

償還 運用報告書（全体版）

第33期<償還日 2022年2月22日>

ニュートピックス インデックス

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	1989年2月23日から2022年2月22日までです。	
運用方針	わが国の株式市場の動きと信託財産の長期的な成長をとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）をモデルとして運用を行います。	
主要投資対象	ニュートピックス インデックス	ニュートピックス インデックス マザーファンド受益証券ならびに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ます。
	ニュートピックス インデックス マザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。
運用方法	<p>主としてニュートピックス インデックス マザーファンドへの投資を通じてわが国の上場株式へ投資します。株式への投資にあたっては、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、次のポートフォリオ管理を行います。</p> <p>株式の運用につきましては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルに従い、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。</p> <p>資金の流入に伴う売買にあたっては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルに従い売買を行います。</p> <p>株式の組入比率は、高位を保ちます。</p>	
組入制限	ニュートピックス インデックスのニュートピックス インデックス マザーファンド 組入上限比率	制限を設けません。
	ニュートピックス インデックス 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	<p>分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は、運用実績を考慮し、原則として利子・配当等収益を中心に決定いたします。留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>	

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、「ニュートピックス インデックス」は、この度、信託約款の規定に基づき、繰上償還の運びとなりました。

ここに、運用経過と償還内容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/>

ニュー トピックス インデックス

■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 比	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 配 分	み 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 率			
29期 (2018年2月22日)	円 7,956	0	% 13.6	ポイント 1,746.17	% 12.1	% 96.8	% 3.0	百万円 613
30期 (2019年2月22日)	7,448	0	△6.4	1,609.52	△7.8	96.5	3.0	528
31期 (2020年2月25日)	7,630	0	2.4	1,618.26	0.5	96.8	2.5	507
32期 (2021年2月22日)	9,300	0	21.9	1,938.35	19.8	97.8	1.5	527
(償 還 日) 2022年2月22日	(償還価額) 9,418.57	0	1.3	1,881.08	△3.0	-	-	470

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)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、(株東京証券取引所)が有しています。なお、本商品は、(株東京証券取引所)により提供、保証または販売されるものではなく、(株東京証券取引所)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4) △(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)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2021年2月22日	円 9,300	% -	ポイント 1,938.35	% -	% 97.8	% 1.5
2 月 末	8,948	△3.8	1,864.49	△3.8	98.2	1.5
3 月 末	9,455	1.7	1,954.00	0.8	95.6	3.0
4 月 末	9,182	△1.3	1,898.24	△2.1	96.9	2.3
5 月 末	9,303	0.0	1,922.98	△0.8	97.0	2.3
6 月 末	9,408	1.2	1,943.57	0.3	96.9	2.3
7 月 末	9,200	△1.1	1,901.08	△1.9	96.1	3.1
8 月 末	9,489	2.0	1,960.70	1.2	96.2	3.1
9 月 末	9,890	6.3	2,030.16	4.7	95.8	4.0
10 月 末	9,740	4.7	2,001.18	3.2	96.6	3.2
11 月 末	9,386	0.9	1,928.35	△0.5	95.8	4.1
12 月 末	9,709	4.4	1,992.33	2.8	95.9	2.5
2022年1月 末	9,237	△0.7	1,895.93	△2.2	95.3	4.1
(償 還 日) 2022年2月22日	(償還価額) 9,418.57	1.3	1,881.08	△3.0	-	-

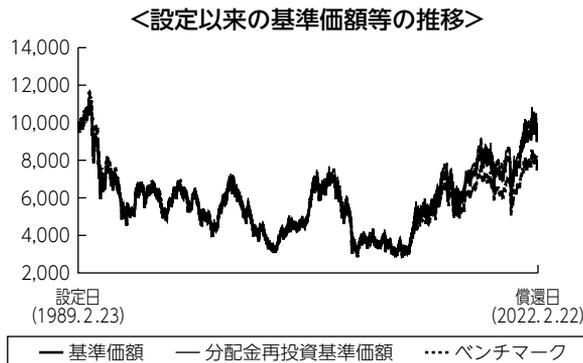
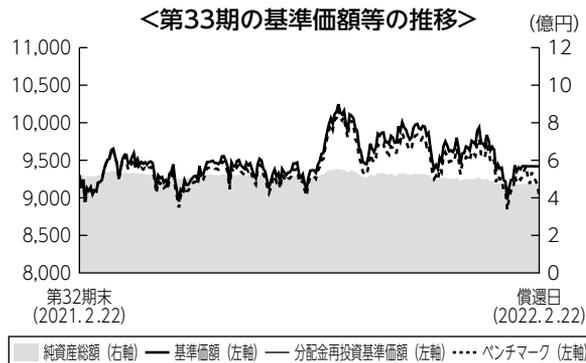
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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。

■設定以来の運用経過（1989年2月23日から2022年2月22日まで）

基準価額等の推移



- (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す。
- (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) 「第33期の基準価額等の推移」の分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 「設定以来の基準価額等の推移」の基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。分配金再投資基準価額およびベンチマークは、設定日前日を10,000として指数化しています。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの感染拡大、金融引き締めへの警戒感などから株式市場は下落したものの、保有株式の配当金が寄与し、基準価額（分配金再投資ベース）は前期末比で上昇しました。

設定来では、1990年からのバブル景気の後退や、2007年後半からの世界的に金融システム不安が高まった局面で、株式市場は大幅に下落し、基準価額（分配金再投資ベース）は下落しました。

設定来の投資環境

設定当初は日銀の緩和的な金融政策などを背景に上昇しましたが、1990年に入り日銀の金融引き締めの影響で信用収縮が進み、バブル景気の後退とともに大幅に下落しました。その後大手金融機関の破綻といった金融システム不安が高まったことなどが下値圧力となりました。2000年にかけては、日銀の緩和的な金融環境のなか、ハイテク企業が牽引役となり、戻りを試す展開となりましたがITバブル崩壊や国内金融機関の不良債権問題の深刻化などを背景に下落しました。

その後2007年前半までは世界的な景気回復を受けて上昇しましたが、サブプライム問題を背景とした米大手金融機関の経営破綻を契機に世界的に金融システム不安が高まり、大幅に下落しました。2009年から2012年までは金融機関の資本増強による信用不安の後退などがプラスに働いた一方、東日本大震災の影響などがマイナスに働き、ボックス圏で推移しました。2012年後半から期末までは、世界景気のリcoveryや政府・日銀による政策期待を背景に上昇基調となりました。

設定来のポートフォリオについて

●当ファンド

当ファンドの主要投資対象はニュー トピックス インデックス マザーファンドであり、マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。償還対応のため2022年2月9日以降はキャッシュを中心とした運用を行いました。

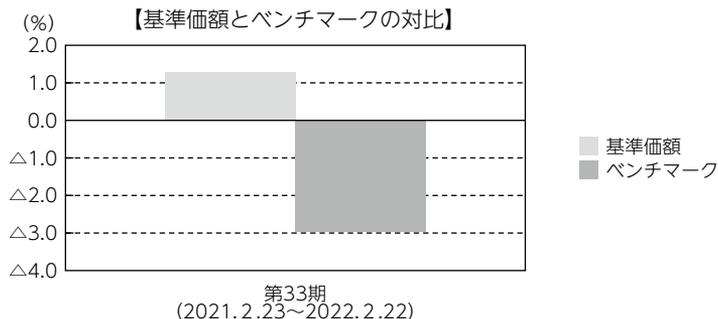
●ニュー トピックス インデックス マザーファンド

TOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目指し、わが国の株式市場の動きと信託財産の長期的成長を捉えることを目標としています。運用にあたっては、TOPIXにおける業種別、銘柄別時価構成比等を勘案し、ポートフォリオを構築しました。また、現物株式と株価指数先物取引を合計した実質の株式組入比率は高位に保ちました。

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3.0%下落しました。当ファンドはベンチマークを4.2%上回りました。この差異は、主に、保有株式の配当金のプラス要因と信託報酬などのマイナス要因、及び償還対応のため2022年2月9日以降にキャッシュを中心とした運用を行ったことによるものです。

設定来では、ベンチマークは23.9%下落しました。当ファンドはベンチマークを23.5%上回りました。この差異は、主に、保有株式の配当金のプラス要因と信託報酬などのマイナス要因、及び償還対応のため2022年2月9日以降にキャッシュを中心とした運用を行ったことによるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金 (税引前) 込みです。

このたび償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第33期		項目の概要
	(2021年2月23日 ～2022年2月22日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	63円	0.660%	(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9,512円です。 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
(投信会社)	(26)	(0.275)	
(販売会社)	(26)	(0.275)	
(受託会社)	(10)	(0.110)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、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)	(0)	(0.001)	
(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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(監査費用)	(0)	(0.001)	
合計	63	0.662	

(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まず。

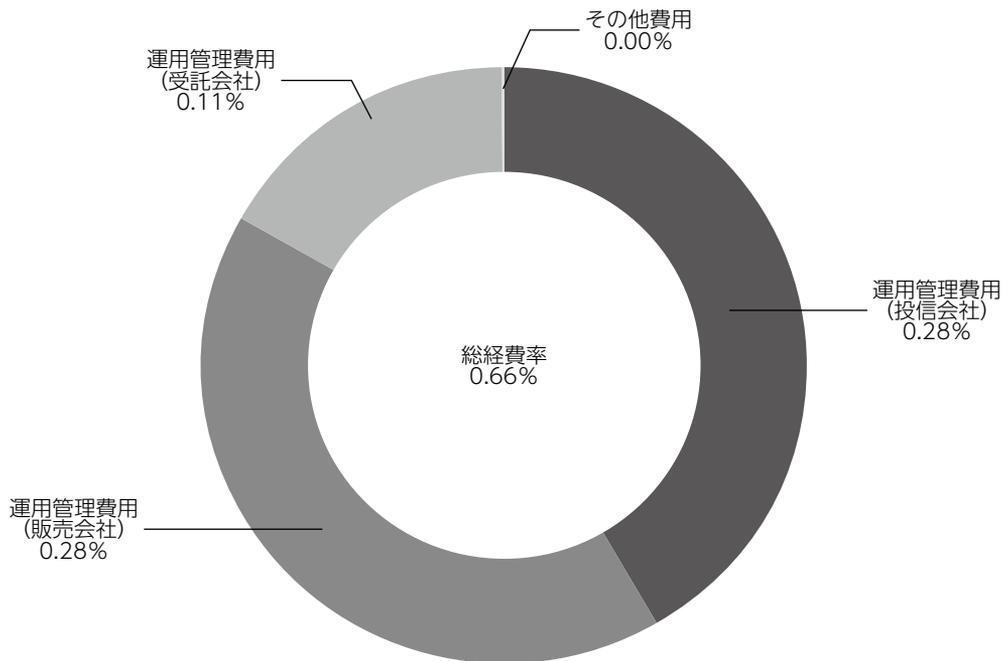
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.66%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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年2月23日から2022年2月22日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ニュートピックス インデックス マザーファンド	千□ 1	千円 3	千□ 196,867	千円 538,916

■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	ニュートピックス インデックス マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	1,055,955千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	2,369,044千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.44

(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23日から2022年2月22日まで）

【ニュートピックス インデックス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

期中の利害関係人との取引はありません。

(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)	6千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	5千円
(B)／(A)	80.4%

(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。

【ニュー トピックス インデックス 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

決 算 期 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 172	百万円 49	% 28.9	百万円 883	百万円 151	% 17.1
株 式 先 物 取 引	766	766	100.0	753	753	100.0

平均保有割合 20.7%

(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 0.484477	百万円 7	百万円 13

(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	期
株 式		百万円 5

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

償還時における有価証券の組入れはありません。前期末の組入れは以下の通りでした。

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	
	□	数
ニュー トピックス インデックス マザーファンド		千□ 196,865

■投資信託財産の構成

2022年2月22日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 473,636	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	473,636	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22日)現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	473,636,036円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	473,636,036
(B) 負 債	3,355,403
未 払 解 約 金	1,650,770
未 払 信 託 報 酬	1,704,375
未 払 利 息	258
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	470,280,633
元 本	499,312,219
償 還 差 損 益 金	△29,031,586
(D) 受 益 権 総 口 数	499,312,219口
1 万 口 当 た り 償 還 価 額(C / D)	9,418円57銭

(注) 期首における元本額は567,195,150円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は67,882,931円です。

■損益の状況

当期 自 2021年2月23日 至 2022年2月22日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,467円
受 取 利 息	3
支 払 利 息	△1,470
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,323,791
売 買 益	11,684,448
売 買 損	△2,360,657
(C) 信 託 報 酬 等	△3,402,310
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	5,920,014
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	199,454,386
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△234,405,986
(配 当 等 相 当 額)	(64,478,853)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△298,884,839)
(G) 合 計(D + E + F)	△29,031,586
償 還 差 損 益 金(G)	△29,031,586

(注1) (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2) (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。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	1989年2月23日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年2月22日		資産総額	473,636,036円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	3,355,403円
				純資産総額	470,280,633円
受益権口数	23,396,000,000口	499,312,219口	△22,896,687,781口	受益権口数	499,312,219口
元本額	23,396,000,000円	499,312,219円	△22,896,687,781円	1万口当たり償還金	9,418円57銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	26,841,291,196円	26,544,394,421円	9,889円	70円	0.70%
第2期	24,303,769,526	17,841,770,856	7,341	40	0.40
第3期	22,016,070,169	13,419,595,357	6,095	10	0.10
第4期	22,728,224,597	11,706,787,991	5,151	10	0.10
第5期	54,067,988,864	33,403,666,806	6,178	50	0.50
第6期	30,389,827,918	16,572,452,275	5,453	20	0.20
第7期	20,328,326,323	12,429,061,336	6,114	60	0.60
第8期	15,278,563,554	8,580,626,727	5,616	5	0.05
第9期	12,844,571,076	6,502,335,582	5,062	0	0.00
第10期	8,134,602,554	3,624,405,739	4,456	5	0.05
第11期	5,100,848,914	3,332,821,019	6,534	30	0.30
第12期	4,389,554,529	2,162,148,315	4,926	0	0.00
第13期	4,496,982,822	1,759,148,208	3,912	5	0.05
第14期	3,858,911,139	1,282,619,943	3,324	0	0.00
第15期	3,396,028,926	1,429,652,329	4,210	10	0.10
第16期	3,267,895,415	1,500,572,655	4,592	10	0.10
第17期	2,776,930,897	1,776,832,265	6,399	10	0.10
第18期	2,427,048,430	1,745,592,667	7,192	10	0.10
第19期	2,438,429,352	1,294,179,992	5,307	0	0.00
第20期	2,073,944,446	620,776,863	2,993	0	0.00
第21期	1,821,044,743	679,340,171	3,730	0	0.00
第22期	1,832,516,851	726,273,934	3,963	5	0.05
第23期	1,706,810,847	593,090,852	3,475	0	0.00
第24期	1,557,118,489	642,548,912	4,127	0	0.00
第25期	1,384,684,604	730,711,923	5,277	0	0.00
第26期	1,156,658,387	760,691,078	6,577	10	0.10

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 27 期	1,003,823,918円	578,205,292円	5,760円	0円	0.00%
第 28 期	906,722,869	634,966,163	7,003	0	0.00
第 29 期	771,135,618	613,527,006	7,956	0	0.00
第 30 期	709,680,599	528,599,579	7,448	0	0.00
第 31 期	664,937,247	507,326,663	7,630	0	0.00
第 32 期	567,195,150	527,491,803	9,300	0	0.00

償還金のお知らせ

1 万 口 当 たり 償 還 金 (税 引 前)	9,418円57銭
----------------------------	-----------

償還乗換えの優遇措置の適用について

当ファンドの償還金をもって他の証券投資信託をお求めになる場合には、購入時手数料のうち所定の額を返戻または割引く措置の適用を受けられる場合があります。優遇措置の適用は販売会社によって異なりますので、詳しくは販売会社までお問い合わせ下さい。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

運用報告書

第20期 (決算日 2022年1月14日)

(計算期間 2021年1月15日～2022年1月14日)

ニュー トピックス インデックス 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	原則、無期限です。
運 用 方 針	東証株価指数 (TOPIX) に連動する投資成果をめざした運用を行います。
主 要 投 資 対 象	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 比	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(ベンチマーク)	期 騰 落			
16期 (2018年1月14日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期 (2019年1月14日)	24,148	23.9	1,876.24	21.4	96.7	2.4	10,999
18期 (2020年1月14日)	20,126	△16.7	1,529.73	△18.5	96.9	2.9	6,806
19期 (2021年1月14日)	23,470	16.6	1,740.53	13.8	96.5	3.0	2,930
20期 (2022年1月14日)	25,887	10.3	1,873.28	7.6	96.4	3.6	2,623
20期 (2022年1月14日)	27,916	7.8	1,977.66	5.6	97.6	1.7	2,360

(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 (㈩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、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩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、㈩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)。

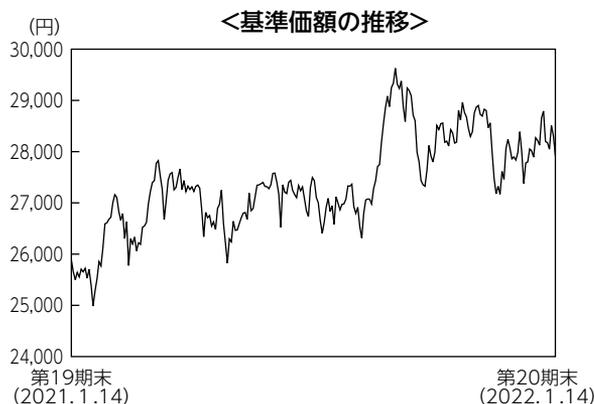
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX) (ベンチマーク)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
	円	騰 落 率 %	ポ イ ン ト	騰 落 率 %		
(期 首) 2021年 1 月 14 日	25,887	—	1,873.28	—	96.4	3.6
1 月 末	24,986	△3.5	1,808.78	△3.4	96.1	3.7
2 月 末	25,778	△0.4	1,864.49	△0.5	98.3	1.5
3 月 末	27,255	5.3	1,954.00	4.3	95.6	3.0
4 月 末	26,482	2.3	1,898.24	1.3	97.0	2.3
5 月 末	26,848	3.7	1,922.98	2.7	97.0	2.3
6 月 末	27,164	4.9	1,943.57	3.8	96.9	2.3
7 月 末	26,579	2.7	1,901.08	1.5	96.1	3.1
8 月 末	27,430	6.0	1,960.70	4.7	96.2	3.1
9 月 末	28,604	10.5	2,030.16	8.4	95.8	4.0
10 月 末	28,186	8.9	2,001.18	6.8	96.6	3.2
11 月 末	27,177	5.0	1,928.35	2.9	95.8	4.1
12 月 末	28,126	8.6	1,992.33	6.4	95.9	2.5
(期 末) 2022年 1 月 14 日	27,916	7.8	1,977.66	5.6	97.6	1.7

(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1月15日から2022年1月14日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は、前期末比で7.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

主として国内株式への投資を行った結果、市況が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初、米英における新型コロナウイルスのワクチン接種開始などが好感され、上昇基調で推移しました。しかしその後は、国内での感染再拡大や米インフレ加速懸念などから、軟調な展開となりました。2021年9月には、菅首相の自民党総裁選不出馬表明により、衆院選での与党大敗が回避されるとの期待などから上昇しましたが、期末にかけては、中国不動産大手の信用懸念拡大などをを受けて乱高下する展開となりました。

ポートフォリオについて

TOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目指し、わが国の株式市場の動きと信託財産の長期的成長を捉えることを目標としています。運用にあたっては、TOPIXにおける業種別、銘柄別時価構成比等を勘案し、ポートフォリオを構築しました。また、現物株式と株価指数先物取引を合計した実質の株式組入比率は、期を通じて高位に保ちました。

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5.6%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.2%程度上回りました。この差異は、主に、保有株式の配当金のプラス要因によるものです。

今後の運用方針

引き続き、TOPIXに連動した投資成果を目指し、運用を行います。運用にあたっては、実質の株式組入比率を高位に保ちます。

■ 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)	0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、組入有効証券等の売買の際に発生する手数料
合 計	0	0.002	
期中の平均基準価額は27,382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1月15日から2022年1月14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
		102.8 (43.638)	216,997 (-)	251.438	577,265

(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 708	百万円 773	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	794,262千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,382,433千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.33

(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1月15日から2022年1月14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 216	百万円 48	% 22.2	百万円 577	百万円 136	% 23.6
株 式 先 物 取 引	708	708	100.0	773	773	100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		当 期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
株 式	百万円 0.776677	百万円 4	百万円 17

(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	期
株 式		百万円 5

(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)	38千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	27千円
(B)/(A)	70.3%

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	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株		千円
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	1.3	1.2	649	
マルハニチロ	0.2	0.2	480	
雪国まいたけ	0.1	—	—	
サカタのタネ	0.2	0.1	342	
ホクト	0.1	0.1	192	
鉱業 (0.2%)				
住石ホールディングス	0.3	—	—	
三井松島ホールディングス	0.1	0.1	176	
I N P E X	4.9	4.6	5,009	
石油資源開発	0.2	0.1	275	
K & Oエナジーグループ	0.1	0.1	143	
建設業 (2.2%)				
ショーボンドホールディングス	0.2	0.2	984	
ミライト・ホールディングス	0.4	0.4	766	
タマホーム	0.1	0.1	279	
日本アクア	0.1	—	—	
Robot Home	0.3	—	—	
スペースバリューホールディングス	0.2	—	—	
安藤・間	0.8	0.6	528	
東急建設	0.4	0.4	277	
コムシスホールディングス	0.5	0.4	1,059	
ビーアールホールディングス	0.1	0.2	71	
高松コンストラクショングループ	0.1	0.1	195	
ヤマウラ	0.1	0.1	96	
オリエンタル白石	—	0.5	117	
大成建設	1	0.8	2,860	
大林組	3.1	2.6	2,353	
清水建設	3.1	2.5	1,807	
飛島建設	0.1	0.1	103	
長谷工コーポレーション	1.2	0.8	1,152	
松井建設	0.1	0.2	144	
鹿島建設	2.4	1.9	2,566	
不動テトラ	0.1	0.1	164	
鉄建建設	0.1	0.1	182	
西松建設	0.2	0.2	740	
三井住友建設	0.7	0.7	304	
大豊建設	0.1	—	—	
前田建設工業	0.8	—	—	
佐田建設	0.1	—	—	
ナカノフドー建設	0.1	—	—	
奥村組	0.1	0.2	655	
東鉄工業	0.1	0.1	243	
戸田建設	1.3	1.2	872	
熊谷組	0.1	0.1	294	
矢作建設工業	0.1	0.2	149	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株		千円
ピーエス三菱	0.1	—	—	
日本ハウスホールディングス	0.2	0.3	137	
大東建託	0.3	0.3	3,987	
新日本建設	0.1	0.2	157	
N I P P O	0.3	0.2	799	
前田道路	0.3	—	—	
東亜建設工業	0.1	0.1	233	
日本国土開発	0.3	0.3	164	
若築建設	0.1	0.1	172	
東洋建設	0.3	0.3	170	
五洋建設	1.2	1.1	706	
世紀東急工業	0.1	0.2	161	
住友林業	0.8	0.7	1,489	
日本基礎技術	0.1	—	—	
巴コーポレーション	0.1	—	—	
大和ハウス工業	3	2.5	8,432	
ライト工業	0.2	0.2	380	
積水ハウス	3.3	2.9	6,971	
日特建設	0.1	—	—	
北陸電気工事	0.1	—	—	
ユアテック	0.2	0.2	133	
日本リーテック	0.1	0.1	151	
中電工	0.1	0.1	213	
関電工	0.4	0.4	345	
きんでん	0.7	0.6	1,020	
東京エネシス	0.1	0.1	98	
住友電設	0.1	0.1	213	
日本電設工業	0.2	0.2	314	
エクシオグループ	0.5	0.4	962	
新日本空調	0.1	0.1	209	
九電工	0.2	0.2	693	
三機工業	0.2	0.2	286	
日揮ホールディングス	0.9	0.8	839	
ヤマト	0.1	—	—	
太平電業	0.1	0.1	280	
高砂熱学工業	0.2	0.2	382	
明星工業	0.2	0.2	143	
大気社	0.1	0.1	301	
ダイダシ	0.1	0.1	221	
日比谷総合設備	0.1	0.1	189	
インフロニア・ホールディングス	—	1.2	1,330	
OSJBホールディングス	0.5	—	—	
東洋エンジニアリング	0.1	0.1	70	
レイズネクスト	0.2	0.1	115	
食料品 (3.3%)				
ニッポン	0.3	0.2	328	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
日清製粉グループ本社	1.1	0.9	1,448	
昭和産業	0.1	0.1	268	
鳥越製粉	0.1	0.2	128	
中部飼料	0.1	0.2	202	
フィード・ワン	0.1	0.2	141	
日本甜菜製糖	0.1	0.1	170	
DM三井製糖ホールディングス	0.1	0.1	195	
塩水港精糖	0.1	—	—	
日新製糖	—	0.1	172	
森永製菓	0.2	0.2	766	
江崎グリコ	0.3	0.2	740	
名糖産業	—	0.1	166	
井村屋グループ	0.1	0.1	227	
不二家	0.1	—	—	
山崎製パン	0.7	0.6	903	
亀田製菓	0.1	—	—	
寿スピリッツ	0.1	0.1	485	
カルビー	0.4	0.4	1,086	
森永乳業	0.2	0.2	1,096	
六甲バター	0.1	0.1	150	
ヤクルト本社	0.7	0.6	3,504	
明治ホールディングス	0.7	0.6	4,230	
雪印メグミルク	0.2	0.2	408	
プリマハム	0.2	0.1	251	
日本ハム	0.4	0.3	1,294	
丸大食品	0.1	0.1	155	
S Foods	0.1	0.1	362	
伊藤ハム米久ホールディングス	0.6	0.4	267	
サッポロホールディングス	0.3	0.3	658	
アサヒグループホールディングス	2.2	2	9,300	
キリンホールディングス	4.2	3.1	5,792	
宝ホールディングス	0.7	0.6	697	
オエノンホールディングス	0.3	0.4	132	
コカ・コーラ ボトラーズ				
ジャパンホールディングス	0.8	0.6	807	
サントリ-食品インターナショナル	0.7	0.6	2,565	
ダイドーグループホールディングス	0.1	—	—	
伊藤園	0.3	0.3	1,845	
キーコーヒー	0.1	0.1	203	
日清オイリオグループ	0.1	0.1	295	
不二製油グループ本社	0.2	0.2	472	
J-オイルミルズ	0.1	0.1	171	
キッコーマン	0.7	0.6	5,124	
味の素	2.2	1.9	6,385	
キューピー	0.5	0.5	1,128	
ハウス食品グループ本社	0.4	0.3	878	
カゴメ	0.4	0.3	903	
アリアケジャパン	0.1	0.1	628	
ニチレイ	0.5	0.4	1,030	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
東洋水産	0.5	0.4	1,936	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.1	—	—	
日清食品ホールディングス	0.4	0.3	2,442	
フジッコ	0.1	0.1	192	
ロック・フィールド	0.1	0.1	151	
日本たばこ産業	5.3	4.6	10,869	
ケンコーマヨネーズ	0.1	0.1	136	
わらべや日洋ホールディングス	0.1	0.1	183	
なとり	0.1	0.1	200	
ファーマフーズ	—	0.1	198	
ユーグレナ	0.4	0.5	340	
理研ビタミン	0.1	0.1	169	
繊維製品 (0.5%)				
片倉工業	0.1	0.1	233	
グンゼ	0.1	0.1	406	
東洋紡	0.4	0.3	400	
ユニチカ	0.3	0.3	93	
倉敷紡績	0.1	0.1	192	
シキボウ	0.1	0.1	94	
日本毛織	0.3	0.3	274	
グイトウボウ	0.2	—	—	
グイド-リミテッド	0.1	—	—	
帝国繊維	0.1	0.1	197	
帝人	0.8	0.8	1,183	
東レ	7	6	4,440	
日本フェルト	0.1	—	—	
アツギ	0.1	—	—	
セーレン	0.2	0.2	503	
小松マテーレ	0.2	0.1	127	
ワコールホールディングス	0.2	0.2	422	
ホギメディカル	0.1	0.1	308	
T S Iホールディングス	0.3	0.3	98	
ワールド	0.1	0.1	114	
三陽商会	0.1	—	—	
オンワードホールディングス	0.6	0.6	181	
キムラタン	0.6	—	—	
ゴールドウイン	0.2	0.2	1,258	
デサント	0.2	0.2	809	
ヤマトインターナショナル	0.1	—	—	
パルプ・紙 (0.2%)				
特種東海製紙	0.1	0.1	409	
王子ホールディングス	4	3.5	2,068	
日本製紙	0.4	0.4	462	
三菱製紙	0.1	—	—	
北越コーポレーション	0.6	0.6	441	
大王製紙	0.5	0.4	751	
レンゴー	0.9	0.7	623	
トーモク	0.1	0.1	176	
ザ・バック	0.1	0.1	264	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
化学 (6.7%)			
北の達人コーポレーション	0.3	0.4	116
クラレ	1.5	1.2	1,258
旭化成	6.4	5.5	6,259
共和レザー	0.1	—	—
昭和電工	0.7	0.7	1,824
住友化学	7.1	6	3,552
日産化学	0.5	0.5	3,140
クレハ	0.1	0.1	892
テイカ	0.1	0.1	127
石原産業	0.2	0.1	121
日本曹達	0.1	0.1	334
東ソー	1.5	1.2	2,175
トクヤマ	0.3	0.3	553
セントラル硝子	0.2	0.1	212
東亜合成	0.6	0.5	563
大阪ソーダ	0.1	0.1	300
関東電化工業	0.2	0.2	228
デンカ	0.4	0.3	1,197
信越化学工業	1.7	1.4	27,160
堺化学工業	0.1	0.1	228
第一稀元素化学工業	0.1	0.1	120
エア・ウォーター	0.9	0.8	1,448
日本酸素ホールディングス	0.9	0.8	2,009
日本パーカライズン	0.5	0.4	436
高圧ガス工業	0.2	0.2	155
四国化成工業	0.1	0.1	139
ステラ ケミファ	0.1	—	—
日本触媒	0.1	0.1	532
大日精化工業	0.1	0.1	231
カネカ	0.2	0.2	777
三菱瓦斯化学	0.9	0.8	1,660
三井化学	0.9	0.8	2,664
J S R	0.9	0.8	3,224
東京応化工業	0.2	0.1	662
大阪有機化学工業	0.1	0.1	339
三菱ケミカルホールディングス	6.4	5.6	5,071
K Hネオケム	0.2	0.1	303
ダイセル	1.2	1.2	1,038
住友ベークライト	0.2	0.1	598
積水化学工業	2	1.7	3,298
日本ゼオン	0.9	0.8	1,134
アイカ工業	0.3	0.2	660
宇部興産	0.5	0.4	845
積水樹脂	0.2	0.1	207
タキロンシーアイ	0.2	0.2	110
旭有機材	0.1	0.1	173
ニチバン	0.1	0.1	177
リケンテクノス	0.2	0.3	150

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
積水化成成品工業	0.1	0.2	96
タイガースポリマー	0.1	—	—
ダイキョーニシカワ	0.2	0.2	123
森六ホールディングス	0.1	0.1	193
日本化薬	0.6	0.7	801
カーリットホールディングス	0.1	—	—
日本精化	0.1	0.1	244
扶桑化学工業	0.1	0.1	469
トリケミカル研究所	—	0.1	339
A D E K A	0.4	0.4	1,002
日油	0.4	0.3	1,596
新日本理化学	0.2	—	—
ハリマ化成グループ	0.1	0.1	83
花王	2.4	1.9	10,839
三洋化成工業	0.1	0.1	526
有機合成薬品工業	0.1	—	—
大日本塗料	0.1	0.2	163
日本ペイントホールディングス	0.8	3.1	2,945
関西ペイント	1.1	0.9	2,207
神東塗料	0.1	—	—
中国塗料	0.3	0.2	186
日本特殊塗料	0.1	0.1	88
藤倉化成	0.1	0.2	98
太陽ホールディングス	0.1	0.1	346
D I C	0.4	0.4	1,234
サカタインクス	0.2	0.2	199
東洋インキSCホールディングス	0.2	0.2	382
T & K T O K A	0.1	0.1	81
富士フィルムホールディングス	1.9	1.5	12,486
資生堂	2	1.6	9,420
ライオン	1.3	1	1,487
高砂香料工業	0.1	0.1	279
マンダム	0.2	0.2	273
ミルボン	0.1	0.1	561
ファンケル	0.4	0.3	899
コーセー	0.2	0.2	2,202
コタ	0.1	0.1	159
ポーラ・オルビスホールディングス	0.4	0.4	696
ノエビアホールディングス	0.1	0.1	504
エステー	0.1	0.1	152
コニシ	0.2	0.2	335
長谷川香料	0.2	0.1	256
星光PMC	0.1	—	—
小林製薬	0.3	0.2	1,694
荒川化学工業	0.1	0.1	117
メック	0.1	0.1	360
タカラバイオ	0.3	0.2	498
J C U	0.1	0.1	539
新田ゼラチン	0.1	0.2	135

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
デクセリアルズ	0.3	0.2	719
アース製薬	0.1	0.1	602
北興化学工業	0.1	0.1	88
クミアイ化学工業	0.4	0.3	237
日本農薬	0.2	—	—
アキレス	0.1	0.1	126
有沢製作所	0.1	0.1	105
日東電工	0.7	0.5	4,475
レック	0.1	0.1	87
三光合成	0.1	—	—
きもと	0.2	—	—
藤森工業	0.1	0.1	410
前澤化成工業	0.1	—	—
未来工業	0.1	—	—
J S P	0.1	0.1	164
エフピコ	0.2	0.2	788
天馬	0.1	0.1	265
信越ポリマー	0.2	0.2	220
東リ	0.2	0.4	86
ニフコ	0.4	0.3	1,150
バルカー	0.1	0.1	273
ユニ・チャーム	2.1	1.7	8,197
医薬品 (4.7%)			
協和キリン	1	1	2,938
武田薬品工業	8.2	6.7	22,404
アステラス製薬	8.5	7.4	13,900
大日本住友製薬	0.7	0.5	685
塩野義製薬	1.2	1.1	8,237
わかもと製薬	0.1	—	—
あすか製薬	0.1	—	—
日本新薬	0.3	0.2	1,528
中外製薬	3.1	2.7	10,125
科研製薬	0.2	0.1	432
エーザイ	1.2	1	6,198
ロート製薬	0.5	0.4	1,268
小野薬品工業	2.3	2	5,651
久光製薬	0.3	0.2	727
持田製薬	0.1	0.1	352
参天製薬	1.8	1.6	2,217
ツムラ	0.3	0.3	1,009
日医工	0.3	0.3	220
キッセイ薬品工業	0.2	0.2	454
生化学工業	0.2	0.2	194
栄研化学	0.2	0.2	374
鳥居薬品	0.1	—	—
J C R ファーマ	0.3	0.2	420
東和薬品	0.1	0.1	287
富士製薬工業	0.1	—	—
沢井製薬	0.2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゼリア新薬工業	0.2	0.2	400
第一三共	8.4	6.7	17,755
キョーリン製薬ホールディングス	0.2	0.2	367
大幸薬品	0.1	0.2	145
ダイト	0.1	0.1	299
大塚ホールディングス	2	1.8	7,354
大正製薬ホールディングス	0.2	0.2	1,072
ペプチドリーム	0.5	0.5	1,186
あすか製薬ホールディングス	—	0.1	101
サワイグループホールディングス	—	0.2	868
石油・石炭製品 (0.4%)			
日本コークス工業	0.8	0.9	126
ニチレキ	0.1	0.1	133
ユシロ化学工業	0.1	—	—
富士石油	0.3	—	—
出光興産	1.1	1	3,140
E N E O S ホールディングス	14.8	12.9	5,927
コスモエネルギーホールディングス	0.3	0.2	473
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	0.6	0.5	922
T O Y O T I R E	0.5	0.5	889
ブリヂストン	2.6	2.5	12,697
住友ゴム工業	0.9	0.8	956
藤倉コンポジット	0.1	—	—
オカモト	0.1	0.1	430
ニッタ	0.1	0.1	285
住友理工	0.2	0.2	124
三ツ星ベルト	0.1	0.1	215
バンダー化学	0.2	0.2	180
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日東紡績	0.1	0.1	289
A G C	0.9	0.8	4,160
日本板硝子	0.5	0.4	216
日本電気硝子	0.4	0.3	866
住友大阪セメント	0.2	0.2	705
太平洋セメント	0.6	0.5	1,159
日本ヒューム	0.1	0.2	141
日本コンクリート工業	0.2	—	—
アジアパイルホールディングス	0.1	0.3	134
東海カーボン	1	0.7	886
日本カーボン	0.1	—	—
東洋炭素	0.1	0.1	304
ノリタケカンパニーリミテド	0.1	—	—
T O T O	0.7	0.6	3,048
日本碍子	1.2	0.9	1,813
日本特殊陶業	0.7	0.6	1,257
ダントーホールディングス	0.1	—	—
ヨータイ	0.1	—	—
イソライト工業	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京窯業	0.1	—	—
フジミインコーポレーテッド	0.1	0.1	755
ニチアス	0.3	0.2	542
ニチハ	0.1	0.1	292
鉄鋼 (0.8%)			
日本製鉄	4.3	3.8	8,323
神戸製鋼所	1.8	1.6	998
中山製鋼所	0.1	0.2	98
合同製鐵	0.1	—	—
ジェイエフイーホールディングス	2.6	2.3	3,949
東京製鐵	0.5	0.3	445
共英製鋼	0.1	0.1	160
大和工業	0.2	0.2	774
大阪製鐵	0.1	—	—
淀川製鋼所	0.1	0.1	261
丸一鋼管	0.3	0.3	792
大同特殊鋼	0.2	0.1	443
日本冶金工業	0.1	0.1	248
山陽特殊製鋼	0.1	0.1	224
愛知製鋼	0.1	—	—
日立金属	1	0.9	1,897
大平洋金属	0.1	0.1	233
新日本電工	0.6	0.6	187
三菱製鋼	0.1	—	—
日亜鋼業	0.1	—	—
シンニッタン	0.2	—	—
非鉄金属 (0.8%)			
大紀アルミニウム工業所	0.2	0.1	179
日本軽金属ホールディングス	0.2	0.2	370
三井金属鉱業	0.3	0.2	672
三菱マテリアル	0.6	0.6	1,255
住友金属鉱山	1.2	1.1	5,574
DOWAホールディングス	0.2	0.2	1,022
古河機械金属	0.2	0.2	257
エス・サイエンス	0.4	—	—
大阪チタニウムテクノロジーズ	0.1	0.1	89
東邦チタニウム	0.2	0.2	204
UACJ	0.1	0.1	294
古河電気工業	0.3	0.3	726
住友電気工業	3.6	3.2	5,259
フジクラ	1.2	0.9	562
昭和電線ホールディングス	0.1	0.1	191
タツタ電線	0.2	0.2	99
平河ヒューテック	—	0.1	119
リョービ	0.1	0.1	123
アーレスティ	0.1	—	—
アサヒホールディングス	0.2	0.3	633
金属製品 (0.6%)			
稲葉製作所	0.1	0.1	135

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トーカロ	0.3	0.2	286
SUMCO	1.2	1.3	3,185
信和	0.1	—	—
東洋製罐グループホールディングス	0.6	0.6	837
ホッカンホールディングス	0.1	0.1	144
コロナ	0.1	—	—
横河ブリッジホールディングス	0.2	0.1	219
三和ホールディングス	0.9	0.8	996
文化シャッター	0.3	0.3	319
三協立山	0.1	0.1	66
アルインコ	0.1	—	—
LIXIL	1.4	1.3	3,719
日本フィルコン	0.1	—	—
ノーリツ	0.2	0.2	335
長府製作所	0.1	0.1	204
リンナイ	0.2	0.2	2,160
ダイニチ工業	0.1	—	—
日東精工	0.1	0.1	60
岡部	0.2	0.2	147
ジーテクト	0.1	0.1	149
東プレ	0.2	0.2	265
高周波熱練	0.2	0.2	125
東京製網	0.1	—	—
サンコール	0.1	—	—
モリテックスチール	0.1	—	—
パイオラックス	0.1	0.1	179
エイチワン	0.1	—	—
日本発条	1	0.8	798
三益半導体工業	0.1	0.1	258
機械 (5.7%)			
日本製鋼所	0.3	0.3	1,281
三浦工業	0.4	0.4	1,472
タクマ	0.3	0.3	432
ツガミ	0.2	0.2	326
オークマ	0.1	0.1	524
芝浦機械	0.1	0.1	382
アマダ	1.2	1.3	1,530
アイダエンジニアリング	0.3	0.2	220
FUJII	0.4	0.4	1,070
牧野フライス製作所	0.1	0.1	407
オーエスジー	0.5	0.4	832
旭ダイヤモンド工業	0.3	0.2	126
DMG森精機	0.6	0.5	997
ソディック	0.2	0.2	164
ディスコ	0.1	0.1	3,515
日東工器	0.1	0.1	172
日進工具	—	0.1	146
パンチ工業	0.1	—	—
豊和工業	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東洋機械金属	0.1	-	-
島精機製作所	0.2	0.1	197
オプトラン	0.1	0.1	244
イワキ	0.1	-	-
フリー	0.1	0.1	122
ヤマシンフィルタ	0.2	0.2	92
日阪製作所	0.1	0.2	163
やまびこ	0.2	0.2	234
ペガサスマシン製造	0.1	-	-
タツモ	-	0.1	148
ナプテスコ	0.6	0.5	1,830
三井海洋開発	0.1	0.1	144
レオン自動車	0.1	0.1	109
S M C	0.3	0.3	20,499
ホンカワミクロン	-	0.1	320
オイルス工業	0.1	0.1	165
サトーホールディングス	0.1	0.1	210
技研製作所	0.1	0.1	402
日精樹脂工業	0.1	0.1	108
小松製作所	4.4	3.9	11,719
住友重機械工業	0.6	0.5	1,499
日立建機	0.4	0.3	892
日工	0.1	0.2	124
井関農機	0.1	0.1	141
TOWA	0.1	0.1	300
北川鉄工所	-	0.1	142
クボタ	5.2	4.1	10,686
月島機械	0.2	0.2	217
帝国電機製作所	0.1	0.1	146
新東工業	0.2	0.3	213
澁谷工業	0.1	0.1	277
アイチコーポレーション	0.2	-	-
小森コーポレーション	0.2	0.3	216
鶴見製作所	0.1	0.1	168
荏原製作所	0.4	0.4	2,508
西島製作所	0.1	0.1	92
北越工業	0.1	0.1	97
ダイキン工業	1.3	1.1	27,830
栗田工業	0.5	0.5	2,625
椿本チエイン	0.1	0.1	323
木村化工機	0.1	0.1	80
アネスト岩田	0.2	0.2	157
ダイフク	0.5	0.5	4,285
加藤製作所	0.1	-	-
タダノ	0.5	0.5	581
フジテック	0.4	0.3	755
C K D	0.3	0.3	678
キトー	0.1	0.1	186
平和	0.3	0.2	386

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
理想科学工業	0.1	0.1	210
SANKYO	0.2	0.2	607
日本金銭機械	0.1	0.1	63
マースグループホールディングス	0.1	-	-
フクシマガリレイ	0.1	0.1	461
竹内製作所	0.2	0.1	306
アマノ	0.3	0.2	506
J U K I	0.1	0.1	84
サンデン	0.1	0.1	21
ジャノメ	0.1	-	-
マックス	0.1	0.1	186
グローリー	0.3	0.2	444
新晃工業	0.1	0.1	188
大和冷機工業	0.2	0.1	120
セガサミーホールディングス	1	0.8	1,442
T P R	0.1	0.1	154
ツバキ・ナカシマ	0.2	0.2	315
ホシザキ	0.3	0.3	2,625
大豊工業	0.1	-	-
日本精工	1.8	1.6	1,302
NTN	2.3	2	504
ジェイテクト	0.9	0.8	855
不二越	0.1	0.1	447
日本トムソン	0.3	0.2	134
T H K	0.6	0.5	1,466
ユーシン精機	0.1	0.1	73
前澤給装工業	-	0.1	100
イーグル工業	0.1	0.1	113
前澤工業	0.1	-	-
日本ピラー工業	0.1	0.1	350
キッツ	0.4	0.3	208
マキタ	1.3	1	4,834
三井E & Sホールディングス	0.4	0.4	162
日立造船	0.8	0.7	556
三菱重工業	1.6	1.3	4,121
I H I	0.7	0.5	1,219
サノヤスホールディングス	0.1	-	-
スター精密	0.2	0.1	158
電気機器 (19.4%)			
日清紡ホールディングス	0.6	0.6	556
イビデン	0.6	0.5	3,345
コニカミノルタ	2.1	1.9	1,012
ブラザー工業	1.2	1	2,228
ミネベアミツミ	1.8	1.5	4,560
日立製作所	4.7	4.1	28,130
東芝	-	1.5	7,378
三菱電機	9.8	8.5	12,962
富士電機	0.6	0.5	3,135
東洋電機製造	-	0.1	103

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
安川電機	1.1	0.9	4,545
シンフォニア テクノロジー	0.1	0.1	126
明電舎	0.2	0.1	273
デンヨー	0.1	0.1	174
P H Cホールディングス	—	0.1	196
東芝テック	0.1	0.1	443
マブチモーター	0.3	0.2	760
日本電産	2.4	2.2	26,840
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.1	0.1	45
トレックス・セミコンダクター	0.1	—	—
東光高岳	0.1	0.1	147
ダブル・スコープ	0.2	0.2	189
ダイヘン	0.1	0.1	462
ヤーマン	0.2	0.1	91
J V Cケンウッド	0.8	0.8	149
ミマキエンジニアリング	0.1	0.1	85
日新電機	0.2	0.2	320
大崎電気工業	0.2	0.2	95
オムロン	0.9	0.7	7,129
日東工業	0.1	0.1	159
I D E C	0.1	0.1	265
ジー・エス・ユアサ コーポレーション	0.3	0.3	790
日本電気	1.2	1.1	5,687
富士通	0.9	0.8	14,512
沖電気工業	0.4	0.4	362
サンケン電気	0.1	0.1	583
アイホン	0.1	—	—
ルネサスエレクトロニクス	4.2	4.6	6,596
セイコーエプソン	1.2	1.1	2,193
ワコム	0.7	0.7	628
アルバック	0.2	0.2	1,346
E I Z O	0.1	0.1	400
ジャパンディスプレイ	2.8	3	114
日本信号	0.3	0.3	272
京三製作所	0.2	0.3	131
能美防災	0.1	0.1	210
ホーチキ	0.1	0.1	127
エレコム	0.1	0.2	293
パナソニック	11.2	9.1	11,925
シャープ	1.1	1	1,314
アンリツ	0.6	0.5	887
富士通ゼネラル	0.3	0.2	524
ソニーグループ	6.2	5.4	76,626
T D K	0.5	1.2	5,394
タムラ製作所	0.3	0.3	200
アルプスアルパイン	0.9	0.8	919
日本電波工業	0.1	0.1	152
メイコー	—	0.1	459
ローランド ディー・ジー	0.1	0.1	325

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フォスター電機	0.1	0.1	75
ヨコオ	0.1	0.1	279
ティアック	0.1	—	—
ホシデン	0.3	0.2	232
ヒロセ電機	0.2	0.1	1,768
日本航空電子工業	0.2	0.2	394
T O A	0.1	0.2	159
マクセル	0.2	0.2	291
古野電気	0.1	0.1	127
スミダコーポレーション	0.1	0.1	112
アイコム	0.1	—	—
本多通信工業	0.1	—	—
船井電機	0.1	—	—
横河電機	0.9	0.9	1,800
アズビル	0.6	0.5	2,412
日本光電工業	0.4	0.4	1,264
共和電業	0.1	—	—
堀場製作所	0.2	0.2	1,270
アドバンテスト	0.7	0.6	6,432
エスベック	0.1	0.1	208
キーエンス	0.9	0.8	49,728
シスメックス	0.7	0.7	8,022
日本マイクロニクス	0.2	0.2	347
メガチップス	0.1	0.1	483
O B A R A G R O U P	0.1	—	—
コーセル	0.1	0.1	83
イリソ電子工業	0.1	0.1	435
オプテックスグループ	0.2	0.2	306
レーザーテック	0.4	0.4	12,000
スタンレー電気	0.7	0.6	1,764
ウシオ電機	0.5	0.4	732
岡谷電機産業	0.1	—	—
ヘリオス テクノ ホールディング	0.1	—	—
日本セラミック	0.1	0.1	259
古河電池	0.1	0.1	135
山一電機	0.1	0.1	226
図研	0.1	0.1	314
日本電子	0.2	0.2	1,434
カシオ計算機	0.9	0.6	841
ファナック	0.9	0.8	18,156
日本シイエムケイ	0.2	—	—
エンプラス	0.1	—	—
大真空	—	0.1	139
ローム	0.4	0.4	4,296
浜松ホトニクス	0.7	0.6	3,750
三井ハイテック	0.1	0.1	948
新光電気工業	0.3	0.3	1,590
京セラ	1.4	1.2	8,571
太陽誘電	0.4	0.4	2,504

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
村田製作所	2.9	2.5	22,657
双葉電子工業	0.2	0.2	139
ニチコン	0.3	0.3	382
日本ケミコン	0.1	0.1	180
KOA	0.1	0.1	157
市光工業	0.1	—	—
小糸製作所	0.6	0.5	3,185
ミツバ	0.2	0.2	87
SCREENホールディングス	0.2	0.1	1,299
キャノン電子	0.1	0.1	161
キャノン	4.9	4.2	11,655
リコー	2.5	2.4	2,527
象印マホービン	0.3	0.2	272
東京エレクトロン	0.6	0.5	32,610
輸送用機器 (8.9%)			
トヨタ紡織	0.3	0.3	724
ユニプレス	0.2	0.2	176
豊田自動織機	0.8	0.7	6,636
モリタホールディングス	0.2	0.2	260
三櫻工業	0.1	0.1	96
デンソー	2.2	1.9	18,525
東海理化電機製作所	0.3	0.2	323
川崎重工業	0.8	0.6	1,391
名村造船所	0.3	—	—
三菱ロジスネクスト	0.1	0.1	111
日産自動車	11.6	10	6,242
いすゞ自動車	2.8	2.7	4,074
トヨタ自動車	11	43	102,770
日野自動車	1.2	1.1	1,125
三菱自動車工業	3.6	3.2	1,059
エフテック	0.1	—	—
武蔵精密工業	0.2	0.2	405
日産車体	0.2	0.1	71
新明和工業	0.3	0.3	270
極東開発工業	0.2	0.2	301
トピー工業	0.1	0.1	116
曙ブレーキ工業	0.5	0.5	93
タチエス	0.2	0.2	265
NOK	0.5	0.4	524
フタバ産業	0.3	0.3	139
K Y B	0.1	0.1	336
大同メタル工業	0.2	0.3	191
プレス工業	0.5	0.5	210
ミクニ	0.1	—	—
太平洋工業	0.2	0.2	250
河西工業	0.1	—	—
アイシン	0.8	0.6	2,871
マツダ	2.9	2.7	2,643
今仙電機製作所	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
本田技研工業	7.7	6.7	23,269
スズキ	1.9	2	9,592
S U B A R U	3	2.4	5,192
ヤマハ発動機	1.4	1.1	3,135
T B K	0.1	—	—
エクセディ	0.1	0.1	174
豊田合成	0.3	0.3	815
愛三工業	0.2	0.2	170
日本プラスト	0.1	—	—
ヨロズ	0.1	0.1	106
エフ・シー・シー	0.2	0.2	313
シマノ	0.4	0.3	8,367
テイ・エス テック	0.2	0.4	598
精密機器 (2.6%)			
テルモ	2.8	2.4	10,324
日機装	0.3	0.3	242
日本エム・ディ・エム	0.1	0.1	163
島津製作所	1.2	1.1	4,548
JMS	0.1	—	—
長野計器	0.1	0.1	145
東京計器	0.1	0.1	100
インターアクション	0.1	—	—
オーバル	0.1	—	—
東京精密	0.2	0.1	512
マニー	0.4	0.4	647
ニコン	1.5	1.3	1,674
トプコン	0.5	0.4	629
オリンパス	5.4	4.5	10,383
理研計器	0.1	0.1	550
タムロン	0.1	0.1	275
HOYA	1.9	1.7	25,899
ノーリツ鋼機	0.1	0.1	239
エー・アンド・ディ	0.1	0.1	110
朝日インテック	1.1	0.9	1,958
シチズン時計	1.2	1	498
大研医器	0.1	—	—
メニコン	0.1	0.3	867
セイコーホールディングス	0.1	0.1	213
ニプロ	0.7	0.6	642
その他製品 (2.2%)			
スノーピーク	0.1	0.1	302
パラマウントベッドホールディングス	0.1	0.2	399
トランザクション	0.1	—	—
ニホンフラッシュ	0.1	0.1	105
前田工織	0.1	0.1	367
永大産業	0.1	—	—
アートネイチャー	0.1	—	—
パンダイナムコホールディングス	1	0.8	6,434
共立印刷	0.2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SHOEI	0.1	0.1	448
フランスベッドホールディングス	0.1	0.1	90
パイロットコーポレーション	0.2	0.1	414
萩原工業	0.1	0.1	123
トッパン・フォームズ	0.2	—	—
フジシールインターナショナル	0.2	0.2	451
タカラトミー	0.4	0.4	454
広済堂ホールディングス	0.1	—	—
プロネクサス	0.1	0.1	110
ホクシン	0.1	—	—
大建工業	0.1	0.1	214
凸版印刷	1.4	1.3	2,863
大日本印刷	1.3	1	2,847
NISSHA	0.2	0.2	315
TAKARA & COMPANY	—	0.1	197
アシックス	0.9	0.8	1,832
ローランド	—	0.1	390
ヤマハ	0.6	0.5	2,695
グリナップ	0.1	—	—
ピジョン	0.6	0.5	1,196
キングジム	0.1	—	—
リントック	0.2	0.2	547
イトーキ	0.2	0.3	106
任天堂	0.6	0.5	25,960
三菱鉛筆	0.2	0.2	237
タカラスタンダード	0.2	0.2	280
コクヨ	0.5	0.4	670
ナカバヤシ	0.1	—	—
グローブライド	—	0.1	307
オカムラ	0.3	0.3	365
美津濃	0.1	0.1	218
電気・ガス業 (1.1%)			
東京電力ホールディングス	7.8	6.4	1,881
中部電力	3	2.6	3,172
関西電力	3.7	3.2	3,500
中国電力	1.4	1.3	1,237
北陸電力	0.9	0.8	463
東北電力	2.5	2	1,632
四国電力	0.9	0.8	648
九州電力	2	1.7	1,455
北海道電力	0.9	0.8	413
沖縄電力	0.2	0.2	284
電源開発	0.8	0.7	1,046
エフオン	0.1	—	—
イーレックス	0.2	0.1	167
レノバ	0.2	0.2	323
東京瓦斯	1.9	1.6	3,515
大阪瓦斯	1.9	1.5	2,908
東邦瓦斯	0.5	0.4	1,202

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	0.1	0.1	151
広島ガス	0.2	0.3	110
西部ガスホールディングス	0.1	0.1	213
静岡ガス	0.3	0.2	199
メタウォーター	0.1	0.1	193
陸運業 (2.8%)			
SBSホールディングス	0.1	0.1	349
東武鉄道	1	0.8	2,100
相鉄ホールディングス	0.3	0.3	615
東急	2.5	2.1	3,129
京浜急行電鉄	1.3	1.1	1,256
小田急電鉄	1.5	1.3	2,600
京王電鉄	0.5	0.4	1,998
京成電鉄	0.7	0.6	1,777
富士急行	0.1	0.1	384
東日本旅客鉄道	1.7	1.5	10,050
西日本旅客鉄道	0.9	1	4,689
東海旅客鉄道	0.8	0.7	10,265
西武ホールディングス	1.3	1.1	1,153
鴻池運輸	0.2	0.1	118
西日本鉄道	0.3	0.2	507
ハマキョウレックス	0.1	0.1	289
サカイ引越センター	0.1	—	—
近鉄グループホールディングス	0.9	0.8	2,604
阪急阪神ホールディングス	1.2	1	3,245
南海電気鉄道	0.4	0.4	880
京阪ホールディングス	0.4	0.4	1,070
名古屋鉄道	0.8	0.7	1,281
山陽電気鉄道	0.1	0.1	197
日本通運	0.3	—	—
ヤマトホールディングス	1.5	1.1	2,756
山九	0.3	0.2	977
丸運	0.1	—	—
丸全昭和運輸	0.1	0.1	315
センコーグループホールディングス	0.5	0.3	281
ニッコンホールディングス	0.3	0.3	649
福山通運	0.1	0.1	380
セイノーホールディングス	0.7	0.5	571
日立物流	0.2	0.2	1,044
丸和運輸機関	0.2	0.2	289
C&Fロジホールディングス	0.1	0.1	143
九州旅客鉄道	0.8	0.6	1,409
SGホールディングス	2	1.5	3,832
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	0.3	2,157
海運業 (0.6%)			
日本郵船	0.8	0.7	6,839
商船三井	0.6	0.5	4,750
川崎汽船	0.3	0.3	2,388
N Sユニテッド海運	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
明治海運	0.1	0.1	79
飯野海運	0.4	0.4	222
乾汽船	0.1	0.1	265
空運業 (0.4%)			
日本航空	2.1	1.8	3,834
A N Aホールディングス	2.3	2.1	5,006
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
日新	0.1	0.1	164
三菱倉庫	0.3	0.3	829
三井倉庫ホールディングス	0.1	0.1	247
住友倉庫	0.3	0.3	591
滋澤倉庫	0.1	—	—
東陽倉庫	0.2	—	—
日本トランスシティ	0.2	0.2	130
中央倉庫	0.1	0.1	98
安田倉庫	0.1	—	—
東洋埠頭	—	0.1	143
宇徳	0.1	—	—
上組	0.5	0.4	888
近鉄エクスプレス	0.2	0.2	577
東海運	0.1	—	—
エーアイティ	0.1	0.1	143
情報・通信業 (7.7%)			
NEC ネットエスアイ	0.3	0.3	525
システナ	0.3	1.2	459
日鉄ソリューションズ	0.1	0.1	346
キューブシステム	0.1	—	—
コア	—	0.1	154
ラクーンホールディングス	—	0.1	135
T I S	1	0.8	2,468
グリー	0.6	0.5	433
コーエーテクモホールディングス	0.2	0.3	1,254
AGS	0.1	—	—
ファインデックス	0.1	0.1	96
K L a b	0.2	0.2	92
ホールトゥウィン・ビットフルホールディングス	0.1	0.2	192
ネクソン	2.4	1.9	3,876
アイスタイル	0.3	0.3	68
エイチーム	0.1	0.1	75
エニグモ	0.1	0.1	66
テクノスジャパン	0.1	—	—
e n i s h	0.1	—	—
コロプラ	0.3	0.3	197
オルトプラス	0.1	0.1	30
ブロードリーフ	0.5	0.5	188
デジタルハーツホールディングス	0.1	—	—
システム情報	0.1	0.1	87
じげん	0.2	0.3	89
ブイキューブ	0.1	0.1	92

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ディー・エル・イー	0.1	—	—
フィックスターズ	0.1	0.1	80
オプティム	0.1	0.1	112
ティーガイア	0.1	0.1	167
日本アジアグループ	0.1	—	—
テクマトリックス	0.1	0.2	305
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.2	0.2	496
GMOペイメントゲートウェイ	0.2	0.2	2,252
インターネットイニシアティブ	0.3	0.2	848
さくらインターネット	0.1	—	—
S R Aホールディングス	0.1	—	—
朝日ネット	0.1	—	—
e B A S E	0.1	0.1	54
アバント	0.1	0.1	106
フリービット	—	0.1	94
コムチュア	0.1	0.1	290
アステリア	0.1	—	—
アイル	0.1	0.1	125
メディカル・データ・ビジョン	0.1	0.1	112
g u m i	0.1	0.1	60
ラクス	—	0.3	737
オーブンドア	—	0.1	155
カナミックネットワーク	0.1	—	—
チェンジ	0.1	0.2	311
オークネット	0.1	—	—
AOI TYO HOLDINGS	0.1	—	—
マクロミル	0.2	0.2	218
マネーフォワード	—	0.1	516
プロトコーポレーション	0.1	0.1	133
野村総合研究所	1.4	1.6	6,976
サイバネットシステム	0.1	—	—
C Eホールディングス	0.1	—	—
インテージホールディングス	0.1	0.1	166
ソースネクスト	0.5	0.5	78
インフォコム	0.1	0.1	207
シンプレクス・ホールディングス	—	0.1	232
ラクスル	0.1	0.1	450
F I G	0.1	—	—
イーソル	0.1	—	—
アルテリア・ネットワークス	0.1	0.1	145
S a n s a n	—	0.3	538
ギフトィ	—	0.1	155
J M D C	—	0.1	577
フォーカスシステムズ	0.1	0.1	93
クレスコ	0.1	0.1	180
フジ・メディア・ホールディングス	0.9	0.8	925
オービック	0.3	0.3	5,475
ジャストシステム	0.2	0.1	506
T D Cソフト	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
Zホールディングス	13.2	12.1	7,453
トレンドマイクロ	0.5	0.5	2,850
日本オラクル	0.2	0.2	1,698
フューチャー	0.1	0.2	316
CAC Holdings	0.1	0.1	136
オービックビジネスコンサルタント	0.1	0.1	443
伊藤忠テクノソリューションズ	0.4	0.4	1,372
アイティフォー	0.1	0.2	160
大塚商会	0.5	0.5	2,490
サイボウズ	0.1	0.1	149
電通国際情報サービス	0.1	0.1	335
ACCESS	0.1	0.1	66
デジタルガレージ	0.2	0.1	453
イーエムシステムズ	0.1	0.2	139
CIJ	0.1	-	-
日本エンタープライズ	0.1	-	-
スカラ	0.1	-	-
インテリジェント ウェイブ	0.1	-	-
IMAGICA GROUP	0.1	-	-
ネットワンシステムズ	0.4	0.3	861
システムソフト	0.2	-	-
アルゴグラフィックス	0.1	0.1	329
マーベラス	0.1	0.2	144
エイベックス	0.2	0.1	134
日本ユニシス	0.3	0.3	933
兼松エレフトロニクス	0.1	-	-
都築電気	-	0.1	160
TBSホールディングス	0.6	0.5	832
日本テレビホールディングス	0.8	0.7	858
朝日放送グループホールディングス	0.1	0.1	70
テレビ朝日ホールディングス	0.3	0.2	295
スカパーJ SATホールディングス	0.6	0.7	305
テレビ東京ホールディングス	0.1	0.1	202
ビジョン	0.1	0.2	204
USEN-NEXT HOLDINGS	-	0.1	295
コネクシオ	0.1	0.1	141
日本通信	0.8	0.8	148
日本電信電話	12.9	8.8	28,793
KDDI	7	6.1	21,709
ソフトバンク	8.8	12.6	18,232
光通信	0.1	0.1	1,636
エムティーアイ	0.1	-	-
GMOインターネット	0.3	0.3	791
KADOKAWA	0.3	0.4	1,007
学研ホールディングス	0.1	0.1	104
ゼンリン	0.2	0.2	201
インプレスホールディングス	0.1	-	-
アイネット	-	0.1	131
松竹	0.1	0.1	1,151

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東宝	0.6	0.5	2,267
エヌ・ティ・ティ・データ	2.6	2.2	5,093
ピー・シー・エー	-	0.1	164
D T S	0.2	0.2	511
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.4	0.4	2,136
シーイーシー	0.1	0.1	107
カプコン	0.5	0.8	1,953
ジャステック	0.1	0.1	102
SCSK	0.2	0.6	1,237
アイネス	0.1	0.1	152
T K C	0.1	0.1	312
富士ソフト	0.1	0.1	501
NSD	0.3	0.3	601
コナミホールディングス	0.4	0.3	1,587
J B C Cホールディングス	0.1	0.1	168
ミロク情報サービス	0.1	0.1	132
ソフトバンクグループ	7.6	5	27,485
卸売業 (5.4%)			
エレマテック	0.1	0.1	107
あらた	0.1	0.1	420
フィールズ	0.1	-	-
双日	5.3	0.9	1,625
アルフレッサ ホールディングス	1.1	0.9	1,417
横浜冷凍	0.3	0.3	255
ラサ商事	0.1	-	-
アルコニックス	0.1	0.1	138
神戸物産	0.7	0.7	2,698
あい ホールディングス	0.1	0.1	188
ダイワボウホールディングス	0.1	0.4	709
マクニカ・富士エレホールディングス	0.2	0.2	530
バイタルケ・エスケー・ホールディングス	0.2	0.2	162
八洲電機	0.1	0.1	97
メディアスホールディングス	0.1	-	-
レスターホールディングス	0.1	0.1	197
TOKAIホールディングス	0.5	0.4	351
三洋貿易	0.1	0.1	100
ウイン・パートナーズ	0.1	0.1	96
シッパヘルスケアホールディングス	0.2	0.3	799
コマダホールディングス	0.2	0.2	410
フルサト・マルカホールディングス	-	0.1	248
ヤマエグループホールディングス	-	0.1	104
小野建	0.1	0.1	171
佐鳥電機	0.1	-	-
伯東	0.1	0.1	263
コンドーテック	0.1	0.1	102
中山福	0.1	-	-
ナガイレーベン	0.1	0.1	221
三菱食品	0.1	0.1	278
松田産業	0.1	0.1	239

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一興商	0.1	0.2	677
メディアパルホールディングス	1	0.9	1,870
アズワン	0.1	0.2	1,270
シモジマ	0.1	—	—
ドウシシャ	0.1	0.1	153
高速	0.1	0.1	154
丸文	0.1	0.1	80
ハピネット	0.1	—	—
日本ライフライン	0.3	0.3	333
タカショー	0.1	—	—
I DOM	0.3	0.3	228
進和	0.1	0.1	222
シークス	0.1	0.1	146
伊藤忠商事	6.8	5.9	20,632
丸紅	10.1	8.3	9,760
長瀬産業	0.5	0.5	930
蝶理	0.1	0.1	183
豊田通商	1.1	0.9	4,635
三共生興	0.1	0.2	112
兼松	0.4	0.3	387
三井物産	8.4	6.5	18,567
日本紙バルブ商事	0.1	—	—
カメイ	0.1	0.1	104
スターゼン	—	0.1	200
山善	0.4	0.4	422
住友商事	6.1	5.3	9,171
三菱商事	6.3	6.3	24,664
キャノンマーケティングジャパン	0.2	0.2	456
西華産業	0.1	0.1	158
佐藤商事	0.1	0.1	116
菱洋エレクトロ	0.1	0.1	239
東京産業	0.1	0.1	76
ユアサ商事	0.1	0.1	296
トルク	0.1	—	—
阪和興業	0.2	0.2	658
正栄食品工業	0.1	0.1	387
カナデン	0.1	0.1	102
菱電商事	0.1	0.1	171
フルサト工業	0.1	—	—
岩谷産業	0.3	0.2	1,164
アステナホールディングス	0.1	0.2	82
三菱石油	0.2	0.2	271
稲畑産業	0.2	0.2	336
明和産業	0.1	—	—
ヤマエ久野	0.1	—	—
ワキタ	0.2	0.2	207
東邦ホールディングス	0.3	0.3	523
サンゲツ	0.3	0.2	322
ミツウロコグループホールディングス	0.1	0.1	117

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
伊藤忠エネクス	0.2	0.1	100
サンリオ	0.3	0.3	702
サンワ テクノス	0.1	0.1	144
リョーサン	0.1	0.1	234
新光商事	0.1	0.1	88
トーホー	—	0.1	111
三信電気	0.1	—	—
東陽テクニカ	0.1	0.1	110
モスフードサービス	0.1	0.1	299
加賀電子	0.1	0.1	316
ソーダニッカ	0.1	0.1	81
立花エレテック	0.1	0.1	155
PAL TAC	0.2	0.1	422
三谷産業	0.1	—	—
国際紙バルブ商事	0.2	—	—
ヤマタネ	—	0.1	160
日鉄物産	0.1	0.1	543
トラスコ中山	0.2	0.2	523
オートバックスセブン	0.4	0.3	421
モリト	0.1	—	—
加藤産業	0.1	0.1	330
イノテック	0.1	0.1	156
イエローハット	0.2	0.2	325
J Kホールディングス	0.1	—	—
日伝	0.1	0.1	220
北沢産業	0.1	—	—
杉本商事	0.1	—	—
因幡電機産業	0.3	0.2	546
ミスミグループ本社	1.2	1.1	4,554
アルテック	0.1	—	—
スズケン	0.4	0.3	999
ジェコス	0.1	—	—
グローセル	0.1	—	—
小売業 (3.9%)			
ローソン	0.2	0.2	992
サンエー	0.1	0.1	401
カワチ薬品	0.1	0.1	221
エービーシー・マート	0.2	0.1	517
アスクル	0.1	0.1	144
ゲオホールディングス	0.2	0.1	119
アダストリア	0.1	0.1	161
ジーフット	0.1	—	—
くら寿司	0.1	0.1	358
バルグループホールディングス	0.1	0.1	151
エディオン	0.4	0.4	430
サーラコーポレーション	0.2	0.2	127
フジオフードグループ本社	0.1	0.1	127
ひらまつ	0.2	0.2	35
ハニーズホールディングス	0.1	0.1	100

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
アルペン	0.1	0.1	212	
クオールホールディングス	0.1	0.1	136	
ジンスホールディングス	0.1	0.1	686	
ビックカメラ	0.6	0.5	503	
DCMホールディングス	0.6	0.5	541	
ペッパーフードサービス	0.1	0.1	35	
MonotaRO	0.7	1.1	2,256	
アークランドサービスホールディングス	0.1	0.1	216	
J. フロント リテイリング	1.2	1	1,015	
ドトール・日レスホールディングス	0.1	0.2	307	
マツキヨココカラ&カンパニー	0.4	0.5	1,980	
ブロンコビリー	0.1	—	—	
ZOZO	0.7	0.6	1,920	
ココカラファイン	0.1	—	—	
三越伊勢丹ホールディングス	1.7	1.5	1,260	
ウエルシアホールディングス	0.6	0.4	1,296	
クリエイトSDホールディングス	0.2	0.1	318	
丸善CHIホールディングス	0.1	—	—	
シュッピン	0.1	0.1	102	
オイシックス・ラ・大地	0.1	0.1	273	
ネクステージ	0.2	0.2	614	
ジョイフル本田	0.3	0.3	457	
ホットランド	0.1	0.1	123	
すかいらーくホールディングス	1.1	1.1	1,606	
SFPホールディングス	0.1	0.1	136	
綿半ホールディングス	0.1	0.1	126	
ユナイテッド・スーパーマー ケット・ホールディングス	0.3	0.2	212	
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.1	—	—	
あさひ	0.1	0.1	140	
日本調剤	0.1	—	—	
コスモス薬品	0.1	0.1	1,567	
セブン&アイ・ホールディングス	3.8	3.3	17,031	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	0.5	0.5	342	
ツルハホールディングス	0.2	0.2	2,062	
サンマルクホールディングス	0.1	0.1	146	
トリドールホールディングス	0.2	0.2	470	
TOKYO BASE	0.1	—	—	
JMホールディングス	0.1	0.1	158	
アレンザホールディングス	—	0.1	107	
パロックジャパンリミテッド	0.1	0.1	86	
クスリのアオキホールディングス	0.1	0.1	674	
FOOD & LIFE COMPANIES	0.5	0.5	1,852	
メディカルシステムネットワーク	0.1	—	—	
ノジマ	0.2	0.1	237	
カッパ・クリエイト	0.1	0.1	131	
ライトオン	0.1	—	—	
良品計画	1.3	1	1,628	
三城ホールディングス	0.1	—	—	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
アドヴァングループ	0.1	—	—	
コナカ	0.1	—	—	
G-7ホールディングス	0.1	0.1	149	
イオン北海道	0.1	0.1	116	
コジマ	0.2	0.2	108	
コーナン商事	0.1	0.1	340	
ワタミ	0.1	0.1	87	
パン・パシフィック・インター ナショナルホールディングス	2.1	1.7	2,572	
西松屋チェーン	0.2	0.2	268	
ゼンショーホールディングス	0.5	0.4	1,067	
幸楽苑ホールディングス	0.1	0.1	135	
サイゼリヤ	0.1	0.1	278	
VTホールディングス	0.4	0.4	186	
フジ・コーポレーション	—	0.1	115	
ユナイテッドアローズ	0.1	0.1	181	
ハイデイ日高	0.1	0.1	165	
YU-WA CREATION HOLDINGS	0.1	—	—	
コロナイド	0.3	0.4	660	
ピーシーデポコーポレーション	0.1	—	—	
壱番屋	0.1	0.1	457	
スギホールディングス	0.2	0.2	1,380	
ヴィア・ホールディングス	0.1	—	—	
スクロール	0.1	0.1	87	
ヨンドシーホールディングス	0.1	0.1	173	
木曽路	0.1	0.1	219	
SRSホールディングス	0.1	0.2	154	
千趣会	0.2	0.2	74	
タカキュー	0.1	—	—	
リテールパートナーズ	0.1	0.1	131	
ケーヨー	0.2	0.2	168	
上新電機	0.1	0.1	207	
日本瓦斯	0.1	0.4	630	
ロイヤルホールディングス	0.2	0.1	178	
いなげや	0.1	0.1	138	
チヨダ	0.1	0.2	147	
ライフコーポレーション	0.1	0.1	328	
リンガーハット	0.1	0.1	219	
MrMaxHD	0.1	0.1	61	
テナアライド	0.1	0.1	30	
AOKIホールディングス	0.2	—	—	
オーグワ	0.2	0.2	185	
コメリ	0.1	0.1	253	
青山商事	0.2	0.2	142	
しまむら	0.1	0.1	979	
はせがわ	0.1	—	—	
高島屋	0.7	0.6	634	
松屋	0.2	0.2	152	
エイチ・ツー・オー リテイリング	0.5	0.4	317	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸井グループ	0.9	0.7	1,497
アクシアル リテイリング	0.1	0.1	325
井筒屋	0.1	—	—
イオン	3.7	3.2	7,662
イズミ	0.2	0.2	613
平和堂	0.2	0.2	383
フジ	0.1	0.1	189
ヤオコー	0.1	0.1	667
ゼビオホールディングス	0.1	0.1	91
ケースホールディングス	0.9	0.8	891
日産東京販売ホールディングス	0.1	—	—
ブックオフグループホールディングス	0.1	—	—
アインホールディングス	0.1	0.1	560
ヤマダホールディングス	2.9	3	1,200
アークランドサカモト	0.2	0.1	155
ニトリホールディングス	0.4	0.3	5,017
グルメ杵屋	0.1	0.1	97
愛眼	0.1	—	—
ケーユーホールディングス	0.1	—	—
吉野家ホールディングス	0.3	0.3	701
サガミホールディングス	0.1	0.2	205
関西スーパーマーケット	0.1	0.1	103
王将フードサービス	0.1	0.1	600
プレナス	0.1	0.1	198
ミニストップ	0.1	0.1	140
アークス	0.2	0.2	420
パローホールディングス	0.2	0.2	437
大 庄	0.1	—	—
ファーストリテイリング	0.1	0.1	6,391
サンドラッグ	0.4	0.3	901
サックスパー ホールディングス	0.1	—	—
ペルーナ	0.2	0.2	142
銀行業 (5.3%)			
じもとホールディングス	0.1	—	—
めびぎフィナンシャルグループ	5	4.3	1,118
東京きらぼしフィナンシャルグループ	0.1	0.1	164
九州フィナンシャルグループ	2.1	1.8	817
ゆうちょ銀行	2.7	1.9	2,133
富山第一銀行	0.2	0.5	154
コンコルディア・フィナンシャルグループ	5.5	4.7	2,246
西日本フィナンシャルホールディングス	0.6	0.5	399
関西みらいフィナンシャルグループ	0.6	—	—
三十三フィナンシャルグループ	0.1	0.1	151
第四北越フィナンシャルグループ	0.2	0.1	268
ひろぎんホールディングス	1.4	1.3	955
おきなわフィナンシャルグループ	—	0.1	238
十六フィナンシャルグループ	—	0.1	230
北國フィナンシャルホールディングス	—	0.1	294
新生銀行	0.7	0.5	1,063

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
あおぞら銀行	0.6	0.5	1,340
三菱UFJフィナンシャル・グループ	66.3	53.2	37,654
りそなホールディングス	10.5	9.7	4,967
三井住友トラスト・ホールディングス	1.8	1.6	6,830
三井住友フィナンシャルグループ	6.7	5.8	24,951
千葉銀行	3.2	2.7	2,011
群馬銀行	1.9	1.9	716
武蔵野銀行	0.1	0.1	187
千葉興業銀行	0.3	—	—
筑波銀行	0.4	0.6	118
七十七銀行	0.3	0.3	427
青森銀行	0.1	0.1	193
秋田銀行	0.1	0.1	171
山形銀行	0.1	0.1	94
岩手銀行	0.1	0.1	198
東邦銀行	0.9	0.8	176
東北銀行	—	0.1	105
みちのく銀行	0.1	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	0.8	0.7	1,596
静岡銀行	2.4	2	1,772
十六銀行	0.1	—	—
スルガ銀行	1	0.7	352
八十二銀行	2.3	2	836
山梨中央銀行	0.1	0.1	94
大垣共立銀行	0.2	0.2	403
福井銀行	0.1	0.1	145
北國銀行	0.1	—	—
清水銀行	—	0.1	161
滋賀銀行	0.2	0.2	441
南都銀行	0.2	0.1	199
百五銀行	0.9	0.7	252
京都銀行	0.3	0.3	1,674
紀陽銀行	0.3	0.3	440
ほくほくフィナンシャルグループ	0.6	0.6	563
山陰合同銀行	0.6	0.5	335
中国銀行	0.8	0.7	665
伊予銀行	1.4	1.2	733
百十四銀行	0.1	0.1	156
四国銀行	0.1	0.2	161
阿波銀行	0.2	0.1	227
大分銀行	0.1	0.1	200
宮崎銀行	0.1	0.1	214
佐賀銀行	0.1	—	—
沖縄銀行	0.1	—	—
琉球銀行	0.2	0.2	162
セブン銀行	3.2	2.2	558
みずほフィナンシャルグループ	13.2	10.7	17,103
山口フィナンシャルグループ	1.2	1	723
名古屋銀行	0.1	0.1	304

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
北洋銀行	1.5	1.3	340	
愛媛銀行	0.1	0.1	89	
京葉銀行	0.4	0.4	198	
栃木銀行	0.5	0.7	158	
東和銀行	0.2	0.3	168	
福島銀行	0.1	—	—	
大東銀行	0.1	—	—	
トモニホールディングス	0.7	0.6	201	
フィデアホールディングス	0.9	0.1	145	
池田泉州ホールディングス	1.1	1.1	204	
証券・商品先物取引業 (0.8%)				
F P G	0.3	0.4	286	
S B Iホールディングス	1.1	1	3,235	
日本アジア投資	0.1	—	—	
ジャフコ グループ	0.1	0.1	641	
大和証券グループ本社	7.8	6.3	4,413	
野村ホールディングス	17	12.9	6,857	
岡三証券グループ	0.8	0.7	279	
丸三証券	0.3	0.3	165	
東洋証券	0.3	—	—	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1.1	1.1	462	
水戸証券	0.3	0.4	111	
いちよし証券	0.2	—	—	
松井証券	0.6	0.4	324	
マネックスグループ	0.7	0.7	451	
極東証券	0.1	0.2	159	
岩井コスモホールディングス	0.1	0.1	143	
アイザワ証券グループ	0.2	0.2	211	
マネーパートナーズグループ	0.1	—	—	
スパークス・グループ	0.4	0.5	132	
保険業 (2.2%)				
かんぽ生命保険	0.3	0.8	1,689	
SOMPOホールディングス	1.8	1.4	7,501	
アニコム ホールディングス	0.3	0.3	227	
MS & Aディンシュアランスグループホールディングス	2.5	1.9	7,565	
第一生命ホールディングス	5.5	4.1	11,096	
東京海上ホールディングス	3.4	2.8	19,586	
T & Dホールディングス	2.9	2.2	3,878	
その他金融業 (1.2%)				
全国保証	0.3	0.2	1,050	
日本モーゲージサービス	—	0.1	112	
アルヒ	0.2	0.1	119	
プレミアグループ	0.1	—	—	
クレディセゾン	0.7	0.5	635	
芙蓉総合リース	0.1	0.1	793	
みずほリース	0.1	0.1	318	
東京センチュリー	0.2	0.2	1,124	
日本証券金融	0.4	0.3	282	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
アイフル	1.5	1.4	525	
リコーリース	0.1	0.1	386	
イオンフィナンシャルサービス	0.6	0.5	617	
アコム	1.9	1.6	545	
ジャックス	0.1	0.1	307	
オリエントコーポレーション	2.6	2.3	308	
日立キャピタル	0.2	—	—	
オリックス	6	5.1	13,030	
三菱HCキャピタル	2.5	3	1,854	
日本取引所グループ	2.8	2.1	5,188	
イー・ギャランティ	0.1	0.1	199	
アサックス	0.1	0.2	139	
不動産業 (1.8%)				
いちご	1.2	1	280	
日本駐車場開発	1	1.2	162	
スター・マイカ・ホールディングス	0.1	0.1	143	
A Dワークスグループ	0.2	—	—	
ヒューリック	2.1	2	2,058	
野村不動産ホールディングス	0.6	0.4	1,053	
三重交通グループホールディングス	0.2	0.2	94	
サムティ	0.1	0.1	210	
ディア・ライフ	0.1	0.1	54	
地主	0.1	0.1	170	
プレサンスコーポレーション	0.2	0.1	207	
日本管理センター	0.1	—	—	
フージャースホールディングス	0.2	0.2	136	
オープンハウスグループ	0.3	0.3	1,797	
東急不動産ホールディングス	2.6	2.5	1,577	
飯田グループホールディングス	0.8	0.7	1,947	
ムゲンエステート	0.1	—	—	
パーク24	0.5	0.5	766	
三井不動産	4.7	3.8	8,605	
三菱地所	6.8	5.5	8,882	
平和不動産	0.2	0.1	391	
東京建物	1	0.8	1,330	
ダイビル	0.2	0.2	440	
京阪神ビルディング	0.2	0.1	151	
住友不動産	2.2	1.8	6,120	
テオーシー	0.2	—	—	
レオパレス21	1.3	0.8	140	
スターツコーポレーション	0.1	0.1	245	
フジ住宅	0.1	0.2	136	
空港施設	0.1	—	—	
明和地所	0.1	—	—	
ゴールドクレスト	0.1	—	—	
エスリード	—	0.1	171	
日神グループホールディングス	0.1	0.1	49	
日本エスコン	0.2	0.2	153	
タカラレーベン	0.4	0.6	179	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
AVANTIA	0.1	—	—
イオンモール	0.5	0.4	641
ランド	5.3	4.5	45
カチタス	0.2	0.2	763
トーセイ	0.1	0.1	103
サンフロンティア不動産	0.1	0.2	205
FJネクストホールディングス	0.1	0.1	100
グランディハウス	0.1	—	—
日本空港ビルデング	0.3	0.3	1,396
サービス業 (5.8%)			
日本工営	0.1	—	—
LIFULL	0.3	0.3	71
ミクシィ	0.2	0.2	414
ジェイエイシーリクルートメント	0.1	0.1	201
日本M&Aセンターホールディングス	0.7	1.3	3,036
UTグループ	0.1	0.1	380
アイティメディア	—	0.1	162
タケエイ	0.1	—	—
夢真ビーネックスグループ	0.1	0.2	317
コシダカホールディングス	0.2	0.3	174
パソナグループ	0.1	0.1	286
リンクアンドモチベーション	0.2	0.2	96
GCA	0.1	—	—
エス・エム・エス	0.3	0.3	1,068
パーソルホールディングス	0.9	0.8	2,412
フックパッド	0.3	0.3	78
シミックホールディングス	—	0.1	149
総合警備保障	0.4	0.3	1,297
カカココム	0.7	0.6	1,573
セントケア・ホールディング	0.1	—	—
ルネサンス	0.1	0.1	103
ディップ	0.1	0.1	347
デジタルホールディングス	0.1	0.1	132
新日本科学	0.1	0.1	131
ツイクホールディングス	0.2	—	—
ベネフィット・ワン	0.3	0.3	1,147
エムスリー	2.1	1.4	6,543
ツカダ・グローバルホールディング	0.1	—	—
アウトソーシング	0.5	0.5	845
ウェルネット	0.1	0.3	134
ディー・エヌ・エー	0.4	0.3	519
博報堂DYホールディングス	1.3	1.1	2,108
ぐるなび	0.2	0.2	78
タカミヤ	0.1	—	—
ジャパンベストレスキューシステム	0.1	—	—
ファンコミュニケーションズ	0.3	0.3	113
エスピーール	0.2	0.2	224
ティア	0.1	—	—
アドウェイズ	—	0.1	80

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
バリューコマース	0.1	0.1	378
インフォーマート	0.9	0.9	712
J Pホールディングス	0.3	0.4	92
エコナックホールディングス	0.2	—	—
E P Sホールディングス	0.1	—	—
プレステージ・インターナショナル	0.4	0.3	203
アミューズ	0.1	0.1	201
クイック	0.1	0.1	132
TAC	0.1	—	—
電通グループ	1.1	0.8	3,264
シーティーエス	0.1	0.1	78
H. U. グループホールディングス	0.3	0.2	567
アルプス技研	0.1	0.1	183
サニックス	0.2	0.1	22
日本空調サービス	0.1	0.1	79
オリエンタルランド	1	1	18,440
ダスキン	0.2	0.2	548
明光ネットワークジャパン	0.1	0.2	113
ファルコホールディングス	0.1	—	—
ラウンドワン	0.3	0.2	253
リゾートトラスト	0.4	0.4	745
ビー・エム・エル	0.1	0.1	357
りらいあコミュニケーションズ	0.2	0.1	99
リソー教育	0.4	0.4	134
ユー・エス・エス	1.1	0.9	1,727
サイバーエージェント	0.6	2	3,598
楽天グループ	4.4	4.2	4,620
クリーク・アンド・リバー社	—	0.1	170
モーニングスター	0.1	0.1	62
テー・オー・ダブリュー	0.1	0.3	90
山田コンサルティンググループ	0.1	—	—
フルキャストホールディングス	0.1	0.1	212
エン・ジャパン	0.2	0.1	305
テクノプロ・ホールディングス	0.2	0.5	1,615
Keeper 技研	0.1	0.1	199
Gunosy	0.1	—	—
リブセンス	0.1	—	—
ジャパンマテリアル	0.3	0.3	549
ベクトル	0.1	0.1	107
チャーム・ケア・コーポレーション	0.1	0.1	129
IBJ	0.1	0.1	78
アサンテ	—	0.1	172
N・フィールド	0.1	—	—
M&Aキャピタルパートナーズ	0.1	0.1	473
シグマクシス・ホールディングス	0.1	—	—
ウィルグループ	0.1	0.1	127
エスクロー・エージェント・ジャパン	0.1	—	—
メドピア	—	0.1	316
リクルートホールディングス	6.7	6.3	38,108

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エラン	0.1	0.1	102
日本郵政	7.7	10.6	10,501
ベルシステム24ホールディングス	0.2	0.1	130
鎌倉新書	0.1	0.1	56
エアトリ	0.1	0.1	238
アトラエ	—	0.1	186
ソラスト	0.3	0.2	221
インソース	0.1	0.1	207
ペイカレント・コンサルティング	0.1	0.1	3,620
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	0.2	0.3	553
ウェルビー	—	0.1	121
日総工産	0.1	—	—
キュービーネットホールディングス	—	0.1	170
RPAホールディングス	0.1	—	—
カープスホールディングス	0.3	0.3	211
LITALICO	—	0.1	311
リログループ	0.5	0.4	822
東祥	0.1	0.1	146
TREホールディングス	—	0.1	161
エイチ・アイ・エス	0.1	0.2	362
共立メンテナンス	0.2	0.1	391
イチネンホールディングス	0.1	0.1	132
建設技術研究所	0.1	—	—
スペース	0.1	0.1	88
東京テアトル	—	0.1	121
東京都競馬	0.1	0.1	406
常磐興産	—	0.1	135

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カナモト	0.2	0.1	237
東京ドーム	0.4	—	—
西尾レントオール	0.1	0.1	275
アゴーラ ホスピタリティー グループ	0.5	—	—
トランス・コスモス	0.1	0.1	318
乃村工藝社	0.4	0.4	402
KNT-CTホールディングス	0.1	—	—
日本管財	0.1	0.1	284
トーカイ	0.1	0.1	196
セコム	1	0.8	6,264
丹青社	0.2	0.2	155
メイテック	0.1	0.1	670
応用地質	0.1	0.1	202
船井総研ホールディングス	0.2	0.2	473
オオバ	0.1	0.1	76
ベネッセホールディングス	0.3	0.3	664
イオンディライト	0.1	0.1	304
ナック	0.1	—	—
ダイセキ	0.2	0.1	441
合 計	株 数 ・ 金 額	千株	千株
	銘柄数<比率>	1,031.7	926.7
		1,506銘柄	1,313銘柄
			2,304,243
			<97.6%>

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価額に対する各業種の比率です。

(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。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	柄 別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	T O P I X	百万円 39	百万円 —

■投資信託財産の構成

2022年1月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	2,304,243	97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	69,197	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	2,373,440	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1月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,373,440,298円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	64,746,637
株 式(評価額)	2,304,243,130
未 収 入 金	154,613
未 収 配 当 金	3,175,918
差 入 委 託 証 拠 金	1,120,000
(B) 負 債	12,582,660
未 払 金	30,660
未 払 解 約 金	12,552,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,360,857,638
元 本	845,701,521
次 期 繰 越 損 益 金	1,515,156,117
(D) 受 益 権 総 口 数	845,701,521口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,916円

(注1) 期首元本額 1,013,423,187円
追加設定元本額 59,792,741円
一部解約元本額 227,514,407円

(注2) 期末における元本の内訳
ニュートピックス インデックス 175,009,217円
新光7資産バランスファンド 239,469,774円
ニュートピックス インデックス (変額年金) 50,975,231円
世界バランスファンド35VA (適格機関投資家私募) 321,610,277円
新光ワールドバランスファンドVA (適格機関投資家私募) 12,990,357円
ワールドバランスファンド30VA (適格機関投資家私募) 20,630,689円
ワールドバランスファンド30VA2 (適格機関投資家私募) 8,657,050円
太陽財形株投 太陽一般財形 30 4,179,996円
太陽財形株投 太陽一般財形 50 11,419,011円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形30 759,919円
期末元本合計 845,701,521円

■損益の状況

当期 自2021年1月15日 至2022年1月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	51,923,128円
受 取 配 当 金	51,918,569
そ の 他 収 益 金	15,877
支 払 利 息	△11,318
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	136,294,355
売 買 益	328,669,618
売 買 損	△192,375,263
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	10,774,250
取 引 益	15,785,170
取 引 損	△5,010,920
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	198,991,733
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,610,075,638
(F) 解 約 差 損 益 金	△398,475,513
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	104,564,259
(H) 合 計(D+E+F+G)	1,515,156,117
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,515,156,117

(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。