

# 運用報告書 (全体版)

第18期<決算日 2019年6月10日>

## MHAMトピックスファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/株式/インデックス型	
信託期間	2001年6月29日から無期限です。 なお、クローズド期間はありません。	
運用方針	東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資を行い、ベンチマークである東証株価指数 (TOPIX) の動きに連動する投資成果を目指します。	
主要投資対象	MHAMトピックスファンド	MHAMトピックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	MHAMトピックスマザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
組入制限	MHAMトピックスファンド	株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	MHAMトピ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。 外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎期、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。 収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「MHAMトピックスファンド」は、2019年6月10日に第18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/>

## お知らせ

## 収益分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)

200円

## 収益分配金の支払いについて

- ・収益分配金は、取扱い販売会社において決算日から起算して5営業日までに支払いを開始いたします。
- ・分配金再投資コースを選択されている場合は、決算日の基準価額に基づき、お客さまの口座に繰り入れて再投資いたします。

## 収益分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金は、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）」の区分があり、分配後の基準価額が個々の受益者の個別元本と同額または上回る場合は、全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個々の受益者の個別元本を下回る場合は、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの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、分配金発生時に個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。

## 普通分配金の税率について

	所得税	復興特別所得税	地方税	計
個人の受益者	15%	0.315%	5%	20.315%
法人の受益者	15%	0.315%	—	15.315%

※2037年12月31日までは所得税の額に対し2.1%の金額が復興特別所得税として徴収されます。

※個人の受益者が有する当該受益権のうちNISA（ニーサ、少額投資非課税制度）の適用を受けているものについては非課税となります。

※上記は当ファンドの期末時点のものです。今後税法が改正された場合等には上記内容が変更になる場合があります。

■信託財産留保額の徴収を廃止する所要の約款変更を行いました。

なお、上記約款変更により商品としての同一性が失われるものではありません。

(変更年月日：2018年9月11日)

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			東証株価指数(TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
14期(2015年6月10日)	13,059	190	34.3	1,628.23	32.5	94.0	6.9	1,425
15期(2016年6月10日)	10,682	135	△17.2	1,330.72	△18.3	95.7	4.5	1,181
16期(2017年6月12日)	12,754	220	21.5	1,591.55	19.6	95.9	5.1	1,253
17期(2018年6月11日)	14,292	240	13.9	1,786.84	12.3	94.3	4.8	1,486
18期(2019年6月10日)	12,438	200	△11.6	1,552.94	△13.1	94.1	5.0	1,569

(注1) 基準価額は1万円当たり(以下同じ)。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、株式組入比率および株式先物比率は、実質組入比率を記載しております(以下同じ)。

(注5) 株式先物比率は買建比率-売建比率(以下同じ)。

(注6) 純資産総額の単位未満は切捨て。

(注7) 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)。

## 当期中の基準価額と市況推移

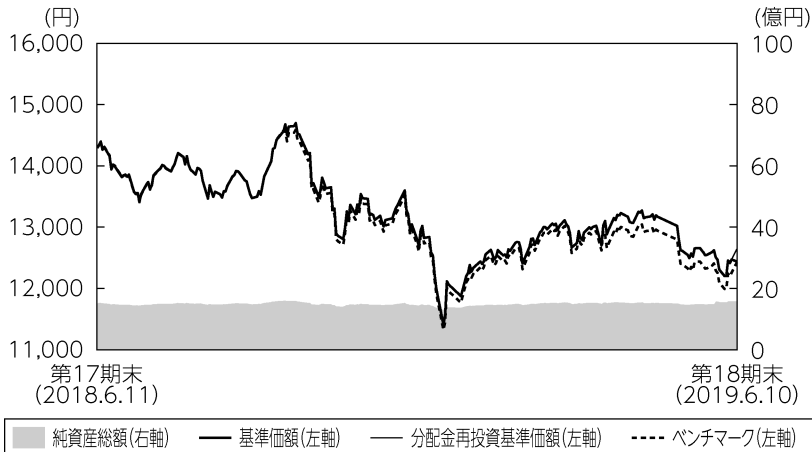
	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率	
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
	円	%		%	%	%	
(期首)2018年6月11日	14,292	-	1,786.84	-	94.3	4.8	
第18期	6月末	13,855	△3.1	1,730.89	△3.1	96.0	3.5
	7月末	14,025	△1.9	1,753.29	△1.9	94.7	4.7
	8月末	13,881	△2.9	1,735.35	△2.9	93.4	5.8
	9月末	14,640	2.4	1,817.25	1.7	95.3	4.6
	10月末	13,255	△7.3	1,646.12	△7.9	94.7	4.5
	11月末	13,424	△6.1	1,667.45	△6.7	95.0	4.5
	12月末	12,062	△15.6	1,494.09	△16.4	92.1	7.6
	2019年1月末	12,636	△11.6	1,567.49	△12.3	94.7	4.3
	2月末	12,952	△9.4	1,607.66	△10.0	94.9	4.3
	3月末	12,955	△9.4	1,591.64	△10.9	93.1	6.3
4月末	13,168	△7.9	1,617.93	△9.5	94.9	4.3	
5月末	12,306	△13.9	1,512.28	△15.4	93.2	5.9	
(期末)2019年6月10日	12,638	△11.6	1,552.94	△13.1	94.1	5.0	

(注1) 期末の基準価額は分配金込み。

(注2) 騰落率は対期首比。

## 当期中の運用経過(2018年6月12日から2019年6月10日まで)

### 基準価額等の推移



第18期首 : 14,292円  
 第18期末 : 12,438円  
 (既払分配金200円)  
 騰落率 : △ 11.6%  
 (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す。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまが利用する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およびベンチマーク（東証株価指数（TOPIX））は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

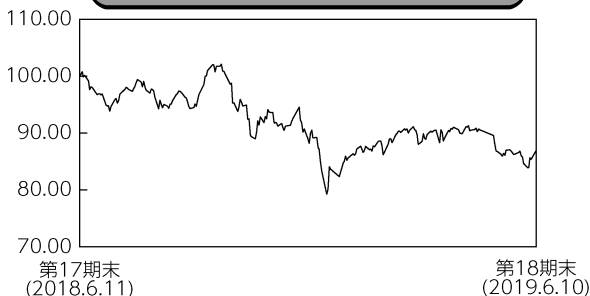
### 基準価額の主な変動要因

MHAMトピックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内株式への投資を行った結果、市況が下落したことなどから、基準価額は下落しました。

## 投資環境

### ●国内株式市況

東証株価指数(TOPIX)の推移



(注) 期首の値を100として指数化しています。

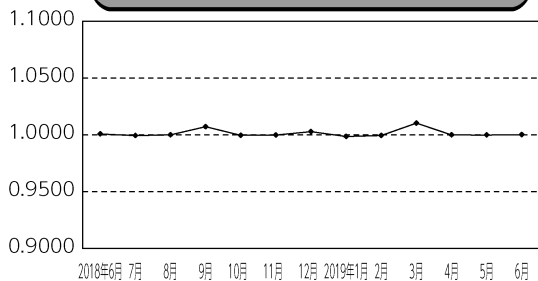
国内株式市場は下落しました。期初から昨年9月にかけては、円安・ドル高の進行や堅調な米国経済指標が好感される一方で、トランプ政権による保護主義的な通商・関税政策への警戒やトルコリラ急落など新興国リスクの顕在化、米国長期金利の上昇などが嫌気され、一進一退の展開が続きました。その後、米中貿易摩擦の激化による世界的な景気減速懸念から企業業績に下方修正懸念が強まったことや、トランプ大統領の政権運営をめぐる不透明感などから、昨年末にかけ大幅下落となりました。年明け1月には、米連邦準備制度理事会 (FRB) から利上げに慎重なスタンスが示され、米国株が堅調に推移したことから、国内株も上昇に転じました。しかし、5月に米国による対中関税引き上げが実施されたこ

とから相場は急落、その後も世界景気の先行き懸念から軟調な展開となりました。

## ポートフォリオについて

### ●MHAMトピックスファンド

月間連動率の推移



$$\text{月間連動率} = \frac{1 + \text{基準価額月間騰落率}}{1 + \text{ベンチマーク月間騰落率}}$$

(注) 月間連動率の2018年6月は対期首比、2019年6月は期末対2019年5月末比

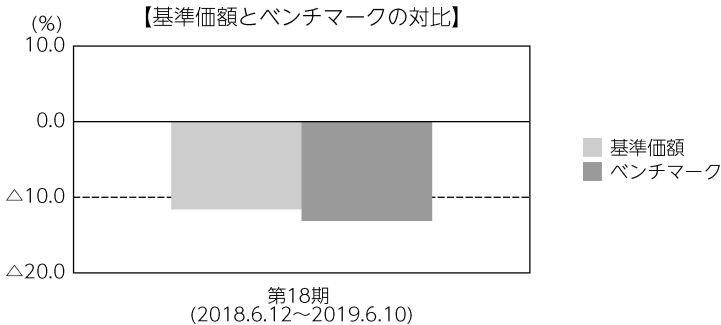
当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、MHAMトピックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

### ●MHAMトピックスマザーファンド

当期の運用につきましては、当マザーファンドの運用方針に従い、東証株価指数 (TOPIX) の動きに連動した投資成果を目指すため、マルチファクターモデル等を利用した現物株式ポートフォリオによる運用を行いました。また、財務リスクが高まったと判断した銘柄を除外した他、資金の流出入等に対応するため一部、株価指数先物取引を行いました。先物を含む株式の組入比率は期を通じて高位を保ちました。

## ベンチマークとの差異について

MHAMトピックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内株式への投資を行った結果、当ファンドの基準価額（分配金再投資ベース）はベンチマークを1.5%程度上回りました。この差異は、主に保有株式の配当金などのプラス要因と信託報酬などのマイナス要因との差によるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、下記のとおりといたしました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

### 分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2018年6月12日 ～2019年6月10日
当期分配金（税引前）	200円
対基準価額比率	1.583%
当期の収益	191円
当期の収益以外	8円
翌期繰越分配対象額	8,297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。

(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

---

- MHAMトピックスファンド

今後の運用につきましても、MHAMトピックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持します。

- MHAMトピックスマザーファンド

今後の運用につきましても、株式の組入比率を高位に保ち、東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第18期		項目の概要
	(2018年6月12日～ 2019年6月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	86円	0.646%	(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13,263円です。
(投信会社)	(26)	(0.194)	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)	(50)	(0.377)	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)	(10)	(0.075)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.004	(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
(株式)	(0)	(0.002)	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
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	－	－	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	0	0.002	(d)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)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(－)	(－)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用
合計	87	0.652	

(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、有価証券取引税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。



## ■ 期中の売買及び取引の状況(2018年6月12日から2019年6月10日まで)

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
MHAMトピックスマザーファンド	257,891	445,259	110,127	194,007

(注) 単位未満は切捨て。

## ■ 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
	MHAMトピックスマザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	359,955千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,410,358千円
(c) 売 買 高 比 率 ( a ) / ( b )	0.25

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■ 利害関係人との取引状況等(2018年6月12日から2019年6月10日まで)

### (1) 当期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

### (2) 当期中の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)	58千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	55千円
(B) / (A)	94.3%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

## 【MHAMトピ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) 当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
株 式	百万円 315	百万円 196	% 62.2	百万円 44	百万円 40	% 90.9
新 株 予 約 権 証 券	—	—	—	0.021297	—	—
株 式 先 物 取 引	694	645	92.9	681	614	90.2

平均保有割合=100.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該子ファンドの親投資信託所有口数の割合。

## (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	期末保有額
株 式	百万円 2	百万円 0.195315	百万円 13

(注) 期末保有額は評価ベース。

## (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 0.263534

\*金額の単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\*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係る利害関係人とは、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、オリエントコーポレーション、興銀リースです。

## 組入資産の明細

2019年6月10日現在

## 親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
M H A M ト ピ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	千□ 788,566	千□ 936,331	千円 1,569,291

(注) 単位未満は切捨て。

※当期末における親投資信託の組入資産の明細は、17～23頁をご参照ください。

## 投資信託財産の構成

2019年6月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
MHAMトピックスマザーファンド	千円 1,569,291	% 97.9
コール・ローン等、その他	33,967	2.1
投資信託財産総額	1,603,258	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

## 資産、負債、元本及び基準価額の状況

2019年6月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,603,258,636円
コール・ローン等	5,611,055
MHAMトピックスマザーファンド(評価額)	1,569,291,681
未 収 入 金	28,355,900
(B) 負 債	33,630,020
未 払 収 益 分 配 金	25,239,533
未 払 解 約 金	3,613,527
未 払 信 託 報 酬	4,764,935
未 払 利 息	10
そ の 他 未 払 費 用	12,015
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,569,628,616
元 本	1,261,976,668
次 期 繰 越 損 益 金	307,651,948
(D) 受 益 権 総 口 数	1,261,976,668口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,438円

(注1) 当期末における1口当たり純資産額 1,2438円

(注2) その他未払費用 監査費用等を計上しています。

(注3) 期首元本額 1,039,894,697円

期中追加設定元本額 421,909,161円

期中一部解約元本額 199,827,190円

## 損益の状況

(2018年6月12日から2019年6月10日まで)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△2,499円
受 取 利 息	19
そ の 他 収 益 金	-
支 払 利 息	△2,518
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△152,463,272
売 買 損 益	14,722,022
売 買 損 益	△167,185,294
(C) 信 託 報 酬 等	△9,626,773
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△162,092,544
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	265,636,781
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	229,347,244
( 配 当 等 相 当 額 )	(781,860,901)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△552,513,657)
(G) 計 ( D + E + F )	332,891,481
(H) 収 益 分 配 金	△25,239,533
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	307,651,948
追 加 信 託 差 損 益 金	229,347,244
( 配 当 等 相 当 額 )	(782,657,716)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△553,310,472)
分 配 準 備 積 立 金	264,505,471
繰 越 損 益 金	△186,200,767

(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 (単位:円)

	金 額
(a)配当等収益(費用控除後)	24,108,223
(b)有価証券売買等損益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	-
(c)収益調整金	782,657,716
(d)分配準備積立金	265,636,781
分配可能額(a + b + c + d)	1,072,402,720
(1万口当たり)	(8,497)
収益分配金額	25,239,533
(1万口当たり)	(200)

(注) (a)配当等収益(費用控除後)および(b)有価証券売買等損益(費用控除後、繰越欠損金補填後)には、当期中に親投資信託が計上した当該金額のうち、当ファンドに相当する金額が含まれています。

※本運用報告書作成時点においては、当計算期間に係る当ファンドの監査は終了しておりません。

# － 運用報告書（全体版）－

## MHAMトピックスマザーファンド

第18期

決算日：2019年6月10日

(計算期間：2018年6月12日～2019年6月10日)

「MHAMトピックスマザーファンド」は、2019年6月10日に第18期決算を行いました。ここに、当マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

### ■マザーファンドの仕組み

信 託 期 間	2001年6月29日から無期限です。
運 用 方 針	東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資を行い、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指します。
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主要投資対象とします。
主 な 投 資 制 限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
14期(2015年6月10日)	16,134	35.0	1,628.23	32.5	94.1	6.9	1,424
15期(2016年6月10日)	13,444	△16.7	1,330.72	△18.3	95.7	4.5	1,181
16期(2017年6月12日)	16,425	22.2	1,591.55	19.6	96.1	5.1	1,251
17期(2018年6月11日)	18,830	14.6	1,786.84	12.3	94.4	4.8	1,484
18期(2019年6月10日)	16,760	△11.0	1,552.94	△13.1	94.2	5.0	1,569

(注1) 基準価額は1万円当たり(以下同じ)。

(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率(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)。

(注4) 純資産総額の単位未満は切捨て。

(注5) 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)。

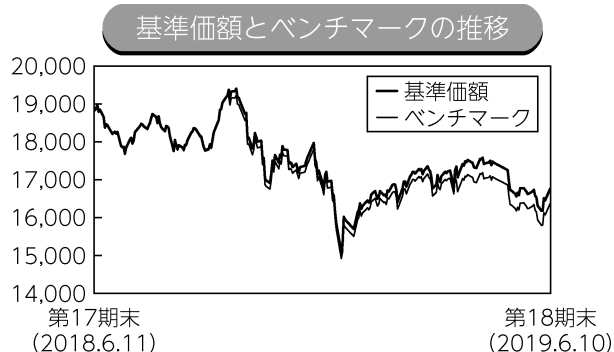
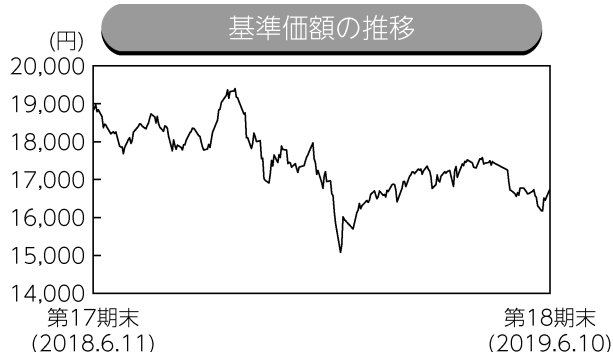
## 当期中の基準価額と市況推移

	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式 組入比率	株式 先物比率	
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
(期首)2018年6月11日	18,830	—	1,786.84	—	94.4	4.8	
第 18 期	6月末	18,259	△3.0	1,730.89	△3.1	96.1	3.5
	7月末	18,494	△1.8	1,753.29	△1.9	94.7	4.7
	8月末	18,313	△2.7	1,735.35	△2.9	93.4	5.8
	9月末	19,324	2.6	1,817.25	1.7	95.3	4.6
	10月末	17,506	△7.0	1,646.12	△7.9	94.7	4.5
	11月末	17,739	△5.8	1,667.45	△6.7	95.0	4.5
	12月末	15,946	△15.3	1,494.09	△16.4	92.2	7.6
	2019年1月末	16,715	△11.2	1,567.49	△12.3	94.8	4.3
	2月末	17,142	△9.0	1,607.66	△10.0	94.9	4.3
	3月末	17,155	△8.9	1,591.64	△10.9	93.1	6.3
4月末	17,446	△7.3	1,617.93	△9.5	95.0	4.3	
5月末	16,314	△13.4	1,512.28	△15.4	93.2	5.9	
(期末)2019年6月10日	16,760	△11.0	1,552.94	△13.1	94.2	5.0	

(注) 騰落率は対期首比。

## 当期中の運用経過（2018年6月12日から2019年6月10日まで）

### 【基準価額等の推移】



(注) ベンチマーク（東証株価指数（TOPIX））は、期首の値を基準価額に合わせて指数化しています。

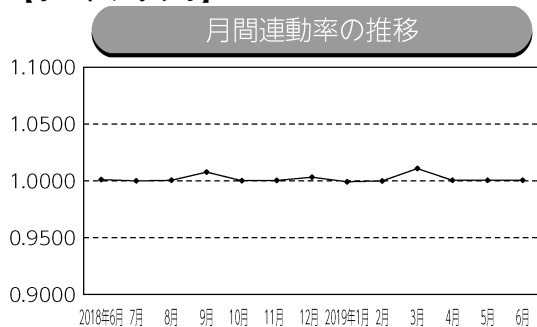
### 【基準価額の主な変動要因】

当ファンドでは、主として国内株式への投資を行った結果、市況が下落したことなどから、基準価額は下落しました。

### 【投資環境】

4頁をご参照ください。

### 【ポートフォリオ】



4頁をご参照ください。

$$\text{月間連動率} = \frac{1 + \text{基準価額月間騰落率}}{1 + \text{ベンチマーク月間騰落率}}$$

(注) 月間連動率の2018年6月は対期首比、2019年6月は期末対2019年5月末比

### 【ベンチマークとの差異】

当ファンドの基準価額はベンチマークを2.1%程度上回りました。この差異は、主に保有株式の配当金などのプラス要因によるものです。

## 今後の運用方針

6頁をご参照ください。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2018年6月12日～ 2019年6月10日)		
	金額 (円)	比率 (%)	
平均基準価額	17,529	—	—
(a) 売買委託手数料	1	0.004	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.002)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
合計	1	0.004	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）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。

(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。

## 期中の売買及び取引の状況(2018年6月12日から2019年6月10日まで)

### (1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株	千円	千株	千円
		169	315,247	33	44,708
		(△27)	(-)		

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ( )内は株式分割、予約権行使、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) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証券	千円	千円	証券	千円
	100	-	100	21	

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

### (3) 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	百万円	百万円	百万円
		694	681	-	-

(注) 単位未満は切捨て。

## 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	359,955千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,410,358千円
(c) 売買高比率 ( a ) / ( b )	0.25

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。



## 利害関係人との取引状況等(2018年6月12日から2019年6月10日まで)

### (1) 当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	$\frac{B}{A}$ A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ C
株 式	百万円 315	百万円 196	% 62.2	百万円 44	百万円 40	% 90.9
新株予約権証券	-	-	-	0.021297	-	-
株式先物取引	694	645	92.9	681	614	90.2

### (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	期末保有額
株 式	百万円 2	百万円 0.195315	百万円 13

(注) 期末保有額は評価ベース。

### (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 0.263534

### (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)	58千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	55千円
(B)／(A)	94.3%

\*金額の単位未満は切捨て。ただし、金額が単位未満の場合は小数で記載。

\*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、当ファンドに係る利害関係人とは、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、オリエントコーポレーション、興銀リースです。

2019年6月10日現在

## 組入資産の明細

## (1) 国内株式

銘柄	前(前)期末		当期末		評価額	銘柄	前(前)期末		当期末		評価額	銘柄	前(前)期末		当期末		評価額
	株数	株数	株数	株数			株数	株数	株数	株数			株数	株数	株数	株数	
水産・農林業(0.1%)					千円					千円							千円
日本水産	0.8	1			654	大気社	0.1	0.1			336	ケンコーマヨネーズ	0.1	0.1			232
マルハニチロ	0.1	0.1			325	ダイダシ	0.1	0.1			227	かや日ホールディングス	0.1	0.1			167
サカタのタネ	0.1	0.1			338	日比谷総合設備	0.1	0.1			186	なとり	0.1	0.1			159
ホクト	0.1	0.1			181	東芝プラントシステム	0.1	0.2			424	北の達人コーポレーション	0.2	0.3			182
鉱業(0.3%)						千代田化工建設	0.4	-			-	ユーグレナ	0.2	0.3			266
国際石油開発帝石	3.1	3.8			3,415	新興プランテック	0.2	0.2			266	繊維製品(0.7%)					
石油資源開発	0.1	0.2			468	食料品(4.2%)						片倉工業	0.1	-			-
建設業(2.9%)						日本製粉	0.2	0.2			361	グンゼ	0.1	0.1			486
ショーボンドホールディングス	0.1	0.1			783	日清製粉グループ本社	0.7	0.7			1,766	東洋紡	0.2	0.3			372
ミライト・ホールディングス	0.2	0.3			509	昭和産業	0.1	0.1			308	ユニチカ	0.3	0.5			187
安藤・間	0.5	0.6			457	中部飼料	0.1	-			-	倉敷紡績	1	0.1			195
東急建設	0.3	0.3			232	日本甜菜製糖	0.1	0.1			193	日本毛織	0.3	0.3			261
コムシスホールディングス	0.2	0.3			810	三井製糖	0.1	0.1			242	帝国繊維	0.1	0.1			229
融コストラクショングループ	0.1	0.1			232	森永製菓	0.1	0.2			1,000	帝人	0.5	0.6			1,094
大成建設	0.6	0.7			2,901	江崎グリコ	0.2	0.2			1,006	東レ	4.1	5.1			4,135
大林組	1.9	2.3			2,467	不二家	0.1	0.1			197	セーレン	0.2	0.2			298
清水建設	1.9	2.3			2,134	山崎製パン	0.4	0.5			819	ワコールホールディングス	0.1	0.2			568
長谷工コーポレーション	0.7	1			1,127	寿スピリッツ	0.1	0.1			532	ホギメディカル	0.1	0.1			346
鹿島建設	3	1.8			2,781	カルビー	0.3	0.3			927	T S Iホールディングス	0.2	0.3			198
鉄建建設	-	0.1			300	森永乳業	0.1	0.1			392	ワールド	-	0.1			219
西松建設	0.2	0.2			429	六甲バター	0.1	0.1			201	オンワードホールディングス	0.4	0.6			361
三井住友建設	0.5	0.6			372	ヤフルト本社	0.3	0.5			3,225	ゴールドウイン	-	0.1			1,391
大豊建設	-	0.1			281	明治ホールディングス	0.4	0.5			3,810	デサント	0.1	0.2			381
前田建設工業	0.5	0.6			549	雪印メグミルク	0.1	0.2			454	パルプ・紙(0.2%)					
奥村組	0.1	0.1			345	プリマム	-	0.1			206	王子ホールディングス	2	2.9			1,690
東鉄工業	0.1	0.1			308	日本ハム	0.2	0.3			1,386	日本製紙	0.3	0.3			561
戸田建設	1	1			622	丸大食品	-	0.1			195	北越コーポレーション	0.6	0.6			336
熊谷組	0.1	0.1			305	S Foods	0.1	0.1			369	大王製紙	0.3	0.3			378
大東建託	0.2	0.3			4,305	伊藤ハムホールディングス	0.4	0.5			325	レンゴー	0.6	0.8			685
N I P P O	0.2	0.2			442	サッポロホールディングス	0.2	0.3			692	化学(7.5%)					
前田道路	0.2	0.2			458	アサヒグループホールディングス	1.1	1.4			6,897	クラレ	1	1.1			1,438
東亜建設工業	0.1	0.1			150	キリンホールディングス	2.6	3			6,940	旭化成	3.6	4.6			5,338
東洋建設	0.3	0.4			168	宝ホールディングス	0.4	0.5			577	昭和電工	0.4	0.5			1,585
五洋建設	0.8	1			518	オエノンホールディングス	0.5	0.5			183	住友化学	4	5.2			2,527
住友林業	0.4	0.6			766	ココ・コーラ ボトラーズ	0.4	0.5			1,362	日産化学	0.3	0.4			1,884
日成ビルド工業	0.1	-			-	ジャパンホールディングス	0.4	0.5			1,362	クレハ	0.1	0.1			745
大和ハウス工業	1.8	2			6,776	サントリー食品インターナショナル	0.4	0.4			1,820	テイカ	0.1	0.1			241
ライト工業	0.2	0.2			282	グایدグループホールディングス	-	0.1			459	石原産業	0.1	0.2			236
積水ハウス	2	2.3			4,100	伊藤園	0.2	0.2			1,066	日本曹達	-	0.1			271
ユアテック	-	0.2			154	キーコーヒー	0.1	0.1			212	東ソー	0.8	1			1,417
中電工	0.1	0.1			228	日清オイリオグループ	0.1	0.1			325	トクヤマ	0.2	0.2			506
関電工	0.3	0.4			362	不二製油グループ本社	0.2	0.2			642	セントラル硝子	0.1	0.2			482
きんでん	0.4	0.5			868	キッコーマン	0.4	0.4			1,860	東亜合成	0.3	0.4			492
住友電設	0.1	0.1			180	味の素	1.3	1.5			2,837	大阪ソーダ	0.1	0.1			273
日本電設工業	0.1	0.1			237	キューピー	0.3	0.4			986	関東電化工業	0.2	0.2			149
協和エグシオ	0.2	0.3			788	ハウス食品グループ本社	0.2	0.2			879	デンカ	0.2	0.3			951
新日本空調	0.1	0.1			176	カゴメ	0.2	0.3			757	信越化学工業	0.9	1.1			10,247
九電工	0.1	0.2			642	アリアケジャパン	0.1	0.1			710	堀化学工業	0.1	0.1			262
三機工業	0.2	0.2			251	ニチレイ	0.3	0.4			1,080	エア・ウォーター	0.5	0.5			865
日揮	0.5	0.7			1,008	東洋水産	0.3	0.3			1,314	太陽酸化	0.4	0.5			1,081
太平電業	0.1	0.1			215	日清食品ホールディングス	0.2	0.3			2,001	日本パーカライズン	0.3	0.4			515
高砂熱学工業	0.2	0.2			348	フジッコ	0.1	0.1			214	四国化成工業	0.1	0.2			216
明星工業	0.2	0.2			132	ロック・フィールド	0.1	0.1			151	日本触媒	0.1	0.1			688
						日本たばこ産業	3.3	3.8			9,553	大日精化工業	-	0.1			305



銘柄	前日(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
リンナイ	0.1	0.1	0.1	713
岡部	0.2	0.2	0.2	197
ゾーテクト	0.1	0.1	0.1	154
東プレ	0.1	0.1	0.1	181
高周波熱練	0.1	0.2	0.2	178
東京製綱	0.1	-	-	-
パイオラックス	0.1	0.1	0.1	191
日本発條	0.6	0.7	0.7	588
三益半導体工業	0.1	0.1	0.1	154
<b>機械(5.1%)</b>				
日本製鋼所	0.2	0.2	0.2	359
三浦工業	0.2	0.3	0.3	999
タクマ	0.2	0.3	0.3	429
ツガミ	-	0.2	0.2	178
オークマ	0.1	0.1	0.1	538
東芝機械	-	0.1	0.1	242
アマダホールディングス	0.9	1	1	1,197
アイデンジニアリング	0.2	0.3	0.3	225
FUJ I	0.2	0.3	0.3	378
牧野フライス製作所	-	0.1	0.1	403
オーエスジ	0.3	0.3	0.3	642
旭ダイヤモロ工業	0.2	0.3	0.3	193
DMG森精機	0.4	0.5	0.5	730
ソディック	0.1	0.2	0.2	187
ディスコ	0.1	0.1	0.1	1,614
日東工器	0.1	0.1	0.1	223
島精機製作所	0.1	0.1	0.1	313
オプトラ	0.1	0.1	0.1	243
やまびこ	0.1	0.2	0.2	185
ナブテスコ	0.3	0.4	0.4	1,159
三井海洋開発	0.1	0.1	0.1	284
レオン自動車	0.1	0.1	0.1	166
S M C	0.2	0.2	0.2	7,550
オイレス工業	0.1	0.1	0.1	156
サトーホールディングス	0.1	0.1	0.1	277
技研製作所	-	0.1	0.1	336
小松製作所	2.6	3	3	7,299
住友重機械工業	0.3	0.4	0.4	1,386
日立建機	0.3	0.3	0.3	815
井関農機	0.1	0.1	0.1	150
クボタ	2.9	3.5	3.5	6,097
月島機械	0.1	0.2	0.2	279
新東工業	0.2	0.2	0.2	191
澁谷工業	0.1	0.1	0.1	291
アイチ コーポレーション	0.2	0.3	0.3	207
小森コーポレーション	0.2	0.2	0.2	235
荏原製作所	0.2	0.3	0.3	879
ダイキン工業	0.7	0.9	0.9	12,357
栗田工業	0.3	0.4	0.4	1,044
榎本チエイン	-	0.1	0.1	351
アナスト岩田	0.1	0.2	0.2	199
ダイフク	0.3	0.4	0.4	2,324
タダノ	0.3	0.4	0.4	433
フジテック	0.2	0.3	0.3	447
C K D	0.2	0.3	0.3	324
平和	0.2	0.2	0.2	439
理想科学工業	0.1	0.1	0.1	171
S A N K Y O	0.1	0.2	0.2	849
竹内製作所	0.1	0.1	0.1	185

銘柄	前日(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
アマノ	0.2	0.2	0.2	588
J U K I	0.1	-	-	-
サンデンホールディングス	0.1	-	-	-
マックス	0.1	0.1	0.1	153
グローリー	0.2	0.2	0.2	565
新晃工業	0.1	-	-	-
大和冷機工業	-	0.1	0.1	119
セガミホールディングス	0.6	0.7	0.7	917
T P R	0.1	0.1	0.1	189
ツバキ・ナカシマ	0.1	0.1	0.1	171
ホシザキ	0.2	0.2	0.2	1,582
日本精工	1.1	1.4	1.4	1,282
N T N	1.4	1.7	1.7	521
ジェイテクト	0.6	0.7	0.7	863
不二越	0.1	0.1	0.1	436
日本トムソン	0.3	0.4	0.4	180
T H K	0.4	0.4	0.4	952
前澤給装工業	0.1	0.1	0.1	196
イーグル工業	0.1	-	-	-
日本ピラー工業	0.1	0.2	0.2	220
キッツ	0.3	0.4	0.4	304
マキタ	0.7	0.8	0.8	3,016
日立造船	0.6	0.8	0.8	289
三菱重工	0.9	1.1	1.1	5,184
I H I	0.4	0.5	0.5	1,249
スター精密	0.1	0.2	0.2	282
<b>電気機器(13.1%)</b>				
日清紡ホールディングス	0.4	0.5	0.5	395
イビデン	0.4	0.4	0.4	728
コニカミノルタ	1.3	1.5	1.5	1,522
ブラザー工業	0.7	0.9	0.9	1,728
ミネベアミツミ	1	1.3	1.3	2,198
日立製作所	13	3	3	11,988
三菱電機	5.4	6.6	6.6	9,286
富士電機	2	0.4	0.4	1,512
安川電機	0.6	0.8	0.8	2,692
シフオニアテクノロジー	1	0.2	0.2	245
明電舎	1	0.2	0.2	309
デンヨー	0.1	0.1	0.1	138
東芝テック	-	0.1	0.1	280
マップモーター	0.2	0.2	0.2	748
日本電産	0.7	0.8	0.8	11,404
ダブル・スコープ	0.1	0.1	0.1	147
ダイヘン	-	0.1	0.1	310
ヤーマン	0.1	-	-	-
J V Cケンウッド	0.5	0.7	0.7	160
日新電機	0.2	0.2	0.2	225
大崎電気工業	0.2	0.3	0.3	207
オムロン	0.6	0.7	0.7	3,808
日東工業	0.1	0.1	0.1	195
I D E C	0.1	0.1	0.1	202
アイ・エス・エフ コーポレーション	1	0.3	0.3	624
日本電気	0.7	0.9	0.9	3,748
富士通	6	0.6	0.6	4,562
沖電気工業	0.3	0.3	0.3	392
電気興業	-	0.1	0.1	304
サンケン電気	-	0.1	0.1	224
ルネサスエレクトロニクス	0.3	0.8	0.8	400
セイコーエプソン	0.8	0.8	0.8	1,320

銘柄	前日(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
ワコム	0.5	0.6	0.6	206
アルパック	0.1	0.1	0.1	317
E I Z O	0.1	0.1	0.1	398
ジャパンディスプレイ	1.2	-	-	-
日本信号	0.2	0.2	0.2	230
京三製作所	-	0.5	0.5	180
能美防災	0.1	0.1	0.1	215
ホーチキ	0.1	-	-	-
エレコム	0.1	0.1	0.1	361
パナソニック	6.2	7.6	7.6	6,650
シャープ	0.5	0.7	0.7	723
アンリツ	0.4	0.5	0.5	888
富士通ゼネラル	0.2	0.2	0.2	317
ソニー	3.7	4.5	4.5	24,120
T D K	0.3	0.4	0.4	3,072
タムラ製作所	0.3	0.4	0.4	226
アルプスアルパイン	0.5	0.7	0.7	1,261
パイオニア	1.1	-	-	-
フォスター電機	0.1	0.1	0.1	151
ヨコオ	0.1	0.1	0.1	213
ホシデン	0.2	0.3	0.3	341
ヒロセ電機	0.1	0.1	0.1	1,201
日本航空電子工業	-	0.2	0.2	319
マルセルホールディングス	0.1	0.2	0.2	368
アルパイン	0.2	-	-	-
スミコーポレーション	0.1	-	-	-
横河電機	0.6	0.7	0.7	1,499
アズビル	0.2	0.4	0.4	1,062
日本光電工業	0.2	0.3	0.3	948
共和電業	0.4	0.5	0.5	207
堀場製作所	0.1	0.1	0.1	526
アドバンテクト	0.3	0.5	0.5	1,423
エスベック	0.1	0.1	0.1	228
キーエンス	0.3	0.3	0.3	19,200
シスメックス	0.4	0.5	0.5	3,855
メガチップス	0.1	-	-	-
コーセル	0.1	0.2	0.2	214
イリソ電子工業	0.1	0.1	0.1	538
オプテックスグループ	0.1	0.2	0.2	268
レーザーテック	0.1	0.1	0.1	395
スタンレー電気	0.4	0.5	0.5	1,276
ウシオ電機	0.3	0.4	0.4	550
日本セラミック	0.1	0.1	0.1	294
日本電子	-	0.1	0.1	233
カシオ計算機	0.5	0.6	0.6	769
ファナック	0.5	0.6	0.6	11,556
日本シイエムケイ	-	0.3	0.3	205
ローム	0.2	0.3	0.3	2,112
浜松ホトニクス	0.4	0.5	0.5	1,955
三井ハイテック	0.1	-	-	-
新光電気工業	0.3	0.3	0.3	277
京セラ	0.9	1	1	6,853
太陽誘電	0.3	0.3	0.3	576
村田製作所	0.6	2.1	2.1	9,548
双葉電子工業	0.1	0.1	0.1	142
ニチコン	0.2	0.3	0.3	243
日本ケミコン	0.1	0.1	0.1	159
K O A	0.1	0.2	0.2	261
市光工業	0.1	-	-	-

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
小糸製作所	0.3	0.4	2,168	
ミツバ	0.1	-	-	
SCREENホールディングス	0.1	0.1	399	
キャノン電子	0.1	0.1	179	
キャノン	2.9	3.5	10,885	
リコー	1.7	2	2,146	
象印マホービン	0.1	0.2	236	
東京エレクトロン	0.4	0.4	6,238	
<b>輸送用機器(7.9%)</b>				
トヨタ紡織	0.2	0.3	425	
ユニプレス	0.1	0.2	356	
豊田自動織機	0.4	0.5	2,950	
モリタホールディングス	0.1	0.1	192	
三櫻工業	0.2	0.4	162	
デンソー	1.2	1.4	6,200	
東海理化電機製作所	0.2	0.2	345	
三井E&Sホールディングス	0.2	0.4	379	
川崎重工業	0.4	0.5	1,229	
日産自動車	6.4	7.8	5,985	
いすゞ自動車	1.6	2.1	2,644	
トヨタ自動車	6.7	7.4	49,624	
日野自動車	0.8	0.9	791	
三菱自動車工業	2.1	2.5	1,285	
武蔵精密工業	0.1	0.2	283	
日産車体	0.2	0.2	209	
新明和工業	0.3	0.3	405	
極東開発工業	0.1	0.2	275	
日信工業	0.1	0.2	287	
トピー工業	0.1	0.1	241	
タチエス	0.1	0.2	270	
NOK	0.3	0.4	584	
フタバ産業	0.2	0.3	168	
K Y B	0.1	0.1	288	
大同メタル工業	-	0.2	128	
アプレス工業	0.4	0.5	243	
太平洋工業	0.2	0.2	300	
ケーヒン	0.2	0.2	296	
河西工業	0.1	-	-	
アイシン精機	0.4	0.5	1,862	
マツダ	1.7	2.1	2,369	
本田技研工業	4.9	5.5	15,290	
スズキ	1.1	1.2	6,362	
S U B A R U	1.7	2	5,245	
ヤマハ発動機	0.8	0.9	1,733	
ショーワ	0.2	0.2	288	
エクセディ	0.1	0.1	221	
豊田合成	0.2	0.2	403	
愛三工業	0.2	0.3	210	
ヨロズ	0.1	0.1	133	
エフ・シー・シー	0.1	0.1	231	
シマノ	0.2	0.3	5,100	
テイ・エス・テック	0.1	0.2	566	
<b>精密機器(2.1%)</b>				
テルモ	0.8	1.9	6,080	
日機装	0.2	0.3	448	
島津製作所	0.7	0.8	2,274	
東京精密	0.1	0.1	261	
マニ	0.1	0.1	697	
ニコン	1	1.2	1,822	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
トプコン	0.3	0.4	540	
オリンパス	0.8	3.9	5,066	
理研計器	0.1	0.1	196	
タムロン	0.1	0.1	218	
HOYA	1.1	1.3	10,320	
ノーリツ鋼機	0.1	0.1	187	
朝日インテック	-	0.3	1,683	
シチズン時計	0.8	0.9	471	
メニコン	0.1	0.1	369	
セイコーホールディングス	0.1	0.1	213	
ニプロ	0.4	0.5	604	
<b>その他製品(2.2%)</b>				
パラマウントベッドホールディングス	0.1	0.1	444	
前田工業	-	0.1	193	
パナゲイムホールディングス	0.6	0.7	3,794	
フナスヤットホールディングス	-	0.2	198	
パイロットコーポレーション	0.1	0.1	419	
トッピー・フォームズ	0.2	0.2	183	
フジールインターナショナル	0.1	0.2	725	
タカラトミー	0.3	0.3	398	
大建工業	0.1	0.1	219	
凸版印刷	2	0.9	1,483	
大日本印刷	0.7	0.9	2,160	
N I S S H A	0.1	0.2	223	
宝印刷	0.1	0.1	159	
アシックス	0.6	0.6	753	
ヤマハ	0.4	0.4	2,060	
ピジョン	0.3	0.4	1,670	
リンテック	0.1	0.2	437	
任天堂	0.3	0.4	15,880	
三菱鉛筆	0.1	0.1	189	
タカラスタンダード	0.1	0.2	334	
コクヨ	0.3	0.3	457	
オカムラ	0.2	0.3	322	
美津濃	0.1	0.1	256	
<b>電気・ガス業(1.8%)</b>				
東京電力ホールディングス	4.5	5.4	3,153	
中部電力	1.7	2	3,140	
関西電力	2.2	2.7	3,511	
中国電力	0.8	0.9	1,257	
北陸電力	0.7	0.8	652	
東北電力	1.3	1.6	1,827	
四国電力	0.5	0.7	715	
九州電力	1.2	1.5	1,642	
北海道電力	0.7	0.9	579	
沖縄電力	0.125	0.2	348	
電源開発	0.4	0.5	1,234	
イーレックス	-	0.1	132	
東京瓦斯	1.1	1.3	3,543	
大阪瓦斯	1	1.3	2,572	
東邦瓦斯	0.3	0.3	1,299	
西部瓦斯	0.1	0.1	228	
静岡ガス	0.2	0.3	257	
<b>陸運業(4.9%)</b>				
SBSホールディングス	-	0.1	160	
東武鉄道	0.6	0.7	2,247	
相鉄ホールディングス	0.2	0.2	620	
東京急行電鉄	1.5	1.8	3,528	
京浜急行電鉄	0.8	0.9	1,728	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
小田急電鉄	0.8	1	2,739	
京王電鉄	0.3	0.3	2,175	
京成電鉄	0.4	0.5	2,057	
富士急行	0.1	0.1	409	
東日本旅客鉄道	1	1.2	12,672	
西日本旅客鉄道	0.5	0.6	5,322	
東海旅客鉄道	0.5	0.6	13,878	
西武ホールディングス	0.7	0.8	1,516	
鴻池運輸	0.1	0.1	174	
西日本鉄道	0.2	0.2	488	
ハマキョウレックス	0.1	0.1	379	
近畿グループホールディングス	0.5	0.6	3,222	
阪急阪神ホールディングス	0.7	0.8	3,232	
南海電気鉄道	0.3	0.3	850	
京阪ホールディングス	0.2	0.3	1,479	
神戸電鉄	-	0.1	398	
名古屋鉄道	0.4	0.5	1,537	
山陽電気鉄道	0.1	0.1	224	
日本通運	0.2	0.2	1,148	
ヤマトホールディングス	0.9	1.1	2,475	
山九	0.1	0.2	1,114	
丸全昭和運輸	-	0.1	342	
セコーグループホールディングス	0.5	0.5	446	
ニコンホールディングス	0.2	0.2	519	
福山通運	0.1	0.1	395	
セイノールホールディングス	0.4	0.5	716	
日立物流	0.1	0.2	675	
九州旅客鉄道	0.4	0.5	1,710	
S Gホールディングス	0.5	0.6	1,830	
<b>海運業(0.2%)</b>				
日本郵船	0.5	0.6	981	
商船三井	0.3	0.4	958	
川崎汽船	0.2	0.2	241	
飯野海運	0.3	0.4	143	
<b>空運業(0.6%)</b>				
日本航空	1	1.2	4,194	
ANAホールディングス	1	1.1	4,075	
<b>倉庫・運輸関連業(0.2%)</b>				
三菱倉庫	0.2	0.2	616	
三井倉庫ホールディングス	1	0.2	324	
住友倉庫	1	0.3	423	
東陽倉庫	0.4	-	-	
日本トランスシティ	-	0.4	186	
安田倉庫	0.2	0.2	178	
上組	0.3	0.4	1,036	
近鉄エクスプレス	0.1	0.2	295	
<b>情報・通信業(8.8%)</b>				
NECネットエスアイ	0.1	0.1	278	
システナ	0.4	0.3	513	
日鉄ソリューションズ	0.1	0.1	347	
T I S	0.2	0.2	1,110	
グリー	0.3	0.5	264	
ユーエックホールディングス	0.1	0.2	407	
三菱総合研究所	-	0.1	326	
K L a b	0.1	-	-	
ネクソン	1.2	1.7	2,844	
アイスタイル	0.1	0.2	141	
コロプラ	0.2	0.2	160	
ブロードリーフ	0.3	0.4	221	

銘柄	前日(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
フィックスターズ	—	0.1	187	
ティーガイア	0.1	0.1	196	
テクマトリックス	—	0.1	200	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	1.5	1.6	472	
GMOパイドムトードウェイ	—	0.1	716	
インターネットインアジア インターネットインアジア	0.1	0.1	212	
SRAホールディングス	0.1	0.1	242	
朝日ネット	0.3	0.4	243	
LINE	0.2	0.2	609	
マクロミル	0.1	0.1	116	
野村総合研究所	0.3	0.4	2,112	
インテージホールディングス	—	0.2	199	
ソースネクスト	—	0.3	129	
インフォコム	—	0.1	242	
フジメディアホールディングス	0.6	0.7	1,076	
オービック	0.2	0.2	2,620	
ジャストシステム	0.1	0.1	363	
ヤフー	3.9	4.3	1,320	
トレンドマイクロ	0.3	0.4	1,974	
日本オラクル	0.1	0.1	781	
フューチャー	0.1	0.1	195	
CAC Holdings	—	0.1	159	
オビツバタシステムコンサルティング	—	0.1	524	
伊藤忠テクノソリューションズ	0.3	0.3	820	
東計電算	0.1	0.1	306	
大塚商会	0.3	0.4	1,740	
電通国際情報サービス	0.1	0.1	352	
デジタルガレージ	0.1	0.1	333	
C I J	0.2	0.2	198	
ネットワンシステムズ	0.3	0.3	897	
アルゴグラフィックス	0.1	0.1	231	
エイベックス	0.1	0.2	288	
日本ユニシス	0.2	0.2	723	
兼松エレクトロニクス	0.1	0.1	311	
東京放送ホールディングス	0.3	0.5	946	
日本テレビホールディングス	0.5	0.6	970	
テレビ朝日ホールディングス	0.2	0.2	356	
スカパーJSATホールディングス	0.5	0.7	296	
テレビ東京ホールディングス	0.1	0.1	249	
コネクシオ	0.1	0.1	137	
日本電信電話	3.8	4.4	21,744	
KDDI	4.8	5.7	15,538	
ソフトバンク	—	6.9	9,701	
光通信	0.1	0.1	2,202	
NTTドコモ	3.8	4	9,976	
GMOインターネット	0.2	0.3	525	
カドカワ	0.2	0.2	292	
ゼンリン	0.1	0.2	418	
アイネット	0.1	—	—	
東宝	0.4	0.4	1,918	
エヌ・ティ・ティ・データ	1.7	1.8	2,394	
DT S	0.1	0.1	453	
スクウェア・エニックス・ ホールディングス	0.3	0.3	1,162	
シーイーシー	0.1	0.1	202	
カブコン	0.3	0.3	679	
ジャステック	0.1	0.2	194	
S C S K	0.1	0.2	1,086	

銘柄	前日(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
アイネス	0.1	0.2	225	
T K C	0.1	0.1	452	
富士ソフト	0.1	0.1	478	
N S D	0.1	0.1	312	
コナミホールディングス	0.2	0.3	1,542	
J B Cホールディングス	—	0.1	132	
ミロク情報サービス	0.1	0.1	340	
ソフトバンクグループ	2.4	2.7	27,405	
<b>卸売業(4.9%)</b>				
あらた	—	0.1	385	
東京エレクトロニクス	0.1	0.1	189	
双日	3.4	3.8	1,337	
アルプスホールディングス	0.6	0.7	1,980	
横浜冷凍	0.3	0.4	374	
アルコニックス	0.1	—	—	
神戸物産	—	0.1	513	
あいホールディングス	0.1	0.1	171	
ダイワホールディングス	0.1	0.1	480	
マニカ・富士エスホールディングス	0.1	0.2	276	
バイタルケ-エスケー	—	0.2	210	
ホールディングス	—	0.1	150	
レスターホールディングス	—	0.1	150	
TOKAIホールディングス	0.3	0.4	359	
ショップ&ストアホールディングス	0.1	0.1	465	
コマダホールディングス	0.1	0.2	425	
小野建	0.1	0.1	137	
佐島電機	—	0.2	176	
伯東	0.1	—	—	
ナガイレーベン	0.1	0.1	259	
三菱食品	0.1	0.1	290	
第一興商	0.1	0.1	514	
メディカルホールディングス	0.5	0.7	1,702	
S P K	0.1	0.1	238	
ドウシシャ	0.1	0.1	180	
ハピネット	—	0.1	130	
日本ライフライン	0.2	0.2	353	
I DOM	0.2	—	—	
シークス	0.1	0.1	124	
伊藤忠商事	3.9	4.5	8,714	
丸紅	4.5	6.5	4,585	
長瀬産業	0.3	0.4	665	
豊田通商	0.6	0.7	2,233	
兼松	0.3	0.3	368	
三井物産	4.5	5.2	9,136	
日本紙パルプ商事	—	0.1	383	
日立ハイテクノロジーズ	0.2	0.2	1,144	
カメイ	0.1	—	—	
山善	0.2	0.3	300	
住友商事	3.3	3.8	6,137	
三菱商事	3.7	4.5	13,081	
キャノム・マーケティングジャパン	0.1	0.2	482	
西華産業	0.1	—	—	
佐藤商事	0.2	0.2	194	
菱洋エレクトロ	0.1	0.1	171	
東京産業	0.4	0.4	187	
ユアサ商事	0.1	0.1	302	
阪和興業	0.1	0.1	285	
正栄食品工業	—	0.1	328	
カナデン	0.2	0.2	259	

銘柄	前日(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
菱電商事	0.1	0.1	161	
岩谷産業	0.1	0.2	724	
三菱石油	0.2	0.3	296	
稲畑産業	0.2	0.2	279	
ワキタ	0.2	0.2	211	
東邦ホールディングス	0.2	0.2	504	
サンゲツ	0.2	0.2	434	
シナホールディングス	0.1	0.1	180	
伊藤忠エネクス	0.2	0.3	257	
サンリオ	0.2	0.2	531	
サンワテックノス	0.1	—	—	
リョーサン	0.1	0.1	267	
新光商事	0.1	0.1	188	
トーヨー	0.1	0.1	217	
三信電気	0.1	0.1	188	
モスフードサービス	0.1	0.1	241	
加賀電子	0.1	0.1	163	
ソーダニッカ	0.3	0.4	216	
立花エレクトック	—	0.1	165	
P A L T A C	0.1	0.1	585	
日鉄物産	—	0.1	432	
トラス中山	0.1	0.2	485	
オートバックスセブン	0.2	0.3	518	
加藤産業	0.1	0.1	351	
イエローハット	0.1	0.2	290	
杉本商事	0.1	0.1	207	
形播電機産業	0.1	0.1	442	
ミスミグループ本社	0.6	0.8	2,152	
スズケン	0.2	0.3	2,082	
<b>小売業(4.5%)</b>				
ローソン	0.1	0.2	1,020	
サンエー	0.1	0.1	437	
カワチ薬品	0.1	0.1	194	
エーピーシー・マート	0.1	0.1	690	
アスフル	0.1	0.1	273	
ゲオホールディングス	0.1	0.1	137	
アダストリア	0.1	0.1	241	
エディオン	0.2	0.3	291	
サーラコーポレーション	—	0.3	174	
アルペン	0.1	0.1	164	
クオールホールディングス	0.1	0.1	152	
ビックカメラ	0.3	0.4	452	
DCMホールディングス	0.3	0.4	438	
Monotaro	0.2	0.4	957	
アークランドサービス	0.1	0.1	190	
ホールディングス	—	0.7	916	
J. フロント リテイリング	0.7	0.8	916	
トール・プレスホールディングス	0.1	0.1	211	
マツモトキヨシホールディングス	0.2	0.3	988	
Z O Z O	0.5	0.7	1,278	
ココカラファイン	0.1	0.1	560	
三越伊勢丹ホールディングス	1	1.2	1,076	
ウエルシアホールディングス	0.1	0.2	833	
グリエイトSDホールディングス	0.1	0.1	243	
ネクステージ	—	0.1	122	
ジョイフル本田	0.1	0.2	250	
すかいらーくホールディングス	0.4	0.6	1,203	
コイテック・スーパーマーケット	—	0.2	191	
ホールディングス	0.2	0.2	191	

銘柄	前日(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
セブ&アイ・ホールディングス	2.2	2.7	千円	9,957
グリイト・レストランツ・ホールディングス	0.2	0.2		290
ツルハホールディングス	0.1	0.1		887
サンマルクホールディングス	0.1	0.1		238
トリドールホールディングス	0.1	0.1		203
クスのアオキホールディングス	—	0.1		719
スノーグローバルホールディングス	0.1	0.1		754
LIXILビバ	0.1	—		—
総合メディアカル	0.1	—		—
ノジマ	0.1	0.1		180
カッパ・クリエイト	0.1	0.1		140
良品計画	0.1	0.1		1,900
アドヴァン	—	0.1		108
コーナン商事	0.1	0.1		229
ワタミ	—	0.1		148
バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	0.4	0.4		2,704
西松屋チェーン	0.2	0.2		175
ゼンショーホールディングス	0.3	0.3		674
幸楽苑ホールディングス	0.1	0.1		284
サイゼリヤ	0.1	0.1		246
VTホールディングス	—	0.4		184
ユナイテッドアローズ	0.1	0.1		352
ハイデイ日高	0.1	0.1		200
コロワイド	0.2	0.2		427
壺番屋	0.1	0.1		457
スギホールディングス	0.1	0.1		499
ヨドシヤホールディングス	0.1	0.1		252
ユニー・ファミリーマートホールディングス	0.2	0.7		1,771
木曾路	0.1	0.1		257
SRSホールディングス	0.2	0.2		202
千趣会	—	0.6		160
ケーヨー	0.3	0.3		148
上新電機	0.1	0.1		223
日本瓦斯	0.1	0.1		266
ロイヤルホールディングス	0.1	0.1		277
いなげや	0.1	0.1		140
島忠	0.1	0.2		500
チヨダ	0.1	0.1		167
リンガーハット	0.1	0.1		231
テンアライド	0.4	0.4		166
AOKIホールディングス	0.1	0.2		208
コメリ	0.1	0.1		221
青山商事	0.1	0.1		212
しまむら	0.1	0.1		818
高島屋	1	0.5		568
松屋	0.1	0.2		176
エイチ・ツー・オー リテイリング	0.3	0.4		490
丸井グループ	0.5	0.6		1,370
イオン	2.1	2.5		4,738
イズミ	0.1	0.1		454
平和堂	0.1	0.1		194
フジ	0.1	0.1		179
ヤオコー	0.1	0.1		489
ゼビオホールディングス	0.1	0.1		124
ケーズホールディングス	0.5	0.7		718
総合メディアカルホールディングス	—	0.1		173

銘柄	前日(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
インホールディングス	0.1	0.1		680
ヤマダ電機	1.9	2		1,022
アークランドサカモト	0.1	0.1		139
ニトリホールディングス	0.2	0.3		3,927
吉野家ホールディングス	0.2	0.3		561
サガミホールディングス	0.1	0.2		268
プレナス	0.1	0.1		187
ミニストップ	0.1	0.1		162
アークス	0.1	0.1		221
パローホールディングス	0.1	0.2		447
大庄	0.1	0.1		158
ファーストリテイリング	0.1	0.1		6,442
サンドラッグ	0.2	0.2		557
ペルーナ	0.2	0.2		149
<b>銀行業(5.9%)</b>				
めがねフィナンシャルグループ	2.8	3.4		938
親善さほしフィナンシャルグループ	0.1	0.1		166
九州フィナンシャルグループ	0.9	1.1		485
ゆうちょ銀行	1.4	1.7		1,854
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3.3	4.1		1,664
西日本フィナンシャルホールディングス	0.4	0.4		330
関西みらいフィナンシャルグループ	0.2	0.3		219
親善フィナンシャルグループ	—	0.1		292
新生銀行	0.5	0.5		845
あおぞら銀行	0.3	0.4		1,048
三菱UFJフィナンシャル・グループ	37.7	44.6		22,688
りそなホールディングス	6	7.2		3,260
三井住友トラスト・ホールディングス	1.1	1.3		5,213
三井住友フィナンシャルグループ	4	4.5		17,023
第四銀行	0.1	—		—
北越銀行	0.1	—		—
千葉銀行	2	2.4		1,262
群馬銀行	1.2	1.5		589
武蔵野銀行	0.1	0.1		210
千葉興業銀行	0.3	—		—
七十七銀行	0.2	0.2		336
青森銀行	0.1	0.1		288
山形銀行	0.1	0.1		168
東邦銀行	0.6	0.7		177
みちのく銀行	0.1	0.1		169
ふくおかフィナンシャルグループ	2	0.6		1,161
静岡銀行	1.3	1.7		1,404
十六銀行	0.1	0.1		230
スルガ銀行	0.6	0.9		377
八十二銀行	1.1	1.6		748
山梨中央銀行	—	0.1		128
大垣共立銀行	0.1	0.1		252
福井銀行	0.1	0.1		157
北國銀行	0.1	0.1		312
滋賀銀行	1	0.2		530
南都銀行	0.1	0.1		237
百五銀行	0.8	0.8		273
京都銀行	0.2	0.2		865
紀陽銀行	0.2	0.3		463
ほくほくフィナンシャルグループ	0.4	0.5		597
広島銀行	0.9	1.1		614
山陰合同銀行	0.4	0.5		363

銘柄	前日(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
中国銀行	0.4	0.6		643
伊予銀行	0.8	1		573
百十四銀行	1	0.1		234
四国銀行	0.1	—		—
阿波銀行	—	0.1		274
佐賀銀行	0.1	0.1		162
住友銀行	0.1	0.1		356
琉球銀行	0.1	0.2		232
セブン銀行	2.1	2.3		653
みずほフィナンシャルグループ	73.1	88.5		13,522
山口フィナンシャルグループ	1	0.9		712
名古屋銀行	—	0.1		359
北洋銀行	1	1.1		288
愛媛銀行	0.1	0.2		225
京葉銀行	1	0.5		329
栃木銀行	0.5	—		—
東和銀行	0.1	0.2		145
トモニホールディングス	0.5	0.6		219
フィデアホールディングス	0.8	—		—
池田泉州ホールディングス	0.7	0.8		174
<b>証券・商品先物取引業(0.8%)</b>				
F P G	0.2	0.2		174
SBIホールディングス	0.6	0.8		2,001
ジャフコ	0.1	0.1		389
大和証券グループ本社	5	5.3		2,544
野村ホールディングス	9.3	11.7		4,125
岡三証券グループ	1	0.8		325
丸三証券	0.2	0.3		174
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	0.7	1		355
いちよし証券	0.2	0.2		153
松井証券	0.3	0.4		414
マネックスグループ	0.7	0.7		228
カブドットコム証券	0.5	0.6		334
極東証券	0.1	—		—
<b>保険業(2.3%)</b>				
かんぽ生命保険	0.2	0.3		617
SOMPOホールディングス	1.1	1.2		5,215
アニコムホールディングス	—	0.1		374
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1.4	1.7		6,043
ソニーフィナンシャルホールディングス	0.5	0.5		1,276
第一生命ホールディングス	3.1	3.7		6,019
東京海上ホールディングス	2	2.3		12,728
T&Dホールディングス	1.7	2.1		2,342
<b>その他金融業(1.1%)</b>				
全国保証	0.2	0.2		842
クレディセゾン	0.4	0.5		608
芙蓉総合リース	0.1	0.1		550
興銀リース	0.1	0.1		266
東京センチュリー	0.1	0.1		470
日本証券金融	0.3	0.4		222
アイフル	1	1.1		235
リコーリース	0.1	0.1		342
イオンフィナンシャルサービス	0.4	0.4		700
アコム	1.1	1.4		537
ジャックス	0.1	0.1		193
オリエントコーポレーション	1.2	1.8		203

銘柄	前自(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
日立キャピタル	0.2	0.2	483	
オリックス	3.6	4.3	6,720	
三菱UFJリース	1.4	1.5	826	
日本取引所グループ	1.6	1.8	3,110	
<b>不動産業(2.5%)</b>				
いちご	0.8	0.9	297	
日本駐車場開発	0.8	0.9	155	
ヒューリック	1.2	1.4	1,205	
野村不動産ホールディングス	0.4	0.5	1,170	
サムティ	—	0.1	149	
フレックスコーポレーション	0.1	0.2	321	
ユニゾホールディングス	0.1	0.1	189	
オープンハウス	0.1	0.1	476	
東急不動産ホールディングス	1.4	1.9	1,176	
鉅田グループホールディングス	0.5	0.6	1,063	
パーク24	0.3	0.4	924	
三井不動産	2.6	3.4	9,334	
三菱地所	3.9	4.5	9,252	
平和不動産	0.2	0.2	458	
東京建物	0.7	0.8	935	
ダイビル	0.2	0.3	297	
京阪神ビルディング	0.3	0.3	311	
住友不動産	1	1.5	6,226	
大京	0.1	—	—	
テーオーシー	0.2	0.3	191	
レオパレス21	0.7	—	—	
スターツコーポレーション	0.1	0.1	260	
フジ住宅	0.2	0.2	154	
空港施設	—	0.3	156	
ゴールドクレスト	0.1	—	—	
タカラレーベン	0.4	0.4	149	
イオンモール	0.4	0.4	655	
カチタス	0.1	0.1	423	
エヌ・ティ・ティ都市開発	0.4	—	—	
日本空港ビルデング	0.2	0.2	870	
<b>サービス業(5.3%)</b>				
日本工営	0.1	0.1	245	
LIFULL	0.2	0.3	176	
ジェイシーリゾートメント	—	0.1	252	
日本M&Aセンター	0.4	0.5	1,330	
コジカホールディングス	—	0.2	285	
パナグループ	—	0.1	177	

銘柄	前自(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
リングアドモチベーション	0.1	—	—	
エス・エム・エス	0.1	0.2	516	
パーソルホールディングス	0.5	0.7	1,689	
総合警備保障	0.2	0.3	1,557	
カカココム	0.4	0.5	1,075	
ルネサンス	0.1	0.1	182	
ディップ	0.1	0.1	173	
ツクイ	0.2	—	—	
ベネフィット・ワン	—	0.2	407	
エムスリー	0.6	1.3	2,735	
アウトソーシング	0.2	0.4	469	
ディー・エヌ・エー	0.3	0.4	866	
博覧堂DYホールディングス	0.7	0.9	1,604	
ぐるなび	0.1	—	—	
インフォマート	0.3	0.4	655	
EP5ホールディングス	0.1	0.1	181	
プラスステージ・インターナショナル	0.2	0.2	325	
アミューズ	0.1	0.1	250	
ケネディクス	0.7	0.6	327	
電通	0.6	0.8	2,960	
みらかホールディングス	0.2	0.2	534	
アルプス技研	0.1	0.1	183	
日本空調サービス	0.2	0.3	204	
オリエンタルランド	0.6	0.7	9,537	
ダスキン	0.2	0.2	596	
明光ネットワークジャパン	0.1	0.2	189	
ラウンドワン	0.2	0.2	318	
リゾートトラスト	0.3	0.3	518	
ピー・エム・エル	0.1	0.1	320	
りらいほコミュニケーションズ	0.1	0.2	252	
リソー教育	—	0.4	185	
ユー・エス・エス	0.6	0.8	1,702	
サイバーエージェント	0.3	0.4	1,580	
楽天	2.7	3	3,585	
フルキャストホールディングス	—	0.1	208	
エン・ジャパン	—	0.1	398	
テクノロ・ホールディングス	0.1	0.1	578	
ジャパンマテリアル	0.2	0.2	282	
ベクトル	0.1	—	—	
リクルートホールディングス	4	4.5	15,655	
日本郵政	2.9	5.1	6,155	
ベルスタム24ホールディングス	0.1	0.1	156	

銘柄	前自(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
ソラスト	—	0.2	188	
リログループ	0.3	0.4	1,184	
東祥	—	0.1	279	
エイチ・アイ・エス	0.1	0.1	284	
共立メンテナンス	0.1	0.1	518	
イネンホールディングス	0.1	0.2	223	
建設技術研究所	0.1	0.1	150	
スペース	0.1	—	—	
東京都競馬	0.1	0.1	341	
常盤興産	0.1	0.1	167	
カナモト	0.1	0.1	274	
東京ドーム	0.3	0.3	326	
西尾レントオール	0.1	0.1	297	
トランス・コスモス	0.1	0.1	239	
乃村工藝社	0.1	0.4	559	
藤田観光	—	0.1	274	
日本管財	0.1	0.1	187	
トーカイ	0.1	0.1	233	
セコム	0.5	0.7	6,464	
セントラル警備保障	0.1	0.1	548	
丹青社	0.2	0.2	228	
メイテック	0.1	0.1	549	
応用地質	0.1	0.2	217	
船井総研ホールディングス	0.1	0.2	535	
パネッセルホールディングス	0.2	0.3	774	
イオンディライト	0.1	0.1	321	
ニチイ学館	0.2	0.2	305	
ダイセキ	0.1	0.1	277	
ステップ	0.1	0.1	149	
合計	株数・金額	657	766	1,477,804
	銘柄数<比率>	1,019	1,056	<94.2%>

(注1) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て、株数の単位未満は小数で記載。

(注4) -印は組入れなし。

## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
国内	株式先物取引	百万円 77	百万円 —

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) -印は組入れなし。



## 投資信託財産の構成

2019年6月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 1,477,804	% 92.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	120,260	7.5
投 資 信 託 財 産 総 額	1,598,064	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

## 資産、負債、元本及び基準価額の状況

2019年6月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,597,644,482円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	103,336,605
株 式 ( 評 価 額 )	1,477,804,940
未 収 入 金	437,084
未 収 配 当 金	11,885,853
差 入 委 託 証 拠 金	4,180,000
(B) 負 債	28,356,101
未 払 解 約 金	28,355,900
未 払 利 息	201
(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )	1,569,288,381
元 本	936,331,552
次 期 繰 越 損 益 金	632,956,829
(D) 受 益 権 総 口 数	936,331,552口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,760円

- (注1) 当期末における1口当たり純資産額 1.6760円  
(注2) 期首元本額 788,566,978円  
期中追加設定元本額 257,891,933円  
期中一部解約元本額 110,127,359円  
(注3) 元本の内訳  
MHAMトピックスファンド 936,331,552円

## 損益の状況

(2018年6月12日から2019年6月10日まで)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	33,737,495円
受 取 配 当 金	33,761,596
受 取 利 息	341
そ の 他 収 益 金	38,475
支 払 利 息	△62,917
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△193,926,421
売 買 益	41,705,138
売 買 損	△235,631,559
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△6,659,540
取 引 益	7,599,012
取 引 損	△14,258,552
(D) 当 期 損 益 金 ( A + B + C )	△166,848,466
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	696,318,769
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	187,367,067
(G) 解 約 差 損 益 金	△83,880,541
(H) 計 ( D + E + F + G )	632,956,829
次 期 繰 越 損 益 金 ( H )	632,956,829

- (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)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3) (G)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。