

運用報告書 (全体版)

第28期<決算日2022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 トピックス 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。
	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。
運用方法	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 トピックス 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 トピックス 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 トピックス 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。
	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	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、2022年2月1日に第28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/>

太陽財形株投 太陽一般財形 30

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		東証株価指数(TOPIX) (参考指数)		株式組入 比率	株式先物 比率	債券組入 比率	純資産 総額
		税金 込み 分配 金	期中 騰落 率	ポイント	騰落 率				
24期(2018年2月1日)	円 9,599	円 5	% 4.6	ポイント 1,870.44	% 22.4	% 26.7	% 0.7	% 57.5	百万円 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
28期(2022年2月1日)	9,389	5	0.1	1,896.06	3.6	26.2	1.1	40.1	43

(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(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) (参考指数)		株式組入 比率	株式先物 比率	債券組入 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2021年2月1日	円 9,380	% -	ポイント 1,829.84	% -	% 26.1	% 1.0	% 60.6
2月末	9,420	0.4	1,864.49	1.9	26.9	0.4	59.8
3月末	9,558	1.9	1,954.00	6.8	25.8	0.8	45.9
4月末	9,472	1.0	1,898.24	3.7	25.8	0.6	34.5
5月末	9,494	1.2	1,922.98	5.1	26.1	0.6	36.0
6月末	9,511	1.4	1,943.57	6.2	26.2	0.6	36.8
7月末	9,445	0.7	1,901.08	3.9	25.2	0.8	40.0
8月末	9,510	1.4	1,960.70	7.2	25.6	0.8	25.3
9月末	9,607	2.4	2,030.16	10.9	26.6	1.1	29.7
10月末	9,561	1.9	2,001.18	9.4	26.4	0.9	40.3
11月末	9,455	0.8	1,928.35	5.4	25.3	1.1	40.3
12月末	9,530	1.6	1,992.33	8.9	25.8	0.7	39.7
2022年1月末	9,395	0.2	1,895.93	3.6	26.2	1.1	40.1
(期末) 2022年2月1日	9,394	0.1	1,896.06	3.6	26.2	1.1	40.1

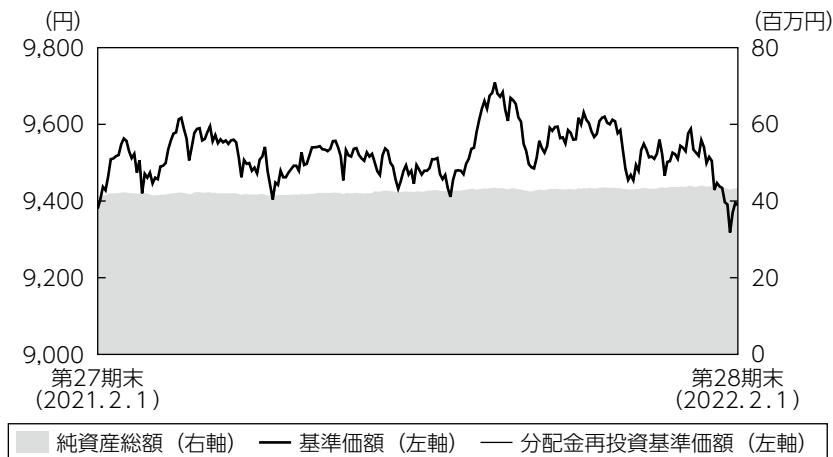
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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（2021年2月2日から2022年2月1日まで）

基準価額等の推移



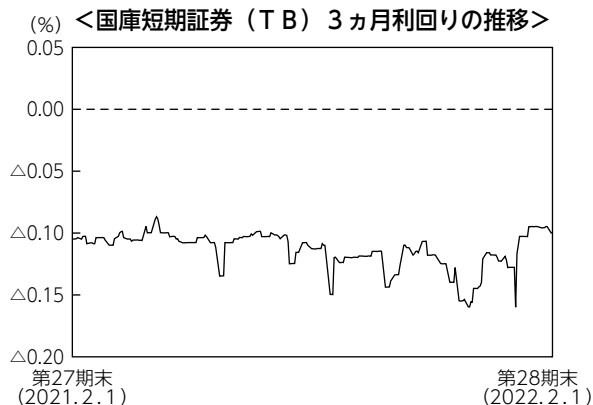
第28期首： 9,380円
第28期末： 9,389円
（既払分配金5円）
騰落率： 0.1%
（分配金再投資ベース）

- (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。

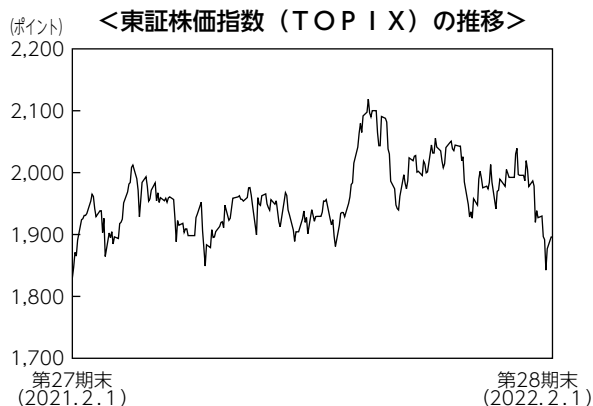
基準価額の主な変動要因

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 (T B) 3 ヶ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、1年および3ヵ月国庫短期証券利回りはマイナス圏で推移しました。日銀がマイナス金利政策などの大規模な金融緩和政策を継続していることが要因となりました。当期末にかけて1年国庫短期証券利回りは海外金利の上昇を受けて若干上昇しましたが、引き続きマイナス圏で推移しています。

国内株式市場は、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、2021年1月から2月にかけて上昇しました。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方向感の定まらない展開となりました。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、米金融政策の引き締め前倒し観測などを受け、軟調な推移となりました。

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

前期末の組入債券を継続保有し、償還分に関しては地方債や社債の組入を行いました。

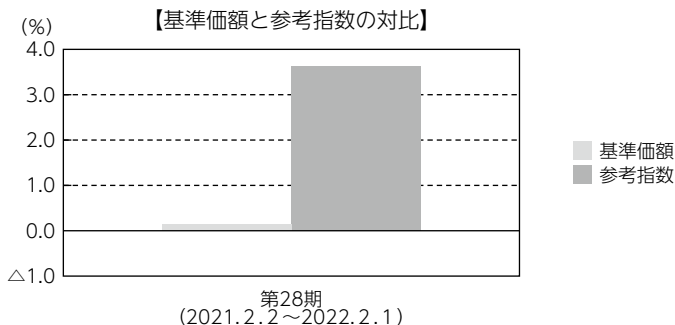
●ニュー トピックス インデックス マザーファンド

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
	2021年2月2日 ～2022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	1,402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

日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成に向け、引き続き緩和的な金融政策を継続していくと予想しています。引き続き公社債等への投資を通じ、安定的な運用を目指します。

●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、T O P I X 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28期		項目の概要
	(2021年2月2日 ～2022年2月1日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	152円	1.595%	(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9,525円です。
(投信会社)	(34)	(0.352)	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)	(110)	(1.155)	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)	(0.088)	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	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、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)	(0.000)	
(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	152	1.596	

(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。

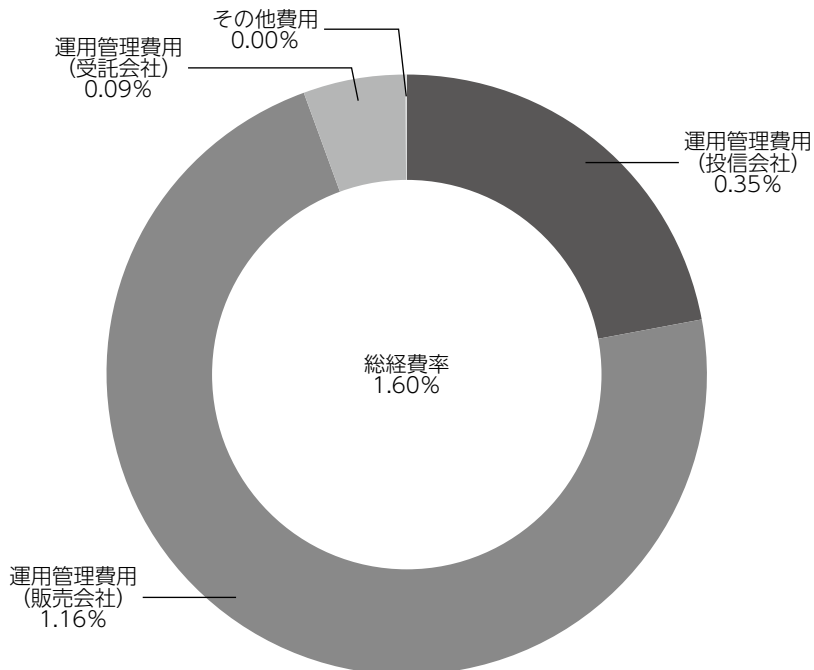
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2021年2月2日から2022年2月1日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
太陽財形公社債 マザーファンド	千口 1,181	千円 1,360	千口 -	千円 -
ニュートピックス インデックス マザーファンド	265	710	247	690

■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	632,212千円
(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)	0.26

(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2日から2022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)	0.153千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.127千円
(B)／(A)	83.0%

(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 29	百万円 10	% 34.3	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 43.0%

(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 172	百万円 49	% 28.9	百万円 460	百万円 155	% 33.8
株 式 先 物 取 引	766	766	100.0	773	773	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	当作成期末保有額
株 式	百万円 0.484477	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	買 付 額
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

親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千円	千円	千円
太陽財形公社債 マザーファンド	24,689	25,871	29,803
ニュートピックスインデックス マザーファンド	4,427	4,445	11,903

■投資信託財産の構成

2022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	11,903	27.3
太陽財形公社債 マザーファンド	29,803	68.3
コール・ローン等、その他	1,929	4.4
投資信託財産総額	43,636	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1日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	43,636,897円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,929,377
ニュートピックスインデックス マザーファンド(評価額)	11,903,589
太陽財形公社債 マザーファンド(評価額)	29,803,931
(B) 負 債	370,521
未 払 収 益 分 配 金	23,040
未 払 信 託 報 酬	347,268
そ の 他 未 払 費 用	213
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	43,266,376
元 本	46,080,574
次 期 繰 越 損 益 金	△2,814,198
(D) 受 益 権 総 口 数	46,080,574口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,389円

(注) 期首における元本額は43,937,412円、当期中における追加設定元本額は3,617,443円、同解約元本額は1,474,281円です。

■損益の状況

当期 自2021年2月2日 至2022年2月1日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△99円
受 取 利 息	1
支 払 利 息	△100
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	696,207
売 買 益	715,076
売 買 損	△18,869
(C) 信 託 報 酬 等	△679,616
(D) 当 期 繰 越 損 益 金(A+B+C)	16,492
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,470,085
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△4,277,735
(配 当 等 相 当 額)	(4,565,659)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△8,843,394)
(G) 合 計(D+E+F)	△2,791,158
(H) 収 益 分 配 金	△23,040
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△2,814,198
追 加 信 託 差 損 益 金	△4,277,735
(配 当 等 相 当 額)	(4,565,659)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△8,843,394)
分 配 準 備 積 立 金	1,896,418
繰 越 損 益 金	△432,881

(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	4,565,659
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,919,458
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	6,485,117
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	1,407.34
(g) 分 配 金	23,040
(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			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
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)。

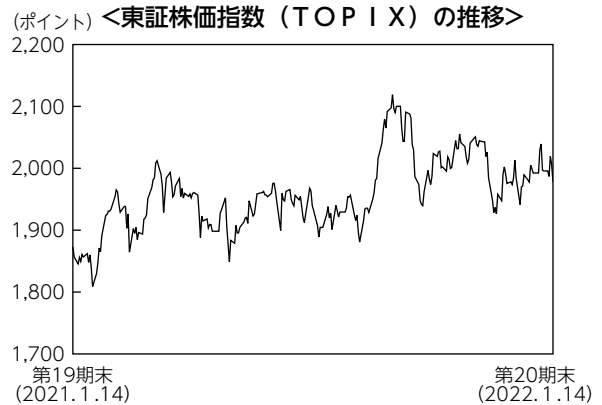
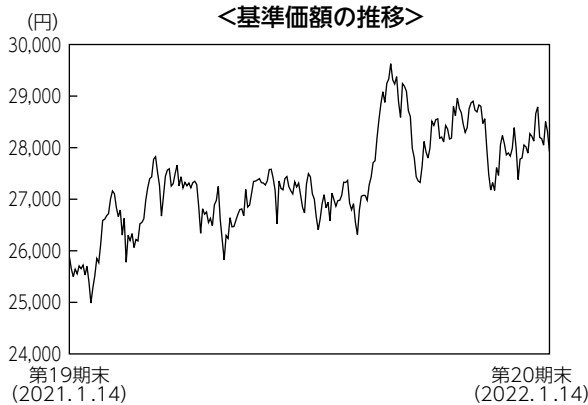
■当期中の基準価額と市況の推移

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、組入有価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 102.8 (43.638)	千円 216,997 (-)	千株 251.438	千円 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	—	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	
サントリー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	—	—	
グイドーリミテッド	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
富士フイ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
バンドー化学	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
高周波熱錬	0.2	0.2	125
東京製鋼	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
FUJI	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
オイレス工業	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
T O W A	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
S A N K Y O	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	—	—
リンテック	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
コーエーテッ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	—	—
コロブラ	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
DT 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
シップ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
日本紙パルプ商事	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
PALTA C	0.2	0.1	422
三谷産業	0.1	—	—
国際紙パルプ商事	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
パ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	—	—	
コロワイド	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	
AD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	
オオパ	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	
	千株	千株	千円	
合 計	株 数・金 額	1,031.7	926.7	2,304,243
	銘柄数<比率>	1,506銘柄	1,313銘柄	<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。

太陽財形公社債 マザーファンド

運用報告書

第28期（決算日 2022年2月1日）

（計算期間 2021年2月2日～2022年2月1日）

太陽財形公社債 マザーファンドの第28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	期騰落中率		債組入比率	債先物比率	純資産額
		期騰	落中率			
26期(2020年2月1日)	円 1,151		% 0.0	% 83.5	% -	百万円 72
27期(2021年2月1日)	1,151		0.0	87.9	-	69
28期(2022年2月1日)	1,152		0.1	58.3	-	68

(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)。

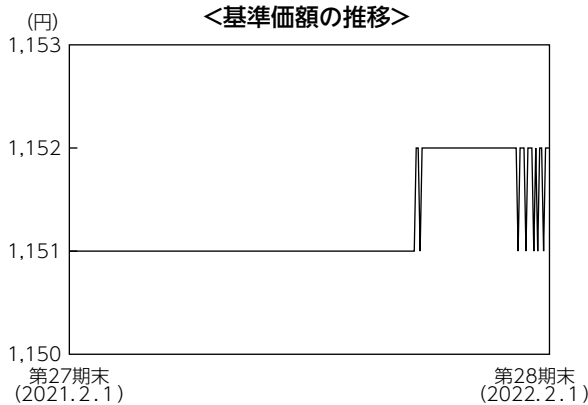
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年 2 月 1 日	円		%	%	%
	1,151	-		87.9	-
2 月 末	1,151	0.0		85.5	-
3 月 末	1,151	0.0		66.5	-
4 月 末	1,151	0.0		49.4	-
5 月 末	1,151	0.0		51.6	-
6 月 末	1,151	0.0		53.1	-
7 月 末	1,151	0.0		58.2	-
8 月 末	1,151	0.0		37.4	-
9 月 末	1,151	0.0		42.9	-
10 月 末	1,152	0.1		58.3	-
11 月 末	1,152	0.1		58.2	-
12 月 末	1,152	0.1		58.2	-
2022年 1 月 末	1,152	0.1		58.3	-
(期 末) 2022年 2 月 1 日	1,152	0.1		58.3	-

(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（2021年2月2日から2022年2月1日まで）

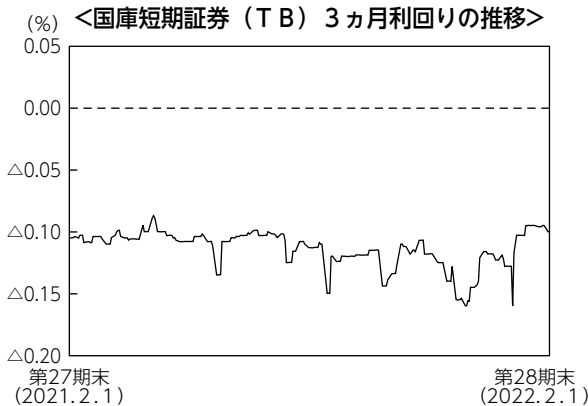


基準価額の推移

当ファンドの基準価額は1千口あたり1,152円となり、前期末の同1,151円から0.09%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

日銀のマイナス金利政策などのマイナス要因がりましたが、当ファンドで保有する債券の利息収入などはプラス要因となりました。当ファンドではプラス要因の影響が大きかったことから、基準価額は前期末比で上昇しました。



※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。

投資環境

国内短期金融市場では、1年および3ヵ月国庫短期証券利回りはマイナス圏で推移しました。日銀がマイナス金利政策などの大規模な金融緩和政策を継続していることが要因となりました。当期末にかけて1年国庫短期証券利回りは海外金利の上昇を受けて若干上昇しましたが、引き続きマイナス圏で推移しています。

ポートフォリオについて

前期末の組入債券を継続保有し、償還分に関しては地方債や社債の組入を行いました。

今後の運用方針

日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成に向け、引き続き緩和的な金融政策を継続していくと予想しています。引き続き公社債等への投資を通じ、安定的な運用を目指します。

■ 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 (2021年2月2日から2022年2月1日まで)

公社債

		買付額	売付額	
国	内	千円	千円	
		地方債証券	21,703	(51,000)
		社債券	8,018	(-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年2月2日から2022年2月1日まで)

期中の利害関係人との取引状況

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 29	百万円 10	% 34.3	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BB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
地 方 債 証 券	千円 31,500	千円 31,671	% 46.5	% 45.8	% -	% 0.7	% 45.8
普 通 社 債 券	8,000	8,004	11.8	-	-	1.5	10.3
合 計	39,500	39,676	58.3	45.8	-	2.2	56.1

(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	額	償 還 年 月 日
(地方債証券)	%	千円	千円	千円	
23年度9回 福岡市公募公債 10年	1.0100	10,000	10,015		2022/03/28
146回 大阪府公募公債 5年	0.0010	10,000	9,999		2023/01/30
376回 大阪府公募公債	0.8200	10,000	10,133		2023/09/27
25年度1回 岡山市公募公債	0.7570	1,000	1,014		2024/01/31
31回1号 宮城県公募公債 10年	0.5150	500	508		2025/09/29
小 計	—	31,500	31,671		—
(普通社債券)	%	千円	千円		
2回 東京電力パワーグリッド社債	0.5800	3,000	3,001		2022/03/09
192回 オリックス社債	0.1500	4,000	4,002		2022/06/22
70回 三菱UFJリース社債	0.2000	1,000	1,000		2025/07/30
小 計	—	8,000	8,004		—
合 計	—	39,500	39,676		—

■投資信託財産の構成

2022年2月1日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円		%
	39,676		58.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	28,388		41.7
投 資 信 託 財 産 総 額	68,065		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1日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	68,065,171円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	28,317,397
地 方 債 証 券(評価額)	31,671,644
社 債 証 券(評価額)	8,004,530
未 収 利 息	71,600
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	68,065,171
元 本	59,109,725
次 期 繰 越 損 益 金	8,955,446
(D) 受 益 権 総 口 数	59,109,725口
1千口当たり基準価額(C/D)	1,152円

(注1) 期首元本額	60,577,802円
追加設定元本額	4,335,364円
一部解約元本額	5,803,441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	25,871,468円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	28,635,407円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	4,602,850円
期末元本合計	59,109,725円

■損益の状況

当期 自2021年2月2日 至2022年2月1日

項 目	当 期
(A) 受 取 利 息 等 収 益	354,059円
受 取 利 息	358,282
支 払 利 息	△4,223
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△333,814
売 買 益	18,417
売 買 損	△352,231
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	20,245
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	9,157,124
(E) 解 約 差 損 益 金	△876,559
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	654,636
(G) 合 計(C+D+E+F)	8,955,446
次 期 繰 越 損 益 金(G)	8,955,446

(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。