

投 株 形 財

一般財形50 / 一般財形30 / 年金・住宅財形30

運用報告書(全体版)

第29期 (決算日2023年2月1日)

作成対象期間 (2022年2月2日～2023年2月1日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

	一般財形50	一般財形30	年金・住宅財形30
商品分類	追加型投信 / 国内 / 資産複合		
信託期間	1994年2月4日から無期限です。		
運用方針	内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図る「財形公社債マザーファンド」受益証券および東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果をめざす「財形株式マザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に内外の公社債およびわが国の株式に投資を行ないます。		
主な投資対象	財形株投 (一般財形50) (一般財形30) (年金・住宅財形30)	財形公社債マザーファンド受益証券および財形株式マザーファンド受益証券ならびに内外の公社債およびわが国の株式を主要投資対象とします。	
	財形公社債マザーファンド	内外の公社債を主要投資対象とします。	
	財形株式マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。	
実質株式組入制限	50%以内	30%以内	
分配方針	利子・配当収入等を中心に安定的に分配します。		

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104
(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

<一般財形50>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式参考指数		債券参考指数			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	東証株価指数(TOPIX)	期中騰落率	NOMURA-BPI総合中期	期中騰落率	コール(無担保翌日物)収益率					
25期(2019年2月4日)	円	円	%		%		%		%	%	%	%	百万円
	10,766	5	△7.8	1,581.33	△15.5	342.37	0.5	△0.1	48.4	1.3	47.4	—	2,616
26期(2020年2月3日)	11,041	5	2.6	1,672.66	5.8	342.05	△0.1	△0.0	46.5	1.5	49.5	—	2,775
27期(2021年2月1日)	11,557	5	4.7	1,829.84	9.4	340.77	△0.4	△0.0	46.9	1.9	49.2	—	2,951
28期(2022年2月1日)	11,708	5	1.3	1,896.06	3.6	339.54	△0.4	△0.0	46.8	2.3	49.4	—	3,055
29期(2023年2月1日)	11,914	5	1.8	1,972.23	4.0	336.98	△0.8	△0.0	48.2	1.2	49.2	—	3,200

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額			株式参考指数		債券参考指数			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率
	騰落率	東証株価指数(TOPIX)	騰落率	NOMURA-BPI総合中期	騰落率	コール(無担保翌日物)収益率						
(期首)	円	%		%		%		%	%	%	%	%
2022年2月1日	11,708	—	1,896.06	—	339.54	—	—	—	46.8	2.3	49.4	—
2月末	11,669	△0.3	1,886.93	△0.5	339.25	△0.1	△0.0	△0.0	46.8	2.2	49.4	—
3月末	11,901	1.6	1,946.40	2.7	338.89	△0.2	△0.0	△0.0	48.4	0.9	49.1	—
4月末	11,750	0.4	1,899.62	0.2	339.18	△0.1	△0.0	△0.0	48.0	1.8	48.8	—
5月末	11,774	0.6	1,912.67	0.9	339.17	△0.1	△0.0	△0.0	48.1	1.4	48.9	—
6月末	11,646	△0.5	1,870.82	△1.3	338.84	△0.2	△0.0	△0.0	47.0	1.9	49.5	—
7月末	11,862	1.3	1,940.31	2.3	340.07	0.2	△0.0	△0.0	47.9	1.3	49.2	—
8月末	11,910	1.7	1,963.16	3.5	339.40	△0.0	△0.0	△0.0	48.4	0.6	49.2	—
9月末	11,562	△1.2	1,835.94	△3.2	338.49	△0.3	△0.0	△0.0	46.4	2.1	50.0	—
10月末	11,836	1.1	1,929.43	1.8	338.62	△0.3	△0.0	△0.0	47.7	1.8	49.0	—
11月末	11,992	2.4	1,985.57	4.7	338.12	△0.4	△0.0	△0.0	48.4	0.7	49.3	—
12月末	11,689	△0.2	1,891.71	△0.2	335.92	△1.1	△0.0	△0.0	46.7	2.1	49.7	—
2023年1月末	11,926	1.9	1,975.27	4.2	336.86	△0.8	△0.0	△0.0	48.3	1.2	49.1	—
(期末)												
2023年2月1日	11,919	1.8	1,972.23	4.0	336.98	△0.8	△0.0	△0.0	48.2	1.2	49.2	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

東証株価指数 (TOPIX) の指数値及び東証株価指数 (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」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数 (TOPIX) に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (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、東証株価指数 (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。

NOMURA-BPI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指数で、当該指数に関する一切の知的財産権と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ております。また、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、当該インデックスの正確性、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うものではありません。

＜一般財形30＞

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式参考指数		債券参考指数			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	東証株価指数(TOPIX)	期中騰落率	NOMURA-BPI総合中期	期中騰落率	コール(無担保翌日物)収益率					
25期(2019年2月4日)	円	円	%		%		%	%	%	%	%	%	百万円
	10,240	5	△5.2	1,581.33	△15.5	342.37	0.5	△0.1	28.7	0.7	67.4	—	2,323
26期(2020年2月3日)	10,332	5	0.9	1,672.66	5.8	342.05	△0.1	△0.0	27.4	0.9	69.0	—	2,475
27期(2021年2月1日)	10,559	5	2.2	1,829.84	9.4	340.77	△0.4	△0.0	27.9	1.1	68.8	—	2,573
28期(2022年2月1日)	10,565	5	0.1	1,896.06	3.6	339.54	△0.4	△0.0	27.7	1.3	69.1	—	2,541
29期(2023年2月1日)	10,594	5	0.3	1,972.23	4.0	336.98	△0.8	△0.0	28.7	0.7	69.1	—	2,590

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		株式参考指数		債券参考指数			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率
	騰落率	東証株価指数(TOPIX)	騰落率	NOMURA-BPI総合中期	騰落率	コール(無担保翌日物)収益率					
(期首)	円	%		%		%	%	%	%	%	%
2022年2月1日	10,565	—	1,896.06	—	339.54	—	—	27.7	1.3	69.1	—
2月末	10,538	△0.3	1,886.93	△0.5	339.25	△0.1	△0.0	27.7	1.3	69.2	—
3月末	10,655	0.9	1,946.40	2.7	338.89	△0.2	△0.0	29.0	0.5	68.7	—
4月末	10,568	0.0	1,899.62	0.2	339.18	△0.1	△0.0	28.6	1.0	68.7	—
5月末	10,575	0.1	1,912.67	0.9	339.17	△0.1	△0.0	28.7	0.9	68.6	—
6月末	10,498	△0.6	1,870.82	△1.3	338.84	△0.2	△0.0	27.9	1.1	69.3	—
7月末	10,621	0.5	1,940.31	2.3	340.07	0.2	△0.0	28.5	0.8	68.9	—
8月末	10,637	0.7	1,963.16	3.5	339.40	△0.0	△0.0	28.8	0.4	68.8	—
9月末	10,440	△1.2	1,835.94	△3.2	338.49	△0.3	△0.0	27.5	1.3	69.6	—
10月末	10,583	0.2	1,929.43	1.8	338.62	△0.3	△0.0	28.5	1.1	68.7	—
11月末	10,659	0.9	1,985.57	4.7	338.12	△0.4	△0.0	28.7	0.4	69.0	—
12月末	10,480	△0.8	1,891.71	△0.2	335.92	△1.1	△0.0	27.6	1.3	69.4	—
2023年1月末	10,601	0.3	1,975.27	4.2	336.86	△0.8	△0.0	28.8	0.7	69.0	—
(期末)											
2023年2月1日	10,599	0.3	1,972.23	4.0	336.98	△0.8	△0.0	28.7	0.7	69.1	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

<年金・住宅財形30>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式参考指数		債券参考指数			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	東証株価指数 (TOPIX)	期中 騰落率	NOMURA- BPI総合中期	期中 騰落率	コール (無担保翌日物) 収益率					
25期(2019年2月4日)	円	円	%		%		%	%	%	%	%	%	百万円
	10,364	5	△5.1	1,581.33	△15.5	342.37	0.5	△0.1	28.7	0.7	67.1	—	2,417
26期(2020年2月3日)	10,457	5	0.9	1,672.66	5.8	342.05	△0.1	△0.0	27.6	0.9	68.8	—	2,527
27期(2021年2月1日)	10,685	5	2.2	1,829.84	9.4	340.77	△0.4	△0.0	27.8	1.1	68.9	—	2,621
28期(2022年2月1日)	10,691	5	0.1	1,896.06	3.6	339.54	△0.4	△0.0	27.7	1.3	69.1	—	2,597
29期(2023年2月1日)	10,719	5	0.3	1,972.23	4.0	336.98	△0.8	△0.0	28.7	0.7	69.1	—	2,629

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		株式参考指数		債券参考指数			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率
	騰落率	東証株価指数 (TOPIX)	騰落率	NOMURA- BPI総合中期	騰落率	コール (無担保翌日物) 収益率					
(期首) 2022年2月1日	円	%		%		%	%	%	%	%	%
	10,691	—	1,896.06	—	339.54	—	—	27.7	1.3	69.1	—
2月末	10,663	△0.3	1,886.93	△0.5	339.25	△0.1	△0.0	27.8	1.3	69.1	—
3月末	10,781	0.8	1,946.40	2.7	338.89	△0.2	△0.0	28.9	0.5	68.7	—
4月末	10,693	0.0	1,899.62	0.2	339.18	△0.1	△0.0	28.6	1.0	68.6	—
5月末	10,701	0.1	1,912.67	0.9	339.17	△0.1	△0.0	28.7	0.9	68.6	—
6月末	10,623	△0.6	1,870.82	△1.3	338.84	△0.2	△0.0	27.9	1.1	69.4	—
7月末	10,747	0.5	1,940.31	2.3	340.07	0.2	△0.0	28.4	0.8	69.1	—
8月末	10,763	0.7	1,963.16	3.5	339.40	△0.0	△0.0	28.8	0.4	68.8	—
9月末	10,563	△1.2	1,835.94	△3.2	338.49	△0.3	△0.0	27.5	1.3	69.6	—
10月末	10,708	0.2	1,929.43	1.8	338.62	△0.3	△0.0	28.5	1.1	68.7	—
11月末	10,785	0.9	1,985.57	4.7	338.12	△0.4	△0.0	28.7	0.4	69.0	—
12月末	10,603	△0.8	1,891.71	△0.2	335.92	△1.1	△0.0	27.6	1.3	69.4	—
2023年1月末	10,726	0.3	1,975.27	4.2	336.86	△0.8	△0.0	28.8	0.7	68.9	—
(期末) 2023年2月1日	10,724	0.3	1,972.23	4.0	336.98	△0.8	△0.0	28.7	0.7	69.1	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

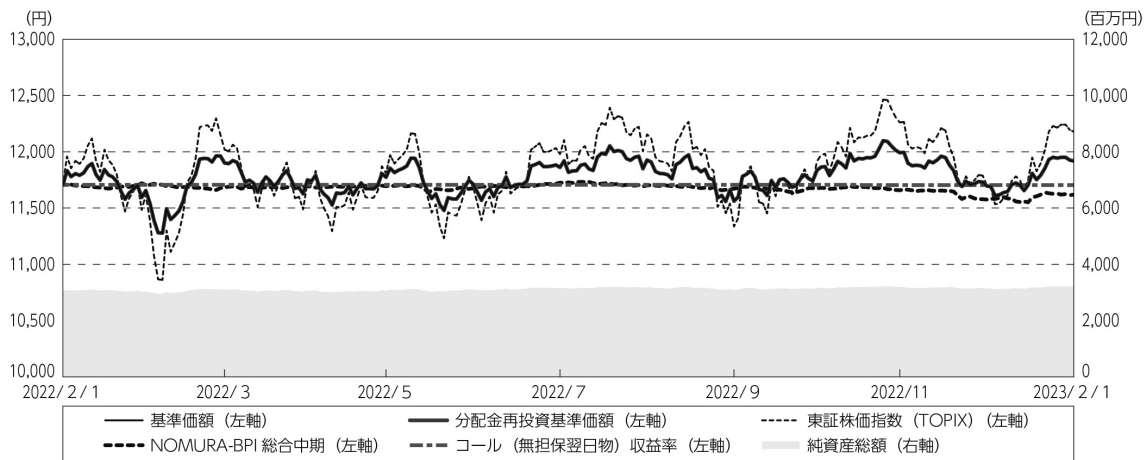
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

＜一般財形50＞

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：11,708円

期 末：11,914円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率： 1.8%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成年首（2022年2月1日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 株式参考指数は東証株価指数（TOPIX）、債券参考指数はNOMURA-BPI総合中期、コール（無担保翌日物）収益率です。コール（無担保翌日物）収益率は当社が独自に累積投資して算出しています。各参考指数は、作成年首（2022年2月1日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする2資産の当期間の値動きは、国内株式が上昇し、国内債券は下落しました。国内株式の上昇が基準価額の主な値上がり要因となりました。

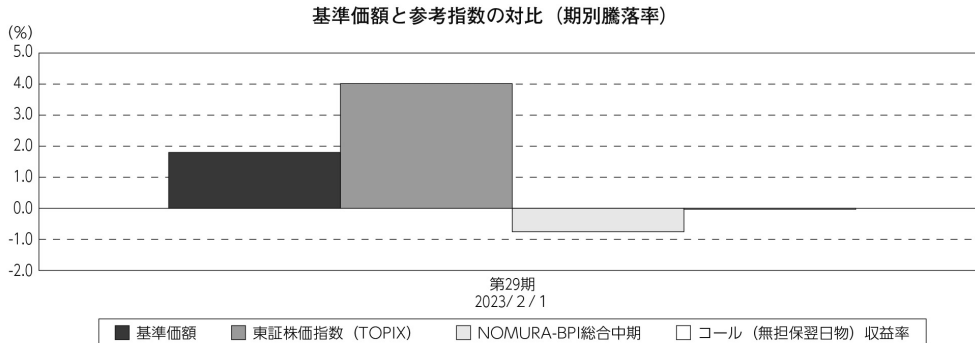
<一般財形50>

○当ファンドのベンチマークとの差異

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。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数としている東証株価指数の騰落率が+4.0%、コール（無担保翌日物）収益率が-0.0%、NOMURA-BPI総合中期の騰落率が-0.8%となったのに対し、基準価額の騰落率は+1.8%となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 株式参考指数は東証株価指数 (TOPIX)、債券参考指数はNOMURA-BPI総合中期、コール (無担保翌日物) 収益率です。コール (無担保翌日物) 収益率は当社が独自に累積投資して算出しています。

◎分配金

収益分配金は、今期の経費控除後の利子・配当等収益から決定させていただきました。なお、「自動けいぞく投資契約」にもとづいて、お手取り分配金は全額再投資いたしました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第29期
	2022年2月2日～ 2023年2月1日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.042%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	5,416

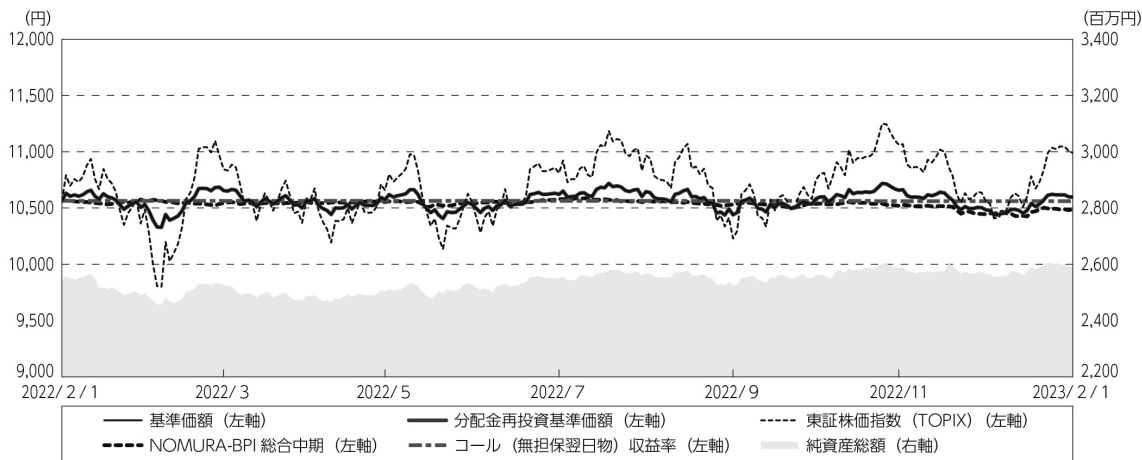
(注) 対基準価額比率は当期分配金 (税込み) の期末基準価額 (分配金込み) に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

＜一般財形30＞

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：10,565円

期 末：10,594円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率： 0.3%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成年首（2022年2月1日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 株式参考指数は東証株価指数（TOPIX）、債券参考指数はNOMURA-BPI総合中期、コール（無担保翌日物）収益率です。コール（無担保翌日物）収益率は当社が独自に累積投資して算出しています。各参考指数は、作成年首（2022年2月1日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

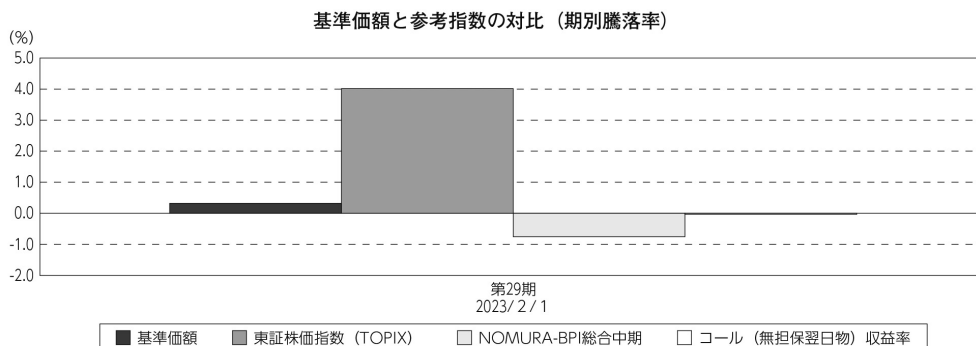
投資対象とする2資産の当期間の値動きは、国内株式が上昇し、国内債券は下落しました。国内株式の上昇が基準価額の主な値上がり要因となりました。

<一般財形30>

○当ファンドのベンチマークとの差異

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。
コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数としている東証株価指数の騰落率が+4.0%、コール（無担保翌日物）収益率が-0.0%、NOMURA-BPI総合中期の騰落率が-0.8%となったのに対し、基準価額の騰落率は+0.3%となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 株式参考指数は東証株価指数 (TOPIX)、債券参考指数はNOMURA-BPI総合中期、コール (無担保翌日物) 収益率です。コール (無担保翌日物) 収益率は当社が独自に累積投資して算出しています。

◎分配金

収益分配金は、今期の経費控除後の利子・配当等収益から決定させていただきました。なお、「自動けいぞく投資契約」にもとづいて、お手取り分配金は全額再投資いたしました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第29期
	2022年2月2日～ 2023年2月1日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.047%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,223

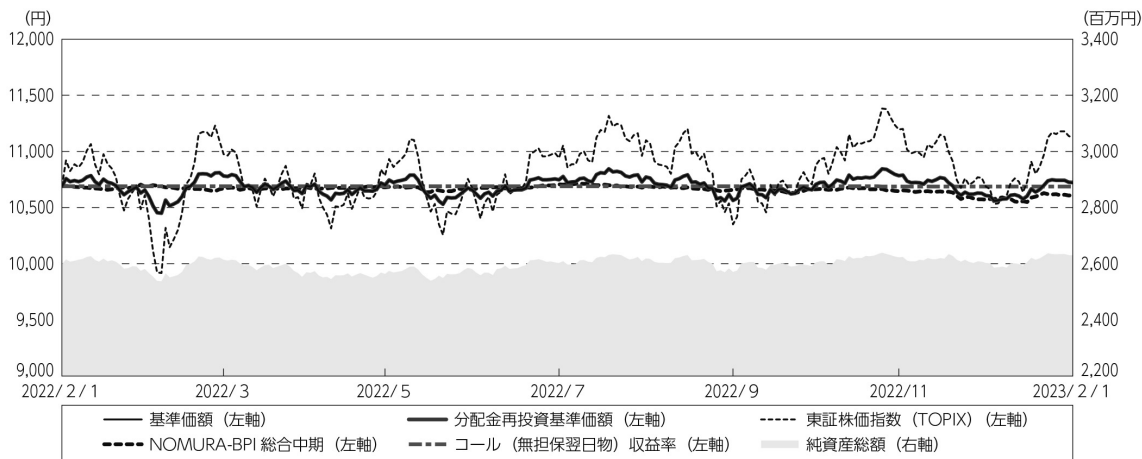
(注) 対基準価額比率は当期分配金 (税込み) の期末基準価額 (分配金込み) に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

<年金・住宅財形30>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：10,691円

期 末：10,719円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率： 0.3%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成年首（2022年2月1日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 株式参考指数は東証株価指数（TOPIX）、債券参考指数はNOMURA-BPI総合中期、コール（無担保翌日物）収益率です。コール（無担保翌日物）収益率は当社が独自に累積投資して算出しています。各参考指数は、作成年首（2022年2月1日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする2資産の当期間の値動きは、国内株式が上昇し、国内債券は下落しました。国内株式の上昇が基準価額の主な値上がり要因となりました。

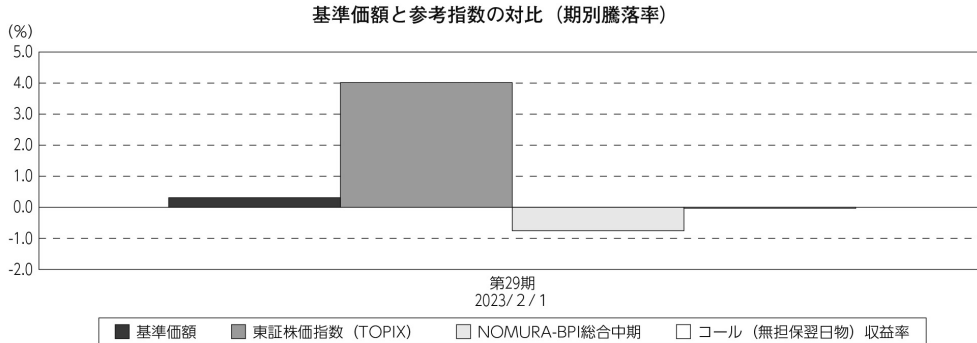
<年金・住宅財形30>

○当ファンドのベンチマークとの差異

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。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数としている東証株価指数の騰落率が+4.0%、コール（無担保翌日物）収益率が-0.0%、NOMURA-BPI総合中期の騰落率が-0.8%となったのに対し、基準価額の騰落率は+0.3%となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 株式参考指数は東証株価指数 (TOPIX)、債券参考指数はNOMURA-BPI総合中期、コール (無担保翌日物) 収益率です。コール (無担保翌日物) 収益率は当社が独自に累積投資して算出しています。

◎分配金

収益分配金は、今期の経費控除後の利子・配当等収益から決定させていただきました。なお、「自動けいぞく投資契約」にもとづいて、お手取り分配金は全額再投資いたしました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第29期
	2022年2月2日～ 2023年2月1日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.047%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,200

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

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

<一般財形50／一般財形30／年金・住宅財形30>

○投資環境

・国内株式

国内株式市場は、期首より国内でのオミクロン株による新型コロナウイルス感染の再拡大や、ウクライナを巡るロシアと欧米との対立、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受けて大きく下落しましたが、2022年3月中旬以降は、原油価格上昇が一服したことやロシアとウクライナの和平交渉が進展するとの期待が高まったことなどから上昇しました。6月中旬以降は、欧米諸国の金融引き締めによる世界景気低迷への懸念などから下落しましたが、7月以降は、円安米ドル高進行による輸出企業の収益改善期待や、FOMC（米連邦公開市場委員会）においてパウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長が利上げペースの緩和を示唆したことで米国株式市場が大幅高となったことなどから概ね堅調に推移しました。8月下旬以降は、米国の金融引き締め局面の長期化観測が広がったことなどから下落しました。10月以降は、米長期金利上昇が一服したことで米国株式市場が堅調に推移したことや、岸田政権の総合経済対策が発表されたことなどから上昇しました。

11月下旬以降は、中国において新型コロナウイルス新規感染者数が過去最多を更新し、同国における行動制限を通じた企業活動への悪影響が懸念されたことなどから、国内株式市場は下落しました。12月中旬以降は、同月開催したFOMCの結果などから利上げ継続と景気減速への警戒感が広がり米国株式市場が下落したことや、日銀の金融政策決定会合において10年国債利回りの許容変動幅拡大など金融緩和策の一部修正が決定されたことなどから、金融関連を除く幅広い業種が下落し市場全体でも下落しました。

2023年1月中旬以降は、日銀が現行の金融緩和策を維持したことで上昇しました。下旬にかけても、FRBによる利上げ停止の可能性が高まったとの見方から米ハイテク株が上昇し国内株式市場も堅調に推移しました。

・国内債券

期首の10年国債利回りは0.18%程度でスタートしました。世界的なインフレリスクの高まりや各国中央銀行の積極的な金融引き締め姿勢を背景に、海外債券利回りが大きく上昇したことから、2022年3月には国内10年国債利回りは0.25%程度まで上昇しました。こうした動きに対し日銀は、イールドカーブ・コントロールの政策方針に則り、10年国債利回り0.25%での連続指値オペを実施し利回り上昇を抑制しました。6月には日銀の政策変更を期待する海外投資家の日本国債先物への売り圧力が強まり、債券先物が大幅安となる形で国内債券市場が不安定化しましたが、日銀は10年国債に加え、残存7年程度の国債も連続指値オペの対象に追加することで、利回り上昇を抑制する姿勢を明確化しました。その後暫くは日銀のコントロールにより10年国債利回りは横ばい圏での推移となっていました。12月の金融政策決定会合にて日銀が長期金利の許容変動幅の拡大を決定したことで、10年国債利回りは一時0.50%程度まで上昇しました。2023年1月の金融政策決定会合でも更なる政策修正が期待されましたが、日銀は政策維持を決定しました。その結果、期末の10年国債利回りは0.48%程度となりました。

<一般財形50／一般財形30／年金・住宅財形30>

○当ファンドのポートフォリオ

[財形株投（一般財形50）]

期を通じて、[財形株式マザーファンド] 受益証券を50%弱、[財形公社債マザーファンド] 受益証券を50%弱の組み入れとしました。

[財形株投（一般財形30）]

期を通じて、[財形株式マザーファンド] 受益証券を30%弱、[財形公社債マザーファンド] 受益証券を70%弱の組み入れとしました。

[財形株投（年金・住宅財形30）]

期を通じて、[財形株式マザーファンド] 受益証券を30%弱、[財形公社債マザーファンド] 受益証券を70%弱の組み入れとしました。

[財形株式マザーファンド]

東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指すため、現物株式につきましては、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証株価指数（TOPIX）でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ないました。ただし、財務評価の視点から一部の銘柄は組み入れを見合わせました。

なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

[財形公社債マザーファンド]

・債券組入比率とデュレーション

期中、債券組入比率は概ね高位で推移させました。

ポートフォリオのデュレーション（金利感応度）は、緩和的な金融環境の継続を見込んだことから、デュレーションを概ね長めで維持しました。

・種別構成

利回り収益を確保するため、地方債など財務リスクの低い高格付け債を保有しました。

＜一般財形50／一般財形30／年金・住宅財形30＞

◎今後の運用方針

[財形株投（一般財形50）]

内外の公社債へ実質的に投資することにより安定した収益の確保を図り、わが国の株式へ実質的に投資することにより信託財産の成長をめざします。株式への実質的な投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の50%とし、常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

[財形株投（一般財形30）]

内外の公社債へ実質的に投資することにより安定した収益の確保を図り、わが国の株式へ実質的に投資することにより信託財産の成長をめざします。株式への実質的な投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%とし、常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

[財形株投（年金・住宅財形30）]

内外の公社債へ実質的に投資することにより安定した収益の確保を図り、わが国の株式へ実質的に投資することにより信託財産の成長をめざします。株式への実質的な投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%とし、常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

[財形株式マザーファンド]

株式組入比率をできるだけ高位に維持し、東証株価指数の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

[財形公社債マザーファンド]

公社債、短期金融商品を中心に運用し、金融・債券市場の動向に合わせて機動的にデュレーションや組入比率を変更し、基準価額の上昇を目指します。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願い申し上げます。

＜一般財形50＞

○1万口当たりの費用明細

(2022年2月2日～2023年2月1日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	191	1.617	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(45)	(0.380)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(139)	(1.182)	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および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(6)	(0.055)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.002)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.003)	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
合 計	191	1.622	
期中の平均基準価額は、11,793円です。			

* 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。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 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マザーファンド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。

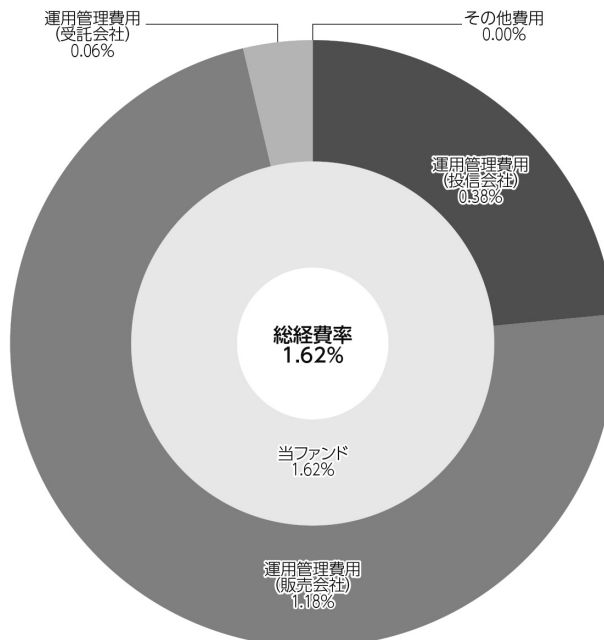
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<一般財形50>

（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（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1.62%です。



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

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料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) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

<一般財形50>

○売買及び取引の状況

(2022年2月2日～2023年2月1日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
財形株式マザーファンド	千口 142,006	千円 270,000	千口 151,944	千円 298,900
財形公社債マザーファンド	215,069	296,100	165,548	227,900

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年2月2日～2023年2月1日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
	財形株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	500,130千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,946,854千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

* (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2月2日～2023年2月1日)

利害関係人との取引状況

<財形株投（一般財形50）>
該当事項はございません。

<財形株式マザーファンド>
該当事項はございません。

＜一般財形50＞

＜財形公社債マザーファンド＞

区 分	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	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 9,996	百万円 201	% 2.0	百万円 9,119	百万円 —	% —

平均保有割合 30.3%

※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子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

＜財形株式マザーファンド＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 1	百万円 0.05015	百万円 9

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2023年2月1日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
財形株式マザーファンド	千口 796,553	千口 786,615	千円 1,585,029
財形公社債マザーファンド	1,109,726	1,159,247	1,591,994

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

＜一般財形50＞

○投資信託財産の構成

(2023年2月1日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
財形株式マザーファンド	1,585,029	49.1
財形公社債マザーファンド	1,591,994	49.3
コール・ローン等、その他	50,650	1.6
投資信託財産総額	3,227,673	100.0

*金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2月1日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,227,673,942
コール・ローン等	50,650,030
財形株式マザーファンド(評価額)	1,585,029,241
財形公社債マザーファンド(評価額)	1,591,994,671
(B) 負債	27,390,747
未払収益分配金	1,343,121
未払解約金	193,251
未払信託報酬	25,801,758
未払利息	20
その他未払費用	52,597
(C) 純資産総額(A-B)	3,200,283,195
元本	2,686,243,682
次期繰越損益金	514,039,513
(D) 受益権総口数	2,686,243,682口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,914円

(注) 期首元本額は2,609,852,374円、期中追加設定元本額は296,811,972円、期中一部解約元本額は220,420,664円、1口当たり純資産額は1.1914円です。

○損益の状況 (2022年2月2日～2023年2月1日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 8,525
支払利息	△ 8,525
(B) 有価証券売買損益	105,333,630
売買益	113,892,156
売買損	△ 8,558,526
(C) 信託報酬等	△ 50,563,883
(D) 当期損益金(A+B+C)	54,761,222
(E) 前期繰越損益金	396,480,417
(F) 追加信託差損益金	64,140,995
(配当等相当額)	(1,004,626,996)
(売買損益相当額)	(△ 940,486,001)
(G) 計(D+E+F)	515,382,634
(H) 収益分配金	△ 1,343,121
次期繰越損益金(G+H)	514,039,513
追加信託差損益金	64,140,995
(配当等相当額)	(1,005,032,011)
(売買損益相当額)	(△ 940,891,016)
分配準備積立金	449,898,518

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

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

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

<一般財形50>

(注) 分配金の計算過程 (2022年2月2日～2023年2月1日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年2月2日～ 2023年2月1日
a. 配当等収益(経費控除後)	23,666,643円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	25,374,345円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,005,032,011円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	402,200,651円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,456,273,650円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	5,421円
g. 分配金	1,343,121円
h. 分配金(1万円当たり)	5円

○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金(税込み)	5円
----------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

＜一般財形30＞

○1万口当たりの費用明細

(2022年2月2日～2023年2月1日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	171	1.617	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(40)	(0.380)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(125)	(1.182)	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および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(6)	(0.055)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.003)	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
合 計	171	1.621	
期中の平均基準価額は、10,571円です。			

* 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。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 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マザーファンド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。

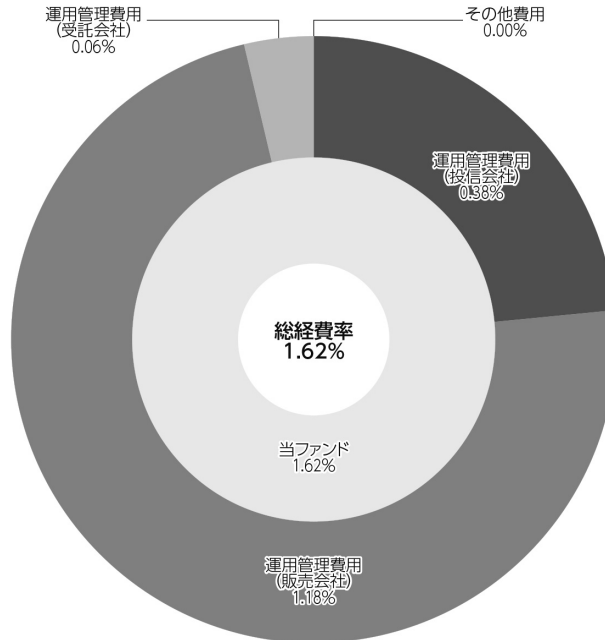
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<一般財形30>

（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（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1.62%です。



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

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料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) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

<一般財形30>

○売買及び取引の状況

(2022年2月2日～2023年2月1日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
財形株式マザーファンド	千口 97,073	千円 183,900	千口 110,082	千円 215,200
財形公社債マザーファンド	189,066	260,300	164,471	226,400

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年2月2日～2023年2月1日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
	財形株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	500,130千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,946,854千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

* (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2月2日～2023年2月1日)

利害関係人との取引状況

<財形株投（一般財形30）>
該当事項はございません。

<財形株式マザーファンド>
該当事項はございません。

＜一般財形30＞

＜財形公社債マザーファンド＞

区 分	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	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 9,996	百万円 201	% 2.0	百万円 9,119	百万円 —	% —

平均保有割合 34.5%

※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子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

＜財形株式マザーファンド＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 1	百万円 0.05015	百万円 9

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2023年2月1日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
財形株式マザーファンド	千口 392,477	千口 379,467	千円 764,627
財形公社債マザーファンド	1,291,675	1,316,269	1,807,633

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

＜一般財形30＞

○投資信託財産の構成

(2023年2月1日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
財形株式マザーファンド	764,627	29.2
財形公社債マザーファンド	1,807,633	69.1
コール・ローン等、その他	43,208	1.7
投資信託財産総額	2,615,468	100.0

*金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2月1日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,615,468,911
コール・ローン等	40,807,691
財形株式マザーファンド(評価額)	764,627,826
財形公社債マザーファンド(評価額)	1,807,633,394
未収入金	2,400,000
(B) 負債	24,555,017
未払収益分配金	1,222,813
未払解約金	2,358,612
未払信託報酬	20,930,919
未払利息	16
その他未払費用	42,657
(C) 純資産総額(A-B)	2,590,913,894
元本	2,445,627,568
次期繰越損益金	145,286,326
(D) 受益権総口数	2,445,627,568口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,594円

(注) 期首元本額は2,405,265,552円、期中追加設定元本額は286,867,933円、期中一部解約元本額は246,505,917円、1口当たり純資産額は1.0594円です。

○損益の状況 (2022年2月2日～2023年2月1日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 6,965
支払利息	△ 6,965
(B) 有価証券売買損益	49,459,583
売買益	57,396,524
売買損	△ 7,936,941
(C) 信託報酬等	△ 41,131,978
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	8,320,640
(E) 前期繰越損益金	130,095,704
(F) 追加信託差損益金	8,092,795
(配当等相当額)	(620,268,864)
(売買損益相当額)	(△612,176,069)
(G) 計(D+E+F)	146,509,139
(H) 収益分配金	△ 1,222,813
次期繰越損益金(G+H)	145,286,326
追加信託差損益金	8,092,795
(配当等相当額)	(620,496,505)
(売買損益相当額)	(△612,403,710)
分配準備積立金	167,930,750
繰越損益金	△ 30,737,219

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

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

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

<一般財形30>

(注) 分配金の計算過程 (2022年2月2日～2023年2月1日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年2月2日～ 2023年2月1日
a. 配当等収益(経費控除後)	4,318,385円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	620,496,505円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	164,835,178円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	789,650,068円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,228円
g. 分配金	1,222,813円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	5円
----------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

＜年金・住宅財形30＞

○1万口当たりの費用明細

(2022年2月2日～2023年2月1日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	173	1.617	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(41)	(0.380)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(126)	(1.182)	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および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(6)	(0.055)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.003)	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
合 計	173	1.621	
期中の平均基準価額は、10,696円です。			

* 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。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 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マザーファンド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。

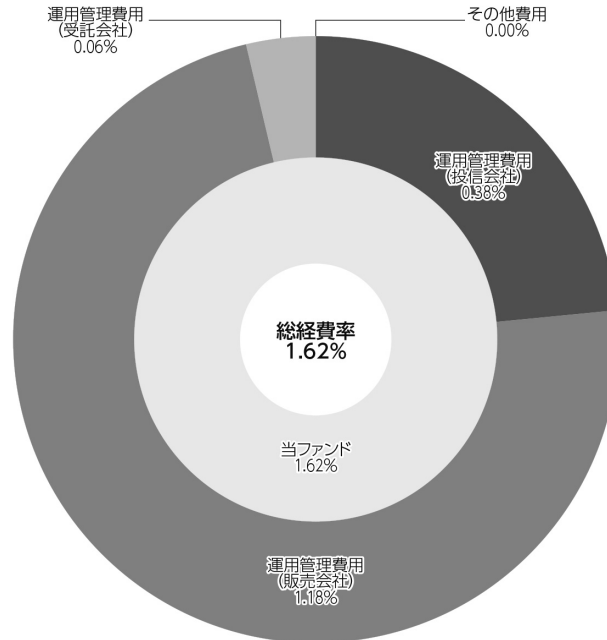
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<年金・住宅財形30>

（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（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1.62%です。



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

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料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) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

<年金・住宅財形30>

○売買及び取引の状況

(2022年2月2日～2023年2月1日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
財形株式マザーファンド	千口 88,301	千円 167,400	千口 104,638	千円 205,100
財形公社債マザーファンド	152,533	210,000	137,019	188,600

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年2月2日～2023年2月1日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
	財形株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	500,130千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,946,854千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

* (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2月2日～2023年2月1日)

利害関係人との取引状況

<財形株投（年金・住宅財形30）>
該当事項はございません。

<財形株式マザーファンド>
該当事項はございません。

＜年金・住宅財形30＞

＜財形公社債マザーファンド＞

区 分	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	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 9,996	百万円 201	% 2.0	百万円 9,119	百万円 —	% —

平均保有割合 35.2%

※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子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

＜財形株式マザーファンド＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 1	百万円 0.05015	百万円 9

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2023年2月1日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
財形株式マザーファンド	千口 401,435	千口 385,099	千円 775,974
財形公社債マザーファンド	1,320,374	1,335,888	1,834,576

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

＜年金・住宅財形30＞

○投資信託財産の構成

(2023年2月1日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
財形株式マザーファンド	775,974	29.3
財形公社債マザーファンド	1,834,576	69.2
コール・ローン等、その他	41,560	1.5
投資信託財産総額	2,652,110	100.0

*金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2月1日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,652,110,344
コール・ローン等	41,559,363
財形株式マザーファンド(評価額)	775,974,956
財形公社債マザーファンド(評価額)	1,834,576,025
(B) 負債	22,548,977
未払収益分配金	1,226,566
未払信託報酬	21,279,036
未払利息	16
その他未払費用	43,359
(C) 純資産総額(A-B)	2,629,561,367
元本	2,453,133,237
次期繰越損益金	176,428,130
(D) 受益権総口数	2,453,133,237口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,719円

(注) 期首元本額は2,429,740,816円、期中追加設定元本額は228,203,586円、期中一部解約元本額は204,811,165円、1口当たり純資産額は1.0719円です。

○損益の状況 (2022年2月2日～2023年2月1日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 7,220
支払利息	△ 7,220
(B) 有価証券売買損益	50,367,837
売買益	57,980,622
売買損	△ 7,612,785
(C) 信託報酬等	△ 42,084,395
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,276,222
(E) 前期繰越損益金	151,150,906
(F) 追加信託差損益金	18,227,568
(配当等相当額)	(590,167,545)
(売買損益相当額)	(△571,939,977)
(G) 計(D+E+F)	177,654,696
(H) 収益分配金	△ 1,226,566
次期繰越損益金(G+H)	176,428,130
追加信託差損益金	18,227,568
(配当等相当額)	(590,366,237)
(売買損益相当額)	(△572,138,669)
分配準備積立金	194,745,627
繰越損益金	△ 36,545,065

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

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

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

<年金・住宅財形30>

(注) 分配金の計算過程 (2022年2月2日～2023年2月1日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年2月2日～ 2023年2月1日
a. 配当等収益(経費控除後)	4,320,749円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	590,366,237円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	191,651,444円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	786,338,430円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,205円
g. 分配金	1,226,566円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	5円
----------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

財形公社債マザーファンド

運用報告書

第29期（決算日2023年2月1日）

作成対象期間（2022年2月2日～2023年2月1日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数			債組入比率	債券先物比率	純資産総額	
	騰落	中率	NOMURA-BPI総合中期	騰落	中率				コール (無担保翌日物) 収益率
	円	%			%	%	%	百万円	
25期(2019年2月4日)	13,811	0.3	342.37		0.5	△0.1	98.1	—	4,515
26期(2020年2月3日)	13,837	0.2	342.05	△0.1		△0.0	98.7	—	4,887
27期(2021年2月1日)	13,813	△0.2	340.77	△0.4		△0.0	98.7	—	5,091
28期(2022年2月1日)	13,787	△0.2	339.54	△0.4		△0.0	98.6	—	5,131
29期(2023年2月1日)	13,733	△0.4	336.98	△0.8		△0.0	99.0	—	5,234

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数			債組入比率	債券先物比率	
	騰落	率	NOMURA-BPI総合中期	騰落	率			コール (無担保翌日物) 収益率
(期首) 2022年2月1日	円	%			%	%	%	
	13,787	—	339.54		—	—	98.6	—
2月末	13,783	△0.0	339.25	△0.1		△0.0	98.7	—
3月末	13,771	△0.1	338.89	△0.2		△0.0	98.7	—
4月末	13,770	△0.1	339.18	△0.1		△0.0	98.8	—
5月末	13,770	△0.1	339.17	△0.1		△0.0	98.6	—
6月末	13,755	△0.2	338.84	△0.2		△0.0	98.9	—
7月末	13,796	0.1	340.07	0.2		△0.0	98.9	—
8月末	13,785	△0.0	339.40	△0.0		△0.0	98.3	—
9月末	13,764	△0.2	338.49	△0.3		△0.0	98.8	—
10月末	13,769	△0.1	338.62	△0.3		△0.0	98.7	—
11月末	13,766	△0.2	338.12	△0.4		△0.0	98.5	—
12月末	13,722	△0.5	335.92	△1.1		△0.0	98.8	—
2023年1月末	13,727	△0.4	336.86	△0.8		△0.0	98.9	—
(期末) 2023年2月1日	円	%			%	%	%	
	13,733	△0.4	336.98	△0.8		△0.0	99.0	—

*騰落率は期首比です。

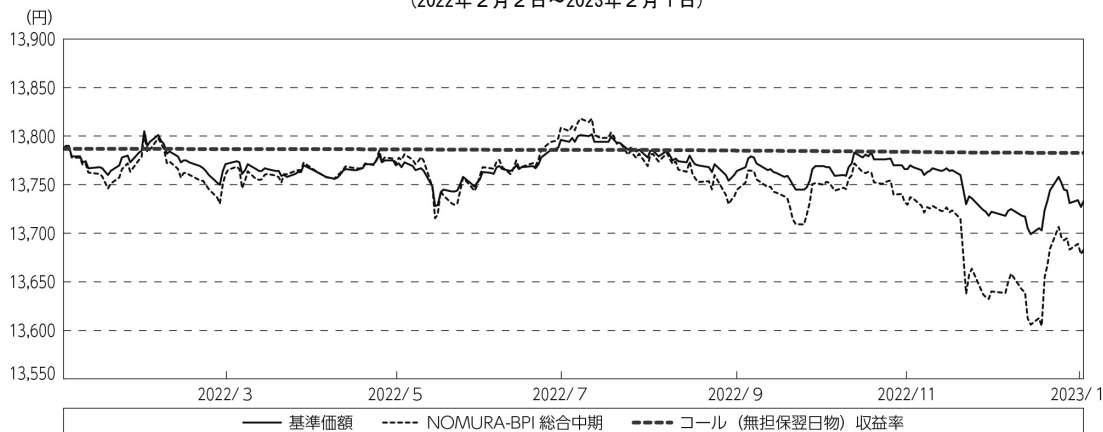
*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

NOMURA-BPI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指数で、当該指数に関する一切の知的財産権と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ております。また、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、当該インデックスの正確性、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うものではありません。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移

【基準価額等の推移】
(2022年2月2日～2023年2月1日)



(注) 参考指数は、NOMURA-BPI総合中期、コール（無担保翌日物）収益率です。コール（無担保翌日物）収益率は当社が独自に累積投資して算出しています。各参考指数は、作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首の13,787円から期末13,733円に54円下落しました。

上昇要因：保有する債券から金利収入を得たこと

下落要因：2022年2月以降、世界的なインフレリスクの高まりや各国中央銀行の積極的な金融引き締めにより海外金利が大幅上昇した影響から、国内債券利回りも上昇（価格は下落）したこと

2022年12月に、日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことで、国内債券利回りが上昇したこと

○投資環境

期首の10年国債利回りは0.18%程度でスタートしました。世界的なインフレリスクの高まりや各国中央銀行の積極的な金融引き締め姿勢を背景に、海外債券利回りが大きく上昇したことから、2022年3月には国内10年国債利回りは0.25%程度まで上昇しました。こうした動きに対し日銀は、イールドカーブ・コントロールの政策方針に則り、10年国債利回り0.25%での連続指値オペを実施し利回り上昇を抑制しました。6月には日銀の政策変更を期待する海外投資家の日本国債先物への売り圧力が強まり、債券先物が大幅安となる形で国内債券市場が不安定化しましたが、日銀は10年国債に加え、残存7年程度の国債も連続指値オペの対象に追加することで、利回り上昇を抑制する姿勢を明確化しました。その後暫くは日銀のコントロールにより10年国債利回りは横ばい圏での推移となっていました。12月の金融政策決定会合にて日銀が長期金利の許容変動幅の拡大を決定したことで、10年国債利回りは一時0.50%程度まで上昇しました。2023年1月の金融政策決定会合でも更なる政策修正が期待されましたが、日銀は政策維持を決定しました。その結果、期末の10年国債利回りは0.48%程度となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・債券組入比率とデュレーション

期中、債券組入比率は概ね高位で推移させました。

ポートフォリオのデュレーション（金利感応度）は、緩和的な金融環境の継続を見込んだことから、デュレーションを概ね長めで維持しました。

・種別構成

利回り収益を確保するため、地方債など財務リスクの低い高格付け債を保有しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数であるコール（無担保翌日物）収益率が -0.03% 、NOMURA-BPI総合中期の騰落率が -0.75% となったのに対し、基準価額の騰落率は -0.39% となりました。

・主な差異要因

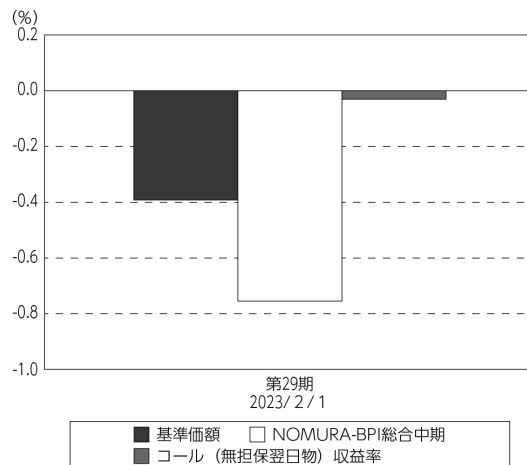
（プラス要因）

- ・スプレッド（国債に対する上乗せ金利）のある地方債などを多めに保有したこと

（マイナス要因）

- ・金利が上昇するなか、ファンドのデュレーションを長めとしていたこと

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



（注）参考指数は、NOMURA-BPI総合中期、コール（無担保翌日物）収益率です。
コール（無担保翌日物）収益率は当社が独自に累積投資して算出しています。

◎今後の運用方針

国内景気は、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大を受けた低調な経済活動から徐々に復調し、今後は個人消費活動を中心に景気回復の動きが強まっていくと考えています。国内金利については、2023年4月以降、新日銀総裁の下で「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」（イールドカーブ・コントロール）がさらに修正される可能性があるため、先行き金利水準が切り上がる展開を予想しています。

当ファンドでは引き続き、公社債、短期金融商品を中心に運用し、金融・債券市場の動向に合わせて機動的にデュレーションや組入比率を変更し、基準価額の上昇を目指します。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2022年2月2日～2023年2月1日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2022年2月2日～2023年2月1日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 8,991,379	千円 9,119,999
	地方債証券	506,036	(518,500)
	特殊債券	—	(200,000)
	社債券 (投資法人債券を含む)	498,848	—

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

*()内は償還等による増減分です。

*社債券 (投資法人債券を含む) には新株予約権付社債 (転換社債) は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2022年2月2日～2023年2月1日)

利害関係人との取引状況

区分	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	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 9,996	百万円 201	% 2.0	百万円 9,119	百万円 —	% —

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

(2023年2月1日現在)

○組入資産の明細

国内公社債

(A) 国内（邦貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB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	2,390,000	2,372,733	45.3	—	14.5	2.7	28.1
地方債証券	1,800,000	1,808,820	34.6	—	—	7.7	26.9
	(1,800,000)	(1,808,820)	(34.6)	(—)	(—)	(7.7)	(26.9)
特殊債券 (除く金融債)	300,000	300,143	5.7	—	—	3.8	1.9
	(300,000)	(300,143)	(5.7)	(—)	(—)	(3.8)	(1.9)
普通社債券 (含む投資法人債券)	700,000	698,929	13.4	—	—	9.5	3.8
	(700,000)	(698,929)	(13.4)	(—)	(—)	(9.5)	(3.8)
合 計	5,190,000	5,180,626	99.0	—	14.5	23.7	60.7
	(2,800,000)	(2,807,893)	(53.6)	(—)	(—)	(21.0)	(32.6)

* ()内は非上場債で内書きです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

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					
国庫債券	利付（2年）第430回	0.005	40,000	40,029	2023/11/1
国庫債券	利付（2年）第431回	0.005	150,000	150,118	2023/12/1
国庫債券	利付（2年）第432回	0.005	240,000	240,009	2024/1/1
国庫債券	利付（2年）第433回	0.005	290,000	290,200	2024/2/1
国庫債券	利付（2年）第434回	0.005	150,000	150,103	2024/3/1
国庫債券	利付（2年）第436回	0.005	110,000	110,074	2024/5/1
国庫債券	利付（2年）第437回	0.005	170,000	170,112	2024/6/1
国庫債券	利付（2年）第443回	0.005	280,000	280,204	2024/12/1
国庫債券	利付（5年）第141回	0.1	40,000	40,088	2024/9/20
国庫債券	利付（5年）第149回	0.005	20,000	19,963	2026/9/20
国庫債券	利付（5年）第155回	0.3	120,000	120,696	2027/12/20
国庫債券	利付（10年）第361回	0.1	360,000	349,347	2030/12/20
国庫債券	利付（10年）第363回	0.1	160,000	154,665	2031/6/20
国庫債券	利付（10年）第364回	0.1	50,000	48,245	2031/9/20
国庫債券	利付（10年）第365回	0.1	150,000	144,591	2031/12/20
国庫債券	利付（20年）第145回	1.7	50,000	55,211	2033/6/20
国庫債券	利付（20年）第157回	0.2	10,000	9,072	2036/6/20
小	計		2,390,000	2,372,733	

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
東京都	公募第725回	0.66	100,000	100,408	2023/9/20
東京都	公募第737回	0.52	100,000	100,701	2024/9/20
神奈川県	公募第227回	0.18	100,000	99,697	2027/6/18
静岡県	公募平成25年度第4回	0.882	100,000	100,341	2023/6/21
静岡県	公募平成26年度第9回	0.554	100,000	100,799	2024/10/24
愛知県	公募平成26年度第7回	0.591	100,000	100,751	2024/7/29
埼玉県	公募平成24年度第10回	0.825	100,000	100,065	2023/2/27
埼玉県	公募平成30年度第2回	0.04	100,000	100,008	2023/4/18
福岡県	公募平成26年度第5回	0.525	100,000	100,753	2024/10/28
福岡県	公募平成26年度第8回	0.441	100,000	100,653	2024/12/25
共同発行市場地方債 公募第135回		0.659	100,000	100,806	2024/6/25
共同発行市場地方債 公募第147回		0.548	100,000	101,033	2025/6/25
静岡県	公募平成27年度第1回	0.476	100,000	100,984	2025/11/25
名古屋市	公募第482回	0.639	100,000	100,085	2023/3/20
横浜市	公募平成27年度第5回	0.481	100,000	100,994	2025/11/21
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	100,103	2023/4/26
徳島県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	100,528	2023/11/29
岡山県	公募平成24年度第2回	0.68	100,000	100,107	2023/3/29
小	計		1,800,000	1,808,820	
特殊債券(除く金融債)					
地方公共団体金融機構債券	F166回	0.961	100,000	101,139	2024/5/28
住宅金融支援機構債券	財投機関債第309回	0.03	200,000	199,004	2026/3/19
小	計		300,000	300,143	
普通社債券(含む投資法人債券)					
関西電力	第523回	0.18	100,000	99,969	2023/10/25
中国電力	第377回	1.121	100,000	100,527	2023/8/25
セブン&アイ・ホールディングス	第14回社債間限定同順位特約	0.19	100,000	99,637	2025/12/19
トヨタ自動車	第26回社債間限定同順位特約付	0.05	100,000	99,349	2026/3/18
N T Tファイナンス	第16回日本電信電話保証付	0.18	100,000	99,680	2025/12/19
東日本旅客鉄道	第184回社債間限定同順位特約付	0.21	100,000	99,745	2025/10/14
K D D I	第30回社債間限定同順位特約付	0.21	100,000	100,022	2025/10/27
小	計		700,000	698,929	
合	計		5,190,000	5,180,626	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(2023年2月1日現在)

○投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 5,180,626	% 96.5
コール・ローン等、その他	185,548	3.5
投資信託財産総額	5,366,174	100.0

*金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2月1日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,366,174,406
コール・ローン等	153,538,353
公社債(評価額)	5,180,626,312
未収入金	27,990,000
未収利息	3,695,274
前払費用	324,467
(B) 負債	132,138,361
未払金	129,738,300
未払解約金	2,400,000
未払利息	61
(C) 純資産総額(A-B)	5,234,036,045
元本	3,811,406,169
次期繰越損益金	1,422,629,876
(D) 受益権総口数	3,811,406,169口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,733円

(注) 期首元本額は3,721,776,459円、期中追加設定元本額は556,668,973円、期中一部解約元本額は467,039,263円、1口当たり純資産額は1.3733円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額
 ・財形株投(年金・住宅財形30) 1,335,888,754円
 ・財形株投(一般財形30) 1,316,269,857円
 ・財形株投(一般財形50) 1,159,247,558円

○損益の状況 (2022年2月2日～2023年2月1日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	18,041,232
受取利息	18,059,770
支払利息	△ 18,538
(B) 有価証券売買損益	△ 38,678,631
売買益	9,721,412
売買損	△ 48,400,043
(C) 当期損益金(A+B)	△ 20,637,399
(D) 前期繰越損益金	1,409,396,985
(E) 追加信託差損益金	209,731,027
(F) 解約差損益金	△ 175,860,737
(G) 計(C+D+E+F)	1,422,629,876
次期繰越損益金(G)	1,422,629,876

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

*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。

*損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

財形株式マザーファンド

運用報告書

第29期（決算日2023年2月1日）

作成対象期間（2022年2月2日～2023年2月1日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に運用を行ない、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率	純資産額
	騰落	率	東証株価指数 (TOPIX)	騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
25期(2019年2月4日)	14,624	△13.5	1,581.33	△15.5	97.3	2.5	2,701
26期(2020年2月3日)	15,857	8.4	1,672.66	5.8	96.6	3.1	2,759
27期(2021年2月1日)	17,760	12.0	1,829.84	9.4	96.0	3.9	2,949
28期(2022年2月1日)	18,836	6.1	1,896.06	3.6	95.2	4.6	2,995
29期(2023年2月1日)	20,150	7.0	1,972.23	4.0	97.4	2.5	3,125

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率
	騰落	率	東証株価指数 (TOPIX)	騰落率		
(期首) 2022年2月1日	円	%		%	%	%
	18,836	—	1,896.06	—	95.2	4.6
2月末	18,756	△0.4	1,886.93	△0.5	95.5	4.4
3月末	19,562	3.9	1,946.40	2.7	98.0	1.8
4月末	19,101	1.4	1,899.62	0.2	96.3	3.5
5月末	19,237	2.1	1,912.67	0.9	97.0	2.9
6月末	18,866	0.2	1,870.82	△1.3	95.8	3.9
7月末	19,569	3.9	1,940.31	2.3	97.3	2.6
8月末	19,800	5.1	1,963.16	3.5	98.6	1.2
9月末	18,712	△0.7	1,835.94	△3.2	95.5	4.4
10月末	19,669	4.4	1,929.43	1.8	96.0	3.7
11月末	20,252	7.5	1,985.57	4.7	98.4	1.4
12月末	19,331	2.6	1,891.71	△0.2	95.5	4.4
2023年1月末	20,182	7.1	1,975.27	4.2	97.4	2.5
(期末) 2023年2月1日	円	%		%	%	%
	20,150	7.0	1,972.23	4.0	97.4	2.5

*騰落率は期首比です。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

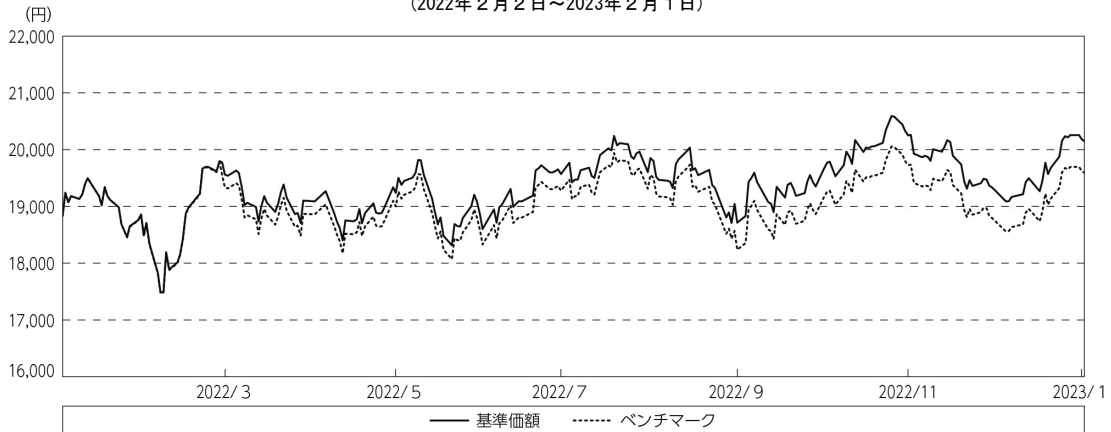
東証株価指数 (TOPIX) の指数値及び東証株価指数 (TOPIX) に係る標準又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数 (TOPIX) に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) に係る標準又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数 (TOPIX) の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、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。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移

【基準価額等の推移】

(2022年2月2日～2023年2月1日)



(注) ベンチマークは、東証株価指数 (TOPIX) です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

国内株式の株価変動

○投資環境

国内株式市場は、期首より国内でのオミクロン株による新型コロナウイルス感染の再拡大や、ウクライナを巡るロシアと欧米との対立、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受けて大きく下落しましたが、2022年3月中旬以降は、原油価格上昇が一服したことやロシアとウクライナの和平交渉が進展するとの期待が高まったことなどから上昇しました。6月中旬以降は、欧米諸国の金融引き締めによる世界景気低迷への懸念などから下落しましたが、7月以降は、円安米ドル高進行による輸出企業の収益改善期待や、FOMC (米連邦公開市場委員会) においてパウエルFRB (米連邦準備制度理事会) 議長が利上げペースの緩和を示唆したことで米国株式市場が大幅高となったことなどから概ね堅調に推移しました。8月下旬以降は、米国の金融引き締め局面の長期化観測が広がったことなどから下落しました。10月以降は、米長期金利上昇が一服したことで米国株式市場が堅調に推移したことや、岸田政権の総合経済対策が発表されたことなどから上昇しました。

11月下旬以降は、中国において新型コロナウイルス新規感染者数が過去最多を更新し、同国における行動制限を通じた企業活動への悪影響が懸念されたことなどから、国内株式市場は下落しました。12月中旬以降は、同月開催したFOMCの結果などから利上げ継続と景気減速への警戒感が広がり米国株式市場が下落したことや、日銀の金融政策決定会合において10年国債利回りの許容変動幅拡大など金融緩和策の一部修正が決定されたことなどから、金融関連を除く幅広い業種が下落し市場全体でも下落しました。

2023年1月中旬以降は、日銀が現行の金融緩和策を維持したことで上昇しました。下旬にかけても、FRBによる利上げ停止の可能性が高まったとの見方から米ハイテク株が上昇し国内株式市場も堅調に推移しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

東証株価指数に連動する投資成果を目指し、先物を含む実質の株式組入比率につきましては、期を通じて高位を維持しました。

・期中の主な動き

東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指すため、現物株式につきましては、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証株価指数（TOPIX）でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ないました。ただし、財務評価の視点から一部の銘柄は組み入れを見合わせました。

なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

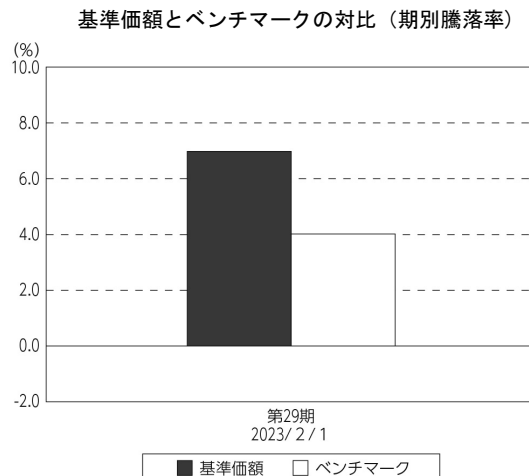
今期の基準価額の騰落率は+7.0%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の+4.0%を3.0ポイント上回りました。

（プラス要因）

保有銘柄の配当権利落ちによりファンドには未収配当金が計上されること

（その他の要因）

運用資産規模などの状況により、ファンドとベンチマークの個別銘柄の構成比に差異が生じること



（注）ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。

◎今後の運用方針

今後の運用につきましても引き続き、株式組入比率をできるだけ高位に維持し、東証株価指数の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2022年2月2日～2023年2月1日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(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
(株 式)	1	0.003	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
	(1)	(0.003)	
合 計	1	0.003	
期中の平均基準価額は、19,419円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*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2月2日～2023年2月1日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 122 (18)	千円 283,316 (-)	千株 108	千円 216,813

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*()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	株式先物取引	百万円 849	百万円 934	百万円 -	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年2月2日～2023年2月1日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	500,130千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,946,854千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

* (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2月2日～2023年2月1日)

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 1	百万円 0.05015	百万円 9

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

(2023年2月1日現在)

○組入資産の明細

国内株式

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	評 価 額	
	千株	千株	千株	千円		千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.1%)					清水建設	3.3	3.2	2,323	
極洋	0.1	0.1	385		飛鳥建設	0.1	0.1	104	
ニッスイ	1.5	1.5	804		長谷工コーポレーション	1	1.1	1,628	
マルハニチロ	0.2	0.2	488		松井建設	0.1	0.1	58	
雪国まいたけ	0.1	0.1	103		鹿島建設	2.5	2.3	3,576	
サカタのタネ	0.2	0.2	831		不動テトラ	0.1	0.1	153	
ホクト	0.1	0.1	187		大東建設	0.1	—	—	
ホクリヨウ	0.1	—	—		鉄建建設	0.1	0.1	182	
鉱業 (0.3%)					西松建設	0.2	0.2	699	
住石ホールディングス	0.4	0.2	78		三井住友建設	0.8	0.8	336	
日鉄鉱業	—	0.1	363		大豊建設	0.1	—	—	
三井松島ホールディングス	0.1	0.1	325		佐田建設	0.1	0.1	47	
I N P E X	6	5.5	7,887		ナカノフドー建設	0.1	0.1	33	
石油資源開発	0.2	0.2	852		奥村組	0.2	0.2	599	
K&Oエナジーグループ	0.1	0.1	201		東鉄工業	0.2	0.1	266	
建設業 (1.9%)					富士ビー・エス	0.1	—	—	
ショーボンドホールディングス	0.2	0.2	1,086		浅沼組	—	0.1	322	
ミライト・ワン	0.5	0.5	775		戸田建設	1.5	1.3	907	
タマホーム	0.1	0.1	319		熊谷組	0.2	0.2	526	
サンヨーホームズ	0.1	—	—		植木組	0.2	—	—	
日本アクア	0.1	0.1	94		矢作建設工業	0.2	0.1	80	
ファーストコーポレーション	0.1	—	—		ビーエス三菱	0.1	0.1	63	
Robot Home	0.3	0.3	49		日本ハウスホールディングス	0.2	0.2	76	
スペースバリューホールディングス	0.2	—	—		大東建託	0.3	—	—	
ダイセキ環境ソリューション	0.1	—	—		新日本建設	0.1	0.1	80	
安藤・間	0.8	0.9	766		N I P P O	0.3	—	—	
東急建設	0.5	0.4	262		東亜建設工業	0.1	0.1	247	
コムシスホールディングス	0.5	0.5	1,210		日本国土開発	0.3	0.3	164	
ビーアールホールディングス	0.2	0.2	68		若築建設	0.1	—	—	
高松コンストラクショングループ	0.1	0.1	194		東洋建設	0.4	0.3	254	
ソネック	0.1	—	—		五洋建設	1.4	1.5	957	
ヤマウラ	0.1	0.1	104		世紀東急工業	0.2	0.1	81	
オリエンタル白石	0.5	0.5	155		住友林業	0.9	0.8	1,914	
大成建設	1	1	4,365		日本基礎技術	0.1	0.1	52	
大林組	3.5	3.7	3,655		巴コーポレーション	0.2	0.1	41	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
大和ハウス工業	3.2	2.9	8,978	
ライト工業	0.2	0.2	375	
積水ハウス	3.7	3.3	8,027	
日特建設	0.1	0.1	91	
北陸電気工事	0.1	0.1	69	
ユアテック	0.2	0.2	149	
日本リーテック	0.1	0.1	87	
中電工	0.2	0.2	414	
関電工	0.6	0.6	517	
きんでん	0.8	0.7	1,021	
東京エネシス	0.1	0.1	90	
住友電設	0.1	0.1	228	
日本電設工業	0.2	0.2	307	
エクシオグループ	0.5	0.5	1,161	
新日本空調	0.1	0.1	194	
九電工	0.3	0.3	967	
三機工業	0.3	0.2	305	
日揮ホールディングス	1.1	1	1,690	
ヤマト	0.1	0.1	76	
太平電業	0.1	0.1	335	
高砂熱学工業	0.3	0.3	553	
三晃金属工業	0.1	—	—	
明星工業	0.2	0.2	160	
大気社	0.2	0.1	344	
ダイダン	0.1	0.1	218	
日比谷総合設備	0.1	0.1	196	
テスホールディングス	0.1	0.1	116	
インフロニア・ホールディングス	1.5	1.1	1,134	
レイズネクスト	0.2	0.2	262	
食料品 (3.4%)				
ニッポン	0.3	0.3	481	
日清製粉グループ本社	1.3	1	1,608	
昭和産業	0.1	0.1	249	
鳥越製粉	0.1	0.1	59	
中部飼料	0.1	0.1	103	
フィード・ワン	0.1	0.2	136	
日本甜菜製糖	0.1	0.1	166	
DM三井製糖ホールディングス	0.1	0.1	201	
塩水港精糖	0.2	0.1	19	
ウエルネオシュガー	0.1	0.1	165	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
森永製菓	0.3	0.2	766	
江崎グリコ	0.3	0.3	1,086	
名糖産業	0.1	—	—	
井村屋グループ	0.1	0.1	225	
不二家	0.1	0.1	252	
山崎製パン	0.9	0.7	1,059	
亀田製菓	0.1	0.1	437	
寿スピリッツ	0.1	0.1	850	
カルビー	0.5	0.5	1,439	
森永乳業	0.2	0.2	958	
六甲バター	0.1	0.1	131	
ヤクルト本社	0.8	0.8	7,376	
明治ホールディングス	0.7	0.7	4,725	
雪印メグミルク	0.3	0.3	540	
プリマハム	0.1	0.1	215	
日本ハム	0.4	0.4	1,530	
林兼産業	0.1	—	—	
丸大食品	0.1	0.1	145	
S F o o d s	0.1	0.1	292	
柿安本店	0.1	—	—	
伊藤ハム米久ホールディングス	0.7	0.8	562	
サッポロホールディングス	0.4	0.3	948	
アサヒグループホールディングス	2.6	2.4	10,255	
キリンホールディングス	4.1	4.7	9,437	
宝ホールディングス	0.8	0.7	735	
オエノンホールディングス	0.3	0.3	76	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	0.8	0.8	1,076	
サントリー食品インターナショナル	0.7	0.7	3,041	
ダイドールグループホールディングス	0.1	0.1	466	
伊藤園	0.3	0.4	1,842	
キーコーヒー	0.1	0.1	206	
ユニカフェ	0.1	—	—	
日清オイリオグループ	0.1	0.1	318	
不二製油グループ本社	0.2	0.2	410	
J-オイルミルズ	0.1	0.1	155	
キッコーマン	0.8	0.7	4,753	
味の素	2.5	2.6	10,704	
ブルドックソース	0.1	—	—	
キュービー	0.6	0.6	1,338	
ハウス食品グループ本社	0.4	0.3	821	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
カゴメ	0.4	0.5	1,582	
焼津水産化学工業	0.1	—	—	
アリアケジャパン	0.1	0.1	435	
ニチレイ	0.5	0.5	1,344	
東洋水産	0.5	0.5	2,680	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.1	0.1	90	
日清食品ホールディングス	0.4	0.4	4,088	
永谷園ホールディングス	0.1	0.1	202	
フジッコ	0.1	0.1	185	
ロック・フィールド	0.1	0.1	157	
日本たばこ産業	5.9	6.9	18,288	
ケンコーマヨネーズ	0.1	0.1	133	
わらべや日洋ホールディングス	0.1	0.1	195	
なとり	0.1	0.1	206	
イフジ産業	0.1	—	—	
ビックスコーポレーション	0.1	—	—	
ファーマフーズ	0.1	0.2	269	
ユークレナ	0.6	0.7	728	
紀文食品	0.1	0.1	95	
ビックスホールディングス	—	0.1	119	
理研ビタミン	0.1	0.1	192	
繊維製品 (0.5%)				
片倉工業	0.1	0.1	173	
グンゼ	0.1	0.1	423	
東洋紡	0.4	0.5	515	
ユニチカ	0.3	0.3	72	
倉敷紡績	0.1	0.1	224	
シキボウ	0.1	0.1	97	
日本毛織	0.3	0.3	286	
ダイトボウ	0.2	0.2	17	
ダイドーリミテッド	0.2	0.2	51	
帝国繊維	0.1	0.1	155	
帝人	1.1	1	1,323	
東レ	7.8	7.2	5,702	
日本フェルト	0.1	0.1	41	
アツギ	0.1	0.1	39	
セーレン	0.3	0.2	467	
東海染工	0.1	—	—	
小松マテーレ	0.2	0.2	153	
ワコールホールディングス	0.3	0.2	487	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ホギメディカル	0.1	0.1	325	
T S Iホールディングス	0.4	0.4	214	
ワールド	0.1	0.1	135	
三陽商会	0.1	—	—	
オンワードホールディングス	0.6	0.7	239	
ゴールドウイン	0.2	0.2	1,972	
デサント	0.2	0.2	727	
キング	0.1	—	—	
ヤマトインターナショナル	0.1	0.1	25	
パルプ・紙 (0.2%)				
特種東海製紙	0.1	—	—	
王子ホールディングス	4.5	4.5	2,421	
日本製紙	0.6	0.6	578	
三菱製紙	0.2	0.1	28	
北越コーポレーション	0.7	0.7	583	
大王製紙	0.5	0.5	497	
阿波製紙	0.1	—	—	
レンゴー	1	1	915	
トーモク	0.1	0.1	154	
ザ・バック	—	0.1	257	
化学 (6.2%)				
北の達人コーポレーション	0.4	0.5	165	
クラレ	1.6	1.7	1,813	
旭化成	7.1	6.7	6,563	
共和レザー	0.1	0.1	51	
レゾナック・ホールディングス	0.9	1	2,210	
住友化学	7.9	7.9	3,918	
日産化学	0.6	0.5	3,020	
クレハ	0.1	0.1	829	
テイカ	0.1	0.1	120	
石原産業	0.2	0.2	220	
日本曹達	0.1	0.1	421	
東ソー	1.6	1.4	2,360	
トクヤマ	0.3	0.3	591	
セントラル硝子	0.2	0.2	583	
東亜合成	0.6	0.6	707	
大阪ソーダ	0.1	0.1	414	
関東電化工業	0.2	0.2	199	
デンカ	0.4	0.4	1,077	
信越化学工業	1.9	1.8	34,659	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
堺化学工業	0.1	0.1	0.1	183
第一稀元素化学工業	0.1	0.1	0.1	108
エア・ウォーター	1	1	1	1,575
日本酸素ホールディングス	1	1	1	2,126
日本パーカラライジング	0.5	0.5	0.5	475
高压ガス工業	0.2	0.2	0.2	131
四国化成ホールディングス	0.1	0.1	0.1	127
ステラ ケミファ	0.1	0.1	0.1	259
日本触媒	0.2	0.2	0.2	1,098
大日精化工業	0.1	0.1	0.1	179
カネカ	0.3	0.2	0.2	676
三菱瓦斯化学	1	0.8	0.8	1,510
三井化学	1	0.9	0.9	2,749
J S R	1	1	1	2,892
東京応化工業	0.2	0.2	0.2	1,282
大阪有機化学工業	0.1	0.1	0.1	211
三菱ケミカルグループ	7.2	7.2	7.2	5,217
KHネオケム	0.2	0.2	0.2	547
ダイセル	1.6	1.6	1.6	1,539
住友ベークライト	0.2	0.2	0.2	835
積水化学工業	2.2	2.2	2.2	3,964
日本ゼオン	1	0.6	0.6	733
アイカ工業	0.3	0.3	0.3	922
UBE	0.5	0.6	0.6	1,215
積水樹脂	0.2	0.2	0.2	387
タキロンシーアイ	0.2	0.2	0.2	104
旭有機材	0.1	0.1	0.1	271
ニチバン	0.1	0.1	0.1	180
リケンテクノス	0.3	0.2	0.2	106
大倉工業	0.1	—	—	—
積水化成製品工業	0.1	0.2	0.2	78
タイガースポリマー	0.1	—	—	—
ダイキョーニシカワ	0.2	0.2	0.2	122
森六ホールディングス	0.1	0.1	0.1	177
恵和	—	0.1	0.1	157
日本化薬	0.8	0.8	0.8	928
カーリットホールディングス	0.1	0.1	0.1	77
日本精化	0.1	0.1	0.1	237
扶桑化学工業	0.1	0.1	0.1	365
トリケミカル研究所	0.1	0.1	0.1	238

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ADEKA	0.5	0.4	0.4	867
日油	0.4	0.3	0.3	1,650
新日本理化	0.2	0.1	0.1	22
ハリマ化成グループ	0.1	0.1	0.1	85
花王	2.4	2.6	2.6	13,452
石原ケミカル	0.1	—	—	—
三洋化成工業	0.1	0.1	0.1	420
有機合成薬品工業	0.1	0.1	0.1	28
大日本塗料	0.1	0.1	0.1	78
日本ペイントホールディングス	4	4.7	4.7	5,531
関西ペイント	1.1	1	1	1,794
神東塗料	0.1	0.1	0.1	12
中国塗料	0.3	0.2	0.2	208
日本特殊塗料	0.1	0.1	0.1	88
藤倉化成	0.1	0.1	0.1	43
太陽ホールディングス	0.2	0.2	0.2	477
D I C	0.5	0.4	0.4	958
サカタインクス	0.2	0.2	0.2	215
東洋インキSCホールディングス	0.2	0.2	0.2	370
T&K TOKA	0.1	0.1	0.1	125
富士フイルムホールディングス	1.9	2.1	2.1	14,259
資生堂	2	2.2	2.2	14,608
ライオン	1.3	1.3	1.3	1,852
高砂香料工業	0.1	0.1	0.1	258
マングム	0.2	0.2	0.2	289
ミルボン	0.1	0.2	0.2	1,124
ファンケル	0.4	0.5	0.5	1,307
コーセー	0.2	0.2	0.2	2,812
コタ	0.1	0.1	0.1	171
ポーラ・オルビスホールディングス	0.5	0.5	0.5	919
ノエビアホールディングス	0.1	0.1	0.1	565
新日本製薬	—	0.1	0.1	145
エステー	0.1	0.1	0.1	157
コニシ	0.2	0.2	0.2	361
長谷川香料	0.2	0.2	0.2	629
星光PMC	0.1	0.1	0.1	56
小林製薬	0.3	0.3	0.3	2,757
荒川化学工業	0.1	0.1	0.1	99
メック	0.1	0.1	0.1	249
タカラバイオ	0.3	0.3	0.3	518

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
J C U	0.1	0.1	0.1	316
新田ゼラチン	0.1	0.1	0.1	85
デクセリアルズ	0.3	0.3	0.3	822
アース製薬	0.1	0.1	0.1	506
北興化学工業	0.1	0.1	0.1	83
クミアイ化学工業	0.4	0.4	0.4	348
日本農薬	0.2	0.2	0.2	142
アキレス	0.1	0.1	0.1	127
有沢製作所	0.2	0.2	0.2	280
日東電工	0.7	0.8	0.8	6,640
レック	0.1	0.2	0.2	200
三光合成	0.1	0.1	0.1	53
きもと	0.2	0.2	0.2	40
藤森工業	0.1	0.1	0.1	331
前澤化成工業	0.1	0.1	0.1	137
J S P	0.1	0.1	0.1	158
エフビコ	0.2	0.2	0.2	757
天馬	0.1	0.1	0.1	220
信越ポリマー	0.2	0.2	0.2	257
東リ	0.3	0.2	0.2	46
ニフコ	0.4	0.4	0.4	1,334
バルカー	0.1	0.1	0.1	322
ユニ・チャーム	2.1	2.2	2.2	10,799
医薬品 (5.4%)				
協和キリン	1.3	1.3	1.3	3,766
武田薬品工業	8.6	9.5	9.5	38,712
アステラス製薬	9.5	10.3	10.3	19,590
住友ファーマ	0.7	0.8	0.8	702
塩野義製薬	1.4	1.4	1.4	8,684
わかもと製薬	0.1	0.1	0.1	22
日本新薬	0.3	0.3	0.3	2,010
中外製薬	3.4	3.4	3.4	11,305
科研製薬	0.2	0.2	0.2	746
エーザイ	1.3	1.3	1.3	10,424
ロート製薬	0.6	1	1	2,374
小野薬品工業	2.5	2.1	2.1	6,012
久光製薬	0.3	0.2	0.2	805
持田製薬	0.1	0.1	0.1	344
参天製薬	2	2	2	2,014
ツムラ	0.3	0.3	0.3	827

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日医工	0.3	—	—	—
キッセイ薬品工業	0.2	0.2	0.2	526
生化学工業	0.2	0.2	0.2	165
栄研化学	0.2	0.2	0.2	321
鳥居薬品	0.1	0.1	0.1	306
J C R ファーマ	0.3	0.4	0.4	654
東和薬品	0.2	0.2	0.2	406
富士製薬工業	0.1	0.1	0.1	105
ゼリア新薬工業	0.2	0.1	0.1	218
第一三共	8.7	9.3	9.3	38,074
キョーリン製薬ホールディングス	0.2	0.2	0.2	341
大幸薬品	0.2	0.2	0.2	77
ダイト	0.1	0.1	0.1	258
大塚ホールディングス	2.3	2.5	2.5	10,382
大正製薬ホールディングス	0.3	0.2	0.2	1,086
ペプチドリーム	0.6	0.5	0.5	986
あすか製薬ホールディングス	0.1	0.1	0.1	123
サワイグループホールディングス	0.2	0.2	0.2	803
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	0.9	1	1	93
ニチレキ	0.1	0.1	0.1	138
ユシロ化学工業	0.1	0.1	0.1	78
富士石油	0.3	0.2	0.2	52
MORESCO	0.1	—	—	—
出光興産	1.2	1.2	1.2	3,870
ENEOSホールディングス	16.6	19.4	19.4	9,001
コスモエネルギーホールディングス	0.3	0.4	0.4	1,446
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	0.6	0.6	0.6	1,281
TOYO TIRE	0.6	0.6	0.6	931
ブリヂストン	3.2	3.4	3.4	16,418
住友ゴム工業	0.9	1.1	1.1	1,277
藤倉コンポジット	0.1	0.1	0.1	90
オカモト	0.1	0.1	0.1	379
フコク	—	0.1	0.1	103
ニッタ	0.1	0.1	0.1	285
住友理工	0.2	0.2	0.2	141
三ツ星ベルト	0.1	0.2	0.2	740
バンドー化学	0.2	0.2	0.2	203

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ガラス・土石製品 (0.7%)				
日東紡績	0.2	0.1		203
A G C	1	1.1		5,203
日本板硝子	0.5	0.5		314
日本電気硝子	0.4	0.4		957
オハラ	—	0.1		121
住友大阪セメント	0.2	0.2		676
太平洋セメント	0.6	0.7		1,545
日本ヒューム	0.1	0.1		66
日本コンクリート工業	0.2	0.2		44
三谷セキサン	0.1	—		—
アジアパイルホールディングス	0.2	0.2		126
東海カーボン	0.9	0.9		1,007
日本カーボン	0.1	0.1		438
東洋炭素	0.1	0.1		413
ノリタケカンパニーリミテド	0.1	0.1		417
T O T O	0.8	0.7		3,220
日本碍子	1.2	1.3		2,324
日本特殊陶業	0.8	0.8		2,064
ダントーホールディングス	0.1	0.1		31
ヨータイ	0.1	0.1		149
東京窯業	0.1	0.1		28
フジミインコーポレーテッド	0.1	0.1		662
ニチアス	0.3	0.3		737
ニチハ	0.2	0.1		264
鉄鋼 (0.8%)				
日本製鉄	4.9	4.9		13,323
神戸製鋼所	2	2.2		1,537
中山製鋼所	0.2	0.2		202
合同製鐵	0.1	0.1		256
J F Eホールディングス	2.9	2.9		4,996
東京製鐵	0.4	0.3		419
共英製鋼	0.1	0.1		144
大和工業	0.2	0.2		996
東京鐵鋼	—	0.1		170
大阪製鐵	0.1	0.1		122
淀川製鋼所	0.1	0.1		276
丸一鋼管	0.4	0.3		840
大同特殊鋼	0.2	0.1		489
日本冶金工業	0.1	0.1		464

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
山陽特殊製鋼	0.1	0.1		254
愛知製鋼	0.1	0.1		232
日立金属	1.2	—		—
大太平洋金属	0.1	0.1		199
新日本電工	0.7	0.7		269
栗本鐵工所	—	0.1		187
三菱製鋼	0.1	0.1		113
日亜鋼業	0.2	0.1		25
エンビプロ・ホールディングス	—	0.1		75
シンニッタン	0.1	0.1		24
非鉄金属 (0.7%)				
大紀アルミニウム工業所	0.2	0.2		274
日本軽金属ホールディングス	0.3	0.3		440
三井金属鉱業	0.3	0.3		1,023
東邦亜鉛	0.1	0.1		217
三菱マテリアル	0.7	0.7		1,549
住友金属鉱山	1.4	1.3		6,853
DOWAホールディングス	0.3	0.2		899
古河機械金属	0.2	0.2		263
大阪チタニウムテクノロジーズ	0.1	0.2		726
東邦チタニウム	0.2	0.2		476
U A C J	0.2	0.2		481
古河電気工業	0.3	0.4		1,004
住友電気工業	4.1	3.8		5,901
フジクラ	1.2	1.2		1,158
昭和電線ホールディングス	0.1	0.1		183
タツタ電線	0.2	0.2		143
平河ヒューテック	0.1	0.1		119
リョービ	0.1	0.1		125
アーレスティ	0.1	0.1		49
アサヒホールディングス	0.4	0.4		786
金属製品 (0.6%)				
稲葉製作所	0.1	0.1		137
トーカロ	0.3	0.3		363
S U M C O	1.7	2.1		4,084
R S T e c h n o l o g i e s	—	0.1		391
信和	0.1	0.1		80
東洋製罐グループホールディングス	0.7	0.7		1,170
ホッカンホールディングス	0.1	0.1		141
コロナ	0.1	0.1		91

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
横河ブリッジホールディングス	0.2	0.1	0.1	201
三和ホールディングス	1.1	1	1	1,369
文化シャッター	0.3	0.3	0.3	345
三協立山	0.1	0.2	0.2	132
アルインコ	0.1	0.1	0.1	105
L I X I L	1.7	1.6	1.6	3,387
日本ファイルコン	0.1	0.1	0.1	45
ノーリツ	0.2	0.2	0.2	295
長府製作所	0.1	0.1	0.1	209
リンナイ	0.2	0.2	0.2	1,998
ダイニチ工業	0.1	0.1	0.1	66
日東精工	0.1	0.2	0.2	101
岡部	0.3	0.2	0.2	145
ジーテクト	0.1	0.1	0.1	155
東ブレ	0.2	0.2	0.2	253
高周波熱錬	0.2	0.2	0.2	138
東京製綱	0.1	0.1	0.1	106
サンコール	0.1	0.1	0.1	66
モリテック スチール	0.1	0.1	0.1	29
バイオラックス	0.2	0.2	0.2	352
エイチワン	0.2	0.1	0.1	66
日本発條	1.1	1	1	908
中央発條	0.1	0.1	0.1	76
三益半導体工業	0.1	0.1	0.1	257
機械 (5.4%)				
日本製鋼所	0.3	0.3	0.3	818
三浦工業	0.5	0.5	0.5	1,592
タクマ	0.4	0.3	0.3	379
ツガミ	0.2	0.2	0.2	284
オークマ	0.1	0.1	0.1	511
芝浦機械	0.1	0.1	0.1	282
アマダ	1.7	1.7	1.7	1,951
アイダエンジニアリング	0.3	0.2	0.2	159
TAKI SAWA	0.1	—	—	—
F U J I	0.5	0.5	0.5	1,071
牧野フライス製作所	0.1	0.1	0.1	469
オーエスジー	0.5	0.5	0.5	1,010
ダイジェット工業	0.1	—	—	—
旭ダイヤモンド工業	0.3	0.3	0.3	223
DMG森精機	0.6	0.7	0.7	1,367

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ソディック	0.2	0.2	0.3	226
ディスコ	0.2	0.2	0.2	7,860
日東工器	0.1	0.1	0.1	157
日進工具	0.1	0.1	0.1	107
パンチ工業	0.1	0.1	0.1	45
富士ダイス	0.1	0.1	0.1	59
豊和工業	0.1	0.1	0.1	96
ニデックオーケーケー	0.1	—	—	—
東洋機械金属	0.1	0.1	0.1	55
津田駒工業	0.1	—	—	—
エンシュウ	0.1	—	—	—
島精機製作所	0.2	0.2	0.2	368
オプトラン	0.1	0.2	0.2	511
NCホールディングス	0.1	—	—	—
イワキポンプ	0.1	0.1	0.1	126
フリュー	0.1	0.1	0.1	116
ヤマシンフィルタ	0.2	0.3	0.3	167
日阪製作所	0.1	0.1	0.1	85
やまびこ	0.2	0.2	0.2	225
平田機工	0.1	0.1	0.1	632
ペガサスミシン製造	0.2	0.1	0.1	67
マルマエ	—	0.1	0.1	168
タツモ	0.1	0.1	0.1	193
ナプテスコ	0.6	0.7	0.7	2,590
三井海洋開発	0.1	0.1	0.1	137
レオン自動機	0.1	0.1	0.1	109
SMC	0.3	0.4	0.4	26,328
ホンカワミクロン	0.1	0.1	0.1	273
オイレス工業	0.2	0.2	0.2	307
サトーホールディングス	0.1	0.2	0.2	422
技研製作所	0.1	0.1	0.1	288
日本エアーテック	0.1	0.1	0.1	111
カワタ	0.1	—	—	—
日精樹脂工業	0.1	0.1	0.1	97
オカダアイオン	0.1	—	—	—
ワイエイシイホールディングス	0.1	—	—	—
小松製作所	5	5.1	5.1	15,952
住友重機械工業	0.6	0.6	0.6	1,695
日立建機	0.4	0.4	0.4	1,206
日工	0.2	0.2	0.2	126

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
井関農機	0.1	0.1	0.1	122
TOWA	0.1	0.1	0.1	193
北川鉄工所	0.1	—	—	—
ローツェ	0.1	0.1	0.1	1,007
タカキタ	0.1	—	—	—
クボタ	5.4	5.7	5.7	10,963
荏原実業	0.1	0.1	0.1	255
月島機械	0.2	0.1	0.1	101
帝国電機製作所	0.1	0.1	0.1	243
東京機械製作所	0.1	—	—	—
新東工業	0.2	0.2	0.2	143
澁谷工業	0.1	0.1	0.1	248
アイチ コーポレーション	0.2	0.2	0.2	154
小森コーポレーション	0.3	0.3	0.3	245
鶴見製作所	0.1	0.1	0.1	198
日本ギア工業	0.1	—	—	—
荏原製作所	0.5	0.4	0.4	2,168
西島製作所	0.1	0.1	0.1	148
北越工業	0.1	0.1	0.1	141
ダイキン工業	1.4	1.3	1.3	29,178
オルガノ	—	0.1	0.1	315
栗田工業	0.6	0.6	0.6	3,474
椿本チエイン	0.1	0.2	0.2	613
大同工業	0.1	—	—	—
木村化工機	0.1	0.1	0.1	70
アネスト岩田	0.2	0.2	0.2	173
ダイフク	0.6	0.6	0.6	4,242
加藤製作所	0.1	0.1	0.1	75
タダノ	0.6	0.6	0.6	567
フジテック	0.4	0.4	0.4	1,250
CKD	0.3	0.3	0.3	610
キトー	0.1	—	—	—
平和	0.3	0.4	0.4	934
理想科学工業	0.1	0.1	0.1	225
SANKYO	0.2	0.2	0.2	1,060
日本金銭機械	0.1	0.1	0.1	116
マースグループホールディングス	0.1	0.1	0.1	241
フクシマガリレイ	0.1	0.1	0.1	430
オーイズミ	0.1	—	—	—
ダイコク電機	0.1	0.1	0.1	204

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
竹内製作所	0.2	0.2	0.2	568
アマノ	0.3	0.3	0.3	699
J U K I	0.2	0.2	0.2	126
ジャノメ	0.1	0.1	0.1	60
マックス	0.1	0.1	0.1	214
グローリー	0.3	0.3	0.3	673
新晃工業	0.1	0.1	0.1	156
大和冷機工業	0.2	0.2	0.2	238
セガサミーホールディングス	1.1	0.9	0.9	1,841
日本ビストンリング	0.1	—	—	—
T P R	0.1	0.1	0.1	132
ツバキ・ナカシマ	0.2	0.3	0.3	336
ホシザキ	0.3	0.7	0.7	3,220
大豊工業	0.1	0.1	0.1	67
日本精工	2.1	2	2	1,462
N T N	2.4	2.1	2.1	562
ジェイテクト	1.1	1	1	963
不二越	0.1	0.1	0.1	386
日本トムソン	0.3	0.3	0.3	177
T H K	0.6	0.6	0.6	1,635
ユースン精機	0.1	0.1	0.1	69
前澤給装工業	0.1	0.1	0.1	93
イーグル工業	0.1	0.1	0.1	114
前澤工業	0.1	0.1	0.1	61
日本ビラー工業	0.1	0.1	0.1	316
キッツ	0.4	0.4	0.4	328
マキタ	1.3	1.3	1.3	4,257
三井E & Sホールディングス	0.4	0.5	0.5	200
日立造船	0.9	0.9	0.9	770
三菱重工業	1.7	1.9	1.9	9,636
I H I	0.7	0.7	0.7	2,737
サノヤスホールディングス	0.1	0.1	0.1	13
スター精密	0.2	0.2	0.2	336
電気機器 (17.5%)				
日清紡ホールディングス	0.7	0.9	0.9	862
イビデン	0.6	0.6	0.6	3,072
コニカミノルタ	2.4	2.4	2.4	1,296
ブラザー工業	1.4	1.4	1.4	2,777
ミネベアミツミ	1.9	1.9	1.9	4,290
日立製作所	5.3	5.4	5.4	36,212

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東芝	1.9	2.1	9,424	
三菱電機	11	11.2	15,954	
富士電機	0.6	0.7	3,647	
安川電機	1.2	1.3	6,565	
シンフォニアテクノロジ	0.1	0.1	158	
明電舎	0.2	0.2	376	
デンヨー	0.1	0.1	153	
PHCホールディングス	0.1	0.1	152	
ソシオネクスト	—	0.1	857	
東芝テック	0.1	0.2	724	
マブチモーター	0.3	0.3	1,113	
日本電産	2.9	2.6	18,621	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.1	—	—	
トレックス・セミコンダクター	0.1	0.1	273	
東光高岳	0.1	0.1	205	
ダブル・スコープ	0.3	0.4	580	
ダイヘン	0.1	0.1	417	
ヤーマン	0.2	0.2	273	
JVCケンウッド	0.9	1	368	
ミマキエンジニアリング	0.1	0.1	60	
I-PEX	0.1	0.1	115	
日新電機	0.3	0.3	411	
大崎電気工業	0.2	0.3	159	
オムロン	0.9	1	7,449	
日東工業	0.1	0.1	241	
I D E C	0.1	0.2	608	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.4	0.4	910	
日本電気	1.4	1.5	7,260	
富士通	1	1.1	20,355	
沖電気工業	0.4	0.5	366	
岩崎通信機	0.1	—	—	
電気興業	0.1	—	—	
サンケン電気	0.1	0.1	780	
アイホン	0.1	0.1	193	
ルネサスエレクトロニクス	5.9	7	9,499	
セイコーエプソン	1.3	1.4	2,646	
ワコム	0.9	0.9	617	
アルバック	0.2	0.3	1,794	
アクセル	0.1	—	—	
E I Z O	0.1	0.1	358	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本信号	0.3	0.2	205	
京三製作所	0.2	0.2	81	
能美防災	0.1	0.1	171	
ホーチキ	0.1	0.1	146	
星和電機	0.1	—	—	
エレコム	0.2	0.3	402	
パナソニック ホールディングス	11.7	12.7	15,144	
シャープ	1.2	1.3	1,402	
アンリツ	0.7	0.8	987	
富士通ゼネラル	0.3	0.3	1,092	
ソニーグループ	6.9	7.6	87,172	
T D K	1.6	1.7	7,947	
タムラ製作所	0.4	0.5	370	
アルプスアルパイン	0.9	1	1,390	
日本電波工業	0.1	0.1	149	
鈴木	—	0.1	96	
メイコー	0.1	0.1	293	
ローランド ディー、ジー、	0.1	0.1	293	
フォスター電機	0.1	0.1	96	
ヨコオ	0.1	0.1	224	
ティアック	0.2	0.2	24	
ホシデン	0.3	0.3	471	
ヒロセ電機	0.2	0.2	3,396	
日本航空電子工業	0.3	0.2	443	
T O A	0.1	0.1	78	
マクセル	0.2	0.2	296	
古野電気	0.1	0.1	94	
スミダコーポレーション	0.1	0.1	143	
本多通信工業	0.1	—	—	
横河電機	1.1	1.2	2,721	
アズビル	0.6	0.7	2,562	
東亜ディーケーケー	0.1	0.1	77	
日本光電工業	0.5	0.5	1,667	
共和電業	0.2	0.1	34	
日本電子材料	0.1	0.1	143	
堀場製作所	0.2	0.2	1,202	
アドバンテスト	0.8	0.8	7,656	
小野測器	0.1	—	—	
エスベック	0.1	0.1	202	
キーエンス	1	1.1	65,538	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日置電機	0.1	0.1	0.1	747
シスメックス	0.9	0.9	0.9	7,704
日本マイクロニクス	0.2	0.2	0.2	279
メガチップス	0.1	0.1	0.1	271
OBARA GROUP	—	0.1	0.1	369
原田工業	0.1	—	—	—
コーセル	0.1	0.1	0.1	110
イリソ電子工業	0.1	0.1	0.1	433
オブテックスグループ	0.2	0.2	0.2	424
アイ・オー・データ機器	0.1	—	—	—
レーザーテック	0.5	0.5	0.5	11,010
スタンレー電気	0.8	0.8	0.8	2,224
ウシオ電機	0.6	0.6	0.6	1,021
岡谷電機産業	0.1	0.1	0.1	26
ヘリオス テクノ ホールディング	0.2	0.1	0.1	47
日本セラミック	0.1	0.1	0.1	243
遠藤照明	0.1	—	—	—
古河電池	0.1	0.1	0.1	107
双信電機	0.1	—	—	—
山一電機	0.1	0.1	0.1	183
図研	0.1	0.1	0.1	312
日本電子	0.2	0.3	0.3	1,129
カシオ計算機	0.8	0.8	0.8	1,064
ファナック	1	1	1	22,800
日本シイエムケイ	0.2	0.2	0.2	102
大真空	0.1	0.1	0.1	74
ローム	0.5	0.5	0.5	5,235
浜松ホトニクス	0.8	0.9	0.9	6,156
三井ハイテック	0.1	0.1	0.1	674
新光電気工業	0.3	0.4	0.4	1,494
京セラ	1.5	1.7	1.7	11,405
太陽誘電	0.5	0.5	0.5	2,190
村田製作所	3.2	3.2	3.2	23,670
双葉電子工業	0.2	0.2	0.2	111
ニチコン	0.3	0.2	0.2	255
日本ケミコン	0.1	0.1	0.1	166
KOA	0.2	0.2	0.2	371
市光工業	0.2	0.2	0.2	77
小糸製作所	0.6	1.3	1.3	2,808
ミツバ	0.2	0.2	0.2	104

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
SCREENホールディングス	0.2	0.2	0.2	2,012
キヤノン電子	0.1	0.1	0.1	170
キヤノン	5.4	5.9	5.9	16,927
リコー	3	2.7	2.7	2,729
象印マホービン	0.3	0.3	0.3	502
東京エレクトロン	0.7	0.8	0.8	36,904
イノテック	—	0.1	0.1	133
輸送用機器 (7.4%)				
トヨタ紡織	0.4	0.4	0.4	766
芦森工業	0.1	—	—	—
ユニプレス	0.2	0.2	0.2	156
豊田自動織機	0.9	0.8	0.8	6,296
モリタホールディングス	0.2	0.2	0.2	236
三櫻工業	0.2	0.2	0.2	129
デンソー	2.4	2.2	2.2	15,402
東海理化電機製作所	0.3	0.3	0.3	448
川崎重工業	0.8	0.8	0.8	2,377
名村造船所	0.4	0.3	0.3	121
日本車輛製造	0.1	—	—	—
三菱ロジスネクスト	0.1	0.2	0.2	144
近畿車輛	0.1	—	—	—
日産自動車	13	15.2	15.2	7,110
いすゞ自動車	3.5	3.1	3.1	5,077
トヨタ自動車	55.8	58.7	58.7	111,706
日野自動車	1.4	1.4	1.4	789
三菱自動車工業	4.1	4.2	4.2	2,158
エフテック	0.1	0.1	0.1	54
レンシップホールディングス	0.1	—	—	—
武蔵精密工業	0.2	0.3	0.3	539
日産車体	0.2	0.2	0.2	178
新明和工業	0.4	0.3	0.3	317
極東開発工業	0.2	0.2	0.2	295
トビー工業	0.1	0.1	0.1	168
ティラド	0.1	—	—	—
タチエス	0.2	0.2	0.2	241
NOK	0.5	0.4	0.4	492
フタバ産業	0.3	0.3	0.3	116
KYB	0.1	0.1	0.1	366
大同メタル工業	0.3	0.2	0.2	99
プレス工業	0.6	0.5	0.5	225

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ミクニ	0.2	0.1	0.1	34
太平洋工業	0.2	0.2	0.2	213
河西工業	0.2	0.1	0.1	16
アイシン	0.8	0.8	0.8	3,028
マツダ	3.5	3.5	3.5	3,727
今仙電機製作所	0.1	0.1	0.1	69
本田技研工業	8.7	8.7	8.7	28,170
スズキ	2.5	2	2	9,668
SUBARU	3.2	3.4	3.4	7,361
安永	0.1	—	—	—
ヤマハ発動機	1.4	1.7	1.7	5,465
TBK	0.2	0.1	0.1	25
エクセディ	0.2	0.2	0.2	349
豊田合成	0.4	0.3	0.3	643
愛三工業	0.2	0.2	0.2	150
日本プラスト	0.1	0.1	0.1	43
ヨロズ	0.2	0.1	0.1	72
エフ・シー・シー	0.2	0.2	0.2	289
シマノ	0.4	0.4	0.4	9,190
テイ・エス テック	0.5	0.5	0.5	806
ジャムコ	0.1	0.1	0.1	154
精密機器 (2.6%)				
テルモ	3.1	3.3	3.3	12,361
日機装	0.4	0.3	0.3	307
日本エム・ディ・エム	0.1	0.1	0.1	89
島津製作所	1.4	1.3	1.3	5,180
JMS	0.1	0.1	0.1	49
長野計器	0.1	0.1	0.1	114
ブイ・テクノロジー	0.1	0.1	0.1	271
東京計器	0.1	0.1	0.1	129
インターアクション	0.1	0.1	0.1	147
オーバル	0.1	0.1	0.1	42
東京精密	0.2	0.2	0.2	894
マニー	0.4	0.5	0.5	929
ニコン	1.7	1.7	1.7	2,152
トプコン	0.6	0.6	0.6	972
オリンパス	5.7	6.7	6.7	16,341
理研計器	0.1	0.1	0.1	463
タムロン	0.1	0.1	0.1	314
HOYA	2.1	2.3	2.3	31,705

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
シード	0.1	0.1	0.1	51
ノーリツ鋼機	0.1	0.1	0.1	234
A&Dホロンホールディングス	0.1	0.2	0.2	215
朝日インテック	1.3	1.4	1.4	3,134
シチズン時計	1.3	1.2	1.2	744
リズム	0.1	—	—	—
大研医器	0.1	0.1	0.1	46
メニコン	0.4	0.4	0.4	1,134
セイコーグループ	0.2	0.2	0.2	591
ニプロ	0.9	0.9	0.9	927
その他製品 (2.3%)				
KYORITSU	—	0.2	0.2	24
スノーピーク	0.2	0.2	0.2	434
パラマウントベッドホールディングス	0.2	0.2	0.2	494
トランザクション	0.1	0.1	0.1	157
ニホンフラッシュ	0.1	0.1	0.1	92
前田工織	0.1	0.1	0.1	330
永大産業	0.2	0.1	0.1	22
アートネイチャー	0.2	0.1	0.1	75
バンダイナムコホールディングス	1	1	1	8,710
共立印刷	0.2	—	—	—
SHOEI	0.1	0.1	0.1	512
フランスベッドホールディングス	0.1	0.1	0.1	97
パイロットコーポレーション	0.2	0.2	0.2	919
萩原工業	0.1	0.1	0.1	118
フジシールインターナショナル	0.3	0.2	0.2	333
タカラトミー	0.5	0.5	0.5	632
広済堂ホールディングス	0.1	0.1	0.1	200
プロネクス	0.1	0.1	0.1	96
ホクシン	0.1	0.1	0.1	14
ウッドワン	0.1	—	—	—
大建工業	0.1	0.1	0.1	219
凸版印刷	1.7	1.4	1.4	2,931
大日本印刷	1.3	1.3	1.3	3,952
共同印刷	0.1	—	—	—
NISSHA	0.2	0.2	0.2	384
TAKARA & COMPANY	0.1	0.1	0.1	213
アシックス	1	1	1	3,205
ローランド	0.1	0.1	0.1	379
小松ウオール工業	0.1	—	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマハ	0.7	0.7	3,482
クリナップ	0.2	0.1	64
ビジョン	0.7	0.7	1,431
キングジム	0.1	0.1	89
リンテック	0.2	0.2	445
イトーキ	0.3	0.2	141
任天堂	0.6	6.7	37,386
三菱鉛筆	0.2	0.2	287
タカラスタンダード	0.2	0.2	274
コクヨ	0.5	0.5	920
ナカバヤシ	0.2	0.1	48
グローブライド	0.1	0.1	266
オカムラ	0.4	0.3	418
美津濃	0.1	0.1	294
電気・ガス業 (1.2%)			
東京電力ホールディングス	8.2	9.6	4,588
中部電力	3.4	3.9	5,409
関西電力	4.2	4.1	4,993
中国電力	1.7	1.7	1,150
北陸電力	1	1	522
東北電力	2.5	2.6	1,679
四国電力	1	0.9	649
九州電力	2.3	2.5	1,770
北海道電力	1	1	473
沖縄電力	0.2	0.3	315
電源開発	0.9	0.8	1,684
エフオン	0.2	0.1	50
イーレックス	0.2	0.2	489
レノバ	0.2	0.3	672
東京瓦斯	2.1	2.3	6,596
大阪瓦斯	2	2.2	4,609
東邦瓦斯	0.5	0.4	992
北海道瓦斯	0.1	0.1	177
広島ガス	0.2	0.2	68
西部ガスホールディングス	0.1	0.1	177
静岡ガス	0.3	0.2	223
メタウォーター	0.1	0.1	164
陸運業 (2.9%)			
SBSホールディングス	0.1	0.1	294
東武鉄道	1.1	1.2	3,630

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
相鉄ホールディングス	0.4	0.4	874
東急	2.8	3	4,893
京浜急行電鉄	1.4	1.2	1,578
小田急電鉄	1.6	1.6	2,659
京王電鉄	0.6	0.6	2,790
京成電鉄	0.8	0.7	2,597
富士急行	0.1	0.1	453
東日本旅客鉄道	1.9	1.8	12,636
西日本旅客鉄道	1.3	1.4	7,358
東海旅客鉄道	0.9	0.8	12,416
西武ホールディングス	1.4	1.3	1,888
鴻池運輸	0.2	0.2	311
西日本鉄道	0.3	0.3	709
ハマキョウレックス	0.1	0.1	323
サカイ引越センター	0.1	0.1	437
近鉄グループホールディングス	1	1.1	4,576
阪急阪神ホールディングス	1.3	1.4	5,348
南海電気鉄道	0.5	0.5	1,375
京阪ホールディングス	0.5	0.4	1,366
名古屋鉄道	0.9	1.2	2,540
山陽電気鉄道	0.1	0.1	216
アルプス物流	0.1	0.1	132
ヤマトホールディングス	1.5	1.4	3,147
山九	0.3	0.3	1,539
丸運	0.1	0.1	22
丸全昭和運輸	0.1	0.1	314
センコーグループホールディングス	0.5	0.6	600
ニッコンホールディングス	0.3	0.3	743
福山通運	0.2	0.1	333
セイノーホールディングス	0.7	0.7	897
日立物流	0.2	0.1	890
AZ-COM丸和ホールディングス	0.2	0.3	499
C&F ロジホールディングス	0.1	0.1	125
九州旅客鉄道	0.8	0.8	2,312
SGホールディングス	1.9	2	3,986
NIPPON EXPRESSホールディン	0.4	0.4	2,980
海運業 (0.6%)			
日本郵船	0.9	2.9	9,207
商船三井	0.6	1.9	6,251
川崎汽船	0.3	0.9	2,531

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
NSユニテッド海運	—	0.1	406	
明治海運	0.1	0.1	68	
飯野海運	0.5	0.4	378	
乾汽船	—	0.1	200	
空運業 (0.5%)				
日本航空	2.4	2.6	7,134	
ANAホールディングス	2.6	2.9	8,333	
バスコ	0.1	—	—	
倉庫・運輸関連業 (0.1%)				
日新	0.1	0.1	223	
三菱倉庫	0.3	0.2	614	
三井倉庫ホールディングス	0.2	0.1	370	
住友倉庫	0.4	0.3	597	
滋澤倉庫	0.1	—	—	
東陽倉庫	0.2	0.1	27	
日本トランスシティ	0.2	0.2	105	
中央倉庫	0.1	0.1	96	
安田倉庫	0.1	0.1	95	
宇徳	0.1	—	—	
上組	0.6	0.5	1,325	
キムラユニティ	—	0.1	94	
キューソー流通システム	0.1	0.1	94	
近鉄エクスプレス	0.2	—	—	
東海運	0.1	0.1	28	
エアアイティ	0.1	0.1	149	
情報・通信業 (8.9%)				
NECネットエスアイ	0.4	0.4	663	
クロスキャット	0.1	0.1	143	
システナ	1.6	1.8	745	
デジタルアーツ	0.1	0.1	546	
日鉄ソリューションズ	0.2	0.2	661	
キューブシステム	0.1	0.1	108	
コア	0.1	—	—	
ラクーンホールディングス	0.1	0.1	118	
ソリトシステムズ	0.1	0.1	115	
T I S	1	1.2	4,476	
JNSホールディングス	0.1	—	—	
グリー	0.7	0.6	417	
コーエーテクモホールディングス	0.3	0.7	1,640	
三菱総合研究所	—	0.1	493	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ボルテージ	0.1	—	—	
AGS	0.1	—	—	
ファインデックス	0.1	0.1	52	
ブレインパッド	0.1	0.1	73	
KL a b	0.2	0.2	82	
ボルトゥウィンホールディングス	0.2	0.2	175	
ネクソン	2.4	2.8	8,736	
アイスタイル	0.3	0.3	152	
エムアップホールディングス	0.2	0.1	120	
エイチーム	0.1	0.1	78	
エニグモ	0.1	0.1	62	
テクノスジャパン	0.1	0.1	56	
e n i s h	0.1	0.1	36	
コロブラ	0.4	0.4	261	
オルトプラス	0.1	0.1	20	
ブロードリーフ	0.5	0.6	274	
クロス・マーケティンググループ	0.1	—	—	
デジタルハーツホールディングス	—	0.1	185	
システム情報	0.1	0.1	84	
じげん	0.3	0.3	114	
ブイキューブ	0.1	0.1	73	
ディー・エル・イー	0.1	0.1	26	
フィックスターズ	0.1	0.1	132	
CARTA HOLDINGS	—	0.1	167	
オブティム	0.1	0.1	115	
SHIFT	0.1	0.1	2,375	
ティールガイア	0.1	0.1	164	
テクマトリックス	0.2	0.2	326	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.3	0.3	642	
GMOペイメントゲートウェイ	0.2	0.2	2,428	
ザッパラス	0.1	—	—	
インターネットイニシアティブ	0.3	0.6	1,432	
さくらインターネット	0.2	0.1	55	
SRAホールディングス	0.1	0.1	308	
システムインテグレータ	0.1	—	—	
朝日ネット	0.1	0.1	59	
eBASE	0.1	0.2	118	
アバントグループ	0.1	0.1	141	
フリービット	0.1	0.1	109	
コムチュア	0.1	0.1	229	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アステリア	0.1	0.1	0.1	77
アイル	0.1	0.1	0.1	192
マークラインズ	0.1	0.1	0.1	269
メディカル・データ・ビジョン	0.1	0.2	0.2	198
g u m i	0.1	0.2	0.2	168
ショーケース	0.1	—	—	—
モバイルファクトリー	0.1	—	—	—
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	0.1	0.1	183
P C Iホールディングス	0.1	—	—	—
ラクス	0.4	0.5	0.5	884
ランドコンピュータ	0.1	—	—	—
オープンドア	0.1	0.1	0.1	183
マイネット	0.1	—	—	—
アカツキ	—	0.1	0.1	230
カナミックネットワーク	0.2	0.2	0.2	114
ノムラシステムコーポレーション	0.2	0.1	0.1	11
チェンジ	0.2	0.3	0.3	697
シンクロ・フード	0.1	0.1	0.1	46
オークネット	0.1	0.1	0.1	187
マクロミル	0.2	0.2	0.2	222
ニューズウェル	0.1	—	—	—
マネーフォワード	0.2	0.3	0.3	1,456
電算システムホールディングス	—	0.1	0.1	214
ソルクシーズ	0.2	0.1	0.1	35
フェイス	0.1	—	—	—
プロトコーポレーション	0.1	0.1	0.1	123
野村総合研究所	2.1	2.2	2.2	6,798
サイバネットシステム	0.1	0.1	0.1	99
C Eホールディングス	0.1	0.1	0.1	51
インテージホールディングス	0.1	0.1	0.1	154
東邦システムサイエンス	0.1	—	—	—
ソースネクスト	0.5	0.5	0.5	144
インフォコム	0.1	0.1	0.1	217
シンプレクス・ホールディングス	0.1	0.2	0.2	472
ラクスル	0.1	0.4	0.4	586
メルカリ	—	0.5	0.5	1,454
F I G	0.2	0.1	0.1	37
イーソル	0.1	0.1	0.1	79
アルテリア・ネットワークス	0.1	0.1	0.1	124
ウイングアーク1 s t	0.1	0.1	0.1	198

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
S a n s a n	0.4	0.4	0.4	656
ギフティ	0.1	0.1	0.1	223
メドレー	—	0.1	0.1	461
J M D C	0.1	0.2	0.2	858
フォーカスシステムズ	0.1	0.1	0.1	106
クレスコ	0.1	0.1	0.1	184
フジ・メディア・ホールディングス	1	1	1	1,081
オービック	0.3	0.4	0.4	8,232
ジャストシステム	0.2	0.2	0.2	641
T D C ソフト	0.1	0.1	0.1	159
Zホールディングス	15.7	15.3	15.3	5,650
トレンドマイクロ	0.6	0.6	0.6	3,756
I Dホールディングス	0.1	0.1	0.1	98
日本オラル	0.2	0.2	0.2	1,780
フューチャー	0.3	0.3	0.3	498
C A C H o l d i n g s	0.1	0.1	0.1	145
トーセ	0.1	—	—	—
オービックビジネスコンサルタント	0.1	0.2	0.2	997
伊藤忠テクノソリューションズ	0.5	0.6	0.6	1,872
アイティフォー	0.1	0.1	0.1	86
エクスネット	0.1	—	—	—
大塚商会	0.6	0.6	0.6	2,586
サイボウズ	0.1	0.1	0.1	271
電通国際情報サービス	0.2	0.1	0.1	424
A C C E S S	0.1	0.1	0.1	97
デジタルガレージ	0.2	0.2	0.2	915
E M システムズ	0.2	0.2	0.2	182
C I J	0.1	0.1	0.1	102
日本エンタープライズ	0.2	0.1	0.1	13
W O W O W	0.1	0.1	0.1	125
スカラ	0.1	0.1	0.1	72
インテリジェント ウェイブ	0.1	0.1	0.1	78
I M A G I C A G R O U P	0.2	0.1	0.1	66
ネットワンシステムズ	0.4	0.4	0.4	1,394
システムソフト	0.3	0.4	0.4	36
アルゴグラフィックス	0.1	0.1	0.1	393
マーベラス	0.2	0.2	0.2	137
エイベックス	0.2	0.2	0.2	352
B I P R O G Y	0.3	0.4	0.4	1,320
兼松エレクトロニクス	0.1	0.1	0.1	618

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
都築電気	0.1	0.1	0.1	132
TBSホールディングス	0.7	0.5	0.5	761
日本テレビホールディングス	0.9	0.9	0.9	939
朝日放送グループホールディングス	0.1	0.1	0.1	64
テレビ朝日ホールディングス	0.3	0.3	0.3	399
スカパーJ SATホールディングス	1	1	1	494
テレビ東京ホールディングス	0.1	0.1	0.1	196
日本BS放送	0.1	—	—	—
ビジョン	0.2	0.1	0.1	141
スマートバリュー	0.1	—	—	—
USEN-NEXT HOLDINGS	0.1	0.1	0.1	225
ワイヤレスゲート	0.1	—	—	—
コネクシオ	0.1	0.1	0.1	191
日本通信	0.9	1	1	221
クロップス	0.1	—	—	—
日本電信電話	11.3	13.7	13.7	53,238
KDDI	7.9	8.3	8.3	33,515
ソフトバンク	16.4	17.2	17.2	25,550
光通信	0.1	0.1	0.1	1,852
エムティーアイ	0.1	0.1	0.1	50
GMOインターネットグループ	0.4	0.4	0.4	1,031
ファイバーゲート	—	0.1	0.1	92
アイドママーケティングコミュニケーション	0.1	—	—	—
KADOKAWA	0.6	0.6	0.6	1,438
学研ホールディングス	0.2	0.2	0.2	194
ゼンリン	0.2	0.2	0.2	167
昭文社ホールディングス	0.1	—	—	—
インプレスホールディングス	0.2	0.1	0.1	20
アイネット	0.1	0.1	0.1	128
松竹	0.1	0.1	0.1	1,092
東宝	0.6	0.7	0.7	3,335
エヌ・ティ・ティ・データ	2.9	3.4	3.4	6,769
ピー・シー・エー	0.1	0.1	0.1	121
DTS	0.2	0.2	0.2	631
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.5	0.5	0.5	3,030
シーイーシー	0.1	0.2	0.2	307
カブコン	1	1.1	1.1	4,576
アイ・エス・ピー	0.1	0.1	0.1	120
ジャステック	0.1	0.1	0.1	121
CS SK	0.7	0.9	0.9	1,766

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アイネス	0.1	0.1	0.1	133
T KC	0.2	0.2	0.2	734
富士ソフト	0.1	0.1	0.1	754
NSD	0.3	0.4	0.4	893
コナミグループ	0.4	0.5	0.5	3,155
福井コンピュータホールディングス	—	0.1	0.1	297
J BCCホールディングス	0.1	0.1	0.1	199
ミロク情報サービス	0.1	0.1	0.1	164
ソフトバンクグループ	6.5	6.2	6.2	38,774
卸売業 (5.9%)				
高千穂交易	0.1	—	—	—
エレマテック	0.1	0.1	0.1	167
あらた	0.1	0.1	0.1	417
円谷フィールドホールディングス	0.1	0.1	0.1	268
双日	1.2	1.2	1.2	3,103
アルフレッサ ホールディングス	1.2	1.1	1.1	1,765
横浜冷凍	0.3	0.3	0.3	324
ラサ商事	0.1	0.1	0.1	121
アルコニックス	0.1	0.1	0.1	139
神戸物産	0.8	0.9	0.9	3,402
あい ホールディングス	0.2	0.2	0.2	432
ダイワボウホールディングス	0.5	0.5	0.5	970
マクニカホールディングス	0.3	0.3	0.3	1,041
バイタルケーエスケー・ホールディングス	0.2	0.2	0.2	167
八洲電機	0.1	0.1	0.1	109
メディアスホールディングス	0.1	0.1	0.1	73
レスターホールディングス	0.1	0.1	0.1	223
大光	0.1	—	—	—
TOKAI ホールディングス	0.5	0.6	0.6	516
三洋貿易	0.1	0.1	0.1	115
ウイン・パートナーズ	0.1	0.1	0.1	100
シップヘルスケアホールディングス	0.3	0.4	0.4	997
コメダホールディングス	0.2	0.3	0.3	717
富士興産	0.1	—	—	—
フルサト・マルカホールディングス	0.1	0.1	0.1	349
ヤマエグループホールディングス	0.1	0.1	0.1	143
小野建	0.1	0.1	0.1	154
佐島電機	0.1	0.1	0.1	141
エコートレーディング	0.1	—	—	—
伯東	0.1	0.1	0.1	468

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
コンドーテック	0.1	0.1	101	
中山福	0.1	0.1	33	
ナガイレーベン	0.1	0.1	194	
三菱食品	0.1	0.1	311	
松田産業	0.1	0.1	240	
第一興商	0.2	0.2	794	
メディバルホールディングス	1.2	1.2	2,056	
S P K	—	0.1	151	
アズワン	0.2	0.2	1,174	
シモジマ	0.1	0.1	95	
ドウシシャ	0.1	0.1	183	
高速	0.1	0.1	191	
丸文	0.1	0.1	124	
ハビネット	0.1	0.1	205	
日本ライフライン	0.3	0.3	282	
タカショー	0.1	0.1	70	
I D O M	0.3	0.3	251	
進和	0.1	0.1	209	
エスケイジャパン	0.1	—	—	
シークス	0.2	0.2	284	
田中商事	0.1	—	—	
オーハシテクニカ	0.1	0.1	149	
伊藤忠商事	7.6	7	29,232	
丸紅	10.6	8.9	14,266	
長瀬産業	0.6	0.5	1,036	
蝶理	0.1	0.1	233	
豊田通商	1.1	1	5,520	
三共生興	0.2	0.2	96	
兼松	0.5	0.4	626	
三井物産	8.4	8.3	32,071	
日本紙バルブ商事	0.1	0.1	546	
カメイ	0.2	0.1	145	
スターゼン	0.1	0.1	214	
山善	0.5	0.3	317	
住友商事	6.8	7	16,296	
三菱商事	8.2	7.1	30,977	
キャノンマーケティングジャパン	0.3	0.3	925	
西華産業	0.1	—	—	
佐藤商事	0.1	0.1	132	
菱洋エレクトロ	0.1	0.1	233	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
東京産業	0.1	0.1	77	
ユアサ商事	0.1	0.1	363	
トルク	0.1	0.1	21	
阪和興業	0.2	0.2	835	
正栄食品工業	0.1	0.1	413	
カナデン	0.1	0.1	112	
菱電商事	0.1	0.1	178	
岩谷産業	0.3	0.3	1,674	
ナイス	0.1	—	—	
極東貿易	—	0.1	140	
アステナホールディングス	0.2	0.2	83	
三愛オブリ	0.3	0.3	402	
稲畑産業	0.3	0.2	500	
G S I クレオス	0.1	0.1	153	
明和産業	0.1	0.2	139	
ワキタ	0.2	0.2	240	
東邦ホールディングス	0.3	0.3	628	
サンゲツ	0.3	0.3	674	
ミツウロコグループホールディングス	0.2	0.1	116	
伊藤忠エネクス	0.2	0.3	325	
サンリオ	0.3	0.3	1,477	
サンワテクノス	0.1	0.1	189	
リョーサン	0.1	0.1	292	
新光商事	0.2	0.2	267	
三信電気	0.1	—	—	
東陽テクニカ	0.1	0.1	135	
モスフードサービス	0.1	0.2	612	
加賀電子	0.1	0.1	435	
ソーダニッカ	0.1	0.1	75	
立花エレテック	0.1	0.1	183	
フォーバル	0.1	—	—	
P A L T A C	0.2	0.2	996	
三谷産業	0.1	0.2	63	
太平洋興発	0.1	—	—	
コーア商事ホールディングス	0.1	0.1	64	
K P P グループホールディングス	0.3	0.3	273	
ヤマタネ	0.1	—	—	
日鉄物産	0.1	0.1	924	
泉州電業	—	0.1	347	
トラスコ中山	0.2	0.2	419	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
オートバックスセブン	0.4	0.4	0.4	572
モリト	0.1	0.1	0.1	95
加藤産業	0.2	0.1	0.1	357
イノテック	0.1	—	—	—
イエローハット	0.2	0.2	0.2	347
J Kホールディングス	0.1	0.1	0.1	105
日伝	0.1	0.1	0.1	181
北沢産業	0.1	0.1	0.1	22
杉本商事	0.1	0.1	0.1	198
因幡電機産業	0.3	0.3	0.3	831
ミスミグループ本社	1.4	1.7	1.7	5,601
アルテック	0.1	0.1	0.1	27
スズケン	0.4	0.4	0.4	1,360
ジェコス	0.1	0.1	0.1	85
グローセル	0.1	0.1	0.1	40
小売業 (4.7%)				
ローソン	0.2	0.3	0.3	1,551
サンエー	0.1	0.1	0.1	414
カワチ薬品	—	0.1	0.1	223
エービーシー・マート	0.2	0.2	0.2	1,400
アスクル	0.1	0.3	0.3	507
ゲオホールディングス	0.1	0.1	0.1	186
アダストリア	0.1	0.1	0.1	215
ジーフット	0.1	0.1	0.1	30
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	0.1	—	—	—
くら寿司	0.1	0.1	0.1	301
キャンドウ	0.1	—	—	—
バルグループホールディングス	0.1	0.1	0.1	281
エディオン	0.4	0.4	0.4	507
サーラコーポレーション	0.2	0.2	0.2	149
ワッツ	0.1	0.1	0.1	69
ハローズ	—	0.1	0.1	313
フジオフードグループ本社	0.1	0.1	0.1	140
ひらまつ	0.2	0.2	0.2	37
ハニースホールディングス	0.1	0.1	0.1	149
アルペン	0.1	0.1	0.1	195
クオールホールディングス	0.1	0.2	0.2	238
ジンズホールディングス	0.1	0.1	0.1	387
ビックカメラ	0.6	0.8	0.8	968
DCMホールディングス	0.6	0.7	0.7	821

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
MonotaRO	1.3	1.6	1.6	3,174
DDホールディングス	0.1	0.1	0.1	80
アーランドサービスホールディングス	—	0.1	0.1	215
J. フロント リテイリング	1.2	1.4	1.4	1,689
ドトール・日レスホールディングス	0.1	0.2	0.2	372
マツキヨココカラ&カンパニー	0.7	0.7	0.7	4,522
ブロンコビリー	0.1	0.1	0.1	245
ZOZO	0.7	0.7	0.7	2,243
物語コーポレーション	0.1	0.1	0.1	649
三越伊勢丹ホールディングス	1.8	1.9	1.9	2,648
マーケットエンタープライズ	0.1	—	—	—
ウエルシアホールディングス	0.5	0.6	0.6	1,746
クリエイトSDホールディングス	0.2	0.2	0.2	708
丸善CHIホールディングス	0.1	0.1	0.1	34
エー・ピーホールディングス	0.1	—	—	—
シュッピン	0.1	0.1	0.1	108
オイシックス・ラ・大地	0.1	0.2	0.2	438
ネクステージ	0.2	0.3	0.3	906
ジョイフル本田	0.3	0.4	0.4	744
ホットランド	0.1	0.1	0.1	141
すかいらくホールディングス	1.3	1.5	1.5	2,302
SFPホールディングス	0.1	0.1	0.1	179
綿半ホールディングス	0.1	0.1	0.1	140
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	0.3	0.4	0.4	451
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.1	0.1	0.1	116
BEENOS	0.1	0.1	0.1	212
あさひ	0.1	0.1	0.1	137
日本調剤	0.1	0.1	0.1	118
コスモス薬品	0.1	0.1	0.1	1,275
トーエル	0.1	—	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	4.2	3.9	3.9	23,751
クリエイト・レストランツ・ホールディング	0.5	0.9	0.9	896
ツルハホールディングス	0.2	0.3	0.3	2,913
サンマルクホールディングス	0.1	0.1	0.1	174
トリドールホールディングス	0.2	0.3	0.3	839
TOKYO BASE	0.1	0.1	0.1	41
JMホールディングス	0.1	0.1	0.1	183
サツドラホールディングス	—	0.1	0.1	79
アレンザホールディングス	0.1	0.1	0.1	103
パロックジャパンリミテッド	0.1	0.1	0.1	85

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クスリのアオキホールディングス	0.1	0.1	745
力の源ホールディングス	0.1	0.1	115
FOOD & LIFE COMPANIE	0.6	0.6	1,756
メディカルシステムネットワーク	0.1	0.1	40
はるやまホールディングス	0.1	—	—
ノジマ	0.1	0.4	528
カッパ・クリエイト	0.1	0.2	281
ライトオン	0.1	0.1	58
良品計画	1.2	1.5	2,119
バリミキホールディングス	0.1	0.1	27
アドヴァングループ	0.1	0.1	88
コナカ	0.1	0.1	34
G-7ホールディングス	0.1	0.1	150
イオン北海道	0.1	0.2	183
コジマ	0.2	0.2	112
コーナン商事	0.2	0.2	661
ワタミ	0.1	0.1	97
パン・パシフィック・インターナショナルホ	2.1	2.5	6,010
西松屋チェーン	0.2	0.3	463
ゼンショーホールディングス	0.5	0.6	1,983
幸楽苑ホールディングス	0.1	0.1	108
サイゼリヤ	0.2	0.2	635
V Tホールディングス	0.4	0.4	200
ポブラ	0.1	—	—
フジ・コーポレーション	0.1	0.1	133
ユナイテッドアローズ	0.1	0.1	174
ハイデイ日高	0.1	0.2	413
YU-WA Creation Holdi	0.1	0.1	20
コロワイド	0.4	0.5	918
ピーシーデポコーポレーション	0.1	0.1	29
老番屋	0.1	0.1	468
スキホールディングス	0.2	0.2	1,148
薬王堂ホールディングス	0.1	0.1	258
スクロール	0.2	0.2	156
ヨンドシーホールディングス	—	0.1	179
木曽路	0.1	0.2	424
SRSホールディングス	0.1	0.2	177
千趣会	0.2	0.2	79
タカキュー	0.1	0.1	7
リテールパートナーズ	0.1	0.2	270

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ケーヨー	0.2	0.2	177
上新電機	0.1	0.1	195
日本瓦斯	0.5	0.6	1,173
ロイヤルホールディングス	0.1	0.2	485
いなげや	0.1	0.1	127
チヨダ	0.1	0.1	79
ライフコーポレーション	0.1	0.1	282
リンガーハット	0.1	0.1	224
MrMaxHD	0.1	0.2	134
テンアライド	0.1	0.1	27
AOKIホールディングス	0.2	0.2	136
オークワ	0.2	0.2	185
コメリ	0.2	0.2	519
青山商事	0.2	0.2	184
しまむら	0.1	0.1	1,236
はせがわ	0.1	0.1	35
高島屋	0.7	0.9	1,621
松屋	0.2	0.2	224
エイチ・ツー・オー リテイリング	0.5	0.6	753
丸井グループ	0.8	0.8	1,736
アクシアル リテイリング	0.1	0.1	350
井筒屋	0.1	0.1	34
イオン	4.1	3.8	10,064
イズミ	0.2	0.2	582
平和堂	0.2	0.2	429
フジ	0.1	0.2	369
ヤオコー	0.1	0.1	670
ゼビオホールディングス	0.1	0.2	185
ケーズホールディングス	0.9	0.9	1,016
Olympicグループ	0.1	—	—
日産東京販売ホールディングス	0.2	0.1	31
Genky DrugStores	—	0.1	431
ブックオフグループホールディングス	0.1	0.1	129
アインホールディングス	0.2	0.2	1,104
ヤマダホールディングス	3.9	4.6	2,148
アークランズ	0.1	0.2	287
ニトリホールディングス	0.5	0.5	8,512
グルメ杵屋	0.1	0.1	101
愛眼	0.1	0.1	16
ケーユーホールディングス	0.1	0.1	143

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
吉野家ホールディングス	0.4	0.4		954
松屋フーズホールディングス	0.1	0.1		400
サガミホールディングス	0.1	0.2		248
関西フードマーケット	0.1	0.1		134
王将フードサービス	0.1	0.1		601
ブレナス	0.1	—		—
ミニストップ	0.1	0.1		141
アークス	0.2	0.2		436
パローホールディングス	0.2	0.2		372
ベルク	—	0.1		557
大庄	0.1	0.1		105
ファーストリテイリング	0.2	0.2	15,598	
サンドラッグ	0.4	0.4	1,474	
サックスパー ホールディングス	0.1	0.1	75	
ペルーナ	0.2	0.3	208	
銀行業 (6.5%)				
いよぎんホールディングス	—	1.3	932	
しずおかフィナンシャルグループ	—	2.4	2,637	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	—	0.9	841	
じもとホールディングス	0.1	0.1	44	
めぶきフィナンシャルグループ	5.6	5.2	1,736	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	0.1	0.1	289	
九州フィナンシャルグループ	2.2	1.9	898	
ゆうちょ銀行	2.6	3	3,474	
富山第一銀行	0.3	0.3	191	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	6.2	5.8	3,271	
西日本フィナンシャルホールディングス	0.7	0.7	739	
三十三フィナンシャルグループ	0.1	0.1	166	
第四北越フィナンシャルグループ	0.2	0.2	602	
ひろぎんホールディングス	1.6	1.4	935	
おきなわフィナンシャルグループ	0.1	0.1	237	
十六フィナンシャルグループ	0.1	0.1	305	
北國フィナンシャルホールディングス	0.1	0.1	408	
プロクレアホールディングス	—	0.1	232	
あいちフィナンシャルグループ	—	0.1	228	
SBI新生銀行	0.7	0.3	720	
あおぞら銀行	0.6	0.7	1,799	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	68	66.8	63,359	
りそなホールディングス	12.4	13.4	9,514	
三井住友トラスト・ホールディングス	2.1	1.9	8,956	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
三井住友フィナンシャルグループ	7.5	7.7	43,728	
千葉銀行	3.6	2.9	2,810	
群馬銀行	2.1	2	1,002	
武蔵野銀行	0.2	0.1	225	
千葉興業銀行	0.3	0.2	100	
筑波銀行	0.4	0.5	122	
七十七銀行	0.3	0.3	677	
青森銀行	0.1	—	—	
秋田銀行	0.1	0.1	186	
山形銀行	0.1	0.1	125	
岩手銀行	0.1	0.1	217	
東邦銀行	0.9	0.8	192	
東北銀行	0.1	0.1	103	
みちのく銀行	0.1	—	—	
ふくおかフィナンシャルグループ	0.9	0.8	2,357	
静岡銀行	2.6	—	—	
スルガ銀行	1	0.9	378	
八十二銀行	2.4	2.2	1,236	
山梨中央銀行	0.1	0.1	121	
大垣共立銀行	0.2	0.2	383	
福井銀行	0.1	0.1	165	
滋賀銀行	0.2	0.2	540	
南都銀行	0.2	0.2	533	
百五銀行	1	1	408	
京都銀行	0.4	0.3	1,839	
紀陽銀行	0.4	0.4	647	
ほくほくフィナンシャルグループ	0.7	0.7	700	
山陰合同銀行	0.6	0.7	562	
中国銀行	0.9	—	—	
伊予銀行	1.4	—	—	
百十四銀行	0.1	0.1	201	
四国銀行	0.2	0.2	196	
阿波銀行	0.2	0.2	425	
大分銀行	0.1	0.1	218	
宮崎銀行	0.1	0.1	265	
佐賀銀行	0.1	0.1	184	
琉球銀行	0.2	0.2	190	
セブン銀行	3.2	3.8	1,007	
みずほフィナンシャルグループ	13.9	15.2	31,000	
山口フィナンシャルグループ	1.3	1.2	1,062	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
名古屋銀行	0.1	0.1	0.1	354
北洋銀行	1.6	1.6	1.6	449
愛媛銀行	0.2	0.1	0.1	96
京葉銀行	0.5	0.5	0.5	305
栃木銀行	0.5	0.5	0.5	154
東和銀行	0.2	0.2	0.2	123
福島銀行	0.2	0.1	0.1	26
大東銀行	0.1	—	—	—
トモニホールディングス	0.8	0.9	0.9	354
フィデアホールディングス	0.1	0.1	0.1	147
池田泉州ホールディングス	1.2	1.3	1.3	323
証券、商品先物取引業 (0.8%)				
F P G	0.4	0.4	0.4	491
ジャパンインベストメントアドバイザー	0.1	0.1	0.1	108
マーキュリアホールディングス	—	0.1	0.1	71
S B I ホールディングス	1.3	1.5	1.5	4,101
日本アジア投資	0.1	0.1	0.1	23
ジャフコ グループ	0.3	0.4	0.4	900
大和証券グループ本社	8.2	7.5	7.5	4,552
野村ホールディングス	16.6	19.4	19.4	9,913
岡三証券グループ	0.9	0.9	0.9	370
丸三証券	0.3	0.4	0.4	169
東洋証券	0.4	0.3	0.3	82
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1.2	1.1	1.1	407
水戸証券	0.3	0.3	0.3	88
いちよし証券	0.3	0.2	0.2	123
松井証券	0.6	0.6	0.6	463
マネックスグループ	0.9	1.2	1.2	562
極東証券	0.2	0.1	0.1	59
岩井コスモホールディングス	0.1	0.1	0.1	132
アイザワ証券グループ	0.2	0.2	0.2	141
マネーパートナーズグループ	0.2	0.1	0.1	26
スパークス・グループ	0.5	0.1	0.1	176
保険業 (2.4%)				
かんぽ生命保険	1.1	1.3	1.3	3,031
S O M P O ホールディングス	1.8	1.8	1.8	10,112
アニコム ホールディングス	0.3	0.4	0.4	243
MS&ADインシュアランスグループホール	2.4	2.1	2.1	8,824
第一生命ホールディングス	5.3	5.4	5.4	16,534
東京海上ホールディングス	3.6	10.6	10.6	29,160

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
T & Dホールディングス	2.8	2.8	2.8	5,832
アドバンスクリエイト	0.1	0.1	0.1	112
その他金融業 (1.1%)				
全国保証	0.3	0.3	0.3	1,480
あんしん保証	0.1	0.1	0.1	27
日本モーゲージサービス	0.1	0.1	0.1	88
アルヒ	0.2	0.1	0.1	104
プレミアグループ	0.1	0.2	0.2	316
ネットプロテクションズホールディングス	—	0.3	0.3	181
クレディセゾン	0.7	0.7	0.7	1,177
芙蓉総合リース	0.1	0.1	0.1	878
みずほリース	0.2	0.2	0.2	681
東京センチュリー	0.2	0.2	0.2	899
日本証券金融	0.4	0.4	0.4	462
アイフル	1.8	1.7	1.7	657
リコーリース	0.1	0.1	0.1	382
イオンフィナンシャルサービス	0.6	0.6	0.6	781
アコム	2.1	1.9	1.9	600
ジャックス	0.1	0.1	0.1	412
オリエントコーポレーション	2.9	0.3	0.3	336
オリックス	6.5	7	7	15,872
三菱HCキャピタル	4	4.1	4.1	2,710
九州リースサービス	0.1	—	—	—
日本取引所グループ	2.7	3	3	5,821
イー・ギャランティ	0.2	0.2	0.2	479
アサックス	0.2	—	—	—
NECキャピタルソリューション	—	0.1	0.1	245
不動産業 (1.9%)				
大東建託	—	0.4	0.4	5,008
いちご	1.2	1.2	1.2	350
日本駐車場開発	1.2	1.3	1.3	348
スター・マイカ・ホールディングス	0.1	0.1	0.1	67
S R E ホールディングス	—	0.1	0.1	338
A D ワークスグループ	0.2	0.3	0.3	44
ヒューリック	2.6	2.5	2.5	2,662
三栄建築設計	—	0.1	0.1	148
野村不動産ホールディングス	0.6	0.7	0.7	1,993
三重交通グループホールディングス	0.2	0.2	0.2	99
サムティ	0.2	0.2	0.2	406
ディア・ライフ	0.2	0.2	0.2	125

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
地主	0.1	0.1	0.1	184
プレサンスコーポレーション	0.2	0.1	0.1	165
JPMC	0.1	0.1	0.1	100
フージャースホールディングス	0.1	0.2	0.2	158
オープンハウスグループ	0.4	0.4	0.4	1,936
東急不動産ホールディングス	3.2	3.2	3.2	2,067
飯田グループホールディングス	0.9	0.9	0.9	1,915
ムゲンエステート	0.1	0.1	0.1	49
ビーロット	0.1	0.1	0.1	53
And Doホールディングス	0.1	0.1	0.1	83
ケイアイスター不動産	—	0.1	0.1	483
グッドコムアセット	0.1	0.1	0.1	79
パーク24	0.6	0.8	0.8	1,751
三井不動産	4.9	4.6	4.6	11,145
三菱地所	7.1	6.4	6.4	10,656
平和不動産	0.2	0.2	0.2	707
東京建物	1.1	1	1	1,589
ダイビル	0.3	—	—	—
京阪神ビルディング	0.2	0.1	0.1	133
住友不動産	2.3	1.9	1.9	5,937
テーオーシー	0.2	0.2	0.2	133
レオバレス21	1.1	1.2	1.2	384
スターツコーポレーション	0.1	0.2	0.2	507
フジ住宅	0.1	0.1	0.1	68
空港施設	0.1	0.1	0.1	51
明和地所	0.1	0.1	0.1	86
ゴールドクレスト	0.1	0.1	0.1	161
日神グループホールディングス	0.2	0.2	0.2	91
日本エスコン	0.2	0.2	0.2	165
MIRARTHホールディングス	0.5	0.5	0.5	192
AVANTIA	0.1	0.1	0.1	79
イオンモール	0.6	0.5	0.5	908
カチタス	0.3	0.3	0.3	940
トーセイ	0.1	0.2	0.2	296
穴吹興産	0.1	—	—	—
サンフロンティア不動産	0.1	0.2	0.2	220
FJネクストホールディングス	0.1	0.1	0.1	100
ランドビジネス	0.1	—	—	—
グランディハウス	0.1	0.1	0.1	58
日本空港ビルデング	0.4	0.4	0.4	2,668

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
サービス業 (5.3%)				
明豊ファシリティワークス	0.1	0.1	0.1	73
日本工営	0.1	0.1	0.1	352
LIFULL	0.3	0.4	0.4	89
MIXI	0.2	0.3	0.3	741
ジェイエイシーリクルートメント	0.1	0.1	0.1	239
日本M&Aセンターホールディングス	1.7	1.9	1.9	2,597
UTグループ	0.2	0.2	0.2	527
E・Jホールディングス	0.1	0.1	0.1	132
オープンアップグループ	0.3	0.4	0.4	767
コシダカホールディングス	0.3	0.3	0.3	281
パソナグループ	0.1	0.1	0.1	211
リンクアンドモチベーション	0.2	0.3	0.3	196
エス・エム・エス	0.4	0.4	0.4	1,386
サニーサイドアップグループ	0.1	—	—	—
パーソルホールディングス	1.1	1.2	1.2	3,433
リニカル	0.1	0.1	0.1	72
クックパッド	0.3	0.3	0.3	64
エスクリ	0.1	—	—	—
アイ・ケイ・ケイホールディングス	0.1	0.1	0.1	63
スタジオアリス	0.1	0.1	0.1	212
シミックホールディングス	0.1	0.1	0.1	175
総合警備保障	0.4	0.4	0.4	1,452
カカコム	0.8	0.8	0.8	1,748
セントケア・ホールディング	0.1	0.1	0.1	82
ルネサンス	0.1	0.1	0.1	92
ディップ	0.2	0.2	0.2	781
デジタルホールディングス	0.1	0.1	0.1	125
新日本科学	0.2	0.1	0.1	218
キャリアデザインセンター	0.1	—	—	—
ベネフィット・ワン	0.4	0.5	0.5	1,154
エムスリー	1.9	2.2	2.2	7,733
ツカダ・グローバルホールディング	0.1	0.1	0.1	38
アウトソーシング	0.6	0.7	0.7	698
ウェルネット	0.1	0.1	0.1	60
ディー・エヌ・エー	0.4	0.5	0.5	901
博報堂DYホールディングス	1.5	1.4	1.4	1,943
ぐるなび	0.2	0.2	0.2	79
タカミヤ	0.1	0.1	0.1	38
ジャパンベสต์レスキューシステム	0.1	0.1	0.1	82

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ファンコミュニケーションズ	0.3	0.2	83	
ビジネス・ブレイクスルー	0.1	—	—	
エスプール	0.3	0.3	231	
WDBホールディングス	—	0.1	214	
ティア	0.1	0.1	42	
アドウェイズ	0.2	0.2	102	
バリューコマース	0.1	0.1	186	
インフォマート	1.2	1.1	462	
J Pホールディングス	0.3	0.3	100	
プレステージ・インターナショナル	0.4	0.5	359	
アミューズ	0.1	0.1	172	
クイック	0.1	0.1	190	
TAC	0.1	0.1	20	
電通グループ	1.1	1.1	4,543	
テイクアンドキッズ・ニューズ	0.1	—	—	
シーティーエス	0.1	0.1	82	
H. U. グループホールディングス	0.3	0.3	825	
アルプス技研	0.1	0.1	219	
日本空調サービス	0.1	0.1	70	
オリエンタルランド	1.2	1.2	25,872	
ダスキン	0.2	0.2	597	
明光ネットワークジャパン	0.1	0.1	61	
ファルコホールディングス	0.1	—	—	
秀英予備校	0.1	—	—	
ラウンドワン	0.3	0.9	429	
リゾートトラスト	0.5	0.4	946	
ビー・エム・エル	0.1	0.1	321	
りらいあコミュニケーションズ	0.2	0.2	291	
リゾー教育	0.5	0.5	179	
早稲田アカデミー	0.1	0.1	116	
ユー・エス・エス	1.2	1.1	2,341	
東京個別指導学院	0.1	0.1	54	
サイバーエージェント	2.6	2.6	3,130	
楽天グループ	5.4	5.1	3,401	
クリーク・アンド・リバー社	0.1	0.1	218	
モーニングスター	0.2	0.2	92	
テー・オー・ダブリュ	0.2	0.2	58	
山田コンサルティンググループ	0.1	0.1	115	
フルキャストホールディングス	0.1	0.1	280	
エン・ジャパン	0.2	0.2	494	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
テクノプロ・ホールディングス	0.6	0.7	2,849	
アトラグループ	0.1	—	—	
アイ・アールジャパンホールディングス	—	0.1	183	
Ke e P e r 技研	0.1	0.1	328	
Gun o s y	0.1	0.1	65	
デザインワン・ジャパン	0.1	—	—	
リブセンス	0.1	0.1	33	
ジャパンマテリアル	0.3	0.3	712	
ベクトル	0.1	0.2	251	
ウチヤマホールディングス	0.1	—	—	
チャーム・ケア・コーポレーション	0.1	0.1	117	
I B J	0.1	0.1	100	
アサンテ	—	0.1	164	
バリューHR	—	0.1	170	
M&Aキャピタルパートナーズ	0.1	0.1	384	
ER I ホールディングス	0.1	—	—	
シグマクス・ホールディングス	0.1	0.2	272	
ウィルグループ	0.1	0.1	122	
エスクロー・エージェント・ジャパン	0.2	0.1	15	
メドピア	0.1	0.1	145	
レアジョブ	0.1	—	—	
リクルートホールディングス	8.1	8.1	34,497	
エラン	0.1	0.1	99	
土木管理総合試験所	0.1	—	—	
ネットマーケティング	0.1	—	—	
日本郵政	13.7	14.4	16,459	
ベルシステム24ホールディングス	0.2	0.1	147	
鎌倉新書	0.1	0.1	110	
エアトリ	0.1	0.1	266	
アトラエ	0.1	0.1	127	
ストライク	—	0.1	394	
ソラスト	0.3	0.3	201	
インソース	0.1	0.3	447	
ペイカレント・コンサルティング	0.1	0.9	4,950	
アイモバイル	—	0.1	125	
キャリアインデックス	0.1	—	—	
ジャパンエレベーターサービスホールディン	0.3	0.4	726	
ウエルビー	0.1	0.1	66	
ミダックホールディングス	—	0.1	288	
日総工産	0.1	0.1	58	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
キュービーネットホールディングス	—	0.1	0.1	150
RPAホールディングス	0.1	0.1	0.1	30
スプリックス	0.1	—	—	—
マネジメントソリューションズ	0.1	0.1	0.1	341
カープスホールディングス	0.3	0.3	0.3	246
フォーラムエンジニアリング	0.1	0.1	0.1	88
ダイレクトマーケティングミックス	0.2	0.1	0.1	161
LITALICO	0.1	0.1	0.1	271
アドバンテッジリスクマネジメント	0.1	—	—	—
リログループ	0.6	0.6	0.6	1,311
東祥	0.1	0.1	0.1	121
TREホールディングス	0.1	0.2	0.2	291
エイチ・アイ・エス	0.2	0.3	0.3	631
共立メンテナンス	0.2	0.2	0.2	1,176
イチネンホールディングス	0.1	0.1	0.1	128
建設技術研究所	0.1	0.1	0.1	330
スペース	0.1	0.1	0.1	93
燦ホールディングス	0.1	—	—	—
東京都競馬	0.1	0.1	0.1	386
カナモト	0.2	0.2	0.2	443
西尾レントオール	0.1	0.1	0.1	308
トランス・コスモス	0.1	0.1	0.1	317

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
乃村工藝社	0.5	0.5	0.5	461
藤田観光	0.1	—	—	—
KNT-CTホールディングス	0.1	0.1	0.1	169
日本管財	0.1	0.1	0.1	252
トーカイ	0.1	0.1	0.1	194
セコム	1	1.1	1.1	8,409
セントラル警備保障	0.1	0.1	0.1	264
丹青社	0.2	0.2	0.2	142
メイテック	0.1	0.4	0.4	978
応用地質	0.1	0.1	0.1	200
船井総研ホールディングス	0.2	0.2	0.2	553
進学会ホールディングス	0.1	—	—	—
オオバ	0.1	0.1	0.1	71
ベネッセホールディングス	0.4	0.4	0.4	787
イオンディライト	0.1	0.1	0.1	305
ナック	0.1	—	—	—
ダイセキ	0.2	0.2	0.2	868
合 計	株 数 ・ 金 額	1,204	1,236	3,043,843
	銘柄数<比率>	1,693	1,601	<97.4%>

*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。

*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。

*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国 内	株式先物取引	ミニTOPIX	百万円 76	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

(2023年2月1日現在)

○投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,043,843	97.4
コール・ローン等、その他	81,823	2.6
投資信託財産総額	3,125,666	100.0

*金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2月1日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,125,666,424
コール・ローン等	73,571,476
株式(評価額)	3,043,843,930
未収入金	1,731,420
未収配当金	5,213,308
差入委託証拠金	1,306,290
(B) 負債	29
未払利息	29
(C) 純資産総額(A-B)	3,125,666,395
元本	1,551,182,146
次期繰越損益金	1,574,484,249
(D) 受益権総口数	1,551,182,146口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,150円

(注) 期首元本額は1,590,466,586円、期中追加設定元本額は327,380,595円、期中一部解約元本額は366,665,035円、1口当たり純資産額は2,0150円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額
 ・財形株投(一般財形50) 786,615,008円
 ・財形株投(年金・住宅財形30) 385,099,234円
 ・財形株投(一般財形30) 379,467,904円

○損益の状況 (2022年2月2日～2023年2月1日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	79,425,772
受取配当金	79,419,468
その他収益金	27,608
支払利息	△ 21,304
(B) 有価証券売買損益	124,704,607
売買益	277,589,892
売買損	△ 152,885,285
(C) 先物取引等取引損益	23,707,409
取引益	34,046,733
取引損	△ 10,339,324
(D) 当期損益金(A+B+C)	227,837,788
(E) 前期繰越損益金	1,405,262,021
(F) 追加信託差損益金	293,919,405
(G) 解約差損益金	△ 352,534,965
(H) 計(D+E+F+G)	1,574,484,249
次期繰越損益金(H)	1,574,484,249

*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。

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

*損益の状況の中で(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。

○お知らせ

投資信託約款に記載されている市場の名称が廃止となることに伴う所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日：2022年4月4日>