

運用報告書 (全体版)

第19期<決算日2020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。 | |
| 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。 |
| 運用方法 | 株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。 運用の効率化を図るため、ならびに追加設定・一部解約等に対応するため、株価指数先物取引等を利用することがあります。 | |
| 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。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。 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、2020年6月10日に第19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/>

MHAMトピックスファンド

■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 | 純資産額 |
|------------------|--------|------------|-----------|----------------|-----------|--------|--------|-------|
| | (分配落) | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | (ベンチマーク) | 期中 騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 19期 (2020年6月10日) | 13,036 | 220 | 6.6 | 1,624.71 | 4.6 | 95.8 | 3.8 | 1,710 |

(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」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、(株)東京証券取引所が有しています。

なお、本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません (以下同じ)。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 東証株価指数 (TOPIX) | | 株式組入比率 | 株式先物比率 |
|------------|--------|------|----------------|------|--------|--------|
| | | 騰落率 | (ベンチマーク) | 騰落率 | | |
| (期首) | 円 | % | ポイント | % | % | % |
| 2019年6月10日 | 12,438 | — | 1,552.94 | — | 94.1 | 5.0 |
| 6月末 | 12,436 | △0.0 | 1,551.14 | △0.1 | 94.8 | 4.9 |
| 7月末 | 12,541 | 0.8 | 1,565.14 | 0.8 | 97.0 | 2.0 |
| 8月末 | 12,112 | △2.6 | 1,511.86 | △2.6 | 96.0 | 3.0 |
| 9月末 | 12,833 | 3.2 | 1,587.80 | 2.2 | 97.8 | 2.0 |
| 10月末 | 13,468 | 8.3 | 1,667.01 | 7.3 | 96.9 | 3.0 |
| 11月末 | 13,716 | 10.3 | 1,699.36 | 9.4 | 97.9 | 1.0 |
| 12月末 | 13,903 | 11.8 | 1,721.36 | 10.8 | 97.7 | 2.1 |
| 2020年1月末 | 13,594 | 9.3 | 1,684.44 | 8.5 | 96.7 | 3.1 |
| 2月末 | 12,203 | △1.9 | 1,510.87 | △2.7 | 95.9 | 4.0 |
| 3月末 | 11,480 | △7.7 | 1,403.04 | △9.7 | 95.5 | 3.9 |
| 4月末 | 11,963 | △3.8 | 1,464.03 | △5.7 | 97.7 | 1.9 |
| 5月末 | 12,765 | 2.6 | 1,563.67 | 0.7 | 95.9 | 3.8 |
| (期末) | | | | | | |
| 2020年6月10日 | 13,256 | 6.6 | 1,624.71 | 4.6 | 95.8 | 3.8 |

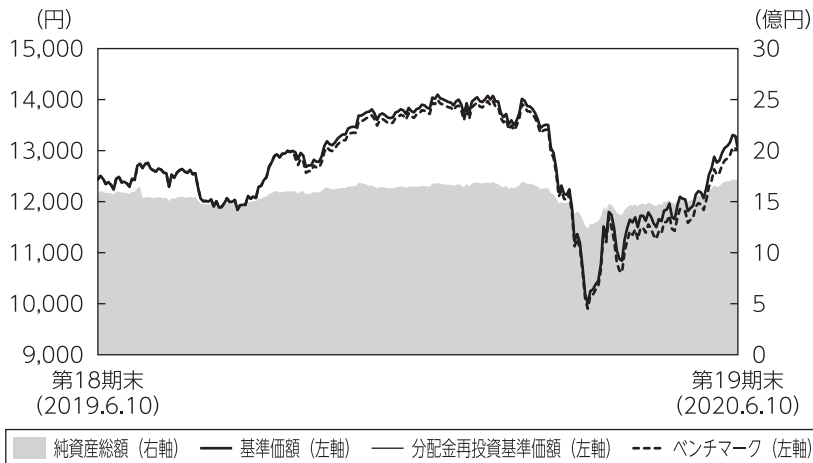
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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」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 (2019年6月11日から2020年6月10日まで)

基準価額等の推移



第19期首 : 12,438円
第19期末 : 13,036円
(既払分配金220円)
騰落率 : 6.6%
(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およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2020年2月半ば以降、新型コロナウイルスが世界的な拡散をみせたことで、世界景気や企業業績への先行き不安が急速に高まり、基準価額は一時的に急落しました。ただ、期末にかけては、感染スピードの鈍化が確認されたことや各国政府の金融政策などを要因として反発しました。

投資環境

期初は、ほぼ横ばいの推移となりましたが、2019年8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され下落しました。しかし、9月から2020年1月前半までは、欧米中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどを好感し、反発しました。その後、2月半ばから3月前半にかけて新型コロナウイルス感染拡大が嫌気され急落しました。ただ、期末にかけては、感染鈍化や各国政府の金融政策等を要因として値を戻しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

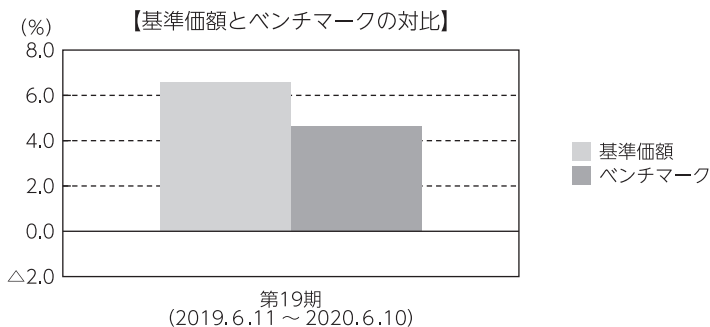
当ファンドの主要投資対象はMHAMトピックスマザーファンドであり、マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●MHAMトピックスマザーファンド

ベンチマークであるTOPIXのリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるTOPIXは前期末比で4.6%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.0%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 |
|------------|---------------------------|
| | 2019年6月11日 ～2020年6月10日 |
| 当期分配金（税引前） | 220円 |
| 対基準価額比率 | 1.66% |
| 当期の収益 | 220円 |
| 当期の収益以外 | -円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 8,355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

当ファンドの運用方針については、引き続きMHAMトピックスマザーファンドを組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。今後もマザーファンド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

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第19期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------------------------|---------|--|
| | (2019年6月11日 ～2020年6月10日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 83円 | 0.655% | (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12,725円です。 |
| (投信会社) | (25) | (0.197) | 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) | (49) | (0.382) | 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) | (0.076) | 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 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) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.002) | |
| (c) その他費用 | 0 | 0.002 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (監査費用) | (0) | (0.002) | 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 |
| 合計 | 84 | 0.661 | |

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

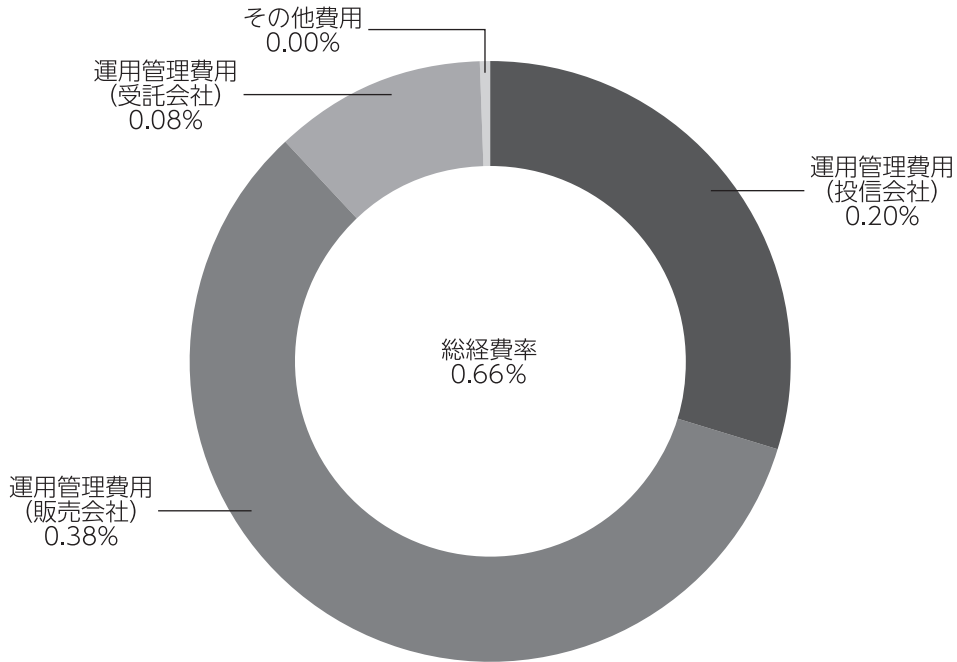
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.66%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2019年6月11日から2020年6月10日まで）

| | 設 定 | | 解 約 | |
|------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| MHAMトピックスマザーファンド | 千□ 201,665 | 千円 338,323 | 千□ 186,848 | 千円 326,033 |

■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 | MHAMトピックスマザーファンド |
|-------------------------------|------------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 434,596千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 1,520,580千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b) | 0.28 |

(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（2019年6月11日から2020年6月10日まで）

【MHAMトピックス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

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) | 67千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 35千円 |
| (B) / (A) | 52.2% |

(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。

【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) 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 | $\frac{B}{A}$ % | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ % |
| 株 式 | 百万円 253 | 百万円 153 | 60.6 | 百万円 181 | 百万円 14 | 7.9 |
| 株 式 先 物 取 引 | 667 | 170 | 25.6 | 680 | 234 | 34.5 |

平均保有割合 100.0%

(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。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期 | | |
|-----|----------|----------|-----------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当期末保有額 |
| 株 式 | 百万円 3 | 百万円 2 | 百万円 14 |

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 |
| MHAMトピックスマザーファンド | 千口 936,331 | 千口 951,148 | 千円 1,710,070 |

■投資信託財産の構成

2020年6月10日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| M H A M ト ピ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド | 千円 1,710,070 | % 97.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 36,900 | 2.1 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,746,971 | 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

(2020年6月10日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--|----------------|
| (A) 資 産 | 1,746,971,387円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 34,838,624 |
| M H A M ト ピ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額) | 1,710,070,763 |
| 未 収 入 金 | 2,062,000 |
| (B) 負 債 | 36,616,808 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 28,865,577 |
| 未 払 解 約 金 | 2,588,357 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 5,150,494 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 12,380 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 1,710,354,579 |
| 元 本 | 1,312,071,726 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 398,282,853 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,312,071,726口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 13,036円 |

(注) 期首における元本額は1,261,976,668円、当期中における追加設定元本額は439,743,322円、同解約元本額は389,648,264円です。

■損益の状況

当期 自2019年6月11日 至2020年6月10日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △1,874円 |
| 受 取 利 息 | 202 |
| 支 払 利 息 | △2,076 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 114,301,783 |
| 売 買 損 益 | 139,760,198 |
| 売 買 損 益 | △25,458,415 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △10,326,415 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 103,973,494 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 57,132,044 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 266,042,892 |
| (配 当 等 相 当 額) | (895,742,659) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△629,699,767) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | 427,148,430 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △28,865,577 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G + H) | 398,282,853 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 266,042,892 |
| (配 当 等 相 当 額) | (897,096,795) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△631,053,903) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 199,227,728 |
| 繰 越 損 益 金 | △66,987,767 |

(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

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------------|---------------|
| (a) 経 費 控 除 後 の 配 当 等 収 益 | 35,106,944円 |
| (b) 経 費 控 除 後 の 有 価 証 券 売 買 等 損 益 | 0 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 897,096,795 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 192,986,361 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額 (a + b + c + d) | 1,125,190,100 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 8,575.68 |
| (g) 分 配 金 | 28,865,577 |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 220 |

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金 220円

※分配金を再投資する場合、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。

MHAMトピックスマザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2020年6月10日）

（計算期間 2019年6月11日～2020年6月10日）

MHAMトピックスマザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 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。 |
| 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主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には、制限を設けません。 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 | 純資産額 |
|------------------|--------|--------|---------------|--------|--------|--------|-----------|
| | 円 | 騰落率 | (ベンチマーク) ポイント | 騰落率 | | | |
| 15期 (2016年6月10日) | 13,444 | △16.7% | 1,330.72 | △18.3% | 95.7% | 4.5% | 1,181 百万円 |
| 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 |
| 19期 (2020年6月10日) | 17,979 | 7.3% | 1,624.71 | 4.6% | 95.9% | 3.8% | 1,710 |

(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）。

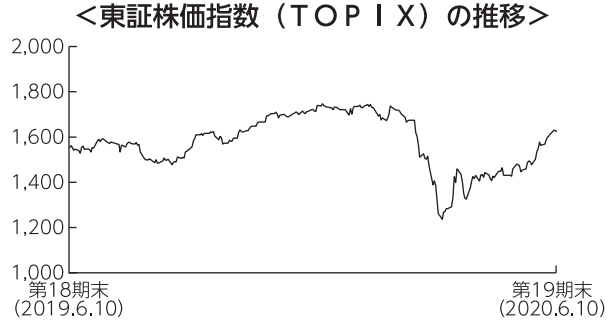
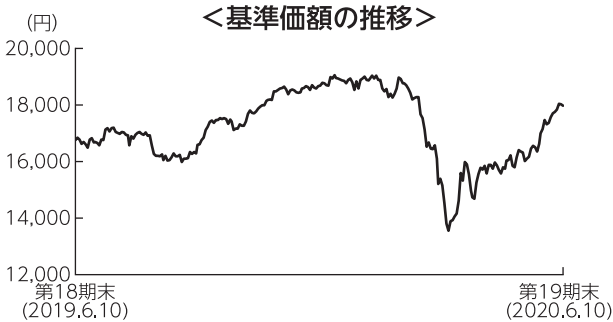
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東証株価指数(TOPIX) | | 株 式 組 入 比 率 | 株 式 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|------------------|-------|----------------|----------------|
| | 円 | 騰 落 率 | (ベンチマーク) ポイント | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2019年6月10日 | 16,760 | — | 1,552.94 | — | 94.2 | 5.0 |
| 6 月末 | 16,763 | 0.0 | 1,551.14 | △0.1 | 94.8 | 4.9 |
| 7 月末 | 16,914 | 0.9 | 1,565.14 | 0.8 | 97.0 | 2.0 |
| 8 月末 | 16,344 | △2.5 | 1,511.86 | △2.6 | 96.0 | 3.0 |
| 9 月末 | 17,327 | 3.4 | 1,587.80 | 2.2 | 97.9 | 2.0 |
| 10月末 | 18,194 | 8.6 | 1,667.01 | 7.3 | 96.9 | 3.0 |
| 11月末 | 18,540 | 10.6 | 1,699.36 | 9.4 | 97.9 | 1.0 |
| 12月末 | 18,803 | 12.2 | 1,721.36 | 10.8 | 97.8 | 2.1 |
| 2020年1 月末 | 18,395 | 9.8 | 1,684.44 | 8.5 | 96.8 | 3.1 |
| 2 月末 | 16,521 | △1.4 | 1,510.87 | △2.7 | 95.9 | 4.0 |
| 3 月末 | 15,551 | △7.2 | 1,403.04 | △9.7 | 95.5 | 3.9 |
| 4 月末 | 16,215 | △3.3 | 1,464.03 | △5.7 | 97.7 | 1.9 |
| 5 月末 | 17,311 | 3.3 | 1,563.67 | 0.7 | 96.0 | 3.8 |
| (期 末) 2020年6月10日 | 17,979 | 7.3 | 1,624.71 | 4.6 | 95.9 | 3.8 |

(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 (2019年6月11日から2020年6月10日まで)



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は17,979円となり、前期末比で7.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

2020年2月半ば以降、新型コロナウイルスが世界的な拡散をみせたことで、世界景気や企業業績への先行き不安が急速に高まり、基準価額は一時的に急落しました。ただ、期末にかけては、感染スピードの鈍化が確認されたことや各国政府の金融政策などを要因として反発しました。

投資環境

●国内株式市況

期初は、ほぼ横ばいの推移となりましたが、2019年8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され下落しました。しかし、9月から2020年1月前半までは、欧米中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどを好感し、反発しました。その後、2月半ばから3月前半にかけて新型コロナウイルス感染拡大が嫌気され急落しました。ただ、期末にかけては、感染鈍化や各国政府の金融政策等を要因として値を戻しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるＴＯＰＩＸのリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

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4.6%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.7%上回りました。この差異は、主に保有株式の配当金によるものです。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 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) | 1円 (0) (0) | 0.004% (0.002) (0.002) | (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 | 1 | 0.004 | |
| 期中の平均基準価額は17,204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 (2019年6月11日から2020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 165.4 (12.37) | 千円 253,431 (-) | 千株 103.66 | 千円 181,164 |

(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 667 | 百万円 680 | 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 | 434,596千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 1,520,580千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b) | 0.28 |

(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 (2019年6月11日から2020年6月10日まで)

(1) 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 | $\frac{B}{A}$ % | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ % |
| 株 式 | 百万円 253 | 百万円 153 | 60.6 | 百万円 181 | 百万円 14 | 7.9 |
| 株 式 先 物 取 引 | 667 | 170 | 25.6 | 680 | 234 | 34.5 |

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期 | | |
|-----|----------|----------|-----------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当期末保有額 |
| 株 式 | 百万円 3 | 百万円 2 | 百万円 14 |

(3) 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) | 67千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 35千円 |
| (B)／(A) | 52.2% |

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 | | 銘柄 | 期首 (前期末) | 当 期 末 | | 銘柄 | 期首 (前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|-------------|-------|-------|-------------------|-------------|-------|-------|---------------------|-------------|-------|-------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | | | きんでん | 0.5 | 0.6 | 1,089 | コカ・コーラ ホールディングス | 0.5 | 0.5 | 1,137 |
| 日本水産 | 1 | 1.1 | 573 | 住友電設 | 0.1 | 0.1 | 239 | サントリー食品インターナショナル | 0.4 | 0.5 | 2,212 |
| マルハニチロ | 0.1 | 0.2 | 468 | 日本電設工業 | 0.1 | 0.1 | 248 | ダイドールホールディングス | 0.1 | 0.1 | 476 |
| サカタのタネ | 0.1 | 0.1 | 351 | 協和エクシオ | 0.3 | 0.3 | 759 | 伊藤園 | 0.2 | 0.2 | 1,218 |
| ホクト | 0.1 | 0.1 | 197 | 新日本空調 | 0.1 | 0.1 | 254 | キーコーヒー | 0.1 | 0.1 | 229 |
| 鉱業 (0.2%) | | | | 九電工 | 0.2 | 0.2 | 616 | 日清オイリオグループ | 0.1 | 0.1 | 337 |
| 国際石油開発帝石 | 3.8 | 4.2 | 3,275 | 三機工業 | 0.2 | 0.2 | 262 | 不二製油グループ本社 | 0.2 | 0.2 | 580 |
| 石油資源開発 | 0.2 | 0.2 | 424 | 日揮ホールディングス | 0.7 | 0.7 | 866 | キッコーマン | 0.4 | 0.5 | 2,715 |
| 建設業 (2.7%) | | | | 太平電業 | 0.1 | 0.1 | 239 | 味の素 | 1.5 | 1.6 | 2,933 |
| ショーボンドホールディングス | 0.1 | 0.2 | 998 | 高砂熱学工業 | 0.2 | 0.2 | 363 | キューピー | 0.4 | 0.4 | 862 |
| ミライト・ホールディングス | 0.3 | 0.3 | 457 | 明星工業 | 0.2 | 0.2 | 157 | ハウス食品グループ本社 | 0.2 | 0.2 | 733 |
| 安藤・間 | 0.6 | 0.6 | 414 | 大気社 | 0.1 | 0.1 | 322 | カゴメ | 0.3 | 0.3 | 909 |
| 東急建設 | 0.3 | 0.4 | 240 | ダイダグ | 0.1 | 0.1 | 290 | アリアケジャパン | 0.1 | 0.1 | 727 |
| コムシスホールディングス | 0.3 | 0.4 | 1,214 | 日比谷総合設備 | 0.1 | 0.1 | 185 | ニチレイ | 0.4 | 0.3 | 910 |
| 髙松コンストラクショングループ | 0.1 | 0.1 | 239 | 東芝プラントシステム | 0.2 | - | - | 東洋水産 | 0.3 | 0.4 | 2,228 |
| 大成建設 | 0.7 | 0.8 | 3,236 | レイズネクスト | 0.2 | 0.2 | 247 | 日清食品ホールディングス | 0.3 | 0.3 | 2,655 |
| 大林組 | 2.3 | 2.3 | 2,444 | 食料品 (3.9%) | | | | フジッコ | 0.1 | 0.1 | 195 |
| 清水建設 | 2.3 | 2.3 | 2,118 | 日本製粉 | 0.2 | 0.2 | 322 | ロック・フィールド | 0.1 | 0.1 | 131 |
| 長谷工コーポレーション | 1 | 0.9 | 1,227 | 日清製粉グループ本社 | 0.7 | 0.8 | 1,403 | 日本たばこ産業 | 3.8 | 4.1 | 9,044 |
| 松井建設 | - | 0.3 | 207 | 昭和産業 | 0.1 | 0.1 | 321 | ケンコーマヨネーズ | 0.1 | 0.1 | 218 |
| 鹿島建設 | 1.8 | 1.8 | 2,332 | 中部飼料 | - | 0.1 | 166 | わらべや日洋ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 175 |
| 鉄建建設 | 0.1 | 0.1 | 219 | 日本甜菜製糖 | 0.1 | 0.1 | 172 | なとり | 0.1 | 0.1 | 174 |
| 西松建設 | 0.2 | 0.2 | 426 | 三井製糖 | 0.1 | 0.1 | 210 | 北の達人コーポレーション | 0.3 | 0.3 | 172 |
| 三井住友建設 | 0.6 | 0.6 | 290 | 森永製菓 | 0.2 | 0.2 | 869 | ユーグレナ | 0.3 | 0.3 | 252 |
| 大豊建設 | 0.1 | 0.1 | 246 | 江崎グリコ | 0.2 | 0.2 | 1,056 | 繊維製品 (0.5%) | | | |
| 前田建設工業 | 0.6 | 0.7 | 612 | 不二家 | 0.1 | 0.1 | 226 | グンゼ | 0.1 | 0.1 | 389 |
| 奥村組 | 0.1 | 0.1 | 262 | 山崎製パン | 0.5 | 0.5 | 934 | 東洋紡 | 0.3 | 0.3 | 462 |
| 東鉄工業 | 0.1 | 0.1 | 280 | 寿スピリッツ | 0.1 | 0.1 | 527 | ユニチカ | 0.5 | 0.6 | 229 |
| 戸田建設 | 1 | 1 | 704 | カルビー | 0.3 | 0.3 | 903 | 倉敷紡績 | 0.1 | 0.1 | 238 |
| 熊谷組 | 0.1 | 0.1 | 272 | 森永乳業 | 0.1 | 0.1 | 447 | 日本毛織 | 0.3 | 0.4 | 420 |
| 大東建託 | 0.3 | 0.3 | 3,495 | 六甲バター | 0.1 | 0.1 | 156 | 帝国繊維 | 0.1 | 0.1 | 230 |
| N I P P O | 0.2 | 0.2 | 523 | ヤクルト本社 | 0.5 | 0.5 | 3,445 | 帝人 | 0.6 | 0.6 | 1,087 |
| 前田道路 | 0.2 | 0.3 | 654 | 明治ホールディングス | 0.5 | 0.5 | 4,130 | 東レ | 5.1 | 5.3 | 2,968 |
| 東亜建設工業 | 0.1 | 0.1 | 160 | 雪印メグミルク | 0.2 | 0.2 | 526 | セーレン | 0.2 | 0.2 | 278 |
| 日本国土開発 | - | 0.3 | 162 | プリマハム | 0.1 | 0.1 | 266 | ワコールホールディングス | 0.2 | 0.2 | 432 |
| 東洋建設 | 0.4 | 0.4 | 167 | 日本ハム | 0.3 | 0.3 | 1,299 | ホギメディカル | 0.1 | 0.1 | 341 |
| 五洋建設 | 1 | 1 | 587 | 丸大食品 | 0.1 | 0.1 | 198 | T S Iホールディングス | 0.3 | - | - |
| 住友林業 | 0.6 | 0.6 | 811 | S Foods | 0.1 | 0.1 | 272 | ワールド | 0.1 | 0.1 | 167 |
| 大和ハウス工業 | 2 | 2.2 | 6,416 | 伊藤ハム米久ホールディングス | 0.5 | 0.5 | 328 | オンワードホールディングス | 0.6 | 0.7 | 273 |
| ライト工業 | 0.2 | 0.2 | 307 | サッポロホールディングス | 0.3 | 0.3 | 667 | ゴールドウイン | 0.1 | 0.1 | 669 |
| 積水ハウス | 2.3 | 2.4 | 5,190 | アサヒグループホールディングス | 1.4 | 1.5 | 6,624 | デサント | 0.2 | 0.2 | 347 |
| ユアテック | 0.2 | 0.2 | 128 | キリンホールディングス | 3 | 3 | 6,945 | パルプ・紙 (0.2%) | | | |
| 中電工 | 0.1 | 0.1 | 231 | 宝ホールディングス | 0.5 | 0.6 | 638 | 王子ホールディングス | 2.9 | 3 | 1,593 |
| 関電工 | 0.4 | 0.4 | 389 | オエノンホールディングス | 0.5 | 0.5 | 204 | 日本製紙 | 0.3 | 0.4 | 654 |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | |
|------------------|-------------|-----|--------|-----|-------------------|-------------|-----|--------|-----|-----------------------|-------------|------|--------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 北越コーポレーション | 0.6 | 0.6 | 249 | | リケンテクノス | 0.3 | 0.3 | 129 | | 武田薬品工業 | 5.7 | 6 | 24,690 | |
| 大王製紙 | 0.3 | 0.3 | 437 | | 積水化成成品工業 | 0.2 | - | - | | アステラス製薬 | 6.1 | 6.2 | 11,404 | |
| レンゴー | 0.8 | 0.7 | 613 | | 森六ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 173 | | 大日本住友製薬 | 0.5 | 0.5 | 808 | |
| 化学 (7.3%) | | | | | 日本化薬 | 0.4 | 0.5 | 566 | | 塩野義製薬 | 0.8 | 0.9 | 5,952 | |
| クラレ | 1.1 | 1 | 1,261 | | 扶桑化学工業 | 0.1 | 0.1 | 392 | | 田辺三菱製薬 | 0.7 | - | - | |
| 旭化成 | 4.6 | 4.7 | 4,420 | | ADEKA | 0.3 | 0.3 | 456 | | あすか製薬 | 0.2 | 0.2 | 259 | |
| 昭和電工 | 0.5 | 0.5 | 1,348 | | 日油 | 0.2 | 0.3 | 1,146 | | 日本新薬 | 0.2 | 0.2 | 1,808 | |
| 住友化学 | 5.2 | 5.2 | 1,851 | | 花王 | 1.6 | 1.7 | 15,242 | | 中外製薬 | 0.7 | 0.7 | 11,067 | |
| 日産化学 | 0.4 | 0.4 | 2,200 | | 日本ペイントホールディングス | 0.5 | 0.6 | 4,728 | | 科研製薬 | 0.1 | 0.1 | 573 | |
| クレハ | 0.1 | 0.1 | 515 | | 関西ペイント | 0.7 | 0.8 | 1,849 | | エーザイ | 0.8 | 0.9 | 8,006 | |
| テイカ | 0.1 | 0.1 | 154 | | 中国塗料 | 0.3 | 0.3 | 245 | | ロート製薬 | 0.3 | 0.4 | 1,310 | |
| 石原産業 | 0.2 | 0.2 | 157 | | 太陽ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 502 | | 小野薬品工業 | 1.6 | 1.7 | 5,145 | |
| 日本曹達 | 0.1 | 0.1 | 302 | | DIC | 0.3 | 0.3 | 863 | | 久光製薬 | 0.2 | 0.2 | 1,116 | |
| 東ソー | 1 | 1.1 | 1,720 | | サカダイクス | 0.2 | 0.2 | 217 | | 持田製薬 | 0.1 | 0.1 | 417 | |
| トクヤマ | 0.2 | 0.2 | 527 | | 東洋インキSCホールディングス | 0.1 | 0.1 | 215 | | 参天製薬 | 1.3 | 1.3 | 2,648 | |
| セントラル硝子 | 0.2 | 0.2 | 418 | | 富士フイルムホールディングス | 1.4 | 1.4 | 7,015 | | ツムラ | 0.2 | 0.2 | 586 | |
| 東亜合成 | 0.4 | 0.5 | 544 | | 資生堂 | 1.3 | 1.4 | 10,112 | | 日医工 | 0.2 | 0.2 | 267 | |
| 大阪ソーダ | 0.1 | 0.1 | 256 | | ライオン | 0.9 | 0.9 | 2,197 | | キッセイ薬品工業 | 0.1 | 0.1 | 276 | |
| 関東電化工業 | 0.2 | 0.2 | 184 | | マンダム | 0.2 | 0.2 | 427 | | 生化学工業 | 0.2 | 0.2 | 234 | |
| デンカ | 0.3 | 0.3 | 841 | | ミルボン | 0.1 | 0.1 | 527 | | 栄研化学 | 0.1 | 0.1 | 184 | |
| 信越化学工業 | 1.1 | 1.2 | 15,324 | | ファンケル | 0.3 | 0.3 | 915 | | 日水製薬 | 0.2 | 0.2 | 248 | |
| 堺化学工業 | 0.1 | 0.1 | 207 | | コーセー | 0.1 | 0.1 | 1,487 | | 鳥居薬品 | 0.1 | 0.1 | 326 | |
| エア・ウォーター | 0.5 | 0.6 | 957 | | ポーラ・オルビスホールディングス | 0.3 | 0.3 | 668 | | JCRファーマ | 0.1 | 0.1 | 1,206 | |
| 大陽日酸 | 0.5 | 0.7 | 1,385 | | ノビアホールディングス | 0.1 | 0.1 | 470 | | 東和薬品 | 0.1 | 0.1 | 221 | |
| 日本パーカライジング | 0.4 | 0.4 | 475 | | エステー | 0.1 | 0.1 | 165 | | 沢井製薬 | 0.1 | 0.1 | 597 | |
| 四国化成工業 | 0.2 | 0.2 | 228 | | コニシ | 0.1 | 0.1 | 155 | | ゼリア新薬工業 | 0.1 | 0.2 | 407 | |
| 日本触媒 | 0.1 | 0.1 | 606 | | 長谷川香料 | 0.1 | 0.1 | 230 | | 第一三共 | 1.9 | 2.1 | 18,832 | |
| 大日精化工業 | 0.1 | 0.1 | 254 | | 小林製薬 | 0.2 | 0.2 | 1,940 | | キョーリン製薬ホールディングス | 0.2 | 0.2 | 432 | |
| カネカ | 0.2 | 0.2 | 598 | | タカラバイオ | 0.2 | 0.2 | 677 | | 大幸薬品 | - | 0.1 | 223 | |
| 三菱瓦斯化学 | 0.7 | 0.7 | 1,174 | | JCU | 0.1 | 0.1 | 318 | | 大塚ホールディングス | 1.3 | 1.4 | 6,956 | |
| 三井化学 | 0.6 | 0.6 | 1,485 | | デクセラアルズ | 0.2 | 0.2 | 176 | | 大正製薬ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 685 | |
| JSR | 0.7 | 0.7 | 1,412 | | アース製薬 | 0.1 | 0.1 | 739 | | ペプチドリーム | 0.3 | 0.4 | 1,990 | |
| 東京応化工業 | 0.1 | 0.1 | 502 | | 北興化学工業 | 0.4 | 0.4 | 249 | | 石油・石炭製品 (0.4%) | | | | |
| 大阪有機化学工業 | - | 0.1 | 204 | | 大成ラミック | 0.1 | 0.1 | 277 | | ニチレキ | - | 0.1 | 165 | |
| 三菱ケミカルホールディングス | 4.4 | 4.7 | 3,163 | | クミアイ化学工業 | 0.3 | 0.3 | 270 | | 出光興産 | 0.8 | 0.8 | 1,943 | |
| KHネオケム | 0.1 | 0.1 | 220 | | アキレス | 0.1 | 0.1 | 176 | | JXTGホールディングス | 11.7 | 11.6 | 4,894 | |
| ダイセル | 1 | 1 | 925 | | 有沢製作所 | 0.2 | 0.2 | 166 | | コスモエネルギーホールディングス | 0.2 | 0.2 | 349 | |
| 住友ベークライト | 0.1 | 0.1 | 337 | | 日東電工 | 0.5 | 0.5 | 3,085 | | ゴム製品 (0.7%) | | | | |
| 積水化学工業 | 1.4 | 1.5 | 2,371 | | レック | - | 0.1 | 179 | | 横浜ゴム | 0.4 | 0.4 | 690 | |
| 日本ゼオン | 0.6 | 0.7 | 742 | | 藤森工業 | 0.1 | 0.1 | 371 | | TOYO TIRE | 0.4 | 0.4 | 635 | |
| アイカ工業 | 0.2 | 0.2 | 671 | | エフピコ | 0.1 | 0.1 | 795 | | ブリヂストン | 2 | 2 | 7,406 | |
| 宇部興産 | 0.4 | 0.4 | 802 | | 信越ポリマー | 0.3 | 0.3 | 281 | | 住友ゴム工業 | 0.6 | 0.7 | 833 | |
| 積水樹脂 | 0.1 | 0.1 | 234 | | ニフコ | 0.3 | 0.3 | 756 | | オカモト | - | 0.1 | 398 | |
| タキロンシーアイ | 0.3 | 0.3 | 210 | | バルカー | 0.1 | 0.1 | 204 | | フコク | - | 0.2 | 138 | |
| 旭有機材 | 0.1 | 0.1 | 151 | | ユニ・チャーム | 1.4 | 1.4 | 5,668 | | ニッタ | 0.1 | 0.1 | 239 | |
| 日立化成 | 0.3 | - | - | | 医薬品 (6.8%) | | | | | 住友理工 | 0.2 | 0.2 | 136 | |
| ニチバン | 0.1 | 0.1 | 150 | | 協和キリン | 0.8 | 0.7 | 1,980 | | 三ツ星ベルト | 0.1 | 0.1 | 176 | |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | |
|------------------------|-------------|-----|-----|-------|--------------------|-------------|-----|-----|-------|---------------|-------------|-----|-----|--------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| バンドー化学 | 0.2 | 0.2 | | 131 | フジクラ | 1 | 1.1 | | 374 | レオン自動機 | 0.1 | - | | - |
| ガラス・土石製品 (0.8%) | | | | | 昭和電線ホールディングス | - | 0.1 | | 109 | SMC | 0.2 | 0.2 | | 11,178 |
| 日東紡績 | 0.1 | 0.1 | | 519 | リョービ | 0.1 | 0.1 | | 147 | オイレス工業 | 0.1 | 0.1 | | 146 |
| AGC | 0.6 | 0.7 | | 2,408 | アサヒホールディングス | 0.1 | 0.1 | | 277 | サトーホールディングス | 0.1 | 0.1 | | 256 |
| 日本板硝子 | 0.5 | 0.6 | | 281 | 金属製品 (0.5%) | | | | | 技研製作所 | 0.1 | 0.1 | | 502 |
| 日本山村硝子 | 0.1 | - | | - | トーカロ | 0.3 | 0.3 | | 326 | 小松製作所 | 3 | 3.3 | | 7,609 |
| 日本電気硝子 | 0.3 | 0.3 | | 572 | SUMCO | 0.8 | 0.9 | | 1,514 | 住友重機械工業 | 0.4 | 0.4 | | 1,078 |
| 住友大阪セメント | 0.1 | 0.1 | | 389 | 東洋製鋼ホールディングス | 0.4 | 0.5 | | 677 | 日立建機 | 0.3 | 0.3 | | 916 |
| 太平洋セメント | 0.4 | 0.5 | | 1,310 | 横河ブリッジホールディングス | 0.2 | 0.2 | | 439 | 井関農機 | 0.1 | - | | - |
| 東海カーボン | 0.7 | 0.8 | | 844 | 三和ホールディングス | 0.7 | 0.8 | | 808 | クボタ | 3.5 | 3.8 | | 6,131 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 0.1 | 0.1 | | 370 | 文化シャッター | 0.3 | 0.3 | | 238 | 月島機械 | 0.2 | 0.2 | | 260 |
| TOTO | 0.5 | 0.5 | | 2,265 | 三協立山 | 0.1 | - | | - | 新東工業 | 0.2 | 0.2 | | 162 |
| 日本碍子 | 0.8 | 0.9 | | 1,512 | LIXILグループ | 0.9 | 1 | | 1,638 | 澁谷工業 | 0.1 | 0.1 | | 314 |
| 日本特殊陶業 | 0.6 | 0.6 | | 1,057 | ノーリツ | 0.1 | 0.2 | | 261 | アイチコーポレーション | 0.3 | 0.3 | | 226 |
| フジミンコーポレートッド | 0.1 | 0.1 | | 312 | 長府製作所 | 0.1 | 0.1 | | 232 | 小森コーポレーション | 0.2 | 0.2 | | 146 |
| ニチアス | 0.2 | 0.2 | | 489 | リンナイ | 0.1 | 0.1 | | 935 | 荏原製作所 | 0.3 | 0.3 | | 818 |
| ニチハ | 0.1 | 0.1 | | 243 | 日東精工 | - | 0.3 | | 149 | ダイキン工業 | 0.9 | 0.9 | | 15,084 |
| 鉄鋼 (0.6%) | | | | | 岡部 | 0.2 | 0.2 | | 171 | 栗田工業 | 0.4 | 0.4 | | 1,230 |
| 日本製鉄 | 2.9 | 3.1 | | 3,396 | ジーテクト | 0.1 | - | | - | 椿本チエイン | 0.1 | 0.1 | | 296 |
| 神戸製鋼所 | 1.4 | 1.6 | | 688 | 東プレ | 0.1 | 0.2 | | 276 | アネスト岩田 | 0.2 | 0.2 | | 175 |
| 合同製鐵 | - | 0.1 | | 214 | 高周波熱錬 | 0.2 | 0.2 | | 116 | ダイフク | 0.4 | 0.4 | | 3,544 |
| ジェイエフイーホールディングス | 1.8 | 2 | | 1,788 | パイオラックス | 0.1 | 0.1 | | 173 | タダノ | 0.4 | 0.4 | | 375 |
| 東京製鐵 | 0.4 | 0.4 | | 271 | 日本発条 | 0.7 | 0.8 | | 636 | フジテック | 0.3 | 0.3 | | 542 |
| 共英製鋼 | 0.1 | 0.1 | | 145 | 三益半導体工業 | 0.1 | 0.1 | | 226 | CKD | 0.3 | 0.2 | | 393 |
| 大和工業 | 0.2 | 0.2 | | 459 | 機械 (5.1%) | | | | | 平和 | 0.2 | 0.2 | | 379 |
| 淀川製鋼所 | 0.1 | 0.1 | | 181 | 日本製鋼所 | 0.2 | 0.2 | | 331 | 理想科学工業 | 0.1 | 0.1 | | 149 |
| 丸一鋼管 | 0.2 | 0.2 | | 573 | 三浦工業 | 0.3 | 0.3 | | 1,344 | SANKYO | 0.2 | 0.2 | | 577 |
| 大同特殊鋼 | 0.1 | 0.1 | | 378 | タクマ | 0.3 | 0.3 | | 432 | フクシマガリレイ | - | 0.1 | | 359 |
| 日本冶金工業 | 0.8 | 0.1 | | 181 | ツガミ | 0.2 | 0.2 | | 203 | 竹内製作所 | 0.1 | 0.1 | | 180 |
| 山陽特殊製鋼 | 0.1 | - | | - | オークマ | 0.1 | 0.1 | | 507 | アマノ | 0.2 | 0.2 | | 491 |
| 愛知製鋼 | 0.1 | 0.1 | | 317 | 芝浦機械 | 0.1 | 0.1 | | 241 | JUKI | - | 0.2 | | 132 |
| 日立金属 | 0.7 | 0.8 | | 1,065 | アマダ | 1 | 1 | | 1,012 | マックス | 0.1 | 0.2 | | 335 |
| 大平洋金属 | 0.1 | 0.1 | | 187 | アイダエンジニアリング | 0.3 | 0.3 | | 234 | グローリー | 0.2 | 0.2 | | 528 |
| 非鉄金属 (0.7%) | | | | | FUJI | 0.3 | 0.3 | | 585 | 大和冷機工業 | 0.1 | - | | - |
| 大紀アルミニウム工業所 | 0.2 | - | | - | 牧野フライス製作所 | 0.1 | 0.1 | | 368 | セガサミーホールディングス | 0.7 | 0.7 | | 972 |
| 日本軽金属ホールディングス | 2 | 2.1 | | 411 | オーエスジー | 0.3 | 0.4 | | 698 | T P R | 0.1 | 0.1 | | 158 |
| 三井金属鉱業 | 0.2 | 0.2 | | 480 | 旭ダイヤモンド工業 | 0.3 | 0.3 | | 163 | ツバキ・ナカシマ | 0.1 | 0.3 | | 315 |
| 東邦亜鉛 | 0.1 | 0.1 | | 167 | DMG森精機 | 0.5 | 0.5 | | 719 | ホシザキ | 0.2 | 0.2 | | 1,844 |
| 三菱マテリアル | 0.4 | 0.5 | | 1,243 | ソディック | 0.2 | 0.2 | | 175 | 日本精工 | 1.4 | 1.4 | | 1,257 |
| 住友金属鉱山 | 0.9 | 0.9 | | 2,867 | ディスコ | 0.1 | 0.1 | | 2,673 | NTN | 1.7 | 1.9 | | 480 |
| DOWAホールディングス | 0.2 | 0.2 | | 723 | 日東工器 | 0.1 | 0.1 | | 201 | ジェイテクト | 0.7 | 0.7 | | 674 |
| 古河機械金属 | 0.1 | - | | - | 島精機製作所 | 0.1 | 0.1 | | 164 | 不二越 | 0.1 | 0.1 | | 374 |
| 大坂チタニウムテクノロジーズ | 0.1 | - | | - | オプトラン | 0.1 | 0.1 | | 257 | 日本トムソン | 0.4 | 0.5 | | 200 |
| 東邦チタニウム | 0.2 | 0.2 | | 149 | ヤマシンフィルタ | - | 0.2 | | 213 | THK | 0.4 | 0.4 | | 1,183 |
| UACJ | 0.1 | 0.1 | | 208 | やまびこ | 0.2 | 0.2 | | 202 | 前澤給装工業 | 0.1 | 0.1 | | 199 |
| 古河電気工業 | 0.2 | 0.2 | | 544 | ナプテスコ | 0.4 | 0.4 | | 1,368 | 日本ピラー工業 | 0.2 | 0.1 | | 147 |
| 住友電気工業 | 2.3 | 2.6 | | 3,580 | 三井海洋開発 | 0.1 | 0.1 | | 173 | キッツ | 0.4 | 0.4 | | 294 |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | |
|---------------------|-------------|-----|--------|--------------|-------------|-----|--------|---------------------|-------------|-----|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 |
| マキタ | 0.8 | 0.9 | 3,528 | 富士通ゼネラル | 0.2 | 0.2 | 451 | SCREENホールディングス | 0.1 | 0.1 | 549 |
| 日立造船 | 0.8 | 0.8 | 328 | ソニー | 4.5 | 4.5 | 33,732 | キャノン電子 | 0.1 | 0.1 | 175 |
| 三菱重工業 | 1.1 | 1.2 | 3,565 | TDK | 0.4 | 0.4 | 4,456 | キャノン | 3.5 | 3.8 | 8,920 |
| IHI | 0.5 | 0.5 | 910 | タムラ製作所 | 0.4 | 0.4 | 193 | リコー | 2 | 1.8 | 1,666 |
| スター精密 | 0.2 | 0.2 | 268 | アルプスアルパイン | 0.7 | 0.7 | 1,108 | 象印マホービン | 0.2 | 0.2 | 349 |
| 電気機器 (15.1%) | | | | フォスター電機 | 0.1 | - | - | 東京エレクトロン | 0.4 | 0.5 | 11,940 |
| 日清紡ホールディングス | 0.5 | 0.6 | 533 | ヨコオ | 0.1 | 0.1 | 280 | 輸送用機器 (7.6%) | | | |
| イビデン | 0.4 | 0.5 | 1,484 | ホシデン | 0.3 | 0.3 | 295 | トヨタ紡織 | 0.3 | 0.2 | 307 |
| コニカミノルタ | 1.5 | 1.7 | 770 | ヒロセ電機 | 0.1 | 0.1 | 1,243 | ユニプレス | 0.2 | 0.2 | 215 |
| ブラザー工業 | 0.9 | 0.9 | 1,904 | 日本航空電子工業 | 0.2 | 0.2 | 335 | 豊田自動織機 | 0.5 | 0.5 | 2,960 |
| ミネベアミツミ | 1.3 | 1.4 | 2,961 | マクセルホールディングス | 0.2 | 0.3 | 336 | モリタホールディングス | 0.1 | 0.1 | 175 |
| 日立製作所 | 3 | 3.5 | 12,981 | アイコム | - | 0.1 | 301 | 三櫻工業 | 0.4 | - | - |
| 三菱電機 | 6.6 | 7.2 | 10,681 | 横河電機 | 0.7 | 0.7 | 1,197 | デンソー | 1.4 | 1.6 | 6,779 |
| 富士電機 | 0.4 | 0.4 | 1,222 | アズビル | 0.4 | 0.5 | 1,505 | 東海理化電機製作所 | 0.2 | 0.2 | 335 |
| 安川電機 | 0.8 | 0.8 | 3,116 | 日本光電工業 | 0.3 | 0.3 | 1,033 | 三井E&Sホールディングス | 0.4 | - | - |
| シフォニア テクノロジー | 0.2 | 0.2 | 225 | 共和電業 | 0.5 | 0.5 | 205 | 川崎重工業 | 0.5 | 0.6 | 1,155 |
| 明電舎 | 0.2 | 0.2 | 364 | 堀場製作所 | 0.1 | 0.1 | 589 | 三菱ロジスネクスト | - | 0.1 | 109 |
| デンヨー | 0.1 | 0.1 | 193 | アドバンテスト | 0.5 | 0.5 | 3,035 | 日産自動車 | 7.8 | 8.8 | 4,082 |
| 東芝テック | 0.1 | 0.1 | 399 | エスベック | 0.1 | 0.1 | 182 | いすゞ自動車 | 2.1 | 2.1 | 2,247 |
| マブチモーター | 0.2 | 0.2 | 720 | キーエンス | 0.3 | 0.7 | 31,346 | トヨタ自動車 | 7.4 | 8.1 | 57,461 |
| 日本電産 | 0.8 | 1.7 | 11,900 | シスメックス | 0.5 | 0.5 | 4,162 | 日野自動車 | 0.9 | 1 | 816 |
| ダブル・スコープ | 0.1 | - | - | メガチップス | - | 0.1 | 206 | 三菱自動車工業 | 2.5 | 2.7 | 909 |
| ダイヘン | 0.1 | 0.1 | 360 | コーセル | 0.2 | 0.2 | 189 | 武蔵精密工業 | 0.2 | 0.3 | 347 |
| JVCケンウッド | 0.7 | 0.8 | 152 | イリソ電子工業 | 0.1 | 0.1 | 395 | 日産車体 | 0.2 | 0.2 | 205 |
| 日新電機 | 0.2 | 0.2 | 230 | オプテックスグループ | 0.2 | 0.2 | 282 | 新明和工業 | 0.3 | 0.2 | 220 |
| 大崎電気工業 | 0.3 | 0.3 | 158 | レーザーテック | 0.1 | 0.3 | 2,907 | 極東開発工業 | 0.2 | 0.2 | 280 |
| オムロン | 0.7 | 0.6 | 4,464 | スタンレー電気 | 0.5 | 0.5 | 1,411 | 日信工業 | 0.2 | 0.2 | 442 |
| 日東工業 | 0.1 | 0.1 | 188 | ウシオ電機 | 0.4 | 0.4 | 608 | トピー工業 | 0.1 | 0.1 | 146 |
| I D E C | 0.1 | 0.1 | 175 | 日本セラミック | 0.1 | 0.1 | 240 | タチエス | 0.2 | 0.2 | 197 |
| ジー・エス・17サ コーポレーション | 0.3 | 0.3 | 590 | 図研 | - | 0.1 | 274 | NOK | 0.4 | 0.4 | 588 |
| 日本電気 | 0.9 | 0.9 | 4,536 | 日本電子 | 0.1 | 0.1 | 292 | フタバ産業 | 0.3 | 0.3 | 159 |
| 富士通 | 0.6 | 0.7 | 8,347 | カシオ計算機 | 0.6 | 0.6 | 1,189 | K Y B | 0.1 | 0.1 | 240 |
| 沖電気工業 | 0.3 | 0.3 | 333 | ファナック | 0.6 | 0.7 | 14,308 | 大同メタル工業 | 0.2 | - | - |
| 電気興業 | 0.1 | 0.1 | 276 | 日本シイエムケイ | 0.3 | 0.3 | 135 | プレス工業 | 0.5 | 0.5 | 152 |
| サンケン電気 | 0.1 | 0.1 | 249 | エンプラス | - | 0.1 | 260 | 太平洋工業 | 0.2 | 0.2 | 221 |
| ルネサスエレクトロニクス | 0.8 | 3.6 | 2,329 | ローム | 0.3 | 0.3 | 2,304 | ケーヒン | 0.2 | 0.2 | 510 |
| セイコーエプソン | 0.8 | 0.9 | 1,280 | 浜松ホトニクス | 0.5 | 0.5 | 2,412 | アイシン精機 | 0.5 | 0.6 | 2,181 |
| ワコム | 0.6 | 0.6 | 357 | 三井ハイテック | - | 0.1 | 165 | マツダ | 2.1 | 2.2 | 1,793 |
| アルバック | 0.1 | 0.1 | 332 | 新光電気工業 | 0.3 | 0.3 | 429 | 本田技研工業 | 5.5 | 5.6 | 17,018 |
| E I Z O | 0.1 | 0.1 | 430 | 京セラ | 1 | 1 | 6,156 | スズキ | 1.2 | 1.4 | 5,817 |
| 日本信号 | 0.2 | 0.3 | 366 | 太陽誘電 | 0.3 | 0.3 | 1,024 | S U B A R U | 2 | 2.2 | 5,705 |
| 京三製作所 | 0.5 | 0.5 | 267 | 村田製作所 | 2.1 | 2.1 | 13,666 | ヤマハ発動機 | 0.9 | 1 | 1,773 |
| 能美防災 | 0.1 | 0.1 | 207 | 双葉電子工業 | 0.1 | - | - | ショーワ | 0.2 | 0.2 | 450 |
| エレコム | 0.1 | 0.1 | 513 | ニチコン | 0.3 | 0.4 | 324 | エクセディ | 0.1 | 0.1 | 184 |
| パナソニック | 7.6 | 8.3 | 8,192 | 日本ケミコン | 0.1 | - | - | 豊田合成 | 0.2 | 0.3 | 732 |
| シャープ | 0.7 | 0.9 | 1,148 | K O A | 0.2 | 0.2 | 223 | 愛三工業 | 0.3 | 0.3 | 186 |
| アンリツ | 0.5 | 0.5 | 1,201 | 小糸製作所 | 0.4 | 0.4 | 1,930 | ヨロズ | 0.1 | - | - |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | |
|---------------------|-------------|-----|--------|-----|----------------------|-------------|------|--------|-----------|------------------------|-------------|-----|-------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千株 | 千円 | |
| エフ・シー・シー | 0.1 | 0.2 | 413 | | 電気・ガス業 (1.6%) | | | | | センコーグループホールディングス | 0.5 | 0.5 | 410 | |
| シマノ | 0.3 | 0.3 | 5,919 | | 東京電力ホールディングス | 5.4 | 6 | 2,238 | | ニッコンホールディングス | 0.2 | 0.3 | 694 | |
| ティ・エス テック | 0.2 | 0.2 | 642 | | 中部電力 | 2 | 2.2 | 3,105 | | 福山通運 | 0.1 | 0.1 | 380 | |
| 精密機器 (2.5%) | | | | | 関西電力 | 2.7 | 2.7 | 3,041 | | セイノーホールディングス | 0.5 | 0.5 | 746 | |
| テルモ | 1.9 | 2 | 8,342 | | 中国電力 | 0.9 | 1 | 1,464 | | 日立物流 | 0.2 | 0.2 | 585 | |
| 日機装 | 0.3 | 0.3 | 316 | | 中国電力 | 0.9 | 1 | 1,464 | | 丸和運輸機関 | - | 0.1 | 287 | |
| 島津製作所 | 0.8 | 0.9 | 2,622 | | 北陸電力 | 0.8 | 0.8 | 582 | | 九州旅客鉄道 | 0.5 | 0.6 | 1,863 | |
| 東京精密 | 0.1 | 0.1 | 374 | | 東北電力 | 1.6 | 1.8 | 1,969 | | S Gホールディングス | 0.6 | 0.7 | 2,422 | |
| マニー | 0.1 | 0.3 | 889 | | 四国電力 | 0.7 | 0.7 | 587 | | 海運業 (0.1%) | | | | |
| ニコン | 1.2 | 1.1 | 1,119 | | 九州電力 | 1.5 | 1.5 | 1,387 | | 日本郵船 | 0.6 | 0.6 | 976 | |
| トプコン | 0.4 | 0.4 | 412 | | 北海道電力 | 0.9 | 1 | 453 | | 商船三井 | 0.4 | 0.4 | 834 | |
| オリンパス | 3.9 | 4 | 7,684 | | 沖縄電力 | 0.2 | 0.21 | 395 | | 川崎汽船 | 0.2 | 0.3 | 348 | |
| 理研計器 | 0.1 | 0.1 | 247 | | 電源開発 | 0.5 | 0.6 | 1,265 | | 飯野海運 | 0.4 | 0.4 | 141 | |
| タムロン | 0.1 | 0.1 | 202 | | イーレックス | 0.1 | 0.1 | 148 | | 空運業 (0.4%) | | | | |
| HOYA | 1.3 | 1.4 | 14,070 | | レノバ | - | 0.1 | 97 | | 日本航空 | 1.2 | 1.3 | 3,123 | |
| ノーリツ鋼機 | 0.1 | - | - | | 東京瓦斯 | 1.3 | 1.4 | 3,587 | | ANAホールディングス | 1.1 | 1.2 | 3,398 | |
| 朝日インテック | 0.3 | 0.8 | 2,452 | | 大阪瓦斯 | 1.3 | 1.4 | 2,969 | | 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | | | | |
| シチズン時計 | 0.9 | 1.1 | 447 | | 東邦瓦斯 | 0.3 | 0.3 | 1,578 | | 三菱倉庫 | 0.2 | 0.2 | 588 | |
| メニコン | 0.1 | 0.1 | 484 | | 西部瓦斯 | 0.1 | 0.1 | 259 | | 三井倉庫ホールディングス | 0.2 | 0.2 | 318 | |
| セイコーホールディングス | 0.1 | 0.1 | 195 | | 静岡ガス | 0.3 | 0.3 | 299 | | 住友倉庫 | 0.3 | 0.3 | 416 | |
| ニプロ | 0.5 | 0.6 | 744 | | 陸運業 (4.2%) | | | | 日本トランスシティ | 0.4 | 0.4 | 216 | | |
| その他製品 (2.3%) | | | | | S B Sホールディングス | 0.1 | 0.1 | 238 | | 安田倉庫 | 0.2 | 0.2 | 181 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 0.1 | 0.1 | 418 | | 東武鉄道 | 0.7 | 0.7 | 2,705 | | 上組 | 0.4 | 0.4 | 878 | |
| 前田工織 | 0.1 | 0.1 | 246 | | 相鉄ホールディングス | 0.2 | 0.3 | 901 | | 近鉄エクスプレス | 0.2 | 0.2 | 364 | |
| サンダインコムホールディングス | 0.7 | 0.7 | 4,343 | | 東急 | 1.8 | 1.8 | 3,097 | | 情報・通信業 (9.5%) | | | | |
| S H O E I | - | 0.1 | 251 | | 京浜急行電鉄 | 0.9 | 0.9 | 1,610 | | N E C ネットズアイ | 0.1 | 0.3 | 597 | |
| フランスベッドホールディングス | 0.2 | 0.2 | 174 | | 小田急電鉄 | 1 | 1 | 2,677 | | システナ | 0.3 | 0.3 | 472 | |
| パイロットコーポレーション | 0.1 | 0.1 | 367 | | 京王電鉄 | 0.3 | 0.4 | 2,540 | | 日鉄ソリューションズ | 0.1 | 0.1 | 298 | |
| トッパン・フォームズ | 0.2 | 0.2 | 224 | | 京成電鉄 | 0.5 | 0.5 | 1,845 | | T I S | 0.2 | 0.7 | 1,581 | |
| フジールインターナショナル | 0.2 | 0.2 | 433 | | 富士急行 | 0.1 | 0.1 | 342 | | 電算システム | - | 0.1 | 351 | |
| タカラトミー | 0.3 | 0.4 | 374 | | 東日本旅客鉄道 | 1.2 | 1.2 | 10,341 | | グリー | 0.5 | 0.6 | 276 | |
| 大建工業 | 0.1 | 0.1 | 175 | | 西日本旅客鉄道 | 0.6 | 0.6 | 4,084 | | コーエーテックホールディングス | 0.2 | 0.2 | 646 | |
| 凸版印刷 | 0.9 | 1 | 1,941 | | 東海旅客鉄道 | 0.6 | 0.6 | 11,229 | | 三菱総合研究所 | 0.1 | 0.1 | 409 | |
| 大日本印刷 | 0.9 | 1 | 2,637 | | 西武ホールディングス | 0.8 | 1 | 1,393 | | K L a b | - | 0.2 | 154 | |
| N I S S H A | 0.2 | 0.2 | 215 | | 鴻池運輸 | 0.1 | 0.2 | 246 | | ネクソン | 1.7 | 2 | 4,638 | |
| TAKARA & COMPANY | 0.1 | 0.1 | 191 | | 西日本鉄道 | 0.2 | 0.2 | 588 | | アイスタイル | 0.2 | - | - | |
| アシックス | 0.6 | 0.6 | 828 | | ハマキョウレックス | 0.1 | 0.1 | 325 | | コロプラ | 0.2 | 0.2 | 209 | |
| ヤマハ | 0.4 | 0.4 | 2,260 | | 近鉄グループホールディングス | 0.6 | 0.7 | 3,668 | | ブロードリーフ | 0.4 | 0.5 | 279 | |
| ビジョン | 0.4 | 0.4 | 1,648 | | 阪急阪神ホールディングス | 0.8 | 0.8 | 3,148 | | フィックスターズ | 0.1 | - | - | |
| キングジム | - | 0.2 | 190 | | 南海電気鉄道 | 0.3 | 0.4 | 1,057 | | オプティム | - | 0.1 | 300 | |
| リンテック | 0.2 | 0.2 | 524 | | 京阪ホールディングス | 0.3 | 0.3 | 1,515 | | ティーガイア | 0.1 | 0.1 | 216 | |
| 任天堂 | 0.4 | 0.4 | 18,136 | | 神戸電鉄 | 0.1 | 0.1 | 371 | | テクマトリックス | 0.1 | 0.1 | 368 | |
| 三菱鉛筆 | 0.1 | 0.1 | 152 | | 名古屋鉄道 | 0.5 | 0.5 | 1,617 | | ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 1.6 | 0.2 | 373 | |
| タカラスタンダード | 0.2 | 0.2 | 311 | | 山陽電気鉄道 | 0.1 | 0.1 | 224 | | GMOペイメントゲートウェイ | 0.1 | 0.2 | 2,250 | |
| コクヨ | 0.3 | 0.3 | 399 | | 日本通運 | 0.2 | 0.2 | 1,192 | | インターネットイニシアティブ | 0.1 | 0.1 | 390 | |
| オカムラ | 0.3 | 0.3 | 252 | | ヤマトホールディングス | 1.1 | 1.2 | 2,955 | | S R Aホールディングス | 0.1 | 0.1 | 249 | |
| 美津濃 | 0.1 | 0.1 | 216 | | 山九 | 0.2 | 0.2 | 882 | | 朝日ネット | 0.4 | 0.3 | 417 | |
| | | | | | 丸全昭和運輸 | 0.1 | 0.1 | 296 | | | | | | |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | |
|------------------|-------------|-----|--------|----------------------|-------------|-----|--------|----------------|-------------|-----|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 |
| コムチュア | - | 0.1 | 281 | 東宝 | 0.4 | 0.4 | 1,624 | 豊田通商 | 0.7 | 0.8 | 2,412 |
| LINE | 0.2 | 0.2 | 1,072 | エヌ・ティ・ティ・データ | 1.8 | 1.9 | 2,511 | 兼松 | 0.3 | 0.3 | 402 |
| マクロミル | 0.1 | 0.2 | 165 | D T S | 0.1 | 0.2 | 476 | 三井物産 | 5.2 | 6.2 | 10,837 |
| 野村総合研究所 | 0.4 | 1 | 2,784 | スクウェア・エニックス・ホールディングス | 0.3 | 0.3 | 1,638 | 日本紙パルプ商事 | 0.1 | 0.1 | 411 |
| インテージホールディングス | 0.2 | 0.2 | 177 | シーイーシー | 0.1 | 0.1 | 193 | 日立ハイテック | 0.2 | - | - |
| ソースネクスト | 0.3 | 0.4 | 128 | カプコン | 0.3 | 0.3 | 1,179 | 山善 | 0.3 | 0.3 | 278 |
| インフォコム | 0.1 | 0.1 | 312 | ジャステック | 0.2 | 0.2 | 243 | 住友商事 | 3.8 | 4.5 | 5,998 |
| ラクスル | - | 0.1 | 266 | S C S K | 0.2 | 0.2 | 1,102 | 三菱商事 | 4.5 | 4.9 | 12,208 |
| アルテリア・ネットワークス | - | 0.1 | 200 | アイネス | 0.2 | 0.1 | 135 | キャンマーケティングジャパン | 0.2 | 0.2 | 466 |
| FJ・メディア・ホールディングス | 0.7 | 0.7 | 803 | T K C | 0.1 | 0.1 | 573 | 佐藤商事 | 0.2 | 0.2 | 188 |
| オービック | 0.2 | 0.2 | 3,644 | 富士ソフト | 0.1 | 0.1 | 441 | 菱洋エレクトロ | 0.1 | 0.1 | 271 |
| ジャストシステム | 0.1 | 0.1 | 752 | NSD | 0.1 | 0.3 | 520 | 東京産業 | 0.4 | 0.5 | 283 |
| Zホールディングス | 4.3 | 9.8 | 4,439 | コナミホールディングス | 0.3 | 0.3 | 1,171 | ユアサ商事 | 0.1 | 0.1 | 306 |
| トレンドマイクロ | 0.4 | 0.3 | 1,863 | J B C Cホールディングス | 0.1 | 0.1 | 163 | 阪和興業 | 0.1 | 0.2 | 401 |
| 日本オラル | 0.1 | 0.1 | 1,235 | ミロク情報サービス | 0.1 | 0.1 | 252 | 正栄食品工業 | 0.1 | 0.1 | 444 |
| フューチャー | 0.1 | 0.1 | 181 | ソフトバンクグループ | 2.7 | 5.6 | 29,988 | カナデン | 0.2 | 0.2 | 260 |
| CAC Holdings | 0.1 | - | - | 卸売業 (4.8%) | | | | 菱電商事 | 0.1 | 0.2 | 307 |
| オービックビジネスコンサルタント | 0.1 | 0.1 | 607 | あらた | 0.1 | 0.1 | 459 | 岩谷産業 | 0.2 | 0.2 | 753 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 0.3 | 0.3 | 1,128 | 東京エレクトロニクス デバイス | 0.1 | 0.1 | 287 | イワキ | - | 0.3 | 143 |
| 東計電算 | 0.1 | 0.1 | 410 | 双日 | 3.8 | 4.3 | 1,122 | 三菱石油 | 0.3 | 0.3 | 329 |
| 大塚商会 | 0.4 | 0.4 | 2,180 | アルフレッサ ホールディングス | 0.7 | 0.8 | 1,808 | 稲畑産業 | 0.2 | 0.2 | 265 |
| サイボウズ | - | 0.1 | 317 | 横浜冷凍 | 0.4 | 0.4 | 365 | ワキタ | 0.2 | 0.2 | 199 |
| 電通国際情報サービス | 0.1 | 0.1 | 500 | 神戸物産 | 0.1 | 0.3 | 1,866 | 東邦ホールディングス | 0.2 | 0.2 | 418 |
| デジタルガレージ | 0.1 | 0.1 | 385 | あい ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 156 | サンゲツ | 0.2 | 0.2 | 315 |
| イーエムシステムズ | - | 0.2 | 179 | ダイワボウホールディングス | 0.1 | 0.1 | 789 | シナネンホールディングス | 0.1 | 0.1 | 267 |
| C I J | 0.2 | 0.2 | 185 | マクニカ・富士レホールディングス | 0.2 | 0.2 | 334 | 伊藤忠エネクス | 0.3 | 0.3 | 260 |
| ネットワンシステムズ | 0.3 | 0.3 | 1,020 | バイタル・エスケイ・ホールディングス | 0.2 | 0.2 | 214 | サンリオ | 0.2 | 0.2 | 386 |
| アルゴグラフィックス | 0.1 | 0.1 | 368 | レスターホールディングス | 0.1 | 0.1 | 226 | リョーサン | 0.1 | 0.1 | 241 |
| エイベックス | 0.2 | 0.2 | 187 | TOKAIホールディングス | 0.4 | 0.5 | 495 | 新光商事 | 0.1 | 0.2 | 179 |
| 日本ユニシス | 0.2 | 0.2 | 677 | シップヘルスケアホールディングス | 0.1 | 0.1 | 451 | トーヨー | 0.1 | 0.1 | 189 |
| 兼松エレクトロニクス | 0.1 | 0.1 | 381 | コメダホールディングス | 0.2 | 0.3 | 577 | 三信電気 | 0.1 | 0.1 | 176 |
| 東京放送ホールディングス | 0.5 | 0.5 | 900 | 小野建 | 0.1 | 0.1 | 126 | 東陽テクノカ | - | 0.2 | 215 |
| 日本テレビホールディングス | 0.6 | 0.6 | 759 | 佐島電機 | 0.2 | 0.2 | 176 | モスフードサービス | 0.1 | 0.1 | 293 |
| テレビ朝日ホールディングス | 0.2 | 0.2 | 333 | ナガイレーベン | 0.1 | 0.1 | 264 | 加賀電子 | 0.1 | 0.1 | 218 |
| スカパーJSATホールディングス | 0.7 | 0.7 | 321 | 三菱食品 | 0.1 | 0.1 | 289 | ソーダニッカ | 0.4 | 0.4 | 215 |
| テレビ東京ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 250 | 第一興商 | 0.1 | 0.1 | 397 | 立花エレテック | 0.1 | 0.1 | 174 |
| コネクシオ | 0.1 | 0.1 | 147 | メディカルホールディングス | 0.7 | 0.8 | 1,742 | P A L T A C | 0.1 | 0.1 | 500 |
| 日本電信電話 | 4.4 | 9.4 | 23,612 | S P K | 0.1 | 0.2 | 289 | 日鉄物産 | 0.1 | 0.1 | 374 |
| KDDI | 5.7 | 5.3 | 16,912 | アズワン | - | 0.1 | 1,158 | トラスコ中山 | 0.2 | 0.2 | 531 |
| ソフトバンク | 6.9 | 6.5 | 8,931 | ドウシシャ | 0.1 | 0.1 | 156 | オートバックスセブン | 0.3 | 0.3 | 437 |
| 光通信 | 0.1 | 0.1 | 2,506 | 小津産業 | - | 0.1 | 178 | 加藤産業 | 0.1 | 0.1 | 379 |
| N T T ドコモ | 4 | 5 | 14,450 | ハピネット | 0.1 | - | - | イエローハット | 0.2 | 0.2 | 302 |
| GMOインターネット | 0.3 | 0.3 | 851 | 日本ライフライン | 0.2 | 0.2 | 293 | 杉本商事 | 0.1 | 0.1 | 190 |
| KADOKAWA | 0.2 | 0.2 | 355 | シークス | 0.1 | - | - | 因幡電機産業 | 0.1 | 0.2 | 500 |
| 学研ホールディングス | - | 0.1 | 155 | 伊藤忠商事 | 4.5 | 4.9 | 11,529 | ミスミグループ本社 | 0.8 | 0.9 | 2,648 |
| ゼンリン | 0.2 | 0.2 | 272 | 丸紅 | 6.5 | 7.6 | 4,173 | スズケン | 0.3 | 0.3 | 1,206 |
| 松竹 | - | 0.1 | 1,489 | 長瀬産業 | 0.4 | 0.4 | 550 | | | | |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | |
|-------------------------|-------------|-----|--------|------------------|-------------|-----|-------|---------------------|-------------|------|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 |
| 小売業 (4.7%) | | | | 幸楽苑ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 161 | サガミホールディングス | 0.2 | 0.2 | 254 |
| ローソン | 0.2 | 0.2 | 1,188 | サイゼリヤ | 0.1 | 0.1 | 226 | 王将フードサービス | - | 0.1 | 627 |
| サンエー | 0.1 | 0.1 | 430 | VTホールディングス | 0.4 | 0.4 | 139 | プレナス | 0.1 | 0.1 | 184 |
| カワチ食品 | 0.1 | 0.1 | 266 | ユナイテッドアローズ | 0.1 | 0.1 | 210 | ミニストップ | 0.1 | 0.1 | 156 |
| エービーシー・マート | 0.1 | 0.1 | 662 | ハイデイ日高 | 0.1 | 0.1 | 190 | アークス | 0.1 | 0.1 | 220 |
| アスクル | 0.1 | 0.1 | 377 | コロワイド | 0.2 | 0.3 | 509 | パローホールディングス | 0.2 | 0.2 | 440 |
| ゲオホールディングス | 0.1 | 0.1 | 137 | 壹番屋 | 0.1 | 0.1 | 541 | 大庄 | 0.1 | 0.1 | 139 |
| アダストリア | 0.1 | 0.1 | 180 | スギホールディングス | 0.1 | 0.1 | 700 | ファーストリテイリング | 0.1 | 0.1 | 6,604 |
| エディオン | 0.3 | 0.3 | 303 | ヨンドシーホールディングス | 0.1 | 0.1 | 195 | サンドラッグ | 0.2 | 0.3 | 1,066 |
| サーラコーポレーション | 0.3 | 0.3 | 179 | ファミリーマート | 0.7 | 0.6 | 1,261 | ベルーナ | 0.2 | 0.3 | 192 |
| アルペン | 0.1 | 0.1 | 185 | 木曾路 | 0.1 | 0.1 | 256 | 銀行業 (5.2%) | | | |
| クオールホールディングス | 0.1 | 0.1 | 124 | SRSホールディングス | 0.2 | 0.2 | 185 | めぶきフィナンシャルグループ | 3.4 | 3.6 | 925 |
| ビックカメラ | 0.4 | 0.5 | 583 | 千趣会 | 0.6 | 0.5 | 200 | 東京さほしフィナンシャルグループ | 0.1 | 0.1 | 115 |
| DCMホールディングス | 0.4 | 0.4 | 445 | ケーヨー | 0.3 | 0.3 | 195 | 九州フィナンシャルグループ | 1.1 | 1.7 | 797 |
| MonotaRO | 0.4 | 0.5 | 2,007 | 上新電機 | 0.1 | 0.1 | 217 | ゆうちょ銀行 | 1.7 | 1.9 | 1,749 |
| アークランドサカモトホールディングス | 0.1 | 0.1 | 196 | 日本瓦斯 | 0.1 | 0.1 | 442 | コンソルディア・フィナンシャルグループ | 4.1 | 4.2 | 1,566 |
| J.フロント リテイリング | 0.8 | 0.8 | 764 | ロイヤルホールディングス | 0.1 | 0.1 | 203 | 西日本フィナンシャルホールディングス | 0.4 | 0.6 | 474 |
| ドトール・日レスホールディングス | 0.1 | 0.1 | 183 | いなげや | 0.1 | 0.1 | 166 | 関西みらいフィナンシャルグループ | 0.3 | 0.5 | 217 |
| マツモトキヨシホールディングス | 0.3 | 0.3 | 1,153 | 島忠 | 0.2 | 0.2 | 580 | 第四北越フィナンシャルグループ | 0.1 | 0.1 | 232 |
| ZOZO | 0.7 | 0.5 | 1,172 | チヨダ | 0.1 | 0.1 | - | 新生銀行 | 0.5 | 0.5 | 744 |
| ココカラファイン | 0.1 | 0.1 | 580 | ライフコーポレーション | - | 0.1 | 336 | あおぞら銀行 | 0.4 | 0.4 | 855 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 1.2 | 1.3 | 960 | リンガーハット | 0.1 | 0.1 | 244 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 44.6 | 48.7 | 22,840 |
| ウエルシアホールディングス | 0.2 | 0.2 | 1,760 | テンアライド | 0.4 | 0.5 | 196 | りそなホールディングス | 7.2 | 8.1 | 3,239 |
| クワイエットSDホールディングス | 0.1 | 0.1 | 351 | AOKIホールディングス | 0.2 | 0.2 | 139 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 1.3 | 1.3 | 4,260 |
| ネクステージ | 0.1 | - | - | オークワ | - | 0.1 | 155 | 三井住友フィナンシャルグループ | 4.5 | 4.8 | 15,964 |
| ジョイフル本田 | 0.2 | 0.2 | 276 | コメリ | 0.1 | 0.1 | 262 | 千葉銀行 | 2.4 | 2.5 | 1,370 |
| すかいらーくホールディングス | 0.6 | 0.8 | 1,446 | 青山商事 | 0.1 | - | - | 群馬銀行 | 1.5 | 1.6 | 563 |
| マクドナルド・スーパーマックスホールディングス | 0.2 | 0.3 | 341 | しまむら | 0.1 | 0.1 | 773 | 武蔵野銀行 | 0.1 | 0.1 | 165 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 2.7 | 2.7 | 10,500 | 高島屋 | 0.5 | 0.6 | 628 | 千葉興業銀行 | - | 0.6 | 161 |
| クワイエットSDホールディングス | 0.2 | 0.4 | 329 | 松屋 | 0.2 | 0.2 | 141 | 七十七銀行 | 0.2 | 0.3 | 492 |
| ツルハホールディングス | 0.1 | 0.1 | 1,593 | エイチ・ツー・オー リテイリング | 0.4 | 0.4 | 339 | 青森銀行 | 0.1 | 0.1 | 227 |
| サンマルクホールディングス | 0.1 | 0.1 | 186 | 丸井グループ | 0.6 | 0.7 | 1,497 | 山形銀行 | 0.1 | - | - |
| トリドールホールディングス | 0.1 | 0.2 | 255 | アクシアル リテイリング | - | 0.1 | 421 | 東邦銀行 | 0.7 | 0.8 | 188 |
| JMホールディングス | - | 0.1 | 269 | イオン | 2.5 | 2.7 | 6,532 | みちのく銀行 | 0.1 | - | - |
| クスリのオキホールディングス | 0.1 | 0.1 | 880 | イズミ | 0.1 | 0.1 | 345 | ふくおかフィナンシャルグループ | 0.6 | 0.6 | 1,119 |
| スシローグローバルホールディングス | 0.1 | 0.4 | 956 | 平和堂 | 0.1 | 0.1 | 194 | 静岡銀行 | 1.7 | 1.8 | 1,323 |
| LIXILビバ | - | 0.1 | 259 | フジ | 0.1 | 0.1 | 189 | 十六銀行 | 0.1 | 0.1 | 213 |
| ノジマ | 0.1 | 0.1 | 247 | ヤオコー | 0.1 | 0.1 | 745 | スルガ銀行 | 0.9 | 0.9 | 396 |
| カップパ・クワイエット | 0.1 | 0.1 | 150 | ゼビオホールディングス | 0.1 | - | - | 八十二銀行 | 1.6 | 1.8 | 761 |
| 良品計画 | 0.1 | 0.9 | 1,428 | ケースホールディングス | 0.7 | 0.7 | 1,019 | 山梨中央銀行 | 0.1 | - | - |
| アドヴァン | 0.1 | - | - | 総合メディカルホールディングス | 0.1 | - | - | 大垣共立銀行 | 0.1 | 0.1 | 231 |
| イオン北海道 | - | 0.2 | 160 | アインホールディングス | 0.1 | 0.1 | 694 | 福井銀行 | 0.1 | 0.1 | 168 |
| コーナン商事 | 0.1 | 0.1 | 313 | ヤマダ電機 | 2 | 2.2 | 1,256 | 北國銀行 | 0.1 | 0.1 | 299 |
| ワタミ | 0.1 | - | - | アークランドサカモト | 0.1 | - | - | 滋賀銀行 | 0.2 | 0.2 | 514 |
| 心斎橋フィナンシャルホールディングス | 0.4 | 1.6 | 3,532 | ニトリホールディングス | 0.3 | 0.3 | 5,796 | 南都銀行 | 0.1 | 0.1 | 224 |
| 西松屋チェーン | 0.2 | 0.2 | 189 | グルメ軒屋 | - | 0.2 | 199 | 百五銀行 | 0.8 | 0.9 | 299 |
| ゼンショーホールディングス | 0.3 | 0.3 | 684 | 吉野家ホールディングス | 0.3 | 0.3 | 727 | 京都銀行 | 0.2 | 0.3 | 1,230 |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | | 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | | |
|--------------------------|-------------|------|--------|--------------------|-----|-------------|-------|---------------------|-----|-----|-------------|----|-----|----|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 |
| 紀陽銀行 | 0.3 | 0.3 | 507 | 芙蓉総合リース | 0.1 | 0.1 | 633 | サービス業 (5.2%) | | | | | | | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 0.5 | 0.5 | 474 | みずほリース | 0.1 | 0.1 | 252 | 日本工営 | 0.1 | 0.1 | 321 | | | | |
| 広島銀行 | 1.1 | 1.2 | 634 | 東京センチュリー | 0.1 | 0.1 | 552 | LIFULL | 0.3 | - | - | | | | |
| 山陰合同銀行 | 0.5 | 0.6 | 333 | 日本証券金融 | 0.4 | 0.4 | 211 | ジェイエイシーワグメント | 0.1 | - | - | | | | |
| 中国銀行 | 0.6 | 0.7 | 720 | アイフル | 1.1 | 1.2 | 319 | 日本M&Aセンター | 0.5 | 0.5 | 2,447 | | | | |
| 伊予銀行 | 1 | 1.1 | 721 | リコーリース | 0.1 | 0.1 | 319 | UTグループ | - | 0.1 | 244 | | | | |
| 百十四銀行 | 0.1 | 0.1 | 201 | イオンフィナンシャルサービス | 0.4 | 0.4 | 531 | コシダカホールディングス | 0.2 | - | - | | | | |
| 阿波銀行 | 0.1 | 0.1 | 269 | アコム | 1.4 | 1.5 | 691 | パソナグループ | 0.1 | - | - | | | | |
| 佐賀銀行 | 0.1 | - | - | ジャックス | 0.1 | 0.1 | 197 | エス・エム・エス | 0.2 | 0.2 | 531 | | | | |
| 沖縄銀行 | 0.1 | 0.1 | 326 | オリエントコーポレーション | 1.8 | 1.9 | 260 | パーソルホールディングス | 0.7 | 0.7 | 1,065 | | | | |
| 琉球銀行 | 0.2 | 0.2 | 192 | 日立キャピタル | 0.2 | 0.2 | 498 | スタジオアリス | - | 0.1 | 170 | | | | |
| セブン銀行 | 2.3 | 2.4 | 724 | オリックス | 4.3 | 4.4 | 6,820 | 総合警備保障 | 0.3 | 0.3 | 1,605 | | | | |
| みずほフィナンシャルグループ | 88.5 | 97.4 | 13,928 | 三菱UFJリース | 1.5 | 1.9 | 1,075 | カカクコム | 0.5 | 0.5 | 1,411 | | | | |
| 山口フィナンシャルグループ | 0.9 | 1 | 672 | 日本取引所グループ | 1.8 | 2 | 4,870 | ルネサンス | 0.1 | 0.2 | 240 | | | | |
| 名古屋銀行 | 0.1 | 0.1 | 252 | イー・ギャランティ | - | 0.1 | 202 | ディップ | 0.1 | 0.1 | 248 | | | | |
| 北洋銀行 | 1.1 | 1.2 | 272 | 不動産業 (2.2%) | | | | ベネフィット・ワン | 0.2 | 0.3 | 684 | | | | |
| 愛媛銀行 | 0.2 | 0.2 | 234 | いちご | 0.9 | 1 | 315 | エムスリー | 1.3 | 1.5 | 6,757 | | | | |
| 京葉銀行 | 0.5 | 0.5 | 266 | 日本駐車場開発 | 0.9 | 0.9 | 131 | アウトソーシング | 0.4 | 0.4 | 301 | | | | |
| 東和銀行 | 0.2 | 0.2 | 145 | ヒューリック | 1.4 | 1.6 | 1,747 | ディー・エヌ・エー | 0.4 | 0.4 | 582 | | | | |
| トモニホールディングス | 0.6 | 0.7 | 250 | 野村不動産ホールディングス | 0.5 | 0.5 | 1,082 | 博報堂DYホールディングス | 0.9 | 1 | 1,343 | | | | |
| 池田泉州ホールディングス | 0.8 | 1.1 | 191 | 三重交通グループホールディングス | - | 0.3 | 149 | ぐるなび | - | 0.2 | 159 | | | | |
| 証券・商品先物取引業 (0.8%) | | | | サムティ | 0.1 | 0.1 | 147 | エスプール | - | 0.2 | 159 | | | | |
| FPG | 0.2 | 0.3 | 211 | プレサンスコーポレーション | 0.2 | 0.2 | 263 | インフォーマート | 0.4 | 0.8 | 724 | | | | |
| SBIホールディングス | 0.8 | 0.8 | 1,876 | ユニゾホールディングス | 0.1 | - | - | EPSホールディングス | 0.1 | 0.1 | 110 | | | | |
| ジャフコ | 0.1 | 0.1 | 382 | フージャースホールディングス | - | 0.2 | 115 | プラスステージ・インターナショナル | 0.2 | 0.3 | 281 | | | | |
| 大和証券グループ本社 | 5.3 | 6.1 | 2,932 | オープンハウス | 0.1 | 0.2 | 707 | アミューズ | 0.1 | 0.1 | 225 | | | | |
| 野村ホールディングス | 11.7 | 12.6 | 6,380 | 東急不動産ホールディングス | 1.9 | 2.3 | 1,386 | ケネディクス | 0.6 | 0.7 | 413 | | | | |
| 岡三証券グループ | 0.8 | 0.8 | 289 | 飯田グループホールディングス | 0.6 | 0.6 | 1,041 | 電通グループ | 0.8 | 0.7 | 2,128 | | | | |
| 丸三証券 | 0.3 | 0.3 | 141 | パーク24 | 0.4 | 0.4 | 905 | みらかホールディングス | 0.2 | 0.2 | 535 | | | | |
| 野村フィナンシャルホールディングス | 1 | 1 | 273 | 三井不動産 | 3.4 | 3.5 | 7,987 | アルプス技研 | 0.1 | 0.1 | 196 | | | | |
| いちよし証券 | 0.2 | 0.3 | 146 | 三菱地所 | 4.5 | 4.9 | 8,753 | 日本空調サービス | 0.3 | 0.3 | 218 | | | | |
| 松井証券 | 0.4 | 0.4 | 353 | 平和不動産 | 0.2 | 0.2 | 619 | オリエンタルランド | 0.7 | 0.7 | 10,825 | | | | |
| マネックスグループ | 0.7 | 0.7 | 168 | 東京建物 | 0.8 | 0.8 | 1,164 | ダスキン | 0.2 | 0.2 | 573 | | | | |
| カブドットコム証券 | 0.6 | - | - | ダイビル | 0.3 | 0.3 | 328 | 明光ネットワークジャパン | 0.2 | 0.2 | 176 | | | | |
| 保険業 (2.1%) | | | | 京阪神ビルディング | 0.3 | 0.2 | 280 | ラウンドワン | 0.2 | 0.2 | 186 | | | | |
| かんぽ生命保険 | 0.3 | 0.3 | 453 | 住友不動産 | 1.5 | 1.6 | 5,238 | リゾートトラスト | 0.3 | 0.4 | 604 | | | | |
| SOMPOホールディングス | 1.2 | 1.3 | 5,038 | テーオーシー | 0.3 | 0.3 | 225 | ビー・エム・エル | 0.1 | 0.1 | 308 | | | | |
| アニコムホールディングス | 0.1 | 0.1 | 500 | スターツコーポレーション | 0.1 | 0.1 | 222 | りらいあコミュニケーションズ | 0.2 | 0.2 | 250 | | | | |
| MS&ADインシアランスグループホールディングス | 1.7 | 1.8 | 5,940 | フジ住宅 | 0.2 | - | - | リソー教育 | 0.4 | - | - | | | | |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 0.5 | 0.6 | 1,557 | 空港施設 | 0.3 | 0.3 | 134 | ユー・エス・エス | 0.8 | 0.8 | 1,555 | | | | |
| 第一生命ホールディングス | 3.7 | 4.1 | 6,246 | ゴールドクレスト | - | 0.1 | 157 | サイバーエージェント | 0.4 | 0.4 | 2,044 | | | | |
| 東京海上ホールディングス | 2.3 | 2.5 | 12,727 | タカラレーベン | 0.4 | 0.5 | 191 | 楽天 | 3 | 3.3 | 3,210 | | | | |
| T&Dホールディングス | 2.1 | 2.2 | 2,371 | イオンモール | 0.4 | 0.4 | 623 | フルキャストホールディングス | 0.1 | - | - | | | | |
| その他金融業 (1.2%) | | | | カチタス | 0.1 | 0.2 | 551 | エン・ジャパン | 0.1 | 0.1 | 316 | | | | |
| 全国保証 | 0.2 | 0.2 | 870 | トーセイ | - | 0.2 | 226 | テクノプロホールディングス | 0.1 | 0.1 | 679 | | | | |
| アルヒ | - | 0.1 | 169 | 日本空港ビルディング | 0.2 | 0.2 | 1,012 | ジャパンマテリアル | 0.2 | 0.2 | 340 | | | | |
| クレディセゾン | 0.5 | 0.5 | 715 | | | | | ベクトル | - | 0.2 | 192 | | | | |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | |
|---------------------|-------------|-----|-----|--------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | - | 0.1 | | 426 |
| リクルートホールディングス | 4.5 | 4.9 | | 19,835 |
| 日本郵政 | 5.1 | 5.6 | | 4,753 |
| ベルシステム24ホールディングス | 0.1 | 0.2 | | 291 |
| ソラスト | 0.2 | 0.2 | | 247 |
| ジャパエリバーサービスホールディングス | - | 0.1 | | 317 |
| キュービernetホールディングス | - | 0.1 | | 222 |
| リログループ | 0.4 | 0.4 | | 980 |
| 東祥 | 0.1 | - | | - |
| エイチ・アイ・エス | 0.1 | 0.1 | | 203 |
| 共立メンテナンス | 0.1 | 0.1 | | 395 |
| イチネンホールディングス | 0.2 | 0.2 | | 253 |
| 建設技術研究所 | 0.1 | 0.1 | | 182 |
| 東京都競馬 | 0.1 | 0.1 | | 374 |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | |
|-----------|-------------|-----|-----|-------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 常磐興産 | 0.1 | 0.1 | | 152 |
| カナモト | 0.1 | 0.1 | | 236 |
| 東京ドーム | 0.3 | 0.4 | | 356 |
| 西尾レントオール | 0.1 | 0.1 | | 235 |
| トランス・コスモス | 0.1 | 0.1 | | 247 |
| 乃村工藝社 | 0.4 | 0.4 | | 406 |
| 藤田観光 | 0.1 | 0.1 | | 192 |
| 日本管財 | 0.1 | 0.1 | | 189 |
| トーカイ | 0.1 | 0.1 | | 266 |
| セコム | 0.7 | 0.7 | | 6,733 |
| セントラル警備保障 | 0.1 | 0.1 | | 466 |
| 丹青社 | 0.2 | 0.2 | | 163 |
| メイテック | 0.1 | 0.1 | | 554 |
| 応用地質 | 0.2 | 0.2 | | 274 |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | 当期末 | |
|--------------|-------------|---------|---------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 船井総研ホールディングス | 0.2 | 0.2 | | 517 |
| ベネッセホールディングス | 0.3 | 0.2 | | 586 |
| イオンディライト | 0.1 | 0.1 | | 323 |
| ニチイ学館 | 0.2 | 0.1 | | 160 |
| ダイセキ | 0.1 | 0.2 | | 570 |
| ステップ | 0.1 | 0.1 | | 151 |
| 合計 | 株数・金額 | 766.4 | 840.51 | 1,639,310 |
| | 銘柄数<比率> | 1,056銘柄 | 1,066銘柄 | <95.9%> |

(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

| 銘柄別 | | 当期末 | |
|-----|-----------|-----------|----------|
| | | 買建額 | 売建額 |
| 国内 | T O P I X | 百万円 64 | 百万円 - |

■投資信託財産の構成

2020年6月10日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 千円 1,639,310 | % 95.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 73,058 | 4.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,712,368 | 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

(2020年6月10日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|---------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,712,368,180円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 57,833,937 |
| 株 式(評価額) | 1,639,310,180 |
| 未 収 入 金 | 461,925 |
| 未 収 配 当 金 | 12,542,138 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 2,220,000 |
| (B) 負 債 | 2,283,320 |
| 未 払 金 | 221,320 |
| 未 払 解 約 金 | 2,062,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 1,710,084,860 |
| 元 本 | 951,148,987 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 758,935,873 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 951,148,987口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C / D) | 17,979円 |

(注1) 期首元本額 936,331,552円
追加設定元本額 201,665,722円
一部解約元本額 186,848,287円

(注2) 期末における元本の内訳
MHAMトピックスファンド 951,148,987円
期末元本合計 951,148,987円

■損益の状況

当期 自2019年6月11日 至2020年6月10日

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 38,596,048円 |
| 受 取 配 当 金 | 38,596,149 |
| 受 取 利 息 | 6 |
| そ の 他 収 益 金 | 30,334 |
| 支 払 利 息 | △30,441 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 89,238,955 |
| 売 買 益 | 184,011,639 |
| 売 買 損 | △94,772,684 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | 671,476 |
| 取 引 益 | 17,186,340 |
| 取 引 損 | △16,514,864 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 128,506,479 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 632,956,829 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △139,184,713 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 136,657,278 |
| (H) 合 計(D + E + F + G) | 758,935,873 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 758,935,873 |

(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。