

運用報告書 (全体版)

第54期<決算日2023年3月10日>

MHAMスリーウェイオープン

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/資産複合	
信託期間	1993年11月26日から無期限です。	
運用方針	わが国の株式、債券および短期金融資産に分散投資し、資産の組入比率の変更を原則としてタクティカル・アセット・アロケーション・モデルの指示により機動的に行い、信託財産の安定的な成長を目指します。	
主要投資対象	MHAMスリーウェイオープン	わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている株式・公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。なお、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券を組入れることもあります。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）、マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
運用方法	3資産（株式・債券・短期金融資産）の組入比率を機動的に変更し、様々な景気・金利局面において適切な資産配分を目指します。 株式の組入れは、信託財産の純資産総額の30%を上限とします。 債券運用部分は債券市場全体の動きに沿った投資成果を目指します。 有価証券の組入比率を変動させる場合、有価証券先物取引等も利用します。	
組入制限	MHAMスリーウェイオープン	株式（新株引受権証券を含む。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）、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	毎年原則として3月10日および9月10日に決算を行い、配当等収益のほかに売買益等の中から運用実績に応じて分配を行います。収益分配に先ず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。 ※分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「MHAMスリーウェイオープン」は、2023年3月10日に第54期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

MHAMスリーウェイオープン

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指標		東証株価指数(TOPIX、配当込み)		NOMURA-BPI		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配) 円	税込み 円	期中 騰落率 %	期中 騰落率 %	期中 騰落率 %	期中 騰落率 %	総合	期中 騰落率 %						
50期(2021年3月10日)	10,387	100	3.2	15,784.20	2.3	3,000.94	19.4	384.66	△0.5	25.5	△13.2	56.3	△51.6	7,908
51期(2021年9月10日)	10,557	10	1.7	16,069.46	1.8	3,306.07	10.2	387.92	0.8	23.9	4.2	57.0	11.6	7,839
52期(2022年3月10日)	10,130	0	△4.0	15,671.17	△2.5	2,921.72	△11.6	382.02	△1.5	22.2	△7.1	47.4	△36.4	7,436
53期(2022年9月12日)	10,023	10	△1.0	15,768.29	0.6	3,205.59	9.7	375.51	△1.7	25.2	△7.0	47.7	22.5	7,259
54期(2023年3月10日)	9,950	0	△0.7	15,746.94	△0.1	3,331.93	3.9	369.76	△1.5	11.3	18.1	50.0	18.6	7,060

(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、国内株式運用部分についてマザーファンドを組入れることがありますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 参考指標は、東証株価指数(TOPIX、配当込み)を15%、NOMURA-BPI総合を50%、短期金融資産(無担保コール翌日物金利)を35%で合成したものを、設定日の前営業日(1993年11月25日)を10,000として指数化したものです。なお、東証株価指数(TOPIX、配当込み)については、2021年7月1日までは東証株価指数(TOPIX)、2021年7月2日以降は東証株価指数(TOPIX、配当込み)のデータを使用しています(以下同じ)。

(注6) 東証株価指数(TOPIX)の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売およ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(以下同じ)。

(注7) NOMURA-BPI総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません(以下同じ)。

(注8) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		参考指標		東証株価指数(TOPIX、配当込み)		NOMURA-BPI総合		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率 %	円	騰落率 %	ポイント	騰落率 %	総合	騰落率 %				
(期首) 2022年9月12日	10,023	-	15,768.29	-	3,205.59	-	375.51	-	25.2	△7.0	47.7	22.5
9月末	9,874	△1.5	15,577.06	△1.2	3,003.39	△6.3	373.60	△0.5	23.6	△6.3	48.2	12.4
10月末	9,952	△0.7	15,688.78	△0.5	3,156.44	△1.5	373.25	△0.6	10.4	5.9	52.7	29.0
11月末	10,010	△0.1	15,717.88	△0.3	3,249.61	1.4	371.33	△1.1	10.8	18.5	52.4	16.6
12月末	9,813	△2.1	15,509.08	△1.6	3,101.25	△3.3	366.60	△2.4	10.4	5.7	48.8	△26.9
2023年1月末	9,825	△2.0	15,590.04	△1.1	3,238.48	1.0	365.59	△2.6	11.0	18.8	46.0	△45.9
2月末	9,890	△1.3	15,697.23	△0.5	3,269.12	2.0	369.57	△1.6	11.2	18.6	51.3	14.6
(期末) 2023年3月10日	9,950	△0.7	15,746.94	△0.1	3,331.93	3.9	369.76	△1.5	11.3	18.1	50.0	18.6

(注1) 騰落率は期首比です。

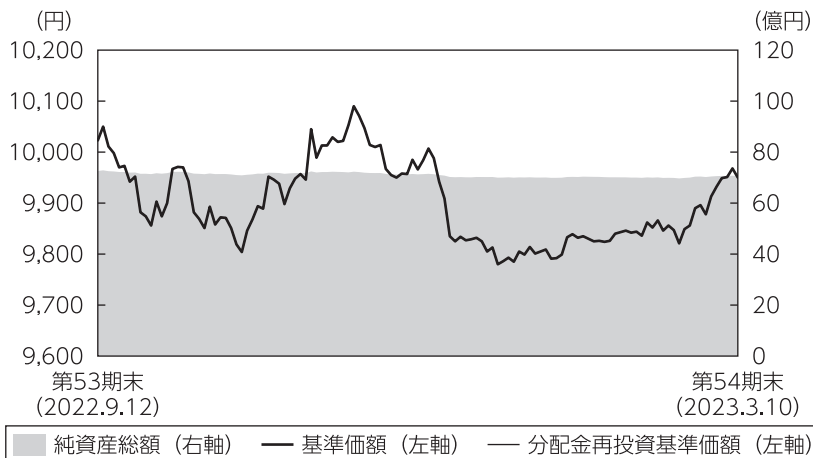
(注2) 当ファンドは、国内株式運用部分についてマザーファンドを組入れることがありますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過 (2022年9月13日から2023年3月10日まで)

基準価額等の推移



第54期首 : 10,023円
第54期末 : 9,950円
(既払分配金0円)
騰落率 : $\triangle 0.7\%$
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

主要投資対象の3資産（国内の株式・公社債・短期金融資産）について、当社独自の定量モデル（TAA（タクティカル・アセット・アロケーション＝戦術的資産配分）モデル）を活用して組入比率の変更を行いました。債券市場が下落したことなどから、基準価額は下落しました。

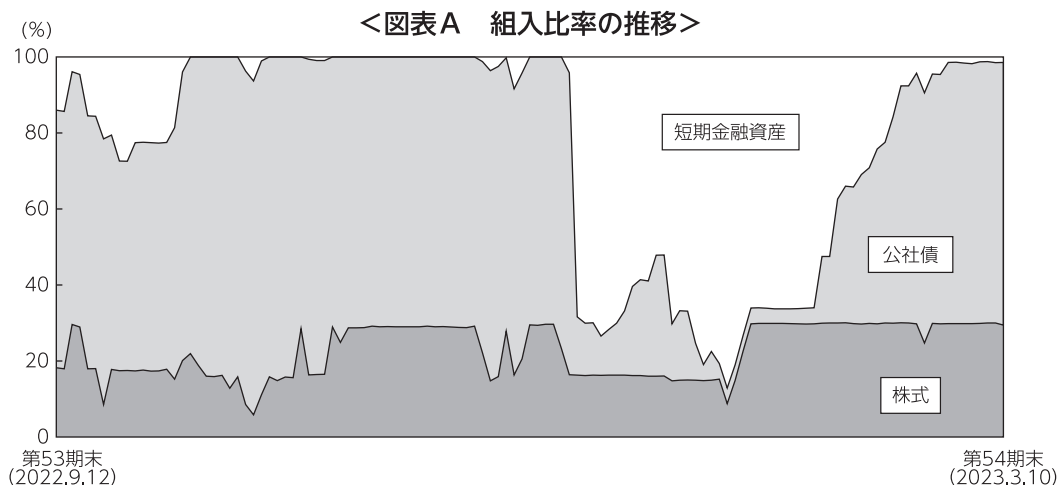
投資環境

国内株式市場は上昇しました。期首から2022年12月にかけては、米国の利上げ動向などを睨み一進一退でした。その後は、日銀の金融緩和政策が当面継続されるとの見方などが上昇要因となりました。

国内債券市場は下落しました。2022年12月の金融政策決定会合で、日銀が長期金利の変動幅を従来の「±0.25%程度」から「±0.5%程度」に拡大したことなどが下落要因となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド



(注) 公社債は、NOMURA-BPI総合のデュレーションを基準に調整を加えた組入比率です。また、短期金融資産については100%から株式および公社債を控除した比率を示しています。

■TAA（タクティカル・アセット・アロケーション=戦術的資産配分）モデルの活用

主要投資対象の3資産について、TAAモデルを活用して組入比率の変更を行いました。当期の3資産の組入比率は、図表Bの月次モデル基本組入比率をベースに、日次モデルによる組入比率調整（株式は±15%、公社債は±50%の範囲で調整）を行い、図表Aのように推移させました。組入比率の変更には、主に先物取引を用いました。

・図表B：当期の月次モデル基本組入比率（単位：％）

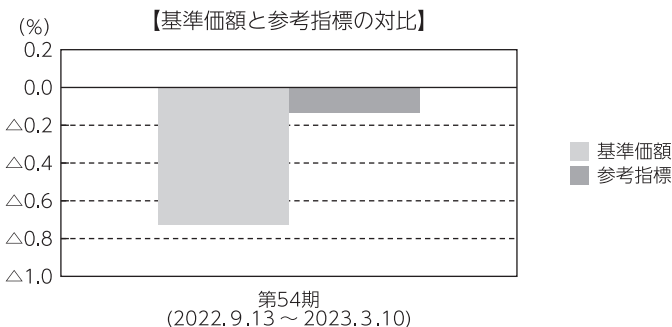
	2022.9月	10月	11月	12月	2023.1月	2月	3月
株 式	18	17	15	16	15	16	20
公 社 債	73	80	66	54	40	52	59
短期金融資産	10	4	20	30	45	32	21

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指標の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金は、配当等収益や売買益等の水準、基準価額の水準等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2022年9月13日 ～2023年3月10日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	1,110円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

原則としてT A Aモデルの指示に基づいて株式・公社債・短期金融資産の組入比率の変更を行う方針です。使用する運用モデルにつきましては、今後も適宜修正・改良を行って参ります。

株式運用部分につきましては、先物に加えて、T O P I X（配当込み）に連動する国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの組入を継続する方針です。

債券運用部分につきましては、債券市場全体の値動きに沿った投資成果を目標として運用を行う方針です。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第54期		項目の概要
	(2022年9月13日 ～2023年3月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	45円	0.459%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,899円です。
(投信会社)	(21)	(0.216)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(19)	(0.189)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(5)	(0.054)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.006	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.006)	
(c) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.001 (0.001)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	46	0.466	

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

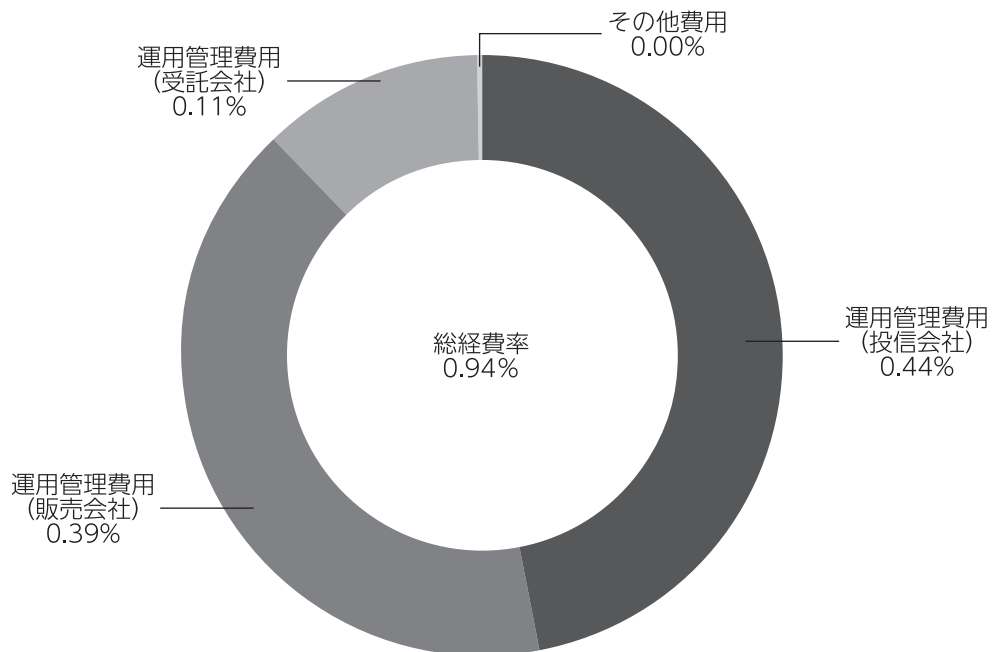
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.94%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■売買及び取引の状況（2022年9月13日から2023年3月10日まで）

(1) 公社債

		買付額	売付額
国	内 国債証券	千円 876,484	千円 718,726 (-)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	株式先物取引	百万円 8,815	百万円 7,626	百万円 1,910	百万円 2,442
	債券先物取引	9,753	10,059	5,692	5,704

(注) 金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年9月13日から2023年3月10日まで）

	設定		解約	
	□数	金額	□数	金額
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 326,921	千円 1,050,000

■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	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	124,211,628千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	360,685,743千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.34

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年9月13日から2023年3月10日まで）

【MHAMスリーウェイオープンにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
百万円		百万円	%		百万円	百万円
公社債	876	86	9.9	718	168	23.4
株式先物取引	11,258	11,258	100.0	9,536	9,536	100.0

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	440千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	354千円
(B) / (A)	80.4%

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

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
株 式	百万円 64,571	百万円 11,501	17.8	百万円 59,640	百万円 35,676	59.8

平均保有割合 0.3%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	百万円 758	百万円 438	百万円 4,336

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

■組入資産の明細

(1) 公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	3,470,000	3,531,879	50.0	—	32.7	12.9	4.4
合 計	3,470,000	3,531,879	50.0	—	32.7	12.9	4.4

(注) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千円	千円	
(国債証券)				
7 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	200,000	205,802	2024/06/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	100,000	103,655	2024/12/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	600,000	601,716	2026/03/20
1 5 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	200,000	199,198	2027/03/20
9 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	100,000	109,185	2027/09/20
1 0 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	140,000	153,913	2028/03/20
1 0 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.4000	100,000	111,359	2028/06/20
1 0 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	100,000	110,108	2028/09/20
3 6 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	100,000	96,730	2031/09/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	20,000	22,111	2032/09/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	150,000	166,305	2032/12/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	100,000	111,800	2032/12/20
1 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1.1000	100,000	104,923	2033/03/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	100,000	110,856	2033/06/20
1 4 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.5000	60,000	65,244	2034/03/20
1 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.5000	100,000	119,491	2034/06/20
1 5 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.2000	10,000	10,515	2034/12/20
1 5 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	0.4000	100,000	94,725	2036/03/20
1 6 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	0.5000	100,000	92,620	2038/12/20
1 7 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	0.3000	100,000	88,505	2039/09/20
1 7 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	0.3000	120,000	105,732	2039/12/20
1 8 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	0.8000	150,000	140,058	2042/03/20
1 8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	0.9000	100,000	94,859	2042/06/20
1 8 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.4000	50,000	51,556	2042/12/20
5 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	0.8000	70,000	62,103	2047/12/20
7 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1.3000	50,000	48,809	2052/06/20
7 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1.4000	350,000	350,000	2052/09/20
合 計	—	3,470,000	3,531,879	—

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	T O P I X	百万円 1,263	百万円 -
	長期国債	1,315	-

(3) 親投資信託残高

	期首(前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	千口 561,857	千口 234,935	千円 812,454

■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
公 社 債	千円 3,531,879	% 49.7
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	812,454	11.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,756,898	38.8
投 資 信 託 財 産 総 額	7,101,233	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年3月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	7,096,802,386円
コール・ローン等	2,689,838,693
公 社 債(評価額)	3,531,879,900
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法) ・マザーファンド(評価額)	812,454,402
未 収 入 金	1,595,745
未 収 利 息	10,498,167
前 払 費 用	2,205,479
差 入 委 託 証 拠 金	48,330,000
(B) 負 債	36,101,826
未 払 解 約 金	3,478,570
未 払 信 託 報 酬	32,565,111
そ の 他 未 払 費 用	58,145
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	7,060,700,560
元 本	7,096,164,789
次 期 繰 越 損 益 金	△35,464,229
(D) 受 益 権 総 口 数	7,096,164,789口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,950円

(注) 期首における元本額は7,243,255,083円、当期中における追加設定元本額は223,150,533円、同解約元本額は370,240,827円です。

■損益の状況

当期 自2022年9月13日 至2023年3月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	17,298,823円
受 取 利 息	17,930,114
支 払 利 息	△631,291
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△94,828,625
売 買 益	40,613,495
売 買 損	△135,442,120
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	61,319,247
取 引 益	150,067,259
取 引 損	△88,748,012
(D) 信 託 報 酬 等	△32,623,256
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△48,833,811
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	48,135,042
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△34,765,460
(配 当 等 相 当 額)	(380,016,291)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△414,781,751)
(H) 合 計(E+F+G)	△35,464,229
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△35,464,229
追 加 信 託 差 損 益 金	△34,765,460
(配 当 等 相 当 額)	(380,082,252)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△414,847,712)
分 配 準 備 積 立 金	408,131,166
繰 越 損 益 金	△408,829,935

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

(注2) (D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (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4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経 費 控 除 後 の 配 当 等 収 益	4,333,885円
(b) 経 費 控 除 後 の 有 価 証 券 売 買 等 損 益	0
(c) 収 益 調 整 金	380,082,252
(d) 分 配 準 備 積 立 金	403,797,281
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	788,213,418
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	1,110.76
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

当期の収益分配金は、配当等収益や売買益等の水準、基準価額の水準等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第21期（決算日 2023年2月7日）

（計算期間 2022年2月8日～2023年2月7日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年10月30日から無期限です。
運用方針	主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期 (2019年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
18期 (2020年2月7日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
19期 (2021年2月8日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
20期 (2022年2月7日)	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336
21期 (2023年2月7日)	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9	396,982

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売およ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（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

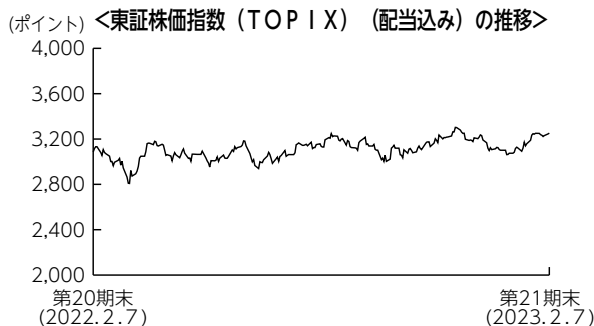
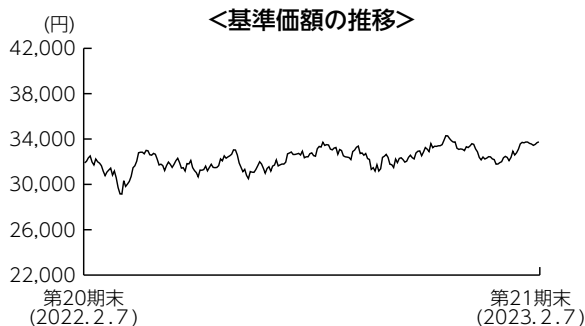
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2022年 2月7日	円	%	ポイント	%	%	%
	31,896	—	3,073.66	—	97.4	2.5
2 月 末	31,265	△2.0	3,012.57	△2.0	98.0	1.3
3 月 末	32,610	2.2	3,142.06	2.2	96.9	3.1
4 月 末	31,831	△0.2	3,066.68	△0.2	96.2	3.9
5 月 末	32,079	0.6	3,090.73	0.6	96.7	3.4
6 月 末	31,424	△1.5	3,027.34	△1.5	96.7	3.3
7 月 末	32,592	2.2	3,140.07	2.2	97.1	2.9
8 月 末	32,985	3.4	3,177.98	3.4	98.0	2.0
9 月 末	31,176	△2.3	3,003.39	△2.3	96.3	3.7
10 月 末	32,765	2.7	3,156.44	2.7	97.1	2.8
11 月 末	33,730	5.7	3,249.61	5.7	97.7	2.3
12 月 末	32,189	0.9	3,101.25	0.9	96.9	3.1
2023年 1 月 末	33,613	5.4	3,238.48	5.4	97.7	2.3
(期 末) 2023年 2月7日	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年2月8日から2023年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は33,751円となり、前期末比で5.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの感染状況、日本や米国などの金融政策、ウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式市場は一進一退の展開となりました。期末にかけては、米国で金融引き締めの長期化懸念が後退したことや日銀の金融緩和継続などを受けて上昇しました。

投資環境

期初から2022年3月半ばまでは、新型コロナウイルスの感染拡大、金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻を要因として、国内株式市場は下落しました。その後は、米国での金融引き締め、日銀の金融政策への思惑、インフレ動向、国内の新型コロナウイルスの感染状況やウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式市場は一進一退の展開となりました。期末にかけては、日銀の金融緩和継続などを要因として上昇しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

【運用状況】 (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

○組入上位10業種

期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	17.5%
2	輸送用機器	8.5
3	情報・通信業	7.8
4	化学	6.4
5	サービス業	5.7
6	卸売業	5.5
7	銀行業	5.4
8	機械	5.1
9	医薬品	4.7
10	小売業	4.1



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.3%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.3
4	銀行業	6.4
5	化学	6.1
6	卸売業	5.9
7	医薬品	5.2
8	サービス業	5.2
9	機械	5.2
10	小売業	4.4

○組入上位10銘柄

期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.3%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.0
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
5	リクルートホールディングス	日本・円	1.5
6	東京エレクトロン	日本・円	1.3
7	日本電信電話	日本・円	1.3
8	任天堂	日本・円	1.2
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
組入銘柄数			2,174銘柄



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.6%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.1
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.0
5	日本電信電話	日本・円	1.7
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.4
7	武田薬品工業	日本・円	1.3
8	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
9	第一三共	日本・円	1.2
10	任天堂	日本・円	1.2
組入銘柄数			2,161銘柄

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で5.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマーク沿ったパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(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、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は32,278円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2022年2月8日から2023年2月7日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		152,381.9 (2,240.729)	362,922,344 (-)	156,466.829	364,983,330

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内 株 式 先 物 取 引	百万円	百万円	百万円	百万円
	116,409	119,651	-	-

(注) 金額は受渡代金です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	727,905,675千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	377,008,289千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	1.93

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年2月8日から2023年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 362,922	百万円 231,022	% 63.7	百万円 364,983	百万円 229,125	% 62.8
金 銭 信 託	1.380	1.380	100.0	1.380	1.380	100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 3,015	百万円 2,776	百万円 4,163

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 3

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	4,537千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	231千円
(B) / (A)	5.1%

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
水産・農林業 (0.1%)	千株	千株	千円																	
極洋	7.2	7.3	26,572				矢作建設工業	20.5	18.4	14,536	ウェルネオシユガー	7.6	7.6	11,501						
ニッスイ	199.7	191.5	100,729				ピーエス三菱	15.4	17.2	10,853	森永製菓	34.8	24.9	92,503						
マルハニチロ	31.4	28.4	67,734				日本ハウスホールディングス	31.7	26.6	10,241	中村屋	2.6	2.8	8,540						
雪国まいたけ	14.8	16.3	16,919				新日本建設	19.9	18.8	15,698	江崎グリコ	40.7	38.5	135,905						
カネコ種苗	4.9	5.9	9,735				東亜道路工業	2.6	2.3	14,191	名糖産業	6.9	5.5	9,234						
サカタのタネ	24	21.8	89,162				日本道路	4.6	2.7	16,578	井村屋グループ	8.6	7.2	16,070						
ホフト	17	17	31,654				東亜建設工業	11.5	11.5	28,520	不二家	8.5	9.3	23,417						
ホグリヨウ	3.4	2.5	2,262				日本国土開発	45.5	40.2	21,868	山崎製パン	110.7	90	134,280						
鉱業 (0.3%)							若築建設	7.7	6	17,952	第一屋製パン	3.5	2.2	851						
住石ホールディングス	35.1	26.4	9,108				東洋建設	51.7	43.4	37,931	モロゾフ	3.7	4.3	14,620						
日鉄鉱業	4.6	7.6	25,992				五洋建設	182.7	189.9	119,826	亀田製菓	8.6	8.6	36,636						
三井松島ホールディングス	8.3	8.7	27,144				世紀東急工業	22.4	17.7	13,983	寿スビリッツ	14.3	14.3	123,981						
I N P E X	800.9	707.9	989,644				福田組	5	5.1	23,001	カルピス	67.3	61.5	178,842						
石油資源開発	23.5	22.2	92,463				住友林業	118	102.7	249,522	森永乳業	27.4	24.5	114,415						
K&Oエナジーグループ	9.9	8.7	17,800				日本基礎技術	12.7	7.2	3,837	六甲バター	11	9.9	13,246						
建設業 (1.9%)							バコーポレーション	20.7	13.5	5,535	ヤクルト本社	109.4	96.1	873,549						
ヒノキグループ	4.5	-	-				大和ハウス工業	425.6	374.1	1,138,760	明治ホールディングス	97.6	83.4	561,282						
ショーポンドホールディングス	28.5	26.1	139,896				ライト工業	29	25.5	47,302	雪印メグミルク	35.6	32.6	57,636						
ミライト・ワン	64.4	66.5	101,146				積水ハウス	500	419.4	1,038,015	プリマハム	18.6	18.2	40,331						
タマホーム	12.1	12.1	38,478				日特建設	9.8	12.9	11,868	日本ハム	56.5	52.6	192,253						
サンヨーホームズ	2.5	2.2	1,601				北陸電気工事	9.8	9.3	6,463	林兼産業	3.8	3.7	1,731						
日本アーク	8.1	7.1	6,780				ユアテック	26.5	29.9	22,155	丸大食品	14.8	13.5	19,642						
ファーストコーポレーション	6.4	4.3	3,057				日本リーテック	9.6	8.9	7,805	S Foods	13.3	14.9	43,001						
ベステラ	4	3.7	3,300				四電工	5.2	5.7	10,208	柿安本店	5.2	5.3	10,621						
Robot Home	33.3	32.7	5,460				中電工	21.3	20.8	43,243	伊藤ハム株式会社ホールディングス	95.7	104.7	73,499						
キャンディル	3.8	2.7	1,358				関電工	75.2	73.6	62,265	サッポロホールディングス	50.4	44.3	141,981						
ダイセキ環境ソリューション	3.9	3.4	3,233				きんでん	103.1	94.5	135,040	アサヒグループホールディングス	347.2	310.6	1,343,345						
第一カッター興業	5.1	5.1	5,253				東京エネシス	15.5	13.3	11,903	キリンホールディングス	542.4	606.7	1,232,511						
安藤・間	99.1	110.9	93,377				トーエネック	4.7	4.4	14,784	宝ホールディングス	100.4	91.8	94,921						
東急建設	58.5	54.6	35,271				住友電設	11.5	12.8	29,964	オエノホールディングス	43	40.1	10,345						
コムシスホールディングス	64.4	64.8	156,556				日本電設工業	25.4	22	32,956	養命酒造	5.1	4.4	8,030						
ビアールホールディングス	27.1	30.5	10,339				エクスオグループ	69.8	61.5	140,958	ココロ ホリスチングホールディングス	103.7	105.3	140,154						
龍松コンストラクショングループ	12.6	12.5	23,950				新日本空調	12.2	7.4	14,097	サントリー食品インターナショナル	98.7	94.7	428,991						
東建コーポレーション	5.5	5.5	41,195				九電工	35.6	32.6	104,157	ダイドグループホールディングス	7.7	7.6	36,214						
ソネック	2.3	2	1,890				三機工業	30.2	29.7	44,371	伊藤園	45	45.5	202,702						
ヤマウラ	10.3	9.8	10,103				日輝ホールディングス	141.9	132.4	220,048	キーコーヒー	14.8	15.1	31,257						
オリエンタル白石	67.8	68.7	20,472				中外炉工業	4.7	4.4	7,700	ユニカフェ	5	4.1	3,673						
大成建設	133.2	133.2	571,428				ヤマト	13.8	10.1	8,019	ジャパンフーズ	1.7	1.5	1,633						
大林組	460.9	478.7	463,860				太平電業	10.4	8.4	28,350	日清オイリオグループ	18.7	19	60,135						
清水建設	431.8	402.5	283,360				高砂熱学工業	41.7	32.3	58,624	不二製油グループ本社	32	31.3	63,413						
飛鳥建設	12.3	14.9	15,451				三晃金属工業	1.7	1.4	5,222	かどや製油	1.1	1.2	4,266						
長谷工コーポレーション	137.3	138.2	203,706				朝日工業社	3.3	5.6	11,586	Jーオイルミルズ	14.2	13.7	21,166						
松井建設	18.4	12.6	7,421				明星工業	29.9	23	18,009	キッコーマン	106.3	89.1	592,515						
銭高組	1.7	1.5	4,072				大気社	22.6	16.1	55,062	味の素	325.9	329	1,349,229						
鹿島建設	337.9	296.9	450,694				ダイダン	10.3	8.9	19,366	ブルドックソース	6.4	5.4	10,022						
不動テトラ	9.8	9.3	14,322				日比谷総合設備	14.9	11.5	22,367	キュービー	77.6	72.2	159,345						
大末建設	5	4.3	4,940				フィル・カンパニー	2.8	2.4	2,712	ハウス食品グループ本社	55.3	41.3	110,931						
鉄建建設	10.3	9.6	17,212				テスホールディングス	8.5	14.4	16,300	カゴメ	56	62.7	193,429						
西松建設	28	22.7	75,818				インフロンティア・ホールディングス	196.5	140.2	142,162	焼津水産化学工業	5.1	5.6	5,073						
三井住友建設	103.8	107.5	44,505				東洋エンジニアリング	19.4	17.7	10,478	アリアケジャパン	13.5	11.8	52,451						
大豊建設	6.8	5.6	20,188				レイズネクスト	22.6	19.4	24,851	ビエトロ	1.2	1.7	3,073						
佐田建設	10.2	7.7	4,150				食料品 (3.4%)				エバラ食品工業	2.5	3.3	10,362						
ナカノフード建設	10.9	8.5	2,822				ニッパン	43.5	36.3	57,898	やまみ	1.7	1.2	1,622						
興村組	27.1	21.7	64,557				日清製粉グループ本社	167	124.3	193,783	ニチレイ	67.3	61.6	161,576						
東鉄工業	21.5	18.5	48,451				日東富士製粉	1.6	2.2	9,515	東洋水産	71	67.9	379,561						
イチケン	3.5	2.7	4,881				昭和産業	14.3	11.8	29,216	イトーヨーカドーホールディングス	5.7	5.8	13,415						
富士ビー・エス	5.9	6.1	2,751				鳥越製粉	13.7	9.8	5,733	大冷	2	1.7	3,226						
浅沼組	5.2	10.7	33,705				中部飼料	16.7	18.7	19,167	ヨシムラ・フード・ホールディングス	7.9	8.6	7,765						
戸田建設	191.4	164.6	112,915				フィード・ワン	20.2	19.7	13,297	日清食品ホールディングス	57.9	47.3	530,706						
熊谷組	23.5	23.2	59,670				東洋精糖	1.8	2.4	2,080	永谷園ホールディングス	6.9	6.7	13,527						
北野建設	2.9	2.3	6,288				日本甜菜製糖	8.1	8	13,080	一正蒲鉾	6.2	5.2	3,655						
植木組	4.1	3.4	4,539				DME三井製糖ホールディングス	13.7	13.3	26,812	フジッコ	13.8	13.9	25,840						
							塩水港精糖	19.9	14.9	2,890	ロック・フィールド	16	15.1	23,435						

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株		千円			千株		千円			千株		千円
日本たばこ産業	791.4	884.9	2,341,002	26,967	ザ・バック	11	10.1	26,967	26,967	ミライアル	4.7	3.7	5,616	
ケンコーマヨネーズ	8.5	9.3	12,173		化学 (6.2%)					ダイキョウクス	5.6	4.4	3,000	
わぱや洋ホールディングス	9.6	9.9	18,810		北の達人コーポレーション	51.4	57.6	18,950	18,950	ダイキョーニシカワ	30.7	30.1	18,150	
なとり	8.1	8.6	17,647		クラレ	210.4	217.3	230,120	230,120	竹本精化	5.3	4.1	3,349	
イフジ産業	2.5	2.2	2,017		旭化成	954.1	853.9	823,586	823,586	森六ホールディングス	7.9	6.9	12,240	
ビッルスコーポレーション	7.2	-	-		共和レザー	9.2	7.1	3,578	3,578	恵和	3.6	8.9	14,204	
ファーマフーズ	14	20.7	28,110		リソナック・ホールディングス	124.8	132.1	291,148	291,148	日本化薬	113.4	104.3	120,570	
ユーグレナ	75	86.6	86,426		住友化学	1,057.7	1,014.5	466,670	466,670	カーリットホールディングス	14.3	12.3	8,843	
紀文食品	8.6	10.5	9,985		住友精化	6.4	5.8	23,606	23,606	日本精化	11.6	7.8	18,517	
ビッルスホールディングス	-	7.9	9,511		日産化学	78.4	64.9	397,188	397,188	扶桑化学工業	12.9	12.7	46,164	
ミヨシ油脂	6.2	4.2	3,880		ラサ工業	5	5.3	10,525	10,525	トリケミカル研究所	14.9	18.3	43,718	
理研ビタミン	15.4	11.6	22,156		クレハ	11.5	11.7	96,876	96,876	A D E K A	66.3	47.7	101,791	
繊維製品 (0.5%)					多木化学	5.6	5.4	24,840	24,840	日油	49.2	42.3	231,804	
片倉工業	13.8	12.6	22,012		テイカ	10.8	9.2	11,178	11,178	新日本理化	23.6	16.8	3,796	
グンゼ	9.6	10.2	43,248		石原産業	23.8	24.7	26,923	26,923	ハリマ化成グループ	11	8.7	7,629	
東洋紡	56.9	59	60,239		片倉コープアグリ	2.5	2.5	4,300	4,300	花王	325.3	333	1,722,609	
ユニチカ	39.2	41.4	9,646		日本書達	18.4	14.7	63,945	63,945	第一工業製薬	5.4	5	10,290	
富士紡ホールディングス	6.4	5.4	17,010		東ソー	207.7	182.6	307,681	307,681	石原ケミカル	7.5	6.3	8,051	
倉敷紡績	12.3	10.2	22,256		トクヤマ	46	44.1	86,303	86,303	日華化学	5	5	4,135	
シキボウ	7.9	6.8	6,636		セントラル硝子	23.5	21.9	64,473	64,473	ニイタカ	3	2.2	4,391	
日本毛織	43.4	36	33,660		東亜合成	80.1	68.5	77,610	77,610	三洋化成工業	8.6	8.5	35,657	
ダイトウボウ	23.8	21.5	1,827		大阪ソーダ	13.5	8.2	34,563	34,563	有機合成薬品工業	10.3	9.2	2,640	
トア紡コーポレーション	4.3	4.2	1,474		関東電化工業	31.6	26.4	26,584	26,584	大日本塗料	17.8	16.9	13,351	
ダイドーリミテッド	20.5	18.6	4,724		デンカ	52.4	49.7	132,301	132,301	日本ペイントホールディングス	541.2	605.1	705,546	
帝国繊維	16.3	15.4	23,931		信越化学工業	247.4	230.7	4,442,128	4,442,128	関西ペイント	149.3	125.3	224,036	
帝人	135.4	131.6	173,317		日本カーバイド工業	5.2	4.6	5,878	5,878	神東塗料	10	10.4	1,310	
東レ	1,042.5	916.3	715,721		堺化学工業	10	10.4	18,803	18,803	中国塗料	34	22.4	23,497	
住江織物	3.4	2.5	4,635		第一稀元素化学工業	13.4	12.5	13,825	13,825	日本特殊塗料	10.9	7.7	6,760	
日本フェルト	5.9	6.7	2,733		エア・ウオーター	136.2	129	200,079	200,079	藤倉化成	18.3	18.6	8,035	
イチカワ	1.4	1.5	2,010		日本薬業ホールディングス	138.5	132.6	299,676	299,676	太陽ホールディングス	21.2	20.7	50,052	
日東製綱	1.7	1.3	2,022		日本化学工業	4.6	4.5	8,541	8,541	D I C	60.9	53.5	129,577	
アツギ	11.5	7.1	2,726		東邦アセチレン	2.6	2.6	3,013	3,013	サカタインクス	28.7	30.3	32,542	
ダイニツク	3.8	3	2,040		日本パーカライズング	72.6	67.8	63,121	63,121	興キネクス(ホールディングス)	30.5	26.7	49,341	
セーレン	29.6	26.4	64,125		高圧ガス工業	23.1	20.1	13,266	13,266	T & K T O K A	11.7	12.2	15,408	
ソトー	6.2	3.9	3,178		チタン工業	1.7	1.4	2,049	2,049	富士フィルムホールディングス	258.5	262.7	1,808,426	
東海染工	1.4	1.3	1,435		四国化成ホールディングス	19	16.2	20,671	20,671	資生堂	273.9	285.8	1,892,853	
小松マテリアル	23.6	19.9	14,188		戸田工業	3.2	3.1	8,091	8,091	ライオン	177.6	164.3	231,663	
ワコールホールディングス	35.9	26.3	62,699		ステラ ケミファ	7.2	8	20,680	20,680	高砂香料工業	10.3	9.3	24,561	
ホギメディカル	19.5	18.4	59,432		保土谷化学工業	4.6	3.9	12,928	12,928	マンダム	30.9	29.5	42,008	
クラヴィアホールディングス	2.5	2.7	977		日本触媒	24.2	20.8	113,984	113,984	ミルボン	18.3	20.3	112,056	
T S Iホールディングス	47.9	48.8	27,328		大日精化工業	12	9.6	17,212	17,212	ファンケル	59.6	59.9	156,938	
マツオカコーポレーション	4.6	3.3	4,125		カネカ	37.3	31.3	104,385	104,385	コーセー	27.7	27.9	418,500	
ワールド	18.9	17.5	23,275		三菱瓦斯化学	133.8	102.1	192,152	192,152	コタ	9.4	11.6	20,021	
三陽商会	6.9	4.6	6,490		三井化学	130.8	112.7	352,751	352,751	シーボン	1.4	1.5	2,392	
ナイガイ	4.1	4.1	1,061		J S R	134.4	127.7	396,508	396,508	ホーオルビスホールディングス	62.8	70.2	126,219	
オンワードホールディングス	86.3	88.5	30,090		東京応化工業	23.3	23.9	155,589	155,589	ノビアホールディングス	12.6	12.2	67,466	
リックホールディングス	4.6	3.5	8,988		大阪有機化学工業	12.3	10.3	21,784	21,784	アジパルホールディングス	3.5	3	2,964	
キムラタン	79.9	72.8	1,528		三菱ケミカルグループ	962.6	922.8	654,080	654,080	新日本製薬	4	7.8	11,286	
ゴールドウイン	26	24.3	240,084		K Hネオケム	23.7	22.7	61,539	61,539	エステー	9.5	10.6	16,726	
デサント	28.1	23.5	92,707		ダイセル	207.2	201	181,101	181,101	アグロ カネシヨウ	5	5.5	8,514	
キング	6.7	5.4	2,743		住友ベークライト	22.8	20.2	88,981	88,981	コニシ	24.1	22.9	39,983	
ヤマトインターナショナル	13.3	9.8	2,450		積水化学工業	301.3	279.7	512,130	512,130	長谷川香料	25.5	28.4	90,454	
パルプ・紙 (0.2%)					日本ゼオン	129.8	82	101,024	101,024	星光 P M C	8.6	6.4	3,622	
特種東海製紙	8.9	6.1	17,805		アイカ工業	40.1	34.5	103,465	103,465	小林製薬	41.3	39.8	361,384	
王子ホールディングス	602.3	569.8	297,435		U B E	67.8	70.4	139,532	139,532	荒川化学工業	12.3	11.7	11,442	
日本製紙	69	71.1	67,402		積水樹脂	21.9	19.9	38,526	38,526	メック	11	11.2	28,078	
三菱製紙	21.3	15.1	4,303		タキロンシーアイ	31.4	30.2	14,888	14,888	日本高純度化学	4.1	3.4	7,939	
北越コーポレーション	94.7	86.4	68,688		旭有機材	8.1	9.1	24,451	24,451	タカラバイオ	38.5	36.9	63,541	
中越パルプ工業	5.6	4.7	4,958		ニチパン	8.6	8.5	15,045	15,045	J C U	16.6	15.5	50,297	
巴川製紙所	4.6	3.8	2,667		リケンテクノス	35.4	29.5	15,841	15,841	新田ゼラチン	9.3	7.5	6,450	
大王製紙	69.6	60.3	59,817		大倉工業	7.5	6.4	11,897	11,897	O A T アグリオ	3.2	5	7,320	
阿波製紙	4	2.9	1,957		積水化成成品工業	19.6	18.7	7,293	7,293	デクセリアルズ	38.2	39.5	112,456	
レンゴウ	136.3	124.6	109,025		群栄化学工業	3.5	2.7	6,714	6,714	アース製薬	12.1	12.4	62,248	
トーモク	9	7.9	12,008		タイガースポリマー	8.5	5.8	2,395	2,395	北興化学工業	13.8	13.8	11,467	

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
大成ラミック	千株	千株	千円				千株	千株	千円				千株	千株	千円					
クミアイ化学工業	4.6	4.3	12,409				5.5	4.6	4,075				丸一鋼管	-	11.7	23,470				
日本農業	54.8	54.5	47,251				39.4	27.9	7,365				丸一工業	51.5	42.9	117,631				
アキレス	26.4	25.1	17,821				5.1	4	4,796				大同特殊鋼	4.5	2.9	8,502				
有沢製作所	9.4	8.9	11,098				163.3	152.1	478,354				日本高周波鋼業	23.8	17.7	86,199				
日東電工	21.5	22.4	31,270				2,210.8	2,473.4	1,137,764				日本冶金工業	4.2	4.2	1,365				
レック	89	99.4	840,924				42.6	57.1	190,702				山陽特殊製鋼	10.8	10.3	43,363				
三光合成	19.1	19.5	19,597										愛知製鋼	15	13.9	36,946				
さもと	15.5	17.1	9,866										日立金属	8.2	8.2	18,146				
藤森工業	22.9	18.1	3,620										日本金属	156.7	-	-				
前澤化成工業	13.2	10.8	34,290										大平洋金属	3.6	2.8	2,492				
未来工業	9.5	8.8	11,968										新日本電工	8.9	10	19,390				
ウェアロックホールディングス	5.5	5	7,400										栗本鐵工所	93.6	90	33,570				
J S P	5.6	3.7	2,260										虹 技	6.8	6.7	12,428				
エフピコ	8.7	9.6	15,273										三菱製鋼	2.3	1.7	1,705				
天馬	27	25.9	95,441										日本精練	1.6	1.4	1,324				
信越ポリマー	11.6	11.7	25,833										日本精線	9.2	8.8	10,181				
東リ	26.4	25.4	33,451										日亜鋼業	19.5	13.3	3,511				
ニフコ	38.8	27.6	7,010										エンビロ・ホールディングス	2.5	2	8,980				
バルカー	49.1	49.4	171,418										シンニッタン	4.8	8.7	6,177				
ユニ・チャーム	12	11.5	36,512										新築工業	18	13.7	3,356				
ショエイコーポレーション	283.4	285.2	1,438,834										大紀アルミニウム工業所	3.8	2.7	6,679				
協和キリン	4	3.8	2,219										三井金属鉱業	22	20	26,440				
協和キリン	172.7	165.4	479,329										東邦亜鉛	36.7	38.1	54,292				
武田薬品工業	1,155.5	1,211.6	5,066,911										三菱マテリアル	39.4	41	137,350				
アステラス製薬	1,274.7	1,312.1	2,511,359										住友金属鉱山	8.1	8.4	17,673				
住友ファーマ	90.9	101.5	88,000										DOWAホールディングス	95.9	9	201,348				
塩野義製薬	184.8	175	1,101,625										古河機械金属	185.8	163.4	825,170				
わかもと製薬	17.6	11.5	2,564										東邦チタニウム	39.7	31.7	139,955				
日本新薬	38.5	32.3	212,857										エス・サイエンス	24.1	20.6	27,192				
中外製薬	460	428.6	1,468,383										大冢チタニウムテクノロジーズ	69	76.5	2,065				
科研製薬	23.1	23.4	83,772										東邦チタニウム	16.7	20.6	75,087				
エーザイ	176.1	166.6	1,265,660										U A C J	26.2	25.5	59,542				
ロート製薬	75.5	132.6	302,593										C Kサンエツ	22.2	19.7	46,610				
小野薬品工業	337.6	264.2	747,025										古河電気工業	3.2	2.6	10,881				
久光製薬	38.8	30.4	120,232										住友電気工業	45.2	46.9	116,405				
持田製薬	18.7	16.4	54,612										フジクラ	543.6	486.4	791,372				
参天製薬	274.1	257.6	255,281										昭和電線ホールディングス	16.2	15.1	151,402				
扶桑薬品工業	5.2	4.3	8,286										東京特殊電線	12.6	15.8	29,008				
日本ケミファ	1.2	1.2	2,053										タツタ電線	1.7	-	-				
ツムラ	45.7	43.1	112,749										カナレ電気	25.7	28.8	20,476				
日医工	45.6	-	-										平河ヒューテック	2.8	2	2,620				
キッセイ薬品工業	26.2	21.2	52,385										リョービ	8.2	8.2	10,651				
生化学工業	26	26.2	21,431										アーレスティ	17.9	15	18,960				
栄研化学	25.9	22.2	34,587										アサヒホールディングス	15.4	13.8	6,624				
日水製薬	5.9	-	-										金庫製品 (0.6%)	58.3	57.1	111,573				
鳥居薬品	8	7.3	22,995										稲葉製作所	4.6	3.9	14,898				
J C R ファーマ	41.5	46.3	77,784										トーカロ	37.6	38.7	46,672				
東和薬品	21.1	21.1	42,263										アルファ	4.8	4.5	4,257				
富士製薬工業	9.1	8.9	9,113										S U M C O	223.9	268.1	537,540				
ゼリア新薬工業	26.9	19	40,147										川田テクノロジーズ	3	3.3	11,104				
第一三共	1,155.4	1,192.7	4,854,289										R S Technologies	4.7	9.4	37,553				
キョーリン製薬ホールディングス	29.6	29.7	49,509										ジェイテックホールディングス	1.6	1.7	5,185				
大幸薬品	22.3	24.8	9,597										信和	9.1	6.8	5,535				
ダイト	9.4	9.6	24,268										東洋製鋼グループホールディングス	92.6	93.2	150,331				
大塚ホールディングス	305.5	313.3	1,280,770										ホッカンホールディングス	8.2	7.5	10,417				
大正製薬ホールディングス	35	30.4	160,816										コロナ	8.6	7.8	7,020				
ペプチドリーム	77.1	66.4	134,592										横河ブリッジホールディングス	25	18.6	36,809				
あすか製薬ホールディングス	16.8	14	16,744										駒井ハルテック	2.9	2.1	3,225				
サワグルホールディングス	32.2	31.3	122,696										高田機工	0.7	0.6	1,554				
石油・石炭製品 (0.5%)													三和ホールディングス	137.1	129.6	172,886				
日本コープス工業	123.8	123.5	10,744										文化シャッター	46.4	40.6	45,918				
ニチレキ	18.9	16.3	22,249																	
ユシロ化学工業	7.9	7.1	5,836																	

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
三協立山	18.9	16.1	10,110	ベガサスミシ製造	15	15.3	10,220	理想科学工業	12.3	12.3	27,613		12.3	12.3	27,613
アルインコ	10.9	10.8	11,232	マルマエ	6	6.7	11,771	SANKYO	31.8	27.1	140,649		31.8	27.1	140,649
東洋シャクター	2.5	2.2	1,139	タツモ	6.9	7.5	14,655	日本金銭機械	15	15.2	17,647		15	15.2	17,647
LI X I L	228.9	205.2	438,102	ナプテスコ	82.9	86.5	316,157	マースグループホールディングス	9.4	8.2	20,221		9.4	8.2	20,221
日本フイルコン	10.9	8.2	3,690	三井海洋開発	15.5	17.3	23,389	フクシマガリレイ	10.3	10.1	44,339		10.3	10.1	44,339
ノーリツ	28	20.7	30,718	レオン自動車	15.6	14.6	16,074	オーイズミ	5.4	4.6	2,208		5.4	4.6	2,208
長府製作所	14.9	14.1	29,243	SMC	43.1	44.7	3,031,107	ダイコク電機	6.9	7.5	15,885		6.9	7.5	15,885
リンナイ	27.4	25.5	251,940	ホンソカワミクロン	10.3	10.6	28,726	竹内製作所	22.4	25	70,950		22.4	25	70,950
ダイニチ工業	7.2	6.5	4,335	ユニオンツール	5.5	6.1	20,801	アマノ	38.5	39.1	95,325		38.5	39.1	95,325
日東精工	18.4	20.6	10,403	オイレス工業	20.5	19.3	30,687	JUKI	20.5	21.4	13,011		20.5	21.4	13,011
三洋工業	1.4	1.4	2,570	日精エー・エス・ピー機械	4.9	6.3	28,822	サンデン	20.4	18.3	4,044		20.4	18.3	4,044
岡部	27.8	22.6	16,226	サトーホールディングス	19.3	19.6	41,748	ジャノメ	12.5	14.1	8,572		12.5	14.1	8,572
ジーテクト	18.2	15.7	21,446	技研製作所	12.8	14.3	41,169	マックス	19.7	17	35,819		19.7	17	35,819
東プレ	27.1	24.9	31,448	日本エアータック	6.8	7	7,714	グローリー	37.7	35.7	81,039		37.7	35.7	81,039
高周波熱錬	25.9	22.8	15,663	カワタ	4.7	3.6	3,074	新晃工業	13.8	13.8	21,045		13.8	13.8	21,045
東京製綱	8.9	8.4	9,307	日精樹脂工業	10.4	10.3	10,083	大和冷機工業	21.2	21.2	25,291		21.2	21.2	25,291
サンコール	12.9	11.1	7,215	オカダアイオン	4.7	3.8	6,254	セガサミーホールディングス	145.9	110.8	222,597		145.9	110.8	222,597
モリテックスチール	11.4	9.4	2,782	ワイエイシホールディングス	5.7	5.2	10,784	日本ピストンリング	5.4	4.2	5,334		5.4	4.2	5,334
パイオラックス	21.6	19.4	34,726	小松製作所	666.1	646	2,020,688	リケン	6.4	5.5	13,387		6.4	5.5	13,387
エイチワン	14.4	14.7	9,555	住友重機械工業	84.1	81.5	227,629	T P R	19.9	15.8	20,777		19.9	15.8	20,777
日本発条	133.7	124.7	112,604	日立建機	58.9	54.9	166,072	ツバキ・ナカシマ	32.2	34	39,950		32.2	34	39,950
中央発條	7.2	7.8	5,483	日工	20.4	20.6	12,875	ホシザキ	43	88.7	401,811		43	88.7	401,811
アドパネクス	2.2	1.5	1,584	巴工業	5.9	6	14,670	大豊工業	12	12.1	7,598		12	12.1	7,598
立川プラインド工業	6.7	6.4	7,692	井関農機	13.7	12.9	15,531	日本精工	276.6	253	183,931		276.6	253	183,931
三益半導体工業	11.5	10.8	27,853	TOWA	12.6	14	27,496	NTN	314.8	271.8	82,899		314.8	271.8	82,899
機械 (5.3%)				丸山製作所	3.2	2.2	3,568	ジェイテクト	140.9	122.7	120,246		140.9	122.7	120,246
日本ドライケミカル	3.8	3	4,851	北川鉄工所	6.8	5.4	6,318	不二越	12.6	10.2	39,219		12.6	10.2	39,219
日本製鋼所	44.1	38	102,372	ローツェ	7.4	7.2	75,312	日本トムソン	40.2	33.7	20,354		40.2	33.7	20,354
三浦工業	63	57.6	182,592	タカキタ	5	3.6	1,504	T H K	83	79.6	214,124		83	79.6	214,124
タクマ	49.2	42.4	52,915	クボタ	712.6	729.6	1,427,097	ユーシン精機	11.7	10.8	7,776		11.7	10.8	7,776
ツガミ	31.9	30.6	43,023	荏原実業	6.9	6.6	17,503	前澤綯装工業	11.4	9.8	9,074		11.4	9.8	9,074
オークマ	16.9	13.8	71,484	三菱化工機	4.7	4.4	9,702	イーグル工業	18.3	15.3	17,258		18.3	15.3	17,258
芝浦機械	16.5	13.7	38,250	月島機械	27.3	18.7	19,410	前澤工業	8.9	7.1	4,366		8.9	7.1	4,366
アマダ	229.4	220	250,580	帝國電機製作所	10.6	10	24,860	日本ピラー工業	14.9	12.8	40,640		14.9	12.8	40,640
アイダエン지니어リング	38.2	28.4	23,117	東京機械製作所	-	2.9	1,711	キッツ	49.7	50.7	40,560		49.7	50.7	40,560
TAKI S AWA	4.8	3.3	3,663	新東工業	32.6	28.2	20,219	マキタ	179	171.5	604,537		179	171.5	604,537
F U J I	67	60	128,700	滋谷工業	12.8	12.9	31,863	三井E&Sホールディングス	53	63.2	25,153		53	63.2	25,153
牧野プライス製作所	16	15.3	70,915	アイチコーポレーション	21.7	19.6	15,131	日立造船	124.3	113	99,779		124.3	113	99,779
オーエスジー	67.3	65.8	129,691	小森コーポレーション	37.5	31.9	26,413	三菱重工業	231	241.1	1,191,034		231	241.1	1,191,034
ダイジェット工業	1.1	1.3	1,060	鶴見製作所	11.5	10.5	20,800	I H I	91.8	86.9	332,392		91.8	86.9	332,392
旭ダイヤモンド工業	38.3	38.5	28,528	住友精密工業	2.4	-	-	サノヤホールディングス	17	16.8	2,200		17	16.8	2,200
D M G 森精機	86.3	83.6	164,942	日本ギア工業	6	4	1,792	スター精密	22.8	26	43,550		22.8	26	43,550
ソディック	32.2	37.9	28,387	酒井重工業	2.7	2	7,480	電気機器 (17.7%)							
ディスコ	21.5	22.1	892,840	荏原製作所	61.1	56.4	308,508	日清紡ホールディングス	89.8	112.1	107,728		89.8	112.1	107,728
日東工器	8.1	6.8	11,396	石井鐵工所	1.2	1	2,282	イビデン	77.2	79	394,605		77.2	79	394,605
日進工具	11.6	11.6	12,481	西島製作所	13.5	12	18,060	コニカミノルタ	320.9	307.8	166,827		320.9	307.8	166,827
パンチ工業	12.2	10.7	4,964	北越工業	14	13.8	19,016	ブラザー工業	179.5	184.2	367,847		179.5	184.2	367,847
富士ダイス	6.8	5.9	3,463	ダイキン工業	187.4	164.6	3,778,393	ミネベアミツミ	253.4	239.8	570,004		253.4	239.8	570,004
豊和工業	7.9	6.6	6,375	オルガン	4.2	19	61,560	日立製作所	707.2	670.5	4,704,898		707.2	670.5	4,704,898
ニデックオーケーケー	5.6	5	4,695	トーヨーカネツ	5.5	5.3	13,970	東芝	256.9	265.3	1,194,911		256.9	265.3	1,194,911
石川製作所	3.9	3.1	4,383	栗田工業	79.7	77.1	474,936	三菱電機	1,470.1	1,425	2,143,912		1,470.1	1,425	2,143,912
東洋機械金属	9.9	8.5	4,734	椿本チエイン	19.4	19.5	59,865	富士電機	88.6	83.8	434,084		88.6	83.8	434,084
津田駒工業	3.4	2.3	1,182	大同工業	6.7	5	3,665	東洋電機製造	5.9	3.9	3,424		5.9	3.9	3,424
エンシュウ	3.5	2.6	1,781	木村化工機	12.2	10.5	7,392	安川電機	158.4	163.4	833,340		158.4	163.4	833,340
島精機製作所	21.2	21.9	40,821	アネスト岩田	23	23.4	20,100	シノフエアテクノロジー	17.7	15.2	24,912		17.7	15.2	24,912
オプトラン	18.3	20.4	51,102	ダイフク	81	71.1	512,631	明電舎	24.9	20.9	39,772		24.9	20.9	39,772
NCホールディングス	4.1	2.5	5,117	サムコ	3.6	4.5	16,650	オリジン	4	2.8	3,553		4	2.8	3,553
イワキ	9.4	9.3	11,820	加藤製作所	6.9	5.8	4,524	山洋電気	6.6	6	33,900		6.6	6	33,900
フリュー	12.8	14.4	17,236	油研工業	1.8	1.7	3,194	デンヨー	12.6	10.5	15,991		12.6	10.5	15,991
ヤマシンフィルタ	29.3	32.8	15,317	タダノ	77	72.6	68,607	P H Cホールディングス	16.9	19.2	29,856		16.9	19.2	29,856
日版製作所	18.3	13.3	11,318	フジテック	54.6	50.5	157,307	ソシオネクスト	-	14.1	117,453		-	14.1	117,453
やまびこ	28.3	22.5	25,290	C K D	43.4	38.1	76,428	東芝テック	16	20.6	77,559		16	20.6	77,559
野村マイクロ・サイエンス	3.9	4.6	21,574	キトー	12.6	-	-	芝浦メカトロニクス	2.7	2.7	30,618		2.7	2.7	30,618
平田機工	6.9	6.6	42,570	平和	41.1	45.8	104,744	マブチモーター	34.1	34.3	128,282		34.1	34.3	128,282

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		銘柄	期首(前期末)	当 期 末		銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
日本電産	381.1	334.9	2,469,552	日本航空電子工業	33.7	28.3	64,184	KOA	22.3	20.6	38,460
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.6	9.9	4,959	ＴＯＡ	16	15.7	12,183	市光工業	17.7	19.7	7,683
トレックス・セミコンダクター	7.5	6.5	17,927	マクセル	29.3	29.9	42,996	小糸製作所	80.7	164.2	363,703
東光高岳	8.2	8.4	16,783	古野電気	17.4	18	16,740	ミツバ	27	25.6	13,568
ダブル・スコープ	42.3	45.1	67,424	ユニデンホールディングス	3.3	-	-	SCREENホールディングス	25.6	23.3	238,825
ダイヘン	16.1	12.5	51,750	スマドコーボレーション	13.9	12.6	18,711	キャノン電子	13.7	15.1	25,790
ヤーマン	24	23.8	32,177	アイコム	5.5	5.4	13,635	キャノン	730.5	749	2,182,586
JVCケンウッド	119.5	125.5	51,455	リオン	5.6	5.7	10,516	リコー	408.1	342.2	344,937
ミカエンジニアリング	13.3	13.1	7,846	本多通信工業	11.9	-	-	象印マホービン	39.8	40.8	67,850
イーペーエックス	6.9	7.6	8,952	横河電機	147.2	150.9	345,108	MUTOHホールディングス	1.2	1.7	2,748
日新電機	34.7	33	56,100	新電元工業	5.6	5.3	17,940	東京エレクトロニクス	93.3	96.3	4,498,173
大崎電気工業	26.8	32.5	17,095	アズビル	86.2	95.4	348,210	イノテック	8.7	9.1	12,212
オムロン	122.4	126.3	954,322	東亜ディーケーケー	7.6	5.9	4,472	輸送用機器 (7.4%)			
日東工業	19.6	18.6	47,076	日本光電工業	60.9	63.1	207,599	トヨタ紡織	60	57.5	115,805
IDEC	18.3	20.3	63,133	チノー	4.8	5.7	10,869	芦森工業	2.5	2.3	3,286
正興電機製作所	4.6	4.6	4,650	共和電業	14.9	11.6	3,920	ユニプレス	21.9	24.5	19,159
不二電機工業	3.4	2.5	2,720	日本電子材料	7.2	9	13,095	豊田自動織機	119.2	99.8	755,486
ジエス・ユアサ コーポレーション	47.9	45.3	101,517	堀場製作所	27.3	30.3	184,830	モリタホールディングス	23.6	24	27,624
サクサホールディングス	2.9	2.6	3,177	アドバント	109.3	107.5	1,059,950	三櫻工業	20.2	20.9	13,773
メルコホールディングス	3.3	3.7	12,265	小野測器	6.9	4.5	1,881	デンソー	323.7	281.6	2,070,886
テクノメディカ	3.5	3.3	5,633	エスベック	12	10.9	22,345	東海理化電機製作所	38.8	38.6	56,394
ダイヤモトエレクトロニクスホールディングス	4.1	4.5	6,187	キーンズ	133.2	136.5	8,336,055	川崎重工業	107.3	102.9	297,072
日本電気	186.9	195	937,950	日置電機	7	7.1	51,830	名村造船所	43.7	31.2	12,261
富士通	132.4	137.4	2,458,773	シスメックス	124.4	117.7	1,035,053	日本車輛製造	5.5	5.3	10,345
沖電気工業	59.8	62.3	45,603	日本マイクロニクス	25.6	22.5	31,410	三菱ロジスネクスト	19.5	21.8	17,156
岩崎通信機	6.3	5.4	4,109	メガチップス	13.8	11.2	32,872	近畿車輛	1.7	1.5	1,606
電気興業	7.9	5.5	10,604	OBARA GROUP	6.8	6.4	23,424	日産自動車	1,733.9	1,939.1	919,327
サンケン電気	13.8	12.8	103,936	澤藤電機	1.8	1.4	1,601	いすゞ自動車	461.4	396.9	635,833
ナカヨ	2.2	2.1	2,375	厚田工業	7.5	5.5	4,719	トヨタ自動車	7,450.7	7,495.9	14,219,722
アイホン	8.5	8.4	16,287	コーセル	16.3	16.4	18,220	日野自動車	183.6	175.8	98,448
ルネサエレクトロニクス	796.7	899.7	1,274,425	イリソ電子工業	12.3	12.6	56,070	三菱自動車工業	544.1	532.6	272,158
セイコーエプソン	182.4	183.6	343,332	オプテックスグループ	24	25.1	50,777	エフテック	10.3	8.3	4,482
ワコム	114	109.2	72,072	千代田インテグレ	6.4	4.7	10,697	レッツホールディングス	5.7	4.7	2,190
アルバック	29.3	32.7	197,508	アイ・オー・データ機器	5.5	-	-	GMB	2.8	2.4	1,718
アクセル	6.3	4.5	7,366	レーザータック	64.5	62.5	1,415,625	ファルテック	2.9	2.1	1,241
EIZO	11.5	10.1	36,562	スタンレー電気	102.8	97.1	271,006	武蔵精密工業	32.7	33.3	59,940
ジャパンドイスプレイ	500	528.8	24,324	岩崎電気	5.4	4.4	12,742	日産車体	21.7	24.1	20,533
日本信号	37.5	31.4	32,404	ウシオ電機	75.3	71.3	113,010	新明和工業	41.7	42.9	45,345
京三製作所	31.6	29	11,832	岡谷電機産業	9.3	9.8	2,518	極東開発工業	27.3	24	34,536
能美防災	19.5	18.7	32,126	ハリオス テクノ ホールディング	12.9	11.1	4,839	トビー工業	12.1	11.1	18,858
ホーチキ	10.9	10.3	15,398	エノモト	4	3.1	5,809	ティラド	4.2	3.4	7,633
星和電機	7.2	5.2	2,246	日本セラミック	13.8	13.9	37,349	曙ブレーキ工業	80.6	83.3	12,661
エレコム	33.7	32.9	44,053	遠藤照明	6.9	5.4	3,963	タチエス	25.7	21.6	26,157
パソナック ホールディングス	1,568.1	1,628.6	1,882,661	古河電池	10.7	10.1	10,817	NOK	71.2	53	62,805
シャープ	167.6	166	179,612	双信電機	6.4	5	1,880	フタバ産業	36.8	36.5	14,381
アンリツ	94.6	97.1	120,306	山一電機	10.8	11.9	20,884	KYB	15.4	13.1	47,684
富士通ゼネラル	39.9	39.1	141,346	図研	9.5	11.9	38,020	大同メタル工業	28.5	26.6	13,273
ソニーグループ	921.1	965.7	11,641,513	日本電子	30.8	34.2	135,261	プレス工業	73	60.8	26,691
TDK	213	218.4	1,036,308	カシオ計算機	106.5	101.6	130,454	ミックニ	19.6	14	4,746
帝國通信工業	6.7	6.2	9,163	ファナック	129.1	133.9	3,090,412	太平洋工業	30.8	31.3	34,868
タムラ製作所	56.8	59.1	44,797	日本シイエムケイ	28.9	29	14,558	河西工業	17.7	16.1	2,495
アルプスアルパイン	129.9	123.1	173,694	エンプラス	3.6	4	16,400	アイシン	107.7	105.4	382,075
池上通信機	5	4	2,472	大真空	19.9	16.6	12,151	マツダ	461.4	451.5	480,396
日本電波工業	13.3	16.5	23,859	ローム	65.8	63.1	663,181	今仙電機製作所	9.6	7.7	5,205
鈴木	6.8	7.4	7,296	浜松ホトニクス	105.5	109.5	770,880	本田技研工業	1,157.5	1,109.7	3,617,622
メイコー	12	15.1	44,016	三井ハイテック	14.6	14.1	100,815	スズキ	336.2	250.8	1,212,116
日本トリム	2.9	3.1	9,008	新光電気工業	43.2	48.3	189,577	SUBARU	421.2	432	932,904
ローランド ディー・ジー	8.7	7.7	22,607	京セラ	206.9	212.1	1,380,771	安永	7.2	5.4	3,682
フォスター電機	14.8	12.8	12,544	太陽誘電	71.3	66.5	303,240	ヤマハ発動機	191.9	214.5	709,995
S/MK	3.5	3.3	7,844	村田製作所	431.9	414	3,191,112	TBK	16.9	11.7	2,878
ヨコオ	10.9	10.9	24,623	双葉電子工業	25.1	25.8	14,112	エクセディ	22.3	22.2	38,472
ティアック	23.5	18.8	2,199	北陸電気工業	5.5	4.5	5,881	豊田合成	47.4	39.8	85,808
ホシデン	35.4	33	53,460	ニチコン	46.3	27.9	37,497	愛三工業	23.1	22.6	19,119
ヒロセ電機	22.8	22.8	382,356	日本ケミコン	14	13.5	26,392	盟和産業	1.7	1.5	1,401

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
日本プラスト	11.5	9.5	4,037	ホクシン	11	9.4	1,353	西日本旅客鉄道	178.4	174.3	918,386	東海旅客鉄道	122.1	105.2	1,614,294
ヨロズ	13.9	12.6	9,072	ウッドワン	4.6	4	3,628	西武ホールディングス	191.8	165.1	240,220	湧池運輸	23.5	23.3	35,602
エフ・シー・シー	24	24.3	34,821	大建工業	8.7	8.3	18,002	西日本鉄道	10.7	36.4	85,576	ハマキョウレックス	40.6	10.7	34,614
シマノ	59.1	55.8	1,333,062	凸版印刷	223.5	178.5	368,245	サカイ引越センター	6.9	6.5	28,015	近畿グループホールディングス	139.3	136.3	571,097
テイ・エス テック	62.1	62.5	98,875	大日本印刷	173.8	162	498,150	阪急阪神ホールディングス	174.1	181.7	700,453	南海電気鉄道	62.3	65.1	179,871
ジャムコ	8.6	6.6	9,781	共同印刷	4.6	3.8	10,784	京阪ホールディングス	62.1	56.3	190,857	神戸電鉄	3.3	3.7	11,692
精密機器 (2.6%)				N I S S H A	30.2	26	50,258	神戸電鉄	3.3	3.7	11,692	名古屋鉄道	114.5	150.6	311,591
テルモ	416	426.5	1,640,745	光村印刷	0.7	0.6	748	山陽電気鉄道	11	10.3	22,309	アルプス物流	9.9	10.9	14,300
クリエートメディック	4.3	4.2	3,725	TAKARA & COMPANY	7.4	8.8	18,981	ヤマトホールディングス	195.2	174.5	425,780	山九	36.6	34.7	173,500
日機装	44.1	34.1	35,702	アシックス	129.9	126	389,340	丸連	8.3	6.5	1,436	丸倉運輸	11.5	8.5	26,265
日本エム・ディ・エム	8.6	8	8,016	ツツミ	3.8	2.4	4,550	セコグループホールディングス	69.9	72.2	71,694	トナミホールディングス	3.4	2.5	9,312
島津製作所	189.3	166.2	664,800	ローランド	10.3	10	37,700	ニッコロホールディングス	46.8	43.7	108,157	日本石油輸送	1.1	0.8	1,858
JMS	12.3	12.8	6,412	小松ウオール工業	4.3	5.1	9,735	福山通運	23	10.4	35,048	セイノホールディングス	94.9	84.9	111,643
クボテック	3.3	3.2	736	ヤマハ	85.5	86.1	438,249	エスライ	3.2	3.7	3,019	ANAホールディングス	319.2	334.8	875,167
長野計器	10.8	9.9	11,325	河合楽器製作所	4.1	3.7	9,568	神奈川中央交通	3.4	3.9	12,870	ANAホールディングス	353.8	370.8	1,051,218
アイ・テクノロジ	6.4	6.6	18,321	クリナップ	14	15.4	9,532	日立物流	26.9	—	—	パスコ	2.8	2.5	3,650
東京計器	9.4	10.4	13,280	ピジョン	89	86.9	179,448	A2-COM(現)ホールディングス	29.5	32.9	55,666	C&Fホールディングス	14.3	13.2	15,866
愛知時計電機	3.7	5.4	7,554	兼松サステック	0.6	0.6	1,347	九州旅客鉄道	107.8	96.3	274,551	S Gホールディングス	263.3	261.6	552,760
インデアクシオン	7.5	6.4	9,420	キングジム	12.3	12.2	10,723	NIPPON EXPRESSホールディングス	48.2	50.9	382,259	海運業 (0.6%)			
オーバル	13.3	10.7	4,889	リントック	31.6	27.4	60,499	日本郵船	116.4	364.6	1,164,532	商船三井	77.1	240.2	792,660
東京精密	24.8	29.9	137,988	イトーキ	26.8	27.9	18,888	川崎汽船	42.9	116.1	362,232	N Sユナイテッド海運	7.7	7.3	28,433
マニ	58.6	60.1	115,091	任天堂	83	861.9	4,847,325	明治海運	16.5	11.8	7,752	飯野海運	64.5	50	46,100
ニコン	224.5	212.3	266,861	三菱鉛筆	24.2	19.4	27,295	共栄タンカー	2.5	2.2	2,098	乾汽船	9.4	17.3	34,427
トプコン	69.1	71.8	117,823	タカラスタンダード	30.5	26.4	35,904	空運業 (0.5%)				日本航空	319.2	334.8	875,167
オリンパス	771.1	853.3	2,132,396	コクヨ	70.5	65.7	117,603	ANAホールディングス	353.8	370.8	1,051,218	ANAホールディングス	353.8	370.8	1,051,218
理研計器	12	8.5	39,950	ナカバヤシ	14	15	7,275	パスコ	2.8	2.5	3,650	パスコ	2.8	2.5	3,650
タムロン	11.5	10.2	32,946	グロープライド	13.2	11	29,095	倉庫・運輸関連業 (0.1%)				トランコム	11	4	3.9
HOYA	287	291.5	4,145,130	オカムラ	50.6	41.1	53,388	日本航空	319.2	334.8	875,167	日新	11.3	10.3	22,536
シード	6.9	6.2	3,236	美津濃	14.7	13.5	39,271	ANAホールディングス	353.8	370.8	1,051,218	三菱倉庫	44.1	29.3	91,269
ノーリツ鋼機	13.2	12.9	30,405	電気・ガス業 (1.2%)				パスコ	2.8	2.5	3,650	三井倉庫ホールディングス	14.9	12.7	47,625
A&Dホールディングス	13.4	19.9	21,870	東京電力ホールディングス	1,100.2	1,230.6	564,845	住友倉庫	49.2	37.5	75,262	滋澤倉庫	8.5	5.5	11,533
朝日インテック	161.2	152.5	352,275	中部電力	449.8	503.1	696,793	東陽倉庫	22.8	16.4	4,542	中央倉庫	8.8	6.7	6,512
シチズン時計	172.1	149.9	91,139	関西電力	557	527.1	640,953	日本トランスシティ	30.8	27.6	14,931	川西倉庫	2.9	2.1	2,114
リズム	4.6	3.8	6,224	中国電力	229.8	217.4	149,136	ケイヒン	2.8	2.2	3,341	安田倉庫	12	9.5	8,873
大研医器	12	9.3	4,287	北陸電力	134.6	128.7	68,211	中央倉庫	8.8	6.7	6,512	ファイブホールディングス	2.9	2.3	2,661
メニコン	48.8	46.9	134,040	東北電力	343.8	333.7	222,244	東洋埠頭	3.2	3.5	4,669	東洋埠頭	3.2	3.5	4,669
シンシア	1.8	1.2	592	四国電力	132.5	116.5	84,695	上組	76.7	65.3	172,914	上組	76.7	65.3	172,914
松風	6.4	6.2	13,590	九州電力	303	315	230,580	サンリツ	4	2.8	2,086	サンリツ	4	2.8	2,086
セイコーグループ	20.7	21.2	62,328	北海道電力	127.8	131.7	62,689	キムラユニティ	4	5.9	5,882	キムラユニティ	4	5.9	5,882
ニプロ	109.6	113.8	117,100	沖縄電力	31.4	31.9	33,590								
その他製品 (2.3%)				電源開発	125.2	102.8	219,683								
K Y O R I T S U	—	17.6	2,164	エフオン	8.9	8.9	4,458								
中本パックス	4.2	3.8	6,099	イーレックス	21.7	24.3	57,105								
スノーピーク	19.3	23.3	49,675	レノバ	28.7	36.3	78,662								
パワフロントベッドホールディングス	28.2	31.6	73,122	東京瓦斯	281.8	288.6	791,629								
トランザクション	8.1	10.5	16,233	大阪瓦斯	266.1	276.6	593,860								
鞋美堂	5	3.5	1,323	東邦瓦斯	67.5	53.8	133,424								
ニホンフラッシュ	12.6	12.9	11,958	北海道瓦斯	7.6	8.2	14,776								
前田工織	16.3	11.6	39,382	広島ガス	29.1	28.8	9,763								
永大産業	20.5	13	2,899	西部ガスホールディングス	16.6	12.8	22,617								
アートネイチャー	12.7	14.1	10,363	静岡ガス	38.4	31.2	34,788								
ハルダイナムホールディングス	131.8	124.7	1,075,038	メタウオーター	15.3	17	28,271								
アイフイスジャパン	4.3	3.5	2,128	陸運業 (2.9%)											
共立印刷	25.1	—	—	S B Sホールディングス	11	12.2	35,794								
S H O E I	13.9	14.4	72,576	東武鉄道	143.6	150	455,250								
フランスベッドホールディングス	19.3	16.8	16,262	相鉄ホールディングス	47	45.1	101,790								
パイロットコーポレーション	24.9	21.4	96,300	東急	370.8	382.7	617,677								
萩原工業	9.6	9.1	10,683	京浜急行電鉄	188.7	154.8	201,704								
フジールインターナショナル	35.7	27.7	45,788	小田急電鉄	218.7	206.9	344,902								
タカラトミー	61.5	62.9	79,442	京王電鉄	76.3	72.2	346,560								
広済堂ホールディングス	9	8.2	16,924	京成電鉄	102.5	88	329,120								
エステールホールディングス	4	2.9	1,824	富士急行	17.6	16.8	74,340								
タカノ	5.4	4.6	3,086	新京成電鉄	3.4	—	—								
プロネクス	11.5	11.4	11,058	東日本旅客鉄道	258.8	231.6	1,591,786								

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額		株	数	評 価 額		株	数	評 価 額
キユーソー流通システム		千株	千円	インターネットイニシアティブ		千株	千円	東邦システムサイエンス		千株	千円		千株	千円	
近鉄エクスプレス	7.3	7.3	6,978	ざくらインターネット	38.5	76.4	180.151	ゾネスネット	4.1	3.5	3,591	61.7	69.6	19,696	
東海運	26.3	-	-	ヴィンクス	15.4	15.3	9,210	インフォコム	15.9	17.6	39,952	16.8	23	55,315	
イーアイティー	8.6	7.5	2,122	GMOアドバンス・ホールディングス	4.2	3.6	5,256	HEROZ	4	4.5	5,085	15.9	38.7	60,101	
内外トランスライン	8.8	8.6	13,467	SRAホールディングス	3.3	4.2	18,564	メルカリ	15.9	17.6	39,952	16.8	23	55,315	
日本コンセプト	5.4	5	11,040	システムインテグレータ	7.2	7	21,490	IPS	4	4.4	12,522	16.8	23	55,315	
情報・通信業 (8.9%)	4.6	4.2	6,392	朝日ネット	4.8	3.7	1,546	FIG	4	4.5	5,085	16.8	23	55,315	
NECネットワークス	47.8	45.7	73,577	eBASE	13.3	14.8	8,658	システムサポート	15.9	17.6	39,952	16.8	23	55,315	
クロスキャスト	3.9	7.8	10,514	アバントグループ	17.2	19.3	12,738	イートレット	4	4.4	12,522	16.8	23	55,315	
システム	205.8	230.2	83,102	アドソル日進	15.5	17.3	24,271	イーソル	4.3	5.3	8,474	16.8	23	55,315	
デジタルアーツ	7.9	8.7	48,285	ODKソリューションズ	5.1	5.8	7,824	アルテリア・ネットワークス	8.7	8.8	6,987	16.8	23	55,315	
日鉄ソリューションズ	20.9	23.4	77,220	フリービット	3	2.7	1,571	東海ソフト	18.3	12.7	15,849	16.8	23	55,315	
キューブシステム	7.5	8.3	8,939	コムチュア	8.6	7.1	8,094	ウイングワーク1st	2.4	1.9	1,763	16.8	23	55,315	
WOW WORLD	2.2	-	-	サイバーコム	16.2	18.1	41,811	ヒューマンエージェンシー	8.2	14.1	27,650	16.8	23	55,315	
コア	6.4	5.9	8,897	アステリア	2.4	2	2,878	Sansan	3.4	3.7	5,742	16.8	23	55,315	
手問いらす	1.8	2.3	11,465	アイル	10.4	10.7	8,003	サバーワークス	2.6	2.8	6,568	16.8	23	55,315	
ラクーンホールディングス	10.3	11.4	13,178	マークライNZ	8	7.6	15,116	東名	1.5	0.9	2,031	16.8	23	55,315	
ソリトンシステムズ	7.3	7	7,966	メディカル・データ・ビジョン	7.4	7.4	20,424	ウィッツ	1.2	1.2	1,129	16.8	23	55,315	
ソフトクワイエットホールディングス	6.4	5.7	20,064	gumi	18.3	20.4	19,808	トビラシステムズ	2.9	3.1	2,551	16.8	23	55,315	
TIS	137.6	153.9	533,263	ショーケース	20	21.1	17,850	リンク-U	51.3	44.7	77,375	16.8	23	55,315	
JNSホールディングス	6.7	5.6	1,797	モバイルファクトリー	3.4	3	927	ギフティ	2.7	2.3	2,120	16.8	23	55,315	
グリー	65.7	36.7	25,910	テラスカイ	3.3	2.6	2,488	モデル	12.6	14.9	35,313	16.8	23	55,315	
GMOペパボ	1.5	2	3,768	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5.2	5.9	11,794	ベース	-	13.7	60,896	16.8	23	55,315	
コアエテックモホールディングス	46.1	85.8	199,399	PCIホールディングス	6.4	7.9	14,844	JMDC	2.6	4.6	21,942	16.8	23	55,315	
三菱総合研究所	6.3	6.7	32,528	パイプドHD	6.6	5.1	5,349	フォーカスシステムズ	13.5	22.5	97,762	16.8	23	55,315	
ボルテージ	4	3.6	1,137	アイビーシー	2.8	-	-	グレスコ	9.6	10	10,880	16.8	23	55,315	
電算	1.1	0.8	1,280	ネオジャパン	2.6	1.9	725	アジ・メディア・ホールディングス	10.7	10.5	19,026	16.8	23	55,315	
AGS	7.2	5.3	3,598	PR TIME S	4	4.5	4,392	オービック	139	131.4	138,101	16.8	23	55,315	
ファインデックス	12.1	10.7	5,703	ラクス	3.2	3.4	6,358	ジャストシステム	45.6	45.7	942,334	16.8	23	55,315	
プレインパッド	11.3	10.2	7,354	ランドコンピュータ	49.6	64.7	120,471	TD Cソフト	20.5	19.7	63,138	16.8	23	55,315	
KLab	26.3	27.2	11,070	ダブルスタンダード	2.5	3	2,820	Zホールディングス	12.6	11.6	18,107	16.8	23	55,315	
ホルトウィンホールディングス	20.9	23.4	20,404	オープンドア	4.5	5.6	12,482	トレンドマイクロ	2,096.9	1,948.4	803,520	16.8	23	55,315	
ネクソン	325.4	354	1,092,090	マイネット	8.6	9.6	16,608	IDホールディングス	77.1	79	497,700	16.8	23	55,315	
アイスタイル	43.7	39.8	19,701	アカツキ	5.1	4	1,504	日本オラクル	9.4	9.3	9,272	16.8	23	55,315	
エムアップホールディングス	16.4	16.7	19,923	ベネフィットジャパン	6.4	6.5	15,268	アルファシステムズ	23.4	26.2	236,324	16.8	23	55,315	
エイチーム	9.9	9.9	7,781	Ubicomホールディングス	1.1	0.8	969	フェューチャー	3.3	4.3	17,630	16.8	23	55,315	
エニグモ	15.5	17.4	10,631	カナミックネットワーク	3.9	4.2	8,379	CAC Holdings	30.5	34.1	55,855	16.8	23	55,315	
テクノスジャパン	11.2	10	5,990	ノムラシステムコムボリューション	15.4	19.7	11,426	S Bテクノロジー	8.6	8.6	11,945	16.8	23	55,315	
enish	8.8	9.2	3,330	チェンジ	7.6	11.7	1,345	トリーセ	6.4	5.8	11,698	16.8	23	55,315	
コロプラ	47.3	53.2	33,675	シンクロ・フード	26.5	33.5	77,351	オービックビジネスコンサダント	4.5	3.2	2,390	16.8	23	55,315	
オルトプラス	11.2	9.2	1,784	オークネット	7.5	7.6	3,663	伊藤忠テクノソリューションズ	13.9	26.9	133,020	16.8	23	55,315	
ブロードリーフ	71.5	79.9	36,514	キャピタル・アセット・プランニング	7.7	6.7	12,709	アイティフォー	65.7	73.5	227,482	16.8	23	55,315	
クロス・マーケティンググループ	5.4	7.3	5,599	セグエグループ	2.9	2.4	1,459	東計電算	17.4	18.2	15,706	16.8	23	55,315	
デジタルハーツホールディングス	6.7	8.6	15,677	エイトレッド	3.8	3.3	2,795	エクスネット	1.7	2	11,500	16.8	23	55,315	
システム情報	10.9	12.1	10,224	マクロリンク	2.2	1.9	2,781	大塚商会	2.5	1.8	1,814	16.8	23	55,315	
メディアアド	5.1	5.5	8,998	ビーグリー	29.5	26.8	29,694	サイボウズ	78	77.6	353,856	16.8	23	55,315	
じげん	40.6	39.9	15,281	オロ	3.4	2.1	2,490	電通国際情報サービス	19.4	18.9	50,292	16.8	23	55,315	
ブイキューブ	14.7	16.4	11,726	ユーザーローカル	4.6	4.1	8,183	ACCES S	20.8	16.6	69,139	16.8	23	55,315	
エンカレッジ・テクノロジー	4.4	2.9	1,441	テモナ	4.5	5	6,965	デジタルガレージ	16.4	16.2	16,054	16.8	23	55,315	
サイバーリンクス	3.8	3.9	3,744	ニーズウェル	3.3	2.3	646	イーエムシステムズ	23.8	24.3	114,088	16.8	23	55,315	
ディー・エル・イー	9.6	8.8	2,279	マネーフォワード	3.4	2.1	2,490	ユーザーニューズ	24	22.8	21,249	16.8	23	55,315	
フィックススターズ	15.4	15.5	21,173	サインポスト	4.6	4.7	2,758	C I J	4.5	4.2	29,316	16.8	23	55,315	
CARTA HOLDINGS	5.7	6.4	10,585	SUN ASTERISK	2.2	2.2	10,519	ビジネスエン지니어リング	9.8	11.4	11,810	16.8	23	55,315	
オプティム	10	11.2	12,812	電算システムホールディングス	-	7.2	10,519	日本エンタープライズ	1.7	2.6	6,432	16.8	23	55,315	
セレス	5.3	5.5	5,857	APPIER GROUP	6	6.6	14,242	WOWOW	14.9	12.4	1,661	16.8	23	55,315	
S H I F T	7.3	10	238,400	ソルクシーズ	-	38.9	73,287	スカラ	7	7.6	9,568	16.8	23	55,315	
ティーガイア	12.7	14.3	23,251	フェイス	12.2	10.2	3,723	インテリジェント ウェブ	12.7	12.7	9,144	16.8	23	55,315	
セック	2.3	1.7	5,635	プロトコムボリューション	4	3.4	1,700	WOW WORLD GROUP	8.7	6.5	4,725	16.8	23	55,315	
テクマトリックス	24.3	25	40,800	ハイマックス	15.4	17.1	21,340	IMAGI CA GROUP	-	2.2	3,293	16.8	23	55,315	
プロシップ	4.9	6	8,610	野村総合研究所	4	4.3	6,170	ネットワンシステムズ	12.2	11.2	7,358	16.8	23	55,315	
カホー・オンライン・エンターテイメント	37.5	41.9	90,587	サイバネットシステム	278.9	280.9	841,857	システムソフト	55	51	164,475	16.8	23	55,315	
GMOペイメントゲートウェイ	28	31.3	373,348	CEホールディングス	10.3	11.5	11,408	アルゴグラフィックス	30.8	46.4	4,176	16.8	23	55,315	
ザッパラス	5.6	3.4	1,166	日本システム技術	7.6	6.2	3,155	マーベラス	11.4	12.6	49,203	16.8	23	55,315	
システムリサーチ	4	4.2	9,819	インテュールホールディングス	2.9	5.1	8,680		22.8	22.3	15,610	16.8	23	55,315	

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
エイバックス		千株	千円	東京エレクトロニクス	千株	千円	丸文	千株	千円	丸文	千株	千円			
B I P R O G Y	24.9	23.2	41,156	日谷フイルズホールディングス	4.2	5.4	41,418	ハビネット	12.7	12.9	16,202				
兼松エレクトロニクス	45.1	50.4	155,232	双日	12.6	12.4	30,938	橋本製菓ホールディングス	12.1	12.3	25,202				
都築電気	8	8.5	52,615	アルフレッサホールディングス	159.9	153.3	393,214	日本ライフライン	3	5.8	6,165				
TBSホールディングス	7.5	7.2	9,612	横浜冷凍	160.8	144.9	231,115	タカショー	42.9	42.3	37,900				
日本テレビホールディングス	87.7	70.2	104,668	神栄	41.4	39.4	41,921	I DOM	11	12.5	8,437				
朝日放送グループホールディングス	120.4	121.3	124,453	ラサ商事	2	1.8	1,519	進和	43.9	43.7	36,620				
テレビ朝日ホールディングス	14.9	13	8,333	アルコニック	8.2	5.8	7,215	エスケイジャパン	8.7	9.6	20,121				
スカパーJ SATホールディングス	34.7	33.3	43,523	神戸物産	15.4	19	26,125	ダイトロン	3.3	3.2	1,792				
テレビ東京ホールディングス	122	121.3	57,738	ハイパー	112.5	111.8	418,691	シークス	6.3	5.7	14,324				
日本BS放送	10.6	9.8	18,708	あいホールディングス	2.3	2.5	1,140	田中商事	20.6	20.5	29,417				
ビジョン	5.3	4.4	3,977	ディービーエックス	20.6	23.1	49,919	オーハシテックニカ	3.3	3.9	2,269				
スマートパリュース	24.6	18.1	25,846	ダイワホールディングス	4.8	3.5	3,545	白銅	8.2	7.2	10,699				
USEN-NEXT HOLDINGS	3.6	3	1,233	マクニカホールディングス	70.4	59	115,817	ダイコー通産	4.7	5.3	13,583				
ワイヤレスゲート	13.8	12.3	28,228	ラクト・ジャパン	34.5	35.4	121,953	伊藤忠商事	1.7	1.4	1,496				
コネクシオ	5.5	5.5	1,380	グリムス	5	5.7	11,793	丸紅	1,012.8	890.1	3,610,245				
日本通信	10.4	8.9	16,990	バイタルワークスホールディングス	6.6	6	15,276	高島	1,428.3	1,140.3	1,981,841				
クロップス	119.8	126.2	27,637	八洲電機	25.2	21.1	17,576	長瀬産業	2.3	2.1	6,117				
日本電信電話	2.9	2.1	2,297	Mディアスホールディングス	11	11.8	12,779	蝶理	79.6	67.9	138,923				
KDDI	1,509.2	1,754.4	6,766,720	レスターホールディングス	8.5	9.2	6,559	豊田通商	8.2	7.8	19,016				
ソフトバンク	1,051.8	1,058	4,198,144	ジュテックホールディングス	13.8	13.8	30,898	三共生興	145.3	126.5	712,195				
光通信	2,185.1	2,199.3	3,366,028	大光	3.6	2.7	3,272	兼松	19.6	20.7	10,577				
エムティーアイ	16.6	16.1	301,392	OCHIホールディングス	6.8	5.2	3,421	ツカモトコーポレーション	53.9	56	88,592				
GMOインターネットグループ	14.2	12.5	6,337	TOKAIホールディングス	3.6	2.9	3,726	日本紙パルプ商事	1.8	1.9	2,637				
ファイバーゲート	51.1	50.9	132,340	黒谷	70.4	71.3	61,104	カメイ	1,124.4	1,056.8	4,134,201				
アドマテックインフォコムコミュニケーション	4.7	7.3	6,810	Cominix	4	3.7	2,205	東都水産	7.7	7.6	39,520				
KADOKAWA	3.5	3.1	871	三洋貿易	1.8	2.4	1,824	OUGホールディングス	17.1	15.4	22,638				
学研ホールディングス	78.7	72.3	181,545	ビューティガレージ	14.7	14.9	17,060	スターゼン	0.6	0.6	3,150				
ゼンリン	20.2	22.8	21,591	ミタチ産業	2.5	2.3	8,257	山善	2.3	2	4,826				
昭文社ホールディングス	23.4	23.3	20,154	明治電機工業	10.9	10.5	10,510	榑本興業	10.9	11	23,111				
インプレスホールディングス	4.6	5.6	1,635	デリカフーズホールディングス	4	3.3	3,953	住友商社	60.9	38.9	40,883				
アイネット	11.7	10.8	2,203	スターティアホールディングス	46.5	51.9	127,777	第一実業	2.3	2.1	8,652				
松竹	7.6	8.4	10,810	コメダホールディングス	4.7	5.5	6,226	三菱商事	913.9	894.6	2,079,497				
東宝	9.5	7.8	86,112	ピーバンドットコム	6	5.2	2,667	内田洋行	6.3	6.4	30,176				
東映	85.2	85.7	406,218	アセンテック	3.4	2.5	2,460	三菱商事	1,085.1	903.1	4,145,229				
エヌ・ティ・ティ・データ	4.7	3.8	64,562	富士興産	31.6	35.3	83,413	第一実業	6.7	5.1	24,709				
ピー・シー・エー	384.2	429.6	853,185	協栄産業	2.4	1.7	895	キヤノンマーケティングジャパン	35.9	33.4	101,870				
ビジネスブレイン太田昭昭	8.6	7.8	9,640	フルサト・マルカホールディングス	4.9	4.7	2,641	西華産業	7.9	5.7	9,034				
DTS	5.1	5.9	11,977	ヤマエグループホールディングス	3.8	2.9	3,436	佐藤商事	12.1	10.1	13,685				
スワミア・エックスホールディングス	27.7	29.1	90,792	小野建	1.7	1.1	1,900	菱洋エレフトロ	8.6	12.3	28,363				
シーイーシー	67.1	68.8	422,432	南陽	14	14.3	47,118	東京産業	13.2	13.3	10,294				
カプコン	15.4	19.2	30,163	佐島電機	9.8	8.2	11,791	ユアサ商事	13.8	13	45,955				
アイ・エス・ピー	136.1	136	569,160	エコートレーディング	14.3	13.4	20,167	神鋼商事	3.4	3.6	20,160				
ジャストテック	6.8	7	8,379	伯東	2.3	2.5	5,010	トルク	6	6.6	1,379				
S C S K	8.6	8.4	10,315	コンドレーテック	9.1	8	11,360	阪和興業	28.9	25.9	107,226				
NSW	100	111.7	219,267	中山福	2.9	2.5	2,010	正栄食品工業	9.4	9.6	39,936				
アイネス	5.4	5.4	11,296	ナガイレーベン	8.7	8.3	38,470	カナデン	12	11.7	12,905				
T K C	13.2	9.5	12,521	三菱食品	11.6	11.1	11,155	菱電商事	1.6	1.6	20,648				
富士ソフト	24.4	24.6	89,175	松田産業	7.6	6.6	2,204	岩谷産業	34.8	32.9	178,976				
NSD	15.4	15.5	114,545	第一興商	19.3	18.2	35,271	ナイス	5.1	3.5	4,669				
コナミグループ	46.5	48.8	112,972	メディアルホールディングス	14.2	13.4	43,885	ニチモウ	2.4	1.4	4,305				
龍井コンピュータホールディングス	52.4	58.6	359,218	S P K	10.7	10.9	25,331	榑東貿易	4.1	8.7	12,145				
J B C Cホールディングス	6.7	9.5	28,642	秋原電気ホールディングス	27.5	27.9	109,507	アステナホールディングス	20.3	25	10,525				
ミロク情報サービス	9.8	9.9	19,899	アズワン	156.2	149.7	257,633	三菱オプリー	35.6	39.8	53,968				
ソフトバンクグループ	12.7	12.5	22,950	スズデン	6	6.4	9,702	稲畑産業	31.8	29.2	71,773				
卸売業 (6.0%)	865	791.6	4,961,748	尾家産業	5.4	5.5	13,975	G S I クレオス	6.9	8.5	13,472				
ハウスイ	0.6	-	-	シモジマ	21.1	21.2	128,260	明和産業	13.3	19.2	13,555				
高千穂交易	5.9	4.5	10,696	ドウシシャ	5.3	5.1	12,525	クワザールホールディングス	4.6	4.4	1,944				
オルパルシアホールディングス	1.7	2	3,256	小津産業	3.2	3.1	2,920	ワキタ	31	26.5	30,713				
伊藤忠食品	3	2.7	13,351	高速	9	9.9	9,969	東邦ホールディングス	46.5	35.9	73,846				
エレマテック	11.7	13	22,919	たけびし	13.8	15.3	27,524	サンゲツ	38.4	36.3	81,239				
J A L U X	4.1	-	-	リック	2.5	2.9	4,584	ミツロコグループホールディングス	21.3	18.6	21,483				
あらた	11.6	11	45,540	リック	8.8	7.5	14,392	シナホンホールディングス	5.4	4.6	16,353				
トーマンデバイス	2.4	2.1	13,461	リック	5.6	5.6	8,954	伊藤忠エネクス	32.1	35.8	38,306				
								サンリオ	44.9	41	202,335				

銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
しまむら		千株	千株	千円		千株	千株	千円		北日本銀行	千株	千株	千円	
はせがわ	16.8	16.9	213,278		13.1	12.8	30,208		4.7	4.7	10,062			
高島屋	8	6.2	2,089		19.5	17.4	52,287		25.9	24.9	14,940			
松屋	105.3	108.9	194,713		13.4	11.4	45,144		16.8	12.8	3,276			
エイ・ツー・ો	29.1	24.5	27,807		-	16.6	38,312		7.4	4.6	3,381			
近鉄百貨店	68.5	70.3	88,437		-	18.8	42,600		112.3	109	42,183			
丸井グループ	114.3	106.5	233,661		94.6	39.7	95,081		13.2	13.8	20,272			
アクシアル	11.4	9.9	33,957		81	84.4	221,465		165.8	170.8	42,187			
井筒屋	6.9	6.1	2,031		9,093.4	8,536.5	8,008,090		証券・商品先物取引業(0.8%)					
イオン	557.2	489.7	1,285,952		1,659.4	1,716	1,221,620		F P G	48.8	54.5	63,329		
イズミ	26.3	22	63,382		274.1	244.4	1,171,898		ジャパンビストメントアドバタイザー	11.3	10.9	11,782		
平和堂	26.8	24	50,736		1,003.6	982.5	5,535,405		マーケキュリアホールディングス	5.1	7.1	5,396		
フジ	17.6	22.2	40,159		483.8	374.7	358,213		S B Iホールディングス	178.9	194.6	538,847		
ヤオコー	16.5	16.3	109,210		277.9	260.6	127,433		日本アジア投資	11.5	9.6	2,150		
ゼビオホールディングス	19.7	19.7	18,045		21.6	17.1	39,586		ジャフコ	55.7	44.9	96,310		
ケーズホールディングス	133.4	114.9	134,892		34.5	28	14,252		大和証券グループ本社	1,086	961.3	591,199		
Olympicグループ	7.9	5.2	2,698		56.9	59.1	13,652		野村ホールディングス	2,214.1	2,476.6	1,339,077		
日産東京販売ホールディングス	22.8	16.4	5,084		45.5	43	96,234		岡三証券グループ	113.8	118.4	49,846		
シルバークライフ	3	3.3	5,613		11.3	-	-		丸三証券	42.9	44.7	18,952		
Genky DrugStores	6.4	6.3	26,743		9.4	9	16,479		東洋証券	46.8	44.6	13,246		
ナルミヤ・インターナショナル	3.4	2.1	1,936		16.3	15	17,265		東興ファイナシヤル・ホールディングス	165.7	146.2	54,825		
ブックオフホールディングス	8.8	8.4	10,600		9.4	9.2	21,077		光世証券	2.9	2.7	985		
ギフトホールディングス	2.4	3.1	13,066		121.4	107.2	25,513		水戸証券	38.7	36.2	10,823		
アインホールディングス	19.4	19.9	107,062		7.5	6	6,138		いちよし証券	27.3	24.6	15,178		
元気寿司	4.1	4.1	12,201		9.5	-	-		松井証券	71.2	79.5	62,010		
ヤマダホールディングス	528.8	592.4	276,650		122	107.3	313,745		マネックスグループ	118	150.1	77,301		
アークランズ	22.8	21.2	30,528		353.2	-	-		福東証券	19.5	16.8	10,096		
ニトリホールディングス	57.6	58.4	992,800		127	118.5	49,888		岩井コスモホールディングス	13.7	15.3	20,517		
グルメ軒屋	12	11.8	11,918		326	275.5	153,453		アイザワ証券グループ	24	19.4	13,851		
愛眼	8.1	7.6	1,254		16	13.7	17,371		マネーパートナーズグループ	15.4	12.5	3,250		
ケユーホールディングス	7.9	8.5	12,265		28.8	25.7	49,241		スパークス・グループ	66.7	15	25,785		
吉野家ホールディングス	50.6	56.4	133,442		12.5	12	20,148		小林洋行	3.2	2.8	630		
榴屋フーズホールディングス	7	6.8	26,928		6.3	5.4	8,170		保険業(2.4%)					
サガミホールディングス	22.3	23.2	29,000		2.2	1.9	3,357		かんぽ生命保険	145.9	163.3	373,793		
関西フードマーケット	11	13	16,731		27.3	22.4	62,809		SOMPOホールディングス	238.1	230.7	1,280,615		
王将フードサービス	9.5	9.5	56,905		22.8	20.2	52,479		アコム	44.4	45.7	27,008		
アピナス	16.4	-	-		140	126.6	51,273		MS&ADインシュアランスグループホールディングス	325.2	273.6	1,149,667		
ミニストップ	11.2	10.4	14,612		51.9	42.6	259,860		第一生命ホールディングス	713.7	684.5	2,030,227		
アークス	27.7	26.5	57,028		92	48.1	77,248		東京海上ホールディングス	477.6	1,353.8	3,691,812		
パーコホールディングス	32.1	27.6	50,728		49.5	85.4	85,314		T & Dホールディングス	376.3	360.9	726,130		
ベルク	6.4	7.2	39,456		86.3	84	67,536		アドバンスクリエイト	7	7.8	9,110		
大庄	8	6.9	7,148		116	-	-		その他金融業(1.1%)					
ファーストリテイリング	19.4	21.7	1,791,552		4.2	3.9	4,793		全国保証	34.7	35.2	172,480		
サンドラッグ	54.5	54.8	197,554		192.3	-	-		あんしん保証	4.9	6	1,602		
サックスパー	13.8	13.7	10,165		15.4	12.2	23,472		ジェイリース	4.9	4	10,880		
ヤマザワ	2.9	2.3	3,155		22.3	21.2	19,885		イントラスト	6.3	4.5	4,243		
やまや	3	2.8	7,173		22.3	19.9	42,227		日本モーターサービス	8.2	6.7	5,916		
ペルーナ	31.1	33.8	23,153		8.6	8	16,824		C A S A	5.1	4.5	3,699		
銀行業(6.5%)					9.1	8.8	23,284		アルビ	21.3	16.5	17,605		
いざぎほホールディングス	-	160.1	112,710		8.6	7.8	14,297		プレミアグループ	7.5	22.6	37,312		
いずみホールディングス	-	303.9	327,604		31.6	30.5	28,853		ネットプロテクションズホールディングス	33	44.4	26,551		
ちゅうぎほホールディングス	-	113.2	105,049		430.4	481.4	126,126		クレディセゾン	92.9	85.1	147,137		
島根銀行	4.5	4.2	2,100		1,854.4	1,944.5	4,039,698		芙蓉総合リース	15.3	12.4	109,740		
じもとホールディングス	10.8	7.9	3,365		4.3	4.1	2,964		みずほリース	22.6	20	68,700		
めがきホールディングス	751.7	666.7	225,344		168.7	148.5	130,086		東京センチュリー	28.1	25.1	114,707		
東京ちほりホールディングス	18.3	17.2	48,968		4.9	3.7	5,180		日本証券金融	57.1	54	56,106		
九州フィナンシャルグループ	296.3	236.8	112,480		10.9	8.9	31,194		アイフル	243	222.6	86,814		
ゆうちょ銀行	342.8	382.9	443,398		218.8	204.1	56,535		リコーリース	12.8	12.7	48,768		
富山第一銀行	35.7	33.4	20,340		5.3	-	-		イオンフィナンシャルサービス	78.8	77.1	100,384		
コンコディア・フィナンシャルグループ	828	740.9	419,349		5.3	-	-		アコム	286	240.2	77,344		
西武フィナンシャルホールディングス	94.6	85	90,015		3.6	3.5	4,312		ジャックス	16.1	14.3	59,416		
三十三フィナンシャルグループ	13.7	12.1	20,073		20.5	18.1	16,851		オリエンタル・レゾナンス	391.5	35.1	40,540		
菊池北越フィナンシャルグループ	23.6	21.2	64,872		5.7	4	4,300		オリックス	880.3	899.2	2,098,283		
ひろぎんホールディングス	214.3	175.5	116,883		62.5	62.5	38,000		三菱H C資本	535.7	523.8	348,850		
					70.5	61.6	19,342		九州リースサービス	7.9	5.6	4,524		

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末					
	株 数	株 数	評 価 額	株 数		株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	株 数	評 価 額			
日本取引所グループ		千株		千株		千株		千株		千株		千株		千株		千株		千株
イ・ギャランティ	367.1	377.7	739,158	MIRARTHホールディングス	61	67.7	24,304	博報堂DYホールディングス	195.6	178.9	250,638							
アサクス	21.2	21.7	49,541	A V A N T I A	7.7	5.9	4,708	ぐるなび	22.9	25.8	10,139							
NECキャピタルソリューション	8.5	5.5	3,366	イオンモール	72.7	69.7	125,111	タカミヤ	17.6	19.2	7,468							
不動産業 (1.9%)	6.2	6.7	16,890	毎日コムネット	5.4	4.5	3,055	ジャパネットレクス・システム	9.4	8.7	7,221							
大東建託	47.2	49.2	615,492	ファースト住建	5.6	5	5,275	ファンコミュニケーションズ	35.1	27.8	11,425							
いちご	161.7	154.8	44,582	ランド	787.3	810.9	7,928	ライク	3.8	5.3	10,700							
日本駐車場開発	158	160.1	41,305	カチタス	35.9	36.1	101,404	ビジネス・ブレイクスルー	5.5	4.6	1,784							
スター・マイカ・ホールディングス	8	12.2	8,161	トーセイ	20	22.3	31,710	エスプール	39.7	40.3	29,419							
SREホールディングス	3.5	6.6	22,176	穴吹興産	3.4	2.4	5,097	WDBホールディングス	6.6	7.1	15,186							
ADワークスグループ	30	30	4,380	サンフロンティア不動産	20	22.4	24,505	ティア	8.7	7.4	3,122							
ヒューリック	346.1	313.4	332,517	FJネクストホールディングス	14.6	14.1	13,930	C D G	1.4	1.4	1,590							
三栄建築設計	5.9	6.5	9,626	インテリックス	3.5	3.1	1,798	アドウェイズ	20.9	19.3	9,939							
野村不動産ホールディングス	75	84	240,072	ランドビジネス	6	4.4	1,020	パリュウコマース	11.2	10.5	19,057							
三菱交通グループホールディングス	29.9	28.8	14,083	サンネクスグループ	5	3.6	3,380	インフォーマート	153.9	145.6	61,588							
サムティ	23.4	21.4	43,270	グランディハウス	10.3	10.1	5,807	J Pホールディングス	35.7	40.3	13,500							
ディア・ライフ	18.9	20.7	12,875	日本空港ビルデング	55.3	47.6	309,400	エコナックホールディングス	26	22	2,024							
コーセーアールイー	4.6	3.7	2,730	サービス業 (5.3%)				C Lホールディングス	3	3.9	3,159							
地主	9.2	10.2	18,645	明豊フアンリテイワークス	6.6	6.3	4,958	プラステジ・インターナショナル	52.4	59	41,300							
プレサンスコーポレーション	18.9	17.6	28,494	日本工営	8.3	8.5	30,132	アミューズ	7.7	7.6	13,148							
T H E グローバル社	9.1	7	1,526	L I F U L L	43	48	10,608	ドリームインキュベータ	3.9	4.3	11,128							
ハウスコム	1.2	2	2,192	M I X I	32.1	31.9	78,952	クワイフ	9.6	10.7	19,837							
J P M C	7	6.8	6,834	ジェイエイサーリクルートメント	11.5	12.7	29,387	T A C	8.6	6.8	1,373							
サンセイラディック	4.6	3.7	3,045	日&&Aセンターホールディングス	230.5	240.8	323,153	電通グループ	144.8	137.9	564,700							
エストラスト	1.4	1.5	870	メンバーズ	4.2	4.1	7,125	テイカアンドグヴ・ニーズ	6.7	4.2	5,590							
フージャースホールディングス	18.8	20.6	16,274	中広	1.2	1	387	びあ	4.9	4.7	15,251							
オープンハウスグループ	46.1	49.2	237,144	UTグループ	20.3	20.6	50,923	イオンファンタジー	5.4	6.1	18,007							
東急不動産ホールディングス	426.9	404.1	260,240	アイティメディア	6.7	5.4	8,202	シーディーエス	16	15.6	12,682							
船舶グループホールディングス	121	117.8	251,149	E・Jホールディングス	7.5	8.2	11,029	ネクシイズグループ	5	3.8	2,519							
イーグランド	2.5	1.9	2,810	オープンアップグループ	45.7	42	78,372	H. U. グループホールディングス	36.7	41.1	111,997							
ムゲンエステート	9.4	7.9	3,950	コジダカホールディングス	37.5	42	38,304	アルプス技研	12.6	12.2	25,729							
ビーロッド	9.9	8.3	4,490	アルトナー	3.6	3.1	3,081	サンックス	24.4	22.7	5,198							
ファーストブラザーズ	3.5	2.3	1,996	パソナグループ	15.3	17	34,765	ダイオーズ	3.5	—	—							
And Doホールディングス	7.2	8	6,760	C D S	2.5	3.2	5,769	日本空調サービス	15	15.4	10,918							
シーアールイー	4	6.1	6,453	リンクアンドモチベーション	31	40.3	25,832	オリエンタルランド	166.1	148.5	3,203,887							
プロパティエージェンツ	1.7	1.5	1,875	エス・エム・エス	47.8	53.4	184,497	ダズキン	32.6	31.3	91,208							
ケイアイスター不動産	6.6	6.5	31,395	サンセイウップグループ	5.1	3.8	2,116	明光ネットワークジャパン	16.5	18.4	11,371							
アグレ都市デザイン	2.5	2.2	3,561	パソナホールディングス	140.5	157.1	446,321	フルコムホールディングス	6.8	6.1	11,376							
グッドコムアセット	6.4	12.5	10,062	リニカル	8.1	7.1	5,033	秀英予備校	3.6	3.1	1,354							
ジェイ・エス・ビー	3	3.3	13,200	クックパッド	44.1	38.4	8,332	田谷	1.8	1.7	902							
ロードスターキャピタル	—	5.8	9,355	エスクリ	6.2	5.2	1,721	ラウンドワン	39.2	117.3	56,538							
テンポインバケーション	4.1	3.7	4,380	アイ・ケイ・ケイホールディングス	5.7	6.2	3,881	リゾートトラスト	64.4	55.4	128,417							
グローバル・リンク・マネジメント	2.7	2.3	2,697	学情	6.6	6.4	8,857	ピー・エム・エル	18.2	17.4	54,375							
フェイスネットワーク	1.4	1.7	2,747	スタジオアリス	6.4	7	14,651	りらほみコミュニケーションズ	21.3	23.2	33,732							
パーク24	77.8	104.7	225,733	シミックホールディングス	8	7.7	13,282	リソー教育	64.3	63.8	22,138							
パラカ	4	4.7	9,150	エabbo	3.3	2.7	1,992	早稲田アカデミー	8	7.8	9,492							
宮越ホールディングス	5.5	6.2	5,542	N J S	2.9	2.6	5,686	ユー・エス・エス	15.3	144.3	313,131							
三井不動産	660.9	584.3	1,425,399	総合警備保障	55.9	52.1	183,652	東京個別指導学院	17.3	16.7	9,034							
三菱地所	952.8	811.2	1,364,438	カカコム	103.1	104.7	224,162	サイバーエージェント	346.2	335.7	420,967							
平和不動産	24.9	21.8	76,845	アイロムグループ	5	5.1	12,321	楽天グループ	721.4	649.5	437,763							
東京建物	143.1	128.1	203,038	セントウ・ホールディング	9.1	9.1	7,462	クワン・アビ・リバー社	7.5	8.3	18,907							
京阪神ビルディング	22.6	16.9	20,989	サイネックス	2.5	2.2	1,216	モーニングスター	24.7	23	10,879							
住友不動産	304.3	243	761,562	リネサンズ	9.8	9.8	9,045	テー・オー・ダリユー	24.8	27.2	7,996							
テオオーシー	26.2	24.5	16,145	ディップ	24.7	24.6	98,154	山崎コンサルティンググループ	7.5	7.1	8,228							
東京楽天地	2.3	2.4	10,296	デジタルホールディングス	9.6	10.9	13,875	セントラルスポーツ	5.2	5.3	12,778							
レオパレス21	150.2	151.4	49,205	新日本科学	17.1	14.9	37,756	フルキャストホールディングス	12	13.4	36,555							
スターツコーポレーション	19.9	19.3	48,037	キャリアデザインセンター	3.6	2.6	4,882	エン・ジャパン	22.9	25.4	61,595							
フジ住宅	17.2	18.8	12,784	ベネフィット・ワン	51.2	65	148,915	リソールホールディングス	1.6	1.1	5,175							
空港施設	15	16.2	8,391	エムスリー	247.9	277.3	997,725	テクノロ・ホールディングス	84.1	83.1	303,730							
明和地所	7	6.1	5,319	ツカグ・グローバルホールディング	8.5	7.8	3,042	アトラグループ	2.6	3	543							
ゴールドクレスト	11.5	12.8	20,672	ブラス	2.2	1.7	1,932	インターワークス	4.5	3.2	1,139							
エスリード	5.7	6.4	13,440	アウトソーシング	80.5	83.6	82,346	アイ・エフ・エフ・ホールディングス	6.6	7.3	14,395							
日経グループホールディングス	23.6	21.7	9,656	ウエルネット	14.3	9.5	6,422	K e e P e r 技研	9	8.7	29,971							
日本エスコン	27.3	30.3	24,936	ワールドホールディングス	5.6	6.3	16,279	ファーストログジック	2.9	2	1,712							
				ディー・エヌ・エー	53.6	59.9	108,059	三機サービス	3	2	1,840							

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	評 価 額	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額	株	数	評 価 額
		千株	千円		千株	千円			千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円	
Gunosy		8.8	7,070		11.1	7,070	船場		1.7	1,051		6.3	6	11,550		6.3	6	11,550		
デザインワン・ジャパン		3.6	706		3.7	706	ジェロエシペーター・ビジネス・ホールディングス		44.5	90,600		0.7	0.6	5,382		0.7	0.6	5,382		
イー・ガーディアン		5.6	13,085		5.3	13,085	フルテック		2.2	1,849		5.4	4.6	5,170		5.4	4.6	5,170		
リブセンス		8.7	1,954		5.8	1,954	グリーンズ		5.3	4,206		4.8	5	3,355		4.8	5	3,355		
ジャパンマテリアル		43.2	101,415		42.9	101,415	ツナググループ・ホールディングス		3.4	3,518		4.6	3.7	28,083		4.6	3.7	28,083		
ベクトル		19.7	27,346		22	27,346	GAMEWITH		4.3	3,712		10.7	11.8	45,607		10.7	11.8	45,607		
ウチヤマホールディングス		7.4	1,495		5.6	1,495	ソウルドアウト		3.5	-		5.4	4.3	5,293		5.4	4.3	5,293		
チャーム・コア・コーポレーション		10.6	13,197		11.7	13,197	MS&Consulting		2.4	838		24.8	25.7	56,437		24.8	25.7	56,437		
キャリアリンク		5.1	13,639		5.2	13,639	ウェルビー		9.1	10,365		12.9	13	38,844		12.9	13	38,844		
IBJ		11.5	8,858		8.6	8,858	エル・ディー・エス		1.8	1,954		75.2	70.2	1,544		75.2	70.2	1,544		
アサンテ		6.4	11,585		7	11,585	ミズグクホールディングス		6.2	8,625		17.9	17.4	57,594		17.9	17.4	57,594		
バリューHR		5.6	20,688		12.3	20,688	日総工産		11	10,567		60.2	61.2	56,059		60.2	61.2	56,059		
M&Aキャピタルパートナーズ		11.6	50,570		13	50,570	キュービネットホールディングス		6.6	9,840		6.2	6.2	20,925		6.2	6.2	20,925		
ライドオンエクスプレスホールディングス		5.4	5,477		5.1	5,477	RPAホールディングス		19.7	6,213		8.7	8.4	14,338		8.7	8.4	14,338		
ERIホールディングス		4	4,457		3.2	4,457	スプリックス		4	3,792		15.1	14.8	37,000		15.1	14.8	37,000		
アビスト		2	5,992		2	5,992	マネジメントソリューションズ		6.9	27,373		12.5	12.5	23,812		12.5	12.5	23,812		
ジグマックス・ホールディングス		8.6	24,047		21.3	24,047	プロレド・パートナーズ		3	3,709		1.7	1.1	1,900		1.7	1.1	1,900		
ウィルグループ		10.4	14,098		11.7	14,098	and factory		3.3	3,619		138.5	142.9	1,088,183		138.5	142.9	1,088,183		
エスコロ・エージェンツ・ジャパン		18.9	2,038		13.5	2,038	テノ・ホールディングス		2	1,408		6.8	7.5	19,110		6.8	7.5	19,110		
メドピア		10.9	16,929		11	16,929	フロンティア・マネジメント		3.6	4,769		28.7	27	19,089		28.7	27	19,089		
レアジョブ		2.8	2,220		2.4	2,220	ピアラ		2.3	2,112		17	55.9	136,507		17	55.9	136,507		
リクルートホールディングス		1,083.7	4,509,260		1,039	4,509,260	コプロ・ホールディングス		2.9	2,520		16	13.1	25,715		16	13.1	25,715		
エラン		19.4	18,451		18.6	18,451	ギークス		2.6	1,760		28.8	29.5	79,709		28.8	29.5	79,709		
土木管理総合試験所		6.9	1,611		5.3	1,611	カーパスホールディングス		38.7	34,480		5.1	4.2	1,251		5.1	4.2	1,251		
ネットマーケティング		6.9	-		-	-	フォーラムエンジニアリング		9.9	7,403		10.2	7.9	5,609		10.2	7.9	5,609		
日本郵政		1,834.3	2,094,848		1,839.2	2,094,848	FAST FITNESS JAPAN		2	4,765		3.9	2.8	4,396		3.9	2.8	4,396		
ベルンスタム24ホールディングス		20.1	28,294		18.8	28,294	ダイレクトマーケティングミックス		15.2	27,367		4.7	5.6	10,746		4.7	5.6	10,746		
鎌倉新書		16	17,108		15.9	17,108	ポピンズ		3.4	4,321		46.8	52.3	100,939		46.8	52.3	100,939		
S MN		3.4	1,484		3.2	1,484	L I T A L I C O		11.5	10,929		17.3	15.5	46,329		17.3	15.5	46,329		
一蔵		2.3	693		1.5	693	アドバンテッジリス・マネジメント		7.2	2,650		7.4	6.5	6,253		7.4	6.5	6,253		
グローバルキッズCOMPANY		2.7	1,520		1.9	1,520	リロググループ		76.9	167,212		26	28.7	122,118		26	28.7	122,118		
エアトリ		9	23,423		9.1	23,423	東祥		10.6	11,485		5.3	5.8	10,300		5.3	5.8	10,300		
アトラエ		9.8	14,190		9.1	14,190	ビーウィズ		-	3,958										
ストライク		5.3	27,841		6.9	27,841	TREホールディングス		19.4	29.5	41,860									
ソラスト		34.5	26,122		38.7	26,122	人・夢・技術グループ		5.6	6.3	8,782									
セラク		4.6	7,690		5	7,690	大栄環境		-	26.7	43,627									
インソース		13.7	50,251		34.8	50,251	エイチ・アイ・エス		31.3	36.7	75,785									
ベイカレント・コンサルティング		9.9	609,390		11.1	609,390	ラックランド		4.1	4.4	12,817									
Orchestra Holdings		2.8	5,925		3	5,925	共立メンテナンス		25	24	136,320									
アイモバイル		4	9,373		7.3	9,373	イチネンホールディングス		14.6	15	19,185									
キャリアインデックス		4.8	1,360		4.2	1,360	建設技術研究所		8.5	7.2	23,724									
MS - Japan		5.7	4,382		4.1	4,382	スペース		10.4	10	9,340									

	株数・金額	株数	金額
合計	161,644	159,799.8	389,230,950
銘柄数<比率>	2,174銘柄	2,161銘柄	<98.0%>

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	T O P I X	百万円 7,621		百万円 -

■投資信託財産の構成

2023年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 389,230,950		% 98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,041,935		2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	397,272,885		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	397,272,885,824円
一 般 株 式	7,105,053,675
株 式 (評 価 額)	389,230,950,760
未 収 入 当 金	279,324,650
未 収 入 委 託 証 拠 金	620,986,739
未 払 解 約 金	36,570,000
(B) 負 債	289,963,000
未 払 解 約 金	289,963,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	396,982,922,824
元 本	117,622,712,134
次 期 繰 越 損 益	279,360,210,690
(D) 受 取 益 当 年 間 基 準 価 額 (C / D)	117,622,712,134円
1 万 円 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	33,751円

(注1) 期首元本額 124,570,625,521円
 追加設定元本額 128,363,975,255円
 一部解約元本額 135,311,888,642円

(注2) 期末における元本の内訳

MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOP1Xオープン	2,645,423,721円
MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ)	4,020,227,881円
One DC 国内株式インデックスファンド	24,845,344,460円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	4,943,887,105円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,060,345円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	14,320,221円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	40,143,190円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	26,541,745円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	24,853,218円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,002,416円
たからノロード TOP1X	1,674,620,773円
たからノロード バランス (8資産均等型)	1,460,942,246円
たからノロード バランス (堅実型)	52,176,853円
たからノロード バランス (標準型)	349,503,344円
たからノロード バランス (積極型)	550,702,894円
たからノロード スマートグローバルバランス (保守型)	2,858,868円
たからノロード スマートグローバルバランス (安定型)	171,426,417円
たからノロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	431,690,813円
たからノロード スマートグローバルバランス (成長型)	329,347,990円
たからノロード スマートグローバルバランス (積極型)	441,937,258円
たからノロード 最適化バランス (保守型)	413,659円
たからノロード 最適化バランス (安定型)	1,761,301円
たからノロード 最適化バランス (安定成長型)	32,921,123円
たからノロード 最適化バランス (成長型)	4,228,726円
たからノロード 最適化バランス (積極型)	12,768,526円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,601,320,487円
Oneグローバルバランス	9,945,679円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型	1,069,194,980円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	3,604,894,445円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型	3,977,108,233円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	337,230,087円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,073,452,202円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,128,991,784円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	31,667,873円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,158,418,676円
マネックス資産設計ファンド エコリユージョン	15,484,653円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	305,935,932円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	356,000,978円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	576,024,312円
投資のソムリエ	6,962,375,127円
フルコンポートロール	371,076,985円
投資のソムリエ<DC年金>	512,324,687円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	369,360,628円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	886,808,363円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	690,449,672円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,925,993,896円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	57,858,403円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	29,095,833円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,863,213円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	100,473,458円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	494,603,718円
リスクコントロール世界分散ファンド	556,231,620円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	276,065,472円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	42,963,704円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	31,180,825円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	19,176,919円
4資産分散投資・ドルクラス<DC年金>	373,583,154円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	4,139,504円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 [適格機関投資家限定]	70,190,490円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 [適格機関投資家限定]	71,566,262円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 [適格機関投資家限定]	23,234,424円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 [適格機関投資家限定]	43,811,639円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 [適格機関投資家限定]	69,167,191円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04 [適格機関投資家限定]	173,752,833円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式・債券型) 21-06	194,219,300円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 [適格機関投資家限定]	62,459,767円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式・債券型) 22-05	198,034,533円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日本資産投) 22-10	500,445,393円
投資のソムリエ 私募 [適格機関投資家限定]	188,318,998円
AMOneマルチアセット・インカム戦略 [適格機関投資家限定]	27,824,141円
DIAMグローバルバランス25VA [適格機関投資家限定]	29,351,203円
日本証券が戦略ファンド (インカム重視) [随時リカバ] [適格機関投資家限定]	230,704,117円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (FOF) [適格機関投資家限定]	119,336,352円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF) [適格機関投資家専用]	3,645,294円
しあわせの一步 私募 [適格機関投資家限定]	7,940,239円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA [適格機関投資家限定]	45,113,121円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	88,905,582円
DIAM国際分散バランスファンド30VA [適格機関投資家限定]	3,022,472円
DIAM国際分散バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	18,327,200円
DIAM国内重視バランスファンド30VA [適格機関投資家限定]	4,076,223円
DIAM国内重視バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	90,458円
DIAM世界バランスファンド40VA [適格機関投資家限定]	5,854,508円
DIAM世界バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	26,240,499円
DIAMバランスファンド25VA [適格機関投資家限定]	416,572,017円
DIAMバランスファンド37.5VA [適格機関投資家限定]	515,249,605円
DIAMバランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	1,525,175,305円
DIAMグローバル・セット・バランスVA [適格機関投資家限定]	15,914,184円
DIAMグローバル・セット・バランスVA2 [適格機関投資家限定]	21,162,392円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA [適格機関投資家限定]	223,693,267円
DIAM世界アセットバランスファンドVA [適格機関投資家限定]	49,325,464円
DIAM世界バランスファンド55VA [適格機関投資家限定]	65,368円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA [適格機関投資家限定]	274,002,585円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA [適格機関投資家限定]	16,040,531円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA [適格機関投資家限定]	53,951,794円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA [適格機関投資家限定]	122,912,087円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA [適格機関投資家限定]	171,605,339円
DIAM世界バランス25VA [適格機関投資家限定]	31,023,888円
DIAM国内バランス30VA [適格機関投資家限定]	15,258,914円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(130) [適格機関投資家限定]	743,503,325円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(130)6 [適格機関投資家限定]	1,220,307,862円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(130)9 [適格機関投資家限定]	48,743,066円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,881,642円
コア資産形成ファンド	17,452,381円
MHAMトピックスファンド	770,553,770円
MHAM TOP1XファンドVA [適格機関投資家専用]	50,331,323円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,300,674,671円
MHAM日本株式バッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,491,222,882円
期末元本合計	117,622,712,134円

(注3) 担保資産
 代用として担保を提供している資産はありません。

■損益の状況

当期 自2022年2月8日 至2023年2月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	10,038,422,831円
受 取 配 当 金	10,036,451,031
受 取 利 息	198,966
そ の 他 収 益	5,808,781
支 払 利 息	△4,035,947
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,151,090,178
売 買 損 益	35,089,806,650
買 買 損	△30,938,716,472
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	827,282,850
取 引 損 益	2,648,479,200
取 引 損	△1,821,196,350
(D) そ の 他 費 用	△4
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)	15,016,795,855
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	272,765,989,933
(G) 解 約 差 損 益 金	△292,592,755,843
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	284,170,180,745
(I) 合 計(E + F + G + H)	279,360,210,690
次 期 繰 越 損 益 金(I)	279,360,210,690

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

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

(注3) (H)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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

(2022年3月15日)

■東京証券取引所の市場区分の再編に伴い、主要投資対象を「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。

(2022年4月4日)