

# 運用報告書 (全体版)

第53期<決算日2022年9月12日>

## MHAMスリーウェイオープン

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	1993年11月26日から無期限です。	
運用方針	わが国の株式、債券および短期金融資産に分散投資し、資産の組入比率の変更を原則としてタクティカル・アセット・アロケーション・モデルの指示により機動的に行い、信託財産の安定的な成長を目指します。	
主要投資対象	MHAMスリーウェイオープン	わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている株式・公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。なお、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券を組入れることもあります。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）、マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
運用方法	3資産（株式・債券・短期金融資産）の組入比率を機動的に変更し、様々な景気・金利局面において適切な資産配分を目指します。 株式の組入れは、信託財産の純資産総額の30%を上限とします。 債券運用部分は債券市場全体の動きに沿った投資成果を目指します。 有価証券の組入比率を変動させる場合、有価証券先物取引等も利用します。	
組入制限	MHAMスリーウェイオープン	株式（新株引受権証券を含む。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）、マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎年原則として3月10日および9月10日に決算を行い、配当等収益のほかに売買益等の中から運用実績に応じて分配を行います。収益分配に先ず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。 ※分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「MHAMスリーウェイオープン」は、2022年9月12日に第53期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

# MHAMスリーウェイオープン

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指標		東証株価指数(TOPIX、配当込み)		NOMURA-BPI		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	総合	期中 騰落率						
49期(2020年9月10日)	円	円	%		%	ポイント	%		%	%	%	%	%	百万円
	10,158	20	0.9	15,424.97	1.6	2,513.93	17.1	386.72	△1.5	19.4	1.3	60.2	9.6	7,877
50期(2021年3月10日)	10,387	100	3.2	15,784.20	2.3	3,000.94	19.4	384.66	△0.5	25.5	△13.2	56.3	△51.6	7,908
51期(2021年9月10日)	10,557	10	1.7	16,069.46	1.8	3,306.07	10.2	387.92	0.8	23.9	4.2	57.0	11.6	7,839
52期(2022年3月10日)	10,130	0	△4.0	15,671.17	△2.5	2,921.72	△11.6	382.02	△1.5	22.2	△7.1	47.4	△36.4	7,436
53期(2022年9月12日)	10,023	10	△1.0	15,768.29	0.6	3,205.59	9.7	375.51	△1.7	25.2	△7.0	47.7	22.5	7,259

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは、国内株式運用部分についてマザーファンドを組入れることがありますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 参考指標は、東証株価指数(TOPIX、配当込み)を15%、NOMURA-BPI総合を50%、短期金融資産(無担保コール翌日物金利)を35%で合成したものを、設定日の前営業日(1993年11月25日)を10,000として指数化したものです。なお、東証株価指数(TOPIX、配当込み)については、2021年7月1日までは東証株価指数(TOPIX)、2021年7月2日以降は東証株価指数(TOPIX、配当込み)のデータを使用しています(以下同じ)。

(注6) 東証株価指数(TOPIX)の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません(以下同じ)。

(注7) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません(以下同じ)。

(注8) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		参考指標		東証株価指数(TOPIX、配当込み)		NOMURA-BPI総合		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率						
(期首)	円	%	%	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%
2022年3月10日	10,130	-	15,671.17	-	2,921.72	-	382.02	-	22.2	△7.1	47.4	△36.4
3月末	10,262	1.3	15,825.06	1.0	3,142.06	7.5	381.04	△0.3	23.6	5.9	46.7	△43.7
4月末	10,253	1.2	15,750.62	0.5	3,066.68	5.0	380.12	△0.5	22.9	△22.6	46.7	△39.8
5月末	10,277	1.5	15,758.99	0.6	3,090.73	5.8	379.54	△0.6	23.2	△23.1	54.3	8.0
6月末	10,059	△0.7	15,640.81	△0.2	3,027.34	3.6	376.08	△1.6	23.3	△16.8	48.1	△46.6
7月末	10,053	△0.8	15,780.42	0.7	3,140.07	7.5	378.55	△0.9	24.3	△9.3	48.4	△12.3
8月末	10,068	△0.6	15,792.27	0.8	3,177.98	8.8	377.67	△1.1	24.8	5.1	51.1	10.2
(期末)												
2022年9月12日	10,033	△1.0	15,768.29	0.6	3,205.59	9.7	375.51	△1.7	25.2	△7.0	47.7	22.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

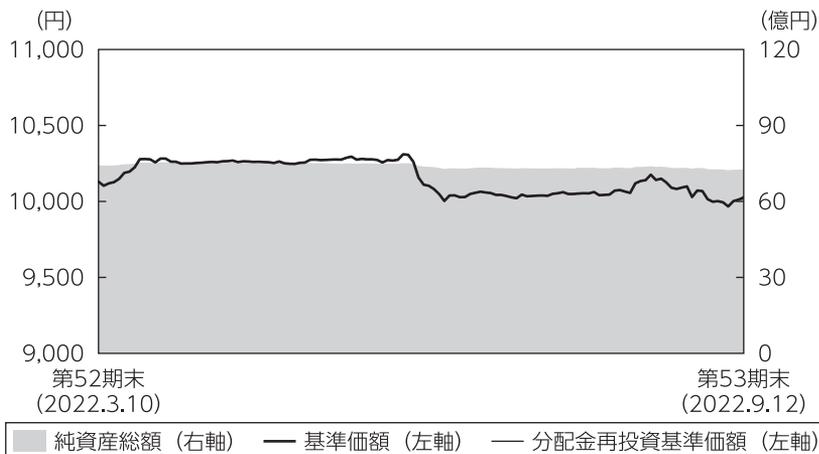
(注2) 当ファンドは、国内株式運用部分についてマザーファンドを組入れることがありますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過 (2022年3月11日から2022年9月12日まで)

### 基準価額等の推移



第53期首： 10,130円  
第53期末： 10,023円  
(既払分配金10円)  
騰落率： △1.0%  
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

主要投資対象の3資産（国内の株式・公社債・短期金融資産）について、当社独自の定量モデル（TAA（タクティカル・アセット・アロケーション＝戦術的資産配分）モデル）を活用して組入比率の変更を行いました。債券市場が下落したことなどから、基準価額は下落しました。

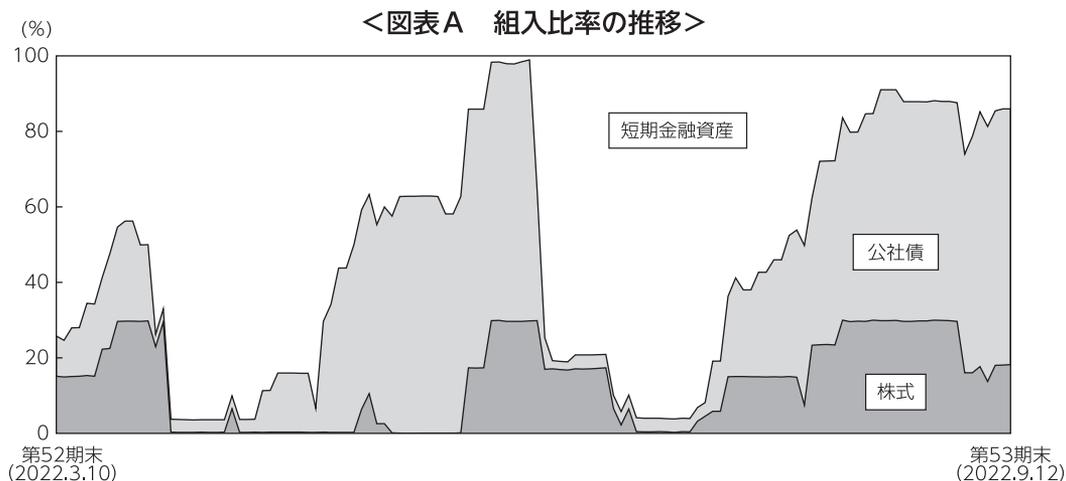
## 投資環境

国内株式市場は上昇しました。日米金融政策の方向性の違いなどから円安が進行したことや、参院選における自民党の改選議席の過半数確保、米利上げへの思惑などが上昇要因となりました。

国内債券市場は下落しました。欧米中央銀行の金融引き締め姿勢により海外金利が上昇したことや、日銀が金融政策の引き締め方向への修正に動くとの思惑などが下落要因となりました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド



(注) 公社債は、NOMURA-BPI総合のデュレーションを基準に調整を加えた組入比率です。また、短期金融資産については100%から株式および公社債を控除した比率を示しています。

## ■TAA（タクティカル・アセット・アロケーション=戦術的資産配分）モデルの活用

主要投資対象の3資産について、TAAモデルを活用して組入比率の変更を行いました。当期の3資産の組入比率は、図表Bの月次モデル基本組入比率をベースに、日次モデルによる組入比率調整（株式は±15%、公社債は±50%の範囲で調整）を行い、図表Aのように推移させました。組入比率の変更には、主に先物取引を用いました。

### ・図表B：当期の月次モデル基本組入比率（単位：％）

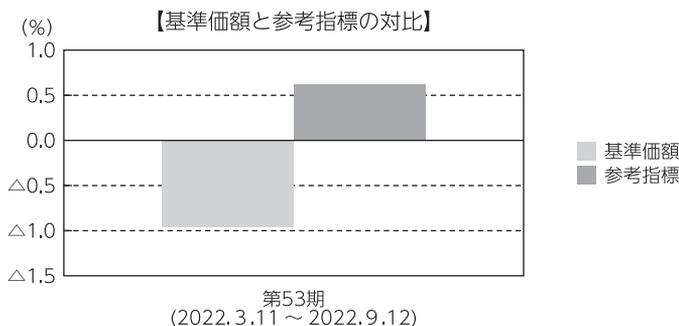
	2022.3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月
株 式	15	0	0	17	0	16	18
公 社 債	20	10	40	50	40	33	73
短期金融資産	65	90	60	33	60	51	10

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

ベンチマークであるTOPIX（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指標の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金は、配当等収益や売買益等の水準、基準価額的水準等を勘案して、下記のとおりといたしました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2022年3月11日 ～2022年9月12日
当期分配金（税引前）	10円
対基準価額比率	0.10%
当期の収益	8円
当期の収益以外	1円
翌期繰越分配対象額	1,104円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

原則としてT A Aモデルの指示に基づいて株式・公社債・短期金融資産の組入比率の変更を行う方針です。使用する運用モデルにつきましては、今後も適宜修正・改良を行って参ります。

株式運用部分につきましては、先物に加えて、T O P I X（配当込み）に連動する国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの組入を継続する方針です。

債券運用部分につきましては、債券市場全体の値動きに沿った投資成果を目標として運用を行う方針です。

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第53期		項目の概要
	(2022年3月11日 ～2022年9月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	48 円	0.476%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,154円です。
(投信会社)	(23)	(0.224)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(20)	(0.196)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	( 6)	(0.056)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.006	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	( 0)	(0.000)	
(先物・オプション)	( 1)	(0.006)	
(c) その他費用	0	0.001	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	( 0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	( 0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	49	0.483	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

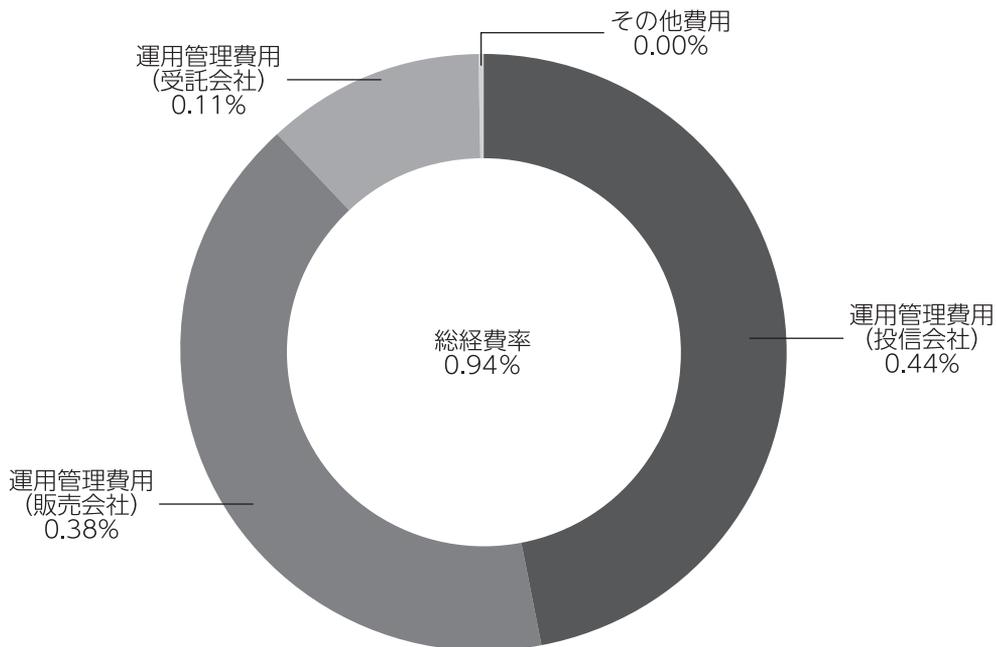
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額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0.94%です。



(注1) 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2) 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3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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異なります。

## ■売買及び取引の状況（2022年3月11日から2022年9月12日まで）

### (1) 公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 1,016,470	千円 1,003,133 (-)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

### (2) 先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	株式先物取引	百万円 1,670	百万円 1,652	百万円 7,297	百万円 7,404
	債券先物取引	7,174	5,530	9,976	12,730

(注) 金額は受渡代金です。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年3月11日から2022年9月12日まで）

期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	439,746,701千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	396,051,038千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.11

(注) (b) は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2022年3月11日から2022年9月12日まで）

### 【MHAMスリーウェイオープンにおける利害関係人との取引状況等】

#### (1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当 期					
	区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 1,016	百万円 203	% 20.0	百万円 1,003	百万円 -	% -
株式先物取引	9,074	9,074	100.0	8,950	8,950	100.0
金銭信託	0.182559	0.182559	100.0	0.182559	0.182559	100.0

## (2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	411千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	311千円
(B)÷(A)	75.6%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

## 【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

## (1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
株 式	百万円 253,039	百万円 164,235	64.9	百万円 186,707	百万円 74,725	40.0
金 銭 信 託	1	1	100.0	1	1	100.0

平均保有割合 0.4%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

## (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	百万円 1,919	百万円 1,391	百万円 3,140

## (3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 3

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

## ■組入資産の明細

(1) 公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	3,370,000	3,466,297	47.7	—	30.6	12.5	4.7
合 計	3,370,000	3,466,297	47.7	—	30.6	12.5	4.7

(注) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

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	
3 3 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	130,000	131,380	2024/03/20
7 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	200,000	208,106	2024/06/20
7 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	100,000	104,738	2024/12/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	600,000	603,378	2026/03/20
1 5 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	200,000	199,908	2027/03/20
9 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	100,000	110,736	2027/09/20
1 0 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	140,000	156,296	2028/03/20
1 0 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	100,000	113,220	2028/06/20
1 0 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	100,000	111,932	2028/09/20
3 6 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	100,000	98,676	2031/09/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	20,000	22,778	2032/09/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	150,000	170,919	2032/12/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	100,000	114,942	2032/12/20
1 0 回 利付国庫債券 (30年)	1.1000	100,000	107,879	2033/03/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	100,000	114,126	2033/06/20
1 4 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	60,000	67,264	2034/03/20
1 5 回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	100,000	123,600	2034/06/20
1 5 1 回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	10,000	10,865	2034/12/20
1 5 6 回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	100,000	97,989	2036/03/20
1 6 7 回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	100,000	96,235	2038/12/20
1 7 0 回 利付国庫債券 (20年)	0.3000	100,000	92,096	2039/09/20
1 7 1 回 利付国庫債券 (20年)	0.3000	120,000	110,144	2039/12/20
1 8 0 回 利付国庫債券 (20年)	0.8000	150,000	146,899	2042/03/20
5 7 回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	170,000	156,814	2047/12/20
1 5 回 利付国庫債券 (40年)	1.0000	220,000	195,373	2062/03/20
合 計	—	3,370,000	3,466,297	—

## (2) 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	T O P I X	百万円 -	百万円 548
	長期国債	1,635	-

## (3) 親投資信託残高

	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	千口 561,857	千口 561,857	千円 1,869,411

## ■投資信託財産の構成

2022年9月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 3,466,297	% 47.3
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	1,869,411	25.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,990,029	27.2
投 資 信 託 財 産 総 額	7,325,738	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年9月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	7,325,738,734円
コール・ローン等	1,924,297,153
公 社 債(評価額)	3,466,297,700
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法) ・マザーファンド(評価額)	1,869,411,402
未 収 入 金	635,765
未 収 利 息	10,744,210
前 払 費 用	1,167,504
差 入 委 託 証 拠 金	53,185,000
(B) 負 債	65,763,631
未 払 金	16,164,240
未 払 収 益 分 配 金	7,243,255
未 払 解 約 金	6,976,623
未 払 信 託 報 酬	35,316,451
そ の 他 未 払 費 用	63,062
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	7,259,975,103
元 本	7,243,255,083
次 期 繰 越 損 益 金	16,720,020
(D) 受 益 権 総 口 数	7,243,255,083口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C / D)	10,023円

(注) 期首における元本額は7,341,514,895円、当期中における追加設定元本額は234,209,843円、同解約元本額は332,469,655円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年3月11日 至2022年9月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	17,284,333円
受 取 利 息	17,505,250
そ の 他 収 益 金	1,042
支 払 利 息	△221,959
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	91,082,043
売 買 益	166,464,009
売 買 損	△75,381,966
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△143,914,209
取 引 益	85,613,606
取 引 損	△229,527,815
(D) 信 託 報 酬 等	△35,379,514
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)	△70,927,347
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	128,856,624
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△33,966,002
(配 当 等 相 当 額)	(374,767,183)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△408,733,185)
(H) 合 計(E + F + G)	23,963,275
(I) 収 益 分 配 金	△7,243,255
次 期 繰 越 損 益 金(H + I)	16,720,020
追 加 信 託 差 損 益 金	△33,966,002
(配 当 等 相 当 額)	(374,858,058)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△408,824,060)
分 配 準 備 積 立 金	425,197,078
繰 越 損 益 金	△374,511,056

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (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4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経 費 控 除 後 の 配 当 等 収 益	6,510,654円
(b) 経 費 控 除 後 の 有 価 証 券 売 買 等 損 益	0
(c) 収 益 調 整 金	374,858,058
(d) 分 配 準 備 積 立 金	425,929,679
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a + b + c + d)	807,298,391
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	1,114.55
(g) 分 配 金	7,243,255
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	10

## ■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金

10円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。  
※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

### 分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
  - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
  - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

- 当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

(2022年3月15日)

- 当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、東京証券取引所の市場区分の再編に伴い、主要投資対象を「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。

(2022年4月4日)

# 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第20期（決算日 2022年2月7日）

（計算期間 2021年2月9日～2022年2月7日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物率	純資産額
	期騰	期中落率	(配当込み) ベンチマーク	期中落率			
16期 (2018年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期 (2019年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
18期 (2020年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
19期 (2021年2月8日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
20期 (2022年2月7日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

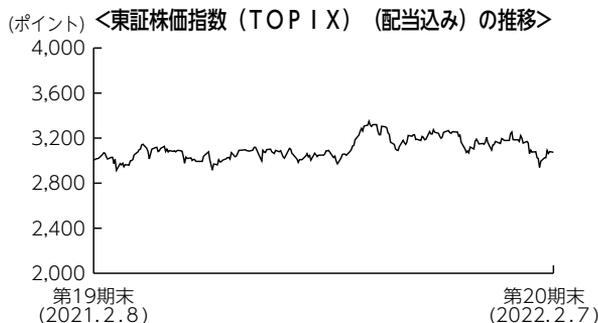
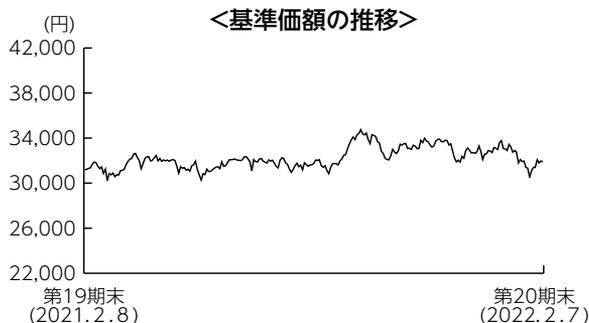
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX) (配当込み) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年 2月 8日	円 31,202	% -	ポイント 3,006.47	% -	% 97.7	% 2.3
2 月 末	30,248	△3.1	2,914.58	△3.1	99.0	1.1
3 月 末	31,972	2.5	3,080.87	2.5	96.2	4.0
4 月 末	31,068	△0.4	2,993.46	△0.4	96.5	3.5
5 月 末	31,493	0.9	3,034.76	0.9	96.6	3.4
6 月 末	31,864	2.1	3,070.81	2.1	96.0	4.0
7 月 末	31,172	△0.1	3,003.91	△0.1	97.2	2.8
8 月 末	32,156	3.1	3,099.08	3.1	97.1	2.9
9 月 末	33,562	7.6	3,234.08	7.6	96.3	3.8
10 月 末	33,082	6.0	3,188.28	6.0	96.8	3.4
11 月 末	31,886	2.2	3,073.26	2.2	84.8	1.0
12 月 末	32,994	5.7	3,179.28	5.7	97.1	3.4
2022年 1 月 末	31,401	0.6	3,025.69	0.6	95.8	4.2
(期 末) 2022年 2月 7日	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2021年2月9日から2022年2月7日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は31,896円となり、前期末比で2.2%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

2021年9月には菅前首相の自民党総裁選への不出馬表明を受けて、新たな政策への期待の高まりから基準価額は上昇しました。その後は、中国不動産開発大手の中国恒大集団の信用リスク懸念、米国での金融引き締めによる金利上昇への警戒感の高まり、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大等を要因として基準価額は下落しました。

### 投資環境

期初から2021年8月までは、国内の感染状況や米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月には、菅前首相の退陣表明を受けて上昇しました。その後、中国恒大集団の信用リスク懸念や米国の金利上昇などを要因として反落しました。その後も、新型コロナウイルスの感染拡大懸念や金融引き締めへの警戒感の高まりなどを受けて下落する場面もありましたが、期末にかけては好決算銘柄を中心に反発しました。

### ポートフォリオについて

ベンチマークである東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

**【運用状況】** (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。  
(注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

○組入上位10業種  
期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	17.6%
2	情報・通信業	9.2
3	化学	7.3
4	輸送用機器	6.9
5	医薬品	5.6
6	機械	5.6
7	サービス業	5.5
8	銀行業	4.6
9	小売業	4.6
10	卸売業	4.4



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.5%
2	輸送用機器	8.5
3	情報・通信業	7.8
4	化学	6.4
5	サービス業	5.7
6	卸売業	5.5
7	銀行業	5.4
8	機械	5.1
9	医薬品	4.7
10	小売業	4.1

○組入上位10銘柄  
期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.0%
2	ソニー	日本・円	2.8
3	ソフトバンクグループ	日本・円	2.7
4	キーエンス	日本・円	2.1
5	任天堂	日本・円	1.3
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.3
7	日本電産	日本・円	1.3
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.3
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	日本電信電話	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,183銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.3%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.0
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
5	リクルートホールディングス	日本・円	1.5
6	東京エレクトロン	日本・円	1.3
7	日本電信電話	日本・円	1.3
8	任天堂	日本・円	1.2
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,174銘柄	

**ベンチマークとの差異について**

ベンチマークは前期末比で2.2%上昇しました。

当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマーク沿ったパフォーマンスとなりました。

**今後の運用方針**

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		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)	1円 (0) (0)	0.002% (0.001) (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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
合 計	1	0.002	
期中の平均基準価額は32,238円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ■ 売買及び取引の状況 (2021年2月9日から2022年2月7日まで)

### (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		192,672.8 (6,584.913)	479,219,336 (-)	161,731.513	395,856,402

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

### (2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 144,564	百万円 142,625	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

## ■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	875,075,739千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	369,108,651千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	2.37

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2021年2月9日から2022年2月7日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 479,219	百万円 130,245	% 27.2	百万円 395,856	百万円 59,442	% 15.0

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 3,678	百万円 3,163	百万円 3,133

### (3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 1,300

### (4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	7,278千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	148千円
(B) / (A)	2.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

# ■組入資産の明細

## (1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額	
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
極洋	5.4	7.2	22,224				矢作建設工業	16.7	20.5	15,641	DM3井製糖ホールディングス	9.5	13.7	27,578							
日本水産	148.6	199.7	103,844				ビーエス三菱	12.2	15.4	9,548	塩水海精糖	14.4	19.9	4,258							
マルハニチロ	25.2	31.4	78,468				日本ハウスホールディングス	25.6	31.7	14,360	日新製糖	4.5	7.6	13,148							
雪国まいたけ	9.9	14.8	17,863				大東建託	40.5	47.2	636,256	森永製菓	27.8	34.8	128,412							
カネコ種苗	4.6	4.9	7,408				新日本建設	15.9	19.9	15,004	中村屋	2.5	2.6	8,710							
サカタのタネ	19.2	24	78,600				N I P P O	30.8	—	—	江崎グリコ	32.7	40.7	153,846							
ホクト	13.6	17	33,320				東亜道路工業	2.4	2.6	13,052	名糖産業	5.6	6.9	11,460							
ホクリヨウ	2.3	3.4	2,363				前田道路	22.9	—	—	井村屋グループ	6.8	8.6	19,169							
<b>鉱業 (0.3%)</b>							日本道路	3.6	4.6	38,180	不二家	7.6	8.5	19,371							
住石ホールディングス	27.8	35.1	4,773				東亜建設工業	9.9	11.5	27,933	山崎製パン	89	110.7	179,887							
日鉄鉱業	3.7	4.6	28,474				日本国土開発	36.3	45.5	24,115	第一屋製パン	2.9	3.5	1,858							
三井鉱山ホールディングス	6.7	8.3	12,640				若築建設	6.7	7.7	13,213	モロゾフ	1.7	3.7	10,175							
I N P E X	590.1	800.9	940,256				東洋建設	41.6	51.7	29,882	亀田製菓	6.9	8.6	33,669							
石油資源開発	21	23.5	66,951				五洋建設	157.5	182.7	116,745	寿スピリッツ	11.4	14.3	78,364							
K&Oエナジーグループ	7.7	9.9	15,246				世紀東急工業	17.9	22.4	18,256	カルビー	54.1	67.3	164,817							
<b>建設業 (2.3%)</b>							福田組	4.3	5	21,950	森永乳業	21.9	27.4	149,604							
ヒノキヤグループ	4	4.5	9,292				住友林業	87.2	118	240,602	六甲バター	8	11	16,280							
ショーボンドホールディングス	22.9	28.5	143,925				日本基礎技術	11.7	12.7	7,975	ヤグルト本社	81.6	109.4	633,422							
ミライト・ホールディングス	55.7	64.4	121,265				巴コーポレーション	16.8	20.7	10,060	明治ホールディングス	78.5	97.6	704,676							
タマホーム	9.7	12.1	29,717				大和ハウス工業	342.4	425.6	1,442,358	雪印メグミルク	28.6	35.6	73,407							
サンヨーホームズ	2.2	2.5	1,827				ライト工業	21.3	29	53,679	プリマハム	16.8	18.6	44,807							
日本アーク	6.4	8.1	5,070				積水ハウス	402.2	500	1,164,500	日本ハム	45.4	56.5	237,865							
ファーストコーポレーション	4.9	6.4	4,454				日特建設	9.9	9.8	6,997	林兼産業	3.6	3.8	1,919							
ベステラ	3	4	5,024				北陸電気工事	6.6	9.8	8,065	丸大食品	11.8	14.8	22,555							
Robot Home	29.9	33.3	7,425				ユアテック	21.3	26.5	18,470	S Foods	10.7	13.3	43,424							
キャンディル	2.8	3.8	1,862				日本リーテック	7.7	9.6	13,468	柿安本店	4.1	5.2	13,577							
スペースリョーホールディングス	19.6	—	—				四電工	1.7	5.2	8,361	伊藤ハム&ポークホールディングス	76.7	95.7	64,310							
ダイセキ環境ソリューション	3.1	3.9	4,555				中電工	17.1	21.3	45,219	サッポロホールディングス	40.5	50.4	112,644							
第一カッター興業	4	5.1	7,063				関電工	60.4	75.2	65,424	アサヒグループホールディングス	259.3	347.2	1,656,144							
安藤・間	102.9	99.1	86,514				きんでん	80.2	103.1	166,506	キリンホールディングス	503.3	542.4	1,020,796							
東急建設	47	58.5	40,131				東京エネシス	12.3	15.5	15,035	宝ホールディングス	87.9	100.4	111,845							
コムシスホールディングス	56.9	64.4	175,683				トーエネック	3.8	4.7	15,110	オノンホールディングス	34.2	43	14,534							
ビーアールホールディングス	19	27.1	9,674				住友電設	10.5	11.5	25,587	養命酒製造	4	5.1	8,981							
福山コンストラクショングループ	10.1	12.6	25,263				日本電設工業	20.4	25.4	37,134	コトコトキョーエツバウホールディングス	90.8	103.7	141,757							
東建コーポレーション	4.9	5.5	50,655				エクシオグループ	56.2	69.8	162,424	サントリー食品インターナショナル	79.5	98.7	443,163							
ソネック	1.7	2.3	2,366				新日本空調	9.8	12.2	24,970	ダイドールグループホールディングス	6.7	7.7	37,345							
ヤマウラ	7.2	10.3	10,186				九電工	26.1	35.6	109,470	伊藤園	36.1	45	279,900							
オリエンタル白石	—	67.8	16,339				三機工業	26.3	30.2	42,823	キーコーヒー	11.8	14.8	30,532							
大成建設	115.4	133.2	508,158				日揮ホールディングス	123.6	141.9	160,914	ユニカフェ	3.9	5	4,790							
大林組	370.8	460.9	434,167				中外炉工業	4.1	4.7	7,562	ジャパンフーズ	1.5	1.7	2,050							
清水建設	347.3	431.8	338,099				ヤマト	11.9	13.8	9,784	日清オイログループ	15.3	18.7	56,287							
飛鳥建設	10.5	12.3	13,161				太平電業	8.2	10.4	28,797	不二製油グループ本社	29	32	74,560							
長谷工コーポレーション	121.3	137.3	200,183				高砂熱学工業	33.5	41.7	79,104	かどや製油	1	1.1	4,411							
松井建設	14.7	18.4	13,082				三晃金属工業	1.6	1.7	4,236	Jーオイルミルズ	5.6	14.2	24,026							
鎌高組	1.2	1.7	6,834				朝日工業社	2.1	3.3	9,543	キッコーマン	85.4	106.3	932,251							
鹿島建設	271.6	337.9	465,964				明星工業	24.1	29.9	20,989	味の素	282.3	325.9	1,055,590							
不動テトラ	9.1	9.8	15,278				大気社	18	22.6	63,777	ブルドックソース	—	6.4	12,524							
大東建設	4.9	5	6,680				ダイダイン	8.2	10.3	23,257	キュービー	66	77.6	186,007							
鉄建建設	7.5	10.3	18,797				日比谷総合設備	12.2	14.9	28,161	ハウス食品グループ本社	44.4	55.3	161,531							
西松建設	26.5	28	104,580				フィル・カンパニー	2.1	2.8	3,166	カゴメ	48.5	56	161,840							
三井住友建設	89.4	103.8	44,426				テスホールディングス	—	8.5	11,313	焼津水産化学工業	4.8	5.1	4,625							
大豊建設	8.1	6.8	25,092				インフロエア・ホールディングス	—	196.5	207,111	アリアケジャパン	10.9	13.5	77,625							
前田建設工業	92.9	—	—				OS J Bホールディングス	54.1	—	—	ビエトロ	1.2	1.2	2,152							
佐田建設	6.7	10.2	4,773				東洋エンジニアリング	15.4	19.4	12,959	エバラ食品工業	2.4	2.5	7,075							
ナカノフード建設	9.7	10.9	3,738				レイズネクスト	20	22.6	25,515	やまみ	1.1	1.7	3,010							
奥村組	20.4	27.1	86,584				<b>食料品 (3.4%)</b>				ニチレイ	56.5	67.3	176,056							
東鉄工業	16	21.5	52,481				ニッポン	35	43.5	72,949	東洋水産	61	71	342,220							
イチケン	2.7	3.5	6,594				日清製粉グループ本社	134.1	167	273,212	イートランドホールディングス	4.2	5.7	13,110							
富士ビー・エス	5	5.9	2,891				日東富士製粉	0.6	1.6	6,392	大冷	1.5	2	3,816							
浅沼組	4.4	5.2	28,132				昭和産業	10.1	14.3	38,181	ソシム・フード・ホールディングス	6.7	7.9	4,005							
戸田建設	154.1	191.4	142,401				鳥越製粉	10.8	13.7	8,863	日清食品ホールディングス	46.5	57.9	518,784							
熊谷組	17.1	23.5	69,842				中部飼料	14.6	16.7	16,983	永谷園ホールディングス	6	6.9	13,461							
北野建設	1.9	2.9	6,194				フィード・ワン	16.2	20.2	14,503	一正蒲鉾	4	6.2	4,811							
榎木組	1.6	4.1	6,076				東洋精糖	1.7	1.8	1,845	フジッコ	13	13.8	26,896							
							日本甜菜製糖	6.4	8.1	13,737	ロック・フィールド	12.8	16	24,704							

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株	数	株	数		株	数	株	数		株	数	株	数
日本たばこ産業	千株	千円	千株	千円	共和レザー	千株	千円	千株	千円	トリケミカル研究所	千株	千円	千株	千円
ケンコーマヨネーズ	636.5	791.4	1,851,876	6.8	昭和電工	9.2	6,127	9.8	14.9	44,342	9.8	14.9	44,342	
くわばや日洋ホールディングス	7.3	8.5	11,517	87.9	住友化学	124.8	297,398	53.3	66.3	167,473	53.3	66.3	167,473	
なとり	7.8	9.6	18,240	911.2	住友精工	1,057.7	619,812	43.6	49.2	252,888	43.6	49.2	252,888	
イフジ産業	2.9	8.1	16,200	5.7	日産化学	6.4	21,184	19	23.6	5,923	19	23.6	5,923	
ピッパルスコーポレーション	6.3	2.5	2,350	63.9	ラサ工業	78.4	516,656	8.7	11	8,987	8.7	11	8,987	
ファーマフーズ	-	7.2	11,419	3.8	クレハ	5	8,095	283.1	325.3	1,709,126	283.1	325.3	1,709,126	
ユーグレナ	51.2	14	22,848	9.9	多木化学	11.5	103,960	3.9	5.4	15,660	3.9	5.4	15,660	
紀文食品	-	75	54,750	4.5	テイカ	5.6	29,400	3	7.5	9,915	3	7.5	9,915	
ミヨシ油脂	4.4	8.6	8,187	8.4	石原産業	10.8	14,850	4.3	5	4,015	4.3	5	4,015	
理研ビタミン	11.2	6.2	6,869	20.6	片倉コープアグリ	23.8	27,631	2.4	3	6,849	2.4	3	6,849	
繊維製品 (0.5%)		15.4	26,257	2.4	東ソー	2.5	2,875	6.9	8.6	44,118	6.9	8.6	44,118	
片倉工業	15.6	13.8	33,092	16.2	トクヤマ	18.4	63,204	9.2	10.3	2,811	9.2	10.3	2,811	
グンゼ	8.5	9.6	37,008	178.9	セントラル硝子	20.7	396,083	13.2	17.8	14,453	13.2	17.8	14,453	
東洋紡	45.8	56.9	74,254	34.3	東亜合成	46	90,666	95.5	541.2	459,478	95.5	541.2	459,478	
ユニチカ	33.8	39.2	11,956	22	大阪ソーダ	80.1	90,352	130.1	149.3	342,792	130.1	149.3	342,792	
富士紡ホールディングス	5.6	6.4	24,288	11.9	関西化成工業	13.5	40,567	34	10	1,540	34	10	1,540	
倉敷紡績	10.7	12.3	23,579	27.3	デンカ	31.6	34,033	27.9	34	30,668	27.9	34	30,668	
シキボウ	6.6	7.9	7,244	42.2	信越化学工業	52.4	190,474	8.7	10.9	9,156	8.7	10.9	9,156	
日本毛織	38.1	43.4	38,929	214.1	日本カーバイド工業	247.4	4,693,178	16	18.3	8,820	16	18.3	8,820	
ダイトウボウ	19.3	23.8	2,118	4.2	堺化学工業	5.2	7,082	8.5	21.2	68,158	8.5	21.2	68,158	
トア紡コーポレーション	4.1	4.3	1,754	8.1	第一稀元素化学工業	10	20,310	48.9	60.9	182,517	48.9	60.9	182,517	
グイードリミテッド	16.6	20.5	2,870	11.7	エア・ウォーター	13.4	15,276	25.3	28.7	28,183	25.3	28.7	28,183	
帝国繊維	13	16.3	32,811	118.1	日本薬業ホールディングス	136.2	238,350	24.5	30.5	58,712	24.5	30.5	58,712	
帯人	109	135.4	187,933	95.3	日本化学工業	138.5	316,195	9.4	11.7	10,120	9.4	11.7	10,120	
東レ	838.4	1,042.5	699,309	3.2	東邦アセチレン	4.6	12,134	207.8	258.5	1,967,702	207.8	258.5	1,967,702	
サカイオーベックス	3.1	-	-	1.9	日本パーカライジフ	2.6	3,302	235	273.9	1,642,578	235	273.9	1,642,578	
住江織物	2.1	3.4	6,504	58.4	高砂香料工業	72.6	74,632	153.7	177.6	268,708	153.7	177.6	268,708	
日本フェルト	5.5	5.9	2,643	18.5	マンダム	23.1	17,278	7.4	10.3	28,953	7.4	10.3	28,953	
イチカワ	1.3	1.4	1,937	1.5	ミルボン	1.7	2,774	24.7	30.9	39,644	24.7	30.9	39,644	
日東製網	1.3	1.7	2,459	15.5	ファンゲル	19	26,600	15.8	18.3	99,735	15.8	18.3	99,735	
アツギ	9.3	11.5	6,704	2.4	コーセー	3.2	9,968	43	59.6	185,356	43	59.6	185,356	
ダイニック	3.6	3.8	2,728	6.3	コタ	7.2	17,978	22.2	27.7	304,146	22.2	27.7	304,146	
セーレン	28.5	29.6	61,952	3.4	シーボン	4.6	24,012	1.3	1.4	2,525	1.3	1.4	2,525	
ソトー	4	6.2	5,139	21	ポレラ・オルビスホールディングス	24.2	144,716	50.5	62.8	108,895	50.5	62.8	108,895	
東海染工	1.3	1.4	1,605	9.6	ノビアホールディングス	12	27,108	10	12.6	63,252	10	12.6	63,252	
小松マテール	19.1	23.6	29,877	30	アジパルホールディングス	37.3	145,843	3	3.5	3,846	3	3.5	3,846	
ワコールホールディングス	28.9	35.9	73,738	116	三菱瓦斯化学	133.8	285,529	2.4	4	5,300	2.4	4	5,300	
ホギメディカル	15.6	19.5	61,425	100	三井化学	130.8	397,632	7.7	9.5	14,601	7.7	9.5	14,601	
クラウディアホールディングス	2.4	2.5	590	116.2	J S R	134.4	463,680	4.5	5	6,515	4.5	5	6,515	
T S Iホールディングス	34.7	47.9	15,807	19.9	東京応化工業	23.3	147,955	19.5	24.1	38,222	19.5	24.1	38,222	
マツカコーポレーション	3.7	4.6	5,409	10.7	大阪有機化学工業	12.2	36,429	20.5	25.5	61,786	20.5	25.5	61,786	
ワールド	15.1	18.9	22,264	774.1	三菱ケミカルホールディングス	962.6	807,910	6.9	8.6	5,633	6.9	8.6	5,633	
三陽商会	6	6.9	5,954	19.1	K Hネオケム	23.7	72,640	33.1	41.3	391,111	33.1	41.3	391,111	
ナイガイ	3.8	4.1	1,160	155.5	ダイヤセル	207.2	181,507	9.9	12.3	13,849	9.9	12.3	13,849	
オンワードホールディングス	69.3	86.3	25,631	18.2	住友ベークライト	22.8	121,752	8.1	11	33,880	8.1	11	33,880	
ルックホールディングス	4	4.6	6,076	244.9	積水化学工業	301.3	583,618	3.3	4.1	10,569	3.3	4.1	10,569	
キムラタン	68.3	79.9	1,518	104.5	日本ゼオン	129.8	175,489	31	38.5	88,280	31	38.5	88,280	
ゴールドウイン	19.1	26	158,340	32.2	アイカ工業	40.1	127,317	13.3	16.6	75,613	13.3	16.6	75,613	
デサント	19.8	28.1	97,085	58.4	宇部興産	67.8	147,058	7.3	9.3	6,045	7.3	9.3	6,045	
キング	4.6	6.7	3,463	19.1	積水樹脂	21.9	43,843	2.7	3.2	6,425	2.7	3.2	6,425	
ヤマインターナショナル	10.6	13.3	3,790	25.2	タキロンシーアイ	31.4	17,552	33	38.2	118,420	33	38.2	118,420	
パルプ・紙 (0.2%)				6.6	旭有機材	8.1	17,528	8.9	12.1	71,027	8.9	12.1	71,027	
特種東海製紙	7.2	8.9	37,291	6.2	ニチバン	8.6	14,852	10.9	13.8	10,874	10.9	13.8	10,874	
王子ホールディングス	521.3	602.3	363,789	28.2	リケンテクノス	35.4	16,142	3.7	4.6	12,962	3.7	4.6	12,962	
日本製紙	51.1	69	81,213	5.5	大倉工業	7.5	15,037	48.8	54.8	44,223	48.8	54.8	44,223	
三菱製紙	17.1	21.3	6,794	15.6	積水化成工業	19.6	8,800	21.2	26.4	14,018	21.2	26.4	14,018	
北越コーポレーション	82.9	94.7	74,244	2.2	群栄化学工業	3.5	12,075	8.2	9.4	11,637	8.2	9.4	11,637	
中越パルプ工業	4.7	5.6	5,538	6.7	タイガースポリマー	8.5	3,714	16.5	21.5	21,414	16.5	21.5	21,414	
巴川製紙所	3.7	4.6	3,762	3.7	ミライアル	4.7	6,974	75.7	89	775,190	75.7	89	775,190	
大王製紙	56	69.6	133,284	4.3	ダイキアクシス	5.6	3,925	14	19.1	18,106	14	19.1	18,106	
阿波製紙	3	4	1,324	24.5	ダイキョーニシカワ	30.7	18,696	12.4	15.5	5,766	12.4	15.5	5,766	
レンゴウ	119.4	136.3	117,763	4.2	竹本容器	5.3	4,202	18.9	22.9	4,854	18.9	22.9	4,854	
トーモク	7.2	9	15,849	6.3	森六ホールディングス	7.9	15,634	10.6	13.2	54,978	10.6	13.2	54,978	
ザ・パック	8.7	11	29,931	1.7	恵和	3.6	18,504	7.8	9.5	11,789	7.8	9.5	11,789	
化学 (6.6%)				71.6	日本たばこ	113.4	132,224	4.3	5.5	8,475	4.3	5.5	8,475	
北の達人コーポレーション	41.4	51.4	11,205	11.5	カーリットホールディングス	14.3	10,052	4	5.6	3,931	4	5.6	3,931	
クラレ	182.3	210.4	217,764	8.4	日本精化	11.6	24,070	7	8.7	13,685	7	8.7	13,685	
旭化成	767.5	954.1	1,064,775	9.1	扶桑化学工業	12.9	61,081	21.8	27	91,125	21.8	27	91,125	

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株	数	価 値	株	数	評 価 額		株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数	評 価 額
		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
天馬		8.9	30,206		11.6	30,206	パナドール化学		20.9	24	21,216	日本軽金属ホールディングス		31.9	36.7	65,582					
信越ポリマー		18.2	29,409		26.4	29,409	ガス・土壌 (0.8%)					三井金属鉱業		31.6	39.4	128,444					
東リ		31.1	8,691		38.8	8,691	日東紡績		17.5	22	64,658	東邦亜鉛		6.5	8.1	19,658					
ニフコ		43.4	168,413		49.1	168,413	A G C		108.6	135.1	680,904	三菱マテリアル		77.2	95.9	199,951					
バルカー		9.7	30,336		12	30,336	日本板硝子		59.8	70.5	32,853	住友金属鉱山		149.4	185.8	998,303					
ユニ・チャーム		250.8	1,248,377		283.4	1,248,377	石塚硝子		2.1	2.5	5,107	DOWAホールディングス		29.6	39.7	205,646					
ショーエイコーポレーション		2.6	2,648		4	2,648	日本山村硝子		5.3	5.7	4,474	古河機械金属		19.3	24.1	30,438					
<b>医薬品 (4.9%)</b>							日本電気硝子		43.8	59.1	166,130	エス・サイエンス		54.7	69	1,587					
協和キリン		119	504,802		172.7	504,802	オハラ		4.7	5.9	6,549	大前チタニウムテクノロジーズ		12	16.7	14,345					
武田薬品工業		983.7	3,978,386		1,155.5	3,978,386	住友大阪セメント		21.3	27.3	96,505	東邦チタニウム		20.9	26.2	23,946					
アステラス製薬		1,025.1	2,576,806		1,274.7	2,576,806	太平洋セメント		70	83.5	192,634	U A C J		17.7	22.2	51,415					
大日本住友製薬		87.6	112,897		90.9	112,897	日本ヒューム		11	15.4	10,641	C K サンエツ		2.1	3.2	12,848					
塩野義製薬		148.7	1,475,443		184.8	1,475,443	日本コンクリート工業		25.4	29.1	8,235	古河電気工業		36.4	45.2	99,666					
わかもと製薬		14.3	5,332		17.6	5,332	三谷セキサン		5.5	6.9	44,988	住友電気工業		407.9	543.6	848,559					
あすか製薬		13.4	—		—	—	アジアビルホールディングス		18.5	23.3	10,298	フジクラ		141.1	162	100,440					
日本新薬		33.5	294,140		38.5	294,140	東海カーボン		115.5	123.2	141,310	昭和電線ホールディングス		11.3	12.6	23,927					
ビオフェルミン製薬		2.2	—		—	—	日本カーボン		6.5	7.6	30,324	東京特殊電線		1.5	1.7	4,921					
中外製薬		369.8	1,867,140		460	1,867,140	東洋炭素		7	9.5	27,559	タツタ電線		20.6	25.7	11,590					
科研製薬		20.2	94,825		23.1	94,825	ハタカカン(仁)リミテド		6.6	8.2	36,982	カネレ電気		2.2	2.8	4,253					
エーザイ		130.6	1,012,927		176.1	1,012,927	T O T O		84.5	105	512,925	平河ヒューテック		6.5	8.2	9,585					
ロート製薬		56.3	75,524		75.5	75,524	日本碍子		230	159.3	296,616	リョービ		14.2	17.9	20,083					
小野薬品工業		271.5	955,576		337.6	955,576	日本特殊陶業		90	111.9	246,739	アーレスティ		14.6	15.4	5,836					
久光製薬		34.4	142,784		38.8	142,784	ダントーホールディングス		8.6	9.5	3,344	アサヒホールディングス		21.9	58.3	128,376					
持田製薬		16.4	69,564		18.7	69,564	M A R U W A		4.1	5.1	70,482	<b>金属製品 (0.6%)</b>									
参天製薬		205.7	362,086		274.1	362,086	黒川フラクトリブズ		2.8	3.5	13,772	稲葉製作所		6.7	8.3	10,665					
扶桑薬品工業		3.8	11,679		5.2	11,679	高崎橋磨		2	2.7	11,947	宮地エニフリンググループ		3.8	4.6	14,628					
日本ケミファ		1.2	2,547		1.2	2,547	ヨータイ		8.6	9.4	12,097	トーカロ		30.2	37.6	49,632					
ツムラ		39.5	153,552		45.7	153,552	イソライト工業		5.3	6.6	7,906	アルファ		4.5	4.8	5,294					
日医工		33.4	34,063		45.6	34,063	東京薬業		15.7	19.4	5,975	S U M C O		149.6	223.9	444,217					
キッセイ薬品工業		20.9	61,805		26.2	61,805	ニッカトー		5.4	6.8	4,168	川田テクノロジーズ		2.4	3	11,910					
生化学工業		20.9	24,700		26	24,700	フジミンコーポレートド		9.5	11.9	79,135	R 5 Technologies		3.8	4.7	26,555					
栄研化学		20.8	46,309		25.9	46,309	クニミネ工業		3.8	4.9	4,914	ジェイテックコーポレーション		1	1.6	2,529					
白水製薬		4.6	5,823		5.9	5,823	エーアンドエーマテリアル		2.4	3.2	2,880	信和		6.4	9.1	7,543					
鳥居薬品		7.4	25,120		8	25,120	ニチアス		29.9	34.2	88,749	東洋製鋼所ホールディングス		74.5	92.6	140,659					
J C R ファーマ		33.3	84,328		41.5	84,328	ニチハ		16.5	20.5	53,669	ホッカンホールディングス		6	8.2	11,627					
東和薬品		17.1	61,823		21.1	61,823	<b>鉄鋼 (0.8%)</b>					コロナ		6.8	8.6	7,731					
富士製薬工業		8.1	9,090		9.1	9,090	日本製鉄		558.1	650.6	1,279,730	横河リソジホールディングス		20.1	25	51,000					
沢井製薬		25.9	—		—	—	神戸製鋼所		213.7	271.2	154,312	駒井ハルテック		2.4	2.9	6,878					
ゼリア新薬工業		21.5	51,325		26.9	51,325	中山製鋼所		17.1	23.1	10,418	高田機工		0.8	0.7	1,989					
第一三共		1,015	2,727,321		1,155.4	2,727,321	合同製鐵		6.3	7.9	10,657	三和ホールディングス		110.2	137.1	164,794					
キョーリン製薬ホールディングス		26.1	54,967		29.6	54,967	ジェイエフイーホールディングス		338.2	392.6	602,641	文化シヤッター		34.6	46.4	47,699					
大幸薬品		14.5	14,338		22.3	14,338	東京製鐵		45.6	49.6	56,891	三協立山		15	18.9	11,623					
ダイト		7.5	26,479		9.4	26,479	共英製鋼		13.1	16.5	25,789	アルインコ		7.8	10.9	9,919					
大塚ホールディングス		245.8	1,249,800		305.5	1,249,800	大和工業		24.9	28	104,160	東洋シヤッター		2.4	2.5	1,357					
大正製薬ホールディングス		28.1	199,150		35	199,150	東京製鋼		4.5	6.4	8,652	L I X I L		161	228.9	575,912					
ペプチドリーム		60.1	155,742		77.1	155,742	大阪製鐵		6.3	7.9	9,653	日本フイルコン		8.5	10.9	5,831					
あすか製薬ホールディングス		—	17,421		16.8	17,421	淀川製鋼所		15.9	19.3	50,373	ノーリツ		24.3	28	45,780					
サワグルーブホールディングス		—	145,061		32.2	145,061	丸一鋼管		37.9	51.5	136,063	長府製作所		12	14.9	28,980					
<b>石油・石化製品 (0.4%)</b>							モリ工業		3.5	4.5	11,403	リンナイ		22.7	27.4	277,014					
日本コークス工業		100.5	17,332		123.8	17,332	大同特殊鋼		19.1	23.8	102,340	ダイニチ工業		5.7	7.2	5,133					
ニチレキ		14	24,381		18.9	24,381	日本高周波鋼業		4	4.2	1,428	日東精工		15.1	18.4	9,568					
ユシロ化学工業		6.8	8,500		7.9	8,500	日本冶金工業		9.1	10.8	31,968	三洋工業		1.3	1.4	2,532					
ピービー・カストロール		4.3	7,155		5.5	7,155	山陽特殊製鋼		14	15	33,135	シーテフト		24.1	27.8	20,822					
富士石油		28.8	10,086		39.4	10,086	愛知製鋼		6.6	8.2	21,197	東レ		21.9	27.1	33,360					
M O R E S C O		4.5	5,997		5.1	5,997	日立金属		110.3	156.7	327,189	高周波熱錬		22.3	25.9	15,306					
出光興産		131.2	502,147		163.3	502,147	日本金属		2.9	3.6	3,880	東京製鋼		8.2	8.9	7,885					
ENEOSホールディングス		1,778.3	1,036,201		2,210.8	1,036,201	大太平洋金属		7.8	8.9	26,619	サンコール		10.3	12.9	7,198					
コスモエネルギーホールディングス		37.3	101,217		42.6	101,217	新日本電工		75.3	93.6	30,513	モリテックススチール		9	11.4	3,693					
<b>ゴム製品 (0.7%)</b>							栗本鐵工所		5.4	6.8	10,608	パイオラックス		17	21.6	38,750					
横浜ゴム		68.4	145,350		85	145,350	虹 技		1.3	2.3	2,178	エイチワン		11.6	14.4	9,432					
TOYO TIRE		62.2	126,557		77.5	126,557	日本鑄鉄管		1.4	1.6	1,601	日本発条		116.4	133.7	120,330					
ブリヂストン		314.4	2,201,872		423.6	2,201,872	三菱製鋼		8.8	9.2	11,546	中央発條		1	7.2	5,724					
住友ゴム工業		106	156,934		132.1	156,934	日本精線		1.7	2.5	11,200	アドパネクス		1.6	2.2	3,260					
藤倉コンポジット		10.8	9,674		11.9	9,674	エンビロ・ホールディングス														

銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
三浦工業	50.6	63	207,585	帝国電機製作所	8.3	10.6	13,939	三菱重工業	185.7	231	737,583									
タフマ	39.6	49.2	70,060	東京機械製作所	4.3	-	-	IHI	79.5	91.8	214,353									
ツガミ	24.2	31.9	41,629	新東工業	28.2	32.6	22,689	サノヤホールディングス	15.5	17	2,227									
オークマ	13.6	16.9	81,458	澁谷工業	10.4	12.8	32,256	スター精密	18.2	22.8	33,288									
芝浦機械	12.2	16.5	50,902	アイチコーポレーション	20.5	21.7	17,967	電気機器 (18.0%)												
アマダ	171.2	229.4	251,651	小森コーポレーション	30.1	37.5	26,100	日清紡ホールディングス		72	89.8									
アイダエンジニアリング	30.7	38.2	39,498	鶴見製作所	9.2	11.5	19,630	イビデン		56.8	77.2									
滝澤鉄工所	3.9	4.8	5,726	住友精密工業	1.9	2.4	4,524	コニカミノルタ		239.4	320.9									
FUJI	46.6	67	168,103	日本ギア工業	6	6	1,578	ブラザー工業		144.3	179.5									
牧野フライス製作所	13.7	16	60,320	酒井重工業	1.9	2.7	7,641	ミネベアミツミ		203.7	253.4									
オーエスジー	57.6	67.3	136,551	荏原製作所	49	61.1	338,494	日立製作所		568.4	707.2									
ダイジェット工業	1	1.1	1,083	石井鐵工所	1.2	1.2	3,584	東芝		-	256.9									
旭ダイヤモンド工業	31	38.3	23,133	西島製作所	12.2	13.5	12,433	三菱電機		1,182.4	1,470.1									
DMG森精機	73.9	86.3	149,557	北越工業	12.4	14	12,600	富士電機		71.2	88.6									
ソディック	25.6	32.2	25,599	ダイキン工業	150.6	187.4	4,194,949	東洋電機製造		4.7	5.9									
ディスコ	15.9	21.5	693,375	オルゴ	3.8	4.2	32,550	安川電機		127.3	158.4									
日東工器	5.7	8.1	13,024	トーヨーカネツ	4.4	5.5	14,069	シニアテクノロジ		15.4	17.7									
日進工具	4.6	11.6	16,576	栗田工業	64	79.7	379,770	明電舎		20	24.9									
パンチ工業	9.9	12.2	5,990	椿本チエイン	16.9	19.4	62,856	オリジン		2.6	4									
富士ダイス	6.4	6.8	4,182	大同工業	4.6	6.7	6,231	山洋電気		5.7	6.6									
豊和工業	6.5	7.9	6,557	木村化工機	9.8	12.2	9,064	デンヨー		10.1	12.6									
OKK	4.8	5.6	4,244	アナスト岩田	20	23	18,653	PHCホールディングス		-	16.9									
石川製作所	3	3.9	5,752	ダイフク	65.1	81	690,930	東芝テック		12.7	16									
東洋機械金属	8.4	9.9	5,613	サムコ	2.9	3.6	8,067	芝浦メカトロニクス		2.1	2.7									
津田駒工業	2.4	3.4	1,975	加藤製作所	6.4	6.9	5,837	マブチモーター		32.7	34.1									
エンシュウ	2.4	3.5	2,289	油研工業	1.7	1.8	3,117	日本電産		284.6	381.1									
島精機製作所	17.1	21.2	37,078	タダノ	57	77	74,998	ユー・エム・シー・エレクトロニクス		7	6.6									
オプトラン	14.6	18.3	42,016	フジテック	40.8	54.6	147,420	トレックス・セミコンダクター		6.4	7.5									
NCホールディングス	3.1	4.1	6,629	CKD	27.4	43.4	89,317	東光高岳		6	8.2									
イワキ	7.6	9.4	9,428	キトー	10	12.6	21,256	ダブル・スコープ		23.2	42.3									
フリュー	11.5	12.8	16,473	平和	32.9	41.1	78,090	ダイヘン		12.9	16.1									
ヤマシンフィルタ	23.5	29.3	11,221	理想科学工業	9.2	12.3	27,416	ヤーマン		19.3	24									
日阪製作所	14.8	18.3	15,060	SANKYO	28	31.8	96,513	JVCケンウッド		101.9	119.5									
やまびこ	22.6	28.3	29,941	日本金銭機械	13.2	15	9,660	ミキエンジニアリング		11	13.3									
野村マクロ・サイエンス	-	3.9	16,282	マースグループホールディングス	7.6	9.4	15,199	I-PEX		5.5	6.9									
平田機工	5.5	6.9	39,054	フクシマガリレイ	8.1	10.3	43,105	日新電機		27.7	34.7									
ベガサスミシン製造	12.2	15	8,565	オーイズミ	5.1	5.4	2,133	大崎電気工業		23.4	26.8									
マルマエ	4.3	6	14,268	ダイコク電機	5.6	6.9	8,583	オムロン		98.4	122.4									
タツモ	4.9	6.9	9,694	竹内製作所	19.7	22.4	63,212	日東工業		17.3	19.6									
ナプテスコ	68.9	82.9	290,564	アマノ	31	38.5	84,199	IDEC		15.9	18.3									
三井海洋開発	12.4	15.5	18,693	JUKI	16.5	20.5	15,723	正興電機製作所		2.7	4.6									
レオン自動機	11.4	15.6	16,270	サンデン	16.5	20.4	3,957	不二電機工業		2.3	3.4									
SMC	34.6	43.1	2,754,521	ジャノメ	10.6	12.5	9,062	ジーエス・ユサフ コーポレーション		42.4	47.9									
ホソカワミクロン	4.1	10.3	29,530	マックス	16.3	19.7	34,947	ザクサホールディングス		2.8	2.9									
ユニオンツール	4.4	5.5	20,405	グローリー	30.4	37.7	78,755	メルコホールディングス		4.1	3.3									
オイレ工業	16.5	20.5	33,066	新晃工業	11	13.8	25,267	テクノメディカ		2.8	3.5									
日精工・エス・ビー機械	3.4	4.9	14,327	大和冷機工業	19	21.2	23,977	ダイキモトエレクトロニクスホールディングス		3.4	4.1									
サトーホールディングス	15.4	19.3	39,121	セガサミーホールディングス	107.5	145.9	302,158	日本電気		150.2	186.9									
技研製作所	10.3	12.8	49,792	日本ビストロリング	4.5	5.4	7,225	富士通		106.4	132.4									
日本エアテック	3.8	6.8	7,459	リケン	5.5	6.4	17,299	沖電気工業		47.9	59.8									
カワタ	3.2	4.7	5,010	TPR	16	19.9	29,631	岩崎通信機		4.4	6.3									
日精樹脂工業	9.2	10.4	10,649	ツバキ・ナカシマ	22.5	32.2	46,657	電気興業		5.7	7.9									
オカダアイオン	3.8	4.7	6,909	ホシザキ	37.2	43	373,240	サンケン電気		13.8	13.8									
ワイエイシイホールディングス	4.6	5.7	7,022	大豊工業	9.8	12	8,592	ナカヨ		1.9	2.2									
小松製作所	535.7	666.1	1,878,068	日本精工	242.6	276.6	206,620	アイホン		6.8	8.5									
住友重機械工業	67.6	84.1	249,356	NTN	272.6	314.8	73,348	ルネサスエレクトロニクス		508.7	796.7									
日立建機	55.3	58.9	172,577	ジェイテクト	113.3	140.9	147,663	セイコーエプソン		146.6	182.4									
日工	17.6	20.4	12,444	不二越	11	12.6	53,109	ワコム		85.5	114									
巴工業	4.8	5.9	13,044	日本トムソン	32.2	40.2	24,964	アルバック		21.8	29.3									
井関農機	11.8	13.7	18,303	THK	73.7	83	233,977	アクセル		4.9	6.3									
TOWA	11	12.6	30,769	ユーシン精機	7.9	11.7	8,154	EIZO		10	11.5									
丸山製作所	2.4	3.2	4,793	前澤給装工業	4.2	11.4	11,149	ジャパンディスプレイ		404	500									
北川鉄工所	5.5	6.8	9,526	イーグル工業	14.7	18.3	19,599	日本信号		27.6	37.5									
ローツェ	5.2	7.4	75,924	前澤工業	7.3	8.9	5,936	京三製作所		25.4	31.6									
タカキタ	4.3	5	3,050	日本ビラー工業	12.1	14.9	46,190	能美防炎		15.7	19.5									
クボタ	621.2	712.6	1,707,745	キッツ	36.6	49.7	33,000	ホーチキ		8.6	10.9									
荏原実業	2.9	6.9	15,035	マキタ	154.2	179	711,883	星和電機		5.9	7.2									
三菱化工機	3.7	4.7	9,494	三井E&Sホールディングス	45.7	53	19,610	エレコム		13.5	33.7									
月島機械	21.8	27.3	28,310	日立造船	93.7	124.3	92,354	パナソニック		1,260.9	1,568.1									

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株
シャープ	136.8		167.6	208,997		千円	カシオ計算機	95.1	106.5	148,780		千円	本田技研工業	930.9	1,157.5	3,938,972		千株	千円	
アンリツ	71		94.6	149,562			ファナック	103.8	129.1	2,875,057			スズキ	234.4	336.2	1,614,768				
富士通ゼネラル	36.2		39.9	97,994			日本シイエムケイ	25.5	28.9	16,241			S U B A R U	338.8	421.2	847,665				
ソニーグループ	740.6		921.1	11,661,126			エンプラス	5.3	3.6	9,478			安永	5.7	7.2	6,278				
T D K	57.1		213	970,215			大真空	4	19.9	24,297			ヤマハ発動機	167.1	191.9	532,906				
帝国通信工業	5.6		6.7	9,112			ローム	49.2	65.8	604,044			T B K	11.8	16.9	6,929				
タムラ製作所	42.3		56.8	36,749			浜松ホトニクス	84.8	105.5	612,955			エグセディ	16	22.3	37,664				
アルプスアルパイン	96.5		129.9	164,713			三井ハイテック	11.6	14.6	124,100			豊田合成	38.2	47.4	106,507				
池上通信機	4		5	3,215			新光電気工業	39.7	43.2	214,920			菱三工業	18.5	23.1	17,094				
日本電波工業	11.5		13.3	16,651			京セラ	180.2	206.9	1,416,437			盟和産業	1.6	1.7	1,723				
鈴木	5.3		6.8	5,882			太陽誘電	52.5	71.3	377,177			日本プラス	10.3	11.5	6,428				
メイコー	—		12	44,700			村田製作所	347.3	431.9	3,556,264			ヨロズ	10.2	13.9	14,011				
日本トリム	2.5		2.9	8,816			双葉電子工業	20.3	25.1	16,892			エフ・シー・シー	19.3	24	34,248				
ロランド ディー・ジ	7		8.7	22,985			北陸電気工業	4.6	5.5	6,897			シマノ	44.3	59.1	1,533,054				
フォスター電機	12.4		14.8	11,928			ニチコン	37.1	46.3	55,467			ティ・エス テック	27.4	62.1	97,000				
S M K	3.1		3.5	7,570			日本ケミコン	11.9	14	26,082			ジャムコ	7	8.6	7,146				
ヨコオ	8.7		10.9	28,656			K O A	16.3	22.3	32,290			<b>精密機器 (2.7%)</b>							
ティアック	7.3		23.5	3,125			市光工業	17.6	17.7	9,062			テルモ	362.5	416	1,724,320				
ホンデン	32.2		35.4	42,480			小糸製作所	70.8	80.7	472,095			クリエートメディック	4.2	4.3	4,166				
ヒロセ電機	18.2		22.8	393,984			ミツバ	21.7	27	11,205			日機装	38.2	44.1	37,529				
日本航空電子工業	27		33.7	61,738			S C R E E Nホールディングス	20.5	25.6	288,000			日本エム・ディ・エム	6.8	8.6	13,837				
T O A	14		16	12,432			キャノン電子	10.9	13.7	22,084			島津製作所	152.2	189.3	779,916				
マクセル	23.4		29.3	36,039			キャノン	587.5	730.5	2,043,939			J M S	10	12.3	7,576				
古野電気	15.1		17.4	18,339			リコー	300.7	408.1	400,754			グボテック	3.1	3.3	858				
ユニテホールディングス	3		3.3	11,913			象印マホービン	31.9	39.8	58,625			長野計器	8.5	10.8	14,450				
スミダコーポレーション	10		13.9	13,538			M U T O Hホールディングス	1.2	1.2	2,510			ブイ・テクノロジ	5.5	6.4	21,760				
アイコム	4.9		5.5	12,980			東京エレクトロン	69.3	93.3	5,156,691			東京計器	7.5	9.4	9,559				
リオン	5		5.6	12,280			<b>輸送用機器 (8.7%)</b>						愛知時計電機	1.2	3.7	7,074				
本多通信工業	9.4		11.9	5,712			トヨタ紡織	34.5	60	130,800			インターアクション	5.9	7.5	14,685				
船井電機	13.4		—	—			芦森工業	2.4	2.5	2,242			オーバル	10.7	13.3	3,564				
横河電機	118.3		147.2	274,969			ユニプレス	19.3	21.9	17,936			東京精密	19.9	24.8	112,592				
新元元工業	4.5		5.6	18,900			豊田自動織機	95.7	119.2	1,060,880			マニ	47	58.6	96,865				
アズビル	80		86.2	359,023			モリタホールディングス	19	23.6	29,854			ニコン	180.4	224.5	292,972				
東亜ディーケーケー	6.1		7.6	6,878			三機工業	16.3	20.2	16,846			トプコン	59.5	69.1	102,682				
日本光電工業	48.9		60.9	188,790			デンソー	260.4	323.7	2,751,450			オリンパス	654.2	771.1	1,744,999				
チノー	3.8		4.8	7,862			東海理化電機製作所	31.2	38.8	59,946			理研計器	10.5	12	63,000				
共和電業	13		14.9	5,632			川崎重工業	91.9	107.3	233,055			ダムロン	9.5	11.5	28,911				
日本電子材料	4.3		7.2	16,516			名村造船所	35.7	43.7	8,827			H O Y A	234.6	287	4,439,890				
堀場製作所	23.4		27.3	165,165			日本車輛製造	4.3	5.5	11,000			シード	5.2	6.9	3,608				
アドバンテスト	87.9		109.3	1,007,746			三菱ロジスネクスト	15.7	19.5	19,929			ノーリツ鋼機	10.6	13.2	27,508				
小野測器	4.3		6.9	3,312			近畿車輛	1.6	1.7	1,847			イー・アンド・デイ	9.9	13.4	12,730				
エスベック	10.5		12	24,168			日産自動車	1,394.4	1,733.9	1,038,432			朝日インテック	124.4	161.2	312,728				
キーエンス	11.6		133.2	7,826,832			いすゞ自動車	342.6	461.4	687,947			シチズン時計	149.2	172.1	86,910				
日置電機	5.7		7	44,240			トヨタ自動車	1,197.8	7,450.7	16,954,067			リズム	3.1	4.6	6,026				
シスメックス	92.2		124.4	1,316,774			日野自動車	147.7	183.6	194,616			大研医器	9.5	12	6,324				
日本マイクロニクス	20.6		25.6	38,476			三菱自動車工業	437.1	544.1	171,935			メニコン	18.1	48.8	132,540				
メガチップス	11.9		13.8	57,339			エフテック	8.4	10.3	5,562			シンシア	1.2	1.8	957				
O B A R A G R O U P	7		6.8	22,236			レシップホールディングス	4.6	5.7	3,192			松風	5.5	6.4	12,268				
澤藤電機	1.3		1.8	2,649			G M B	2.2	2.8	2,282			セイコーホールディングス	16.6	20.7	45,602				
原田工業	5		7.5	7,357			ファルテック	2.3	2.9	2,105			ニプロ	88.1	109.6	117,052				
コーセル	14.4		16.3	13,219			武蔵精密工業	26.4	32.7	57,421			<b>その他製品 (2.3%)</b>							
イリソ電子工業	9.9		12.3	52,152			日産車体	17.3	21.7	15,428			中本パックス	3.1	4.2	7,274				
オプテックスグループ	19.4		24	35,256			新明和工業	33.3	41.7	38,072			スノーピーク	7	19.3	44,544				
千代田インテグレ	5.1		6.4	11,936			極東開発工業	20.4	27.3	39,666			パタマワンヘッドホールディングス	11.4	28.2	54,538				
アイ・オー・データ機器	4.4		5.5	4,713			トビー工業	9.8	12.1	13,467			トランザクション	6.4	8.1	8,245				
レーザーテック	51.9		64.5	1,435,447			ティラド	3.7	4.2	11,919			粧美堂	3	5	2,065				
スタンレー電気	82.9		102.8	274,064			曙ブレーキ工業	64.1	80.6	13,863			ニホンフラッシュ	10.1	12.6	13,393				
岩崎電気	4.3		5.4	12,144			タチエス	18.1	25.7	31,122			前田工織	13	16.3	51,426				
ウシオ電機	60.6		75.3	1,397,079			N O K	57.2	71.2	91,207			永大産業	16.8	20.5	6,293				
岡谷電機産業	8.9		9.3	2,929			フタバ産業	29.6	36.8	15,124			アートネイチャー	11.6	12.7	8,801				
ヘリオス テクノホールディング	11.2		12.9	3,715			K Y B	13.2	15.4	47,124			バンダイナムコホールディングス	97.8	131.8	1,124,385				
エノモト	3.3		4	6,408			大同メタル工業	24.6	28.5	18,126			アイフィスジャパン	3.2	4.3	2,893				
日本セラミック	12		13.8	34,610			プレス工業	58.5	73	27,813			共立印刷	21.9	25.1	3,614				
遠藤照明	6.7		6.9	6,817			ミクニ	16.1	19.6	8,976			S H O E I	10.4	13.9	60,812				
古河電池	8.4		10.7	13,171			太平洋工業	24.8	30.8	33,140			フランスベッドホールディングス	15.4	19.3	17,427				
双信電機	5.8		6.4	3,718			河西工業	16.2	17.7	5,557			パイロットコーポレーション	20.9	24.9	104,829				
山一電機	7.6		10.8	23,630			アイシン	86.5	107.7	487,342			萩原工業	6.7	9.6	11,529				
図研	7.7		9.5	28,376			マツダ	370.8	461.4	406,954			トッパン・フォームズ	21.2	—	—				
日本電子	21.6		30.8	192,500			今仙電機製作所	10.4	9.6	5,712			フジノールインターナショナル	24.3	35.7	76,540				

銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末					
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額			
	千株	千株	千円		千株	千株		千株	千株	千円		千株	千株		千株	千株	千円		千株	千株	千円		
タカラトミー	52.9	61.5	71,586	東日本旅客鉄道	208.1	258.8	1,799,954	東海運	7.9	8.6	2,631	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
広済堂ホールディングス	8.1	9	6,993	西日本旅客鉄道	105.3	178.4	880,939	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
エステールホールディングス	4	4	2,552	東海旅客鉄道	98.3	122.1	1,825,395	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
タカノ	4.5	5.4	3,758	西武ホールディングス	142.4	191.8	227,474	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
プロネクサス	10.3	11.5	12,443	鴻池運輸	19	23.5	27,518	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
ホクシン	8.5	11	1,705	西日本鉄道	32.8	40.7	103,296	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
ウッドワン	3.4	4.6	4,590	ハマキョウワレックス	9.1	10.6	30,390	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
大建工業	8	8.7	18,661	サカイ引越センター	5.5	6.9	30,291	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
凸版印刷	179.6	223.5	488,124	近鉄グループホールディングス	111.9	139.3	475,709	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
大日本印刷	142.8	173.8	476,038	阪急阪神ホールディングス	149.3	174.1	600,645	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
共同印刷	3.7	4.6	12,479	南海電気鉄道	53.1	62.3	143,788	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
N I S S H A	24.3	30.2	44,877	京阪ホールディングス	49.9	62.1	172,079	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
光村印刷	0.8	0.7	987	神戸電気	2.8	3.3	10,741	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
TAKARA & COMPANY	5.8	7.4	13,912	名古屋鉄道	92.1	114.5	209,420	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
アシックス	104.6	129.9	310,720	山陽電気鉄道	8.1	11	22,000	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
ツツミ	3	3.8	7,079	アルプス物流	—	9.9	10,038	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
ローランド	6.9	10.3	44,856	日本通運	38.8	—	—	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
小松ウオール工業	3.7	4.3	7,942	ヤマトホールディングス	157	195.2	484,681	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
ヤマハ	70.3	85.5	459,135	丸山	28.7	36.6	149,145	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
河合楽器製作所	3.3	4.1	12,209	丸連	7.6	8.3	2,008	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
クリナップ	11.4	14	7,462	丸全昭和運輸	9.1	11.5	36,627	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
ピジョン	75.9	89	195,889	セコグループホールディングス	61.9	69.9	64,587	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
オリバー	2.4	—	—	トナミホールディングス	2.3	3.4	12,546	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
兼松サステック	0.6	0.6	990	ニッコホールディングス	37.6	46.8	99,216	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
キングジム	10.2	12.3	10,750	日本石油輸送	0.9	1.1	2,905	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
リンテック	25.4	31.6	81,496	福山通運	14.4	23	83,950	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
イトーキ	23.3	26.8	9,326	セイノホールディングス	83.9	94.9	108,660	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
任天堂	67.7	83	4,854,670	エスライン	3	3.2	2,870	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
三菱鉛筆	19.5	24.2	29,741	神奈川中央交通	2.5	3.4	11,424	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
タカラスタンダード	24.5	30.5	41,541	日立物流	24.7	26.9	144,184	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
ココロ	56.6	70.5	119,850	丸和運輸機関	23.6	29.5	34,220	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
ナカバヤシ	12.1	14	7,224	C&Fロジホールディングス	11.4	14.3	19,347	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
グループライド	5.7	13.2	35,970	九州旅客鉄道	86.4	107.8	262,277	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
オカムラ	45.4	50.6	60,517	S Gホールディングス	211.7	263.3	622,441	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
美津濃	11.7	14.7	33,236	N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	—	48.2	325,350	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
<b>電気・ガス業 (1.1%)</b>				<b>海運業 (0.6%)</b>				<b>情報・通信業 (8.0%)</b>															
東京電力ホールディングス	1,002.3	1,100.2	392,771	日本郵船	93.6	116.4	1,080,192	東海運	7.9	8.6	2,631	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
中部電力	361.8	449.8	504,675	商船三井	66.4	77.1	669,999	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
関西電力	448	557	595,990	川崎汽船	34.5	42.9	288,717	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
中国電力	170.7	229.8	200,615	N S ユナイテッド海運	5.4	7.7	27,373	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
北陸電力	108.1	134.6	71,607	明治海運	12.3	16.5	13,447	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
東北電力	276.8	343.8	249,255	飯野海運	52.4	64.5	35,668	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
四国電力	98.2	132.5	103,880	共栄タンカー	2.2	2.5	2,310	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
九州電力	261	303	249,369	乾汽船	5.9	9.4	22,080	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
北海道電力	110.3	127.8	64,283	<b>空運業 (0.4%)</b>				エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
沖縄電力	23	31.4	44,117	日本航空	272.7	319.2	730,968	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
電源開発	94	125.2	246,644	ANAホールディングス	302.1	353.8	914,926	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
エフオン	7.2	8.9	4,823	パスコ	2.2	2.8	3,687	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
イーレックス	17.3	21.7	31,877	<b>食料・運輸業 (0.2%)</b>				エーアイディー	7.2	8.4	12,786	エーアイディー	7.2	8.4	12,786	内外トランスライン	4.1						

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	価 値	株	数	評 価 額		株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数
システムインテグレータ		千株	千円		千株	千円	EDULAB		千株	千株	千円		千株	千株	千円	日本電信電話		千株	千株	千円
朝日ネット		3.2	2,654		4.8	2,654	東海ソフト		1.1	—	—		1,357.1	1,509.2	5,054,310	KDDI		930.4	1,051.8	3,938,991
eBASE		9.4	8,246		13.3	8,246	ウイングアーク1st		1.4	2.4	2,198		1,054.5	2,185.1	3,148,729	ソフトバンク		13.7	16.6	234,558
アバント		13.8	9,718		17.2	9,718	ビット・コミュニケーションズ		—	8.2	11,422		13.7	16.6	234,558	光通信		11.4	14.2	8,037
アドソル日進		12.4	17,654		15.5	17,654	サンバーワークス		2	3.4	6,613		41.5	51.1	127,443	GMOインターネット		3.7	4.7	5,649
ODKソリューションズ		4.1	8,445		5.1	8,445	東名		0.6	1.5	1,426		10	11.7	2,468	ファイバーゲート		6	7.6	9,750
フリービット		2	1,911		3	1,911	ヴィッツ		0.4	1.2	1,555		6	7.6	9,750	アイネット		7.6	9.5	114,570
コムチュア		6.9	7,808		8.6	7,808	トピラスシステムズ		1.1	2.9	2,375		31.3	78.7	179,672	東宝		68.5	85.2	405,978
サイバーコム		10.7	47,968		16.2	47,968	Sansan		—	51.3	62,842		3.8	4.7	82,720	東映		309	384.2	866,755
アステリア		2.1	2,613		2.4	2,613	Link-U		0.7	2.7	2,033		1.7	8.6	13,261	エヌ・ティ・ティ・データ		4.4	5.1	8,828
アイル		8.3	9,318		10.4	9,318	ギフティ		5.2	12.6	13,759		4	5.1	8,828	ビー・シー・イー		24	27.7	71,743
マークラインズ		6.5	8		8	10,040	ベース		1	2.6	11,414		49.5	67.1	397,903	ビー・エス・ピー		7.3	8.6	8,969
メディカル・データ・ビジョン		4.8	7,195		7.4	17,915	JMDC		—	13.5	66,892		26.8	100	195,600	日本システムウエア		3.8	5.4	11,496
gumi		13.2	18,702		18.3	18,702	フォーカスシステムズ		7.7	9.6	8,937		11.3	13.2	19,813	アイネス		9.8	11.8	12,414
ショーケース		16	11,720		20	11,720	グレスコ		7.9	10.7	18,136		12.2	15.4	16,755	T K C		11.3	13.2	19,813
モバイルファクトリー		2.4	3,392		3.3	3,392	フジ・メディア・ホールディングス		120.1	139	174,167		12.2	15.4	16,755	富士ソフト		12.3	15.4	77,000
テラスカイ		3.7	7,638		5.2	7,638	オービック		36.6	45.6	859,104		49.7	136.1	393,737	NSD		37.3	46.5	96,487
デジタル・インフレーション・テクノロジー		5.1	7,756		6.4	7,756	ジャストシステム		16.5	20.5	101,065		5.3	6.8	6,283	コナミホールディングス		42.1	52.4	366,800
PCIホールディングス		4.4	6,903		6.6	6,903	TDCソフト		10.2	12.6	13,154		7.3	8.6	8,969	群小コンピュータホールディングス		5.3	6.7	19,999
パイプHD		2.4	2,210		2.8	7,210	Zホールディングス		1,593.8	2,096.9	1,214,314		26.8	100	195,600	JBCホールディングス		7.8	9.8	14,719
アイビシー		1.9	2,616		2.6	7,176	トレンドマイクロ		61.9	77.1	472,623		3.8	5.4	11,496	ミロク情報サービス		11.5	12.7	16,344
ネオジャパン		2.2	4,300		3.2	8,995	IDホールディングス		4.5	9.4	7,980		11.3	13.2	19,813	ソフトバンクグループ		920.5	865	4,627,750
PR TIME S		2.4	3,200		3.2	8,995	日本オラクル		23.5	23.4	195,244		12.2	15.4	16,755	卸売業 (5.6%)		0.6	0.6	501
ラクス		—	49.6	108,723		—	アルファシステムズ		3.1	3.3	12,292		4.7	5.9	9,410	ボウスイ		0.6	0.6	501
ランドコンピュータ		1.5	2,052		2.5	2,052	フューチャー		14	30.5	44,560		1.6	1.7	2,502	高千穂交易		1.6	1.7	2,502
ダブルスタンダード		1.5	11,101		4.5	11,101	CAC Holdings		7.5	8.6	11,567		2.4	3	14,835	オルパルストアホールディングス		2.4	3	14,835
オープンドア		6.9	8.6	14,258		8.6	SBCテクノロジーズ		4.2	6.4	15,507		9.4	11.7	12,296	伊藤忠食品		9.4	11.7	12,296
マイネット		3.8	5.1	2,565		5.1	トーセ		3.3	4.5	3,253		3.3	4.1	10,487	エレマテック		3.3	4.1	10,487
アカツキ		4.6	6.4	18,835		6.4	オビックビジネスコンサルティング		11.9	13.9	60,395		3.3	4.1	10,487	JALUX		9.3	11.6	44,660
ベネフィットジャパン		0.9	1.1	2,327		1.1	伊藤テクノソリューションズ		52.9	65.7	193,552		1.6	2.4	15,408	あらた		1.6	2.4	15,408
Ubicomホールディングス		3	3.9	8,853		3.9	アイティフォー		15.1	17.4	13,519		3.8	4.2	22,638	トーマンデバイス		1.6	2.4	15,408
カナミックネットワーク		10.6	15.4	6,976		15.4	東計電算		1.8	1.7	8,117		3.8	4.2	22,638	東京エレクトロニクス		3.8	4.2	22,638
ノムラシステムコーポレーション		5.1	7.6	1,938		7.6	エックスネット		2.2	2.5	2,407		10.2	12.6	6,363	フィールズ		10.2	12.6	6,363
チェンジ		16.2	26.5	37,683		26.5	大塚商会		62.8	78	333,450		641.6	159.9	306,368	アルパルソールホールディングス		120.7	160.8	272,877
シンクロ・フード		6.9	7.5	2,347		7.5	サイボウズ		13.5	19.4	27,819		30.8	41.4	35,728	横浜冷凍		30.8	41.4	35,728
オークネット		6.1	7.7	11,711		7.7	電通国際情報サービス		14.4	20.8	72,696		1.6	2	1,794	神栄		1.6	2	1,794
キャピタル・アセット・プランニング		1.5	2.9	2,293		2.9	ACC E S S		10.8	16.4	9,626		6.5	8.2	8,495	ラサ商事		6.5	8.2	8,495
セグエグループ		2.9	3.8	2,200		3.8	デジタルガレージ		19.1	23.8	88,774		12.3	15.4	20,851	アルコニックス		12.3	15.4	20,851
エイトレード		2.2	2.2	4,639		2.2	エイムシステムズ		19.2	24	15,696		80.4	112.5	396,562	神戸物産		80.4	112.5	396,562
AOI TYO HOLDINGS		12	—	—		—	ウェザースニーズ		3.4	4.5	35,640		2	2.3	1,101	ハイパー		2	2.3	1,101
マクロミル		23.6	29.5	32,509		29.5	C I J		7.9	9.8	7,947		16.7	20.6	36,647	あいホールディングス		16.7	20.6	36,647
ビッグリリー		2.3	3.4	3,910		3.4	ビジネスエンジニアリング		1.2	1.7	5,873		4	4.8	4,992	ディー・ブイエックス		4	4.8	4,992
オロ		3.6	4.6	10,718		4.6	日本エンタープライズ		11.6	14.9	2,547		10.6	70.4	115,596	ダイワホールディングス		10.6	70.4	115,596
ユーザローカル		1.8	4.5	6,570		4.5	WOWOW		5.7	7	12,173		27.7	34.5	93,046	マクニコ・富士ホールディングス		27.7	34.5	93,046
テモナ		2.5	3.3	1,402		3.3	スカラ		10.3	12.7	8,509		5.1	5	9,895	ラクト・ジャパン		5.1	5	9,895
ニーズウェル		2.2	3.4	2,077		3.4	インテリジェント ウェイブ		6.9	8.7	4,845		2.5	6.6	14,031	グリムス		2.5	6.6	14,031
マネーフォワード		—	22	109,340		22	IMAGICA GROUP		10	12.2	7,112		20.6	25.2	20,286	バスタークエスタールホールディングス		20.6	25.2	20,286
サインポスト		2.6	4.6	4,135		4.6	ネットワンシステムズ		47.3	55	150,315		9.2	11	10,527	八洲電機		9.2	11	10,527
電研システムホールディングス		—	6	15,768		6	システムソフト		25.5	30.8	3,172		6.8	8.5	7,556	メディアスホールディングス		6.8	8.5	7,556
ソルクシーズ		4.4	12.2	5,099		12.2	アルゴグラフィックス		9	11.4	35,454		12.2	13.8	26,937	レスタールホールディングス		12.2	13.8	26,937
フェイス		3.6	4	2,664		4	マーベラス		18.2	22.8	16,507		2.3	3.6	4,186	ジョテックホールディングス		2.3	3.6	4,186
プロトコーポレーション		10.4	15.4	19,404		15.4	エイベックス		19.9	24.9	33,316		4.9	6.8	4,583	大光		4.9	6.8	4,583
ハイマックス		2.9	4	4,788		4	日本ユニシス		40.3	45.1	141,388		3.5	3.6	4,755	OCHIホールディングス		3.5	3.6	4,755
野村総合研究所		211.8	278.9	1,126,756		278.9	兼松エレクトロニクス		6.4	8	30,800		3.5	3.6	4,755					
サイバネットシステム		8.2	10.3	6,509		10.3	都築電気		4.3	7.5	10,515		2	2.3	1,101					
CEホールディングス		6.2	7.6	3,655		7.6	TBSホールディングス		76.9	87.7	159,877		2	2.3	1,101					
日本システム技術		2.1	2.9	6,342		2.9	日本テレビホールディングス		96.6	120.4	159,891		16.7	20.6	36,647					
インテックホールディングス		14.4	16.6	30,892		16.6	朝日放送グループホールディングス		12.1	14.9	10,549		4	4.8	4,992					
東邦システムサイエンス		3	4.1	3,813		4.1	テレビ朝日ホールディングス		35.8	34.7	55,832		10.6	70.4	115,596					
ソースネクスト		54.7	61.7	9,810		61.7	スカパーJSATホールディングス		76.3	122	55,022		27.7	34.5	93,046					
インフォコム		10.6	15.9	30,925		15.9	テレビ東京ホールディングス		8.5	10.6	21,571		5.1	5	9,895					
シンプレックスホールディングス		—	16.8	34,809		16.8	日本BS放送		4.1	5.3	5,803		2.5	6.6	14,031					
HEROZ		3.2	4	3,708		4	ビジョン		14.2	24.6	25,682		20.6	25.2	20,286					
ラクスル		9.4	15.9	57,876		15.9	スマートパリュウ		3.1	3.6	1,702		9.2	11	10,527					
I P S		2.1	4	7,356		4														

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株	株
TOKAIホールディングス	56.6	70.4	63,219	56.6	70.4	63,219	OGUホールディングス	1.8	2.3	6,175	1.8	2.3	6,175	J Kホールディングス	10.7	11.7	11,629	10.7	11.7	11,629	
黒谷	3.3	4	2,548	3.3	4	2,548	スターゼン	4.3	10.9	22,868	4.3	10.9	22,868	日伝	9.7	12.1	26,111	9.7	12.1	26,111	
Cominix	1.7	1.8	1,317	1.7	1.8	1,317	山善	45.5	60.9	60,839	45.5	60.9	60,839	北沢産業	7.3	7.6	1,725	7.3	7.6	1,725	
三洋貿易	11.6	14.7	15,199	11.6	14.7	15,199	椿本興業	1.7	2.3	9,487	1.7	2.3	9,487	杉本商事	5.9	6.6	14,242	5.9	6.6	14,242	
ビューティガレージ	1.9	2.5	7,800	1.9	2.5	7,800	住友商事	734.9	913.9	1,678,377	734.9	913.9	1,678,377	稲崎電機産業	31.1	38.7	99,962	31.1	38.7	99,962	
ワイン・パートナーズ	8.5	10.9	10,823	8.5	10.9	10,823	内田洋行	4.6	6.3	28,948	4.6	6.3	28,948	東テック	3.9	4.6	11,145	3.9	4.6	11,145	
ミタチ産業	3	4	3,604	3	4	3,604	三菱商事	709	1,085.1	4,289,400	709	1,085.1	4,289,400	ミスミグループ本社	146	181.7	630,499	146	181.7	630,499	
シップヘルスケアホールディングス	20.6	46.5	119,551	20.6	46.5	119,551	第一実業	5.3	6.7	28,542	5.3	6.7	28,542	アルテック	8.8	10.3	3,162	8.8	10.3	3,162	
明治電機工業	3.1	4.7	5,757	3.1	4.7	5,757	キャノンマーケティングジャパン	28.9	35.9	89,821	28.9	35.9	89,821	タキヒヨー	4	4.1	5,781	4	4.1	5,781	
デリカフーズホールディングス	5.2	6	3,222	5.2	6	3,222	西華産業	6.2	7.9	12,687	6.2	7.9	12,687	戴玉産業	1.9	2.2	4,037	1.9	2.2	4,037	
スターティアホールディングス	2.3	3.4	2,590	2.3	3.4	2,590	佐藤商事	10	12.1	14,023	10	12.1	14,023	スズケン	49.3	56.6	200,647	49.3	56.6	200,647	
コマダホールディングス	25.4	31.6	67,782	25.4	31.6	67,782	菱洋エレクトロ	8.8	8.6	17,397	8.8	8.6	17,397	ジェコス	8.2	10.8	8,640	8.2	10.8	8,640	
ピーバンドットコム	1.5	2.4	1,521	1.5	2.4	1,521	東京産業	11	13.2	9,438	11	13.2	9,438	グローセール	12.9	17.1	7,609	12.9	17.1	7,609	
アセンテック	2.9	4.9	3,474	2.9	4.9	3,474	ユアサ商事	12	13.8	40,020	12	13.8	40,020	小売業 (4.2%)							
富士興産	3.5	3.8	3,689	3.5	3.8	3,689	神鋼商事	2.7	3.4	12,750	2.7	3.4	12,750	ローソン	29.5	32.1	154,240	29.5	32.1	154,240	
協栄産業	1.5	1.7	2,618	1.5	1.7	2,618	トルク	5.8	6	1,272	5.8	6	1,272	サンエー	8.8	11	44,935	8.8	11	44,935	
フルサト・マルカホールディングス	-	14	30,716	-	14	30,716	阪和興業	23.2	28.9	95,370	23.2	28.9	95,370	カワチ薬品	8.1	11.3	26,577	8.1	11.3	26,577	
ヤマエグループホールディングス	-	9.8	10,201	-	9.8	10,201	正栄食品工業	7.5	9.4	38,352	7.5	9.4	38,352	イービーシー・マート	18.1	22.7	118,040	18.1	22.7	118,040	
小野建	10.7	14.3	24,238	10.7	14.3	24,238	カナデン	9.6	12	12,060	9.6	12	12,060	ハードオフコーポレーション	5.4	6.9	5,319	5.4	6.9	5,319	
南陽	2.1	2.3	4,473	2.1	2.3	4,473	菱電商事	8.4	11.6	20,218	8.4	11.6	20,218	アスクル	10.1	32.7	54,249	10.1	32.7	54,249	
佐鳥電機	7.4	9.1	8,399	7.4	9.1	8,399	フルサト工業	6.3	-	-	6.3	-	-	ゲオホールディングス	15.6	19.4	22,445	15.6	19.4	22,445	
エコートレーディング	2.6	2.9	1,722	2.6	2.9	1,722	岩谷産業	27.9	34.8	183,744	27.9	34.8	183,744	アダストリア	16.1	15.5	27,125	16.1	15.5	27,125	
伯東	7.1	8.7	19,783	7.1	8.7	19,783	ナイス	4.7	5.1	9,205	4.7	5.1	9,205	ジーフット	7.6	10	3,170	7.6	10	3,170	
コンドーテック	9.2	11.6	11,982	9.2	11.6	11,982	昭光通商	3.4	-	-	3.4	-	-	シー・ワイ・エス・バイエリア	2	2.3	869	2	2.3	869	
中山福	7.1	7.6	3,108	7.1	7.6	3,108	ニチモウ	1.6	2.4	6,182	1.6	2.4	6,182	くら寿司	6.9	15.1	55,115	6.9	15.1	55,115	
ナガイレーベン	15.5	19.3	40,916	15.5	19.3	40,916	極東貿易	3	4.1	10,893	3	4.1	10,893	キャンドゥ	5.6	5.3	10,780	5.6	5.3	10,780	
三菱食品	12.9	14.2	45,298	12.9	14.2	45,298	アステナホールディングス	15.2	20.3	8,363	15.2	20.3	8,363	アイケイ	2.5	4	1,544	2.5	4	1,544	
松田産業	8.5	10.7	25,209	8.5	10.7	25,209	三菱石油	28.7	35.6	32,716	28.7	35.6	32,716	バルグループホールディングス	10.2	12.6	20,878	10.2	12.6	20,878	
第一興商	17.3	27.5	91,850	17.3	27.5	91,850	稲畑産業	27.9	31.8	64,617	27.9	31.8	64,617	エディオン	49.3	66.3	73,924	49.3	66.3	73,924	
メディアルホールディングス	116.7	156.2	339,266	116.7	156.2	339,266	G S I クレオス	2.8	6.9	7,741	2.8	6.9	7,741	サーラコーポレーション	29.9	29.6	18,766	29.9	29.6	18,766	
S P K	5.2	6	7,668	5.2	6	7,668	明和産業	10.8	13.3	14,856	10.8	13.3	14,856	ワッツ	5.2	7.2	4,960	5.2	7.2	4,960	
視原電気ホールディングス	4.4	5.4	10,675	4.4	5.4	10,675	クワザホールディングス	4.4	4.6	2,865	4.4	4.6	2,865	ハロース	4.4	6.7	18,900	4.4	6.7	18,900	
アズワン	8.3	21.1	129,132	8.3	21.1	129,132	ヤマエク野	8.5	-	-	8.5	-	-	フジオールドグループ本社	9.8	12.3	16,605	9.8	12.3	16,605	
スズデン	3.5	5.3	10,732	3.5	5.3	10,732	ワキタ	22.9	31	31,434	22.9	31	31,434	あみやき亭	2.5	3.4	9,860	2.5	3.4	9,860	
尾家産業	3	3.2	3,184	3	3.2	3,184	東邦ホールディングス	37.3	46.5	87,373	37.3	46.5	87,373	ひらまつ	21.9	30.8	5,821	21.9	30.8	5,821	
シモジマ	6.5	9	9,117	6.5	9	9,117	サンゲツ	31.5	38.4	60,364	31.5	38.4	60,364	大黒天物産	2.7	4.7	22,419	2.7	4.7	22,419	
ドウシシャ	11	13.8	20,920	11	13.8	20,920	ミツロコグループホールディングス	17.1	21.3	21,917	17.1	21.3	21,917	ハニースホールディングス	9.1	11.5	11,879	9.1	11.5	11,879	
小津産業	2.3	2.5	4,920	2.3	2.5	4,920	シナネンホールディングス	4.3	5.4	17,685	4.3	5.4	17,685	フーマライホールディングス	3.3	4	2,860	3.3	4	2,860	
高速	6.3	8.8	12,944	6.3	8.8	12,944	伊藤忠エネクス	26	32.1	33,448	26	32.1	33,448	アルペン	8.9	11.2	23,990	8.9	11.2	23,990	
たけびし	3.5	5.6	8,092	3.5	5.6	8,092	サンリオ	32.6	44.9	105,290	32.6	44.9	105,290	ハブ	3.6	4.8	2,836	3.6	4.8	2,836	
リックス	2.2	2.5	3,875	2.2	2.5	3,875	サンワ テクノス	7.6	8.8	11,915	7.6	8.8	11,915	クオールホールディングス	15.7	17.8	23,745	15.7	17.8	23,745	
丸文	10.6	12.7	9,258	10.6	12.7	9,258	リョーサン	12.8	16	36,576	12.8	16	36,576	ジンスホールディングス	6.2	9.9	66,528	6.2	9.9	66,528	
ハピネット	9.7	12.1	18,452	9.7	12.1	18,452	新光商事	15.9	22	19,162	15.9	22	19,162	ビックカメラ	69	85.7	88,271	69	85.7	88,271	
橋本総業ホールディングス	2	3	6,027	2	3	6,027	トーホー	5.4	6.8	7,289	5.4	6.8	7,289	DCMホールディングス	71.9	89.3	98,578	71.9	89.3	98,578	
日本ライフライン	37.6	42.9	42,942	37.6	42.9	42,942	三信電気	6.4	6.8	11,131	6.4	6.8	11,131	ペッパーフードサービス	13.2	19.7	6,934	13.2	19.7	6,934	
タカショー	7.4	11	7,271	7.4	11	7,271	東陽テクニカ	12.2	14.3	15,015	12.2	14.3	15,015	MonotaRO	82.8	183.1	337,087	82.8	183.1	337,087	
マルカ	3.8	-	-	3.8	-	-	モスフードサービス	16.5	19.1	57,777	16.5	19.1	57,777	東京一番フーズ	2.6	4	2,372	2.6	4	2,372	
I DOM	39.3	43.9	29,544	39.3	43.9	29,544	加賀電子	10.5	13.1	42,837	10.5	13.1	42,837	DDホールディングス	5.2	7.7	4,365	5.2	7.7	4,365	
進和	7	8.7	17,748	7	8.7	17,748	ソーダニッカ	11.3	15.1	13,423	11.3	15.1	13,423	きちりホールディングス	3.4	4.1	1,455	3.4	4.1	1,455	
エスケイジャパン	2.7	3.3	1,382	2.7	3.3	1,382	立花エレクトック	8.7	11.7	18,532	8.7	11.7	18,532	アークロイヤルホールディングス	9.7	10.8	23,727	9.7	10.8	23,727	
グイトロン	5	6.3	12,814	5	6.3	12,814	フォーバル	4.3	6.6	6,177	4.3	6.6	6,177	J. フロント リテイリング	139	172.8	185,932	139	172.8	185,932	
シークス	14.8	20.6	27,047	14.8	20.6	27,047	P A L T A C	18.7	20.3	89,624	18.7	20.3	89,624	トール・プレスホールディングス	18.4	25	40,125	18.4	25	40,125	
田中商事	3.1	3.3	2,128	3.1	3.3	2,128	三谷産業	15.6	17.1	5,232	15.6	17.1	5,232	マツキョココカラ&カンパニー	48.1	89.1	363,528	48.1	89.1	363,528	
オーハンテックニカ	6.2	8.2	11,693	6.2	8.2	11,693	太平洋興発	5.1	5.6	3,662	5.1	5.6	3,662	ブロンコビリー	6.1	8.3	18,467	6.1	8.3	18,467	
白鋼	3.6	4.7	12,502	3.6	4.7	12,502	B&W smeltacホールディングス	2.6	3.4	10,642	2.6	3.4	10,642	ZOZO	68.7	99.8	306,386	68.7	99.8	306,386	
ダイコー通産	1.1	1.7	2,012	1.1	1.7	2,012	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.1	1.2	2,354	1.1	1.2	2,354	トレジャー・							

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株
オイシックス・ラ・大地	11.5	20.8	53,185	11.5	20.8	53,185	ピーシーデポコーポレーション	13.6	16.9	4,867	13.6	16.9	4,867	パロールホールディングス	23.8	32.1	72,225	23.8	32.1	72,225
ネクステージ	19.9	29.3	85,907	19.9	29.3	85,907	壹番屋	8.2	10.3	48,049	8.2	10.3	48,049	藤久	2.7	—	—	2.7	—	—
ジョイフル本田	34.2	42.4	64,660	34.2	42.4	64,660	トップカルチャー	4.8	5.5	1,545	4.8	5.5	1,545	ベルク	5.8	6.4	34,496	5.8	6.4	34,496
鳥貴族ホールディングス	3.3	5.3	9,714	3.3	5.3	9,714	PLANT	3.1	3.6	2,390	3.1	3.6	2,390	大 庄	6.3	8	8,256	6.3	8	8,256
ホットランド	8.6	11	14,069	8.6	11	14,069	スズキホールディングス	23.2	28.9	194,786	23.2	28.9	194,786	ファーストリテイリング	15.6	19.4	1,242,570	15.6	19.4	1,242,570
すかいらーくホールディングス	130.4	186.9	280,536	130.4	186.9	280,536	兼天堂ホールディングス	5.1	7.3	17,571	5.1	7.3	17,571	サンドラッグ	43.8	54.5	162,628	43.8	54.5	162,628
SFPホールディングス	5.7	7.2	10,188	5.7	7.2	10,188	ウィア・ホールディングス	14.2	19.3	2,952	14.2	19.3	2,952	サックスパーホールディングス	10	13.8	7,120	10	13.8	7,120
綿半ホールディングス	8.8	11	14,289	8.8	11	14,289	スクロール	16.6	22.3	20,159	16.6	22.3	20,159	ヤマザワ	2.6	2.9	4,738	2.6	2.9	4,738
ヨシダホールディングス	2.3	2.9	6,252	2.3	2.9	6,252	ヨンドシーホールディングス	10.8	13.3	23,368	10.8	13.3	23,368	やまや	2.5	3	7,482	2.5	3	7,482
コナカ	33.9	42.3	45,684	33.9	42.3	45,684	木曾路	15.3	19.3	42,884	15.3	19.3	42,884	ペルーナ	25	31.1	23,418	25	31.1	23,418
ゴルフダイジェスト・オンライン	6	7.6	8,109	6	7.6	8,109	SRSホールディングス	14.6	20	16,260	14.6	20	16,260	<b>銀行業 (5.6%)</b>						
BENOS	5.4	7.5	13,702	5.4	7.5	13,702	千趣会	20.9	26.4	9,794	20.9	26.4	9,794	島根銀行	4.3	4.5	2,533	4.3	4.5	2,533
あさひ	8.6	12	17,112	8.6	12	17,112	タカキュー	9.9	12.9	1,380	9.9	12.9	1,380	じもとホールディングス	8	10.8	7,430	8	10.8	7,430
日本調剤	7.1	8.8	12,883	7.1	8.8	12,883	リテールパートナーズ	14.1	17.6	22,792	14.1	17.6	22,792	めぐみフィナンシャルグループ	604.6	751.7	208,220	604.6	751.7	208,220
コスモス薬品	11.8	14.7	207,270	11.8	14.7	207,270	ケーヨー	21.6	26.9	22,918	21.6	26.9	22,918	東京きんぎょフィナンシャルグループ	14.6	18.3	30,707	14.6	18.3	30,707
トーエール	5.7	6.8	5,861	5.7	6.8	5,861	上新電機	13.7	16.6	35,275	13.7	16.6	35,275	九州フィナンシャルグループ	238	296.3	135,705	238	296.3	135,705
オンリー	2.6	—	—	2.6	—	—	日本瓦斯	19.2	70.4	117,004	19.2	70.4	117,004	ゆうちょ銀行	330.8	342.8	402,447	330.8	342.8	402,447
セブ&アイ・ホールディングス	455.6	566.6	3,282,880	455.6	566.6	3,282,880	ロイヤルホールディングス	20.3	24.9	46,961	20.3	24.9	46,961	富士第一銀行	28.6	35.7	11,424	28.6	35.7	11,424
クワイ・レストラン・ホールディングス	62.5	77.1	58,596	62.5	77.1	58,596	東天虹	0.6	0.6	562	0.6	0.6	562	コンコディア・フィナンシャルグループ	709.7	828	416,484	709.7	828	416,484
ツルハホールディングス	25.4	31.6	288,192	25.4	31.6	288,192	いなげや	13	18	25,416	13	18	25,416	西日本フィナンシャルホールディングス	77.6	94.6	80,788	77.6	94.6	80,788
サマルクホールディングス	9.1	11.5	18,285	9.1	11.5	18,285	チヨダ	12.2	14	10,668	12.2	14	10,668	関西みらいフィナンシャルグループ	54.8	—	—	54.8	—	—
フェリシモ	2.6	3.4	4,372	2.6	3.4	4,372	ライフコーポレーション	8.8	13.5	41,242	8.8	13.5	41,242	三三フィナンシャルグループ	10.2	13.7	21,344	10.2	13.7	21,344
トリドールホールディングス	28.8	35.9	83,682	28.8	35.9	83,682	リンゴバーハット	14.4	17.9	40,650	14.4	17.9	40,650	親睦越フィナンシャルグループ	19	23.6	65,584	19	23.6	65,584
TOKYO BASE	10.4	13.2	5,913	10.4	13.2	5,913	Mr Max HD	15.9	18.2	11,156	15.9	18.2	11,156	ひろぎんホールディングス	172.2	214.3	150,652	172.2	214.3	150,652
ウィルプラスホールディングス	1.9	2.5	2,425	1.9	2.5	2,425	テンアライド	11.7	15.3	4,758	11.7	15.3	4,758	おきなわフィナンシャルグループ	—	13.1	30,418	—	13.1	30,418
JMホールディングス	8.8	9.8	16,787	8.8	9.8	16,787	AOKIホールディングス	23.1	28	16,856	23.1	28	16,856	十六フィナンシャルグループ	—	19.5	47,541	—	19.5	47,541
サツドラホールディングス	1.5	7.4	4,684	1.5	7.4	4,684	オークワ	18.2	22.8	21,500	18.2	22.8	21,500	北都フィナンシャルホールディングス	—	13.4	42,880	—	13.4	42,880
アレンザホールディングス	6.7	11.2	12,208	6.7	11.2	12,208	コメリ	18	22.4	61,219	18	22.4	61,219	新生銀行	95.1	94.6	221,458	95.1	94.6	221,458
専科田中ホールディングス	3	3.9	8,037	3	3.9	8,037	青山商事	25.7	29.7	20,582	25.7	29.7	20,582	あおぞら銀行	69.4	81	222,912	69.4	81	222,912
ハロッジジャパンリミテッド	8.1	10.6	9,508	8.1	10.6	9,508	しまむら	13.5	16.8	176,904	13.5	16.8	176,904	三井住友フィナンシャルグループ	7,977.2	9,093.4	6,731,844	7,977.2	9,093.4	6,731,844
クスのアオキホールディングス	11.6	14.4	98,928	11.6	14.4	98,928	はせがわ	5.2	8	2,408	5.2	8	2,408	りそなホールディングス	1,267.6	1,659.4	901,386	1,267.6	1,659.4	901,386
力の源ホールディングス	5.4	7.7	4,319	5.4	7.7	4,319	高島屋	84.7	105.3	117,725	84.7	105.3	117,725	三井住友トラスト・ホールディングス	220.5	274.1	1,162,184	220.5	274.1	1,162,184
FOOD & LIFE COMPANIES	63.9	84.7	300,685	63.9	84.7	300,685	松屋	25.4	29.1	21,155	25.4	29.1	21,155	三井住友フィナンシャルグループ	807.1	1,003.6	4,351,609	807.1	1,003.6	4,351,609
メディカルシステムネットワーク	—	14.2	7,668	—	14.2	7,668	エイチ・オー・リテイリング	55	68.5	56,992	55	68.5	56,992	千葉銀行	388.8	483.8	381,718	388.8	483.8	381,718
一家ホールディングス	10.2	2.7	1,422	10.2	2.7	1,422	近鉄百貨店	4.5	5.5	14,756	4.5	5.5	14,756	群馬銀行	239.9	277.9	112,721	239.9	277.9	112,721
藤久ホールディングス	—	3.5	2,688	—	3.5	2,688	丸井グループ	98.5	114.3	259,918	98.5	114.3	259,918	武蔵野銀行	2.3	21.6	41,752	2.3	21.6	41,752
はるやまホールディングス	6.1	6.9	3,519	6.1	6.9	3,519	アジアル リテイリング	9.7	11.4	37,848	9.7	11.4	37,848	千葉興業銀行	19.8	34.5	10,005	19.8	34.5	10,005
ノジマ	20.7	23.4	58,125	20.7	23.4	58,125	井筒屋	6.3	6.9	2,732	6.3	6.9	2,732	筑波銀行	48.4	56.9	11,778	48.4	56.9	11,778
カップ・クリエイト	16.4	20.4	27,478	16.4	20.4	27,478	イオン	448.1	557.2	1,481,594	448.1	557.2	1,481,594	七十七銀行	36.6	45.5	73,164	36.6	45.5	73,164
ライトオン	8.8	11.2	8,064	8.8	11.2	8,064	イズミ	23.6	26.3	86,395	23.6	26.3	86,395	青森銀行	9	11.3	22,249	9	11.3	22,249
ジーンズメイト	3.6	—	—	3.6	—	—	平和堂	21.5	26.8	52,474	21.5	26.8	52,474	秋田銀行	7.1	9.4	17,343	7.1	9.4	17,343
良品計画	154.5	166.7	293,892	154.5	166.7	293,892	フジ	14.1	17.6	32,929	14.1	17.6	32,929	山形銀行	13	16.3	16,348	13	16.3	16,348
三城ホールディングス	14.9	15.7	3,940	14.9	15.7	3,940	ヤオコー	13.2	16.5	109,560	13.2	16.5	109,560	岩手銀行	7.6	9.4	18,593	7.6	9.4	18,593
アドヴァングループ	12	14.9	14,125	12	14.9	14,125	ゼビオホールディングス	14	19.7	18,064	14	19.7	18,064	東邦銀行	104.1	121.4	26,950	104.1	121.4	26,950
アルピス	3.7	4.8	10,502	3.7	4.8	10,502	ケーズホールディングス	103.7	133.4	165,282	103.7	133.4	165,282	東北銀行	5.9	7.5	8,047	5.9	7.5	8,047
コナカ	14.1	16.9	5,965	14.1	16.9	5,965	Olympicグループ	6	7.9	5,609	6	7.9	5,609	みちのく銀行	7.5	9.5	8,540	7.5	9.5	8,540
ハウス オブ ローゼ	1.2	1.2	2,026	1.2	1.2	2,026	日産東京販売ホールディングス	14.3	22.8	5,198	14.3	22.8	5,198	ふくおかフィナンシャルグループ	105.1	122	289,018	105.1	122	289,018
G-7ホールディングス	6.9	16.2	24,526	6.9	16.2	24,526	シルバライフ	1.6	3	3,264	1.6	3	3,264	静岡銀行	283.9	353.2	323,531	283.9	353.2	323,531
イオン北海道	15.6	25.7	29,400	15.6	25.7	29,400	一家ダイニングプロジェクト	1.1	—	—	1.1	—	—	十六銀行	14.6	—	—	14.6	—	—
ゴジマ	19.9	24.8	13,392	19.9	24.8	13,392	Genky DrugStores	5.1	6.4	22,848	5.1	6.4	22,848	スルガ銀行	101.6	127	63,627	101.6	127	63,627
ヒマラヤ	4.3	5.1	5,232	4.3	5.1	5,232	ナルミヤ・インターナショナル	2.3	3.4	3,910	2.3	3.4	3,910	八十二銀行	262.3	326	144,418	262.3	326	144,418
コーナン商事	16.6	20.6	72,821	16.6	20.6	72,821	ゾフオグループホールディングス	6.8	8.8	9,160	6.8	8.8	9,160	山梨中央銀行	13.6	16	15,472	13.6	16	15,472
エコス	4.3	5.4	11,334	4.3	5.4	11,334	ギフト	1.1	2.4	5,904	1.1	2.4	5,904	大垣共立銀行	23	28.8	60,307	23	28.8	60,307
ワタミ	15.3	17.6	16,227	15.3	17.6	16,227	アインホールディングス	16.9	19.4	115,818	16.9	19.4	115,818	福井銀行	10	12.5	18,587	10	12.5	18,587
マルシェ	3	4	1,760	3																



銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	株	数	株	価 額		株	数	株	価 額		株	数	株	価 額		
		千株		千円			千株		千円			千株		千円		
キャリアデザインセンター		2.5		4,194	リソルホールディングス		0.9		1.6	7,000	プロレド・パートナーズ		1.6		3	2,436
ベネフィット・ワン		41.2		153,548	テクノプロ・ホールディングス		22.5		84.1	295,191	and factory		1		3.3	1,214
エムスリー		199.3		1,042,667	アトラグループ		2.5		2.6	676	テノ・ホールディングス		0.9		2	1,206
ツカガ・グローバルホールディング		9.5		2,380	インターワークス		3.5		4.5	1,687	7フンティア・マネジメント		2		3.6	2,350
プラス		1.5		1,392	アイ・アールジャパンホールディングス		4.6		6.6	32,505	ピアラ		0.6		2.3	1,258
アウトソーシング		64.7		108,514	KeepPer 技研		7.3		9	16,929	ゴブ・ホールディングス		0.6		2.9	3,204
ウエルネット		11.5		6,263	ファーストロジック		2.2		2.9	2,166	ギョクス		1.5		2.6	3,803
ワールドホールディングス		3.9		13,484	三機サービズ		2.3		3	2,907	カーブホールディングス		31		38.7	27,244
ディー・エヌ・エー		47.8		95,783	Gunosy		6.8		8.8	6,274	フォーラムエンジニアリング		5.8		9.9	8,613
博報堂DYホールディングス		157.2		350,124	デザインワン・ジャパン		3.5		3.6	673	FAST FITNESS JAPAN		-		2	4,224
ぐるなび		19.6		8,724	イー・ガーディアン		4.9		5.6	14,795	ダイレクトマーケティングミックス		4.4		15.2	21,964
タカミヤ		14.1		7,128	リブセンス		6.2		8.7	1,400	ポピュラスホールディングス		2.3		3.4	8,493
ジャロバベストレスキューシステム		8.9		8,610	ジャパンマテリアル		34.8		43.2	71,625	LITALICO		-		11.5	35,190
ファンコミュニケーションズ		31.3		13,267	ベクトル		14		19.7	20,448	アドバレッジシステムマネジメント		5.7		7.2	5,184
ライク		3		6,805	ウチヤマホールディングス		5.8		7.4	2,412	リリコグループ		61.7		76.9	158,337
ビジネス・ブレークスルー		5.1		2,304	チャーム・ケア・コーポレーション		8.4		10.6	12,084	東祥		7.1		10.6	16,472
エスグループ		28.9		39,342	キャリアリンク		3.6		5.1	8,573	TR Eホールディングス		-		19.4	28,731
WDBホールディングス		5.2		18,513	IBJ		9.1		11.5	8,728	人・夢・技術グループ		-		5.6	10,102
手間いらず		1.1		8,496	アサンテ		4.1		6.4	10,419	エイチ・エイ・エス		16.4		31.3	64,165
ティア		7.2		3,801	N・フィールド		7.6		-	-	ラックランド		3.2		4.1	11,836
CDG		1.3		1,912	バリュウHR		4.5		5.6	13,904	共立メンテナンクス		18.7		25	103,875
アドウェイズ		13.7		15,863	M&Aキャピタルパートナーズ		9.3		11.6	55,042	イチネスホールディングス		11.8		14.6	18,804
パリュウ・コマース		7.5		39,032	ライオンシステムホールディングス		4.3		5.4	8,262	建設技術研究所		7.3		8.5	20,102
インフォマート		114.3		97,880	ER Iホールディングス		2.8		4	4,660	スペースス		7.7		10.4	9,505
J Pホールディングス		32.6		8,246	アビスト		1.8		2.2	6,435	長 大		4.5		-	-
Eコナックホールディングス		20.7		2,288	ジグマシステムホールディングス		6.2		8.6	19,049	燦ホールディングス		4.7		6.3	9,714
E P Sホールディングス		15.3		-	ウィルグループ		8.2		10.4	13,176	スバル興業		0.7		0.7	5,537
C Lホールディングス		2.7		3,594	エスコロー・エージェンツ・ジャパン		16.6		18.9	3,553	東京データル		4.6		5.4	6,615
プラステック・インターナショナル		42.2		37,832	メドビア		5.3		10.9	30,498	タナベ経営		2.2		4.8	3,028
アマユーズ		6.2		16,216	レアジョブ		1.6		2.8	2,282	ナガワ		3.6		4.6	43,608
ドリームインキュベータ		3.5		8,088	リクルートホールディングス		809.3		1,083.7	6,140,244	よみうりランド		0.6		-	-
クイック		7		15,801	エラン		15.6		19.4	19,826	東京競馬		7.3		10.7	46,224
T A C		6.3		1,952	土木管理総合試験所		5.7		6.9	2,187	常磐興産		4.7		5.4	7,317
ケネディクス		32.3		-	ネットマーケティング		5.4		6.9	3,029	カナモト		19.9		24.8	57,015
電通グループ		127		605,988	日本郵政		855.3		1,834.3	1,880,157	東京ドーム		44.5		-	-
デアアンドガ・ニーズ		5.2		6,880	ベルシスシステム24ホールディングス		18.9		20.1	28,642	西尾レントオール		10.4		12.9	36,894
びあ		3.2		16,415	鎌倉新書		11.4		16	8,400	アゴラ ホスピタリティ・グループ		71.2		75.2	1,654
イオンファンタジー		4.3		11,718	SMN		2.4		3.4	2,046	トランス・コスモス		10.8		17.9	57,101
シーティーエス		12.6		12,976	一蔵		1.7		2.3	899	乃村工藝社		48.3		60.2	57,671
ネクシースグループ		3.5		3,445	LITALICO		4.6		-	-	藤田観光		4.4		6.2	15,196
H. U. グループホールディングス		31.7		108,411	グローバルキッズCOMPANY		2.1		2.7	2,130	KNT-CTホールディングス		6		8.7	12,754
アルプス技研		10		23,347	エアトリ		6.1		9	27,270	日本管財		12.2		15.1	42,083
サンックス		17.7		4,733	アトラエ		3.4		9.8	20,482	トーカイ		11		12.5	22,887
ダイオーズ		2.2		3,475	ストライク		4.2		5.3	21,995	白洋舎		1		1.7	2,050
日本空調サービス		12.2		11,730	ソラスト		27.7		34.5	36,570	セコム		111.3		138.5	1,147,749
オリエンタルランド		120.1		3,474,812	セラク		3.5		4.6	5,602	セントラル警備保障		5.4		6.8	16,109
ダスキン		26.2		89,650	インソース		9.4		13.7	26,112	丹青社		21.1		28.7	20,635
明光ネットワークジャパン		14.2		9,322	ベイカレント・コンサルティング		7.4		9.9	402,435	メイテック		13.8		17	113,900
ファルコホールディングス		5.4		14,048	Orchestra Holdings		2.5		2.8	7,834	応用地質		13.2		16	34,160
秀英予備校		2.8		1,519	アイモバイル		4		4	4,660	船研ホールディングス		23.1		28.8	66,643
田谷		1.7		991	キャリアインデックス		4.6		4.8	3,609	進学会ホールディングス		4.9		5.1	1,672
ラウンドワン		38.5		57,310	MS-Japan		4.5		5.7	5,061	オオバ		7.9		10.2	7,405
リゾートトラスト		51.7		123,390	船場		1.6		1.7	1,269	いであ		2.7		3.9	6,953
ビー・エム・エル		14.6		66,339	グレイステクノロジー		5.7		-	-	学究社		3.4		4.7	7,219
ワタベウェディング		1.7		-	ジャロバエンターテインメントホールディングス		32.5		44.5	71,422	ベネッセホールディングス		41.4		46.8	106,516
りらあコミュニケーションズ		17.1		21,917	フルテック		1.8		2.2	2,893	イオンデベロップメント		13.9		17.3	52,332
リソー教育		57.3		26,105	グリーンズ		4.2		5.3	2,501	ナック		5.6		7.4	7,266
早稲田アカデミー		4.4		8,104	ツナグループ・ホールディングス		1.7		3.4	1,030	ダイセキ		18.9		26	127,270
ユー・エス・エス		126.4		299,656	GAMEWITH		3.5		4.3	1,917	ステップ		4.3		5.3	9,481
東京個別指導学院		9.9		7,699	ソウルドアウト		2.7		3.5	3,174						
サイバーエージェント		69.6		508,221	MS&Consulting		1.9		2.4	1,576	合計	株数・金額	124,117.8	161,644	387,140,847	
楽天グループ		526.6		705,529	ウェルビー		-		9.1	11,129	銘柄数<比率>	2,183銘柄	2,174銘柄	1<97.4%>		
クリーグ・アンド・リバー社		5.8		13,087	エル・ディー・エス		0.8		1.8	4,152	(注1) 銘柄柄の( )内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。					
モーニングスター		12.4		14,424	ミダックホールディングス		2.4		6.2	15,710	(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。					
デー・オー・ダブリュー		19.8		7,489	日総工業		8.7		11	8,558	(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。					
山田コンサルティンググループ		6.6		8,565	キューベネットホールディングス		5.2		6.6	11,180						
セントラルスポーツ		4.2		12,844	RPAホールディングス		12.8		19.7	7,052						
フルキャストホールディングス		9.8		26,460	スプリックス		3.2		4	5,788						
エン・ジャパン		20.1		66,341	マネジメントソリューションズ		5.5		6.9	22,770						

## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	T O P I X	百万円 10,035		百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 387,140,847		% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,580,070		3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	399,720,917		100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	399,670,143,174円
一 般 株 式 (評 価 額)	11,420,891,042
株 未 入 式 (評 価 額)	387,140,847,090
株 未 入 式 (評 価 額)	11,243,540
株 未 入 式 (評 価 額)	655,237,202
株 未 入 式 (評 価 額)	441,924,300
(B) 負 債	2,333,527,720
負 債	909,720
負 債	2,332,618,000
(C) 純 資 産	397,336,615,454
純 資 産	124,570,625,521
純 資 産	272,765,989,933
(D) 受 益 権 益	124,570,625,521円
受 益 権 益	31,896円

(注1) 期首元本額	102,109,610,506円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	42,977,458円
追加設定元本額	163,175,331,486円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	17,916,384円
一部解約元本額	140,714,316,471円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	15,092,602円
(注2) 期末における元本の内訳		4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	105,875,155円
MHAMスリーウェイクオープン	561,857,238円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	985,477円
MHAM TOP I Xオープン	2,725,686,605円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	22,944,960円
MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ)	7,087,968,915円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	23,431,080円
One DC 国内株式インデックスファンド	20,422,344,253円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	21,508,092円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	4,704,569,337円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	14,273,870円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	3,424,028円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	22,637,856円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	23,972,661円	インカム重視マルチアセット運用ファンドI2021-04 (適格機関投資家限定)	193,585,816円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	78,308,323円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05	41,677,610円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	28,249,023円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	84,110,969円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	21,103,225円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-07	68,984,011円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	15,896,115円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-08	47,924,787円
たわらノーロード TOP I X	1,306,069,812円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	22,733,018円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,033,861,326円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-09	49,987,822円
たわらノーロード バランス (堅実型)	40,906,841円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-12	70,694,127円
たわらノーロード バランス (標準型)	262,619,504円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	329,597,803円
たわらノーロード バランス (積極型)	394,664,404円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	34,825,039円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	3,669,806円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	116,640,502円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	174,139,466円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適合型)	39,121,859円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	434,342,242円	リスクコントロール8資産/ラップファンド (FOF 5用) (適格機関投資家専用)	7,907,522円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	283,511,087円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	57,045,218円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	405,598,982円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	101,888,672円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	705,164円	DIAM国際分散/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	4,956,036円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	2,916,286円	DIAM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	26,722,846円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	36,588,931円	DIAM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	5,712,676円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	6,020,593円	DIAM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,338,373円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,009,153,068円	DIAM世界/バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	7,152,634円
Oneグローバルバランス	5,199,858円	DIAM世界/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	34,835,196円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,065,319,872円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	557,427,217円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,512,005,009円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	634,827,723円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,794,173,475円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,809,585,772円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	3,343,318,358円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	31,302,862円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,113,385,483円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	31,388,733円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,115,312,187円	DIAM アジャドグローバル/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	301,727,248円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	30,317,366円	DIAM世界アセット/バランスファンドVA (適格機関投資家限定)	74,733,048円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,055,563,450円	DIAM世界/バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,406,645円
マネックス資産設計ファンド エコリノベーション	18,529,124円	DIAM世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	349,638,985円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	304,544,955円	DIAM世界アセット/バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	20,826,409円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	306,459,778円	DIAM世界アセット/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	73,311,471円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	545,764,310円	DIAM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	173,199,524円
投資のソムリエ	13,743,021,171円	DIAM世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	237,769,545円
フルズコントロール	128,837,057円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	38,321,734円
投資のソムリエ<DC年金>	831,424,634円	DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	18,177,991円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	337,759,108円	DIAM世界アセット/バランスファンド7VA(121) (適格機関投資家限定)	291,737,796円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	549,884,906円	DIAM世界アセット/バランスファンド7VA(130) (適格機関投資家限定)	936,557,239円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,701,235円	DIAM世界アセット/バランスファンド7VA(136) (適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	5,513,567円	DIAM世界アセット/バランスファンド7VA(139) (適格機関投資家限定)	49,936,951円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	559,030,369円	動的パッケージ・ファンド<DC年金>	19,960,341円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,846,898,552円	コア資産形成ファンド	13,478,680円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	41,503,360円	MHAMトピックスファンド	692,612,483円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	20,515,309円	MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用)	65,067,902円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,618,660円	MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定)	2,686,127,829円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	146,712,017円	MHAM日本株式バッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,050,559,819円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	348,653,940円	期末元本合計	124,570,625,521円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,393,008,159円	担保資産	
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	279,145,423円	代用として担保を提供している資産はありません。	

## ■損益の状況

当期 自2021年2月9日 至2022年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	7,296,744,510円	
	受取配当金	7,292,821,896	
	受取利息	44,549	
	その他の収益	6,677,036	
	支払利息	△2,798,971	
(B)	有価証券売買損益	△7,496,155,473	
	売却益	39,449,298,775	
	売却損	△46,945,454,248	
(C)	先物取引等取引損益	654,522,360	
	取引益	1,686,367,190	
	取引損	△1,031,844,830	
(D)	当期損益金(A+B+C)	455,111,397	
(E)	前期繰越損益金	216,481,029,551	
(F)	解約差損益金	△309,165,756,529	
(G)	追加信託差損益金	364,995,605,514	
(H)	合計(D+E+F+G)	272,765,989,933	
	次期繰越損益金(H)	272,765,989,933	

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (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。