

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 太陽年金・住宅財形 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 太陽年金・ 住宅財形 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 太陽年金・住宅財形 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 太陽年金・住宅財形 30

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 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 | 純資産 総額 |
|----------------|---------------|------------|----------|-------------------------|-----------|------------|------------|------------|-----------|
| | | 税込み 分配金 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | | | |
| 24期(2018年2月1日) | 円 9,629 | 円 5 | % 4.8 | ポイント 1,870.44 | % 22.4 | % 25.9 | % 0.7 | % 57.9 | 百万円 27 |
| 25期(2019年2月4日) | 9,132 | 5 | △5.1 | 1,581.33 | △15.5 | 27.0 | 0.7 | 40.6 | 22 |
| 26期(2020年2月3日) | 9,205 | 5 | 0.9 | 1,672.66 | 5.8 | 25.7 | 0.6 | 56.4 | 23 |
| 27期(2021年2月1日) | 9,417 | 5 | 2.4 | 1,829.84 | 9.4 | 26.1 | 1.0 | 60.7 | 11 |
| 28期(2022年2月1日) | 9,461 | 5 | 0.5 | 1,896.06 | 3.6 | 26.7 | 1.2 | 39.9 | 7 |

(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) (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 9,417 | % - | ポイント 1,829.84 | % - | % 26.1 | % 1.0 | % 60.7 |
| 2月末 | 9,457 | 0.4 | 1,864.49 | 1.9 | 27.0 | 0.4 | 58.6 |
| 3月末 | 9,592 | 1.9 | 1,954.00 | 6.8 | 27.3 | 0.9 | 45.8 |
| 4月末 | 9,501 | 0.9 | 1,898.24 | 3.7 | 27.4 | 0.7 | 34.7 |
| 5月末 | 9,550 | 1.4 | 1,922.98 | 5.1 | 27.6 | 0.7 | 35.2 |
| 6月末 | 9,572 | 1.6 | 1,943.57 | 6.2 | 26.4 | 0.6 | 36.1 |
| 7月末 | 9,503 | 0.9 | 1,901.08 | 3.9 | 26.1 | 0.8 | 40.3 |
| 8月末 | 9,572 | 1.6 | 1,960.70 | 7.2 | 26.7 | 0.9 | 25.7 |
| 9月末 | 9,677 | 2.8 | 2,030.16 | 10.9 | 25.9 | 1.1 | 29.8 |
| 10月末 | 9,633 | 2.3 | 2,001.18 | 9.4 | 26.2 | 0.9 | 40.1 |
| 11月末 | 9,526 | 1.2 | 1,928.35 | 5.4 | 25.3 | 1.1 | 40.4 |
| 12月末 | 9,602 | 2.0 | 1,992.33 | 8.9 | 25.8 | 0.7 | 39.8 |
| 2022年1月末 | 9,466 | 0.5 | 1,895.93 | 3.6 | 26.7 | 1.2 | 39.9 |
| (期末) 2022年2月1日 | 9,466 | 0.5 | 1,896.06 | 3.6 | 26.7 | 1.2 | 39.9 |

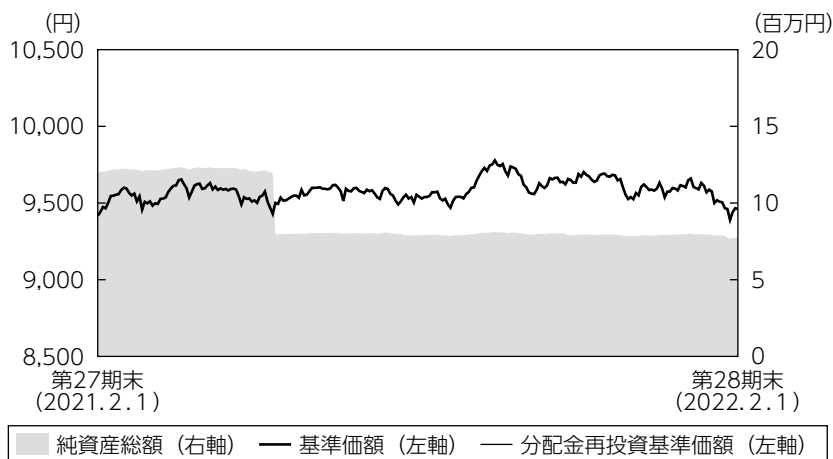
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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



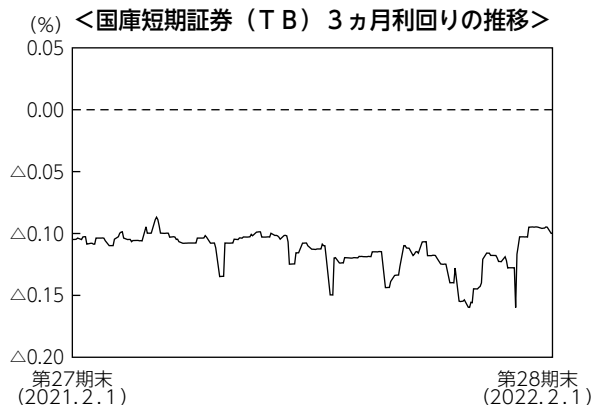
第28期首： 9,417円
第28期末： 9,461円
(既払分配金5円)
騰落率： 0.5%
(分配金再投資ベース)

- (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。

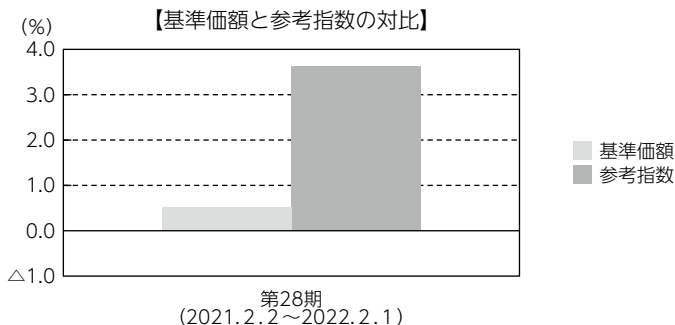
●ニュー トピックス インデックス マザーファンド

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 | 883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 | 153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9,582円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (投信会社) | (34) | (0.352) | |
| (販売会社) | (111) | (1.155) | |
| (受託会社) | (8) | (0.088) | |
| (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) | |
| 合計 | 153 | 1.595 | |

(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、売買委託手数料は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含まず。

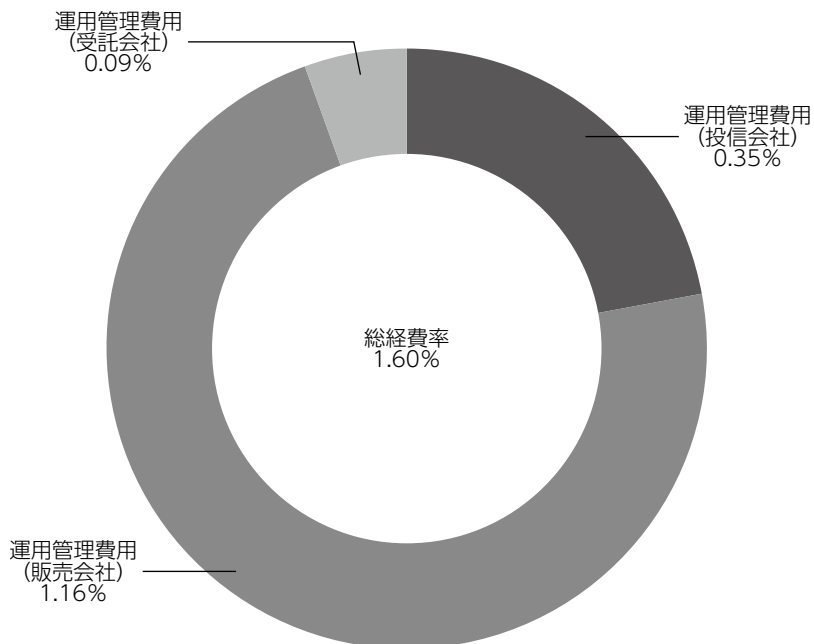
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は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 |
| | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| 太陽財形公社債 マザーファンド | 278 | 320 | 2,858 | 3,290 |
| ニュートピックス インデックス マザーファンド | 49 | 130 | 525 | 1,400 |

■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 太陽年金・住宅財形 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) | 0.031千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 0.025千円 |
| (B)／(A) | 80.6% |

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

【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 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 |
| 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 9.0%

(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 区 分 | 当 期 | | | 期 | | |
|--------------|------------|--------------------|-----------|------------|--------------------|-----------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 株 式 | 百万円 172 | 百万円 49 | % 28.9 | 百万円 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 0.1%

(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 | | 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 |
| 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□ | 千□ | | 千円 |
| 太陽財形公社債 マザーファンド | 7,183 | 4,602 | | 5,302 |
| ニュートピックス インデックス マザーファンド | 1,285 | 808 | | 2,166 |

■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 | | 2,166 | 27.7 |
| 太陽財形公社債 マザーファンド | | 5,302 | 67.9 |
| コール・ローン等、その他 | | 337 | 4.3 |
| 投資信託財産総額 | | 7,806 | 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 | 7,806,180円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 337,694 |
| ニュートピックスインデックス マザーファンド(評価額) | 2,166,003 |
| 太陽財形公社債 マザーファンド(評価額) | 5,302,483 |
| (B) 負 債 | 67,851 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 4,089 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 63,762 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 7,738,329 |
| 元 本 | 8,179,487 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △441,158 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 8,179,487口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 9,461円 |

(注) 期首における元本額は12,715,573円、当期中における追加設定元本額は268,053円、同解約元本額は4,804,139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) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 181,636円 |
| 売 買 益 | 192,092 |
| 売 買 損 | △10,456 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △145,612 |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B) | 36,024 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 128,832 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △601,925 |
| (配 当 等 相 当 額) | (458,460) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△1,060,385) |
| (F) 合 計(C+D+E) | △437,069 |
| (G) 収 益 分 配 金 | △4,089 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(F+G) | △441,158 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △601,925 |
| (配 当 等 相 当 額) | (458,460) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△1,060,385) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 264,184 |
| 繰 越 損 益 金 | △103,417 |

(注1) (A)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) (B)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) (E)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 | 458,460 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 268,273 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 726,733 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 888.48 |
| (g) 分 配 金 | 4,089 |
| (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 | | | |
| 16期 (2018年1月14日) | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 17期 (2019年1月14日) | 24,148 | 23.9 | 1,876.24 | 21.4 | 96.7 | 2.4 | 10,999 |
| 18期 (2020年1月14日) | 20,126 | △16.7 | 1,529.73 | △18.5 | 96.9 | 2.9 | 6,806 |
| 19期 (2021年1月14日) | 23,470 | 16.6 | 1,740.53 | 13.8 | 96.5 | 3.0 | 2,930 |
| 20期 (2022年1月14日) | 25,887 | 10.3 | 1,873.28 | 7.6 | 96.4 | 3.6 | 2,623 |
| 20期 (2022年1月14日) | 27,916 | 7.8 | 1,977.66 | 5.6 | 97.6 | 1.7 | 2,360 |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (㈩東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

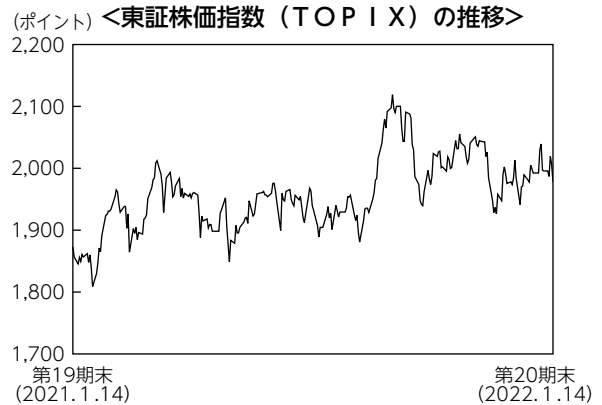
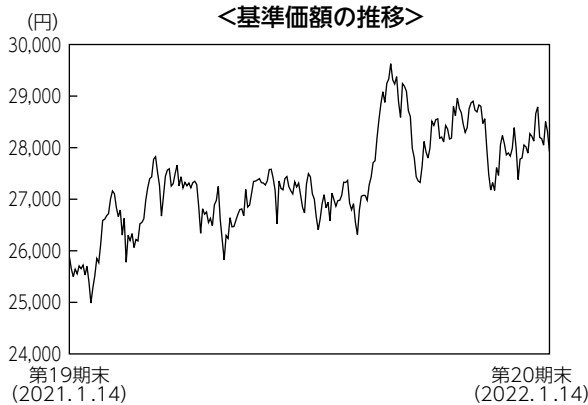
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東証株価指数(TOPIX) (ベンチマーク) | | 株 式 組 入 率 比 | 株 式 先 物 率 比 |
|-------------------------|-------------|--------|---------------------------|--------|----------------|----------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | |
| (期 首) 2021年 1 月 14 日 | 円 25,887 | % - | ポイント 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 |
| 株 式 | 百万円 5 |

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|-------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 38千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 27千円 |
| (B)/(A) | 70.3% |

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

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

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-----|-------|---|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 | 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 日清製粉グループ本社 | 1.1 | 0.9 | 1,448 | |
| 昭和産業 | 0.1 | 0.1 | 268 | |
| 鳥越製粉 | 0.1 | 0.2 | 128 | |
| 中部飼料 | 0.1 | 0.2 | 202 | |
| フィード・ワン | 0.1 | 0.2 | 141 | |
| 日本甜菜製糖 | 0.1 | 0.1 | 170 | |
| DM三井製糖ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 195 | |
| 塩水港精糖 | 0.1 | — | — | |
| 日新製糖 | — | 0.1 | 172 | |
| 森永製菓 | 0.2 | 0.2 | 766 | |
| 江崎グリコ | 0.3 | 0.2 | 740 | |
| 名糖産業 | — | 0.1 | 166 | |
| 井村屋グループ | 0.1 | 0.1 | 227 | |
| 不二家 | 0.1 | — | — | |
| 山崎製パン | 0.7 | 0.6 | 903 | |
| 亀田製菓 | 0.1 | — | — | |
| 寿スピリッツ | 0.1 | 0.1 | 485 | |
| カルビー | 0.4 | 0.4 | 1,086 | |
| 森永乳業 | 0.2 | 0.2 | 1,096 | |
| 六甲バター | 0.1 | 0.1 | 150 | |
| ヤクルト本社 | 0.7 | 0.6 | 3,504 | |
| 明治ホールディングス | 0.7 | 0.6 | 4,230 | |
| 雪印メグミルク | 0.2 | 0.2 | 408 | |
| プリマハム | 0.2 | 0.1 | 251 | |
| 日本ハム | 0.4 | 0.3 | 1,294 | |
| 丸大食品 | 0.1 | 0.1 | 155 | |
| S Foods | 0.1 | 0.1 | 362 | |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 0.6 | 0.4 | 267 | |
| サッポロホールディングス | 0.3 | 0.3 | 658 | |
| アサヒグループホールディングス | 2.2 | 2 | 9,300 | |
| キリンホールディングス | 4.2 | 3.1 | 5,792 | |
| 宝ホールディングス | 0.7 | 0.6 | 697 | |
| オエノンホールディングス | 0.3 | 0.4 | 132 | |
| コカ・コーラ ボトラーズ | | | | |
| ジャパンホールディングス | 0.8 | 0.6 | 807 | |
| サントリー食品インターナショナル | 0.7 | 0.6 | 2,565 | |
| グアール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 | |
| グアイトウボウ | 0.2 | — | — | |
| グアイトーリミテッド | 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 | 0.2 | — | — |
| ハリマ化成グループ | 0.1 | 0.1 | 83 |
| 花王 | 2.4 | 1.9 | 10,839 |
| 三洋化成工業 | 0.1 | 0.1 | 526 |
| 有機合成薬品工業 | 0.1 | — | — |
| 大日本塗料 | 0.1 | 0.2 | 163 |
| 日本ペイントホールディングス | 0.8 | 3.1 | 2,945 |
| 関西ペイント | 1.1 | 0.9 | 2,207 |
| 神東塗料 | 0.1 | — | — |
| 中国塗料 | 0.3 | 0.2 | 186 |
| 日本特殊塗料 | 0.1 | 0.1 | 88 |
| 藤倉化成 | 0.1 | 0.2 | 98 |
| 太陽ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 346 |
| D I C | 0.4 | 0.4 | 1,234 |
| サカタインクス | 0.2 | 0.2 | 199 |
| 東洋インキSCホールディングス | 0.2 | 0.2 | 382 |
| T & K T O K A | 0.1 | 0.1 | 81 |
| 富士フィルムホールディングス | 1.9 | 1.5 | 12,486 |
| 資生堂 | 2 | 1.6 | 9,420 |
| ライオン | 1.3 | 1 | 1,487 |
| 高砂香料工業 | 0.1 | 0.1 | 279 |
| マンダム | 0.2 | 0.2 | 273 |
| ミルボン | 0.1 | 0.1 | 561 |
| ファンケル | 0.4 | 0.3 | 899 |
| コーセー | 0.2 | 0.2 | 2,202 |
| コタ | 0.1 | 0.1 | 159 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 0.4 | 0.4 | 696 |
| ノエビアホールディングス | 0.1 | 0.1 | 504 |
| エステー | 0.1 | 0.1 | 152 |
| コニシ | 0.2 | 0.2 | 335 |
| 長谷川香料 | 0.2 | 0.1 | 256 |
| 星光PMC | 0.1 | — | — |
| 小林製薬 | 0.3 | 0.2 | 1,694 |
| 荒川化学工業 | 0.1 | 0.1 | 117 |
| メック | 0.1 | 0.1 | 360 |
| タカラバイオ | 0.3 | 0.2 | 498 |
| J C U | 0.1 | 0.1 | 539 |
| 新田ゼラチン | 0.1 | 0.2 | 135 |

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|--------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ゼリア新薬工業 | 0.2 | 0.2 | 400 |
| 第一三共 | 8.4 | 6.7 | 17,755 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 0.2 | 0.2 | 367 |
| 大幸薬品 | 0.1 | 0.2 | 145 |
| ダイト | 0.1 | 0.1 | 299 |
| 大塚ホールディングス | 2 | 1.8 | 7,354 |
| 大正製薬ホールディングス | 0.2 | 0.2 | 1,072 |
| ペプチドリーム | 0.5 | 0.5 | 1,186 |
| あすか製薬ホールディングス | — | 0.1 | 101 |
| サワイグループホールディングス | — | 0.2 | 868 |
| 石油・石炭製品 (0.4%) | | | |
| 日本コークス工業 | 0.8 | 0.9 | 126 |
| ニチレキ | 0.1 | 0.1 | 133 |
| ユシロ化学工業 | 0.1 | — | — |
| 富士石油 | 0.3 | — | — |
| 出光興産 | 1.1 | 1 | 3,140 |
| E N E O S ホールディングス | 14.8 | 12.9 | 5,927 |
| コスモエネルギーホールディングス | 0.3 | 0.2 | 473 |
| ゴム製品 (0.7%) | | | |
| 横浜ゴム | 0.6 | 0.5 | 922 |
| T O Y O T I R E | 0.5 | 0.5 | 889 |
| ブリヂストン | 2.6 | 2.5 | 12,697 |
| 住友ゴム工業 | 0.9 | 0.8 | 956 |
| 藤倉コンポジット | 0.1 | — | — |
| オカモト | 0.1 | 0.1 | 430 |
| ニッタ | 0.1 | 0.1 | 285 |
| 住友理工 | 0.2 | 0.2 | 124 |
| 三ツ星ベルト | 0.1 | 0.1 | 215 |
| バンドー化学 | 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 |
| 高周波熱練 | 0.2 | 0.2 | 125 |
| 東京製網 | 0.1 | — | — |
| サンコール | 0.1 | — | — |
| モリテックスチール | 0.1 | — | — |
| パイオラックス | 0.1 | 0.1 | 179 |
| エイチワン | 0.1 | — | — |
| 日本発条 | 1 | 0.8 | 798 |
| 三益半導体工業 | 0.1 | 0.1 | 258 |
| 機械 (5.7%) | | | |
| 日本製鋼所 | 0.3 | 0.3 | 1,281 |
| 三浦工業 | 0.4 | 0.4 | 1,472 |
| タクマ | 0.3 | 0.3 | 432 |
| ツガミ | 0.2 | 0.2 | 326 |
| オークマ | 0.1 | 0.1 | 524 |
| 芝浦機械 | 0.1 | 0.1 | 382 |
| アマダ | 1.2 | 1.3 | 1,530 |
| アイダエンジニアリング | 0.3 | 0.2 | 220 |
| 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 |
| レオン自動機 | 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 |
| TOWA | 0.1 | 0.1 | 300 |
| 北川鉄工所 | — | 0.1 | 142 |
| クボタ | 5.2 | 4.1 | 10,686 |
| 月島機械 | 0.2 | 0.2 | 217 |
| 帝国電機製作所 | 0.1 | 0.1 | 146 |
| 新東工業 | 0.2 | 0.3 | 213 |
| 澁谷工業 | 0.1 | 0.1 | 277 |
| アイチコーポレーション | 0.2 | — | — |
| 小森コーポレーション | 0.2 | 0.3 | 216 |
| 鶴見製作所 | 0.1 | 0.1 | 168 |
| 荏原製作所 | 0.4 | 0.4 | 2,508 |
| 西島製作所 | 0.1 | 0.1 | 92 |
| 北越工業 | 0.1 | 0.1 | 97 |
| ダイキン工業 | 1.3 | 1.1 | 27,830 |
| 栗田工業 | 0.5 | 0.5 | 2,625 |
| 椿本チエイン | 0.1 | 0.1 | 323 |
| 木村化工機 | 0.1 | 0.1 | 80 |
| アネスト岩田 | 0.2 | 0.2 | 157 |
| ダイフク | 0.5 | 0.5 | 4,285 |
| 加藤製作所 | 0.1 | — | — |
| タダノ | 0.5 | 0.5 | 581 |
| フジテック | 0.4 | 0.3 | 755 |
| C K D | 0.3 | 0.3 | 678 |
| キトー | 0.1 | 0.1 | 186 |
| 平和 | 0.3 | 0.2 | 386 |

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

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

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

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

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

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|--------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 北海道瓦斯 | 0.1 | 0.1 | 151 |
| 広島ガス | 0.2 | 0.3 | 110 |
| 西部ガスホールディングス | 0.1 | 0.1 | 213 |
| 静岡ガス | 0.3 | 0.2 | 199 |
| メタウォーター | 0.1 | 0.1 | 193 |
| 陸運業 (2.8%) | | | |
| SBSホールディングス | 0.1 | 0.1 | 349 |
| 東武鉄道 | 1 | 0.8 | 2,100 |
| 相鉄ホールディングス | 0.3 | 0.3 | 615 |
| 東急 | 2.5 | 2.1 | 3,129 |
| 京浜急行電鉄 | 1.3 | 1.1 | 1,256 |
| 小田急電鉄 | 1.5 | 1.3 | 2,600 |
| 京王電鉄 | 0.5 | 0.4 | 1,998 |
| 京成電鉄 | 0.7 | 0.6 | 1,777 |
| 富士急行 | 0.1 | 0.1 | 384 |
| 東日本旅客鉄道 | 1.7 | 1.5 | 10,050 |
| 西日本旅客鉄道 | 0.9 | 1 | 4,689 |
| 東海旅客鉄道 | 0.8 | 0.7 | 10,265 |
| 西武ホールディングス | 1.3 | 1.1 | 1,153 |
| 鴻池運輸 | 0.2 | 0.1 | 118 |
| 西日本鉄道 | 0.3 | 0.2 | 507 |
| ハマキョウレックス | 0.1 | 0.1 | 289 |
| サカイ引越センター | 0.1 | — | — |
| 近鉄グループホールディングス | 0.9 | 0.8 | 2,604 |
| 阪急阪神ホールディングス | 1.2 | 1 | 3,245 |
| 南海電気鉄道 | 0.4 | 0.4 | 880 |
| 京阪ホールディングス | 0.4 | 0.4 | 1,070 |
| 名古屋鉄道 | 0.8 | 0.7 | 1,281 |
| 山陽電気鉄道 | 0.1 | 0.1 | 197 |
| 日本通運 | 0.3 | — | — |
| ヤマトホールディングス | 1.5 | 1.1 | 2,756 |
| 山九 | 0.3 | 0.2 | 977 |
| 丸運 | 0.1 | — | — |
| 丸全昭和運輸 | 0.1 | 0.1 | 315 |
| センコーグループホールディングス | 0.5 | 0.3 | 281 |
| ニッコンホールディングス | 0.3 | 0.3 | 649 |
| 福山通運 | 0.1 | 0.1 | 380 |
| セイノーホールディングス | 0.7 | 0.5 | 571 |
| 日立物流 | 0.2 | 0.2 | 1,044 |
| 丸和運輸機関 | 0.2 | 0.2 | 289 |
| C&Fロジホールディングス | 0.1 | 0.1 | 143 |
| 九州旅客鉄道 | 0.8 | 0.6 | 1,409 |
| SGホールディングス | 2 | 1.5 | 3,832 |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | — | 0.3 | 2,157 |
| 海運業 (0.6%) | | | |
| 日本郵船 | 0.8 | 0.7 | 6,839 |
| 商船三井 | 0.6 | 0.5 | 4,750 |
| 川崎汽船 | 0.3 | 0.3 | 2,388 |
| N Sユニテッド海運 | 0.1 | — | — |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 明治海運 | 0.1 | 0.1 | 79 |
| 飯野海運 | 0.4 | 0.4 | 222 |
| 乾汽船 | 0.1 | 0.1 | 265 |
| 空運業 (0.4%) | | | |
| 日本航空 | 2.1 | 1.8 | 3,834 |
| A N Aホールディングス | 2.3 | 2.1 | 5,006 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | | | |
| 日新 | 0.1 | 0.1 | 164 |
| 三菱倉庫 | 0.3 | 0.3 | 829 |
| 三井倉庫ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 247 |
| 住友倉庫 | 0.3 | 0.3 | 591 |
| 滋澤倉庫 | 0.1 | — | — |
| 東陽倉庫 | 0.2 | — | — |
| 日本トランスシティ | 0.2 | 0.2 | 130 |
| 中央倉庫 | 0.1 | 0.1 | 98 |
| 安田倉庫 | 0.1 | — | — |
| 東洋埠頭 | — | 0.1 | 143 |
| 宇徳 | 0.1 | — | — |
| 上組 | 0.5 | 0.4 | 888 |
| 近鉄エクスプレス | 0.2 | 0.2 | 577 |
| 東海運 | 0.1 | — | — |
| エーアイティ | 0.1 | 0.1 | 143 |
| 情報・通信業 (7.7%) | | | |
| NEC ネットエスアイ | 0.3 | 0.3 | 525 |
| システナ | 0.3 | 1.2 | 459 |
| 日鉄ソリューションズ | 0.1 | 0.1 | 346 |
| キューブシステム | 0.1 | — | — |
| コア | — | 0.1 | 154 |
| ラクーンホールディングス | — | 0.1 | 135 |
| T I S | 1 | 0.8 | 2,468 |
| グリー | 0.6 | 0.5 | 433 |
| コーエーテ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 |
| ボルトウウィン・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 |
| C I J | 0.1 | - | - |
| 日本エンタープライズ | 0.1 | - | - |
| スカラ | 0.1 | - | - |
| インテリジェント ウェイブ | 0.1 | - | - |
| IMAGICA GROUP | 0.1 | - | - |
| ネットワンシステムズ | 0.4 | 0.3 | 861 |
| システムソフト | 0.2 | - | - |
| アルゴグラフィックス | 0.1 | 0.1 | 329 |
| マーベラス | 0.1 | 0.2 | 144 |
| エイベックス | 0.2 | 0.1 | 134 |
| 日本ユニシス | 0.3 | 0.3 | 933 |
| 兼松エレフトロニクス | 0.1 | - | - |
| 都築電気 | - | 0.1 | 160 |
| TBSホールディングス | 0.6 | 0.5 | 832 |
| 日本テレビホールディングス | 0.8 | 0.7 | 858 |
| 朝日放送グループホールディングス | 0.1 | 0.1 | 70 |
| テレビ朝日ホールディングス | 0.3 | 0.2 | 295 |
| スカパーJ SATホールディングス | 0.6 | 0.7 | 305 |
| テレビ東京ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 202 |
| ビジョン | 0.1 | 0.2 | 204 |
| USEN-NEXT HOLDINGS | - | 0.1 | 295 |
| コネクシオ | 0.1 | 0.1 | 141 |
| 日本通信 | 0.8 | 0.8 | 148 |
| 日本電信電話 | 12.9 | 8.8 | 28,793 |
| KDDI | 7 | 6.1 | 21,709 |
| ソフトバンク | 8.8 | 12.6 | 18,232 |
| 光通信 | 0.1 | 0.1 | 1,636 |
| エムティーアイ | 0.1 | - | - |
| GMOインターネット | 0.3 | 0.3 | 791 |
| KADOKAWA | 0.3 | 0.4 | 1,007 |
| 学研ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 104 |
| ゼンリン | 0.2 | 0.2 | 201 |
| インプレスホールディングス | 0.1 | - | - |
| アイネット | - | 0.1 | 131 |
| 松竹 | 0.1 | 0.1 | 1,151 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|--------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東宝 | 0.6 | 0.5 | 2,267 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 2.6 | 2.2 | 5,093 |
| ピー・シー・エー | - | 0.1 | 164 |
| D T S | 0.2 | 0.2 | 511 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 0.4 | 0.4 | 2,136 |
| シーイーシー | 0.1 | 0.1 | 107 |
| カプコン | 0.5 | 0.8 | 1,953 |
| ジャステック | 0.1 | 0.1 | 102 |
| S C S K | 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 |
| N S D | 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 |
| T O K A Iホールディングス | 0.5 | 0.4 | 351 |
| 三洋貿易 | 0.1 | 0.1 | 100 |
| ウイン・パートナーズ | 0.1 | 0.1 | 96 |
| シッパヘルスケアホールディングス | 0.2 | 0.3 | 799 |
| コマダホールディングス | 0.2 | 0.2 | 410 |
| フルサト・マルカホールディングス | - | 0.1 | 248 |
| ヤマエグループホールディングス | - | 0.1 | 104 |
| 小野建 | 0.1 | 0.1 | 171 |
| 佐鳥電機 | 0.1 | - | - |
| 伯東 | 0.1 | 0.1 | 263 |
| コンドーテック | 0.1 | 0.1 | 102 |
| 中山福 | 0.1 | - | - |
| ナガイレーベン | 0.1 | 0.1 | 221 |
| 三菱食品 | 0.1 | 0.1 | 278 |
| 松田産業 | 0.1 | 0.1 | 239 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|--------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 第一興商 | 0.1 | 0.2 | 677 |
| メディアパルホールディングス | 1 | 0.9 | 1,870 |
| アズワン | 0.1 | 0.2 | 1,270 |
| シモジマ | 0.1 | — | — |
| ドウシシャ | 0.1 | 0.1 | 153 |
| 高速 | 0.1 | 0.1 | 154 |
| 丸文 | 0.1 | 0.1 | 80 |
| ハピネット | 0.1 | — | — |
| 日本ライフライン | 0.3 | 0.3 | 333 |
| タカショー | 0.1 | — | — |
| I DOM | 0.3 | 0.3 | 228 |
| 進和 | 0.1 | 0.1 | 222 |
| シークス | 0.1 | 0.1 | 146 |
| 伊藤忠商事 | 6.8 | 5.9 | 20,632 |
| 丸紅 | 10.1 | 8.3 | 9,760 |
| 長瀬産業 | 0.5 | 0.5 | 930 |
| 蝶理 | 0.1 | 0.1 | 183 |
| 豊田通商 | 1.1 | 0.9 | 4,635 |
| 三共生興 | 0.1 | 0.2 | 112 |
| 兼松 | 0.4 | 0.3 | 387 |
| 三井物産 | 8.4 | 6.5 | 18,567 |
| 日本紙パルプ商事 | 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 |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 | 千株 | 千株 |
| | 銘柄数<比率> | 1,031.7 | 926.7 |
| | | 1,506銘柄 | 1,313銘柄 |
| | | | 2,304,243 |
| | | | <97.6%> |

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

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

■投資信託財産の構成

2022年1月14日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 2,304,243 | 97.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 69,197 | 2.9 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 2,373,440 | 100.0 |

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年1月14日)現在

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

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

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

■損益の状況

当期 自2021年1月15日 至2022年1月14日

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

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

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

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

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）。

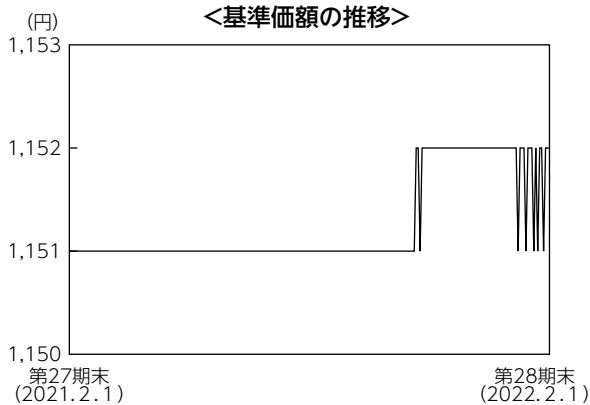
■当期中の基準価額の推移

| 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）

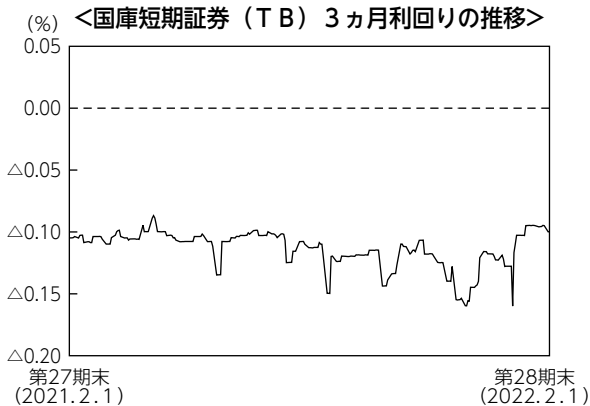


基準価額の推移

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 | | | 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 | 償 | 還 | 年 | 月 | 日 | |
| (地方債証券) | | | | | | | | | | | | | | | |
| 23年度9回 福岡市公募公債 | 1.0100 | % | 10,000 | 千円 | 10,015 | 千円 | | | | | | | | | 2022/03/28 |
| 146回 大阪府公募公債 | 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 | 0.5150 | | 500 | | 508 | | | | | | | | | | 2025/09/29 |
| 小計 | - | | 31,500 | | 31,671 | | | | | | | | | | - |
| (普通社債券) | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2回 東京電力パワーグリッド社債 | 0.5800 | % | 3,000 | 千円 | 3,001 | 千円 | | | | | | | | | 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 | | | 39,676 | 千円 | 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。 |