

ミリオン バランスポートフォリオ

運用報告書（全体版）

第30期（決算日 2017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。
「ミリオン」の「バランスポートフォリオ」は、2017年11月7日に第30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	東京証券取引所第一部に上場されている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。	

<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
<http://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)	額			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	純資産額
		税金	み	騰落率				
	円		円	%	%	%	%	百万円
26期(2013年11月7日)	8,067		5	26.6	48.6	0.7	24.2	436
27期(2014年11月7日)	8,619		5	6.9	49.2	1.0	24.9	382
28期(2015年11月9日)	9,300		5	8.0	51.3	1.0	22.0	322
29期(2016年11月7日)	8,629		5	△7.2	49.7	1.1	26.1	271
30期(2017年11月7日)	9,920		5	15.0	50.1	0.9	25.4	268

(注) 基準価額および分配金は、1万円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	騰落率		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率
		騰	落			
(期首)	円		%	%	%	%
2016年11月7日	8,629		—	49.7	1.1	26.1
11月末	8,957		3.8	50.1	0.9	25.1
12月末	9,104		5.5	49.5	0.6	24.6
2017年1月末	9,101		5.5	49.9	0.5	25.5
2月末	9,135		5.9	49.8	0.5	25.7
3月末	9,091		5.4	50.0	1.0	26.2
4月末	9,140		5.9	50.4	1.0	26.0
5月末	9,240		7.1	49.2	0.9	25.7
6月末	9,359		8.5	50.4	0.8	25.5
7月末	9,367		8.6	50.0	0.4	26.0
8月末	9,354		8.4	50.1	0.6	26.2
9月末	9,547		10.6	51.2	0.8	25.7
10月末	9,793		13.5	49.5	0.9	25.7
(期末)						
2017年11月7日	9,925		15.0	50.1	0.9	25.4

(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。

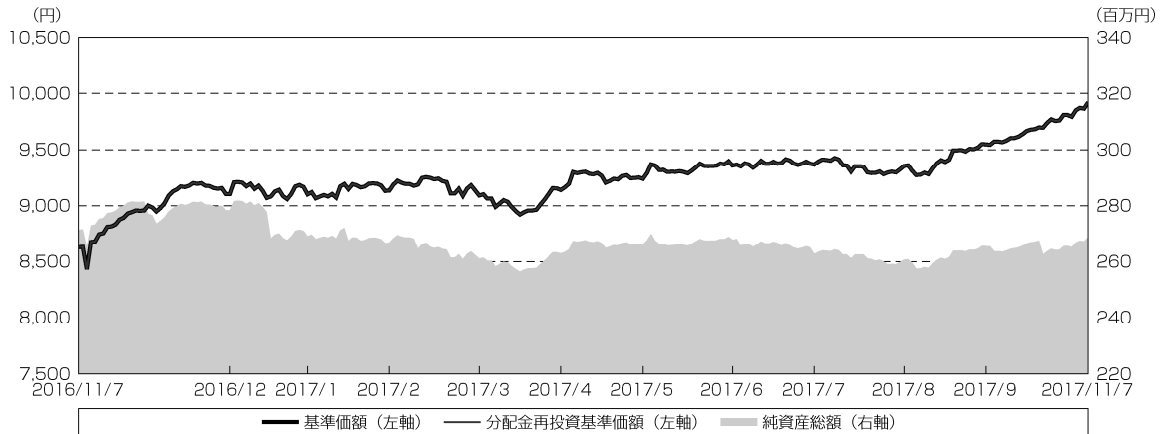
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○運用経過

(2016年11月8日～2017年11月7日)

期中の基準価額等の推移



期首：8,629円
 期末：9,920円 (既払分配金 (税込み)：5円)
 騰落率：15.0% (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 (2016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)

- ・日銀が固定利回りで国債を無制限に買い入れる「指し値オペ」を実施したこと。
- ・日銀が金融政策決定会合にて物価目標の達成時期を先送りし、緩和政策が長期化するとの見方が強まったこと。
- ・北朝鮮が米国領グアム周辺へのミサイル攻撃の検討を発表するなど情勢が緊迫化し、投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。

勢が強まったこと。

(株式資産に対する要因)

- ・米国において減税やインフラ投資拡大への期待が高まったこと。
- ・フランス大統領選挙において独立系中道候補が当選し欧州連合（EU）の結束が強まると期待されたこと。
- ・衆議院選挙の与党勝利を受けて日銀による大規模な金融緩和政策が継続するとの見方が広がったこと。

<値下がり要因>

(債券資産に対する要因)

- ・米国次期大統領による政策への期待を背景に円安／アメリカドル高が進行したこと(期間の初め～2016年12月中旬)。
- ・フランス大統領選挙が波乱なく終了しEUの先行きを懸念したリスク回避需要が後退したこと。
- ・内外の良好な経済指標の発表などを受けて国内株式市場が堅調に推移したこと。

(株式資産に対する要因)

- ・米国新大統領が打ち出した保護主義的政策への警戒が広がったこと。
- ・シリアや北朝鮮の地政学的リスクが高まったこと。
- ・為替が円高／アメリカドル安の動きとなったこと(2016年12月下旬～2017年4月中旬)。

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2016年12月中旬にかけては、米国において次期大統領による減税やインフラ投資拡大への期待が高まったこと、円安／アメリカドル高の進行を受けて輸出企業の業績改善への期待が広がったことなどから、TOPIXは上昇しました。12月下旬から2017年3月上旬にかけては、米国新大統領が打ち出した保護主義的政策への警戒が広がったことなどが株価の重しとなる一方で、米国や中国の良好な経済指標の発表などが支援材料となり、TOPIXはもみ合いの展開となりました。3月中旬から4月中旬にかけては、シリアや北朝鮮の地政学的リスクの高まりや、米国大統領の発言を背景とする円高／アメリカドル安の進行などが影響し、TOPIXは下落しました。4月下旬から期間末にかけては、北朝鮮による米国領グアム周辺へのミサイル攻撃検討の発表や核実験の実施などから情勢が緊迫化し、投資家のリスク回避姿勢が強まったものの、フランス大統領選挙において独立系中道候補が当選しEUの結束が強まると期待されたことや、法人企業統計にて設備投資の順調な回復が示されたこと、衆議院選挙の与党勝利を受けて日銀による大規模な金融緩和政策が継続するとの見方が広がったことなどから、TOPIXは上昇しました。

(国内債券市況)

国内債券市場では、期間の初めから2017年2月中旬にかけては、日銀による固定利回りで国債を無制限に買入れる「指し値オペ」の実施などから国債利回りが低下（債券価格は上昇）する局面があったものの、米国トランプ大統領による政策への期待を背景とする円安／アメリカドル高や国内株高の進行などから、国債利回りは総じて上昇（債券価格は下落）しました。2月下旬から4月中旬にかけては、シリアや北朝鮮の地政学的リスクの高まりや、米国新政権の政策運営に対する不透明感から投資家のリスク回避姿勢が強まり、国債利回

りは総じて低下しました。4月下旬から7月上旬にかけては、フランス大統領選挙が波乱なく終了しEUの先行きを懸念したリスク回避需要が後退したことや、国内株式市場が上昇したこと、米国や欧州において金融緩和策の縮小への動きが強まったことなどから、国債利回りは総じて上昇しました。7月中旬から9月上旬にかけては、日銀が金融政策決定会合にて物価目標の達成時期を先送りし、緩和政策が長期化するとの見方が強まったことや、北朝鮮が米国領グアム周辺へのミサイル攻撃の検討を発表するなど情勢が緊迫化し、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、国債利回りは総じて低下しました。9月中旬から期間末にかけては、北朝鮮に対する国連の制裁決議が当初案より穏便な内容となり朝鮮半島情勢を巡る警戒感が緩和したことや、内外の良好な経済指標の発表などを受けて国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に、国債利回りは概して上昇しました。

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)

東証株価指数(TOPIX)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30期
	2016年11月8日～ 2017年11月7日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.050%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,677

(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

(2016年11月8日～2017年11月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	152	1.642	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(34)	(0.367)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(110)	(1.188)	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 ）	(8)	(0.086)	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	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、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)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.005	(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)	(0.005)	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	152	1.648	
期中の平均基準価額は、9,265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。

○売買及び取引の状況

(2016年11月8日～2017年11月7日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 —	千円 —
	地方債証券	13,035	(15,000) —

(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す。

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 —	28,212	42,888

○株式売買比率

(2016年11月8日～2017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	2,383,231千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	11,428,386千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

(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

(2016年11月8日～2017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 0.4024	百万円 7	百万円 40

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 (2016年11月8日～2017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

(2016年11月8日～2017年11月7日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2017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BB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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	35,000 (20,000)	35,296 (20,118)	13.1 (7.5)	— (—)	— (—)	7.5 (7.5)	5.6 (—)
地方債証券	33,000 (33,000)	32,962 (32,962)	12.3 (12.3)	— (—)	— (—)	— (—)	12.3 (12.3)
合 計	68,000 (53,000)	68,258 (53,080)	25.4 (19.8)	— (—)	— (—)	7.5 (7.5)	17.9 (12.3)

(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
国債証券	%	千円	千円	
第122回利付国債 (5年)	0.1	20,000	20,118	2019/12/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	15,000	15,177	2018/6/20
小 計		35,000	35,296	
地方債証券				
平成26年度京都安心づくりみらい債	0.16	13,000	12,978	2019/9/2
第29回兵庫県民債	0.19	20,000	19,983	2019/3/19
小 計		33,000	32,962	
合 計		68,000	68,258	

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	105,669	77,457	137,642

(注) 親投資信託の2017年11月7日現在の受益権総口数は、6,948,269千口です。

○投資信託財産の構成

(2017年11月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	68,258	25.2
インデックス東証株式マザーファンド	137,642	50.8
コール・ローン等、その他	65,180	24.0
投資信託財産総額	271,080	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 (2017年11月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	271,080,712
コール・ローン等	65,060,566
公社債(評価額)	68,258,320
インデックス東証株式マザーファンド(評価額)	137,642,014
未収利息	119,812
(B) 負債	2,320,865
未払収益分配金	135,459
未払信託報酬	2,178,355
未払利息	96
その他未払費用	6,955
(C) 純資産総額(A-B)	268,759,847
元本	270,918,710
次期繰越損益金	△ 2,158,863
(D) 受益権総口数	270,918,710口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,920円

- (注) 当ファンドの期首元本額は314,422,612円、期中追加設定元本額は7,480,324円、期中一部解約元本額は50,984,226円です。
 (注) 1口当たり純資産額は0.9920円です。
 (注) 2017年11月7日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は2,158,863円です。

○損益の状況 (2016年11月8日～2017年11月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	323,568
受取利息	350,459
支払利息	△ 26,891
(B) 有価証券売買損益	38,778,746
売買益	42,271,642
売買損	△ 3,492,896
(C) 信託報酬等	△ 4,406,292
(D) 当期損益金(A+B+C)	34,696,022
(E) 前期繰越損益金	△ 404,156
(F) 追加信託差損益金	△36,315,270
(配当等相当額)	(38,370,747)
(売買損益相当額)	(△74,686,017)
(G) 計(D+E+F)	△ 2,023,404
(H) 収益分配金	△ 135,459
次期繰越損益金(G+H)	△ 2,158,863
追加信託差損益金	△36,315,270
(配当等相当額)	(38,370,747)
(売買損益相当額)	(△74,686,017)
分配準備積立金	34,156,407

- (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(2016年11月8日～2017年11月7日)は以下の通りです。

項 目	2016年11月8日～ 2017年11月7日
a. 配当等収益(経費控除後)	286,996円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	17,307,187円
c. 信託約款に定める収益調整金	38,370,747円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	16,697,683円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	72,662,613円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,682円
g. 分配金	135,459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

2016年11月8日から2017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、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2に定める信用リスクを適正に管理する方法として、一般社団法人投資信託協会規則に従って委託会社が合理的な方法を定めるべく、2017年8月8日付けにて信託約款に所要の変更を行ないました。(付表)

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31期（決算日 2017年10月23日）
 (2016年10月22日～2017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	東京証券取引所第一部に上場されている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

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、「バール日本株式モデル」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		東証株価指数 (ベンチマーク)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	騰落	中率	騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
27期(2013年10月21日)	1,096	63.8	1,212.36	60.9	98.4	1.4	12,461
28期(2014年10月21日)	1,111	1.4	1,205.36	△0.6	98.2	1.6	11,546
29期(2015年10月21日)	1,434	29.1	1,526.81	26.7	98.0	1.7	12,404
30期(2016年10月21日)	1,311	△8.6	1,365.29	△10.6	97.6	2.2	10,698
31期(2017年10月23日)	1,710	30.4	1,745.25	27.8	97.4	1.9	12,182

(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めて表示しています。

(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		東証株価指数 (ベンチマーク)		株組入比率	株先物比率
	騰落	率	騰落	率		
(期首)	円	%		%	%	%
2016年10月21日	1,311	—	1,365.29	—	97.6	2.2
10月末	1,337	2.0	1,393.02	2.0	97.8	1.9
11月末	1,411	7.6	1,469.43	7.6	97.9	1.8
12月末	1,460	11.4	1,518.61	11.2	98.5	1.2
2017年1月末	1,463	11.6	1,521.67	11.5	98.7	1.1
2月末	1,477	12.7	1,535.32	12.5	98.8	0.9
3月末	1,468	12.0	1,512.60	10.8	97.7	1.9
4月末	1,487	13.4	1,531.80	12.2	97.8	1.9
5月末	1,523	16.2	1,568.37	14.9	98.0	1.8
6月末	1,567	19.5	1,611.90	18.1	98.1	1.5
7月末	1,574	20.1	1,618.61	18.6	99.0	0.7
8月末	1,573	20.0	1,617.41	18.5	98.5	1.3
9月末	1,641	25.2	1,674.75	22.7	98.2	1.5
(期末)						
2017年10月23日	1,710	30.4	1,745.25	27.8	97.4	1.9

(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

(2016年10月22日～2017年10月23日)

基準価額の推移

期間の初め1,311円の基準価額は、期間末に1,710円となり、騰落率は+30.4%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>

- ・米国において減税やインフラ投資拡大への期待が高まったこと。
- ・フランス大統領選挙において独立系中道候補が当選し、欧州連合（EU）の結束が強まると期待されたこと。
- ・衆議院解散と衆議院総選挙の与党勝利を受けて新たな政策への期待が高まったこと。

<値下がり要因>

- ・米国新大統領が打ち出した保護主義的政策への警戒が広がったこと。
- ・シリアや北朝鮮の地政学的リスクが高まったこと。
- ・為替が円高／アメリカドル安の動きとなったこと（2016年12月下旬以降）。

(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2016年12月中旬にかけては、米国において次期大統領による減税やインフラ投資拡大への期待が高まったこと、円安／アメリカドル高の進行を受けて輸出企業の業績改善期待が広がったことなどから、TOPIXは上昇しました。12月下旬から2017年3月上旬にかけては、米国新大統領が打ち出した保護主義的政策への警戒が広がったことなどが株価の重しとなる一方で、米国や中国の良好な経済指標の発表などが支援材料となり、TOPIXはもみ合いの展開となりました。3月中旬から4月中旬にかけては、シリアや北朝鮮の地政学的リスクの高まりや、米国大統領の発言を背景とする円高／アメリカドル安の進行などが影響し、TOPIXは下落しました。4月下旬から期間末にかけては、北朝鮮による米国領グアム周辺へのミサイル攻撃検討の発表や核実験の実施などから情勢が緊迫化し、投資家のリスク回避姿勢が強まったものの、フランス大統領選挙において独立系中道候補が当選し、EUの結束が強まると期待されたことや、法人企業統計にて設備投資の順調な回復が示されたこと、衆議院解散と衆議院総選挙の与党勝利を受けて新たな政策への期待が高まったことなどから、TOPIXは上昇しました。



期首	期中高値	期中安値	期末
2016/10/21	2017/10/23	2016/11/09	2017/10/23
1,311円	1,710円	1,249円	1,710円

ポートフォリオ

東証株価指数（TOPIX）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、30.4%の値上がりとなり、ベンチマークである「東証株価指数」の上昇率27.8%を概ね2.6%上回ることでなりました。

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。

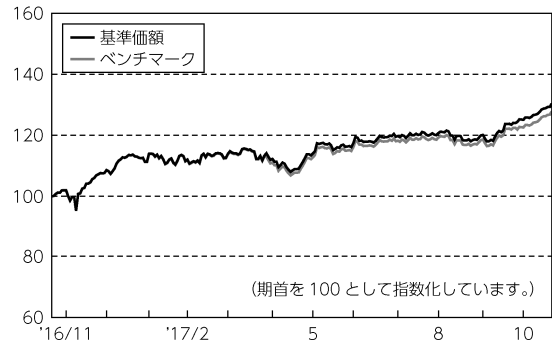
<プラス要因>

- ・ 株式配当金の受取り。

<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

東証株価指数（TOPIX）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

(2016年10月22日～2017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) (新 株 予 約 権 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 0 (0) (0) (0)	% 0.001 (0.000) (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、1,498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

(2016年10月22日～2017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 299 (△1,276)	千円 361,378 ()	千株 1,231	千円 1,711,825

(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 — (6,300)	千円 — (—)	証券 6,300	千円 62

(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 1,571	百万円 1,631	百万円 —	百万円 —

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2016年10月22日～2017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	2,073,203千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	11,324,158千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.18

(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

(2016年10月22日～2017年10月23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 0.7544	百万円 5	百万円 41

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 (2016年10月22日～2017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

(2017年10月23日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				銭高組	1	0.1	547
極洋	0.2	0.2	727	鹿島建設	27	23	26,404
日本水産	7.3	6.9	4,678	不動テトラ	3.9	4.3	825
マルハニチロ	1.2	1	3,410	大末建設	0.3	0.2	198
カネコ種苗	0.2	0.2	319	鉄建建設	4	0.3	1,078
サカタのタネ	0.9	0.8	2,884	西松建設	7	1.2	3,972
ホクト	0.6	0.5	1,012	三井住友建設	22.5	4	2,752
ホクリョウ	0.1	0.1	112	大豊建設	2	2	1,042
鉱業 (0.3%)				前田建設工業	4	3.5	4,725
住石ホールディングス	2.4	1.7	273	ナカノフドー建設	0.5	0.3	188
日鉄鉱業	0.2	0.1	812	奥村組	5	0.8	3,368
三井松島産業	0.4	0.3	412	東鉄工業	0.7	0.6	2,166
国際石油開発帝石	30.6	27.6	32,761	イチケン	1	0.2	534
日本海洋掘削	0.2	0.2	428	浅沼組	2	2	750
石油資源開発	0.9	0.8	1,839	戸田建設	7	6	5,286
K&Oエナジーグループ	0.4	0.3	577	熊谷組	8	0.8	2,768
建設業 (3.3%)				青木あすなろ建設	0.5	0.3	303
ショーボンドホールディングス	0.6	0.5	3,285	北野建設	1	1	502
ミライト・ホールディングス	1.8	1.6	2,179	植木組	1	0.1	270
ファーストコーポレーション	—	0.2	224	三井ホーム	1	1	688
インベスターズクラウド	—	0.1	690	矢作建設工業	0.7	0.7	699
安藤・間	4	3.8	3,207	ピーエス三菱	0.5	0.6	394
東急建設	1.9	1.9	1,776	日本ハウスホールディングス	1.2	1	671
コムシスホールディングス	2.5	2.1	5,819	大東建託	2.1	1.9	38,959
ミサワホーム	0.7	0.6	563	新日本建設	0.7	0.6	555
高松コンストラクショングループ	0.5	0.4	1,212	N I P P O	1	1	2,291
東建コーポレーション	0.2	0.2	2,678	東亜道路工業	1	0.1	448
ヤマウラ	0.3	0.3	287	前田道路	2	2	4,772
大成建設	30	5.3	32,436	日本道路	2	0.2	1,310
大林組	17.4	15.6	22,401	東亜建設工業	0.5	0.4	880
清水建設	18	16	20,720	若築建設	4	0.3	554
飛島建設	4.7	5.1	826	東洋建設	1.9	1.5	765
長谷工コーポレーション	6.8	6.1	9,625	五洋建設	6.4	5.8	4,222
松井建設	0.6	0.6	587	大林道路	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
世紀東急工業	0.9	0.7	467
福田組	1	0.2	1,316
住友林業	4	3.6	6,746
日本基礎技術	0.9	0.5	200
日成ビルド工業	2	0.8	998
ヤマダ・エスバイエルホーム	3	3	252
巴コーポレーション	0.8	0.7	311
バナホーム	2	—	—
大和ハウス工業	17.1	15.5	63,488
ライト工業	1.1	1	1,116
積水ハウス	19.4	16	32,384
日特建設	0.8	0.5	304
北陸電気工事	0.3	0.3	317
ユアテック	1	0.9	777
西部電気工業	0.2	0.1	252
四電工	1	—	—
中電工	0.9	0.6	2,004
関電工	2	2	2,334
きんでん	3.5	3.5	6,720
東京エネシス	1	0.5	623
トーエネック	1	0.2	686
住友電設	0.5	0.4	868
日本電設工業	1	0.8	1,933
協和エクシオ	2.2	2.1	4,949
新日本空調	0.5	0.4	650
NDS	0.1	—	—
九電工	1.1	1	4,425
三機工業	1.3	1.1	1,412
日揮	5.8	4.9	9,265
中外炉工業	2	0.2	445
ヤマト	0.8	0.4	310
太平電業	1	0.4	1,056
高砂熱学工業	1.7	1.5	2,968
三見金属工業	0.1	0.1	375
朝日工業社	0.2	0.1	343
明星工業	1.1	1	757
大気社	0.7	0.7	2,215
ダイダン	1	0.4	1,134

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日比谷総合設備	0.7	0.6	1,510
東芝プラントシステム	0.9	0.9	1,723
OSJBホールディングス	—	1.6	532
東洋エンジニアリング	3	0.6	795
千代田化工建設	4	3.9	2,511
新興プランテック	1.1	1.1	1,053
食料品 (4.5%)			
日本製粉	1.8	1.6	2,817
日清製粉グループ本社	6.4	5.7	11,605
日東富士製粉	0.1	—	—
昭和産業	2	0.4	1,169
鳥越製粉	0.6	0.4	361
中部飼料	0.5	0.6	1,221
フィード・ワン	3.8	3.2	931
東洋精糖	1	0.1	119
日本甜菜製糖	0.3	0.3	718
三井製糖	0.4	0.4	1,558
塩水港精糖	0.4	0.7	185
日新製糖	0.3	0.2	407
森永製菓	1	1	6,380
中村屋	0.1	0.1	508
江崎グリコ	1.3	1.3	8,164
名糖産業	0.3	0.2	300
不二家	3	0.3	758
山崎製パン	4.2	3.8	8,162
第一屋製パン	1	0.1	122
モロゾフ	1	0.1	736
亀田製菓	0.3	0.3	1,572
寿スピリッツ	0.4	0.5	2,147
カルビー	2.1	2.1	8,662
森永乳業	5	0.9	4,036
六甲バター	0.2	0.2	507
ヤクルト本社	3.1	2.8	25,564
明治ホールディングス	3.4	3.1	28,675
雪印メグミルク	1.4	1.1	3,547
プリマハム	4	3	2,247
日本ハム	4	4	13,260
林兼産業	0.2	0.2	188

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸大食品	3	3	1,665
S Foods	0.4	0.3	1,297
伊藤ハム米久ホールディングス	3.4	3	3,201
サッポロホールディングス	1.9	1.7	5,890
アサヒグループホールディングス	10.9	9.8	49,931
キリンホールディングス	25	22.5	61,796
宝ホールディングス	4.2	3.8	4,054
オエノンホールディングス	1	1.3	425
養命酒製造	—	0.2	448
コカ・コーラボトラーズジャパン	2	3.3	12,771
コカ・コーライーストジャパン	2.3	—	—
サントリー食品インターナショナル	4	3.6	18,828
ダイドールグループホールディングス	0.3	0.2	1,090
伊藤園	1.7	1.5	5,827
キーコーヒー	0.5	0.5	1,095
ユニカフェ	0.2	0.2	213
ジャパンフーズ	0.1	0.1	139
日清オイリオグループ	3	0.6	2,238
不二製油グループ本社	1.5	1.4	4,242
かどや製油	0.1	0.1	576
J-オイルミルズ	0.2	0.2	828
キッコーマン	4	3.7	14,097
味の素	11.9	10.7	24,417
キュービー	2.9	2.7	7,622
ハウス食品グループ本社	2	1.9	6,355
カゴメ	2.1	1.9	7,049
焼津水産化学工業	0.4	0.3	359
アリアケジャパン	0.5	0.4	3,452
ビエトロ	0.1	0.1	163
エバラ食品工業	0.1	0.1	210
ニチレイ	3	2.4	7,142
東洋水産	2.9	2.6	11,518
日清食品ホールディングス	2.4	2	14,400
永谷園ホールディングス	1	1	1,326
一正蒲鉾	0.2	0.2	266
フジッコ	0.6	0.5	1,335
ロック・フィールド	0.6	0.5	1,008
日本たばこ産業	32.1	29	112,404

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	0.3	873
わらべや日洋ホールディングス	0.3	0.3	844
なとり	0.3	0.3	616
イフジ産業	—	0.2	160
ユーグレナ	1.8	1.8	2,089
ミヨシ油脂	2	0.2	295
理研ビタミン	0.1	0.2	884
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	0.7	0.6	849
グンゼ	4	0.4	2,100
東洋紡	21	1.9	3,971
ユニチカ	15	1.4	1,358
富士紡ホールディングス	0.3	0.2	781
倉敷紡績	6	5	1,610
シキボウ	3	0.3	470
日本毛織	1.5	1.4	1,401
ダイトウボウ	2	1.9	197
トーア紡コーポレーション	0.3	—	—
ダイドーリミテッド	0.6	0.6	264
帝国繊維	0.5	0.5	1,187
帝人	4.4	4	9,436
東レ	39	35.5	39,280
サカイオーベックス	0.2	0.1	230
住江織物	2	1	313
日本フェルト	0.4	0.3	150
イチカワ	1	—	—
日東製網	1	0.1	187
アツギ	5	0.4	505
ダイニック	1	0.2	227
セーレン	1.3	1.2	2,378
ソトー	0.2	0.2	228
東海染工	1	0.1	156
小松精練	0.8	0.6	546
ワコールホールディングス	3	1.5	4,987
ホギメディカル	0.3	0.3	2,298
レナウン	1.2	1.5	303
T S I ホールディングス	2.4	2	1,978
三陽商会	3	0.3	563

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ナイガイ	3	0.2	116
オンワードホールディングス	4	3	2,901
ルック	1	1	413
キムラタン	11	2.6	161
ゴールドウイン	0.2	0.2	1,720
デサント	1.2	1.2	1,765
キング	0.2	0.4	200
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	0.3	0.3	1,374
王子ホールディングス	21	19	11,837
日本製紙	2.8	2.2	4,796
三菱製紙	0.8	0.7	529
北越紀州製紙	3.4	2.7	1,954
中越パルプ工業	2	0.2	431
巴川製紙所	1	1	292
大王製紙	2.4	2	2,776
阿波製紙	—	0.2	152
レンゴー	4.7	4.8	3,307
トーモク	2	0.3	590
ザ・バック	0.4	0.4	1,554
化学 (7.1%)			
クラレ	9.2	8.2	18,195
旭化成	34	30.5	41,449
共和レザー	0.5	0.3	289
昭和電工	3.6	3.2	11,536
住友化学	40	36	27,036
日本化成	1	—	—
住友精化	0.2	0.2	1,198
日産化学工業	3.2	2.6	10,738
ラサ工業	2	0.2	418
クレハ	0.4	0.4	2,612
多木化学	—	0.1	501
テイカ	1	0.4	1,019
石原産業	1	0.9	1,490
日東エフシー	0.3	0.3	257
日本曹達	4	3	2,088
東ソー	15	7.1	18,225
トクヤマ	9	1.5	4,017

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セントラル硝子	6	1	2,510
東亜合成	3.4	2.9	4,425
大阪ソーダ	2	0.4	1,132
関東電化工業	1	1	1,148
デンカ	11	1.9	7,106
信越化学工業	9.7	8.8	99,704
日本カーバイド工業	2	0.2	459
堺化学工業	2	0.4	1,114
エア・ウォーター	4	4.1	8,794
大陽日酸	4.2	3.8	5,225
日本化学工業	2	0.2	515
日本パーカライジング	2.7	2.5	4,557
高圧ガス工業	0.9	0.7	590
四国化成工業	1	0.7	1,250
戸田工業	1	0.1	464
ステラ ケミファ	0.3	0.2	842
保土谷化学工業	0.2	0.2	1,512
日本触媒	0.8	0.8	6,648
大日精化工業	2	0.4	2,080
カネカ	7	7	6,342
三菱瓦斯化学	4.5	4.6	12,443
三井化学	23	4.5	15,367
J S R	5.1	4.9	10,510
東京応化工業	1.1	0.9	3,960
大阪有機化学工業	0.4	0.3	395
三菱ケミカルホールディングス	36.2	32.9	38,032
KHネオケム	—	0.7	1,792
ダイセル	7.3	6.6	9,259
住友ペークライト	5	4	3,580
積水化学工業	12.3	10.9	24,982
日本ゼオン	5	4	5,728
アイカ工業	1.6	1.6	5,976
宇部興産	29	2.5	8,450
積水樹脂	0.9	0.8	1,768
タキロンシーアイ	1	1	711
旭有機材	2	0.3	429
日立化成	2.7	2.7	8,316
ニチバン	1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リケンテクノス	1	1.1	772
大倉工業	1	1	781
積水化成成品工業	0.5	0.7	975
群栄化学工業	0.2	0.1	399
タイガースポリマー	0.3	0.3	240
ミライアル	0.2	0.2	311
ダイキョーニシカワ	0.7	0.9	1,686
日本化薬	4	3	5,391
カーリットホールディングス	0.5	0.5	380
日本精化	0.6	0.4	384
扶桑化学工業	0.3	0.3	1,075
ADEKA	2.6	2.1	4,160
日油	4	1.9	6,251
新日本理化	0.5	1	275
ハリマ化成グループ	0.6	0.4	399
花王	13.7	11.5	82,765
第一工業製薬	1	1	754
日華化学	—	0.2	225
ニイタカ	0.1	0.1	189
三洋化成工業	0.4	0.3	1,944
有機合成薬品工業	1	0.5	150
大日本塗料	3	0.6	1,026
日本ペイントホールディングス	4.2	3.8	15,048
関西ペイント	6.1	5.1	14,305
中国塗料	1.7	1.4	1,425
日本特殊塗料	0.4	0.3	584
藤倉化成	0.8	0.6	409
太陽ホールディングス	0.4	0.4	2,136
D I C	2.1	1.9	7,942
サカタインクス	1.1	1	2,131
東洋インキS Cホールディングス	5	5	3,235
T & K TOKA	0.4	0.3	384
富士フイルムホールディングス	12.4	9.7	44,125
資生堂	10.2	8.7	42,186
ライオン	7	6.5	13,981
高砂香料工業	0.4	0.3	1,195
マンダム	0.5	1	3,210
ミルボン	0.3	0.3	2,076

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ファンケル	1.3	1.1	2,911
コーセー	0.9	0.8	11,672
コタ	0.2	0.2	278
シーズ・ホールディングス	0.7	0.6	2,490
ポーラ・オルビスホールディングス	0.6	2	7,440
ノエビアホールディングス	0.3	0.3	2,001
エステー	0.4	0.3	862
コニン	0.8	0.8	1,596
長谷川香料	0.7	0.6	1,368
星光PMC	0.3	0.3	361
小林製薬	1.6	1.3	8,567
荒川化学工業	0.5	0.4	1,047
メック	0.4	0.4	699
日本高純度化学	0.2	0.1	278
タカラバイオ	1.2	1.4	2,088
J C U	0.2	0.3	1,434
新田ゼラチン	0.4	0.4	320
デクセリアルズ	1.6	1.3	1,740
アース製薬	0.4	0.4	2,064
イハラケミカル工業	0.7	—	—
北興化学工業	1	0.5	343
大成ラミック	0.2	0.1	309
クミアイ化学工業	1.1	2.2	1,766
日本農薬	1.2	1.2	778
アキレス	0.4	0.4	909
有沢製作所	0.8	0.8	810
日東電工	4.2	3.5	34,730
レック	0.2	0.3	832
きもと	0.7	1	269
藤森工業	0.5	0.4	1,494
前澤化成工業	0.4	0.3	385
J S P	0.3	0.2	746
エフビコ	0.5	0.4	2,360
天馬	0.4	0.3	716
信越ポリマー	1	1	1,057
東リ	2	1.1	436
ニフコ	1	0.9	6,399
日本バルカー工業	0.4	0.4	1,108

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニ・チャーム	11	9.9	26,239
医薬品 (4.5%)			
協和発酵キリン	6.5	5.8	11,832
武田薬品工業	21.6	18.4	116,324
アステラス製薬	58.8	47.9	72,831
大日本住友製薬	3.8	3.5	5,600
塩野義製薬	7.9	6.2	38,433
田辺三菱製薬	6.3	5.7	15,224
わかもと製薬	1	1	295
あすか製薬	0.7	0.5	975
日本新薬	1.2	1.1	9,020
ピオフェルミン製薬	0.1	0.1	304
中外製薬	5.4	4.8	25,872
科研製薬	0.9	0.9	5,292
エーザイ	6.7	6	36,414
ロート製薬	2.6	2.4	6,338
小野薬品工業	12.3	11.1	30,103
久光製薬	1.7	1.4	8,694
持田製薬	0.4	0.3	2,637
参天製薬	10	8.8	16,068
扶桑薬品工業	0.2	0.2	567
日本ケミファ	0.1	0.1	519
ツムラ	1.7	1.6	6,784
日医工	1.3	1.1	1,956
キッセイ薬品工業	1	0.9	2,848
生化学工業	1	0.9	1,875
栄研化学	0.5	0.4	1,738
鳥居薬品	0.4	0.3	957
JCRファーマ	0.4	0.4	1,484
東和薬品	0.3	0.2	1,152
富士製薬工業	0.2	0.2	768
沢井製薬	0.9	0.8	5,264
ゼリア新薬工業	1.1	1	2,023
第一三共	18.2	14.4	36,460
キョーリン製薬ホールディングス	1.4	1.2	2,852
大幸薬品	0.3	0.3	711
ダイト	0.3	0.3	844
大塚ホールディングス	11.7	9.7	46,327

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大正製薬ホールディングス	1.3	1	8,960
ペプチドリーム	0.9	1.9	6,602
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	5.2	4	476
昭和シェル石油	4.9	4.4	5,680
ニチレキ	0.6	0.6	826
東燃ゼネラル石油	9	—	—
ユシロ化学工業	0.3	0.3	507
ビービー・カストロール	0.3	0.2	397
富士石油	1.4	1.1	459
MORESCO	0.1	0.2	417
出光興産	2.8	3	9,345
JXTGホールディングス	63.9	74.4	42,809
コスモエネルギーホールディングス	1.6	1.5	3,765
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	3.3	2.7	6,901
東洋ゴム工業	2.9	2.8	7,305
ブリヂストン	18.3	16.5	91,426
住友ゴム工業	5.1	4.6	9,945
藤倉ゴム工業	0.4	0.4	357
オカモト	2	1	1,193
フコク	0.3	0.2	232
ニッタ	0.6	0.4	1,816
住友理工	1.1	0.9	1,071
三ツ星ベルト	1	1	1,389
バンドー化学	1	0.9	1,094
ガラス・土石製品 (1.0%)			
日東紡績	4	0.8	2,900
旭硝子	27	4.8	20,856
日本板硝子	2.6	2.2	2,013
石塚硝子	1	0.1	246
日本山村硝子	2	2	396
日本電気硝子	11	2	8,940
オハラ	0.2	0.2	416
住友大阪セメント	11	9	4,617
太平洋セメント	34	3	13,455
日本ヒューム	0.6	0.4	304
日本コンクリート工業	0.9	1.1	512

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三谷セキサン	0.3	0.2	523
アジアパイルホールディングス	0.7	0.6	380
東海カーボン	5	4.3	4,687
日本カーボン	3	0.2	954
東洋炭素	0.3	0.3	833
ノリタケカンパニーリミテド	0.3	0.3	1,623
TOTO	4	3.6	17,802
日本碍子	6.9	6.2	13,590
日本特殊陶業	4.6	4	9,980
MARUWA	0.2	0.2	1,288
品川リフラクトリーズ	2	0.1	368
黒崎播磨	1	0.1	527
イソライト工業	0.1	0.3	249
東京窯業	1	0.8	308
ニッカー	0.3	0.3	183
フジミインコーポレーテッド	0.5	0.4	1,051
エーアンドエーマテリアル	2	0.2	256
ニチアス	3	3	4,185
ニチハ	0.7	0.7	3,055
鉄鋼 (1.2%)			
新日鐵住金	24.4	22	59,895
神戸製鋼所	9.9	8.5	7,369
中山製鋼所	—	0.6	458
合同製鐵	0.3	0.3	674
ジェイ エフ イー ホールディングス	14.8	13.4	31,590
日新製鋼	2.5	1.6	2,534
東京製鐵	3	2.5	2,327
共英製鋼	0.6	0.5	894
大和工業	1.2	1	3,025
東京製鋼	1	0.2	436
大阪製鐵	0.3	0.3	774
淀川製鋼所	0.8	0.7	2,261
東洋鋼板	1.4	1.2	626
丸一鋼管	1.8	1.6	5,408
モリ工業	0.2	0.1	284
大同特殊鋼	9	0.8	5,496
日本高周波鋼業	3	0.2	198
日本冶金工業	4.1	4.1	975

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山陽特殊製鋼	3	0.6	1,772
愛知製鋼	0.3	0.3	1,351
日立金属	6.2	5	8,155
日本金属	0.2	0.1	313
大平洋金属	4	0.3	982
新日本電工	3.1	2.8	1,307
栗本鐵工所	0.2	0.2	467
日本鑄鉄管	1	1	186
三菱製鋼	4	0.3	885
日亜鋼業	1	0.8	257
日本精練	1	—	—
シンニッタン	0.8	0.5	368
新家工業	2	0.1	215
非鉄金属 (1.0%)			
大紀アルミニウム工業所	1	0.8	710
日本軽金属ホールディングス	12	12.6	4,321
三井金属鉱業	14	1.3	7,345
東邦亜鉛	3	0.3	1,542
三菱マテリアル	3.4	3.1	12,927
住友金属鉱山	15	6.3	27,354
DOWAホールディングス	7	1.1	5,115
古河機械金属	8	0.8	1,611
エス・サイエンス	1.3	1.8	142
大阪チタニウムテクノロジーズ	0.5	0.5	807
東邦チタニウム	0.9	0.8	712
UAC J	8	0.7	2,208
古河電気工業	1.7	1.6	10,464
住友電気工業	21.8	18.4	34,472
フジクラ	7.5	6.4	5,888
昭和電線ホールディングス	7	0.6	613
タツタ電線	1.1	0.9	720
沖電線	1	0.1	311
カナレ電気	0.1	0.1	253
平河ヒューテック	—	0.2	298
リョービ	3	0.6	1,881
アーレスティ	0.7	0.6	605
アサヒホールディングス	0.8	0.7	1,678

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
金属製品 (0.7%)			
稲葉製作所	0.3	0.3	422
宮地エンジニアリンググループ	2	0.1	298
トーカロ	0.4	0.3	1,293
アルファC.O.	0.2	0.2	466
SUMCO	5.6	4.3	9,305
川田テクノロジーズ	0.1	0.1	647
東洋製織グループホールディングス	3.9	3.5	7,017
ホッカンホールディングス	1	1	423
コロナ	0.3	0.3	417
横河ブリッジホールディングス	1.1	0.9	1,904
駒井ハルテック	0.1	0.1	254
高田機工	1	0.1	327
三和ホールディングス	5.3	4.8	6,422
文化シャッター	1.5	1.4	1,282
三協立山	0.7	0.6	975
アルインコ	0.3	0.3	374
東洋シャッター	0.1	0.2	122
LIXILグループ	7.5	6.8	20,910
日本フィルコン	0.5	0.4	326
ノーリツ	1.1	1	2,070
長府製作所	0.6	0.5	1,398
リンナイ	1	0.8	7,808
ダイニチ工業	0.3	0.3	253
日東精工	1	0.6	396
三洋工業	1	0.1	219
岡部	1.1	0.9	957
ジーテクト	0.6	0.5	1,154
中国工業	0.1	0.1	78
東ブレ	1.1	0.9	3,109
高周波熱錬	1	0.9	1,017
東京製鋼	0.4	0.3	513
モリテック スチール	0.2	0.3	197
バイオラックス	0.3	0.8	2,524
エイチワン	—	0.4	519
日本発條	5.1	4.6	5,883
中央発條	1	0.1	372
アドパネクス	0.2	0.1	297

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三益半導体工業	0.4	0.4	749
機械 (5.4%)			
日本製鋼所	1.8	1.6	4,536
三浦工業	2.4	2	5,212
タクマ	2	1.5	2,130
ツガミ	2	1	1,076
オークマ	4	0.6	3,936
東芝機械	3	3	2,082
アマダホールディングス	7.9	6.6	8,665
アイダエンジニアリング	1.4	1.4	1,857
滝澤鉄工所	2	0.2	386
富士機械製造	1.8	1.5	3,216
牧野フライス製作所	3	2	2,006
オーエスジー	2.4	2.1	5,187
ダイジェット工業	1	0.1	191
旭ダイヤモンド工業	1.5	1.3	1,362
DMG森精機	3.2	2.6	5,756
ソディック	1.4	1.2	1,788
ディスコ	0.7	0.6	14,856
日東工器	0.3	0.3	835
パンチ工業	0.1	0.2	384
富士ダイス	—	0.3	255
豊和工業	0.4	0.3	603
OKK	2	0.2	249
東洋機械金属	0.6	0.4	350
津田駒工業	1	1	201
島精機製作所	0.8	0.6	3,684
NCホールディングス	0.2	0.2	169
フリュー	0.1	0.3	346
ヤマシンフィルタ	—	0.1	375
日阪製作所	0.7	0.6	616
やまびこ	1	0.9	1,340
平田機工	—	0.2	2,374
ペガサスミシン製造	0.7	0.5	395
ナプテスコ	2.8	2.5	10,912
三井海洋開発	0.5	0.5	1,286
レオン自動機	0.7	0.4	675
SMC	1.6	1.5	61,380

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
新川	0.5	0.4	333
ホソカワミクロン	1	0.2	1,252
ユニオンツール	0.2	0.2	704
オイレス工業	0.7	0.6	1,315
日精エー・エス・ビー機械	0.2	0.2	929
サトーホールディングス	0.7	0.6	1,601
技研製作所	—	0.2	669
日本エアータック	0.3	0.3	258
日精樹脂工業	0.4	0.4	591
ワイエイシイホールディングス	0.3	0.2	224
小松製作所	26.5	22.5	80,527
住友重機械工業	16	2.8	13,230
日立建機	2.4	2.2	8,162
日工	0.2	0.1	225
巴工業	0.2	0.2	454
井関農機	6	0.5	1,203
TOWA	0.6	0.4	780
丸山製作所	2	0.1	189
北川鉄工所	0.2	0.2	583
ローツェ	0.2	0.2	559
クボタ	26	25.2	52,113
荏原実業	0.2	0.2	348
三菱化工機	2	0.2	478
月島機械	1.1	0.9	1,199
帝国電機製作所	0.4	0.4	470
新東工業	1.2	1.1	1,401
澁谷工業	0.5	0.4	1,650
アイチ コーポレーション	0.7	0.7	567
小森コーポレーション	1.2	1.2	1,765
鶴見製作所	0.4	0.4	778
住友精密工業	1	1	364
酒井重工業	1	0.1	358
荏原製作所	2.4	2.2	8,734
石井鐵工所	0.1	0.1	178
西島製作所	0.6	0.5	587
北越工業	—	0.5	553
ダイキン工業	7.5	6.4	77,888
オルガノ	1	0.2	564

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トーヨーカネツ	3	0.2	810
栗田工業	3.3	2.7	9,045
椿本チエイン	3	3	2,778
大同工業	1	0.2	337
木村化工機	0.6	0.5	219
アネスト岩田	0.8	0.9	1,016
ダイフク	2.8	2.3	12,397
サムコ	0.1	0.2	210
加藤製作所	0.2	0.3	975
油研工業	1	0.1	262
タダノ	2.4	2.5	3,505
フジテック	1.5	1.3	2,004
CKD	1.5	1.4	3,339
キトー	0.6	0.6	838
平和	1.6	1.5	3,375
理想科学工業	0.6	0.5	1,048
SANKYO	1.4	1.3	4,881
日本金銭機械	0.5	0.4	484
マースエンジニアリング	0.3	0.3	695
福島工業	0.3	0.3	1,290
オーイズミ	0.4	0.4	227
ダイコク電機	0.2	0.2	356
竹内製作所	1	0.9	2,114
アマノ	1.6	1.4	3,761
JUKI	0.8	0.7	1,168
サンデンホールディングス	3	0.6	1,347
蛇の目マシン工業	0.5	0.5	398
マックス	1	0.7	1,112
グローリー	1.8	1.5	6,397
新晃工業	0.4	0.4	706
大和冷機工業	0.8	0.7	870
セガサミーホールディングス	5.6	4.6	7,484
日本ピストンリング	0.2	0.2	493
リケン	0.2	0.2	1,198
T P R	0.6	0.5	1,962
ツバキ・ナカシマ	0.6	0.5	1,210
ホンザキ	1.1	1.5	15,780
大豊工業	0.4	0.4	689

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本精工	10.6	9.6	14,966
NTN	13	11	5,555
ジェイテクト	5.5	5	8,420
不二越	5	4	2,692
日本トムソン	1.9	1.5	981
THK	3.4	3.3	13,299
ユースン精機	0.2	0.2	631
前澤給装工業	0.2	0.2	368
イーグル工業	0.6	0.5	1,068
前澤工業	0.7	0.5	207
日本ビラー工業	0.5	0.5	858
キッツ	2.3	2.2	2,057
日立工機	1.4	—	—
マキタ	3.4	6.1	27,694
日立造船	4.1	3.7	2,208
三菱重工業	92	7.8	35,451
I H I	40	3.6	14,256
スター精密	1	0.8	1,593
電気機器 (13.6%)			
日清紡ホールディングス	2.8	2.9	3,886
イビデン	3.2	3.3	6,108
コニカミノルタ	12.9	10.9	10,671
ブラザー工業	6.7	5.7	16,108
ミネベアミツミ	8.4	8.5	16,490
日立製作所	132	112	97,216
東芝	109	—	—
三菱電機	55	49.8	96,636
富士電機	16	14	9,576
東洋電機製造	1	0.2	400
安川電機	6.4	5.4	22,410
シンフォニアテクノロジー	3	3	1,431
明電舎	5	4	1,776
オリジン電気	1	0.2	399
山洋電気	1	0.2	1,262
デンヨー	0.5	0.4	756
東芝テック	4	3	1,929
芝浦メカトロニクス	1	1	405
マブチモーター	1.5	1.3	7,579

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本電産	6.2	6.1	90,402
ユース・エム・シー・エレクトロニクス	0.1	0.1	225
東光高岳	0.3	0.2	393
ダブル・スコープ	0.5	0.7	1,551
ダイヘン	3	3	2,985
田淵電機	0.6	0.7	208
ヤーマン	—	0.1	1,330
JVCケンウッド	3.8	3.5	1,207
ミマキエンジニアリング	0.3	0.4	345
第一精工	0.2	0.2	520
日新電機	1.2	0.9	1,269
大崎電気工業	1	0.9	790
オムロン	5.8	5	32,000
日東工業	0.9	0.7	1,372
I D E C	0.7	0.5	1,154
ジーエス・ユアサ コーポレーション	10	9	5,409
サクサホールディングス	2	0.1	209
メルコホールディングス	0.3	0.3	1,056
テクノメディカ	0.2	0.1	195
日本電気	71	6.4	19,872
富士通	50	45	40,968
沖電気工業	2.2	2	3,138
岩崎通信機	3	0.3	253
電気興業	1	0.2	578
サンケン電気	3	3	2,007
ナカヨ	1	0.2	387
アイホン	0.3	0.3	560
ルネサスエレクトロニクス	2.7	2.4	3,069
セイコーエプソン	7.7	7	20,048
ワコム	4.1	3.5	1,725
アルバック	0.9	0.8	5,920
アクセル	0.3	0.2	161
E I Z O	0.5	0.5	2,240
ジャパンディスプレイ	9.7	8.6	2,055
日本信号	1.4	1.3	1,586
京三製作所	1	1	657
能美防災	0.6	0.5	924
ホーチキ	0.4	0.3	671

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エレコム	0.4	0.4	902
日本無線	0.2	—	—
パナソニック	59.1	53.6	89,297
アンリツ	3.1	3.4	3,236
富士通ゼネラル	2	1.6	3,628
日立国際電気	1.2	1.2	3,744
ソニー	36.5	33	141,141
TDK	3.1	2.6	20,592
帝国通信工業	1	0.2	226
ミツミ電機	2	—	—
タムラ製作所	2	1.8	1,202
アルプス電気	4.5	4.3	13,695
池上通信機	2	2	336
バイオニア	8.5	7.1	1,562
日本電波工業	0.5	0.4	336
鈴木	0.1	0.2	201
日本トリム	0.1	0.1	485
ローランド ディー. ジー.	0.3	0.2	603
フォスター電機	0.7	0.5	1,190
クラリオン	3	2	916
SMK	1	1	526
ヨコオ	0.6	0.3	413
ホシデン	1.6	1.4	2,513
ヒロセ電機	0.8	0.8	13,136
日本航空電子工業	1	1	1,822
TOA	0.6	0.5	593
マクセルホールディングス	0.8	0.7	1,922
古野電気	0.6	0.6	478
ユニデンホールディングス	2	1	355
アルパイン	1.3	1.1	2,435
スミダコーポレーション	0.4	0.5	1,014
アイコム	0.3	0.2	532
リオン	0.1	0.2	446
本多通信工業	—	0.2	350
船井電機	0.5	0.5	454
横河電機	5.2	5.1	10,648
新電元工業	2	0.2	1,452
アズビル	1.6	1.4	6,790

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東亜ディーケーケー	0.2	0.3	258
日本光電工業	2.2	2	5,170
チノー	0.3	0.2	256
共和電業	0.7	0.5	226
日本電子材料	0.2	0.3	208
堀場製作所	1	0.9	5,913
アドバンテスト	3.5	3.2	7,740
小野測器	0.4	0.3	222
エスベック	0.5	0.4	905
パナソニック デバイスSUNX	0.5	—	—
キーエンス	1.2	2.1	127,953
日置電機	0.2	0.2	498
シスメックス	4	3.6	27,396
日本マイクロニクス	1	0.8	864
メガチップス	0.5	0.4	1,450
OBARA GROUP	0.3	0.3	1,971
コーセル	0.7	0.7	1,061
イリソ電子工業	0.2	0.4	2,288
新日本無線	0.6	0.4	343
オプテックスグループ	0.4	0.4	1,766
千代田インテグレ	0.3	0.2	538
アイ・オー・データ機器	0.2	0.2	220
レーザーテック	0.5	1.1	2,599
スタンレー電気	3.7	3.3	13,579
岩崎電気	2	0.2	393
ウシオ電機	3.1	2.9	4,616
ヘリオス テクノ ホールディング	0.6	0.4	291
日本セラミック	0.4	0.5	1,565
遠藤照明	0.3	0.2	267
日本デジタル研究所	0.4	—	—
双信電機	0.3	0.3	300
山一電機	0.5	0.5	1,053
図研	0.4	0.3	590
日本電子	2	2	1,138
カンデオ計算機	5.2	3.8	6,425
ファナック	5.2	4.7	120,249
日本シイエムケイ	1.2	1	1,151
エンプラス	0.3	0.2	1,038

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大真空	0.2	0.2	372
ローム	2.5	2.3	23,506
浜松ホトニクス	4	3.4	12,206
三井ハイテック	0.8	0.6	1,365
新光電気工業	2	1.7	1,390
京セラ	8.5	7.7	57,773
太陽誘電	2.5	2.3	4,160
村田製作所	5.4	4.9	84,182
ユーシン	0.7	0.7	560
双葉電子工業	0.8	0.8	1,704
北陸電気工業	2	0.2	306
ニチコン	1.6	1.5	2,104
日本ケミコン	4	0.4	1,556
KOA	0.7	0.6	1,329
市光工業	2	1	880
小糸製作所	3.1	2.8	21,168
ミツバ	0.9	0.9	1,651
SCREENホールディングス	1	0.9	7,632
キャノン電子	0.5	0.4	935
キャノン	27.8	25.2	102,513
リコー	16.7	14.1	16,356
MUTOHホールディングス	1	0.1	256
東京エレクトロン	4.2	3.1	59,458
輸送用機器 (8.8%)			
トヨタ紡織	1.8	1.6	3,971
芦森工業	2	0.1	315
ユニプレス	1.1	0.9	2,803
豊田自動織機	4.7	4.3	30,229
モリタホールディングス	0.9	0.8	1,505
三櫻工業	0.6	0.6	582
デンソー	11.5	11.5	66,838
東海理化電機製作所	1.5	1.2	2,863
三井造船	20	1.7	2,468
川崎重工業	40	3.6	14,076
名村造船所	1.6	1.4	970
サノヤスホールディングス	0.3	0.7	233
日本車輛製造	2	2	608
三菱ロジスネクスト	0.6	0.5	399

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
近畿車輛	0.1	0.1	264
日産自動車	70.5	55.1	60,444
いすゞ自動車	15	13.5	21,721
トヨタ自動車	65.9	56.8	396,520
日野自動車	7.4	6.7	9,567
三菱自動車工業	20.6	17.1	15,646
エフテック	0.2	0.3	536
レシップホールディングス	0.2	0.2	186
武蔵精密工業	0.6	0.5	1,770
日産車体	2.5	2.1	2,625
新明和工業	2	1.9	1,966
極東開発工業	1	0.9	1,690
日信工業	1.2	1	2,062
トビー工業	0.4	0.4	1,504
ティラド	2	0.2	874
曙ブレーキ工業	2.6	2.1	789
タチエス	0.8	0.8	1,652
NOK	2.5	2.3	6,352
フタバ産業	1.5	1.4	1,715
KYB	6	0.5	3,560
大同メタル工業	0.7	0.6	626
プレス工業	2.7	2.5	1,545
ミクニ	0.5	0.6	361
カルソニックカンセイ	4	—	—
太平洋工業	1.1	1.1	1,635
ケーヒン	1.2	1.1	2,256
河西工業	0.6	0.6	979
アイシン精機	5.3	4.3	26,531
富士機工	0.9	0.5	369
マツダ	16.3	14.8	23,835
今仙電機製作所	0.5	0.4	572
本田技研工業	46.5	42	145,782
スズキ	9.5	9.2	54,924
SUBARU	16.1	14.5	57,710
安永	0.2	0.2	681
ヤマハ発動機	7.3	6.6	21,846
ショーワ	1.3	1.2	1,712
TBK	0.7	0.5	257

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エクセディ	0.7	0.6	2,022
豊田合成	1.9	1.5	4,308
愛三工業	0.8	0.8	881
ヨロズ	0.5	0.4	930
エフ・シー・シー	0.9	0.7	1,789
シマノ	2.1	1.9	29,298
タカタ	0.9	—	—
テイ・エス テック	1.2	1.1	4,350
ジャムコ	0.3	0.3	693
精密機器 (1.6%)			
テルモ	8	7.2	33,588
クリエートメディック	0.2	0.2	212
日機装	1.9	1.6	1,726
島津製作所	7	6	13,860
JMS	1	0.5	350
長野計器	0.4	0.4	483
ブイ・テクノロジー	0.1	0.1	1,911
東京計器	2	0.3	464
愛知時計電機	0.1	0.1	422
インターアクション	—	0.3	230
オーバル	0.4	0.7	262
東京精密	1	0.9	3,748
マニー	0.7	0.6	1,920
ニコン	9.7	8.1	16,564
トプコン	1.8	2.4	5,457
オリンパス	7.7	7.4	30,229
理研計器	0.4	0.4	978
タムロン	0.5	0.4	910
HOYA	11.5	9.6	61,267
シード	—	0.1	375
ノーリツ鋼機	0.5	0.5	764
ユー・アンド・デイ	0.6	0.4	209
シチズン時計	6.3	5.2	4,290
リズム時計工業	3	0.2	471
大研医器	0.4	0.4	312
メニコン	0.4	0.3	1,551
松風	0.3	0.2	269
セイコーホールディングス	3	0.6	1,514

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニプロ	3.8	3.3	5,454
その他製品 (2.2%)			
スノーピーク	0.1	0.1	301
パラマウントベッドホールディングス	0.5	0.5	2,492
SHO-BI	0.1	0.2	88
ニホンフラッシュ	0.2	0.2	342
前田工織	0.5	0.5	933
永大産業	1	1	558
アートネイチャー	0.4	0.5	353
ダンロップスポーツ	0.3	0.3	505
バンダイナムコホールディングス	5.3	5.1	20,349
アイフィスジャパン	0.1	0.1	56
共立印刷	0.9	0.7	247
SHOEI	0.2	0.2	676
フランスベッドホールディングス	0.7	0.6	631
パイロットコーポレーション	0.9	0.8	4,456
萩原工業	0.1	0.1	391
トッパン・フォームズ	0.9	0.8	1,007
フジシールインターナショナル	0.6	1.1	3,894
タカラトミー	1.7	1.8	3,178
廣済堂	0.7	0.4	196
As-me エステール	0.1	—	—
タカノ	0.3	0.2	249
プロネクス	0.5	0.4	545
ホクシン	0.4	0.4	87
ウッドワン	1	0.2	374
大建工業	0.4	0.3	879
凸版印刷	15	13	15,041
大日本印刷	15	6.6	17,767
図書印刷	1	0.3	328
共同印刷	2	0.1	372
NISSHA	0.9	0.9	3,127
光村印刷	1	0.1	249
宝印刷	0.4	0.2	348
アシックス	5.2	4.6	8,197
ツツミ	0.3	0.2	401
小松ウオール工業	0.2	0.1	207
ヤマハ	3.8	3.1	13,748

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
河合楽器製作所	0.2	0.2	475
クリナップ	0.7	0.5	436
ビジョン	2.9	2.8	11,004
兼松サステック	1	0.1	229
キングジム	0.5	0.4	411
リンテック	1.2	1.1	3,283
TASAKI	0.1	—	—
イトーキ	1.1	1	939
任天堂	3.2	2.9	126,759
三菱鉛筆	0.4	0.8	2,259
タカラスタンダード	1	1	1,955
コクヨ	2.7	2.3	4,503
ナカバヤシ	2	0.5	347
グローブライト	—	0.2	394
岡村製作所	1.8	1.6	2,038
美津濃	3	0.5	1,612
アデランス	0.9	—	—
電気・ガス業 (1.7%)			
東京電力ホールディングス	43.9	39.6	18,453
中部電力	15.8	15.3	21,955
関西電力	21.1	19	29,488
中国電力	7.1	6.5	8,235
北陸電力	5.1	4.7	4,577
東北電力	12.9	11.7	17,748
四国電力	4.7	4.2	5,817
九州電力	11.4	10.3	13,132
北海道電力	4.9	4.5	3,712
沖縄電力	0.8	0.7	1,775
電源開発	4.4	3.7	10,667
エフオン	0.2	0.2	286
イーレックス	0.2	0.6	655
東京瓦斯	55	10	29,085
大阪瓦斯	54	9.1	20,202
東邦瓦斯	13	2.3	7,670
北海道瓦斯	1	1	294
広島ガス	0.9	1	361
西部瓦斯	6	0.5	1,480
静岡ガス	1.5	1.3	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
メタウォーター	0.3	0.3	910
陸運業 (4.0%)			
SBSホールディングス	0.5	0.4	350
東武鉄道	28	5	16,425
相鉄ホールディングス	9	1.5	4,329
東京急行電鉄	30	12.6	21,621
京浜急行電鉄	14	6.4	14,937
小田急電鉄	8.3	7.5	16,522
京王電鉄	15	2.6	12,740
京成電鉄	3.9	3.5	11,812
富士急行	1	0.5	1,240
新京成電鉄	1	0.2	425
東日本旅客鉄道	9.4	9	98,370
西日本旅客鉄道	5	4.5	36,409
東海旅客鉄道	4.6	3.9	81,276
西武ホールディングス	5.5	6.5	12,967
鴻池運輸	0.7	0.7	1,173
西日本鉄道	7	1.1	3,180
ハマキョウレックス	0.4	0.3	991
サカイ引越センター	0.2	0.2	1,294
近鉄グループホールディングス	52	4.7	20,609
阪急阪神ホールディングス	6.9	5.9	26,255
南海電気鉄道	12	2	5,842
京阪ホールディングス	12	2.1	7,276
神戸電鉄	1	0.1	382
名古屋鉄道	19	3.4	8,663
山陽電気鉄道	2	0.4	1,155
日本通運	20	1.7	12,444
ヤマトホールディングス	9.2	8.4	18,979
山九	7	1.2	5,598
丸運	0.3	0.3	95
丸全昭和運輸	2	2	1,066
センコーグループホールディングス	2.3	2.2	1,784
トナミホールディングス	1	0.1	540
ニッコンホールディングス	1.6	1.6	4,579
日本石油輸送	0.1	—	—
福山通運	3	0.6	2,208
セイノーホールディングス	3.7	3.4	5,535

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
神奈川中央交通	1	—	—
日立物流	1.1	1	2,822
丸和運輸機関	0.1	0.2	446
C&Fロジホールディングス	0.4	0.5	752
九州旅客鉄道	—	4.6	16,629
海運業 (0.2%)			
日本郵船	47	4	9,232
商船三井	25	2.4	8,028
川崎汽船	23	1.8	5,418
NSユナイテッド海運	2	0.2	482
明治海運	0.6	0.5	246
飯野海運	2.7	2.5	1,320
共栄タンカー	1	0.1	219
乾汽船	0.3	0.4	333
空運業 (0.6%)			
日本航空	9.9	8.2	31,537
ANAホールディングス	96	8.7	37,975
バスコ	1	1	349
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	0.2	0.1	610
日新	2	0.4	1,208
三菱倉庫	4	1.5	4,369
三井倉庫ホールディングス	3	3	1,041
住友倉庫	4	3	2,358
澁澤倉庫	1	0.2	419
東陽倉庫	1.1	1	324
日本トランスシティ	1	1	498
ケイヒン	1	0.2	331
中央倉庫	0.2	0.4	490
安田倉庫	0.4	0.4	373
東洋埠頭	2	0.2	380
宇徳	0.3	0.5	256
上組	6	2.8	7,176
サンリツ	0.2	—	—
キューソー流通システム	0.2	0.2	614
郵船ロジスティクス	0.5	0.4	414
近鉄エクスプレス	0.9	0.8	1,527
エーアイティー	0.2	0.3	374

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
内外トランスライン	0.1	0.2	345
日本コンセプト	—	0.1	125
情報・通信業 (7.8%)			
NECネットエスアイ	0.6	0.5	1,307
システナ	0.5	0.4	1,084
デジタルアーツ	0.3	0.2	962
新日鉄住金ソリューションズ	0.8	0.7	1,792
キューブシステム	0.2	0.3	243
コア	0.3	0.2	369
ソフトクリエイトホールディングス	0.1	0.2	314
T I S	1.7	1.5	4,980
ネオス	—	0.1	45
電算システム	0.1	0.2	427
グリー	3.1	2.8	2,192
コーエーテックモホールディングス	1.2	1.1	2,484
三菱総合研究所	0.2	0.2	657
AGS	0.1	0.2	415
ファインデックス	0.4	0.4	318
ヒト・コミュニケーションズ	0.2	0.1	194
ブレインパッド	0.1	0.2	251
KL a b	1	0.9	1,627
ポルトゥウィン・ビッドクルーHD	0.3	0.4	670
イーブックイニシアティブジャパン	0.1	0.1	109
ネクソン	5.6	5.1	14,968
アイスタイル	0.7	1	745
エイチーム	0.2	0.3	852
テクノスジャパン	—	0.4	431
コロブラ	1.4	1.5	1,804
モバイルクリエイト	0.2	0.5	186
オルトプラス	—	0.3	268
ブロードリーフ	0.6	1.1	998
ハーツユナイテッドグループ	0.2	0.3	479
メディアドゥホールディングス	0.1	0.1	256
ブイキューブ	0.3	0.4	262
サイバーリンクス	0.1	0.1	144
ディー・エル・イー	0.1	0.4	174
フィックスターズ	—	0.1	404
VOYAGE GROUP	0.2	0.2	290

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セレス	—	0.2	256
ティーガイア	0.5	0.5	1,082
日本アジアグループ	0.5	0.6	266
豆蔵ホールディングス	0.3	0.3	367
テクマトリックス	0.2	0.3	485
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	11.7	12.5	3,812
GMOペイメントゲートウェイ	0.4	0.3	2,409
ザッパラス	0.4	0.4	178
インターネットイニシアティブ	0.8	0.7	1,600
さくらインターネット	0.3	0.4	352
GMOクラウド	0.1	0.1	305
SRAホールディングス	0.3	0.2	623
フリービット	0.3	0.3	276
コムチュア	—	0.2	417
サイバーコム	0.1	0.2	203
メディカル・データ・ビジョン	—	0.2	428
gumi	0.5	0.5	560
ショーケース・ティービー	—	0.2	350
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	0.1	194
LINE	0.8	1.3	5,434
オークネット	—	0.2	284
AOI TYO Holdings	—	0.4	465
マクロミル	—	0.6	1,878
フェイス	0.2	0.3	375
ハイマックス	0.1	0.1	162
野村総合研究所	3.5	3.4	14,841
サイバネットシステム	0.7	0.5	375
CEホールディングス	0.1	0.2	124
インタージホールディングス	0.3	0.5	698
東邦システムサイエンス	0.1	0.3	249
ティー・ワイ・オー	0.5	—	—
クレスコ	0.2	0.1	420
フジ・メディア・ホールディングス	5.3	4.8	7,896
オービック	1.8	1.6	11,552
ジャストシステム	0.9	0.7	1,673
TDCソフト	0.4	0.3	340
ヤフー	36.6	33.1	17,840
トレンドマイクロ	2.7	2.2	13,068

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本オラクル	0.8	0.7	6,566
アルファシステムズ	0.2	0.2	491
フューチャー	0.7	0.6	598
CAC Holdings	0.4	0.4	446
ソフトバンク・テクノロジー	0.2	0.2	366
トーセ	0.2	0.1	255
オービックビジネスコンサルタント	0.3	0.2	1,160
伊藤忠テクノソリューションズ	1.1	1.1	4,708
アイティフォー	0.8	0.6	389
東計電算	0.1	0.1	333
エクسسネット	0.1	—	—
大塚商会	1.4	1.4	10,332
サイボウズ	1.2	0.6	308
ソフトブレーン	0.7	0.4	173
電通国際情報サービス	0.3	0.3	840
デジタルガレージ	0.8	0.9	2,188
EMシステムズ	0.2	0.2	419
ウェザーニューズ	0.2	0.2	722
C I J	0.8	0.4	310
日本エンタープライズ	0.3	0.8	207
WOWOW	0.2	0.2	735
スカラ	0.2	0.3	236
日本コロムビア	0.3	—	—
イマジカ・ロボット ホールディングス	0.3	0.4	384
ネットワンシステムズ	2.2	2	2,796
アルゴグラフィックス	0.2	0.2	704
マーベラス	0.8	0.8	750
エイベックス・グループ・ホールディングス	0.9	0.9	1,422
日本ユニシス	1.4	1.3	2,389
兼松エレクトロニクス	0.3	0.3	1,003
東京放送ホールディングス	3	3.1	6,962
日本テレビホールディングス	4.7	4.2	8,576
朝日放送	0.5	0.5	451
テレビ朝日ホールディングス	1.4	1.3	2,897
スカパーJ S A Tホールディングス	3.9	3	1,581
テレビ東京ホールディングス	0.5	0.4	942
日本BS放送	0.1	0.2	245
ビジョン	—	0.1	261

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ワイヤレスゲート	0.2	0.2	254
コネクシオ	0.5	0.3	605
日本通信	3.8	4	556
日本電信電話	39.5	37	195,064
KDD I	50.5	45	137,700
光通信	0.6	0.6	8,802
NTTドコモ	38.2	33.9	90,614
エムティーアイ	0.7	0.6	410
GMOインターネット	1.9	1.7	2,757
アイドママーケティングコミュニケーション	—	0.2	140
カドカワ	1.6	1.3	1,708
学研ホールディングス	2	0.2	667
ゼンリン	0.7	0.6	2,112
昭文社	0.4	0.3	220
インプレスホールディングス	0.7	0.8	124
アイネット	0.4	0.3	546
松竹	3	0.3	5,151
東宝	3.6	3	11,415
東映	2	0.2	2,544
AOI Pro.	0.3	—	—
エヌ・ティ・ティ・データ	3.1	14.2	18,318
ビー・シー・エー	0.1	0.1	169
ビジネスブレイン太田昭和	0.1	0.2	313
DTS	0.6	0.5	1,582
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2.2	1.8	7,857
シーイーシー	0.4	0.3	756
カブコン	1.3	1.1	3,051
ジャステック	0.5	0.3	403
S C S K	1.2	1.3	6,331
日本システムウェア	0.4	0.1	226
アイネス	0.6	0.6	679
TKC	0.5	0.4	1,382
富士ソフト	0.8	0.6	1,968
NSD	1.1	0.9	1,823
コナミホールディングス	2.3	2.1	11,151
福井コンピュータホールディングス	0.2	0.1	284
JBC Cホールディングス	0.5	0.4	415
ミロク情報サービス	0.4	0.5	1,267

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソフトバンクグループ	28.9	20.8	209,976
卸売業 (4.5%)			
ハウスイ	1	—	—
高千穂交易	0.2	0.2	226
伊藤忠食品	0.1	0.1	506
エレマテック	0.2	0.2	485
J A L U X	0.2	0.1	259
あらた	0.2	0.2	983
トーメンデバイス	0.1	0.1	305
東京エレクトロン デバイス	0.1	0.2	423
フィールズ	0.4	0.4	438
双日	32.1	27.3	8,899
アルフレッサ ホールディングス	6.4	5.4	11,928
横浜冷凍	1.3	1.1	1,201
神栄	1	0.1	168
ラサ商事	0.3	0.3	335
ラクーン	—	0.3	181
アルコニックス	0.3	0.5	913
神戸物産	0.3	0.3	1,545
ベッパーフードサービス	—	0.2	1,148
あい ホールディングス	0.9	0.6	1,603
ディーブイエックス	0.2	0.2	284
ダイワボウホールディングス	5	0.4	1,856
マクニカ・富士エレホールディングス	0.9	0.9	1,962
バイタルケーエスケー・ホールディングス	0.9	0.9	847
八洲電機	0.4	0.3	285
メディアスホールディングス	—	0.1	278
UKCホールディングス	0.3	0.3	566
大光	—	0.2	206
OCHIホールディングス	0.1	0.2	288
TOKAIホールディングス	2.2	2	1,780
三洋貿易	0.3	0.2	570
ウイン・パートナーズ	—	0.3	420
ミタチ産業	0.1	0.2	335
シップヘルスケアホールディングス	1	0.9	3,199
明治電機工業	0.2	0.2	354
デリカフーズホールディングス	0.1	0.1	153
コメダホールディングス	0.7	0.8	1,530

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
富士興産	0.2	0.3	181
協栄産業	1	0.1	235
小野建	0.4	0.4	769
佐島電機	0.4	0.3	306
エコートレーディング	0.1	0.2	140
伯東	0.4	0.3	511
コンドーテック	0.2	0.4	476
中山福	0.4	0.3	235
ナガイレーベン	0.7	0.6	1,702
三菱食品	0.6	0.5	1,685
松田産業	0.4	0.3	486
第一興商	0.9	0.8	4,256
メディバルホールディングス	5.1	4.6	9,945
SPK	0.1	0.1	327
萩原電気	0.1	0.2	674
アズワン	0.4	0.4	2,404
尾家産業	0.2	0.2	254
シモジマ	0.4	0.3	362
ドウシシャ	0.6	0.5	1,248
小津産業	0.1	0.1	219
高速	0.4	0.3	368
たけびし	0.2	0.2	310
黒田電気	1	0.6	1,203
リックス	0.1	0.1	181
丸文	0.5	0.4	387
ハビネット	0.5	0.4	768
日本ライフライン	0.2	0.5	2,695
エクセル	0.3	0.2	503
マルカキカイ	0.2	0.2	436
IDOM	1.4	1.3	1,034
日本エム・ディ・エム	0.8	0.3	311
進和	0.3	0.3	718
エスケイジャパン	0.2	0.3	105
ダイトロン	0.3	0.2	399
シークス	0.4	0.3	1,419
田中商事	0.2	0.2	154
オーハシテクニカ	0.3	0.3	502
白銅	0.3	0.1	220

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
伊藤忠商事	40.1	33.7	64,569
丸紅	50.1	45.4	34,245
高島	1	0.1	222
長瀬産業	3	2.8	5,401
蝶理	0.3	0.3	630
豊田通商	5.7	5.1	20,374
三共生興	1.1	0.7	329
兼松	11	2	2,930
ツカモトコーポレーション	1	0.1	126
三井物産	46.2	41.6	69,326
日本紙パルプ商事	3	0.2	930
日立ハイテクノロジーズ	1.8	1.6	7,216
カメイ	0.7	0.6	1,109
東都水産	0.1	—	—
OUGホールディングス	1	0.1	271
スターゼン	0.2	0.2	1,048
山善	2	1.8	2,237
椿本興業	1	0.2	582
住友商事	32.2	29	46,864
内田洋行	1	0.2	706
三菱商事	38.2	34.6	90,219
第一実業	1	0.2	645
キャノンマーケティングジャパン	1.4	1.3	3,734
西華産業	2	0.2	576
佐藤商事	0.5	0.4	484
菱洋エレクトロ	0.6	0.4	832
東京産業	0.6	0.4	210
ユアサ商事	0.5	0.4	1,650
神鋼商事	0.2	0.1	290
小林産業	0.2	0.5	202
阪和興業	5	0.9	3,730
正栄食品工業	—	0.3	1,417
カナデン	—	0.4	511
菱電商事	1	0.4	696
フルサト工業	0.3	0.3	551
岩谷産業	6	1	3,490
すてきなイスグループ	2	0.2	315
昭光通商	2	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
ニチモウ	1	0.1	202
極東貿易	1	1	367
イワキ	1	1	460
三愛石油	1.1	1.3	1,709
稲畑産業	1.2	1.1	1,743
G S Iクレオス	2	0.1	167
明和産業	0.5	0.4	202
ワキタ	1	1	1,334
東邦ホールディングス	1.6	1.5	3,283
サンゲツ	1.7	1.6	3,328
ミツウロコグループホールディングス	0.8	0.7	577
シナネンホールディングス	0.2	0.2	507
伊藤忠エネクス	1.3	1	1,196
サンリオ	1.6	1.4	2,650
サンワテクノス	0.4	0.3	651
リョーサン	0.8	0.6	2,751
新光商事	0.6	0.5	1,010
トーホー	0.2	0.2	557
三信電気	0.7	0.5	866
東陽テクニカ	0.7	0.5	538
モスフードサービス	0.7	0.6	2,046
加賀電子	0.5	0.4	1,392
ソーダニッカ	0.6	0.6	347
立花エレテック	0.4	0.3	564
フォーバル	0.2	0.3	218
P A L T A C	0.8	0.7	3,230
三谷産業	0.5	0.5	217
太平洋興発	2	0.2	202
ヤマタネ	0.3	0.2	385
日鉄住金物産	0.5	0.4	2,388
トラスコ中山	0.6	1	2,875
オートバックスセブン	1.9	1.7	3,328
モリト	—	0.4	428
加藤産業	0.8	0.7	2,415
イノテック	0.4	0.4	386
イエローハット	0.5	0.4	1,386
J Kホールディングス	0.6	0.5	440
日伝	0.2	0.4	954

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北沢産業	0.6	0.5	111
杉本商事	0.3	0.3	512
因幡電機産業	0.7	0.6	2,871
パイテックホールディングス	0.1	0.2	366
ミスミグループ本社	5.7	5.3	15,709
アルテック	0.4	0.5	148
タキヒヨー	1	0.1	239
蔵王産業	0.1	0.1	166
スズケン	2.3	2.1	8,641
ジェコス	0.4	0.3	370
小売業 (4.6%)			
ローソン	1.9	1.5	11,280
サンエー	0.3	0.3	1,545
カワチ薬品	0.4	0.4	1,088
エービーシー・マート	0.7	0.8	4,568
ハードオフコーポレーション	0.3	0.2	229
アスクル	0.6	0.5	1,550
ゲオホールディングス	0.9	0.8	1,313
アダストリア	0.9	0.7	1,775
ジーフット	0.3	0.3	225
くらコーポレーション	0.3	0.3	1,578
キャンドウ	0.3	0.2	350
バルグループホールディングス	0.3	0.2	620
エディオン	2.2	1.8	1,956
サーラコーポレーション	0.5	0.8	605
ワッツ	0.2	0.2	230
ハローズ	0.2	0.2	512
あみやき亭	0.1	0.1	517
ひらまつ	0.7	0.7	431
ゲンキー	—	0.2	777
大黒天物産	0.1	0.1	523
ハニーズホールディングス	0.4	0.4	476
ファーマライズホールディングス	0.1	0.2	126
アルペン	0.4	0.4	902
クオール	0.5	0.5	982
ジンズ	0.3	0.3	1,782
ビックカメラ	2.9	2.7	3,852
D C Mホールディングス	2.6	2.8	2,886

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
Monotaro	1.8	1.7	5,423
DDホールディングス	0.1	0.1	391
きちり	0.1	0.2	144
アークランドサービスホールディングス	0.2	0.4	909
J. フロント リテイリング	6.4	5.8	9,993
ドトール・日レスホールディングス	0.9	0.8	2,146
マツモトキヨシホールディングス	1.1	0.9	7,416
ブロンコビリー	0.3	0.2	578
スタートトゥデイ	4.6	4.1	14,452
物語コーポレーション	0.1	0.1	763
ココカラファイン	0.5	0.5	3,200
三越伊勢丹ホールディングス	10.1	9.2	11,748
Hamee	—	0.2	333
ウエルシアホールディングス	0.4	1.2	5,112
クリエイトSDホールディングス	0.8	0.7	1,950
丸善CHIホールディングス	0.3	0.6	208
チムニー	0.2	0.1	284
シュッピン	0.2	0.2	555
ジョイフル本田	0.8	0.7	2,103
鳥貴族	0.1	0.2	611
キリン堂ホールディングス	0.3	0.2	295
ホットランド	0.2	0.3	450
すかいらく	2.2	2.8	4,746
綿半ホールディングス	0.1	0.2	486
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1.7	1.6	1,732
ブックオフコーポレーション	0.3	0.3	244
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.2	0.3	295
あさひ	0.3	0.3	416
日本調剤	0.1	0.2	721
コスモス薬品	0.3	0.2	4,756
トーエル	0.3	0.3	288
オンリー	0.1	0.1	90
セブン&アイ・ホールディングス	21.3	19.3	89,667
薬王堂	0.1	0.2	652
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1.4	1.2	1,417
ツルハホールディングス	1.2	0.9	12,573
サンマルクホールディングス	0.4	0.3	1,015
フェリシモ	0.2	0.2	264

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トリドールホールディングス	0.6	0.6	2,109
クスリのアオキ	0.5	—	—
TOKYO BASE	—	0.1	433
サツドラホールディングス	0.1	0.1	201
ダイユー・リックホールディングス	0.1	0.2	206
パロックジャパンリミテッド	—	0.4	384
クスリのアオキホールディングス	—	0.4	2,500
スシローグローバルホールディングス	—	0.4	1,428
LIXILピバ	—	0.4	727
メディカルシステムネットワーク	0.2	0.6	333
総合メディカル	0.3	0.2	1,006
はるやまホールディングス	0.4	0.3	300
ノジマ	0.6	0.7	1,733
カッパ・クリエイト	0.7	0.6	760
ライトオン	0.4	0.4	381
ジーンズメイト	0.2	0.2	152
良品計画	0.6	0.6	19,860
三城ホールディングス	0.7	0.6	283
アドヴァン	0.5	0.5	522
アルビス	0.1	0.1	420
コナカ	0.7	0.6	364
ハウス オブ ローゼ	0.1	0.1	157
G-7ホールディングス	0.2	0.1	233
イオン北海道	0.7	0.5	322
コジマ	0.8	0.8	300
ヒマラヤ	0.2	0.2	196
コーナン商事	0.7	0.7	1,637
エコス	0.2	0.2	254
ワタミ	0.5	0.5	723
ドンキホーテホールディングス	3.3	3	14,100
西松屋チェーン	1	0.8	990
ゼンショーホールディングス	2.6	2.4	4,996
幸楽苑ホールディングス	0.3	0.3	526
ハークスレイ	0.2	0.2	234
サイゼリヤ	0.8	0.7	2,453
VTホールディングス	1.7	1.6	1,038
魚力	0.2	0.2	237
ポプラ	0.2	0.2	123

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フジ・コーポレーション	—	0.1	211
ユナイテッドアローズ	0.7	0.6	2,469
ハイデイ日高	0.4	0.5	1,607
京都きもの友禅	0.4	0.3	251
コロワイド	1.7	1.5	3,175
ピーシーデポコーポレーション	0.7	0.6	502
老番屋	0.5	0.3	1,314
トップカルチャー	0.3	0.3	162
P L A N T	0.1	0.2	251
スギホールディングス	0.9	1	5,870
ヴィア・ホールディングス	—	0.3	247
スクロール	0.9	0.7	274
ヨンドシーホールディングス	0.4	0.5	1,535
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2.2	2	12,780
木曾路	0.6	0.6	1,603
S R Sホールディングス	0.6	0.6	560
千趣会	0.9	0.8	560
タカキュー	0.5	0.5	105
ケーヨー	1	0.8	620
上新電機	1	0.5	1,947
日本瓦斯	0.8	0.8	2,968
ベスト電器	1.9	—	—
ロイヤルホールディングス	0.9	0.8	2,357
東天紅	1	0.1	234
いなげや	0.5	0.5	926
島忠	1.3	1.2	3,822
チヨダ	0.6	0.6	1,735
ライフコーポレーション	0.3	0.3	904
リンガーハット	0.5	0.5	1,218
さが美	1	—	—
M r M a x H D	0.6	0.6	414
テンアライド	0.4	0.5	214
A O K Iホールディングス	1.2	0.9	1,381
オークワ	1	1	1,114
コメリ	0.8	0.7	2,366
青山商事	1	1	4,145
しまむら	0.6	0.5	6,400
はせがわ	0.2	0.3	151

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高島屋	8	8	8,528
松屋	1	1	1,188
エイチ・ツー・オー リテイリング	2.6	2.4	5,145
近鉄百貨店	2	0.2	742
丸栄	1	—	—
パルコ	0.5	0.4	601
丸井グループ	6.3	4.9	8,418
アクシアル リテイリング	0.4	0.4	1,852
イオン	21.1	18.9	32,753
イズミ	1	0.8	4,792
東武ストア	0.1	—	—
平和堂	1	1	2,493
フジ	0.6	0.5	1,542
ヤオコー	0.6	0.5	2,755
ゼビオホールディングス	0.7	0.6	1,336
ケーズホールディングス	2.2	2	5,178
O l y m p i c グループ	0.4	0.3	179
日産東京販売ホールディングス	0.8	0.7	282
アインホールディングス	0.6	0.6	4,440
元気寿司	0.2	0.1	274
ヤマダ電機	15.5	15.8	9,685
アークランドサカモト	0.9	0.8	1,440
ニトリホールディングス	2.2	2	33,580
愛眼	0.5	0.5	144
ケーユーホールディングス	0.2	0.3	309
吉野家ホールディングス	1.8	1.6	3,017
松屋フーズ	0.2	0.2	851
サガミチェーン	0.7	0.6	838
関西スーパーマーケット	0.3	0.4	560
王将フードサービス	0.4	0.4	1,822
プレナス	0.6	0.5	1,158
ミニストップ	0.4	0.3	680
アークス	1	0.9	2,283
パローホールディングス	1.1	1	2,588
ベルク	0.2	0.2	1,282
大庄	0.3	0.2	351
ファーストリテイリング	0.9	0.8	29,560
サンドラッグ	1.1	1.8	8,739

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サクスパー ホールディングス	0.5	0.4	553
ヤマザワ	0.2	0.1	172
やまや	0.1	0.1	204
ペルーナ	1.3	1	1,290
銀行業 (7.5%)			
島根銀行	0.1	0.2	267
じもとホールディングス	3.8	3.4	724
めぶきフィナンシャルグループ	25.3	22.1	10,077
東京TYフィナンシャルグループ	0.7	0.7	2,138
九州フィナンシャルグループ	7.7	7.7	5,382
ゆうちょ銀行	13.1	13.1	18,457
富山第一銀行	1.3	1.2	670
コンコルディア・フィナンシャルグループ	35.5	29.9	17,572
西日本フィナンシャルホールディングス	3.3	3.2	4,108
新生銀行	44	4.4	8,012
あおぞら銀行	32	2.9	12,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	409.5	345.9	255,793
りそなホールディングス	59.6	53.9	31,677
三井住友トラスト・ホールディングス	10.7	9.6	41,030
三井住友フィナンシャルグループ	40.9	36.9	163,171
第四銀行	6	0.6	3,240
北越銀行	0.6	0.5	1,292
千葉銀行	20	18	14,868
群馬銀行	11	10	7,150
武蔵野銀行	0.8	0.7	2,499
千葉興業銀行	1.4	1.3	794
筑波銀行	1.8	1.9	733
七十七銀行	8	1.4	3,957
青森銀行	4	0.4	1,450
秋田銀行	3	0.3	1,032
山形銀行	3	0.5	1,297
岩手銀行	0.4	0.3	1,410
東邦銀行	5	4.1	1,750
東北銀行	3	0.2	302
みちのく銀行	3	0.3	581
ふくおかフィナンシャルグループ	22	19	10,450
静岡銀行	15	12	12,756
十六銀行	6	0.6	2,346

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スルガ銀行	4.8	4.7	11,618
八十二銀行	9.1	8.9	6,203
山梨中央銀行	3	3	1,413
大垣共立銀行	7	0.7	2,243
福井銀行	4	0.4	1,164
北國銀行	5	0.5	2,440
清水銀行	0.2	0.2	739
富山銀行	0.1	0.1	436
滋賀銀行	5	4	2,512
南都銀行	0.5	0.5	1,577
百五銀行	5	4	2,040
京都銀行	10	1.6	9,440
紀陽銀行	2	1.7	3,233
三重銀行	0.2	0.2	538
ほくほくフィナンシャルグループ	3.4	3.1	5,657
広島銀行	15	6.8	6,317
山陰合同銀行	3.1	2.7	2,705
中国銀行	3.6	3.2	5,104
鳥取銀行	0.2	0.2	358
伊予銀行	5.4	6.6	6,124
百十四銀行	6	5	1,990
四国銀行	4	0.7	1,233
阿波銀行	4	4	2,872
大分銀行	3	0.3	1,332
宮崎銀行	3	0.3	1,150
佐賀銀行	3	0.3	816
十八銀行	3	3	870
沖縄銀行	0.4	0.4	1,790
琉球銀行	1.1	1	1,680
セブン銀行	19.2	17.3	7,179
みずほフィナンシャルグループ	733.6	626	125,387
高知銀行	2	0.2	260
山口フィナンシャルグループ	5	4	5,372
長野銀行	0.2	0.1	198
名古屋銀行	0.4	0.4	1,750
北洋銀行	7.6	7.6	2,713
愛知銀行	0.2	0.2	1,394
第三銀行	0.3	0.3	566

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
中京銀行	0.2	0.2	466
大光銀行	2	0.2	511
愛媛銀行	0.6	0.6	849
トマト銀行	0.2	0.2	313
みなと銀行	0.5	0.4	845
京葉銀行	4	4	2,180
関西アーバン銀行	0.7	0.7	1,015
栃木銀行	2.8	2.5	1,255
北日本銀行	0.2	0.1	337
東和銀行	9	0.8	908
福島銀行	6	0.5	454
大東銀行	3	0.2	333
トモニホールディングス	3.9	3.8	2,010
フィデアホールディングス	3.7	4.5	927
池田泉州ホールディングス	5.5	4.8	2,102
証券、商品先物取引業 (1.1%)			
F P G	1.9	1.6	1,966
S B I ホールディングス	6.1	5.2	9,172
ジャフコ	0.8	0.8	4,488
大和証券グループ本社	48	42	28,173
野村ホールディングス	98.3	94.2	62,237
岡三証券グループ	4	4	2,820
丸三証券	1.5	1.4	1,404
東洋証券	2	2	618
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	5.8	5.3	3,800
光世証券	1	0.1	169
水戸証券	1.5	1.4	551
いちよし証券	1.1	1	1,264
松井証券	2.5	2.7	2,470
だいこう証券ビジネス	0.4	0.2	149
マネックスグループ	6	5	1,585
カブドットコム証券	4.4	3.5	1,253
極東証券	0.7	0.6	1,000
岩井コスモホールディングス	0.5	0.4	590
藍澤証券	0.9	0.9	722
マネースクウェアHD	0.1	—	—
マネーパートナーズグループ	0.4	0.5	237
小林洋行	0.2	0.3	85

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
保険業 (2.4%)			
かんぽ生命保険	2.1	1.7	4,120
S O M P Oホールディングス	11.3	9.6	42,432
アニコム ホールディングス	0.3	0.3	897
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	15.3	12.9	48,916
ソニーフィナンシャルホールディングス	4.9	4.4	8,364
第一生命ホールディングス	32.7	27.8	59,644
東京海上ホールディングス	20.6	18.6	89,168
T & Dホールディングス	18.6	16.1	27,925
アドバンスクリエイト	0.1	0.2	381
その他金融業 (1.3%)			
全国保証	1.3	1.3	5,934
クレディセゾン	3.9	3.5	8,113
芙蓉総合リース	0.6	0.5	3,680
興銀リース	1	0.9	2,631
東京センチュリー	1.2	0.9	4,581
日本証券金融	2.3	2.1	1,304
アイフル	8.5	7.7	3,041
ポケットカード	0.6	0.4	428
リコーリース	0.4	0.4	1,664
イオンフィナンシャルサービス	3.4	2.9	7,151
アコム	10.3	9.3	4,361
ジャックス	3	0.5	1,411
オリエントコーポレーション	22	10	1,850
日立キャピタル	1.2	1.1	3,019
アプラスフィナンシャル	2.7	2.2	244
オリックス	36.2	32.6	62,869
三菱UFJリース	13	11.7	7,172
日本取引所グループ	15	14.3	30,187
イー・ギャランティ	0.2	0.1	313
アサックス	0.1	0.1	175
NECキャピタルソリューション	0.2	0.2	450
不動産業 (2.3%)			
いちご	5.7	4.3	1,651
日本駐車場開発	5.6	5.6	929
ヒューリック	10.6	9.6	11,088
三栄建築設計	0.1	0.2	510
スター・マイカ	—	0.2	312

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
野村不動産ホールディングス	3.4	3.1	7,477
三重交通グループホールディングス	0.9	0.9	424
サムティ	0.4	0.4	599
ディア・ライフ	0.3	0.5	218
エー・ディー・ワークス	3.4	9.2	386
日本商業開発	0.2	0.3	499
プレサンスコーポレーション	0.7	0.7	1,045
ユニゾホールディングス	0.3	0.5	1,364
THEグローバル社	0.2	0.3	243
日本管理センター	0.4	0.3	459
フージャースホールディングス	0.8	0.6	627
オープンハウス	0.7	0.7	2,838
東急不動産ホールディングス	12.4	11.2	8,064
飯田グループホールディングス	4.7	3.8	7,934
ムゲンエステート	0.2	0.4	446
ハウスドゥ	—	0.1	185
ケイアイスター不動産	—	0.2	432
パーク24	2.6	2.6	6,957
バラカ	—	0.2	487
三井不動産	27	24.4	63,757
三菱地所	38	34.2	69,477
平和不動産	1	0.9	1,766
東京建物	5.9	5	7,635
ダイビル	1.3	1.2	1,555
京阪神ビルディング	0.9	0.8	619
住友不動産	12	11	39,952
大京	10	0.8	1,795
テーオーシー	2	1.8	1,792
東京楽天地	1	0.1	583
レオパレス21	6	5.8	4,663
スターツコーポレーション	0.6	0.6	1,773
フジ住宅	0.7	0.6	529
空港施設	0.7	0.6	376
明和地所	0.4	0.4	365
住友不動産販売	0.4	—	—
ゴールドクレスト	0.4	0.4	1,071
日本エスリード	0.3	0.2	424
日神不動産	0.8	0.6	456

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本エスコン	0.7	0.9	457
タカラレーベン	2.2	2	1,056
サンヨーハウジング名古屋	0.3	0.3	363
イオンモール	3.3	2.9	5,834
ファースト住建	0.1	0.2	365
トーセイ	0.7	0.6	656
穴吹興産	1	—	—
エヌ・ティ・ティ都市開発	3.1	2.9	3,384
サンフロンティア不動産	0.6	0.5	642
エフ・ジェー・ネクスト	0.2	0.5	474
インテリックス	—	0.3	302
ランドビジネス	0.4	0.5	158
グランディハウス	0.4	0.5	228
日本空港ビルデング	1.6	1.5	6,112
サービス業 (4.1%)			
日本工営	2	0.3	1,239
L I F U L L	1.5	1.2	1,081
ジェイエイシーリクルートメント	0.3	0.3	597
日本M&Aセンター	1.6	1.4	7,448
ノバレーゼ	0.1	—	—
メンバーズ	—	0.2	142
アコーディア・ゴルフ	1.5	—	—
タケエイ	0.5	0.4	464
トラスト・テック	0.2	0.2	637
コンダカホールディングス	—	0.2	890
パソナグループ	0.4	0.4	623
CDS	0.1	0.2	268
リンクアンドモチベーション	0.9	0.8	589
GCA	0.5	0.5	506
エス・エム・エス	0.7	0.7	2,457
パーソルホールディングス	3.8	3.8	10,267
リニカル	0.3	0.3	465
クックパッド	1.2	1.4	1,051
エスクリ	0.1	0.3	266
アイ・ケイ・ケイ	0.2	0.3	267
学情	0.4	0.2	280
スタジオアリス	0.2	0.2	522
シミックホールディングス	0.2	0.3	468

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
N J S	0.1	0.2	284
総合警備保障	1.8	1.8	9,720
カカココム	3.9	3.5	5,484
アイロムグループ	—	0.2	329
セントケア・ホールディング	—	0.1	266
ルネサンス	0.4	0.3	507
ディップ	0.6	0.6	1,632
オプトホールディング	0.4	0.3	357
新日本科学	0.5	0.6	316
ツクイ	1.2	1.2	927
キャリアデザインセンター	0.1	0.1	167
エムスリー	4.7	4.2	13,713
ツカダ・グローバルホールディング	0.2	0.3	173
アウトソーシング	0.3	1.3	1,959
ウェルネット	0.4	0.4	482
ワールドホールディングス	0.1	0.2	682
ディー・エヌ・エー	2.4	2.2	5,401
博報堂DYホールディングス	7.5	6.8	10,764
ぐるなび	0.6	0.7	1,206
エスアールジータカミヤ	0.4	0.5	334
ファンコムコミュニケーションズ	1.4	1.2	1,388
ライク	0.1	0.2	413
ビジネス・ブレイクスルー	—	0.4	220
WDBホールディングス	0.1	0.2	525
ティア	0.1	0.3	273
バリューコマース	0.4	0.4	338
インフォマート	1.2	2.3	1,906
J Pホールディングス	1.4	1.4	555
E P Sホールディングス	0.7	0.7	1,485
レッグス	0.1	0.2	168
プレステージ・インターナショナル	1	0.9	1,037
アミューズ	0.3	0.3	881
ドリームインキュベータ	0.2	0.2	445
クイック	—	0.3	567
T A C	0.3	0.5	146
ケネディクス	7.1	6.3	4,101
電通	6	5.4	27,270
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.2	0.3	256

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
びあ	0.2	0.1	559
イオンファンタジー	0.2	0.1	418
シーティーエス	0.1	0.5	381
ネクシィーズグループ	—	0.2	433
みらかホールディングス	1.4	1.3	6,812
アルプス技研	0.2	0.2	761
ダイオーズ	0.2	0.2	281
日本空調サービス	—	0.5	365
オリエンタルランド	5.8	5.3	48,436
ダスキン	1.4	1.2	3,792
明光ネットワークジャパン	0.6	0.6	812
ファルコホールディングス	0.3	0.2	351
秀英予備校	0.1	0.2	94
田谷	0.1	0.2	134
ラウンドワン	1.7	1.5	2,133
リゾートトラスト	2.3	1.9	4,212
ビー・エム・エル	0.6	0.6	1,513
ワタベウエディング	0.1	0.2	164
りらいあコミュニケーションズ	0.9	0.8	1,056
リソー教育	0.7	0.8	705
早稲田アカデミー	0.1	0.1	170
ユー・エス・エス	6.6	5.9	13,581
東京個別指導学院	0.6	0.2	198
サイバーエージェント	2.8	2.9	9,613
楽天	27.6	22.8	28,260
クリーク・アンド・リバー社	0.2	0.2	224
テー・オー・ダブリュー	0.4	0.4	350
セントラルスポーツ	0.2	0.2	795
フルキャストホールディングス	0.6	0.4	816
リソルホールディングス	1	0.1	402
テクノプロ・ホールディングス	0.9	0.8	4,032
アトラ	0.1	0.2	128
三機サービス	—	0.1	136
イー・ガーディアン	—	0.2	446
リブセンス	0.3	0.3	165
ジャパンマテリアル	0.2	0.4	1,146
ベクトル	0.3	0.4	602
キャリアリンク	0.2	0.2	115

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
I B J	0.4	0.4	340
アサンテ	0.1	0.2	398
N・フィールド	0.3	0.3	612
M&Aキャピタルパートナーズ	—	0.1	592
ER Iホールディングス	0.1	0.2	187
アピスト	0.1	0.1	423
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	0.1	292
日本ビューホテル	—	0.1	140
リクルートホールディングス	10.9	31.9	86,576
エラン	0.1	0.2	309
日本郵政	15.9	26	33,800
ベルシステム24ホールディングス	1	0.8	984
L I T A L I C O	—	0.1	160
エポラブルアジア	—	0.1	246
ソラスト	0.2	0.3	655
リログループ	0.2	2.5	6,650
東祥	0.2	0.2	592
エイチ・アイ・エス	0.9	0.7	2,635
ラックランド	0.1	0.1	213
共立メンテナンス	0.4	0.8	2,664
イチネンホールディングス	0.5	0.5	779
建設技術研究所	0.3	0.3	324
スペース	0.4	0.3	508
燦ホールディングス	0.1	—	—
東京テアトル	2	0.2	293
ナガワ	0.1	0.1	445
よみうりランド	1	0.1	470
東京都競馬	4	0.3	1,018
常磐興産	0.2	0.2	374
カナモト	0.8	0.7	2,677
東京ドーム	2	1.9	2,002
西尾レントオール	0.4	0.4	1,584

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
トランス・コスモス	0.6	0.6	1,527	
乃村工藝社	1.1	1.1	2,470	
藤田観光	2	0.2	711	
K N T - C Tホールディングス	3	0.3	582	
日本管財	0.4	0.4	811	
トーカイ	0.2	0.2	1,044	
白洋舎	0.1	0.1	346	
セコム	5.6	5.1	43,829	
セントラル警備保障	0.3	0.2	398	
丹青社	1	0.9	1,188	
メイテック	0.7	0.6	3,270	
アサツー ディ・ケイ	0.9	0.9	3,366	
応用地質	0.5	0.5	868	
船井総研ホールディングス	0.7	0.6	2,316	
進学会ホールディングス	0.4	0.3	196	
オオバ	0.3	0.4	206	
いであ	—	0.2	237	
ベネッセホールディングス	1.8	1.6	6,336	
イオンディライト	0.5	0.6	2,505	
ナック	0.4	0.3	290	
ニチイ学館	0.9	0.8	917	
ダイセキ	1	0.9	2,459	
ステップ	0.2	0.2	307	
合 計	株 数・金 額	7,955	5,747	11,867,642
	銘柄数<比率>	1,837	1,869	<97.4%>

(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	
			買建額	売建額
国内	株式先物取引	TOPIX先物	百万円 227	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2017年10月23日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 11,867,642	% 97.2
コール・ローン等、その他	345,463	2.8
投資信託財産総額	12,213,105	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 (2017年10月23日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,330,884,941
コール・ローン等	150,608,701
株式(評価額)	11,867,642,780
未収入金	107,122,330
未取配当金	92,631,830
差入委託証拠金	112,879,300
(B) 負債	147,971,256
未払解約金	30,191,762
未払利息	194
差入委託証拠金代用有価証券	117,779,300
(C) 純資産総額(A-B)	12,182,913,685
元本	7,125,486,826
次期繰越損益金	5,057,426,859
(D) 受益権総口数	7,125,486,826口
1千口当たり基準価額(C/D)	1,710円

(注) 当ファンドの期首元本額は8,161,799,628円、期中追加設定元本額は37,874,644円、期中一部解約元本額は1,074,187,446円です。

(注) 2017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 7,048,029,305円
 ・バランスポートフォリオ 77,457,521円

(注) 1口当たり純資産額は1,710円です。

(注) 2017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 105,250千円

○損益の状況 (2016年10月22日～2017年10月23日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	241,907,612
受取配当金	241,829,754
受取利息	1,166
その他収益金	144,847
支払利息	△ 68,155
(B) 有価証券売買損益	2,776,411,098
売買益	2,853,839,887
売買損	△ 77,428,789
(C) 先物取引等取引損益	54,364,840
取引益	57,318,660
取引損	△ 2,953,820
(D) 保管費用等	408
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,072,683,958
(F) 前期繰越損益金	2,536,624,967
(G) 追加信託差損益金	17,593,761
(H) 解約差損益金	△ 569,475,827
(I) 計(E+F+G+H)	5,057,426,859
次期繰越損益金(I)	5,057,426,859

(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処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2016年10月22日から2017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、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2に定める信用リスクを適正に管理する方法として、一般社団法人投資信託協会規則に従って委託会社が合理的な方法を定めるべく、2017年8月8日付けにて信託約款に所要の変更を行ないました。(付表)