

インデックスファンドTOPIX（日本株式） ＜愛称 DC TOPIX＞

運用報告書（全体版）

第20期（決算日 2021年2月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
「インデックスファンドTOPIX（日本株式）」は、2021年2月12日に第20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あげます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申しあげます。

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／株式／インデックス型	
信託期間	2001年10月31日から原則無期限です。	
運用方針	わが国の株式市場全体の動きをとらえることを目標に、東証株価指数に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要運用対象	インデックスファンドTOPIX（日本株式）	「インデックス マザーファンド TOPIX」受益証券を主要投資対象とします。
	インデックス マザーファンド TOPIX	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	インデックスファンドTOPIX（日本株式）	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。
	インデックス マザーファンド TOPIX	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。	

<358290>

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			東証株価指数		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税金 分配	み 騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
16期(2017年2月13日)	16,898	10	31.9	1,554.20	29.9	99.7	0.3	14,234
17期(2018年2月13日)	18,920	10	12.0	1,716.78	10.5	99.7	0.3	15,717
18期(2019年2月12日)	17,586	10	△7.0	1,572.60	△8.4	99.6	0.4	15,884
19期(2020年2月12日)	19,564	10	11.3	1,718.92	9.3	99.8	0.3	17,088
20期(2021年2月12日)	22,390	10	14.5	1,933.88	12.5	99.8	0.3	19,227

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(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。

○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		株式組入比率	株式先物比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首)	円	%		%	%	%
2020年2月12日	19,564	—	1,718.92	—	99.8	0.3
2月末	17,197	△12.1	1,510.87	△12.1	99.7	0.3
3月末	16,160	△17.4	1,403.04	△18.4	98.4	1.6
4月末	16,850	△13.9	1,464.03	△14.8	98.6	1.4
5月末	17,987	△8.1	1,563.67	△9.0	98.7	1.3
6月末	17,945	△8.3	1,558.77	△9.3	99.2	0.8
7月末	17,212	△12.0	1,496.06	△13.0	99.7	0.3
8月末	18,608	△4.9	1,618.18	△5.9	99.7	0.3
9月末	18,839	△3.7	1,625.49	△5.4	98.9	1.1
10月末	18,297	△6.5	1,579.33	△8.1	98.9	1.1
11月末	20,326	3.9	1,754.92	2.1	99.1	0.8
12月末	20,919	6.9	1,804.68	5.0	99.7	0.4
2021年1月末	20,955	7.1	1,808.78	5.2	99.7	0.3
(期末)						
2021年2月12日	22,400	14.5	1,933.88	12.5	99.8	0.3

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

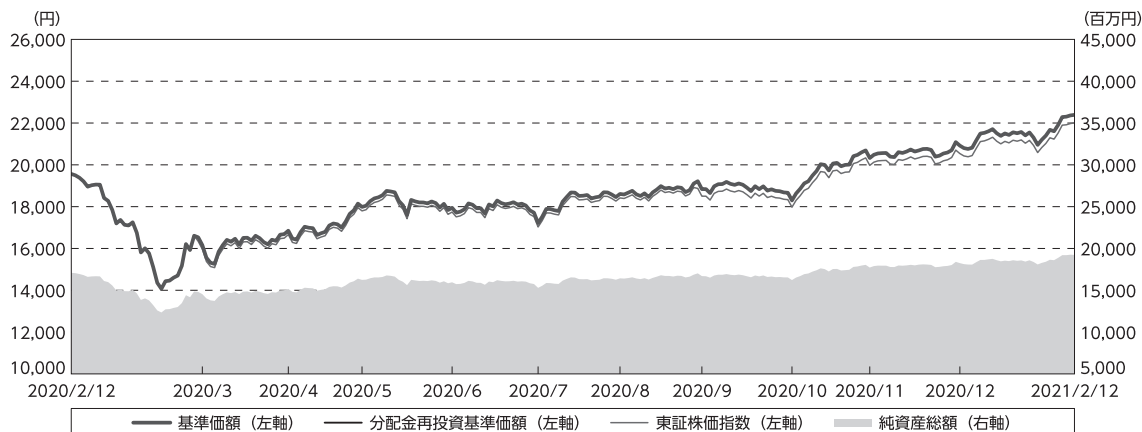
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2020年2月13日～2021年2月12日)

期中の基準価額等の推移



期首：19,564円

期末：22,390円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：14.5%（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および東証株価指数は、期首（2020年2月12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) 東証株価指数は当ファンドのベンチマークです。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、わが国の株式市場全体の動きをとらえることを目標に、東証株価指数に連動する投資成果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>

- ・新型コロナウイルスの感染拡大を受けて各国が経済対策を打ち出したこと。
- ・新型コロナウイルスのワクチン接種が欧米で始まり、感染拡大収束への期待が高まったこと。
- ・米国で新政権が発足し大型の経済対策による景気の回復期待が高まったこと。

<値下がり要因>

- ・2019年10-12月期の国内総生産（GDP）速報値が市場予想を下回ったこと。
- ・新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への影響の深刻化が警戒されたこと。
- ・世界保健機関（WHO）による「新型コロナウイルスはパンデミック（世界的な大流行）」との表明や、各国の渡航制限を受けて世界の経済活動が一段と鈍化したこと。

投資環境

（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2020年3月中旬にかけては、2019年10－12月期のGDP速報値が市場予想を下回ったことや、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への影響の深刻化が警戒されたこと、WHOによる「新型コロナウイルスはパンデミック」との表明や、各国の渡航制限を受けて世界の経済活動が一段と鈍化したことなどから、TOPIXは下落しました。3月下旬から期間末にかけては、新型コロナウイルスの感染が再び拡大し、経済活動の制限による景気の先行きへの懸念が強まったことなどが株価の重しとなったものの、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて各国が経済対策を打ち出したことや、新型コロナウイルスのワクチン接種が欧米で始まり感染拡大収束への期待が高まったこと、米国で新政権が発足し大型の経済対策による景気の回復期待が高まったことなどが支援材料となり、TOPIXは上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当ファンドは、「インデックス マザーファンド TOPIX」受益証券を高位に組み入れて運用を行ないました。

（インデックス マザーファンド TOPIX）

原則として「バーラ日本株式モデル」を使用して構築したポートフォリオにより、株式先物取引を含めた実質の株式組入比率を高位に保ち、東証株価指数（TOPIX）との連動をめざす運用を行ないました。

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、14.5%（分配金再投資ベース）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12.5%を概ね2.0%上回りました。

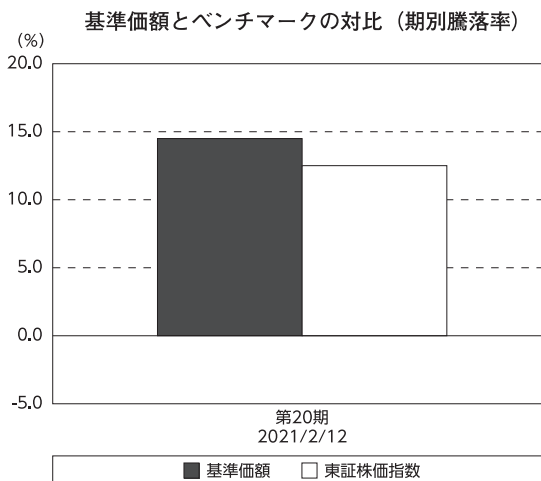
ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

＜プラス要因＞

- ・ 株式配当金を受取ったこと。

＜マイナス要因＞

- ・ 売買委託手数料などの諸費用を支払ったこと。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

(注) 東証株価指数は当ファンドのベンチマークです。

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20期
	2020年2月13日～ 2021年2月12日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.045%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	17,935

(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、ファンドの基本方針に則り、「インデックス マザーファンド TOPIX」受益証券を原則として高位に組み入れて運用を行ないます。

（インデックス マザーファンド TOPIX）

引き続き、原則として「バーラ日本株式モデル」を利用して一定期間ごとにポートフォリオの見直しなどを行なうとともに、株式先物取引も含めた実質の株式組入比率を高位に保ち、TOPIXとの連動性を維持するように努めます。

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

(2020年2月13日～2021年2月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 126	% 0.682	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(45)	(0.242)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(71)	(0.385)	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 ）	(10)	(0.055)	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	127	0.686	
期中の平均基準価額は、18,441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。

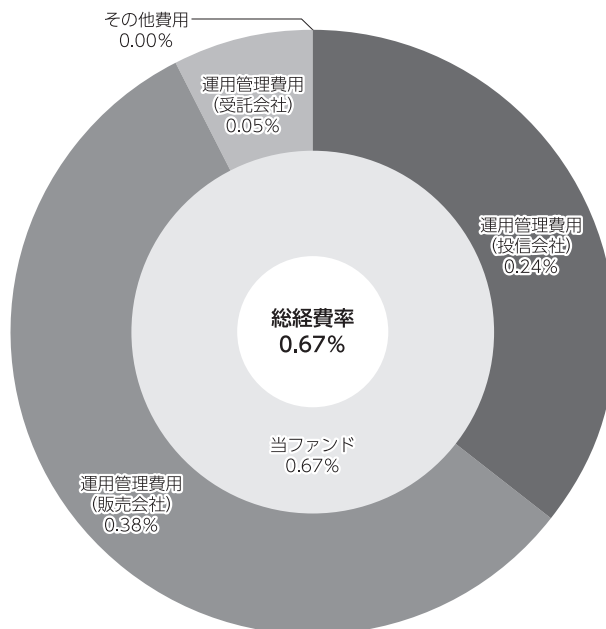
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.67%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) 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

(2020年2月13日～2021年2月12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 マザーファンド TOPIX	千口 828,088	千円 1,626,788	千口 1,017,827	千円 2,154,109

○株式売買比率

(2020年2月13日～2021年2月12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 マザーファンド TOPIX
(a) 期中の株式売買金額	6,657,029千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	37,240,023千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.17

(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

(2020年2月13日～2021年2月12日)

利害関係人との取引状況

<インデックスファンドTOPIX（日本株式）>

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	
金銭信託	百万円 4	百万円 4	% 100.0	百万円 4	百万円 4	% 100.0

<インデックス マザーファンド TOPIX>

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	
金銭信託	百万円 10	百万円 10	% 100.0	百万円 10	百万円 10	% 100.0

平均保有割合 43.5%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

＜インデックスファンドTOPIX（日本株式）＞

該当事項はございません。

＜インデックス マザーファンド TOPIX＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	1	4	105

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信託銀行株式会社、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（2020年2月13日～2021年2月12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

(2020年2月13日～2021年2月12日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年2月12日現在)

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 マザーファンド TOPIX	7,882,311	7,692,572	19,225,278

(注) 親投資信託の2021年2月12日現在の受益権総口数は、17,193,201千口です。

○投資信託財産の構成

(2021年2月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
インデックス マザーファンド TOPIX	19,225,278	99.3
コール・ローン等、その他	144,182	0.7
投資信託財産総額	19,369,460	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（2021年2月12日現在）

○損益の状況（2020年2月13日～2021年2月12日）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	19,369,460,311
コール・ローン等	87,914,141
インデックス マザーファンド TOPIX(評価額)	19,225,278,249
未収入金	56,267,921
(B) 負債	142,260,455
未払収益分配金	8,587,350
未払解約金	73,681,496
未払信託報酬	59,607,106
未払利息	5
その他未払費用	384,498
(C) 純資産総額(A-B)	19,227,199,856
元本	8,587,350,288
次期繰越損益金	10,639,849,568
(D) 受益権総口数	8,587,350,288口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,390円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 9,859
受取利息	54
支払利息	△ 9,913
(B) 有価証券売買損益	2,831,467,104
売買益	3,032,200,158
売買損	△ 200,733,054
(C) 信託報酬等	△ 112,366,846
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,719,090,399
(E) 前期繰越損益金	2,271,312,803
(F) 追加信託差損益金	5,658,033,716
(配当等相当額)	(10,404,817,176)
(売買損益相当額)	(△ 4,746,783,460)
(G) 計(D+E+F)	10,648,436,918
(H) 収益分配金	△ 8,587,350
次期繰越損益金(G+H)	10,639,849,568
追加信託差損益金	5,658,033,716
(配当等相当額)	(10,420,166,346)
(売買損益相当額)	(△ 4,762,132,630)
分配準備積立金	4,981,815,852

(注) 当ファンドの期首元本額は8,734,938,133円、期中追加設定元本額は2,426,525,540円、期中一部解約元本額は2,574,113,385円です。
 (注) 1口当たり純資産額は2,2390円です。

(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（2020年2月13日～2021年2月12日）は以下の通りです。

項 目	2020年2月13日～ 2021年2月12日
a. 配当等収益(経費控除後)	355,785,729円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	2,363,304,670円
c. 信託約款に定める収益調整金	10,420,166,346円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	2,271,312,803円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	15,410,569,548円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	17,945円
g. 分配金	8,587,350円
h. 分配金(1万口当たり)	10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）	10円
-----------------	-----

○お知らせ

約款変更について

2020年2月13日から2021年2月12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 マザーファンド TOPIX

運用報告書

第20期（決算日 2021年2月12日）
（2020年2月13日～2021年2月12日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2001年10月26日から原則無期限です。
運用方針	わが国の長期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、原則として「バレー日本株式モデル」にしたがい次のポートフォリオ管理を行ないます。

- ①東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。
- ②資金の流出入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。
- 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。

日興アセットマネジメント

<336122>

【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
	騰落率	中率		騰落率	中率		
	円	%		%	%	%	百万円
16期(2017年2月13日)	18,319	32.8	1,554.20	29.9	99.7	0.3	39,850
17期(2018年2月13日)	20,661	12.8	1,716.78	10.5	99.7	0.3	40,265
18期(2019年2月12日)	19,345	△ 6.4	1,572.60	△ 8.4	99.6	0.4	38,790
19期(2020年2月12日)	21,678	12.1	1,718.92	9.3	99.8	0.3	40,460
20期(2021年2月12日)	24,992	15.3	1,933.88	12.5	99.8	0.3	42,969

(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		騰落率	騰落率	
(期首) 2020年2月12日	円	%		%	%	%
	21,678	—	1,718.92	—	99.8	0.3
2月末	19,061	△12.1	1,510.87	△12.1	99.8	0.3
3月末	17,922	△17.3	1,403.04	△18.4	98.4	1.6
4月末	18,698	△13.7	1,464.03	△14.8	98.6	1.4
5月末	19,970	△ 7.9	1,563.67	△ 9.0	98.7	1.3
6月末	19,936	△ 8.0	1,558.77	△ 9.3	99.2	0.8
7月末	19,133	△11.7	1,496.06	△13.0	99.8	0.3
8月末	20,697	△ 4.5	1,618.18	△ 5.9	99.8	0.3
9月末	20,965	△ 3.3	1,625.49	△ 5.4	98.9	1.1
10月末	20,373	△ 6.0	1,579.33	△ 8.1	98.9	1.1
11月末	22,646	4.5	1,754.92	2.1	99.1	0.8
12月末	23,320	7.6	1,804.68	5.0	99.7	0.4
2021年1月末	23,373	7.8	1,808.78	5.2	99.7	0.3
(期末) 2021年2月12日	円	%		%	%	%
	24,992	15.3	1,933.88	12.5	99.8	0.3

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2020年2月13日～2021年2月12日)

基準価額の推移

期間の初め21,678円の基準価額は、期間末に24,992円となり、騰落率は+15.3%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>

- ・新型コロナウイルスの感染拡大を受けて各国が経済対策を打ち出したこと。
- ・新型コロナウイルスのワクチン接種が欧米で始まり、感染拡大収束への期待が高まったこと。
- ・米国で新政権が発足し大型の経済対策による景気の回復期待が高まったこと。

<値下がり要因>

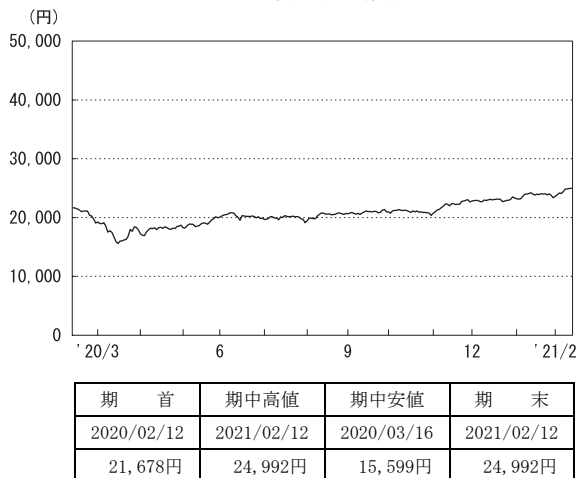
- ・2019年10-12月期の国内総生産（GDP）速報値が市場予想を下回ったこと。
- ・新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への影響の深刻化が警戒されたこと。
- ・世界保健機関（WHO）による「新型コロナウイルスはパンデミック（世界的な大流行）」との表明や、各国の渡航制限を受けて世界の経済活動が一段と鈍化したこと。

(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2020年3月中旬にかけては、2019年10-12月期のGDP速報値が市場予想を下回ったことや、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への影響の深刻化が警戒されたこと、WHOによる「新型コロナウイルスはパンデミック」との表明や、各国の渡航制限を受けて世界の経済活動が一段と鈍化したことなどから、TOPIXは下落しました。3月下旬から期間末にかけては、新型コロナウイルスの感染が再び拡大し、経済活動の制限による景気の先行きへの懸念が強まったことなどが株価の重しとなったものの、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて各国が経済対策を打ち出したことや、新型コロナウイルスのワクチン接種が欧米で始まり感染拡大収束への期待が高まったこと、米国で新政権が発足し大型の経済対策による景気の回復期待が高まったことなどが支援材料となり、TOPIXは上昇しました。

基準価額の推移



ポートフォリオ

原則として「バーラ日本株式モデル」を使用して構築したポートフォリオにより、株式先物取引を含めた実質の株式組入比率を高位に保ち、東証株価指数（TOPIX）との連動をめざす運用を行ないました。

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、15.3%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12.5%を概ね2.8%上回りました。

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。

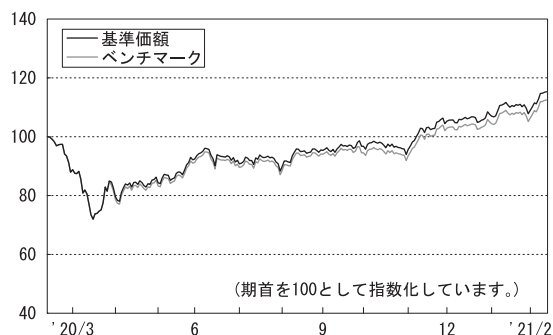
<プラス要因>

- ・ 株式配当金を受取ったこと。

<マイナス要因>

- ・ 売買委託手数料などの諸費用を支払ったこと。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○今後の運用方針

引き続き、原則として「バーラ日本株式モデル」を利用して一定期間ごとにポートフォリオの見直しなどを行なうとともに、株式先物取引も含めた実質の株式組入比率を高位に保ち、TOPIXとの連動性を維持するように努めます。

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。

○1万口当たりの費用明細

(2020年2月13日～2021年2月12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、20,507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

(2020年2月13日～2021年2月12日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 1,076 (△1,864)	千円 2,107,073 ()	千株 1,951	千円 4,549,956

(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 — (4,600)	千円 — ()	証券 — (4,600)	千円 — ()

(注) 金額は受渡代金。

(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 1,595	百万円 1,666	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2020年2月13日～2021年2月12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	6,657,029千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	37,240,023千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.17

(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

(2020年2月13日～2021年2月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B A	%	うち利害関係人 との取引状況D	D C	%
金銭信託	百万円 10	百万円 10	100.0	百万円 10	百万円 10	100.0

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 1	百万円 4	百万円 105

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信託銀行株式会社、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 (2020年2月13日～2021年2月12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

(2021年2月12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%)				高松コンストラクショングループ	1.4	1.3	2,750
極洋	0.8	0.7	2,156	東建コーポレーション	0.7	0.7	6,111
日本水産	22.8	20.4	10,322	ソネック	0.2	0.3	248
マルハニチロ	3.3	3.5	8,624	ヤマウラ	1	1	942
雪国まいたけ	—	1.4	2,590	大成建設	17.4	15.8	59,803
カネコ種苗	0.7	0.7	1,114	大林組	52.3	50.7	46,137
サカタのタネ	2.7	2.6	10,231	清水建設	53.1	47.6	37,794
ホクト	1.7	1.8	3,870	飛鳥建設	1.6	1.5	1,659
ホクリヨウ	0.4	0.4	280	長谷工コーポレーション	20.2	16.6	23,107
鉱業 (0.2%)				松井建設	2.1	2	1,436
住石ホールディングス	4.7	4.4	488	銭高組	0.2	0.2	906
日鉄鉱業	0.5	0.5	2,715	鹿島建設	41	37.2	55,502
三井松島ホールディングス	0.9	0.9	823	不動テトラ	1.4	1.3	2,376
国際石油開発帝石	90.8	80.8	58,418	大末建設	0.6	0.6	528
石油資源開発	3	2.9	6,707	鉄建建設	1.2	1.1	2,148
K&Oエナジーグループ	1.1	1.1	1,618	西松建設	4.1	3.6	9,558
建設業 (2.3%)				三井住友建設	12.7	12.4	5,952
ヒノキヤグループ	0.6	0.6	1,344	大豊建設	1.2	1.1	4,213
ショーボンドホールディングス	3.5	3.2	15,440	前田建設工業	13.1	12.7	11,798
ミライト・ホールディングス	6.7	7.6	13,566	ナカノフドー建設	1.5	1.3	520
タマホーム	1.2	1.4	2,665	奥村組	2.8	2.8	7,663
サンヨーホームズ	0.2	0.3	252	東鉄工業	2.2	2.2	5,973
日本アクア	0.9	0.9	572	イテケン	0.4	0.4	800
ファーストコーポレーション	0.7	0.8	571	富士ビー・エス	0.8	0.7	424
ベストラ	0.4	0.5	840	浅沼組	0.6	0.6	2,817
キャンディル	0.2	0.5	270	戸田建設	21.7	21	16,107
スペースバリューホールディングス	2.9	2.7	1,876	熊谷組	2.4	2.3	6,561
ダイセキ環境ソリューション	0.5	0.5	397	北野建設	0.3	0.3	736
第一カッター興業	0.3	0.6	810	植木組	0.3	0.2	581
明豊ファシリティアークス	0.6	—	—	矢作建設工業	2.3	2.3	1,966
安藤・間	13.5	14.2	10,905	ピーエス三菱	1.8	1.7	1,188
東急建設	6.6	6.6	3,715	日本ハウスホールディングス	3.7	3.8	1,295
コムシスホールディングス	8	7.8	26,325	大東建託	6.3	5.6	67,200
ピーアールホールディングス	2.5	2.7	2,041	新日本建設	2.2	2.1	1,799

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
NIPPPO	4.3	4.2	11,730
東亜道路工業	0.4	0.3	1,191
前田道路	5.6	3.2	6,400
日本道路	0.5	0.5	3,865
東亜建設工業	1.7	1.4	2,966
日本国土開発	3.8	5	2,785
若築建設	1	0.9	1,126
東洋建設	6	5.8	3,248
五洋建設	20.8	21.6	18,165
世紀東急工業	2.5	2.4	2,133
福田組	0.6	0.6	3,126
住友林業	13.3	12	27,288
日本基礎技術	1.8	1.5	760
巴コーポレーション	2.4	2.3	910
大和ハウス工業	51.7	46.9	153,316
ライト工業	3	2.9	5,008
積水ハウス	57.2	55	115,197
日特建設	1.4	1.4	1,103
北陸電気工事	0.9	0.9	1,114
ユアテック	3	3	2,535
日本リーテック	—	1.1	2,805
四電工	0.3	0.3	855
中電工	2.1	2.3	5,131
関電工	7.4	8.3	7,494
きんでん	12.4	11	20,174
東京エネシス	1.7	1.7	1,626
トーエネック	0.5	0.5	1,972
住友電設	1.5	1.5	3,882
日本電設工業	2.9	2.8	5,521
協和エクシオ	7.9	7.7	21,898
新日本空調	1.4	1.3	2,887
九電工	3.7	3.6	12,744
三機工業	3.8	3.6	4,672
日揮ホールディングス	16.1	17	22,219
中外炉工業	0.6	0.6	1,056
ヤマト	1.7	1.7	1,213
太平電業	1.3	1.1	2,807
高砂熱学工業	4.5	4.6	7,645

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三晃金属工業	0.2	0.2	599
朝日工業社	0.4	0.4	1,159
明星工業	3.4	3.3	2,699
大気社	2.5	2.5	7,332
ダイダン	1.3	1.1	3,124
日比谷総合設備	1.7	1.7	3,190
フィル・カンパニー	0.2	0.3	633
東洋エンジニアリング	2.3	2.4	1,149
レイズネクスト	2.8	2.7	3,164
食料品 (3.3%)			
ニップン	4.9	4.7	7,609
日清製粉グループ本社	18.9	18.3	31,860
日東富士製粉	0.1	0.1	671
昭和産業	1.5	1.3	4,218
鳥越製粉	1.5	1.4	1,223
中部飼料	2.1	1.9	2,783
フィード・ワン	11.3	2.2	2,061
東洋精糖	0.3	0.3	373
日本甜菜製糖	0.9	0.8	1,340
三井製糖	1.5	1.3	2,518
塩水港精糖	1.9	2.1	480
日新製糖	0.8	0.7	1,313
森永製菓	3.9	3.8	16,302
中村屋	0.4	0.4	1,584
江崎グリコ	5	4.5	21,307
名糖産業	0.8	0.7	1,056
井村屋グループ	0.7	0.9	2,291
不二家	0.9	1.1	2,623
山崎製パン	12.5	12.2	24,070
第一屋製パン	0.3	0.5	487
モロゾフ	0.3	0.3	1,710
亀田製菓	0.9	0.9	4,392
寿スピリッツ	1.6	1.6	10,512
カルビー	7.6	7.4	22,570
森永乳業	3.1	3	15,150
六甲バター	1.1	1.1	2,015
ヤクルト本社	11.5	11.2	58,464
明治ホールディングス	11	10.7	75,970

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
雪印メグミルク	4	3.9	8,755
プリマハム	2.6	2.3	7,670
日本ハム	6.4	6.2	28,458
林兼産業	0.6	0.5	312
丸大食品	1.8	1.5	2,575
S Foods	1.3	1.5	5,242
柿安本店	0.6	0.6	1,665
伊藤ハム米久ホールディングス	10.6	10.3	7,786
サッポロホールディングス	5.7	5.6	12,269
アサヒグループホールディングス	35	35.5	157,194
キリンホールディングス	70.9	69	153,387
宝ホールディングス	12.6	12	18,360
オエノンホールディングス	4.6	4.6	1,761
養命酒製造	0.5	0.5	993
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11.7	12.5	22,625
サントリー食品インターナショナル	11.2	10.9	41,256
ダイドーグループホールディングス	0.9	0.9	4,842
伊藤園	5.1	4.9	32,340
キーコーヒー	1.7	1.6	3,473
ユニカフェ	0.5	0.6	608
ジャパンフーズ	0.3	0.3	372
日清オイリオグループ	2.1	2.1	6,951
不二製油グループ本社	4.1	4	13,300
かどや製油	0.2	0.2	829
J-オイルミルズ	0.9	0.7	2,709
キッコーマン	12.1	11.7	84,708
味の素	37	38.7	87,965
キュービー	9.3	9.1	21,949
ハウス食品グループ本社	6.3	6.1	23,546
カゴメ	6.3	6.6	22,572
焼津水産化学工業	0.8	0.7	700
アリアケジャパン	1.5	1.5	10,380
ビエトロ	0.2	0.3	531
エバラ食品工業	0.4	0.4	1,119
やまみ	0.1	0.2	434
ニチレイ	7.9	7.8	22,362
東洋水産	8.6	8.4	38,850
イートアンドホールディングス	0.6	0.7	1,337

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大冷	0.2	0.2	387
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1	1	943
日清食品ホールディングス	7.1	6.4	54,720
永谷園ホールディングス	0.8	0.8	1,926
一正蒲鉾	0.7	0.6	716
フジッコ	1.8	1.7	3,474
ロック・フィールド	1.8	1.8	2,881
日本たばこ産業	96.5	87.2	172,743
ケンコーマヨネーズ	0.9	1	1,947
わらべや日洋ホールディングス	1.1	1.1	1,863
なとり	0.9	0.9	1,821
イフジ産業	0.3	0.3	277
ビックスコーポレーション	0.4	0.4	1,452
北の達人コーポレーション	5.9	5.7	3,693
ユーグレナ	7.2	7.1	6,972
ミヨシ油脂	0.6	0.5	601
理研ビタミン	0.8	1.6	2,291
繊維製品 (0.5%)			
片倉工業	2.4	2.1	2,977
グンゼ	1.2	1.1	4,092
東洋紡	6.5	6.3	8,719
ユニチカ	4.9	4.9	2,327
富士紡ホールディングス	0.8	0.8	3,588
倉敷紡績	1.6	1.5	2,836
シキボウ	0.9	0.9	936
日本毛織	5.3	5	4,870
ダイトウボウ	2.7	3.1	341
トーア紡コーポレーション	0.7	0.7	328
ダイドーリミテッド	2.2	2.6	483
帝国繊維	1.9	1.8	4,156
帝人	13.3	14.9	28,012
東レ	118.2	114.9	80,682
サカイオーベックス	0.4	0.4	1,164
住江織物	0.4	0.4	825
日本フェルト	0.9	0.9	403
日東製網	0.2	0.2	306
アツギ	1.4	1.2	608
ダイニック	0.6	0.6	469

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セーレン	4	3.9	7,784
ソトー	0.5	0.7	571
東海染工	0.2	0.2	226
小松マテーレ	2.7	2.6	2,709
ワコールホールディングス	4.3	4	9,372
ホギメディカル	1.8	2.1	6,825
レナウン	4.3	—	—
クラウドシアホールディングス	0.4	0.6	175
T S Iホールディングス	5.5	4.9	1,352
マツオカコーポレーション	0.5	0.5	1,075
ワールド	2.3	2.1	2,946
三陽商会	0.9	0.9	644
ナイガイ	0.6	0.7	231
オンワードホールディングス	9.9	9.8	2,744
ルックホールディングス	0.6	0.5	510
キムラタン	8.8	—	—
ゴールドウイン	3	2.6	19,838
デサント	3.2	2.7	4,860
キング	0.8	0.8	464
ヤマトインターナショナル	0.9	1.4	476
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	1	1	4,655
王子ホールディングス	68.3	71.4	48,980
日本製紙	7.3	7	10,059
三菱製紙	1.9	2.5	912
北越コーポレーション	10.8	11.2	5,465
中越パルプ工業	0.7	0.6	709
巴川製紙所	0.5	0.6	484
大王製紙	7.2	7.7	16,300
阿波製紙	0.5	0.5	227
レンゴー	15.5	16.3	14,425
トーモク	1	0.9	1,666
ザ・バック	1.2	1.2	3,309
化学 (7.4%)			
クラレ	25.7	25	30,350
旭化成	108.2	105.1	124,438
共和レザー	0.9	0.8	529
昭和電工	11.6	12.1	32,149

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友化学	119.9	125.1	64,551
住友精化	0.7	0.8	3,252
日産化学	9.1	8.8	52,712
ラサ工業	0.6	0.5	1,201
クレハ	1.4	1.3	9,438
多木化学	0.5	0.6	3,630
テイカ	1.2	1.2	1,755
石原産業	3	2.9	2,279
片倉コープアグリ	0.4	0.4	516
日本曹達	2.4	2.2	7,601
東ソー	25.2	24.5	46,403
トクヤマ	4.7	4.7	12,342
セントラル硝子	3.3	3	6,669
東亜合成	10.2	9.6	11,635
大阪ソーダ	1.6	1.6	4,244
関東電化工業	3.9	3.8	3,233
デンカ	6	5.8	24,534
信越化学工業	28	29.3	535,750
日本カーバイド工業	0.6	0.6	815
堺化学工業	1.1	1.1	2,295
第一稀元素化学工業	1.8	1.7	1,749
エア・ウォーター	15.2	16.2	28,350
日本酸素ホールディングス	15.7	13.1	26,933
日本化学工業	0.5	0.5	1,655
東邦アセチレン	0.2	0.3	435
日本パーカライジング	8.2	8	9,240
高圧ガス工業	2.6	2.5	1,887
四国化成工業	2.5	2.1	2,593
戸田工業	0.4	0.4	860
ステラ ケミファ	0.9	0.9	3,069
保土谷化学工業	0.6	0.5	2,510
日本触媒	2.5	2.9	16,965
大日精化工業	1.4	1.3	3,103
カネカ	4.2	4.1	17,343
三菱瓦斯化学	15.4	15.9	40,099
三井化学	14.8	13.7	46,032
J S R	15.2	15.9	51,675
東京応化工業	2.8	2.7	19,872

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大阪有機化学工業	1.5	1.5	5,805
三菱ケミカルホールディングス	109	106.1	77,919
KHネオケム	2.9	2.6	6,258
ダイセル	22.4	21.4	18,168
住友ベークライト	2.6	2.5	10,662
積水化学工業	35.1	33.5	67,837
日本ゼオン	14.7	14.3	23,480
アイカ工業	4.9	4.4	17,380
宇部興産	8.2	8	16,464
積水樹脂	3	2.6	5,556
タキロンシーアイ	3.5	3.4	2,366
旭有機材	0.9	0.9	1,371
日立化成	7.5	—	—
ニチバン	0.9	0.8	1,481
リケンテクノス	4.1	3.8	1,919
大倉工業	0.8	0.7	1,343
積水化成成品工業	2.2	2	1,120
群栄化学工業	0.4	0.4	1,003
タイガースポリマー	0.8	0.7	323
ミライアル	0.6	0.5	629
ダイキアクシス	0.6	0.6	630
ダイキョーニシカワ	3.4	3.3	2,851
竹本容器	0.6	0.7	634
森六ホールディングス	0.9	0.8	1,692
恵和	—	0.3	609
日本化薬	10.1	9.8	10,162
カーリットホールディングス	1.8	1.6	1,198
日本精化	1.3	1.2	1,726
扶桑化学工業	1.7	1.3	4,803
トリケミカル研究所	0.4	1.2	4,956
ADEKA	7.5	7.2	13,881
日油	6.1	6	33,000
新日本理化	2.8	2.9	774
ハリマ化成グループ	1.4	1.2	1,148
花王	39.9	38.8	290,456
第一工業製薬	0.6	0.6	2,262
石原ケミカル	0.4	0.4	860
日華化学	0.5	0.6	542

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニイタカ	—	0.3	876
三洋化成工業	1	0.9	4,860
有機合成薬品工業	1.3	1.4	425
大日本塗料	1.8	1.8	1,690
日本ペイントホールディングス	13.5	13.1	115,935
関西ペイント	18.3	17.8	54,290
神東塗料	1.3	1.3	266
中国塗料	4.7	3.9	3,646
日本特殊塗料	1.2	1.2	1,377
藤倉化成	2.1	2.2	1,159
太陽ホールディングス	1.2	1.2	7,200
D I C	6.9	6.7	18,157
サカタインクス	3.6	3.5	3,773
東洋インキS Cホールディングス	3.4	3.3	6,237
T & K TOKA	1.2	1.2	1,015
富士フィルムホールディングス	32	28.5	181,944
資生堂	33.1	32.2	257,439
ライオン	21.7	21.1	50,407
高砂香料工業	1.1	1	2,546
マンダム	3.8	3.4	6,052
ミルボン	2.2	2.2	15,466
ファンケル	6.7	5.9	24,013
コーセー	3.1	3	54,570
コタ	0.9	0.9	1,485
シーボン	0.2	0.3	598
ポーラ・オルビスホールディングス	7.1	6.9	17,360
ノエビアホールディングス	1.6	1.4	6,979
アジュバンコスメジヤパン	0.4	0.4	429
新日本製薬	—	0.4	1,141
エステー	1.1	1.1	2,260
アグロ カネショウ	0.5	0.6	955
コニシ	2.7	2.6	4,256
長谷川香料	2.2	2.8	5,614
星光PMC	1	1	790
小林製薬	4.7	4.5	50,220
荒川化学工業	1.5	1.3	1,660
メック	1.2	1.1	2,327
日本高純度化学	0.5	0.5	1,371

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
タカラバイオ	4.4	4.2	13,986	
JCU	2	1.8	6,309	
新田ゼラチン	1.1	1	672	
OATアグリオ	0.3	0.4	544	
デクセリアルズ	4.3	4.6	6,605	
アース製薬	1.3	1.2	7,704	
北興化学工業	1.7	1.5	1,701	
大成ラミック	0.6	0.6	1,765	
クミアイ化学工業	6.9	6.7	5,949	
日本農薬	3.1	2.9	1,528	
アキレス	1.2	1.2	1,810	
有沢製作所	2.7	2.3	2,281	
日東電工	11.5	10.4	102,648	
レック	1.8	1.9	2,612	
三光合成	2	1.9	858	
きもと	2.9	2.9	580	
藤森工業	1.5	1.4	6,678	
前澤化成工業	1.1	1	980	
未来工業	0.9	0.5	872	
ウェーブブロックホールディングス	0.6	0.6	468	
JSP	1	1.1	2,026	
エフビコ	1.8	3	12,450	
天馬	1.1	1.2	2,838	
信越ポリマー	3	2.5	2,665	
東リ	4.2	3.6	892	
ニフコ	6.1	5.9	23,895	
バルカー	1.4	1.3	2,804	
ユニ・チャーム	32.1	34.3	160,901	
ショーエイコーポレーション	0.2	0.4	412	
医薬品 (5.6%)				
協和キリン	16.8	16.3	50,937	
武田薬品工業	138.6	134.8	497,142	
アステラス製薬	146.6	140.4	249,561	
大日本住友製薬	12.3	12	20,424	
塩野義製薬	21.3	20.4	121,910	
わかもと製薬	2.1	2	490	
あすか製薬	1.9	1.9	2,878	
日本新薬	4.4	4.6	35,604	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
ピオフェルミン製薬	0.3	0.2	517	
中外製薬	17.4	50.6	260,438	
科研製薬	2.9	2.8	11,466	
エーザイ	20	17.9	139,262	
ロート製薬	8.6	7.7	24,024	
小野薬品工業	38.3	37.2	116,101	
久光製薬	4.4	4.7	32,101	
持田製薬	2.3	2.2	9,372	
参天製薬	31	28.2	45,571	
扶桑薬品工業	0.6	0.5	1,346	
日本ケミファ	0.2	0.2	448	
ツムラ	5.1	5.4	18,360	
日医工	4.7	4.7	4,831	
キッセイ薬品工業	2.9	2.8	6,311	
生化学工業	3.2	2.9	3,103	
栄研化学	2.9	2.9	6,530	
日水製薬	0.7	0.6	609	
鳥居薬品	1	1	3,035	
JCRファーマ	1.2	4.6	14,628	
東和薬品	2.1	2.3	4,882	
富士製薬工業	1.1	1.1	1,503	
沢井製薬	3.4	3.6	17,730	
ゼリア新薬工業	3	2.9	6,000	
第一三共	47.7	139	451,889	
キョーリン製薬ホールディングス	3.7	3.6	7,005	
大幸薬品	0.7	2	3,190	
ダイト	1	1	3,745	
大塚ホールディングス	31.8	33.6	154,123	
大正製薬ホールディングス	3.5	3.8	26,866	
ペプチドリーム	8.4	8.2	47,724	
石油・石炭製品 (0.4%)				
日本コークス工業	13.8	14	1,442	
ニチレキ	2	1.9	2,964	
ユシロ化学工業	0.9	0.9	1,038	
ビービー・カストロール	0.6	0.6	744	
富士石油	4.6	4.6	1,002	
MORESCO	0.6	0.7	819	
出光興産	18.8	18	48,078	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ENEOSホールディングス	250.7	243.5	108,381
コスモエネルギーホールディングス	4.8	5.1	12,795
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	9.7	9.4	17,126
TOYO TIRE	9.6	8.5	15,980
ブリヂストン	51.2	43.1	190,071
住友ゴム工業	15	14.7	17,022
藤倉コンポジット	1.5	1.5	654
オカモト	1	1	4,025
フコク	0.8	0.8	554
ニッタ	1.9	1.6	4,027
住友理工	3.3	3.1	2,039
三ツ星ベルト	2.2	2	3,524
バンドー化学	2.9	2.8	2,058
ガラス・土石製品 (0.8%)			
日東紡績	2.5	2.4	11,004
AGC	16.5	14.8	53,724
日本板硝子	8.1	8.5	4,666
石塚硝子	0.3	0.3	565
日本山村硝子	0.7	0.6	534
日本電気硝子	6.7	6	14,358
オハラ	0.7	0.7	1,343
住友大阪セメント	3.2	2.9	10,440
太平洋セメント	10.5	9.6	24,326
日本ヒューム	1.7	1.5	1,167
日本コンクリート工業	3.7	3.6	1,231
三谷セキサン	0.8	0.8	4,040
アジアパイルホールディングス	2.5	2.4	1,178
東海カーボン	17.5	15.8	24,379
日本カーボン	0.9	0.9	3,681
東洋炭素	1	1	2,044
ノリタケカンパニーリミテド	0.9	0.9	3,235
TOTO	11.9	11.6	82,824
日本碍子	20.3	17.9	34,010
日本特殊陶業	13	12.3	23,763
ダントーホールディングス	1.3	1.3	494
MARUWA	0.6	0.6	6,552
品川リフラクトリーズ	0.4	0.4	1,138

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
黒崎播磨	0.3	0.3	1,413
ヨータイ	1.3	1.1	1,036
イソライト工業	0.9	0.8	473
東京窯業	2	1.9	630
ニッカトー	0.8	0.8	601
フジミインコーポレーテッド	1.5	1.3	5,414
クニミネ工業	0.7	0.5	643
ユーアンドユーマテリアル	0.3	0.2	217
ニチアス	4.6	4.1	10,286
ニチハ	2.3	2.2	7,260
鉄鋼 (0.7%)			
日本製鉄	73.8	76.5	113,832
神戸製鋼所	30.4	29.4	19,257
合同製鐵	0.9	0.8	1,677
ジェイ エフ イー ホールディングス	44.6	46.4	50,483
東京製鐵	8	6.3	4,680
共英製鋼	1.9	1.8	2,559
大和工業	3.5	3.4	9,458
東京製鋼	0.7	0.6	1,202
大阪製鐵	0.9	0.8	1,009
淀川製鋼所	2.2	2.1	4,867
丸一鋼管	5.3	5.2	12,906
モリ工業	0.5	0.5	1,179
大同特殊鋼	2.7	2.6	12,259
日本高周波鋼業	0.6	0.7	260
日本冶金工業	1.4	1.3	2,654
山陽特殊製鋼	1.1	1.9	3,351
愛知製鋼	0.9	0.9	3,024
日立金属	17.8	15.1	26,274
日本金属	0.4	0.4	477
大平洋金属	1.2	1.1	2,429
新日本電工	10.9	10.5	3,055
栗本鐵工所	0.8	0.7	1,222
虹技	0.3	0.2	236
日本鑄鉄管	0.2	0.2	277
三菱製鋼	1.3	1.3	960
日亜鋼業	2.5	2.2	649
日本精線	0.3	0.3	1,140

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エンビプロ・ホールディングス	0.7	0.8	627
シンニッタン	2.6	1.8	403
新家工業	0.4	0.4	562
非鉄金属 (0.7%)			
大紀アルミニウム工業所	2.7	2.4	1,874
日本軽金属ホールディングス	41.7	4.4	8,905
三井金属鉱業	4.5	4.3	16,318
東邦亜鉛	0.9	0.9	2,201
三菱マテリアル	10.9	10.6	25,514
住友金属鉱山	21.1	20.5	101,659
DOWAホールディングス	4.2	4	15,940
古河機械金属	3	2.6	3,437
エス・サイエンス	7.5	10.6	466
大阪チタニウムテクノロジーズ	1.8	1.8	1,456
東邦チタニウム	3	2.9	2,679
UACJ	2.5	2.4	5,332
CKサンエツ	0.4	0.3	1,122
古河電気工業	5.1	5	14,500
住友電気工業	61.6	55.8	89,028
フジクラ	20.1	19.6	9,721
昭和電線ホールディングス	2	1.6	2,928
タツタ電線	3.3	2.9	1,980
カナレ電気	0.3	0.3	530
平河ヒューテック	0.6	0.9	1,091
リョービ	2	2	2,720
アーレスティ	2.2	2.2	924
アサヒホールディングス	2.9	3	12,960
金属製品 (0.6%)			
稲葉製作所	1	1.1	1,584
宮地エンジニアリンググループ	0.5	0.5	1,111
トーカロ	4.6	4.1	5,867
アルファC o	0.6	0.6	632
SUMCO	19.7	20.5	49,794
川田テクノロジーズ	0.3	0.3	1,387
RS Technologies	0.5	0.5	3,395
ジェイテックコーポレーション	—	0.1	375
信和	0.7	1	725
東洋製織グループホールディングス	10.5	10.1	13,119

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ホッカンホールディングス	0.9	0.8	1,172
コロナ	1	1	977
横河ブリッジホールディングス	3.1	2.8	5,566
駒井ハルテック	0.3	0.4	867
高田機工	0.2	0.1	260
三和ホールディングス	15.9	15.1	20,098
文化シャッター	4.8	4.7	4,779
三協立山	2.1	2.1	1,755
アルインコ	1.2	1.1	1,078
東洋シャッター	0.4	0.3	210
L I X I L	24.4	22.1	66,300
日本フィルコン	1.3	1.1	551
ノーリツ	3.4	3.3	5,468
長府製作所	1.7	1.7	3,598
リンナイ	3.2	3.1	37,572
ダイニチ工業	0.9	0.9	811
日東精工	2.3	2	1,026
三洋工業	0.2	0.2	375
岡部	3.4	3.3	2,600
ジーテクト	2.1	2	3,060
東ブレ	3.1	3	4,890
高周波熱練	3.2	3.1	1,655
東京製綱	1.2	1.2	1,711
サンコール	0.9	1.3	659
モリテック スチール	1.3	1.4	581
パイオラックス	2.4	2.4	4,120
エイチワン	1.7	1.6	1,350
日本発條	17.7	15.9	13,324
中央発條	0.2	0.1	288
アドバネクス	0.3	0.3	489
立川ブラインド工業	0.8	0.7	928
三益半導体工業	1.3	1.2	3,218
機械 (5.7%)			
日本ドライケミカル	0.4	0.4	640
日本製綱所	5	4.9	15,925
三浦工業	7.1	6.9	43,125
タクマ	5.6	5.4	11,680
ツガミ	3.5	3.3	5,458

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オークマ	1.9	1.9	11,628
芝浦機械	1.9	1.7	4,977
アマダ	20.9	23.4	29,835
アイダエンジニアリング	4.3	4.1	4,022
滝澤鉄工所	0.5	0.5	533
F U J I	7.1	6.4	17,945
牧野プライス製作所	2	1.9	7,961
オーエスジー	7.6	7.9	15,468
ダイジェット工業	0.2	0.2	268
旭ダイヤモンド工業	4.4	4.3	2,158
DMG森精機	10.5	10.2	17,085
ソディック	3.9	3.5	3,458
ディスコ	2.2	2.2	76,230
日東工器	0.9	0.8	1,493
日進工具	0.5	0.6	1,614
パンチ工業	1.6	1.4	757
富士ダイス	0.8	0.7	467
豊和工業	1	0.9	798
OKK	0.7	0.9	406
東洋機械金属	1.2	1.2	565
津田駒工業	0.3	0.4	364
島精機製作所	2.7	2.4	5,457
オプトラン	1.8	2	5,098
NCホールディングス	0.5	0.5	337
イワキポンプ	0.8	1	849
フリュー	1.6	1.6	1,860
ヤマシンフィルタ	3.6	3.3	2,785
日阪製作所	2	1.8	1,531
やまびこ	3.2	3.1	4,247
平田機工	0.8	0.8	6,288
ベガサスミシン製造	1.7	1.8	745
マルマエ	0.7	0.6	775
タツモ	0.8	0.7	1,110
ナブテスコ	9.7	9.4	46,859
三井海洋開発	1.8	1.7	3,036
レオン自動機	1.6	1.6	1,929
SMC	5.2	4.8	318,912
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1.5	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ホソカワミクロン	0.6	0.6	3,732
ユニオンツール	0.6	0.6	2,127
オイレス工業	2.1	2.2	3,718
日精エー・エス・ピー機械	0.6	0.5	3,015
サトーホールディングス	2.4	2.2	5,735
技研製作所	1.5	1.4	7,154
日本エアータック	0.5	0.5	730
カワタ	0.5	0.4	386
日精樹脂工業	1.4	1.3	1,210
オカダアイヨン	0.6	0.5	584
ワイエイシイホールディングス	0.7	0.7	755
小松製作所	75.5	73.3	232,067
住友重機械工業	9.5	9.3	27,081
日立建機	6.7	7.6	23,408
日工	2.3	2.4	1,821
巴工業	0.7	0.6	1,233
井関農機	1.7	1.6	2,342
T O W A	1.7	1.5	3,105
丸山製作所	0.4	0.3	491
北川鉄工所	0.7	0.7	1,059
ローツェ	0.7	0.7	5,670
タカキタ	0.6	0.6	424
クボタ	88.4	85.1	217,345
荏原実業	0.4	0.4	1,926
三菱化工機	0.6	0.5	1,535
月島機械	3.1	2.9	3,944
帝国電機製作所	1.4	1.1	1,356
新東工業	3.9	3.8	2,933
澁谷工業	1.4	1.4	5,145
アイチ コーポレーション	2.8	2.7	2,502
小森コーポレーション	4.2	4.1	2,870
鶴見製作所	1.3	1.2	2,122
住友精密工業	0.2	0.2	412
日本ギア工業	0.5	0.8	249
酒井重工業	0.3	0.3	653
荏原製作所	6.9	6.7	24,790
石井鐵工所	0.2	0.2	579
西島製作所	1.7	1.6	1,385

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北越工業	1.7	1.7	1,859
ダイキン工業	21.2	20.6	474,624
オルガノ	0.6	0.5	3,195
トーヨーカネツ	0.8	0.6	1,572
栗田工業	9	8.8	37,532
椿本チエイン	2.4	2.3	6,520
大同工業	0.8	0.8	616
木村化工機	1.4	1.4	866
アネスト岩田	2.6	2.7	3,024
ダイフク	8.5	8.9	96,743
サムコ	0.5	0.4	1,504
加藤製作所	0.9	0.9	876
油研工業	0.3	0.2	338
タダノ	8.1	7.9	7,884
フジテック	6.1	5.6	15,456
CKD	4.7	3.8	9,511
キトー	1.3	1.4	2,133
平和	4.7	4.6	7,245
理想科学工業	1.5	1.3	1,843
SANKYO	3.7	3.9	11,516
日本金銭機械	1.9	2.2	1,190
マースグループホールディングス	1.1	1	1,616
フクシマガリレイ	1	1.1	4,752
オーイズミ	0.7	0.8	336
ダイコク電機	0.8	0.7	669
竹内製作所	2.8	2.7	7,149
アマノ	4.4	4.3	11,081
JUKI	2.4	2.4	1,648
サンデンホールディングス	2.3	2.6	1,092
蛇の目ミシン工業	1.6	1.5	1,375
マックス	2.6	2.2	3,544
グローリー	4.3	4.2	9,748
新晃工業	1.6	1.5	3,102
大和冷機工業	2.4	2.6	2,849
セガサミーホールディングス	16.6	14.7	26,724
日本ビストンリング	0.6	0.6	673
リケン	0.8	0.7	1,663
TPR	2.2	2.2	3,592

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツバキ・ナカシマ	3.4	3.2	4,275
ホンザキ	4.9	5.1	53,448
大豊工業	1.4	1.3	1,004
日本精工	31.5	33.3	34,898
NTN	38.9	38.4	11,788
ジェイテクト	16	15.5	18,088
不二越	1.6	1.5	6,652
日本トムソン	5.1	4.6	2,392
THK	9.7	10.1	37,370
ユーンシン精機	1.3	1.1	1,107
前澤給装工業	0.6	0.6	1,386
イーグル工業	2.1	2	2,394
前澤工業	1.1	1	585
日本ビラー工業	1.7	1.6	2,944
キッツ	6.7	5	3,080
マキタ	21.7	21.1	101,385
日立造船	13.4	12.9	8,488
三菱重工業	27.9	25.4	76,860
IHI	12	10.9	21,037
スター精密	2.5	2.5	4,117
電気機器 (18.1%)			
日清紡ホールディングス	11.1	9.8	8,016
イビデン	10.2	7.8	38,298
コニカミノルタ	36.6	33	18,843
ブラザー工業	20.4	19.8	47,579
ミネベアミツミ	30.9	27.9	75,609
日立製作所	80.1	77.9	381,086
三菱電機	166.7	161.9	274,987
富士電機	10	9.8	44,002
東洋電機製造	0.6	0.7	852
安川電機	18	17.4	100,224
シンフォニアテクノロジー	2.2	2.2	3,031
明電舎	3.1	2.8	6,826
オリジン	0.5	0.4	539
山洋電気	0.8	0.8	5,024
デンヨー	1.4	1.4	2,924
東芝テック	2.1	1.8	7,245
芝浦メカトロニクス	0.3	0.3	1,515

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マブチモーター	4.6	4.5	21,510
日本電産	20.1	39	577,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1	1.1	695
トレックス・セミコンダクター	1	0.9	1,358
東光高岳	1	0.8	1,314
ダブル・スコープ	2.7	—	—
ダイヘン	1.8	1.8	8,901
ヤーマン	2.7	2.6	4,953
JVCケンウッド	14	14.6	2,993
ミマキエンジニアリング	1.6	1.6	908
IPEX	0.6	0.8	1,766
日新電機	3.9	3.8	4,966
大崎電気工業	3.3	3.3	2,059
オムロン	15	13.5	130,275
日東工業	2.4	2.3	5,064
IDEC	2.4	2.2	4,026
正興電機製作所	0.4	0.4	983
不二電機工業	0.2	0.3	387
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5.6	5.8	19,778
サクサホールディングス	0.4	0.4	578
メルコホールディングス	0.6	0.6	2,247
テクノメディカ	0.4	0.4	652
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	—	0.5	990
日本電気	20.2	20.6	128,956
富士通	16.1	14.6	233,965
沖電気工業	6.8	6.6	7,213
岩崎通信機	0.7	0.7	611
電気興業	0.8	0.8	2,359
サンケン電気	1.8	1.9	10,811
ナカヨ	0.3	0.3	431
アイホン	1	0.9	1,593
ルネサスエレクトロニクス	79.6	69.7	89,355
セイコーエプソン	20.8	20.2	37,107
ワコム	11.3	11.7	9,991
アルバック	3.1	3	15,540
アクセル	0.7	0.7	567
EIZO	1.3	1.4	5,243
日本信号	4.3	3.7	3,526

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
京三製作所	3.9	3.5	1,522
能美防災	2.2	2.1	4,830
ホーチキ	1.2	1.2	1,555
星和電機	0.9	0.8	532
エレコム	1.8	1.8	8,874
パナソニック	190.5	172.8	254,275
シャープ	19.4	18.8	43,804
アンリツ	10.8	9.7	24,638
富士通ゼネラル	4.6	5	16,125
ソニー	105.4	101.5	1,202,267
TDK	8.1	7.8	126,126
帝国通信工業	0.7	0.7	763
タムラ製作所	5.6	6.1	3,428
アルプスアルパイン	14.8	13.3	20,122
池上通信機	0.6	0.6	511
日本電波工業	1.6	—	—
鈴木	0.9	0.8	942
日本トリム	0.2	0.4	1,786
ローランド ディー・ジー	0.9	1	1,745
フォスター電機	1.8	1.8	2,619
SMK	0.4	0.5	1,525
ヨコオ	1.1	1.2	3,684
ホシデン	4.6	4.5	4,828
ヒロセ電機	2.6	2.5	40,275
日本航空電子工業	3.8	3.7	6,230
TOA	1.8	1.9	1,763
マクセルホールディングス	3.6	3.3	4,778
古野電気	2.2	2.1	2,446
ユニデンホールディングス	0.5	0.4	994
スミダコーポレーション	1.3	1.4	1,428
アイコム	0.9	0.7	2,006
リオン	0.7	0.7	2,194
本多通信工業	1.5	1.5	754
船井電機	1.8	2	902
横河電機	15.3	16.2	35,575
新電元工業	0.6	0.7	2,264
アズビル	10.5	10.9	53,464
東亜ディーケーケー	0.9	0.8	688

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本光電工業	6.9	6.7	20,736
チノー	0.6	0.5	715
共和電業	1.6	1.6	611
日本電子材料	0.7	0.6	1,094
堀場製作所	3.3	3.2	23,072
アドバンテスト	12.4	12.1	110,715
小野測器	0.6	0.6	328
エスベック	1.5	1.4	2,724
キーエンス	15.1	15.9	917,271
日置電機	0.9	0.8	3,200
シスメックス	11.9	12.6	151,326
日本マイクロニクス	2.9	2.8	4,592
メガチップス	1.6	1.6	4,788
OBARA GROUP	0.9	0.9	3,613
澤藤電機	0.2	0.2	435
原田工業	0.8	0.7	647
コーセル	2.2	2.1	2,471
イリソ電子工業	1.4	1.4	7,294
オブテックスグループ	2.7	2.7	5,270
千代田インテグレ	0.8	0.7	1,258
アイ・オー・データ機器	0.6	0.5	505
レーザーテック	7.3	7.1	101,459
スタンレー電気	11.7	11.3	41,188
岩崎電気	0.7	0.6	930
ウシオ電機	9.7	8.4	11,776
岡谷電機産業	1.4	1.4	541
ヘリオス テクノ ホールディング	1.6	1.8	637
エノモト	0.5	0.5	916
日本セラミック	1.7	1.7	5,159
遠藤照明	0.8	0.8	465
古河電池	1.2	1.2	1,995
双信電機	0.9	0.9	403
山一電機	1.2	1.1	1,665
図研	1.1	1	2,943
日本電子	3.3	2.9	12,368
カシオ計算機	14.8	13.1	26,213
ファナック	15.8	14.2	398,310
日本シイエムケイ	3.9	3.6	1,555

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エンプラス	0.9	0.7	3,374
大真空	0.6	0.6	1,435
ローム	7.4	6.7	78,256
浜松トニクス	12	11.6	80,040
三井ハイテック	1.9	1.6	6,664
新光電気工業	5.6	5.4	15,530
京セラ	23.4	24.7	172,331
太陽誘電	7.4	7.2	39,384
村田製作所	49	47.6	464,195
双葉電子工業	2.7	2.9	2,859
北陸電気工業	0.7	0.7	662
ニチコン	5.7	5.1	7,099
日本ケミコン	1.3	1.7	2,980
KOA	2.5	2.3	3,716
市光工業	2.5	2.5	2,047
小糸製作所	10	9.7	77,503
ミツバ	3.2	3.2	1,961
SCREENホールディングス	2.9	2.8	24,388
キャノン電子	1.7	1.6	2,756
キャノン	89.7	80.6	192,351
リコー	42.6	41.4	39,330
象印マホービン	4.9	4.4	8,272
MUTOHホールディングス	0.3	0.2	316
東京エレクトロン	11.1	9.5	408,405
輸送用機器 (7.2%)			
トヨタ紡織	4.9	4.7	8,803
芦森工業	0.4	0.4	427
ユニプレス	3.3	2.7	2,897
豊田自動織機	13.5	13.1	126,808
モリタホールディングス	2.9	2.6	4,732
三櫻工業	2.2	2.3	2,152
デンソー	36.7	35.6	248,096
東海理化電機製作所	4.4	4.2	8,022
三井E&Sホールディングス	6.2	6.5	2,775
川崎重工業	13	12.6	29,169
名村造船所	5.5	5.6	1,080
サノヤスホールディングス	2.1	—	—
日本車輛製造	0.6	0.6	1,572

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱ロジスネクスト	2.2	2.2	2,618
近畿車輛	0.3	0.2	247
日産自動車	196.5	191.2	120,016
いすゞ自動車	48.3	46.9	52,621
トヨタ自動車	186	164.1	1,380,573
日野自動車	20.8	20.3	19,691
三菱自動車工業	61.7	60.4	19,146
エフテック	1.2	1.2	810
レシップホールディングス	0.7	0.6	359
GMB	0.3	0.4	372
ファルテック	0.3	0.3	262
武蔵精密工業	3.7	3.6	6,876
日産車体	3.3	2.3	2,012
新明和工業	4.5	4.6	4,393
極東開発工業	3.1	2.7	4,338
日信工業	3.4	—	—
トビー工業	1.4	1.4	1,999
ティラド	0.6	0.5	891
タチエス	2.8	2.5	2,962
NOK	9	7.9	11,194
フタバ産業	4.7	4.1	2,304
KYB	1.9	1.9	6,061
大同メタル工業	3.2	3.4	2,012
プレス工業	8.3	7.9	2,662
ミクニ	2.2	2.2	664
太平洋工業	3.5	3.4	4,474
ケーヒン	3.9	—	—
河西工業	2.3	2.6	1,157
アイシン精機	13.7	11.9	44,030
マツダ	49.2	50.9	45,301
今仙電機製作所	1.5	1.4	1,050
本田技研工業	131.2	127.5	384,922
スズキ	33	32.1	157,482
SUBARU	51.7	46.4	102,080
安永	0.8	0.9	1,126
ヤマハ発動機	21.7	22.9	56,334
ショーワ	4	—	—
TBK	1.9	1.9	845

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	2.3	2.2	3,603
豊田合成	5.4	5.2	15,782
愛三工業	2.7	2.6	1,531
盟和産業	0.3	0.2	183
日本プラスト	1.4	1.4	782
ヨロズ	1.6	1.5	2,125
エフ・シー・シー	2.7	2.7	4,549
シマノ	6.3	6.1	160,582
テイ・エス テック	3.9	3.8	12,236
ジャムコ	0.9	1.1	827
精密機器 (2.6%)			
テルモ	47.2	49.6	223,795
クリエートメディック	0.5	0.5	489
日機装	5	5.3	5,639
日本エム・ディ・エム	1	0.9	1,924
島津製作所	19.9	20.8	89,960
JMS	1.4	1.4	1,516
長野計器	1.2	1.2	1,146
ブイ・テクノロジーズ	0.8	0.8	4,968
東京計器	1.1	1	922
愛知時計電機	0.2	0.2	878
インターアクション	0.9	0.8	2,051
オーバル	1.5	1.6	472
東京精密	3	2.7	13,054
マニー	6.6	6.4	17,945
ニコン	27	24.9	22,733
トプコン	8.4	8.2	11,717
オリンパス	92.3	89.6	184,755
理研計器	1.5	1.4	4,256
タムロン	1.4	1.4	2,811
HOYA	33.3	32.1	419,226
シード	0.7	0.8	512
ノーリツ鋼機	1.2	1.5	3,532
エー・アンド・デイ	1.6	1.4	1,913
朝日インテック	14.2	17	57,800
シチズン時計	19.7	21.4	8,281
リズム	0.6	0.6	432
大研医器	1.2	1.4	803

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メニコン	2.3	2.5	17,625
シンシア	0.2	0.2	138
松風	0.8	0.8	1,528
セイコーホールディングス	2.4	2.5	4,005
ニプロ	11.5	12.1	15,258
その他製品 (2.5%)			
中本ボックス	0.4	0.4	717
スノーピーク	0.8	1	2,049
パラマウントベッドホールディングス	1.7	1.5	7,192
トランザクション	1.1	0.9	1,036
粧美堂	0.5	0.7	280
ニホンフラッシュ	0.8	1.4	1,733
前田工織	1.8	1.8	5,290
永大産業	2.3	2	612
アートネイチャー	1.8	1.5	1,042
バンダイナムコホールディングス	17.2	13.4	117,933
アイフィスジャパン	0.5	0.4	288
共立印刷	2.9	2.6	340
SHOE I	0.8	1.4	5,957
フランスベッドホールディングス	2.4	2.4	2,332
パイロットコーポレーション	2.7	2.9	9,222
萩原工業	0.9	0.9	1,337
トッパン・フォームズ	3.6	2.9	3,250
フジシールインターナショナル	3.7	3.3	7,230
タカラトミー	7.5	7.5	7,297
廣済堂	1.2	1.2	1,056
エステールホールディングス	0.5	0.7	462
アーク	6.6	—	—
タカノ	0.6	0.7	425
プロネクス	1.4	1.3	1,530
ホクシン	1.1	1.5	172
ウッドワン	0.6	0.5	555
大建工業	1.1	1.1	2,236
凸版印刷	23.5	24.5	38,489
大日本印刷	21.8	19.5	37,849
共同印刷	0.5	0.5	1,682
N I S S H A	3.5	3.3	4,976
光村印刷	0.2	0.1	174

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TAKARA & COMPANY	0.8	0.8	1,425
アシックス	13.8	14.3	28,385
ツツミ	0.6	0.5	989
小松ウオール工業	0.5	0.6	1,084
ヤマハ	9.9	9.7	58,588
河合楽器製作所	0.5	0.5	1,762
クリナップ	1.6	1.4	694
ビジョン	10.1	10.4	47,476
オリバー	0.4	0.4	1,037
兼松サステック	0.1	0.2	357
キングジム	1.4	1.5	1,338
リンテック	3.9	3.4	8,160
イトーキ	3.6	3.5	1,242
任天堂	10.2	9.3	616,962
三菱鉛筆	2.7	2.6	3,686
タカラスタンダード	3.4	3.3	5,468
コクヨ	8	8	11,680
ナカバヤシ	1.6	1.4	865
オカムラ	5.8	6.4	6,700
美津濃	1.5	1.7	3,881
電気・ガス業 (1.3%)			
東京電力ホールディングス	133.1	137.5	53,625
中部電力	50.9	49.5	66,255
関西電力	63.2	61.3	66,204
中国電力	23	23.4	30,654
北陸電力	15.3	14.8	10,271
東北電力	41.6	37.9	35,739
四国電力	15	13.5	10,206
九州電力	34.4	35.8	34,010
北海道電力	15.7	15.4	7,268
沖縄電力	3.1	3.2	4,579
電源開発	13.3	12.9	22,394
エフオン	0.8	1	1,120
イーレックス	2.4	2.4	4,408
レノバ	2.8	2.7	9,598
東京瓦斯	32	31.2	71,182
大阪瓦斯	32.3	29.3	57,838
東邦瓦斯	8.2	8	52,720

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北海道瓦斯	0.9	0.8	1,282
広島ガス	3.3	3.1	1,178
西部瓦斯	1.9	1.8	5,212
静岡ガス	4.7	4.5	4,288
メタウォーター	0.8	1.8	3,994
陸運業 (3.6%)			
SBSホールディングス	1.4	1.2	3,386
東武鉄道	17.6	16.9	53,657
相鉄ホールディングス	5.3	5.6	14,481
東急	42	40.9	58,282
京浜急行電鉄	21.5	20.8	36,691
小田急電鉄	24.8	26	87,750
京王電鉄	8.7	9.1	78,442
京成電鉄	11.6	12.1	48,218
富士急行	2.3	2.2	12,716
東日本旅客鉄道	29.3	28.5	222,186
西日本旅客鉄道	14.9	14.5	94,235
東海旅客鉄道	13.9	13.5	235,170
西武ホールディングス	22.4	19.6	23,363
鴻池運輸	2.6	2.5	2,690
西日本鉄道	4.6	4.5	14,040
ハマキョウレックス	1.3	1.2	3,810
サカイ引越センター	0.9	0.7	3,647
近鉄グループホールディングス	15.8	15.3	71,298
阪急阪神ホールディングス	21.1	20.4	74,358
南海電気鉄道	7.5	7.3	19,768
京阪ホールディングス	7	6.8	34,884
神戸電鉄	0.4	0.4	1,516
名古屋鉄道	13	12.6	35,922
山陽電気鉄道	1.2	1.1	2,229
日本通運	5.6	5.3	40,439
ヤマトホールディングス	27.7	21.5	61,640
山九	4.4	3.9	16,945
丸運	0.5	0.5	128
丸全昭和運輸	1.3	1.2	4,110
センコーグループホールディングス	8.6	8.4	8,828
トナミホールディングス	0.4	0.4	2,288
ニッコンホールディングス	5.6	5.1	11,327

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本石油輸送	0.2	0.2	533
福山通運	2	1.9	8,502
セイノーホールディングス	11.8	11.4	17,601
エスライン	0.4	0.3	270
神奈川中央交通	0.4	0.4	1,540
日立物流	2.9	3.4	11,220
丸和運輸機関	1.7	3.2	6,963
C&F ロジホールディングス	1.6	1.5	2,889
九州旅客鉄道	14.1	11.9	31,535
SGホールディングス	16.5	29	76,531
海運業 (0.2%)			
日本郵船	13.2	12.8	35,788
商船三井	10	9.1	26,763
川崎汽船	4.9	4.8	8,860
NSユナイテッド海運	0.9	0.7	1,072
明治海運	1.7	1.7	664
飯野海運	7.7	7.3	3,212
共栄タンカー	0.3	0.3	289
乾汽船	1	0.9	854
空運業 (0.4%)			
日本航空	28.4	37.4	83,776
ANAホールディングス	28.9	41.4	98,987
パスコ	0.3	0.3	433
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	0.4	0.5	4,295
日新	1.3	1.2	1,694
三菱倉庫	5	5.3	17,172
三井倉庫ホールディングス	1.8	1.6	3,640
住友倉庫	5.8	5.5	7,760
澁澤倉庫	0.9	0.8	1,893
東陽倉庫	2.8	2.5	840
日本トランスシティ	3.5	3.3	1,815
ケイセン	0.3	0.2	274
中央倉庫	1	0.9	1,071
川西倉庫	0.3	0.3	358
安田倉庫	1.3	1.2	1,143
ファイズホールディングス	0.3	0.3	322
東洋埠頭	0.4	0.4	570

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
宇徳	1.3	1	469
上組	9	8.5	17,017
サンリツ	0.4	0.4	287
キムラユニティー	0.4	0.3	336
キューソー流通システム	0.4	0.4	638
近鉄エクスプレス	3.4	2.9	8,079
東海運	0.9	1	318
エアアイティー	1.1	1	1,072
内外トランスライン	0.6	0.6	798
日本コンセプト	0.5	0.5	852
情報・通信業 (9.5%)			
NECネットエスアイ	1.6	5.2	10,119
クロスキャット	0.4	0.4	472
システナ	5.8	5.7	11,291
デジタルアーツ	0.8	0.9	9,468
日鉄ソリューションズ	2.4	2.4	8,160
キューブシステム	0.9	0.9	1,063
エイジア	0.3	0.2	372
コア	0.7	0.7	1,100
ラクーンホールディングス	—	1.2	2,534
ソリトンシステムズ	0.7	0.8	1,548
ソフトクリエイトホールディングス	0.7	0.6	1,613
T I S	5.4	15.9	38,080
J N Sホールディングス	0.7	0.8	459
電算システム	0.6	0.6	1,890
グリー	10	9.8	6,183
GMOペパボ	—	0.1	610
コーエーテックモホールディングス	3.3	3.2	20,768
三菱総合研究所	0.7	0.7	2,943
ボルテージ	0.3	0.5	281
電算	0.2	0.2	509
A G S	0.9	0.8	691
ファインデックス	1.4	1.4	1,688
ブレインパッド	0.4	0.4	1,712
K L a b	3.2	3	2,724
ポールトゥウィン・ビットクルーHD	2	2.1	2,673
イーブックイニシアティブジャパン	0.3	0.2	488
ネクソン	46.6	40.1	132,931

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アイスタイル	4.6	5	2,460
エムアップホールディングス	0.5	0.4	992
エイチーム	1.2	1.1	1,405
エニグモ	1.2	1.5	1,975
テクノスジャパン	1.3	1.2	886
e n i s h	0.8	—	—
コロブラ	5.4	5.2	5,012
ブロードリーフ	8.2	7.9	5,111
クロス・マーケティンググループ	0.8	0.8	317
デジタルハーツホールディングス	0.9	0.7	1,017
システム情報	0.9	1.2	1,327
メディアドゥ	0.5	0.6	3,858
じげん	4.1	4	1,676
ブイキューブ	1.1	0.9	2,754
エンカレッジ・テクノロジー	0.3	0.3	201
サイバーリンクス	0.3	0.6	1,275
フィックスターズ	1.8	1.8	1,836
CARTA HOLDINGS	0.8	0.6	820
オプティム	0.4	1.1	3,663
セレス	0.6	0.5	1,391
SHIFT	0.4	0.7	9,303
ティーガイア	1.4	1.7	3,253
セック	0.3	0.2	575
日本アジアグループ	1.8	1.6	1,961
豆蔵ホールディングス	1.1	—	—
テクマトリックス	1.2	2.5	4,955
プロシップ	0.5	0.4	564
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4	3.9	10,436
GMOペイメントゲートウェイ	2.7	3.4	53,074
ザッパラス	0.9	0.7	332
システムリサーチ	0.5	0.5	897
インターネットイニシアティブ	2.4	4.2	9,991
さくらインターネット	1.8	1.8	1,265
ヴィンクス	0.5	0.4	500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	0.3	0.4	4,044
S R Aホールディングス	0.8	0.8	2,085
システムインテグレータ	0.6	0.5	316
朝日ネット	1.2	1.3	1,110

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
eBASE	1	1.9	1,884
アバント	1.2	1.7	2,468
アドソル日進	0.6	0.6	1,732
ODKソリューションズ	—	0.2	155
フリービット	0.8	1	1,001
コムチュア	1.8	1.5	4,590
サイバーコム	0.3	0.3	500
アステリア	1	1.2	1,269
アイル	0.6	0.9	1,373
マークラインズ	0.8	0.7	1,888
メディカル・データ・ビジョン	1.3	1.8	4,294
gumi	2.2	2.3	2,182
ショーケース	0.4	0.4	384
モバイルファクトリー	0.4	0.4	418
テラスカイ	0.6	0.5	2,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.6	0.8	1,328
PCIホールディングス	0.3	0.6	819
パイブドHD	0.2	0.3	476
アイビーシー	0.3	0.3	333
ネオジャパン	0.3	0.3	551
PR TIMES	0.2	0.3	1,096
ランドコンピュータ	0.2	0.2	227
ダブルスタンダード	0.2	0.2	887
オープンドア	0.8	1	2,186
マイネット	0.6	0.6	557
アカツキ	0.6	0.7	3,031
ベネフィットジャパン	0.1	0.1	188
Ubicomホールディングス	0.4	0.4	1,282
LINE	3.7	—	—
カナミックネットワーク	1	1.5	1,204
ノムラシステムコーポレーション	0.4	0.8	293
チェンジ	0.4	2.2	8,382
シンクロ・フード	0.7	1	376
オークネット	1	0.9	1,197
キャピタル・アセット・プランニング	—	0.2	201
セグエグループ	0.3	0.4	515
エイトレッド	0.2	0.3	771
AOI TYO Holdings	1.7	1.7	788

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マクロミル	3.3	3.4	2,947
ビーグリー	0.3	0.3	501
オロ	0.5	0.5	1,910
ユーザーローカル	0.1	0.3	1,329
テモナ	—	0.4	395
ニーズウェル	0.2	0.4	273
サインポスト	0.3	0.4	404
ソルクシーズ	0.7	0.6	609
フェイス	0.6	0.5	418
プロトコーポレーション	1.5	1.4	1,705
ハイマックス	0.2	0.4	597
野村総合研究所	23.2	29	104,835
サイバネットシステム	1.2	1.2	1,093
CEホールディングス	1	0.9	531
日本システム技術	0.3	0.3	462
インテージホールディングス	2	2	2,444
東邦システムサイエンス	0.4	0.4	378
ソースネクスト	7.9	7.7	2,402
インフォコム	1.8	1.4	4,312
HEROZ	0.2	0.5	1,742
ラクスル	0.9	1.3	5,115
IPS	—	0.3	815
FIG	1.8	1.9	503
システムサポート	0.2	0.5	768
イーソル	0.6	0.9	1,274
アルテリア・ネットワークス	1.8	1.8	3,004
EduLab	—	0.2	1,490
東海ソフト	—	0.2	234
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	0.4	0.3	643
東名	—	0.1	109
ヴィッツ	—	0.1	225
トピラスシステムズ	—	0.2	328
Link-U	—	0.1	142
ギフティ	—	0.7	2,362
ベース	—	0.1	538
フォーカスシステムズ	1	1.1	1,068
クレスコ	1	1.1	1,567
フジ・メディア・ホールディングス	15.7	16.4	21,467

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オービック	5.7	5	97,350
ジャストシステム	2.7	2.2	16,764
TDCソフト	1.4	1.4	1,376
Zホールディングス	224.6	218.3	147,352
トレンドマイクロ	7.3	8.5	51,170
IDホールディングス	0.6	0.6	740
日本オラクル	3.3	3.2	40,512
アルファシステムズ	0.5	0.4	1,528
フューチャー	2	1.9	3,678
CAC Holdings	1.1	1	1,435
SBテクノロジー	0.6	0.6	1,896
トーセ	0.5	0.5	403
オービックビジネスコンサルタント	1.7	1.6	10,576
伊藤忠テクノソリューションズ	7.4	7.2	25,704
アイティフォー	2	2.1	1,864
東計電算	0.2	0.2	863
エクスネット	0.2	0.2	201
大塚商会	8.8	8.6	45,408
サイボウズ	1.9	1.8	4,957
ソフトブレイン	1	—	—
電通国際情報サービス	1	2	7,570
ACCESS	—	1.5	1,168
デジタルガレージ	2.9	2.6	11,128
EMシステムズ	2.3	2.6	2,327
ウェザーニューズ	0.6	0.5	2,590
C I J	1.2	1.1	992
ビジネスエンジニアリング	0.2	0.2	676
日本エンタープライズ	1.7	1.8	433
WOWOW	0.8	0.8	2,313
スカラ	1.2	1.5	1,237
インテリジェント ウェイブ	0.7	1	698
IMAGICA GROUP	1.4	1.4	642
ネットワンシステムズ	6.2	6.5	22,977
システムソフト	4	4.8	571
アルゴグラフィックス	1.4	1.2	3,738
マーベラス	2.5	2.6	2,451
エイベックス	2.8	2.8	4,121
日本ユニシス	5.1	5.5	19,442

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
兼松エレクトロニクス	0.9	0.9	3,415
都築電気	—	0.6	956
TBSホールディングス	9.9	10.5	22,302
日本テレビホールディングス	13.6	13.2	18,453
朝日放送グループホールディングス	1.5	1.5	1,071
テレビ朝日ホールディングス	4.5	4.9	11,044
スカパーJ S A Tホールディングス	10.5	10.4	4,867
テレビ東京ホールディングス	1.3	1.2	2,923
日本BS放送	0.5	0.6	702
ビジョン	1.5	2	1,978
スマートバリュー	0.5	0.5	470
USEN-NEXT HOLDINGS	0.7	0.7	1,316
コネクシオ	1	1.1	1,556
クロップス	0.3	0.3	237
日本電信電話	218.8	186	521,823
KDDI	122	127.6	422,994
ソフトバンク	148.9	144.7	207,210
光通信	1.7	1.9	42,674
NTTドコモ	121	—	—
エムティーアイ	1.6	1.6	1,427
GMOインターネット	6.4	5.7	20,634
ファイバークーゲート	0.4	0.6	1,346
アイドママーケティングコミュニケーション	0.5	0.5	235
KADOKAWA	4.4	4.3	16,404
学研ホールディングス	0.6	2.1	3,975
ゼンリン	3.3	2.9	4,094
昭文社ホールディングス	0.8	0.8	383
インプレスホールディングス	1.4	1.5	292
アイネット	0.8	0.8	1,237
松竹	1.1	1.1	16,819
東宝	9.8	9.4	40,796
東映	0.6	0.5	10,605
エヌ・ティ・ティ・データ	43.5	42.2	70,389
ピー・シー・エー	0.2	0.3	1,312
ビジネスブレイン太田昭和	0.3	0.6	1,081
D T S	3.6	3.3	8,144
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7	6.8	48,552
シーイーシー	1.7	1.7	2,488

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カブコン	7.7	6.8	46,784
アイ・エス・ビー	0.3	0.7	954
ジャステック	1	1	1,250
SCSK	3.8	3.7	24,605
日本システムウエア	0.5	0.5	1,047
アイネス	1.6	1.6	2,235
TKC	1.4	1.3	9,048
富士ソフト	2.1	1.7	10,013
NSD	5.3	5.1	10,210
コナミホールディングス	5.9	5.8	41,818
福井コンピュータホールディングス	0.6	0.7	2,779
JBCCHホールディングス	1.1	1.1	1,655
ミロク情報サービス	1.4	1.6	3,536
ソフトバンクグループ	129.8	126.1	1,235,401
卸売業 (4.5%)			
ハウスイ	0.2	0.1	99
高千穂交易	0.6	0.6	736
オルパヘルスケアホールディングス	—	0.3	477
伊藤忠食品	0.4	0.4	2,120
エレマテック	1.5	1.3	1,340
JALUX	0.5	0.5	778
あらた	1.3	1.3	6,402
トーマンデバイス	0.2	0.2	801
東京エレクトロン デバイス	0.6	0.5	1,957
フィールズ	1.3	1.5	739
双日	90.9	88.7	23,062
アルフレッサ ホールディングス	18.2	16.5	36,712
横浜冷凍	4.6	4.3	3,900
神栄	0.3	0.3	455
ラサ商事	0.9	0.9	824
ラクーンホールディングス	0.8	—	—
アルコニックス	1.8	1.7	2,823
神戸物産	5.7	11	31,999
ハイパー	—	0.2	108
あい ホールディングス	2.4	2.3	4,834
ディーブイエックス	0.6	0.5	530
ダイワボウホールディングス	1.4	1.5	12,615
マクニカ・富士エレホールディングス	3.9	3.8	8,394

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ラクト・ジャパン	0.6	0.7	1,914
グリムス	—	0.3	514
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3.1	2.7	2,238
八洲電機	1.3	1.2	1,162
メディアスホールディングス	0.9	0.9	787
レスターホールディングス	1.7	1.7	3,683
ジュテックホールディングス	0.4	0.4	432
大光	0.7	0.8	533
OCHIホールディングス	0.5	0.5	687
TOKAIホールディングス	8.6	7.7	7,546
黒谷	0.4	0.5	352
Cominix	0.3	0.4	308
三洋貿易	1.6	1.6	1,768
ビューティガレージ	0.3	0.3	758
ウイン・パートナーズ	1.2	1.1	1,296
ミタチ産業	0.4	0.4	236
シップヘルスケアホールディングス	2.6	2.8	17,668
明治電機工業	0.5	0.5	720
デリカフーズホールディングス	0.6	0.8	508
スターティアホールディングス	0.4	0.3	315
コメダホールディングス	3.6	3.5	6,996
ビーバンドットコム	0.1	0.3	278
アセンテック	0.2	0.4	752
富士興産	0.5	0.5	635
協栄産業	0.2	0.2	278
小野建	1.5	1.4	1,828
南陽	0.4	0.3	499
佐島電機	1.2	1	785
エコートレーディング	0.4	0.3	206
伯東	1	1	1,316
コンドーテック	1.3	1.2	1,288
中山福	1	1.1	577
ナガイレーベン	2.4	2.1	6,363
三菱食品	1.8	1.7	5,023
松田産業	1.2	1.2	2,378
第一興商	2.4	2.4	9,456
メディアパルホールディングス	17.7	15.9	35,600
SPK	0.4	0.7	896

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
萩原電気ホールディングス	0.6	0.6	1,642
アズワン	1.1	1.1	17,028
スズデン	0.6	0.6	748
シモジマ	1	0.9	1,258
ドウシシャ	1.6	1.5	2,827
小津産業	0.4	0.4	768
高速	1	0.8	1,244
たけびし	0.6	0.5	779
リックス	0.4	0.4	657
丸文	1.4	1.4	779
ハビネット	1.4	1.4	2,171
橋本総業ホールディングス	0.4	0.3	756
日本ライフライン	4.8	5.2	7,264
タカショー	0.8	1.2	928
エクセル	0.5	—	—
マルカ	0.6	0.5	1,007
I D O M	4.5	5.5	3,470
進和	0.9	0.9	1,989
エスケイジャパン	0.4	0.5	228
ダイترون	0.7	0.7	1,116
シークス	2.1	2.1	3,656
田中商事	0.5	0.5	347
オーハシテクニカ	0.9	0.8	1,196
白銅	0.6	0.6	870
ダイコー通産	—	0.2	319
伊藤忠商事	114.8	111.4	347,233
丸紅	170.9	157.3	115,599
高島	0.2	0.2	341
長瀬産業	9.2	8.9	15,681
蝶理	1	1	1,581
豊田通商	18.3	16	73,040
三共生興	2.5	2.2	1,089
兼松	6.1	6.4	9,145
ツカモトコーポレーション	0.3	0.3	460
三井物産	144.2	129.4	259,964
日本紙バルブ商事	0.9	0.8	2,928
日立ハイテック	5.7	—	—
カメイ	2.1	1.9	2,356

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東都水産	0.2	0.2	735
OUGホールディングス	0.3	0.3	851
スターゼン	0.6	0.6	2,661
山善	6.4	6.2	6,342
椿本興業	0.3	0.3	1,129
住友商事	103.6	100.8	150,141
内田洋行	0.7	0.6	2,721
三菱商事	115.2	97	276,741
第一実業	0.8	0.7	2,856
キヤノンマーケティングジャパン	4.7	3.9	9,750
西華産業	0.9	0.8	1,125
佐藤商事	1.3	1.3	1,280
菱洋エレクトロ	1.7	1.2	3,525
東京産業	1.5	1.3	865
ユアサ商事	1.5	1.6	5,056
神鋼商事	0.4	0.4	777
トルク	1	1	264
阪和興業	3.1	3.2	9,241
正栄食品工業	1.1	1	3,855
カナデン	1.3	1.3	1,667
菱電商事	1.2	1.1	1,753
フルサト工業	0.9	0.7	919
岩谷産業	3.7	3.8	24,396
ナイス	0.7	0.7	1,125
昭光通商	0.6	0.7	478
ニチモウ	0.3	0.3	579
極東貿易	0.5	0.5	705
イワキ	2.2	2.1	1,327
三愛石油	4	3.9	4,352
稲畑産業	3.6	3.8	5,871
G S I クレオス	0.4	0.4	1,004
明和産業	1.6	1.5	735
クワザワホールディングス	0.6	0.6	405
ヤマエ久野	—	1.1	1,217
ワキタ	3.5	3.1	3,211
東邦ホールディングス	5.3	5.1	10,342
サンゲツ	4.5	4.2	6,862
ミツウロコグループホールディングス	2.4	2.3	2,911

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シナネンホールディングス	0.7	0.6	1,953
伊藤忠エネクス	3.5	3.4	3,505
サンリオ	4.7	4.6	7,622
サンワテクノス	1.2	1.1	1,208
リョーサン	1.8	1.8	4,168
新光商事	2.5	2.2	1,711
トーヨー	0.8	0.7	1,288
三信電気	0.9	0.9	1,923
東陽テクニカ	1.9	1.7	1,963
モスフードサービス	2.2	2.3	7,199
加賀電子	1.6	1.4	3,469
ソーダニッカ	1.7	1.5	802
立花エレテック	1.2	1.2	1,945
フォーバル	0.7	0.6	508
PALTAC	2.6	2.6	14,612
三谷産業	2.1	2.2	976
太平洋興発	0.7	0.6	390
西本Wismettacホールディングス	0.3	0.4	1,138
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.2	0.1	157
コア商事ホールディングス	—	0.5	693
国際紙パルプ商事	4	3.5	871
ヤマタネ	0.9	0.7	1,015
丸紅建材リース	0.2	0.1	184
日鉄物産	1.1	1.1	4,180
泉州電業	0.5	0.5	1,715
トラスコ中山	3.4	3.7	10,241
オートバックスセブン	6.1	5.9	8,354
モリト	1.1	1.1	676
加藤産業	2.6	2.3	8,142
北恵	0.3	0.5	471
イノテック	1	0.9	1,170
イエローハット	3.1	3	5,166
J Kホールディングス	1.5	1.4	1,152
日伝	1.5	1.3	2,896
北沢産業	1.3	1.2	318
杉本商事	0.9	0.8	1,934
因幡電機産業	4.7	4.2	10,718
東テック	0.6	0.5	1,422

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ミスミグループ本社	20.6	20	70,400
アルテック	1.4	1.2	340
タキヒヨー	0.5	0.6	1,184
蔵王産業	0.3	0.3	416
スズケン	7	6.7	29,011
ジェコス	1.1	1	971
グローセル	1.5	1.7	894
小売業 (4.7%)			
ローソン	4.2	4.1	21,812
サンエー	1.3	1.2	5,118
カワチ薬品	1.3	1.1	3,333
エービーシー・マート	2.6	2.5	15,575
ハードオフコーポレーション	0.6	0.7	550
アスクル	1.7	1.4	5,341
ゲオホールディングス	3	2.1	2,568
アダストリア	2.3	2.2	4,538
ジーフット	0.9	1.3	553
シー・ヴィ・エス・バイエリア	0.3	0.3	126
くら寿司	0.9	1	6,950
キャンドウ	0.8	0.8	1,522
アイケイ	—	0.4	360
バルグループホールディングス	0.9	1.4	2,244
エディオン	7.5	6.7	7,236
サーラコーポレーション	3.3	3.2	1,859
ワッツ	0.8	0.8	696
ハローズ	0.6	0.6	1,863
フジオフードグループ本社	1.4	1.4	1,870
あみやき亭	0.4	0.4	1,192
ひらまつ	3.1	3.8	668
大黒天物産	0.4	0.4	2,400
ハニーズホールディングス	1.5	1.3	1,285
ファーマライズホールディングス	0.4	0.3	237
アルペン	1.3	1.2	2,757
ハブ	0.5	0.6	423
クオールホールディングス	2.4	2.2	2,998
ジンズホールディングス	0.9	0.9	6,687
ビックカメラ	9.7	9.5	11,390
DCMホールディングス	8.8	9.8	11,015

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
MonotaRO	11.7	11.4	71,934
東京一番フーズ	0.4	0.6	350
DDホールディングス	0.7	—	—
きちりホールディングス	0.5	—	—
アークランドサービスホールディングス	1.2	1.4	3,115
J. フロント リテイリング	19.6	19.1	19,367
ドトール・日レスホールディングス	2.6	2.5	4,202
マツモトキヨシホールディングス	6.8	6.6	30,624
ブロンコビリー	0.9	0.9	2,072
ZOZO	11.3	9.4	32,571
トレジャー・ファクトリー	0.5	0.5	420
物語コーポレーション	0.4	0.4	4,816
ココカラファイン	1.7	1.4	11,018
三越伊勢丹ホールディングス	28.8	28	20,496
Hamee	0.6	0.4	714
ウエルシアホールディングス	4.9	8.5	30,770
クリエイトSDホールディングス	2.8	2.3	7,877
丸善CHIホールディングス	1.7	1.7	640
ミサワ	0.4	0.4	270
ティールライフ	0.2	0.2	245
エー・ビーホールディングス	0.3	—	—
チムニー	0.5	0.6	839
シュッピン	1.2	1.2	1,140
オイシックス・ラ・大地	—	1.6	4,960
ネクステージ	2.4	2.7	4,206
ジョイフル本田	4.8	4.6	6,619
鳥貴族ホールディングス	0.6	0.5	851
キリン堂ホールディングス	0.7	—	—
ホットランド	1.1	1.3	1,606
すかいらーくホールディングス	18.4	18	29,880
SFPホールディングス	0.7	0.8	1,186
綿半ホールディングス	0.6	1.2	1,594
ヨシックス	0.3	0.3	651
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4.7	4.6	5,308
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.8	0.9	924
BEENOS	0.6	0.8	2,119
あさひ	1.3	1.2	1,964
日本調剤	0.5	1	1,673

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コスモス薬品	0.7	1.6	25,696
トーエル	0.8	0.7	582
オンリー	0.3	0.3	140
セブン&アイ・ホールディングス	64.2	62.4	258,398
クリエイト・レストラnitz・ホールディングス	4.4	8.6	7,568
ツルハホールディングス	3.6	3.5	50,750
サンマルクホールディングス	1.3	1.4	2,193
フェリシモ	0.4	0.4	521
トリドールホールディングス	2	4	6,424
TOKYO BASE	1.5	1.5	1,017
ウイルプラスホールディングス	0.3	0.3	310
JMホールディングス	0.8	1.2	2,478
サツドラホールディングス	0.3	0.3	617
アレンザホールディングス	0.8	0.9	1,278
串カツ田中ホールディングス	0.3	0.4	743
パロックジャパンリミテッド	1.1	1.1	899
クスリのアオキホールディングス	1.5	1.6	13,728
力の源ホールディングス	0.8	—	—
スシローグローバルホールディングス	1.8	8.8	38,236
LIXILビバ	1.6	—	—
メディカルシステムネットワーク	1.6	1.4	1,082
はるやまホールディングス	0.7	0.6	423
ノジマ	2.9	2.8	7,809
カッパ・クリエイト	2.3	2.4	3,626
ライトオン	1.3	1.4	904
ジーンズメイト	0.5	0.7	204
良品計画	21.8	21.2	54,399
三城ホールディングス	1.8	2	608
アドヴァン	2.5	1.7	1,878
アルビス	0.6	0.5	1,231
コナカ	2	2.1	699
ハウス オブ ローゼ	0.2	0.2	341
G-7ホールディングス	1	0.9	2,187
イオン北海道	1.4	2.1	2,217
コジマ	2.9	2.7	1,814
ヒマラヤ	0.6	0.6	579
コーナン商事	2.3	2.3	6,743
エコス	0.6	0.6	1,170

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ワタミ	2	—	—
マルシェ	0.5	—	—
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	36.1	31.9	84,152
西松屋チェーン	3.6	3.5	5,355
ゼンショーホールディングス	7.9	8.6	24,983
幸楽苑ホールディングス	1.1	1.1	1,951
ハークスレイ	0.3	0.3	279
サイゼリヤ	2.7	2.4	5,136
V Tホールディングス	6.8	6.1	2,641
魚力	0.5	0.5	929
ポブラ	0.5	—	—
フジ・コーポレーション	0.4	0.4	905
ユナイテッドアローズ	1.7	1.9	3,665
ハイデイ日高	2.4	2.3	4,291
京都きもの友禅	1.1	1.4	331
コロワイド	5.5	5.3	10,297
ピーシーデポコーポレーション	2.2	1.9	1,162
老番屋	1.1	1.1	5,687
P L A N T	0.4	0.4	303
スギホールディングス	3.3	3.2	23,328
薬王堂ホールディングス	0.7	0.7	1,894
ヴィア・ホールディングス	2.1	—	—
スクロール	2.6	2.3	3,006
ヨンドシーホールディングス	1.7	1.5	3,082
ファミリーマート	13.1	—	—
木曽路	2.1	2.1	5,035
S R Sホールディングス	1.9	2.3	1,987
千趣会	3.1	2.9	971
タカキュー	1.3	1.8	268
リテールパートナーズ	—	1.9	2,758
ケーヨー	3.4	3	2,238
上新電機	1.9	1.8	5,967
日本瓦斯	2.6	2.6	13,858
ロイヤルホールディングス	2.9	2.8	5,342
東天紅	0.1	0.1	93
いなげや	2	1.8	3,132
島忠	3.1	1.1	6,028
チヨダ	1.7	1.7	1,664

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ライフコーポレーション	1.2	1.2	3,996
リンガーハット	2	2	5,046
M r M a x H D	2.2	2.2	1,705
テンアライド	1.6	—	—
A O K Iホールディングス	3.2	3.2	1,907
オークワ	2.6	2.5	3,140
コメリ	2.5	2.5	7,102
青山商事	3.4	3.7	2,612
しまむら	1.9	1.9	22,344
はせがわ	0.8	1.2	350
高島屋	12	11.7	12,331
松屋	3.4	3.6	3,362
エイチ・ツー・オー リテイリング	7.8	7.6	6,292
近鉄百貨店	0.6	0.6	2,055
バルコ	1.6	—	—
丸井グループ	15	13.5	26,419
アクシアル リテイリング	1.3	1.3	6,513
イオン	63.2	61.4	214,224
イズミ	3.3	3.2	12,848
平和堂	3.3	2.9	6,339
フジ	2	1.9	3,855
ヤオコー	1.8	1.8	12,366
ゼビオホールディングス	2	1.9	1,757
ケーズホールディングス	15.8	14.2	21,427
O l y m p i cグループ	0.9	0.8	732
日産東京販売ホールディングス	2.5	2.1	556
シルバーライフ	—	0.2	437
G e n k y D r u g S t o r e s	0.7	0.7	2,695
ナルミヤ・インターナショナル	0.3	0.3	292
総合メディカルホールディングス	1.4	—	—
ブックオフグループホールディングス	1	1	878
ギフト	—	0.2	409
アインホールディングス	2	2.3	16,859
元気寿司	0.4	0.5	1,260
ヤマダホールディングス	50	53.5	29,371
アークランドサカモト	2.5	2.5	3,952
ニトリホールディングス	7.1	6.3	130,252
愛眼	1.4	1.2	284

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ケーユーホールディングス	0.8	0.8	696
吉野家ホールディングス	5.4	5.3	11,718
松屋フーズホールディングス	0.8	0.8	2,960
サガミホールディングス	2.2	2.3	2,769
関西スーパーマーケット	1.4	1.2	1,402
王将フードサービス	1.2	1	5,920
ブレナス	1.8	1.8	3,515
ミニストップ	1.2	1.2	1,744
アークス	3.3	3	7,089
パローホールディングス	3.6	3.2	7,609
藤久	0.2	0.4	321
ベルク	0.8	0.8	4,728
大庄	0.9	1	1,053
ファーストリテイリング	2.2	2.1	200,655
サンドラッグ	6.2	6	24,930
サックスパー ホールディングス	1.4	1.4	798
ヤマザワ	0.4	0.3	521
やまや	0.3	0.3	676
ペルーナ	3.5	3.4	3,519
銀行業 (4.7%)			
島根銀行	0.4	0.7	467
じもとホールディングス	11.3	1.2	987
めぶきフィナンシャルグループ	84.9	83	18,177
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2.3	2.1	2,482
九州フィナンシャルグループ	26.9	32.7	14,420
ゆうちょ銀行	46.4	45	45,855
富山第一銀行	3.8	3.6	1,047
コンコルディア・フィナンシャルグループ	96.6	96.9	38,566
西日本フィナンシャルホールディングス	11.1	10.6	7,197
関西みらいフィナンシャルグループ	9.5	7.5	4,395
三十三フィナンシャルグループ	1.5	1.4	1,866
第四北越フィナンシャルグループ	2.8	2.6	5,993
ひろぎんホールディングス	—	23.5	14,828
新生銀行	12.1	13	17,849
あおぞら銀行	9.8	9.5	20,985
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,131.4	1,092.7	577,601
りそなホールディングス	180.4	173.6	72,668
三井住友トラスト・ホールディングス	31.1	30.2	105,851

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友フィナンシャルグループ	113.7	110.5	397,910
千葉銀行	56.5	53.1	33,506
群馬銀行	32.3	32.8	10,922
武蔵野銀行	2.4	2.3	3,645
千葉興業銀行	4.6	4.3	1,075
筑波銀行	7.1	7.1	1,292
七十七銀行	5.6	5	7,020
青森銀行	1.3	1.3	3,153
秋田銀行	1	1	1,406
山形銀行	1.9	1.9	2,025
岩手銀行	1.1	1.1	2,283
東邦銀行	14.7	14.4	3,024
東北銀行	0.8	0.8	867
みちのく銀行	1.1	1.2	1,260
ふくおかフィナンシャルグループ	13.8	14.4	28,641
静岡銀行	40.6	38.8	30,768
十六銀行	2.1	2	3,978
スルガ銀行	17.1	14.1	4,779
八十二銀行	39.7	36	13,068
山梨中央銀行	1.9	1.9	1,637
大垣共立銀行	3.3	3.1	6,342
福井銀行	1.4	1.4	2,644
北國銀行	1.7	1.5	3,927
清水銀行	0.7	0.7	1,193
富山銀行	0.3	0.3	852
滋賀銀行	3.3	3.2	6,361
南都銀行	2.7	2.3	4,165
百五銀行	14.7	14.4	4,492
京都銀行	5.9	5.7	35,112
紀陽銀行	5.8	5.7	8,082
ほくほくフィナンシャルグループ	10.9	10.6	10,366
広島銀行	24.2	—	—
山陰合同銀行	9.7	10.2	5,069
中国銀行	14.2	13.7	11,768
鳥取銀行	0.5	0.5	563
伊予銀行	23.5	21.1	13,630
百十四銀行	1.7	1.8	2,836
四国銀行	2.5	2.3	1,662

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
阿波銀行	2.7	2.4	5,388
大分銀行	1	0.9	1,889
宮崎銀行	1.1	1	2,231
佐賀銀行	1	0.9	1,239
沖縄銀行	1.5	1.4	3,931
琉球銀行	3.8	3.5	2,695
セブン銀行	55	53.7	13,156
みずほフィナンシャルグループ	2,233	217	332,010
高知銀行	0.6	0.6	453
山口フィナンシャルグループ	20.5	19.8	12,612
長野銀行	0.5	0.5	640
名古屋銀行	1.3	1.3	3,578
北洋銀行	24.9	24	5,568
愛知銀行	0.6	0.5	1,461
中京銀行	0.7	0.6	1,099
大光銀行	0.6	0.6	774
愛媛銀行	2.3	2.2	2,142
トマト銀行	0.6	0.5	525
京業銀行	6.9	6.7	2,867
栃木銀行	8.2	7.9	1,429
北日本銀行	0.5	0.5	949
東和銀行	2.9	2.9	1,963
福島銀行	1.6	2.2	508
大東銀行	0.9	0.8	516
トモニホールディングス	12.7	12.4	3,893
フィデアホールディングス	15.8	16.1	1,883
池田泉州ホールディングス	19.2	18.9	2,986
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	5.1	5.1	3,075
ジャパンインベストメントアドバイザー	—	0.8	999
マーキュリアインベストメント	0.8	0.7	532
S B I ホールディングス	18.4	19.6	61,348
ジャフコ グループ	2.5	2.4	16,176
大和証券グループ本社	131.9	119.6	63,866
野村ホールディングス	289.3	243.9	156,974
岡三証券グループ	14.1	13.5	5,440
丸三証券	5	4.8	2,961
東洋証券	6.1	5.4	815

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19	17.1	6,070
光世証券	0.4	0.4	269
水戸証券	4.9	4.2	1,176
いちよし証券	3	3.3	1,927
松井証券	9.4	7.9	7,157
だいこう証券ビジネス	0.8	—	—
マネックスグループ	12.7	14.4	12,816
極東証券	2.3	2.2	1,753
岩井コスモホールディングス	1.5	1.6	2,452
藍澤證券	2.9	2.8	2,503
マネーパートナーズグループ	1.8	2.1	472
スパークス・グループ	5.6	7.5	2,460
保険業 (1.9%)			
かんぽ生命保険	5.9	19.8	44,312
S O M P O ホールディングス	30.9	28.2	124,446
アニコム ホールディングス	1.4	4.5	5,323
M S & A D インシュアランスグループ ホールディングス	42.9	38.8	125,207
ソニーフィナンシャルホールディングス	13.5	—	—
第一生命ホールディングス	93.1	84.5	153,536
東京海上ホールディングス	58.8	53	293,302
T & D ホールディングス	49.2	47.7	66,446
アドバンスクリエイト	0.4	0.3	565
その他金融業 (1.1%)			
全国保証	4.6	4.2	21,000
ジェイリース	0.5	0.6	440
イントラスト	0.6	0.5	376
日本モーゲージサービス	0.4	0.9	1,040
C a s a	0.6	0.5	508
アルヒ	2.6	2.4	3,938
プレミアムグループ	0.9	0.8	1,840
クレディセゾン	11.5	9.3	12,201
芙蓉総合リース	1.7	1.6	11,904
みずほリース	2.5	2.4	8,316
東京センチュリー	3.3	3.7	29,822
日本証券金融	7.2	6.7	4,214
アイフル	25.5	27.1	7,506
リコーリース	1.3	1.2	3,942
イオンフィナンシャルサービス	10	9.8	13,592

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アコム	33	32.1	14,798
ジャックス	1.8	1.8	3,790
オリエントコーポレーション	44.7	43.8	6,088
日立キャピタル	3.9	3.7	10,663
アプラスフィナンシャル	8.2	—	—
オリックス	102.8	99.1	174,168
三菱UFJリース	41.6	35.9	20,534
九州リースサービス	0.8	0.8	516
日本取引所グループ	47.2	43.2	103,960
イー・ギャランティ	1.8	1.8	4,231
アサックス	0.8	0.9	673
NECキャピタルソリューション	0.7	0.6	1,215
不動産業 (1.9%)			
いちご	20.9	17.9	5,942
日本駐車場開発	18.2	16.4	2,361
スター・マイカ・ホールディングス	0.9	0.9	1,059
SREホールディングス	—	0.2	1,026
ADワークスグループ	—	3.9	612
ヒューリック	35.1	33.9	40,713
三栄建築設計	0.7	0.7	1,263
野村不動産ホールディングス	10	9.7	24,036
三重交通グループホールディングス	3.4	3.2	1,616
サムティ	2.3	2.3	4,117
ディア・ライフ	2.2	2.3	1,044
コーセーアールイー	0.5	0.6	364
ユー・ディー・ワークス	31.5	—	—
日本商業開発	1	1.1	1,861
プレサンスコーポレーション	2.7	2.6	3,944
ユニゾホールディングス	2.5	—	—
THEグローバル社	0.9	1.3	360
ハウスコム	0.2	0.3	396
日本管理センター	1.1	0.9	1,126
サンセイランディック	0.5	0.5	376
エストラスト	0.3	0.3	214
フージャースホールディングス	3.3	2.7	1,900
オープンハウス	4.8	5	22,300
東急不動産ホールディングス	44.8	43.5	30,145
飯田グループホールディングス	13.7	13.3	32,984

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イーグランド	0.3	0.3	256
ムゲンエステート	1.2	1.3	634
ビーロット	0.4	0.9	601
ファーストブラザーズ	0.4	0.3	297
ハウスドゥ	0.8	0.9	1,045
シーアールイー	0.4	0.4	508
プロパティエージェント	0.3	0.3	458
ケイアイスター不動産	0.5	0.5	1,810
アグレ都市デザイン	0.3	0.4	308
グッドコムアセット	0.4	0.8	1,069
ジェイ・エス・ビー	0.2	0.3	1,054
テンポイノベーション	0.4	0.5	463
グローバル・リンク・マネジメント	0.3	0.3	227
パーク24	8.8	8.6	19,427
バラカ	0.4	0.4	664
三井不動産	81.1	72.9	176,527
三菱地所	115.2	105	194,250
平和不動産	3	2.7	10,111
東京建物	18	15.8	24,837
ダイビル	4.3	4.1	5,297
京阪神ビルディング	2.7	2.8	4,365
住友不動産	37	35.9	130,245
テオーシー	3.3	3.1	2,393
東京薬天地	0.3	0.3	1,312
レオパレス21	21.8	—	—
スターツコーポレーション	2.2	1.9	5,648
フジ住宅	1.9	1.9	1,263
空港施設	1.6	1.4	730
明和地所	0.9	0.9	578
ゴールドクレスト	1.3	1.5	2,680
エスリード	0.6	0.6	945
日神グループホールディングス	2.4	2.3	1,007
日本エスコ	3	2.9	2,259
タカラレーベン	7.6	7	2,387
A V A N T I A	1	0.9	818
イオンモール	8.3	8	15,080
毎日コムネット	0.4	0.6	414
ファースト住建	0.7	0.6	666

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カチタス	2	4	12,340
トーセイ	2.3	2.3	2,451
穴吹興産	0.4	0.3	501
サンフロンティア不動産	2.3	1.9	1,742
エフ・ジェー・ネクスト	1.4	1.6	1,844
インテリックス	0.5	0.5	278
ランドビジネス	0.7	0.6	202
サンネクスタグループ	0.5	0.6	591
グランディハウス	1.3	1.1	509
日本空港ビルデング	5.2	5.1	27,336
サービス業 (5.7%)			
明豊ファシリティワークス	—	0.8	514
日本工営	1.1	1	2,771
L I F U L L	5.6	5.5	2,497
ミクシィ	—	3	7,734
ジェイエイシーリクルートメント	1.1	1	1,909
日本M&Aセンター	12	12.7	79,883
メンバーズ	0.5	0.5	1,265
中広	0.2	0.3	102
UTグループ	1.9	2.3	7,716
アイティメディア	0.5	0.5	1,074
タケエイ	1.6	1.8	2,442
E・Jホールディングス	0.3	0.6	603
ビーネックスグループ	2	2	2,550
コシダカホールディングス	3.8	3.8	1,934
アルトナー	0.4	0.4	360
パソナグループ	1.7	1.7	3,415
CDS	0.4	0.3	432
リンクアンドモチベーション	3.6	2.9	1,873
GCA	2	2	1,554
エス・エム・エス	5	5.3	20,590
サニーサイドアップグループ	0.4	0.6	406
パーソルホールディングス	15.9	15.5	34,022
リニカル	0.8	1	767
クックパッド	5.7	5.1	1,601
エスクリ	0.5	0.6	219
アイ・ケイ・ケイ	0.7	0.9	571
学情	0.6	0.6	850

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スタジオアリス	0.8	0.8	1,696
シミックホールディングス	0.9	0.8	1,388
エプロ	0.3	0.4	396
N J S	0.4	0.4	789
総合警備保障	6.3	6.2	31,930
カカコム	11.9	11.4	40,641
アイロムグループ	0.6	0.6	1,202
セントケア・ホールディング	1	1.2	1,156
サイネックス	0.3	0.3	216
ルネサンス	0.9	1.1	1,221
ディップ	2.2	2.4	7,260
デジタルホールディングス	0.9	1.1	2,252
新日本科学	1.8	2	1,364
ソクイホールディングス	3.8	3.7	3,422
キャリアデザインセンター	0.4	0.4	366
ベネフィット・ワン	4.3	5.6	17,136
エムスリー	35.1	27.3	238,137
ソカダ・グローバルホールディング	0.9	1.2	372
プラス	0.2	0.3	143
アウトソーシング	9.1	8.9	13,581
ウエルネット	1.5	1.9	946
ワールドホールディングス	0.5	0.6	1,378
ディー・エヌ・エー	7.8	6.6	14,355
博報堂DYホールディングス	22.1	21.5	38,162
ぐるなび	2.8	2.8	1,702
タカミヤ	1.7	2	1,068
ジャパンベストレスキューシステム	1.1	1.3	1,238
ファンコミュニケーションズ	4.4	4.3	1,754
ライク	0.5	0.4	795
ビジネス・ブレイクスルー	0.7	0.6	271
エスプール	3.1	4	4,124
WDBホールディングス	0.7	0.7	1,984
手間いらず	—	0.2	1,042
ティア	0.9	0.9	411
CDG	0.2	0.1	154
アドウェイズ	—	1.9	1,255
パリュウコマース	0.9	1	3,250
インフォマート	17.5	15.7	15,841

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
J Pホールディングス	5	4.6	1,375
エコナックホールディングス	3	3.3	313
E P Sホールディングス	2.4	2.1	2,587
レッグス	0.4	0.4	736
プレステージ・インターナショナル	6	5.8	4,703
アミューズ	0.9	0.9	2,429
ドリームインキュベータ	0.5	0.5	600
クイック	1	1	1,253
T A C	1	1	264
ケネディクス	14.8	4.4	3,286
電通グループ	16.4	17.4	65,772
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.6	0.8	532
びあ	0.5	0.5	1,542
イオンファンタジー	0.6	0.6	1,469
シーティーエス	1.8	1.8	1,650
ネクシィーズグループ	0.6	0.6	620
H. U. グループホールディングス	4.5	4.4	14,652
アルプス技研	1.4	1.3	2,739
日本空調サービス	1.7	1.6	1,180
オリエンタルランド	16.9	16.4	290,854
ダスキン	4.1	3.6	10,494
明光ネットワークジャパン	1.9	2.1	1,257
ファルコホールディングス	0.9	0.7	1,150
秀英予備校	0.4	0.2	87
田谷	0.3	—	—
ラウンドワン	4.5	5.3	5,755
リゾートトラスト	7.3	7.1	12,517
ピー・エム・エル	2	2	7,750
ワタベウエディング	0.3	0.3	92
りらいあコミュニケーションズ	2.9	2.3	3,192
リソー教育	7.3	8	2,824
早稲田アカデミー	0.5	0.6	599
ユー・エス・エス	17.8	17.3	35,465
東京個別指導学院	0.6	1.4	966
サイバーエージェント	9.2	9.5	64,885
楽天	74.3	72.2	85,701
クリーク・アンド・リバー社	0.8	0.8	989
モーニングスター	—	1.7	839

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
テー・オー・ダブリュー	1.3	2.7	834
山田コンサルティンググループ	0.8	0.9	961
セントラルスポーツ	0.6	0.6	1,436
フルキャストホールディングス	1.6	1.4	2,629
エン・ジャパン	2.8	2.7	9,666
リソルホールディングス	0.2	0.2	815
テクノプロ・ホールディングス	3.2	3.1	25,234
アトラ	0.4	0.5	172
インターワークス	0.3	0.6	228
アイ・アールジャパンホールディングス	0.7	0.6	9,072
Ke e P e r 技研	0.6	1	1,880
ファーストロジック	0.4	0.3	239
三機サービス	0.4	0.3	298
G u n o s y	1	1.1	888
デザインワン・ジャパン	0.3	0.7	150
イー・ガーディアン	0.8	0.7	2,422
リプセンス	1.1	1	240
ジャパンマテリアル	4.9	4.7	7,040
ベクトル	2.1	2	2,652
ウチヤマホールディングス	0.8	0.7	249
チャーム・ケア・コーポレーション	1.4	1.2	1,636
ライクキッズ	0.4	—	—
キャリアリンク	0.6	0.5	1,535
I B J	1.1	1.3	1,423
アサンテ	0.6	0.6	1,034
N・フィールド	1.1	1.1	1,317
バリュースHR	0.3	0.6	1,067
M&Aキャピタルパートナーズ	1.1	1.3	6,526
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.6	0.6	1,251
E R I ホールディングス	0.5	0.4	250
アビスト	0.3	0.2	596
シグマクス	1.1	0.9	1,729
ウィルグループ	1.1	1.2	1,266
エスクロー・エージェント・ジャパン	2.3	2.4	710
メドピア	—	0.7	5,096
レアジョブ	—	0.2	488
リクルートホールディングス	114.1	110.8	568,182
エラン	1	2.1	3,160

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
土木管理総合試験所	0.7	0.9	311
ネットマーケティング	0.6	0.8	483
日本郵政	130.3	116.9	105,174
ベルシステム24ホールディングス	2.7	2.6	4,893
鎌倉新書	1.2	1.6	1,491
SMN	0.3	0.3	229
一蔵	0.2	0.3	120
LITALICO	0.5	0.6	2,295
グローバルキッズCOMPANY	0.3	0.3	271
エアトリ	0.7	0.9	1,545
アトラエ	0.4	0.5	1,745
ストライク	0.6	0.6	2,847
ソラスト	4.4	3.8	6,140
セラク	0.5	0.5	900
インソース	0.8	1.3	2,931
ペイカレント・コンサルティング	1	1	19,670
Orchestra Holdings	0.3	0.4	913
アイモバイル	0.5	0.6	733
キャリアインデックス	0.7	0.6	357
MS-Japan	0.5	0.7	851
船場	0.3	0.4	350
グレイステクノロジー	0.7	0.8	4,928
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1.7	4.4	10,340
フルテック	0.2	0.3	420
グリーンズ	0.4	0.8	408
ツナググループ・ホールディングス	0.2	0.4	159
GameWith	0.4	0.5	290
ソウルドアウト	0.3	0.4	669
MS&Consulting	0.2	0.3	179
エル・ティール・エス	—	0.1	398
ミダック	0.2	0.4	1,358
日総工産	1.1	1.3	1,110
キュービーネットホールディングス	0.7	0.8	1,362
RPAホールディングス	0.9	1.8	1,224
スプリックス	0.6	0.4	319
マネジメントソリューションズ	0.2	0.8	1,515
プロレド・パートナーズ	—	0.2	712
and factory	—	0.2	152

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
テノ・ホールディングス	—	0.1	128
フロンティア・マネジメント	—	0.3	653
ピアラ	—	0.1	207
コプロ・ホールディングス	—	0.1	313
ギークス	—	0.2	313
カープスホールディングス	—	4.3	4,162
フォーラムエンジニアリング	—	0.8	813
ダイレクトマーケティングミックス	—	0.7	2,271
アドバンテッジリスクマネジメント	0.8	0.8	620
リログループ	8.7	8.5	21,836
東祥	1	1	1,745
エイチ・アイ・エス	2.5	2.3	4,738
ラックランド	0.3	0.5	1,202
共立メンテナンス	2.7	2.6	9,828
イチネンホールディングス	1.8	1.6	2,160
建設技術研究所	1.1	1	2,467
スペース	1	1.1	983
長大	0.6	0.6	931
燦ホールディングス	0.7	0.6	699
スバル興業	0.1	0.1	827
東京テアトル	0.7	0.7	914
タナベ経営	0.3	0.3	420
ナガワ	0.5	0.5	5,895
よみうりランド	0.4	0.1	603
東京都競馬	1	1	4,840
常磐興産	0.7	0.8	1,112
カナモト	2.6	2.7	6,382
東京ドーム	6.5	6.3	8,171
西尾レントオール	1.6	1.4	3,588
アゴーラ・ホスピタリティール・グループ	10.6	12.7	330
トランス・コスモス	1.5	1.5	4,293
乃村工藝社	6.8	6.6	5,464
藤田観光	0.7	0.8	1,301
KN T-C Tホールディングス	1	0.9	864
日本管財	1.7	1.6	3,361
トーカイ	1.5	1.5	3,351
白洋舎	0.2	0.2	479
セコム	16.9	15.2	149,644

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セントラル警備保障	0.8	0.8	2,788
丹青社	3	3	2,382
メイテック	2	1.9	10,526
応用地質	1.7	1.8	2,350
船井総研ホールディングス	3.3	3.2	7,936
進学会ホールディングス	0.6	0.6	286
オオバ	1.1	1.1	817
いであ	0.3	0.4	720
学究社	0.5	0.5	667

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ベネッセホールディングス	5.3	5.7	12,688	
イオンディライト	1.9	1.9	5,700	
ナック	0.9	0.7	695	
ニチイ学館	2.3	—	—	
ダイセキ	2.7	2.6	8,944	
ステップ	0.6	0.5	769	
合 計	株 数 ・ 金 額	19,565	16,826	42,868,520
	銘柄数 < 比率 >	2,122	2,134	< 99.8% >

(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 115	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2021年2月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	42,868,520	98.6
コール・ローン等、その他	613,953	1.4
投資信託財産総額	43,482,473	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 (2021年2月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	43,844,825,927
コール・ローン等	555,781,535
株式(評価額)	42,868,520,230
未収入金	10,011,882
未収配当金	57,448,280
差入委託証拠金	353,064,000
(B) 負債	875,323,226
未払解約金	512,971,194
未払利息	32
差入委託証拠金代用有価証券	362,352,000
(C) 純資産総額(A-B)	42,969,502,701
元本	17,193,201,813
次期繰越損益金	25,776,300,888
(D) 受益権総口数	17,193,201,813口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,992円

(注) 当ファンドの期首元本額は18,664,275,035円、期中追加設定元本額は2,076,202,654円、期中一部解約元本額は3,547,275,876円です。

(注) 2021年2月12日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・インデックスファンドTSP	8,873,110,538円
・インデックスファンドTOPIX(日本株式)	7,692,572,923円
・TOPIXインデックスファンド(個人型年金向け)	457,323,608円
・財形株投(一般財形50)	40,116,367円
・財形株投(年金・住宅財形30)	27,122,417円
・時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08	25,135,591円
・時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-11	18,757,161円
・財形株投(一般財形30)	14,240,080円
・時間分散型バランスファンド(成長指向)2017-02	13,830,538円
・時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-08	12,932,357円
・時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11	9,268,925円
・時間分散型バランスファンド(安定指向)2017-02	8,791,308円

(注) 1口当たり純資産額は2,4992円です。

(注) 2021年2月12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	293,172,000円
-----	--------------

○損益の状況 (2020年2月13日～2021年2月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	877,305,287
受取配当金	877,149,016
受取利息	258
その他収益金	186,202
支払利息	△ 30,189
(B) 有価証券売買損益	4,940,629,885
売買益	7,143,839,930
売買損	△ 2,203,210,045
(C) 先物取引等取引損益	83,527,700
取引益	117,462,300
取引損	△ 33,934,600
(D) 保管費用等	△ 32
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	5,901,462,840
(F) 前期繰越損益金	21,796,355,112
(G) 追加信託差損益金	2,051,414,686
(H) 解約差損益金	△ 3,972,931,750
(I) 計(E+F+G+H)	25,776,300,888
次期繰越損益金(I)	25,776,300,888

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

(注) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

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

○お知らせ

約款変更について

2020年2月13日から2021年2月12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。