1	—	—
大王製紙	1.1	1.1	982
阿波製紙	0.1	—	—
レンゴー	2.3	2.2	2,076
トーモク	0.1	0.1	237
ザ・バック	0.2	0.2	747
化学 (5.6%)			
北の達人コーポレーション	1	0.9	144
クラレ	3.6	3.5	7,129
旭化成	15.7	16.4	17,121
共和レザー	0.1	—	—
巴川コーポレーション	0.1	—	—
レゾナック・ホールディングス	2.4	2.2	8,140
住友化学	18.6	17.8	7,299
住友精化	0.1	0.1	500
日産化学	1.2	1.1	5,847
ラサ工業	0.1	0.1	280
クレハ	0.2	0.5	1,421
多木化学	0.1	0.1	368
テイカ	0.2	0.2	331
石原産業	0.5	0.4	588
日本曹達	0.3	0.6	1,495
東ソー	3.3	3.2	6,076
トクヤマ	0.8	0.8	2,202
セントラル硝子	0.4	0.3	1,041
東亜合成	1.3	1.2	1,932
大阪ソーダ	0.1	1	1,750
関東電化工業	0.5	0.4	388
デンカ	0.9	0.9	1,943
信越化学工業	20.9	21.7	128,789
日本カーバイド工業	0.1	0.1	167
堺化学工業	0.2	0.2	530
第一稀元素化学工業	0.2	0.2	160
エア・ウォーター	2.4	2.3	4,486
日本酸素ホールディングス	2.4	2.3	11,918
日本化学工業	0.1	0.1	272

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東邦アセチレン	—	0.1	33
日本パーカライジニング	1.2	1.1	1,443
高圧ガス工業	0.4	0.3	264
四国化成ホールディングス	0.3	0.3	595
戸田工業	0.1	—	—
ステラ ケミファ	0.1	0.1	461
保土谷化学工業	0.1	0.1	418
日本触媒	0.4	1.4	2,432
大日精化工業	0.2	0.2	588
カネカ	0.6	0.6	2,250
三菱瓦斯化学	1.9	1.7	4,577
三井化学	2.1	2	7,094
J S R	2.3	—	—
東京応化工業	0.4	1.1	3,957
大阪有機化学工業	0.2	0.2	601
三菱ケミカルグループ	17	17.7	14,666
KHネオケム	0.4	0.4	816
ダイセル	3.5	3	3,993
住友ベークライト	0.4	0.7	2,772
積水化学工業	5.1	4.8	10,531
日本ゼオン	1.5	1.6	2,164
アイカ工業	0.6	0.6	1,983
UBE	1.3	1.1	2,805
積水樹脂	0.4	0.4	929
タキロンシーアイ	0.5	—	—
旭有機材	0.2	0.2	828
ニチバン	0.2	0.1	196
リケンテクノス	0.5	0.4	431
大倉工業	0.1	0.1	271
積水化成成品工業	0.4	0.3	118
群栄化学工業	0.1	—	—
タイガースポリマー	0.1	—	—
ミライアル	0.1	—	—
ダイキアクシス	0.1	—	—
ダイキョーニシカワ	0.6	0.5	314
竹本容器	0.1	—	—
森六ホールディングス	0.1	0.1	228
恵和	0.2	0.1	103

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本化薬	1.9	1.8	2,210
カーリット	0.2	0.3	383
日本精化	0.1	0.2	470
扶桑化学工業	0.2	0.3	1,174
トリケミカル研究所	0.3	0.3	951
ADEKA	0.9	0.8	2,226
日油	0.8	2.2	5,639
新日本理化	0.3	0.1	18
ハリマ化成グループ	0.1	0.2	169
花王	5.7	5.9	40,521
第一工業製薬	0.1	0.1	320
石原ケミカル	0.1	0.1	243
日華化学	0.1	—	—
三洋化成工業	0.2	0.1	413
有機合成薬品工業	0.2	0.1	26
大日本塗料	0.3	0.3	312
日本ペイントホールディングス	13.3	10.7	11,111
関西ペイント	2	2.1	5,202
神東塗料	0.3	—	—
中国塗料	0.4	0.5	1,059
日本特殊塗料	0.1	—	—
藤倉化成	0.4	0.3	141
太陽ホールディングス	0.4	0.4	1,572
D I C	1	0.9	3,003
サカタインクス	0.6	0.5	786
artience	0.5	0.4	1,438
T&K TOKA	0.2	—	—
富士フイルムホールディングス	4.8	13.5	49,491
資生堂	5.3	5.1	17,380
ライオン	3.3	3.1	5,217
高砂香料工業	0.2	0.2	1,032
マンダム	0.5	0.5	630
ミルボン	0.3	0.4	1,256
ファンケル	1.1	0.6	1,673
コーセー	0.5	0.5	4,235
コタ	0.2	0.2	333
ポーラ・オルビスホールディングス	1.3	1.2	1,822
ノエビアホールディングス	0.2	0.2	1,040

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
新日本製薬	0.1	0.1	172
I - n e	—	0.1	175
アクシージア	0.1	0.1	58
エステー	0.2	0.2	296
アグロ カネショウ	0.1	0.1	135
コニシ	0.4	0.7	923
長谷川香料	0.5	0.5	1,682
星光PMC	0.1	—	—
小林製薬	0.7	0.6	3,457
荒川化学工業	0.2	0.2	275
メック	0.2	0.2	762
日本高純度化学	0.1	—	—
タカラバイオ	0.7	0.7	735
J C U	0.3	0.3	1,024
新田ゼラチン	0.1	0.1	90
OATアグリオ	0.1	0.1	189
デクセリアルズ	0.7	1.8	4,332
アース製薬	0.2	0.2	1,058
北興化学工業	0.3	0.2	253
大成ラミック	0.1	0.1	261
クミアイ化学工業	1	1	813
日本農薬	0.5	0.4	250
アキレス	0.2	0.1	148
有沢製作所	0.4	0.4	560
日東電工	1.8	7.5	18,251
レック	0.4	0.3	394
三光合成	0.3	0.3	182
きもと	0.3	0.1	24
ZACROS	0.2	0.2	849
前澤化成工業	0.2	0.2	363
未来工業	0.1	0.1	348
ウェーブロックホールディングス	0.1	—	—
J S P	0.2	0.2	387
エフビコ	0.5	0.5	1,361
天馬	0.2	0.2	587
信越ポリマー	0.5	0.5	737
東リ	0.4	0.1	37
ニフコ	0.9	0.7	2,419

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
バルカー	0.2	0.2	670
ユニ・チャーム	5.2	5	24,390
ショーエイコーポレーション	0.1	—	—
医薬品 (4.8%)			
協和キリン	3	2.9	7,653
武田薬品工業	22.3	21.4	91,891
アステラス製薬	23.8	21.2	37,842
住友ファーマ	1.8	1.8	1,121
塩野義製薬	3.2	8.7	18,252
わかもと製薬	0.1	—	—
日本新薬	0.6	0.6	2,521
中外製薬	7.9	7.6	53,222
科研製薬	0.4	0.4	1,547
エーザイ	3.1	2.9	15,262
ロート製薬	2.4	2.3	7,985
小野薬品工業	4.8	5	10,035
久光製薬	0.6	0.5	2,149
持田製薬	0.3	0.3	1,053
参天製薬	4.5	4.3	7,763
扶桑薬品工業	0.1	0.1	244
ツムラ	0.8	0.8	3,937
キッセイ薬品工業	0.4	0.4	1,534
生化学工業	0.5	0.4	347
栄研化学	0.4	0.4	1,020
鳥居薬品	0.1	0.1	394
JCRファーマ	0.8	0.8	547
東和薬品	0.4	0.4	1,234
富士製薬工業	0.2	0.2	263
ゼリア新薬工業	0.3	0.3	697
ネクスラファーマ	0.8	1.1	1,354
第一三共	21.9	21.1	103,790
杏林製薬	0.5	0.5	758
大幸薬品	0.5	0.5	194
ダイト	0.2	0.2	450
大塚ホールディングス	5.2	6	54,342
大正製薬ホールディングス	0.6	—	—
ペプチドリーム	1.2	1.2	3,561
セルソース	—	0.2	252

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
あすか製薬ホールディングス	0.2	0.2	447
サワイグループホールディングス	0.6	1.8	3,702
石油・石炭製品 (0.6%)			
日本コークス工業	2.3	2.5	240
ニチレキグループ	0.2	0.3	720
ユシロ化学工業	0.1	0.1	159
ビービー・カストロール	0.1	0.1	87
富士石油	0.6	0.7	240
MORESCO	0.1	0.1	121
出光興産	2.8	12.5	13,025
ENEOSホールディングス	42.6	38.3	29,835
コスモエネルギーホールディングス	1	0.7	5,407
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	1.2	1.2	3,802
TOYO TIRE	1.4	1.4	2,996
ブリヂストン	7.4	7.1	39,973
住友ゴム工業	2.4	2.4	3,709
藤倉コンボジット	0.1	0.2	240
オカモト	0.1	0.1	529
フコク	0.1	0.1	176
ニッタ	0.3	0.2	745
住友理工	0.5	0.4	581
三ツ星ベルト	0.4	0.3	1,167
バンドー化学	0.4	0.4	712
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日東紡績	0.3	0.3	2,088
AGC	2.4	2.3	10,718
日本板硝子	1.3	1.1	404
日本山村硝子	0.1	—	—
日本電気硝子	1	0.9	3,024
オハラ	0.1	0.1	131
住友大阪セメント	0.4	0.4	1,587
太平洋セメント	1.6	1.4	4,817
日本ヒューム	0.2	0.2	270
日本コンクリート工業	0.5	0.5	165
三谷セキサン	0.1	0.1	579
アジアパイルホールディングス	0.4	0.3	242
東海カーボン	2.3	2.2	1,901

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本カーボン	0.1	0.1	450
東洋炭素	0.2	0.2	1,086
ノリタケ	0.1	0.3	1,194
TOTO	1.7	1.6	8,200
日本碍子	2.9	2.8	5,248
日本特殊陶業	1.9	2	8,334
ダントーホールディングス	0.1	—	—
MARUWA	0.1	0.1	4,185
品川リフラクトリーズ	0.5	0.3	526
黒崎播磨	—	0.2	456
ヨータイ	0.1	0.1	168
東京窯業	0.1	0.1	40
ニッカトー	0.1	—	—
フジミインコーポレーテッド	0.6	0.6	1,411
ニチアス	0.6	0.6	3,396
ニチハ	0.3	0.3	1,051
鉄鋼 (0.8%)			
日本製鉄	11.6	11.8	36,084
神戸製鋼所	5.2	5	8,357
中山製鋼所	0.6	0.5	382
合同製鐵	0.1	0.1	405
JFEホールディングス	7.2	6.9	12,737
東京製鐵	0.7	0.7	1,360
共英製鋼	0.3	0.3	520
大和工業	0.4	0.5	3,571
東京鐵鋼	0.1	0.1	516
大阪鐵鐵	0.1	0.1	331
淀川製鋼所	0.3	0.3	1,665
中部鋼板	0.2	0.1	252
丸一鋼管	0.8	0.8	2,658
モリ工業	—	0.1	516
大同特殊鋼	0.3	1.6	2,165
日本高周波鋼業	0.2	—	—
日本冶金工業	0.2	0.2	876
山陽特殊製鋼	0.3	0.2	372
愛知製鋼	0.2	0.1	423
日本金属	0.1	—	—
大平洋金属	0.2	0.2	280

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
新日本電工	1.4	1.4	410
栗本鐵工所	0.1	0.1	392
三菱製鋼	0.2	0.2	269
日亜鋼業	0.3	—	—
日本精線	—	0.2	255
エンビプロ・ホールディングス	0.2	0.2	104
シンニッタン	0.3	—	—
新家工業	0.1	—	—
非鉄金属 (0.8%)			
大紀アルミニウム工業所	0.3	0.3	334
日本軽金属ホールディングス	0.7	0.7	1,137
三井金属鉱業	0.7	0.7	3,427
東邦亜鉛	0.1	—	—
三菱マテリアル	1.7	1.8	4,551
住友金属鉱山	3	2.9	12,829
DOWAホールディングス	0.6	0.6	3,133
古河機械金属	0.4	0.3	502
エス・サイエンス	0.5	0.8	18
大阪チタニウムテクノロジーズ	0.4	0.4	968
東邦チタニウム	0.5	0.5	560
UACJ	0.4	0.4	2,056
CKサンエツ	0.1	0.1	370
古河電気工業	0.8	0.8	2,864
住友電気工業	8.9	9.3	21,580
フジクラ	2.8	2.9	14,879
SWCC	0.3	0.3	1,590
タツタ電線	0.5	0.2	155
平河ヒューテック	0.1	0.2	309
リョービ	0.3	0.3	562
アーレスティ	0.2	0.1	56
AREホールディングス	1	0.9	1,631
金属製品 (0.5%)			
稲葉製作所	0.1	0.1	175
宮地エンジニアリンググループ	0.2	0.2	402
トーカロ	0.7	0.7	1,277
アルファC o	0.1	—	—
SUMCO	4.6	4.7	7,028
川田テクノロジーズ	0.1	0.2	492

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
RS Technologies	0.2	0.2	802
信和	0.1	0.1	74
東洋製織グループホールディングス	1.5	1.4	3,136
ホッカンホールディングス	0.1	0.1	178
コロナ	0.1	0.1	96
横河ブリッジホールディングス	0.3	0.4	1,050
三和ホールディングス	2.4	2.5	9,185
文化シャッター	0.8	0.6	1,093
三協立山	0.3	0.3	229
アルインコ	0.2	0.2	194
LIXIL	3.8	3.9	6,419
日本フィルコン	0.1	0.1	52
ノーリツ	0.4	0.4	725
長府製作所	0.3	0.3	590
リンナイ	1.4	1.2	4,104
ダイニチ工業	0.1	0.1	60
日東精工	0.4	0.3	171
岡部	0.5	0.4	313
ジーテクト	0.3	0.3	467
東プレ	0.5	0.4	703
高周波熱練	0.4	0.3	298
東京製網	0.1	0.2	222
サンコール	0.1	0.3	112
モリテック スチール	0.1	0.2	36
バイオラックス	0.4	0.3	737
エイチワン	0.3	0.2	186
日本発條	2.3	2.2	4,097
中央発條	0.2	0.2	244
立川ブラインド工業	0.1	0.1	133
三益半導体工業	0.2	0.1	368
機械 (5.5%)			
日本製鋼所	0.7	0.7	3,902
三浦工業	1.1	1	3,641
タクマ	0.8	0.8	1,286
ツガミ	0.6	0.5	723
オークマ	0.3	0.4	1,261
芝浦機械	0.3	0.2	760
アマダ	4.1	3.7	5,701

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アイダエンジニアリング	0.6	0.5	390
F U J I	1.1	1.1	2,490
牧野フライス製作所	0.3	0.3	1,794
オーエスジー	1.1	1.1	2,005
旭ダイヤモンド工業	0.7	0.6	513
DMG森精機	1.5	1.5	4,353
ソディック	0.7	0.7	551
ディスコ	1.2	1.2	47,448
日東工器	0.1	0.1	254
日進工具	0.2	0.3	225
パンチ工業	0.2	0.2	86
富士ダイス	0.1	0.2	158
豊和工業	0.1	—	—
石川製作所	0.1	—	—
リケンNPR	0.2	0.3	702
東洋機械金属	0.2	0.1	62
エンシュウ	0.1	0.1	62
島精機製作所	0.4	0.4	460
オプトラン	0.4	0.4	762
イワキポンプ	0.2	0.2	582
フリュー	0.3	0.3	321
ヤマシンフィルタ	0.7	0.6	286
日阪製作所	0.3	0.3	309
やまびこ	0.4	0.4	1,022
野村マイクロ・サイエンス	0.1	0.3	669
平田機工	0.1	0.1	501
PEGASUS	0.3	0.3	142
マルマエ	0.1	0.1	158
タツモ	0.2	0.2	715
ナブテスコ	1.6	1.5	3,696
三井海洋開発	0.3	0.3	948
レオン自動機	0.3	0.3	418
SMC	0.8	0.7	44,975
ホソカワミクロン	0.2	0.2	824
ユニオンツール	0.1	0.1	685
瑞光	—	0.2	274
オイレス工業	0.4	0.3	590
日精エー・エス・ビー機械	0.1	0.1	454

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サトーホールディングス	0.4	0.3	648
技研製作所	0.3	0.2	372
日本エアータック	0.1	0.1	121
日精樹脂工業	0.2	0.2	186
ワイエイシイホールディングス	0.1	0.1	228
小松製作所	11.9	11.4	45,634
住友重機械工業	1.5	1.4	4,891
日立建機	1	1	3,452
日工	0.4	0.4	278
巴工業	0.1	0.1	397
井関農機	0.3	0.2	199
TOWA	0.3	0.9	1,818
北川鉄工所	0.1	0.1	123
ローツェ	0.1	1	2,076
クボタ	13.4	12.8	25,523
荏原実業	0.1	0.1	406
三菱化工機	0.1	0.1	357
月島ホールディングス	0.4	0.3	414
帝国電機製作所	0.2	0.2	575
東京機械製作所	0.1	0.1	35
新東工業	0.5	0.5	501
澁谷工業	0.2	0.2	731
アイチ コーポレーション	0.4	0.3	381
小森コーポレーション	0.6	0.6	667
鶴見製作所	0.2	0.2	853
日本ギア工業	0.2	0.1	46
酒井重工業	—	0.2	486
荏原製作所	1	5	11,810
西島製作所	0.2	0.2	582
北越工業	0.3	0.2	372
ダイキン工業	3	2.9	54,491
オルガノ	0.4	0.3	2,205
トーヨーカネツ	0.1	0.1	434
栗田工業	1.4	1.4	8,219
椿本チエイン	0.4	0.9	1,725
木村化工機	0.2	0.2	147
アネスト岩田	0.5	0.4	569
ダイフク	4	4.1	11,371

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サムコ	0.1	0.1	344
加藤製作所	0.1	—	—
タダノ	1.5	1.4	1,341
フジテック	0.9	0.6	2,977
CKD	0.7	0.7	1,930
平和	0.9	0.7	1,504
理想科学工業	0.2	0.2	672
SANKYO	0.5	2.3	4,899
日本金銭機械	0.3	0.3	277
マースグループホールディングス	0.2	0.1	324
フクシマガリレイ	0.2	0.2	1,144
ダイコク電機	0.1	0.1	363
竹内製作所	0.5	0.4	1,908
アマノ	0.7	0.7	3,117
JUKI	0.4	0.4	159
サンデン	0.5	—	—
ジャノメ	0.3	0.3	272
マックス	0.3	0.3	1,077
グローリー	0.6	0.6	1,512
新晃工業	0.3	0.2	901
大和冷機工業	0.4	0.4	576
セガサミーホールディングス	2.1	2.2	6,472
T P R	0.3	0.3	685
ツバキ・ナカシマ	0.5	0.6	418
ホシザキ	1.5	1.6	8,355
大豊工業	0.3	0.2	126
日本精工	4.3	4.5	3,147
NTN	5.1	5.4	1,361
ジェイテクト	2.3	2.2	2,226
不二越	0.2	0.2	639
日本トムソン	0.7	0.7	334
THK	1.5	1.4	3,516
ユースイン精機	0.3	0.2	134
前澤給装工業	0.2	0.2	260
イーグル工業	0.3	0.3	627
前澤工業	0.1	—	—
PILLAR	0.2	0.2	896
キッツ	0.9	0.9	963

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マキタ	3.2	2.8	13,482
三井E&S	1.3	1.2	1,341
カナデビア	2.1	2.2	2,237
三菱重工業	4.5	42.6	94,529
I H I	1.6	1.8	14,344
サノヤスホールディングス	0.5	—	—
スター精密	0.5	0.4	790
電気機器 (17.5%)			
日清紡ホールディングス	1.9	1.8	1,756
イビデン	1.5	1.3	6,437
コニカミノルタ	5.7	5.4	2,628
ブラザー工業	3.4	3.2	9,664
ミネベアミツミ	4.4	4.2	11,762
日立製作所	12.3	58.5	231,367
東芝	4.9	—	—
三菱電機	26.2	26.7	63,225
富士電機	1.5	1.5	12,157
東洋電機製造	0.1	—	—
安川電機	3	2.6	11,395
シンフォニアテクノロジー	0.3	0.3	1,536
明電舎	0.4	0.5	1,950
オリジン	0.1	—	—
山洋電気	0.1	0.1	919
デンヨー	0.2	0.2	515
PHCホールディングス	0.3	0.5	510
KOKUSAI ELECTRIC	—	1.3	3,861
ソシオネクスト	0.4	1.8	5,331
東芝テック	0.4	0.3	1,042
芝浦メカトロニクス	—	0.1	1,041
マブチモーター	0.6	1.1	2,453
ニデック	6.2	10.8	31,201
ユウ・エム・シー・エレクトロニクス	0.2	0.1	36
トレックス・セミコンダクター	0.1	0.1	152
東光高岳	0.2	0.1	181
ダブル・スコープ	0.8	0.7	240
ダイヘン	0.2	0.2	1,294
ヤーマン	0.4	0.4	348
JVCケンウッド	2.3	1.9	2,380

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ミマキエンジニアリング	0.3	0.2	268
I-PEX	0.2	0.1	155
大崎電気工業	0.6	0.5	397
オムロン	2.3	1.9	11,837
日東工業	0.3	0.3	891
I D E C	0.4	0.3	751
正興電機製作所	0.1	—	—
不二電機工業	0.1	—	—
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.8	0.9	2,484
メルコホールディングス	0.1	0.1	238
テクノメディカ	0.1	0.1	184
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	60
日本電気	3.6	3.2	42,656
富士通	2.5	22.4	68,521
沖電気工業	1.1	1.1	1,119
岩崎通信機	0.1	—	—
電気興業	0.1	0.1	197
サンケン電気	0.2	0.2	1,270
ナカヨ	0.1	—	—
アイホン	0.2	0.1	303
ルネサスエレクトロニクス	16.5	18.6	38,185
セイコーエプソン	3.2	3.1	8,652
ワコム	1.9	1.7	1,162
アルバック	0.6	0.5	3,636
アクセル	0.1	0.1	141
E I Z O	0.2	0.4	890
日本信号	0.6	0.6	571
京三製作所	0.6	0.5	281
能美防災	0.3	0.3	824
ホーチキ	0.2	0.2	431
星和電機	0.1	0.1	52
エレコム	0.6	0.6	883
パナソニック ホールディングス	29.9	28.8	36,748
シャープ	3.1	4	3,964
アンリツ	1.8	1.7	1,913
富士通ゼネラル	0.7	0.7	1,428
ソニーグループ	17.8	84.5	228,995
T D K	4	19.5	35,070

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
帝国通信工業	0.1	0.1	265
タムラ製作所	1.1	1	579
アルプスアルパイン	2.3	2.2	3,426
池上通信機	0.1	—	—
日本電波工業	0.3	0.3	324
鈴木	0.2	0.1	191
メイコー	0.3	0.2	1,232
日本トリム	0.1	0.1	361
ローランド ディー. ジー.	0.1	—	—
フォスター電機	0.3	0.2	361
SMK	0.1	0.1	227
ヨコオ	0.2	0.2	315
ティアック	0.6	0.1	8
ホシデン	0.6	0.5	1,095
ヒロセ電機	0.4	0.4	7,422
日本航空電子工業	0.5	0.6	1,558
TOA	0.3	0.3	294
マクセル	0.5	0.5	942
古野電気	0.3	0.3	681
スミダコーポレーション	0.3	0.3	279
アイコム	0.1	0.1	287
リオン	0.1	0.1	222
横河電機	2.8	2.7	9,668
新電元工業	0.1	0.1	242
アズビル	1.8	6.8	8,309
東亜ディーケーケー	0.1	0.1	77
日本光電工業	1.1	2	4,421
チノー	0.1	0.1	227
共和電業	0.2	0.2	83
日本電子材料	0.2	0.1	250
堀場製作所	0.5	0.5	4,716
アドバンテスト	7.9	6.9	56,448
小野測器	0.1	0.1	57
エスベック	0.2	0.2	533
キーエンス	2.5	2.4	160,536
日置電機	0.1	0.1	834
シスメックス	2.2	6.2	17,868
日本マイクロニクス	0.5	0.4	1,516

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メガチップス	0.2	0.2	1,076
OBARA GROUP	0.1	0.2	841
原田工業	0.1	0.1	54
コーセル	0.3	0.3	356
イリソ電子工業	0.2	0.2	516
オプテックスグループ	0.5	0.5	816
千代田インテグレ	0.1	0.1	353
レーザーテック	1.2	1.1	23,919
スタンレー電気	1.7	1.5	3,934
ウシオ電機	1.3	1.1	2,268
岡谷電機産業	0.3	0.2	46
ヘリオス テクノ ホールディング	0.2	—	—
エノモト	0.1	—	—
日本セラミック	0.2	0.2	516
遠藤照明	0.1	—	—
古河電池	0.2	0.2	275
双信電機	0.2	—	—
山一電機	0.2	0.2	503
図研	0.2	0.2	758
日本電子	0.6	0.6	3,346
カシオ計算機	1.9	1.7	1,963
ファナック	12.2	11.7	46,308
日本シイエムケイ	0.6	0.5	206
エンプラス	0.1	0.1	680
大真空	0.3	0.3	184
ローム	4.6	4.3	7,353
浜松ホトニクス	2	3.8	7,609
三井ハイテック	0.3	1	879
新光電気工業	0.9	0.8	4,324
京セラ	3.9	15	25,477
太陽誘電	1.2	1.2	3,429
村田製作所	22.8	21.5	60,823
双葉電子工業	0.5	0.5	254
北陸電気工業	0.1	—	—
ニチコン	0.5	0.6	588
日本ケミコン	0.3	0.3	324
KOA	0.4	0.3	339
市光工業	0.5	0.4	177

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	2.5	5,025
ミツバ	0.5	0.4	346
SCREENホールディングス	0.8	0.8	7,864
キヤノン電子	0.3	0.2	461
キヤノン	12.5	12	60,264
リコー	6.3	6	9,849
象印マホービン	0.7	0.7	1,148
東京エレクトロン	5.3	5.1	120,972
イノテック	0.2	0.2	304
輸送用機器 (7.1%)			
トヨタ紡織	1.1	1	1,910
ユニプレス	0.5	0.4	448
豊田自動織機	1.8	2.1	23,205
モリタホールディングス	0.5	0.4	795
三櫻工業	0.4	0.3	218
デンソー	20.7	19.9	41,461
東海理化電機製作所	0.7	0.7	1,374
川崎重工業	1.9	2	12,364
名村造船所	0.5	0.7	1,076
日本車輛製造	0.1	0.1	220
三菱ロジスネクスト	0.4	0.4	473
日産自動車	35.8	31.6	12,611
いすゞ自動車	7.3	6.7	13,168
トヨタ自動車	137.8	128.1	325,566
日野自動車	3.3	3.5	1,608
三菱自動車工業	9.8	9.2	3,715
エフテック	0.2	—	—
レシップホールディングス	0.1	—	—
ファルテック	0.1	—	—
武蔵精密工業	0.6	0.6	1,174
日産車体	0.5	0.2	215
新明和工業	0.8	0.6	840
極東開発工業	0.4	0.4	1,014
トピー工業	0.2	0.2	394
ティラド	0.1	—	—
タチエス	0.4	0.4	716
NOK	1	0.9	1,983
フタバ産業	0.7	0.5	350

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カヤバ	0.2	0.2	969
大同メタル工業	0.5	0.4	198
プレス工業	1.2	0.9	499
ミクニ	0.3	—	—
太平洋工業	0.6	0.5	676
アイシン	1.9	5.1	8,152
マツダ	8.3	7.9	8,330
今仙電機製作所	0.2	—	—
本田技研工業	61.3	57.1	87,106
スズキ	4.6	17.7	26,647
SUBARU	8	7.5	19,586
安永	0.1	—	—
ヤマハ発動機	3.6	10.2	13,805
TBK	0.2	—	—
エクセディ	0.4	0.4	1,440
豊田合成	0.8	0.7	1,788
愛三工業	0.4	0.4	560
日本プラスト	0.2	—	—
ヨロズ	0.3	0.2	225
エフ・シー・シー	0.5	0.4	948
シマノ	1	1.1	26,829
テイ・エス テック	1.2	0.8	1,381
ジャムコ	0.1	0.1	123
精密機器 (2.5%)			
テルモ	7.8	13.5	39,757
日機装	0.6	0.6	608
日本エム・ディ・エム	0.1	0.2	138
島津製作所	3.1	3.2	14,838
JMS	0.2	0.2	96
長野計器	0.2	0.2	498
プイ・テクノロジー	0.1	0.1	249
東京計器	0.2	0.2	620
愛知時計電機	0.1	0.1	199
インターアクション	0.1	0.1	112
オーバル	0.1	0.1	37
東京精密	0.5	0.5	3,944
マニー	1	1	1,752
ニコン	3.6	3.5	6,440

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トプコン	1.3	1.2	1,903
オリンパス	15.6	13.8	39,129
理研計器	0.2	0.3	1,297
タムロン	0.1	0.3	1,335
HOYA	5.3	4.8	97,584
シード	0.1	0.1	49
ノーリツ銅機	0.2	0.2	798
A&Dホロンホールディングス	0.4	0.4	862
朝日インテック	2.8	3	7,476
シチズン時計	2.3	2.2	2,052
大研医器	0.1	0.1	49
メニコン	0.9	0.8	1,260
松風	0.1	0.2	448
セイコーグループ	0.4	0.3	1,180
ニプロ	2.1	2	2,821
その他製品 (2.5%)			
三井松島ホールディングス	—	0.2	914
KYORITSU	0.2	0.3	45
スノーピーク	0.3	—	—
パラマウントベッドホールディングス	0.6	0.5	1,264
トランザクション	0.1	0.2	523
ニホンフラッシュ	0.2	0.2	179
前田工織	0.2	0.4	714
永大産業	0.2	0.2	43
アートネイチャー	0.2	0.3	256
フルヤ金属	—	0.2	787
バンダイナムコホールディングス	6.9	6.6	21,080
SHOEI	0.6	0.7	1,635
フランスベッドホールディングス	0.3	0.3	384
パイロットコーポレーション	0.4	0.4	1,881
萩原工業	0.2	0.2	316
フジシールインターナショナル	0.5	0.5	1,270
タカラトミー	1.1	1.1	4,341
広済堂ホールディングス	0.1	0.7	371
タカノ	0.1	—	—
プロネクサス	0.2	0.2	263
ホクシン	0.1	—	—
大建工業	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
TOPPANホールディングス	3.1	2.9	12,490
大日本印刷	2.7	5	12,960
共同印刷	0.1	0.1	340
NISSHA	0.4	0.4	731
TAKARA & COMPANY	0.2	0.1	265
アシックス	2.1	8.9	24,270
ツツミ	—	0.1	208
ローランド	0.2	0.2	788
小松ウオール工業	0.1	0.2	307
ヤマハ	1.6	4.5	5,654
河合楽器製作所	0.1	0.1	275
クリナップ	0.3	0.3	212
ビジョン	1.6	1.5	2,485
キングジム	0.2	0.2	171
リンテック	0.5	0.5	1,625
イトーキ	0.5	0.5	782
任天堂	15.9	15.2	122,375
三菱鉛筆	0.3	0.3	726
タカラスタンダード	0.5	0.5	825
コクヨ	1	1.2	3,142
ナカバヤシ	0.3	0.3	156
グローブライド	0.2	0.2	376
オカムラ	0.7	0.7	1,397
美津濃	0.3	0.2	1,658
電気・ガス業 (1.4%)			
グリムス	—	0.1	277
東京電力ホールディングス	22.6	21.7	13,488
中部電力	9.3	8.9	15,125
関西電力	9.7	9.3	23,631
中国電力	4	4.2	4,403
北陸電力	2.3	2.5	2,310
東北電力	6.1	6.4	9,232
四国電力	2.1	2.2	2,719
九州電力	5.7	5.6	9,189
北海道電力	2.4	2.3	2,252
神縄電力	0.6	0.6	607
電源開発	1.9	2	4,847
エフオン	0.2	0.2	72

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イーレックス	0.4	0.4	259
レノバ	0.7	0.7	609
東京瓦斯	5.3	4.7	15,054
大阪瓦斯	5.1	4.8	15,268
東邦瓦斯	1	1	3,811
北海道瓦斯	0.2	0.5	294
広島ガス	0.5	0.5	191
西部ガスホールディングス	0.2	0.3	529
静岡ガス	0.5	0.6	607
メタウォーター	0.3	0.3	549
陸運業 (2.4%)			
SBSホールディングス	0.2	0.2	515
東武鉄道	2.8	2.6	6,401
相鉄ホールディングス	0.8	0.9	2,087
東急	7	6.8	12,481
京浜急行電鉄	2.9	3	3,583
小田急電鉄	3.8	4	6,372
京王電鉄	1.3	1.1	3,787
京成電鉄	1.6	1.6	6,216
富士急行	0.3	0.3	760
東日本旅客鉄道	4.3	13.3	40,046
西日本旅客鉄道	3.2	5.7	15,495
東海旅客鉄道	9.5	9.3	29,648
西武ホールディングス	3	2.9	9,561
鴻池運輸	0.4	0.4	1,022
西日本鉄道	0.7	0.6	1,353
ハマキョウレックス	0.2	0.8	1,040
サカイ引越センター	0.2	0.3	736
近鉄グループホールディングス	2.5	2.4	8,644
阪急阪神ホールディングス	3.3	3.2	13,427
南海電気鉄道	1.2	1.1	2,505
京阪ホールディングス	1.4	1.3	3,712
神戸電鉄	0.1	0.1	240
名古屋鉄道	2.8	2.4	4,089
山陽電気鉄道	0.2	0.2	405
アルプス物流	0.2	0.2	1,154
ヤマトホールディングス	3.2	2.9	4,715
山九	0.6	0.6	2,913

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸運	0.1	0.1	46
丸全昭和運輸	0.2	0.1	573
センコーグループホールディングス	1.3	1.3	1,762
トナミホールディングス	0.1	0.1	595
ニッコンホールディングス	0.8	1.4	2,660
福山通運	0.2	0.2	781
セイノーホールディングス	1.4	1.3	3,136
神奈川中央交通	0.1	0.1	340
AZ-COM丸和ホールディングス	0.6	0.6	642
C&Fロジホールディングス	0.2	—	—
九州旅客鉄道	1.8	1.7	6,740
SGホールディングス	4.8	4	6,036
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.9	0.9	6,869
海運業 (0.8%)			
日本郵船	6.8	6.3	32,999
商船三井	4.4	5.2	26,286
川崎汽船	1.9	5.5	11,885
NSユナイテッド海運	0.1	0.1	462
飯野海運	1	0.9	1,150
乾汽船	0.3	0.3	345
空運業 (0.4%)			
日本航空	6.2	5.9	14,221
ANAホールディングス	6.8	6.6	19,420
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	0.1	0.1	1,041
日新	0.2	0.2	865
三菱倉庫	0.5	0.6	3,124
三井倉庫ホールディングス	0.2	0.2	1,372
住友倉庫	0.7	0.6	1,624
澁澤倉庫	0.1	0.1	320
日本トランスシティ	0.5	0.4	386
中央倉庫	0.1	0.1	165
安田倉庫	0.2	0.2	342
東洋埠頭	0.1	—	—
上組	1.2	1.1	3,526
キムラユニティ	0.1	—	—
キューソー流通システム	0.1	0.2	378
東海運	0.1	0.1	32

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エーアイティー	0.2	0.2	358
内外トランスライン	0.1	0.1	289
日本コンセプト	0.1	0.1	178
情報・通信業 (7.5%)			
NECネットエスアイ	0.8	0.9	2,414
クロスキャット	0.1	0.2	224
システナ	4.2	3.7	1,369
デジタルアーツ	0.2	0.2	1,054
日鉄ソリューションズ	0.4	0.8	2,856
キューブシステム	0.2	0.1	100
コア	0.1	0.1	194
ラクーンホールディングス	0.2	0.2	143
ソリトンシステムズ	0.1	0.1	129
ソフトクリエイトホールディングス	0.2	0.2	415
T I S	2.8	2.6	9,750
テクミラホールディングス	0.1	0.1	32
グリー	0.7	0.8	386
コーエーテクモホールディングス	1.6	1.5	2,355
三菱総合研究所	0.1	0.1	426
ボルテージ	0.1	—	—
AGS	0.1	0.1	81
ファインデックス	0.2	0.2	170
KL a b	0.5	0.7	133
ポルトゥウィンホールディングス	0.4	0.4	186
ネクソン	5.6	5.3	13,933
アイスタイル	0.7	0.8	372
エムアップホールディングス	0.3	0.3	396
エイチーム	0.2	0.2	130
エニグモ	0.3	0.4	126
テクノスジャパン	0.1	0.1	65
e n i s h	0.1	0.2	34
コロブラ	1	0.8	430
ブロードリーフ	1.2	1	596
クロス・マーケティンググループ	0.1	0.1	70
デジタルハーツホールディングス	0.2	0.2	173
システム情報	0.2	—	—
メディアドゥ	0.1	0.1	129
じげん	0.7	0.7	431

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブイキューブ	0.3	—	—
サイバーリンクス	0.1	—	—
フィックスターズ	0.3	0.2	306
CARTA HOLDINGS	0.1	0.1	145
オプティム	0.2	0.3	187
セレス	0.1	0.1	141
S H I F T	0.2	0.2	2,921
ティーガイア	0.3	0.3	800
テクマトリックス	0.5	0.4	922
プロシップ	0.1	0.1	149
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.7	0.6	2,028
GMOペイメントゲートウェイ	0.5	0.6	5,502
ザップラス	0.1	—	—
システムリサーチ	0.1	0.2	287
インターネットイニシアティブ	1.4	1.2	3,534
さくらインターネット	0.3	0.3	1,239
GMOグローバルサイン・ホールディングス	0.1	0.1	282
SRAホールディングス	0.1	0.1	432
システムインテグレータ	0.1	—	—
朝日ネット	0.3	0.3	190
eBASE	0.3	0.4	264
アバントグループ	0.3	0.3	665
アドソル日進	0.1	0.1	181
フリービット	0.1	0.1	117
コムチュア	0.3	0.4	761
アステリア	0.2	0.2	103
アイル	0.1	0.1	321
マークライنز	0.1	0.1	295
メディカル・データ・ビジョン	0.3	0.3	159
g u m i	0.4	0.5	155
テラスカイ	0.1	0.1	182
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.1	0.1	216
P C Iホールディングス	0.1	—	—
ネオジャパン	0.1	0.1	194
P R T I M E S	0.1	—	—
ラクス	1.2	1.1	2,317
ランドコンピュータ	—	0.1	74
ダブルスタンダード	0.1	0.1	171

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オープンドア	0.2	0.2	140
マイネット	0.1	—	—
アカツキ	0.1	0.1	201
Ubicomホールディングス	0.1	0.1	142
カナミックネットワーク	0.3	0.3	174
ノムラシステムコーポレーション	0.2	0.2	23
チェンジホールディングス	0.6	0.5	618
シンクロ・フード	0.1	0.1	49
オークネット	0.1	0.1	253
マクロミル	0.5	0.5	410
オロ	0.1	0.1	230
ユーザーローカル	0.1	0.1	181
テモナ	0.1	—	—
ニーズウェル	0.1	0.2	57
マネーフォワード	0.6	0.6	3,282
サインポスト	0.1	—	—
Sun Asterisk	0.2	0.2	109
プラスアルファ・コンサルティング	—	0.3	637
電算システムホールディングス	0.1	0.1	270
Appier Group	0.9	0.7	1,223
ビジョナル	—	0.3	2,424
ソルクシーズ	0.1	0.1	28
フェイス	0.1	—	—
プロトコーポレーション	0.3	—	—
ハイマックス	0.1	0.1	139
野村総合研究所	5	5.2	25,994
サイバネットシステム	0.2	—	—
CEホールディングス	0.1	0.1	44
日本システム技術	0.1	0.2	367
インテージホールディングス	0.3	0.3	478
東邦システムサイエンス	—	0.1	146
ソースネクスト	1.2	1.1	228
インフォコム	0.3	—	—
シンプレクス・ホールディングス	0.4	0.4	942
HEROZ	0.1	0.1	135
ラクスル	0.6	0.6	768
メルカリ	1.5	1.2	2,846
I P S	0.1	0.1	234

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
F I G	0.2	0.2	61
システムサポート	0.1	0.1	189
イーソル	0.2	0.2	144
ウイングアーク1 s t	0.3	0.3	973
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	0.1	0.1	81
サーバーワークス	0.1	—	—
S a n s a n	0.8	0.8	1,852
ギフティ	0.2	0.2	181
メドレー	0.3	0.3	1,234
ベース	0.1	0.1	305
JMDC	0.4	0.4	1,826
フォーカスシステムズ	0.2	0.2	221
クレスコ	0.2	0.4	507
フジ・メディア・ホールディングス	2.4	2.3	3,892
オービック	0.8	4	19,380
ジャストシステム	0.4	0.3	1,038
TDCソフト	0.2	0.5	612
L I N E ヤフー	35.9	34.5	14,762
トレンドマイクロ	1.2	1.3	10,475
I Dホールディングス	0.2	0.2	286
日本オラクル	0.5	0.5	7,630
アルファシステムズ	0.1	0.1	326
フューチャー	0.6	0.6	1,059
CAC Holdings	0.1	0.2	351
S B テクノロジー	0.1	—	—
トーセ	0.1	—	—
オービックビジネスコンサルタント	0.5	0.3	2,202
伊藤忠テクノソリューションズ	0.7	—	—
アイティフォー	0.3	0.3	403
東計電算	—	0.1	481
大塚商会	1.3	2.7	9,274
サイボウズ	0.3	0.3	642
電通総研	0.3	0.2	1,088
A C C E S S	0.3	0.3	401
デジタルガレージ	0.5	0.4	1,236
EMシステムズ	0.4	0.4	218
ウェザーニューズ	0.1	0.1	572
C I J	0.4	0.6	249

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本エンタープライズ	0.2	0.2	21
WOWOW	0.2	0.2	204
スカラ	0.2	0.3	140
インテリジェント ウェイブ	0.1	0.1	88
ANYCOLOR	—	0.4	899
IMAGICA GROUP	0.2	0.3	152
ネットワンシステムズ	1	0.9	3,143
システムソフト	0.8	1.2	74
アルゴグラフィックス	0.2	0.2	1,048
マーベラス	0.4	0.4	230
エイベックス	0.4	0.4	609
BIPROGY	0.9	0.7	3,378
都築電気	0.1	0.1	242
TBSホールディングス	1.3	1.2	4,657
日本テレビホールディングス	2.3	2.1	5,017
朝日放送グループホールディングス	0.2	0.2	124
テレビ朝日ホールディングス	0.6	0.6	1,222
スカパーJ SATホールディングス	2.2	1.9	1,675
テレビ東京ホールディングス	0.2	0.2	714
日本BS放送	0.1	—	—
ビジョン	0.4	0.4	454
U-NEXT HOLDINGS	0.3	0.3	1,483
日本通信	2.3	2.4	357
日本電信電話	806.7	719.2	104,787
KDDI	19.5	17.8	84,354
ソフトバンク	40.5	387.2	72,522
光通信	0.3	0.2	6,270
エムティーアイ	0.2	0.2	239
GMOインターネットグループ	0.9	0.8	2,058
ファイバーゲート	0.1	0.1	103
KADOKAWA	1.3	1.3	4,390
学研ホールディングス	0.4	0.4	395
ゼンリン	0.4	0.4	338
昭文社ホールディングス	0.1	0.1	37
インプレスホールディングス	0.2	0.2	28
アイネット	0.1	0.2	313
松竹	0.1	0.1	978
東宝	1.6	1.3	7,573

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東映	0.1	0.4	1,910
NTTデータグループ	7.9	6.3	15,208
ピー・シー・エー	0.1	0.1	222
ビジネスブレイン太田昭和	0.1	0.1	183
DTS	0.5	0.5	1,972
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1.3	1.1	6,473
シーイーシー	0.3	0.3	552
カプコン	2.5	4.3	14,095
アイ・エス・ピー	0.1	0.1	149
ジャステック	0.2	—	—
SCSK	2.1	1.7	4,890
NSW	0.1	0.1	292
アイネス	0.2	0.2	322
TKC	0.4	0.4	1,578
富士ソフト	0.5	0.7	6,545
NSD	0.9	0.9	2,938
コナミグループ	1.1	0.9	12,609
福井コンピュータホールディングス	0.2	0.1	270
JBCホールディングス	0.2	0.2	805
ミロク情報サービス	0.2	0.2	370
ソフトバンクグループ	12.4	11.9	108,706
卸売業 (7.2%)			
リョーサン菱洋ホールディングス	—	0.5	1,292
高千穂交易	0.1	0.1	416
伊藤忠食品	0.1	0.1	703
エレマテック	0.2	0.2	346
あらた	0.2	0.4	1,424
東京エレクトロン デバイス	0.3	0.3	1,065
円谷フィールズホールディングス	0.5	0.4	924
双日	2.7	2.8	9,335
アルフレッサ ホールディングス	2.7	2.5	5,787
横浜冷凍	0.7	0.6	574
ラサ商事	0.1	0.1	146
アルコニックス	0.3	0.3	412
神戸物産	2.1	2	8,368
ハイパー	0.1	—	—
あい ホールディングス	0.4	0.4	951
ディーブイエックス	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
ダイワボウホールディングス	1.1	1.1	3,069
マクニカホールディングス	0.6	1.8	3,562
ラクト・ジャパン	0.1	0.1	283
グリムス	0.1	—	—
バイタルケーエスケー・ホールディングス	0.3	0.4	525
八洲電機	0.2	0.2	361
メディアスホールディングス	0.2	0.2	170
レスター	0.3	0.2	538
大光	0.1	0.1	61
TOKAIホールディングス	1.3	1.4	1,314
黒谷	0.1	—	—
三洋貿易	0.3	0.3	443
ビューティガレージ	—	0.1	154
ウイン・パートナーズ	0.2	0.2	248
ミタチ産業	0.1	—	—
シップヘルスケアホールディングス	1	0.9	2,116
明治電機工業	0.1	0.1	141
デリカフーズホールディングス	0.1	—	—
コマダホールディングス	0.7	0.6	1,689
アセンテック	0.1	0.1	69
フルサト・マルカホールディングス	0.2	0.2	432
ヤマエグループホールディングス	0.2	0.2	387
小野建	0.3	0.2	305
佐鳥電機	0.1	0.2	386
伯東	0.2	0.1	458
コンドーテック	0.2	0.2	250
中山福	0.1	0.1	37
ナガイレーベン	0.3	0.3	704
三菱食品	0.3	0.2	1,000
松田産業	0.2	0.2	639
第一興商	1	1	1,865
メディパルホールディングス	2.6	2.6	6,579
S PK	0.1	0.1	199
萩原電気ホールディングス	0.1	0.1	344
アズワン	0.4	0.8	2,432
スズデン	0.1	0.1	184
シモジマ	0.2	0.2	269
ドウシシャ	0.3	0.2	437

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高速	0.1	0.2	513
たけびし	0.1	0.1	212
リックス	—	0.1	278
丸文	0.2	0.2	214
ハビネット	0.2	0.2	816
橋本総業ホールディングス	0.1	0.1	122
日本ライフライン	0.8	0.7	850
タカショー	0.2	0.2	99
I DOM	0.8	0.7	898
進和	0.2	0.2	521
エスケイジャパン	0.1	—	—
ダイトロン	0.1	0.1	285
シークス	0.4	0.3	336
田中商事	0.1	—	—
オーハシテクニカ	0.1	0.1	174
白銅	0.1	0.1	233
伊藤忠商事	16	17.1	129,481
丸紅	20.7	21.2	50,763
長瀬産業	1.2	1.1	3,483
蝶理	0.1	0.2	822
豊田通商	2.4	6.7	17,791
三共生興	0.4	0.3	178
兼松	1	1.1	2,582
三井物産	18.7	38.2	120,139
日本紙パルプ商事	0.1	1	688
カメイ	0.3	0.3	582
スターゼン	0.2	0.2	575
山善	0.7	0.8	1,073
椿本興業	—	0.2	373
住友商事	16.2	15.2	49,886
内田洋行	0.1	0.1	660
三菱商事	16.2	49	139,160
第一実業	0.3	0.2	458
キャノンマーケティングジャパン	0.6	0.6	2,796
西華産業	0.1	0.1	400
佐藤商事	0.2	0.2	281
菱洋エレクトロ	0.2	—	—
東京産業	0.2	0.2	142

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユアサ商事	0.2	0.2	959
神鋼商事	0.1	0.1	637
トルク	0.1	0.1	23
阪和興業	0.5	0.5	2,565
正栄食品工業	0.2	0.2	892
カナデン	0.2	0.2	308
RYODEN	0.2	0.2	505
岩谷産業	0.6	2.4	4,855
ナイス	0.1	—	—
極東貿易	0.2	0.1	148
アステナホールディングス	0.5	0.5	264
三愛オプリー	0.7	0.6	1,125
稲畑産業	0.5	0.5	1,645
G S I クレオス	0.1	0.1	205
明和産業	0.4	0.3	193
クワザワホールディングス	0.1	—	—
ワキタ	0.5	0.4	648
東邦ホールディングス	0.7	0.7	3,337
サンゲツ	0.7	0.6	1,698
ミツウロコグループホールディングス	0.3	0.3	507
シナネンホールディングス	0.1	0.1	614
伊藤忠エネクス	0.7	0.6	935
サンリオ	0.8	2.1	8,601
サンワテクノス	0.1	0.1	197
リョーサン	0.3	—	—
新光商事	0.4	0.3	287
トーホー	0.1	0.1	269
三信電気	0.1	0.1	204
東陽テクニカ	0.3	0.2	324
モスフードサービス	0.4	0.4	1,438
加賀電子	0.2	0.4	1,138
ソーダニッカ	0.1	0.3	359
立花エレテック	0.2	0.2	510
フォーバル	0.1	0.1	135
P A L T A C	0.4	0.3	1,299
三谷産業	0.5	0.4	129
太平洋興発	0.1	—	—
西本Wismettacホールディングス	0.1	0.2	266

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コアア商事ホールディングス	0.2	0.2	122
K P P グループホールディングス	0.6	0.6	412
ヤマタネ	0.1	0.1	321
泉州電業	0.1	0.2	966
トラスコ中山	0.6	0.5	1,152
オートボックスセブン	0.9	0.9	1,308
モリト	0.2	0.2	283
加藤産業	0.3	0.3	1,249
北恵	0.1	—	—
イエローハット	0.5	0.4	1,030
J K ホールディングス	0.2	0.2	210
日伝	0.2	0.2	655
北沢産業	0.1	0.1	34
杉本商事	0.1	0.2	284
因幡電機産業	0.7	0.7	2,642
東テク	0.1	0.3	800
ミスミグループ本社	4	3.9	9,958
アルテック	0.1	—	—
スズケン	0.8	0.9	4,709
ジェコス	0.2	0.1	87
グローセル	0.2	—	—
小売業 (4.5%)			
ローソン	0.7	—	—
サンエー	0.2	0.4	1,182
カワチ薬品	0.2	0.2	514
エービーシー・マート	1.2	1.1	3,368
ハードオフコーポレーション	0.1	0.1	193
アスクル	0.5	0.6	1,207
ゲオホールディングス	0.3	0.3	461
アダストリア	0.3	0.3	1,180
ジーフット	0.2	0.2	57
くら寿司	0.3	0.3	1,180
キャンドウ	0.1	0.1	328
I K ホールディングス	0.1	—	—
パルグループホールディングス	0.5	0.5	1,610
エディオン	1	1	1,775
サーラコーポレーション	0.6	0.5	434
ワッツ	0.1	0.1	70

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ハローズ	0.1	0.1	441
フジオフードグループ本社	0.3	0.3	411
あみやき亭	0.1	0.3	516
ひらまつ	0.4	0.5	90
大黒天物産	0.1	0.1	1,037
ハニーズホールディングス	0.2	0.2	352
ファーマライズホールディングス	0.1	—	—
アルベン	0.2	0.2	415
ハブ	0.1	—	—
クオールホールディングス	0.4	0.4	590
ジーンズホールディングス	0.2	0.2	1,174
ビックカメラ	1.4	1.5	2,542
DCMホールディングス	1.5	1.3	1,925
ベッパーフードサービス	0.6	0.9	191
Monotaro	3.7	3.6	8,847
東京一番フーズ	0.1	—	—
J. フロント リテイリング	3.3	2.9	4,563
ドトール・日レスホールディングス	0.5	0.5	1,114
マツキヨココカラ&カンパニー	4.8	4.6	9,641
ブロンコビリー	0.2	0.2	757
ZOZO	1.7	1.6	8,611
トレジャー・ファクトリー	0.1	0.2	277
物語コーポレーション	0.4	0.4	1,482
三越伊勢丹ホールディングス	4.5	4.2	9,305
Hamee	0.1	0.1	107
ウエルシアホールディングス	1.4	1.3	2,549
クリエイトSDホールディングス	0.4	0.4	1,248
丸善CHIホールディングス	0.2	0.3	96
シュッピン	0.2	0.2	216
オイシックス・ラ・大地	0.4	0.4	535
ネクステージ	0.6	0.6	865
ジョイフル本田	0.8	0.7	1,416
エターナルホスピタリティグループ	0.1	0.1	395
ホットランド	0.2	0.2	461
すかいらくホールディングス	3.6	3.5	8,127
SFPホールディングス	0.1	0.1	194
綿半ホールディングス	0.2	0.2	338
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	0.9	0.7	578

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.1	0.2	90
BEENOS	0.1	0.2	586
あさひ	0.2	0.2	314
日本調剤	0.2	0.2	286
コスモス薬品	0.3	0.4	3,138
トーエル	0.1	0.1	80
セブン&アイ・ホールディングス	9.2	25.8	57,727
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	2	1.7	2,016
ツルハホールディングス	0.6	0.5	4,393
サンマルクホールディングス	0.2	0.2	473
フェリシモ	0.1	—	—
トリドールホールディングス	0.7	0.7	2,758
TOKYO BASE	0.3	0.4	100
JMホールディングス	0.2	0.2	606
サツドラホールディングス	0.1	—	—
アレンザホールディングス	0.2	0.2	219
串カツ田中ホールディングス	0.1	0.1	153
パロックジャパンリミテッド	0.2	0.2	156
クスリのアオキホールディングス	0.2	0.9	2,973
力の源ホールディングス	0.1	0.2	226
FOOD & LIFE COMPANIES	1.4	1.4	4,191
メディカルシステムネットワーク	0.3	0.3	129
一家ホールディングス	0.1	—	—
ジャパングラフトホールディングス	0.1	0.2	28
はるやまホールディングス	0.1	0.1	55
ノジマ	0.8	0.8	1,634
カッパ・クリエイト	0.4	0.4	657
ライトオン	0.1	0.1	23
良品計画	2.9	3	7,560
バリミキホールディングス	0.2	0.3	97
アドヴァングループ	0.3	0.2	173
アルビス	0.1	0.1	267
コナカ	0.2	0.2	45
G-7ホールディングス	0.3	0.3	495
イオン北海道	0.4	0.8	715
コジマ	0.4	0.5	537
ヒマラヤ	0.1	—	—
コーナン商事	0.4	0.3	1,098

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エコス	0.1	0.1	210
ワタミ	0.3	0.3	283
バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	5.4	5.2	19,598
西松屋チェーン	0.6	0.5	1,210
ゼンショーホールディングス	1.4	1.3	10,110
幸楽苑	—	0.2	258
ハークスレイ	0.1	—	—
サイゼリヤ	0.4	0.4	2,120
V Tホールディングス	1	1	460
魚力	0.1	0.1	239
フジ・コーポレーション	0.1	0.1	193
ユナイテッドアローズ	0.3	0.3	712
ハイデイ日高	0.4	0.4	1,094
京都きもの友禅ホールディングス	0.2	—	—
コロワイド	1.2	1.3	2,171
老番屋	0.2	1	1,028
トップカルチャー	0.1	—	—
P L A N T	0.1	—	—
スギホールディングス	0.5	1.5	4,020
薬王堂ホールディングス	0.1	0.1	224
スクロール	0.4	0.4	386
ヨンドシーホールディングス	0.2	0.3	562
木曽路	0.4	0.4	908
S R Sホールディングス	0.4	0.4	478
千趣会	0.5	0.6	189
リテールパートナーズ	0.4	0.4	504
ケーヨー	0.4	—	—
上新電機	0.2	0.3	782
日本瓦斯	1.4	1.3	2,847
ロイヤルホールディングス	0.5	0.5	1,236
いなげや	0.3	0.3	350
チヨダ	0.3	0.3	394
ライフコーポレーション	0.2	0.3	997
リンガーハット	0.3	0.3	672
M r M a x H D	0.4	0.3	215
A O K Iホールディングス	0.5	0.6	730
オークワ	0.4	0.4	366
コメリ	0.4	0.4	1,424

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
青山商事	0.6	0.6	806
しまむら	0.3	0.6	4,995
はせがわ	0.1	—	—
高島屋	2	3.2	3,912
松屋	0.5	0.4	332
エイチ・ツー・オー リテイリング	1.3	1.3	2,698
近鉄百貨店	0.1	0.1	216
丸井グループ	1.9	1.7	4,085
アクシアル リテイリング	0.2	0.7	627
井筒屋	0.1	0.1	41
イオン	9	8.7	32,712
イズミ	0.4	0.5	1,645
平和堂	0.4	0.4	894
フジ	0.4	0.4	810
ヤオコー	0.3	0.3	2,811
ゼビオホールディングス	0.4	0.4	464
ケーズホールディングス	1.9	1.7	2,533
O l y m p i cグループ	0.1	—	—
日産東京販売ホールディングス	0.2	0.2	86
シルバライフ	0.1	0.1	75
Genky DrugStores	0.1	0.2	666
ブックオフグループホールディングス	0.1	0.2	264
ギフトホールディングス	0.2	0.1	328
アインホールディングス	0.4	0.4	2,032
Genki Global Dining	0.1	0.2	837
ヤマダホールディングス	10.8	7.9	3,509
アークランズ	0.7	0.8	1,348
ニトリホールディングス	1.1	0.9	18,769
グルメ軒屋	0.2	0.2	213
愛眼	0.2	0.2	31
ケーユーホールディングス	0.2	0.1	108
吉野家ホールディングス	1	0.9	2,838
松屋フーズホールディングス	0.1	0.1	674
サガミホールディングス	0.4	0.4	729
関西フードマーケット	0.2	—	—
王将フードサービス	0.2	0.6	1,809
ミニストップ	0.2	0.2	339
アークス	0.5	0.5	1,244

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パローホールディングス	0.5	0.5	1,056
ベルク	0.1	0.1	666
大庄	0.1	0.2	208
ファーストリテイリング	1.2	1.4	74,368
サンドラッグ	1	0.9	3,537
サックスパー ホールディングス	0.3	0.3	274
ペルーナ	0.6	0.6	432
銀行業 (7.8%)			
いよぎんホールディングス	2.9	2.8	3,969
しずおかフィナンシャルグループ	5.5	5.2	6,640
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	2.1	2	2,944
楽天銀行	0.8	1.1	3,602
京都フィナンシャルグループ	0.8	3	6,943
島根銀行	0.1	—	—
じもとホールディングス	0.1	0.1	29
めぶきフィナンシャルグループ	12.1	10.9	6,345
東京きらぼしフィナンシャルグループ	0.3	0.3	1,266
九州フィナンシャルグループ	4.3	4.6	3,342
ゆうちょ銀行	6.8	26.1	36,526
富山第一銀行	0.8	0.7	762
コンコルディア・フィナンシャルグループ	13.2	12.6	9,840
西日本フィナンシャルホールディングス	1.5	1.3	2,225
三十三フィナンシャルグループ	0.2	0.2	333
第四北越フィナンシャルグループ	0.4	0.8	1,940
ひろぎんホールディングス	3.2	3.4	3,935
おきなわフィナンシャルグループ	0.2	0.2	459
十六フィナンシャルグループ	0.3	0.3	1,222
北國フィナンシャルホールディングス	0.3	0.2	896
ブロックレアホールディングス	0.3	0.3	533
あいちフィナンシャルグループ	0.3	0.5	1,141
あおぞら銀行	1.5	1.7	4,570
三菱UFJフィナンシャル・グループ	154.8	144.6	233,239
りそなホールディングス	31	27.3	28,214
三井住友トラストグループ	4.5	8.5	28,883
三井住友フィナンシャルグループ	17.6	49.4	158,178
千葉銀行	6.9	6.6	7,580
群馬銀行	4.8	4.6	4,069
武蔵野銀行	0.3	0.3	817

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
千葉興業銀行	0.4	0.6	670
筑波銀行	1	1.1	250
七十七銀行	0.8	0.7	2,838
秋田銀行	0.2	0.2	429
山形銀行	0.3	0.3	295
岩手銀行	0.2	0.1	233
東邦銀行	1.9	1.9	516
東北銀行	0.1	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	2	2.1	7,576
スルガ銀行	2.1	1.8	2,023
八十二銀行	5.2	5.1	4,333
山梨中央銀行	0.2	0.3	510
大垣共立銀行	0.5	0.4	732
福井銀行	0.2	0.2	367
清水銀行	0.1	0.1	144
滋賀銀行	0.4	0.4	1,348
南都銀行	0.4	0.4	1,208
百五銀行	2.3	2.3	1,290
紀陽銀行	0.9	0.9	1,618
ほくほくフィナンシャルグループ	1.6	1.5	2,468
山陰合同銀行	1.5	1.5	1,855
百十四銀行	0.2	0.2	510
四国銀行	0.4	0.4	379
阿波銀行	0.3	0.3	729
大分銀行	0.1	0.1	312
宮崎銀行	0.2	0.1	273
佐賀銀行	0.1	0.1	206
琉球銀行	0.6	0.5	501
セブン銀行	8.8	7.5	2,328
みずほフィナンシャルグループ	35.7	32	101,760
山口フィナンシャルグループ	2.4	2.3	3,551
名古屋銀行	0.2	0.2	1,194
北洋銀行	3.7	3.6	1,465
愛媛銀行	0.3	0.3	313
トマト銀行	0.1	—	—
京葉銀行	1.1	1	695
栃木銀行	1.1	1.2	318
北日本銀行	0.1	0.1	253

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東和銀行	0.4	0.5	293
福島銀行	0.2	0.1	24
大東銀行	0.1	—	—
トモニホールディングス	2	2.3	922
フィデアホールディングス	0.3	0.2	288
池田泉州ホールディングス	3.2	3.3	1,092
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	0.8	0.8	1,977
ジャパンインベストメントアドバイザー	0.2	0.4	414
マーキュリアホールディングス	0.1	0.1	89
S B I ホールディングス	3.6	3.8	12,821
日本アジア投資	0.2	0.1	21
ジャフコ グループ	0.8	0.7	1,409
大和証券グループ本社	17.7	18.4	19,366
野村ホールディングス	44.5	40	31,680
岡三証券グループ	2.1	2.1	1,318
丸三証券	0.8	0.8	752
東洋証券	0.8	0.6	289
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	2.6	2.8	1,369
水戸証券	0.7	0.7	327
いちよし証券	0.5	0.4	276
松井証券	1.4	1.2	961
マネックスグループ	2.6	2.3	1,534
極東証券	0.3	0.3	398
岩井コスモホールディングス	0.3	0.3	615
アイザワ証券グループ	0.4	0.3	539
マネーパートナーズグループ	0.2	0.1	22
スパークス・グループ	0.3	0.3	403
小林洋行	0.2	—	—
保険業 (3.2%)			
かんぽ生命保険	2.9	2.4	6,172
S O M P O ホールディングス	4.3	10.7	35,224
アニコム ホールディングス	0.8	0.9	621
MS & AD インシュアランスグループ ホールディングス	5	15.9	55,761
第一生命ホールディングス	12.1	11.2	43,321
東京海上ホールディングス	24.4	23.2	131,196
T & D ホールディングス	6.6	6.4	16,227
アドバンスクリエイト	0.2	0.2	156

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	0.6	0.6	3,360
あんしん保証	0.1	0.1	18
ジェイリース	0.1	0.2	305
イントラスト	0.1	—	—
日本モーゲージサービス	0.1	0.1	43
C a s a	0.1	—	—
S B I アルヒ	0.3	0.2	165
プレミアムグループ	0.4	0.4	903
ネットプロテクションズホールディングス	0.8	0.8	297
クレディセゾン	1.6	1.5	5,293
芙蓉総合リース	0.2	0.2	2,175
みずほリース	0.4	2	2,002
東京センチュリー	0.5	1.8	2,866
日本証券金融	0.9	0.9	1,877
アイフル	4.1	3.5	1,113
リコーリース	0.2	0.2	1,002
イオンフィナンシャルサービス	1.4	1.4	1,709
アコム	4.4	4.3	1,584
ジャックス	0.3	0.3	1,161
オリエントコーポレーション	0.6	0.8	740
オリックス	16.2	14.3	46,689
三菱HCキャピタル	9.6	10.6	10,653
九州リースサービス	0.1	0.1	100
日本取引所グループ	7	12.2	22,265
イー・ギャランティ	0.4	0.4	610
アサックス	0.1	0.1	71
NECキャピタルソリューション	0.1	0.1	376
不動産業 (1.9%)			
大東建託	0.9	0.9	15,052
サムティホールディングス	—	0.5	1,647
いちご	2.9	2.4	950
日本駐車場開発	2.5	2.8	638
スター・マイカ・ホールディングス	0.3	0.2	131
S R E ホールディングス	0.1	0.1	389
A D ワークスグループ	0.6	0.3	61
ヒューリック	5.8	5.5	7,818
野村不動産ホールディングス	1.5	1.3	4,912

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三重交通グループホールディングス	0.6	0.5	248
サムティ	0.4	—	—
ディア・ライフ	0.5	0.4	338
コーセーアールイー	0.1	—	—
地主	0.2	0.2	433
ブレサンスコーポレーション	0.4	0.3	580
THEグローバル社	0.2	0.1	63
ハウスコム	0.1	—	—
JPMC	0.2	0.1	115
サンセイランディック	0.1	—	—
エストラスト	0.1	—	—
フージャースホールディングス	0.4	0.4	422
オープンハウスグループ	0.9	0.9	5,200
東急不動産ホールディングス	7.4	7.2	7,093
飯田グループホールディングス	2.1	2.3	5,138
ムゲンエステート	0.1	—	—
ビーロッド	0.2	0.1	117
ファーストブラザーズ	0.1	—	—
And Doホールディングス	0.2	0.1	105
シーアールイー	0.2	0.1	124
ケイアイスター不動産	0.1	0.1	395
グッドコムアセット	0.3	0.2	170
ジェイ・エス・ビー	0.1	0.1	280
ロードスターキャピタル	0.2	0.1	231
イノベーションホールディングス	0.1	—	—
グローバル・リンク・マネジメント	0.1	—	—
フェイスネットワーク	0.1	—	—
霞ヶ関キャピタル	—	0.1	1,555
パーク24	1.6	1.8	3,338
バラカ	0.1	0.1	179
宮越ホールディングス	0.1	0.1	181
三井不動産	10.5	33	44,682
三菱地所	14.9	14.9	34,791
平和不動産	0.4	0.4	1,626
東京建物	2.1	2.1	5,022
京阪神ビルディング	0.4	0.5	828
住友不動産	4.5	3.4	15,939
テーオーシー	0.5	0.4	247

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
レオパレス21	—	2.4	1,344
スターツコーポレーション	0.4	0.3	1,066
フジ住宅	0.4	0.3	212
空港施設	0.4	0.3	172
明和地所	0.1	0.2	200
ゴールドクレスト	0.2	0.2	662
エスリード	0.1	0.1	475
日神グループホールディングス	0.4	0.4	200
日本エスコン	0.5	0.4	398
MIRARTHホールディングス	1.2	1.2	600
AVANTIA	0.1	0.1	77
イオンモール	1.3	1.2	2,463
毎日コムネット	0.1	0.1	73
ファースト住建	0.1	—	—
カチタス	0.7	0.6	1,176
トーセイ	0.4	0.4	960
サンフロンティア不動産	0.4	0.4	736
FJネクストホールディングス	0.3	0.3	348
インテリックス	0.1	—	—
ランドビジネス	0.2	0.1	19
サンネクスタグループ	0.1	—	—
グランディハウス	0.2	0.2	114
日本空港ビルデング	0.9	0.8	4,266
サービス業 (4.9%)			
明豊ファシリティワークス	0.1	0.1	87
LIFULL	0.9	0.7	105
MIXI	0.6	0.5	1,409
ジェイエイシーリクルートメント	0.2	0.9	665
日本M&Aセンターホールディングス	4.4	4	2,458
メンバーズ	0.1	0.1	96
UTグループ	0.4	0.3	799
アイティメディア	0.1	0.1	162
ケアネット	—	0.5	337
E・Jホールディングス	0.2	0.2	343
オープンアップグループ	0.8	0.8	1,576
コシダカホールディングス	0.8	0.7	867
パソナグループ	0.3	0.3	602
リンクアンドモチベーション	0.7	0.6	359

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エス・エム・エス	1	0.9	1,939
サニーサイドアップグループ	0.1	0.1	55
パーソルホールディングス	28.5	25.3	6,567
リニカル	0.1	0.1	38
クックパッド	0.8	0.7	123
エスクリ	0.1	0.1	22
アイ・ケイ・ケイホールディングス	0.1	0.1	77
学情	0.1	0.1	181
スタジオアリス	0.1	0.1	201
シミックホールディングス	0.1	—	—
エプロ	0.1	—	—
N J S	0.1	0.1	393
総合警備保障	4.8	4.1	4,237
カカココム	1.9	1.6	3,897
アイロムグループ	0.1	0.1	278
セントケア・ホールディング	0.2	0.2	150
ルネサンス	0.2	0.2	220
ディップ	0.5	0.4	1,037
デジタルホールディングス	0.1	0.1	99
新日本科学	0.3	0.2	257
ベネフィット・ワン	1.2	—	—
エムスリー	5.1	4.9	8,626
ツカダ・グローバルホールディング	0.1	0.1	39
アウトソーシング	1.7	—	—
ウェルネット	0.1	0.1	71
ワールドホールディングス	0.1	0.1	195
ディー・エヌ・エー	1	0.9	1,615
博報堂D Yホールディングス	3.3	3.1	3,751
ぐるなび	0.5	0.5	165
タカミヤ	0.4	0.3	131
ジャパンベストレスキューシステム	0.1	—	—
ファンココミュニケーションズ	0.4	0.4	169
ライク	0.1	0.1	141
A o b a - B B T	0.1	0.1	32
エスプール	0.8	0.8	289
W D Bホールディングス	0.1	0.1	174
ティア	0.1	0.1	44
アドウェイズ	0.4	0.3	99

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
バリューコマース	0.2	0.2	225
インフォマート	2.7	2.4	876
J Pホールディングス	0.8	0.6	420
エコナックホールディングス	0.2	0.1	11
C Lホールディングス	0.1	0.1	93
プレステージ・インターナショナル	1.1	1.2	831
プロトコーポレーション	—	0.3	427
アミューズ	0.1	0.2	279
ドリームインキュベータ	0.1	0.1	228
クイック	0.2	0.2	403
T A C	0.2	0.1	16
電通グループ	2.5	2.7	12,879
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.1	0.1	90
びあ	0.1	0.1	305
イオンファンタジー	0.1	0.1	222
シーティーエス	0.3	0.3	283
N E X Y Z , G r o u p	0.1	—	—
H . U . グループホールディングス	0.8	0.7	1,846
アルプス技研	0.3	0.2	569
サニックス	0.5	0.4	109
日本空調サービス	0.3	0.3	308
オリエンタルランド	13.7	13.1	47,277
ダスキン	0.6	0.5	2,063
明光ネットワークジャパン	0.3	0.3	198
ファルコホールディングス	0.1	0.1	243
秀英予備校	0.1	—	—
ラウンドワン	2.2	2.3	2,263
リゾートトラスト	1	1.1	3,082
ビー・エム・エル	0.3	0.3	813
リソー教育	1.1	1.3	360
早稲田アカデミー	0.1	0.1	161
ユー・エス・エス	2.7	5.6	7,011
東京個別指導学院	0.3	0.3	120
サイバーエージェント	5.7	5.5	5,684
楽天グループ	22.1	17.5	16,661
クリーク・アンド・リバー社	0.1	0.1	158
S B I グローバルアセットマネジメント	0.4	0.5	295
テー・オー・ダブリュー	0.6	0.5	162

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山田コンサルティンググループ	0.1	0.1	215
セントラルスポーツ	0.1	0.1	242
フルキャストホールディングス	0.2	0.2	312
エン・ジャパン	0.5	0.4	972
テクノプロ・ホールディングス	1.5	1.4	3,924
アトラグループ	0.1	0.1	13
アイ・アールジャパンホールディングス	0.1	0.1	86
Keeper 技研	0.2	0.2	838
Gunosy	0.2	0.2	147
デザインワン・ジャパン	0.1	0.1	11
イー・ガーディアン	0.1	0.1	187
リブセンス	0.1	0.1	16
ジャパンマテリアル	0.8	0.8	1,491
ベクトル	0.4	0.3	289
ウチヤマホールディングス	0.1	0.1	31
チャーム・ケア・コーポレーション	0.2	0.2	260
キャリアリンク	0.1	0.1	249
IBJ	0.2	0.2	134
アサンテ	0.1	0.1	168
バリューHR	0.2	0.2	345
M&Aキャピタルパートナーズ	0.2	0.2	478
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.1	0.1	100
シグマクシス・ホールディングス	0.4	0.3	515
ウィルグループ	0.2	0.2	197
エスクロー・エージェント・ジャパン	0.3	0.3	42
メドピア	0.2	0.2	116
リクルートホールディングス	19.1	17.8	172,250
エラン	0.3	0.3	282
土木管理総合試験所	0.1	0.1	31
日本郵政	31.1	25.9	36,544
ベルシステム24ホールディングス	0.4	0.3	395
鎌倉新書	0.3	0.2	105
SMN	0.1	—	—
エアトリ	0.2	0.2	212
アトラエ	0.2	0.2	166
ストライク	0.1	0.1	465
ソラスト	0.7	0.7	355
セラク	0.1	0.1	125

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
インソース	0.6	0.5	520
バイカレント	2	1.8	9,064
Orchestra Holdings	0.1	0.1	88
アイモバイル	0.1	0.3	157
ディスラプターズ	0.1	0.1	17
MS-Japan	0.1	0.1	105
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	0.9	0.8	2,492
グリーンズ	0.1	—	—
ツナググループ・ホールディングス	0.1	—	—
GameWith	0.1	0.1	21
ウエルビー	0.2	—	—
ミダックホールディングス	0.2	0.2	368
キュービーネットホールディングス	0.1	0.1	104
オープングループ	0.4	0.4	84
スプリックス	0.1	—	—
マネジメントソリューションズ	0.1	0.1	199
プロレド・パートナーズ	0.1	0.1	50
and factory	0.1	0.1	26
フロンティア・マネジメント	0.1	0.1	121
アンビスホールディングス	0.3	0.5	977
カープスホールディングス	0.7	0.7	565
フォーラムエンジニアリング	0.2	0.3	271
Fast Fitness Japan	0.1	0.1	132
Macbee Planet	—	0.1	264
ダイレクトマーケティングミックス	0.3	0.4	97
LITALICO	0.2	0.2	253
アドバンテッジリスクマネジメント	0.1	0.1	58
リログループ	1.4	1.2	2,264
東祥	0.2	0.2	139
ID&Eホールディングス	0.2	0.1	433
ビーウィズ	0.1	0.1	168
サンウェルズ	—	0.1	168
TREホールディングス	0.6	0.5	929
人・夢・技術グループ	0.1	0.1	168
NISSOホールディングス	0.2	0.2	165
大栄環境	0.7	0.5	1,600
日本管財ホールディングス	0.3	0.3	811
M&A総研ホールディングス	—	0.3	838

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エイチ・アイ・エス	0.8	0.8	1,360
ラックランド	0.1	0.1	197
共立メンテナンス	0.4	0.8	1,959
イチネンホールディングス	0.3	0.3	550
建設技術研究所	0.1	0.1	461
スペース	0.2	0.2	234
燦ホールディングス	0.2	0.2	232
スバル興業	—	0.1	313
東京テアトル	0.1	—	—
タナベコンサルティンググループ	0.1	0.1	121
ナガワ	0.1	0.1	698
東京都競馬	0.2	0.2	849
常磐興産	0.1	—	—
カナモト	0.4	0.4	1,125
ニシオホールディングス	0.3	0.2	761
アゴーラ ホスピタリティィー グループ	1.8	0.8	37
トランス・コスモス	0.3	0.3	1,032
乃村工藝社	1.2	1.1	871
藤田観光	0.1	0.1	840

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
KNT-CTホールディングス	0.2	0.1	129	
トーカイ	0.2	0.2	436	
セコム	2.6	5	26,400	
セントラル警備保障	0.1	0.1	263	
丹青社	0.5	0.5	406	
メイテックグループホールディングス	1	0.8	2,558	
応用地質	0.2	0.2	517	
船井総研ホールディングス	0.5	0.5	1,249	
進学会ホールディングス	0.1	0.1	22	
オオバ	0.1	0.1	103	
学究社	0.1	0.1	193	
ベネッセホールディングス	1	—	—	
イオンディライト	0.3	0.3	1,287	
ナック	0.1	0.2	116	
ダイセキ	0.5	0.5	1,945	
ステップ	0.1	0.1	203	
合 計	株 数・金 額	3,833	4,478	9,085,951
	銘柄数<比率>	1,934	1,795	<98.6%>

(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	TOPIX先物	
		百万円	百万円
		107	—

○投資信託財産の構成

(2024年10月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 9,085,951	% 98.6
コール・ローン等、その他	132,118	1.4
投資信託財産総額	9,218,069	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 (2024年10月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,343,959,598
コール・ローン等	43,033,543
株式(評価額)	9,085,951,820
未収入金	200
未収配当金	88,922,162
未収利息	273
差入委託証拠金	126,051,600
(B) 負債	126,980,550
未払解約金	626,550
差入委託証拠金代用有価証券	126,354,000
(C) 純資産総額(A-B)	9,216,979,048
元本	2,974,407,412
次期繰越損益金	6,242,571,636
(D) 受益権総口数	2,974,407,412口
1口当たり基準価額(C/D)	3,099円

(注) 当ファンドの期首元本額は3,218,063,246円、期中追加設定元本額は3,257,207円、期中一部解約元本額は246,913,041円です。

(注) 2024年10月21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	2,953,941,857円
・バランスポートフォリオ	20,465,555円

(注) 1口当たり純資産額は3.0990円です。

(注) 2024年10月21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	119,459千円
-----	-----------

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処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2023年10月24日から2024年10月21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、新NISA制度におけるつみたて投資枠および成長投資枠の要件に適合させるため、当該マザーファンドにて行なうデリバティブ取引の利用目的を明確化するべく、2024年8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。(付表、第13条の2、第13条の4)

○損益の状況

(2023年10月24日～2024年10月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	216,788,068
受取配当金	216,677,591
受取利息	75,871
その他収益金	40,477
支払利息	△ 5,871
(B) 有価証券売買損益	1,569,489,860
売買益	1,808,050,729
売買損	△ 238,560,869
(C) 先物取引等取引損益	16,479,300
取引益	25,607,450
取引損	△ 9,128,150
(D) 保管費用等	△ 7
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,802,757,221
(F) 前期繰越損益金	4,926,747,896
(G) 追加信託差損益金	5,582,256
(H) 解約差損益金	△ 492,515,737
(I) 計(E+F+G+H)	6,242,571,636
次期繰越損益金(I)	6,242,571,636

(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。