

明治安田TOPIXオープン

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	無期限	
運用方針	東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	明治安田TOPIXオープン	明治安田TOPIXマザーファンドを主要投資対象とします。このほか、当ファンドにおいて直接、わが国の金融商品取引所に上場されている株式に投資を行い、TOPIX先物取引を行うことがあります。
	明治安田TOPIXマザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場されている株式およびTOPIX先物取引を主要投資対象とします。
組入制限	明治安田TOPIXオープン	株式への実質投資割合には制限を設けません。また、外貨建資産への投資は行いません。
	明治安田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。また、外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	分配対象額の範囲は利子・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とし、基準価額水準等を勘案して分配します。ただし、必ず分配を行うものではありません。	

運用報告書(全体版)

第20期

(決算日 2023年3月10日)

受益者のみなさまへ

平素は「明治安田TOPIXオープン」にご投資いただき、厚くお礼申し上げます。

さて、当ファンドは、第20期の決算を行いましたので、期中の運用状況につきまして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。

 明治安田アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目3番2号
ホームページ <https://www.myam.co.jp/>

〈運用報告書のお問い合わせ先〉

サポートデスク 0120-565787

(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額			東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	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	%		%	%	%	百万円
(第16期) 2019年3月11日	19,033	310	△ 7.7	1,581.44	△ 9.2	96.0	3.9	223
(第17期) 2020年3月10日	16,950	360	△ 9.1	1,406.68	△11.1	95.8	4.0	166
(第18期) 2021年3月10日	23,022	500	38.8	1,919.74	36.5	96.7	3.2	148
(第19期) 2022年3月10日	21,992	320	△ 3.1	1,830.03	△ 4.7	97.5	2.3	143
(第20期) 2023年3月10日	24,353	540	13.2	2,031.58	11.0	96.7	3.1	157

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「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) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注4) 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社JPX総研が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。東証株価指数(TOPIX)の指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

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		
	円	%		%	%	%
(期首) 2022年 3月10日	21,992	—	1,830.03	—	97.5	2.3
3月末	23,631	7.5	1,946.40	6.4	95.8	4.0
4月末	23,050	4.8	1,899.62	3.8	95.1	4.7
5月末	23,205	5.5	1,912.67	4.5	95.1	4.7
6月末	22,717	3.3	1,870.82	2.2	94.7	5.1
7月末	23,553	7.1	1,940.31	6.0	95.1	4.7
8月末	23,825	8.3	1,963.16	7.3	95.4	4.5
9月末	22,506	2.3	1,835.94	0.3	94.1	5.7
10月末	23,630	7.4	1,929.43	5.4	93.8	6.0
11月末	24,324	10.6	1,985.57	8.5	94.2	5.6
12月末	23,201	5.5	1,891.71	3.4	93.6	6.2
2023年 1月末	24,207	10.1	1,975.27	7.9	94.2	5.6
2月末	24,427	11.1	1,993.28	8.9	94.2	3.3
(期末) 2023年 3月10日	24,893	13.2	2,031.58	11.0	96.7	3.1

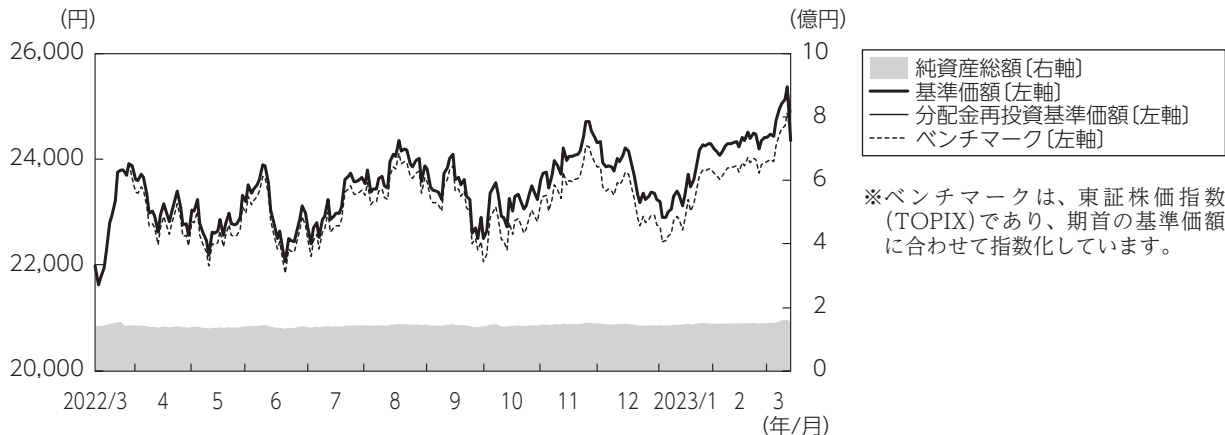
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「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) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

運用経過の説明

■ 基準価額等の推移



第20期首(2022年3月10日)：21,992円

第20期末(2023年3月10日)：24,353円(既払分配金540円)

騰落率：13.2%(分配金再投資ベース)

※ベンチマークは、東証株価指数(TOPIX)であり、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は分配金実績があった場合、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。

※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。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額の主な変動要因

ファンドの運用方針に従い、マザーファンドを通じてわが国の株式へ投資を行いました。投資対象資産の価格変動等による基準価額の変動要因は以下の通りとなりました。

(上昇要因)

- ・ 期首から2022年3月下旬にかけて、円安の進行による輸出関連企業を中心とした業績拡大期待の高まりなどから国内株式相場が大きく上昇したこと
- ・ 日銀による緩和的な金融政策の継続が相場を下支えしたこと

(下落要因)

- ・ 6月には欧州における複数の中央銀行、9月にはF R B (米連邦準備制度理事会) がインフレの抑制を目的に金融引き締め姿勢を強めたことから、国内株式相場が下落したこと

■投資環境

当期の国内株式相場は上昇しました。期首から2022年3月下旬にかけて、円安の進行による輸出関連企業を中心とした業績拡大期待の高まりなどから大きく上昇しました。その後はインフレの抑制を目的とする海外中央銀行の金融引き締め動きや、中国の新型コロナウイルスの感染再拡大などの下落材料もありましたが、日銀による緩和的な金融政策の継続が相場の下支えとなり、また新型コロナウイルス禍を背景とした行動制限の段階的な緩和による景気回復期待や企業業績の拡大などから強含みもみ合いとなりました。

■当該投資信託のポートフォリオ

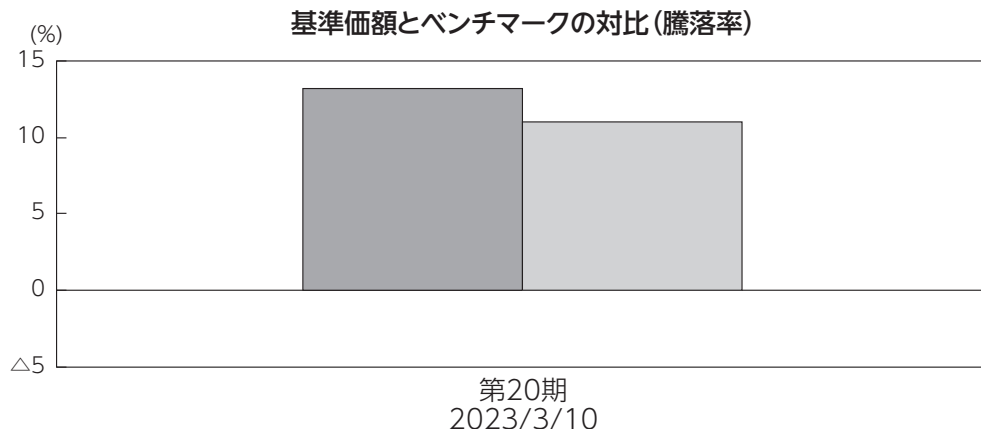
明治安田TOPIXオープン

期首の運用方針に基づき、明治安田TOPIXマザーファンドへの投資比率を高位に維持しました。追加設定および解約に対応してマザーファンドの売買を迅速に行いました。期末におけるマザーファンド組入比率は概ね100%となりました。

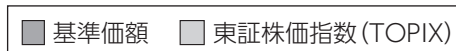
明治安田TOPIXマザーファンド

期首の運用方針に基づき、ファンド規模を勘案して最適化手法にてポートフォリオを構築し、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。追加設定および解約に伴う資金の流出入や、新規上場・上場廃止や浮動株比率の変更等に伴うTOPIXの銘柄構成比の変更に対応し、適宜ポートフォリオの見直しを行いました。この結果、銘柄数は期首の1,226銘柄から期末には1,230銘柄となりました。株式と株式先物を合計した実質株式組入比率は高位を保ち、期末には概ね100%となりました。

■当該投資信託のベンチマークとの差異



※ファンドの騰落率は分配金込み



当期の基準価額の騰落率（分配金込み）は+13.2%になりました。一方、ベンチマークの騰落率は+11.0%となり、騰落率の差異は+2.2%でした。この差異に関する主な要因は以下の通りです。

(プラス要因)

- ・保有株式に係る配当金を計上したこと（特に2022年3月、9月）

(マイナス要因)

- ・信託報酬等のファンドに係る費用を計上したこと

■ 分配金

- ・ 収益分配金については、分配対象額水準、基準価額水準等を勘案し、1万口当たり540円（税込み）とさせていただきます。
- ・ 収益分配にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

分配原資の内訳

（単位：円・％、1万口当たり、税引前）

項目	第20期
	(2022年3月11日～2023年3月10日)
当期分配金	540
（対基準価額比率）	2.169
当期の収益	540
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	19,698

(注1) 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2) 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

明治安田TOPIXオープン

引き続き、明治安田TOPIXマザーファンドへの投資を通じて、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。追加設定および解約に伴う資産の増減に対して、マザーファンドの買付け、売却を迅速に行い、マザーファンドへの投資比率を高位に維持します。

明治安田TOPIXマザーファンド

引き続き、ファンド規模を勘案して最適化手法にてポートフォリオを構築し、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。追加設定および解約に伴う資金の流出入や、新規上場・上場廃止や浮動株比率の変更等に伴うTOPIXの銘柄構成比の変更に対応し、適宜ポートフォリオの見直しを行います。

◎1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年3月11日～2023年3月10日)		
	金額	比率	
(a)信託報酬	155 円	0.660 %	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×期末の信託報酬率 ※期中の平均基準価額は23,523円です。
(投信会社)	(67)	(0.286)	ファンドの運用、基準価額の算出、法定書類の作成等の対価
(販売会社)	(65)	(0.275)	購入後の情報提供、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)	(23)	(0.099)	ファンド財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b)売買委託手数料	1	0.004	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(株式)	(0)	(0.001)	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
(先物・オプション)	(1)	(0.002)	
(c)その他費用	2	0.011	(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)	(1)	(0.005)	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)	(1)	(0.005)	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
合 計	158	0.675	

(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。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。

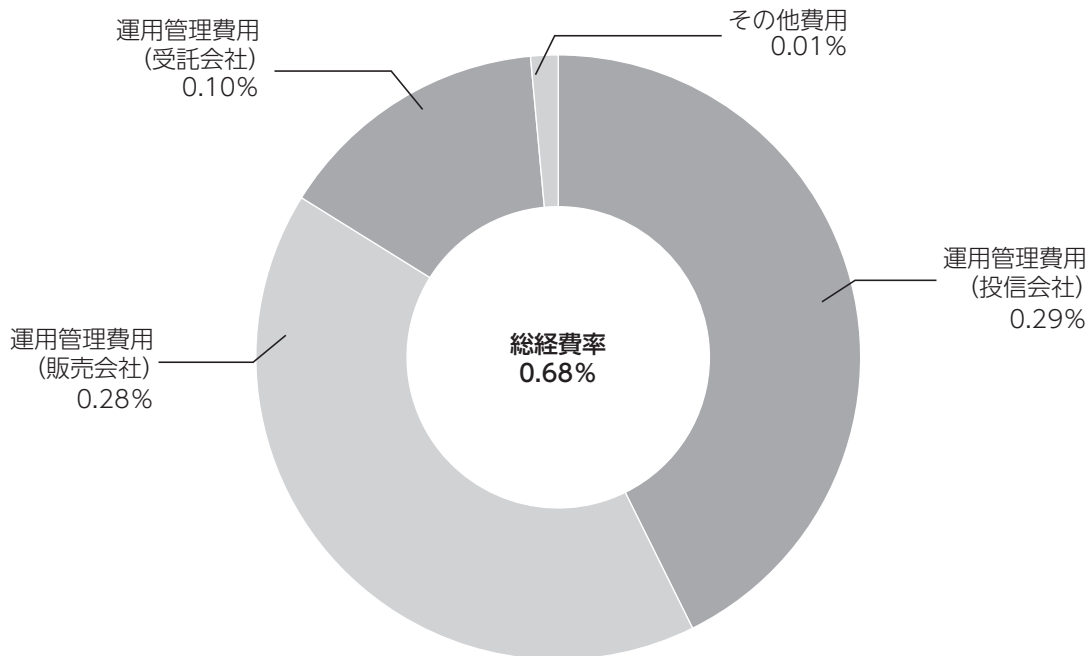
(注2)消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3)各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4)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、売買委託手数料及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0.68%です。



(注) 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、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(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**(2022年3月11日～2023年3月10日)

○親投資信託の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
明 治 安 田 T O P I X マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 6,602	千円 22,280	千口 8,256	千円 28,180

(注)単位未満は切り捨て。

◎**親投資信託の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
	明治安田TOPIXマザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	5,555,173千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	16,784,832千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.33

(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**(2022年3月11日～2023年3月10日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(注)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す。

◎**組入資産明細表**

○親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
明 治 安 田 T O P I X マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 45,415	千口 43,761	千円 156,907

(注1)口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注2)明治安田TOPIXマザーファンド全体の当期末受益権口数は(4,497,328千口)です。

◎投資信託財産の構成

2023年3月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
明治安田TOPIXマザーファンド	156,907	97.4
コール・ローン等、その他	4,207	2.6
投資信託財産総額	161,114	100.0

(注)評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年3月10日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	161,114,970
コール・ローン等	4,207,696
明治安田TOPIXマザーファンド(評価額)	156,907,274
(B)負 債	3,975,097
未払収益分配金	3,484,349
未払解約金	1,504
未払信託報酬	485,195
その他未払費用	4,049
(C)純資産総額(A - B)	157,139,873
元 本	64,524,988
次期繰越損益金	92,614,885
(D)受益権総口数	64,524,988口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,353円

◎損益の状況

自 2022年3月11日
至 2023年3月10日

項 目	当 期
	円
(A)有価証券売買損益	18,176,710
売 買 益	19,861,892
売 買 損	△ 1,685,182
(B)信託報酬等	△ 968,362
(C)当期損益金(A + B)	17,208,348
(D)前期繰越損益金	20,893,559
(E)追加信託差損益金	57,997,327
(配当等相当額)	(92,421,970)
(売買損益相当額)	(△34,424,643)
(F)計(C + D + E)	96,099,234
(G)収益分配金	△ 3,484,349
次期繰越損益金(F + G)	92,614,885
追加信託差損益金	57,997,327
(配当等相当額)	(92,489,427)
(売買損益相当額)	(△34,492,100)
分配準備積立金	34,617,558

(注1)当ファンドの期首元本額は65,107,296円、期中追加設定元本額は10,281,093円、期中一部解約元本額は10,863,401円です。

(注2)1口当たり純資産額は2,4353円です。

(注3)損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注4)損益の状況の中で(B)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注5)損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注6)計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,509,263円)、費用控除後の有価証券等損益額(7,950,574円)、信託約款に規定する収益調整金(92,489,427円)および分配準備積立金(26,642,070円)より分配対象収益は130,591,334円(10,000口当たり20,238円)であり、うち3,484,349円(10,000口当たり540円)を分配金額としております。

◎収益分配金のお知らせ

1万口当たりの分配金（税込み）	540円
-----------------	------

※分配金をお支払いする場合

分配金は、決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

※分配金を再投資する場合

お手取り分配金は、決算日現在の基準価額に基づいてみなさまの口座に繰入れて再投資いたしました。

課税上の取扱いについて

- 分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、普通分配金と元本払戻金（特別分配金）に分かれます。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額普通分配金となります。また、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分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個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- 課税上の取扱いの詳細については、税務署等にお問い合わせください。

【お知らせ】

- ・東京証券取引所の市場再編による市場区分等の変更に伴い、信託約款に所定の整備を行いました。
(2022年4月4日)

明治安田TOPIXマザーファンド

運用報告書

第20期

(決算日 2023年3月10日)

「明治安田TOPIXマザーファンド」は、2023年3月10日に第20期決算を行いました。
以下、当マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所に上場されている株式およびTOPIX先物取引を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資には制限を設けません。また、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)	騰落率			
(第16期) 2019年3月11日	25,236	△ 7.1	1,581.44	△ 9.2	96.1	3.9	13,124
(第17期) 2020年3月10日	23,066	△ 8.6	1,406.68	△11.1	95.9	4.0	17,009
(第18期) 2021年3月10日	32,244	39.8	1,919.74	36.5	96.7	3.2	16,829
(第19期) 2022年3月10日	31,467	△ 2.4	1,830.03	△ 4.7	97.7	2.3	17,638
(第20期) 2023年3月10日	35,855	13.9	2,031.58	11.0	96.8	3.1	16,125

(注1) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注2) 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社J P X総研が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。東証株価指数(TOPIX)の指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

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)	騰落率		
(期首)2022年 3月10日	31,467	—	1,830.03	—	97.7	2.3
3月末	33,827	7.5	1,946.40	6.4	95.9	4.0
4月末	33,012	4.9	1,899.62	3.8	95.2	4.7
5月末	33,254	5.7	1,912.67	4.5	95.2	4.7
6月末	32,572	3.5	1,870.82	2.2	94.8	5.1
7月末	33,789	7.4	1,940.31	6.0	95.2	4.7
8月末	34,201	8.7	1,963.16	7.3	95.5	4.5
9月末	32,323	2.7	1,835.94	0.3	94.2	5.7
10月末	33,958	7.9	1,929.43	5.4	93.9	6.0
11月末	34,975	11.1	1,985.57	8.5	94.3	5.6
12月末	33,377	6.1	1,891.71	3.4	93.7	6.2
2023年 1月末	34,847	10.7	1,975.27	7.9	94.3	5.6
2月末	35,182	11.8	1,993.28	8.9	94.3	3.3
(期末)2023年 3月10日	35,855	13.9	2,031.58	11.0	96.8	3.1

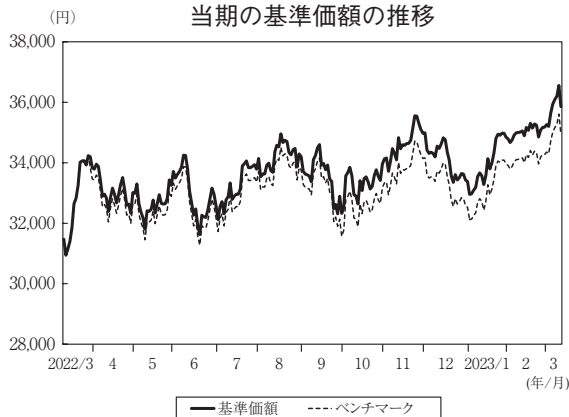
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎当期中の運用経過と今後の運用方針(2022年3月11日～2023年3月10日)

1 基準価額

(1) 基準価額の推移と主な変動要因



※ベンチマークは、東証株価指数(TOPIX)であり、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額は期首31,467円で始まり、期末35,855円で終わりました。騰落率は+13.9%となりました。基準価額の主な変動要因は以下の通りです。

(上昇要因)

- ・期首から2022年3月下旬にかけて、円安の進行による輸出関連企業を中心とした業績拡大期待の高まりなどから国内株式相場が大きく上昇したこと
- ・日銀による緩和的な金融政策の継続が相場を下支えたこと

(下落要因)

- ・6月には欧州における複数の中央銀行、9月にはFRB(米連邦準備制度理事会)がインフレの抑制を目的に金融引き締め姿勢を強めたことから、国内株式相場が下落したこと

(2) ベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+13.9%となりました。一方、ベンチマークの騰落率は+11.0%となり、騰落率の差異は+2.9%でした。この差異に関する主な要因は以下の通りです。

(プラス要因)

- ・保有株式に係る配当金を計上したこと(特に2022年3月、9月)

2 運用経過

運用概況

期首の運用方針に基づき、ファンド規模を勘案して最適化手法にてポートフォリオを構築し、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。追加設定および解約に伴う資金の流出入や、新規上場・上場廃止や浮動株比率の変更等に伴うTOPIXの銘柄構成比の変更に対応し、適宜ポートフォリオの見直しを行いました。この結果、銘柄数は期首の1,226銘柄から期末には1,230銘柄となりました。株式と株式先物を合計した実質株式組入比率は高位を保ち、期末には概ね100%となりました。

3 今後の運用方針

引き続き、ファンド規模を勘案して最適化手法にてポートフォリオを構築し、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。追加設定および解約に伴う資金の流出入や、新規上場・上場廃止や浮動株比率の変更等に伴うTOPIXの銘柄構成比の変更に対応し、適宜ポートフォリオの見直しを行います。

◎1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項目の概要
	(2022年3月11日～2023年3月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1 円	0.003 %	(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 ※期中の平均基準価額は33,776円です。
(株式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(1)	(0.002)	
(b) その他費用	2	0.005	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
(その他)	(2)	(0.005)	
合 計	3	0.008	

(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2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 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(2022年3月11日～2023年3月10日)

○株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株	千円	千株	千円
		517 (106)	1,074,938 (-)	1,916	4,480,235

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	4,725	4,721	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

◎株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	5,555,173千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	16,784,832千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.33

(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(2022年3月11日～2023年3月10日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(注)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す。

◎組入資産明細表

○国内株式
上場株式

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)			
極ニマサホ	0.9	0.7	2,537
ニルカホ	10.2	8	4,440
サカタ	1.4	1.2	2,947
ホク	1.2	1.1	4,554
	1.1	0.5	945
鉱業(0.3%)			
日三井	0.3	0.3	1,129
井松	1.5	0.5	1,877
INP	38.2	28.3	41,629
石油	1.4	1	5,010
建設			
ショー	1.3	1	5,530
ミラ	2.9	2.5	4,222
安東	4.9	4.6	4,126
東シ	3.5	2.8	2,002
高松	3	2.4	6,096
東建	0.7	0.6	1,243
大成	0.3	0.3	2,409
大	6.2	5.1	23,791
清	21.1	17.7	18,708
飛	20.2	15.3	11,903
長谷	1.8	1.4	1,583
鹿島	6.2	5.4	8,748
不動	15.4	11.3	18,746
大鉄	1.2	1.1	1,844
西井	2.8	0.9	1,094
三井	0.8	0.7	1,325
大東	1.6	1	3,645
奥村	5.6	4.3	1,887
東鉄	0.5	0.3	1,210
戸田	1	0.7	2,359
熊谷	0.8	0.9	2,519
北野	8.4	6.7	4,937
矢作	1.2	1	2,917
大東	0.6	0.8	2,540
東道	2.3	2	1,712
日東	2.2	-	-
東本	0.3	0.3	2,265
若	0.3	0.2	1,528
東	0.7	0.6	1,678
五世	1.3	0.7	2,492
福	4.1	2.3	2,070
住友	8.8	7.7	5,097
巴	2.1	1.7	1,448
大和	0.5	0.3	1,368
積	5.7	4.1	11,029
関	4.4	3.6	1,594
水	19.7	14.4	46,296
水	1.3	1.1	2,201
水	22.8	16.3	45,167
水	2.9	1.2	1,118
水	3.6	2.8	4,606
水	0.6	0.5	1,300
水	1.1	0.7	1,129
水	3.1	2.3	5,683
水	1.6	1.2	4,266

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
機工業	1.2	0.8	1,240
揮外	6.6	5.2	9,016
中太	0.9	0.7	1,316
高砂	0.7	0.4	1,676
明大	1.8	1.3	2,802
	1.7	1.4	1,127
	1.1	0.7	2,576
	0.5	0.7	1,505
	9.4	5.6	6,120
	1.1	0.7	1,049
食料品(3.4%)			
ニ日	1.2	1	1,670
昭東	7.6	5	7,920
日DM	0.7	0.3	770
森中	2.1	1.8	1,650
江崎	0.8	0.8	1,385
不山	0.5	0.3	637
亀田	1.8	1.1	4,350
寿カ	0.5	0.7	2,205
森永	1.8	1.4	4,809
スビ	0.7	0.6	1,476
森永	5.3	3.7	5,960
クホル	0.6	0.4	1,734
ヤ治	0.8	0.6	5,436
雪印	3.1	2.6	6,947
日丸	1.4	1	4,815
S F o d s	5.2	3.8	36,290
伊藤	4.5	3.2	20,416
サッ	1.7	1.1	2,020
アサ	1.1	0.9	2,008
キリン	2.5	2	7,680
宝	0.4	0.2	305
ココ	0.7	0.7	1,995
サント	3.3	2.4	1,759
ダイ	2.4	1.9	6,317
伊	16.3	12.1	58,878
キ	25.2	23.6	49,123
ジ	5.1	3.6	3,866
日	4.9	3.5	4,998
日	4.7	3.7	18,241
日	0.5	0.4	1,922
伊	2.1	2	8,720
キ	1	0.8	1,663
ジ	2	1.8	1,983
日	0.7	0.8	2,748
日	1.6	1.4	2,738
日	0.8	0.4	632
日	5.1	3.6	23,328
味	15.2	13	58,773
味	3.5	2.8	6,204
カ	2.6	1.5	4,108
カ	2.5	2.5	7,637
ア	0.7	0.5	2,465
ア	3.5	2.4	6,525
東	3.4	2.7	15,417
日	2.7	1.9	22,173
フ	0.5	0.7	1,320

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価	価額
	千株	千株	千円	
ロック・フイールド	1.6	1.2	1,888	
日本たばこ産業	36	34.1	94,746	
日わらべや日洋ホールディングス	0.9	0.7	1,296	
ユニヨシ油脂	4.5	4.2	3,985	
織維製(0.5%)	1.7	1.7	1,657	
グ東富士織	0.5	0.3	1,405	
東富士織	2.4	1.9	2,038	
富士織	0.5	0.3	963	
倉シ敷キ本	0.5	0.4	1,055	
日グイド	0.8	1.4	1,519	
帝帝東住アセ	1.9	1.4	1,395	
帝帝東住アセ	7.1	12.5	3,475	
帝帝東住アセ	1	0.8	1,358	
帝帝東住アセ	5.5	4.6	6,812	
帝帝東住アセ	47.8	35.4	27,700	
帝帝東住アセ	0.8	0.5	1,004	
帝帝東住アセ	1.9	1.7	681	
帝帝東住アセ	1.6	1.2	2,912	
帝帝東住アセ	2.3	1.2	866	
帝帝東住アセ	1.5	0.6	1,548	
帝帝東住アセ	0.9	0.8	2,616	
帝帝東住アセ	3.5	2.7	1,782	
帝帝東住アセ	1.2	1	1,506	
帝帝東住アセ	5.6	3.5	1,288	
帝帝東住アセ	0.9	0.5	1,120	
帝帝東住アセ	1.3	1	11,970	
帝帝東住アセ	1.5	1	4,115	
パルプ・紙(0.2%)	0.5	0.3	918	
王子ホ	27.8	20.6	11,474	
王子ホ	2	2.6	2,841	
王子ホ	3.2	3.7	1,317	
王子ホ	4.8	3.7	3,318	
王子ホ	1	0.9	947	
王子ホ	3.3	2.6	2,779	
王子ホ	5.6	4.6	4,034	
王子ホ	0.6	0.6	982	
王子ホ	0.8	0.6	1,800	
化学(6.2%)	8.6	7.1	9,017	
旭化成	43.7	32.1	31,239	
旭化成	6	5.1	11,454	
旭化成	48.7	39.1	18,650	
旭化成	0.4	0.3	1,375	
旭化成	3.7	2.5	15,025	
旭化成	1.1	0.8	1,700	
旭化成	0.6	0.4	3,440	
旭化成	2.1	1.4	1,656	
旭化成	0.9	0.6	2,910	
旭化成	9.7	6.9	12,606	
旭化成	2.2	1.5	3,301	
旭化成	0.5	1	3,225	
旭化成	3.2	2	2,584	
旭化成	0.8	0.4	1,792	
旭化成	2.1	1.6	1,672	
旭化成	2.4	1.9	5,443	
旭化成	11.5	8.9	182,450	
旭化成	1.6	1.3	1,745	
旭化成	1.1	0.5	915	
旭化成	6.2	4.7	8,159	
旭化成	6.6	5.2	12,875	

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価	価額
	千株	千株	千円	
日本化成	0.6	0.6	1,222	
日本化成	3	1.7	1,757	
日本化成	1.3	1.2	1,608	
日本化成	0.6	0.7	1,925	
日本化成	0.4	0.3	937	
日本化成	1	0.7	4,116	
日本化成	0.7	0.3	553	
日本化成	1.6	1	3,555	
日本化成	6.2	3.7	7,451	
日本化成	6.2	4.3	14,512	
日本化成	6.3	5.1	16,345	
日本化成	1.3	1	7,650	
日本化成	44	34.8	27,996	
日本化成	1.4	1	2,520	
日本化成	9.6	7.6	8,086	
日本化成	1.1	0.8	3,988	
日本化成	13.6	10.7	20,779	
日本化成	6.2	3.2	4,316	
日本化成	1.8	1.3	4,056	
日本化成	2.6	2.1	4,397	
日本化成	1	0.9	1,909	
日本化成	2.1	1.4	708	
日本化成	1.2	0.7	2,078	
日本化成	3.3	2.8	1,727	
日本化成	0.8	0.7	1,387	
日本化成	0.5	0.5	1,296	
日本化成	1.7	1.3	878	
日本化成	5	3.7	4,558	
日本化成	0.7	0.6	2,301	
日本化成	—	1	2,489	
日本化成	3.1	1.7	3,913	
日本化成	2.3	1.7	10,336	
日本化成	14.9	13	65,403	
日本化成	0.6	0.5	992	
日本化成	0.4	0.2	897	
日本化成	1.6	1.4	1,190	
日本化成	26.1	24.1	28,703	
日本化成	6.9	5.1	8,761	
日本化成	2.3	1.4	1,519	
日本化成	3.3	3.4	1,533	
日本化成	1.3	1	2,472	
日本化成	2.3	1.7	4,146	
日本化成	1.4	1.2	1,238	
日本化成	0.5	0.3	599	
日本化成	2	1.2	1,410	
日本化成	12.1	10.2	66,300	
日本化成	12.9	11.1	68,498	
日本化成	8.3	6.5	9,587	
日本化成	0.6	0.4	1,063	
日本化成	1.7	1.3	1,933	
日本化成	0.9	0.9	5,022	
日本化成	2.9	2.5	6,175	
日本化成	1.4	1.1	16,852	
日本化成	2.9	2.8	4,790	
日本化成	0.6	0.4	2,152	
日本化成	1.7	1.2	2,314	
日本化成	1.2	1.1	3,295	
日本化成	2.2	3	1,662	
日本化成	2	1.7	13,838	
日本化成	0.8	0.7	1,599	
日本化成	1.2	1	2,567	
日本化成	1.9	1.7	2,998	

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価	価額
	千株	千株	千円	
DOWAホールディングス	2	1.3	5,915	
古河機械金	0.8	0.5	684	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2.1	1	3,640	
東邦チタニウム	2.1	1.2	2,959	
UJAニC	1.2	1	2,701	
古河電気工業	2	1.5	3,735	
住友電気工業	24.4	18.3	31,622	
フタバタ電線	8.2	6.3	6,167	
リョー	3.1	—	—	
アサヒホールディングス	1	0.5	757	
金 属製 品 (0.6%)	3.1	2.7	5,597	
宮地エンジニアリンググループ	0.9	0.4	1,512	
トーカ	1.8	1.6	2,083	
SUMICO	10.6	10.4	20,092	
川田テクノロジーズ	0.6	0.3	1,134	
東洋製織グループホールディングス	4.3	3.3	6,223	
横河ブリッジホールディングス	1.4	0.6	1,288	
駒井ホールディングス	0.5	0.4	704	
和興ホールディングス	6.2	5	7,235	
文化シヤッタ	2.9	2.3	2,718	
三協立山	1.6	1.4	1,080	
ILIXI	10.6	8	18,760	
ノリツ	1.2	0.7	1,224	
長府製作所	0.6	0.3	659	
リオン	1.3	1	9,630	
岡東	2.1	2.1	1,652	
高東	1.6	0.8	995	
周波熱錬	1.6	1.3	938	
高東	1.3	0.9	1,123	
バオラック	0.9	1	2,026	
日三益	5.9	4.7	4,512	
機 械 (5.4%)	0.8	0.7	1,969	
日本浦製鋼	2.1	1.7	4,341	
日三	2.9	2.3	7,728	
タツ	2.6	1.9	2,673	
オガ	2.1	1.9	2,832	
芝浦	0.6	0.3	1,845	
アイダ	0.7	0.7	2,187	
マジン	9.8	7.3	9,417	
アエン	1.9	1.3	1,079	
FUJIN	3.2	2.3	5,234	
牧野	0.7	0.6	3,024	
オ旭	2.9	2.4	4,807	
ダイモ	3.2	2.1	1,852	
DMM	4.1	3.3	7,411	
ソデ	1.7	1.7	1,341	
日東	1	0.9	39,510	
精工	0.7	0.6	1,125	
日島	0.8	0.8	1,547	
オプ	1.2	1	2,266	
日や	1.4	1.9	1,831	
平	1.6	1.2	1,602	
ナ	0.4	0.3	2,013	
三井	3.9	3.4	11,679	
レ	0.9	1	1,450	
S	1.2	1	1,288	
ホニ	2.1	1.7	120,887	
ユオ	0.6	0.5	1,512	
	0.4	0.3	987	
	0.7	0.7	1,199	

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価	価額
	千株	千株	千円	
日精	0.4	0.3	1,243	
サトー	1	0.9	2,116	
技研	0.7	0.6	1,671	
小松	31	25	85,525	
住友	3.7	2.8	9,422	
日立	2.7	2	6,640	
日井	2.2	1.8	1,153	
井川	0.9	0.6	729	
北川	1.4	1	1,130	
ロク	0.5	0.4	4,556	
クク	33.4	28.4	59,654	
三月	0.8	0.6	1,423	
帝新	1.5	1	1,133	
新渡	1.1	0.7	1,905	
森	1	0.1	82	
コボ	0.8	0.5	1,245	
見井	2.1	1.2	1,267	
酒原	0.8	0.6	1,253	
西島	0.5	0.3	1,222	
イキ	2.8	2.2	12,870	
オト	1.5	1.3	2,041	
栗本	8.8	6.4	151,104	
大田	0.3	1	3,355	
ネ	0.7	0.5	1,398	
加藤	3.8	3	18,270	
フジ	0.8	0.5	1,665	
キ平	1.2	0.9	702	
理S	2	1.6	1,584	
日フ	3.8	2.8	20,888	
竹内	1.5	1	1,065	
ア	3.7	3	3,195	
J	2.5	2	6,800	
ジ	2.1	1.7	3,755	
キ平	1.1	—	—	
理S	1.4	1.7	4,532	
日フ	0.7	0.6	1,505	
竹内	1.1	1	5,690	
ア	2.1	1.6	2,040	
J	0.6	0.5	2,260	
ジ	1	0.6	1,830	
ウ	1.3	1.1	3,454	
マ	1.7	1.6	4,222	
コ	1.6	1.4	896	
ク	1.6	1.3	850	
リ	0.9	0.7	1,540	
工	1.5	1.1	3,224	
業	1	0.8	1,346	
業	1.6	1	1,267	
セ	6.6	4.2	10,311	
ガ	1.7	1	1,381	
サ	0.5	0.3	794	
日	1.1	0.6	858	
T	1.9	1.7	1,725	
ツ	2	3.5	17,307	
ホ	1.6	1.2	786	
大	12.2	9	7,056	
N	14.3	12.3	4,464	
ジ	6.2	4.4	4,743	
不	0.5	0.3	1,180	
日	3.1	2.3	1,403	
T	4.2	3	9,555	
ユ	1.6	1.7	1,271	

銘柄	業	期首		期末	
		株数	千株	評価	金額
イグ	業	1	0.8		990
日一本	工	1	0.7		2,502
キマ	工	2.8	2.6		2,381
日三	工	8.4	6.8		21,794
I	工	6.6	5.1		4,768
三I	工	10.4	9.5		47,063
S	工	4.4	3.5		12,180
ホ	工	1.4	0.9		1,606
日	工	4.3	3.9		4,063
清	工	3.7	3.2		15,632
イ	工	14.5	11		6,424
コ	工	8.1	6.9		14,020
プ	工	11.8	9.4		23,105
ミ	工	33	26.2		184,710
日	工	12.1	10.5		43,932
東	工	67.5	55.2		86,829
三	工	4.1	3.2		16,736
富	工	1.8	1.7		1,535
東	工	7.4	6.3		35,154
安	工	1.9	1		1,754
シ	工	1.3	1		1,976
ン	工	0.4	0.3		1,788
明	工	0.9	0.6		1,002
山	工	—	0.6		6,024
ア	工	0.8	0.8		3,176
ソ	工	1.6	1.3		4,940
東	工	17.9	13.2		90,076
マ	工	0.8	0.6		1,443
日	工	0.8	0.5		2,220
東	工	9.6	8.3		3,328
ダ	工	1.6	—		—
J	工	2	1.1		588
日	工	5.7	5		38,670
大	工	0.9	1		2,794
オ	工	1.3	0.9		3,208
日	工	2.4	1.8		4,388
I	工	0.3	0.3		1,015
ジ	工	0.3	0.3		39,270
エ	工	8.8	7.7		99,198
ス	工	6.2	5.4		99,198
メル	工	3.2	2.6		1,921
コ	工	0.7	0.4		928
ホ	工	0.7	0.6		7,008
本	工	1	0.7		1,414
日	工	37.5	35.4		65,012
富	工	8.5	7.1		13,490
沖	工	6.1	5		3,460
電	工	1.3	1.3		6,851
サ	工	1.7	0.9		1,599
ン	工	1.7	1		1,063
ア	工	2.9	2.7		1,142
ル	工	0.8	0.6		1,005
ネ	工	2	1.3		1,671
サ	工	73.1	62.9		76,863
シ	工	8	6.8		6,419
ワ	工	4.6	3.8		4,776
ア	工	2	1.7		6,613
ア	工	43.1	37.8		442,260
日	工	10	8.7		41,499
京	工	3.7	3		2,385
能	工	5.9	4.8		6,288
エ	工	—	0.7		2,039

銘柄	業	期首		期末	
		株数	千株	評価	金額
日	工	0.4	0.5		1,617
ロ	工	0.7	0.5		1,640
フ	工	1.2	1		1,038
S	工	0.8	0.5		1,275
ホ	工	2.1	1.6		2,670
日	工	1.1	0.9		15,525
三	工	1.7	1.2		2,752
I	工	1.5	1.7		1,407
マ	工	1.6	1.2		1,776
古	工	1.5	1.4		1,359
ア	工	0.6	0.5		1,295
横	工	6.7	5.7		12,403
新	工	0.5	0.3		1,143
ア	工	4.1	3.7		13,357
日	工	2.9	2.6		9,399
共	工	5.1	5.3		1,876
堀	工	1.3	1.1		8,437
ア	工	5.2	4.3		49,020
ド	工	0.8	0.7		1,444
ス	工	6.2	5.3		318,901
エ	工	0.4	0.3		2,490
日	工	5.9	4.7		40,358
シ	工	1.8	1.5		1,999
本	工	0.8	0.6		1,761
メ	工	0.5	0.3		1,204
コ	工	2.4	1.5		1,723
イ	工	0.7	0.6		2,955
オ	工	1.4	1.2		2,511
バ	工	0.7	0.4		920
ラ	工	3.1	2.5		53,062
ア	工	4.7	3.7		10,981
レ	工	0.8	—		—
ス	工	3.6	2.7		4,303
岩	工	0.7	0.7		1,935
ウ	工	1.4	1.1		936
日	工	0.7	0.8		906
遠	工	—	0.7		2,425
古	工	1.6	1.4		5,880
図	工	5	4.2		5,510
日	工	6	5.2		125,476
カ	工	0.3	0.3		1,327
フ	工	2.6	1.2		908
エ	工	3	2.4		25,536
大	工	4.9	4.3		28,982
ロ	工	0.8	0.6		4,236
浜	工	2.2	2		7,620
松	工	9.4	8.2		56,383
井	工	3.4	2.7		11,542
光	工	20.2	16.2		124,383
三	工	0.4	0.6		327
新	工	1.8	1.4		1,995
京	工	2.6	1.5		2,166
太	工	1	0.8		1,856
村	工	1.8	1.2		2,313
双	工	3.8	6.3		15,239
北	工	2.6	2.3		1,244
二	工	1.3	1		11,380
日	工	0.8	0.6		1,108
K	工	33.9	29		86,130
小	工	19.1	13.9		14,595
ミ	工	2	1.7		2,713
S	工	4.4	3.8		182,514

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価	価額
	千株	千株	千円	
輸送用機器(7.5%)				
トヨ自動車	2.8	2.2	4,734	
豊田自動織機	1.2	1.2	1,118	
モリタホタル	5.5	3.8	32,794	
三菱電機	1.1	1.1	1,417	
三洋電機	1.5	1.6	1,120	
東海理化	15.1	11	83,017	
東川理崎	1.5	1.2	2,010	
名村工業	5.3	4.2	12,600	
三菱重工業	5.8	1.8	653	
近畿自動車	1.2	0.9	763	
日産自動車	0.8	0.8	1,210	
イトヨ自動車	80.6	74.3	39,445	
日野自動車	21.9	15.6	26,036	
三武自動車	347.1	293.1	555,717	
武蔵精密	8.7	6.9	3,829	
日新自動車	26.5	21.6	12,031	
日新自動車	1.9	1.6	2,912	
日新自動車	0.8	0.5	454	
日新自動車	1.6	2	2,360	
日新自動車	1.6	1	1,596	
日新自動車	1.1	1	1,994	
日新自動車	0.5	0.3	700	
日新自動車	1.4	0.8	1,008	
日新自動車	3.1	1.7	2,380	
日新自動車	3.3	3.5	1,512	
日新自動車	—	0.4	1,610	
日新自動車	2.5	2.1	1,094	
日新自動車	4.2	2.6	1,300	
日新自動車	2	1.6	1,880	
日新自動車	3.7	—	—	
日新自動車	5	4	15,180	
日新自動車	21.9	17.5	22,890	
日新自動車	1.3	1.3	1,050	
日新自動車	53.6	43	155,359	
日新自動車	15.7	9.8	47,912	
日新自動車	19.3	16.9	37,703	
日新自動車	8.9	8.3	29,880	
日新自動車	3.1	3.3	917	
日新自動車	0.9	0.5	927	
日新自動車	2.1	1.7	3,930	
日新自動車	1.8	1.5	1,375	
日新自動車	0.9	1	831	
日新自動車	1	0.8	1,237	
日新自動車	2.7	2.2	47,212	
日新自動車	2.8	2.4	4,204	
日新自動車	1.3	0.7	1,126	
精密機器(2.6%)				
テックエレクトリック	19.3	16.6	59,560	
日島津製作所	1.8	2.3	2,051	
東京エレクトリック	2.6	1.5	1,440	
東京エレクトリック	8.8	6.5	25,935	
東京エレクトリック	0.4	0.4	996	
東京エレクトリック	1.6	1.1	1,436	
東京エレクトリック	1.3	1.2	6,144	
東京エレクトリック	2.8	2.6	4,963	
東京エレクトリック	10.4	8.3	11,445	
東京エレクトリック	3.4	3	5,451	
東京エレクトリック	36	33.5	79,981	
東京エレクトリック	0.8	0.4	2,228	
東京エレクトリック	0.6	0.5	1,680	
東京エレクトリック	13.4	11.6	165,242	

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価	価額
	千株	千株	千円	
朝日インテック	7.8	6.1	14,353	
日チズン時計器	7.6	6	5,088	
大研医コ	4	4.7	2,335	
メセニックグループ	2.4	1.9	5,464	
セニエ	1.1	1	2,983	
その他製品(2.2%)	5.1	3.9	4,071	
スノーピーク	1.2	1.1	2,356	
パラマウントベッドホールディングス	1.1	1.1	2,657	
前田工業	1.1	0.9	2,988	
永大産業	3.3	4	928	
アートネイチャー	2.2	2.5	1,917	
バンダイナムコホールディングス	6.2	4.9	41,262	
S H O E I	0.7	0.6	3,306	
フランスベッドホールディングス	1	0.5	520	
パイロットコーポレーション	1.2	0.9	3,847	
フジシールインターナショナル	1.7	1.2	1,855	
カヲト	2.7	2.4	3,328	
プロネクス	2.1	2	1,958	
ウッドワフ	1.1	0.8	1,036	
大凸出版	0.7	0.4	920	
日共本印	10.1	7	19,369	
N I S S H K A	8.1	6.3	24,759	
アイシックス	0.7	0.4	1,127	
アソツラマ	1.8	1.2	2,160	
河合楽器製作所	6.2	5	18,150	
河合楽器製作所	0.4	0.3	696	
河合楽器製作所	—	0.4	1,622	
河合楽器製作所	4	3.3	16,995	
河合楽器製作所	0.4	0.3	825	
河合楽器製作所	2.6	1.9	1,358	
河合楽器製作所	4.4	3.6	7,279	
河合楽器製作所	0.9	0.6	1,339	
河合楽器製作所	2.6	2.5	1,940	
河合楽器製作所	3.9	33.7	173,487	
河合楽器製作所	1.2	0.8	1,253	
河合楽器製作所	1.4	0.6	915	
河合楽器製作所	2.9	2	3,820	
河合楽器製作所	0.8	0.6	1,524	
河合楽器製作所	2.4	1.7	2,339	
河合楽器製作所	0.8	0.4	1,418	
電気・ガス業(1.2%)				
東京電力ホールディングス	54.4	48.7	22,791	
中部電力	19.1	19.3	28,100	
関西電力	25.5	20.5	26,793	
中国電力	10	8.7	6,037	
北陸電力	6.4	5.8	3,514	
東北電力	14.4	13.6	9,180	
四国電力	5.9	4.8	3,628	
九州電力	13.9	12.5	9,400	
北海道電力	6.8	6.1	2,989	
北海道電力	1.1	1	1,067	
北海道電力	5.6	4.2	9,324	
北海道電力	1.4	1.1	2,084	
北海道電力	13	11.4	29,184	
北海道電力	12.2	11	24,563	
北海道電力	3.3	2.2	5,599	
北海道電力	1.3	1	1,907	
北海道電力	1.1	0.9	1,637	
北海道電力	2.5	1.5	1,734	
北海道電力	1.1	0.8	1,384	

銘柄	業 柄	期首	当期	期末	
		株数	株数	評価額	
		千株	千株	千円	
陸	運業 (2.9%)				
	東武鉄道	6.8	6	18,360	
	相模鉄道	2.4	2.1	4,750	
	東京急行電鉄	17.3	14.8	25,648	
	小田急電鉄	9.3	6.6	8,388	
	京王電鉄	10.4	8.1	13,097	
	京成電鉄	3.6	2.9	13,775	
	富田電鉄	4.8	3.5	14,052	
	東日本旅客鉄道	1.1	0.8	3,464	
	西日本旅客鉄道	12	9	65,349	
	西武旅客鉄道	8.4	6.7	36,213	
	西武ホールディングス	5.7	4.1	63,611	
	鴻池運輸	9.8	7	9,373	
	西日本鉄道	1.1	1	1,511	
	ハルカイトレックス	2	1.6	3,865	
	サカイ引越センター	0.6	0.4	1,300	
	近畿グループホールディングス	0.4	0.3	1,377	
	阪神ホールディングス	6.6	5.5	23,402	
	南海電気鉄道	7.6	7	27,510	
	京阪ホールディングス	2.8	2.7	7,835	
	神戸電鉄	3.1	2.3	7,981	
	名古屋鉄道	0.5	0.6	1,926	
	山陽電気鉄道	5.3	5.8	11,872	
	ヤマトホールディングス	0.8	0.6	1,342	
	山九	9	7	16,107	
	丸全昭和運輸	1.7	1.2	6,072	
	センコーグループホールディングス	0.7	0.5	1,620	
	ニッコンホールディングス	3.2	3	2,931	
	福山通運	2	1.5	3,892	
	セイノーホールディングス	1.1	0.5	1,782	
	神奈川中央交通	4	3	4,365	
	日立物流	0.2	0.3	996	
	AZ-COM丸和ホールディングス	1.4	—	—	
九州旅客鉄道	1.8	1.7	3,252		
S Gホールディングス	5	3.7	11,155		
NIPPON EXPRESSホールディングス	12.5	10.4	20,061		
海	運業 (0.7%)	2.2	2	15,760	
	日本郵船	5.6	14.5	49,227	
	商船三井	3.7	9.6	33,792	
	川崎汽船	2.1	4.8	16,080	
	NSユナイテッド海運	0.6	0.3	1,390	
	飯野海運	4.8	2.5	2,827	
	空	運業 (0.5%)			
		日本航空	14.8	13	33,800
		ANAホールディングス	16.5	14.3	39,939
		倉庫・運輸関連業 (0.1%)	ムラコ	0.3	0.2
日新			0.7	0.5	1,102
三菱倉庫			2	1	3,270
三井倉庫			1.1	0.7	2,803
住友倉庫			2.1	1.5	3,397
澁田倉庫			1.1	0.6	1,342
安田倉庫			1	1.1	1,135
東洋頭組	1.3		1	1,403	
近鉄エクスプレス	3.3		2.7	7,686	
情報・通信業 (8.5%)	1.4		—	—	
NECシステムズ	2.8	2.3	3,813		
ニッセイシステムズ	11.3	10.3	3,275		
デジタライゼーション	0.5	0.4	2,104		
日鉄ソリューションズ	1.2	1	3,590		

銘柄	業 柄	期首	当期	期末
		株数	株数	評価額
		千株	千株	千円
T I S	グーエーテクノロジーホールディングス	6.7	6.2	21,917
	コーエーテクモホールディングス	6.1	3.8	2,679
	K L a b	2.2	3.6	8,290
	ボールトゥウィンホールディングス	2.9	2.3	890
	ネコソフ	2.5	1.9	1,729
	コロパシ	15.5	13.8	42,228
	プロードリーフ	2.2	2.1	1,270
	デジタルハーツホールディングス	5.4	4.6	2,010
	S H I F T	1.2	0.8	1,212
	テイーガイア	0.4	0.4	8,800
	テクマトリックス	1	0.6	1,002
	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	1.4	2,084
	GMOペイメントゲートウェイ	1.9	1.7	4,374
	インターネットイニシアティブ	1.4	1.3	14,430
	コムチユア	2.2	3.4	9,220
	ラクス	—	1.1	2,394
	チエンジ	2.6	3	5,196
	マナーフォワード	1.7	1.7	4,216
	Appier Group	1.2	1.5	6,900
	野村総合研究所	—	2	3,734
	インテージホールディングス	13.4	11.2	33,566
	インフォコム	1.7	1.1	1,702
	シンプレクス・ホールディングス	1.3	1	2,375
	ブラクス	—	1.1	2,635
	メルカリ	0.9	2	3,332
	S a n s a n	—	3	7,407
	メドレ	2.7	2.4	3,883
	J M D C	—	0.5	2,120
	フジメディア・ホールディングス	0.7	1	4,300
	オービッツ	5.5	3.8	4,632
	ジャストシステム	2.1	1.8	36,612
	T D C ソフト	1.2	1	3,415
	Zホールディングス	2.1	1.6	2,406
	トレンドマイクル	100.6	79	29,245
	日本オライクル	3.7	3.2	20,800
	フューチャー	1.2	1	9,040
	オービックビジネスコンサルタント	2.1	1.7	3,031
	伊藤忠テクノソリューションズ	0.8	1.2	5,838
	大塚商会	3.5	3.1	9,842
	サイボウズ	3.8	3.2	14,992
	電通国際情報サービス	1.4	1.3	4,030
	デジタルガレージ	1.2	0.8	3,884
ウェザーニューズ	1.3	1	4,265	
W O W O W	0.3	0.3	2,025	
ネットワンシステムズ	0.7	0.7	902	
アルゴグラフィックス	2.7	2.2	6,809	
マーベラス	1	0.6	2,277	
エイベックス	1.8	1.2	847	
B I P R O G Y	1.5	1.2	1,860	
兼松エレクトロニクス	2.4	2.1	6,615	
T B Sホールディングス	0.5	—	—	
日本テレビホールディングス	4	2.4	4,692	
テレビ朝日ホールディングス	5.2	4.1	4,879	
スカパーJ SATホールディングス	1.9	1	1,571	
テレビ東京ホールディングス	5.2	5	2,655	
コネクシオ	0.8	0.7	1,697	
日本通信	0.8	—	—	
日本電信電話	11.1	8.6	2,167	
K D D I	70.4	68.7	273,838	
ソフトバンク	49.1	41.5	170,689	
光通	102.5	86.6	133,970	
	0.8	0.7	13,776	

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価	価額
	千株	千株	千円	
GMOインターネットグループ	3	2.5	6,437	
K A D O K A W A	4.3	3.1	8,512	
学研ホールディングス	2	1.9	1,641	
ゼンリ	1.9	1.5	1,276	
松竹	0.5	0.3	3,423	
東宝	4.1	3.4	16,796	
東映	0.2	0.2	3,590	
エヌ・ティ・ティ・データ	18.3	17.1	30,557	
D T S	1.8	1.4	4,620	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3.2	2.8	17,612	
カブコム	6.5	5.4	23,733	
S C S	5	4.5	8,847	
N S W	1.1	1	2,197	
アイネ	1.6	1.4	1,989	
T K S C	1.6	1.1	4,136	
富士フクト	0.9	0.7	5,831	
N S D	2.6	2.2	5,458	
コナミグループ	2.5	2.3	14,513	
J B C Cホールディングス	1.6	1.2	2,576	
ソフトバンクグループ	40.6	31	165,633	
卸売業(6.1%)				
エレマ	1	0.9	1,702	
あらた	0.6	0.4	1,672	
円谷フィールズホールディングス	1.8	0.7	2,873	
双日	7.7	6.2	17,341	
アルフレッサホールディングス	7.3	5.3	9,243	
横浜冷凍	1.2	1	1,011	
アルニコ	1.5	1.2	1,675	
神戸物産	5.6	4.5	15,862	
あいホールディングス	1.1	1	2,278	
ダイワボウホールディングス	3.5	2.3	5,191	
マクニカホールディングス	1.7	1.5	5,535	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1.6	0.6	589	
レスターホールディングス	0.4	0.3	718	
TOKAIホールディングス	3.3	2.8	2,483	
シップヘルスケアホールディングス	2.3	2.2	5,341	
コマダホールディングス	2.1	2	4,752	
フルサト・マルカホールディングス	—	0.6	1,746	
小野建	1	0.8	1,241	
エコートレーディング	2.2	2	1,648	
ナイレーベン	1.1	0.8	1,610	
三菱食品	0.7	0.5	1,667	
三田	0.8	0.7	1,667	
第一産業	1.4	1.1	4,763	
メディアバルホールディングス	6.8	5.7	10,721	
アズワ	1.2	1	5,580	
ドウシヤ	1	0.8	1,565	
高速	0.9	0.9	1,800	
日本ライフ	2.2	2.1	2,047	
I D O M S	3.1	2.5	2,195	
イシク	1.2	1	1,402	
伊藤忠商事	47.1	34.9	149,476	
丸紅	66.3	44.5	83,415	
長瀬産	2.9	2.3	5,066	
豊田通	6.7	4.9	27,538	
兼松	2.5	2.1	3,595	
三井物産	52.8	41.6	173,846	
日本紙パルプ	0.2	0.3	1,671	
日カス	1	0.6	913	
山澤	0.9	0.8	1,832	
山善	2.9	1.7	1,827	
住友商	41.5	34.9	84,388	

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価	価額
	千株	千株	千円	
内田洋行	0.4	0.3	1,512	
三菱商事	50.6	35.5	177,180	
第三セクター	0.6	0.4	2,136	
キャノンマーケティングジャパン	1.9	1.3	4,199	
三菱商事	0.5	0.5	1,364	
ユアサ	0.8	0.5	1,942	
大阪興業	1.5	1.2	4,800	
正栄食品工業	0.7	0.5	2,177	
三菱商事	0.8	0.6	1,152	
岩谷産業	1.9	1.4	8,246	
三愛オ	2.1	1.7	2,456	
三和	1.3	1.3	3,610	
ワキタ	1.7	1.2	1,417	
東邦ホールディングス	1.9	1.2	2,809	
サゲ	1.9	1.2	2,880	
藤忠エネ	0.8	0.2	230	
伊サリ	2.2	1.7	7,378	
サリ	0.9	0.6	1,989	
新三光	1.7	1.5	1,984	
東陽	0.9	0.6	1,519	
モス	1.8	1.3	1,839	
加立	1	1	3,075	
日立	0.8	0.6	3,102	
日立	0.6	0.6	1,248	
ヤマタ	1	0.9	4,482	
日鉄	1.1	1.2	2,062	
トラスコ	0.4	—	—	
オートバックス	1.5	1.3	2,857	
加藤	1.9	1.2	1,783	
イトー	1	0.7	2,492	
日エ	1.3	1	1,833	
日因	0.6	0.6	1,201	
ミスミ	1.4	1	2,958	
スズ	8.5	8.6	28,638	
小売業(4.6%)	2.4	1.8	6,336	
ロソ	1.4	1.4	7,714	
カワチ	0.3	0.3	1,263	
エービーシー	0.6	0.4	940	
アース	1.1	0.9	6,489	
ゲオ	1.4	1.7	2,878	
アド	1.4	1	1,714	
くら	1.1	0.8	1,960	
キヤン	0.9	0.9	3,073	
バルグループ	1.2	0.4	986	
エデ	1.2	0.7	2,074	
サラー	2.4	2	2,724	
ハニズ	2.6	2.1	1,593	
アル	1.6	1.1	1,761	
クオール	0.8	0.5	994	
ジンズ	1.4	1.2	1,413	
ジンズ	0.5	0.5	1,862	
ビック	3.6	4.1	4,784	
D C M	4	3.9	4,508	
M o n o t a R O	9.1	8.3	15,106	
J・フロント	8.4	7	9,366	
ドール	8.4	7	9,366	
ドール	1.2	0.7	1,333	
マツキョ	4.3	3.5	23,590	
ブロン	1.3	0.7	1,722	
Z O Z O	1.3	0.7	1,722	
Z O Z O	4.8	3.9	11,758	
物語	0.5	1.2	3,254	
三越伊勢丹	12	9.7	14,356	

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価	価額
	千株	千株	千円	
ウエルシアホールディングス	3.8	3.3	9,302	
クリエイティブSDホールディングス	1.1	0.9	3,078	
チムニ	1.3	1.6	1,918	
オイシックス・ラ・大地	1.1	1.1	2,425	
ネクステラ	1.8	1.6	4,625	
ジョイフル本田	2	1.9	3,364	
すかいらくホールディングス	8.9	7.7	12,566	
エイトッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1.4	1.7	1,897	
あさひ	1.6	1.4	1,911	
コスモス薬品	0.8	0.7	8,309	
セブン&アイ・ホールディングス	26.4	19.5	120,900	
クリエイティブ・レストランツ・ホールディングス	4	4.6	4,889	
ツルハホールディングス	1.5	1.2	10,488	
サンマルクホールディングス	1.5	0.8	1,440	
トリドールホールディングス	2.1	1.7	4,746	
クスリのアオキホールディングス	0.8	0.7	4,739	
FOOD & LIFE COMPANIES	4.1	3.5	12,845	
ノジマ	1.3	2	2,846	
カッパ・クリエイティブ	2	1.6	2,339	
良品計画	7.8	7.5	10,462	
ココナ	2.8	2.3	841	
コーナ商事	1.3	0.9	2,920	
エスコ	1.2	0.9	1,665	
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	13.9	11.6	30,067	
西松屋チェーン	1.9	1.7	2,750	
ゼンショーホールディングス	3.4	3.3	13,480	
サイゼリヤ	1.4	1	3,350	
Vホールディングス	3.6	2.7	1,436	
ユニテッドアローズ	1.1	0.8	1,500	
ハイウェイ高	1.7	1	2,081	
コロワイド	3	2.8	5,544	
荖番屋	0.4	0.4	1,950	
スギホールディングス	1.5	1.3	7,306	
ヨンドシーホールディングス	0.9	0.6	1,081	
木曾路	1.4	1.1	2,469	
SRSホールディングス	2.8	2.1	1,976	
ケーヨー	1.9	1.7	1,428	
上新電機	0.8	0.5	1,038	
日本瓦斯	3.8	3.2	6,160	
ロイヤルホールディングス	1.6	1.5	4,159	
チヨダ	0.6	0.5	411	
ライフコーポレーション	0.8	0.6	1,577	
リンガーハット	1.4	1.2	2,690	
AOKIホールディングス	2.1	1.5	1,321	
オーク	1.1	1	855	
ココメ	1.1	1	2,742	
青い山	2.1	1.4	1,423	
青い山	0.8	0.7	9,380	
高松島	4.9	4.3	8,591	
高松	2.1	1.6	1,860	
エイチ・ツー・オー	3.1	2.9	4,408	
近鉄百貨店	0.3	0.1	244	
丸井グループ	6.1	4.3	9,206	
アクシアル	0.7	0.5	1,730	
イズ	25.9	19.3	49,658	
イイズ	1.3	0.9	2,785	
平和	0.9	0.7	1,446	
フジ	1	1	1,729	
ヤオコ	0.8	0.7	4,809	
ゼビオホールディングス	1	0.8	837	
ケーズホールディングス	6.2	4.4	5,359	
アインホールディングス	1.1	0.9	5,121	

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価	価額
	千株	千株	千円	
ヤマダホールディングス	22.9	23.5	11,491	
アークランズ	1.5	1.3	1,931	
ニトリホールディングス	2.7	2.3	35,753	
吉野家ホールディングス	2.7	2.3	5,476	
サガミホールディングス	2.6	1.8	2,352	
王将フードサービス	0.4	0.3	1,836	
ミースト	0.2	0.3	419	
アークス	1.1	0.7	1,565	
パローホールディングス	1.4	0.9	1,834	
ベルク	0.4	0.3	1,674	
ファーストリテイリング	0.9	2.7	77,584	
サンドラッグ	2.6	2.3	8,211	
サックスパーホールディングス	2.9	2	1,626	
ベルーナ	2.1	1.6	1,153	
銀行業(6.5%)				
いざぎんホールディングス	—	5.9	4,743	
しずおかフィナンシャルグループ	—	12.3	12,976	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	—	3.7	3,540	
じもとホールディングス	2.5	2.7	1,174	
めぶきフィナンシャルグループ	29.8	24	8,808	
東京きらばしフィナンシャルグループ	1.5	0.9	2,596	
九州フィナンシャルグループ	12.7	7.8	4,048	
ゆうちょ銀行	13.2	13.3	15,920	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	34.4	28.1	15,932	
西日本フィナンシャルホールディングス	3.8	2.8	3,124	
三十三フィナンシャルグループ	0.9	0.3	520	
第四北越フィナンシャルグループ	0.9	0.5	1,590	
ひろぎんホールディングス	7.7	5.5	3,839	
おきなわフィナンシャルグループ	0.5	0.6	1,380	
十六フィナンシャルグループ	0.9	0.5	1,627	
北國フィナンシャルホールディングス	0.8	0.5	2,135	
プロクレアホールディングス	—	1	2,265	
あいちフィナンシャルグループ	—	0.8	1,966	
SBI新生銀行	4.7	1.8	4,473	
あおぞら銀行	3.9	2.8	7,226	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	421.8	333.7	311,241	
りそなホールディングス	79.9	69.4	50,925	
三井住友トラスト・ホールディングス	13	9.8	50,617	
三井住友フィナンシャルグループ	46.1	38.2	225,953	
千葉銀行	21	14.9	14,318	
群馬銀行	11.7	9.3	4,650	
武蔵野銀行	1	0.3	747	
筑波銀行	13.4	10.5	2,436	
七十七銀行	1.4	1.4	3,236	
青森銀行	0.9	—	—	
秋田銀行	1	0.7	1,357	
山形銀行	1.6	1.2	1,459	
山梨銀行	1	0.7	1,710	
岩手銀行	1	0.7	1,710	
東邦銀行	6.6	3.4	809	
東北銀行	2.1	1.9	1,943	
ちのく銀行	2.1	—	—	
ふくおかフィナンシャルグループ	5.2	4.2	12,037	
静岡銀行	14.3	—	—	
スルガ銀行	6.2	4.4	1,883	
八十二銀行	12.4	9	5,544	
山梨中央銀行	1.4	0.8	1,047	
山梨共立銀行	1.4	0.9	1,845	
福井銀行	1.2	0.6	1,005	
福清銀行	1.5	1.2	1,821	
滋賀銀行	1.1	0.8	2,311	
南都銀行	0.7	0.9	2,404	
百五銀行	5	2.7	1,104	

銘柄	期首 株数	当期 株数	期末	
			評価	価額
	千株	千株	千円	
京都市銀行	2.2	1.6	10,576	
紀陽銀行	2.3	1.7	2,760	
ほくほくフィナンシャルグループ	3.8	3.5	3,717	
山中陰合同銀行	4	2.5	2,077	
伊予四国銀行	4.3	—	—	
百十四銀行	7.1	—	—	
四国銀行	0.7	0.5	1,001	
阿波分岐銀行	1.7	0.6	573	
大宮北野銀行	0.9	0.6	1,299	
佐賀銀行	0.9	0.6	1,369	
琉球銀行	0.7	0.5	1,343	
セブン銀行	1	0.9	1,652	
みずほフィナンシャルグループ	2.4	1.7	1,756	
山口フィナンシャルグループ	17.9	16.5	4,521	
名古屋銀行	85.3	75.5	159,682	
北洋銀行	5.4	3.9	3,576	
愛媛銀行	0.5	0.3	1,039	
京葉銀行	10.5	8.6	2,717	
栃木銀行	0.6	—	—	
日本銀行	2.1	1.2	1,150	
東福和銀行	2	2.1	1,350	
大東東銀行	10	4.3	1,453	
トモニホールディングス	1.4	1.1	2,395	
フィデアホールディングス	4	2.7	1,641	
池田泉州ホールディングス	4.8	6.2	1,624	
証券・商品先物取引業 (0.8%)	3.4	2.6	1,905	
FPG	6.8	4.8	1,876	
SBIホールディングス	2.1	1	1,495	
ジャフコグループ	10	7.7	2,002	
野村ホールディングス	3.6	2.5	2,937	
野村証券グループ本社	8.6	7.7	22,168	
野村ホールディングス	2.9	2	4,484	
丸三証券	48.8	36.8	23,920	
東三証券	103.5	95.1	52,095	
東洋証券	3.5	2.9	1,238	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	3.6	3.7	1,631	
水戸証券	11.1	5	1,740	
いちよし証券	6.8	5.1	1,938	
松井証券	4.8	5.4	1,647	
マネックスグループ	2.7	2.1	1,344	
極東証券	2.7	2.5	2,027	
岩井コスモホールディングス	6.5	6.5	2,912	
保険業 (2.4%)	2	1.8	1,126	
かんぽ生命保険	1.9	1	1,376	
SOMPOホールディングス	6.6	6.3	15,302	
アニコムホールディングス	11	9	52,596	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3.5	2.7	1,495	
第一生命ホールディングス	14.7	10.6	47,763	
東京海上ホールディングス	33.7	27	74,223	
T&Dホールディングス	22.3	52.9	152,404	
その他金融業 (1.2%)	18.2	14.2	27,306	
全日本生命	1.7	1.5	8,265	
ネットプロテクションズホールディングス	—	1.8	1,990	
クレディセゾン	1.6	—	—	
芙蓉総合リース	4.7	3.7	6,996	
みずほリース	0.7	0.5	4,795	
東証チユリ	1.2	0.8	2,968	
日本証券金融	1.4	1	4,775	
	3.7	2.5	2,582	

銘柄	期首 株数	当期 株数	期末	
			評価	価額
	千株	千株	千円	
アイフル	14.2	10.7	3,937	
アールリース	0.6	0.4	1,642	
イオンフィナンシャルサービス	3.8	3.2	4,067	
アオンコム	15.4	10.9	3,716	
アジャックシステム	1.1	0.8	3,728	
オリエントコーポレーション	23.7	1.8	2,127	
オリックシステム	39.9	34.2	82,097	
三菱HCキャピタル	22.7	18.6	13,578	
日本取引所グループ	17.3	14.8	30,095	
イー・キャランティ	1.3	1.1	2,367	
NECキャピタルソリューション	0.6	0.3	824	
不動産業 (1.9%)	—	—	—	
大東建設	—	1.9	24,966	
いち託	9	7.7	2,217	
日本駐車場開発	17.3	11	2,717	
ヒューリック	17.2	12.3	13,591	
野村不動産ホールディングス	3.8	3.3	10,098	
サムイ	—	1	2,181	
フージャースホールディングス	3.2	2.3	1,994	
オープンハウスグループ	2.3	2	9,990	
東急不動産ホールディングス	20.5	16.3	10,839	
飯田グループホールディングス	5.7	4.6	10,506	
一ク24	4.2	4.4	8,514	
三井不動産	31.1	23	60,099	
三菱地所	44.2	31.9	53,113	
平和不動産	1.4	1	3,815	
東京建設	7.2	5.1	8,573	
京阪神ビルディング	1.8	1.2	1,452	
住友不動産	14.5	9.7	31,020	
テオ動シ	2	1.5	972	
東京楽天地	0.4	0.4	1,680	
レオパレス21	—	7.3	2,445	
スターツコーポレーション	1.2	0.8	2,120	
空港施設	3.4	2.3	1,308	
ゴールドクレスト	0.8	0.5	867	
MIRARTHホールディングス	8.9	5.3	2,040	
イオンモール	3.4	2.6	4,622	
イカチタス	1.9	1.7	4,557	
サンフロンティア不動産	2	1.6	2,363	
日本空港ビルデング	2.1	1.6	2,044	
サードビス業 (5.0%)	2.7	1.9	12,502	
日本精工	0.8	0.6	2,025	
LIFULL	6.6	9	2,016	
MIXI	1.9	1.6	4,433	
日本M&Aセンターホールディングス	11.1	9.8	10,495	
UTグループ	1.2	1	2,382	
オープンアップグループ	2.2	2.1	4,032	
コシダカホールディングス	—	2.4	2,265	
エス・エム・エス	2.5	2.3	7,406	
パーソルホールディングス	6.8	6.3	16,890	
クックパッド	10.8	7.3	1,620	
シミックホールディングス	1.6	1.1	2,222	
総合警備保障	2.7	2.2	8,052	
カカクコム	5.3	4.5	8,464	
デイトック	1.5	1.1	3,938	
新日本科学	—	0.8	2,360	
ベネフィット・ワン	2.6	2.9	5,910	
エム・ス・リ	12	11.2	36,568	
アウトソーシング	4.2	3.7	5,143	
ディー・エヌ・エー	3.1	3	5,361	
博報堂DYホールディングス	9.5	7.3	11,380	

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ぐるなび	2.7	2.9	986
ジャパンベストレシキューシステム	1.6	1.4	1,080
ファンコミュニケーションズ	5.3	4.9	2,009
パリュウコーマース	0.9	0.8	1,340
インフォーマート	7.9	7	2,058
J Pホールディングス	11.2	7.7	2,664
プレステージ・インターナショナル	4	3.6	2,293
電通グループ	6.9	5.8	26,535
テイクアンドグヴ・ニーズ	1.2	0.6	836
H. U. グループホールディングス	1.8	1.7	4,765
オリエントラランド	7.7	5.8	128,296
ダスキン	1.3	1.2	3,954
明光ネットワークジャパン	4.4	3.2	2,025
ファルコホールディングス	1.2	1	1,996
ラウンドワン	2.5	5.3	2,819
リゾートトラスト	3.5	2.3	4,958
ビー・エム・エル	1.1	0.9	2,911
りらいあコミュニケーションズ	2.1	—	—
ユー・エス・エス	7.5	5.7	13,092
サイバーエージェント	17.1	13.7	15,467
楽天グループ	35.2	26.5	17,304
フルキャストホールディングス	—	0.8	1,965
エン・ジャパン	1.3	1.2	3,007
テクノプロ・ホールディングス	4.2	3.4	12,291
アイ・アールジャパンホールディングス	0.4	0.5	1,135
Ke e P e r 技研	—	0.5	2,360
ジャパンマテリアル	2.4	1.9	4,195
M&Aキャピタルパートナーズ	0.7	0.7	2,569
リクルートホールディングス	50.8	40.9	144,581
日本郵政	83.4	70.3	86,574
ベルシステム24ホールディングス	1.9	1.3	1,951
ソラースト	2.3	2.4	1,564
インソース	—	1.7	2,397
ベイカレント・コンサルティング	0.5	4.3	23,865
ジャパンエレベーターキーズホールディングス	2.7	2.3	4,485
リログループ	3.9	3.2	6,963
TREホールディングス	1.4	1.4	2,149
エイチ・アイ・エス	2	—	—
共立メンテナンス	1.4	1.1	6,039
イチネンホールディングス	1.4	1.7	2,266
建設技術研究所	1.1	0.6	2,148
スバル興業	0.2	0.3	2,823
東京テアトル	2.2	2.4	2,714
東京都競馬	0.7	0.6	2,208
カナモト	0.8	0.8	1,817
西尾レントオール	0.5	0.4	1,294
トランス・コスモス	1.1	0.9	3,015
乃村工藝社	3.4	3	2,724

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本管財	1.2	0.9	2,353
トーカイ	1	0.8	1,600
セコム	6.4	5.7	45,776
丹青社	2.4	2.3	1,715
メイテック	1	2.3	5,655
応用地質	1.3	1	2,246
船井総研ホールディングス	1.7	1.4	3,997
ベネッセホールディングス	2.2	2.3	4,659
イオンデパート	1.1	0.8	2,456
ダイセイ	1.5	1.3	5,336
合計	7,493	6,200	15,616,731
計	株数・金額	株数・金額	株数・金額
	1,226	1,230	<96.8%>

(注1)銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注2)評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注3)評価額の単位未満は切り捨て。
(注4)－印は組み入れなし。

○先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期	期末
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
TOPIX	501	—

(注1)単位未満は切り捨て。
(注2)－印は組み入れなし。

◎投資信託財産の構成

2023年3月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	15,616,731	96.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	537,103	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	16,153,834	100.0

(注)評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

◎損益の状況

自 2022年3月11日
至 2023年3月10日

2023年3月10日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	16,153,834,264
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	491,205,628
株 式(評価額)	15,616,731,720
未 収 配 当 金	32,271,916
差 入 委 託 証 拠 金	13,625,000
(B)負 債	28,532,952
未 払 金	4,147,000
未 払 解 約 金	24,300,000
そ の 他 未 払 費 用	85,952
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	16,125,301,312
元 本	4,497,328,855
次 期 繰 越 損 益 金	11,627,972,457
(D)受 益 権 総 口 数	4,497,328,855口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	35,855円

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	463,838,041
受 取 配 当 金	463,693,509
そ の 他 収 益 金	144,532
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	1,785,625,056
売 買 益	2,315,891,518
売 買 損	△ 530,266,462
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	98,723,200
取 引 益	116,396,080
取 引 損	△ 17,672,880
(D)信 託 報 酬 等	△ 858,264
(E)当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	2,347,328,033
(F)前 期 繰 越 損 益 金	12,033,520,142
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	765,613,087
(H)解 約 差 損 益 金	△ 3,518,488,805
(I)計 (E + F + G + H)	11,627,972,457
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	11,627,972,457

(注1)当親ファンドの期首元本額は5,605,476,604円、期中追加設定元本額は328,946,913円、期中一部解約元本額は1,437,094,662円です。

(注2)当親ファンドの当期末元本の内訳は、明治安田日本株式パッシブPファンド(適格機関投資家私募)2,138,436,965円、明治安田DC・TOP I Xオープン2,023,603,796円、明治安田DC・TOP I Xインデックスファンド291,526,478円、明治安田TOP I Xオープン43,761,616円です。

(注3)1口当たり純資産額は3,5855円です。

(注4)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5)損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注6)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7)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。

【お知らせ】

- ・東京証券取引所の市場再編による市場区分等の変更に伴い、信託約款に所定の整備を行いました。
(2022年4月4日)