

インデックスファンド日本株式（DC専用）

運用報告書（全体版）

第21期（決算日 2024年11月6日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「インデックスファンド日本株式（DC専用）」は、2024年11月6日に第21期の決算を行ないましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

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	2003年11月7日から原則無期限です。	
運用方針	主として「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券に投資を行ない、「TOPIX（東証株価指数）配当込み」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要運用対象	インデックスファンド 日本株式（DC専用）	「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	インデックスファンド 日本株式（DC専用）	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ないません。
	日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。 ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

<940429>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			TOPIX (東証株価指数) 配当込み (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税 分	込 配	み 金	期 騰	中 落			
	円		円	騰	率				百万円
17期(2020年11月6日)	21,209		10		0.1	2,587.73	98.8	1.1	2,135
18期(2021年11月8日)	26,524		10		25.1	3,242.52	98.6	1.4	2,779
19期(2022年11月7日)	25,829		10	△	2.6	3,164.07	98.5	1.4	3,300
20期(2023年11月6日)	32,274		0		25.0	3,960.76	98.7	1.2	4,435
21期(2024年11月6日)	37,944		0		17.6	4,664.89	98.8	1.2	5,540

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		TOPIX（東証株価指数）配当込み （ベンチマーク）		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率	円	騰 落 率		
（期 首） 2023年11月 6 日	32,274	—	3,960.76	—	98.7	1.2
11月末	32,474	0.6	3,986.65	0.7	98.7	1.2
12月末	32,398	0.4	3,977.63	0.4	99.5	0.5
2024年 1 月 末	34,924	8.2	4,288.36	8.3	99.6	0.3
2 月 末	36,640	13.5	4,499.61	13.6	99.6	0.4
3 月 末	38,258	18.5	4,699.20	18.6	98.7	1.4
4 月 末	37,911	17.5	4,656.27	17.6	98.7	1.4
5 月 末	38,338	18.8	4,710.15	18.9	98.3	1.6
6 月 末	38,889	20.5	4,778.56	20.6	98.6	1.4
7 月 末	38,670	19.8	4,752.72	20.0	98.9	1.2
8 月 末	37,547	16.3	4,615.06	16.5	99.7	0.2
9 月 末	36,966	14.5	4,544.38	14.7	98.6	1.4
10 月 末	37,656	16.7	4,629.83	16.9	98.5	1.5
（期 末） 2024年11月 6 日	37,944	17.6	4,664.89	17.8	98.8	1.2

（注）騰落率は期首比です。

（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

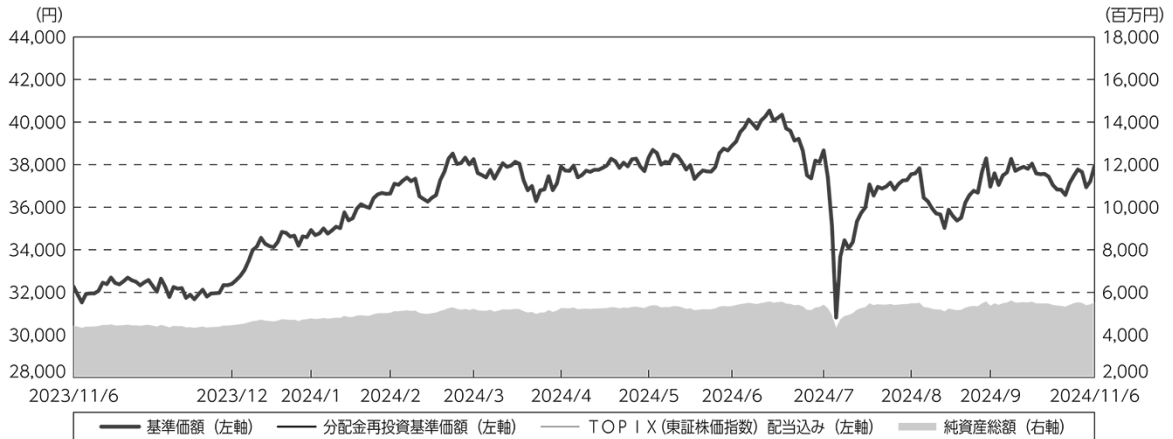
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

（2023年11月7日～2024年11月6日）

期中の基準価額等の推移



期首：32,274円

期末：37,944円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：17.6%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびTOPIX（東証株価指数）配当込みは、期首（2023年11月6日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) TOPIX（東証株価指数）配当込みは当ファンドのベンチマークです。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主としてわが国の株式に実質的に投資を行ない、「TOPIX（東証株価指数）配当込み」に連動する投資成果をめざして運用を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

＜値上がり要因＞

- ・米国連邦公開市場委員会（FOMC）の結果を受けて米国連邦準備制度理事会（FRB）が2024年に利下げに動くことと期待されたこと。
- ・国内企業の好調な業績を受けて海外の投資家が日本株式への関心を高めていたこと。
- ・米国の大手半導体企業の好決算などを背景として半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったこと。

<値下がり要因>

- ・中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念が強まったこと（2024年8月上旬）。
- ・新首相が衆議院の解散・総選挙を表明し政治的不透明感が高まったこと。

投資環境

（株式市況）

国内株式市場では、東証株価指数（TOPIX）は、期間の初めと比べて上昇しました。

期間の初めから2024年7月上旬にかけては、中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどが株価の重しとなったものの、FOMCの結果を受けてFRBが2024年に利下げに動くことが期待されたことや、国内企業の好調な業績を受けて海外の投資家が日本株式への関心を高めていたこと、米国の大手半導体企業の好決算などを背景として半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったこと、円安／アメリカドル高が進行し輸出企業の好調な業績が期待されたことなどが支援材料となり、TOPIXは上昇しました。7月中旬から期間末にかけては、FRBが利下げを開始し米国経済の下支えになるとの期待感が強まったことや、日銀総裁の金融政策決定会合後の記者会見での発言から早期の追加利上げ観測が後退したことなどが株価の上昇要因となったものの、日銀が金融政策決定会合において利上げを決定したことを受けて円高／アメリカドル安が進み、輸出関連企業の業績への期待が一時後退したことや、米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念が強まったこと、新首相が衆議院の解散・総選挙を表明し政治的不透明感が高まったことなどが重しとなり、TOPIXは下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当ファンドは、「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券を高位に組み入れて運用を行ないました。

（日本株式インデックスTOPIXマザーファンド）

「TOPIX（東証株価指数）配当込み」に連動する投資成果を目標とし、「パーラ日本株式モデル」に基づいてポートフォリオを構築しました。また、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

当ファンドのベンチマークとの差異

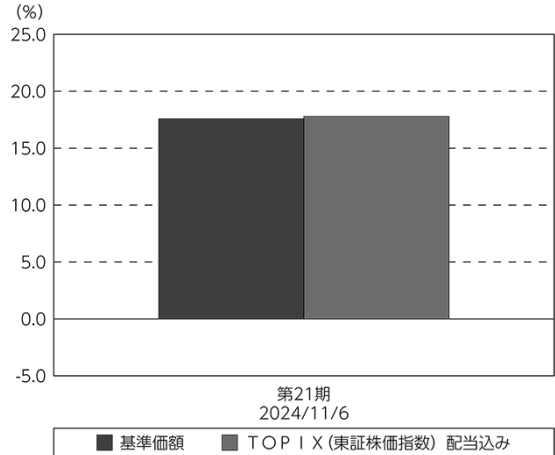
期間中における基準価額は、17.6%の値上がりとなり、ベンチマークである「TOPIX（東証株価指数）配当込み」の上昇率17.8%を概ね0.2%下回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<マイナス要因>

- ・売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

(注) TOPIX（東証株価指数）配当込みは当ファンドのベンチマークです。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第21期
	2023年11月7日～ 2024年11月6日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	30,349

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、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合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、ファンドの基本方針に則り、「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券を原則として高位に組み入れて運用を行いません。

（日本株式インデックスTOPIXマザーファンド）

引き続き、ベンチマークである「TOPIX（東証株価指数）配当込み」との連動をめざし、原則として「バーラ日本株式モデル」に基づいて構築したポートフォリオによる運用を継続します。また、一定期間ごとにポートフォリオの見直しなどを行ない、株式先物取引を含めた実質の株式組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年11月7日～2024年11月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(20)	(0.055)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(28)	(0.077)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
(受 託 会 社)	(8)	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	2	0.004	(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)	(2)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	59	0.158	
期中の平均基準価額は、36,722円です。			

(注) 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・解約により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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

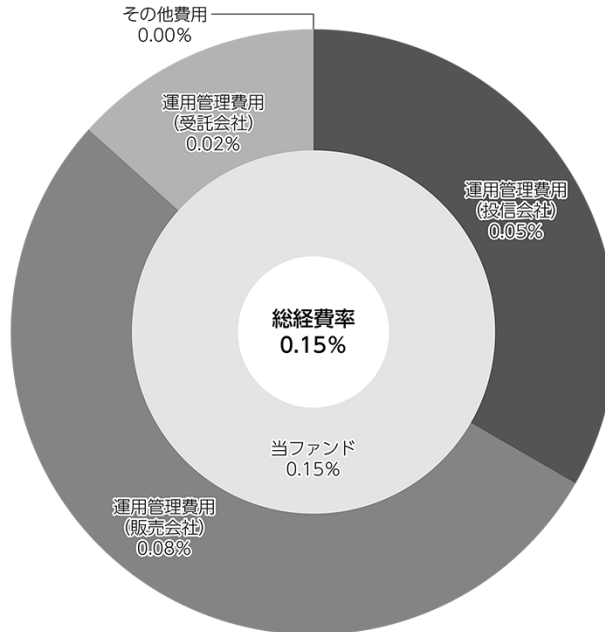
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（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除く。）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0.15%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 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) 「その他費用」には保管費用が含まれる場合があります。なお、「その他費用」の内訳は「1万口当たりの費用明細」にてご確認ください。ただし、期中の費用の総額と年率換算した値は一致しないことがあります。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年11月7日～2024年11月6日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	千口 379,485	千円 1,023,394	千口 268,844	千円 729,299

○株式売買比率

(2023年11月7日～2024年11月6日)

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	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	15,762,741千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	58,807,256千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.26	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2023年11月7日～2024年11月6日)

利害関係人の発行する有価証券等

<インデックスファンド日本株式（DC専用）>

該当事項はございません。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 14	百万円 14	百万円 196

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三井住友トラストグループ株式会社です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2023年11月7日～2024年11月6日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2023年11月7日～2024年11月6日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年11月6日現在)

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当	期	末
		口数	口数	口数	評価額
		千口	千口	千口	千円
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド		1,836,216	1,946,857		5,539,589

(注) 親投資信託の2024年11月6日現在の受益権総口数は、21,979,468千口です。

○投資信託財産の構成

(2024年11月6日現在)

項	目	当	期	末
		評価額	比率	率
		千円		%
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド		5,539,589		99.8
コール・ローン等、その他		13,281		0.2
投資信託財産総額		5,552,870		100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年11月6日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,552,870,434
コール・ローン等	11,361,081
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド(評価額)	5,539,589,252
未収入金	1,920,029
未収利息	72
(B) 負債	12,737,563
未払解約金	8,510,085
未払信託報酬	4,110,108
その他未払費用	117,370
(C) 純資産総額(A-B)	5,540,132,871
元本	1,460,073,836
次期繰越損益金	4,080,059,035
(D) 受益権総口数	1,460,073,836口
1万口当たり基準価額(C/D)	37,944円

(注) 当ファンドの期首元本額は1,374,310,081円、期中追加設定元本額は479,465,912円、期中一部解約元本額は393,702,157円です。

(注) 1口当たり純資産額は3,7944円です。

○損益の状況（2023年11月7日～2024年11月6日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	11,908
受取利息	12,156
支払利息	△ 248
(B) 有価証券売買損益	673,207,158
売買益	808,355,674
売買損	△ 135,148,516
(C) 信託報酬等	△ 8,023,976
(D) 当期損益金(A+B+C)	665,195,090
(E) 前期繰越損益金	844,736,980
(F) 追加信託差損益金	2,570,126,965
(配当等相当額)	(2,920,336,298)
(売買損益相当額)	(△ 350,209,333)
(G) 計(D+E+F)	4,080,059,035
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	4,080,059,035
追加信託差損益金	2,570,126,965
(配当等相当額)	(2,921,384,943)
(売買損益相当額)	(△ 351,257,978)
分配準備積立金	1,509,932,070

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 分配金の計算過程（2023年11月7日～2024年11月6日）は以下の通りです。

項 目	2023年11月7日～ 2024年11月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	120,223,511円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	544,971,579円
c. 信託約款に定める収益調整金	2,921,384,943円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	844,736,980円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	4,431,317,013円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	30,349円
g. 分配金	0円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	0円
-----------------	----

○お知らせ

約款変更について

2023年11月7日から2024年11月6日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

運用報告書

第25期（決算日 2024年10月28日）
（2023年10月27日～2024年10月28日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1999年10月29日から原則無期限です。
運用方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、「TOPIX（東証株価指数）配当込み」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主としてわが国の株式に投資し、「TOPIX（東証株価指数）配当込み」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数等先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		TOPIX (東証株価指数) 配当込み (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	騰落	騰落率	騰落	騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
21期(2020年10月26日)	15,382	0.7	2,525.98	0.6	98.9	1.1	33,867
22期(2021年10月26日)	19,593	27.4	3,215.34	27.3	98.2	1.8	41,752
23期(2022年10月26日)	19,126	△ 2.4	3,137.97	△ 2.4	98.6	1.3	43,751
24期(2023年10月26日)	22,755	19.0	3,731.91	18.9	98.7	1.3	49,957
25期(2024年10月28日)	27,840	22.3	4,564.71	22.3	98.7	1.3	60,942

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		TOPIX (東証株価指数) 配当込み (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落	騰落率	騰落	騰落率		
(期首) 2023年10月26日	円	%		%	%	%
	22,755	—	3,731.91	—	98.7	1.3
10月末	23,059	1.3	3,781.64	1.3	98.7	1.3
11月末	24,306	6.8	3,986.65	6.8	98.8	1.2
12月末	24,253	6.6	3,977.63	6.6	99.5	0.5
2024年1月末	26,149	14.9	4,288.36	14.9	99.6	0.3
2月末	27,438	20.6	4,499.61	20.6	99.6	0.4
3月末	28,655	25.9	4,699.20	25.9	98.7	1.4
4月末	28,400	24.8	4,656.27	24.8	98.7	1.4
5月末	28,724	26.2	4,710.15	26.2	98.3	1.6
6月末	29,142	28.1	4,778.56	28.0	98.6	1.4
7月末	28,983	27.4	4,752.72	27.4	98.9	1.2
8月末	28,146	23.7	4,615.06	23.7	99.7	0.2
9月末	27,715	21.8	4,544.38	21.8	98.6	1.4
(期末) 2024年10月28日	27,840	22.3	4,564.71	22.3	98.7	1.3

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2023年10月27日～2024年10月28日)

基準価額の推移

期間の初め22,755円の基準価額は、期間末に27,840円となり、騰落率は+22.3%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

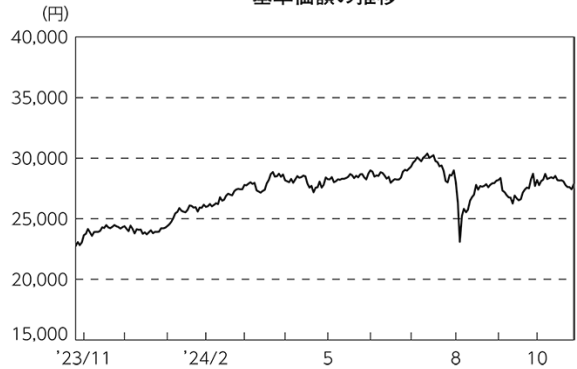
<値上がり要因>

- ・米国連邦公開市場委員会（FOMC）の結果を受けて米国連邦準備制度理事会（FRB）が2024年に利下げに動くことが期待されたこと。
- ・国内企業の好調な業績を受けて海外の投資家が日本株式への関心を高めていたこと。
- ・米国の大手半導体企業の好決算などを背景として半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったこと。

<値下がり要因>

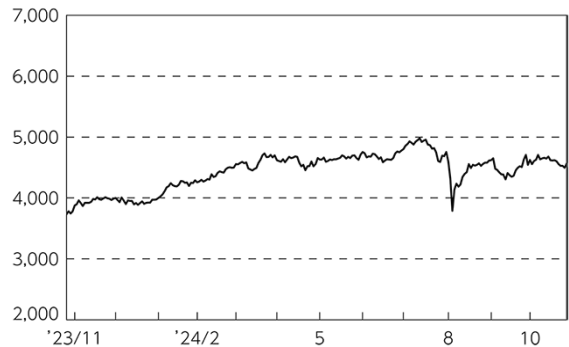
- ・中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念が強まったこと。
- ・新首相が衆議院の解散・総選挙を表明し政治的不透明感が高まったこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2023/10/26	2024/07/11	2023/10/30	2024/10/28
22,755円	30,383円	22,829円	27,840円

TOPIX（東証株価指数）配当込みの推移



（株式市況）

国内株式市場では、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、期間の初めと比べて上昇しました。

期間の初めから2024年7月上旬にかけては、中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどが株価の重しとなったものの、FOMCの結果を受けてFRBが2024年に利下げに動くことが期待されたことや、国内企業の好調な業績を受けて海外の投資家が日本株式への関心を高めていたこと、米国の大手半導体企業の好決算などを背景として半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったこと、円安／アメリカドル高が進行し輸出企業の好調な業績が期待されたことなどが支援材料となり、ＴＯＰＩＸは上昇しました。7月中旬から期間末にかけては、FRBが利下げを開始し米国経済の下支えになるとの期待感が強まったことや、日銀総裁の金融政策決定会合後の記者会見での発言から早期の追加利上げ観測が後退したことなどが上昇要因となったものの、日銀が金融政策決定会合において利上げを決定したことを受けて円高／アメリカドル安が進み、輸出関連企業の業績への期待が一時後退したことや、米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念が強まったこと、新首相が衆議院の解散・総選挙を表明し政治的不透明感が高まったことなどが重しとなり、ＴＯＰＩＸは下落しました。

ポートフォリオ

ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込みに連動する投資成果を目標とし、「バラ日本株式モデル」に基づいてポートフォリオを構築しました。また、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、22.3%の値上がりとなり、ベンチマークである「ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込み」の上昇率22.3%と概ね同水準となりました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<マイナス要因>

- ・売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○今後の運用方針

引き続き、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込みとの連動をめざし、原則として「バラ日本株式モデル」に基づいて構築したポートフォリオによる運用を継続します。また、一定期間ごとにポートフォリオの見直しなどを行ない、株式先物取引を含めた実質の株式組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○1万口当たりの費用明細

(2023年10月27日～2024年10月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	0 (0) (0)	0.000 (0.000) (0.000)	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、27,080円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2023年10月27日～2024年10月28日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 3,758 (5,900)	千円 7,855,363 (464)	千株 3,610	千円 6,999,679

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()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。

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 — (1,300)	千円 — (ー)	証券 — (1,300)	千円 — (ー)	

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は新株予約権の付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

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 6,034	百万円 5,937	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2023年10月27日～2024年10月28日)

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	14,855,042千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	57,898,919千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.25

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2023年10月27日～2024年10月28日)

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 15	百万円 11	百万円 187

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三井住友トラストグループ株式会社です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年10月27日～2024年10月28日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2024年10月28日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	0.8	0.9	3,753
ニッセイ	21.9	22.6	20,459
マルハニチロ	3.3	3.3	9,797
雪国まいたけ	1.8	1.9	1,976
カネコ種苗	0.7	0.8	1,112
サカタのタネ	2.5	2.5	8,775
ホクト	1.9	1.8	3,254
ホクリヨウ	0.2	0.3	306
鉱業 (0.3%)			
住石ホールディングス	2.3	3.2	3,088
日鉄鉱業	0.9	0.9	3,924
三井松島ホールディングス	1	—	—
INPEX	80.9	68.3	133,970
石油資源開発	2.5	12.9	14,331
K&Oエナジーグループ	1	1	3,160
建設業 (2.1%)			
ショーボンドホールディングス	3	3	15,981
ミライト・ワン	7.3	6.8	14,450
タマホーム	—	1.4	5,285
サンヨーホームズ	0.3	—	—
日本アクア	0.7	0.4	317
ファーストコーポレーション	0.5	—	—
ベステラ	0.4	—	—
キャンディル	0.4	0.4	209
ダイセキ環境ソリューション	0.4	0.3	375
第一カッター興業	0.6	0.6	879
安藤・間	12.7	13	14,378
東急建設	6.3	7	4,809
コムシスホールディングス	7	7.2	22,176
ピーアールホールディングス	3.7	3.3	1,151
高松コンストラクショングループ	1.5	1.7	4,943
東建コーポレーション	0.6	0.6	6,372
ソネック	0.2	—	—
ヤマウラ	1.2	1.2	1,431
オリエンタル白石	8.2	8.2	3,107
大成建設	14.3	14.5	92,336

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大林組	54.8	56.4	105,750
清水建設	43.5	44.7	43,671
飛島建設	1.8	—	—
長谷工コーポレーション	15.8	14.5	26,687
松井建設	1.6	1.4	1,190
銭高組	0.2	—	—
鹿島建設	34	35	91,157
不動テトラ	1.1	1.1	2,290
大未建設	0.4	—	—
鉄建建設	1.1	1.1	2,625
西松建設	2.6	3	14,865
三井住友建設	12.6	11.7	4,551
大豊建設	0.7	0.5	1,702
ナカノフドー建設	1	—	—
奥村組	2.5	2.6	10,972
東鉄工業	2.1	2	6,470
イチケン	0.3	0.1	243
富士ビー・エス	0.7	—	—
淺沼組	1.3	5.9	3,864
戸田建設	18.9	21.3	19,125
熊谷組	2.6	2.6	9,165
北野建設	0.2	0.1	395
植木組	0.3	0.2	296
矢作建設工業	2.2	2.1	3,147
ビーエス・コンストラクション	2.1	2	1,974
日本ハウスホールディングス	3.5	3.3	1,115
新日本建設	2.2	2.2	3,370
東亜道路工業	0.6	3	3,774
日本道路	1.6	1.9	2,929
東亜建設工業	1.3	4.8	4,694
日本国土開発	4.5	4.5	2,290
若築建設	0.7	0.5	1,760
東洋建設	5	4	5,192
五洋建設	21.8	22.3	13,953
世紀東急工業	—	2	2,930
福田組	0.6	0.6	3,486
住友林業	13.2	13.6	82,048

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本基礎技術	0.8	—	—
巴コーポレーション	1.3	0.6	499
大和ハウス工業	42.3	43.6	198,380
ライト工業	2.9	2.9	6,397
積水ハウス	46.5	47.8	178,198
日特建設	1.6	1.5	1,513
北陸電気工事	1.2	1.1	1,298
ユアテック	3.4	3.5	5,099
日本リーテック	1.4	1.3	1,328
四電工	0.7	2.1	2,614
中電工	2.4	2.5	7,900
関電工	8.4	9.9	20,334
きんでん	10.8	11	34,276
東京エネシス	1.6	1.5	1,681
トーエネック	0.5	2.5	2,232
住友電設	1.5	1.5	6,817
日本電設工業	2.6	3	5,484
エクシオグループ	7.1	15.5	23,846
新日本空調	0.9	1	3,340
九電工	3.7	3.4	20,502
三機工業	3.4	3.3	7,857
日揮ホールディングス	15.2	15.6	20,124
中外炉工業	0.6	0.5	1,301
ヤマト	1	0.4	362
太平電業	1	1	5,050
高砂熱学工業	3.7	4.2	19,824
三晃金属工業	0.1	0.1	390
朝日工業社	0.7	1.5	1,920
明星工業	2.7	3.1	3,937
大気社	1.8	1.8	8,505
ダイダン	2.1	2.1	6,058
日比谷総合設備	1.3	1.1	3,811
飛鳥ホールディングス	—	1.6	2,456
フィル・カンパニー	0.4	—	—
テスホールディングス	3.4	3.3	907
インフロニア・ホールディングス	16.1	18.2	20,711
東洋エンジニアリング	2.2	2.4	1,766
レイズネクスト	2.3	2.3	3,539
食料品 (3.2%)			
ニッポン	4.1	4.7	10,213
日清製粉グループ本社	14.2	14.7	25,923

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日東富士製粉	0.3	0.3	2,034
昭和産業	1.3	1.5	4,278
鳥越製粉	0.9	—	—
中部飼料	2.1	2.2	3,062
フィード・ワン	2.2	2.3	1,888
東洋精糖	0.2	0.2	270
日本甜菜製糖	0.9	0.9	2,321
DM三井製糖ホールディングス	1.5	1.6	5,088
塩水港精糖	1.2	1.4	380
ウエルネオシュガー	0.8	0.8	1,752
森永製菓	2.7	6.6	18,532
中村屋	0.4	0.4	1,294
江崎グリコ	4.4	4.5	19,804
名糖産業	0.6	0.6	1,097
井村屋グループ	0.8	0.9	2,193
不二家	1.1	1.1	2,908
山崎製パン	10.3	10.6	27,931
第一屋製パン	0.2	—	—
モロゾフ	0.5	0.5	2,315
亀田製菓	1	0.9	3,825
寿スピリッツ	8.2	7.4	14,681
カルビー	7	7.2	24,328
森永乳業	2.8	5.6	19,471
六甲バター	1.1	1.2	1,740
ヤクルト本社	22	22.6	74,896
明治ホールディングス	18.8	19.4	68,132
雪印メグミルク	3.7	3.8	9,880
プリマハム	2.1	2.1	4,689
日本ハム	6	6.8	35,088
林兼産業	0.3	0.5	229
丸大食品	1.6	1.6	2,632
S F o o d s	1.7	1.8	5,063
柿安本店	0.6	0.6	1,576
伊藤ハム米久ホールディングス	2.3	2.4	9,168
サッポロホールディングス	5.1	5.2	38,105
アサヒグループホールディングス	35.5	118.9	218,716
キリンホールディングス	64	66	152,295
シマダヤ	—	0.5	710
宝ホールディングス	10.5	10.6	12,688
オエノンホールディングス	4.6	5.1	2,101
養命酒製造	0.5	0.5	1,258

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	12	11.2	21,470
ライフドリンク カンパニー	—	1.2	2,116
サントリー食品インターナショナル	10.8	11.2	57,937
ダイドールグループホールディングス	0.9	1.8	5,472
伊藤園	5.2	5.3	17,521
キーコーヒー	1.7	1.8	3,574
ユニカフェ	0.3	0.3	280
ジャパンフーズ	0.2	—	—
日清オイリオグループ	2.2	2.2	11,352
不二製油グループ本社	3.6	3.7	11,810
J-オイルミルズ	1.6	1.8	3,686
キッコーマン	10.2	52.5	94,237
味の素	37.1	37.2	215,388
ブルドックソース	0.8	0.8	1,421
キュービー	8.3	8.5	29,495
ハウス食品グループ本社	4.7	5.3	15,645
カゴメ	6.6	6.8	21,270
焼津水産化学工業	0.4	—	—
アリアケジャパン	1.4	1.6	8,256
ビエトロ	0.2	—	—
エバラ食品工業	0.4	0.4	1,168
やまみ	0.1	0.1	391
ニチレイ	7	7.3	29,988
東洋水産	7.8	8	70,616
イートアンドホールディングス	0.7	0.8	1,745
大冷	0.1	0.2	380
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1	0.7	966
日清食品ホールディングス	5.4	16.7	68,470
永谷園ホールディングス	0.8	—	—
一正蒲鉾	0.4	—	—
フジッコ	1.6	1.6	2,699
ロック・フィールド	1.7	1.9	2,783
日本たばこ産業	93.4	96.3	398,007
ケンコーマヨネーズ	1.1	1.1	2,348
わらべや日洋ホールディングス	1.1	1.1	2,217
なとり	1	1	2,109
イフジ産業	0.2	0.2	276
ファーマフーズ	2.2	2.1	1,843
ユークレナ	9.6	9.8	3,988
紀文食品	1.2	1.4	1,545
ピックルスホールディングス	0.9	0.9	981

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ミヨシ油脂	0.4	—	—
理研ビタミン	1.3	1.4	3,698
繊維製品 (0.4%)			
片倉工業	1.4	1.5	2,995
グンゼ	1.1	1.2	6,408
東洋紡	6.8	7	6,755
ユニチカ	4.8	5.2	1,502
富士紡ホールディングス	0.6	0.7	3,209
倉敷紡績	1.2	1.1	5,098
シキボウ	0.6	1.2	1,214
日本毛織	4.2	4.2	5,271
ダイトウボウ	1.8	—	—
トーア紡コーポレーション	0.4	—	—
ダイドーリミテッド	1.5	0.6	531
帝国繊維	1.7	1.8	4,800
帝人	15	15.4	21,021
東レ	104.7	107.9	89,762
住江織物	0.2	0.1	203
日本フェルト	0.6	—	—
イチカワ	0.1	—	—
日東製網	0.1	—	—
アツギ	0.6	—	—
ダイニック	0.3	—	—
セーレン	3	3.1	7,895
ソトー	0.3	—	—
東海染工	0.1	—	—
小松マテール	2.3	2.4	1,819
ワコールホールディングス	2.8	3	13,860
ホギメディカル	2.1	1.9	8,569
クラウディアホールディングス	0.2	0.4	136
T S I ホールディングス	5.2	4.9	4,380
マツオカコーポレーション	0.3	0.2	347
ワールド	2	2.3	4,489
三陽商会	0.4	0.8	2,124
ナイガイ	0.4	—	—
オンワードホールディングス	10.2	9.5	4,940
ルックホールディングス	0.3	0.5	1,269
ゴールドウイン	2.8	2.9	23,002
デサント	2.7	2.8	12,152
キング	0.4	—	—
ヤマトインターナショナル	0.8	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パルプ・紙 (0.1%)			
特種東海製紙	0.7	0.9	3,366
王子ホールディングス	65.1	67.3	38,004
日本製紙	8.1	9	8,109
三菱製紙	1.3	0.7	342
北越コーポレーション	9.8	7.8	11,840
中越パルプ工業	0.4	0.2	246
大王製紙	6.9	7	6,055
阿波製紙	0.2	—	—
レンゴー	14.2	14.6	13,662
トーモク	0.9	0.9	2,104
ザ・バック	1.2	1.2	4,434
化学 (5.5%)			
北の達人コーポレーション	6.5	6.8	1,054
クラレ	22.8	23.4	47,923
旭化成	97.6	108.9	113,582
共和レザー	0.6	—	—
八川コーポレーション	0.3	—	—
レゾナック・ホールディングス	15.1	14.4	52,329
住友化学	115.9	119.4	47,927
住友精化	0.7	0.8	4,000
日産化学	7.3	7.5	39,172
ラサ工業	0.6	0.6	1,632
クレハ	1.2	3.4	9,526
多木化学	0.6	0.6	2,181
テイカ	1	1.3	2,096
石原産業	2.8	2.7	3,906
片倉コープアグリ	0.2	—	—
日本曹達	1.7	3.8	9,515
東ソー	20.9	21.5	40,581
トクヤマ	5	5.2	14,198
セントラル硝子	2.5	1.7	5,856
東亜合成	7.8	7.7	12,069
大阪ソーダ	0.9	5.5	9,053
関東電化工業	3	3.1	2,976
デンカ	5.7	5.9	12,611
信越化学工業	129.9	144.5	808,188
日本カーバイド工業	0.4	0.9	1,476
堺化学工業	1.2	1.2	3,129
第一稀元素化学工業	1.4	1.8	1,409
エア・ウォーター	14.7	15.2	29,138

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本酸素ホールディングス	15.2	15.7	81,451
日本化学工業	0.5	0.6	1,590
東邦アセチレン	0.2	0.9	300
日本パーカライズジング	7.7	7.1	8,988
高压ガス工業	2.2	2.4	2,145
四国化成ホールディングス	2	1.8	3,409
戸田工業	0.4	0.5	841
ステラ ケミファ	0.9	0.9	3,987
保土谷化学工業	0.4	0.5	2,120
日本触媒	2.4	9.3	15,810
大日精化工業	1.1	1.1	3,213
カネカ	3.6	4	14,876
三菱瓦斯化学	11.7	11.7	30,958
三井化学	12.9	13.3	46,496
J S R	14.6	—	—
東京応化工業	2.5	7.7	26,772
大阪有機化学工業	1.3	1.4	4,054
三菱ケミカルグループ	105.4	117.7	96,784
KHネオケム	2.4	2.9	5,907
ダイセル	21.8	19.9	26,347
住友ペークライト	2.3	4.5	18,049
積水化学工業	31.7	32	68,688
日本ゼオン	9.4	11.1	14,851
アイカ工業	3.9	4.1	13,415
UBE	8	7.7	19,250
積水樹脂	2.2	2.4	5,390
タキロンシーアイ	3.4	—	—
旭有機材	1	1.1	4,471
ニチバン	1	0.9	1,719
リケンテクノス	3.3	3	3,138
大倉工業	0.7	0.8	2,138
積水化成成品工業	2.2	2.3	897
群栄化学工業	0.4	0.4	1,080
タイガースポリマー	0.4	0.4	285
ミライアル	0.3	—	—
ダイキアクシス	0.4	—	—
ダイキョーニシカワ	3.5	3.6	2,264
竹本容器	0.4	—	—
森六ホールディングス	0.8	0.8	1,836
恵和	1.1	1	1,016
日本化薬	11.9	12.2	14,518

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カーリット	1.4	1.8	2,232
日本精化	0.9	1.1	2,543
扶桑化学工業	1.5	1.7	6,290
トリケミカル研究所	2.1	2	6,120
ADEKA	5.4	5.6	15,257
日油	4.8	14.5	35,902
新日本理化学	1.4	—	—
ハリマ化成グループ	0.8	1.2	1,015
花王	35.3	39.2	263,894
第一工業製薬	0.6	0.7	2,142
石原ケミカル	0.7	0.7	1,614
日華化学	0.4	—	—
ニイタカ	0.2	—	—
三洋化成工業	0.9	1	4,090
有機合成薬品工業	0.8	—	—
大日本塗料	1.9	1.8	1,839
日本ペイントホールディングス	82.9	71.2	72,517
関西ペイント	12.5	14	34,216
神東塗料	0.9	—	—
中国塗料	2.5	3.3	7,170
日本特殊塗料	0.7	0.4	452
藤倉化成	2.1	2.2	1,020
太陽ホールディングス	2.4	2.8	10,976
DIC	6.1	5.7	18,536
サカタインクス	3.5	3.6	5,508
artience	3.4	2.9	10,657
T&K TOKA	1.4	—	—
富士フイルムホールディングス	30	89.8	327,590
資生堂	32.7	33.7	112,524
ライオン	20.5	20.5	33,702
高砂香料工業	1.1	1.2	6,024
マンダム	3.4	3.5	4,354
ミルボン	2.1	2.6	8,270
ファンケル	6.8	4	11,164
コーセー	3.2	3.3	27,452
コタ	1.4	1.6	2,622
ポーラ・オルビスホールディングス	8	8.2	12,218
ノエビアホールディングス	1.4	1.4	7,098
アジュバンホールディングス	0.3	—	—
新日本製薬	0.9	0.9	1,549
I-one	—	0.6	1,202

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アクシージア	0.8	1.3	725
エステー	1.2	1.3	1,898
アグロ カネショウ	0.6	0.7	928
コニシ	2.6	4.7	6,110
長谷川香料	3	3.1	10,090
星光PMC	0.7	—	—
小林製薬	4.6	4.2	23,721
荒川化学工業	1.3	1.4	1,793
メック	1.3	1.3	4,732
日本高純度化学	0.4	0.4	1,240
タカラバイオ	4.2	4.4	4,347
JCU	1.8	1.8	5,994
新田ゼラチン	0.7	—	—
OATアグリオ	0.4	0.7	1,297
デクセリアルズ	4.3	12	28,302
アース製薬	1.4	1.5	7,785
北興化学工業	1.6	1.5	1,879
大成ラミック	0.5	0.5	1,299
クミアイ化学工業	6.2	6.5	5,174
日本農薬	2.8	3	1,863
アキレス	1	1	1,491
有沢製作所	2.6	2.8	3,883
日東電工	11.4	51	124,159
レック	2.2	2.1	2,696
三光合成	2	2.1	1,270
きもと	1.4	—	—
ZACROS	1.2	1.3	5,525
前澤化成工業	1	1.1	1,954
未来工業	0.6	0.6	2,091
ウェーブロックホールディングス	0.3	—	—
JSP	1.1	1.1	2,102
エフビコ	3	3.1	8,225
天馬	1.3	1.1	3,191
信越ポリマー	2.9	3.5	5,306
東リ	2.4	1.2	466
ニフコ	5.6	4.8	16,584
バルカー	1.3	1.4	4,557
ユニ・チャーム	32.6	33.6	164,572
ショーエイコーボレーション	0.3	—	—
医薬品 (4.9%)			
協和キリン	18.9	19.5	50,007

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
武田薬品工業	138.5	142.8	590,192
アステラス製薬	147.8	141.5	245,573
住友ファーマ	11.6	11.8	7,221
塩野義製薬	19.7	58.9	124,514
わかもと製薬	1	—	—
日本新薬	3.7	4.2	17,064
中外製薬	49	50.5	396,677
科研製薬	2.7	2.8	10,931
ユーザイ	19	19.6	101,606
ロート製薬	15.1	15.6	52,057
小野薬品工業	30.2	33	64,317
久光製薬	3.5	3.6	15,616
持田製薬	1.8	1.8	6,138
参天製薬	28.5	28.5	51,129
扶桑薬品工業	0.5	0.6	1,449
日本ケミファ	0.1	—	—
ツムラ	4.9	5.1	25,245
キッセイ薬品工業	2.3	2.7	10,003
生化学工業	3	2.7	2,289
栄研化学	2.5	2.8	6,874
鳥居薬品	0.8	0.9	3,487
JCRファーマ	5.3	5.4	3,542
東和薬品	2.4	2.5	7,687
富士製薬工業	1.1	1.2	1,574
ゼリア新薬工業	2.2	2.2	5,077
ネクセラファーマ	5	7.5	8,895
第一三共	136.3	140.6	687,252
杏林製薬	3.4	3.5	5,211
大幸薬品	3.2	3.7	1,420
ダイト	1.2	1.2	2,654
大塚ホールディングス	32.6	40.3	368,745
大正製薬ホールディングス	3.5	—	—
ペプチドリーム	7.5	7.8	21,691
セルソース	—	1.1	1,291
あすか製薬ホールディングス	1.6	1.6	3,400
サワイグループホールディングス	3.6	11.1	22,444
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	14.1	16.2	1,555
ニチレキグループ	1.8	2.1	4,974
ユシロ化学工業	0.8	0.8	1,234
ビービー・カストロール	0.4	0.3	258

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
富士石油	3.3	4.7	1,555
MORESCO	0.3	0.2	240
出光興産	17.3	83.7	84,704
ENEOSホールディングス	265.4	255.3	193,874
コスモエネルギーホールディングス	6.2	4.8	35,726
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	7.9	8.2	25,526
TOYO TIRE	9	9.3	20,157
ブリヂストン	45.8	47.3	260,339
住友ゴム工業	15.3	15.9	25,026
藤倉コンポジット	0.8	1.5	1,779
オカモト	0.8	0.7	3,682
フコク	0.8	0.9	1,565
ニッタ	1.6	1.6	5,864
住友理工	3.1	2.5	3,675
三ツ星ベルト	2.3	1.9	7,334
パンドー化学	2.3	2.4	4,264
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日東紡績	1.8	2	13,800
AGC	14.6	15.7	71,890
日本板硝子	7.9	7.6	2,766
石塚硝子	0.2	0.1	239
日本山村硝子	0.4	0.2	302
日本電気硝子	6.4	6	20,064
オハラ	0.7	0.7	925
住友大阪セメント	2.2	2.7	10,084
太平洋セメント	9.9	9.2	31,298
日本ヒューム	1.4	1.5	1,848
日本コンクリート工業	3	3.1	1,019
三谷セキサン	0.7	0.7	4,298
アジアパイルホールディングス	2.4	2.4	1,905
東海カーボン	14.4	14.8	12,691
日本カーボン	0.8	0.9	3,951
東洋炭素	1.1	1.1	5,742
ノリタケ	0.8	1.8	6,948
TOTO	10.3	10.6	52,194
日本碍子	18.1	18.8	34,968
日本特殊陶業	11.9	13.3	57,549
ダントーホールディングス	0.7	—	—
MARUWA	0.6	0.6	23,580
品川リフラクトリーズ	2.1	2	3,492

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
黒崎播磨	0.3	1.3	2,913
ヨータイ	0.8	0.9	1,494
東京窯業	0.9	—	—
ニッカトー	0.4	—	—
フジミインコーポレーテッド	3.7	4.4	10,133
クニミネ工業	0.3	—	—
ユーアンドエーマテリアル	0.2	0.2	228
ニチアス	3.9	4.1	22,345
ニチハ	2	2	6,800
鉄鋼 (0.8%)			
日本製鉄	72.1	78.7	238,303
神戸製鋼所	32.4	33.4	54,759
中山製鋼所	—	3.8	2,834
合同製鐵	0.8	0.9	3,541
JFEホールディングス	44.8	46.2	85,285
東京製鐵	4.6	4.7	7,557
共英製鋼	1.9	1.9	3,241
大和工業	2.7	3.1	21,393
東京製鋼	0.8	0.7	3,332
大阪製鐵	0.8	0.8	2,624
淀川製鋼所	1.9	1.7	9,180
中部鋼板	1.4	1.1	2,673
丸一鋼管	4.9	5.1	16,595
モリ工業	0.3	0.4	2,024
大同特殊鋼	2	10.4	13,795
日本高周波鋼業	0.6	0.6	234
日本冶金工業	1.2	1.2	5,172
山陽特殊製鋼	1.6	1.6	2,899
愛知製鋼	0.9	1	4,160
日本金属	0.3	—	—
大平洋金属	1.2	1.4	1,929
新日本電工	8.3	9.9	2,871
栗本鐵工所	0.8	0.8	3,048
缸技	0.2	—	—
日本鋳鉄管	0.2	—	—
三菱製鋼	1.1	1.3	1,709
日亜鋼業	1.4	—	—
日本精線	0.2	1.4	1,764
エンビプロ・ホールディングス	0.9	2	1,032
シンニッタン	1.5	—	—
新家工業	0.3	0.1	459

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
非鉄金属 (0.8%)			
大紀アルミニウム工業所	2.3	2.1	2,293
日本軽金属ホールディングス	4.3	4.9	7,771
三井金属鉱業	4.7	4.8	23,313
東邦亜鉛	0.9	—	—
三菱マテリアル	10.7	11.9	29,512
住友金属鉱山	18.7	19.2	81,734
DOWAホールディングス	3.6	4.1	21,311
古河機械金属	2.4	2.2	3,630
エス・サイエンス	7	11.2	246
大阪チタニウムテクノロジーズ	2.4	2.9	6,510
東邦チタニウム	2.9	3.5	3,706
UACJ	2.2	2.3	11,569
CKサンエツ	0.4	0.4	1,432
古河電気工業	5.3	5.5	19,255
住友電気工業	55.6	62.1	143,513
フジクラ	17.2	19.6	99,842
SWCC	1.8	1.9	9,747
タツタ電線	3.3	—	—
カナレ電気	0.2	0.2	282
平河ヒューテック	1	1.1	1,752
リョービ	1.7	1.8	3,382
アーレスティ	1.2	0.6	333
AREホールディングス	6.5	6.3	11,232
金属製品 (0.5%)			
稲葉製作所	0.8	0.9	1,606
宮地エンジニアリンググループ	0.9	1.6	3,184
トーカロ	4.3	4.8	8,467
アルファC o	0.4	—	—
SUMCO	28.6	31.6	47,400
川田テクノロジーズ	0.4	1.2	2,864
RS Technologies	1.1	1.3	5,148
ジェイテックコーポレーション	0.1	—	—
信和	0.6	0.4	293
東洋製罐グループホールディングス	9.6	9.5	21,527
ホクサンホールディングス	0.9	0.8	1,401
コロナ	0.9	1.1	1,036
横河ブリッジホールディングス	2	2.6	6,853
駒井ハルテック	0.2	—	—
高田機工	0.1	—	—
三和ホールディングス	14.8	16.5	60,357

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
文化シャッター	4.6	4.4	7,884
三協立山	1.8	2.1	1,602
アルインコ	1.2	1.3	1,251
東洋シャッター	0.2	0.4	312
L I X I L	23.4	25.9	41,711
日本フィルコン	0.7	—	—
ノーリツ	2.7	2.3	4,041
長府製作所	1.6	1.9	3,676
リンナイ	8.7	7.9	26,749
ダイニチ工業	0.5	—	—
日東精工	2.3	2.5	1,432
三洋工業	0.1	0.1	312
岡部	2.9	3	2,328
ジーテクト	1.8	2.1	3,280
東ブレ	2.8	2.9	5,066
高周波熱錬	2.5	2.5	2,460
東京製綱	1	1.1	1,227
サンコール	0.9	2.2	886
モリテック スチール	0.8	—	—
バイオラックス	2.2	2	4,782
エイチワン	1.7	1.7	1,592
日本発條	14.2	14.7	27,356
中央発條	1.2	1.3	1,635
アドバネクス	0.1	—	—
立川プラインド工業	0.8	0.8	1,035
三益半導体工業	1.2	—	—
機械 (5.5%)			
日本ドライケミカル	0.2	0.1	324
日本製鋼所	4.3	4.5	23,134
三浦工業	6.6	6.8	24,466
タクマ	4.8	5.5	8,607
ツガミ	3.5	3.4	4,838
オークマ	1.6	2.8	8,761
芝浦機械	1.6	1.5	5,542
アマダ	25.1	24.6	36,924
アイダエンジニアリング	3.3	3.6	2,811
TAKI SAWA	0.3	—	—
F U J I	6.8	7.6	17,153
牧野フライス製作所	1.7	1.8	10,440
オーエスジー	6.9	7.1	12,907
ダイジェット工業	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
旭ダイヤモンド工業	4.4	3.7	3,126
DMG森精機	9.5	10.3	29,746
ソディック	3.9	4.3	3,246
ディスコ	7.6	7.8	309,426
日東工器	0.8	0.7	1,760
日進工具	1.3	1.5	1,107
パンチ工業	0.9	—	—
富士ダイス	0.5	1.2	946
豊和工業	0.6	—	—
リケンNPR	1.6	1.8	4,194
東洋機械金属	0.7	—	—
島精機製作所	2.5	2.6	2,914
オプトラン	2.6	2.7	5,154
NCホールディングス	0.2	—	—
イワキポンプ	1	1.1	3,148
フリュー	1.6	1.5	1,624
ヤマシンフィルタ	3.8	3.9	1,805
日阪製作所	1.5	1.8	1,780
やまびこ	2.5	2.7	6,633
野村マイクロ・サイエンス	0.5	2.2	4,686
平田機工	0.8	0.8	3,928
PEGASUS	1.8	1.9	858
マルマエ	0.7	0.7	1,053
タツモ	1	1.2	4,362
ナプテスコ	9.9	10.1	24,805
三井海洋開発	2	2	6,510
レオン自動機	1.7	1.9	2,652
SMC	5.1	4.9	312,767
ホソカワミクロン	1	1.1	4,317
ユニオンツール	0.7	0.7	4,774
瑞光	1.1	1.2	1,623
オイレス工業	2.2	2.2	4,301
日精エー・エス・ビー機械	0.6	0.6	2,709
サトーホールディングス	2.2	2.2	4,655
技研製作所	1.5	1.5	2,613
日本エアータック	0.8	0.9	1,069
カワタ	0.3	—	—
日精樹脂工業	1.2	1.3	1,220
オカダアイオン	0.3	0.2	406
ワイエイシイホールディングス	0.4	0.7	1,519
小松製作所	73.8	76.1	304,780

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友重機械工業	9.3	9.6	32,985
日立建機	6.3	6.5	21,833
日工	2.3	2.4	1,663
巴工業	0.6	0.6	2,292
井関農機	1.5	1.5	1,488
TOWA	1.6	5.4	10,492
丸山製作所	0.2	—	—
北川鉄工所	0.6	0.7	873
ローツェ	0.8	8.4	18,127
タカキタ	0.3	0.3	120
クボタ	82.7	84.8	167,098
荏原実業	0.8	0.8	3,256
三菱化工機	0.5	0.6	2,100
月島ホールディングス	2.1	2.2	2,981
帝国電機製作所	1.1	1.1	3,050
新東工業	3.1	3.3	3,276
澁谷工業	1.5	1.5	5,437
アイチ コーポレーション	2.2	2.2	2,602
小森コーポレーション	3.6	4	4,392
鶴見製作所	1.2	1.2	5,034
酒井重工業	0.2	0.6	1,395
荏原製作所	6.5	33.4	75,751
石井鐵工所	0.1	0.1	833
西島製作所	1.4	1.4	3,866
北越工業	1.6	1.6	2,939
ダイキン工業	18.8	19.4	355,602
オルガノ	2.2	2	13,880
トーヨーカネツ	0.6	0.6	2,625
栗田工業	8.8	9.1	51,378
椿本チエイン	2.2	6.6	12,586
大同工業	0.4	—	—
木村化工機	1.2	1.4	1,024
アネスト岩田	2.7	2.5	3,472
ダイフク	24.4	27.4	78,651
サムコ	0.4	0.4	1,286
加藤製作所	0.5	0.3	366
油研工業	0.2	—	—
タダノ	9	9.3	9,032
フジテック	5.5	3.8	18,460
CKD	4.4	4.5	11,718
平和	5.2	4.8	10,032

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
理想科学工業	1.3	1.3	4,576
SANKYO	3.1	15.6	31,870
日本金銭機械	1.7	2	1,806
マースグループホールディングス	0.9	0.8	2,528
フクシマガリレイ	1.2	1.1	6,050
オーイズミ	0.4	0.4	137
ダイコク電機	0.9	0.8	2,760
竹内製作所	2.9	3	14,370
アマノ	4.5	4.6	20,092
JUKI	2.4	2.6	1,045
サンデン	1.6	—	—
ジャノメ	1.6	1.6	1,451
マックス	1.9	2.3	8,038
グローリー	3.8	3.9	9,711
新晃工業	1.6	1.6	6,976
大和冷機工業	2.4	2.5	3,567
セガサミーホールディングス	12.7	14.5	42,013
TPR	1.8	2.1	4,785
ツバキ・ナカシマ	3.2	4	2,760
ホシザキ	9.3	10.5	53,203
大豊工業	1.4	1.6	1,008
日本精工	26.2	30	20,958
NTN	31	35.1	8,897
ジェイテクト	14	14.4	14,947
不二越	1.2	1.2	3,804
日本トムソン	3.8	4.4	2,103
THK	9.1	9.3	23,561
ユーション精機	1.3	1.5	990
前澤給装工業	1.1	1.2	1,518
イーグル工業	1.8	1.8	3,654
前澤工業	0.6	0.3	354
PILLAR	1.5	1.5	6,390
キッツ	5.3	5.4	5,659
マキタ	19.6	18.5	85,155
三井E&S	7.7	8	8,888
カナデビア	12.9	14.3	15,100
三菱重工業	27.6	284.1	591,496
IHI	9.9	12.1	92,928
サノヤスホールディングス	1.4	—	—
スター精密	3	2.7	5,224

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電気機器 (17.7%)			
日清紡ホールディングス	11.8	12.2	11,785
イビデン	9	8.5	41,684
コニカミノルタ	35.1	36.3	23,152
ブラザー工業	21	21.7	64,752
ミネベアミツミ	27.4	28.3	77,400
日立製作所	76.6	390.5	1,571,372
東芝	30.3	—	—
三菱電機	162.9	178	416,609
富士電機	9.6	9.9	77,447
東洋電機製造	0.3	—	—
安川電機	18.7	17.6	76,859
シンフォニアテクノロジ	1.8	1.8	8,955
明電舎	2.4	3	12,060
オリジン	0.2	—	—
山洋電気	0.7	0.7	6,321
デンヨー	1.2	1.2	2,986
PHCホールディングス	2.2	3.1	3,112
KOKUSAI ELECTRIC	—	8.5	24,386
ソシオネクスト	2.3	11.9	33,962
東芝テック	2.3	2.1	7,056
芝浦メカトロニクス	0.9	0.9	9,585
マブチモーター	3.9	7.2	15,732
ニデック	38.3	71.7	229,655
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1.2	—	—
トレックス・セミコンダクター	0.7	0.8	1,201
東光高岳	0.9	1	1,788
ダブル・スコープ	4.5	4.7	1,635
ダイヘン	1.4	1.6	9,936
ヤーマン	2.8	3.2	2,649
JVCケンウッド	14.3	12.8	15,155
ミマキエンジニアリング	1.6	1.6	2,131
I-PEX	1.1	0.9	1,379
大崎電気工業	3.7	3.5	2,744
オムロン	14.4	12.4	75,875
日東工業	2.1	2.2	6,439
IDEC	2.3	2.4	5,901
正興電機製作所	0.4	0.3	379
不二電機工業	0.2	—	—
ジーエス・ユアサコーポレーション	5.2	6.4	17,507
サクサ	0.2	0.1	238

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
メルコホールディングス	0.4	0.5	1,175
テクノメディカ	0.4	0.5	905
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	0.6	0.9	548
日本電気	22.3	21.3	284,887
富士通	15.7	149.5	444,164
沖電気工業	7.1	7.3	7,321
岩崎通信機	0.5	—	—
電気興業	0.6	0.6	1,182
サンケン電気	1.5	1.5	9,213
ナカヨ	0.2	—	—
アイホン	1	0.9	2,601
ルネサスエレクトロニクス	102.9	123.8	259,918
セイコーエプソン	20.2	20.8	57,522
ワコム	12	11.4	7,695
アルバック	3.7	3.6	25,743
アクセル	0.4	0.8	1,106
EIZO	1.2	2.4	5,270
日本信号	3.5	3.7	3,422
京三製作所	3.3	3.5	1,890
能美防災	2.1	2.2	6,448
ホーチキ	1.2	1.2	2,527
星和電機	0.5	0.5	258
エレコム	3.8	3.9	5,584
パナソニックホールディングス	186.1	192	238,944
シャープ	18.9	27.4	25,939
アンリツ	11.1	11.4	12,665
富士通ゼネラル	4.5	4.6	8,565
ソニーグループ	110.3	563.3	1,519,783
TDK	25	128.6	239,003
帝国通信工業	0.7	0.7	1,822
タムラ製作所	6.7	6.5	3,646
アルプスアルパイン	14	14.5	22,823
池上通信機	0.3	—	—
日本電波工業	1.9	2	2,092
鈴木	0.9	0.9	1,684
メイコー	1.7	1.6	9,728
日本トリム	0.4	0.4	1,412
ローランド ディー・ジー	0.9	—	—
フォスター電機	1.5	1.2	2,088
SMK	0.4	0.4	907
ヨコオ	1.3	1.4	2,172

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ホシデン	3.6	3.7	8,299
ヒロセ電機	2.5	2.4	43,296
日本航空電子工業	3.2	3.9	10,767
TOA	1.8	1.9	1,835
マクセル	3.2	3.6	6,649
古野電気	2.1	2.1	5,130
スミダコーポレーション	2.2	2.2	2,057
アイコム	0.6	0.6	1,716
リオン	0.7	0.7	1,544
横河電機	17.2	17.8	61,659
新電元工業	0.6	0.6	1,422
アズビル	10.9	44.2	52,045
東亜ディーケーケー	0.5	0.4	301
日本光電工業	7.2	13.4	30,223
チノー	0.7	0.7	1,532
共和電業	1	—	—
日本電子材料	1	1	2,493
堀場製作所	3	3.1	28,678
アドバンテス	49.2	46.1	377,144
小野測器	0.4	—	—
エスベック	1.3	1.3	3,416
キーエンス	15.6	16.1	1,068,235
日置電機	0.7	0.9	7,389
シスメックス	13.5	41.6	118,456
日本マイクロニクス	2.8	2.7	10,098
メガチップス	1.3	1.3	7,137
OBARA GROUP	0.8	1	4,175
澤藤電機	0.1	—	—
原田工業	0.5	0.5	270
コーセル	1.9	1.8	2,174
イリソ電子工業	1.4	1.5	3,892
オブテックスグループ	2.9	3	4,878
千代田インテグレ	0.6	0.6	2,043
レーザーテック	7.2	7.4	164,798
スタンレー電気	11	10.1	26,542
ウシオ電機	7.9	7	14,479
岡谷電機産業	0.8	1	229
ヘリオス テクノ ホールディング	1.1	—	—
エノモト	0.3	—	—
日本セラミック	1.3	1.5	3,829
遠藤照明	0.5	0.3	385

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
古河電池	1.2	1.2	1,645
双信電機	0.5	—	—
山一電機	1.3	1.5	3,724
図研	1.4	1.3	4,654
日本電子	3.9	4	21,684
カシオ計算機	11.6	11.4	12,807
ファナック	76.1	77.8	312,444
日本シイエムケイ	3.3	3.9	1,587
エンプラス	0.5	0.5	3,260
大真空	1.9	2.4	1,437
ローム	28.8	29.1	49,775
浜松ホトニクス	12.5	25.9	52,318
三井ハイテック	1.6	7.1	6,007
新光電気工業	5.5	5.7	30,990
京セラ	24.2	99.9	171,778
太陽誘電	7.6	7.9	21,890
村田製作所	142	143.7	399,054
双葉電子工業	3	3.1	1,540
北陸電気工業	0.4	—	—
ニチコン	3.2	4.2	4,086
日本ケミコン	1.5	1.7	1,839
KOA	2.4	2.5	2,670
市光工業	2.8	2.9	1,302
小糸製作所	18.7	16.7	33,575
ミツバ	2.9	3	2,625
SCREENホールディングス	5.3	5.5	54,659
キヤノン電子	1.7	1.5	3,544
キヤノン	77.8	80.2	404,689
リコー	39.1	40.3	66,595
象印マホービン	4.3	4.8	7,560
MUTOHホールディングス	0.1	—	—
東京エレクトロン	33	34	811,240
イノテック	1	1.1	1,619
輸送用機器 (7.5%)			
トヨタ紡織	6.6	6.8	13,416
芦森工業	0.2	0.1	247
ユニプレス	2.8	2.9	3,221
豊田自動織機	11.4	13.8	158,286
モリタホールディングス	2.7	2.8	5,437
三櫻工業	2.4	2.5	1,815
デンソー	128.7	132.7	285,437

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東海理化電機製作所	4.4	4.5	9,067
川崎重工業	11.8	13.1	73,189
名村造船所	2.7	5	8,065
日本車輛製造	0.6	0.5	1,059
三菱ロジスネクスト	2.5	2.6	2,927
近畿車輛	0.2	—	—
日産自動車	221.8	211.5	86,672
いすゞ自動車	45.4	45.1	89,568
トヨタ自動車	856.5	855.3	2,315,297
日野自動車	20.1	24.1	11,049
三菱自動車工業	60.9	62.7	26,804
エフテック	0.8	—	—
レシップホールディングス	0.5	0.5	255
GMB	0.2	—	—
ファルテック	0.2	—	—
武蔵精密工業	3.8	3.9	7,655
日産車体	2.8	1.6	1,633
新明和工業	4.9	4.6	6,154
極東開発工業	2.6	2.7	6,331
トビー工業	1.3	1.3	2,519
ティラド	0.4	0.4	1,372
曙ブレーキ工業	—	9.5	1,149
タチエス	2.5	3	5,328
NOK	6.1	6.3	13,825
フタバ産業	4.2	4.3	3,065
カヤバ	1.5	1.5	7,237
大同メタル工業	3.1	3.2	1,606
プレス工業	7	6.4	3,558
ミクニ	1.3	0.8	256
太平洋工業	3.6	3.7	5,039
アイシン	12	34	57,222
マツダ	51.6	53.2	58,653
今仙電機製作所	0.7	—	—
本田技研工業	380.4	381.2	603,058
スズキ	28.7	118.2	180,846
SUBARU	49.4	49.9	136,451
安永	0.5	0.4	204
ヤマハ発動機	22.5	67.9	89,899
TBK	1.1	—	—
エクセディ	2.6	2.6	9,867
豊田合成	4.5	4.6	11,971

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
愛三工業	2.6	2.7	3,834
盟和産業	0.2	—	—
日本プラスト	0.9	—	—
ヨロズ	1.5	1.5	1,753
エフ・シー・シー	2.8	2.9	6,846
シマノ	6.3	7	163,345
テイ・エス テック	7.1	5.7	9,815
ジャムコ	0.6	0.9	1,120
精密機器 (2.5%)			
テルモ	48	89.7	258,919
クリエートメディック	0.3	—	—
日機装	3.6	4.2	4,221
日本エム・ディ・エム	0.9	1.5	1,000
島津製作所	19	21.4	96,599
JMS	1.5	1.8	864
長野計器	1.1	1.2	2,960
プイ・テクノロジ	0.7	0.8	1,958
東京計器	1.2	1.2	3,552
愛知時計電機	0.6	0.7	1,360
インターアクション	0.8	1	1,082
オーバル	0.9	—	—
東京精密	3.4	3.3	26,499
マニー	6.2	6.4	11,376
ニコン	22.5	23.3	42,872
トプコン	8.2	7.7	11,915
オリンパス	96.1	92.1	246,643
理研計器	1	2.3	9,913
タムロン	1	2.2	9,537
HOYA	33.1	31.7	637,170
シード	0.5	—	—
ノーリツ鋼機	1.5	1.5	5,745
A&Dホロンホールディングス	2.3	2.4	5,217
朝日インテック	17.4	19.6	48,000
シチズン時計	14.3	14.7	13,597
リズム	0.3	—	—
大研医器	0.8	0.6	298
メニコン	5.3	5.5	9,102
シンシア	0.1	0.5	235
松風	0.7	1.4	3,166
セイコーグループ	2.4	2.2	8,514
ニプロ	12.9	13.4	18,820

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
その他製品 (2.6%)			
三井松島ホールディングス	—	1.3	5,681
KYORITSU	1.5	—	—
中本ボックス	0.3	—	—
スノーピーク	2.2	—	—
バラマウントベッドホールディングス	3.6	3.4	8,462
トランザクション	1	1.1	2,765
粧美堂	0.2	0.3	147
ニホンフラッシュ	1.5	1.5	1,326
前田工織	1.3	2.9	5,028
永大産業	1.1	—	—
アートネイチャー	1.6	1.4	1,167
フルヤ金属	—	1.5	5,895
バンダイナムコホールディングス	42.8	43.7	141,063
アイフィスジャパン	0.3	0.3	168
SHOEI	3.5	4.5	10,287
フランスベッドホールディングス	1.8	2.1	2,631
パイロットコーポレーション	2.2	2.5	11,910
萩原工業	1	1.1	1,717
フジシールインターナショナル	3.2	3.3	8,457
タカラトミー	7.1	7.3	28,521
広済堂ホールディングス	0.7	5.2	2,735
エステールホールディングス	0.2	—	—
タカノ	0.4	—	—
プロネクサス	1.3	1.7	2,172
ホクシン	0.7	—	—
ウッドワン	0.3	—	—
大建工業	0.9	—	—
TOPPANホールディングス	19.2	19.2	83,846
大日本印刷	17	33.3	87,246
共同印刷	0.4	0.4	1,356
NISSHA	2.7	2.8	5,163
光村印刷	0.1	—	—
TAKARA & COMPANY	1	1	2,632
アシックス	13.3	59.4	157,707
ツツミ	0.3	0.4	848
ローランド	1.1	1.2	4,620
小松ウオール工業	0.6	1.4	2,102
ヤマハ	9.8	29.3	36,625
河合楽器製作所	0.4	0.5	1,396
クリナップ	1.7	1.8	1,272

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビジョン	9.9	10.2	16,620
キングジム	1.4	1.6	1,366
リンテック	3.1	3.2	10,096
イトーキ	3.2	3.2	4,627
任天堂	98.5	101.6	829,056
三菱鉛筆	2.2	2.2	5,398
タカラスタンダード	2.9	3.3	5,392
ココロ	6.7	8	21,204
ナカバヤシ	1.7	2	1,040
グローブライド	1.3	1.4	2,615
オカムラ	4.7	4.9	9,403
美津濃	1.5	1.6	12,800
電気・ガス業 (1.4%)			
グリムス	—	0.7	1,813
東京電力ホールディングス	140.6	145.1	89,280
中部電力	57.5	59.3	98,882
関西電力	60.3	62.1	153,014
中国電力	24.8	28	28,182
北陸電力	14.7	16.4	14,727
東北電力	38.1	42.4	60,356
四国電力	13.3	15	18,360
九州電力	36	37.1	60,102
北海道電力	15.1	15.5	14,442
沖縄電力	3.7	4.1	4,132
電源開発	11.7	13.2	32,300
エフオン	1	—	—
イーレックス	2.8	2.9	1,838
レノバ	4.2	4.3	3,655
東京瓦斯	33	31.3	100,191
大阪瓦斯	31.6	32.1	101,724
東邦瓦斯	6.1	7	26,047
北海道瓦斯	0.9	5	2,880
広島ガス	3.3	3.6	1,375
西部ガスホールディングス	1.5	1.7	2,964
静岡ガス	3.1	3.7	3,703
メタウォーター	1.8	1.9	3,402
陸運業 (2.3%)			
SBSホールディングス	1.4	1.4	3,480
東武鉄道	17.1	17.6	43,102
相鉄ホールディングス	5.1	5.8	13,197
東急	43.7	45.1	83,683

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
京浜急行電鉄	17.7	19.9	23,472
小田急電鉄	23.6	26.6	42,227
京王電鉄	8.2	7.7	26,164
京成電鉄	10.1	10.4	40,341
富士急行	1.9	2	5,030
東日本旅客鉄道	26.5	88.7	266,632
西日本旅客鉄道	19.9	38.1	101,498
東海旅客鉄道	60.1	62	193,626
西武ホールディングス	18.9	19.4	63,205
鴻池運輸	2.7	2.7	6,677
西日本鉄道	4.1	4.3	9,333
ハマキョウレックス	1.2	5.6	7,050
サカイ引越センター	1.5	1.8	4,363
近鉄グループホールディングス	15.6	16.1	56,913
阪急阪神ホールディングス	20.8	21.4	87,226
南海電気鉄道	7.4	7.1	15,762
京阪ホールディングス	8.6	8.9	24,937
神戸電鉄	0.4	0.4	971
名古屋鉄道	17.2	16.5	27,662
山陽電気鉄道	1.2	1.2	2,433
アルプス物流	1.2	1.3	7,514
ヤマトホールディングス	19.9	19.5	31,297
山九	4	3.9	18,283
丸運	0.5	—	—
丸全昭和運輸	1	1	5,730
センコーグループホールディングス	8.2	8.4	11,650
トナミホールディングス	0.3	0.4	2,440
ニッコンホールディングス	5	9.9	19,037
日本石油輸送	0.1	—	—
福山通運	1.2	1.5	5,767
セイノーホールディングス	8.7	9.1	21,935
エスライングループ本社	0.3	—	—
神奈川中央交通	0.4	0.4	1,330
AZ-COM丸和ホールディングス	3.8	4.1	4,141
C&Fロジホールディングス	1.5	—	—
九州旅客鉄道	11	11.4	45,189
SGホールディングス	29.9	26.9	40,565
NIPPON EXPRESSホールディングス	5.3	6	44,934
海運業 (0.8%)			
日本郵船	41.7	41.6	209,705
商船三井	27.5	34.9	174,116

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎汽船	11.7	36.7	77,547
NSユナイテッド海運	0.9	0.9	4,041
飯野海運	5.8	5.9	7,198
乾汽船	2.1	1.9	2,110
空運業 (0.4%)			
日本航空	38.3	39.4	94,816
ANAホールディングス	42.4	43.7	128,936
バスコ	0.2	0.1	213
倉庫・運輸関連業 (0.1%)			
トランコム	0.4	0.5	5,165
日新	1.2	1.2	5,094
三菱倉庫	3.3	3.8	19,611
三井倉庫ホールディングス	1.5	1.5	10,425
住友倉庫	4.2	4.3	11,386
澁澤倉庫	0.6	0.7	2,205
東陽倉庫	0.2	—	—
日本トランスシティ	3.1	3.2	2,940
ケイヒン	0.2	—	—
中央倉庫	0.8	0.9	1,459
川西倉庫	0.2	0.3	320
安田倉庫	1.1	1.1	1,845
ファイズホールディングス	0.2	0.3	252
東洋埠頭	0.3	—	—
上組	7.5	7.4	23,620
サンリツ	0.3	—	—
キムラユニティ	0.5	0.3	438
キューソー流通システム	0.5	1.1	2,036
東海運	0.7	—	—
エーアイテイ	1	1	1,772
内外トランスライン	0.6	0.6	1,688
日本コンセプト	0.6	0.6	1,070
情報・通信業 (7.5%)			
NECネットエスアイ	5.2	6.3	16,852
クロスキャット	0.9	1	1,087
システナ	26.4	24.4	8,784
デジタルアーツ	1	1	5,080
日鉄ソリューションズ	2.7	5.5	19,030
キューブシステム	1	1	981
コア	0.7	0.7	1,353
手間いらず	0.3	0.3	982
ラクーンホールディングス	1.4	1.5	1,117

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソリトンシステムズ	0.8	1	1,267
ソフトクリエイトホールディングス	1.3	1.3	2,618
T I S	17.1	17	63,274
テクミラホールディングス	0.5	—	—
グリー	4.3	5.4	2,511
GMOベバボ	0.2	—	—
コーエーテクモホールディングス	9.8	10	15,400
三菱総合研究所	0.8	0.8	3,356
ボルテージ	0.4	—	—
電算	0.1	0.1	140
AGS	0.5	0.3	243
ファインデックス	1.3	1.3	1,105
ブレインパッド	—	1.3	1,041
KL a b	3	4.6	805
ポルトトゥウィンホールディングス	2.8	2.8	1,274
ネクソン	34.9	35.4	94,093
アイスタイル	4.7	5.3	2,305
エムアップホールディングス	1.9	2	2,552
エイチーム	1	—	—
エニグモ	2.1	2.4	744
テクノスジャパン	0.9	0.5	314
e n i s h	0.9	—	—
コロブラ	6.1	5.4	2,808
ブロードリーフ	7.4	6.5	3,757
クロス・マーケティンググループ	0.7	0.5	340
デジタルハーツホールディングス	1	1.2	964
システム情報	1.3	—	—
メディアドゥ	0.7	0.7	896
じげん	4.6	4.7	2,683
ブイキューブ	2	—	—
エンカレッジ・テクノロジー	0.3	—	—
サイバーリンクス	0.4	—	—
フィックスターズ	1.8	1.6	2,297
CARTA HOLDINGS	0.8	0.9	1,278
オブティム	1.3	1.6	928
セレス	0.7	0.8	1,130
SHIFT	1	1.1	16,115
ティーガイア	1.7	1.7	4,535
セック	0.2	0.2	795
テクマトリックス	2.9	2.9	6,374
プロシップ	0.7	0.8	1,200

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4.1	4	13,200
GMOペイメントゲートウェイ	3.1	3.7	31,993
ザッパラス	0.3	—	—
システムリサーチ	0.5	1.1	1,494
インターネットイニシアティブ	8.5	7.7	21,852
さくらインターネット	1.8	2	8,710
ヴェインクス	0.3	—	—
GMOグローバルサイン・ホールディングス	0.5	0.5	1,367
SRAホールディングス	0.8	0.8	3,372
システムインテグレータ	0.4	0.4	129
朝日ネット	1.7	1.9	1,193
eBASE	2.2	2.3	1,455
アバントグループ	2	2	4,244
アドソル日進	0.7	0.8	1,450
ODKソリューションズ	0.3	—	—
フリービット	0.9	0.8	973
コムチュア	2.1	2.3	4,250
サイバーコム	0.2	—	—
アステリア	1.3	1.6	804
アイル	0.8	0.9	2,857
マークライنز	0.9	0.9	2,462
メディカル・データ・ビジョン	1.9	2.1	1,106
g u m i	2.4	3	900
ショーケース	0.3	—	—
モバイルファクトリー	0.3	—	—
テラスカイ	0.7	0.7	1,279
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.9	0.8	1,604
P C I ホールディングス	0.4	0.3	283
アイビーシー	0.2	—	—
ネオジャパン	0.6	0.6	1,136
P R T I M E S	0.4	0.4	619
ラクス	7.4	7.6	15,466
ランドコンピュータ	0.3	0.4	298
ダブルスタンダード	0.6	0.6	961
オーブンドア	1.1	—	—
マイネット	0.4	—	—
アカツキ	0.8	0.8	1,620
ベネフィットジャパン	0.1	0.1	107
U b i c o mホールディングス	0.5	0.6	808
カナミックネットワーク	1.8	2.1	1,131
ノムラシステムコーポレーション	1.4	1.3	146

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
チェンジホールディングス	3.8	3.5	4,221
シンクロ・フード	0.7	0.7	326
オークネット	0.6	0.7	1,733
キャピタル・アセット・プランニング	0.2	—	—
エイトレッド	0.2	0.1	159
マクロミル	3.1	3.1	2,467
ビーグリー	0.2	0.1	140
オロ	0.6	0.7	1,596
ユーザーローカル	0.6	0.7	1,248
テモナ	0.3	—	—
マネーフォワード	3.5	4	20,264
サインポスト	0.5	—	—
Sun Asterisk	1.1	1.2	616
プラスアルファ・コンサルティング	0.6	2	4,244
電算システムホールディングス	0.7	0.7	1,846
Appier Group	5.3	4.9	7,972
ビジョナル	—	1.9	14,877
ソルクシーズ	0.9	0.7	199
フェイス	0.3	—	—
プロトコーポレーション	2	—	—
ハイマックス	0.5	0.6	831
野村総合研究所	31.2	34.9	169,404
サイバネットシステム	1.2	—	—
CEホールディングス	0.6	0.3	122
日本システム技術	0.5	1.5	2,713
インテージホールディングス	1.8	1.8	2,790
東邦システムサイエンス	0.5	0.7	1,009
ソースネクスト	8	7.2	1,432
インフォコム	2	—	—
シンプレクス・ホールディングス	2.7	2.5	5,777
HEROZ	0.6	0.8	1,058
ラクスル	3.8	3.9	4,758
メルカリ	9.5	7.8	16,302
I P S	0.5	0.5	1,180
F I G	1.3	—	—
システムサポート	0.6	0.6	1,084
イーソル	1.2	1.3	924
東海ソフト	0.2	0.1	122
ウイングアーク1st	1.6	1.7	5,338
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	0.5	0.7	555
サーバーワークス	0.3	0.4	938

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東名	0.1	0.2	425
ヴィッツ	0.1	—	—
トピラスシステムズ	0.3	0.2	154
Sansan	5.1	5.3	11,511
Link-Uグループ	0.3	0.3	141
ギフトエイ	1.4	1.4	1,276
メドレー	2.1	1.8	6,975
ベース	0.5	0.8	2,364
JMDC	2.6	2.8	11,662
フォーカスシステムズ	1.2	1.2	1,291
クレスコ	1.2	2.6	3,237
フジ・メディア・ホールディングス	15	15.4	25,756
オービック	5.2	26.9	127,613
ジャストシステム	2.3	2.3	7,843
TDCソフト	1.3	3	3,513
LINEヤフー	222.6	229.4	95,315
トレンドマイクロ	7.4	8.5	68,569
IDホールディングス	1.1	1.1	1,546
日本オラクル	3	3.1	45,895
アルファシステムズ	0.5	0.4	1,276
フューチャー	3.4	4	7,564
CAC Holdings	0.8	1	1,747
SBテクノロジー	0.7	—	—
トーセ	0.3	—	—
オービックビジネスコンサルタント	3.1	2.3	16,380
伊藤忠テクノソリューションズ	4.2	—	—
アイティフォー	2.1	2	2,768
東計電算	0.2	0.5	2,332
エックスネット	0.2	0.1	140
大塚商会	7.8	18.2	61,370
サイボウズ	2.2	2.2	4,488
電通総研	1.9	1.6	8,480
ACCESS	1.9	1.7	2,131
デジタルガレージ	2.8	2.6	7,852
EMシステムズ	2.6	2.6	1,370
ウェザーニューズ	0.5	0.5	2,930
C I J	2.6	4	1,624
ビジネスエンジニアリング	0.2	0.4	1,584
日本エンタープライズ	1.3	—	—
WOWOW	1.2	1.2	1,213
スカラ	1.5	1.7	785

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
インテリジェント ウェイブ	0.6	0.3	255
ANYCOLOR	0.5	2.2	4,736
IMAGICA GROUP	1.4	1.9	978
ネットワンシステムズ	5.8	6.3	21,615
システムソフト	5.9	—	—
アルゴグラフィックス	1.4	1.5	7,605
マーベラス	2.5	2.5	1,415
エイベックス	2.7	2.7	4,120
BIPROGY	5.7	4.9	23,137
都築電気	0.8	0.8	2,046
TBSホールディングス	8	8.1	30,253
日本テレビホールディングス	13.8	14.2	32,688
朝日放送グループホールディングス	1.5	1.5	927
テレビ朝日ホールディングス	3.8	3.9	7,694
スカパーJ SATホールディングス	13.8	12.4	10,676
テレビ東京ホールディングス	1.1	1.2	4,032
日本BS放送	0.4	—	—
ビジョン	2.4	2.4	2,510
スマートバリュー	0.3	—	—
U-NEXT HOLDINGS	1.8	1.8	8,649
日本通信	14.8	15.6	2,215
クロップス	0.2	0.2	194
日本電信電話	5,011.8	4,798.8	704,463
KDDI	120.9	118.7	565,486
ソフトバンク	251.6	2,579.9	485,537
光通信	1.8	1.6	49,600
エムティーアイ	1.1	1.2	1,354
GMOインターネットグループ	5.8	5.3	13,615
ファイバーゲート	0.7	0.8	808
アйдママーケティングコミュニケーション	0.3	—	—
KADOKAWA	8.3	8.5	27,608
学研ホールディングス	2.6	2.9	2,865
ゼンリン	2.7	2.7	2,238
昭文社ホールディングス	0.5	—	—
インプレスホールディングス	1.1	—	—
アイネット	1	1	1,551
松竹	0.9	0.8	8,412
東宝	9.8	8.9	51,913
東映	0.4	2.7	13,108
NTTデータグループ	49.1	42.1	100,997
ピー・シー・エー	0.9	0.9	1,864

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ビジネスブレイン太田昭和	0.7	0.6	1,110
DTS	3.3	3.2	12,416
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7.9	7.3	42,953
シーイーシー	2.2	2	3,592
カプコン	15.5	28.8	95,760
アイ・エス・ビー	0.8	0.7	1,014
ジャステック	1	—	—
SCSK	12.8	11.2	31,376
NSW	0.6	0.7	2,085
アイネス	1.1	1.3	2,031
TKC	2.5	2.9	11,339
富士ソフト	3.1	4.5	41,535
NSD	5.6	5.7	18,183
コナミグループ	6.7	6.1	84,790
福井コンピュータホールディングス	1.1	1	2,683
JBC Cホールディングス	1.2	1.1	4,229
ミロク情報サービス	1.4	1.5	2,772
ソフトバンクグループ	77.2	79.6	717,116
卸売業 (7.2%)			
リョーサン菱洋ホールディングス	—	3.2	8,153
高千穂交易	0.4	0.7	2,828
オルパヘルスケアホールディングス	0.2	0.2	403
伊藤忠食品	0.4	0.4	2,812
エレマテック	1.5	1.5	2,545
あらた	1.3	2.6	8,918
トーマンデバイス	0.2	0.2	1,186
東京エレクトロン デバイス	1.8	1.7	5,848
円谷フィールズホールディングス	2.9	2.8	6,008
双日	16.5	18.9	61,595
アルフレッサ ホールディングス	16.6	17	37,170
横浜冷凍	4.5	4.3	3,956
神栄	0.2	0.2	325
ラサ商事	0.5	0.9	1,260
アルコニクス	2.2	2.2	2,983
神戸物産	12.8	13.1	49,806
ハイパー	0.3	—	—
あい ホールディングス	2.7	2.7	6,282
ディーブイエックス	0.3	—	—
ダイワボウホールディングス	6.8	7.6	20,573
マクニカホールディングス	3.9	12	23,562
ラクト・ジャパン	0.6	0.7	1,878

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
グリムス	0.7	—	—
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2.1	2.6	3,320
八洲電機	1.3	1.4	2,395
メディアスホールディングス	1.1	1.2	1,034
レスター	1.6	1.4	3,668
ジオリーブグループ	0.3	0.3	322
大光	0.5	0.5	309
OCHIホールディングス	0.3	0.2	266
TOKAIホールディングス	8.2	9.2	8,528
黒谷	0.4	—	—
Cominix	0.3	—	—
三洋貿易	1.9	1.7	2,453
ビューティガレージ	0.3	0.6	886
ウイン・パートナーズ	1.2	1.1	1,325
ミタチ産業	0.3	—	—
シップヘルスケアホールディングス	5.9	6.1	14,133
明治電機工業	0.6	0.7	957
デリカフーズホールディングス	0.5	0.4	206
スターティアホールディングス	0.2	0.2	382
コマダホールディングス	4.1	4.2	11,928
ビーバンドットコム	0.2	—	—
アセンテック	0.6	0.9	588
富士興産	0.3	—	—
協栄産業	0.1	—	—
フルサト・マルカホールディングス	1.5	1.4	3,063
ヤマエグループホールディングス	1	1.5	2,835
小野建	1.7	1.7	2,529
南陽	0.2	0.3	328
佐島電機	0.7	1.2	2,264
エコートレーディング	0.2	0.2	182
伯東	1	1	4,455
コンドーテック	1.3	1.3	1,636
中山福	0.7	—	—
ナガイレーベン	2.1	2.2	4,903
三菱食品	1.5	1.6	7,736
松田産業	1.3	1.3	4,082
第一興商	6.4	6.6	12,332
メディバルホールディングス	15.8	17.2	41,770
SPK	0.7	0.7	1,427
萩原電気ホールディングス	0.7	0.7	2,338
アズワン	2.4	5.3	15,036

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スズデン	0.6	0.6	1,070
シモジマ	1.2	1.1	1,437
ドウシシャ	1.7	1.6	3,424
小津産業	0.3	—	—
高速	0.9	1	2,554
たけびし	0.7	0.7	1,447
リックス	0.2	0.4	1,051
丸文	1.5	1.5	1,564
ハビネット	1.4	1.4	5,551
橋本総業ホールディングス	0.7	0.8	991
日本ライフライン	4.9	4.6	5,405
タカショー	1.5	1.8	889
IDOM	5	4.5	4,536
進和	1	1	2,650
エスケイジャパン	0.3	0.2	132
ダイトロン	0.7	0.7	1,974
シークス	2.4	2.4	2,673
田中商事	0.4	—	—
オーハシテクニカ	0.8	0.9	1,548
白銅	0.6	0.5	1,183
ダイコー通産	0.1	0.1	119
伊藤忠商事	100.1	114.4	862,461
丸紅	127.8	141.1	331,373
高島	0.8	0.4	482
長瀬産業	7.6	7.6	23,575
蝶理	0.9	1.1	4,240
豊田通商	14.5	44.7	119,192
三共生興	2.3	2.3	1,352
兼松	6.4	7	16,198
ツカモトコーポレーション	0.2	—	—
三井物産	115.5	255	803,760
日本紙パルプ商事	0.9	7.9	5,269
カメイ	1.8	1.8	3,439
東都水産	0.1	—	—
OUGホールディングス	0.2	0.1	248
スターゼン	1.3	1.2	3,480
山善	4.5	5.2	6,801
椿本興業	0.3	1	1,862
住友商事	99.9	101.9	333,314
内田洋行	0.7	0.7	4,564
三菱商事	100.6	326.8	916,674

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一実業	1.8	1.6	3,705
キヤノンマーケティングジャパン	3.8	4	17,980
西華産業	0.7	0.7	2,688
佐藤商事	1.2	1.2	1,654
菱洋エレクトロ	1.4	—	—
東京産業	1.5	1.6	1,092
エアサ商事	1.4	1.3	6,038
神鋼商事	0.4	0.4	2,492
トルク	0.6	—	—
阪和興業	3	3.1	15,531
正栄食品工業	1.1	1.1	4,911
カナデン	1.1	1.3	1,939
RYODEN	1.4	1.4	3,458
岩谷産業	3.8	15.5	30,713
ナイス	0.3	0.2	317
ニチモウ	0.1	0.2	365
極東貿易	1	1	1,471
アステナホールディングス	3.1	3.2	1,644
三愛オブリ	4.4	4	7,416
稲畑産業	3.3	3.3	10,659
G S Iクレオス	1	0.9	1,800
明和産業	2.2	2	1,282
クワザワホールディングス	0.4	—	—
ワキタ	3.1	2.8	4,407
東邦ホールディングス	4.1	4.6	20,966
サンゲツ	4.2	3.9	10,799
ミツウロコグループホールディングス	2.2	2.2	3,726
シナネンホールディングス	0.5	0.5	3,150
伊藤忠エネクス	4.1	4.2	6,493
サンリオ	4.7	13.8	56,235
サンワテクノス	0.8	0.9	1,730
リョーサン	1.8	—	—
新光商事	2.3	2.3	2,157
トーホー	0.7	0.7	1,868
三信電気	0.7	0.7	1,408
東陽テクニカ	1.7	1.6	2,534
モスフードサービス	2.4	2.5	8,900
加賀電子	1.3	3.2	8,947
ソーダニッカ	0.8	1.8	2,080
立花エレテック	1.2	1.1	2,757
フォーバル	0.7	0.8	1,098

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
PAL TAC	2.6	2.3	9,729
三谷産業	3	2.9	925
太平洋興発	0.4	—	—
西本Wismettacホールディングス	0.4	1	1,324
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.1	0.1	216
コア商事ホールディングス	1	1.5	906
K P Pグループホールディングス	3.9	4.4	2,895
ヤマタネ	0.7	0.7	2,261
丸紅建材リース	0.1	—	—
泉州電業	0.8	1.2	5,622
トラスコ中山	3.5	3.6	8,233
オートバックスセブン	5.8	5.9	8,386
モリト	1.2	1.3	1,818
加藤産業	2.1	2.1	8,641
北恵	0.3	—	—
イエローハット	3	2.7	6,671
J Kホールディングス	1.3	1.3	1,358
日伝	1	1.1	3,437
北沢産業	0.7	—	—
杉本商事	0.7	1.6	2,214
因幡電機産業	4.3	4.4	16,368
東テク	0.6	1.7	4,338
ミスミグループ本社	24.9	25.7	68,194
アルテック	0.6	—	—
タキヒヨー	0.3	—	—
蔵王産業	0.2	0.1	245
スズケン	4.8	6.1	30,073
ジェコス	1	1	873
グローセル	1.4	—	—
小売業 (4.5%)			
ローソン	4.1	—	—
サンエー	1.3	2.6	7,529
カワチ薬品	1.3	1.3	3,272
エービーシー・マート	7.2	7.4	22,259
ハードオフコーポレーション	0.5	0.7	1,335
アスクル	3.4	4.1	7,995
ゲオホールディングス	1.6	1.9	2,920
アダストリア	2	2.1	7,350
ジーフット	0.9	—	—
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	0.2	0.3	160
くら寿司	1.9	2	7,940

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キャンドゥ	0.6	0.6	1,914
I Kホールディングス	0.4	—	—
パルグループホールディングス	3.3	3.4	10,285
エディオン	6.5	6.8	11,832
サーラコーポレーション	3.5	3.6	3,110
ワッツ	0.6	—	—
ハローズ	0.8	0.8	3,388
フジオフードグループ本社	1.9	1.9	2,608
あみやき亭	0.4	1.2	1,986
ひらまつ	2.5	—	—
大黒天物産	0.5	0.5	5,120
ハニーズホールディングス	1.3	1.5	2,547
ファーマライズホールディングス	0.3	0.3	187
アルベン	1.4	1.4	2,842
ハブ	0.4	0.4	296
クオールホールディングス	2.3	2.3	3,194
ジンズホールディングス	1	1.3	7,943
ビックカメラ	8.8	10.1	16,543
DCMホールディングス	9.6	8.7	12,406
ベッパーフードサービス	3.7	—	—
Monotaro	23.4	24.1	55,381
東京一番フーズ	0.3	0.4	199
J. フロント リテイリング	20.5	19.5	31,297
ドトール・日レスホールディングス	3	3	6,666
マツキヨココカラ&カンパニー	30	30.9	63,592
ブロンコビリー	1	1	3,670
ZOZO	10.9	10.9	53,987
トレジャー・ファクトリー	0.7	1.2	1,600
物語コーポレーション	2.8	3	10,680
三越伊勢丹ホールディングス	27.8	28.2	65,184
Hamee	0.6	0.9	922
マーケットエンタープライズ	0.1	—	—
ウエルシアホールディングス	8.6	8.8	17,045
クリエイトSDホールディングス	2.7	2.4	7,236
丸善CHIホールディングス	1.4	0.9	288
ミサワ	0.2	—	—
ティーライフ	0.2	0.2	232
チムニー	0.4	—	—
シュッピン	1.3	1.6	1,689
オイシックス・ラ・大地	2.3	2.3	3,017
ネクステージ	3.8	3.9	5,545

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジョイフル本田	4.8	4.7	9,470
エターナルホスピタリティグループ	0.6	0.6	2,142
ホットランド	1.3	1.3	2,904
すかいらくホールディングス	22.6	23.2	54,056
SFPホールディングス	0.9	0.8	1,540
綿半ホールディングス	1.3	1.3	2,193
ヨシックスホールディングス	0.2	0.4	1,320
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5.4	4.8	3,902
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.8	—	—
BEENOS	0.7	1	2,947
あさひ	1.4	1.6	2,408
日本調剤	1.1	1.2	1,675
コスモス薬品	1.6	2.9	21,146
トーエル	0.5	0.4	322
セブン&アイ・ホールディングス	56.9	172.3	392,671
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12.4	11.4	13,725
ツルハホールディングス	3.5	3.6	30,747
サンマルクホールディングス	1.4	1.4	3,215
フェリシモ	0.3	—	—
トリドールホールディングス	4.1	4.8	18,648
TOKYO BASE	1.8	—	—
ウイルプラスホールディングス	0.2	0.2	204
JMホールディングス	1.3	1.3	3,827
サツドラホールディングス	0.5	—	—
アレンザホールディングス	1.3	1.3	1,393
串カツ田中ホールディングス	0.5	0.6	929
パロックジャパンリミテッド	1.1	1.3	988
クスリのアオキホールディングス	1.5	5.7	18,297
力の源ホールディングス	0.6	1.1	1,207
FOOD & LIFE COMPANIES	8.8	9.1	27,086
メディカルシステムネットワーク	1.5	2.3	982
一家ホールディングス	0.3	0.3	200
ジャパンクラフトホールディングス	0.8	—	—
はるやまホールディングス	0.5	—	—
ノジマ	5.4	5	9,840
カッパ・クリエイト	2.6	2.7	4,325
ライトオン	0.9	—	—
良品計画	18	20.2	47,995
バリミキホールディングス	1.4	—	—
アドヴァングループ	1.6	1.5	1,386
アルビス	0.6	0.6	1,623

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コナカ	1.3	—	—
ハウス オブ ローゼ	0.2	0.1	148
G-7ホールディングス	2.1	1.9	3,000
イオン北海道	2.5	5.1	4,508
コジマ	2.8	3.3	3,451
ヒマラヤ	0.4	—	—
コーナン商事	2.2	2.1	7,549
エコス	0.6	0.6	1,256
ワタミ	2	1.9	1,957
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	33.4	34.3	129,173
西松屋チェーン	3.7	3.4	7,582
ゼンショーホールディングス	9	8.6	64,921
幸楽苑	—	1.3	1,626
ハークスレイ	0.4	—	—
サイゼリヤ	2.4	2.5	13,775
VTホールディングス	6.4	6.7	3,055
魚力	0.5	0.6	1,453
フジ・コーポレーション	0.8	0.8	1,484
ユナイテッドアローズ	1.8	2	4,390
ハイデイ日高	2.5	2.5	6,795
京都きもの友禅ホールディングス	0.8	—	—
コロワイド	7.6	8.7	14,568
荳番屋	1.3	6.7	6,934
PLANT	0.3	—	—
スギホールディングス	3.3	10.2	26,586
薬王堂ホールディングス	0.9	0.8	1,764
スクロール	2.5	2.5	2,372
ヨンドシーホールディングス	1.5	1.6	2,939
木曽路	2.5	2.6	5,951
SRSホールディングス	2.8	2.8	3,245
千趣会	3.1	3.6	1,130
リテールパートナーズ	2.5	2.5	3,250
ケーヨー	2.7	—	—
上新電機	1.5	1.7	4,345
日本瓦斯	8.8	8.8	18,678
ロイヤルホールディングス	2.9	3	7,323
東天紅	0.1	—	—
いなげや	1.6	1.7	1,895
チヨダ	1.6	1.7	2,210
ライフコーポレーション	1.5	1.8	5,967
リンガーハット	2.1	2.2	4,961

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
MrMaxHD	2.4	2.2	1,522
AOKIホールディングス	3.1	3.7	4,336
オークワ	2.7	2.5	2,285
コメリ	2.6	2.6	8,541
青山商事	3.6	3.7	4,813
しまむら	1.9	4	31,088
はせがわ	0.6	0.7	212
高島屋	12.5	21.7	26,300
松屋	2.8	2.9	2,427
エイチ・ツー・オー リテイリング	8	8.6	17,741
近鉄百貨店	0.7	0.7	1,477
丸井グループ	12.2	11.2	26,544
アクシアル リテイリング	1.1	4.7	4,173
イオン	56	57.6	217,036
イズミ	2.5	3	9,543
平和堂	2.8	2.9	6,362
フジ	2.6	2.6	5,259
ヤオコー	1.9	2	18,328
ゼビオホールディングス	2.3	2.3	2,647
ケーズホールディングス	11.7	11.4	16,524
Olympicグループ	0.5	—	—
日産東京販売ホールディングス	1.5	0.9	387
シルバーライフ	0.3	0.7	520
Genky DrugStores	0.7	1.5	4,770
ナルミヤ・インターナショナル	0.2	0.2	245
ブックオフグループホールディングス	0.8	1.2	1,790
ギフトホールディングス	0.7	0.9	2,862
アインホールディングス	2.3	2.4	11,880
Genki Global Dining	0.5	1	4,175
ヤマダホールディングス	67.7	52.3	22,609
アークランズ	5	5.1	8,491
ニトリホールディングス	6.7	6.2	120,962
グルメ軒屋	—	1.4	1,435
愛眼	1	—	—
ケーユーホールディングス	1	1	1,054
吉野家ホールディングス	6.5	6.3	19,378
松屋フーズホールディングス	0.8	0.8	5,416
サガミホールディングス	2.7	2.6	4,576
関西フードマーケット	1.5	—	—
王将フードサービス	1.1	3.9	11,583
ミニストップ	1.2	1.3	2,219

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アークス	3	3.1	7,694
パローホールディングス	3.2	3.3	6,864
ベルク	0.8	0.9	5,769
大庄	0.6	1.1	1,124
ファーストリテイリング	7.4	9.6	484,128
サンドラッグ	6.3	5.8	22,190
サックスパー ホールディングス	1.6	1.5	1,347
ヤマザワ	0.2	—	—
やまや	0.2	0.1	287
ペルーナ	4	4.1	2,902
銀行業 (7.7%)			
いよぎんホールディングス	18.3	18.8	26,620
しずおかフィナンシャルグループ	34.1	34.9	42,630
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12.9	13.3	19,058
楽天銀行	5.3	7.4	22,459
京都フィナンシャルグループ	4.9	19.9	44,814
島根銀行	0.4	—	—
じもとホールディングス	0.9	1.1	326
めぶきフィナンシャルグループ	76.2	73.4	41,375
東京きらほしフィナンシャルグループ	2	2	8,200
九州フィナンシャルグループ	27	30.6	21,159
ゆうちょ銀行	42.2	174.1	233,642
富山第一銀行	4.9	5	5,225
コンコルディア・フィナンシャルグループ	82.4	84.3	62,719
西日本フィナンシャルホールディングス	9.5	8.8	14,572
三十三フィナンシャルグループ	1.4	1.4	2,290
第四北越フィナンシャルグループ	2.4	5	12,050
ひろぎんホールディングス	20	22.3	24,730
おきなわフィナンシャルグループ	1.4	1.3	2,906
十六フィナンシャルグループ	2	2.1	8,400
北國フィナンシャルホールディングス	1.6	1.6	6,944
ブクレアホールディングス	1.9	1.8	3,220
あいちフィナンシャルグループ	2.2	3.3	7,405
あおぞら銀行	9.7	11.4	29,166
三菱UFJフィナンシャル・グループ	962.2	965	1,507,330
りそなホールディングス	193.1	181.7	180,355
三井住友トラストグループ	27.4	56.4	187,248
三井住友フィナンシャルグループ	109.2	330.5	1,044,380
千葉銀行	42.8	44.1	48,796
群馬銀行	29.8	30.7	26,236
武蔵野銀行	2	2.2	5,783

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
千葉興業銀行	2.4	3.7	4,144
筑波銀行	6.7	6.8	1,530
七十七銀行	4.9	4.6	17,848
秋田銀行	1	1.1	2,288
山形銀行	1.7	1.8	1,760
岩手銀行	1.1	1	2,286
東邦銀行	12	12.4	3,211
東北銀行	0.5	0.3	318
ふくおかフィナンシャルグループ	12.3	13.8	47,817
スルガ銀行	13.5	11.9	12,863
八十二銀行	32.4	34	28,046
山梨中央銀行	1.6	1.8	2,914
大垣共立銀行	2.9	3	5,460
福井銀行	1.4	1.4	2,518
清水銀行	0.6	0.6	864
富山銀行	0.2	—	—
滋賀銀行	2.6	2.6	8,489
南都銀行	2.3	2.4	7,173
百五銀行	14.5	14.9	8,165
紀陽銀行	5.5	5.7	10,214
ほくほくフィナンシャルグループ	9.8	9.7	15,423
山陰合同銀行	9.6	9.8	11,936
鳥取銀行	0.3	0.2	244
百十四銀行	1.4	1.6	4,003
四国銀行	2.4	2.3	2,164
阿波銀行	2.2	2.2	5,313
大分銀行	0.9	1	3,040
宮崎銀行	1	1	2,662
佐賀銀行	0.9	0.9	1,836
琉球銀行	3.5	3.4	3,366
セブン銀行	55	49.5	15,879
みずほフィナンシャルグループ	222.2	213.9	666,298
高知銀行	0.3	—	—
山口フィナンシャルグループ	15	15.5	23,133
名古屋銀行	1	1	5,940
北洋銀行	23.3	23.9	9,416
大光銀行	0.3	0.2	257
愛媛銀行	2	2.1	2,160
トマト銀行	0.3	0.2	220
京葉銀行	7	6.5	4,433
栃木銀行	7	7.8	2,028

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北日本銀行	0.5	0.5	1,227
東和銀行	2.8	2.9	1,664
福島銀行	1.1	—	—
大東銀行	0.4	0.4	279
トモニホールディングス	12.5	14.9	5,930
フィデアホールディングス	1.6	1.6	2,283
池田泉州ホールディングス	19.8	22	7,502
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	5.2	5.7	13,303
ジャパンインベストメントアドバイザー	1.3	2.6	2,657
マーキュリアホールディングス	0.5	0.3	263
S B I ホールディングス	22.4	25.5	84,558
ジャフコ グループ	5.1	4.7	9,522
大和証券グループ本社	109.8	122.7	123,497
野村ホールディングス	277	266.5	208,856
岡三証券グループ	13.5	13.8	8,390
丸三証券	5.1	5.3	4,823
東洋証券	5.1	4.3	2,184
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16.7	18.8	9,024
光世証券	0.2	—	—
水戸証券	4.1	4.3	1,926
いちよし証券	2.8	3	2,016
松井証券	9.1	7.7	6,052
マネックスグループ	16.5	15.5	10,152
極東証券	1.9	2.2	2,838
岩井コスモホールディングス	1.8	1.8	3,547
アイザワ証券グループ	2.2	2.3	3,912
マネーパートナーズグループ	1.1	—	—
スパークス・グループ	1.7	1.7	2,325
保険業 (3.1%)			
かんぽ生命保険	17.8	16.2	40,022
F P パートナー	—	0.7	1,931
S O M P O ホールディングス	26.4	71.5	230,373
アニコム ホールディングス	5.2	5.3	3,529
MS & AD インシュアランスグループ ホールディングス	31.3	106.4	360,696
第一生命ホールディングス	75.1	74.5	279,673
東京海上ホールディングス	151.8	154.7	854,098
T & D ホールディングス	41.2	42.5	104,465
アドバンスクリエイト	0.8	1.2	920
その他金融業 (1.2%)			
N E X Y Z . G r o u p	—	0.4	313

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
全国保証	4	4.1	22,578
あんしん保証	0.4	1.3	221
ジェイリース	0.3	1.1	1,532
イントラスト	0.4	0.4	290
日本モーゲージサービス	0.5	0.7	291
C a s a	0.4	—	—
S B I アルヒ	1.9	1.5	1,206
プレミアムグループ	2.6	2.7	6,574
ネットプロテクションズホールディングス	5.1	5.3	1,770
クレディセゾン	9.7	10	34,190
芙蓉総合リース	1.4	1.5	16,132
みずほリース	2.3	13.1	13,060
東京センチュリー	2.9	11.8	18,396
日本証券金融	5.7	5.8	11,431
アイフル	25.5	23.1	7,276
リコーリース	1.5	1.5	7,350
イオンフィナンシャルサービス	8.8	9	10,890
アコム	27.5	28.2	9,994
ジャックス	1.6	1.7	6,426
オリエントコーポレーション	4	5.2	4,659
オリックス	100.9	95	307,135
三菱HCキャピタル	59.9	70.6	71,306
九州リースサービス	0.5	—	—
日本取引所グループ	43.2	81.7	147,591
イー・ギャランティ	2.5	2.6	3,910
アサックス	0.4	—	—
NECキャピタルソリューション	0.7	0.8	3,000
不動産業 (1.9%)			
大東建託	5.6	5.8	97,324
サムティホールディングス	—	3.1	10,199
いちご	18.2	16	6,560
日本駐車場開発	16.8	18.8	4,173
スター・マイカ・ホールディングス	2.1	1.7	1,120
S R E ホールディングス	0.8	0.7	2,705
A D ワークスグループ	3.3	—	—
ヒューリック	35.9	36.9	50,184
野村不動産ホールディングス	9.6	8.8	33,158
三重交通グループホールディングス	3.4	3.4	1,761
サムティ	2.5	—	—
ディア・ライフ	2.7	2.7	2,222
コーセーアールイー	0.4	0.3	202

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
地主	1.2	1.4	2,961
ブレサンスコーポレーション	2.5	2.1	3,924
THEグローバル社	0.8	0.4	244
ハウスコム	0.3	—	—
JPMC	1	0.9	1,022
サンセイランディック	0.4	0.3	282
エストラスト	0.4	0.2	134
フージャースホールディングス	2.4	2.4	2,438
オープンハウスグループ	5.7	5.8	32,282
東急不動産ホールディングス	46.3	47.6	46,243
飯田グループホールディングス	13.1	15.2	32,710
イーグランド	0.2	0.1	134
ムゲンエステート	0.9	0.4	621
ピーロット	0.9	0.3	342
ファーストブラザーズ	0.3	0.3	333
And Doホールディングス	1	1.1	1,137
シーアールイー	1	0.7	853
ケイアイスター不動産	0.8	0.8	3,132
アグレ都市デザイン	0.2	0.2	299
グッドコムアセット	1.5	1.3	1,164
ジェイ・エス・ビー	0.4	0.7	1,901
ロードスターキャピタル	1	0.9	2,089
イノベーションホールディングス	0.4	0.3	274
グローバル・リンク・マネジメント	0.3	0.1	223
フェイスネットワーク	0.4	—	—
霞ヶ関キャピタル	—	0.7	10,759
パーク24	10	12.3	22,933
バラカ	0.6	0.5	877
ミガロホールディングス	0.2	0.2	323
宮越ホールディングス	—	0.7	1,206
三井不動産	65.6	219.8	290,575
三菱地所	92.8	99.4	227,228
平和不動産	2.5	2.6	10,712
東京建物	13.5	13.8	34,486
京阪神ビルディング	2.7	3	4,812
住友不動産	27.8	22.9	105,385
テーオーシー	2.9	2.9	1,783
東京楽天地	0.3	—	—
レオパレス21	—	15.8	8,721
スターツコーポレーション	2.3	2.3	8,142
フジ住宅	2.3	2	1,396

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
空港施設	2.1	2.3	1,320
明和地所	0.6	1.1	1,072
ゴールドクレスト	1.5	1.3	3,932
エスリード	0.8	0.7	3,209
日神グループホールディングス	2.8	2.5	1,245
日本エスコン	3.1	3	2,898
MIRARTHホールディングス	8	8.1	3,977
AVANTIA	0.8	—	—
イオンモール	8	8.2	16,613
毎日コムネット	0.5	0.3	215
ファースト住建	0.5	—	—
カチタス	4.2	4.3	8,277
トーセイ	2.6	2.6	6,128
サンフロンティア不動産	2.6	2.3	4,130
FJネクストホールディングス	1.7	1.7	1,934
インテリックス	0.5	—	—
ランドビジネス	0.9	—	—
グランディハウス	1.1	1.8	997
日本空港ビルデング	5.5	5.6	30,340
サービス業 (4.8%)			
明豊ファシリティワークス	0.5	0.3	254
LIFULL	5.5	—	—
MIXI	3.7	3.6	10,054
ジェイエイシーリクルートメント	1.4	6	4,284
日本M&Aセンターホールディングス	27.5	26.4	15,684
メンバーズ	0.5	—	—
中広	0.1	0.4	176
UTグループ	2.4	2.2	5,629
アイティメディア	0.6	0.6	960
ケアネット	—	3.4	2,291
E・Jホールディングス	0.9	1	1,703
オープンアップグループ	4.8	5	9,825
コシダカホールディングス	4.8	5	5,980
アルトナー	0.3	0.2	345
パソナグループ	2	2	4,128
CDS	0.3	0.2	351
リンクアンドモチベーション	4.6	4.1	2,345
エス・エム・エス	6.1	5.8	12,304
サニーサイドアップグループ	0.3	0.3	161
パーソルホールディングス	176.8	168.1	43,504
リニカル	0.6	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クックパッド	4.5	—	—
エスクリ	0.5	—	—
アイ・ケイ・ケイホールディングス	0.5	0.4	304
学情	0.8	0.9	1,572
スタジオアリス	0.8	0.8	1,624
シミックホールディングス	0.8	—	—
エブコ	0.3	0.2	150
N J S	0.4	0.4	1,612
総合警備保障	29.8	27.6	29,214
カカココム	11.8	10.7	24,989
アイロムグループ	0.6	0.7	1,945
セントケア・ホールディング	1	1.2	879
サイネックス	0.2	—	—
ルネサンス	1.2	1.3	1,371
ディップ	2.8	2.5	6,667
デジタルホールディングス	0.9	1	973
新日本科学	1.7	1.5	1,851
キャリアデザインセンター	0.2	0.2	355
ベネフィット・ワン	7.4	—	—
エムスリー	31.7	32.7	55,753
ツカダ・グローバルホールディング	0.7	0.7	275
プラス	0.1	—	—
アウトソーシング	10.3	—	—
ウェルネット	0.8	0.5	346
ワールドホールディングス	0.7	0.6	1,146
ディー・エヌ・エー	6.4	5.9	10,631
博報堂DYホールディングス	20.4	21	25,683
ぐるなび	3	3.1	948
タカミヤ	2.2	2.3	1,016
ジャパンベストレスキューシステム	0.8	—	—
ファンコミュニケーションズ	2.3	2.6	1,073
ライク	0.6	0.7	961
A o b a - B B T	0.4	—	—
エスプール	4.6	5.3	1,881
WDBホールディングス	0.8	0.9	1,545
ティア	0.6	0.9	386
CDG	0.1	—	—
アドウェイズ	2.2	2.5	812
バリューコマース	1.4	1.5	1,671
インフォマート	16.7	15.6	5,662
J Pホールディングス	4.6	4.2	3,019

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エコナックホールディングス	1	—	—
CLホールディングス	0.4	—	—
プレステージ・インターナショナル	6.8	7.7	5,212
プロトコーポレーション	—	1.7	2,410
アミューズ	0.9	1	1,365
ドリームインキュベータ	0.5	0.5	1,082
クイック	1.2	1.2	2,347
T A C	0.5	—	—
電通グループ	15.8	17.9	84,309
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.4	—	—
びあ	0.5	0.6	1,836
イオンファンタジー	0.7	0.6	1,534
シーティーエス	1.8	2.1	1,892
NEXYZ. Group	0.3	—	—
H. U. グループホールディングス	4.7	4.9	12,798
アルプス技研	1.5	1.4	3,890
日本空調サービス	1.7	1.8	1,837
オリエンタルランド	84.9	87.5	316,225
ダスキン	3.6	3.6	14,396
明光ネットワークジャパン	2	2.1	1,398
ファルコホールディングス	0.7	0.7	1,652
秀英予備校	0.2	—	—
ラウンドワン	13.4	15.5	14,756
リゾートトラスト	6.3	7.2	19,843
ビー・エム・エル	2	2	5,476
リソー教育	7.2	8.4	2,310
早稲田アカデミー	0.9	0.9	1,476
ユー・エス・エス	16.5	37	47,064
東京個別指導学院	2	2.3	913
サイバーエージェント	35.4	36.5	37,102
楽天グループ	137.3	116.3	105,577
クリーク・アンド・リバー社	0.9	0.8	1,279
SBIグローバルアセットマネジメント	2.6	3.3	1,914
テー・オー・ダブリュー	3.2	3.3	1,069
山田コンサルティンググループ	0.8	0.7	1,438
セントラルスポーツ	0.6	0.6	1,453
フルキャストホールディングス	1.6	1.4	2,168
エン・ジャパン	2.9	2.7	6,496
リソルホールディングス	0.1	0.1	503
テクノプロ・ホールディングス	9.5	9.6	26,059
アトラグループ	0.3	—	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アイ・アールジャパンホールディングス	0.8	1.1	940	
Keeper 技研	1	1	4,105	
楽待	0.2	0.3	209	
三機サービス	0.2	0.2	175	
Gunosy	1.3	1.5	1,071	
デザインワン・ジャパン	0.2	—	—	
イー・ガーディアン	0.6	0.8	1,452	
リブセンス	0.5	1	164	
ジャパンマテリアル	4.9	5.1	9,266	
ベクトル	2.5	2	1,902	
ウチヤマホールディングス	0.4	—	—	
チャーム・ケア・コーポレーション	1.3	1.4	1,751	
キャリアリンク	0.6	0.6	1,482	
IBJ	1.2	1.6	1,054	
アサンテ	0.8	0.8	1,361	
バリュエHR	1.4	1.5	2,560	
M&Aキャピタルパートナーズ	1.3	1.3	3,035	
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.6	0.8	801	
ERIホールディングス	0.3	0.2	365	
アビスト	0.2	—	—	
シグマクシス・ホールディングス	2.4	2.2	3,729	
ウィルグループ	1.3	1.4	1,360	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1.1	—	—	
メドピア	1.4	1.6	896	
レアジョブ	0.2	0.5	199	
リクルートホールディングス	118.7	119.1	1,097,744	
エラン	2.1	2.2	1,892	
土木管理総合試験所	0.5	—	—	
日本郵政	193	172.8	237,600	
ベルシステム24ホールディングス	2.2	1.8	2,316	
鎌倉新書	1.8	1.9	974	
SMN	0.2	—	—	
一歳	0.1	0.3	153	
グローバルキッズCOMPANY	0.2	—	—	
エアトリ	1.2	1.2	1,225	
アトラエ	1	—	—	
ストライク	0.7	0.8	3,508	
ソラスト	4.5	4.6	2,226	
セラク	0.5	0.7	907	
インソース	3.4	3.6	3,517	
ペイカレント	12.7	12.2	60,390	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
Orchestra Holdings	0.3	0.5	418	
アイモバイル	0.7	2.4	1,209	
ディスラプターズ	0.3	—	—	
MS-Japan	0.3	0.9	925	
船場	0.2	—	—	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5.7	5.4	15,800	
フルテック	0.2	—	—	
グリーンズ	0.4	0.2	301	
ツナググループ・ホールディングス	0.3	—	—	
GameWith	0.3	—	—	
MS&Consulting	0.1	—	—	
ウエルビー	1.1	—	—	
エル・ティー・エス	0.2	0.3	536	
ミダックホールディングス	1	1	1,783	
キュービーネットホールディングス	0.8	1	1,015	
オープングループ	2.2	—	—	
スプリックス	0.3	—	—	
マネジメントソリューションズ	0.7	0.8	1,482	
プロレド・パートナーズ	0.4	0.7	338	
and factory	0.3	—	—	
テノ・ホールディングス	0.1	—	—	
フロンティア・マネジメント	0.4	0.7	805	
ピアラ	0.2	—	—	
コプロ・ホールディングス	0.4	0.2	275	
ギークス	0.1	—	—	
アンビスホールディングス	1.7	3.6	6,760	
カープスホールディングス	4.4	4.5	3,613	
フォーラムエン지니어リング	0.9	2.3	2,010	
Fast Fitness Japan	0.6	0.7	921	
Macbee Planet	—	0.5	1,305	
ダイレクトマーケティングミックス	1.7	—	—	
ポピンズ	0.2	0.5	694	
LITALICO	1.3	1.3	1,556	
コンフィデンス・インターワークス	—	0.1	169	
アドバンテッジリスクマネジメント	0.5	0.7	396	
リログループ	8.9	8.2	15,141	
東祥	1.1	1.4	940	
ID&Eホールディングス	1	1	4,395	
ビーウィズ	0.4	0.4	620	
サンウエルズ	—	0.6	1,046	
TREホールディングス	3.4	3.2	5,721	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
人・夢・技術グループ	0.6	0.7	1,163
NISSOホールディングス	1.2	1.5	1,201
大栄環境	4.1	3	9,360
日本管財ホールディングス	1.7	1.7	4,471
M&A総研ホールディングス	0.8	1.8	4,957
エイチ・アイ・エス	4.7	5.3	8,946
ラックランド	0.7	0.8	1,548
共立メンテナンス	2.7	5.2	12,682
イチネンホールディングス	1.7	1.8	3,220
建設技術研究所	0.8	0.9	4,059
スペース	1.1	1.2	1,376
燦ホールディングス	1.4	1.5	1,660
スバル興業	0.1	0.6	1,860
東京テアトル	0.4	—	—
タナベコンサルティンググループ	0.4	—	—
ナガワ	0.4	0.5	3,310
東京都競馬	1.3	1.2	4,956
常磐興産	0.4	—	—
カナモト	2.5	2.6	7,160
ニシオホールディングス	1.5	1.4	5,222
トランス・コスモス	2	1.9	6,403
乃村工藝社	7	7.2	5,508

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
藤田観光	0.6	0.7	5,992	
KNT-CTホールディングス	1	1	1,260	
トーカイ	1.4	1.5	3,325	
白洋舎	0.2	0.1	233	
セコム	16.3	33.7	182,114	
セントラル警備保障	0.9	0.9	2,457	
丹青社	3.1	3.2	2,601	
メイテックグループホールディングス	6.2	5.7	17,590	
応用地質	1.5	1.6	4,072	
船井総研ホールディングス	3.3	3.3	7,906	
進学会ホールディングス	0.3	—	—	
オオバ	0.7	0.4	403	
いであ	0.3	—	—	
学究社	0.6	0.6	1,143	
ベネッセホールディングス	6	—	—	
イオンディライト	1.8	1.8	7,767	
ナック	0.7	1.7	950	
ダイセキ	3.3	3.4	13,481	
ステップ	0.6	0.6	1,210	
合 計	株数・金額	23,776	29,824	60,171,635
	銘柄数<比率>	2,102	1,837	<98.7%>

(注) 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) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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	TOPIX先物	
		百万円	百万円
		798	—

○投資信託財産の構成

(2024年10月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 60,171,635	% 98.7
コール・ローン等、その他	782,121	1.3
投資信託財産総額	60,953,756	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年10月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	61,662,202,583
コール・ローン等	167,237,454
株式(評価額)	60,171,635,490
未収配当金	594,014,867
未収利息	1,072
差入委託証拠金	729,313,700
(B) 負債	719,732,516
未払金	10,164,700
未払解約金	677,316
差入委託証拠金代用有価証券	708,890,500
(C) 純資産総額(A-B)	60,942,470,067
元本	21,889,889,956
次期繰越損益金	39,052,580,111
(D) 受益権総口数	21,889,889,956口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,840円

(注) 当ファンドの期首元本額は21,954,159,010円、期中追加設定元本額は2,901,079,093円、期中一部解約元本額は2,965,348,147円です。

(注) 2024年10月28日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・DCインデックスバランス(株式80)	5,884,659,978円
・DCインデックスバランス(株式60)	4,579,248,616円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,251,785,274円
・DCインデックスバランス(株式40)	2,043,518,570円
・インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,943,042,190円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,382,191,474円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	968,267,378円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	926,963,772円
・DCインデックスバランス(株式20)	722,868,655円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	567,479,340円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	433,981,686円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	181,462,903円
・Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	2,449,262円
・Niつみインデックススラップ世界10指数(均等型)	1,383,466円
・Niつみインデックススラップ世界10指数(安定成長型)	587,392円

(注) 1口当たり純資産額は2,7840円です。

(注) 2024年10月28日現在、先物取引などに係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は以下の通りです。

・株式	717,847千円
-----	-----------

○損益の状況 (2023年10月27日～2024年10月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,398,481,001
受取配当金	1,397,471,965
受取利息	302,875
その他収益金	712,272
支払利息	△ 6,111
(B) 有価証券売買損益	10,018,410,404
売買益	11,473,659,732
売買損	△ 1,455,249,328
(C) 先物取引等取引損益	35,010,600
取引益	144,917,050
取引損	△ 109,906,450
(D) 保管費用等	△ 3
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	11,451,902,002
(F) 前期繰越損益金	28,003,316,124
(G) 追加信託差損益金	4,654,976,606
(H) 解約差損益金	△ 5,057,614,621
(I) 計(E+F+G+H)	39,052,580,111
次期繰越損益金(I)	39,052,580,111

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

(注) 損益の状況の中で(H)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。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2023年10月27日から2024年10月28日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。