

財形株投

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21期(決算日2015年2月2日)

作成対象期間 (2014年2月4日～2015年2月2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	東京証券取引所第1部上場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

東京都中央区日本橋1-12-1



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)	税金	期中	東証株価指数	期中	NOMURA-	期中	コール					
	分配金	騰落率	(TOPIX)	騰落率	BPI総合中期	騰落率	収益率	収益率					
17期(2011年2月1日)	円 8,131	円 5	% 0.9	913.52	% 1.7	322.47	% 1.1	% 0.1	47.8	% 0.2	% 46.5	% -	百万円 1,983
18期(2012年2月1日)	7,484	5	△7.9	757.96	△17.0	327.31	1.5	0.1	48.3	0.6	46.1	-	1,934
19期(2013年2月4日)	8,391	5	12.2	955.75	26.1	332.17	1.5	0.1	48.4	0.7	45.7	-	2,212
20期(2014年2月3日)	9,357	5	11.6	1,196.32	25.2	334.72	0.8	0.1	46.8	0.8	47.1	-	2,347
21期(2015年2月2日)	10,158	5	8.6	1,408.75	17.8	338.61	1.2	0.1	48.9	0.6	46.9	-	2,561

* 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	騰落率	NOMURA-	騰落率	コール					
		(TOPIX)		BPI総合中期		(無担保翌日物)					
(期首)	円	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
2014年2月3日	9,357	-	1,196.32	-	334.72	-	-	46.8	0.8	47.1	-
2月末	9,416	0.6	1,211.66	1.3	335.12	0.1	0.0	47.2	0.8	46.8	-
3月末	9,416	0.6	1,202.89	0.5	334.99	0.1	0.0	47.9	0.8	46.1	-
4月末	9,254	△1.1	1,162.44	△2.8	335.25	0.2	0.0	47.5	0.8	46.7	-
5月末	9,399	0.4	1,201.41	0.4	335.67	0.3	0.0	48.0	0.8	46.3	-
6月末	9,624	2.9	1,262.56	5.5	336.15	0.4	0.0	48.0	0.8	46.5	-
7月末	9,714	3.8	1,289.42	7.8	336.43	0.5	0.0	48.2	0.8	46.0	-
8月末	9,661	3.2	1,277.97	6.8	336.48	0.5	0.0	47.9	0.8	47.5	-
9月末	9,861	5.4	1,326.29	10.9	336.52	0.5	0.0	48.6	0.8	46.8	-
10月末	9,899	5.8	1,333.64	11.5	337.27	0.8	0.0	49.2	0.6	45.7	-
11月末	10,173	8.7	1,410.34	17.9	337.84	0.9	0.1	48.9	0.6	46.7	-
12月末	10,171	8.7	1,407.51	17.7	339.02	1.3	0.1	48.5	0.6	46.6	-
2015年1月末	10,188	8.9	1,415.07	18.3	338.73	1.2	0.1	48.9	0.6	46.8	-
(期末)											
2015年2月2日	10,163	8.6	1,408.75	17.8	338.61	1.2	0.1	48.9	0.6	46.9	-

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

* 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。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が作成している指数で、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證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、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
	(分配率)	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					
17期(2011年2月1日)	円	円	%	913.52	%	322.47	%	%	%	%	%	%	百万円
	8,929	5	0.2		1.7		1.1	0.1	28.0	0.1	65.8	—	1,433
18期(2012年2月1日)	8,498	5	△4.8	757.96	△17.0	327.31	1.5	0.1	28.3	0.4	65.5	—	1,471
19期(2013年2月4日)	9,057	5	6.6	955.75	26.1	332.17	1.5	0.1	28.7	0.4	65.2	—	1,636
20期(2014年2月3日)	9,617	5	6.2	1,196.32	25.2	334.72	0.8	0.1	27.3	0.5	66.3	—	1,718
21期(2015年2月2日)	10,067	5	4.7	1,408.75	17.8	338.61	1.2	0.1	29.1	0.3	66.5	—	1,878

* 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	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
2014年2月3日	9,617	—	1,196.32	—	334.72	—	—	27.3	0.5	66.3	—
2月末	9,650	0.3	1,211.66	1.3	335.12	0.1	0.0	27.7	0.5	66.1	—
3月末	9,642	0.3	1,202.89	0.5	334.99	0.1	0.0	28.1	0.5	65.5	—
4月末	9,543	△0.8	1,162.44	△2.8	335.25	0.2	0.0	27.8	0.5	66.2	—
5月末	9,628	0.1	1,201.41	0.4	335.67	0.3	0.0	28.3	0.5	65.7	—
6月末	9,762	1.5	1,262.56	5.5	336.15	0.4	0.0	28.3	0.5	65.8	—
7月末	9,813	2.0	1,289.42	7.8	336.43	0.5	0.0	28.5	0.5	65.1	—
8月末	9,776	1.7	1,277.97	6.8	336.48	0.5	0.0	28.3	0.5	67.1	—
9月末	9,890	2.8	1,326.29	10.9	336.52	0.5	0.0	29.0	0.5	66.2	—
10月末	9,917	3.1	1,333.64	11.5	337.27	0.8	0.0	29.7	0.3	65.3	—
11月末	10,080	4.8	1,410.34	17.9	337.84	0.9	0.1	29.1	0.3	66.2	—
12月末	10,083	4.8	1,407.51	17.7	339.02	1.3	0.1	28.9	0.3	65.9	—
2015年1月末	10,088	4.9	1,415.07	18.3	338.73	1.2	0.1	29.1	0.3	66.4	—
(期末)											
2015年2月2日	10,072	4.7	1,408.75	17.8	338.61	1.2	0.1	29.1	0.3	66.5	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

* 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)	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					
17期(2011年2月1日)	円	円	%		%		%	%	%	%	%	%	百万円
	9,037	5	0.1	913.52	1.7	322.47	1.1	0.1	28.0	0.1	65.7	—	1,563
18期(2012年2月1日)	8,600	5	△4.8	757.96	△17.0	327.31	1.5	0.1	28.3	0.4	65.5	—	1,569
19期(2013年2月4日)	9,166	5	6.6	955.75	26.1	332.17	1.5	0.1	28.7	0.4	65.2	—	1,794
20期(2014年2月3日)	9,732	5	6.2	1,196.32	25.2	334.72	0.8	0.1	27.3	0.5	66.3	—	1,884
21期(2015年2月2日)	10,187	5	4.7	1,408.75	17.8	338.61	1.2	0.1	29.1	0.3	66.5	—	2,033

* 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	%		%		%	%	%	%	%	%
2014年2月3日	9,732	—	1,196.32	—	334.72	—	—	27.3	0.5	66.3	—
2月末	9,766	0.3	1,211.66	1.3	335.12	0.1	0.0	27.7	0.5	66.1	—
3月末	9,758	0.3	1,202.89	0.5	334.99	0.1	0.0	28.1	0.5	65.5	—
4月末	9,657	△0.8	1,162.44	△2.8	335.25	0.2	0.0	27.8	0.5	66.2	—
5月末	9,743	0.1	1,201.41	0.4	335.67	0.3	0.0	28.3	0.5	65.7	—
6月末	9,879	1.5	1,262.56	5.5	336.15	0.4	0.0	28.3	0.5	65.8	—
7月末	9,930	2.0	1,289.42	7.8	336.43	0.5	0.0	28.5	0.5	65.1	—
8月末	9,893	1.7	1,277.97	6.8	336.48	0.5	0.0	28.4	0.5	67.2	—
9月末	10,008	2.8	1,326.29	10.9	336.52	0.5	0.0	29.0	0.5	66.3	—
10月末	10,035	3.1	1,333.64	11.5	337.27	0.8	0.0	29.7	0.3	65.3	—
11月末	10,200	4.8	1,410.34	17.9	337.84	0.9	0.1	29.1	0.3	66.3	—
12月末	10,203	4.8	1,407.51	17.7	339.02	1.3	0.1	28.9	0.3	65.9	—
2015年1月末	10,208	4.9	1,415.07	18.3	338.73	1.2	0.1	29.2	0.3	66.4	—
(期末)											
2015年2月2日	10,192	4.7	1,408.75	17.8	338.61	1.2	0.1	29.1	0.3	66.5	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

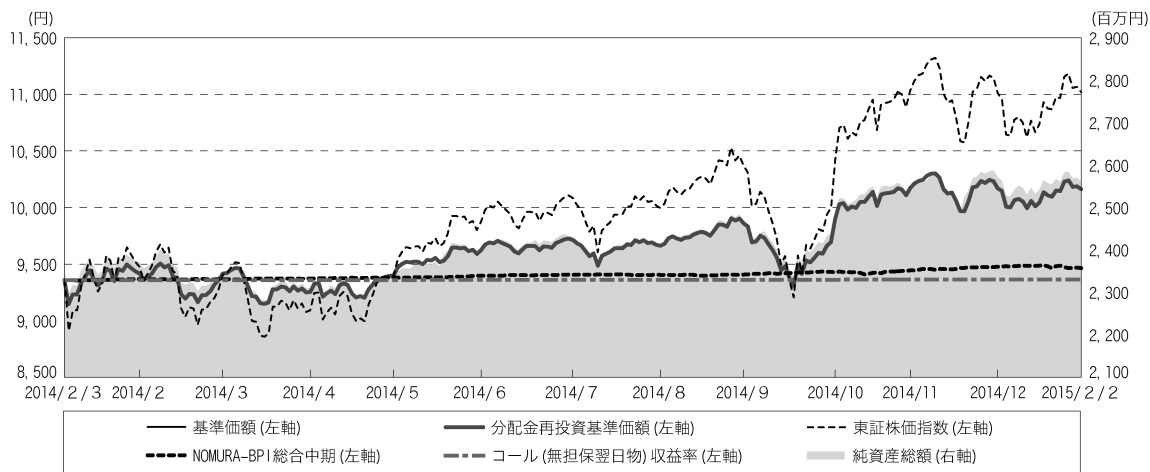
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 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：9,357円

期 末：10,158円（既払分配金（税込み）：5円）

騰 落 率：8.6%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2014年2月3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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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、作成期首（2014年2月3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

基準価額は、期首9,357円から期末10,163円（分配金込み）に806円の値上がりとなりました。

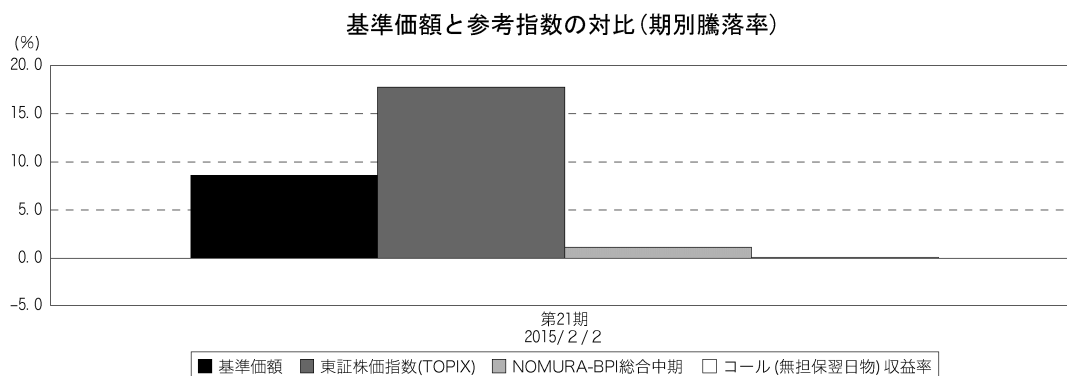
米国の低金利政策が長期間継続するという見方が強まったことなどにより投資家心理が改善したことや、政府の成長戦略への期待感が広がったこと、日銀が追加金融緩和を決定したことなどを背景に国内株式市場が上昇したこと。

<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+17.8%、コール（無担保翌日物）収益率が+0.1%、NOMURA-BPI総合中期の騰落率が+1.2%となったのに対し、基準価額の騰落率は+8.6%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、お手持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21期
	2014年2月4日～ 2015年2月2日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.049%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,526

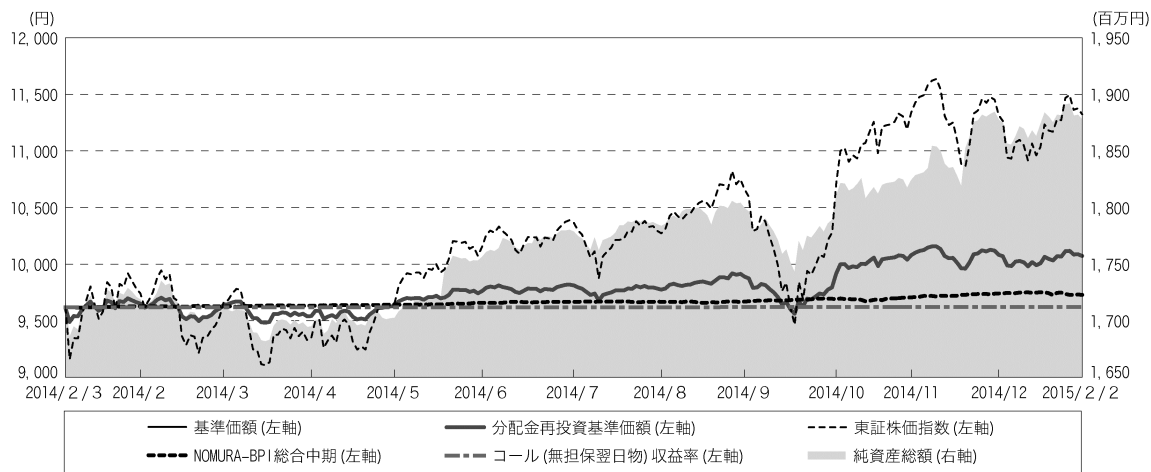
(注)対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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：9,617円

期 末：10,067円（既払分配金（税込み）：5円）

騰 落 率：4.7%（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。作成期首（2014年2月3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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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、作成期首（2014年2月3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

基準価額は、期首9,617円から期末10,072円（分配金込み）に455円の値上がりとなりました。

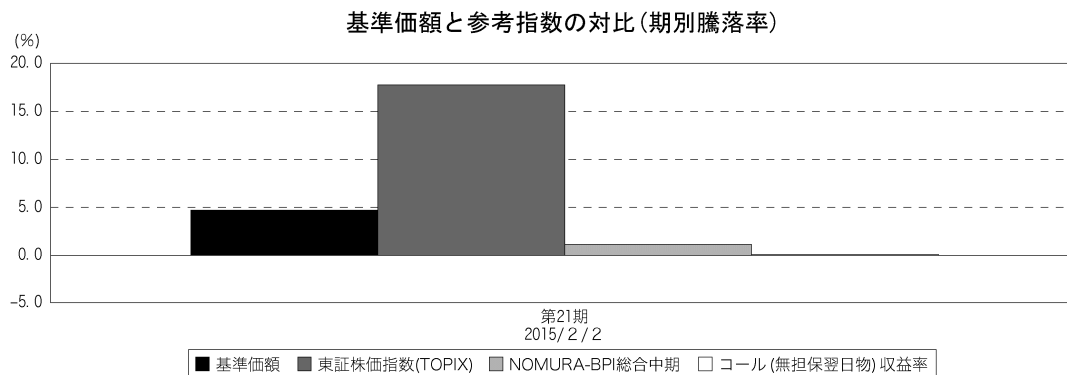
米国の低金利政策が長期間継続するという見方が強まったことなどにより投資家心理が改善したことや、政府の成長戦略への期待感が広がったこと、日銀が追加金融緩和を決定したことなどを背景に国内株式市場が上昇したこと。

<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+17.8%、コール(無担保翌日物)収益率が+0.1%、NOMURA-BPI総合中期の騰落率が+1.2%となったのに対し、基準価額の騰落率は+4.7%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21期
	2014年2月4日～ 2015年2月2日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.050%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,423

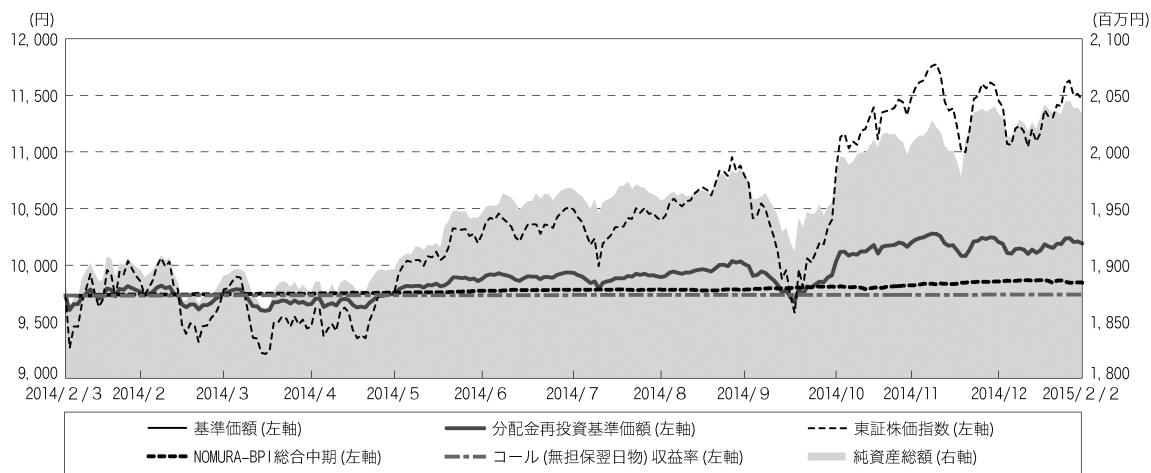
(注)対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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：9,732円

期 末：10,187円（既払分配金（税込み）：5円）

騰 落 率：4.7%（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。作成期首（2014年2月3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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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、作成期首（2014年2月3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

基準価額は、期首9,732円から期末10,192円（分配金込み）に460円の値上がりとなりました。

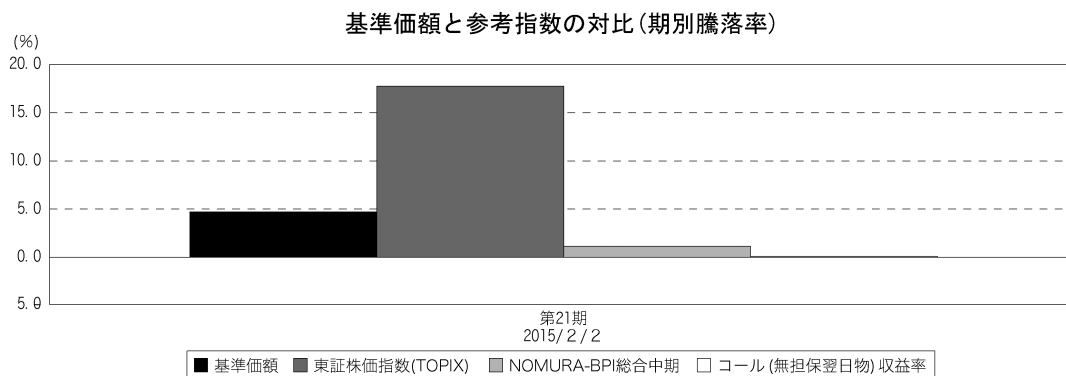
米国の低金利政策が長期間継続するという見方が強まったことなどにより投資家心理が改善したことや、政府の成長戦略への期待感が広がったこと、日銀が追加金融緩和を決定したことなどを背景に国内株式市場が上昇したこと。

<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+17.8%、コール(無担保翌日物)収益率が+0.1%、NOMURA-BPI総合中期の騰落率が+1.2%となったのに対し、基準価額の騰落率は+4.7%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、お手持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21期
	2014年2月4日～ 2015年2月2日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.049%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,385

(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

期首から2014年5月中旬にかけては、米国の低金利政策が長期間継続するという見方が強まったことなどで投資家心理が改善し上昇する場面があったものの、日銀の金融政策決定会合で金融政策の現状維持が決定されたことから追加緩和期待が後退したことなどを受けて下落するなど、国内株式市場は一進一退で推移しました。

2014年5月中旬以降、中国の景気指標の改善や米国株式市場の上昇などを好感したこと、政府の成長戦略への期待感が広がったことなどから国内株式市場は上昇しました。10月上旬に世界景気の先行き不透明感や米国内でのエボラ出血熱の感染拡大が懸念されたことから一時下落する局面があったものの、同月末に日銀が追加金融緩和を決定したことから再び上昇に転じました。

・国内債券

今期の10年国債利回りは0.6%台前半でスタートしました。期前半は日銀の量的金融緩和政策が恒常的な金利低下圧力として作用したことに加え、ECB(欧州中央銀行)による利下げ観測の高まりやFRB(米連邦準備制度理事会)が低金利政策を長期にわたり維持するとの見方が台頭したことに伴う欧米の債券利回りの低下に連れる形で、国内債券利回りもやや低下することとなりました。その後も、ECBの利下げ実施や日本においても消費増税後の駆け込み需要の反動減がGDP(国内総生産)を大きく押し下げたことなどを要因として8月末にかけて利回り低下基調が継続しました。9月には、米国FRBによる金融引き締め観測が高まったことや外国為替市場において急速に円安が進行したことから一時的に利回り上昇する局面もありましたが、世界的な金融緩和環境の長期化観測が根強く残るなかで再度利回りは低下基調に回帰しました。10月末には日銀が追加金融緩和を導入し、国債買い入れペースの拡大と買い入れ年限の長期化が決定されたことから一段と利回り低下基調が強まりました。期末にかけても、ECBによる国債買い入れを中心とした追加金融緩和期待の高まりや、原油価格急落に伴う世界的な期待インフレ率の低下により利回り低下が進みました。

○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]

東証株価指数の動きに連動する投資成果を目指して、時価構成比、業種構成比や値位、規模などを考慮して選択した銘柄に分散投資しております。期中、設定・解約に伴う資金増減や各銘柄の指数構成比率の変動、東証株価指数採用銘柄の入れ替えに応じてポートフォリオの修正を行いました。主に未収配当金の計上に伴う株式組入比率低下への対応のため、引き続き株式先物を利用しました。なお、先物を含む実質の株式組入比率は期を通じ高位に維持しました。

[財形公社債マザーファンド]

期首、債券組入比率は96.5%で始まり、期中は概ね高位で推移させました。期末には97.8%としました。

ポートフォリオのデュレーション(金利感応度)は期首3.2年程度で開始しましたが、10月末の金融緩和を受けて段階的にデュレーションを引き上げました。期末時点では3.4年程度としました。

◎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目指します。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目指します。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目指します。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、よろしくお願い申し上げます。

＜一般財形50＞

○1万口当たりの費用明細

(2014年2月4日～2015年2月2日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 154	% 1.583	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(36)	(0.370)	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 ）	(113)	(1.159)	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 ）	(5)	(0.054)	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	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	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	154	1.586	
期中の平均基準価額は、9,731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>

○売買及び取引の状況

(2014年2月4日～2015年2月2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
		千口	千円	千口	千円
財形株式マザーファンド		209,537	219,641	273,421	302,660
財形公社債マザーファンド		247,720	335,704	193,002	261,443

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2014年2月4日～2015年2月2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	1,443,312千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,243,547千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.64	

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

<一般財形50>

○利害関係人との取引状況等

(2014年2月4日～2015年2月2日)

利害関係人との取引状況

<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>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 7	% 1.0		百万円 764	百万円 7	% 0.9

平均保有割合 52.4%

※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。

<財形公社債マザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
公社債	百万円 527	% 12.4		百万円 2,758	百万円 459	% 16.6

平均保有割合 31.5%

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	期 末 保 有 額
株式	百万円 2	百万円 4	百万円 14

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

<一般財形50>

○組入資産の明細

(2015年2月2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
	千口	千口	千円
財形株式マザーファンド	1,124,127	1,060,244	1,268,582
財形公社債マザーファンド	848,087	902,805	1,228,538

*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。

○投資信託財産の構成

(2015年2月2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	1,268,582	49.1
財形公社債マザーファンド	1,228,538	47.6
コール・ローン等、その他	86,553	3.3
投資信託財産総額	2,583,673	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

<一般財形50>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年2月2日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,583,673,409
コール・ローン等	85,772,749
財形株式マザーファンド(評価額)	1,268,582,361
財形公社債マザーファンド(評価額)	1,228,538,143
未収入金	780,000
未収利息	156
(B) 負債	22,351,609
未払収益分配金	1,260,729
未払解約金	1,046,385
未払信託報酬	20,003,732
その他未払費用	40,763
(C) 純資産総額(A-B)	2,561,321,800
元本	2,521,458,939
次期繰越損益金	39,862,861
(D) 受益権総口数	2,521,458,939口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,158円

(注)期首元本額2,508百万円、期中追加設定元本額284百万円、期中一部解約元本額270百万円、計算口数当たり純資産額10,158円。

○損益の状況 (2014年2月4日～2015年2月2日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	51,926
受取利息	51,926
(B) 有価証券売買損益	232,699,469
売買益	242,807,973
売買損	△ 10,108,504
(C) 信託報酬等	△ 38,273,374
(D) 当期損益金(A+B+C)	194,478,021
(E) 前期繰越損益金	161,547,283
(F) 追加信託差損益金	△314,901,714
(配当等相当額)	(534,138,153)
(売買損益相当額)	(△849,039,867)
(G) 計(D+E+F)	41,123,590
(H) 収益分配金	△ 1,260,729
次期繰越損益金(G+H)	39,862,861
追加信託差損益金	△314,901,714
(配当等相当額)	(534,416,904)
(売買損益相当額)	(△849,318,618)
分配準備積立金	354,764,575

*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。

(注)分配金の計算過程(2014年2月4日～2015年2月2日)は以下の通りです。

項目	第21期
	2014年2月4日～ 2015年2月2日
a. 配当等収益(経費控除後)	26,215,703円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	168,262,318円
c. 信託約款に定める収益調整金	534,416,904円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	161,547,283円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	890,442,208円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,531円
g. 分配金	1,260,729円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

<一般財形50>

○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

運用報告書(全体版)について電磁的方法により提供する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日:2014年12月1日>

<一般財形30>

○1万口当たりの費用明細

(2014年2月4日～2015年2月2日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 156	% 1.583	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(37)	(0.365)	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 ）	(114)	(1.164)	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 ）	(5)	(0.054)	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	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	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	156	1.586	
期中の平均基準価額は、9,822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>

○売買及び取引の状況

(2014年2月4日～2015年2月2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
		千口	千円	千口	千円
財形株式マザーファンド		121,551	128,752	139,477	155,237
財形公社債マザーファンド		188,387	255,293	124,630	168,703

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2014年2月4日～2015年2月2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	1,443,312千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,243,547千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.64	

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

<一般財形30>

○利害関係人との取引状況等

(2014年2月4日～2015年2月2日)

利害関係人との取引状況

<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>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 678	百万円 7	% 1.0	百万円 764	百万円 7	% 0.9

平均保有割合 22.7%

※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。

<財形公社債マザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
公社債	百万円 4,252	百万円 527	% 12.4	百万円 2,758	百万円 459	% 16.6

平均保有割合 32.6%

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	期 末 保 有 額
株式	百万円 2	百万円 4	百万円 14

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

<一般財形30>

○組入資産の明細

(2015年2月2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
	千口	千口	千円
財形株式マザーファンド	480,574	462,648	553,559
財形公社債マザーファンド	874,578	938,336	1,276,887

*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。

○投資信託財産の構成

(2015年2月2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	553,559	29.2
財形公社債マザーファンド	1,276,887	67.4
コール・ローン等、その他	63,142	3.4
投資信託財産総額	1,893,588	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

<一般財形30>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年2月2日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,893,588,921
コール・ローン等	58,941,680
財形株式マザーファンド(評価額)	553,559,209
財形公社債マザーファンド(評価額)	1,276,887,925
未収入金	4,200,000
未収利息	107
(B) 負債	15,585,352
未払収益分配金	932,734
未払信託報酬	14,622,837
その他未払費用	29,781
(C) 純資産総額(A-B)	1,878,003,569
元本	1,865,469,428
次期繰越損益金	12,534,141
(D) 受益権総口数	1,865,469,428口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,067円

(注)期首元本額1,786百万円、期中追加設定元本額264百万円、期中一部解約元本額186百万円、計算口数当たり純資産額10,067円。

○損益の状況 (2014年2月4日～2015年2月2日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	38,552
受取利息	38,552
(B) 有価証券売買損益	108,067,447
売買益	111,977,163
売買損	△ 3,909,716
(C) 信託報酬等	△ 27,969,188
(D) 当期損益金(A+B+C)	80,136,811
(E) 前期繰越損益金	65,516,436
(F) 追加信託差損益金	△132,186,372
(配当等相当額)	(307,113,960)
(売買損益相当額)	(△439,300,332)
(G) 計(D+E+F)	13,466,875
(H) 収益分配金	△ 932,734
次期繰越損益金(G+H)	12,534,141
追加信託差損益金	△132,186,372
(配当等相当額)	(307,326,070)
(売買損益相当額)	(△439,512,442)
分配準備積立金	144,720,513

*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。

(注)分配金の計算過程(2014年2月4日～2015年2月2日)は以下の通りです。

項目	第21期
	2014年2月4日～ 2015年2月2日
a. 配当等収益(経費控除後)	13,657,461円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	66,479,350円
c. 信託約款に定める収益調整金	307,326,070円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	65,516,436円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	452,979,317円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,428円
g. 分配金	932,734円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

<一般財形30>

○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

運用報告書(全体版)について電磁的方法により提供する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日:2014年12月1日>

＜年金・住宅財形30＞

○1万口当たりの費用明細

(2014年2月4日～2015年2月2日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 157	% 1.583	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(37)	(0.372)	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 ）	(115)	(1.158)	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 ）	(5)	(0.054)	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	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	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	157	1.586	
期中の平均基準価額は、9,940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＞

○売買及び取引の状況

(2014年2月4日～2015年2月2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
		千口	千円	千口	千円
財形株式マザーファンド		129,671	136,452	155,385	173,271
財形公社債マザーファンド		186,053	252,125	128,461	174,012

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2014年2月4日～2015年2月2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	1,443,312千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,243,547千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.64	

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

<年金・住宅財形30>

○利害関係人との取引状況等

(2014年2月4日～2015年2月2日)

利害関係人との取引状況

<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>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 7	% 1.0		百万円 764	百万円 7	% 0.9

平均保有割合 24.9%

※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。

<財形公社債マザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
公社債	百万円 527	% 12.4		百万円 2,758	百万円 459	% 16.6

平均保有割合 35.8%

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	期 末 保 有 額
株式	百万円 2	百万円 4	百万円 14

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

＜年金・住宅財形30＞

○組入資産の明細

(2015年2月2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
	千口	千口	千円
財形株式マザーファンド	526,935	501,222	599,712
財形公社債マザーファンド	958,962	1,016,554	1,383,326

*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。

○投資信託財産の構成

(2015年2月2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	599,712	29.2
財形公社債マザーファンド	1,383,326	67.4
コール・ローン等、その他	68,849	3.4
投資信託財産総額	2,051,887	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

＜年金・住宅財形30＞

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年2月2日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,051,887,218
コール・ローン等	68,577,536
財形株式マザーファンド(評価額)	599,712,718
財形公社債マザーファンド(評価額)	1,383,326,839
未収入金	270,000
未収利息	125
(B) 負債	18,051,446
未払収益分配金	998,202
未払解約金	1,016,555
未払信託報酬	16,004,085
その他未払費用	32,604
(C) 純資産総額(A-B)	2,033,835,772
元本	1,996,405,038
次期繰越損益金	37,430,734
(D) 受益権総口数	1,996,405,038口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,187円

(注)期首元本額1,936百万円、期中追加設定元本額233百万円、期中一部解約元本額173百万円、計算口数当たり純資産額10,187円。

○損益の状況 (2014年2月4日～2015年2月2日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	42,392
受取利息	42,392
(B) 有価証券売買損益	118,624,725
売買益	123,050,736
売買損	△ 4,426,011
(C) 信託報酬等	△ 30,770,765
(D) 当期損益金(A+B+C)	87,896,352
(E) 前期繰越損益金	68,704,071
(F) 追加信託差損益金	△118,171,487
(配当等相当額)	(320,536,553)
(売買損益相当額)	(△438,708,040)
(G) 計(D+E+F)	38,428,936
(H) 収益分配金	△ 998,202
次期繰越損益金(G+H)	37,430,734
追加信託差損益金	△118,171,487
(配当等相当額)	(320,725,549)
(売買損益相当額)	(△438,897,036)
分配準備積立金	155,602,221

*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。

(注)分配金の計算過程(2014年2月4日～2015年2月2日)は以下の通りです。

項目	第21期
	2014年2月4日～ 2015年2月2日
a. 配当等収益(経費控除後)	15,009,576円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	72,886,776円
c. 信託約款に定める収益調整金	320,725,549円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	68,704,071円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	477,325,972円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,390円
g. 分配金	998,202円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

<年金・住宅財形30>

○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

運用報告書(全体版)について電磁的方法により提供する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日:2014年12月1日>

財形公社債マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日2015年2月2日）

作成対象期間（2014年2月4日～2015年2月2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	外貨建て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

東京都中央区日本橋 1-12-1

<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
	騰落率	中率	NOMURA-BPI総合中期	騰落率	中率			
	円	%		%	%	%	%	百万円
17期(2011年2月1日)	13,234	0.6	322.47	1.1	0.1	96.9	—	2,985
18期(2012年2月1日)	13,371	1.0	327.31	1.5	0.1	97.0	—	2,971
19期(2013年2月4日)	13,452	0.6	332.17	1.5	0.1	97.1	—	3,346
20期(2014年2月3日)	13,501	0.4	334.72	0.8	0.1	96.5	—	3,620
21期(2015年2月2日)	13,608	0.8	338.61	1.2	0.1	97.8	—	3,888

*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	中率	NOMURA-BPI総合中期	騰落率	中率		
(期首)	円	%		%	%	%	%
2014年2月3日	13,501	—	334.72	—	—	96.5	—
2月末	13,511	0.1	335.12	0.1	0.0	97.0	—
3月末	13,506	0.0	334.99	0.1	0.0	96.6	—
4月末	13,513	0.1	335.25	0.2	0.0	97.1	—
5月末	13,524	0.2	335.67	0.3	0.0	96.6	—
6月末	13,536	0.3	336.15	0.4	0.0	96.3	—
7月末	13,543	0.3	336.43	0.5	0.0	95.4	—
8月末	13,545	0.3	336.48	0.5	0.0	98.0	—
9月末	13,545	0.3	336.52	0.5	0.0	97.7	—
10月末	13,566	0.5	337.27	0.8	0.0	97.1	—
11月末	13,581	0.6	337.84	0.9	0.1	97.6	—
12月末	13,610	0.8	339.02	1.3	0.1	96.7	—
2015年1月末	13,610	0.8	338.73	1.2	0.1	97.8	—
(期末)							
2015年2月2日	13,608	0.8	338.61	1.2	0.1	97.8	—

*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、野村證券株式会社が作成している指数で、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證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、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

【基準価額の推移】

(2014年2月4日～2015年2月2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、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13,501円から期末13,608円に107円上昇しました。

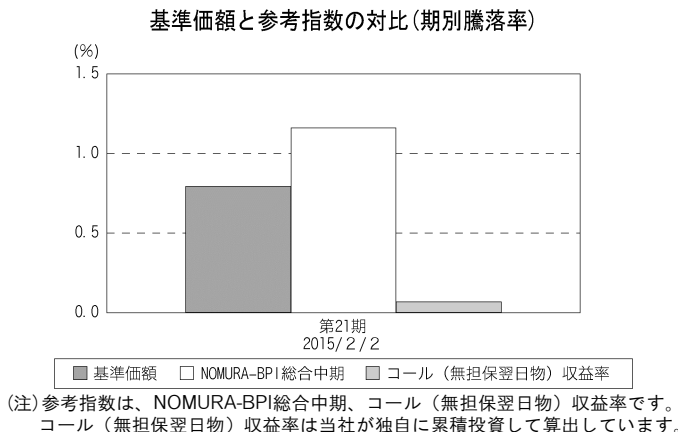
(上昇要因) 日銀の国債買い入れによって、債券利回りが低下(価格は上昇)したこと。

○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+0.07%、NOMURA-BPI総合中期の騰落率が+1.16%となったのに対し、基準価額の騰落率は+0.79%となりました。



・主な差異要因

(プラス要因) 金利の低下局面において、相対的に金利の低下幅が大きかった長期・超長期債を多めに組み入れていたこと

○投資環境

今期の10年国債利回りは0.6%台前半でスタートしました。期前半は日銀の量的金融緩和政策が恒常的な金利低下圧力として作用したことに加え、ECB(欧州中央銀行)による利下げ観測の高まりやFRB(米連邦準備制度理事会)が低金利政策を長期にわたり維持するとの見方が台頭したことに伴う欧米の債券利回りの低下に連れる形で、国内債券利回りもやや低下することとなりました。その後も、ECBの利下げ実施や日本においても消費増税後の駆け込み需要の反動減がGDP(国内総生産)を大きく押し下げたことなどを要因として8月末にかけて利回り低下基調が継続しました。9月には、米国FRBによる金融引き締め観測が高まったことや外国為替市場において急速に円安が進行したことから一時的に利回り上昇する局面もありましたが、世界的な金融緩和環境の長期化観測が根強く残るなかで再度利回りは低下基調に回帰しました。10月末には日銀が追加金融緩和を導入し、国債買い入れペースの拡大と買い入れ年限の長期化が決定されたことから一段と利回り低下基調が強まりました。期末にかけても、ECBによる国債買い入れを中心とした追加金融緩和期待の高まりや、原油価格急落に伴う世界的な期待インフレ率の低下により利回り低下が進みました。

○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

期首、債券組入比率は96.5%で始まり、期中は概ね高位で推移させました。期末には97.8%としました。

ポートフォリオのデュレーション(金利感応度)は期首3.2年程度で開始しましたが、10月末の金融緩和を受けて段階的にデュレーションを引き上げました。期末時点では3.4年程度としました。

・種別構成

日銀の信用緩和や投資家の需要を背景にクレジット市場では安定推移が続く中、国内信用市場のイベントリスク等に注意しつつ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組入れています。

◎今後の運用方針

国内景気は、堅調な企業業績を背景とした雇用・所得環境の改善や、原油価格下落による家計の実質購買力の改善をもとに個人消費が持ち直していく事で、緩やかに回復していくと考えています。国内金利については、日銀が2%の物価目標達成に向けて巨額の国債購入を継続することにより、低水準での推移が継続すると予想しています。

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

(2014年2月4日～2015年2月2日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2014年2月4日～2015年2月2日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	2,251,311	2,758,830 (1,130,000)
	地方債証券	1,072,091	— (58,400)
	特殊債券	823,920	—
	社債券(投資法人債券を含む)	104,680	—

*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、上段の数字には含まれておりません。

*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

(2014年2月4日～2015年2月2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	
		百万円	%		百万円	%
公社債	4,252	527	12.4	2,758	459	16.6

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。

(2015年2月2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	1,410,000	1,468,889	37.8	—	15.9	20.3	1.5
地方債証券	1,288,270	1,310,356	33.7	—	—	9.8	23.9
	(1,288,270)	(1,310,356)	(33.7)	(—)	(—)	(9.8)	(23.9)
特殊債券 (除く金融債)	835,000	854,921	22.0	—	—	11.4	10.5
	(835,000)	(854,921)	(22.0)	(—)	(—)	(11.4)	(10.5)
普通社債券 (含む投資法人債券)	160,000	169,409	4.4	—	—	4.4	—
	(160,000)	(169,409)	(4.4)	(—)	(—)	(4.4)	(—)
合 計	3,693,270	3,803,577	97.8	—	15.9	46.0	35.9
	(2,283,270)	(2,334,687)	(60.0)	(—)	(—)	(25.6)	(34.4)

* ()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。

* -印は組み入れなし。

* 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	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付(2年)第326回	0.1	60,000	59,991	2015/3/15
国庫債券	利付(5年)第112回	0.4	220,000	222,741	2018/6/20
国庫債券	利付(5年)第118回	0.2	100,000	100,676	2019/6/20
国庫債券	利付(5年)第120回	0.2	130,000	130,899	2019/9/20
国庫債券	利付(5年)第122回	0.1	60,000	60,130	2019/12/20
国庫債券	利付(10年)第299回	1.3	60,000	63,096	2019/3/20
国庫債券	利付(10年)第303回	1.4	200,000	212,456	2019/9/20
国庫債券	利付(10年)第309回	1.1	100,000	105,597	2020/6/20
国庫債券	利付(10年)第312回	1.2	200,000	213,470	2020/12/20
国庫債券	利付(10年)第314回	1.1	100,000	106,374	2021/3/20
国庫債券	利付(10年)第325回	0.8	60,000	62,987	2022/9/20
国庫債券	利付(10年)第328回	0.6	40,000	41,377	2023/3/20
国庫債券	利付(10年)第337回	0.3	10,000	10,014	2024/12/20
国庫債券	利付(20年)第145回	1.7	70,000	79,077	2033/6/20
小	計		1,410,000	1,468,889	
地方債証券					
東京都	公募第629回	1.45	100,000	101,232	2015/12/18
東京都	公募第639回	1.83	20,000	20,578	2016/9/20
大阪府	公募第282回	1.4	100,000	100,828	2015/9/29
大阪府	公募第303回	1.93	30,000	31,318	2017/6/28
兵庫県	公募平成17年度第8回	1.4	20,000	20,166	2015/9/28
兵庫県	公募平成18年度第10回	2.01	10,000	10,343	2016/11/16
静岡県	公募平成23年度第7回	0.39	17,520	17,609	2016/8/25
愛知県	公募平成20年度第7回	1.39	10,000	10,516	2019/1/30
埼玉県	公募平成19年度第4回	1.8	50,000	52,294	2017/9/27
千葉県	公募平成18年度第4回	1.8	110,000	113,303	2016/10/25
新潟県	公募平成18年度第2回	1.87	102,000	105,338	2016/11/29
新潟県	公募平成20年度第2回	1.52	12,700	13,427	2019/2/27
岐阜県	公募平成20年度第1回	1.57	13,000	13,711	2018/10/24
共同発行市場地方債	公募第36回	1.6	100,000	101,753	2016/3/25
島根県	公募平成24年度第1回	0.24	10,500	10,545	2017/11/27
大阪市	公募平成17年度第1回	1.3	100,000	100,464	2015/6/23
京都市	公募平成24年度第6回	0.137	100,000	100,163	2018/3/28
札幌市	公募平成22年度第5回	0.37	100,000	100,188	2015/9/18
川崎市	公募第30回	0.4	32,550	32,760	2016/12/20
川崎市	公募第39回	0.209	100,000	100,466	2019/3/20
福岡市	公募平成24年度第5回	0.19	50,000	50,158	2017/12/26
鹿児島県	公募平成18年度第1回	1.9	100,000	103,188	2016/10/31
小	計		1,288,270	1,310,356	
特殊債券(除く金融債)					
公営企業債券	政府保証第860回	1.6	105,000	106,707	2016/2/19
日本政策投資銀行社債	財投機関債第36回	0.233	100,000	100,200	2016/9/20
首都高速道路社債	第13回	0.223	100,000	100,266	2019/9/20
福祉医療機構債券	第36回財投機関債	0.167	100,000	100,116	2016/12/20
住宅金融支援機構債券	財投機関債第21回	1.92	100,000	106,449	2018/9/20
東日本高速道路	第28回	0.248	100,000	100,377	2019/12/20
中日本高速道路債券	財投機関債第3回	1.92	30,000	31,419	2017/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第19回	2.01	100,000	106,323	2018/6/20
緑資源債券	財投機関債第5回	2.05	100,000	103,063	2016/9/23
小	計		835,000	854,921	
普通社債券(含む投資法人債券)					
成田国際空港	第4回一般担保付	1.7	100,000	104,534	2017/12/20
東日本旅客鉄道	第7回社債間限定同順位特約付	3.3	60,000	64,875	2017/8/25
小	計		160,000	169,409	
合	計		3,693,270	3,803,577	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2015年2月2日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 3,803,577	% 97.7
コール・ローン等、その他	88,529	2.3
投資信託財産総額	3,892,106	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 (2015年2月2日現在)

項目	当期末
(A) 資産	3,892,106,931
コール・ローン等	77,414,475
公社債(評価額)	3,803,577,139
未収利息	8,216,149
前払費用	2,899,168
(B) 負債	3,490,000
未払解約金	3,490,000
(C) 純資産総額(A-B)	3,888,616,931
元本	2,857,696,141
次期繰越損益金	1,030,920,790
(D) 受益権総口数	2,857,696,141口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,608円

(注)期首元本額2,681百万円、期中追加設定元本額622百万円、期中一部解約元本額446百万円、計算口数当たり純資産額13,608円。

(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> 902百万円
- ・財形株投<一般財形30> 938百万円
- ・財形株投<年金・住宅財形30> 1,016百万円

○損益の状況 (2014年2月4日～2015年2月2日)

項目	当期
(A) 配当等収益	25,809,634
受取利息	25,809,634
(B) 有価証券売買損益	3,264,358
売買益	14,860,105
売買損	△ 11,595,747
(C) 当期繰越損益金(A+B)	29,073,992
(D) 前期繰越損益金	938,950,300
(E) 追加信託差損益金	220,960,045
(F) 解約差損益金	△ 158,063,547
(G) 計(C+D+E+F)	1,030,920,790
次期繰越損益金(G)	1,030,920,790

*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21期（決算日2015年2月2日）

作成対象期間（2014年2月4日～2015年2月2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	東京証券取引所第一部上場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

東京都中央区日本橋 1-12-1

<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		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	騰落	期中率	東証株価指数 (TOPIX)	騰落率			
17期(2011年2月1日)	円 7,142	% 3.7	913.52	% 1.7	% 99.3	% 0.5	百万円 1,801
18期(2012年2月1日)	6,070	△15.0	757.96	△17.0	98.6	1.2	1,822
19期(2013年2月4日)	7,826	28.9	955.75	26.1	97.8	1.4	2,101
20期(2014年2月3日)	9,964	27.3	1,196.32	25.2	98.0	1.7	2,123
21期(2015年2月2日)	11,965	20.1	1,408.75	17.8	98.7	1.2	2,421

*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		株式組入比率	株式先物比率
	騰落	率	東証株価指数 (TOPIX)	騰落率		
(期首) 2014年2月3日	円 9,964	% -	1,196.32	% -	% 98.0	% 1.7
2月末	10,096	1.3	1,211.66	1.3	98.0	1.7
3月末	10,117	1.5	1,202.89	0.5	98.0	1.7
4月末	9,774	△1.9	1,162.44	△2.8	98.1	1.6
5月末	10,108	1.4	1,201.41	0.4	98.1	1.7
6月末	10,626	6.6	1,262.56	5.5	98.0	1.7
7月末	10,854	8.9	1,289.42	7.8	98.0	1.7
8月末	10,759	8.0	1,277.97	6.8	98.1	1.7
9月末	11,246	12.9	1,326.29	10.9	97.8	1.7
10月末	11,312	13.5	1,333.64	11.5	96.5	1.1
11月末	11,965	20.1	1,410.34	17.9	98.5	1.2
12月末	11,954	20.0	1,407.51	17.7	98.5	1.2
2015年1月末	12,019	20.6	1,415.07	18.3	98.6	1.2
(期末) 2015年2月2日	11,965	20.1	1,408.75	17.8	98.7	1.2

*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。

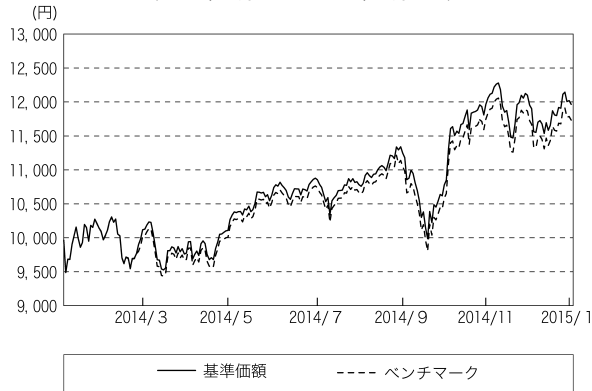
TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移

【基準価額の推移】

(2014年2月4日～2015年2月2日)



(注) ベンチマークは、東証株価指数 (TOPIX) です。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。

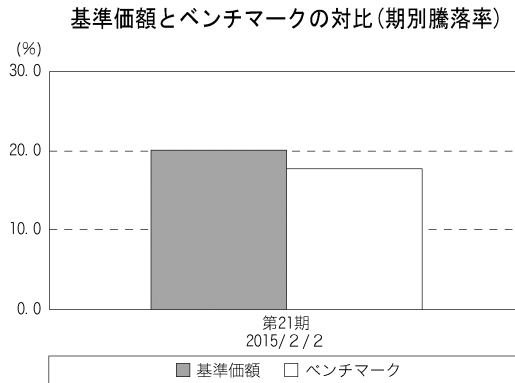
○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首9,964円から期末11,965円に2,001円の値上がりとなりました。

米国の低金利政策が長期間継続するという見方が強まったことなどにより投資家心理が改善したことや、政府の成長戦略への期待感が広がったこと、日銀が追加金融緩和を決定したことなどを背景に国内株式市場が上昇したこと。

○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+20.1%となり、ベンチマークの+17.8%を2.3ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。



(注)ベンチマークは、東証株価指数 (TOPIX) です。

(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

○投資環境

期首から2014年5月中旬にかけては、米国の低金利政策が長期間継続するという見方が強まったことなどで投資家心理が改善し上昇する場面があったものの、日銀の金融政策決定会合で金融政策の現状維持が決定されたことから追加緩和期待が後退したことなどをを受けて下落するなど、国内株式市場は一進一退で推移しました。

2014年5月中旬以降、中国の景気指標の改善や米国株式市場の上昇などを好感したこと、政府の成長戦略への期待感が広がったことなどから国内株式市場は上昇しました。10月上旬に世界景気の先行き不透明感や米国内でのエボラ出血熱の感染拡大が懸念されたことから一時下落する局面があったものの、同月末に日銀が追加金融緩和を決定したことから再び上昇に転じました。

○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

東証株価指数の動きに連動する投資成果を目指して、時価構成比、業種構成比や値位、規模などを考慮して選択した銘柄に分散投資しております。期中、設定・解約に伴う資金増減や各銘柄の指数構成比率の変動、東証株価指数採用銘柄の入れ替えに応じてポートフォリオの修正を行いました。主に未収配当金の計上に伴う株式組入比率低下への対応のため、引き続き株式先物を利用しました。なお、先物を含む実質の株式組入比率は期を通じ高位に維持しました。

◎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

(2014年2月4日～2015年2月2日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式)	円 0	% 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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、10,902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

(2014年2月4日～2015年2月2日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 776 (△ 7)	千円 678,634 (-)	千株 816	千円 764,677

*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 141	百万円 155	百万円 -	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2014年2月4日～2015年2月2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	1,443,312千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,243,547千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.64

* (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

(2014年2月4日～2015年2月2日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 7	% 1.0		百万円 7	% 0.9	

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株式	百万円 2	百万円 4	百万円 14

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

(2015年2月2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%)					大末建設	1	0.1	80	
極洋	1	1	275		鉄建建設	1	1	441	
日本水産	1.7	1.6	633		西松建設	2	1	473	
マルハニチロ	—	0.2	351		三井住友建設	3.7	5.3	858	
マルハニチロホールディングス	3	—	—		大豊建設	1	—	—	
サカタのタネ	0.2	0.2	404		前田建設工業	1	1	894	
ホクト	0.1	0.1	216		佐田建設	1	1	137	
鉱業 (0.4%)					ナカノフドー建設	0.2	0.1	38	
住石ホールディングス	0.4	0.4	45		奥村組	1	1	535	
日鉄鉱業	1	1	414		大和小田急建設	0.5	0.1	68	
三井松島産業	1	—	—		東鉄工業	0.2	0.2	559	
国際石油開発帝石	6.6	6.8	8,789		イチケン	1	1	319	
石油資源開発	0.2	0.2	720		浅沼組	1	1	150	
K&Oエナジーグループ	—	0.1	152		戸田建設	2	2	826	
建設業 (2.6%)					熊谷組	2	2	738	
ショーボンドホールディングス	0.1	0.1	501		青木あすなろ建設	0.1	0.1	79	
ミライト・ホールディングス	0.4	0.4	534		北野建設	1	—	—	
タマホーム	0.1	0.1	52		植木組	1	1	266	
サンヨーホームズ	—	0.1	63		矢作建設工業	0.2	0.2	177	
ダイセキ環境ソリューション	0.1	0.1	170		ビーエス三菱	0.2	0.2	95	
安藤・間	1	0.9	685		東日本ハウス	—	0.2	103	
東急建設	0.5	0.4	238		大東建託	0.5	0.5	6,362	
コムシスホールディングス	0.7	0.6	960		新日本建設	0.2	0.2	87	
ミサワホーム	0.2	0.2	207		東亜建設工業	2	1	201	
高松コンストラクショングループ	0.2	0.1	241		若築建設	1	1	199	
東建コーポレーション	0.06	0.1	490		東洋建設	0.5	0.4	222	
ヤマウラ	0.1	0.1	39		五洋建設	2	1.5	675	
大成建設	7	7	4,760		世紀東急工業	1	0.2	110	
大林組	4	4	2,968		住友林業	1	1	1,072	
清水建設	4	4	3,224		日本基礎技術	0.2	0.2	78	
飛島建設	0.9	0.9	231		日成ビルド工業	1	—	—	
長谷工コーポレーション	1.9	1.7	1,626		ヤマダ・エスバイエルホーム	1	1	89	
銭高組	1	1	357		巴コーポレーション	0.2	0.2	85	
鹿島建設	6	6	2,796		パナホーム	1	—	—	
不動デトラ	1	1	238		大和ハウス工業	4	3.8	8,234	

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
ライト工業	0.3	0.2	227	
積水ハウス	3.7	4	6,026	
日特建設	0.2	0.2	105	
中電工	0.2	0.2	365	
関電工	1	1	663	
きんでん	1	1	1,399	
住友電設	0.1	0.2	255	
日本電設工業	—	0.2	344	
協和エクシオ	0.6	0.6	751	
新日本空調	0.2	0.2	190	
NDS	1	1	299	
三機工業	—	0.3	212	
日揮	1	1	2,369	
中外炉工業	1	1	271	
高砂熱学工業	0.4	0.4	586	
三見金属工業	1	1	259	
朝日工業社	—	1	405	
大気社	0.2	0.2	563	
日比谷総合設備	0.2	0.2	304	
東芝プラントシステム	0.3	0.3	550	
OSJBホールディングス	—	0.2	56	
東洋エンジニアリング	1	1	406	
千代田化工建設	1	1	918	
新興プランテック	0.3	0.3	265	
食料品 (4.1%)				
日本製粉	1	1	549	
日清製粉グループ本社	1.4	1.4	1,974	
昭和産業	1	1	484	
鳥越製粉	0.1	0.1	70	
中部飼料	0.1	0.1	65	
フィード・ワンホールディングス	—	0.8	87	
日本甜菜製糖	1	1	203	
三井製糖	1	1	394	
塩水港精糖	—	0.1	26	
森永製菓	1	1	362	
江崎グリコ	—	0.3	1,557	
名糖産業	0.1	0.1	115	
不二家	1	1	194	
山崎製パン	1	1	1,710	
亀田製菓	0.1	0.1	397	

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
カルビー	0.6	0.5	2,225	
森永乳業	1	1	503	
六甲バター	0.1	0.1	106	
ヤクルト本社	0.8	0.7	4,984	
明治ホールディングス	0.4	0.4	5,136	
雪印メグミルク	0.3	0.3	482	
プリマハム	1	1	294	
日本ハム	1	1	2,847	
伊藤ハム	1	1	666	
丸大食品	1	1	431	
S Foods	—	0.1	214	
サッポロホールディングス	2	2	976	
アサヒグループホールディングス	2.8	2.6	10,065	
キリンホールディングス	6	5.5	8,717	
宝ホールディングス	1	1.1	827	
コカ・コーラウエスト	0.4	0.4	677	
コカ・コーライーストジャパン	0.3	0.3	581	
サントリー食品インターナショナル	0.7	0.8	3,300	
ダイドードリンコ	0.1	0.1	476	
伊藤園	0.4	0.4	904	
キーコーヒー	0.2	0.1	171	
日清オイリオグループ	1	1	431	
不二製油	0.4	0.3	471	
J-オイルミルズ	1	1	423	
キッコーマン	1	1	3,340	
味の素	3	3	6,960	
キュービー	0.7	0.7	1,929	
ハウス食品グループ本社	0.5	0.5	1,181	
カゴメ	0.5	0.5	945	
焼津水産化学工業	0.1	0.1	103	
アリアケジャパン	0.1	0.1	319	
ニチレイ	1	1	609	
東洋水産	1	0.7	2,800	
日清食品ホールディングス	0.5	0.5	2,910	
ロック・フィールド	0.1	0.1	210	
日本たばこ産業	7.6	7.2	23,112	
わらべや日洋	0.1	0.1	198	
なとり	0.1	0.1	142	
繊維製品 (0.8%)				
片倉工業	0.2	0.2	240	

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
グンゼ	1	1	1	305
東洋紡	5	5	5	795
ユニチカ	4	4	4	216
富士紡ホールディングス	1	1	1	300
日清紡ホールディングス	1	1	1	1,314
倉敷紡績	2	2	2	386
シキボウ	1	1	1	118
トーア紡コーポレーション	1	1	1	74
ダイドーリミテッド	0.2	0.2	0.2	102
帝国繊維	0.2	0.2	0.2	482
帝人	5	5	5	1,760
東レ	9	9	9	9,148
サカイオーベックス	1	—	—	—
日本フエルト	0.1	0.1	0.1	52
アツギ	2	1	1	115
セーレン	0.3	0.3	0.3	287
小松精練	—	0.3	0.3	154
ワコールホールディングス	1	1	1	1,142
ホギメディカル	0.1	0.1	0.1	607
レナウン	0.3	0.3	0.3	33
T S I ホールディングス	0.6	0.6	0.6	408
三陽商会	1	1	1	281
ナイガイ	1	—	—	—
オンワードホールディングス	1	1	1	762
キムラタン	4	6	6	54
キング	0.1	0.1	0.1	43
ヤマトインターナショナル	0.1	0.1	0.1	42
パルプ・紙 (0.2%)				
特種東海製紙	1	1	1	287
王子ホールディングス	6	5	5	2,245
日本製紙	0.7	0.5	0.5	923
三菱製紙	2	2	2	172
北越紀州製紙	1	0.8	0.8	432
中越パルプ工業	1	—	—	—
大王製紙	—	1	1	1,011
レンゴー	1	1	1	504
ザ・バック	0.1	—	—	—
化学 (6.3%)				
クラレ	2	2.1	2.1	3,129
旭化成	8	8	8	9,560

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
共和レザー	0.1	0.1	0.1	75
コープケミカル	—	1	1	106
昭和電工	9	8	8	1,184
住友化学	9	9	9	4,581
日本化成	—	1	1	140
日産化学工業	0.9	0.8	0.8	1,749
ラサ工業	1	1	1	130
クレハ	1	1	1	491
石原産業	3	2	2	202
日本曹達	1	1	1	662
東ソー	3	3	3	1,935
トクヤマ	2	2	2	524
セントラル硝子	1	1	1	473
東亜合成	2	2	2	942
ダイソー	1	1	1	439
電気化学工業	3	3	3	1,383
信越化学工業	2.3	2.2	2.2	17,261
日本カーバイド工業	1	—	—	—
堺化学工業	1	1	1	410
エア・ウォーター	1	1	1	2,019
大陽日酸	2	2	2	2,866
日本化学工業	1	—	—	—
日本パーカライジニング	—	0.3	0.3	834
ステラ ケミファ	0.1	0.1	0.1	129
保土谷化学工業	1	1	1	192
日本触媒	1	1	1	1,603
大日精化工業	—	1	1	639
カネカ	2	2	2	1,436
三菱瓦斯化学	2	2	2	1,094
三井化学	6	6	6	2,142
J S R	1.2	1.2	1.2	2,494
東京応化工業	0.3	0.3	0.3	1,201
大阪有機化学工業	0.1	0.1	0.1	49
三菱ケミカルホールディングス	8	7.6	7.6	4,668
ダイセル	2	1.7	1.7	2,456
住友ベークライト	1	1	1	493
積水化学工業	3	3	3	4,005
日本ゼオン	1	1	1	1,187
アイカ工業	0.4	0.4	0.4	1,094
宇部興産	6	6	6	1,068

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
積水樹脂	0.2	0.2	312	
旭有機材工業	1	—	—	
日立化成	0.6	0.6	1,406	
リケンテクノス	—	0.1	43	
積水化成成品工業	1	—	—	
タイガースポリマー	0.1	0.1	77	
ミライアル	—	0.1	150	
日本化薬	1	1	1,601	
カーリットホールディングス	0.2	0.1	70	
日本精化	0.1	0.1	83	
ADEKA	0.6	0.6	873	
日油	1	1	751	
新日本理化	0.2	0.2	42	
ハリマ化成グループ	0.2	0.2	93	
花王	3.3	3.4	17,506	
大日本塗料	1	1	152	
日本ペイントホールディングス	1	1.1	4,015	
関西ペイント	2	1	2,035	
日本特殊塗料	0.1	0.1	73	
藤倉化成	0.2	0.1	57	
太陽ホールディングス	0.1	0.1	442	
D I C	5	5	1,440	
サカタインクス	0.3	0.2	251	
東洋インキS Cホールディングス	1	1	550	
T & K TOKA	0.1	—	—	
富士フイルムホールディングス	2.9	2.8	10,976	
資生堂	2.3	2.1	3,772	
ライオン	1	1	638	
高砂香料工業	1	—	—	
マンダム	0.1	0.1	371	
ミルボン	0.1	0.1	329	
ファンケル	0.3	0.3	563	
コーセー	0.2	0.2	1,108	
コタ	—	0.1	184	
ドクターシーラボ	0.1	0.1	403	
ポーラ・オルビスホールディングス	0.1	0.1	503	
ノエビアホールディングス	0.1	0.1	214	
アジupanコスメジャパン	—	0.1	95	
エステー	0.1	0.1	101	
アグロ カネショウ	—	0.1	109	

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
コニシ	0.1	0.1	204	
長谷川香料	0.2	0.2	338	
星光PMC	0.1	0.1	90	
小林製薬	0.2	0.2	1,596	
荒川化学工業	0.1	0.1	118	
メック	0.1	0.1	86	
日本高純度化学	0.001	—	—	
新田ゼラチン	0.1	0.1	70	
アース製薬	0.1	0.1	398	
イハラケミカル工業	—	0.2	259	
大成ラミック	0.1	—	—	
日本農薬	—	0.3	418	
アキレス	1	2	302	
有沢製作所	0.3	0.3	265	
日東電工	1	0.9	6,705	
レック	0.1	0.1	131	
きもと	0.1	0.3	84	
藤森工業	0.1	0.1	333	
前澤化成工業	0.1	0.1	126	
J S P	0.1	0.1	234	
エフビコ	0.1	0.1	416	
天馬	0.1	0.1	153	
信越ポリマー	0.3	0.2	107	
ニフコ	0.3	0.3	1,233	
日本バルカー工業	1	1	309	
ユニ・チャーム	0.8	2.5	8,286	
医薬品 (5.0%)				
協和発酵キリン	2	1	1,352	
武田薬品工業	4.8	4.6	27,084	
アステラス製薬	3	13.8	25,557	
大日本住友製薬	0.9	0.9	1,108	
塩野義製薬	2	1.9	6,745	
田辺三菱製薬	1.1	1.4	2,626	
わかもと製薬	—	1	275	
あすか製薬	0.2	0.2	254	
ピオフェルミン製薬	—	0.1	295	
中外製薬	1.3	1.2	4,242	
エーザイ	1.6	1.6	9,785	
ロート製薬	0.6	0.6	975	
小野薬品工業	0.6	0.6	7,530	

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
久光製薬	0.4	0.4	1,624	
有機合成薬品工業	—	1	271	
持田製薬	0.1	0.1	665	
参天製薬	0.5	0.4	2,912	
ツムラ	0.4	0.4	1,100	
日医工	0.3	0.3	643	
キッセイ薬品工業	0.2	0.3	1,057	
生化学工業	0.3	0.3	635	
栄研化学	0.1	0.2	365	
日水製薬	0.1	0.1	127	
鳥居薬品	0.1	0.1	298	
JCRファーマ	0.1	0.1	231	
東和薬品	0.1	0.1	533	
富士製薬工業	—	0.1	205	
沢井製薬	0.2	0.2	1,452	
ゼリア新薬工業	0.2	0.3	571	
第一三共	4.1	4	6,998	
キョーリン製薬ホールディングス	0.3	0.3	708	
大幸薬品	0.1	0.1	178	
ダイト	—	0.1	249	
大塚ホールディングス	2.6	2.4	8,848	
大正製薬ホールディングス	0.3	0.3	2,253	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	1	1.1	118	
昭和シェル石油	1.1	1.1	1,269	
コスモ石油	4	3	477	
東燃ゼネラル石油	2	2	2,106	
ユシロ化学工業	0.1	0.1	180	
ビービー・カストロール	0.1	—	—	
富士石油	0.3	0.3	104	
出光興産	0.6	0.6	1,201	
JXホールディングス	14.3	13.5	5,915	
ゴム製品 (1.0%)				
横浜ゴム	1	1	1,108	
東洋ゴム工業	1	0.6	1,587	
ブリヂストン	4	3.8	17,603	
住友ゴム工業	1	1	1,825	
藤倉ゴム工業	0.1	0.2	159	
オカモト	1	—	—	
フコク	0.1	0.1	120	

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
ニッタ	0.2	0.2	560	
住友理工	0.3	0.3	289	
バンドー化学	1	1	426	
ガラス・土石製品 (0.9%)				
日東紡績	1	1	410	
旭硝子	6	6	3,750	
日本板硝子	6	6	618	
日本山村硝子	1	—	—	
日本電気硝子	3	2	1,194	
オハラ	0.1	—	—	
住友大阪セメント	2	2	686	
太平洋セメント	7	7	2,415	
デイ・シイ	0.1	0.1	46	
日本ヒューム	—	0.1	86	
日本コンクリート工業	—	0.2	112	
三谷セキサン	0.1	—	—	
ジャパンパイル	0.1	0.2	152	
東海カーボン	1	1	342	
日本カーボン	1	—	—	
東洋炭素	0.1	—	—	
ノリタケカンパニーリミテド	1	—	—	
TOTO	2	2	2,780	
日本碍子	2	2	4,326	
日本特殊陶業	1	1	3,340	
イソライト工業	—	0.1	21	
フジミインコーポレーテッド	0.1	0.1	185	
ニチアス	1	1	649	
ニチハ	0.2	0.2	256	
鉄鋼 (1.5%)				
新日鐵住金	54	51	14,152	
神戸製鋼所	18	21	4,305	
中山製鋼所	1	—	—	
合同製鐵	1	1	184	
ジェイ エフ イー ホールディングス	3.3	3.1	7,887	
日新製鋼	0.5	0.5	613	
東京製鐵	0.7	0.6	540	
共英製鋼	0.1	0.1	216	
大和工業	0.3	0.3	898	
大阪製鐵	0.1	0.1	213	
淀川製鋼所	1	1	423	

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
丸一銅管	0.4	0.4	1,123	
大同特殊鋼	2	2	936	
日本高周波鋼業	1	1	108	
日本冶金工業	1	0.9	210	
山陽特殊製鋼	1	1	411	
愛知製鋼	1	1	491	
日立金属	1	1	1,908	
日本金属	—	1	146	
大平洋金属	1	1	322	
新日本電工	1	0.7	206	
栗本鐵工所	1	1	220	
三菱製鋼	1	1	237	
日亜鋼業	—	1	342	
シンニッタン	0.1	0.1	52	
新家工業	—	1	183	
非鉄金属 (0.9%)				
大紀アルミニウム工業所	—	1	319	
日本軽金属ホールディングス	2.9	2.9	504	
三井金属鉱業	3	3	744	
東邦亜鉛	1	1	377	
三菱マテリアル	8	8	3,008	
住友金属鉱山	3	3	5,115	
DOWAホールディングス	1	1	964	
古河機械金属	3	2	384	
大阪チタニウムテクノロジーズ	0.2	0.1	246	
東邦チタニウム	0.3	0.3	246	
UACJ	2	1	301	
古河電気工業	5	4	796	
住友電気工業	4.9	4.5	6,885	
フジクラ	2	2	972	
昭和電線ホールディングス	2	2	198	
東京特殊電線	—	0.1	146	
タツタ電線	0.2	0.2	101	
カナレ電気	—	0.1	220	
平河ヒューテック	0.1	0.1	108	
リョービ	1	1	316	
アーレスティ	—	0.2	126	
アサヒホールディングス	0.2	0.2	348	
金属製品 (0.6%)				
稲葉製作所	0.1	0.1	133	

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
宮地エンジニアリンググループ	1	1	183	
トーカロ	0.1	0.1	196	
アルファC o	0.1	0.1	118	
SUMCO	0.8	0.9	1,813	
東洋製罐グループホールディングス	0.9	0.9	1,328	
コロナ	0.1	0.1	118	
横河ブリッジホールディングス	—	0.2	265	
OSJBホールディングス	0.3	—	—	
三和ホールディングス	1	1.2	951	
三協立山	0.2	0.1	183	
東洋シヤッター	0.1	0.1	83	
LIXILグループ	1.8	1.8	4,260	
日本ファイルコン	0.1	0.1	46	
ノーリツ	0.3	0.2	377	
長野製作所	0.1	0.1	289	
リンナイ	0.2	0.2	1,576	
ダイニチ工業	0.1	0.1	76	
三洋工業	—	1	210	
岡部	0.3	0.2	201	
中国工業	0.1	0.1	81	
東プレ	0.3	0.2	333	
高周波熱錬	0.2	0.3	259	
東京製綱	1	1	217	
モリテック スチール	0.1	0.1	31	
パイオラックス	0.1	0.1	538	
日本発條	1.1	1.1	1,159	
アドバネクス	—	1	180	
三益半導体工業	0.1	0.1	129	
機械 (5.2%)				
日本製鋼所	2	2	940	
三浦工業	0.2	0.5	662	
オークマ	1	1	1,090	
東芝機械	1	1	446	
アマダ	2	1.8	1,935	
アイダエンジニアリング	0.3	0.3	352	
富士機械製造	0.4	0.4	455	
牧野フライス製作所	1	1	965	
オーエスジー	0.5	0.6	1,296	
旭ダイヤモンド工業	0.3	0.3	361	
DMG森精機	0.7	0.8	1,221	

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
ディスコ	0.1	0.1	0.1	1,069
日東工器	0.1	0.1	0.1	219
豊和工業	0.1	0.1	0.1	74
東洋機械金属	0.1	0.1	0.1	46
島精機製作所	0.2	0.2	0.2	400
日阪製作所	—	0.2	0.2	186
やまびこ	0.1	—	—	—
ベガスミシン製造	0.1	0.2	0.2	119
ナプテスコ	0.6	0.7	0.7	2,156
三井海洋開発	0.1	0.1	0.1	191
SMC	0.4	0.4	0.4	12,674
新川	0.1	0.1	0.1	62
ユニオンツール	0.1	0.1	0.1	330
オイレス工業	0.1	0.2	0.2	431
サトーホールディングス	0.1	0.2	0.2	525
日精樹脂工業	0.1	0.1	0.1	139
ワイエイシイ	0.1	0.1	0.1	63
小松製作所	5.9	6	6	13,944
住友重機械工業	4	3	3	1,986
日立建機	0.7	0.6	0.6	1,297
井関農機	1	1	1	223
TOWA	0.1	0.1	0.1	71
北川鉄工所	1	1	1	236
クボタ	7	6	6	10,449
月島機械	—	0.2	0.2	254
帝国電機製作所	—	0.1	0.1	122
東京機械製作所	—	1	1	72
新東工業	0.3	0.3	0.3	249
澁谷工業	0.1	0.1	0.1	242
アイチ コーポレーション	0.2	0.2	0.2	117
小森コーポレーション	0.3	0.3	0.3	354
鶴見製作所	—	0.1	0.1	197
荏原製作所	3	3	3	1,365
西島製作所	0.1	0.1	0.1	86
北越工業	—	0.1	0.1	108
ダイキン工業	1.6	1.7	1.7	13,967
トーヨーカネツ	1	1	1	240
栗田工業	0.8	0.7	0.7	1,900
椿本チエイン	1	1	1	956
木村化工機	0.1	0.2	0.2	100

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
アネスト岩田	—	0.2	0.2	156
ダイフク	0.5	0.6	0.6	804
タダノ	1	1	1	1,469
フジテック	—	0.3	0.3	363
CKD	0.3	0.3	0.3	315
キトー	0.1	0.1	0.1	111
平和	0.3	0.3	0.3	718
理想科学工業	0.1	0.1	0.1	185
SANKYO	0.4	0.4	0.4	1,692
日本金銭機械	0.1	0.1	0.1	167
マースエンジニアリング	0.1	0.1	0.1	209
福島工業	0.1	0.1	0.1	175
オーイズミ	0.1	—	—	—
ダイコク電機	0.1	—	—	—
アマノ	0.3	0.4	0.4	506
JUKI	1	1	1	391
サンデン	1	1	1	560
蛇の目ミシン工業	1	1	1	133
グローリー	0.4	0.4	0.4	1,218
新晃工業	0.1	0.1	0.1	135
大和冷機工業	—	0.1	0.1	70
セガサミーホールディングス	1.3	1.2	1.2	1,868
リケン	1	—	—	—
TPR	0.1	0.1	0.1	294
ホシザキ電機	0.3	0.3	0.3	1,821
大豊工業	0.1	0.1	0.1	130
日本精工	3	2	2	2,760
NTN	3	3	3	1,503
ジェイテクト	1.3	1.2	1.2	2,317
不二越	1	1	1	631
THK	0.7	0.8	0.8	2,272
ユースン精機	0.1	0.1	0.1	223
イーグル工業	0.2	0.2	0.2	441
前澤工業	0.1	0.1	0.1	31
日本ビラー工業	0.1	0.1	0.1	87
キッツ	0.5	0.5	0.5	297
日立工機	0.3	0.3	0.3	255
マキタ	0.8	0.8	0.8	4,176
日立造船	0.9	0.9	0.9	576
三菱重工業	22	19	19	12,500

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
I H I	8	8	4,848
電気機器 (12.8%)			
イビデン	0.7	0.8	1,420
コニカミノルタ	3	2.7	3,194
ブラザー工業	1.6	1.5	3,000
ミネベア	2	2	3,648
日立製作所	29	28	24,556
東芝	24	24	11,236
三菱電機	12	12	16,608
富士電機	3	3	1,494
安川電機	1	1.4	2,072
シンフォニアテクノロジー	1	1	188
明電舎	1	1	359
デンヨー	0.2	0.1	193
東芝テック	1	1	716
マブチモーター	0.2	0.4	1,926
日本電産	0.7	1.2	9,706
東光高岳	0.1	0.1	175
ダイヘン	1	1	556
JVCケンウッド	0.9	0.9	283
第一精工	0.1	0.1	215
オムロン	1.4	1.3	6,077
日東工業	0.2	0.2	437
I D E C	0.2	0.1	103
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2	2	1,074
サクサホールディングス	—	1	228
メルコホールディングス	0.1	0.1	179
日本電気	17	15	4,875
富士通	12	11	7,544
沖電気工業	5	4	960
岩崎通信機	1	1	96
サンケン電気	1	1	962
アイホン	0.1	—	—
ルネサスエレクトロニクス	0.7	0.6	498
セイコーエプソン	0.9	0.8	3,472
ワコム	1	0.9	504
アルバック	0.2	0.2	327
アクセル	0.1	0.1	168
E I Z O	0.1	0.1	258
ジャパンディスプレイ	—	1.8	752

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本信号	0.4	0.3	377
能美防災	—	0.2	298
エレコム	0.1	—	—
パナソニック	14	14.1	18,999
シャープ	9	10	2,320
アンリツ	0.7	0.7	541
ソニー	6.7	7.4	19,968
T D K	0.7	0.7	5,481
帝国通信工業	1	—	—
ミツミ電機	0.5	0.4	354
タムラ製作所	1	—	—
アルプス電気	0.9	0.9	2,252
池上通信機	1	1	172
パイオニア	1.7	1.7	384
日本電波工業	0.2	0.1	93
鈴木	—	0.1	88
ローランド ディー. ジー.	0.1	0.1	351
フォスター電機	0.1	0.1	224
クラリオン	1	1	343
ヨコオ	0.1	0.1	62
東光	1	—	—
ティアック	1	1	58
ホシデン	0.4	0.4	251
ヒロセ電機	0.2	0.2	2,670
T O A	0.1	0.1	114
日立マクセル	—	0.2	390
古野電気	0.2	0.2	240
ユニデン	1	—	—
アルパイン	0.3	0.3	582
スミダコーポレーション	0.1	0.1	78
アイコム	0.1	0.1	267
リオン	—	0.1	141
船井電機	0.2	0.2	281
横河電機	1.4	1.1	1,362
アズビル	0.4	0.4	1,162
東亜ディーケーケー	0.1	0.1	57
日本光電工業	0.3	0.2	1,190
チノー	—	0.1	117
共和電業	—	0.2	90
日本電子材料	0.1	0.1	64

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
堀場製作所	0.2	0.2	764	
アドバンテクト	0.8	0.8	1,161	
小野測器	—	0.1	89	
エスベック	0.2	0.1	105	
パナソニック デバイスSUNX	0.2	0.2	164	
キーエンス	0.3	0.3	16,794	
日置電機	0.1	0.1	177	
シスメックス	0.5	0.9	4,779	
メガチップス	0.2	0.1	141	
OBARA GROUP	0.1	0.1	588	
日本電産コパル電子	0.2	—	—	
コーセル	0.2	0.2	251	
オプテックス	0.1	0.1	189	
千代田インテグレ	0.1	0.1	216	
レーザーテック	0.1	0.1	140	
スタンレー電気	0.9	0.9	2,394	
岩崎電気	1	—	—	
ウシオ電機	0.7	0.7	987	
岡谷電機産業	0.1	0.1	44	
ヘリオス テクノ ホールディング	0.2	0.2	84	
日本セラミック	0.1	0.1	181	
遠藤照明	0.1	0.1	133	
日本デジタル研究所	0.1	0.1	142	
双信電機	0.1	0.1	42	
山一電機	0.2	0.2	167	
図研	0.1	0.1	118	
カシオ計算機	1.3	1.2	2,216	
ファナック	1.4	1.2	23,904	
日本シイエムケイ	0.3	0.2	65	
エンプラス	—	0.1	450	
ローム	0.6	0.6	4,530	
浜松ホトニクス	0.5	0.5	2,775	
三井ハイテック	0.2	0.2	156	
新光電気工業	0.5	0.4	339	
京セラ	2.1	1.9	9,821	
太陽誘電	0.6	0.6	885	
村田製作所	1.3	1.2	15,642	
ユージン	0.2	0.2	139	
双葉電子工業	0.2	0.2	376	
北陸電気工業	1	1	176	

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
ニチコン	0.4	0.3	264	
日本ケミコン	1	1	334	
KOA	0.2	0.2	217	
小糸製作所	1	0.7	2,681	
ミツバ	0.2	0.2	428	
スター精密	0.2	0.2	293	
SCREENホールディングス	1	1	687	
キヤノン電子	0.1	0.1	208	
キヤノン	7.1	6.7	24,873	
リコー	3.7	3.5	3,918	
東京エレクトロン	1.1	1	8,130	
輸送用機器 (12.0%)				
トヨタ紡織	0.4	0.4	632	
ユニプレス	0.2	0.2	410	
豊田自動織機	1.1	1.1	6,842	
モリタホールディングス	—	0.2	257	
三櫻工業	0.2	0.1	74	
デンソー	3	2.9	15,227	
東海理化電機製作所	0.4	0.3	741	
三井造船	5	5	960	
佐世保重工業	1	—	—	
川崎重工業	10	8	4,544	
名村造船所	0.2	0.3	345	
サノヤスホールディングス	0.1	0.2	59	
ニチュ三菱フォークリフト	—	0.1	73	
近畿車輛	—	1	329	
日産自動車	17.2	16.3	16,528	
いすゞ自動車	7	3.7	5,820	
トヨタ自動車	17.1	16	122,560	
日野自動車	1.6	1.7	2,830	
三菱自動車工業	3.9	4.2	4,275	
エフテック	0.1	0.1	117	
レシップホールディングス	—	0.1	85	
GMB	0.1	0.1	132	
武蔵精密工業	0.1	0.1	241	
日産車体	1	0.5	641	
新明和工業	1	—	—	
極東開発工業	0.2	0.2	266	
日信工業	0.2	0.2	361	
トビー工業	1	1	266	

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
ティラド	1	—	—	—
曙ブレーキ工業	0.6	0.5	211	
タチエス	0.2	0.2	339	
NOK	0.6	0.6	2,037	
フタバ産業	0.4	0.4	246	
カヤバ工業	1	1	472	
シロキ工業	1	1	311	
大同メタル工業	—	0.2	221	
プレス工業	—	1	403	
カルソニックカンセイ	1	1	656	
太平洋工業	0.3	0.2	194	
ケーヒン	0.3	0.3	556	
河西工業	—	0.1	102	
アイシン精機	1.1	1.1	4,554	
マツダ	18	3.4	8,219	
ダイハツ工業	1.3	1.4	2,312	
今仙電機製作所	0.1	0.1	150	
本田技研工業	11	10.5	38,844	
スズキ	2.6	2.4	8,935	
富士重工業	4.1	3.9	16,633	
安永	—	0.1	60	
ヤマハ発動機	1.9	1.8	4,584	
ショーワ	0.3	0.3	353	
T B K	—	0.2	121	
エクセディ	0.1	0.2	523	
豊田合成	0.4	0.4	1,033	
愛三工業	0.2	0.2	206	
ヨロズ	0.1	0.1	233	
エフ・シー・シー	0.2	0.2	385	
シマノ	0.5	0.5	7,785	
タカタ	0.2	0.2	269	
テイ・エス テック	0.3	0.2	629	
精密機器 (1.5%)				
テルモ	0.9	1.8	5,281	
クリエートメディック	0.1	0.1	100	
日機装	0.4	0.4	420	
島津製作所	2	1	1,211	
クボテック	—	0.1	27	
ショットモリテックス	—	0.1	23	
長野計器	0.1	0.1	67	

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
東京計器	—	1	281	
オーバル	—	0.1	32	
東京精密	0.2	0.2	466	
ニコン	2.3	2.2	3,271	
トプコン	0.4	0.4	932	
オリンパス	1.8	1.7	6,944	
理研計器	0.1	0.1	121	
タムロン	0.1	0.1	232	
HOYA	3	2.8	13,066	
ノーリツ鋼機	0.1	0.2	128	
エー・アンド・デイ	0.1	0.2	98	
シチズンホールディングス	1.5	1.4	1,318	
リズム時計工業	1	1	163	
大研医器	—	0.1	119	
松風	0.1	0.1	150	
セイコーホールディングス	1	1	635	
ニプロ	0.7	0.7	718	
その他製品 (1.3%)				
パラマウントベッドホールディングス	0.1	0.1	333	
S H O - B I	0.1	0.1	40	
前田工織	0.1	0.1	107	
アートネイチャー	—	0.1	119	
ダンロップスポーツ	0.1	0.1	134	
バンダイナムコホールディングス	1.3	1.3	3,144	
共立印刷	0.3	0.3	86	
フランスベッドホールディングス	1	1	181	
パイロットコーポレーション	0.1	0.1	683	
トッパン・フォームズ	0.2	0.2	245	
フジシールインターナショナル	0.1	0.1	374	
タカラトミー	0.4	0.5	328	
廣済堂	0.1	0.2	97	
アーク	0.4	0.4	55	
タカノ	0.1	0.1	57	
プロネクス	0.2	0.1	74	
ホクシン	0.1	0.1	12	
大建工業	—	1	269	
凸版印刷	3	3	2,382	
大日本印刷	4	4	4,240	
日本写真印刷	0.2	0.2	359	
宝印刷	0.1	0.1	86	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アシックス	1.2	1.2	3,433
ツツミ	0.1	0.1	243
ローランド	0.1	—	—
小松ウオール工業	—	0.1	249
ヤマハ	0.9	0.9	1,546
河合楽器製作所	1	—	—
クリナップ	0.1	0.1	86
ビジョン	0.2	0.2	1,468
キングジム	0.1	0.1	74
リンテック	0.3	0.3	781
TASAKI	0.1	—	—
イトーキ	0.3	0.3	170
任天堂	0.8	0.7	8,011
三菱鉛筆	0.1	0.1	344
タカラスタンダード	1	—	—
コクヨ	0.6	0.6	536
グロープライド	1	1	189
岡村製作所	—	0.5	429
美津濃	1	1	580
アデランス	0.2	0.1	104
電気・ガス業 (2.2%)			
東京電力	10.4	9.8	4,723
中部電力	4.1	3.5	5,244
関西電力	5.1	4.7	5,000
中国電力	1.7	1.6	2,604
北陸電力	1.2	1.2	1,999
東北電力	3.1	2.9	4,315
四国電力	1.1	1.1	1,653
九州電力	2.7	2.6	2,826
北海道電力	1.1	1.1	985
沖縄電力	0.1	0.1	394
電源開発	0.8	0.8	3,724
東京瓦斯	14	14	10,092
大阪瓦斯	13	12	5,646
東邦瓦斯	3	3	1,893
西部瓦斯	1	1	257
静岡瓦斯	0.3	0.3	222
陸運業 (4.3%)			
SBSホールディングス	—	0.1	90
東武鉄道	7	6	3,414

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	2	2	1,100
東京急行電鉄	7	6	4,752
京浜急行電鉄	3	3	2,775
小田急電鉄	4	4	4,620
京王電鉄	3	3	2,922
京成電鉄	2	2	3,026
東日本旅客鉄道	2.3	2.1	19,683
西日本旅客鉄道	1.1	1.1	7,024
東海旅客鉄道	1.1	1	20,175
西武ホールディングス	—	1	2,832
鴻池運輸	0.1	0.1	239
西日本鉄道	2	2	1,036
ハマキョウレックス	0.1	—	—
近畿日本鉄道	12	12	5,004
阪急阪神ホールディングス	8	8	5,304
南海電気鉄道	3	3	1,437
京阪電気鉄道	3	3	2,160
名糖運輸	0.1	0.1	72
名古屋鉄道	4	5	2,340
日本通運	5	5	3,435
ヤマトホールディングス	2.3	2.1	5,720
山九	1	1	455
丸運	0.1	0.1	25
丸全昭和運輸	—	1	404
センコー	1	—	—
日本梱包運輸倉庫	0.4	0.4	742
日本石油輸送	—	1	233
福山通運	1	1	666
セイノーホールディングス	1	1	1,286
日立物流	0.3	0.2	336
海運業 (0.3%)			
日本郵船	10	10	3,480
商船三井	7	6	2,448
川崎汽船	5	5	1,715
N S ユナイテッド海運	1	—	—
乾汽船	0.1	—	—
明治海運	0.1	0.2	85
飯野海運	0.5	0.7	460
第一中央汽船	1	2	92

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
空運業 (0.7%)			
日本航空	1	2.2	8,635
ANAホールディングス	25	23	7,376
スカイマーク	0.3	—	—
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	0.1	—	—
三菱倉庫	1	1	1,708
三井倉庫ホールディングス	1	1	393
住友倉庫	1	1	645
乾汽船	—	0.1	96
ケイヒン	—	1	191
中央倉庫	0.1	0.1	93
安田倉庫	0.1	0.1	99
東洋埠頭	1	—	—
宇徳	0.1	0.1	63
上組	1	1	1,179
サンリツ	—	0.1	55
キムラユニティー	—	0.1	100
キューソー流通システム	0.1	0.1	143
郵船ロジスティクス	0.1	0.1	143
近鉄エクスプレス	0.1	0.1	508
東海運	0.1	0.1	28
エーアイティー	—	0.1	120
情報・通信業 (7.0%)			
NECネットエスアイ	0.1	0.1	247
システナ	0.2	0.1	85
デジタルアーツ	—	0.1	111
新日鉄住金ソリューションズ	0.1	0.1	300
キューブシステム	—	0.1	59
コア	0.1	0.1	88
ソフトクリエイトホールディングス	0.1	0.1	92
ITホールディングス	0.4	0.4	775
電算システム	—	0.1	149
グリー	0.7	0.7	465
コーエーテクモホールディングス	0.2	0.3	503
三菱総合研究所	0.1	—	—
KL a b	0.1	0.1	120
ポルトゥガウィン・ピットクルーホールディ	0.1	0.1	80
ネクソン	1	1.1	1,277
アイスタイル	—	0.1	50

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コプロラ	—	0.2	517
モバイルクリエイト	—	0.1	73
ブロードリーフ	0.1	0.1	182
ドワンゴ	0.1	—	—
マクロミル	0.3	—	—
ティーガイア	0.1	0.1	131
豆蔵ホールディングス	0.1	0.1	75
テクマトリックス	—	0.1	60
GMOペイメントゲートウェイ	0.1	0.1	208
ザッパラス	0.1	0.1	65
インターネットイニシアティブ	0.2	0.2	492
ビットアイル	0.1	0.2	100
SRAホールディングス	0.1	0.1	145
朝日ネット	0.1	0.2	101
フェイス	0.1	0.1	121
野村総合研究所	0.7	0.6	2,397
サイバネットシステム	0.1	0.1	46
インテージホールディングス	0.1	0.1	166
東邦システムサイエンス	—	0.1	59
ソースネクスト	0.1	0.1	76
ティー・ワイ・オー	—	0.2	34
フジ・メディア・ホールディングス	1.1	1.1	1,636
オービック	0.4	0.4	1,636
ジャストシステム	—	0.2	141
ヤフー	8.7	8.2	3,296
トレンドマイクロ	0.5	0.6	1,986
日本オラクル	0.2	0.2	1,004
アルファシステムズ	0.1	0.1	151
フューチャーアーキテクト	0.2	0.1	64
CAC Holdings	0.1	0.1	112
オービックビジネスコンサルタンツ	0.1	0.1	357
伊藤忠テクノソリューションズ	0.1	0.1	425
アイティフォー	0.2	0.2	89
大塚商会	0.1	0.3	1,248
サイボウズ	0.2	0.2	71
ソフトブレイン	0.2	0.2	38
電通国際情報サービス	0.1	0.1	114
C I J	0.2	0.1	45
日本エンタープライズ	—	0.1	39
日本コロムビア	0.1	0.1	39

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
イマジカ・ロボット ホールディングス	—	0.1	49	
ネットワンシステムズ	0.5	0.5	376	
アルゴグラフィックス	0.1	—	—	
マーベラス	0.2	0.2	321	
エイベックス・グループ・ホールディングス	0.2	0.2	400	
日本ユニシス	0.3	0.3	313	
兼松エレクトロニクス	0.1	0.1	176	
東京放送ホールディングス	0.7	0.7	924	
日本テレビホールディングス	1.2	1	1,928	
朝日放送	—	0.1	94	
テレビ朝日ホールディングス	0.3	0.3	544	
スカパーJ S A Tホールディングス	0.9	0.9	652	
テレビ東京ホールディングス	0.1	0.1	259	
コネクシオ	0.1	0.1	104	
日本電信電話	4.8	4.5	31,306	
KDD I	3.8	3.9	31,410	
光通信	0.1	0.1	674	
NTTドコモ	9.9	9.4	18,583	
GMOインターネット	0.4	0.4	386	
KADOKAWA・DWANGO	—	0.3	532	
学研ホールディングス	1	—	—	
ゼンリン	0.2	0.2	287	
昭文社	0.1	0.1	85	
KADOKAWA	0.1	—	—	
インプレスホールディングス	0.1	0.1	12	
アイネット	0.1	0.1	89	
松竹	1	1	1,161	
東宝	0.8	0.8	2,116	
東映	1	—	—	
AOI P r o .	0.1	0.1	77	
エヌ・ティ・ティ・データ	0.8	0.7	3,080	
D T S	0.1	0.1	248	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.4	0.4	1,034	
シーイーシー	0.1	0.1	100	
カプコン	0.3	0.3	587	
ジャステック	0.1	0.1	91	
S C S K	0.3	0.3	867	
日本システムウエア	0.1	0.1	96	
アイネス	0.2	0.2	173	
T K C	0.1	0.1	207	

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
富士ソフト	0.2	0.2	472	
NSD	0.3	0.2	353	
コナミ	0.5	0.5	1,103	
J B C Cホールディングス	0.1	0.1	75	
ミロク情報サービス	—	0.1	69	
ソフトバンク	5.9	6.1	42,889	
卸売業 (4.0%)				
高千穂交易	0.1	0.1	105	
エレマテック	0.1	0.1	275	
J A L U X	0.1	0.1	208	
あらた	—	1	323	
双日	8	7.6	1,162	
アルフレッサ ホールディングス	0.4	1.4	2,016	
横浜冷凍	0.3	0.3	244	
ラサ商事	0.1	0.1	54	
アルコニックス	0.1	0.1	182	
あい ホールディングス	0.2	0.2	404	
ダイワボウホールディングス	1	1	199	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	0.2	0.2	181	
八洲電機	0.1	0.1	56	
UKCホールディングス	0.1	0.1	180	
T O K A Iホールディングス	0.6	0.6	320	
三洋貿易	—	0.1	128	
シップヘルスケアホールディングス	0.2	0.2	595	
富士興産	0.1	0.1	58	
小野建	0.1	0.1	95	
佐島電機	0.1	0.1	76	
エコトレードィング	—	0.1	66	
伯東	0.1	0.1	124	
コンドレーテック	0.1	0.1	82	
中山福	0.1	0.1	88	
ナガイレーベン	0.2	0.2	393	
三菱食品	0.1	0.1	258	
松田産業	0.1	—	—	
メディカルホールディングス	1.2	1.2	1,671	
アドヴァン	0.1	0.1	131	
アズワン	0.1	0.1	317	
スズデン	0.1	0.1	70	
尾家産業	0.1	0.1	83	
シモジマ	0.1	0.1	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
ドウシシャ	0.1	0.2	0.2	387
高速	0.1	0.1	0.1	88
黒田電気	0.2	0.2	0.2	337
丸文	0.2	0.1	0.1	78
ハビネット	0.1	0.1	0.1	132
トーマンエレクトロニクス	0.1	—	—	—
エクセル	0.1	0.1	0.1	126
マルカキカイ	0.1	—	—	—
ガリバーインターナショナル	0.4	0.4	0.4	383
日本エム・ディ・エム	0.1	0.1	0.1	65
進和	0.1	0.1	0.1	132
エスケイジャパン	—	0.1	0.1	23
ダイトエレクトロニクス	0.1	0.1	0.1	59
シークス	0.1	0.1	0.1	249
田中商事	0.1	0.1	0.1	66
オーハシテクニカ	0.1	0.1	0.1	157
マクニカ	0.1	0.1	0.1	351
白銅	0.1	0.1	0.1	114
伊藤忠商事	9.6	9.5	9.5	11,385
丸紅	11	10	10	6,572
長瀬産業	0.7	0.7	0.7	1,029
蝶理	0.1	0.1	0.1	192
豊田通商	1.3	1.3	1.3	3,621
三共生興	0.2	0.2	0.2	94
兼松	3	2	2	338
三井物産	11.1	9.7	9.7	14,744
日本紙パルプ商事	1	1	1	334
日立ハイテクノロジーズ	0.4	0.4	0.4	1,484
カメイ	0.2	0.2	0.2	154
山善	0.5	0.5	0.5	415
住友商事	7.1	6.7	6.7	7,872
三菱商事	9.4	8.8	8.8	18,167
キヤノンマーケティングジャパン	0.3	0.3	0.3	655
佐藤商事	0.1	0.2	0.2	146
菱洋エレクトロ	0.1	0.2	0.2	244
東京産業	0.1	0.2	0.2	94
ユアサ商事	1	0.1	0.1	239
小林産業	0.1	0.1	0.1	24
阪和興業	1	1	1	452
フルサト工業	0.1	0.1	0.1	157

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
岩谷産業	1	1	1	763
すてきなイスグループ	1	—	—	—
昭光通商	1	—	—	—
稲畑産業	0.3	0.3	0.3	321
明和産業	0.2	0.1	0.1	44
ワキタ	—	0.2	0.2	222
東邦ホールディングス	0.4	0.4	0.4	665
サンゲツ	0.2	0.2	0.2	634
ミツウロコグループホールディングス	0.2	0.2	0.2	108
伊藤忠エネクス	0.3	0.3	0.3	274
サンリオ	0.3	0.4	0.4	1,186
サンワテクノス	0.1	0.1	0.1	119
リョーサン	0.2	0.2	0.2	500
新光商事	0.1	0.1	0.1	114
三信電気	0.1	0.2	0.2	161
東陽テクニカ	0.2	0.2	0.2	220
モスフードサービス	0.2	0.2	0.2	489
加賀電子	0.1	0.1	0.1	148
立花エレテック	0.1	0.1	0.1	163
P a l t a c	0.2	0.2	0.2	295
太平洋興発	1	1	1	96
ヤマタネ	1	1	1	175
日鉄住金物産	1	1	1	433
トラスコ中山	0.1	0.1	0.1	310
オートバックスセブン	0.4	0.4	0.4	699
加藤産業	0.2	0.2	0.2	431
イノテック	0.2	0.2	0.2	96
イエローハット	0.1	0.1	0.1	231
富士エレクトロニクス	0.1	0.1	0.1	144
J Kホールディングス	0.1	0.2	0.2	111
日伝	0.1	—	—	—
北沢産業	—	0.1	0.1	17
杉本商事	0.1	0.1	0.1	125
因幡電機産業	0.2	0.2	0.2	791
バイテック	—	0.1	0.1	96
ミスミグループ本社	0.5	0.4	0.4	1,802
江守グループホールディングス	—	0.1	0.1	104
アルテック	0.1	0.1	0.1	20
スズケン	0.5	0.5	0.5	1,695
ジェコス	0.1	0.1	0.1	149

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
ルネサスイーストン	—	0.1	72	
小売業 (4.3%)				
ローソン	0.5	0.4	3,088	
サンエー	0.1	0.1	386	
キリン堂	0.1	—	—	
ダイユーエイト	—	0.1	88	
カワチ薬品	0.1	0.1	187	
エービーシー・マート	0.2	0.2	1,182	
ハードオフコーポレーション	0.1	0.1	109	
アスクル	0.1	0.1	181	
ゲオホールディングス	0.3	0.2	230	
アダストリアホールディングス	0.1	0.1	285	
くらコーポレーション	0.1	0.1	369	
キャンドウ	0.1	0.1	153	
バル	0.1	0.1	292	
エディオン	0.6	0.6	520	
サーラコーポレーション	0.2	0.1	58	
ワッツ	—	0.1	85	
ひらまつ	0.2	0.2	129	
ハニーズ	0.1	0.1	101	
アルベン	0.1	0.1	166	
クオール	0.1	0.1	87	
ジェイアイエヌ	0.1	0.1	344	
ビックカメラ	0.005	0.5	674	
DCMホールディングス	0.6	0.6	469	
MonotaRO	0.2	0.2	605	
きちり	—	0.1	69	
J. フロント リテイリング	3	1.5	2,280	
ドトール・日レスホールディングス	0.2	0.2	332	
マツモトキヨシホールディングス	0.2	0.3	1,173	
スタートトゥデイ	0.4	0.4	1,019	
ココカラファイン	0.1	0.1	302	
三越伊勢丹ホールディングス	2.4	2.2	3,682	
ウエルシアホールディングス	—	0.1	442	
クリエイトSDホールディングス	0.1	0.1	390	
丸善CHIホールディングス	0.1	0.2	70	
ネクステージ	—	0.1	62	
ジョイフル本田	—	0.1	425	
キリン堂ホールディングス	—	0.1	81	
すかいらーく	—	0.4	505	

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
ブックオフコーポレーション	0.1	0.1	85	
あさひ	0.1	0.1	114	
日本調剤	0.02	—	—	
コスモス薬品	0.1	0.1	1,918	
トーエール	—	0.1	65	
一六堂	—	0.1	44	
セブン&アイ・ホールディングス	5	4.7	20,282	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	—	0.1	156	
ツルハホールディングス	0.1	0.2	1,606	
フェリシモ	0.1	0.1	99	
トリドール	0.2	0.1	167	
クスリのアオキ	—	0.1	773	
メディカルシステムネットワーク	0.1	0.2	75	
はるやま商事	0.1	0.1	72	
カッパ・クリエイトホールディングス	0.1	0.2	231	
ライトオン	0.1	0.1	74	
ジーンズメイト	0.1	0.1	23	
良品計画	0.1	0.1	1,288	
三城ホールディングス	0.2	0.2	96	
コナカ	0.2	0.1	61	
G-7ホールディングス	0.1	0.1	99	
イオン北海道	0.1	0.1	70	
コジマ	0.2	0.2	62	
ヒマラヤ	—	0.1	99	
コーナン商事	0.1	0.2	266	
エコス	0.1	0.1	96	
ワタミ	0.1	0.2	236	
マルシェ	—	0.1	90	
ドンキホーテホールディングス	0.4	0.4	3,472	
西松屋チェーン	0.2	0.2	187	
ゼンショーホールディングス	0.4	0.6	639	
幸楽苑	0.1	0.1	161	
ハークスレイ	0.1	0.1	98	
サイゼリヤ	0.2	0.2	379	
ポプラ	—	0.1	56	
ユナイテッドアローズ	0.2	0.2	650	
ハイデイ日高	0.1	0.1	367	
京都きもの友禅	0.1	0.1	100	
コロワイド	0.5	0.4	742	
壺番屋	0.1	—	—	

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
トップカルチャー	0.1	0.1	0.1	49
P L A N T	—	0.1	0.1	126
スギホールディングス	0.2	0.2	0.2	1,122
スクロール	0.2	0.2	0.2	56
ヨンドシーホールディングス	0.1	0.1	0.1	184
ファミリーマート	0.4	0.4	0.4	2,012
木曽路	0.1	0.1	0.1	201
サトレストランシシステムズ	0.2	0.1	0.1	108
千趣会	0.3	0.2	0.2	165
タカキュー	0.1	0.1	0.1	22
ケーヨー	0.2	0.3	0.3	169
日本瓦斯	0.2	0.2	0.2	577
ベスト電器	0.4	0.4	0.4	58
ロイヤルホールディングス	0.2	0.2	0.2	337
いなげや	0.1	0.1	0.1	133
島忠	0.3	0.3	0.3	875
チヨダ	0.1	0.1	0.1	246
ライフコーポレーション	0.1	0.1	0.1	169
カスミ	0.2	0.2	0.2	199
リンガーハット	0.1	0.1	0.1	227
さが美	—	1	1	95
Mr M a x	0.2	0.2	0.2	56
テンアライド	0.1	0.1	0.1	38
AOKIホールディングス	0.2	0.3	0.3	408
コメリ	0.2	0.2	0.2	493
青山商事	0.3	0.3	0.3	1,131
しまむら	0.1	0.1	0.1	1,034
CFSコーポレーション	0.1	0.1	0.1	84
はせがわ	0.1	0.1	0.1	57
高島屋	2	2	2	2,098
松屋	0.2	0.2	0.2	382
エイチ・ツー・オー リテイリング	1	0.6	0.6	1,291
ニッセンホールディングス	0.3	0.3	0.3	90
パルコ	0.2	0.1	0.1	100
丸井グループ	1.5	1.4	1.4	1,666
アクシアル リテイリング	0.1	0.1	0.1	268
井筒屋	1	1	1	63
ダイエー	0.75	—	—	—
イオン	4.8	4.8	4.8	5,973
ユニーグループ・ホールディングス	1.1	1.1	1.1	743

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
イズミ	0.3	0.3	0.3	1,263
平和堂	0.2	0.2	0.2	494
フジ	0.1	0.1	0.1	215
ヤオコー	0.1	0.1	0.1	824
ゼビオ	0.1	0.2	0.2	370
ケーズホールディングス	0.2	0.3	0.3	1,027
O l y m p i cグループ	0.1	0.1	0.1	81
日産東京販売ホールディングス	—	0.2	0.2	52
アインファーマシーズ	0.1	0.1	0.1	391
元気寿司	0.1	—	—	—
ヤマダ電機	4.7	4.5	4.5	1,971
アークランドサカモト	0.1	0.1	0.1	214
ニトリホールディングス	0.25	0.5	0.5	3,280
愛眼	0.1	0.1	0.1	24
ケーユーホールディングス	—	0.1	0.1	63
吉野家ホールディングス	0.3	0.3	0.3	400
松屋フーズ	0.1	0.1	0.1	247
関西スーパーマーケット	0.1	0.1	0.1	80
王将フードサービス	0.1	0.1	0.1	443
プレナス	0.1	0.1	0.1	206
ミニストップ	0.1	0.1	0.1	159
アークス	0.2	0.2	0.2	488
パロー	0.3	0.2	0.2	443
ベルク	0.1	0.1	0.1	325
大庄	0.1	0.1	0.1	149
ファーストリテイリング	0.3	0.2	0.2	8,611
サンドラッグ	0.2	0.2	0.2	998
サックスパー ホールディングス	0.1	0.1	0.1	169
ヤマザワ	—	0.1	0.1	169
やまや	—	0.1	0.1	152
ベルーナ	0.3	0.3	0.3	152
銀行業 (8.6%)				
じもとホールディングス	0.8	0.8	0.8	173
足利ホールディングス	0.4	0.7	0.7	343
東京TYフィナンシャルグループ	—	0.2	0.2	677
新生銀行	10	11	11	2,387
あおぞら銀行	6	8	8	3,432
三菱UFJフィナンシャル・グループ	91.6	91.9	91.9	57,437
りそなホールディングス	11.4	13.4	13.4	7,794
三井住友トラスト・ホールディングス	23	25	25	10,330

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	9.1	8.7	34,343	
第四銀行	2	1	398	
北越銀行	1	1	215	
西日本シティ銀行	4	4	1,528	
千葉銀行	5	4	3,128	
横浜銀行	8	8	5,029	
常陽銀行	4	4	2,384	
群馬銀行	3	3	2,304	
武蔵野銀行	0.2	0.2	763	
千葉興業銀行	0.2	0.2	155	
筑波銀行	0.5	0.5	171	
東京都民銀行	0.2	—	—	
七十七銀行	2	2	1,302	
青森銀行	1	1	347	
秋田銀行	1	1	332	
山形銀行	1	1	499	
岩手銀行	0.1	0.1	477	
東邦銀行	1	1	413	
東北銀行	1	1	156	
みちのく銀行	1	1	218	
ふくおかフィナンシャルグループ	5	5	2,930	
静岡銀行	4	3	3,186	
十六銀行	2	1	392	
スルガ銀行	1	1.2	2,661	
八十二銀行	2	2	1,544	
山梨中央銀行	1	1	461	
大垣共立銀行	2	1	364	
福井銀行	1	1	264	
北國銀行	1	1	393	
滋賀銀行	1	1	659	
南都銀行	1	1	396	
百五銀行	1	1	498	
京都銀行	2	2	1,974	
紀陽銀行	0.5	0.5	723	
三重銀行	1	1	260	
ほくほくフィナンシャルグループ	8	8	1,944	
広島銀行	3	3	1,728	
山陰合同銀行	1	1	992	
中国銀行	0.9	0.8	1,345	
鳥取銀行	1	—	—	

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
伊予銀行	1.3	1.2	1,628	
百十四銀行	1	1	392	
四国銀行	1	1	241	
阿波銀行	1	1	641	
鹿児島銀行	1	1	731	
大分銀行	1	1	416	
宮崎銀行	1	1	407	
肥後銀行	1	1	641	
佐賀銀行	1	1	262	
十八銀行	1	1	336	
沖縄銀行	0.1	0.1	465	
琉球銀行	0.2	0.2	325	
八千代銀行	0.1	—	—	
セブン銀行	4.5	3.9	2,102	
みずほフィナンシャルグループ	156.5	158.6	30,514	
山口フィナンシャルグループ	1	1	1,218	
長野銀行	1	—	—	
名古屋銀行	1	1	423	
北洋銀行	1.8	1.8	801	
第三銀行	1	1	193	
中京銀行	1	—	—	
東日本銀行	1	1	330	
大光銀行	1	—	—	
愛媛銀行	1	1	250	
トマト銀行	1	1	175	
みなと銀行	1	1	227	
京葉銀行	1	1	645	
関西アーバン銀行	1	0.2	237	
栃木銀行	1	1	540	
東和銀行	1	2	192	
福島銀行	2	1	86	
大東銀行	1	1	140	
トモニホールディングス	0.9	0.9	456	
フィデアホールディングス	0.7	0.7	144	
池田泉州ホールディングス	0.9	1	527	
証券、商品先物取引業 (1.3%)				
F P G	0.1	—	—	
S B Iホールディングス	1.5	1.4	1,755	
日本アジア投資	1	—	—	
ジャフコ	0.2	0.2	816	

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
大和証券グループ本社	12	11	9,284	
野村ホールディングス	24.8	23.4	14,774	
岡三証券グループ	1	1	820	
丸三証券	0.4	0.4	321	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1.3	1.3	977	
水戸証券	—	0.4	162	
いちよし証券	0.2	0.2	236	
松井証券	0.7	0.6	599	
だいがく証券ビジネス	0.1	0.1	75	
マネックスグループ	1.3	1.3	312	
カブドットコム証券	0.5	0.5	318	
極東証券	0.1	0.2	337	
岩井コスモホールディングス	0.1	0.1	133	
マネーパートナーズグループ	0.1	0.1	39	
保険業 (2.4%)				
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	2.7	2.5	8,115	
アニコム ホールディングス	—	0.1	158	
MS&ADインシュアランスグループホール	3.7	3.7	10,567	
ソニーフィナンシャルホールディングス	1.1	1.1	1,784	
第一生命保険	6	7.4	11,433	
東京海上ホールディングス	4.7	4.7	19,129	
T&Dホールディングス	4.1	4.1	5,364	
その他金融業 (1.1%)				
全国保証	0.1	0.3	1,119	
クレディセゾン	1	0.9	1,773	
アクリーティブ	0.1	0.1	21	
芙蓉総合リース	0.1	0.1	376	
興銀リース	0.2	0.2	444	
東京センチュリーリース	0.3	0.3	819	
日本証券金融	0.6	0.5	289	
アイフル	—	1.9	771	
ポケットカード	0.1	0.1	53	
リコーリース	0.1	0.1	305	
イオンフィナンシャルサービス	0.7	0.8	1,696	
アコム	2.4	2.3	793	
ジャックス	1	1	541	
オリエントコーポレーション	2.7	2.6	457	
日立キャピタル	0.2	0.2	456	
アブラスフィナンシャル	0.4	0.6	77	
オリックス	7.4	8.1	10,894	

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
三菱UFJリース	3.1	2.9	1,479	
日本取引所グループ	1.8	1.7	4,569	
イー・ギャランティ	0.1	—	—	
NECキャピタルソリューション	0.1	—	—	
不動産業 (2.9%)				
日本駐車場開発	1.3	1.2	151	
ヒューリック	2	1.9	2,120	
東京建物不動産販売	0.1	0.1	38	
三栄建築設計	0.1	—	—	
野村不動産ホールディングス	0.8	0.6	1,164	
日本管理センター	—	0.1	129	
フージャースホールディングス	0.2	0.1	48	
オープンハウス	0.1	0.1	205	
東急不動産ホールディングス	2.7	3	2,217	
飯田グループホールディングス	0.5	0.7	1,010	
パーク24	0.6	0.5	1,015	
パラカ	0.1	—	—	
三井不動産	6	6	18,051	
三菱地所	8	9	21,384	
平和不動産	0.3	0.2	331	
東京建物	2	2	1,588	
ダイビル	0.4	0.3	302	
京阪神ビルディング	0.2	0.1	69	
住友不動産	3	3	11,353	
大京	2	2	344	
テーオーシー	0.5	0.4	281	
レオパレス21	1.4	1.2	894	
スターツコーポレーション	—	0.1	165	
フジ住宅	0.2	0.1	66	
空港施設	0.1	0.1	68	
明和地所	0.1	0.1	48	
住友不動産販売	0.1	—	—	
ゴールドクレスト	0.1	0.1	185	
日本エスリード	0.1	—	—	
日神不動産	0.2	0.1	48	
タカラレーベン	0.4	0.5	291	
サンヨーハウジング名古屋	0.1	0.1	125	
イオンモール	0.8	0.7	1,366	
トーセイ	0.2	0.1	70	
エス・ティ・ティ都市開発	0.8	0.7	795	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サンフロンティア不動産	0.1	0.2	182
エフ・ジェー・ネクスト	0.1	—	—
ランドビジネス	0.1	0.1	39
グランディハウス	0.1	0.1	29
日本空港ビルディング	0.4	0.4	2,156
サービス業 (3.0%)			
ネクスト	0.1	0.1	93
日本M&Aセンター	0.1	0.2	781
アコーディア・ゴルフ	0.6	0.5	597
タケエイ	0.1	0.1	89
パソナグループ	0.1	0.1	69
リンクアンドモチベーション	0.002	0.2	32
GCAサヴィアン	0.1	0.1	118
エス・エム・エス	0.1	0.2	242
テンプホールディングス	0.3	0.2	815
クックパッド	0.1	0.1	485
エスクリ	—	0.1	119
学情	0.1	0.1	100
スタジオアリス	0.1	0.1	183
NECフィールディング	0.1	—	—
総合警備保障	0.5	0.4	1,276
カカクコム	0.7	0.9	1,485
ルネサンス	0.1	0.1	115
オプト	0.1	0.1	64
新日本科学	0.1	0.1	79
ツクイ	0.1	0.2	214
総合臨床ホールディングス	—	0.1	45
エムスリー	0.004	1	2,376
ツカダ・グローバルホールディング	0.1	0.1	73
ディー・エヌ・エー	0.7	0.6	907
博報堂DYホールディングス	1.7	1.7	1,995
ぐるなび	0.1	0.1	190
一休	0.001	0.1	154
ジャパンベストレスキューシステム	0.001	0.2	52
ファンコミュニケーションズ	—	0.2	266
PGMホールディングス	0.2	0.2	255
WDBホールディングス	—	0.1	84
ティア	—	0.1	57
バリューコマース	0.1	0.1	52
J Pホールディングス	0.2	0.3	108

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
E P Sホールディングス	0.001	0.2	299
プレステージ・インターナショナル	0.1	0.1	98
アミューズ	0.1	—	—
クイック	—	0.1	77
TAC	0.1	0.1	22
ケネディクス	1.5	1.8	910
電通	1.2	1.4	6,608
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.1	0.1	94
びあ	0.1	0.1	217
イオンファンタジー	0.1	—	—
ネクシィーズ	—	0.1	57
みらかホールディングス	0.3	0.3	1,578
アルプス技研	0.1	0.1	145
日本空調サービス	—	0.1	87
オリエンタルランド	0.3	0.3	8,698
ダスキン	0.4	0.4	754
明光ネットワークジャパン	0.1	0.1	120
ファルコホールディングス	0.1	0.1	129
秀英予備校	—	0.1	30
ラウンドワン	0.4	0.4	293
リゾートトラスト	0.4	0.5	1,410
ビー・エム・エル	0.1	0.1	314
ワタベウェディング	0.1	0.1	51
もしもしホットライン	0.3	0.2	259
リソー教育	0.1	0.2	49
ユニー・エス・エス	1.5	1.5	2,781
東京個別指導学院	0.1	0.1	35
サイバーエージェント	—	0.2	1,058
楽天	4.1	5.2	8,715
テー・オー・ダブリュー	0.1	0.1	87
セントラルスポーツ	0.1	—	—
フルキャストホールディングス	0.1	0.2	93
リブセンス	0.1	0.1	71
ジャパンマテリアル	—	0.1	186
ウチヤマホールディングス	—	0.1	60
リクルートホールディングス	—	1.4	4,760
リロ・ホールディング	0.1	—	—
エイチ・アイ・エス	0.1	0.2	791
共立メンテナンス	0.1	0.1	640
イチネンホールディングス	0.2	0.1	107

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
建設技術研究所	0.1	0.1	149
スペース	0.1	0.1	115
東京テアトル	—	1	140
東京都競馬	1	1	293
常磐興産	1	1	156
カナモト	0.1	0.2	605
東京ドーム	1	1	546
西尾レントオール	0.1	0.1	363
トランス・コスモス	0.2	0.2	431
乃村工芸社	0.3	0.2	220
日本管財	0.1	0.1	258
トーカイ	0.1	0.1	365
セコム	1.3	1.2	8,217
セントラル警備保障	0.1	0.1	122
丹青社	0.23	0.2	159
メイテック	0.2	0.2	692

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アサツー ディ・ケイ	0.2	0.2	573	
応用地質	0.2	0.1	170	
船井総研ホールディングス	0.1	0.1	93	
進学会	0.1	0.1	47	
ベネッセホールディングス	0.4	0.4	1,418	
イオンディライト	0.1	0.1	264	
ナック	0.1	0.1	106	
ニチイ学館	0.3	0.2	254	
ダイセキ	0.2	0.2	401	
ステップ	—	0.1	83	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,980	1,933	2,389,334
	銘柄数<比率>	1,347	1,410	<98.7%>

*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。

*—印は組み入れなし。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	百万円	百万円
	TOPIX	28	—

*単位未満は切り捨て。

*—印は組み入れなし。

(2015年2月2日現在)

○投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 2,389,334	% 98.6
コール・ローン等、その他	35,017	1.4
投資信託財産総額	2,424,351	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 (2015年2月2日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,424,351,275
コール・ローン等	30,549,357
株式(評価額)	2,389,334,160
未収配当金	2,797,703
未収利息	55
差入委託証拠金	1,670,000
(B) 負債	2,521,242
未払金	761,242
未払解約金	1,760,000
(C) 純資産総額(A-B)	2,421,830,033
元本	2,024,115,578
次期繰越損益金	397,714,455
(D) 受益権総口数	2,024,115,578口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,965円

(注)期首元本額2,131百万円、期中追加設定元本額460百万円、期中一部解約元本額568百万円、計算口数当たり純資産額11,965円。

(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> 1,060百万円
- ・財形株投<一般財形30> 462百万円
- ・財形株投<年金・住宅財形30> 501百万円

○損益の状況 (2014年2月4日～2015年2月2日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	44,275,828
受取配当金	44,225,896
受取利息	24,894
その他収益金	25,038
(B) 有価証券売買損益	393,757,558
売買益	452,385,256
売買損	△ 58,627,698
(C) 先物取引等取引損益	6,226,647
取引益	6,987,889
取引損	△ 761,242
(D) 当期損益金(A+B+C)	444,260,033
(E) 前期繰越損益金	△ 7,745,463
(F) 追加信託差損益金	24,083,919
(G) 解約差損益金	△ 62,884,034
(H) 計(D+E+F+G)	397,714,455
次期繰越損益金(H)	397,714,455

*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

該当事項はございません。