

# 運用報告書 (全体版)

第27期<決算日2021年2月1日>

## 太陽財形株投 太陽一般財形 30

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	原則、無期限です。	
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の成長をはかることを目的として、安定運用を行います。	
主要投資対象	太陽財形株投 太陽一般財形 30	太陽財形公社債 マザーファンド受益証券およびニュー トビックス インデックス マザーファンド受益証券。
	太陽財形公社債 マザーファンド	内外の公社債。
運用方法	ニュー トビックス 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。
	主として、太陽財形公社債 マザーファンド受益証券およびニュー トビックス インデックス マザーファンド受益証券への投資により、安定した収益の確保と売買益の獲得をはかります。ニュー トビックス インデックス マザーファンド受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%としたうえ、常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。	
組入制限	当ファンドのニュー トビックス インデックス マザーファンド 組 入 上 限 比 率	信託財産の純資産総額の30%以下。
	太陽財形公社債 マザーファンド	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
分配方針	ニュー トビックス 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。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。	

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、「太陽財形株投 太陽一般財形 30」は、2021年2月1日に第27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/>

■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	株式先物比率	債券組入率	純資産総額
	(分配額)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率				
	円	円	%	ポイント	%	%	%	%	百万円
23期 (2017年2月1日)	9,178	5	0.8	1,527.77	4.5	25.9	0.6	41.2	42
24期 (2018年2月1日)	9,599	5	4.6	1,870.44	22.4	26.7	0.7	57.5	41
25期 (2019年2月4日)	9,122	5	△4.9	1,581.33	△15.5	26.7	0.7	41.0	38
26期 (2020年2月3日)	9,185	5	0.7	1,672.66	5.8	25.3	0.6	56.7	39
27期 (2021年2月1日)	9,380	5	2.2	1,829.84	9.4	26.1	1.0	60.6	41

(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」、「債券組入比率」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) 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5) △(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	株式先物比率	債券組入率
	騰落率	騰落率	(参考指数)	騰落率			
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%	%
2020年2月3日	9,185	－	1,672.66	－	25.3	0.6	56.7
2月末	8,937	△2.7	1,510.87	△9.7	25.7	0.8	58.6
3月末	8,790	△4.3	1,403.04	△16.1	25.9	1.0	60.5
4月末	8,886	△3.3	1,464.03	△12.5	27.3	0.9	59.8
5月末	9,043	△1.5	1,563.67	△6.5	26.8	1.1	58.4
6月末	9,026	△1.7	1,558.77	△6.8	26.5	0.7	64.3
7月末	8,915	△2.9	1,496.06	△10.6	25.6	0.9	65.1
8月末	9,094	△1.0	1,618.18	△3.3	27.0	1.0	64.2
9月末	9,114	△0.8	1,625.49	△2.8	27.1	1.1	63.1
10月末	9,029	△1.7	1,579.33	△5.6	26.5	1.1	63.6
11月末	9,293	1.2	1,754.92	4.9	27.0	1.0	61.0
12月末	9,359	1.9	1,804.68	7.9	27.2	1.0	61.1
2021年1月末	9,357	1.9	1,808.78	8.1	25.9	1.0	60.8
(期末)							
2021年2月1日	9,385	2.2	1,829.84	9.4	26.1	1.0	60.6

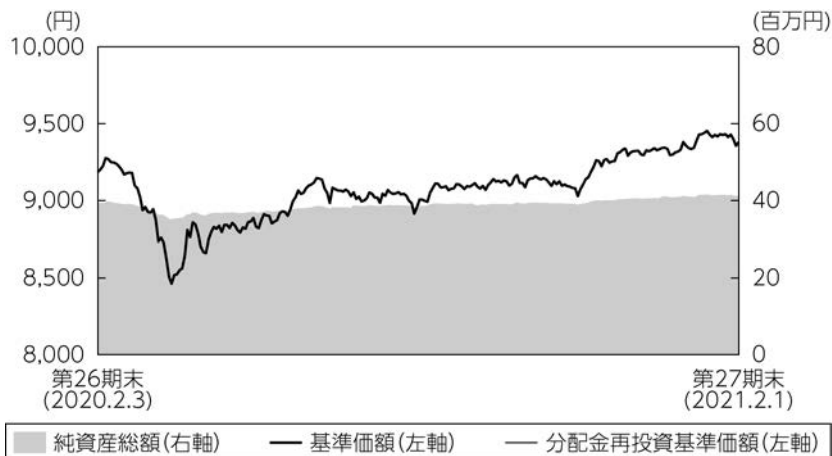
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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」、「債券組入比率」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。

## ■当期の運用経過（2020年2月4日から2021年2月1日まで）

### 基準価額等の推移



第27期首： 9,185円  
第27期末： 9,380円  
(既払分配金5円)  
騰落率： 2.2%  
(分配金再投資ベース)

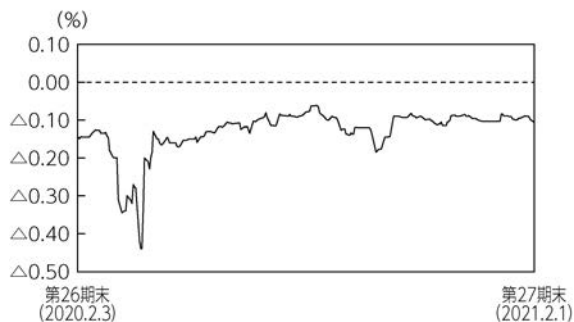
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

国内の株式および公社債への投資を行った結果、国内株式の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

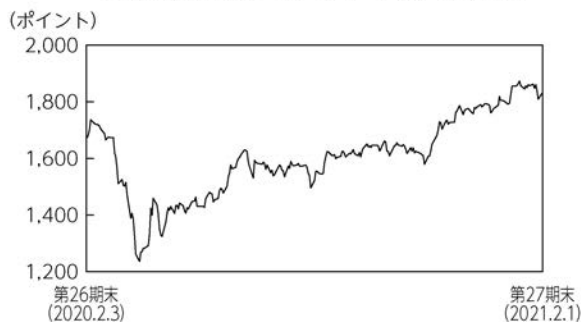
<国庫短期証券（TB）3ヵ月利回りの推移>



※国庫短期証券（TB）3ヵ月利回りの低下は価格の上昇を示し、逆の場合は下落したことを示します。

国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは日銀の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。日銀が大規模な金融緩和政策を続けており、国債利回りに低下圧力がかかっていることが要因となりました。

<東証株価指数（TOPIX）の推移>



国内株式市場は上昇しました。新型コロナウイルスの感染拡大が世界的な規模となり、経済の長期的な停滞懸念によって2020年2月下旬から3月中旬にかけて大幅な下落となりました。その後は新型コロナウイルスのワクチン開発への期待を背景に緩やかに値を戻す展開となり、期末にかけては国内感染者数が再拡大したものの、欧米でのワクチン接種開始や米国の追加経済対策決定などが相場を支えました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

当ファンドでは、わが国の株式および国内外の公社債に実質的に投資し、投資信託財産の成長と安定した収益の確保をはかることを目的として安定運用を行います。当期の運用にあたっては、わが国の株式および国内外の公社債への直接投資は行わず、太陽財形公社債 マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資しました。

### ●太陽財形公社債 マザーファンド

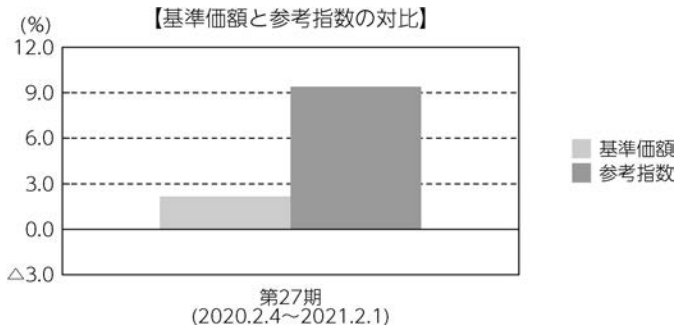
地方債などを組み入れるポートフォリオを維持しました。また、当期は組入債券の償還見合いで地方債などを買付けました。

### ●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、わが国の株式の値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、東京証券取引所が発表する東証一部上場銘柄の指数用株数等を勘案し、ポートフォリオを構築します。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

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。  
グラフは、基準価額と参考指数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

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2020年2月4日 ～2021年2月1日
当期分配金（税引前）	5円
対基準価額比率	0.05%
当期の収益	-円
当期の収益以外	5円
翌期繰越分配対象額	1,407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

太陽財形公社債 マザーファンドへの投資により安定した収益の確保に努める一方、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により信託財産の成長を目指します。

### ●太陽財形公社債 マザーファンド

引き続き公社債を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。

### ●ニュー トピックス インデックス マザーファンド

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	第27期		項目の概要
	(2020年2月4日 ～2021年2月1日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	144円	1.586%	(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9,081円です。
(投信会社)	( 32)	(0.350)	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)	(104)	(1.149)	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)	( 8)	(0.087)	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	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)	(0.001)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.000)	
(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
合計	144	1.588	

(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。

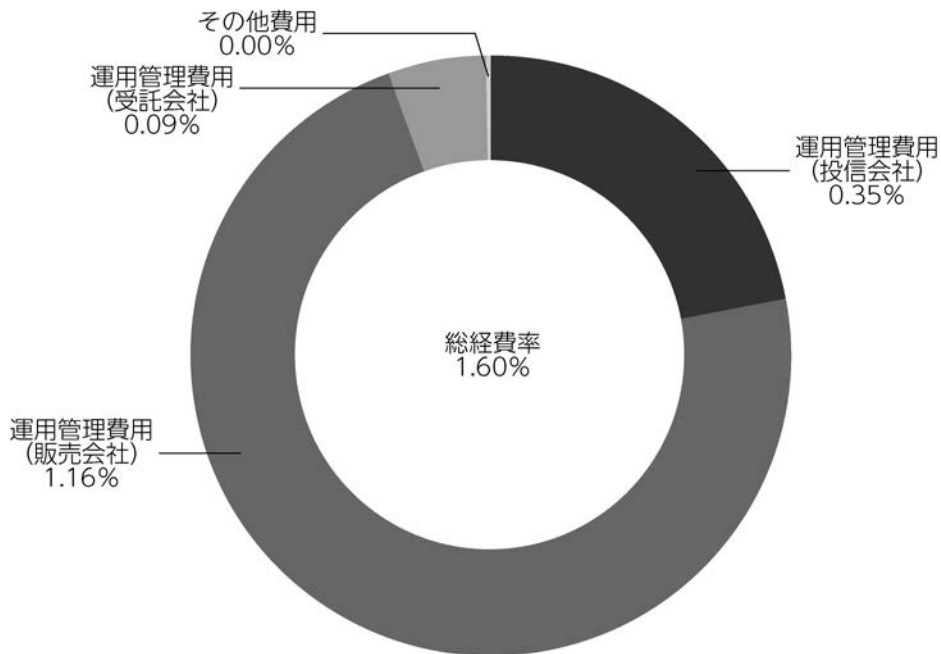
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.60%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（2020年2月4日から2021年2月1日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
太陽財形公社債 マザーファンド	3,354	3,860	1,850	2,130
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	1,188	2,290	1,317	2,860

■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	896,497千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	2,286,849千円
(c) 売 買 高 比 率 ( a ) / ( b )	0.39

(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（2020年2月4日から2021年2月1日まで）

【太陽財形株投 太陽一般財形 30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等はありません。

(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)	0.448千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.254千円
(B)／(A)	56.7%

(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。

## 【太陽財形公社債 マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

### 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			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
公 社 債	百万円 10	百万円 10	% 100.0	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 39.5%

(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。

## 【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	当			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 209	百万円 12	% 6.0	百万円 687	百万円 148	% 21.6
株 式 先 物 取 引	758	758	100.0	759	759	100.0

平均保有割合 0.5%

(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	百万円 5	百万円 18

## (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

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

親投資信託残高

	期首(前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
太 陽 財 形 公 社 債 マ ザ ー フ ァ ン ド	23,186	24,689	28,418
ニ ュ ー ト ピ ッ ク ス イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	4,556	4,427	11,194

### ■投資信託財産の構成

2021年2月1日現在

項 目	当 期 末
	評 価 額 比 率
	千円 %
ニ ュ ー ト ピ ッ ク ス イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	11,194 26.9
太 陽 財 形 公 社 債 マ ザ ー フ ァ ン ド	28,418 68.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,941 4.7
投 資 信 託 財 産 総 額	41,553 100.0

(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

(2021年2月1日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	41,553,754円
コール・ローン等	1,941,310
ニュー トピックス インデックス マザーファンド(評価額)	11,194,386
太陽財形公社債 マザーファンド(評価額)	28,418,058
(B) 負 債	338,328
未 払 収 益 分 配 金	21,968
未 払 信 託 報 酬	316,178
そ の 他 未 払 費 用	182
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	41,215,426
元 本	43,937,412
次 期 繰 越 損 益 金	△2,721,986
(D) 受 益 権 総 口 数	43,937,412口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,380円

(注) 期首における元本額は42,818,661円、当期中における追加設定元本額は3,787,524円、同解約元本額は2,668,773円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年2月4日 至2021年2月1日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△419円
受 取 利 息	6
支 払 利 息	△425
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,522,058
売 買 益	1,697,176
売 買 損	△175,118
(C) 信 託 報 酬 等	△615,404
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	906,235
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	635,447
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△4,241,700
( 配 当 等 相 当 額 )	(4,199,242)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△8,440,942)
(G) 合 計(D+E+F)	△2,700,018
(H) 収 益 分 配 金	△21,968
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△2,721,986
追 加 信 託 差 損 益 金	△4,241,700
( 配 当 等 相 当 額 )	(4,199,242)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△8,440,942)
分 配 準 備 積 立 金	1,984,259
繰 越 損 益 金	△464,545

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (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3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	4,199,242
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,006,227
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	6,205,469
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,412.34
(g) 分 配 金	21,968
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	5

## ■分配金のお知らせ

**1万口当たり分配金 5円**

※分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

### 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。

# 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19期 (決算日 2021年1月14日)

(計算期間 2020年1月15日～2021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19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)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
15期 (2017年1月14日)	19,490	12.2	ポイント 1,544.89	% 9.8	% 97.5	% 2.5	百万円 11,762
16期 (2018年1月14日)	24,148	23.9	1,876.24	21.4	96.7	2.4	10,999
17期 (2019年1月14日)	20,126	△16.7	1,529.73	△18.5	96.9	2.9	6,806
18期 (2020年1月14日)	23,470	16.6	1,740.53	13.8	96.5	3.0	2,930
19期 (2021年1月14日)	25,887	10.3	1,873.28	7.6	96.4	3.6	2,623

(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、(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)。

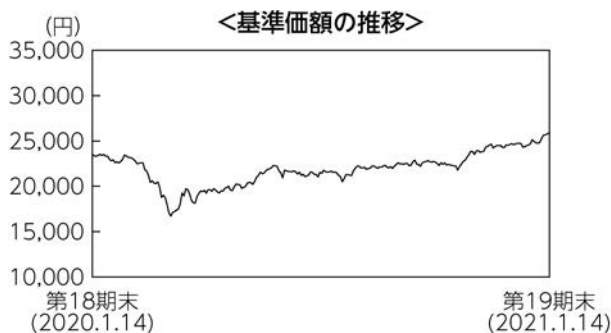
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首)	円	%	ポイント	%	%	%
2020年 1 月 14 日	23,470	-	1,740.53	-	96.5	3.0
1 月 末	22,714	△3.2	1,684.44	△3.2	96.2	3.0
2 月 末	20,411	△13.0	1,510.87	△13.2	95.9	3.1
3 月 末	19,197	△18.2	1,403.04	△19.4	94.7	3.7
4 月 末	20,019	△14.7	1,464.03	△15.9	96.7	3.2
5 月 末	21,372	△8.9	1,563.67	△10.2	96.0	3.9
6 月 末	21,334	△9.1	1,558.77	△10.4	97.0	2.7
7 月 末	20,480	△12.7	1,496.06	△14.0	96.3	3.3
8 月 末	22,142	△5.7	1,618.18	△7.0	96.4	3.5
9 月 末	22,416	△4.5	1,625.49	△6.6	95.9	4.0
10 月 末	21,779	△7.2	1,579.33	△9.3	95.6	4.0
11 月 末	24,210	3.2	1,754.92	0.8	96.3	3.5
12 月 末	24,938	6.3	1,804.68	3.7	95.7	3.5
(期 末)						
2021年 1 月 14 日	25,887	10.3	1,873.28	7.6	96.4	3.6

(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（2020年1月15日から2021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25,887円となり、前期末比で10.3%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

国内における新型コロナウイルスの感染ペース鈍化やワクチン開発への期待、米国の追加経済対策等を背景にTOPIX（東証株価指数）が上昇し、当ファンドの基準価額も上昇しました。

### 投資環境

期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しがみられたことや世界各国での経済対策などを受けて値を戻す展開となりました。7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続やワクチン開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

### ポートフォリオについて

TOPIX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、東京証券取引所が発表する東証一部上場銘柄の指数用株式数等を勘案し、ポートフォリオを構築します。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7.6%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.7%上回りました。ベンチマークとの差は、主に保有株式の配当金計上によるものです。

### 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	1円	0.004%	(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
(株式)	(1)	(0.003)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
合計	1	0.004	
期中の平均基準価額は21,912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 (2020年1月15日から2021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
		80.2 (△110.78)	163,243 (-)	300.92	613,828

(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 842	百万円 861	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	777,071千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,313,595千円
(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（2020年1月15日から2021年1月14日まで）

### (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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株 式	163	12	7.7	613	148	24.2
株 式 先 物 取 引	842	842	100.0	861	861	100.0

### (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
	百万円	百万円	百万円
株 式	1	5	19

### (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

### (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)	101千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	61千円
(B)/(A)	60.8%

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
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			
極洋	0.1	—	—
日本水産	1.6	1.3	579
マルハニチロ	0.2	0.2	457
雪国まいたけ	—	0.1	175
サカタのタネ	0.2	0.2	762
ホクト	0.1	0.1	211
<b>鉱業 (0.2%)</b>			
住石ホールディングス	0.3	0.3	34
三井松島ホールディングス	0.1	0.1	77
国際石油開発帝石	6.3	4.9	3,150
石油資源開発	0.2	0.2	417
K&Oエナジーグループ	0.1	0.1	143
<b>建設業 (2.3%)</b>			
ショーボンドホールディングス	0.2	0.2	943
ミライト・ホールディングス	0.5	0.4	707
タマホーム	0.1	0.1	147
日本アクア	0.1	0.1	63
T A T E R U	0.3	0.3	54
スペースバリューホールディングス	0.2	0.2	139
安藤・間	0.9	0.8	607
東急建設	0.5	0.4	213
コムシスホールディングス	0.6	0.5	1,622
ピーアールホールディングス	0.2	0.1	66
高松コンストラクシヨングループ	0.1	0.1	211
ヤマウラ	0.1	0.1	94
大成建設	1.2	1	3,595
大林組	3.6	3.1	2,929
清水建設	3.7	3.1	2,414
飛島建設	0.1	0.1	108
長谷工コーポレーション	1.4	1.2	1,466
松井建設	0.1	0.1	75

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
鹿島建設	2.9	2.4	3,489
不動テトラ	0.1	0.1	172
鉄建建設	0.1	0.1	188
西松建設	0.3	0.2	466
三井住友建設	0.9	0.7	317
大豊建設	0.1	0.1	373
前田建設工業	0.9	0.8	753
佐田建設	0.1	0.1	45
ナカノフドー建設	0.1	0.1	41
奥村組	0.2	0.1	272
東鉄工業	0.2	0.1	273
富士ビー・エス	0.1	—	—
戸田建設	1.5	1.3	973
熊谷組	0.2	0.1	269
矢作建設工業	0.2	0.1	88
ピーエス三菱	0.1	0.1	63
日本ハウスホールディングス	0.2	0.2	66
大東建託	0.4	0.3	2,859
新日本建設	0.2	0.1	85
N I P P O	0.3	0.3	835
前田道路	0.4	0.3	535
東亜建設工業	0.1	0.1	205
日本国土開発	0.2	0.3	175
若築建設	0.1	0.1	126
東洋建設	0.4	0.3	145
五洋建設	1.4	1.2	1,129
世紀東急工業	0.2	0.1	85
住友林業	0.9	0.8	1,649
日本基礎技術	0.1	0.1	49
巴コーポレーション	0.2	0.1	40
大和ハウス工業	3.6	3	9,456
ライト工業	0.2	0.2	349

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
積水ハウス	4	3.3	7,095
日特建設	0.1	0.1	79
北陸電気工事	0.1	0.1	125
ユアテック	0.2	0.2	172
日本リーテック	-	0.1	258
中電工	0.1	0.1	225
関電工	0.5	0.4	366
きんでん	0.9	0.7	1,234
東京エネシス	0.1	0.1	91
住友電設	0.1	0.1	265
日本電設工業	0.2	0.2	413
協和エクシオ	0.6	0.5	1,452
新日本空調	0.1	0.1	226
九電工	0.3	0.2	650
三機工業	0.3	0.2	250
日揮ホールディングス	1.1	0.9	1,001
ヤマト	0.1	0.1	75
太平電業	0.1	0.1	249
高砂熱学工業	0.3	0.2	321
明星工業	0.2	0.2	166
大気社	0.2	0.1	289
ダイダン	0.1	0.1	293
日比谷総合設備	0.1	0.1	189
OSJBホールディングス	0.6	0.5	140
東洋エンジニアリング	0.2	0.1	46
レイズネクスト	0.2	0.2	246
<b>食料品 (3.5%)</b>			
ニッポン	0.3	0.3	498
日清製粉グループ本社	1.3	1.1	1,868
昭和産業	0.1	0.1	311
鳥越製粉	0.1	0.1	89
中部飼料	0.1	0.1	145
フィード・ワン	0.8	0.1	88
日本甜菜製糖	0.1	0.1	168

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井製糖	0.1	0.1	186
塩水港精糖	0.1	0.1	22
日新製糖	0.1	-	-
森永製菓	0.3	0.2	777
江崎グリコ	0.3	0.3	1,384
名糖産業	0.1	-	-
井村屋グループ	-	0.1	260
不二家	0.1	0.1	228
山崎製パン	0.9	0.7	1,187
亀田製菓	0.1	0.1	490
寿スピリッツ	0.1	0.1	512
カルビー	0.5	0.4	1,254
森永乳業	0.2	0.2	996
六甲バター	0.1	0.1	184
ヤクルト本社	0.8	0.7	3,640
明治ホールディングス	0.8	0.7	5,159
雪印メグミルク	0.3	0.2	439
プリマハム	0.2	0.2	676
日本ハム	0.4	0.4	1,842
丸大食品	0.1	0.1	171
S Foods	0.1	0.1	357
伊藤ハム米久ホールディングス	0.7	0.6	417
サッポロホールディングス	0.4	0.3	595
アサヒグループホールディングス	2.4	2.2	9,277
キリンホールディングス	4.9	4.2	9,874
宝ホールディングス	0.9	0.7	903
オエノンホールディングス	0.3	0.3	116
コカ・コーラ ホトラズジャパンホールディングス	0.8	0.8	1,254
サントリー食品インターナショナル	0.8	0.7	2,562
ガイドグループホールディングス	0.1	0.1	516
伊藤園	0.4	0.3	2,055
キーコーヒー	0.1	0.1	216
日清オイリオグループ	0.1	0.1	312
不二製油グループ本社	0.3	0.2	587

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
J-オイルミルズ	0.1	0.1	370
キッコーマン	0.8	0.7	5,236
味の素	2.6	2.2	5,420
キューピー	0.6	0.5	1,187
ハウス食品グループ本社	0.4	0.4	1,550
カゴメ	0.4	0.4	1,410
焼津水産化学工業	0.1	-	-
アリアケジャパン	0.1	0.1	696
ニチレイ	0.6	0.5	1,488
東洋水産	0.6	0.5	2,680
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.1	0.1	78
日清食品ホールディングス	0.5	0.4	3,668
永谷園ホールディングス	0.1	-	-
フジッコ	0.1	0.1	205
ロック・フィールド	0.1	0.1	156
日本たばこ産業	6.7	5.3	10,891
ケンコーマヨネーズ	0.1	0.1	179
わらべや日洋ホールディングス	0.1	0.1	168
なとり	0.1	0.1	189
北の達人コーポレーション	0.4	0.3	140
ユーグレナ	0.5	0.4	322
理研ビタミン	0.1	0.1	137
<b>繊維製品 (0.5%)</b>			
片倉工業	0.2	0.1	137
グンゼ	0.1	0.1	343
東洋紡	0.4	0.4	556
ユニチカ	0.3	0.3	120
富士紡ホールディングス	0.1	-	-
倉敷紡績	0.1	0.1	185
シキボウ	0.1	0.1	102
日本毛織	0.4	0.3	303
ダイトウボウ	0.2	0.2	21
ガイドーリミテッド	0.1	0.1	18
帝国繊維	0.1	0.1	241

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
帝人	0.9	0.8	1,600
東レ	8.2	7	4,635
日本フェルト	0.1	0.1	42
アツギ	0.1	0.1	49
セーレン	0.3	0.2	324
小松マテール	0.2	0.2	201
ワコールホールディングス	0.3	0.2	422
ホギメディカル	0.1	0.1	326
レナウン	0.3	-	-
T S Iホールディングス	0.4	0.3	74
ワールド	0.2	0.1	127
三陽商会	0.1	0.1	62
オンワードホールディングス	0.7	0.6	141
キムラタン	0.6	0.6	14
ゴールドウイン	0.2	0.2	1,308
デサント	0.2	0.2	369
キング	0.1	-	-
ヤマトインターナショナル	0.1	0.1	33
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>			
特種東海製紙	0.1	0.1	487
王子ホールディングス	4.7	4	2,540
日本製紙	0.5	0.4	507
三菱製紙	0.1	0.1	33
北越コーポレーション	0.8	0.6	259
大王製紙	0.5	0.5	994
レンゴー	1.1	0.9	798
トーモク	0.1	0.1	179
ザ・バック	0.1	0.1	268
<b>化学 (7.6%)</b>			
クラレ	1.8	1.5	1,686
旭化成	7.5	6.4	7,347
共和レザー	0.1	0.1	65
昭和電工	0.8	0.7	1,715
住友化学	8.3	7.1	3,067

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友精化	0.1	—	—
日産化学	0.6	0.5	2,980
クレハ	0.1	0.1	706
テイカ	0.1	0.1	149
石原産業	0.2	0.2	144
日本曹達	0.2	0.1	311
東ソー	1.8	1.5	2,646
トクヤマ	0.3	0.3	766
セントラル硝子	0.2	0.2	475
東亜合成	0.7	0.6	723
大阪ソーダ	0.1	0.1	270
関東電化工業	0.3	0.2	168
デンカ	0.4	0.4	1,720
信越化学工業	1.9	1.7	32,436
堺化学工業	0.1	0.1	208
第一稀元素化学工業	0.1	0.1	94
エア・ウォーター	1.1	0.9	1,628
日本酸素ホールディングス	1.1	0.9	1,801
日本パーカライジング	0.6	0.5	551
高压ガス工業	0.2	0.2	164
四国化成工業	0.2	0.1	125
ステラ ケミファ	0.1	0.1	353
日本触媒	0.2	0.1	604
大日精化工業	0.1	0.1	244
カネカ	0.3	0.2	735
三菱瓦斯化学	1.1	0.9	2,291
三井化学	1	0.9	2,698
J S R	1.1	0.9	2,835
東京応化工業	0.2	0.2	1,536
大阪有機化学工業	0.1	0.1	399
三菱ケミカルホールディングス	7.6	6.4	4,241
K Hネオケム	0.2	0.2	532
ダイセル	1.6	1.2	946
住友ベークライト	0.2	0.2	773

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
積水化学工業	2.4	2	4,074
日本ゼオン	1	0.9	1,350
アイカ工業	0.3	0.3	1,093
宇部興産	0.6	0.5	977
積水樹脂	0.2	0.2	443
タキロンシーアイ	0.2	0.2	132
旭有機材	0.1	0.1	154
日立化成	0.5	—	—
ニチバン	0.1	0.1	169
リケンテクノス	0.3	0.2	97
大倉工業	0.1	—	—
積水化成成品工業	0.2	0.1	54
タイガースポリマー	0.1	0.1	41
ダイキョーニシカワ	0.2	0.2	166
森六ホールディングス	0.1	0.1	223
日本化薬	0.7	0.6	597
カーリットホールディングス	0.1	0.1	78
日本精化	0.1	0.1	139
扶桑化学工業	0.1	0.1	398
A D E K A	0.5	0.4	741
日油	0.4	0.4	1,990
新日本理化	0.2	0.2	56
ハリマ化成グループ	0.1	0.1	102
花王	2.8	2.4	18,895
三洋化成工業	0.1	0.1	560
有機合成薬品工業	0.1	0.1	31
大日本塗料	0.1	0.1	94
日本ペイントホールディングス	0.9	0.8	8,000
関西ペイント	1.3	1.1	3,316
神東塗料	0.1	0.1	20
中国塗料	0.3	0.3	308
日本特殊塗料	0.1	0.1	125
藤倉化成	0.2	0.1	52
太陽ホールディングス	0.1	0.1	643

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
D I C	0.5	0.4	1,054
サカタインクス	0.2	0.2	224
東洋インキSCホールディングス	0.2	0.2	378
T & K TOKA	0.1	0.1	84
富士フィルムホールディングス	2.2	1.9	11,650
資生堂	2.3	2	13,376
ライオン	1.5	1.3	3,209
高砂香料工業	0.1	0.1	260
マンダム	0.3	0.2	327
ミルボン	0.2	0.1	656
ファンケル	0.5	0.4	1,538
コーセー	0.2	0.2	3,300
コタ	0.1	0.1	148
ポーラ・オルビスホールディングス	0.5	0.4	874
ノエビアホールディングス	0.1	0.1	459
エステー	0.1	0.1	201
コニシ	0.2	0.2	331
長谷川香料	0.2	0.2	425
星光PMC	0.1	0.1	75
小林製薬	0.3	0.3	3,696
荒川化学工業	0.1	0.1	126
メック	0.1	0.1	252
タカラバイオ	0.3	0.3	838
JCU	0.1	0.1	393
新田ゼラチン	0.1	0.1	67
デクセリアルズ	0.3	0.3	434
アース製薬	0.1	0.1	589
北興化学工業	0.1	0.1	123
クミアイ化学工業	0.5	0.4	356
日本農薬	0.2	0.2	99
アキレス	0.1	0.1	147
有沢製作所	0.2	0.1	101
日東電工	0.8	0.7	6,650
レック	0.1	0.1	133

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三光合成	0.1	0.1	48
きもと	0.2	0.2	35
藤森工業	0.1	0.1	481
前澤化成工業	0.1	0.1	99
未来工業	0.1	0.1	168
J S P	0.1	0.1	175
エフピコ	0.1	0.2	854
天馬	0.1	0.1	211
信越ポリマー	0.2	0.2	195
東リ	0.3	0.2	49
ニフコ	0.4	0.4	1,554
バルカー	0.1	0.1	213
ユニ・チャーム	2.2	2.1	10,523
<b>医薬品 (5.9%)</b>			
協和キリン	1.2	1	2,789
武田薬品工業	9.6	8.2	30,258
アステラス製薬	10.2	8.5	14,063
大日本住友製薬	0.9	0.7	1,045
塩野義製薬	1.5	1.2	7,009
わかもと製薬	0.1	0.1	24
あすか製薬	0.1	0.1	160
日本新薬	0.3	0.3	2,184
中外製薬	1.2	3.1	17,986
科研製薬	0.2	0.2	829
エーザイ	1.4	1.2	9,117
ロート製薬	0.6	0.5	1,555
小野薬品工業	2.7	2.3	7,162
久光製薬	0.3	0.3	1,908
持田製薬	0.2	0.1	399
参天製薬	2.2	1.8	3,088
ツムラ	0.4	0.3	1,021
日医工	0.3	0.3	301
キッセイ薬品工業	0.2	0.2	468
生化学工業	0.2	0.2	203

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
栄研化学	0.2	0.2	412
鳥居薬品	0.1	0.1	328
JCRファーマ	0.1	0.3	752
東和薬品	0.1	0.1	197
富士製薬工業	0.1	0.1	124
沢井製薬	0.2	0.2	978
ゼリア新薬工業	0.2	0.2	385
第一三共	3.3	8.4	30,634
キョーリン製薬ホールディングス	0.3	0.2	393
大幸薬品	-	0.1	162
ダイト	0.1	0.1	388
大塚ホールディングス	2.2	2	8,842
大正製薬ホールディングス	0.2	0.2	1,432
ペプチドリウム	0.6	0.5	2,885
<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>			
日本コークス工業	1	0.8	76
ニチレキ	0.1	0.1	159
ユシロ化学工業	0.1	0.1	114
富士石油	0.3	0.3	55
出光興産	1.3	1.1	2,698
ENEOSホールディングス	17.4	14.8	6,316
コスモエネルギーホールディングス	0.3	0.3	647
<b>ゴム製品 (0.6%)</b>			
横浜ゴム	0.7	0.6	980
TOYO TIRE	0.7	0.5	843
ブリヂストン	3.6	2.6	10,140
住友ゴム工業	1	0.9	871
藤倉コンポジット	0.1	0.1	38
オカモト	0.1	0.1	408
フコク	0.1	-	-
ニッタ	0.1	0.1	228
住友理工	0.2	0.2	118
三ツ星ベルト	0.2	0.1	174
バンドー化学	0.2	0.2	137

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>			
日東紡績	0.2	0.1	478
AGC	1.1	0.9	3,357
日本板硝子	0.6	0.5	248
日本電気硝子	0.5	0.4	922
住友大阪セメント	0.2	0.2	635
太平洋セメント	0.7	0.6	1,648
日本ヒューム	0.1	0.1	79
日本コンクリート工業	0.2	0.2	64
三谷セキサン	0.1	-	-
アジアパイルホールディングス	0.2	0.1	49
東海カーボン	1.2	1	1,487
日本カーボン	0.1	0.1	421
東洋炭素	0.1	0.1	205
ノリタケカンパニーリミテド	0.1	0.1	318
TOTO	0.8	0.7	4,158
日本碍子	1.4	1.2	2,136
日本特殊陶業	0.9	0.7	1,310
ダントーホールディングス	0.1	0.1	44
ヨータイ	0.1	0.1	83
イソライト工業	0.1	0.1	55
東京窯業	0.1	0.1	36
ニッカトー	0.1	-	-
フジミインコーポレーテッド	0.1	0.1	420
ニチアス	0.3	0.3	765
ニチハ	0.2	0.1	336
<b>鉄鋼 (0.6%)</b>			
日本製鉄	5.1	4.3	6,198
神戸製鋼所	2.1	1.8	1,022
中山製鋼所	0.2	0.1	40
合同製鉄	0.1	0.1	205
ジェイ エフ イー ホールディングス	3.1	2.6	2,691
東京製鉄	0.6	0.5	341
共英製鋼	0.1	0.1	144



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大和工業	0.2	0.2	574
大阪製鐵	0.1	0.1	129
淀川製鋼所	0.2	0.1	219
丸一鋼管	0.4	0.3	722
大同特殊鋼	0.2	0.2	917
日本冶金工業	0.1	0.1	179
山陽特殊製鋼	0.1	0.1	150
愛知製鋼	0.1	0.1	327
日立金属	1.2	1	1,593
大平洋金属	0.1	0.1	236
新日本電工	0.7	0.6	173
栗本鐵工所	0.1	-	-
三菱製鋼	0.1	0.1	67
日垂鋼業	0.2	0.1	30
シンニッタン	0.2	0.2	41
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	0.2	0.2	157
日本軽金属ホールディングス	2.9	0.2	401
三井金属鉱業	0.3	0.3	1,215
東邦亜鉛	0.1	-	-
三菱マテリアル	0.8	0.6	1,437
住友金属鉱山	1.5	1.2	6,046
DOWAホールディングス	0.3	0.2	827
古河機械金属	0.2	0.2	257
エス・サイエンス	0.5	0.4	14
大阪チタニウムテクノロジーズ	0.1	0.1	88
東邦チタニウム	0.2	0.2	184
UACJ	0.2	0.1	198
古河電気工業	0.4	0.3	895
住友電気工業	4.3	3.6	5,380
フジクラ	1.4	1.2	604
昭和電線ホールディングス	0.1	0.1	181
タツタ電線	0.2	0.2	160
リョービ	0.1	0.1	128

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アーレスティ	0.2	0.1	37
アサヒホールディングス	0.2	0.2	787
<b>金属製品 (0.6%)</b>			
稲葉製作所	0.1	0.1	143
トーカロ	0.3	0.3	466
SUMCO	1.4	1.2	2,887
信和	-	0.1	71
東洋製鐵グループホールディングス	0.7	0.6	702
ホッカンホールディングス	0.1	0.1	145
コロナ	0.1	0.1	94
横河ブリッジホールディングス	0.2	0.2	421
三和ホールディングス	1.1	0.9	1,126
文化シャッター	0.3	0.3	288
三協立山	0.2	0.1	85
アルインコ	0.1	0.1	96
LIXIL	1.7	1.4	3,425
日本ファイルコン	0.1	0.1	52
ノーリツ	0.2	0.2	323
長府製作所	0.1	0.1	217
リンナイ	0.2	0.2	2,370
ダイニチ工業	0.1	0.1	94
日東精工	0.2	0.1	46
岡部	0.2	0.2	155
ジーテクト	0.1	0.1	151
東プレ	0.2	0.2	311
高周波熱錬	0.2	0.2	99
東京製綱	0.1	0.1	100
サンコール	0.1	0.1	47
モリテックスチール	0.1	0.1	43
パイオラックス	0.2	0.1	159
エイチワン	0.1	0.1	79
日本発条	1.2	1	750
立川ブラインド工業	0.1	-	-
三益半導体工業	0.1	0.1	301

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>機械 (5.8%)</b>			
日本製鋼所	0.3	0.3	946
三浦工業	0.5	0.4	2,508
タクマ	0.4	0.3	632
ツガミ	0.2	0.2	331
オークマ	0.1	0.1	622
芝浦機械	0.1	0.1	230
アマダ	1.5	1.2	1,438
アイダエンジニアリング	0.3	0.3	308
F U J I	0.5	0.4	1,131
牧野フライス製作所	0.1	0.1	416
オーエスジー	0.5	0.5	1,039
旭ダイヤモンド工業	0.3	0.3	143
DMG森精機	0.7	0.6	1,015
ソディック	0.3	0.2	181
ディスコ	0.2	0.1	3,725
日東工器	0.1	0.1	181
パンチ工業	0.1	0.1	44
富士ダイス	0.1	—	—
豊和工業	0.1	0.1	87
東洋機械金属	0.1	0.1	45
島精機製作所	0.2	0.2	354
オプトラン	0.1	0.1	219
イワキ	0.1	0.1	84
フリーー	0.1	0.1	110
ヤマシンフィルタ	0.2	0.2	219
日阪製作所	0.1	0.1	91
やまびこ	0.2	0.2	271
平田機工	0.1	—	—
ペガサスミシン製造	0.1	0.1	35
タツモ	0.1	—	—
ナプテスコ	0.7	0.6	2,973
三井海洋開発	0.1	0.1	205
レオン自動機	0.1	0.1	127

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SMC	0.4	0.3	20,754
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	0.1	—	—
オイレス工業	0.1	0.1	168
サトーホールディングス	0.2	0.1	229
技研製作所	0.1	0.1	469
日精樹脂工業	0.1	0.1	88
小松製作所	5.2	4.4	13,288
住友重機械工業	0.7	0.6	1,759
日立建機	0.5	0.4	1,274
日工	0.2	0.1	72
井関農機	0.1	0.1	142
TOWA	0.1	0.1	218
北川鉄工所	0.1	—	—
ローツェ	0.1	—	—
クボタ	6.1	5.2	12,129
月島機械	0.2	0.2	287
帝国電機製作所	0.1	0.1	120
新東工業	0.3	0.2	156
澁谷工業	0.1	0.1	364
アイチコーポレーション	0.2	0.2	187
小森コーポレーション	0.3	0.2	147
鶴見製作所	0.1	0.1	183
荏原製作所	0.5	0.4	1,486
西島製作所	0.1	0.1	86
北越工業	0.1	0.1	107
ダイキン工業	1.5	1.3	30,933
トーヨーカネツ	0.1	—	—
栗田工業	0.6	0.5	2,317
椿本チエイン	0.2	0.1	284
大同工業	0.1	—	—
木村化工機	0.1	0.1	62
アネスト岩田	0.2	0.2	222
ダイフク	0.6	0.5	6,575
加藤製作所	0.1	0.1	97

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タダノ	0.6	0.5	480
フジテック	0.4	0.4	924
CKD	0.3	0.3	730
キトー	0.1	0.1	161
平和	0.3	0.3	439
理想科学工業	0.1	0.1	138
SANKYO	0.3	0.2	573
日本金銭機械	0.1	0.1	52
マースグループホールディングス	0.1	0.1	156
フクシマガリレイ	0.1	0.1	446
ダイコク電機	0.1	-	-
竹内製作所	0.2	0.2	521
アマノ	0.3	0.3	737
JUKI	0.2	0.1	53
サンデンホールディングス	0.2	0.1	36
蛇の目ミシン工業	0.1	0.1	84
マックス	0.2	0.1	145
グローリー	0.3	0.3	627
新晃工業	0.1	0.1	177
大和冷機工業	0.2	0.2	202
セガサミーホールディングス	1.1	1	1,701
リケン	0.1	-	-
TPR	0.2	0.1	147
ツバキ・ナカシマ	0.2	0.2	247
ホシザキ	0.3	0.3	2,814
大豊工業	0.1	0.1	78
日本精工	2.2	1.8	1,735
NTN	2.7	2.3	621
ジェイテクト	1.1	0.9	782
不二越	0.1	0.1	483
日本トムソン	0.3	0.3	134
THK	0.7	0.6	2,226
ユーシン精機	0.1	0.1	100
イーグル工業	0.1	0.1	101

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
前澤工業	0.1	0.1	54
日本ピラー工業	0.1	0.1	155
キッツ	0.5	0.4	254
マキタ	1.5	1.3	6,656
日立造船	0.9	0.8	532
三菱重工業	1.9	1.6	5,329
IHI	0.8	0.7	1,383
スター精密	0.2	0.2	323
<b>電気機器 (17.9%)</b>			
日清紡ホールディングス	0.8	0.6	469
イビデン	0.7	0.6	3,066
コニカミノルタ	2.5	2.1	867
ブラザー工業	1.4	1.2	2,864
ミネベアミツミ	2.2	1.8	3,960
日立製作所	5.6	4.7	20,398
三菱電機	11.6	9.8	16,483
富士電機	0.7	0.6	2,499
安川電機	1.2	1.1	6,556
シンフォニア テクノロジー	0.2	0.1	150
明電舎	0.2	0.2	540
山洋電気	0.1	-	-
デンヨー	0.1	0.1	216
東芝テック	0.1	0.1	381
マブチモーター	0.3	0.3	1,296
日本電産	1.4	2.4	33,720
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	0.1	143
東光高岳	0.1	0.1	168
ダブル・スコープ	0.2	0.2	210
ダイヘン	0.1	0.1	516
ヤーマン	0.2	0.2	390
JVCケンウッド	0.9	0.8	137
ミマキエンジニアリング	0.1	0.1	48
日新電機	0.3	0.2	273

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大崎電気工業	0.2	0.2	121
オムロン	1	0.9	8,919
日東工業	0.2	0.1	204
I D E C	0.2	0.1	184
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.4	0.3	936
日本電気	1.4	1.2	6,960
富士通	1.1	0.9	14,418
沖電気工業	0.5	0.4	411
岩崎通信機	0.1	—	—
電気興業	0.1	—	—
サンケン電気	0.1	0.1	509
アイホン	0.1	0.1	168
ルネサスエレクトロニクス	5.5	4.2	5,182
セイコーエプソン	1.4	1.2	1,933
ワコム	0.8	0.7	651
アルパック	0.2	0.2	940
E I Z O	0.1	0.1	362
ジャパンディスプレイ	3.3	2.8	137
日本信号	0.3	0.3	289
京三製作所	0.3	0.2	83
能美防災	0.2	0.1	228
ホーチキ	0.1	0.1	129
星和電機	0.1	—	—
エレコム	0.1	0.1	514
パナソニック	13.2	11.2	14,436
シャープ	1.3	1.1	2,018
アンリツ	0.7	0.6	1,520
富士通ゼネラル	0.3	0.3	823
ソニー	7.3	6.2	66,650
T D K	0.6	0.5	8,675
帝国通信工業	0.1	—	—
タムラ製作所	0.4	0.3	174
アルプスアルパイン	1	0.9	1,324
日本電波工業	0.1	0.1	71

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
鈴木	0.1	—	—
ローランド ディー. ジー.	0.1	0.1	181
フォスター電機	0.1	0.1	140
ヨコオ	0.1	0.1	319
ティアック	0.1	0.1	11
ホシデン	0.3	0.3	299
ヒロセ電機	0.2	0.2	3,192
日本航空電子工業	0.3	0.2	322
TOA	0.1	0.1	88
マクセルホールディングス	0.2	0.2	269
古野電気	0.1	0.1	135
スミダコーポレーション	0.1	0.1	108
アイコム	0.1	0.1	272
本多通信工業	0.1	0.1	49
船井電機	0.1	0.1	44
横河電機	1.1	0.9	2,077
アズビル	0.7	0.6	3,606
東亜ディーケーケー	0.1	—	—
日本光電工業	0.5	0.4	1,270
共和電業	0.1	0.1	39
堀場製作所	0.2	0.2	1,332
アドバンテスト	0.9	0.7	6,090
エスベック	0.1	0.1	207
キーエンス	1	0.9	51,930
日置電機	0.1	—	—
シスメックス	0.8	0.7	9,068
日本マイクロニクス	0.2	0.2	295
メガチップス	0.1	0.1	318
OBARA GROUP	0.1	0.1	416
原田工業	0.1	—	—
コーセル	0.1	0.1	127
イリソ電子工業	0.1	0.1	467
オプテックスグループ	0.2	0.2	411
千代田インテグレ	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
レーザーテック	0.5	0.4	5,732
スタンレー電気	0.8	0.7	2,341
ウシオ電機	0.7	0.5	688
岡谷電機産業	0.1	0.1	38
ヘリオス テクノ ホールディング	0.1	0.1	31
日本セラミック	0.1	0.1	303
遠藤照明	0.1	-	-
古河電池	0.1	0.1	169
双信電機	0.1	-	-
山一電機	0.1	0.1	169
図研	0.1	0.1	279
日本電子	0.2	0.2	1,014
カシオ計算機	1	0.9	1,663
ファナック	1.1	0.9	24,907
日本シイエムケイ	0.3	0.2	86
エンプラス	0.1	0.1	423
ローム	0.5	0.4	4,476
浜松ホトニクス	0.8	0.7	4,592
三井ハイテック	0.1	0.1	439
新光電気工業	0.4	0.3	795
京セラ	1.6	1.4	9,415
太陽誘電	0.5	0.4	2,232
村田製作所	3.4	2.9	29,739
双葉電子工業	0.2	0.2	205
ニチコン	0.4	0.3	417
日本ケミコン	0.1	0.1	204
KOA	0.2	0.1	160
市光工業	0.2	0.1	68
小糸製作所	0.7	0.6	4,188
ミツバ	0.2	0.2	91
S C R E E Nホールディングス	0.2	0.2	1,664
キャノン電子	0.1	0.1	151
キャノン	6.2	4.9	10,165
リコー	2.9	2.5	1,830

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
象印マホービン	0.3	0.3	552
東京エレクトロン	0.8	0.6	25,350
<b>輸送用機器 (7.3%)</b>			
トヨタ紡織	0.3	0.3	504
ユニプレス	0.2	0.2	202
豊田自動織機	0.9	0.8	6,896
モリタホールディングス	0.2	0.2	363
三櫻工業	0.1	0.1	86
デンソー	2.6	2.2	13,050
東海理化電機製作所	0.3	0.3	531
三井E & Sホールディングス	0.4	0.4	161
川崎重工業	0.9	0.8	2,051
名村造船所	0.4	0.3	54
サノヤスホールディングス	0.1	0.1	16
三菱ロジスネクスト	0.2	0.1	124
日産自動車	13.7	11.6	6,250
いすゞ自動車	3.4	2.8	2,856
トヨタ自動車	12.9	11	86,493
日野自動車	1.4	1.2	1,099
三菱自動車工業	4.3	3.6	828
エフテック	0.1	0.1	62
武蔵精密工業	0.3	0.2	347
日産車体	0.2	0.2	174
新明和工業	0.3	0.3	273
極東開発工業	0.2	0.2	285
日信工業	0.2	-	-
トピー工業	0.1	0.1	128
曙ブレーキ工業	0.6	0.5	63
タチエス	0.2	0.2	235
NOK	0.6	0.5	585
フタバ産業	0.3	0.3	161
K Y B	0.1	0.1	239
大同メタル工業	0.2	0.2	103
プレス工業	0.6	0.5	155

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ミクニ	0.1	0.1	27
太平洋工業	0.2	0.2	234
ケーヒン	0.3	-	-
河西工業	0.2	0.1	41
アイシン精機	1	0.8	2,544
マツダ	3.4	2.9	2,204
今仙電機製作所	0.1	0.1	74
本田技研工業	9.1	7.7	22,476
スズキ	2.3	1.9	9,918
S U B A R U	3.6	3	6,336
安永	0.1	-	-
ヤマハ発動機	1.5	1.4	2,980
ショーワ	0.3	-	-
T B K	0.1	0.1	46
エクセディ	0.2	0.1	139
豊田合成	0.4	0.3	888
愛三工業	0.2	0.2	107
日本プラスト	0.1	0.1	50
ヨロズ	0.1	0.1	117
エフ・シー・シー	0.2	0.2	362
シマノ	0.4	0.4	10,228
テイ・エス テック	0.3	0.2	649
ジャムコ	0.1	-	-
<b>精密機器 (2.6%)</b>			
テルモ	3.3	2.8	11,860
日機装	0.3	0.3	318
日本エム・ディ・エム	0.1	0.1	243
島津製作所	1.4	1.2	5,046
J M S	0.1	0.1	94
長野計器	0.1	0.1	100
プイ・テクノロジー	0.1	-	-
東京計器	0.1	0.1	94
インターアクション	0.1	0.1	231
オーバル	0.1	0.1	36

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京精密	0.2	0.2	1,054
マニー	0.5	0.4	1,204
ニコン	1.9	1.5	1,204
トプコン	0.6	0.5	719
オリンパス	6.4	5.4	10,970
理研計器	0.1	0.1	316
タムロン	0.1	0.1	197
HOYA	2.3	1.9	26,448
ノーリツ鋼機	0.1	0.1	220
エー・アンド・デイ	0.1	0.1	137
朝日インテック	1	1.1	3,993
シチズン時計	1.4	1.2	380
大研医器	0.1	0.1	57
メニコン	0.2	0.1	653
松風	0.1	-	-
セイコーホールディングス	0.2	0.1	139
ニプロ	0.8	0.7	860
<b>その他製品 (2.7%)</b>			
スノーピーク	0.1	0.1	176
パラマウントベッドホールディングス	0.1	0.1	473
トランザクション	0.1	0.1	101
ニホンフラッシュ	0.1	0.1	133
前田工織	0.1	0.1	281
永大産業	0.2	0.1	28
アートネイチャー	0.1	0.1	65
バンダイナムコホールディングス	1.2	1	9,335
共立印刷	0.2	0.2	23
S H O E I	0.1	0.1	404
フランスベッドホールディングス	0.2	0.1	94
パイロットコーポレーション	0.2	0.2	605
萩原工業	0.1	0.1	152
トッパン・フォームズ	0.2	0.2	210
フジシールインターナショナル	0.3	0.2	396
タカラトミー	0.5	0.4	362

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
廣済堂	0.1	0.1	80
アーク	0.4	—	—
プロネクサス	0.1	0.1	107
ホクシン	0.1	0.1	11
大建工業	0.1	0.1	173
凸版印刷	1.6	1.4	2,156
大日本印刷	1.5	1.3	2,483
N I S S H A	0.2	0.2	287
TAKARA & COMPANY	0.1	—	—
アシックス	1	0.9	1,700
ヤマハ	0.7	0.6	3,804
クリナップ	0.1	0.1	48
ピジョン	0.7	0.6	2,646
キングジム	0.1	0.1	86
リンテック	0.3	0.2	484
イトーキ	0.2	0.2	69
任天堂	0.7	0.6	39,486
三菱鉛筆	0.2	0.2	267
タカラスタンダード	0.2	0.2	314
コクヨ	0.6	0.5	714
ナカバヤシ	0.1	0.1	63
グローブライド	0.1	—	—
オカムラ	0.4	0.3	300
美津濃	0.1	0.1	206
<b>電気・ガス業 (1.3%)</b>			
東京電力ホールディングス	9.2	7.8	2,542
中部電力	3.5	3	3,972
関西電力	4.4	3.7	3,794
中国電力	1.6	1.4	1,773
北陸電力	1.1	0.9	640
東北電力	2.9	2.5	2,242
四国電力	1	0.9	650
九州電力	2.4	2	1,938
北海道電力	1.1	0.9	369

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
沖縄電力	0.2	0.2	286
電源開発	0.9	0.8	1,352
エフオン	0.1	0.1	116
イーレックス	0.2	0.2	338
レノバ	0.2	0.2	911
東京瓦斯	2.2	1.9	4,563
大阪瓦斯	2.2	1.9	3,927
東邦瓦斯	0.6	0.5	3,310
北海道瓦斯	0.1	0.1	157
広島ガス	0.2	0.2	75
西部瓦斯	0.1	0.1	312
静岡ガス	0.3	0.3	312
メタウォーター	0.1	0.1	240
<b>陸運業 (3.4%)</b>			
S B S ホールディングス	0.1	0.1	251
東武鉄道	1.2	1	3,065
相鉄ホールディングス	0.4	0.3	750
東急	2.9	2.5	3,185
京浜急行電鉄	1.5	1.3	2,397
小田急電鉄	1.7	1.5	4,875
京王電鉄	0.6	0.5	4,135
京成電鉄	0.8	0.7	2,408
富士急行	0.2	0.1	456
東日本旅客鉄道	2	1.7	11,396
西日本旅客鉄道	1	0.9	4,903
東海旅客鉄道	1	0.8	11,720
西武ホールディングス	1.6	1.3	1,284
鴻池運輸	0.2	0.2	206
西日本鉄道	0.3	0.3	906
ハマキョウレックス	0.1	0.1	298
サカイ引越センター	0.1	0.1	514
近鉄グループホールディングス	1.1	0.9	4,063
阪急阪神ホールディングス	1.5	1.2	4,170
南海電気鉄道	0.5	0.4	1,036

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
京阪ホールディングス	0.5	0.4	2,008
名古屋鉄道	0.9	0.8	2,200
山陽電気鉄道	0.1	0.1	198
日本通運	0.4	0.3	2,250
ヤマトホールディングス	1.9	1.5	4,179
山九	0.3	0.3	1,245
丸運	0.1	0.1	25
丸全昭和運輸	0.1	0.1	355
センコーグループホールディングス	0.6	0.5	502
ニッコンホールディングス	0.4	0.3	670
福山通運	0.1	0.1	437
セイノーホールディングス	0.8	0.7	1,078
日立物流	0.2	0.2	638
丸和運輸機関	0.1	0.2	464
C&Fロジホールディングス	0.1	0.1	217
九州旅客鉄道	1	0.8	1,787
S Gホールディングス	1.2	2	6,010
<b>海運業 (0.2%)</b>			
日本郵船	0.9	0.8	2,112
商船三井	0.7	0.6	1,914
川崎汽船	0.3	0.3	633
NSユニテッド海運	0.1	0.1	153
明治海運	0.1	0.1	39
飯野海運	0.5	0.4	181
乾汽船	0.1	0.1	93
<b>空運業 (0.4%)</b>			
日本航空	2	2.1	3,964
ANAホールディングス	2	2.3	5,247
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
日新	0.1	0.1	125
三菱倉庫	0.3	0.3	961
三井倉庫ホールディングス	0.1	0.1	231
住友倉庫	0.4	0.3	401
澁澤倉庫	0.1	0.1	217

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東陽倉庫	0.2	0.2	66
日本トランスシティ	0.2	0.2	110
中央倉庫	0.1	0.1	113
安田倉庫	0.1	0.1	96
宇徳	0.1	0.1	48
上組	0.6	0.5	959
近鉄エクスプレス	0.2	0.2	530
東海運	0.1	0.1	31
エーアイティ	0.1	0.1	98
<b>情報・通信業 (9.1%)</b>			
NECネットエスアイ	0.1	0.3	567
システナ	0.4	0.3	655
デジタルアーツ	0.1	-	-
日鉄ソリューションズ	0.2	0.1	333
キューブシステム	0.1	0.1	124
ラクーンホールディングス	0.1	-	-
T I S	0.4	1	2,148
グリー	0.8	0.6	361
コーエーテックモホールディングス	0.2	0.2	1,246
AGS	0.1	0.1	84
ファインデックス	0.1	0.1	112
K L a b	0.2	0.2	179
ポルトウイン・ビットクルーホールディングス	0.1	0.1	112
ネクソン	3.2	2.4	8,160
アイスタイル	0.3	0.3	123
エイチーム	0.1	0.1	113
エニグモ	0.1	0.1	121
テクノスジャパン	0.1	0.1	67
e n i s h	0.1	0.1	44
コロプラ	0.4	0.3	284
オルトプラス	0.1	0.1	41
ブロードリーフ	0.6	0.5	322
クロス・マーケティンググループ	0.1	-	-
デジタルハーツホールディングス	0.1	0.1	122



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
システム情報	0.1	0.1	115
じげん	0.3	0.2	72
プイキューブ	0.1	0.1	326
ディー・エル・イー	－	0.1	31
フィックスターズ	0.1	0.1	96
CARTA HOLDINGS	0.1	－	－
オプティム	－	0.1	292
ティーガイア	0.1	0.1	195
日本アジアグループ	0.1	0.1	78
豆蔵ホールディングス	0.1	－	－
テクマトリックス	0.1	0.1	191
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.3	0.2	491
GMOペイメントゲートウェイ	0.2	0.2	2,886
ザッパラス	0.1	－	－
インターネットイニシアティブ	0.2	0.3	673
さくらインターネット	0.1	0.1	69
SRAホールディングス	0.1	0.1	260
朝日ネット	0.1	0.1	87
eBASE	0.1	0.1	102
アバント	0.1	0.1	118
フリービット	0.1	－	－
コムチュア	0.1	0.1	300
アステリア	0.1	0.1	105
アイル	－	0.1	145
マークライonz	0.1	－	－
メディカル・データ・ビジョン	0.1	0.1	289
gumi	0.1	0.1	84
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.1	－	－
オープンドア	0.1	－	－
LINE	0.3	－	－
カナミックネットワーク	0.1	0.1	71
チェンジ	－	0.1	338
オークネット	0.1	0.1	137
AOI TYO HOLDINGS	0.1	0.1	43

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マクロミル	0.2	0.2	132
プロトコーポレーション	0.1	0.1	105
野村総合研究所	1.9	1.4	5,586
サイバネットシステム	0.1	0.1	96
CEホールディングス	0.1	0.1	58
インテージホールディングス	0.1	0.1	115
ソースネクスト	0.5	0.5	138
インフォコム	0.1	0.1	327
ラクスル	0.1	0.1	450
FIG	0.1	0.1	26
イーソル	－	0.1	122
アルテリア・ネットワークス	0.1	0.1	160
フォーカスシステムズ	0.1	0.1	94
クレスコ	－	0.1	130
フジ・メディア・ホールディングス	1.1	0.9	1,082
オービック	0.4	0.3	6,651
ジャストシステム	0.2	0.2	1,474
TDCソフト	0.1	0.1	98
Zホールディングス	15.6	13.2	9,331
トレンドマイクロ	0.5	0.5	2,885
日本オラクル	0.2	0.2	2,744
フューチャー	0.1	0.1	180
CAC Holdings	0.1	0.1	137
オービックビジネスコンサルタント	0.1	0.1	700
伊藤忠テクノソリューションズ	0.5	0.4	1,538
アイティフォー	0.1	0.1	92
大塚商会	0.6	0.5	2,510
サイボウズ	0.1	0.1	257
ソフトブレイン	0.1	－	－
電通国際情報サービス	0.1	0.1	348
ACCESS	－	0.1	75
デジタルガレージ	0.2	0.2	828
イーエムシステムズ	0.2	0.1	99
CIJ	0.1	0.1	87

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本エンタープライズ	0.1	0.1	20
WOWOW	0.1	—	—
スカラ	0.1	0.1	79
インテリジェント ウェイブ	—	0.1	71
IMAGICA GROUP	0.1	0.1	34
ネットワンシステムズ	0.4	0.4	1,440
システムソフト	0.3	0.2	18
アルゴグラフィックス	0.1	0.1	306
マーベラス	0.2	0.1	94
エイバックス	0.2	0.2	248
日本ユニシス	0.4	0.3	1,234
兼松エレクトロニクス	0.1	0.1	411
TBSホールディングス	0.7	0.6	1,164
日本テレビホールディングス	0.9	0.8	938
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	0.3	554
スカパーJ SATホールディングス	0.7	0.6	284
テレビ東京ホールディングス	0.1	0.1	241
ビジョン	0.1	0.1	95
ワイヤレスゲート	0.1	—	—
コネクシオ	0.1	0.1	143
日本通信	0.9	0.8	136
日本電信電話	15.2	12.9	35,668
KDDI	8.5	7	22,666
ソフトバンク	10.3	8.8	11,910
光通信	0.1	0.1	2,151
NTTドコモ	8.4	—	—
エムティーアイ	0.1	0.1	81
GMOインターネット	0.4	0.3	946
KADOKAWA	0.3	0.3	999
学研ホールディングス	—	0.1	166
ゼンリン	0.2	0.2	246
昭文社ホールディングス	0.1	—	—
インプレスホールディングス	0.1	0.1	17

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アイネット	0.1	—	—
松竹	0.1	0.1	1,491
東宝	0.7	0.6	2,523
エヌ・ティ・ティ・データ	3	2.6	3,874
DTS	0.3	0.2	429
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.5	0.4	2,540
シーイーシー	0.1	0.1	145
カプコン	0.5	0.5	3,510
ジャステック	0.1	0.1	136
SCSK	0.3	0.2	1,142
アイネス	0.1	0.1	140
TKC	0.1	0.1	755
富士ソフト	0.1	0.1	515
NSD	0.4	0.3	633
コナミホールディングス	0.4	0.4	2,588
JBCホールディングス	0.1	0.1	148
ミロク情報サービス	0.1	0.1	207
ソフトバンクグループ	9	7.6	65,124
<b>卸売業 (4.6%)</b>			
エレマテック	0.1	0.1	105
あらた	0.1	0.1	504
フィールズ	0.1	0.1	47
双日	6.3	5.3	1,325
アルフレッサ ホールディングス	1.3	1.1	2,314
横浜冷凍	0.3	0.3	263
ラサ商事	0.1	0.1	90
アルコニックス	0.1	0.1	151
神戸物産	0.4	0.7	2,117
あい ホールディングス	0.2	0.1	209
ダイワボウホールディングス	0.1	0.1	953
マクニカ・富士エレホールディングス	0.3	0.2	426
バイタルケーエスケー・ホールディングス	0.2	0.2	165
八洲電機	0.1	0.1	98
メディアスホールディングス	0.1	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
レスターホールディングス	0.1	0.1	231
TOKAIホールディングス	0.6	0.5	509
三洋貿易	0.1	0.1	100
ウイン・パートナーズ	0.1	0.1	116
シップヘルスケアホールディングス	0.2	0.2	1,166
コメダホールディングス	0.2	0.2	382
小野建	0.1	0.1	129
佐島電機	0.1	0.1	78
伯東	0.1	0.1	116
コンドーテック	0.1	0.1	110
中山福	0.1	0.1	56
ナガイレーベン	0.2	0.1	302
三菱食品	0.1	0.1	292
松田産業	0.1	0.1	185
第一興商	0.2	0.1	354
メディパルホールディングス	1.2	1	2,139
アズワン	0.1	0.1	1,658
シモジマ	0.1	0.1	143
ドウシシャ	0.1	0.1	194
高速	0.1	0.1	160
丸文	0.1	0.1	53
ハピネット	0.1	0.1	162
日本ライフライン	0.3	0.3	482
タカショー	0.1	0.1	87
I DOM	0.3	0.3	183
進和	0.1	0.1	214
シークス	0.1	0.1	158
オーハシテクニカ	0.1	-	-
伊藤忠商事	8	6.8	21,331
丸紅	11.9	10.1	7,612
長瀬産業	0.6	0.5	792
蝶理	0.1	0.1	159
豊田通商	1.3	1.1	4,851
三共生興	0.2	0.1	47

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
兼松	0.4	0.4	534
三井物産	10	8.4	16,800
日本紙パルプ商事	0.1	0.1	364
日立ハイテク	0.4	-	-
カメイ	0.1	0.1	120
山善	0.4	0.4	416
住友商事	7.2	6.1	8,768
三菱商事	8	6.3	16,953
第一実業	0.1	-	-
キャンノンマーケティングジャパン	0.3	0.2	470
西華産業	0.1	0.1	137
佐藤商事	0.1	0.1	92
菱洋エレクトロ	0.1	0.1	357
東京産業	0.1	0.1	62
ユアサ商事	0.1	0.1	334
トルク	0.1	0.1	24
阪和興業	0.2	0.2	589
正栄食品工業	0.1	0.1	377
カナデン	0.1	0.1	130
菱電商事	0.1	0.1	157
フルサト工業	0.1	0.1	129
岩谷産業	0.3	0.3	2,172
イワキ	0.1	0.1	64
三愛石油	0.3	0.2	226
稲畑産業	0.3	0.2	292
明和産業	0.1	0.1	45
ヤマエ久野	-	0.1	114
ワキタ	0.2	0.2	199
東邦ホールディングス	0.4	0.3	597
サンゲツ	0.3	0.3	474
ミツウロコグループホールディングス	0.2	0.1	141
伊藤忠エネクス	0.3	0.2	209
サンリオ	0.3	0.3	445
サンワ テクノス	0.1	0.1	105

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リョーサン	0.1	0.1	202
新光商事	0.2	0.1	78
トーホー	0.1	—	—
三信電気	0.1	0.1	206
東陽テクニカ	0.1	0.1	120
モスフードサービス	0.1	0.1	304
加賀電子	0.1	0.1	242
ソーダニッカ	0.1	0.1	54
立花エレテック	0.1	0.1	160
PALTA C	0.2	0.2	1,152
三谷産業	0.1	0.1	46
国際紙パルプ商事	0.3	0.2	48
ヤマタネ	0.1	—	—
日鉄物産	0.1	0.1	387
トラスコ中山	0.2	0.2	562
オートバックスセブン	0.4	0.4	572
モリト	0.1	0.1	61
加藤産業	0.2	0.1	358
イノテック	0.1	0.1	108
イエローハット	0.2	0.2	346
J Kホールディングス	0.1	0.1	81
日伝	0.1	0.1	231
北沢産業	0.1	0.1	26
杉本商事	0.1	0.1	249
因幡電機産業	0.3	0.3	767
ミスミグループ本社	1.4	1.2	3,870
アルテック	0.1	0.1	32
スズケン	0.5	0.4	1,658
ジェコス	0.1	0.1	97
グローセル	0.1	0.1	48
<b>小売業 (4.5%)</b>			
ローソン	0.3	0.2	1,006
サンエー	0.1	0.1	431
カワチ薬品	0.1	0.1	306

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エービーシー・マート	0.2	0.2	1,144
アスクル	0.1	0.1	395
ゲオホールディングス	0.2	0.2	246
アダストリア	0.2	0.1	192
ジーフット	0.1	0.1	42
くら寿司	0.1	0.1	604
キャンドウ	0.1	—	—
パルグループホールディングス	0.1	0.1	136
エディオン	0.5	0.4	416
サーラコーポレーション	0.2	0.2	114
ワッツ	0.1	—	—
フジオフードグループ本社	0.1	0.1	120
ひらまつ	0.2	0.2	29
ハニーズホールディングス	0.1	0.1	99
アルペン	0.1	0.1	230
クオールホールディングス	0.2	0.1	115
ジーンズホールディングス	0.1	0.1	669
ビックカメラ	0.7	0.6	688
DCMホールディングス	0.6	0.6	653
ペッパーフードサービス	0.1	0.1	24
MonotaRO	0.8	0.7	3,815
アークランドサービスホールディングス	0.1	0.1	206
J. フロント リテイリング	1.4	1.2	1,016
ドール・日レスホールディングス	0.2	0.1	151
マツモトキヨシホールディングス	0.5	0.4	1,738
ブロンコビリー	0.1	0.1	226
ZOZO	0.8	0.7	1,937
ココカラファイン	0.1	0.1	741
三越伊勢丹ホールディングス	2	1.7	1,072
ウエルシアホールディングス	0.3	0.6	2,130
クリエイトSDホールディングス	0.2	0.2	738
丸善CHIホールディングス	0.1	0.1	37
シュッピン	0.1	0.1	94
オイシックス・ラ・大地	—	0.1	329

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ネクステージ	0.2	0.2	302
ジョイフル本田	0.3	0.3	437
ホットランド	0.1	0.1	119
すかいらーくホールディングス	1.3	1.1	1,732
S F Pホールディングス	—	0.1	128
綿半ホールディングス	—	0.1	140
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	0.3	341
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.1	0.1	87
あさひ	0.1	0.1	170
日本調剤	—	0.1	151
コスモス薬品	0.1	0.1	1,584
トーエル	0.1	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	4.5	3.8	15,017
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	0.3	0.5	307
ツルハホールディングス	0.2	0.2	2,940
サンマルクホールディングス	0.1	0.1	140
トリドールホールディングス	0.1	0.2	279
TOKYO BASE	0.1	0.1	48
JMホールディングス	0.1	0.1	225
アレンザホールディングス	0.1	—	—
パロックジャパンリミテッド	0.1	0.1	73
クスリのアオキホールディングス	0.1	0.1	878
力の源ホールディングス	0.1	—	—
スシローグローバルホールディングス	0.1	0.5	1,887
L I X I L ビバ	0.1	—	—
メディカルシステムネットワーク	0.1	0.1	63
はるやまホールディングス	0.1	—	—
ノジマ	0.2	0.2	574
カップ・クリエイト	0.2	0.1	145
ライトオン	0.1	0.1	66
良品計画	1.5	1.3	3,081
三城ホールディングス	0.1	0.1	31
アドヴァン	0.2	0.1	123
コナカ	0.1	0.1	30

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
G-7ホールディングス	0.1	0.1	246
イオン北海道	0.1	0.1	100
コジマ	0.2	0.2	135
コーナン商事	0.2	0.1	302
ワタミ	0.1	0.1	87
パ・パフィック・インターナショナルホールディングス	2.7	2.1	4,901
西松屋チェーン	0.3	0.2	306
ゼンショーホールディングス	0.5	0.5	1,383
幸楽苑ホールディングス	0.1	0.1	162
サイゼリヤ	0.2	0.1	197
V Tホールディングス	0.5	0.4	174
ユナイテッドアローズ	0.1	0.1	149
ハイデイ日高	0.2	0.1	163
京都市もの友禅	0.1	0.1	20
コロナイド	0.4	0.3	489
ピーシーデポコーポレーション	0.2	0.1	58
壱番屋	0.1	0.1	511
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	0.1	23
スクロール	0.2	0.1	83
ヨンドシーホールディングス	0.1	0.1	201
ファミリーマート	0.9	—	—
木曽路	0.1	0.1	236
S R Sホールディングス	0.1	0.1	82
千趣会	0.2	0.2	63
タカキュー	0.1	0.1	15
リテールパートナーズ	—	0.1	142
ケーヨー	0.2	0.2	147
上新電機	0.1	0.1	286
日本瓦斯	0.2	0.1	560
ロイヤルホールディングス	0.2	0.2	340
いなげや	0.1	0.1	180
島忠	0.2	—	—
チヨダ	0.1	0.1	89

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ライフコーポレーション	0.1	0.1	345
リンガーハット	0.1	0.1	229
MrMa xHD	0.2	0.1	78
テナアライド	0.1	0.1	32
AOKIホールディングス	0.2	0.2	105
オークワ	0.2	0.2	258
コメリ	0.2	0.1	297
青山商事	0.2	0.2	116
しまむら	0.1	0.1	1,199
はせがわ	0.1	0.1	29
高島屋	0.8	0.7	634
松屋	0.2	0.2	155
エイチ・ツー・オー リテイリング	0.5	0.5	359
パルコ	0.1	-	-
丸井グループ	1	0.9	1,647
アクシアル リテイリング	0.1	0.1	525
井筒屋	0.1	0.1	19
イオン	4.4	3.7	12,517
イズミ	0.2	0.2	773
平和堂	0.2	0.2	446
フジ	0.1	0.1	203
ヤオコー	0.1	0.1	696
ゼビオホールディングス	0.1	0.1	84
ケーブホールディングス	1.1	0.9	1,293
Olympicグループ	0.1	-	-
日産東京販売ホールディングス	0.2	0.1	26
Genky DrugStores	0.1	-	-
総合メディカルホールディングス	0.1	-	-
ブックオフグループホールディングス	0.1	0.1	84
アインホールディングス	0.2	0.1	642
ヤマダホールディングス	3.5	2.9	1,609
アークランドサカモト	0.2	0.2	325
ニトリホールディングス	0.5	0.4	8,968
グルメ杵屋	0.1	0.1	96

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
愛眼	0.1	0.1	24
ケーユーホールディングス	0.1	0.1	84
吉野家ホールディングス	0.4	0.3	611
松屋フーズホールディングス	0.1	-	-
サガミホールディングス	0.2	0.1	120
関西スーパーマーケット	0.1	0.1	121
王将フードサービス	0.1	0.1	566
プレナス	0.1	0.1	175
ミニストップ	0.1	0.1	141
アークス	0.2	0.2	479
バローホールディングス	0.3	0.2	526
ベルク	0.1	-	-
大 庄	0.1	0.1	96
ファーストリテイリング	0.2	0.1	9,366
サンドラッグ	0.4	0.4	1,632
サックスパー ホールディングス	0.1	0.1	55
ペルーナ	0.2	0.2	221
<b>銀行業 (4.7%)</b>			
じもとホールディングス	0.8	0.1	83
めぶきフィナンシャルグループ	5.9	5	1,085
東京きらぼしフィナンシャルグループ	0.2	0.1	115
九州フィナンシャルグループ	1.9	2.1	947
ゆうちょ銀行	3.2	2.7	2,454
富山第一銀行	0.3	0.2	58
コンコルディア・フィナンシャルグループ	6.7	5.5	2,178
西日本フィナンシャルホールディングス	0.8	0.6	407
関西みらいフィナンシャルグループ	0.7	0.6	327
三十三フィナンシャルグループ	0.1	0.1	129
第四北越フィナンシャルグループ	0.2	0.2	461
ひろぎんホールディングス	-	1.4	870
新生銀行	0.8	0.7	981
あおぞら銀行	0.7	0.6	1,190
三菱UFJフィナンシャル・グループ	78.7	66.3	33,222
りそなホールディングス	12.5	10.5	4,129

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	2.2	1.8	6,080
三井住友フィナンシャルグループ	7.9	6.7	23,744
千葉銀行	3.9	3.2	1,961
群馬銀行	2.2	1.9	642
武蔵野銀行	0.2	0.1	157
千葉興業銀行	0.3	0.3	74
筑波銀行	0.5	0.4	75
七十七銀行	0.4	0.3	425
青森銀行	0.1	0.1	247
秋田銀行	0.1	0.1	142
山形銀行	0.1	0.1	103
岩手銀行	0.1	0.1	201
東邦銀行	1	0.9	187
東北銀行	0.1	—	—
みちのく銀行	0.1	0.1	103
ふくおかフィナンシャルグループ	1	0.8	1,617
静岡銀行	2.8	2.4	1,896
十六銀行	0.1	0.1	194
スルガ銀行	1.2	1	334
八十二銀行	2.8	2.3	834
山梨中央銀行	0.1	0.1	79
大垣共立銀行	0.2	0.2	417
福井銀行	0.1	0.1	195
北國銀行	0.1	0.1	262
滋賀銀行	0.2	0.2	425
南都銀行	0.2	0.2	353
百五銀行	1	0.9	274
京都銀行	0.4	0.3	1,797
紀陽銀行	0.4	0.3	442
ほくほくフィナンシャルグループ	0.8	0.6	594
広島銀行	1.7	—	—
山陰合同銀行	0.7	0.6	300
中国銀行	1	0.8	680
伊予銀行	1.6	1.4	929

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
百十四銀行	0.1	0.1	149
四国銀行	0.2	0.1	70
阿波銀行	0.2	0.2	464
大分銀行	0.1	0.1	212
宮崎銀行	0.1	0.1	226
佐賀銀行	0.1	0.1	134
沖縄銀行	0.1	0.1	280
琉球銀行	0.3	0.2	152
セブン銀行	3.8	3.2	723
みずほフィナンシャルグループ	155.3	13.2	18,975
山口フィナンシャルグループ	1.4	1.2	745
名古屋銀行	0.1	0.1	272
北洋銀行	1.7	1.5	336
愛媛銀行	0.2	0.1	97
京葉銀行	0.5	0.4	168
栃木銀行	0.6	0.5	87
東和銀行	0.2	0.2	134
福島銀行	0.1	0.1	20
大東銀行	0.1	0.1	64
トモニホールディングス	0.9	0.7	218
フィデアホールディングス	1.1	0.9	99
池田泉州ホールディングス	1.3	1.1	167
<b>証券、商品先物取引業 (0.8%)</b>			
F P G	0.4	0.3	148
マーキュリアインベストメント	0.1	—	—
S B Iホールディングス	1.3	1.1	3,009
日本アジア投資	0.1	0.1	24
ジャフコ グループ	0.2	0.1	564
大和証券グループ本社	9.2	7.8	4,038
野村ホールディングス	20.1	17	10,031
岡三証券グループ	1	0.8	336
丸三証券	0.3	0.3	153
東洋証券	0.4	0.3	43
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1.3	1.1	365

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水戸証券	0.3	0.3	80
いちよし証券	0.2	0.2	101
松井証券	0.7	0.6	496
だいこう証券ビジネス	0.1	—	—
マネックスグループ	0.9	0.7	359
極東証券	0.2	0.1	75
岩井コスモホールディングス	0.1	0.1	144
藍澤証券	0.2	0.2	157
マネーパートナーズグループ	0.1	0.1	22
スパークス・グループ	0.4	0.4	109
<b>保険業 (2.0%)</b>			
かんぽ生命保険	0.4	0.3	684
SOMPOホールディングス	2.1	1.8	7,758
アニコム ホールディングス	0.1	0.3	354
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3	2.5	8,290
ソニーフィナンシャルホールディングス	0.9	—	—
第一生命ホールディングス	6.5	5.5	9,682
東京海上ホールディングス	4.1	3.4	19,186
T & Dホールディングス	3.4	2.9	4,010
<b>その他金融業 (1.2%)</b>			
全国保証	0.3	0.3	1,377
アルヒ	0.2	0.2	335
プレミアグループ	0.1	0.1	243
クレディセゾン	0.8	0.7	875
芙蓉総合リース	0.1	0.1	732
みずほリース	0.2	0.1	327
東京センチュリー	0.2	0.2	1,718
日本証券金融	0.5	0.4	211
アイフル	1.7	1.5	387
リコーリース	0.1	0.1	321
イオンフィナンシャルサービス	0.7	0.6	819
アコム	2.3	1.9	898
ジャックス	0.1	0.1	192
オリエンコーポレーション	3.1	2.6	325

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立キャピタル	0.3	0.2	528
アプラスフィナンシャル	0.5	—	—
オリックス	7.1	6	10,890
三菱UFJリース	2.9	2.5	1,320
九州リースサービス	0.1	—	—
日本取引所グループ	3.3	2.8	7,453
イー・ギャランティ	0.1	0.1	236
アサックス	0.1	0.1	72
<b>不動産業 (1.9%)</b>			
いちご	1.5	1.2	366
日本駐車場開発	1.3	1	140
スター・マイカ・ホールディングス	0.1	0.1	119
ADワークスグループ	—	0.2	31
ヒューリック	2.4	2.1	2,423
野村不動産ホールディングス	0.7	0.6	1,366
三重交通グループホールディングス	0.2	0.2	99
サムティ	0.2	0.1	167
ディア・ライフ	0.1	0.1	42
エー・ディー・ワークス	2.1	—	—
日本商業開発	0.1	0.1	167
プレサンスコーポレーション	0.2	0.2	344
ユニゾホールディングス	0.2	—	—
THEグローバル社	0.1	—	—
日本管理センター	0.1	0.1	117
フージャースホールディングス	0.2	0.2	126
オープンハウス	0.3	0.3	1,251
東急不動産ホールディングス	3.1	2.6	1,437
飯田グループホールディングス	1	0.8	1,781
ムゲンエステート	0.1	0.1	45
ハウスドゥ	0.1	—	—
パーク24	0.6	0.5	961
三井不動産	5.6	4.7	9,785
三菱地所	8	6.8	11,359
平和不動産	0.2	0.2	756



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京建物	1.2	1	1,480
ダイビル	0.3	0.2	252
京阪神ビルディング	0.2	0.2	350
住友不動産	2.6	2.2	6,908
テーオーシー	0.2	0.2	149
レオパレス21	1.5	1.3	192
スターツコーポレーション	0.2	0.1	282
フジ住宅	0.1	0.1	63
空港施設	0.1	0.1	48
明和地所	0.1	0.1	58
ゴールドフレスト	0.1	0.1	168
日神グループホールディングス	0.2	0.1	41
日本エスコ	0.2	0.2	157
タカラレーベン	0.5	0.4	125
AVANTIA	0.1	0.1	88
イオンモール	0.6	0.5	873
ランド	6.2	5.3	47
カチタス	0.1	0.2	613
トーセイ	0.2	0.1	106
サンフロンティア不動産	0.2	0.1	89
エフ・ジェー・ネクスト	0.1	0.1	100
グランディハウス	0.1	0.1	42
日本空港ビルデング	0.4	0.3	1,893
<b>サービス業 (5.6%)</b>			
日本工営	0.1	0.1	279
LIFULL	0.4	0.3	109
ミクシィ	-	0.2	510
ジェイエイシーリクルートメント	0.1	0.1	179
日本M&Aセンター	0.8	0.7	4,263
UTグループ	0.1	0.1	290
タケエイ	0.1	0.1	134
ビーネックスグループ	0.1	0.1	117
コシダカホールディングス	0.3	0.2	81
パソナグループ	0.1	0.1	202

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リンクアンドモチベーション	0.2	0.2	106
GCA	0.1	0.1	72
エス・エム・エス	0.3	0.3	1,218
パーソルホールディングス	1.1	0.9	1,680
リニカル	0.1	-	-
クックパッド	0.4	0.3	92
アイ・ケイ・ケイ	0.1	-	-
スタジオアリス	0.1	-	-
シミックホールディングス	0.1	-	-
総合警備保障	0.4	0.4	2,176
カカクコム	0.8	0.7	2,014
セントケア・ホールディング	0.1	0.1	93
ルネサンス	0.1	0.1	87
ディップ	0.2	0.1	231
デジタルホールディングス	0.1	0.1	182
新日本科学	0.1	0.1	70
ツクイホールディングス	0.3	0.2	107
ベネフィット・ワン	0.3	0.3	934
エムスリー	2.4	2.1	21,598
ツカダ・グローバルホールディング	0.1	0.1	24
アウトソーシング	0.6	0.5	657
ウエルネット	0.1	0.1	44
ディー・エヌ・エー	0.5	0.4	757
博報堂DYホールディングス	1.5	1.3	1,974
ぐるなび	0.2	0.2	100
タカミヤ	0.1	0.1	53
ジャパンベストレスキューシステム	0.1	0.1	87
ファンコミュニケーションズ	0.3	0.3	122
エスピーール	0.2	0.2	170
WDBホールディングス	0.1	-	-
ティア	0.1	0.1	41
バリユーコマース	0.1	0.1	333
インフォマート	1.2	0.9	792
J Pホールディングス	0.3	0.3	84

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エコナックホールディングス	0.2	0.2	18
E P Sホールディングス	0.2	0.1	100
プレステージ・インターナショナル	0.4	0.4	357
アミューズ	0.1	0.1	255
クイック	0.1	0.1	106
T A C	0.1	0.1	25
ケネディクス	1.1	—	—
電通グループ	1.1	1.1	3,399
シーティーエス	0.1	0.1	94
H. U. グループホールディングス	0.3	0.3	894
アルプス技研	0.1	0.1	204
サニックス	0.2	0.2	62
日本空調サービス	0.1	0.1	74
オリエンタルランド	1.2	1	16,470
ダスキン	0.3	0.2	575
明光ネットワークジャパン	0.1	0.1	59
ファルコホールディングス	0.1	0.1	169
ラウンドワン	0.3	0.3	238
リゾートトラスト	0.5	0.4	594
ビー・エム・エル	0.1	0.1	341
りらいあコミュニケーションズ	0.2	0.2	266
リソー教育	0.5	0.4	120
ユー・エス・エス	1.2	1.1	2,383
サイバーエージェント	0.6	0.6	4,356
楽天	5.2	4.4	4,285
クリーク・アンド・リバー社	0.1	—	—
モーニングスター	—	0.1	47
テー・オー・ダブリュー	0.1	0.1	25
山田コンサルティンググループ	0.1	0.1	95
フルキャストホールディングス	0.1	0.1	157
エン・ジャパン	0.2	0.2	613
テクノプロ・ホールディングス	0.2	0.2	1,736
Keep E r技研	—	0.1	224
Gunosy	0.1	0.1	74

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イー・ガーディアン	0.1	—	—
リブセンス	0.1	0.1	24
ジャパンマテリアル	0.3	0.3	515
ベクトル	0.1	0.1	105
ウチヤマホールディングス	0.1	—	—
チャーム・ケア・コーポレーション	0.1	0.1	132
I B J	0.1	0.1	80
N・フィールド	0.1	0.1	80
M&Aキャピタルパートナーズ	0.1	0.1	511
シグマクシス	0.1	0.1	178
ウィルグループ	0.1	0.1	98
エスクロー・エージェント・ジャパン	0.2	0.1	29
リクルートホールディングス	7.9	6.7	30,605
エラン	0.1	0.1	151
日本郵政	9.1	7.7	6,700
ベルシステム24ホールディングス	0.2	0.2	349
鎌倉新書	0.1	0.1	92
エアトリ	—	0.1	125
ソラスト	0.3	0.3	463
インソース	0.1	0.1	173
ベイカレント・コンサルティング	0.1	0.1	1,853
グレイステクノロジー	0.1	—	—
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	0.1	0.2	479
日総工産	0.1	0.1	70
キュービーネットホールディングス	0.1	—	—
R P Aホールディングス	0.1	0.1	67
カーブスホールディングス	—	0.3	222
アドバンテッジリスクマネジメント	0.1	—	—
リログループ	0.6	0.5	1,258
東祥	0.1	0.1	148
エイチ・アイ・エス	0.2	0.1	167
共立メンテナンス	0.2	0.2	712
イチネンホールディングス	0.1	0.1	129
建設技術研究所	0.1	0.1	233

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スペース	0.1	0.1	81
東京都競馬	0.1	0.1	455
カナモト	0.2	0.2	462
東京ドーム	0.4	0.4	519
西尾レントオール	0.1	0.1	218
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	0.7	0.5	11
トランス・コスモス	0.1	0.1	263
乃村工藝社	0.5	0.4	324
KNT-CTホールディングス	0.1	0.1	91
日本管財	0.1	0.1	206
トーカイ	0.1	0.1	202
セコム	1.2	1	9,948
セントラル警備保障	0.1	-	-
丹青社	0.2	0.2	168
メイテック	0.1	0.1	529

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
応用地質	0.1	0.1	131	
船井総研ホールディングス	0.2	0.2	480	
オオバ	0.1	0.1	75	
ベネッセホールディングス	0.4	0.3	609	
イオンディライト	0.1	0.1	275	
ナック	0.1	0.1	96	
ニチイ学館	0.2	-	-	
ダイセキ	0.2	0.2	671	
合 計	株 数 ・ 金 額	千株 1,363.2	千株 1,031.7	千円 2,528,216
	銘柄数<比率>	1,591 銘柄	1,506 銘柄	<96.4%>

(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 93	百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2021年1月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	2,528,216	96.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	96,471	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	2,624,687	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

(2021年1月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,721,928,025円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	92,063,145
株 式(評価額)	2,528,216,700
未 収 入 金	6,523,350
未 収 配 当 金	3,184,630
差 入 委 託 証 拠 金	91,940,200
(B) 負 債	98,429,200
未 払 解 約 金	1,189,000
差入委託証拠金代用有価証券	97,240,200
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,623,498,825
元 本	1,013,423,187
次 期 繰 越 損 益 金	1,610,075,638
(D) 受 益 権 総 口 数	1,013,423,187口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,887円

(注1) 期首元本額 1,248,560,704円  
追加設定元本額 162,385,234円  
一部解約元本額 397,522,751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 207,085,721円  
新光7資産バランスファンド 258,644,104円  
ニュー トピックス インデックス (変額年金) 68,650,005円  
世界バランスファンド35VA (適格機関投資家私募) 384,596,441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) 18,351,450円  
ワールドバランスファンド30VA (適格機関投資家私募) 29,836,129円  
ワールドバランスファンド30VA2 (適格機関投資家私募) 11,056,709円  
グローバル・ナビ 16,423,631円  
太陽財形株投 太陽一般財形 30 4,675,213円  
太陽財形株投 太陽一般財形 50 12,745,329円  
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形30 1,358,455円  
期末元本合計 1,013,423,187円

## ■損益の状況

当期 自2020年1月15日 至2021年1月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	54,108,344円
受 取 配 当 金	54,129,943
そ の 他 収 益 金	12,558
支 払 利 息	△34,157
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	151,099,209
売 買 損 益	385,564,353
売 買 損	△234,465,144
(C) 先 物 取 引 等 損 益	25,560,360
取 引 益	40,276,920
取 引 損	△14,716,560
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	230,767,913
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,681,842,208
(F) 解 約 差 損 益 金	△472,127,249
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	169,592,766
(H) 合 計(D+E+F+G)	1,610,075,638
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,610,075,638

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等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。

# 太陽財形公社債 マザーファンド

## 運用報告書

第27期（決算日 2021年2月1日）

（計算期間 2020年2月2日～2021年2月1日）

太陽財形公社債 マザーファンドの第27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	公社債への投資により、安定した収益の確保をはかることを目的として、安定運用を行います。
主要投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

### ■最近3期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率			
25期（2019年2月1日）	1,151	0.0	61.6	—	74
26期（2020年2月1日）	1,151	0.0	83.5	—	72
27期（2021年2月1日）	1,151	0.0	87.9	—	69

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

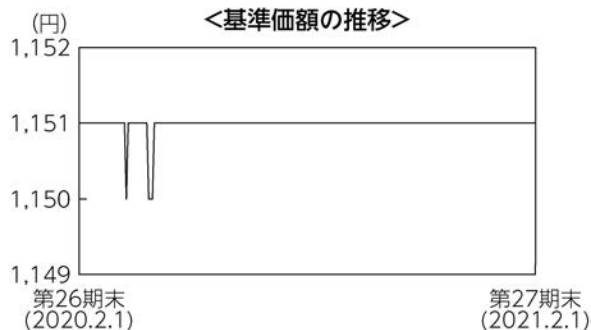
## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	円	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 2 月 1 日	1,151	—	83.5	—
2 月 末	1,151	0.0	83.4	—
3 月 末	1,150	△0.1	88.0	—
4 月 末	1,151	0.0	87.9	—
5 月 末	1,151	0.0	86.0	—
6 月 末	1,151	0.0	93.9	—
7 月 末	1,151	0.0	93.8	—
8 月 末	1,151	0.0	92.9	—
9 月 末	1,151	0.0	91.4	—
10 月 末	1,151	0.0	91.3	—
11 月 末	1,151	0.0	88.7	—
12 月 末	1,151	0.0	90.4	—
2021 年 1 月 末	1,151	0.0	87.9	—
(期 末) 2021 年 2 月 1 日	1,151	0.0	87.9	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過 (2020年2月2日から2021年2月1日まで)



### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は前期末と同水準でした。

### 基準価額の主な変動要因

当ファンドは残存期間が1年程度の公社債を中心に投資を行った結果、債券価格の変動やマイナス金利などの影響から期中の変動はありましたが、前期末と同水準で当期末を迎えました。

### 投資環境

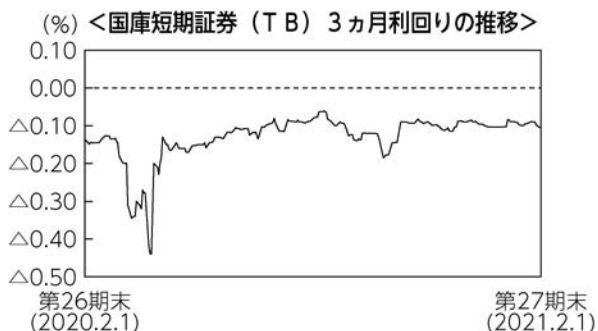
国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは日銀の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。日銀が大規模な金融緩和政策を続けており、国債利回りに低下圧力がかかっていることが要因となりました。

### ポートフォリオについて

当期は組入債券の償還見合いで地方債を買い付けました。

### 今後の運用方針

引き続き公社債を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。



※国庫短期証券 (TB) 3ヵ月利回りの低下は価格の上昇を示し、逆の場合は下落したことを示します。

## ■ 1千口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

## ■ 売買及び取引の状況 (2020年2月2日から2021年2月1日まで)

公社債

		買付額	売付額
国	内 地 方 債 証 券	千円	千円
		10,126	- (8,900)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子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。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2020年2月2日から2021年2月1日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			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
公 社 債	百万円 10	百万円 10	% 100.0	百万円 -	百万円 -	% -

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、みずほ証券です。



## ■組入資産の明細

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	%	%	%	%	%
地 方 債 証 券	61,000	61,287	87.9	56.2	-	-	87.9
合 計	61,000	61,287	87.9	56.2	-	-	87.9

(注1) 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。

(注2) 無格付銘柄については、BB格以下に含めて表示しています。

(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
(地方債証券)	%	千円	千円	
474回 名古屋市公募公債 10年	1.3100	15,000	15,024	2021/03/19
22年度2回 福井県公募公債	1.4000	22,000	22,067	2021/04/23
101回 共同発行市場公募地方債	1.0500	14,000	14,080	2021/08/25
23年度9回 福岡市公募公債 10年	1.0100	10,000	10,115	2022/03/28
合 計	-	61,000	61,287	-

## ■投資信託財産の構成

2021年2月1日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	61,287	87.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,447	12.1
投 資 信 託 財 産 総 額	69,734	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

(2021年2月1日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	69,734,926円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,192,518
地 方 債 証 券(評価額)	61,287,703
未 収 利 息	231,185
前 払 費 用	23,520
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	69,734,926
元 本	60,577,802
次 期 繰 越 損 益 金	9,157,124
(D) 受 益 権 総 口 数	60,577,802口
1 千 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	1,151円

(注1) 期首元本額	63,175,152円
追加設定元本額	9,784,460円
一部解約元本額	12,381,810円
(注2) 期末における元本の内訳	
太陽財形株投 太陽一般財形 30	24,689,886円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	28,704,912円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	7,183,004円
期末元本合計	60,577,802円

## ■損益の状況

当期 自2020年2月2日 至2021年2月1日

項 目	当 期
(A) 受 取 利 息 等 収 益	668,959円
受 取 利 息	671,682
支 払 利 息	△2,723
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△664,355
売 買 益	12,512
売 買 損	△676,867
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	4,604
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	9,545,170
(E) 解 約 差 損 益 金	△1,868,190
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,475,540
(G) 合 計(C+D+E+F)	9,157,124
次 期 繰 越 損 益 金(G)	9,157,124

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (E)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) (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。