<訂正のお知らせとお詫び>

「国内株式セレクション(ラップ向け)」の運用報告書(全体版)の「第 2 期: 決算日 2019 年 2 月 5 日」におきまして、「利害関係人との取引状況等」に下記の通り記載漏れがございました。

謹んでお詫び申し上げますとともに、今後はこのようなことがないよう、再発 防止に努めてまいります。

何卒、今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

記

(誤) 国内株式セレクション (ラップ向け)

9頁

○利害関係人との取引状況等

(2018年2月6日 ~ 2019年2月5日)

<TOPIXマザーファンド>

区分	買付額等A		В	売付額等C		D
区力	貝门似守八	うち利害関係人	_	元円領守し	うち利害関係人	_
		との取引状況B	Α		との取引状況D	С
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	155, 397	77,060	49.6	218,023	62, 264	28.6
貸付有価証券(株式)	386, 715	386, 715	100.0	386, 689	386, 689	100.0

(正) 国内株式セレクション (ラップ向け)

9頁

○利害関係人との取引状況等 <TOPIXマザーファンド> (2018年2月6日 ~ 2019年2月5日)

(1011A()) / V V						
区分			В			D
四月		うち利害関係人	_		うち利害関係人	_
	買付額等A	との取引状況B	Α	売付額等C	との取引状況D	С
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	155, 397	77,060	49.6	218,023	62, 264	28.6
新株予約権証券	-	1	-	1	1	100.0
貸付有価証券(株式)	386, 715	386, 715	100.0	386, 689	386, 689	100.0

以上

当ファンドの仕組みは次の通りです。

ᆂᄆᄼᆇ	351-7410./ 5 / 5 / 1
商品分類	追加型投信/内外/株式
信託期間	2027年2月5日まで(2017年3月13日設定)
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式に実質的な投資を行います。投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替へッジを行います。投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
主要運用対象	別に示した投資対象ファンドの投資信託証券 を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

※ 当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書(全体版)

国内株式セレクション (ラップ向け)



第2期(決算日:2019年2月5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。 さて、お手持ちの「国内株式セレクション(ラップ 向け)」は、去る2月5日に第2期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い 申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号 ホームページ https://www.am.mufg.jp/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客さま専用 フリーダイヤル 9 1 2 0 - 1 5 1 0 3 4

土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

│ お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- 一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

〇設定以来の運用実績

決	算	期	基	準	ſ	額	(参考	指価	数 指) 数	株工式	株 式	投資信託 券	純	資産
	9 F	791	(分配落)	税分	込 配 金	中 落 率	(TOPIX)	期騰	落	中率	組入比率	先物比率	組入比率	総	額
(設	定日)		円		円	%				%	%	%	%		百万円
201	7年3月	13日	10,000		_	_	1, 577. 40			_	_	_	_		10
1期	(2018年2	月5日)	11, 677		C	16.8	1, 823. 74		1	5. 6	93. 2	1.5	1.1		3, 798
2期	(2019年2)	月5日)	10, 048		C	△14. 0	1, 582. 88		$\triangle 1$	3.2	96. 9	0.5	0.6		6, 798

- (注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
- (注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。
- (注) 東証株価指数 (TOPIX) とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式 市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
- (注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
- (注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。
- (注) 設定目の純資産総額は、設定元本を表示しております。

〇当期中の基準価額と市況等の推移

年	月	日	基	準	価		額	(東	参 証	考株	指価	数 指) 数	株組	入	H	式率		物	比	式率	投証	資	ž	托条
					騰	落	率	(T)	O P I	X)	騰	落	率	心口				ル	120	νь	+	組	入	比。	輕
	(期 首)			円			%						%				%				%			9	%
20	18年2月5	日		11,677			_		1,823	. 74			_			93	3. 2			1	. 5			1.	1
	2月末			11, 358		\triangle 2	2. 7		1, 768	. 24		\triangle	3.0			95	5. 1			(0.9			1.	1
	3月末			11, 125		\triangle 4	1. 7		1,716	. 30		Δ	5.9			94	l. 5			1	. 5			1.	2
	4月末			11, 469		\triangle 1	1.8		1, 777	. 23		Δ	2.6			94	1.8			1	. 4			1.	3
	5月末			11, 328		\triangle 3	3.0		1, 747	. 45		Δ	4.2			95	5.0			(). 9			0.	6
	6月末			11, 202		\triangle 4	1. 1		1, 730	. 89		Δ	5. 1			95	5. 1			(0.6			0.	7
	7月末			11, 288		\triangle 3	3. 3		1, 753	. 29		Δ	3.9			95	5. 5			(). 4			0.	6
	8月末			11, 161		\triangle 4	1.4		1, 735	. 35		Δ	4.8			96	5. 2			(). 4			0.	6
	9月末			11, 682		(0.0		1,817	. 25		Δ	0.4			94	1.6			1	. 1			0.	6
	10月末			10, 522		△ 5	9.9		1,646	. 12		Δ	9.7			95	5.0			1	. 1			0.	6
	11月末			10, 583		\triangle 8	9.4		1, 667	. 45		Δ	8.6			95	5.0			1	. 0			0.	6
	12月末			9, 427		△19	9. 3		1, 494	. 09		\triangle 1	8.1			95	5. 4			(0.6			0.	6
20	019年1月	末		9, 931		△15	5.0		1, 567	. 49		\triangle 1	4. 1			97	7.0			(0.6			0.	6
	(期 末)																								
20	19年2月5	日		10,048		$\triangle 14$	1.0]	1, 582	. 88		\triangle	3.2			96	5. 9			(). 5			0.	6

⁽注)騰落率は期首比。

⁽注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

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

⁽注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

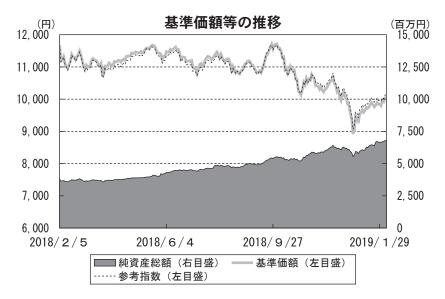
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第2期:2018/2/6~2019/2/5)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.0%の下落となりました。



第2期首:11,677円 第2期末:10,048円 (既払分配金 0円) 騰落率:-14.0%

・分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金(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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。



実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより 異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益 の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の主な変動要因

下落要因

国内株式市況が下落したことなどから、組み入れを行った投資信託証券の すべてが下落し、マイナスに影響しました。

投資環境について

(第2期:2018/2/6~2019/2/5)

◎国内株式市況

- ・国内株式市況は下落しました。
- ・堅調な国内企業業績などから上昇する局面があったものの、米国の金利上昇などを背景とした世界的な株式市場の下落、米中の貿易摩擦への懸念、一部新興国通貨の急落などを受けて、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、期を通してみると国内株式市場は下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

- **i** 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。
- ・投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式に実質的な投資を行い ました。
- ・投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき行い、期首から2018年5月初旬にかけて「TOPIXマザーファンド」、「JPX日経400インデックスマザーファンド」、「日本株インカム・マザーファンド」、「ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド」、「JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド」に投資を行いました。
- ・5月中旬に組み入れる投資信託証券の一部入れ替えを行い、期末にかけては「TOPI Xマザーファンド」、「JPX日経400インデックスマザーファンド」、「日本株イ ンカム・マザーファンド」、「JAPAN クオリティ150インデックスマザーファン ド」、「日本株オープン「35」マザーファンド」、「日本・小型株・ファンド・マ ザーファンド」に投資を行いました。
- ・前記の運用の結果、国内株式市況が下落したことなどから、組み入れを行った投資信託 証券のすべてが下落し、基準価額は期首に比べて下落しました。

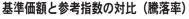
(ご参考) 投資信託証券別組入比率表

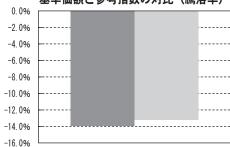
																	(%)
投	資	信	託	証	券	2018年2月末	3月末	4月末	5月末	6月末	7月末	8月末	9月末	10月末	11月末	12月末	2019年 1月末
ТОР	IXマザ	ーファン	۴			41.5	41. 7	41.8	41. 3	41. 2	41.5	41.6	41. 7	41. 3	41.3	41.7	41. 9
JPX	日経40	0インデ	ックスマー	ザーファン	ノド	9. 6	9. 8	9. 8	9. 7	9. 6	9. 7	9. 6	9. 7	9. 7	9. 7	9. 7	9. 9
日本株	インカム	・マザー	ファンド			26. 9	27. 0	27. 1	14. 5	14. 7	14. 7	14. 6	14. 5	14. 7	14. 6	14. 8	14. 8
ヘッジ	付外国株	式インデ	ックスマー	ザーファン	ノド	9. 8	9. 6	9. 6	_	_	_	_	_	_	_	_	-
JAPA	AN クオリ	ティ15(コインデック	フスマザーフ	ファンド	9. 6	9. 7	9. 7	9. 8	9. 6	9. 7	9. 6	9. 5	9. 6	9. 8	9. 7	9. 9
日本株	オープン	[35]	マザーファ	ァンド		_	_	_	14. 8	14. 8	14. 5	14. 8	14. 6	14. 9	14. 8	14. 5	14. 9
日本・	小型株・	ファンド	・マザー	ファンド		_	_	_	7. 4	7. 4	7. 1	7. 3	7. 2	7. 4	7. 5	7. 3	7. 4

(注) 比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- プログラス ベンチマークまたは参考指数と比較することで、期間中の運用内容を評価することができます。
 - ・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。右記のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率との対比です。
 - ・参考指数は東証株価指数(TOPIX)です。





2018/2/5~2019/2/5

■ ファンド 参考指数

分配金について

プライス 分配金の内訳および翌期繰越分配対象額(翌期に繰越す分配原資)がどの程度あるかを確認できます。

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきました。収益分配に充てなかった利益(留保益)につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】

(単位:円、1万口当たり、税込み)

	- 古口	第2期
	項目	2018年2月6日~2019年2月5日
当期分配金		_
(対基準	西額比率)	-%
当期の収	益	_
当期の収	益以外	_
翌期繰越分配	 対象額	1, 540

- (注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
- (注)当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

◎今後の運用方針

- ・日本を含む世界の株式を実質的な主要投資対象とし、主として値上がり益の獲得をめざします。実質組入外貨建資産については、原則として為替へッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。
- ・投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に 基づき決定します。

〇1万口当たりの費用明細

(2018年2月6日~2019年2月5日)

項目	当	期	項目の概要
- д	金 額	比率	ス ロ ジ 腕 女
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	49	0.449	(a)信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投信会社)	(40)	(0.364)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書 等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0.043)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等 の対価
(受託会社)	(5)	(0.043)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	8	0.071	(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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株式)	(7)	(0.069)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	(c)有価証券取引税=期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.005	(d)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(0)	(0.001)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監査費用)	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	58	0.525	
期中の平均基準価額は、1	0, 906円です	0	

- (注) 期中の費用 (消費税等のかかるものは消費税等を含む) は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- (注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンド に対応するものを含みます。
- (注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに 小数第3位未満は四捨五入してあります。

〇売買及び取引の状況

(2018年2月6日~2019年2月5日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	設	定	*	解	約	
遊	מיוז	数	金	額	数	金	額
		千口		千円	千口		千円
ヘッジ付外国株式インデ	゛ックスマザーファンド	6, 430		11,000	220,650		378, 856
JPX日経400インデ		248, 107		368, 600	4, 353		6,000
JAPAN クオリティ150	インデックスマザーファンド	312, 414		374, 600	6, 362		7,000
日本・小型株・ファンド		93, 578		605, 930	387		2,000
TOPIXマザーファン	, F.	865, 733]	1, 547, 240	14, 493		24,000
日本株オープン「35」	マザーファンド	419, 895]	1, 175, 260	1		_
日本株インカム・マザー	ファンド	270, 454		569, 000	217, 695		481,860

〇株式売買比率

(2018年2月6日~2019年2月5日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

			当		期		
項	ヘッジ付外国株式 インデックス マザーファンド	17/77/	JAPAN クオリティ150 インデックス マザーファンド	つザーファンド	インカム・		日本株 オープン「35」 「マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額			4,076,876千円				
(b) 期中の平均組入株式時価総額	43,993,791千円	7,735,066千円	2,216,765千円	254,212,656千円	7, 394, 745千円	10,593,918千円	8,113,785千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.33	0.96	1.83	1.46	1.77	2.16	4.17

⁽注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2018年2月6日~2019年2月5日)

利害関係人との取引状況

<国内株式セレクション(ラップ向け)>

該当事項はございません。

<TOPIXマザーファンド>

		買付額等			売付額等		
区 3	分	貝的領守 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	元刊領寺 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{\mathrm{D}}{\mathrm{C}}$
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式		155, 397	77, 060	49.6	218, 023	62, 264	28.6
貸付有価証券(株式)		386, 715	386, 715	100.0	386, 689	386, 689	100.0

平均保有割合 0.8%

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

		m /_\ws.kh			= / / / / / / / / / / / / /		
区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	<u>B</u> A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u> C
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式		3, 819	1, 394	36. 5	3,636	736	20. 2

平均保有割合 6.4%

<日本株インカム・マザーファンド>

		四八烯烷			主从婚处		
区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	<u>B</u> A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u> C
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式		5, 428	1,086	20.0	7,717	1, 544	20.0
投資信託証券		74	1	1.4	175	21	12.0

平均保有割合 11.1%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

[※]平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

[※]平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド>

			買付額等			売付額等			
	区	分	貝的領守 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{\mathrm{B}}{\mathrm{A}}$	C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u> C	
ı			百万円	百万円	%	百万円	百万円	%	
	為替先物取引		557, 431	219, 289	39. 3	553, 522	217, 427	39. 3	
	為替直物取引		6, 092	996	16.3	7,095	1, 933	27. 2	

平均保有割合 0.8%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド>

		四八烷炒			主仏姫炊				
区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	<u>B</u> A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u> C		
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%		
株式		2, 423	250	10.3	1,653	183	11.1		

平均保有割合 22.3%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<日本・小型株・ファンド・マザーファンド>

		四八烷炔			主体病体			
区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	<u>B</u>	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C	
		百万円	百万円	%	百万円	五子田	%	
		ロ <i>か</i> ロ	ロカロ	/0	D 2011	日カロ	/0	
株式		12, 622	3, 621	28. 7	10, 311	2, 419	23. 5	

平均保有割合 3.9%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<日本株オープン「35」マザーファンド>

		PP (1.455 k/r			= /_ <i>b</i> = <i>b</i> *		
区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	<u>B</u> A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u> C
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式		17, 333	2, 513	14. 5	16, 545	1,951	11.8

平均保有割合 10.2%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

<TOPIXマザーファンド>

種	類	買	付	額	売	付	額	当期末保有額
				百万円			百万円	百万円
株式				3,078			4,611	4, 240

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

種	類	買	付	額	売	付	額	当期末保有額
				百万円			百万円	百万円
株式				79			45	118

<日本株インカム・マザーファンド>

種	類	買	付	額	売	付	額	当期末保有額
				百万円			百万円	百万円
株式				233			20	175

<日本株オープン「35」マザーファンド>

種	類	買	付	額	売	付	額	当期末保有額
				百万円			百万円	百万円
株式				471			596	306

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<TOPIXマザーファンド>

	種	類	買	付	額
					百万円
株	式				182

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

				•	
	種	類	買	付	額
					百万円
株式					1

<日本株インカム・マザーファンド>

種	類	買	付	額
				百万円
投資信託証券				56

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額(A)	3,498千円
うち利害関係人への支払額 (B)	594千円
(B) / (A)	17.0%

⁽注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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中京銀行、カブドットコム証券、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUFG証券、日立キャピタルです。

〇自社による当ファンドの設定・解約状況

(2018年2月6日~2019年2月5日)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
10	_	10	_	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2019年2月5日現在)

親投資信託残高

銘	柄	期首(前	前期末)		当	期末	
沙 白	TY)		数	П	数	評 佃	額
			千口		千口		千円
ヘッジ付外国株式インデ	゚ックスマザーファンド		214, 219		_		_
JPX日経400インデ			227, 774		471, 528		667, 543
JAPAN クオリティ150	インデックスマザーファンド		285, 687		591, 739		678, 311
日本・小型株・ファンド	・マザーファンド		_		93, 190		508, 952
TOPIXマザーファン	ド		817, 672		1, 668, 911		2, 835, 648
日本株オープン「35」					419, 895		1,017,238
日本株インカム・マザー	ファンド		450, 091		502, 849		995, 893

〇有価証券の貸付及び借入の状況

TOPIXマザーファンドにおいて、2019年2月5日現在における貸付株数の総株数は21,435,000株です。 うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFG証券に対する貸付は、21,435,000株です。

〇投資信託財産の構成

(2019年2月5日現在)

75			当	ļ	玥	末
項	目	評	価	額	比	率
				千円		%
JPX日経400インデックス	スマザーファンド			667, 543		9.8
JAPAN クオリティ150	インデックスマザーファンド			678, 311		9. 9
日本・小型株・ファンド・マ	ゲーファンド			508, 952		7. 5
TOPIXマザーファンド				2, 835, 648		41. 6
日本株オープン「35」マザー	ーファンド			1, 017, 238		14. 9
日本株インカム・マザーファン	/ド			995, 893		14. 6
コール・ローン等、その他				118, 091		1. 7
投資信託財産総額				6, 821, 676		100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年2月5日現在)

○損益の状況

項

(2018年2月6日~2019年2月5日)

当

期

円

_		
	項目	当 期 末
		円
(A)	資産	6, 821, 676, 880
	コール・ローン等	118, 089, 751
	JPX日経400インデックスマザーファンド(評価額)	667, 543, 337
	JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド(評価額)	678, 311, 191
	日本・小型株・ファンド・マザーファンド(評価額)	508, 952, 175
	TOPIXマザーファンド(評価額)	2, 835, 648, 348
	日本株オープン「35」マザーファンド(評価額)	1, 017, 238, 198
	日本株インカム・マザーファンド(評価額)	995, 893, 880
(B)	負債	23, 097, 779
	未払解約金	10, 119, 379
	未払信託報酬	12, 882, 702
	未払利息	216
	その他未払費用	95, 482
(C)	純資産総額(A-B)	6, 798, 579, 101
	元本	6, 765, 963, 551
	次期繰越損益金	32, 615, 550
(D)	受益権総口数	6, 765, 963, 551 □
	1万口当たり基準価額(C/D)	10, 048円
	のまでく	

(A)	配当等収益	△ 79, 339
	受取利息	335
	支払利息	△ 79,674
(B)	有価証券売買損益	△671, 710, 722
	売買益	65, 861, 470
	売買損	$\triangle 737, 572, 192$
(C)	信託報酬等	△ 22, 193, 783
(D)	当期損益金(A+B+C)	△693, 983, 844
(E)	前期繰越損益金	385, 525, 871
(F)	追加信託差損益金	341, 073, 523
	(配当等相当額)	(574, 855, 489)
	(売買損益相当額)	$(\triangle 233, 781, 966)$
(G)	計(D+E+F)	32, 615, 550
(H)	収益分配金	0
	次期繰越損益金(G+H)	32, 615, 550
	追加信託差損益金	341, 073, 523
	(配当等相当額)	(578, 195, 311)
	(売買損益相当額)	$(\triangle 237, 121, 788)$
	分配準備積立金	463, 964, 939
	繰越損益金	△772, 422, 912
(注)	(B) 有価証券売買捐益け期末の評価換え	によるものを含みます

目

<注記事項>

①期首元本額 3, 252, 761, 662円 期中追加設定元本額 4, 337, 352, 686円 期中一部解約元本額 824, 150, 797円

また、1口当たり純資産額は、期末1.0048円です。

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- (注) (0) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
- (注) (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。

②分配金の計算過程

項	目	2018年2月6日~ 2019年2月5日
費用控除後の配当等収益額		78, 439, 068円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有何	価証券売買等損益額	-円
収益調整金額		578, 195, 311円
分配準備積立金額		385, 525, 871円
当ファンドの分配対象収益額		1,042,160,250円
1万口当たり収益分配対象額		1,540円
1万口当たり分配金額		-円
収益分配金金額		-円

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ(https://www.am.mufg.jp/)をご覧ください。

「お知らせ」

- ①市況動向変化を踏まえたポートフォリオ分散を図るため、投資対象とする投資信託証券を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。 (2018年5月3日)
- ②市況動向変化を踏まえたポートフォリオ分散を図るため、投資対象とする投資信託証券を削除し、信託約款に所要の変更を行いました。 (2018年11月3日)
- ③2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%(法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。))の税率が適用されます。

TOPIXマザーファンド

《第17期》決算日2018年3月26日

[計算期間: 2017年3月28日~2018年3月26日]

「TOPIXマザーファンド」は、3月26日に第17期の決算を行いました。 以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方

東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果をめざして運用を行います。TOPIX からカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は、原則として高位を維持します。

主 要 運 用 対 象 東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

主 な 組 入 制 限 株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。

〇最近5期の運用実績

	fata		基	準	価		額	東	証	株	価	指	数	株			式	株			式	純	資	産
決	算	期			期騰	落	中率	(T	OP	IX)	期騰	落	中率	組	入	比	率		物	比	率		,	額
				円			%						%				%				%		百万	万円
13期(2	2014年3	月25日)		11, 255		1	3.3		1, 16	3. 70			11.1			98	3. 7]	1.2		221,	564
14期(2	2015年3	月25日)		15, 711		3	9.6		1, 59	2.01		(36.8			98	3.4			J	1.3		245,	366
15期(2	2016年3	月25日)		13, 743		$\triangle 1$	2.5		1, 36	6.05		\triangle	14.2			98	3.2			J	1.9		220,	801
16期(2	2017年3	月27日)		15, 678		1	4. 1		1, 52	4. 39			11.6			98	8.8				1.0		296,	391
17期(2	2018年3	月26日)		17, 551		1	1.9		1, 67	1. 32			9.6			98	3. 1]	1.1		275,	958

- (注) 東証株価指数 (TOPIX) とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式 市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
- (注)上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。
- (注)株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率 売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

/T:		п	基	準	価		額	東	証	株	価	指	数	株			式	株			式
年	月	日			騰	落	率	(T)	ОРІ	X)	騰	落	率	組	入	比	率	先	物	比	率
	(期 首)			円			%						%				%				%
20	17年3月27日	1		15, 678			_		1, 52	4. 39			_			9	8.8				1.0
	3月末			15, 696			0.1		1, 51	2.60		Δ	0.8			9	8.4				1.8
	4月末			15, 899			1.4		1, 53	1.80			0.5			10	0.6				1.5
	5月末			16, 291			3.9		1, 56	8.37			2.9			9	8.5				1.7
	6月末			16, 761			6.9		1,61	1.90			5. 7			9	9.7				1.1
	7月末			16, 831			7.4		1,61	8.61			6.2			9	9.2				0.7
	8月末			16, 824			7.3		1,61	7.41			6.1			9	9.0				1.0
	9月末			17, 554			12.0		1,67	4.75			9.9			10	0.1				1.6
	10月末			18, 512			18.1		1, 76	5.96			15.8			9	8.7				1.3
	11月末			18, 790			19.8		1, 79	2.08			17.6			9	9.0				1.1
	12月末			19,079			21.7		1,81	7.56			19.2			9	9.6				0.5
2	018年1月末			19, 282			23.0		1,83	6.71			20.5			9	9.4				0.7
	2月末			18, 569			18.4		1, 76	8.24			16.0			9	9.8				0.6
<u> </u>	(期 末)		·			<u> </u>						<u> </u>									
20	18年3月26日	1		17, 551			11.9		1,67	1.32			9.6			9	8.1				1.1

- (注)騰落率は期首比。
- (注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

〇運用経過

- ●当期中の基準価額等の推移について
- ◎基準価額の動き 基準価額は期首に比べ11.9%の上昇となりました。
- ◎ベンチマークとの差異ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(9.6%)を2.3%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎国内株式市況

- ・期首から2018年1月中旬までは、衆議院選挙で 与党が勝利したことによる経済政策継続への期 待や、国内企業の業績改善が進んだこと等を受 けて、国内株式市況は上昇しました。
- ・1月下旬から期末までは、米国長期金利上昇による世界的な株安や、円高・米ドル安が進んだこと等を受け、国内株式市況は下落しました。
- ●当該投資信託のポートフォリオについて
- ・資産のほぼ全額を株式(先物を含む)に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークである東証 株価指数(TOPIX)の個別銘柄構成比率に 合わせて構築しました。
- ●当該投資信託のベンチマークとの差異について ベンチマークは9.6%の上昇となったため、カイ 離は2.3%程度となりました。配当要因を除くと低 水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	安 囚		安 囚	
ベンチマーク と の カ イ 離	0.0%程度	0.0%程度	2.3%程度	2.3%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しない ことがあります。

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式(先物を含む)に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、1.2%程度 となりました。
 - (注) 先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからのカイ離を生む可能性があります。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.3%程度でした。

配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当収入等	詁	2.3%程度
マイナス要因	売買コスト等	計	△0.0%程度

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の5割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。

〇今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざ して運用を行います。

〇1万口当たりの費用明細

(2017年3月28日~2018年3月26日)

項	B	当	期	項目の概要
垻	Ħ	金 額	比 率	切り 切
		F	9 %	
(a) 売 買	委託 手数料	0	0.002	(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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株	式)	(0)	(0.001)	
(先物	・オプション)	(0)	(0.002)	
(b) そ の	他 費 用	0	0.000	(b) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(~~	の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合	11	0	0.002	
期中の	平均基準価額は、	17, 507円で	す。	

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

〇売買及び取引の状況

(2017年3月28日~2018年3月26日)

株式

	買		付		売		付	
	株	数	金	額	株	数	金	額
国		千株		千円		千株		千円
上場		96,823	166,	458, 794		127, 179	216, 3	340,673
内	(,	△31, 750)	(-)				

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

新株予約権証券

		買	付			売	付	
	証	券 数	金	額	証	券 数	金	額
		証券		千円		証券		千円
国内		_		_		127,000		4, 261
		(127,000)		(-)				

- (注) 金額は受渡代金。
- (注)()内は株主割当および権利行使等による増減分です。

先物取引の種類別取引状況

括				買	建	売	建
	但	規	ДIJ	新規買付額 決済額		新規売付額	決 済 額
玉				百万円	百万円	百万円	百万円
内	株式先物取引			75, 389	75, 760	_	_

〇株式売買比率

(2017年3月28日~2018年3月26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	382, 799, 467千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	300, 118, 677千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.27

⁽注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

〇利害関係人との取引状況等

(2017年3月28日~2018年3月26日)

利害関係人との取引状況

	四八烷於			士山城市大		
区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u> C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	166, 458	65, 596	39. 4	216, 340	71, 354	33. 0
貸付有価証券(株式)	375, 394	375, 394	100.0	389, 765	389, 765	100.0

利害関係人の発行する有価証券等

I	種	類	買	付	額	売	付	額	当期末保有額
ſ					百万円			百万円	百万円
	株式				3,855			5, 447	5, 810

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

Ę.	種	類	買	付	額
					百万円
株式					559

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項		当	期
売買委託手数料総額(A)			7,072千円
うち利害関係人への支払額(B))		779千円
(B) / (A)			11.0%

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中京銀行、カブドットコム証券、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUFG証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2018年3月26日現在)

国内株式

銘	柄	期首(前期	期末)	当	其	第 末	
逝	1173	株	数	株	数	評価	額
		-	千株		千株	=	千円
水産・農林業 (0.1%)							
極洋			5.8		5	19,	300
日本水産		19	91.9		143	75,	647
マルハニチロ			28		24. 1	78,	927
カネコ種苗			5. 1		4. 4	6,	820
サカタのタネ		2	21.8		18.7	65,	824
ホクト			15		12.9	26,	070
ホクリヨウ			1.6		1.8	2,	318
鉱業 (0.3%)							
住石ホールディングス			41		33. 2	5,	079
日鉄鉱業			4. 1		3. 5	21,	035
三井松島産業			9. 1		6. 4	9,	580
国際石油開発帝石		77	78. 3	(617.7	803,	010
日本海洋掘削			5. 2		4. 4	8,	738
石油資源開発		2	23. 4		20.1	49,	40
K&Oエナジーグループ			9. 9		7. 5	12,	352
建設業 (3.1%)							
ショーボンドホールディン	グス	:	14. 3		12	88,	920
ミライト・ホールディング	ス	4	45. 4		39. 1	63,	772
タマホーム			11. 1		9. 5	11,	894
サンヨーホームズ			3. 1		2. 2	2,	10
ファーストコーポレーショ	ン		2. 4		4. 2	5,	11
ベステラ			-		1.8	2,	97
インベスターズクラウド			1. 4		11.1	23,	620
ダイセキ環境ソリューショ	ン		4. 1		3	3,	14
第一カッター興業			_		1. 3	2,	774
安藤・間		10	06. 2		98.8	77,	558
東急建設			52. 4		48. 9	55,	208
コムシスホールディングス			57. 7		44. 7	122,	16
ミサワホーム		:	17. 4		10.6	9,	296
ビーアールホールディング	ス	:	14. 6		12.6	4,	926
高松コンストラクショング	ループ	:	11. 1		8. 2	24,	518
東建コーポレーション			5. 5		4. 7	47,	708
ソネック			1.8		1.6	1,	21

銘	柄	期首(前期末)	当其	東 末
SH.	1111	株 数	株 数	評価額
		千株	千株	千円
ヤマウラ		6. 9	5. 9	5, 622
大成建設		751	126. 5	652, 740
大林組		443. 1	380. 9	430, 417
清水建設		452	388.6	352, 071
飛島建設		142. 3	115.5	19, 866
長谷工コーポレーション	,	172. 4	148. 2	230, 895
松井建設		16. 3	14	10, 808
錢高組		21	1.8	8, 469
鹿島建設		649	558	527, 310
不動テトラ		119. 2	96. 1	17, 778
大末建設		5. 2	4. 1	4, 182
鉄建建設		90	7. 7	22, 407
西松建設		171	29. 4	77, 939
三井住友建設		566. 1	91.6	57, 158
大豊建設		54	46	26, 910
前田建設工業		97	90. 6	107, 814
佐田建設		10. 2	8. 2	3, 747
ナカノフドー建設		11. 3	9. 7	5, 839
奥村組		122	20. 9	92, 796
東鉄工業		17. 7	15. 2	48, 868
イチケン		13	2. 3	5, 835
淺沼組		52	45	18, 720
戸田建設		172	148	110, 556
熊谷組		232	19. 9	65, 471
青木あすなろ建設		9. 7	8. 3	8, 175
北野建設		31	26	10, 504
植木組		18	1.6	4, 163
三井ホーム		19	16	10, 560
矢作建設工業		20. 1	17. 3	13, 338
ピーエス三菱		15. 6	15	10, 380
日本ハウスホールディン	グス	30. 1	24. 3	13, 219
大東建託		54. 4	46	815, 350
新日本建設		17. 6	15. 1	16, 383
NIPPO		34	29. 4	67, 884

銘	柄	期首(前期末)	当	其	東 末
鄞	fff1	株	数	株	数	評価額
			千株	=	千株	千円
東亜道路工業			28		2.6	10, 361
前田道路			46		40	84, 720
日本道路			44		3. 4	17, 578
東亜建設工業			12	1	10.3	22, 618
若築建設			85		6.8	11,016
東洋建設			42.5	3	39. 9	19, 191
五洋建設			163. 9		151	111, 589
大林道路			15. 3		-	_
世紀東急工業			21.5	1	17. 1	11, 645
福田組			24		4. 1	26, 076
住友林業			101.7	8	31. 2	135, 685
日本基礎技術			16. 4	1	14. 1	5, 611
日成ビルド工業			44	1	18.8	23, 274
ヤマダ・エスバイエルホー	ーム		75		57	5, 130
巴コーポレーション			18. 4	1	15.8	8, 437
パナホーム			55		_	_
大和ハウス工業			436. 4	37	75.2	1, 455, 025
ライト工業			28. 4	2	24. 4	26, 669
積水ハウス			464. 9	41	3.3	764, 398
日特建設			12.6	1	10.8	6, 696
北陸電気工事			7. 2		7	7, 868
ユアテック			23		20	16, 260
西部電気工業			2. 5		2. 1	5, 932
四電工			11		1. 9	4, 941
中電工			18. 7	1	16.4	46, 428
関電工			59	5	50.6	59, 657
きんでん			98. 2	8	34. 5	144, 410
東京エネシス			15	1	4.4	16, 732
トーエネック			21		3. 6	11,052
住友電設			10.2		10	20, 340
日本電設工業			24. 1	1	19.5	39, 390
協和エクシオ			57. 9	4	15. 6	120, 840
新日本空調			11.4		9.8	15, 601
NDS			2. 3		2	8, 640
九電工			28. 7		25	118, 125
三機工業			32. 7	2	26. 9	30, 746
日揮			137. 9	10	9.4	244, 399
中外炉工業			45		3. 8	11, 042
ヤマト			13. 2	1	0.4	7, 560

lista:	1 55	期首(前期末)	当	東 末	
銘	柄	株 数	株 数	評価額	
		千株	千株	千円	
太平電業		20	8. 6	22, 385	
高砂熱学工業		40.7	35	65, 135	
三晃金属工業		1.3	1. 4	5, 509	
朝日工業社		3. 3	2. 6	8, 827	
明星工業		26. 7	23	16, 790	
大氣社		19. 6	16. 8	56, 532	
ダイダン		20	8. 5	18, 470	
日比谷総合設備		16. 5	14. 2	27, 150	
東芝プラントシステム		24	27. 5	63, 470	
OSJBホールディング	ス	45. 1	56. 1	15, 651	
東洋エンジニアリング		87	14. 9	14, 825	
千代田化工建設		107	82. 5	80, 685	
新興プランテック		30. 3	24. 5	23, 887	
食料品 (4.4%)					
日本製粉		43. 9	37. 8	61,009	
日清製粉グループ本社		162	139. 3	282, 082	
日東富士製粉		1	0.8	3, 824	
昭和産業		61	10.4	28, 880	
鳥越製粉		11.7	10. 1	9, 574	
中部飼料		16. 2	13. 9	28, 731	
フィード・ワン		88. 9	76. 4	16, 196	
東洋精糖		22	1. 9	2, 304	
日本甜菜製糖		7. 5	6. 5	15, 086	
三井製糖		10. 4	9	37, 215	
塩水港精糖		15. 8	13. 6	3, 644	
日新製糖		6. 3	5. 4	11, 280	
森永製菓		28.8	26. 7	122, 419	
中村屋		3. 4	2. 9	13, 731	
江崎グリコ		37	31. 8	176, 172	
名糖産業		6. 4	5. 5	8, 761	
井村屋グループ		_	4. 5	16, 875	
不二家		84	7. 3	18, 155	
山崎製パン		108. 2	93	204, 600	
第一屋製パン		23	2	2, 270	
モロゾフ		23	1. 9	11,932	
亀田製菓		8. 2	7. 1	35, 855	
寿スピリッツ		10. 5	11	59, 180	
カルビー		60.3	51. 8	190, 106	
森永乳業		133	22. 8	96, 672	

銘	柄	期首(前期末)	当 其	朝 末		
蹈	枘	株 数	株 数	評価額		
		千株	千株	千円		
六甲バター		6. 6	5. 7	12, 272		
ヤクルト本社		79. 2	68. 1	531, 180		
明治ホールディングス		87.5	75. 2	597, 840		
雪印メグミルク		31. 9	27. 4	76, 829		
プリマハム		93	80	47, 520		
日本ハム		100	98	213, 934		
林兼産業		4.7	4. 1	3, 263		
丸大食品		71	61	30, 805		
S Foods		7. 9	8	33, 720		
伊藤ハム米久ホールディ	ングス	85. 2	73. 3	68, 169		
サッポロホールディング	ス	48. 4	41.6	123, 884		
アサヒグループホールデ	ィングス	277. 2	238. 3	1, 298, 735		
キリンホールディングス		636. 1	546.9	1, 526, 944		
宝ホールディングス		106.9	85. 2	99, 854		
オエノンホールディング	ス	38	32. 3	14, 567		
養命酒製造		4. 6	3. 5	8, 242		
コカ・コーラ ボトラーズジ	ャパンホールデ	50	79. 9	332, 384		
コカ・コーライーストジ	ヤパン	57. 5	_	-		
サントリー食品インター	ナショナル	101.2	87	439, 350		
ダイドーグループホール	ディングス	6.8	5. 8	38, 164		
伊藤園		43.8	37. 7	153, 439		
キーコーヒー		13	11.2	23, 956		
ユニカフェ		4	3. 4	3, 529		
ジャパンフーズ		1. 9	1.6	2, 457		
日清オイリオグループ		85	13. 4	39, 128		
不二製油グループ本社		39. 4	30.8	98, 406		
かどや製油		1.4	1. 2	7, 752		
J -オイルミルズ		6. 9	5. 9	21, 358		
キッコーマン		103	88. 9	365, 823		
味の素		304.3	261.7	497, 360		
キユーピー		75. 2	63. 4	178, 217		
ハウス食品グループ本社		54. 7	43. 4	148, 428		
カゴメ		53	45.6	163, 476		
焼津水産化学工業		6. 9	5. 5	6, 875		
アリアケジャパン		12. 1	10.4	85, 384		
ピエトロ		1. 7	1.5	2, 512		
エバラ食品工業		3. 5	2. 5	5, 447		
ニチレイ		72. 7	54. 2	147, 532		
東洋水産		72. 6	62. 4	255, 528		

244	605	期首(前期末)	当	其	期 末	
銘	柄	株	数	株	数	評 価 額	
			千株		千株	千円	
イートアンド			1.6		3. 1	6, 475	
大冷			1. 1		1.3	2, 718	
ヨシムラ・フード・ホー	ルディングス		_		1. 7	2, 271	
目清食品ホールディング	゚ス		57.7		49.6	357, 616	
永谷園ホールディングス			14		12	17,532	
一正蒲鉾			5. 1		4. 4	5, 227	
フジッコ			14. 3		12.3	29, 114	
ロック・フィールド			14. 3		12.3	25, 817	
日本たばこ産業			818.8		704	2, 048, 288	
ケンコーマヨネーズ			6		7. 5	24, 862	
わらべや日洋ホールディ	ングス		8. 7		7. 4	18, 278	
なとり			7. 4		6. 3	12, 291	
イフジ産業			_		2	1,560	
ピックルスコーポレーシ	ョン		_		1.7	2, 992	
北の達人コーポレーショ	ン		3. 2		32.8	23, 550	
ユーグレナ			47.6		43. 9	42, 890	
ミヨシ油脂			51		4. 4	5, 904	
理研ビタミン			4. 4		4. 3	17, 565	
繊維製品 (0.7%)							
片倉工業			17. 3		13.6	18, 468	
グンゼ			103		8. 9	52, 243	
東洋紡			547		43. 9	91, 751	
ユニチカ			378		34.6	21,901	
富士紡ホールディングス			6. 7		6. 6	24, 915	
倉敷紡績			139		120	39, 240	
シキボウ			74		6	7,740	
日本毛織			38. 9		33. 5	34, 572	
ダイトウボウ			18		18	1,944	
トーア紡コーポレーショ	ン		5. 9		5	2, 810	
ダイドーリミテッド			15. 4		13. 3	6, 211	
帝国繊維			14. 4		12. 4	25, 370	
帝人			112.9		97. 5	193, 732	
東レ			1,002		861.4	853, 561	
サカイオーベックス			3. 4		3	7, 146	
住江織物			38		3	8, 142	
日本フエルト			7. 9		6. 3	3, 301	
イチカワ			9		8	2, 784	
日東製網			1. 5		1. 3	2, 281	
アツギ			113		7. 9	9, 503	

N/+	LT*	期首(前	期末)	当	其	東 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
ダイニック			26		4.5	4, 666
セーレン			34. 4		27.3	49, 604
ソトー			5. 1		4. 4	4, 677
東海染工			19		1.7	2, 454
小松精練			19. 4		18. 2	20, 147
ワコールホールディン	グス		82		32.8	101, 352
ホギメディカル			8. 7		7. 5	62, 250
レナウン			37. 3		32. 1	5, 168
クラウディアホールデ	ィングス		3. 2		2.7	1, 471
TSIホールディング	`ス		56. 9		41	30, 135
マツオカコーポレーシ	ョン		_		2. 1	6, 285
三陽商会			72		6. 2	14, 253
ナイガイ			50		4. 3	2, 425
オンワードホールディ	ングス		89		70.9	63, 597
ルックホールディング	`ス		25		20	6, 020
キムラタン			583		54. 2	2, 384
ゴールドウイン			5. 9		3. 4	38, 692
デサント			31. 5		27. 1	43, 576
キング			6.8		5. 9	3, 616
ヤマトインターナショ	ナル		8. 5		7. 9	5, 119
パルプ・紙 (0.3%)						
特種東海製紙			8		6. 5	26, 552
王子ホールディングス			540		500	337, 000
日本製紙			61. 9		53. 2	105, 336
三菱製紙			19.6		16. 9	10, 849
北越紀州製紙			77. 1		66.3	44, 288
中越パルプ工業			55		4. 7	8, 535
巴川製紙所			21		18	4, 914
大王製紙			55		47.3	69, 531
阿波製紙			2. 5		2. 9	1, 696
レンゴー		1	33. 2		114.5	105, 111
トーモク			44		6.8	14, 164
ザ・パック			9.8		8. 4	31, 962
化学 (7.2%)						
クラレ		2	32. 4		199.8	342, 057
旭化成			861		740.5	1, 023, 741
共和レザー			8		6. 9	6, 506
昭和電工			91. 9		79	334, 170
住友化学		1	, 017		874	514, 786

Bif4	66	期首(i	前期末)	当	其	期 末	
銘	柄	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	千円	
住友精化			5. 7		4. 9	24,010	
日産化学工業			75. 7		69. 1	288, 147	
ラサ工業			52		4. 2	8, 568	
クレハ			10.4		10.2	68, 748	
多木化学			9		1.6	6, 488	
テイカ			21		9. 1	24, 679	
石原産業			24. 8		21.3	27, 264	
片倉コープアグリ			19		2. 9	3, 630	
日東エフシー			8. 1		6. 9	4, 954	
日本曹達			83		82	48, 134	
東ソー			399		171.6	350, 578	
トクヤマ			215		34. 5	107, 640	
セントラル硝子			141		24. 2	56, 797	
東亞合成			86. 5		69.7	84, 824	
大阪ソーダ			59		10.8	29, 160	
関東電化工業			28		28. 4	30, 530	
デンカ			286		43.6	153, 908	
信越化学工業			247.7		197. 7	2, 117, 367	
日本カーバイド工業			47		3. 7	7, 448	
堺化学工業			52		8. 1	21,740	
エア・ウォーター			113.9		97.9	191, 198	
大陽日酸			106.4		91.5	140, 178	
日本化学工業			51		4. 4	14, 234	
東邦アセチレン			_		1.7	2, 373	
日本パーカライジング			70.6		60.7	105, 375	
高圧ガス工業			20.5		17.6	14, 960	
チタン工業			16		1. 3	3, 213	
四国化成工業			20		17. 1	25, 051	
戸田工業			27		2. 4	9, 084	
ステラ ケミファ			6.6		6	19, 260	
保土谷化学工業			4.8		3.8	17, 309	
日本触媒			21.7		18.7	132, 770	
大日精化工業			57		9. 2	38, 548	
カネカ			186		160	158, 720	
三菱瓦斯化学			128.7		97.9	241, 617	
三井化学			628		107.9	352, 293	
J S R			138.8		119. 4	277, 246	
東京応化工業			25. 8		20.6	75, 293	
大阪有機化学工業			8. 9		7. 7	10, 402	

銘	柄	期首(前期末	()	当 其	期 末
¥₽	1ri	株 数	ζ 1	珠 数	評価額
		手	朱	千株	千円
三菱ケミカルホールディン	グス	930.	4	795. 3	781, 541
KHネオケム		16.	9	18. 2	52, 652
ダイセル		186.	2	160.1	181, 713
住友ベークライト		12	22	96	86, 112
積水化学工業		313.	5	246.6	454, 730
日本ゼオン		1	16	100.1	148, 848
アイカ工業		44.	3	33. 3	126, 540
宇部興産		69	96	59.8	182, 390
積水樹脂		21.	3	18. 3	40, 827
タキロンシーアイ		:	29	24	16, 440
旭有機材		4	15	7	12, 040
目立化成		76.	8	58.7	137, 886
ニチバン			14	5. 8	18, 763
リケンテクノス		29.	8	25.6	12, 672
大倉工業		;	33	28	15, 288
積水化成品工業		19.	6	14. 9	16, 896
群栄化学工業		3.	3	2. 9	9, 947
タイガースポリマー		6.	8	5.8	4, 848
ミライアル			5	3. 9	5, 935
ダイキアクシス		2.	3	3. 9	6, 146
ダイキョーニシカワ		24.	2	23. 4	38, 563
竹本容器			-	1. 3	3, 126
森六ホールディングス			-	4. 5	13, 360
日本化薬		9	90	77. 1	99, 073
カーリットホールディング	ス	12.	8	11	11, 605
日本精化		11.	4	9.8	11, 593
扶桑化学工業		9.	8	8. 4	22, 344
トリケミカル研究所			-	2. 1	9, 639
ADEKA		59.	4	51.1	92, 082
日油		10)7	45.9	138, 847
新日本理化		21.	8	18.7	4, 450
ハリマ化成グループ		11.	7	9. 2	7, 378
花王		350.	8	278.8	2, 079, 290
第一工業製薬		;	31	23	16, 928
日華化学		4.	4	3. 7	4, 414
ニイタカ			2	1. 7	2, 981
三洋化成工業		8.	7	7. 5	36, 337
有機合成薬品工業			9	7. 7	2, 279
大日本塗料			79	13.6	20, 141

銘 柄	期首(前期末)	当 其	東 末
36D 113	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
日本ペイントホールディングス	106. 6	91. 6	342, 126
関西ペイント	145. 1	124. 7	306, 512
神東塗料	10	8. 7	2, 122
中国塗料	39. 6	34	35, 734
日本特殊塗料	9. 7	7. 5	14, 700
藤倉化成	18.8	15	9, 750
太陽ホールディングス	11.2	9. 1	40, 586
DIC	54. 5	46. 9	162, 274
サカタインクス	28. 2	24. 2	35, 719
東洋インキSCホールディングス	136	117	73, 593
Т&К ТОКА	10	7. 9	10, 025
富士フイルムホールディングス	273.9	235. 5	970, 731
資生堂	262	211.2	1, 335, 206
ライオン	171	157. 9	328, 274
高砂香料工業	9. 1	7. 1	21, 868
マンダム	13.8	22. 1	77, 681
ミルボン	7. 5	15. 2	67, 716
ファンケル	29. 4	27. 5	98, 037
コーセー	22. 3	19. 2	385, 728
コタ	5. 2	4. 9	9, 280
シーズ・ホールディングス	17. 9	15. 4	76, 923
シーボン	1.6	1. 4	4, 585
ポーラ・オルビスホールディングス	14. 1	48. 4	206, 668
ノエビアホールディングス	8. 7	7. 2	52, 632
アジュバンコスメジャパン	2. 6	2. 5	2, 547
エステー	9. 4	8. 1	17, 406
アグロ カネショウ	5. 4	4. 6	10, 304
コニシ	21. 7	18. 6	30, 931
長谷川香料	17. 5	15	29, 580
星光PMC	7. 6	6. 5	6, 727
小林製薬	38. 3	31.8	223, 554
荒川化学工業	11.8	10. 2	18, 543
メック	10.7	7.8	13, 306
日本高純度化学	3. 9	3. 1	7, 883
タカラバイオ	29. 6	29. 7	60, 439
lcn	4. 3	7	32, 760
新田ゼラチン	8. 3	7.8	6, 084
OATアグリオ	1.6	1.8	6, 030
デクセリアルズ	36. 2	29. 1	30, 846

銘	柄	期首(i	前期末)	当	其	東 末
野白	iri	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
アース製薬			9. 9		8. 5	46, 070
イハラケミカル工業			19. 1		_	_
北興化学工業			14		11.6	7, 957
大成ラミック			4. 3		3. 5	11, 095
クミアイ化学工業			28. 5		51.6	30, 547
日本農薬			31.5		29.6	17, 700
アキレス			11. 3		8.6	18, 266
有沢製作所			23. 3		19	17, 423
日東電工			99.6		85. 6	664, 512
レック			4. 3		6. 7	23, 718
きもと			24. 7		19. 3	5, 809
藤森工業			10.3		9. 5	34, 057
前澤化成工業			9		7.8	8, 892
JSP			6. 4		6.6	20, 988
エフピコ			12. 2		9. 4	61, 758
天馬			9. 1		8.8	18, 224
信越ポリマー			27. 1		23. 3	25, 373
東リ			32. 8		28. 2	10, 405
ニフコ			24. 2		20.8	148, 928
日本バルカー工業			10.7		9. 2	26, 634
ユニ・チャーム			279.6	4	240. 4	718, 796
医薬品 (4.8%)						
協和発酵キリン			165. 2		142	308, 282
武田薬品工業			517. 7	4	117.6	2, 317, 680
アステラス製薬		1,	410.8	1, 1	165. 1	1, 852, 509
大日本住友製薬			97. 7		84	141, 288
塩野義製薬			175. 2		162. 2	868, 905
田辺三菱製薬			160.9		138. 3	303, 706
わかもと製薬			16		13	3, 692
あすか製薬			15		12. 9	21, 607
日本新薬			31.6		29. 7	213, 543
ビオフェルミン製薬			2. 2		1. 9	5, 314
中外製薬			137. 5		118. 2	627, 642
科研製薬			25. 8		20. 5	124, 435
エーザイ			170		135. 7	907, 290
ロート製薬			67. 6		62. 3	174, 190
小野薬品工業			313. 6	5	267. 7	851, 553
久光製薬			39		33. 5	258, 620
持田製薬			9. 4		7. 9	56, 169

Dit 1	4xx	期首(前	朝末)	当	其	用 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
参天製薬		2	49.4		214. 7	356, 402
扶桑薬品工業			4.6		4	11, 168
日本ケミファ			1. 9		1. 5	6, 990
ツムラ			46. 4		40.5	144, 78
目医工			32. 3		29. 9	47, 36
キッセイ薬品工業		:	24. 5		21	57, 01
生化学工業		:	25. 6		22	41, 910
栄研化学			11.6		9. 2	47, 10
日水製薬			5. 5		4.8	6, 628
鳥居薬品			9. 4		7. 1	19, 170
JCRファーマ			10.6		8	40, 320
東和薬品			6. 3		5. 4	35, 640
富士製薬工業			4. 5		3. 9	17, 199
沢井製薬		:	23. 4		22.8	105, 678
ゼリア新薬工業		:	28. 3		24. 3	49,06
第一三共		40	06.4		324. 4	1, 142, 212
キョーリン製薬ホールデ	ィングス	:	33. 8		31. 7	63, 178
大幸薬品			6. 9		6	12, 102
ダイト			8. 2		6. 6	23, 760
大塚ホールディングス		25	96. 9		235.6	1, 208, 156
大正製薬ホールディング	ス	:	29. 5		25. 4	260, 858
ペプチドリーム			25.8		51.8	271, 950
石油・石炭製品(0.7%)						
日本コークス工業		1	11.4		95.8	10, 442
昭和シェル石油		13	23. 4		106. 1	145, 995
ニチレキ			16. 9		14. 5	17, 31
東燃ゼネラル石油			225		_	_
ユシロ化学工業			7. 4		6. 4	10, 99
ビーピー・カストロール			5. 6		4. 9	7, 66
富士石油			32		27. 5	11, 08
MORESCO			4. 7		4. 1	6, 96
出光興産		'	65. 5		95. 2	368, 42
JXTGホールディング	ス	1, 5	32. 4	1,	809.3	1, 137, 32
コスモエネルギーホール	ディングス		41.6		32.8	110, 04
ゴム製品 (0.9%)						
横浜ゴム		;	83. 3		65.6	154, 488
東洋ゴム工業			72. 9		67.1	116, 48
ブリヂストン			466		375. 3	1, 685, 097
住友ゴム工業		13	29. 2		116.7	218, 812

銘	柄	期首(i	前期末)	当	其	東 末
野白	171	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
藤倉ゴム工業			11.5		9. 9	7, 128
オカモト			42		39	40, 638
フコク			5.8		5	4, 995
ニッタ			12. 4		11.7	44, 226
住友理工			25.6		22	22, 396
三ツ星ベルト			34		28	31, 500
バンドー化学			25. 1		21.6	25, 185
ガラス・土石製品 (0.9%)						
日東紡績			112		16. 9	38, 041
旭硝子			680		15.9	479, 246
日本板硝子			62. 9		57. 3	45, 954
石塚硝子			19		1. 5	3, 681
日本山村硝子			55		47	8, 742
日本電気硝子			285		49	147,000
オハラ			5. 2		4. 5	10, 930
住友大阪セメント			256		220	99, 440
太平洋セメント			833		71.6	264, 204
日本ヒューム			13. 2		11.4	8, 698
日本コンクリート工業			30. 7		24. 4	10, 321
三谷セキサン			6. 9		5. 9	14, 785
アジアパイルホールディン	グス		17		14.6	8, 833
東海カーボン			128.9	1	02.9	155, 276
日本カーボン			68		5. 8	29, 406
東洋炭素			7. 6		7. 4	23, 532
ノリタケカンパニーリミテ	ド		7.8		6. 7	30, 887
TOTO			101.4		87. 2	462, 160
日本碍子			174. 3	1	38. 4	248, 704
日本特殊陶業			119		97. 3	238, 385
ダントーホールディングス			11		8	1, 176
MARUWA			5. 1		3. 9	31, 863
品川リフラクトリーズ			35		3	8, 319
黒崎播磨			30		2. 2	11, 242
ヨータイ			8		6.8	5, 276
イソライト工業			6.8		5. 8	4, 593
東京窯業			16.8		14. 4	5, 817
ニッカトー			4. 5		3. 8	3, 644
フジミインコーポレーテッ	ド		11.7		10. 1	22, 624
エーアンドエーマテリアル			29		2. 5	3, 062
ニチアス			72		62	79, 236

銘	for:	期首(前	期末)	当	其	1 7	k
路	柄	株	数	株	数	評価	額
			千株		千株		千円
ニチハ			18.3		17. 1	65	6,664
鉄鋼 (1.1%)							
新日鐵住金			622.5		501.7	1, 138	3, 357
神戸製鋼所		:	238. 7		205. 2	206	5, 226
中山製鋼所			15.5		15. 5	10), 757
合同製鐵			7.7		6	12	2, 264
ジェイ エフ イー ホー	ルディングス	;	377. 3		302.8	638	3, 302
日新製鋼			63		30.9	38	3, 408
東京製鐵			69.8		60	49	9, 200
共英製鋼			14.7		12.6	22	2, 705
大和工業			27.7		23.8	67	7,020
東京鐵鋼			29		4. 6	7	7, 038
大阪製鐵			8. 7		7. 4	15	5, 369
淀川製鋼所			19. 1		16. 4	45	5, 116
東洋鋼鈑			33		28	19	9, 964
丸一鋼管			46. 2		39. 7	124	1, 658
モリ工業			4. 4		3. 7	11	1,581
大同特殊鋼			231		19. 9	105	5, 669
日本高周波鋼業			48		4. 1	;	3, 107
日本冶金工業			114. 2		92. 7	26	5, 512
山陽特殊製鋼			82		12. 9	34	1,043
愛知製鋼			8. 1		6. 3	26	6, 995
日立金属			140.5		120.8	147	7,617
日本金属			3. 3		2.8	(5, 437
大平洋金属			88		6. 9	20), 099
新日本電工			78. 1		67. 1	21	1, 337
栗本鐵工所			6.6		5. 7	11	1,223
虹技			19		1.7	;	3, 296
日本鋳鉄管			13		12	1	1,920
三菱製鋼			96		8. 3	19	9, 505
日亜鋼業			19. 1		16. 4	Ę	5, 559
日本精線			9		1.8	8	8, 658
シンニッタン			11.3		8. 7	7	7, 577
新家工業			30		2.6		5, 340
非鉄金属 (0.9%)							
大紀アルミニウム工業所			23		18. 4	13	3, 266
日本軽金属ホールディン	ゲス	:	355. 3		327.3	88	3, 043
三井金属鉱業			375		30. 3	138	3, 016
東邦亜鉛			78		6. 2	29	9, 946

銘	柄	期首(前期末)	当	期 末		
鄞	ff?i	株 数	株 数	評価額		
		千株	千株	千円		
三菱マテリアル		86. 1	74. 1	233, 044		
住友金属鉱山		357	143.3	624, 358		
DOWAホールディングス		152	28. 4	105, 790		
古河機械金属		215	18. 5	36, 241		
エス・サイエンス		62. 7	53. 1	3, 876		
大阪チタニウムテクノロジ	ーズ	15. 1	11.7	23, 645		
東邦チタニウム		23. 3	20. 1	22, 210		
UACJ		178	17	45, 203		
古河電気工業		46. 3	37. 3	207, 388		
住友電気工業		520	419. 2	663, 384		
フジクラ		181.7	135. 4	95, 050		
昭和電線ホールディングス		164	14. 1	12, 873		
東京特殊電線		2	1. 4	4, 683		
タツタ電線		25. 8	22. 2	14, 230		
沖電線		14	_	_		
カナレ電気		1. 9	1. 9	4, 001		
平河ヒューテック		6. 5	5. 6	7, 229		
リョービ		84	13.8	36, 818		
アーレスティ		16	13. 7	12, 467		
アサヒホールディングス		20.8	19. 2	37, 017		
金属製品 (0.7%)						
稲葉製作所		7. 3	6. 3	8, 070		
宮地エンジニアリンググル	ープ	40	3. 2	6, 336		
トーカロ		9. 1	31. 1	39, 621		
アルファCo		4. 6	3. 9	6, 684		
SUMCO		144. 1	103. 2	299, 486		
川田テクノロジーズ		2. 6	2. 3	11, 914		
RS Technolog	i e s	0. 5	1.6	10, 768		
東洋製罐グループホールデ	ィングス	98. 1	76. 7	117, 811		
ホッカンホールディングス		36	28	10, 416		
コロナ		7. 2	6. 2	7, 874		
横河ブリッジホールディン	グス	24. 2	20.8	45, 864		
駒井ハルテック		2. 6	2. 5	6, 220		
高田機工		12	1	3, 460		
三和ホールディングス		137	107.5	142, 222		
文化シヤッター		38. 4	33	33, 363		
三協立山		18. 1	15. 5	22, 940		
アルインコ		9. 5	8. 1	8, 650		
東洋シヤッター		3. 4	2. 9	1, 792		

銘	柄	期首(前期末	₹)	当 其	期 末
逝	ניוז	株 数	ζ	株 数	評価額
		手	侏	千株	千円
LIXILグループ		192	2	165.3	384, 983
日本フイルコン			10	8.6	5, 478
ノーリツ		:	27	25	45, 450
長府製作所		14.	7	12.7	31, 572
リンナイ		23.	5	20	197, 200
ダイニチ工業			7	6	5, 196
日東精工		19.	6	15. 5	10, 881
三洋工業			17	1. 4	2,877
岡部		28.	6	22. 7	21,020
ジーテクト		14.	4	12. 4	25, 407
中国工業			2	1. 7	1, 188
東プレ		26.	5	20.9	62, 428
高周波熱錬		25.	6	21.6	23, 220
東京製綱		9.	3	8	17, 280
サンコール		7.	3	6. 3	4, 460
モリテック スチール		6.	9	6. 6	5, 075
パイオラックス			7	16. 6	44, 869
エイチワン			-	8. 2	11, 398
日本発條		129	9	111.7	121, 976
中央発條			16	1. 3	4, 426
アドバネクス		2.	4	1.8	7, 857
立川ブラインド工業		5.	7	4. 9	7, 168
三益半導体工業		11.	6	8. 7	15, 964
機械 (5.4%)					
日本ドライケミカル		1.	8	1.5	3, 571
日本製鋼所		45.	6	36. 6	119, 865
三浦工業		56.	4	48.5	154, 715
タクマ		44.	2	38	43, 320
ツガミ		:	37	30	39, 270
オークマ			90	13. 1	77, 945
東芝機械			32	63	45, 234
アマダホールディングス		185	. 8	173	216, 769
アイダエンジニアリング		39.	2	28. 5	36, 166
滝澤鉄工所			40	3. 5	6, 727
富士機械製造		42.	1	33. 6	66, 931
牧野フライス製作所			59	57	55, 347
オーエスジー		62.	9	51. 7	120, 667
ダイジェット工業			16	1. 4	2, 793
旭ダイヤモンド工業		39.	5	33. 3	36, 097

銘	柄	期首(前期末)	当	其	東 末
¥¶	111	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
DMG森精機			81.6		62. 1	117, 306
ソディック			35		24. 5	33, 050
ディスコ			16. 1		15. 2	343, 824
日東工器			8		6. 9	20, 631
日進工具			_		3	8, 967
パンチ工業			5		9.3	10, 350
冨士ダイス			_		4. 2	4, 246
豊和工業			7. 7		6. 2	7, 539
OKK			50		4. 3	4, 618
石川製作所			3. 4		2. 9	6, 235
東洋機械金属			9. 3		8. 7	7, 160
津田駒工業			31		26	5, 824
エンシュウ			34		29	4, 408
島精機製作所			18		14. 2	100, 252
オプトラン			_		8. 2	24, 600
NCホールディングス			4. 5		3. 6	2, 692
フリュー			8. 1		8	8, 120
ヤマシンフィルタ			2. 7		16.7	21, 125
日阪製作所			18.8		16. 1	16, 261
やまびこ			25. 3		21.7	29, 468
平田機工			_		3. 1	29, 202
ペガサスミシン製造			13. 2		10.5	7, 255
ナブテスコ			71.7		61.7	246, 183
三井海洋開発			13. 9		11.9	31, 308
レオン自動機			11.6		10	20, 310
SMC			41.4		35. 6	1, 515, 136
新川			11.5		9. 2	10, 432
ホソカワミクロン			23		4. 2	30, 072
ユニオンツール			6		5. 1	18, 564
オイレス工業			17.8		14. 5	32, 030
日精エー・エス・ビー機械	皮		4. 4		3.8	27, 208
サトーホールディングス			17. 2		14.8	48, 544
技研製作所			_		5. 7	16, 564
日本エアーテック			4. 5		3. 8	3, 226
日精樹脂工業			10.9		9. 4	13, 526
オカダアイヨン			2. 9		3. 3	4, 428
ワイエイシイホールディン	/グス		5. 1		3. 8	3, 651
小松製作所			636. 7	5	547. 4	1, 858, 423
住友重機械工業			403		64. 9	250, 514

銘	柄	期首(前期末)	구 -	í ‡	期 末	
拓	ff/l	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	千円	
日立建機			61.6		53	211, 470	
日工			4. 1		3. 1	7, 167	
巴工業			5. 6		4.8	9, 628	
井関農機			141		11.3	23, 018	
TOWA			11. 3		8.8	12, 135	
丸山製作所			29		2. 5	4, 530	
北川鉄工所			6. 3		5. 4	14, 520	
ローツェ			4. 9		5. 6	12, 863	
タカキタ			4. 6		3. 9	2, 784	
クボタ			660.5		608.1	1, 077, 857	
荏原実業			3. 8		3. 3	6, 999	
三菱化工機			45		3. 9	8, 408	
月島機械			26. 2		22. 5	32, 917	
帝国電機製作所			10		7. 9	12, 324	
東京機械製作所			52		4. 4	2, 332	
新東工業			31. 3		26. 9	29, 132	
澁谷工業			11.5		9.9	35, 046	
アイチ コーポレーション			19. 5		19.6	13, 857	
小森コーポレーション			33. 2		28. 5	37, 762	
鶴見製作所			10.3		9.6	18, 969	
住友精密工業			22		19	7, 144	
酒井重工業			26		2. 1	10, 300	
荏原製作所			62. 5		46.6	167, 527	
石井鐵工所			2		1.7	3, 218	
酉島製作所			13. 5		11.6	11, 112	
北越工業			14.8		12.7	14,630	
ダイキン工業			180		154.8	1, 780, 200	
オルガノ			26		4. 1	12, 894	
トーヨーカネツ			63		4.8	14,640	
栗田工業			78. 1		61.4	203, 234	
椿本チエイン			78		67	55, 744	
大同工業			27		4. 3	5, 908	
木村化工機			11.8		9. 4	4, 549	
アネスト岩田			23. 9		19. 1	21, 201	
ダイフク			65.8		57. 7	345, 623	
サムコ			3. 3		3. 1	3, 909	
加藤製作所			7. 2		5. 4	12, 830	
油研工業			26		2. 2	6, 140	
タダノ			68. 9		54. 7	83, 964	

銘	柄	期首(i	前期末)	当	其	東 末
和	113	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
フジテック			38. 4		36. 3	50, 638
CKD			39. 5		31.5	70, 938
キトー			16.6		8.6	16, 013
平和			40.9		35. 1	76, 096
理想科学工業			13. 1		11.3	22, 148
SANKYO			36. 7		28. 4	108, 346
日本金銭機械			12. 1		10.4	11, 117
マースエンジニアリング			7.4		7. 2	17, 546
福島工業			8. 1		7	30, 870
オーイズミ			5. 5		4.8	2, 428
ダイコク電機			5. 4		5. 2	8, 746
竹内製作所			24. 1		19	40, 869
アマノ			40.8		35. 1	94, 383
JUKI			20.8		16.8	23, 133
サンデンホールディングス	;		80		13.8	20, 217
蛇の目ミシン工業			12.8		10.3	7, 127
マックス			20		17.4	23, 524
グローリー			42. 1		33. 8	122, 863
新晃工業			9. 2		11.5	19, 630
大和冷機工業			21. 2		18. 2	22, 604
セガサミーホールディンク	゚゙ス		130.8		112. 4	187, 370
日本ピストンリング			5. 1		4. 1	9, 204
リケン			6. 1		5. 2	30, 108
TPR			14. 8		12. 7	36, 068
ツバキ・ナカシマ			14. 8		11.4	30, 130
ホシザキ			28. 9		35. 7	334, 509
大豊工業			10.7		9. 2	13, 984
日本精工			270.8	4	232.8	319, 867
NTN			305	4	262.4	114, 668
ジェイテクト			140.5		120.8	182, 528
不二越			133		105	63, 525
日本トムソン			42. 1		36. 2	29, 611
ТНК			93. 2		70. 7	308, 605
ユーシン精機			5.8		5	16, 775
前澤給装工業			5		4. 4	8, 461
イーグル工業			14. 3		14	25, 004
前澤工業			8.8		8. 3	3, 212
日本ピラー工業			13. 3		11.5	18, 308
キッツ			63. 3		50. 5	44, 137

DH.	442	期首(前期末)	当 其	期 末
銘	柄	株 数	株 数	評価額
		千株	千株	千円
日立工機		34. 9	_	_
マキタ		86	147.8	735, 305
日立造船		104. 5	89. 9	47, 736
三菱重工業		2, 210	190	753, 350
IHI		1,013	87. 1	279, 155
スター精密		23. 1	18. 2	35, 162
電気機器 (13.9%)				
日清紡ホールディングス	Z,	73. 2	69. 2	96, 672
イビデン		92. 3	69. 4	109, 929
コニカミノルタ		308. 7	265. 4	240, 717
ブラザー工業		170. 4	138. 4	330, 637
ミネベアミツミ		239. 9	210. 5	468, 573
日立製作所		3, 166	2, 722	2, 058, 104
東芝		2, 949	_	_
三菱電機		1, 406. 5	1, 133. 7	1, 883, 075
富士電機		397	342	239, 742
東洋電機製造		5. 6	4. 5	7, 542
安川電機		152. 9	131. 4	612, 324
シンフォニアテクノロミ	ブー	85	73	25, 623
明電舎		121	96	37, 440
オリジン電気		19	3. 3	5, 530
山洋電気		35	5. 5	43, 065
デンヨー		12. 2	10. 5	19, 908
東芝テック		83	81	50, 301
芝浦メカトロニクス		21	16	7, 168
マブチモーター		37. 2	31.6	160, 528
日本電産		170.9	136. 4	2, 163, 304
ユー・エム・シー・エロ	レクトロニクス	1. 5	4. 1	9, 979
東光高岳		6. 7	5. 7	9, 359
ダブル・スコープ		12. 7	16. 5	22, 968
宮越ホールディングス		4. 5	4. 2	3, 465
ダイヘン		72	62	48, 236
田淵電機		19. 9	15. 7	4, 176
ヤーマン		1. 7	16. 4	35, 424
JVCケンウッド		96. 7	83. 2	28, 870
ミマキエンジニアリング	ブ	11.8	10. 1	7, 696
第一精工		6. 2	5. 3	11, 416
日新電機		26. 5	26. 6	26, 919
大崎電気工業		26	24. 3	18, 176

銘	柄	期首(前	前期末)	当	当 其		朝 末	
鄞	ff?i	株	数	株	数	評価	額	
			千株		千株		千円	
オムロン			140.1		120.5	738	8, 665	
日東工業			19. 4		18.2	28	8, 883	
IDEC			17. 2		14	3	5, 266	
不二電機工業			1.4		1.2		1,611	
ジーエス・ユアサ コー	ーポレーション		254		204	11:	3, 832	
サクサホールディングス	ζ		33		2. 9		6, 011	
メルコホールディングス	ζ		7. 3		5. 5	19	9, 167	
テクノメディカ			3		2.8	:	5, 560	
日本電気			1,813		146. 7	440	6, 701	
富士通			1, 271		1, 166	72	7,001	
沖電気工業			57. 1		46	6	3, 664	
岩崎通信機			58		5	:	3, 665	
電気興業			37		6. 4	19	9, 296	
サンケン電気			77		66	50), 556	
ナカヨ			14		2. 2		4, 197	
アイホン			7. 5		6. 4	1	1, 225	
ルネサスエレクトロニク	7ス		68. 3		58. 7	65	2, 574	
セイコーエプソン			196. 3		168.8	313	3, 461	
ワコム			102.3		87. 9	45	3, 686	
アルバック			22. 2		26. 1	14'	7, 726	
アクセル			5. 5		4. 7		4, 399	
EIZO			13		10.4	50	0, 856	
ジャパンディスプレイ			246. 2		232. 9	4	5, 648	
日本信号			36. 4		31. 3	29	9, 922	
京三製作所			31		27	17	7, 361	
能美防災			14. 9		15	32	2, 925	
ホーチキ			9.6		8. 2	1	5, 284	
エレコム			11.4		9. 9	23	3, 443	
日本無線			8. 1		_		_	
パナソニック		1, 51	4. 256	1,	295. 1	2, 03	3, 954	
シャープ			_		78.9	25	4, 847	
アンリツ			96. 1		82.6	10-	4, 241	
富士通ゼネラル			45		34. 6	6	4, 702	
日立国際電気			34. 5		-		_	
ソニー			931		757. 4	3, 846	5, 834	
TDK			74. 3		59.3		0, 304	
帝国通信工業			29		5		6, 415	
タムラ製作所			51		43. 7	33	2, 425	
アルプス電気			121.7		97. 7	250	0,600	

later	66	期首(i	前期末)	当	其	東 末	
銘	柄	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	千円	
池上通信機			42		36	5, 724	
パイオニア			198. 1		188. 9	32, 301	
日本電波工業			12.7		10. 2	6, 364	
鈴木			5. 1		4. 8	5, 112	
日本トリム			3. 2		2. 4	12,648	
ローランド ディー. ジー.			6. 7		5. 8	13, 566	
フォスター電機			15. 4		13. 3	34, 367	
クラリオン			69		60	18, 360	
SMK			34		29	12, 122	
ヨコオ			9. 4		7. 3	14, 454	
ティアック			95		81	3, 564	
ホシデン			40		28.6	37, 408	
ヒロセ電機			21.3		18.3	272, 487	
日本航空電子工業			38		29	43, 616	
TOA			15.6		12. 2	16, 177	
マクセルホールディングス			19.7		22. 5	45, 202	
古野電気			17		13. 5	9, 355	
ユニデンホールディングス			39		31	8, 122	
アルパイン			31. 4		27	54, 108	
スミダコーポレーション			10.8		11.6	15, 694	
アイコム			7. 3		6. 3	16, 915	
リオン			5		4.8	13, 041	
本多通信工業			4. 2		8.8	8, 659	
船井電機			14.8		11.4	8, 721	
横河電機			143		113.5	231, 653	
新電元工業			51		4	27, 520	
アズビル			40		34	164, 900	
東亜ディーケーケー			6. 5		5. 6	7, 100	
日本光電工業			55. 1		47.4	136, 701	
チノー			4. 7		3. 9	5, 635	
共和電業			14. 9		12.8	5, 196	
日本電子材料			5. 2		4. 5	3, 550	
堀場製作所			26. 1		22. 5	175, 725	
アドバンテスト			89. 9		63. 2	141, 252	
小野測器			6. 4		4.8	3, 945	
エスペック			11.7		10	24, 020	
キーエンス			59. 7		55. 6	3, 531, 712	
日置電機			6. 9		5. 9	19, 027	
シスメックス			102.5		88. 2	799, 092	

銘	柄	期首(前	前期末)	当	ļ	期 末		
珀	ff?i	株	数	株	数	評価額		
			千株		千株	千円		
日本マイクロニクス			24.6		19.7	19, 640		
メガチップス			12.3		8. 9	31, 506		
OBARA GROUP			7. 7		6. 6	40, 788		
澤藤電機			8		1. 2	2, 377		
コーセル			18.3		15.7	22, 199		
イリソ電子工業			4. 2		9. 5	57, 855		
新日本無線			11.2		6. 9	5, 595		
オプテックスグループ			10		9. 2	46, 460		
千代田インテグレ			6. 9		5. 5	12, 886		
アイ・オー・データ機器			4. 1		4. 7	5, 193		
レーザーテック			14. 5		23. 2	86, 652		
スタンレー電気			94		86. 7	335, 095		
岩崎電気			48		4. 4	7, 370		
ウシオ電機			80		68.8	98, 108		
岡谷電機産業			7		6. 1	3, 580		
ヘリオス テクノ ホールデ	イング		12. 1		9. 6	8, 774		
日本セラミック			10.8		11.5	31, 291		
遠藤照明			6. 7		5. 7	6, 013		
古河電池			9		8. 1	7, 557		
双信電機			6. 4		4. 9	2, 895		
山一電機			12.4		8. 2	14, 374		
図研			8.6		7.4	11,026		
日本電子			48		41	37, 597		
カシオ計算機			106		91. 2	142, 819		
ファナック			133. 7		107.7	2, 828, 740		
日本シイエムケイ			28.4		20	16, 260		
エンプラス			6		5. 1	17, 416		
大真空			4.8		4. 1	5, 371		
ローム			63.7		50.9	508, 491		
浜松ホトニクス			102.9		82.6	329, 987		
三井ハイテック			17.4		14.9	22, 230		
新光電気工業			49.8		42.8	32, 870		
京セラ			216. 4		186. 1	1, 076, 030		
太陽誘電			64. 1		50.9	87, 548		
村田製作所			138. 3		118.9	1, 664, 005		
ユーシン			17. 7		17. 1	12, 671		
双葉電子工業			21.6		18.5	40, 996		
北陸電気工業			53		4. 6	6, 683		
ニチコン			41.5		35. 7	41, 804		

N/a	Lord.	期首(前期末)	当	其	期 末	
銘	柄	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	千円	
日本ケミコン			114		9. 2	22, 218	
KOA			18. 2		15. 7	33, 079	
市光工業			28		16. 9	18,066	
小糸製作所			79		67. 9	473, 942	
ミツバ			24. 3		20. 9	27, 483	
SCREENホールディ	ィングス		27		21.5	205, 970	
キヤノン電子			12. 1		10.4	23, 639	
キヤノン			709.8		610.3	2, 322, 801	
リコー			396.4	:	340.9	355, 558	
MUTOHホールディン	/グス		18		1.5	3, 681	
東京エレクトロン			87. 9		75. 6	1, 506, 330	
輸送用機器 (8.7%)							
トヨタ紡織			46. 1		33	69, 663	
芦森工業			30		2. 3	4, 836	
ユニプレス			25. 4		21.9	50, 873	
豊田自動織機			120.1		91.8	559, 980	
モリタホールディングス	ζ		23		18. 2	35, 690	
三櫻工業			16. 7		14. 4	10, 440	
デンソー			325. 1	:	251.5	1, 432, 292	
東海理化電機製作所			34. 7		29. 9	63, 388	
三井造船			476		40.9	69, 570	
川崎重工業			1,026		88. 2	290, 178	
名村造船所			39. 6		34	19, 346	
サノヤスホールディング	ブス		16		13.8	3, 394	
日本車輌製造			48		41	12,054	
三菱ロジスネクスト			15. 7		13. 5	11,691	
近畿車輛			2		1.7	4, 052	
日産自動車		1	, 555. 1	1,	337. 1	1, 477, 495	
いすゞ自動車			382. 1	:	328. 5	515, 416	
トヨタ自動車			1,603	1,	378. 2	9, 154, 004	
日野自動車			188. 2		161.8	217, 297	
三菱自動車工業			483.2	4	419.6	316, 798	
エフテック			7		7. 2	9, 252	
レシップホールディング	ブス		4. 3		4. 1	3, 247	
GMB			2. 1		1.8	3, 040	
ファルテック			2. 3		2	2, 746	
武蔵精密工業			15. 3		12. 1	42, 471	
日産車体			57. 9		44. 3	47, 356	
新明和工業			53		49.3	41,757	

銘	柄	期首(前	期末)	当	其	期 末	
對	fff1	株	数	株	数	評価	額
			千株		千株		千円
極東開発工業			26. 2		21. 1	3:	2, 283
日信工業			29. 5		23	4	0, 411
トピー工業			10.8		9.3	2	8, 272
ティラド			51		4. 1	1	6, 072
曙ブレーキ工業			61.2		52. 7	1	3, 543
タチエス			22. 4		19.2	3-	4, 848
NOK			63.8		60.9	12	3, 444
フタバ産業			40. 2		34. 7	2	9, 460
КҮВ			148		11.8	5	6, 876
大同メタル工業			16.6		14. 2	1	6, 912
プレス工業		1	70		60.2	3	7, 143
ミクニ			16.7		14. 4		9, 100
カルソニックカンセイ			40		-		-
太平洋工業			27. 1		23. 7	3	1, 402
ケーヒン			30. 3		26	5	2, 884
河西工業			17.8		13.9	13	8, 334
アイシン精機			120.6		93. 3	52	0,614
富士機工			13. 1		-		-
マツダ			417.5		355.8	49	3, 138
今仙電機製作所			12. 1		10.5	1:	2, 306
本田技研工業		1,	186. 5	1,	020.1	3, 55	7, 088
スズキ			261.3		224. 7	1, 25	0, 904
SUBARU			409.4		352	1, 22	5, 664
安永			4.8		5. 5	1	1,874
ヤマハ発動機			186. 2		160. 1	47	8, 699
ショーワ			34. 2		29. 4	5	1, 067
ТВК			16. 9		13.5		6, 885
エクセディ			17. 9		13.7	4	4, 319
豊田合成		1	42.6		41.2	9	6, 572
愛三工業		1	23. 1		19.9	2	1, 929
盟和産業		1	2		1. 7		2, 210
日本プラスト		1	_		4. 6		4, 117
ヨロズ		1	12. 3		11.5	1	9, 607
エフ・シー・シー		1	21.6		18. 5	5	1,800
シマノ		1	53. 1		45. 7	67	4, 532
タカタ		1	23. 8		_		_
テイ・エス テック		1	30.6		26. 3	10	5, 726
ジャムコ			7. 7		5. 7	1	1, 970

No	LT*	期首(前期末	当	其	東 末	
銘	柄	株 数	株	数	評価額	
		千杉	ŧ	千株	千円	
精密機器 (1.6%)						
テルモ		202.	1	173.8	921, 140	
クリエートメディック		4.	1	3. 7	4, 044	
日機装		45.	5	39. 2	41, 983	
島津製作所		169.	7	135. 5	378, 451	
JMS		2	1	10.4	6, 489	
クボテック		2.	3	2. 4	1, 245	
長野計器		10.	3	8. 9	10, 332	
ブイ・テクノロジー		2.	7	2. 7	81,810	
東京計器		4	5	7. 2	7, 992	
愛知時計電機		1.	7	1. 5	6, 322	
インターアクション		-	-	4. 5	4, 414	
オーバル		12.	9	11.1	3, 374	
東京精密		25.	5	20.5	85, 382	
マニー		17.	5	13.8	54, 096	
ニコン		229.	3	197. 5	372, 090	
トプコン		66.	1	60.9	121, 191	
オリンパス		210.	1	168. 9	676, 444	
理研計器		11.	6	10.8	23, 274	
タムロン		11.	7	9. 1	19, 710	
НОҮА		271.	3	230.8	1, 228, 548	
シード		-	-	1.2	8, 064	
ノーリツ鋼機		13.	3	11.5	25, 978	
エー・アンド・デイ		1:	2	10.3	6, 386	
シチズン時計		144.	3	135. 3	98, 633	
リズム時計工業		5	3	4. 3	9, 945	
大研医器		11.	7	10.1	7, 878	
メニコン			9	15.5	40,052	
シンシア		-	-	0.9	621	
松風		6.	9	5. 5	7, 887	
セイコーホールディングス		9	3	17.5	43, 137	
ニプロ		91.	3	78. 5	120, 419	
その他製品 (2.3%)						
中本パックス		-	-	2. 2	4, 556	
スノーピーク			2	3. 5	4, 462	
パラマウントベッドホールデ	イングス	12.	5	12	65, 880	
トランザクション		5.	3	5. 1	5, 671	
SHO-BI		4.	1	3. 8	1, 535	
ニホンフラッシュ		6.	2	5. 3	12, 179	

N/4	LT*	期首(i	前期末)	7	4 其	東 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
前田工繊			13. 2		11.3	18, 577
永大産業			17		15	8, 010
アートネイチャー			14. 1		12. 1	8, 687
ダンロップスポーツ			8. 3		_	_
バンダイナムコホール	ディングス		145. 4		117.2	401, 410
アイフィスジャパン			2. 9		2. 5	1,615
共立印刷			21.9		18.8	6, 617
SHOEI			5. 9		5. 1	19, 915
フランスベッドホール	ディングス		16.5		13. 4	12, 475
パイロットコーポレー	ション		23		19.8	112, 266
萩原工業			3. 7		6. 3	10, 634
トッパン・フォームス			23. 5		24.3	27, 677
フジシールインターナ	ショナル		29.6		25. 4	93, 980
タカラトミー			51. 2		47.4	49, 817
廣済堂			13. 3		10.5	5, 890
As-meエステール			3. 5		3. 3	3, 372
アーク			55. 5		47.7	5, 724
タカノ			5.8		5	4, 465
プロネクサス			12. 3		10.6	13, 356
ホクシン			9. 3		8	1, 464
ウッドワン			22		3.8	5, 415
大建工業			9. 3		8.9	21, 796
凸版印刷			372		320	274, 560
大日本印刷			380		148.4	323, 066
図書印刷			18		7. 6	7, 577
共同印刷			41		3. 5	10, 972
NISSHA			22. 1		23. 3	61, 465
光村印刷			12		1	2, 425
宝印刷			6. 9		5. 9	10, 779
アシックス			131		112.6	210, 336
ツツミ			4. 9		3. 5	7, 245
小松ウオール工業			4. 5		3.8	10, 267
ヤマハ			88.8		76. 4	343, 418
河合楽器製作所			5. 2		3. 8	13, 148
クリナップ			15. 5		10.5	8, 274
ピジョン			79. 7		68. 5	303, 112
兼松サステック			14		0. 9	1,677
キングジム			11		9. 4	9, 400
リンテック			31. 3		26. 9	79, 435

144	4cr:	期首(前	前期末)	当	其	期末	
銘	柄	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	千円	
TASAKI			3. 6		-	_	
イトーキ			27.8		23. 9	15, 535	
任天堂			81. 2		69.8	3, 307, 822	
三菱鉛筆			10.9		18.7	42, 430	
タカラスタンダード			27. 2		23. 4	40,926	
コクヨ			68. 5		54. 4	105, 372	
ナカバヤシ			24		11. 1	6, 759	
グローブライド			6. 4		5. 1	12, 382	
岡村製作所			46		39.6	54, 925	
美津濃			71		11.2	35, 224	
電気・ガス業 (1.6%)							
東京電力ホールディングス		1,	118.4		905	346, 615	
中部電力			434. 4		346.8	495, 403	
関西電力			538		462.6	586, 576	
中国電力			182. 3		156. 7	198, 538	
北陸電力			129. 2		111. 1	97, 101	
東北電力			329. 4		265. 5	363, 469	
四国電力			118.7		102. 1	125, 174	
九州電力			291.2		250.4	309, 494	
北海道電力			123. 4		113. 7	75, 383	
沖縄電力			19. 4		18.3	52, 575	
電源開発			104. 9		90.2	242, 277	
エフオン			4. 9		5. 7	6, 902	
イーレックス			16.6		17. 9	13, 102	
東京瓦斯			1, 414		241.9	646, 840	
大阪瓦斯			1, 279		220	447, 480	
東邦瓦斯			330		56. 2	177, 030	
北海道瓦斯			32		30	8, 970	
広島ガス			27. 1		23. 3	8, 854	
西部瓦斯			148		13. 7	36, 428	
静岡ガス			40.6		32. 2	29, 237	
メタウォーター			7. 4		6. 4	20, 192	
陸運業 (4.0%)							
SBSホールディングス			13		11.2	14, 828	
東武鉄道			705		121.1	382, 070	
相鉄ホールディングス			211		36. 3	101, 131	
東京急行電鉄			716		307.9	513, 577	
京浜急行電鉄			361		155. 3	282, 490	
小田急電鉄			211. 2		168.6	354, 903	

銘	柄	期首(前	前期末)	当	其	第 末
珀	11/3	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
京王電鉄			368		63.3	281, 368
京成電鉄			98.8		78.9	247, 746
富士急行			36		15. 5	41, 090
新京成電鉄			17		2. 9	6, 388
東日本旅客鉄道			255. 1		203.6	1, 961, 278
西日本旅客鉄道			126.9		102.3	740, 856
東海旅客鉄道			109.6		101.5	1, 970, 115
西武ホールディングス			182. 1		144. 5	267, 180
鴻池運輸			18.6		16	28, 592
西日本鉄道			158		31.4	85, 156
ハマキョウレックス			8.6		8	27, 360
サカイ引越センター			4. 5		6	31, 680
近鉄グループホールディン	グス		1, 327		107.4	440, 877
阪急阪神ホールディングス			166.6		143. 2	553, 468
南海電気鉄道			279		50.9	132, 899
京阪ホールディングス			295		47.8	154, 155
神戸電鉄			32		2. 6	10, 205
名古屋鉄道			480		84.5	223, 925
山陽電気鉄道			48		8. 3	21, 521
日本通運			510		42. 2	295, 400
ヤマトホールディングス			235.8		188. 2	484, 803
山九			174		27.5	140, 800
丸運			7. 1		6. 1	2, 031
丸全昭和運輸			44		38	19,000
センコーグループホールデ	ィングス		62.6		64.6	52, 713
トナミホールディングス			27		2. 6	15, 262
ニッコンホールディングス			44. 7		40.8	110, 078
日本石油輸送			1.5		1. 3	3, 997
福山通運			80		15. 7	69, 865
セイノーホールディングス			93. 5		80.4	152, 840
神奈川中央交通			15		2. 7	10, 125
目立物流			27. 5		23. 6	68, 794
丸和運輸機関			3. 3		5. 6	17, 472
C&Fロジホールディング	ス		13. 7		11.8	17, 015
九州旅客鉄道			98. 3		90. 1	294, 627
SGホールディングス			-		76. 1	173, 051
海運業 (0.2%)						
日本郵船			1, 114		89.8	184, 000
商船三井			691		67.9	200, 848

Nt	to:	期首(前期末)	当 其	期 末
銘	柄	株 数	株 数	評価額
		千株	千株	千円
川崎汽船		500	49.6	120, 280
NSユナイテッド海運		59	5. 1	10, 761
明治海運		11.8	11.4	4, 753
飯野海運		68. 2	54. 7	26, 529
共栄タンカー		11	0.8	1, 517
乾汽船		9. 6	8.3	7, 129
空運業 (0.6%)				
日本航空		237.6	199. 2	837, 436
ANAホールディングス		2, 447	210.4	851, 909
パスコ		12	10	3, 040
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム		3. 8	3	21, 690
日新		54	9. 3	24, 914
三菱倉庫		86	37. 2	81,058
三井倉庫ホールディングス		76	61	20,008
住友倉庫		96	74	52, 244
澁澤倉庫		34	5. 9	10, 584
東陽倉庫		22. 5	19. 4	6, 887
日本トランスシティ		30	26	11,830
ケイヒン		24	2. 1	3, 530
中央倉庫		7. 6	6. 5	7, 130
川西倉庫		_	2. 2	3, 896
安田倉庫		10. 3	9. 6	9, 830
東洋埠頭		38	3. 3	5, 504
宇徳		10. 7	9. 2	4, 149
上組		157	67. 6	154, 736
サンリツ		3. 2	2. 7	2, 019
キムラユニティー		3. 3	2. 9	3, 256
キユーソー流通システム		4. 2	3. 1	7, 991
郵船ロジスティクス		12. 1	_	-
近鉄エクスプレス		23. 6	20. 3	38, 773
東海運		7. 1	6. 1	2, 482
エーアイテイー		8. 1	7. 6	8, 512
内外トランスライン		3. 9	3. 8	6, 798
日本コンセプト		_	2. 1	3, 076
情報・通信業 (7.5%)			1	
NECネッツエスアイ		14. 3	12. 3	33, 308
システナ		10. 4	8. 9	36, 757
デジタルアーツ		5.8	5. 5	21, 917

銘 柄	期首(前	朝末)	当	其	東 末
蹈 М	株	数	株	数	評価額
		千株		千株	千円
新日鉄住金ソリューションズ		21.7		17.5	50, 155
キューブシステム		5. 6		6. 5	5, 148
エイジア		-		1.7	2, 563
コア		5. 5		4. 7	6, 072
ソリトンシステムズ		_		3. 6	4, 593
ソフトクリエイトホールディングス		6. 2		5. 3	7, 499
TIS		43. 1		37. 1	148, 956
ネオス		3. 9		3. 3	1, 267
電算システム		4. 5		3. 9	7, 347
グリー		79. 2		59.6	36, 356
コーエーテクモホールディングス		30. 9		19	38, 893
三菱総合研究所		5		4.8	15, 696
ボルテージ		2. 3		2. 2	2, 026
電算		1.4		1. 2	3, 016
AGS		3. 3		6. 3	6, 079
ファインデックス		9.6		9. 2	6, 154
ヒト・コミュニケーションズ		2. 9		2. 5	4, 337
ブレインパッド		2.8		2. 4	6, 528
KLab		24. 9		21.6	34, 689
ポールトゥウィン・ピットクルーホールデ	1	9. 4		8	15, 184
イーブックイニシアティブジャパン		2		1.8	1, 972
ネクソン	1	42.4		124	441, 440
アイスタイル		27. 4		27. 9	37, 776
エムアップ		3. 7		3. 7	3, 818
エイチーム		7. 2		7. 6	18, 597
テクノスジャパン		10		10. 1	8, 968
e n i s h		3.8		3. 6	3, 211
コロプラ		36. 5		36. 2	33, 883
モバイルクリエイト		9. 5		9	3, 024
オルトプラス		5. 4		5. 4	5, 232
ブロードリーフ		32. 1		27.6	28, 510
ハーツユナイテッドグループ		6.8		5. 9	9, 611
メディアドゥホールディングス		2.8		3. 6	6, 087
ブイキューブ		7. 1		6.8	3, 753
サイバーリンクス		2		1. 7	2, 031
ディー・エル・イー		4. 3		7. 2	3, 009
フィックスターズ		1. 9		1. 9	17, 005
VOYAGE GROUP		4. 4		5. 6	6, 994
オプティム		1.4		1. 9	4, 558

N/+	<i>tr</i>	期首(前期	期末)	当	其	東 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
		-	千株		千株	手円
セレス			2. 3		3. 4	5, 307
ベリサーブ			1. 5		1.5	4,620
ティーガイア		1	12. 9		11. 1	31, 879
セック			_		1. 1	3, 080
日本アジアグループ		1	14. 7		11.7	6,060
豆蔵ホールディングス			9. 5		8. 3	9, 569
テクマトリックス			8. 1		6. 1	10, 174
プロシップ			_		1.6	4, 118
ガンホー・オンライン・エ	ンターテイメント	27	72.8	3	801.6	107, 369
GMOペイメントゲー	トウェイ	1	10.6		7.8	77, 298
ザッパラス			6. 7		5. 3	2, 045
システムリサーチ			1. 3		1. 1	2, 468
インターネットイニシ	アティブ	1	19. 1		18. 1	40, 254
さくらインターネット		1	10.6		13. 2	9, 649
ヴィンクス			-		2. 3	3, 130
GMOクラウド			2. 9		2. 5	5, 462
SRAホールディング	ス		6. 9		5. 9	17, 534
Minoriソリュー:	ションズ		2. 9		2. 2	3, 132
システムインテグレー	タ		1.8		1.6	1,568
朝日ネット		1	11.8		10.1	5, 050
e B A S E			_		2. 2	2, 976
アドソル日進			2. 6		4. 3	5, 379
フリービット			7. 2		7. 4	9, 257
コムチュア			2. 2		5. 7	19,636
サイバーコム			1.7		2	4, 226
メディカル・データ・	ビジョン		2. 2		4. 2	16, 569
gumi		1	14. 7		12.8	13, 350
ショーケース・ティー	ビー		1. 5		2. 1	3, 381
モバイルファクトリー			-		2	2, 682
デジタル・インフォメーシ	ョン・テクノロジ		-		1.8	4, 973
PCIホールディング	ス		1. 5		1. 9	5, 534
パイプドHD			2. 3		1. 7	2, 402
アイビーシー			1		1. 2	1,743
ネオジャパン			-		2	2, 992
オープンドア			1. 3		4. 4	10, 137
マイネット			-		2. 2	2, 838
アカツキ			-		2. 2	10,835
Ubicomホールデ	ィングス		-		1. 2	1, 114
LINE		2	21.8		33.6	134, 736

銘	柄	期首(i	前期末)	当	其	東 末
भ	1173	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
シンクロ・フード			_		0.9	3, 928
オークネット			_		3. 5	5, 183
AOI TYO Holdi	n g s		10.6		9. 1	12, 676
マクロミル			-		10.4	33, 176
ソルクシーズ			3. 7		4. 2	4, 107
フェイス			3. 4		3. 9	4, 477
ハイマックス			1. 7		1.5	2, 563
野村総合研究所			97. 3		70.7	335, 471
サイバネットシステム			10.6		9. 1	7, 325
CEホールディングス			2		3. 1	2, 501
日本システム技術			_		1. 3	1, 657
インテージホールディングス			7.4		12. 9	14, 822
東邦システムサイエンス			4. 3		3. 7	3, 056
ソースネクスト			7.8		15.6	11, 278
フォーカスシステムズ			5		6.3	5, 827
クレスコ			2. 9		2. 5	8, 500
フジ・メディア・ホールディ	ングス		135. 5		116.5	210, 282
オービック			44. 9		35. 1	305, 370
ジャストシステム			21		18. 1	42, 770
TDCソフト			5. 7		4. 9	6, 639
ヤフー			932. 7		802.1	405, 060
トレンドマイクロ			68. 9		54. 3	321, 456
インフォメーション・ディベロ	プメント		3. 7		3. 5	5, 267
日本オラクル			20. 9		18	155, 520
アルファシステムズ			4. 3		3. 7	7, 881
フューチャー			17.6		15. 1	19, 856
CAC Holdings			9. 7		8. 3	8, 640
ソフトバンク・テクノロジー			3. 1		4.6	8, 303
トーセ			3. 5		3	4, 632
オービックビジネスコンサル	タント		6. 6		5. 7	38, 532
伊藤忠テクノソリューション	ズ		29. 5		25. 3	108, 031
アイティフォー			16. 9		13.5	12, 069
東計電算			2. 3		2	6, 160
エックスネット			1. 2		1. 7	1, 492
大塚商会			35		33. 4	346, 358
サイボウズ			17. 3		14. 9	8, 165
ソフトブレーン			17. 7		8. 7	3, 810
電通国際情報サービス			8		6. 9	19, 037
デジタルガレージ			18. 9		20	68, 100

		期首(前	前期末)	当	其	月 末
銘 柞	丙	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
EMシステムズ			4. 4		7. 7	10, 202
ウェザーニューズ			4. 4		3. 8	12, 388
СІЈ			10. 9		8. 7	5, 898
東洋ビジネスエンジニアリング	ブ		1. 3		1. 1	1,974
日本エンタープライズ			13. 3		11. 4	2, 485
WOWOW			6. 2		5. 3	17,675
スカラ			9		8. 9	6, 995
日本コロムビア			3. 9		_	_
イマジカ・ロボット ホールデ	ィングス		10.9		9. 4	10, 161
ネットワンシステムズ			56. 3		45. 4	69, 870
システムソフト			23		26. 3	3, 708
アルゴグラフィックス			5. 9		5. 1	16, 218
マーベラス			21.9		18.9	17, 463
エイベックス			23. 9		20.6	31, 476
日本ユニシス			35. 9		30. 9	68, 258
兼松エレクトロニクス			8. 2		7. 1	21, 229
東京放送ホールディングス			85.8		67	146, 060
日本テレビホールディングス			118.8	1	102.1	188, 476
朝日放送			12.8		11	9, 856
テレビ朝日ホールディングス			35. 5		30.6	67, 442
スカパーJSATホールディン	/グス		84. 6		84. 9	40,072
テレビ東京ホールディングス			10.6		9. 1	25, 234
日本BS放送			2. 9		3. 8	4, 746
ビジョン			1.5		2. 9	9, 512
USEN-NEXT HOLD	INGS		3. 4		2. 9	2, 351
ワイヤレスゲート			4. 5		5. 2	7, 196
コネクシオ			11.4		7. 9	17, 277
日本通信			108.8	i	100.3	11, 233
クロップス			2.8		2. 4	2, 205
日本電信電話		1,	044.6	7	798. 4	3, 898, 587
KDDI		1,	287. 4	1, (001.7	2, 680, 048
光通信			15. 6		13. 4	218, 554
NTTドコモ			972.4	8	323. 5	2, 210, 274
エムティーアイ			19. 9		15	9, 285
GMOインターネット			47. 5		40. 5	90, 679
アイドママーケティングコミュニク	「ーション		-		1.8	1, 269
カドカワ			37. 7		32. 4	34, 894
学研ホールディングス			43		3. 7	17,001
ゼンリン			17. 2		13.4	43, 550

銘	柄	期首(前期末)	当	期 末
拓	11/1	株 数	株 数	評価額
		千株	千株	千円
昭文社		7. 1	5. 1	4, 141
インプレスホールディング	ス	10.7	9. 2	2, 106
アイネット		7. 3	6. 3	9, 557
松竹		86	7. 4	104, 932
東宝		85. 1	73. 2	247, 416
東映		48	4. 2	45, 738
エヌ・ティ・ティ・データ		80. 4	345.6	370, 483
ピー・シー・エー		1. 9	1.6	2, 812
ビジネスブレイン太田昭和	I	2. 2	1. 9	3, 858
DTS		13. 4	11.5	41,630
スクウェア・エニックス・ホー	・ルディングス	50. 1	51.7	245, 316
シーイーシー		7. 7	6. 6	22, 077
カプコン		30. 5	23. 8	117, 810
アイ・エス・ビー		2. 5	2. 2	3, 751
ジャステック		8. 2	6. 4	8, 179
SCSK		35. 4	25. 7	112, 052
日本システムウエア		4. 3	3. 7	10, 345
アイネス		16. 4	14. 1	15, 369
TKC		12	10.3	43, 157
富士ソフト		19. 3	15. 4	61, 138
NSD		27. 6	18. 3	38, 521
コナミホールディングス		58. 7	45. 5	237, 965
福井コンピュータホールデ	イングス	3. 8	3. 2	7, 328
JBCCホールディングス		10.9	8.8	9, 160
ミロク情報サービス		9. 6	9. 8	28, 390
ソフトバンクグループ		585. 8	503.6	4, 069, 088
卸売業 (4.7%)				
ホウスイ		10	0. 9	1, 064
高千穂交易		5	4. 3	5, 138
伊藤忠食品		3. 2	2. 8	16, 380
エレマテック		5. 2	5. 2	13, 156
JALUX		4. 2	3. 1	9, 734
あらた		5. 8	5. 5	30, 910
トーメンデバイス		1. 9	1. 7	4, 785
東京エレクトロン デバイ	ス	4. 7	4	7, 744
フィールズ		9. 9	8. 5	9, 919
双目		768. 5	660.8	216, 742
アルフレッサ ホールディ	ングス	153. 9	124. 1	276, 991
横浜冷凍		32. 2	27.8	27, 772

A4-	17	期首(前期末)		当	其	期 末	
銘	柄	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	千円	
神栄			18		1.5	2, 143	
山下医科器械			1		-	_	
ラサ商事			5. 6		4. 9	4, 473	
ラクーン			6. 2		6. 5	3, 809	
アルコニックス			7. 4		11.8	24, 178	
神戸物産			7		7. 2	33, 480	
ペッパーフードサービス			-		6	27, 990	
あい ホールディングス			18.5		17. 9	50, 137	
ディーブイエックス			4.6		4	4, 908	
ダイワボウホールディンク	゚ス		110		9. 5	40, 897	
マクニカ・富士エレホール	ディングス		24. 1		20. 9	38, 435	
ラクト・ジャパン			_		1.5	5, 475	
バイタルケーエスケー・ホー	ルディングス		24. 4		21	21,609	
八洲電機			10		8. 6	7, 198	
メディアスホールディンク	゚ス		-		2. 1	6, 018	
UKCホールディングス			8. 4		7. 2	15, 400	
ジューテックホールディン	グス		-		2. 5	3, 090	
大光			_		2. 8	2, 366	
OCHIホールディングス			3.8		3. 2	4, 633	
TOKAIホールディンク	゚ス		57. 2		59	60, 947	
大阪工機			1.5		1.7	1,703	
三洋貿易			7. 1		6. 1	11, 956	
ビューティガレージ			1.3		1.5	4, 194	
ウイン・パートナーズ			9.4		8. 1	12, 417	
ミタチ産業			3		2. 6	3, 367	
シップヘルスケアホールテ	ディングス		25		23. 3	86, 210	
明治電機工業			4. 4		3. 8	6, 684	
デリカフーズホールディン	グス		2. 7		2. 2	3, 403	
スターティア			2. 9		2. 5	2, 362	
コメダホールディングス			17.6		20.6	39, 902	
富士興産			4. 7		4. 3	2, 644	
協栄産業			16		1. 3	2,606	
小野建			11.3		9. 7	17, 857	
佐鳥電機			9.6		8. 2	8, 733	
エコートレーディング			3		2. 5	1, 765	
伯東			8. 9		6.8	10, 329	
コンドーテック			10.3		8. 9	8, 339	
中山福			7. 4		6. 4	4, 921	
ナガイレーベン			18.8		14.8	42,609	

銘	柄	期首(前期末)	当	其	東 末
341	1111	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
三菱食品			14. 3		12. 3	36, 125
松田産業			9. 5		8. 1	14, 887
第一興商			21. 2		16.6	91, 134
メディパルホールディング	ゲス		130.1	1	11.9	233, 759
SPK			2.8		2. 4	6, 852
萩原電気			4. 4		3. 9	12, 168
アズワン			10.2		8. 7	58, 116
スズデン			4. 7		3. 9	6, 622
尾家産業			4. 2		3. 3	4, 346
シモジマ			7. 9		6.8	7, 697
ドウシシャ			15. 3		11.8	27, 482
小津産業			2.8		2. 4	5, 340
高速			7. 7		6.6	8, 144
たけびし			4. 5		3. 9	6, 793
黒田電気			17.8		_	_
リックス			2. 9		2. 5	4, 897
丸文			11.5		9. 9	9, 454
ハピネット			10.8		7. 6	11, 628
橋本総業ホールディングス	z		2. 7		2. 3	3, 903
日本ライフライン			11. 1		31.8	94, 732
エクセル			5. 6		4. 5	12, 132
マルカキカイ			4. 2		3. 6	6, 721
IDOM			35		33. 9	23, 391
日本エム・ディ・エム			9.8		7. 5	6, 975
進和			7. 7		6. 6	13, 741
エスケイジャパン			2. 4		2. 7	1, 949
ダイトロン			5. 9		5. 1	9, 975
シークス			9. 3		7. 1	31, 950
田中商事			4		3. 4	2, 298
オーハシテクニカ			7. 3		6. 3	10, 773
白銅			3. 3		4	8, 848
伊藤忠商事			953. 1	8	319. 4	1, 629, 376
丸紅		1	, 280. 7		917. 6	688, 200
高島			22		1. 9	4, 195
長瀬産業			78. 2		67. 3	118, 313
蝶理			8. 3		7. 1	13, 660
豊田通商			144. 9	1	24. 6	432, 362
三共生興			19. 7	ľ	19	9, 557
兼松			277		47. 6	63, 688

	期首(前期末)	当 其	期 末
銘 柄	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ツカモトコーポレーション	23	2	2, 588
三井物産	1, 176. 8	948.5	1, 697, 815
日本紙パルプ商事	68	5. 8	24, 969
日立ハイテクノロジーズ	45. 1	38. 8	187, 986
カメイ	16. 9	14. 6	20, 805
東都水産	2	1. 7	3, 321
OUGホールディングス	20	1.8	4,678
スターゼン	5. 4	4. 4	23, 144
山善	49. 9	43.6	45, 823
椿本興業	15	2. 5	8, 737
住友商事	819. 2	704.3	1, 219, 143
内田洋行	6. 4	5. 1	14, 106
三菱商事	976. 4	783.6	2, 201, 132
第一実業	30	5. 1	15, 402
キヤノンマーケティングジャパン	37. 1	31. 9	88, 394
西華産業	42	6. 9	17, 450
佐藤商事	11.6	10	11, 380
菱洋エレクトロ	12. 4	10. 4	17, 638
東京産業	12.9	11. 1	6, 382
ユアサ商事	12.3	10.6	36, 252
神鋼商事	3. 3	2. 5	8, 987
小林産業	9. 5	7. 4	2, 604
阪和興業	130	20. 9	89, 870
正栄食品工業	_	6. 1	22, 875
カナデン	12.4	10.7	15, 525
菱電商事	21	8	14, 128
フルサト工業	7. 2	6. 2	10, 992
岩谷産業	144	24. 8	96, 348
すてきナイスグループ	55	4.8	6, 648
昭光通商	46	40	4, 280
ニチモウ	19	1. 7	3, 005
極東貿易	20	16	7, 264
イワキ	20	15. 7	6, 264
三愛石油	34. 9	30	45, 570
稲畑産業	31. 2	26. 8	40, 736
GSIクレオス	32	3	4, 641
明和産業	12	10. 3	4, 964
ワキタ	27. 7	23.8	28, 417
東邦ホールディングス	41. 7	33. 1	80, 333

144	4cm	期首(前	前期末)	計 当 期 末		
銘	柄	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
サンゲツ			44.6		37. 2	78, 789
ミツウロコグループホ	ールディングス		20.9		16. 2	12, 652
シナネンホールディン	グス		5. 6		4.6	12, 015
伊藤忠エネクス			28. 7		24.7	24, 033
サンリオ			40.1		31.3	58, 781
サンワテクノス			7. 7		6.6	12, 058
リョーサン			19.3		14	52, 500
新光商事			14. 2		12. 2	21, 594
トーホー			5. 9		5	10, 945
三信電気			14. 4		10.3	21, 094
東陽テクニカ			16		12. 9	12, 190
モスフードサービス			17		14.6	45, 990
加賀電子			11.8		10.1	25, 977
ソーダニッカ			13. 4		11.5	8, 590
立花エレテック			8.8		7. 6	15, 868
フォーバル			5. 7		4. 9	4, 297
PALTAC			20.8		15.7	81, 640
三谷産業			13.8		12. 1	5, 287
太平洋興発			54		4. 7	4, 789
西本Wismettac	ホールディングス		-		2. 3	10, 522
ヤマシタヘルスケアホ	ールディングス		_		0.9	1, 313
ヤマタネ			6.5		5.6	10, 421
丸紅建材リース			13		11	2, 541
日鉄住金物産			11.4		8. 7	48, 633
泉州電業			-		3. 7	11, 285
トラスコ中山			29.7		23. 2	57, 837
オートバックスセブン			48. 2		44. 4	86, 668
モリト			10.4		8. 9	8, 722
加藤産業			20.3		17.5	62, 387
イノテック			11.2		9.6	12, 096
イエローハット			12.3		10.5	31, 972
J Kホールディングス			13		11.2	9, 923
日伝			5. 4		9. 3	19, 371
北沢産業			10.7		9. 2	2, 888
杉本商事			7. 5		6	10, 890
因幡電機産業			18.3		14.7	68, 722
バイテックホールディ	ングス		5. 3		5. 1	10, 266
東テク			_		3. 7	8, 965
ミスミグループ本社			146. 3		129.7	357, 323

銘 柄	期首(前期末)	当其	朝 末		
平 白 179	株 数	株 数	評価額		
	千株	千株	千円		
アルテック	11. 1	9. 5	3, 657		
タキヒヨー	20	3. 7	8, 417		
蔵王産業	2. 1	1.8	3, 124		
スズケン	59. 2	50. 9	215, 561		
ジェコス	8. 9	7. 7	8, 354		
ルネサスイーストン	11.9	10. 2	6, 976		
小売業 (4.9%)					
ローソン	41.1	28. 2	197, 682		
サンエー	9.8	8. 4	49, 896		
カワチ薬品	10.1	8. 7	21, 915		
エービーシー・マート	23. 7	20. 3	137, 837		
ハードオフコーポレーション	5. 7	4. 9	5, 429		
アスクル	13.6	9. 7	33, 513		
ゲオホールディングス	21. 7	20. 4	34, 761		
アダストリア	20	17. 2	36, 876		
ジーフット	7.8	6. 7	4, 964		
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1. 7	1. 4	994		
くらコーポレーション	8. 5	6. 6	46, 530		
キャンドゥ	6. 9	5. 3	9, 121		
パルグループホールディングス	6. 6	5. 7	16, 125		
エディオン	50. 4	43. 4	52, 123		
サーラコーポレーション	16. 2	19. 2	11, 980		
ワッツ	5. 6	4. 4	4, 589		
ハローズ	4. 3	4. 2	10, 193		
あみやき亭	2. 5	2. 4	14, 016		
ひらまつ	17. 9	15. 4	7, 561		
ゲンキー	2. 6	_	_		
大黒天物産	3. 1	2. 7	14, 256		
ハニーズホールディングス	12. 6	10.8	10, 789		
ファーマライズホールディングス	3	2. 5	1,550		
アルペン	9. 9	8.6	19, 590		
ハブ	-	2. 1	2, 133		
クオール	14. 7	12. 3	24, 575		
ジンズ	8. 8	7. 6	42, 484		
ビックカメラ	74. 7	65.8	105, 016		
D C Mホールディングス	79	60. 2	62, 728		
MonotaRO	46. 1	39. 7	145, 897		
東京一番フーズ	3. 2	2.8	1, 960		
DDホールディングス	2. 9	2. 5	8, 300		

銘 柄	期首(前期末)	当 其	用 末
蹈 প	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
きちり	3. 5	3	2, 100
アークランドサービスホールディングス	4. 1	9. 3	21, 185
J. フロント リテイリング	164.6	133. 3	230, 742
ドトール・日レスホールディングス	22.8	19. 6	48, 608
マツモトキヨシホールディングス	24.6	46. 2	194, 964
ブロンコビリー	6.8	5. 8	19, 459
スタートトゥデイ	118.8	109.7	291, 363
トレジャー・ファクトリー	3. 7	3. 2	2, 416
物語コーポレーション	3. 7	3. 2	32, 320
ココカラファイン	13. 6	11. 7	81, 315
三越伊勢丹ホールディングス	258. 9	208.8	236, 779
Hamee	2. 9	2. 8	4, 841
ウエルシアホールディングス	25. 7	29. 5	131, 275
クリエイトSDホールディングス	19. 1	16. 5	42, 355
丸善CHIホールディングス	15. 2	13	4, 472
ミサワ	2. 3	2	848
ティーライフ	1. 2	1. 5	1, 737
エー・ピーカンパニー	2. 1	2. 1	1, 734
チムニー	4	3. 4	10, 111
シュッピン	4. 9	6. 7	7, 919
ネクステージ	2. 5	11.8	13, 794
ジョイフル本田	21. 1	16. 4	60, 270
鳥貴族	3. 2	4. 1	11, 976
キリン堂ホールディングス	4. 2	4	6, 460
ホットランド	6	6. 5	7, 962
すかいらーく	55. 8	69. 3	103, 395
綿半ホールディングス	5. 2	4. 2	16, 359
ヨシックス	1. 3	1.8	6, 282
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	43. 1	37. 1	40, 439
ブックオフコーポレーション	7. 4	6. 4	5, 484
ゴルフダイジェスト・オンライン	5. 2	4. 5	4, 167
BEENOS	1. 5	1.7	2, 703
あさひ	9. 7	8. 3	10, 482
日本調剤	4. 6	3. 9	12, 928
コスモス薬品	6. 6	5. 6	116, 984
トーエル	6. 3	5. 4	5, 421
一六堂	2. 7	2. 4	1,003
オンリー	1. 5	1. 7	1, 562
セブン&アイ・ホールディングス	544. 6	468	2, 046, 564

銘	柄		前期末)	当	其	期 末	
珀	TYY	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	手円	
薬王堂			6. 5		4. 9	18, 865	
クリエイト・レストランツ	・ホールディング		34. 9		30	35, 910	
ツルハホールディングス			26		24. 2	355, 014	
サンマルクホールディン	グス		8. 4		8	24, 920	
フェリシモ			3. 7		2.8	3, 768	
トリドールホールディン	グ ス		16		13.8	53, 199	
TOKYO BASE			_		7. 4	10, 034	
サツドラホールディンク	゚ス		1.7		1.8	3, 625	
ダイユー・リックホール	ディングス		4. 2		5. 2	5, 538	
バロックジャパンリミテ	・ッド		7. 6		8. 9	9, 300	
クスリのアオキホールテ	^デ ィングス		10. 3		8. 9	65, 237	
スシローグローバルホー	-ルディングス		_		10.7	55, 426	
LIXILビバ			_		10.6	21, 889	
メディカルシステムネッ	トワーク		14. 7		12.7	6, 832	
総合メディカル			6. 3		4. 9	28, 07	
はるやまホールディンク	゚ス		6. 1		5. 2	5, 636	
ノジマ			15. 1		19.6	48, 020	
カッパ・クリエイト			18. 2		13. 9	18, 18	
ライトオン			9. 7		9. 4	8, 572	
ジーンズメイト			4. 1		3. 4	2, 658	
良品計画			17. 2		14. 8	530, 580	
三城ホールディングス			16. 1		13. 8	6, 91	
アドヴァン			13. 2		11.4	11, 26	
アルビス			3. 4		2. 7	8, 626	
コナカ			16.6		14. 3	8, 36	
ハウス オブ ローゼ			1.6		1.4	2, 57	
G-7ホールディングス			3. 8		3. 3	7, 751	
イオン北海道			13		11. 2	8, 489	
コジマ			19. 1		19. 2	6, 259	
ヒマラヤ			4		3	3, 597	
コーナン商事			18. 5		15. 9	39, 002	
エコス			5		4. 5	5, 386	
ワタミ			15. 4		13. 2	18, 387	
マルシェ			2. 9		2. 9	2, 360	
ドンキホーテホールディ	ングス		84. 2		72. 4	419, 920	
西松屋チェーン			22. 8		24. 5	28, 371	
ゼンショーホールディン	グ ス		67. 4		57. 9	140, 060	
幸楽苑ホールディングス			8. 2		7. 1	13, 73	
ハーカフレイ			2 9		9.7	2 803	

744	4x2	期首(前	期末)	当	其	東 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
サイゼリヤ			21. 4		16.6	49, 484
VTホールディングス			44		37.8	20, 601
魚力			4		3. 1	4, 315
ポプラ			3. 2		2. 9	2, 517
フジ・コーポレーション	/		1.9		1. 9	5, 021
ユナイテッドアローズ			17. 3		13.8	54, 717
ハイデイ日高			14. 2		14.6	37, 945
京都きもの友禅			8. 2		7. 1	5, 396
コロワイド			43. 1		37. 1	91, 117
ピーシーデポコーポレー	ーション		17. 2		16.7	11, 573
壱番屋			9. 1		7. 9	32, 706
トップカルチャー			4. 7		4	1, 916
PLANT			2. 9		2. 6	3, 400
スギホールディングス			28. 5		24. 5	141,610
ヴィア・ホールディング	ブス		9. 9		9. 9	7, 405
スクロール			19. 7		17. 2	6, 983
ヨンドシーホールディン	/ グス		9. 9		11. 4	30, 141
ユニー・ファミリーマート	ホールディングス		57. 1		35. 7	297, 381
木曽路			15. 9		13. 7	37, 442
SRSホールディングス	ζ		15. 3		13. 2	12, 922
千趣会			23. 5		20. 2	10, 706
タカキュー			10		8.6	1, 754
ケーヨー			21.9		20.6	10, 938
上新電機			31		13. 2	49, 368
日本瓦斯			23. 9		20. 5	93, 172
ベスト電器			41.9		_	_
ロイヤルホールディング	ブス		21.4		19.8	54, 054
東天紅			11		0.8	1, 418
いなげや			14. 5		12. 4	22, 121
島忠			33. 7		27	89, 505
チョダ			15. 3		13. 2	33, 910
ライフコーポレーション	/		9.8		8. 5	24, 157
リンガーハット			14. 6		13.8	32, 788
さが美グループホールラ	ディングス		12		10	1, 170
МгМахНД			16. 2		13. 9	9, 035
テンアライド			12		10.3	4, 954
AOK I ホールディング	ブス		26		22. 3	35, 613
オークワ			19		16	17, 024
コメリ			20		17. 2	48, 332

銘	柄	期首(前	前期末)	当	其	東 末	
跖	11/1	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	千円	
青山商事			27. 2		21.4	89, 559	
しまむら			15. 1		13	171, 340	
はせがわ			6. 9		5. 9	2, 790	
髙島屋			218		175	170, 450	
松屋			28. 4		22. 5	30, 75	
エイチ・ツー・オー	リテイリング		66.6		52. 9	98, 817	
近鉄百貨店			50		4. 3	15, 50	
丸栄			27		_	_	
パルコ			12. 5		10.7	14, 24	
丸井グループ			136. 9	:	106. 9	211, 448	
アクシアル リテイリ	ング		10. 1		9. 3	37, 060	
井筒屋			7		6. 1	2, 28	
イオン			535.4	4	429. 7	778, 40	
イズミ			25.8		20. 2	134, 936	
東武ストア			1.6		1.3	3, 858	
平和堂			26. 4		22.7	55, 61	
フジ			14. 5		13. 3	28, 465	
ヤオコー			14. 7		12.7	71, 75	
ゼビオホールディンク	゚゙ス		17. 7		15. 2	31, 20	
ケーズホールディンク	゚ス		60		47. 3	138, 68	
Olympicグルー	-プ		7. 6		6. 6	3, 59	
日産東京販売ホールテ	ディングス		19. 1		16. 4	7, 13	
Genky Drug	Stores		_		4. 4	15, 84	
アインホールディンク	゚゙ス		17		15	116, 70	
元気寿司			3. 3		2. 8	7, 74	
ヤマダ電機			435. 2	:	374. 2	243, 60	
アークランドサカモト			22		18.9	32, 26	
ニトリホールディンク	゚゙ス		56. 2		44. 3	797, 178	
グルメ杵屋			9		8	9, 23	
愛眼			9. 5		8. 9	4, 06	
ケーユーホールディン	グス		6.8		5. 8	6, 008	
吉野家ホールディンク	゚゙ス		45. 3		36. 7	75, 602	
松屋フーズ			6. 2		5. 4	21,000	
サガミチェーン			16. 3		14. 9	20, 368	
関西スーパーマーケッ	, F		10.6		8. 4	9, 198	
王将フードサービス			9. 5		8. 2	42, 476	
プレナス			14. 5		12. 5	25, 087	
ミニストップ			9. 6		8. 3	17, 446	
アークス			24. 4		20. 9	51, 790	

銘	柄	期首(前期末)	当 非	東 末
鄞	11/3	株 数	株 数	評価額
		千株	千株	千円
バローホールディングス		28	26	72, 540
藤久		1	0. 9	1, 307
ベルク		5. 8	5	29, 400
大庄		6. 9	6	9, 720
ファーストリテイリング		21. 7	18. 7	751, 179
サンドラッグ		24. 7	47.3	225, 384
サックスバー ホールディ	ングス	12. 2	10. 5	11, 539
ヤマザワ		2. 7	2. 3	4, 025
やまや		2. 7	2. 3	7, 072
ベルーナ		32. 4	27. 4	33, 154
銀行業 (7.2%)				
島根銀行		2. 7	2. 4	3, 300
じもとホールディングス		93. 4	75. 5	14, 118
めぶきフィナンシャルグハ	ノープ	627. 5	581	234, 724
東京TYフィナンシャルク	ブループ	18. 8	15. 1	36, 889
九州フィナンシャルグルー	-プ	213. 4	183. 5	95, 787
ゆうちょ銀行		368. 5	316.8	454, 608
富山第一銀行		33. 1	28. 4	13, 944
コンコルディア・フィナンシ	ャルグループ	851.9	679.8	388, 845
西日本フィナンシャルホー	レディングス	88. 2	75. 9	93, 584
新生銀行		1, 239	96.8	153, 815
あおぞら銀行		823	66. 6	281, 385
三菱UFJフィナンシャル	・グループ	9, 861	7, 828. 1	5, 384, 949
りそなホールディングス		1, 522. 4	1, 227. 1	692, 697
三井住友トラスト・ホール	ディングス	271.7	219.8	932, 391
三井住友フィナンシャルク	ブループ	1,042	846.4	3, 759, 708
第四銀行		159	13. 7	62, 746
北越銀行		14. 1	11.2	25, 603
千葉銀行		502	401	334, 434
群馬銀行		289. 2	227. 1	136, 487
武蔵野銀行		20.8	17.8	58, 651
千葉興業銀行		35. 7	30.7	13, 784
筑波銀行		54. 1	46. 5	15, 856
七十七銀行		204	35. 1	86, 626
青森銀行		101	8. 7	28, 623
秋田銀行		83	7. 2	19, 972
山形銀行		73	12. 6	29, 043
岩手銀行		8. 5	7.8	32, 136
東邦銀行		116	100	39, 600

銘	丙	期首(前期末)	当	其	期 末	
)指 1	ניר	株	数	株	数	評(価 額
			千株		千株		千円
東北銀行			66		5. 7		8, 116
みちのく銀行			78		7. 2		12, 58
ふくおかフィナンシャルグルー	ープ		528		454	2	46, 976
静岡銀行			354		295	2	89, 10
十六銀行			175		15		41, 16
スルガ銀行			133		114. 4	1	74, 00
八十二銀行			251.1		202.4	1	14, 76
山梨中央銀行			81		69		28, 98
大垣共立銀行			201		17.7		47, 17
福井銀行			111		9.6		21, 79
北國銀行			138		12.7		50, 99
清水銀行			4. 4		3. 8		10, 66
富山銀行			2. 5		2. 2		8, 28
滋賀銀行			122		105		56, 28
南都銀行			12.6		13. 1		37, 17
百五銀行			117		107.3		52, 46
京都銀行			233		42.7	2	40, 82
紀陽銀行			48.9		42. 1		69, 59
三重銀行			5.8		5		11, 64
ほくほくフィナンシャルグルー	ープ		86.6		74. 4	1	07, 88
広島銀行			384		165. 1	1	28, 94
山陰合同銀行			78. 2		66. 3		61, 39
中国銀行			92. 2		77. 3		94, 22
鳥取銀行			4. 1		3. 6		6, 19
伊予銀行			139. 2		159. 5	1	24, 88
百十四銀行			143		119		41, 76
四国銀行			100		17. 1		25, 18
阿波銀行			111		90		59, 58
大分銀行			75		6. 4		25, 08
宮崎銀行			87		7. 4		24, 05
佐賀銀行			79		6.8		15, 80
十八銀行			80		69		17, 94
沖縄銀行			12. 7		10. 9		48, 50
琉球銀行			26.8		21.7		34, 52
セブン銀行			487.8		419. 4	1	40, 49
みずほフィナンシャルグループ	プ	17,	667. 9	15,	192. 4		01, 74
高知銀行			47		4. 1		5, 24
山口フィナンシャルグループ			122		105	1	34, 19
長野銀行			4. 3		3. 7		6, 77

lata .	66	期首(前期末)	当	期 末
銘	柄	株 数	株 数	評価額
		千株	千株	千円
名古屋銀行		10.9	9	35, 010
北洋銀行		212. 4	168.6	57, 661
愛知銀行		4. 4	3. 8	19, 836
第三銀行		7. 4	6. 3	10, 395
中京銀行		5. 3	4. 6	10, 718
大光銀行		45	3. 8	8, 565
愛媛銀行		15. 5	15. 6	19, 281
トマト銀行		5	4. 3	6, 548
みなと銀行		11.8	10. 1	21, 149
京葉銀行		106	99	45, 738
関西アーバン銀行		18. 1	15. 6	22, 464
栃木銀行		71.8	57. 9	22, 696
北日本銀行		4. 1	3. 5	10, 416
東和銀行		244	19. 6	27, 518
福島銀行		141	10.5	7, 812
大東銀行		68	5. 4	6, 631
トモニホールディングス		107. 2	92. 2	41, 951
フィデアホールディング	ス	126. 3	108.6	20, 634
池田泉州ホールディング	ス	138. 1	118.7	47, 836
証券、商品先物取引業(1.0%)			
FPG		46. 4	39	50, 934
マーキュリアインベスト	メント	_	2. 3	2, 465
SBIホールディングス		147. 1	126. 5	325, 105
日本アジア投資		12. 4	10. 1	3, 434
ジャフコ		21.7	16	76, 800
大和証券グループ本社		1, 218	957	643, 295
野村ホールディングス		2, 660. 4	1, 923. 7	1, 160, 952
岡三証券グループ		111	95	61, 560
丸三証券		41.4	35. 6	37, 914
東洋証券		46	40	11, 640
東海東京フィナンシャル・ホ	ールディングス	149. 3	123. 8	90, 745
光世証券		31	2. 7	3, 537
水戸証券		40. 3	34.6	14, 462
いちよし証券		29. 1	23. 5	29, 328
松井証券		74. 3	54.8	52, 060
だいこう証券ビジネス		6. 3	5. 4	3, 537
マネックスグループ		139. 6	118.5	38, 986
カブドットコム証券		97. 9	70. 5	26, 155
極東証券		17. 4	15	23, 400

		期首(i	前期末)	当	其	期末		
銘	柄	株	数	株	数	評価額		
			千株		千株	千円		
岩井コスモホールディン	グス		12. 3		11.4	16, 222		
藍澤證券			24. 3		20.9	15, 152		
マネーパートナーズグル・	ープ		16.6		14. 3	5, 634		
小林洋行			3. 7		3. 2	956		
保険業 (2.2%)								
かんぽ生命保険			49. 1		42. 2	105, 753		
SOMPOホールディン	グス		272. 1		219.3	900, 445		
アニコム ホールディン	グス		8.8		7.6	28, 766		
MS&ADインシュアランス	グループホール		388.9		292.4	941,820		
ソニーフィナンシャルホー	ルディングス		124.7		91.9	172, 863		
第一生命ホールディング	ス		784.7		632. 5	1, 215, 348		
東京海上ホールディング	ス		527. 2		421.3	2, 013, 814		
アドバンテッジリスクマ	ネジメント		_		2. 7	3, 491		
T&Dホールディングス			474.3		345.8	571, 261		
アドバンスクリエイト			3		2. 6	5, 106		
その他金融業 (1.2%)								
全国保証			36. 6		31.5	143, 640		
イントラスト			_		1.8	1, 359		
アルヒ			_		9.5	13, 794		
クレディセゾン			98. 7		84. 9	145, 518		
アクリーティブ			10.7		6. 1	1,970		
芙蓉総合リース			14. 9		12.8	88, 448		
興銀リース			24. 4		21	62, 748		
東京センチュリー			26. 2		22. 5	142, 650		
日本証券金融			57. 3		45.8	29, 586		
アイフル			218.2		187.6	63, 596		
ポケットカード			9. 7		-	_		
リコーリース			10.2		8.8	31, 372		
イオンフィナンシャルサ	ービス		83. 1		79.4	183, 652		
アコム			264. 4		224. 7	105, 159		
ジャックス			72		13.6	31, 307		
オリエントコーポレーシ	ョン		281.4		241.9	40,881		
日立キャピタル			30.7		30.8	80, 203		
アプラスフィナンシャル			62. 4		53.6	5, 788		
オリックス			921.5		745. 9	1, 367, 980		
三菱UFJリース			330. 1		283.8	172, 266		
九州リースサービス			_		4.8	3, 945		
日本取引所グループ			404.6		328. 5	623, 493		
イー・ギャランティ			3.8		5. 9	11,617		

銘	柄	期首(前期末)	弄	á 其	東
跖	怬	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
アサックス			2. 3		1. 5	2, 755
NECキャピタルソリ	ューション		5. 3		4. 5	9, 481
不動産業 (2.3%)						
いちご			123.7		159.8	70, 951
日本駐車場開発			156.9		134.9	22, 528
ヒューリック			271.4		233.4	255, 806
三栄建築設計			5. 2		4. 5	9, 958
スター・マイカ			_		4. 1	8, 331
野村不動産ホールディ	ングス		86.4		74. 4	184, 140
三重交通グループホー	ルディングス		23. 1		22.7	11,622
サムティ			10.4		9. 5	16, 558
ディア・ライフ			8. 9		11.2	5, 600
コーセーアールイー			_		1. 9	1,666
エー・ディー・ワーク	ス		119.3		148. 2	5, 928
日本商業開発			7. 2		6. 3	10, 999
プレサンスコーポレー	ション		20. 2		15. 3	23, 347
ユニゾホールディング	ス		10.7		13. 1	32, 881
THEグローバル社			4. 5		5. 2	4, 232
日本管理センター			9. 3		7. 4	10, 989
サンセイランディック			2. 7		3. 2	3, 840
エストラスト			2. 3		1. 5	1, 345
フージャースホールデ	ィングス		16.8		27. 2	19, 937
オープンハウス			18.8		18. 2	116, 662
東急不動産ホールディ	ングス		314.8		270.7	201, 130
飯田グループホールデ	ィングス		108.5		93. 3	183, 801
イーグランド			_		1. 3	1, 517
ムゲンエステート			4. 5		6. 9	8, 928
ファーストブラザーズ			1. 3		3. 1	4, 476
ハウスドゥ			1.6		1.8	5, 526
シーアールイー			1.8		1.8	3, 211
ケイアイスター不動産			2. 6		4	10, 260
エコナックホールディ	ングス		49		_	-
パーク24			66		62	176, 204
パラカ			3. 7		3. 6	8, 060
三井不動産			690		558.3	1, 363, 368
三菱地所			968		832.3	1, 431, 556
平和不動産			24. 6		19.7	39, 124
東京建物			151		122. 2	188, 065
ダイビル			33. 5		28.8	35, 136

D/r	4at	期首(前期末)	当	其	東 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
京阪神ビルディング			21.6		18.5	16, 372
住友不動産			312		268	1, 015, 988
大京			242		17.8	37, 718
テーオーシー			50.4		38. 5	32, 532
東京楽天地			21		1.8	8, 685
レオパレス21			164.2	1	33. 4	109, 121
スターツコーポレーショ	ン		13. 3		15. 2	41, 389
フジ住宅			16.6		14. 3	12, 555
空港施設			15. 7		11.6	7,029
明和地所			7. 1		6. 1	4, 880
住友不動産販売			11.7		-	_
ゴールドクレスト			11.7		8.8	19, 201
日本エスリード			5. 1		4. 4	9, 653
日神不動産			15. 4		14. 9	11, 279
日本エスコン			17. 3		20	18, 560
タカラレーベン			56. 7		52. 4	23, 632
サンヨーハウジング名古	屋		6. 7		5. 8	7, 035
イオンモール			83.8		72	153, 792
ファースト住建			4.8		4. 2	6, 615
ランド			123.4	2	245.8	3, 687
カチタス			_		11.4	34, 428
トーセイ			17.8		13.6	16, 904
穴吹興産			1.4		1. 2	3, 490
エヌ・ティ・ティ都市開	発		80.8		69. 5	86, 805
サンフロンティア不動産			14		13. 5	15, 552
エフ・ジェー・ネクスト			11. 3		8. 5	6, 919
インテリックス			3		3. 1	3, 186
ランドビジネス			7. 7		6.6	2, 105
グランディハウス			11.4		9.8	4, 478
日本空港ビルデング			41.5		32. 7	125, 895
サービス業 (4.4%)						
日本工営			9. 2		7. 3	22,009
LIFULL			34		37. 6	33, 539
ジェイエイシーリクルー	トメント		8. 5		8. 7	19,087
日本M&Aセンター			39. 7		37. 5	264,000
メンバーズ			_		2. 7	2, 821
中広			1. 3		1. 1	795
タケエイ			12. 1		11. 2	13, 350
トラスト・テック			5. 6		4. 9	15, 459

銘	柄	期首(前	前期末)	当	其	期 末		
भ	מיוו	株	数	株	数	評価額		
			千株		千株	千円		
コシダカホールディングス			4. 7		5. 7	40, 128		
パソナグループ			10.2		10.3	22, 938		
CDS			3. 1		2. 9	3, 781		
リンクアンドモチベーショ	ン		32. 4		19.9	23, 084		
GCA			12. 2		12.3	10, 811		
エス・エム・エス			19.5		21.4	90, 094		
パーソルホールディングス			106.6		100	298, 900		
リニカル			8. 1		7	11, 823		
クックパッド			30.7		34	19, 176		
エスクリ			4. 9		3.8	3, 275		
アイ・ケイ・ケイ			6. 1		6. 3	4, 863		
学情			5. 7		4. 9	7, 232		
スタジオアリス			5. 6		5. 4	13, 591		
シミックホールディングス			7		6	16, 248		
NJS			3. 1		2. 7	4, 220		
綜合警備保障			50.1		43. 1	209, 466		
カカクコム			98. 2		81.5	148, 167		
アイロムグループ			4. 2		3. 7	11, 229		
セントケア・ホールディン	グ		1.8		4.6	3, 376		
サイネックス			1		1.6	1, 368		
ルネサンス			7		5. 3	9, 518		
ディップ			17.8		15.3	47, 277		
オプトホールディング			9. 9		7. 5	11, 617		
新日本科学			15. 3		13. 2	7, 484		
ツクイ			32.6		25.5	20, 145		
キャリアデザインセンター			2. 9		2. 5	5, 012		
エムスリー			119.3		114	512, 430		
ツカダ・グローバルホール	ディング		10		8.6	5, 254		
ブラス			_		0.6	562		
アウトソーシング			8. 1		32. 3	56, 589		
ウェルネット			10.3		10.9	11, 837		
ワールドホールディングス			3. 1		3.6	15, 588		
ディー・エヌ・エー			61.7		58. 4	111, 485		
博報堂DYホールディング	ス		190. 9		150.5	212, 205		
ぐるなび			19. 9		17. 1	23, 820		
エスアールジータカミヤ			14.8		12.8	7, 654		
ジャパンベストレスキュー	システム		17		13. 4	13, 413		
ファンコミュニケーション	ズ		35		30. 1	20, 377		
ライク			2. 5		4. 2	8, 761		

銘	柄	期首(前期末)	当	其	月 末	=
种	Tri	株	数	株	数	評価	額
			千株		千株		千円
ビジネス・ブレークスルー			4. 4		5	2	, 320
WDBホールディングス			4. 9		4. 9	18	, 301
ティア			6.6		5. 7	5	, 580
CDG			_		1	1	, 853
バリューコマース			12.7		9. 7	12	, 939
インフォマート			58. 4		54.8	56	, 279
J Pホールディングス			39.6		34	10	, 098
エコナックホールディング	ス		_		21. 1	2	, 637
EPSホールディングス			17. 1		16. 3	33	, 741
レッグス			3. 1		2. 7	2	, 851
プレステージ・インターナ	ショナル		19.5		22. 5	27	, 315
アミューズ			7. 6		7. 2	21	, 405
ドリームインキュベータ			4. 2		3. 6	9	, 633
クイック			7		6. 7	12	, 140
TAC			7. 6		6. 5	2	, 112
ケネディクス			174.6		143. 5	94	, 423
電通			153.5		132	582	, 120
テイクアンドギヴ・ニーズ			6. 4		5. 1	5	, 263
ぴあ			4. 2		3. 6	18	, 288
イオンファンタジー			4		3. 5	17	, 920
シーティーエス			7. 3		10.7	8	, 067
ネクシィーズグループ			4. 9		4. 2	6	, 438
みらかホールディングス			35. 2		32. 3	134	, 045
アルプス技研			5. 5		9. 5	22	, 382
サニックス			22		17. 2	4	, 282
ダイオーズ			2. 5		2. 1	2	, 562
日本空調サービス			13. 2		11.3	8	, 294
オリエンタルランド			148.9		128	1, 322	, 240
ダスキン			35. 3		29. 1	75	, 427
明光ネットワークジャパン			17. 1		13. 7	17	, 179
ファルコホールディングス			6. 5		5. 6	10	, 040
秀英予備校			2. 7		2. 4	1	, 192
田谷			2. 3		2	1	, 408
ラウンドワン			43		33. 6	55	, 708
リゾートトラスト			53. 3		45.8	101	, 676
ビー・エム・エル			18		13. 9	36	, 098
ワタベウェディング			2		1.7		940
りらいあコミュニケーショ	ンズ		22.8		17. 1	21	, 135
リソー教育			23. 4		18. 3	13	, 523

Delay.	for:	期首(前	前期末)	弄	á 其	東 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
早稲田アカデミー			1.8		1.5	2, 400
ユー・エス・エス			166.7		132.3	276, 507
東京個別指導学院			4. 4		3.8	4, 191
サイバーエージェント			72. 5		71. 2	378, 784
楽天			703. 7		555.4	488, 918
クリーク・アンド・リ	バー社		4. 9		5. 6	5, 247
テー・オー・ダブリュ	_		11		10.3	8, 991
セントラルスポーツ			4. 7		4	14,620
フルキャストホールデ	ィングス		14. 2		9. 5	23, 104
リソルホールディング	ス		14		1. 2	5, 340
テクノプロ・ホールデ	ィングス		22. 4		19.3	120, 046
アトラ			1.6		1.8	1,560
インターワークス			2.8		2. 4	2, 474
KeePer技研			1.5		3. 5	4, 497
ファーストロジック			0.7		1.7	1, 497
三機サービス			_		1. 2	2, 186
Gunosy			_		4. 9	13, 230
デザインワン・ジャパ	ン		1.8		2. 1	2, 139
イー・ガーディアン			4. 5		5. 5	21, 532
リブセンス			9. 2		6. 9	3, 581
ジャパンマテリアル			10		29.6	38, 628
ベクトル			11.2		13	29, 042
ウチヤマホールディン	グス		6. 2		5. 3	3, 174
ライクキッズネクスト			1.3		1. 1	2, 521
キャリアリンク			3. 1		3. 5	1, 928
ІВЈ			10.7		8.6	8,600
アサンテ			5. 1		3. 9	7, 823
N・フィールド			6. 5		6	11, 130
バリューHR			1		2. 4	4, 204
M&Aキャピタルパー	トナーズ		1.8		2. 2	17, 996
ライドオンエクスプレス	ホールディングス		3. 4		4. 4	4, 628
ERIホールディング	ス		3. 5		3	2, 907
アビスト			2. 1		1. 5	7, 425
シグマクシス			-		4. 3	7, 903
ウィルグループ			5. 5		4. 7	6, 768
エスクロー・エージェ	ント・ジャパン		2. 3		14.8	6, 334
日本ビューホテル			2. 8		3. 4	5, 028
リクルートホールディ	ングス		300.9		835.7	2, 125, 602
エラン			1.8		2. 6	5, 493

N4	to:	期首(i	前期末)	当	其	東	
銘	柄	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	千円	
土木管理総合試験所			1.4		3. 3	1,848	
日本郵政			359.4		614.7	796, 651	
ベルシステム24ホールデ	ィングス		21		18. 1	26, 190	
鎌倉新書			_		1.5	5,070	
一蔵			1		1.4	1, 387	
LITALICO			_		1.8	2, 903	
グローバルグループ			_		1. 2	1, 591	
エボラブルアジア			_		2. 2	4, 721	
ストライク			_		1	6, 130	
ソラスト			6. 3		6. 5	17, 433	
セラク			_		1.8	1, 263	
インソース			_		1.3	5, 869	
キャリアインデックス			_		1. 1	3, 105	
MS-Japan			_		0.8	5, 336	
船場			_		1.6	2,019	
リログループ			5. 2		59. 2	168, 956	
東祥			2. 9		6. 7	25, 795	
エイチ・アイ・エス			22. 4		16. 9	61, 262	
ラックランド			2. 4		2. 1	4, 767	
共立メンテナンス			11.2		19. 3	90,613	
イチネンホールディングス			14. 4		12. 1	17, 424	
建設技術研究所			8. 7		7. 5	10, 440	
スペース			7. 4		7	9, 590	
長大			_		3. 2	2, 566	
燦ホールディングス			2. 7		2. 6	6, 585	
スバル興業			10		0.7	4, 459	
東京テアトル			52		4. 5	6, 336	
タナベ経営			2. 7		2. 1	3, 901	
ナガワ			2. 5		2. 2	9, 625	
よみうりランド			27		2. 4	10,656	
東京都競馬			94		8. 1	29, 038	
常磐興産			5		4. 3	8, 277	
カナモト			19. 2		16. 5	56, 925	
東京ドーム			54. 9		43. 9	42, 451	
西尾レントオール			11. 1		9. 9	31, 482	
アゴーラ・ホスピタリティー	・グループ		68		59	2, 065	
トランス・コスモス			16		12	32, 436	
乃村工藝社			29. 5		25. 3	54, 243	
藤田観光			45		4. 3	12, 964	

銘	柄	期首(前期末)	当	其	東 末
野白	1171	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
KNT-CTホールデ	ディングス		78		6. 7	11, 242
日本管財			11.8		11.6	23, 780
トーカイ			6. 1		10.5	24, 412
白洋舎			1.3		1. 2	3, 433
セコム			143. 3		115	866, 410
セントラル警備保障			6. 1		5. 2	14, 409
丹青社			23. 8		22. 2	26, 595
メイテック			16. 7		12.7	73, 660
アサツー ディ・ケー	ſ		22.4		_	_
応用地質			13		12. 2	17, 860
船井総研ホールディン	ノグス		17. 7		22. 5	47, 610
進学会ホールディング	ブス		5. 7		4. 9	2, 881

Distr.	1 25	期首(前期末)	当	其	期 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
オオバ			10.7		8. 5	5, 244
いであ			_		2. 2	2, 252
学宪社			3.6		2. 9	4, 959
ベネッセホールディ	・ングス		46. 1		39. 7	148, 478
イオンディライト			15. 5		13.3	49, 210
ナック			8. 4		7. 2	6, 825
ニチイ学館			23. 9		20.6	22, 763
ダイセキ			24		18. 2	51, 815
ステップ			4. 6		4	6, 388
合 計	株数・金額	19	99, 465	13	7, 359	270, 790, 807
合 計	銘柄数<比率>		1, 997		2, 057	<98.1%>

- (注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
- (注) 評価額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

	DA.	柄	别		当	其	Я	末	
	銘	TY	万门	買	建	額	売	建	額
玉						百万円			百万円
内	株式先物取引		TOPIX			2, 941			_

〇有価証券の貸付及び借入の状況

(2018年3月26日現在)

X	分	当数	期	末量	
		200		<u> </u>	株
貸付有価証券<株式>総株数					10, 155, 800
(モルガン・スタンレー M し	J F G 証 券)				(10, 155, 800)

(注)()内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

(2018年3月26日現在)

百			当	其	玥 オ	Ħ
項	A	評	価	額	比	率
				千円		%
株式			2	70, 790, 807		90. 7
コール・ローン等、その他			:	27, 910, 416		9. 3
投資信託財産総額			29	98, 701, 223		100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年3月26日現在)

	項目	当期末
		円
(A)	資産	298, 701, 223, 842
	コール・ローン等	24, 444, 733, 475
	株式(評価額)	270, 790, 807, 310
	未収入金	2, 883, 876, 020
	未収配当金	345, 621, 575
	その他未収収益	35, 160, 462
	差入委託証拠金	201, 025, 000
(B)	負債	22, 743, 140, 899
	未払金	87, 201, 120
	未払解約金	1, 174, 721, 308
	未払利息	42, 741
	受入担保金	21, 481, 175, 730
(C)	純資産総額(A-B)	275, 958, 082, 943
	元本	157, 232, 250, 877
	次期繰越損益金	118, 725, 832, 066
(D)	受益権総口数	157, 232, 250, 877□
	1万口当たり基準価額(C/D)	17, 551円

○損益の状況 (2017年3月28日~2018年3月26日)

	項目	当 期
		円
(A)	配当等収益	6, 246, 400, 125
	受取配当金	5, 800, 274, 188
	受取利息	269, 728
	その他収益金	467, 057, 204
	支払利息	△ 21, 200, 995
(B)	有価証券売買損益	27, 754, 025, 602
	売買益	39, 662, 112, 920
	売買損	△ 11, 908, 087, 318
(C)	先物取引等取引損益	491, 337, 220
	取引益	1, 108, 899, 340
	取引損	△ 617, 562, 120
(D)	保管費用等	△ 1, 257, 410
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	34, 490, 505, 537
(F)	前期繰越損益金	107, 338, 936, 430
(G)	追加信託差損益金	99, 236, 602, 513
(H)	解約差損益金	△122, 340, 212, 414
(I)	計(E+F+G+H)	118, 725, 832, 066
	次期繰越損益金(I)	118, 725, 832, 066

- (注) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- (注) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
- (注) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

①期首元本額 189, 052, 090, 341円 期中追加設定元本額 137,884,382,881円 期中一部解約元本額 169,704,222,345円 また、1口当たり純資産額は、期末1.7551円です。 ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額) ファンド・マネジャー (国内株式) 2,434,058,224円 eMAXIS TOPIXインデックス 12,050,045,926円 eMAXIS バランス (8資産均等型) 1,749,911,004円 eMAXIS バランス (波乗り型) 89,639,930円 コアバランス 758,949円 三菱UFI ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金) 20,347,142円 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金) 29,938,694円 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金) 26,640,240円 eMAXIS Slim 国内株式 (TOPIX) 1,070,491,276円 国内株式セレクション (ラップ向け) 852, 624, 468円 e MAXIS Slim バランス (8 資産均等型) 678, 597, 316円 つみたて日本株式 (TOPIX) 1,295,447,695円 つみたて8資産均等バランス 40,056,671円 つみたて4資産均等バランス 9,535,634円 eMAXIS マイマネージャー 1970s 1,223,458円 eMAXIS マイマネージャー 1980s 1,558,881円 e MAXIS マイマネージャー 1990s 1,982,488円 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金) 1,567,913円 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金) 2,098,735円 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金) 2,406,280円 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型) 2,496,867,539円 三菱UFI バランス・イノベーション (株式重視型) 4,976,044,809円 三菱UFI バランス・イノベーション (新興国投資型) 13,595,824円 236, 558, 098円 三菱UFI DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) 三菱UFI バランス・イノベーション (債券重視型) 1,325,165,637円 三菱UFI アドバンスト・バランス (安定型) 36, 975, 422円 三菱UFI アドバンスト・バランス (安定成長型) 214,885,560円 eMAXIS バランス (4資産均等型) 108,722,958円 eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) 35, 317, 536円 eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) 46,603,032円 eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) 176, 279, 827円 e MAXIS 最適化バランス (マイフォワード) 129,092,138円 eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) 391, 341, 406円 55,680,200円 三菱UFI バランスファンド45 VA (適格機関投資家限定) 三菱UFI バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 9,942,321,641円 三菱UFI バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定) 284, 087, 763円 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) 2,875,846,855円 MUAM 日本株式インデックスファンド(適格機関投資家限定) 35, 151, 381, 334円 三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定) 700, 592, 997円 三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定) 95, 175, 190円 三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 9,099,046円 三菱UFI バランスファンドVA 45型 (適格機関投資家限定) 172,922,881円 三菱UFI バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) 101,489,004円 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 424, 893, 899円 三菱UFI バランスファンド20VA (適格機関投資家限定) 903, 702, 266円 MUAMトピックスリスクコントロール (5%) インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定) 2,558,990円 MUAMトピックスリスクコントロール (10%) インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定) 256,811,961円 MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定) 8,726,654円

MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付) MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	2, 477, 948, 179円 897, 270, 772円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	170, 647, 002円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	28, 398, 733円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド (適格機関投資家限定)	4,712,373,955円
MUKAM バランス・イノベーション (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付)	594, 224円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	546,110円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	9, 076, 178, 848円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	6,901,057円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	21, 384, 401円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	27, 778, 910円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	24, 332, 650円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	1, 966, 786, 300円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	388, 022, 564円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	53, 376, 909円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	356, 572, 506円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	31,737,453円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	265, 413, 272円
三菱UFJ <dc>TOPIX・ファンド</dc>	1,894,823,016円
三菱UFJ <dc>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)</dc>	480, 511, 315円
三菱UFJ <dc>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)</dc>	1, 895, 252, 575円
三菱UFJ <dc>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)</dc>	1, 590, 437, 180円
三菱UFJ <dc>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型)</dc>	1, 292, 930, 763円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	48, 040, 360, 792円
合計	157, 232, 250, 877円

[お知らせ]

- ①投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について、該当する記載の整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。 (2017年8月16日)
- ②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。 (変更前(旧) http://www.am.mufg.jp/ → 変更後(新) https://www.am.mufg.jp/)(2018年1月1日)



JPX日経400インデックスマザーファンド

《第5期》決算日2019年1月28日

[計算期間: 2018年1月27日~2019年1月28日]

「JPX日経400インデックスマザーファンド」は、1月28日に第5期の決算を行いました。 以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第5期の運用状況をご報告申し上げます。

運	用	方	針	わが国の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)を主要投資対象とし、 JPX日経インデックス400に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の 組入比率は原則として高位を保ちます。対象インデックスとの連動を維持するため、先 物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資 産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。
主	要 運	用:	対 象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
主	な組	入:	制限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

〇設定以来の運用実績

2/h	hehe-	##0	基	準	価		額	J	PX目経イン		ウス4		株			式	株		5	ţ	純	資	産
決	算	期			期騰	落	中率			期騰	落	中率	組	入	比	率		物	比	輕	総		額
(設定	目)			円			%					%				%			C,	%		百	万円
201	14年4月	1日		10,000			_		10, 901			_				_			-	-			999
1期(2	2015年1	月26日)		11,815]	18.2		12, 733		1	6.8			90	5. 2			3.	8		4,	, 866
2期(2	2016年1	月26日)		11, 593		\triangle	1.9		12, 274		Δ	3.6			9'	7.6			2.	4		12,	, 535
3期(2	2017年1	月26日)		13, 375]	15.4		13, 860		1	2.9			9'	7.2			2.	8		12,	, 083
4期(2	2018年1	月26日)		16, 392		2	22.6		16, 637		2	20.0			9'	7. 3			2.	7		8,	, 332
5期(2	2019年1	月28日)		13, 910		$\triangle 1$	15.1		13, 809		Δ1	7.0			9'	7. 5			2.	5		7,	, 392

- (注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
- (注) JPX日経インデックス400とは、東京証券取引所の第一部、第二部、マザーズ、JASDAQを主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、売買代金、ROE等を基に原則400銘柄を選定し算出される株価指数です。「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所(以下、総称して「JPXグループ」といいます。)と株式会社日本経済新聞社(以下、「日本経済新聞社」といいます。)によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPXグループと日本経済新聞社は、「JPX日経インデックス400」自体および「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべてJPXグループと日本経済新聞社に帰属しています。ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、JPXグループと日本経済新聞社は、その運用およびファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。JPXグループと日本経済新聞社は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。JPXグループと日本経済新聞社は、「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- (注)上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率 売建比率。
- (注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

〇当期中の基準価額と市況等の推移

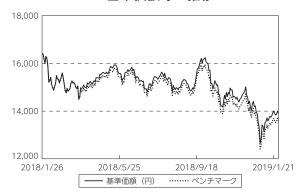
年	月	п	基	準	価		額	JPX日経イン	デック	ス40	0 (株			式	株			式
4-	Э	日			騰	落	率		騰	落	率	組	入	比	率	先	物	比	率
	(期 首)			円			%				%				%				%
2	018年1月26日			16, 392			_	16, 637			_			9'	7.3			2.	. 7
	1月末			16,013		Δ	2.3	16, 251		Δ	2.3			98	8.4			1.	. 6
	2月末			15, 384		Δ	6.1	15, 613		Δ	6.2			98	8. 7			1.	. 3
	3月末			15, 094		Δ	7.9	15, 180		Δ	8.8			9'	7.8			2.	. 2
	4月末			15, 627		Δ	4.7	15, 713		Δ	5.6			98	8. 1			1.	. 9
	5月末			15, 372		Δ	6.2	15, 450		Δ	7. 1			98	8.1			1.	. 9
	6月末			15, 258		Δ	6.9	15, 312		Δ	8.0			98	8.4			1.	. 8
	7月末			15, 445		Δ	5.8	15, 500		Δ	6.8			98	8.8			1.	. 2
	8月末			15, 279		Δ	6.8	15, 332		Δ	7.8			99	9. 1			0.	. 9
	9月末			16, 174		Δ	1.3	16, 096		Δ	3. 3			90	6.9			3.	. 1
	10月末			14,662		\triangle	10.6	14, 584		$\triangle 1$	2. 3			98	8.0			2.	. 0
	11月末			14,829		Δ	9.5	14, 747		$\triangle 1$	1.4			9'	7. 3			2.	. 7
	12月末			13, 351		\triangle	18.6	13, 253		$\triangle 2$	20.3			98	8.3			1.	. 7
	(期 末)								·										
2	019年1月28日			13,910		\triangle	15. 1	13, 809		$\triangle 1$	7.0			9'	7. 5			2.	. 5

- (注)騰落率は期首比。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

〇運用経過

- ●当期中の基準価額等の推移について
- ◎基準価額の動き 基準価額は期首に比べ15.1%の下落となりました。
- ◎ベンチマークとの差異ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(-17.0%)を1.9%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎国内株式市況

- ・米国長期金利上昇や景気後退懸念の台頭等による米国株式の下落や、国内企業の業績上方修正期待がしぼんだこと等を受け、国内株式市況は下落しました。
- ●当該投資信託のポートフォリオについて
- ・資産のほぼ全額を株式(先物を含む)に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークである JPX日経インデックス400の個別銘柄構成 比率に合わせて構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について ベンチマークは17.0%の下落となったため、カ イ離は1.9%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

• 配当要因* 2.1%

※ベンチマークが配当相当分を含まないインデックスであることによって生じるプラス要因です。

(主なマイナス要因)

・取引コスト要因

〇今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざ して運用を行います。

〇1万口当たりの費用明細

(2018年1月27日~2019年1月28日)

項	E	当	期	項 目 の 概 要
坦	=	金 額	比 率	切 切 城 安
		円	%	
(a) 売 買 委	託 手 数 料	2	0.012	(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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株	式)	(0)	(0.000)	
(先物・	オプション)	(2)	(0.012)	
(b) そ の	他 費 用	0	0.000	(b)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(~~	の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合	11	2	0.012	
期中の当	P均基準価額は、1	.5, 062円です	0	

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

〇売買及び取引の状況

(2018年1月27日~2019年1月28日)

株式

		買	付			売	付	
	株	数	金	額	株	数	金	額
国		千株		千円		千株		千円
		1,837	4,	072, 588		1,611	3,	634, 802
内		(△ 111)	(-)				

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

先物取引の種類別取引状況

	呑	米只	RII	買	建	売	建
	種	類	751)	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
玉				百万円	百万円	百万円	百万円
内	株式先物取引			6, 540	6, 541	132	132

〇株式売買比率

(2018年1月27日~2019年1月28日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	7,707,391千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	7,809,980千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.98

⁽注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

〇利害関係人との取引状況等

(2018年1月27日~2019年1月28日)

利害関係人との取引状況

		PP /			= /_ <i>b</i> E/A		
区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	<u>B</u> A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	<u>D</u> C
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式		4,072	1, 390	34. 1	3,634	731	20. 1

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
					百万円			百万円	百万円
株	式				83			45	118

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

	種	類	買	付	額
					百万円
株式	弋				1

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項		当	期	
売買委託手数料総額(A)				974千円
うち利害関係人への支払額(F	3)			2千円
(B) / (A)				0.2%

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カブドットコム証券、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、モルガン・スタンレーMUFG証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2019年1月28日現在)

国内株式

銘	柄	期首(前	前期末)	当	其	東 末
学白	1173	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	手巴
水産・農林業 (0.1%)						
日本水産			5. 1		5. 7	3, 779
マルハニチロ			_		0.8	2, 920
鉱業 (0.3%)						
国際石油開発帝石			22. 1		22. 9	23, 403
建設業 (3.0%)						
安藤・間			3. 5		3. 6	2, 56
東急建設			1.7		1.7	1,67
コムシスホールディング	ス		1.6		1.8	5, 04
大成建設			4. 5		4. 7	23, 73
大林組			13.6		14. 1	14, 36
清水建設			13. 9		14. 4	13, 26
長谷工コーポレーション			5. 3		5. 9	7, 09
鹿島建設			20		11	16, 66
西松建設			_		1	2, 51
三井住友建設			3. 3		3. 4	2, 34
前田建設工業			3. 2		3. 4	3, 63
戸田建設			5		5. 5	3, 75
熊谷組			0.7		0.7	2, 33
大東建託			1.6		1.7	25, 55
NIPPO			1		1.2	2, 48
前田道路			1		1.5	3, 14
五洋建設			5. 4		5. 6	3, 47
住友林業			2. 9		3. 3	4, 80
大和ハウス工業			13. 4		13	45, 60
積水ハウス			14.8		14. 4	23, 89
協和エクシオ			1.6		1.7	4, 47
九電工			0.9		0.9	3, 40
食料品 (4.2%)						
森永製菓			-		1. 1	4, 884
江崎グリコ			1. 1		1. 3	6, 87
カルビー			1. 9		1. 9	6, 63
ヤクルト本社			2. 4		3. 1	22, 10
明治ホールディングス			2. 7		3	25, 086

			1	
銘	柄	期首(前期末)	当其	
		株 数	株 数	評価額
n.t.)		千株	千株	千円
日本ハム	···	4	1.8	8, 199
アサヒグループホールラ		8. 5	8.8	37, 461
キリンホールディングス		19. 6	19	48, 782
サントリー食品インター	- テンヨテル	3. 1	2.8	13, 594
キッコーマン		3. 2	2.8	15, 540
味の素		9. 4	9.3	17, 260
キユーピー		2. 3	2. 3	5, 715
ニチレイ		1. 9	2. 2	6, 529
東洋水産	*	2. 2	2. 2	8, 547
日清食品ホールディング	7 ス	1.8	1.8	12, 330
日本たばこ産業		25. 2	24. 3	66, 691
繊維製品 (0.4%)		0.5		2 225
帝人		3. 5	3. 4	6, 337
東レ		30. 8	31.9	25, 596
パルプ・紙 (0.2%)				
王子ホールディングス		18	18. 5	11, 377
大王製紙		1. 7	_	_
化学 (7.4%)				
クラレ		7. 2	6. 9	11, 509
旭化成		26. 5	29. 2	34, 558
昭和電工		_	2.7	9, 801
住友化学		31	32. 3	18, 895
日産化学		2. 5	2.5	14, 225
東ソー		6. 1	6. 4	9, 785
デンカ		1.6	1.6	5, 488
信越化学工業		7. 1	7. 2	65, 656
エア・ウォーター		3. 5	3. 4	6, 089
大陽日酸 日本パーカライジング		3. 3	3. 4	5, 916
		2. 2	2. 2	2, 752
三菱瓦斯化学		3. 5	4. 2	7, 177
		3.9	3. 7	10, 015
JSR 三菱ケミカルホールディ	ハノガラ	4. 3	4. 1	7, 236
	V 9 A	28. 5	27. 5	25, 462
ダイセル		5. 7	6. 4	7, 180

銘	柄	期首(前期末)	当	其	東 末
李白	ff/3	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
積水化学工業			8.8		9	14, 598
日本ゼオン			3. 6		3. 7	4,073
アイカ工業			1.2		1.2	4, 338
宇部興産			2. 1		2. 1	5, 117
目立化成			2. 1		1.9	3, 418
ダイキョーニシカワ			0.8		0.9	1, 035
日本化薬			2.8		_	_
日油			1.6		1.6	5, 584
花王			10		10. 2	77, 622
日本ペイントホールディン	グス		3. 3		3. 4	12, 206
関西ペイント			4. 5		4.6	8, 845
DIC			1.7		1.9	6, 574
資生堂			7. 6		8. 3	52, 597
ライオン			5. 7		5.8	12, 789
コーセー			0.7		0.7	11, 095
シーズ・ホールディングス			0.6		0.4	2, 352
ポーラ・オルビスホールデ	ィングス		_		1.8	5, 472
小林製薬			1. 1		1.2	8, 280
日東電工			3. 1		3. 2	19, 350
ニフコ			0.7		1.7	4, 481
ユニ・チャーム			8.6		8. 9	28, 880
医薬品 (5.6%)						
協和発酵キリン			5. 1		5. 3	10, 949
武田薬品工業			15		16.6	74, 849
アステラス製薬			41.7		38. 7	59, 172
大日本住友製薬			3		3. 1	11, 578
塩野義製薬			5.8		5. 5	35, 777
田辺三菱製薬			5		4. 4	7, 260
中外製薬			4. 2		4. 4	27, 588
科研製薬			0.7		0.8	4, 072
エーザイ			4. 9		5	43, 150
小野薬品工業			9.6		9. 9	23, 012
久光製薬			1.2		1. 2	6, 552
参天製薬			7. 7		8	11, 920
ツムラ			1.5		1.3	3, 991
沢井製薬			0.8		0.9	4, 950
第一三共			11.6		12	44, 796
大塚ホールディングス			8. 4		8	34, 664

No.	期首(前期末)	当 其	東 末
銘 柄	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
石油・石炭製品 (0.8%)			
出光興産	_	3. 3	12, 507
JXTGホールディングス	_	70. 6	41, 068
コスモエネルギーホールディングス	_	1. 2	2, 914
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	2. 4	2. 4	5, 491
TOYO TIRE	2. 4	_	_
ブリヂストン	14. 3	12. 9	54, 579
住友ゴム工業	4	3.8	5, 624
ガラス・土石製品 (0.8%)			
AGC	4. 1	4. 1	14, 985
住友大阪セメント	8	_	-
太平洋セメント	2.6	2. 6	9, 555
ТОТО	3. 1	3. 2	13, 008
日本碍子	5	5. 1	8, 440
日本特殊陶業	3. 5	3. 5	7, 836
ニチアス	_	1. 1	2, 103
鉄鋼 (0.9%)			
新日鐵住金	18	18. 6	36, 967
ジェイ エフ イー ホールディングス	10.8	11. 2	20, 944
東京製鐵	2. 1	2. 2	1, 929
日立金属	4. 3	4. 5	5, 418
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	11.7	11. 3	2, 565
三菱マテリアル	2. 7	2. 7	8, 329
住友金属鉱山	5. 1	5. 7	17, 385
DOWAホールディングス	1	1	3, 395
古河電気工業	-	1.2	3, 918
住友電気工業	15	15. 5	24, 048
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	_	4.6	6, 904
三和ホールディングス	3.8	4. 3	5, 069
リンナイ	0.7	0.7	4, 998
東プレ	_	0.8	1,884
日本発條	4	4. 1	4, 153
機械 (5.0%)			
アマダホールディングス	6. 2	6. 4	7, 020
オーエスジー	1.8	2	4, 400
DMG森精機	2. 2	2.6	3, 819

ht. 17	期首(前期末)	当 其	用 末
銘 柄	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ディスコ	0. 5	0.6	9, 510
ニューフレアテクノロジー	0.1	_	_
ナブテスコ	2. 2	2. 3	6, 497
三井海洋開発	_	0.4	963
SMC	1. 3	1. 2	44, 040
小松製作所	19. 6	19	53, 979
住友重機械工業	2. 3	2. 4	8, 856
日立建機	1. 9	1. 7	4, 717
ハーモニック・ドライブ・システムズ	0.6	0.8	3, 072
クボタ	21.9	22. 5	38, 553
荏原製作所	1.7	1. 9	5, 719
ダイキン工業	5. 5	5. 7	66, 661
椿本チエイン	2	0.5	2, 012
ダイフク	2. 1	2. 3	12, 397
タダノ	2	2	2, 520
平和	1.3	1. 2	2, 744
竹内製作所	0.7	0.7	1, 363
TPR	0.5	0.6	1, 396
ホシザキ	1.3	1. 2	9, 384
日本精工	8.3	8.6	9, 133
ジェイテクト	4.3	4	5, 684
ТНК	2. 5	2. 6	6, 708
イーグル工業	0. 5	_	_
マキタ	5. 3	5. 1	19, 915
三菱重工業	6.8	7	29, 239
電気機器 (14.2%)			
コニカミノルタ	9. 5	9. 2	9, 825
ブラザー工業	5	5. 5	10, 081
ミネベアミツミ	7. 5	7. 8	13, 790
日立製作所	97	18. 9	64, 770
三菱電機	40. 6	41.9	57, 738
富士電機	12	2. 7	9,072
安川電機	4. 7	4. 9	15, 263
日本電産	4. 9	5	64, 600
オムロン	4. 3	4.5	19, 912
日本電気	5. 3	5. 4	18, 684
富士通	42	4	29, 492
ルネサスエレクトロニクス	2. 1	4.3	2, 782
セイコーエプソン	6	5. 2	8, 777

銘	柄	期首(前期末)	当	其	東 末	
鄞	ff1	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	千円	
アルバック			0.7		1	3, 555	
エレコム			0.4		0.4	1, 134	
パナソニック			46. 4		47. 9	50, 917	
富士通ゼネラル			1.2		1. 3	1, 797	
日立国際電気			0.7		_	_	
ソニー			23. 7		21.4	114, 982	
TDK			2. 1		2. 2	17, 600	
アルプスアルパイン			3. 5		3. 9	8, 962	
クラリオン			2		0.3	747	
ヒロセ電機			0.7		0.6	6, 822	
日本航空電子工業			1		-	_	
横河電機			4. 1		4. 2	8, 374	
日本光電工業			1.7		1.8	5, 913	
堀場製作所			0.8		0.8	4, 248	
アドバンテスト			2. 3		2. 9	6, 986	
キーエンス			2		1. 9	104, 443	
シスメックス			3. 2		3. 3	19, 905	
OBARA GROUP			0.2		0.2	692	
スタンレー電気			3. 1		3	9, 660	
カシオ計算機			3. 3		3. 7	5, 261	
ファナック			3. 9		4	74, 700	
浜松ホトニクス			3		3	11, 325	
京セラ			6.7		6.4	39, 033	
村田製作所			4. 3		4. 4	65, 538	
小糸製作所			2. 4		2. 5	15, 825	
ミツバ			0.7		-	-	
SCREENホールディン	グス		0.8		0.7	3, 850	
キヤノン			21.8		22. 6	70, 805	
リコー			12. 2		-	_	
東京エレクトロン			2. 7		2.8	43, 456	
輸送用機器 (7.3%)							
トヨタ紡織			1. 2		1. 5	2, 610	
豊田自動織機			3. 3		3. 4	18, 326	
デンソー			9		9. 2	46, 754	
川崎重工業			3. 2		3. 3	8, 731	
日産自動車			47. 9		49. 5	45, 554	
いすゞ自動車			11.8		13. 3	21, 366	
トヨタ自動車			18. 2		15. 5	103, 679	
日野自動車			5. 8		5. 2	5, 839	

Dit.	400	期首(前期	末)	当	其	東 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
		Ŧ	一株		千株	千円
日信工業			0.8		_	_
NOK		:	2. 2		2. 3	3, 933
アイシン精機		;	3. 3		3. 5	15, 295
マツダ		12	2. 7		13. 2	15, 978
本田技研工業			35		34. 9	113, 425
スズキ			8		7.7	43, 859
SUBARU		12	2.6		13	32, 532
ヤマハ発動機			5. 7		5. 9	13, 823
豊田合成			1. 5		1.4	3, 390
シマノ			1.6		1.7	25, 755
テイ・エス テック			0.9		1	3, 295
精密機器 (1.9%)						
テルモ			6. 2		5. 9	36, 090
島津製作所		4	4.8		5. 4	13, 370
オリンパス			6		6. 2	27, 435
НОҮА			8. 3		8. 4	52, 281
朝日インテック			2		2	9, 170
セイコーホールディングス		(0.6		_	_
その他製品 (1.9%)						
バンダイナムコホールディン	ングス	4	4. 2		4. 3	20, 210
パイロットコーポレーション	/	(0. 7		0.7	3, 626
アシックス			4		4. 2	6, 560
ヤマハ		:	2. 7		2. 5	11,675
ピジョン		:	2. 5		2.5	10, 175
任天堂			-		2.6	85, 566
電気・ガス業 (1.9%)						
中部電力		1:	2. 4		12.8	22, 041
関西電力		10	6. 6		17. 1	28, 309
東北電力		9	9. 5		9.8	14, 719
九州電力			-		8.6	11, 627
電源開発		;	3. 2		3. 3	9, 167
東京瓦斯			8. 7		8. 2	23, 111
大阪瓦斯			7. 9		8. 1	17, 244
東邦瓦斯			2		2. 1	10, 006
陸運業 (5.3%)						
東武鉄道		4	4. 3		4. 4	13, 200
相鉄ホールディングス			1. 7		1. 9	6, 118
東京急行電鉄			11		11. 4	20, 565
小田急電鉄			6		6.7	16, 147

Rid.	605	期首(前	期末)	当	其	東 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
京王電鉄			2. 3		2. 3	14, 122
京成電鉄			2.8		3. 1	10, 493
東日本旅客鉄道			7. 3		7. 5	73, 950
西日本旅客鉄道			3. 7		3.8	29, 598
東海旅客鉄道			3.6		3.8	87, 362
西武ホールディングス			5. 2		5. 3	9, 873
西日本鉄道			1.5		_	_
近鉄グループホールデ	ィングス		3.8		4	18, 820
阪急阪神ホールディン	グス		5. 1		5. 3	19, 981
南海電気鉄道			2. 4		_	_
京阪ホールディングス			2. 3		2. 4	10, 512
名古屋鉄道			4		4. 2	11, 797
日本通運			1.5		1.6	10, 384
ヤマトホールディング	ス		6. 7		7	20, 401
山九			1		1. 1	5, 720
日立物流			0.8		0.9	2, 740
空運業 (0.8%)						
日本航空			7. 1		7. 3	28, 659
ANAホールディング	ス		7. 5		7. 3	28, 659
情報・通信業 (7.7%)						
新日鉄住金ソリューシ	ョンズ		0.6		0.6	1, 689
TIS			-		1.4	6, 594
ネクソン			4. 5		10.5	17, 388
コロプラ			1.3		1.2	948
ティーガイア			0.4		0.4	828
ガンホー・オンライン・エ	ンターテイメント		10.8		9.9	2, 445
野村総合研究所			2. 7		2.6	11, 765
オービック			1.3		1.4	12, 530
ヤフー			28. 7		26.8	7, 852
トレンドマイクロ			1.9		2. 2	14, 124
日本オラクル			0.6		0.7	5, 355
伊藤忠テクノソリュー	ションズ		0.9		1. 9	4, 218
大塚商会			1.2		2. 2	7, 436
日本ユニシス			-		1. 3	3, 272
日本テレビホールディ	ングス		3. 7		3.8	6, 342
日本電信電話			18		22. 9	106, 004
KDDI			33. 1		36. 3	97, 211
光通信			0.5		0.5	8, 510
NTTドコモ			29. 5		29.6	76, 146

744	łu:	期首(前期末)	当 其	東 末
銘	柄	株 数	株 数	評価額
		千株	千株	千円
GMOインターネット		1.5	1.5	2, 100
東宝		2. 6	2. 7	10, 368
エヌ・ティ・ティ・デー	- タ	12. 4	11	14, 047
スクウェア・エニックス・	ホールディングス	1.9	1.9	6, 707
カプコン		_	1.8	4, 109
SCSK		0.9	1. 1	4, 757
コナミホールディングス	ζ	1.6	1.7	8, 534
ソフトバンクグループ		11.8	14	113, 064
卸売業 (5.2%)				
双目		23. 7	22. 8	9, 416
アルフレッサ ホールラ	ディングス	4. 4	4.6	13, 675
神戸物産		0.3	0.6	2,031
シップヘルスケアホール	レディングス	0.8	0.9	3, 663
第一興商		0.8	0.8	4, 152
メディパルホールディン	/ グス	4	4. 5	10, 849
伊藤忠商事		29. 3	28. 9	57, 222
丸紅		32. 8	40. 7	33, 349
豊田通商		4. 5	4.6	15, 847
兼松		1. 7	1. 7	2, 203
三井物産		34	34	59, 296
日立ハイテクノロジース	<	1.4	1. 3	5, 148
住友商事		25. 2	24. 4	40,613
三菱商事		28. 1	29	90, 132
阪和興業		0.7	0.7	2,090
岩谷産業		0.9	0.9	3, 352
東邦ホールディングス		1. 2	1. 2	3, 184
サンリオ		1. 1	_	_
PALTAC		_	0. 7	3, 549
日鉄住金物産		0.3	0.3	1, 389
ミスミグループ本社		4. 6	5. 2	13,000
小売業 (4.7%)				
ローソン		1	1	6,660
エービーシー・マート		0. 7	0.6	3, 696
アダストリア		0.6	0.6	1, 210
セリア		1	1. 1	3, 685
ビックカメラ		2. 3	2. 2	2, 840
MonotaRO		1.4	2.6	6, 253
J. フロント リテイリ	リング	4.8	5. 3	6, 545
マツモトキヨシホールラ	ディングス	1.7	1.7	5, 703

Dit.	400	期首(前期末)	当	其	期 末	
銘	柄	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	千日	
ZOZO			3. 9		4. 5	9, 71	
ウエルシアホールディング	゚ス		1. 1		1. 1	4, 36	
クリエイトSDホールディ	ングス		0.6		0.6	1,60	
すかいらーくホールディン	グス		_		3. 9	7, 14	
コスモス薬品			0.2		0.2	3, 99	
セブン&アイ・ホールディ	ングス		16.8		17. 3	80, 91	
ツルハホールディングス			0.8		0.9	8, 71	
クスリのアオキホールディ	ングス		0.3		0.3	2, 10	
ノジマ			0.7		0.7	1, 50	
良品計画			0.5		0.6	14, 59	
ドンキホーテホールディン	グス		2.6		2. 7	16, 74	
ゼンショーホールディング	゚ス		_		1. 9	4, 75	
ユナイテッドアローズ			0.5		0.5	1, 85	
スギホールディングス			0.9		0.9	4, 03	
ユニー・ファミリーマートホー	-ルディングス		1.3		1.2	14, 91	
日本瓦斯			0.7		0.7	2, 82	
しまむら			0.5		0.5	4, 62	
高島屋			6		_	-	
丸井グループ			_		3. 5	7, 64	
イオン			15. 4		15. 9	34, 37	
イズミ			0.7		0.8	4, 29	
ヤオコー			0.5		0.5	2, 80	
ケーズホールディングス			1.7		4. 3	4, 66	
アインホールディングス			0.6		0.6	4, 75	
ニトリホールディングス			1.6		1.8	25, 28	
バローホールディングス			0.9		_	-	
ファーストリテイリング			0.7		0.6	30, 10	
サンドラッグ			1.7		1.6	5, 48	
銀行業 (6.1%)							
めぶきフィナンシャルグル	ープ		20.8		21.5	6, 60	
東京きらぼしフィナンシャ	・ルグループ		0.5		_	-	
九州フィナンシャルグルー	・プ		8.8		9. 1	3, 93	
コンコルディア・フィナンシ	ャルグループ		24. 3		26. 4	11, 85	
新生銀行			3. 5		3	4, 37	
あおぞら銀行			2. 4		2. 3	7, 67	
三菱UFJフィナンシャル	・グループ		132. 4	1	190. 6	110, 75	
りそなホールディングス			43. 9		45. 4	25, 00	
三井住友トラスト・ホール	ディングス		7. 9		8. 1	34, 40	
三井住友フィナンシャルグ	゛ループ		23. 1		26. 2	104, 95	

銘	柄	期首(前期末)	当	其	東 末
銘	枘	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
千葉銀行			14		14. 7	9, 702
群馬銀行			8. 1		_	_
静岡銀行			11		10. 4	9, 401
スルガ銀行			4. 1		_	_
ほくほくフィナンシャル	グループ		2. 7		_	_
広島銀行			5. 9		6. 1	3, 818
中国銀行			3. 7		_	_
セブン銀行			15		14	4, 564
みずほフィナンシャルグ	ループ		522. 4		62. 2	100, 296
山口フィナンシャルグル	ープ		5		-	_
証券、商品先物取引業(1.0%)					
FPG			1.4		1. 3	1, 495
SBIホールディングス			4. 5		4. 9	11, 323
ジャフコ			0.6		-	_
大和証券グループ本社			34		33. 2	19, 621
野村ホールディングス			72. 3		75. 9	34, 329
東海東京フィナンシャル・ホ	ニールディングス		4. 4		4. 9	2, 479
松井証券			2		2	2, 364
カブドットコム証券			2.6		-	_
保険業 (2.9%)						
SOMPOホールディン	グス		7. 9		7. 3	29, 360
MS&ADインシュアランス	グループホール		10.5		10.8	34, 560
ソニーフィナンシャルホー	-ルディングス		3. 3		3. 4	7,010
第一生命ホールディング	ス		22.6		23. 4	40, 985
東京海上ホールディング	ス		15. 1		15	79, 275
T&Dホールディングス			12. 4		12.8	17, 388
その他金融業 (1.3%)						
全国保証			1. 1		1.2	4, 578
芙蓉総合リース			0.5		0.5	2,680
興銀リース			0.8		-	_
東京センチュリー			0.8		0.8	3, 856
イオンフィナンシャルサ	ービス		2.8		2.6	5, 535
オリエントコーポレーシ	ョン		8. 7		11.2	1, 478
日立キャピタル			1. 1		1	2, 436
オリックス			26. 7		27. 6	46, 464
三菱UFJリース			10. 2		9. 3	5, 142
日本取引所グループ			11.8		11. 2	22, 052

銘	柄	期首(i	前期末)	当	其	期 末	
珀	በሃ	株	数	株	数	評価額	
			千株		千株	手巴	
不動産業 (2.8%)							
いちご			5. 7		5. 3	1, 939	
ヒューリック			8. 4		8.6	8, 453	
野村不動産ホールディン	グス		2. 7		2.8	5, 874	
プレサンスコーポレーシ	ョン		0.5		0.7	1, 059	
オープンハウス			0.7		0.7	3, 111	
東急不動産ホールディン	グス		9.7		11. 1	6, 426	
飯田グループホールディ	ングス		3. 3		3. 5	6, 930	
パーク24			2. 2		2. 4	6, 256	
三井不動産			20		21. 9	56, 020	
三菱地所			29.8		29	53, 490	
東京建物			4. 4		4. 5	5, 832	
住友不動産			10		9. 3	38, 213	
レオパレス 2 1			4.8		5. 1	2, 646	
スターツコーポレーショ	ン		0.5		0.6	1, 449	
イオンモール			2.6		2. 1	3, 76	
エヌ・ティ・ティ都市開	発		2. 5		-	-	
サービス業 (4.3%)							
ミクシィ			1		1. 1	3, 050	
日本M&Aセンター			1.3		3	7, 659	
パーソルホールディング	ス		3. 6		4	7, 536	
綜合警備保障			1.5		1.6	7, 792	
カカクコム			3		3	5, 59	
ディップ			0.5		0.6	1, 17	
エムスリー			4. 1		8. 4	13, 05	
ディー・エヌ・エー			2. 1		2. 2	4, 246	
博報堂DYホールディン	グス		5. 4		5. 6	9, 16	
電通			_		4. 9	25, 039	
オリエンタルランド			4. 6		4. 7	50, 87	
リゾートトラスト			1.6		1. 7	2, 70	
ユー・エス・エス			4. 7		4. 9	9, 074	
サイバーエージェント			2. 5		2. 5	10, 487	
楽天			19. 9		18. 7	15, 689	
エン・ジャパン			-		0.6	2, 355	
テクノプロ・ホールディ	ングス		_		0.8	4, 368	
リクルートホールディン	グス		_		28. 7	80, 116	
リログループ			2. 1		2. 2	6, 113	

銘	柄		前期末)	当	į į	東 末
對	fl'3	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
カナモト			0.6		0.6	1,809
セコム			4.1		4.3	38, 932
メイテック			0.5		0.5	2, 322

銘	柄	期首(前期末)	当 其	期 末
班	171	株 数	株 数	評価額
		千株	千株	千円
イオンディライト		0. 5	0.5	1, 997
合 計	株数・金額	3, 374	3, 488	7, 206, 792
TO #T	銘柄数 < 比率 >	400	399	<97.5%>

- (注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
- (注) 評価額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

	A-lz	1 2E	RII		当	其	月	末	
	銘	柄	別	買	建	額	売	建	額
国						百万円			百万円
内	株式先物取引		JPX月経400			185			_

〇投資信託財産の構成

(2019年1月28日現在)

項	П		当	其	玥 ヲ	Ħ
世	Ħ	評	価	額	比	率
				千円		%
株式				7, 206, 792		97. 3
コール・ローン等、その他				198, 243		2.7
投資信託財産総額				7, 405, 035		100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年1月28日現在)

項 \blacksquare 当期末 円 (A) 資産 7, 401, 202, 153 コール・ローン等 83, 353, 848 株式(評価額) 7, 206, 792, 400 未収入金 99, 229, 355 未収配当金 12, 274, 550 差入委託証拠金 448,000 \triangle (B) 負債 8, 499, 288 未払解約金 8, 498, 181 未払利息 159 その他未払費用 948 (C) 純資産総額(A-B) 7, 392, 702, 865 元本 5, 314, 620, 423 次期繰越損益金 2,078,082,442 (D) 受益権総口数 5, 314, 620, 423 II 13.910円 1万口当たり基準価額(C/D)

<注記事項>

①期首元本額 5,083,419,288円 期中追加設定元本額 2,719,492,336円 期中一部解約元本額 2,488,291,201円 また、1口当たり純資産額は、期末1,3910円です。

〇損益の状況

(2018年1月27日~2019年1月28日)

		T
	項 目	当 期
		円
(A)	配当等収益	171, 148, 438
	受取配当金	171, 107, 220
	受取利息	875
	その他収益金	158, 925
	支払利息	△ 118, 582
(B)	有価証券売買損益	△1, 338, 417, 677
	売買益	196, 673, 084
	売買損	△1, 535, 090, 761
(C)	先物取引等取引損益	△ 37, 817, 668
	取引益	60, 425, 192
	取引損	△ 98, 242, 860
(D)	保管費用等	Δ 2, 197
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	△1, 205, 089, 104
(F)	前期繰越損益金	3, 249, 573, 766
(G)	追加信託差損益金	1, 355, 943, 574
(H)	解約差損益金	△1, 322, 345, 794
(I)	計(E+F+G+H)	2, 078, 082, 442
	次期繰越損益金(I)	2, 078, 082, 442

- (注) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の 評価換えによるものを含みます。
- (注) (6) 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) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額) 国際 JPX日経インデックス400オープン(適格機関投資家専用) 833,562円 eMAXIS JPX日経400インデックス 4,719,893,023円 JPX日経400インデックスファンド(ラップ向け) 47,253,350円 国内株式セレクション(ラップ向け) 471,528,811円 三菱UFJアドバンスト・バランス(安定型) 10,633,916円 合計 64,477,761円 合計 5,314,620,423円

日本株インカム・マザーファンド

《第27期》決算日2019年2月4日

[計算期間: 2018年8月4日~2019年2月4日]

「日本株インカム・マザーファンド」は、2月4日に第27期の決算を行いました。 以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第27期の運用状況をご報告申し上げます。

主として東京証券取引所第一部上場株式の中から、予想配当利回りが市場平均と比較して高いと判断される銘柄に投資し、高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。なお、東京証券取引所第二部上場株式およびJASDAQ上場株式等に投資する場合があります。
主要運用対象わが国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。

〇最近5期の運用実績

決	算	期	基	準	無 期 騰落	額中率	(参 東 詞 (TOI	正株	指価期騰	数 指 落)数中率	株組入	式、比率	株先生	物比	式率	投証組	資 化	券	純総	資	産額
				円		%					%		%			%			%		百万	5円
23期(2	2017年2	月3日)		18, 436		22. 7	1, 5	14. 99		1	9. 1		96. 2			_			2.9		10,	270
24期(2	2017年8	月3日)		19, 938		8.1	1, 6	33. 82			7.8		95. 9			_			2.6		9,	816
25期(2	2018年2	月5日)		22, 858		14.6	1,8	23. 74		1	1.6		95. 5			_			3.3		10,	849
26期(2	2018年8	月3日)		21,818	Δ	4.5	1, 7	42. 58		\triangle	4. 5		94. 3			_			4.4		7,	691
27期(2	2019年2	月4日)		19, 796	Δ	9.3	1, 5	81. 33		\triangle	9. 3		95. 1			_			4.2		6,	914

- (注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。
- (注) 東証株価指数 (TOPIX) とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式 市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東 京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
- (注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

〇当期中の基準価額と市況等の推移

年	月	月	基	準	価 騰	額 落 率	(東 (T(参 証 O P I	考 株 X)	指価騰	数 指 落) 数 率	株組	入	式 比 率	株先	物	比	式率	投証組	 信影率
	(期 首)			円	/4///9	%	(1)	<i>-</i> 1 1	11)	/4///9	TH	%			%				%	//12	 %
201	8年8月3	日		21,818		_		1, 742	2. 58			_			94. 3				_		4.4
	8月末			21, 518		△ 1.4		1, 735	5. 35		Δ	0.4			94. 9				_		4.1
	9月末			22, 692		4.0		1,817	7. 25			4.3			93. 9				_		4.0
	10月末			20, 792		△ 4.7		1,646	5. 12		\triangle	5.5			93.4				_		4.2
	11月末			20, 521		△ 5.9		1,667	45		\triangle	4.3			93.6						4.2
	12月末			18,666		△14.4		1, 494	l. 09		\triangle	14.3			94.7				_		4.2
20	19年1月末	ŧ		19,681		△ 9.8		1,567	7.49		\triangle	10.0			95. 0				_		4. 2
	(期 末)			•		•									<u> </u>						
201	9年2月4	目		19, 796		△ 9.3		1,58	. 33		Δ	9.3			95. 1				_		4.2

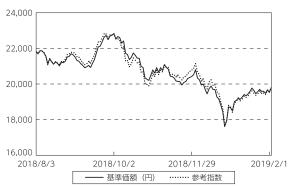
- (注)騰落率は期首比。
- (注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率 売建比率。

○運用経過

- ●当期中の基準価額等の推移について
- ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ9.3%の下落となりました。

基準価額等の推移



(注) 参考指数は期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

- ・期首から2018年10月上旬にかけては、米中間での貿易協議再開への期待が高まったことや自民党総裁選における安倍首相の再選、為替が円安・米ドル高に推移したことなどが好感され国内株式市況は上昇しました。
- 10月中旬から12月下旬にかけては、米国の長短金利差が縮小し景気減速懸念が強まったことや米中関係の悪化が懸念されたことなどに加えて、マティス米国防長官の辞意表明や予算失効に伴う米政府機関の一部閉鎖など、米国の政治不安が拡大したことなどを受けて、国内株式市況は下落しました。
- ・2019年1月上旬から期末にかけては、パウエル 米連邦準備制度理事会(FRB)議長が金融引 き締めを急がない姿勢を示し利上げ観測が後退 したことや米中間の通商交渉が進展するとの期 待が高まったことなどから、国内株式市況は上 昇しました。

- ●当該投資信託のポートフォリオについて
- ・株式組入比率は、運用の基本方針にしたがい、 高水準を維持しました。
- ・銘柄選択にあたっては、予想配当利回りが市場 平均を上回る銘柄の中から、株価の値上がり益 が期待できる銘柄を厳選して投資しました。
- ・組入銘柄数は概ね80~90銘柄程度で推移させました。株価水準や予想配当利回り水準等を勘案し、銘柄入れ替えを機動的・継続的に行いました。当期では、臨時株主総会においてシャイアー社の買収が承認された武田薬品工業など27銘柄を新規に組み入れました。また、キヤノンなど20銘柄を全売却しました。新規組入と全売却をした主な銘柄のポイントは以下の通りです。

◎新規組入銘柄

・武田薬品工業:臨時株主総会においてシャイアー社の買収が承認され、今後は予想配当利回りなどで見た割安感が注目されることを期待し、新規で組み入れました。

◎全売却銘柄

・キヤノン:デジタルカメラ市場の縮小やそれに 伴う競争激化を背景とした収益悪化などが懸念 されることから、全売却しました。

以上の投資判断の結果、組入銘柄の株価下落により、基準価額は下落しました。パフォーマンス に寄与・影響した主な銘柄は以下の通りです。

(プラス要因)

◎銘柄

・リソー教育:積極的な株主還元姿勢などを評価 し、期首より保有していました。主力事業の個 別指導塾に加え幼児教育事業が好調に推移して いることなどが好感され、株価は堅調に推移、 プラスに寄与しました。

(マイナス要因)

◎銘柄

- ・SUBARU:予想配当利回り水準の高さなどから、期中に組み入れました。品質関連費用の増加などが嫌気され株価は軟調に推移、マイナスに影響しました。
- ・住友金属鉱山:予想配当利回り水準の高さなど から期首より保有していました。非鉄金属市況 が軟調に推移したことなどが嫌気され、株価は 軟調に推移、マイナスに影響しました。

〇今後の運用方針

◎運用環境の見通し

◎今後の運用方針

・今後も企業調査を十分に行い、予想配当利回りの高い銘柄を中心に投資し、「高水準の配当収入」と「中長期的な株価の値上がり益」の獲得をめざす基本方針を継続します。加えて、財務の健全性や株式の流動性に留意しながら、保有銘柄の比率調整や新規銘柄の組み入れを行います。

〇1万口当たりの費用明細

(2018年8月4日~2019年2月4日)

	項	ī		目			当	其	Fl.		項	В	Ø	概	要
	巧	Į		Ħ		金	額	比	率		垬	Ħ	0)	恢	— 发 ————————————————————————————————————
							円		%						
(a)	売	買 委	託	手 数	料		15	0.	071						中の平均受益権口数 ふわれる手数料
	(株式)		(15)	(0.	071)							
	(投資信託証券)		(0)	(0.	001)						
(b)	そ	0)	他	費	用		0	0.	000	(b) その他費用	月=期中の	のその他	費用÷期	中の平均勢	受益権口数
	(そ	Ø	他)		(0)	(0.	000)	信託事務の処	理等に要	うるその	他諸費月	1	
	合			計			15	0.	071						
	期中の平均基準価額は、					20, 656	円です	0							

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

〇売買及び取引の状況

(2018年8月4日~2019年2月4日)

株式

		買	付			売	付	
	株	数	金	額	株	数	金	額
国		千株		千円		千株		千円
上場		2,084	3,	538, 557		1,891	3, 3	366, 641
内		(128)	(-)				

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

新株予約権証券

		買	付			売	付	
	証	券 数	金	額	証	券 数	金	額
		証券		千円		証券		千円
国内		_		_		10, 200		2,284
		(10, 200)		(-)				

- (注) 金額は受渡代金。
- (注)()内は株主割当および権利行使等による増減分です。

投資信託証券

	銘	拇		買	付			売	付	
	逝	柄	口	数	金	額	П	数	金	額
				千口		千円		千口		千円
	アドバンス・レジ	デンス投資法人		_		_		0.05		14, 289
玉	インベスコ・オフィ	ス・ジェイリート投資法人		0.088		1,432		0.644		10,050
	ラサールロジポー	- ト投資法人		0.006		641		0.031		3, 253
	オリックス不動産	投資法人		0.003		535		0.099		17,605
内	グローバル・ワン	不動産投資法人		0.007		818		0.055		6,541
	ユナイテッド・ア	ーバン投資法人		0.008		1,404		0.06		10, 713
	ケネディクス・オ	フィス投資法人		_		_		0.01		6,951
	合	≕		0.112		4,833		0.949		69, 405

⁽注) 金額は受渡代金。

〇株式売買比率

(2018年8月4日~2019年2月4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	E	当期	
(a) 期中の株式売買金額			6,905,198千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額			6,811,507千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)			1.01

⁽注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

〇利害関係人との取引状況等

(2018年8月4日~2019年2月4日)

利害関係人との取引状況

		四八烯林			士山城が		
区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{\mathrm{D}}{\mathrm{C}}$
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式		3, 538	991	28.0	3, 366	1,053	31.3
投資信託証券		4	0.706147	17. 7	69	21	30. 4

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
				百万円			百万円	百万円
株式				156			19	174

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当期
売買委託手数料総額(A)	5,165千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,536千円
(B) / (A)	29.7%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱 UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、モルガン・スタンレーMUFG証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2019年2月4日現在)

国内株式

銘	柄	期首(前	前期末)	当	其	期 末		
狆	173	株	数	株	数	評価額		
			千株		千株	千円		
建設業 (6.2%)						1		
ウエストホールディン	グス		-		21	25, 662		
ミライト・ホールディ	ングス		34. 1		35	56, 595		
安藤・間			82. 9		_	_		
西松建設			13		_	_		
熊谷組			21.4		_	_		
大東建託			_		4.8	72, 264		
大和ハウス工業			11		_	_		
ライト工業			_		69. 7	94, 582		
積水ハウス			34. 9		_	_		
中電工			20.8		_	_		
協和エクシオ			_		18	49, 266		
新興プランテック			83. 3		86. 5	108, 211		
化学 (5.0%)								
デンカ			13. 9		4.6	15, 893		
三菱ケミカルホールデ	ィングス		101. 7		112. 1	104, 645		
アイカ工業			9.6		17. 4	67, 773		
東洋インキSCホール・	ディングス		18.7		_	_		
ポーラ・オルビスホー	ルディングス		_		22. 2	72, 927		
有沢製作所			57. 5		43. 7	36, 576		
バルカー			18.7		14. 4	32, 889		
医薬品 (6.8%)								
武田薬品工業			_		71.8	319, 725		
田辺三菱製薬			37. 9		_	_		
沢井製薬			17. 7		5. 9	33, 217		
キョーリン製薬ホール	ディングス		_		40	93, 200		
石油・石炭製品(1.6%	6)							
出光興産			43. 7		26. 1	102, 312		
JXTGホールディン	グス		119. 9		_	_		
ガラス・土石製品(0.4	4%)							
ニチアス			_		13. 4	26, 237		
鉄鋼 (1.6%)								
ジェイ エフ イー ホ	ニールディングス		_		36. 8	71, 392		
日本冶金工業			_		122. 4	31, 089		

		期首(前期末)	当	朝 末		
銘	柄	株 数	株 数	評価額		
		千株	千株	千円		
非鉄金属 (1.0%)						
日本軽金属ホールディン	グス	205. 6	_	_		
住友金属鉱山		45. 1	21. 3	66, 583		
金属製品 (0.5%)						
トーカロ		_	38. 1	36, 042		
機械 (3.9%)						
小松製作所		_	48. 2	132, 309		
マックス		23. 7	20. 3	30, 348		
ツバキ・ナカシマ		28. 2	28. 9	50, 488		
スター精密		24. 8	25. 5	40, 647		
電気機器 (3.4%)						
マブチモーター		_	17. 7	68, 676		
IDEC		24. 8	29	56, 811		
мс Ј		_	92. 1	65, 483		
エスペック		_	17. 3	34, 686		
キヤノン		72. 3	_	_		
東京エレクトロン		6. 1	_	_		
輸送用機器 (8.6%)						
日産自動車		183. 7	_	_		
トヨタ自動車		59. 9	58. 3	392, 125		
アイシン精機		_	16	69, 600		
本田技研工業		41. 4	_	_		
SUBARU		_	41.9	106, 949		
精密機器 (0.3%)						
タムロン		_	9. 9	17, 691		
電気・ガス業 (3.3%)						
中部電力		_	44. 4	72, 993		
東北電力		78. 9	99. 4	142, 738		
陸運業(1.1%)						
センコーグループホール	ディングス	45. 3	84. 9	74, 627		
空運業(1.2%)						
日本航空		20. 1	20. 1	82, 088		
倉庫・運輸関連業(1.19	6)					
住友倉庫		_	49. 9	70, 109		

Dift	4st	期首(前期末)	当	期 末		
銘	柄	株 数	株 数	評価額		
		千株	千株	千円		
情報・通信業 (8.7%)						
コーエーテクモホール・	ディングス	35. 7	40. 1	74, 425		
トレンドマイクロ		6. 4	11. 9	69, 258		
日本電信電話		26. 1	30. 4	144, 248		
KDDI		22. 4	_	_		
沖縄セルラー電話		5. 9	5. 6	21, 616		
NTTドコモ		126. 3	100. 2	261, 021		
卸売業 (14.3%)						
TOKAIホールディ	ングス	79. 5	112	101, 136		
コメダホールディング	ス	21. 4	30. 1	63, 210		
伊藤忠商事		165. 5	111.8	221, 587		
丸紅		_	125. 2	105, 556		
兼松		51. 1	47.6	63, 641		
三井物産		62. 5	_	_		
住友商事		125	33. 5	56, 430		
三菱商事		_	79. 6	248, 829		
阪和興業		19	2. 4	7, 356		
サンゲツ		_	16. 3	33, 855		
日鉄住金物産		13.8	_	_		
オートバックスセブン		27. 1	_	_		
因幡電機産業		8. 2	8. 2	37, 720		
小売業 (1.6%)						
VTホールディングス		54	80. 1	34, 923		
ヤマダ電機		200. 6	135. 9	73, 657		
銀行業 (8.4%)						
あおぞら銀行		74. 7	_	_		
三菱UFJフィナンシ	ャル・グループ	_	189. 4	109, 624		
りそなホールディング	ス	241. 5	245. 8	131, 453		
三井住友フィナンシャ	ルグループ	76. 2	77. 4	308, 284		

N/+	£r*	期首(前期末)	当 其	東 末		
銘	柄	株 数	株 数	評価額		
		千株	千株	千円		
証券、商品先物取引	業(1.5%)					
SBIホールディン	/ グス	_	45. 5	99, 963		
保険業 (4.9%)						
ソニーフィナンシャ	ルホールディングス	84. 5	103. 2	218, 371		
東京海上ホールディ	ングス	24. 7	19. 4	104, 604		
その他金融業 (4.3	%)					
日本証券金融		117. 7	121. 2	74, 174		
イオンフィナンシャ	・ルサービス	28. 9	34. 7	73, 008		
目立キャピタル		25. 6	26. 3	64, 435		
オリックス		65. 7	72, 742			
不動産業 (3.2%)						
日本駐車場開発		_	114.8	18, 827		
野村不動産ホールラ	ディングス	30. 1	30.8	64, 803		
サムティ		14. 1	_			
フージャースホール	·ディングス	35. 7	59. 4	39, 798		
パーク24		27. 2	24. 3	64, 905		
フジ住宅		22. 7	22. 5	19, 147		
サービス業 (7.1%))					
ジェイエイシーリク	ルートメント	20. 9	17. 9	39, 809		
アルプス技研		_	17. 3	30, 102		
リソー教育		43	193. 6	89, 056		
日本郵政		58	77. 4	104, 335		
ベルシステム24オ	ベールディングス	36. 9	12. 7	18, 529		
丹青社		81. 7	112, 912			
メイテック		9. 2	74, 518			
合 計	株数・金額	3, 770	4, 091	6, 577, 339		
	銘柄数 < 比率 >	70	77	<95.1%>		

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

国内投資信託証券

銘	141	期首(前	期末)			当	期	末		
季 白	柄	П	数	П	数	評	価 額	Į	比	率
			千口		千口			千円		%
アドバンス・レジデンス	投資法人		0.122		0.072		23	3,004		0.3
日本リート投資法人			0.063		0.063		24	4, 759		0.4
インベスコ・オフィス・	ジェイリート投資法人		1		1		19	9, 103		0.3
ラサールロジポート投資	法人		0.179		0.154		16	6,678		0.2
ジャパンリアルエステイ	ト投資法人		0.094		0.094		60	0, 254		0.9
オリックス不動産投資法	人		0.214		0.118		22	2, 384		0.3
グローバル・ワン不動産	投資法人		0.201		0.153		19	9,063		0.3
ユナイテッド・アーバン	投資法人		0.247		0.195		34	4, 144		0.5
ケネディクス・オフィス	ケネディクス・オフィス投資法人				0.056		4	1,664		0.6
大和証券オフィス投資法	人		0.041		0.041		30	0,381		0.4
습 計・	口数・金額		2		2		29	1,436		
T T	銘 柄 数<比 率>		10		10		< 4. 2	2%>		

⁽注) 比率および合計欄の〈 >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

〇投資信託財産の構成

(2019年2月4日現在)

項目	当	末
項目	評 価 額	比率
	千円	%
株式	6, 577, 339	94.6
投資証券	291, 436	4. 2
コール・ローン等、その他	81, 567	1.2
投資信託財産総額	6, 950, 342	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年2月4日現在)

項 目 当 期 末 円 (A) 資産 6, 950, 342, 607 コール・ローン等 36, 676, 160 株式(評価額) 6, 577, 339, 480 投資証券(評価額) 291, 436, 890 未収入金 32, 666, 507 未収配当金 12, 223, 570 (B) 負債 36, 021, 792 未払金 33, 928, 258 未払解約金 2,093,323 未払利息 31 その他未払費用 180 (C) 純資産総額(A-B) 6, 914, 320, 815 元本 3, 492, 702, 518 次期繰越損益金 3, 421, 618, 297 (D) 受益権総口数 3, 492, 702, 518 🗆

<注記事項>

①期首元本額 3,525,148,163円 期中追加設定元本額 195,955,239円 期中一部解約元本額 228,400,884円 また、1口当たり純資産額は、期末1.9796円です。

1万口当たり基準価額(C/D)

〇損益の状況

(2018年8月4日~2019年2月4日)

	項目	当 期
		円
(A)	配当等収益	110, 347, 578
	受取配当金	110, 271, 401
	受取利息	84
	その他収益金	102, 338
	支払利息	△ 26, 245
(B)	有価証券売買損益	△ 821, 132, 487
	売買益	181, 693, 134
	売買損	$\triangle 1,002,825,621$
(C)	保管費用等	△ 724
(D)	当期損益金(A+B+C)	△ 710, 785, 633
(E)	前期繰越損益金	4, 165, 855, 741
(F)	追加信託差損益金	207, 147, 661
(G)	解約差損益金	△ 240, 599, 472
(H)	$\ddagger(D+E+F+G)$	3, 421, 618, 297
	次期繰越損益金(H)	3, 421, 618, 297

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- (注) (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) (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。

②期末における元本の内訳 (当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

19.796円

三菱UFJ 好配当日本株ファンド(2ヵ月決算型) 2,945,921,154円 好配当日本株ファンド(ラップ向け) 43,931,639円 国内株式セレクション(ラップ向け) 502,849,725円 合計 3,492,702,518円



JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド

《第4期》決算日2019年1月28日

[計算期間: 2018年1月27日~2019年1月28日]

「JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド」は、1月28日に第4期の決算を行いました。 以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第4期の運用状況をご報告申し上げます。

運	用	方	ī		主としてわが国の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)に投資を行い、iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。
主	要運	用	対	象	わが国の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)を主要投資対象とします。
主	な組	入	制	限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

〇設定以来の運用実績

>h.	杏	###	基	準	価		額	iSTOXX M ¹ クオリティ15	IUTB JAPAN 50インデックス				式				式		資	産		
決	算	期			期騰	落	中率		期騰	落	中率	組	入	比	率	先	物	比	率	総		額
(設定	(日)			円			%				%				%				%		百万	万円
20	15年11月(6 日		10,000			_	166. 32			_				_				_			299
1期(2016年1月	月26日)		8, 905		$\triangle 1$	1.0	148. 04		$\triangle 1$	1.0			96	6.9			3	3. 1			444
2期(2017年 1丿	月26日)		10, 267		1	5. 3	167. 04		1	2.8			98	3. 2			1	. 2		1,	322
3期(2018年1月	月26日)		13, 199		2	8.6	210. 69		2	6. 1			99	0.6			1	. 0		1,	840
4期(2019年1月	月28日)		11, 105		$\triangle 1$	5.9	173. 82		$\triangle 1$	7.5			98	3. 7			1	. 3		2,	333

- (注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
- (注)iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスとは、東京証券取引所を主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、流動性によりスクリーニングされる投資ユニバースのうち、高ROEかつ、①財務健全性、②キャッシュフロー収益性、③利益安定性の3点に着目し、高ROEの継続性を評価して150銘柄を選定し算出される株価指数です。iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスは、三菱UFJ信託銀行が有するアクティブ運用機関としてのノウハウとSTOXXリミテッド(以下「STOXX社」)が有する指数提供機関としての経験を活用し、両社で共同開発したものです。2001年6月18日の時価総額を100として、STOXX社が算出・公表しています。STOXX社は、iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス及びそれに含まれるデータの発行元です。STOXX社は、報告された情報の作成に何ら関与するものではなく、かつ報告された情報、又はiSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス及びそれに含まれるデータの発行元です。STOXX社は、報告された情報の作成に何ら関与するものではなく、かつ報告された情報、又はiSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス若しくはそのデータに関するエラー、遺漏若しくは中断について、何ら保証するものではなく、(過失の有無を問わず)いかなる責任も負うものではありません。これらについては、正確性、妥当性、完全性、適時性及び目的への適合性を含みますが、これらに限定されません。STOXX社に関係する情報の流布又は再配信は、一切禁止されています。
- (注)上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率 売建比率。
- (注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

〇当期中の基準価額と市況等の推移

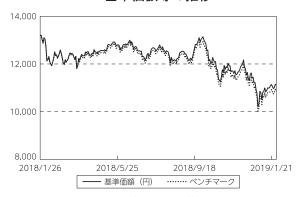
年	月	月	基	準	価		額	i STOXX MU クオリティ15	UTB 0イン	JAP. ゲック	AN カス	株织	7	Lile	式率	株先	tl-/m	Lle	式
					騰	落	率		騰	落	率	組	入	比	半	尤	物	比	率
	(期 首)			円			%				%				%				%
2	018年1月26日	1		13, 199			_	210.69			_			9	9.0				1.0
	1月末			12,875		Δ	2.5	205. 49		\triangle	2.5			9	9.0				1.0
	2月末			12, 439		Δ	5.8	198. 40		Δ	5.8			9	9.1				0.9
	3月末			12, 404		Δ	6.0	196. 67		Δ	6.7			9	8.5				1.6
	4月末			12, 564		Δ	4.8	199. 12		Δ	5.5			9	8.3				1.6
	5月末			12,686		Δ	3.9	201. 04		Δ	4.6			9	8.4				1.5
	6月末			12, 538		Δ	5.0	198. 34		Δ	5.9			9	9.2				0.8
	7月末			12,627		Δ	4.3	199. 75		Δ	5.2			9	9.2				0.8
	8月末			12, 525		Δ	5.1	198. 06		Δ	6.0			9	9.4				0.8
	9月末			13,036		Δ	1.2	204. 81		Δ	2.8			9	8.4				1.6
	10月末			11,759		\triangle	10.9	184. 61		\triangle	12.4			9	9.2				1.5
	11月末			11, 998		Δ	9.1	188. 29		\triangle	10.6			9	8.6				1.4
	12月末			10, 780		\triangle	18.3	168. 74		Δ	19.9			9	9.3				0.7
	(期 末)																		
2	019年1月28日	1		11, 105		\triangle	15.9	173. 82		\triangle	17.5			9	8.7				1.3

- (注)騰落率は期首比。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

〇運用経過

- ●当期中の基準価額等の推移について
- ◎基準価額の動き 基準価額は期首に比べ15.9%の下落となりました。
- ◎ベンチマークとの差異ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(-17.5%)を1.6%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎国内株式市況

米国長期金利上昇や景気後退懸念の台頭等による米国株式の下落や、国内企業の業績上方修正期 待がしぼんだこと等を受け、国内株式市況は下落 しました。

- ●当該投資信託のポートフォリオについて
- ・資産のほぼ全額を株式(先物を含む)に投資しました。
- 株式ポートフォリオはベンチマークである iSTOXX MUTB JAPAN クオリ ティ150インデックスの個別銘柄構成比率に 合わせて構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について ベンチマークは17.5%の下落となったため、カ イ離は1.6%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

・配当要因* 1.9%

※ベンチマークが配当相当分を含まないインデックスであることによって生じるプラス要因です。

(主なマイナス要因)

・取引コスト要因

〇今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざ して運用を行います。

〇1万口当たりの費用明細

(2018年1月27日~2019年1月28日)

	項	î		目			当	其	Fl.		項		Ø	概	要
	均	l .		Ħ		金	額	比	率		快	Ħ	V)	713/1.	女
							円		%						
(a)	売	買 委	託	手 数	料		0	0.	004						中の平均受益権口数 われる手数料
	(株		式)		(0)	(0.	000)						
	(5	先物 •	オフ	゚ショ	ン)		(0)	(0.	004)						
(b)	そ	0)	他	費	用		0	0.	000	(b) その他費	別=期中	のその他的	費用÷期	中の平均	受益権口数
	(そ	Ø	他)		(0)	(0.	000)	信託事務の	処理等に要	きするその	他諸費用		
	合			計			0	0.	004						
	期中の平均基準価額は、12,216円です。														

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

〇売買及び取引の状況

(2018年1月27日~2019年1月28日)

株式

		買	付			売	付	
	株	数	金	額	株	数	金	額
国		千株		千円		千株		千円
上場		817	2,	509, 517		608	1,	640, 135
内		(△ 59)	(-)				

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

先物取引の種類別取引状況

	呑	絽	Bil	買	建	売	建
	種	狽	別	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
玉				百万円	百万円	百万円	百万円
内	株式先物取引			1, 215	1, 197	118	118

〇株式売買比率

(2018年1月27日~2019年1月28日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項	E	当	期
(a) 期中の株式売買金額			4, 149, 652千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額			2,174,058千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)			1.90

⁽注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

〇利害関係人との取引状況等

(2018年1月27日~2019年1月28日)

利害関係人との取引状況

		四八烷炔			士山蛎炊			
区	分	買付額等 A	うち利害関係人	<u>B</u>	売付額等 C	うち利害関係人	$\frac{D}{C}$	
			との取引状況B	A	_	との取引状況D	С	
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%	
株式		2, 509	269	10.7	1,640	183	11.2	

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱 UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFG証券です。

○組入資産の明細

(2019年1月28日現在)

国内株式

銘	柄	期首(前期末)	当	其	用 末
鄞	fr3	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
建設業 (1.1%)						1
大成建設			2.8		_	_
長谷工コーポレーショ	ン		3. 7		_	_
鹿島建設			13		_	_
西松建設			0.7		_	_
前田建設工業			2. 1		_	_
大東建託			0.9		1. 2	18, 036
五洋建設			3. 5		_	_
大和ハウス工業			8. 2		_	_
協和エクシオ			1.2		1.5	3, 948
九電工			0.7		0.8	3, 028
食料品 (7.7%)						
森永製菓			0.6		_	_
カルビー			1		1.3	4, 537
ヤクルト本社			_		2. 3	16, 399
明治ホールディングス			1.8		2. 2	18, 392
アサヒグループホール	ディングス		5. 7		7	29, 799
キリンホールディング	ス		11.3		14	35, 945
サントリー食品インタ	ーナショナル		_		1. 9	9, 224
伊藤園			0.8		_	_
キッコーマン			_		3	16, 650
日本たばこ産業			9. 4		16.8	46, 107
繊維製品 (0.1%)						
ゴールドウイン			_		0.3	3, 177
化学(12.6%)						
旭化成			17.3		21.5	25, 445
昭和電工			_		2. 3	8, 349
日産化学			1.9		2. 3	13, 087
東ソー			4		5	7, 645
信越化学工業			-		5. 2	47, 418
三菱瓦斯化学			2.7		3. 3	5, 639
JSR			2. 5		_	_
三菱ケミカルホールデ	ィングス		18.6		_	_
ダイセル			4. 3		5. 4	6, 058

1		1		
銘	柄	期首(前期末)		
		株数	株数	評価額
*** 1. 11. 324 → 384		千株		千円
積水化学工業		5. 6		11, 516
日本ゼオン		2. 5		_
アイカ工業		0.8		
日油		1.1		4, 537
花王		4.5		44, 899
資生堂		_	6. 1	38, 655
ライオン		3. 7		10, 143
ファンケル		_	1. 6	3, 918
コーセー	. 10	0. 4		9, 510
シーズ・ホールディン		_	0. 3	1, 764
ポーラ・オルビスホー	ルアインクス	1. 2		4, 560
小林製薬		0.8		6, 210
日東電工		2		14, 512
ニフコ		0.6		3, 954
ユニ・チャーム		5. 3	7. 1	23, 039
医薬品 (7.5%)		04.5	00.6	40.700
アステラス製薬		24. 7	28. 6	43, 729
大日本住友製薬		2. 1	4.7	20 572
塩野義製薬		3.8		30, 573
日本新薬		0.8		01 010
中外製薬 科研製薬		2.8		21, 318
イザイ エーザイ		0. 5		3, 054
小野薬品工業		5. 8	4. 5 7. 9	38, 835 18, 363
		5. 0		
◇人袋架 ペプチドリーム			6. 2 1. 5	9, 238 6, 787
ゴム製品 (1.9%)			1. 5	0, 101
ブリヂストン		7	10. 5	44, 425
ブラクストン ガラス・土石製品 (1.	0%)	· '	10.0	11, 120
東海カーボン	0,0,	_	3. 3	4, 996
TOTO		2. 1	2. 6	10, 569
日本特殊陶業		2.1	3. 2	7, 164
金属製品 (0.2%)			0.2	1,101
SUMCO		_	3. 6	5, 403

Ne	LT.	期首(前期末)	当	期末
銘	柄	株 数	株 数	対 評価額
		千树	手	株
三和ホールディングス		2.9)	
機械 (5.8%)				
オークマ		_	0	. 5 2, 835
ディスコ		0.	1 0	. 5 7, 925
島精機製作所		0.	1	
ナブテスコ		1.	5 1	. 9 5, 367
SMC		0.8	3	1 36, 700
クボタ		14. (5	
ダイキン工業		2.	7 3	. 8 44, 441
ダイフク		1.	5 1	. 9 10, 241
CKD		0.8	3	
竹内製作所		0.	5 0	. 6 1, 168
ホシザキ		0.	7 0	. 9 7, 038
ТНК		1. (5	
マキタ		-	4	. 3 16, 791
電気機器 (19.7%)				
ブラザー工業		3. 2	2	4 7, 332
ミネベアミツミ		5.	3	
日立製作所		-	14	. 7 50, 376
富士電機		9	9	
安川電機		3.	3 4	. 1 12, 771
マブチモーター		0.8	3	1 3, 780
日本電産		-	3	. 4 43, 928
オムロン		2. (3	. 3 14, 602
富士通		-	3	. 2 23, 593
アルバック		0.0	0	. 7 2, 488
富士通ゼネラル		0.8	3	
ソニー		-	. 8	. 1 43, 521
アルプスアルパイン		2.	1 3	. 5 8, 043
日本航空電子工業		_	0	. 9 1, 288
アズビル		0. 9	2	5, 096
堀場製作所		0.	0	. 7 3, 717
アドバンテスト		-	3	. 1 7, 467
キーエンス		0. (0	. 8 43, 976
シスメックス		2. 3	2	. 7 16, 286
レーザーテック		-	0	. 7 2, 415
スタンレー電気		1.9	2	. 4 7, 728
ファナック		1.	3 2	52, 290
浜松ホトニクス		-	2	. 2 8, 305

		期者(前期末)	当	Į.	用 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
		PIN	千株	PI	千株	手円
村田製作所			2. 4		2. 9	43, 195
小糸製作所			1.6		2	12, 660
SCREENホールディン	グス		0.6		_	_
東京エレクトロン			1. 7		2. 5	38, 800
輸送用機器 (7.1%)						
トヨタ紡織			1. 1		1. 3	2, 262
いすゞ自動車			7. 7		9. 5	15, 261
トヨタ自動車			_		7	46, 823
アイシン精機			2. 3		2.8	12, 236
スズキ			5. 4		7. 1	40, 441
SUBARU			7. 9		9.8	24, 524
ヤマハ発動機			3.8		_	_
シマノ			1. 1		1. 3	19, 695
テイ・エス テック			0.6		0.8	2, 636
精密機器 (4.0%)						
テルモ			4. 1		5. 5	33, 643
島津製作所			3. 4		4. 2	10, 399
東京精密			0.5		0.6	1,866
オリンパス			4		_	_
НОҮА			4.8		5.8	36, 099
朝日インテック			1.5		2	9, 170
その他製品(1.6%)						
バンダイナムコホールディ	ングス		2. 7		3. 4	15, 980
タカラトミー			1. 1		_	_
ヤマハ			_		2.6	12, 142
ピジョン			1.5		1. 9	7, 733
陸運業 (0.2%)						
東海旅客鉄道			1. 7		_	_
山九			_		0.9	4, 680
空運業 (0.9%)						
日本航空			4. 4		5. 3	20, 807
ANAホールディングス			4. 3		_	_
情報・通信業(10.7%)						
TIS			_		1. 3	6, 123
ネクソン			2. 4		7. 3	12, 088
GMOペイメントゲートウ	エイ		_		0.6	3, 216
野村総合研究所			1.8		2	9, 050
オービック			0.9		1. 1	9, 845
ヤフー			15. 1		40.9	11, 983

N4-	1-2	期首(前	期末)	当	其	Я	末
銘	柄	株	数	株	数	評(西 額
			千株		千株		千円
トレンドマイクロ			1.6		2	1	2,840
日本オラクル			0.4		0.5		3, 825
伊藤忠テクノソリューシ	ョンズ		0.7		1.6		3, 552
大塚商会			0.8		2		6, 760
日本ユニシス			1		1.2		3,020
日本電信電話			_		10.3	4	7, 678
KDDI			10. 9		18. 2	4	8, 739
光通信			0.3		0.4		6, 808
NTTドコモ			12. 2		18. 4	4	7, 334
東宝			1.7		_		_
スクウェア・エニックス・ホ	ールディングス		1.1		_		_
カプコン			0.6		1.5		3, 424
SCSK			0.7		0.8		3, 460
コナミホールディングス			1.3		1.5		7, 530
卸売業 (0.7%)							
神戸物産			_		0.5		1,692
第一興商			0.6		0.7		3, 633
ミスミグループ本社			3. 5		4. 3	1	0, 750
小売業 (4.8%)							
ローソン			0.6		_		_
エービーシー・マート			0.4		0.5		3, 080
MonotaRO			0.8		2. 1		5, 050
マツモトキョシホールデ	ィングス		1. 1		1.6		5, 368
ウエルシアホールディン	グス		0.6		0.8		3, 172
すかいらーくホールディ	ングス		1.5		_		_
コスモス薬品			0.1		0.2		3, 998
ツルハホールディングス			-		0.7		6, 776
クスリのアオキホールデ	ィングス		-		0.3		2, 109
良品計画			0.3		0.4		9, 728
ドンキホーテホールディ	ングス		1.4		_		_
スギホールディングス			0.6		0.7		3, 139
アインホールディングス			0.3		0.5		3, 965
ニトリホールディングス			1.2		1.4	1	9, 663
ファーストリテイリング			0.8		0.8	4	0, 136
サンドラッグ			0.9		1		3, 430
銀行業(一%)							
めぶきフィナンシャルグ	ループ		13		_		-

株 数 株 数 評価額	N/+	£rr*	期首(前期末)	当	其	用 末
スルガ銀行 2.9	蹈	PS	株	数	株	数	評価額
世ガン銀行 9.1 - 一				千株		千株	千円
正券、商品先物取引業 (-%) ジャフコ	スルガ銀行			2. 9		_	_
ジャフコ	セブン銀行			9. 1		_	_
保険業 (5.2%) SOMPのホールディングス	証券、商品先物取引	業 (-%)					
SOMP Oホールディングス	ジャフコ			0.4		_	_
ソニーフィナンシャルホールディングス - 2.5 5,155 第一生命ホールディングス - 18.4 32,227 東京海上ホールディングス - 9.4 12,769 その他金融業(0.8%) - 9.4 12,769 全国保証 0.6 0.8 3,052 日本取引所グループ 6.8 8.2 16,145 不動産業(0.4%) - 1.4 1.9 4,953 サービス業(6.0%) - 1.2 4,752 サービス業(6.0%) - 1.2 4,752 サービス業(6.0%) - 1.2 4,752 サービス業(6.0%) - 1.2 4,752 サービス業(6.0%) - 1.1 1,896 ボーソルホールディングス 2.4 - - カカコム 1.7 2 3,730 エムスリー 2.6 6.6 10,256 アウトソーシング 1 - - ディー・エヌ・エス 3.1 3.6 6,667 薬犬 - 12.5 10,487 コー・エス・エス・エス・エス・エス・エス・エス・エス・エス・エス・エス・エス・エス・	保険業 (5.2%)						
第一生命ホールディングス	SOMPOホールラ	ディングス		_		5. 7	22, 925
東京海上ホールディングス	ソニーフィナンシャ	ルホールディングス		_		2. 5	5, 155
T&Dホールディングス - 9.4 12,769 その他金融業 (0.8%) 全国保証	第一生命ホールディ	・ングス		_		18. 4	32, 227
をの他金融業 (0.8%) 全国保証	東京海上ホールディ	・ングス		_		9	47, 565
全国保証 0.6 0.8 3,052 日本取引所グループ 6.8 8.2 16,145 不動産業 (0.4%) パーク2 4 1.4 1.9 4,953 サービス業 (6.096) 日本空港ビルデング - 1.2 4,752 サービス業 (6.096) 日本M&Aセンター 0.8 2.2 5,616 エス・エム・エス 0.4 1.1 1,896 ボールディングス 2.4 - - カカクコム 1.7 2 3,730 エムスリー アウトソーシング 1 - - ディー・エヌ・エス 1.4 - - - 中職製室DYホールディングス - 4.8 7,852 オリエンタルランド 2.8 3.5 37,887 コー・エス・エス・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - - <td< td=""><td>T&Dホールディン</td><th>/グス</th><td></td><td>_</td><td></td><td>9.4</td><td>12, 769</td></td<>	T&Dホールディン	/ グス		_		9.4	12, 769
日本取引所グループ 6.8 8.2 16,145 不動産業 (0.4%) パーク24 1.4 1.9 4,953 レオパレス21 3.1	その他金融業 (0.8	%)					
不動産業 (0.4%) パーク24 レオパレス21 日本空港ビルデング サービス業 (6.0%) 日本M&Aセンター エス・エム・エス ハーソルホールディングス カカクコム エムスリー アウトソーシング アウトソーシング アウトソーシング アウトソーシング アウトソーシング スポー・エヌ・エー 博報堂DYホールディングス カリエンタルランド コーー 「神報堂DYホールディングス カリー・エス・エス カリー・カー・カー・カー・カー・カー・カー・カー・カー・カー・カー・カー・カー・カー	全国保証			0.6		0.8	3, 052
パーク24	日本取引所グループ	ŕ		6.8		8. 2	16, 145
レオパレス 2 1 3.1 - 1.2 4,752 サービス業 (6.0%) 日本M&Aセンター 0.8 2.2 5,616 エス・エム・エス 0.4 1.1 1,896 パーソルホールディングス 2.4 カカクコム 1.7 2 3,730 エムスリー 2.6 6.6 10,256 7ウトソーシング 1 グアイ・エヌ・エー 1.4 「博報堂DYホールディングス 2.8 3.5 37,887 ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス カナモト 6 排 株 数・金額 467 618 2,303,401	不動産業 (0.4%)						
日本空港ビルデング - 1.2 4,752 サービス業 (6.0%) 日本M&Aセンター 0.8 2.2 5,616 エス・エム・エス 0.4 1.1 1,896 パーソルホールディングス 2.4 クカクコム 1.7 2 3,730 エムスリー 2.6 6.6 10,256 アウトソーシング 1 グディー・エヌ・エー 1.4 博報堂DYホールディングス - 4.8 7,852 オリエンタルランド 2.8 3.5 37,887 ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス カナモト - 0.6 1,809	パーク24			1.4		1.9	4, 953
サービス業 (6.0%) 日本M&Aセンター 0.8 2.2 5,616 エス・エム・エス 0.4 1.1 1,896 パーソルホールディングス 2.4 - - カカクコム 1.7 2 3,730 エムスリー 2.6 6.6 10,256 アウトソーシング 1 - - ディー・エヌ・エー 1.4 - - 博報堂DYホールディングス - 4.8 7,852 オリエンタルランド 2.8 3.5 37,887 ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス - 0.6 3,276 リログルートホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 株数・金額 467 618 2,303,401	レオパレス21			3. 1		_	_
日本M&Aセンター 0.8 2.2 5,616 エス・エム・エス 0.4 1.1 1,896 パーソルホールディングス 2.4 — — カカクコム 1.7 2 3,730 エムスリー 2.6 6.6 10,256 アウトソーシング 1 — — ディー・エヌ・エー 1.4 — — 博報堂DYホールディングス — 4.8 7,852 オリエンタルランド 2.8 3.5 37,887 ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 — 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス — 0.6 3,276 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 — — カナモト — 0.6 1,809 株数・金額 467 618 2,303,401	日本空港ビルデンク	r		_		1.2	4, 752
エス・エム・エス 0.4 1.1 1,896 パーソルホールディングス 2.4 カカクコム 1.7 2 3,730 エムスリー 2.6 6.6 10,256 アウトソーシング 1	サービス業 (6.0%))					
パーソルホールディングス 2.4 カカクコム 1.7 2 3,730 エムスリー 2.6 6.6 10,256 アウトソーシング 1 ディー・エヌ・エー 1.4 中轉報堂DYホールディングス - 4.8 7,852 オリエンタルランド 2.8 3.5 37,887 ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス - 0.6 3,276 リクルートホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 カナモト - 0.6 1,809	日本M&Aセンター	-		0.8		2. 2	5, 616
カカクコム 1.7 2 3,730 エムスリー 2.6 6.6 10,256 アウトソーシング 1 - - ディー・エヌ・エー 1.4 - - 博報堂DYホールディングス - 4.8 7,852 オリエンタルランド 2.8 3.5 37,887 ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス - 0.6 3,276 リログルード 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 株 数・金額 467 618 2,303,401	エス・エム・エス			0.4		1. 1	1, 896
エムスリー 2.6 6.6 10,256 アウトソーシング 1 - - ディー・エヌ・エー 1.4 - - 博報堂DYホールディングス - 4.8 7,852 オリエンタルランド 2.8 3.5 37,887 ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス - 0.6 3,276 リログルードホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 体数・金額 467 618 2,303,401	パーソルホールディ	・ングス		2. 4		_	_
アウトソーシング 1 - - ディー・エヌ・エー 1.4 - - 博報堂DYホールディングス - 4.8 7,852 オリエンタルランド 2.8 3.5 37,887 ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス - 0.6 3,276 リログルートホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 株 数・金額 467 618 2,303,401	カカクコム			1.7		2	3, 730
ディー・エヌ・エー 1.4 - - 博報堂DYホールディングス - 4.8 7,852 オリエンタルランド 2.8 3.5 37,887 ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス - 0.6 3,276 リログルートホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 合 計 467 618 2,303,401	エムスリー			2.6		6.6	10, 256
博報堂DYホールディングス	アウトソーシング			1		_	_
オリエンタルランド 2.8 3.5 37,887 ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス - 0.6 3,276 リログルートホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 合 計 株数・金額 467 618 2,303,401	ディー・エヌ・エー	-		1.4		_	_
ユー・エス・エス 3.1 3.6 6,667 楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス - 0.6 3,276 リログルートホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 合 計 株数・金額 467 618 2,303,401	博報堂DYホールラ	ディングス		_		4.8	7, 852
楽天 - 12.5 10,487 テクノプロ・ホールディングス - 0.6 3,276 リクルートホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 カナモト - 0.6 1,809 合 計 株 数 ・金 額 467 618 2,303,401	オリエンタルラント	*		2.8		3. 5	37, 887
テクノプロ・ホールディングス - 0.6 3,276 リクルートホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 合 計 株数・金額 467 618 2,303,401	ユー・エス・エス			3. 1		3.6	6, 667
リクルートホールディングス 13.4 15.5 43,268 リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 合計 株数・金額 467 618 2,303,401	楽天			_		12.5	10, 487
リログループ 1.5 1.8 5,002 共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 合計 株数・金額 467 618 2,303,401	テクノプロ・ホール	<i>、</i> ディングス		_		0.6	3, 276
共立メンテナンス 0.4 - - カナモト - 0.6 1,809 合計 株数・金額 467 618 2,303,401	リクルートホールラ	ディングス		13. 4		15. 5	43, 268
カナモト - 0.6 1,809 合計 株数・金額 467 618 2,303,401	リログループ			1.5		1.8	5, 002
合 計 株数・金額 467 618 2,303,401	共立メンテナンス			0.4		_	_
合 計	カナモト			-		0.6	1,809
	△ ⇒1	株数・金額		467		618	2, 303, 401
銘柄数 < 比率 > 149 150 < 98.7% >	古 計	銘柄数<比率>	[149		150	<98.7%>

- (注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
- (注) 評価額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

I		Ada	扭	RII		当	其	月	末	
		銘	柄	751)	買	建	額	売	建	額
	玉						百万円			百万円
	内	株式先物取引		TOPIX			31			_

〇投資信託財産の構成

(2019年1月28日現在)

	T.T.			当	其	期	末	
	項	Ħ	評	価	額	比		率
					千円			%
株式					2, 303, 401			98. 3
コール・ロ	ーン等、その他				40, 259			1.7
投資信託財	産総額				2, 343, 660			100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年1月28日現在)

項 目 当 期 末 円 2, 343, 095, 502 (A) 資産 コール・ローン等 28, 125, 026 株式(評価額) 2, 303, 401, 400 未収入金 6, 304, 276 未収配当金 4,839,800 差入委託証拠金 425,000 (B) 負債 9, 573, 138 未払解約金 9, 572, 983 未払利息 53 その他未払費用 102 (C) 純資産総額(A-B) 2, 333, 522, 364 元本 2, 101, 279, 687 次期繰越損益金 232, 242, 677 (D) 受益権総口数 2, 101, 279, 687 🗆 11, 105円 1万口当たり基準価額(C/D)

<注記事項>

①期首元本額	1, 394, 296, 523円
期中追加設定元本額	1, 297, 574, 591円
期中一部解約元本額	590, 591, 427円
また 1 口当たり純資	産額け 期末1 1105円です

〇損益の状況

(2018年1月27日~2019年1月28日)

	項目	当 期
		円
(A)	配当等収益	41, 472, 039
	受取配当金	41, 392, 747
	受取利息	52
	その他収益金	102, 997
	支払利息	△ 23, 757
(B)	有価証券売買損益	△387, 340, 927
	売買益	91, 045, 374
	売買損	△478, 386, 301
(C)	先物取引等取引損益	△ 5, 604, 700
	取引益	11, 633, 420
	取引損	△ 17, 238, 120
(D)	保管費用等	△ 340
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	△351, 473, 928
(F)	前期繰越損益金	446, 092, 726
(G)	追加信託差損益金	279, 735, 501
(H)	解約差損益金	△142, 111, 622
(1)	計(E+F+G+H)	232, 242, 677
	次期繰越損益金(I)	232, 242, 677

- (注) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の 評価換えによるものを含みます。
- (注) (6) 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) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資	信託ごとの元本額)
iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスファンド (ラップ向け)	55, 464, 771円
国内株式セレクション (ラップ向け)	591, 739, 677円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	13, 679, 589円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	80,051,831円
eMAXIS JAPAN クオリティ150インデックス	1, 360, 343, 819円
合計	2, 101, 279, 687円

日本株オープン「35」マザーファンド

《第17期》決算日2018年3月23日

[計算期間:2017年3月24日~2018年3月23日]

「日本株オープン「35」マザーファンド」は、3月23日に第17期の決算を行いました。 以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

運	用	方	針	国内の上場株式、店頭登録株式を主たる投資対象とし、個別企業訪問等によるボトム・アップ・アプローチをベースとしたアクティブ運用を行います。東証株価指数(TOPIX)をベンチマークとし、これを上回る投資成果をめざします。主として、委託会社が厳選した「35銘柄」に投資します。投資対象を「35銘柄」に絞ることで、銘柄のフォローを徹底し、集中投資効果を図ります。なお、市場動向等によっては、限定された範囲内で、委託会社が継続的にフォローしている銘柄群に投資することがあります。
主	要 運	用:	対 象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主	な組	入台	制限	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産 総額の30%以下とします。

〇最近5期の運用実績

	fata		基	準	価		額	東	証	株	価	指	数	株			式	株			式	紬	資	産
決	算	期			期騰	落	中率	(T	ОРІ	X)	期騰	落	中率	組	入	比			物	比	率		,,	額
				円			%						%				%				%		百	万円
13期(2	2014年3	月24日)		13, 945		1	7.7		1, 16	3.04]	11.1			97	7.3				_		8,	128
14期(2	2015年3	月23日)		18, 911		3	35.6		1, 592	2. 25		3	36.9			97	7.0				_		7,	784
15期(2	2016年3	月23日)		17, 693		\triangle	6.4		1, 36	4. 20		\triangle	14.3			97	7. 2				_		5,	817
16期(2	2017年3	月23日)		21, 467		2	21.3		1, 53	0. 41]	12.2			98	3. 4						5,	179
17期(2	2018年3	月23日)		27, 880		2	29. 9		1, 66	4. 94			8.8			96	6.9				_		7,	481

- (注) 東証株価指数 (TOPIX) とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式 市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東 京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

〇当期中の基準価額と市況等の推移

r	п	п	基	準	価		額	東	証	株	価	指	数	株			式	株			式
年	月	日			騰	落	率	(T	ОРІ	X)	騰	落	率		入	比	率	株先	物	比	率
	(期 首)			円			%						%				%				%
2	017年3月23日			21, 467			_		1, 53	0.41			_			98	. 4				_
	3月末			21,696			1.1		1, 51	2.60		Δ	1.2			96	. 6				_
	4月末			22, 028			2.6		1, 53	1.80			0.1			98	. 2				_
	5月末			22,822			6.3		1, 56	8.37			2.5			98	. 0				_
	6月末			23, 238			8.2		1,61	1.90			5.3			97	. 2				_
	7月末			24, 123			12.4		1,61	8.61			5.8			97	. 7				_
	8月末			24, 528			14.3		1,61	7.41			5.7			98	. 4				_
	9月末			26, 371			22.8		1,67	4.75			9.4			98	. 1				_
	10月末			28,080			30.8		1, 76	5.96			15. 4			97	. 9				_
	11月末			29, 390			36.9		1, 79	2.08			17. 1			97	. 8				_
	12月末			29, 963			39.6		1,81	7.56			18.8			97	. 6				_
	2018年1月末			30, 894			43.9		1,83	6.71			20.0			97	. 3				_
	2月末			30, 170			40.5		1, 76	8.24			15. 5			97	. 6				_
	(期 末)																				
2	018年3月23日			27,880			29.9		1,66	4.94			8.8			96	. 9				_

- (注)騰落率は期首比。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

〇運用経過

- ●当期中の基準価額等の推移について
- ◎基準価額の動き 基準価額は期首に比べ29.9%の上昇となりました。
- ◎ベンチマークとの差異 ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率 (8.8%) を21.1%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎国内株式市況

- ・期首から2017年4月中旬にかけては、オバマケア代替案について共和党内で調整が難航しているとの報道を受けてトランプ米大統領の政策執行に対する懸念が高まったこと、北朝鮮によるミサイル発射を契機に地政学リスクが高まったことなどを背景に、国内株式市況は下落しました。
- ・4月下旬から8月上旬にかけては、地政学リスクが後退したことに加え、米国での予算成立や 堅調な国内企業業績の発表などを背景に、国内 株式市況は上昇しました。
- ・8月中旬から9月上旬にかけては、トランプ米 政権の混乱や北朝鮮リスクが再び高まったこと、 円高進行などにより下落しました。
- ・9月中旬から2018年1月下旬にかけては、衆議院選挙での与党の大勝や、2017年度中間期決算での好調な企業業績、米国の税制改革法案の成立などが好感され、上昇しました。
- ・2月上旬から期末にかけては、1月の米雇用統計が米国のインフレ圧力の高まりを示す内容であったことをきっかけに米国金利の一段の上昇懸念が強まり、さらにトランプ米大統領の通商政策を巡る発言により貿易摩擦で世界経済が減速するとの警戒感が台頭したことなどから、世界的に株式市況は大きく下落しました。
- ●当該投資信託のポートフォリオについて
- ・個別銘柄の選別においては、競争力の有無や収益力向上への取り組みなどを重視し、中長期的な成長期待が持てる企業として厳選した「35銘柄」を中心に投資を行いました。
- ・組入銘柄数は概ね40銘柄程度で推移させました。 自動車の電装化・電動化を背景に車載機器向け アナログ半導体の拡大を見込んで新日本無線、 良品廉価の商品性が特徴のPB化粧品「LB」 の成長性を期待してアイケイなどを新規に組み 入れました。一方でバリュエーション、業績動 向などを勘案し、UACJ、東ソーなどを全株

売却しました。期首、期末時点の比較では24銘 柄を新規に買い付け、24銘柄を全株売却しました。

- ●当該投資信託のベンチマークとの差異について
- ・当期の運用成果は個別銘柄選択の結果として電気機器をベンチマーク比オーバーウェイトとしていたことや、陸運業をベンチマーク比アンダーウェイトとしたことなどがプラスに寄与し、業種配分効果はプラスとなりました。銘柄選択効果は東海カーボンやアイケイなどが寄与してプラスとなり、トータルでベンチマークを上回りました。
- ・特に、寄与、影響が大きかったのは以下の通り です。

(プラス要因)

◎銘柄

- ・東海カーボン:タイヤの原料として使うカーボンブラックの日本と中国の生産能力削減、全社で約100人の人員削減などの構造改革を実施したことで、業績が改善へ向かう可能性が高いと判断して期首よりベンチマーク比オーバーウェイトとしていました。主力事業の1つである黒鉛電極が、中国の環境規制強化を受けて需給が改善し、販売価格が大きく上昇する気運が高まったことなどから株価は上昇しプラスに寄与しました。
- ・アイケイ:良品廉価の商品性が特徴のPB化粧品「LB」の成長性を期待して期中に買い付けました。会社側の業績計画が上方修正されるなど、好調な企業業績などを背景に株価は上昇しプラスに寄与しました。

(マイナス要因)

◎銘柄

・イーレックス:電力小売事業を展開する独立系の新電力企業。競争力のあるベースロード電源、機動的な販売戦略といった特長を武器に、電力全面自由化の流れのなかで高成長を期待し、期首よりベンチマーク比オーバーウェイトとしていました。電力卸取引価格の上昇と販売競争の

激化などから、会社側の業績計画が市場参加者 の期待を下回ったことなどから、株価が下落し マイナスに影響しました。なお、期中に全株売 却しました。

〇今後の運用方針

◎運用環境の見通し

・国内株式市況は中長期的には堅調に推移するを 予想しています。米国金利上昇懸念や況は下表 の警戒感などから世界的に株式市況は、 米国の景気拡大を追い風に、世局の ではいますが、米国の景気が、世界的に大き にはいる。 ではいるでは、 ではないるでは、 ではないるでは、 ではないるでは、 ではないるでは、 ではないるでは、

◎今後の運用方針

・個別銘柄の選別においては、競争力の有無、収益力向上への取り組みなどを重視しています。 今後公表される2018年度会社計画の内容なども 勘案しながら、マネジメントカ、バリュエーション、中長期的な成長や収益力改善のためにどのような施策に取り組んでいるのかなどを精査し、競争力があり、中長期的な成長期待が持てる企業を中心に銘柄選別を行っていく方針です。

〇1万口当たりの費用明細

(2017年3月24日~2018年3月23日)

	項	ī		目			当	期	項 目 の 概 要
	.,,	`		н		金	額	比 率	7 H V M 9
							円	%	
(a)	売	買 委	託	手 数	料		69	0. 266	(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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
	(株		式)		(69)	(0. 266)	
(b)	そ	0)	他	費	用		2	0.009	(b) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
	(そ	の	他)	,	(2)	(0.009)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
	合			計			71	0. 275	
	,	期中の平	均基	準価額に	t 、2	26, 108	円です	0	

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

〇売買及び取引の状況

(2017年3月24日~2018年3月23日)

株式

			買	付			売	付	
		株	数	金	額	株	数	金	額
玉			千株		千円		千株		千円
l .	上場		5, 947	11,	698, 024		6,764	10, 8	322, 232
内			(△ 733)	(-)				

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

〇株式売買比率

(2017年3月24日~2018年3月23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	22, 520, 257千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,298,833千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3. 57

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

〇利害関係人との取引状況等

(2017年3月24日~2018年3月23日)

利害関係人との取引状況

Γ			四八烷炒		·	士山蛎炊		
	区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u>
Γ			百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
	株式		11, 698	1, 997	17. 1	10,822	2, 244	20. 7

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
				百万円			百万円	百万円
株式				270			342	325

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種	類	買	付	額
				百万円
株式				11

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項	₽ I	当	期	
売買委託手数料総額(A)				17,043千円
うち利害関係人への支払額	(B)			2,893千円
(B) / (A)				17.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱 UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、モルガン・スタンレーMUFG証券です。

○組入資産の明細

(2018年3月23日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当	期 末
¥£D 11.3	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
食料品(1.6%)			
森永製菓	14. 1	_	-
アサヒグループホールディングス	_	21.6	116, 46
繊維製品 (一%)			
シキボウ	820	_	-
化学 (11.2%)			
昭和電工	_	37. 9	158, 61
東ソー	200	-	-
東京応化工業	44. 3	63. 3	233, 57
扶桑化学工業	42. 5	-	-
トリケミカル研究所	_	45. 5	214, 53
日本ペイントホールディングス	18.9	_	-
資生堂	_	34. 2	209, 54
医薬品 (3.3%)			
ペプチドリーム	20. 3	46.3	240, 29
ガラス・土石製品 (5.6%)			
東海カーボン	355. 2	263. 5	403, 68
非鉄金属 (7.3%)			
三井金属鉱業	278	41.5	191, 10
東邦チタニウム	_	136. 4	151, 13
UACJ	712	_	-
古河電気工業	_	32. 3	184, 43
金属製品 (2.6%)			
SUMCO	94. 4	65	189, 34
機械 (7.4%)			
牧野フライス製作所	84	_	-
日特エンジニアリング	_	27. 4	103, 70
島精機製作所	19	_	-
SMC	_	2. 5	103, 65
小松製作所	_	53. 4	185, 40
キトー	_	78	146, 32
電気機器 (23.8%)			
三菱電機	86. 6	_	-
マブチモーター	13.6	_	-
日本電産	8	12. 9	203, 43
オムロン	_	19.8	118, 40
エスケーエレクトロニクス	_	75. 7	179, 25
セイコーエプソン	18	_	-
ソニー	17. 1	_	-
アルプス電気	15. 7	_	-

		− 出 者(i	前期末)	当	其	月 末	
銘	柄	株	数	株	数	評価額	
		1/1	千株	1/1	-	千円	
キーエンス			1.5		1.6	100, 752	
メガチップス			50. 8		_	_	
フェローテックホールディ	ィングス		_		56. 6	143, 141	
新日本無線			_	3	62. 6	298, 419	
山一電機			137. 7		127	224, 155	
ファナック			7. 3		_	_	
ローム			_		16. 7	167,000	
KOA			_		23. 8	50, 717	
東京エレクトロン			9. 2		11.8	237, 475	
輸送用機器 (6.7%)							
トヨタ自動車			8.2		40.6	268, 081	
KYB			127		_	_	
スズキ			25. 2		23. 9	132, 931	
SUBARU			26. 2		_	_	
ヤマハ発動機			_		29. 7	88, 951	
精密機器 (1.9%)							
トプコン			79. 5		_	_	
朝日インテック			_		37. 1	140, 238	
その他製品(3.2%)							
SHOEI			31		_	-	
ピジョン			24. 4		25. 7	111,666	
任天堂			_		2.5	119, 175	
電気・ガス業(一%)							
イーレックス			72. 1		-	_	
情報・通信業(1.7%)							
アカツキ			22. 7		-	_	
ソフトバンクグループ			23. 2		15. 1	122, 264	
卸売業 (2.2%)							
シークス			25. 5		_	_	
三菱商事			34. 4		56	158, 592	
小売業 (5.9%)		1					
アイケイ			_		63.8	297, 946	
ニトリホールディングス			5. 3		-	_	
ファーストリテイリング			2. 3		3. 2	126, 912	
銀行業 (4.5%)							
三菱UFJフィナンシャル	レ・グループ	1	593. 2	4	74. 6	325, 385	
保険業 (1.5%)							
第一生命ホールディングス			123. 2		55. 9	109, 340	
東京海上ホールディングス	ス		26.3		_	_	

lida .	686	期首(前期末)	当其		東 末
銘	柄	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
不動産業 (1.5%)						
東京建物			18.3		69.5	107, 377
サービス業 (8.1%)						
綜合警備保障			_		21.5	105, 672
アウトソーシング			_		59. 5	104, 125
シンメンテホールディ	ングス		_		68. 3	184, 000

Altr	100	期首(前期末)		当 其		· 末	
銘	柄	株	数	株	数	評価額	
		-	千株		千株	千円	
D. A. コンソーシフ		-		81.1	194, 072		
合 計	株数・金額	4,	336		2, 785	7, 251, 307	
	銘柄数 < 比率 >		42		42	<96.9%>	

- (注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
- (注) 評価額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

〇投資信託財産の構成

(2018年3月23日現在)

項	Н		当	其	y .	末	
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	Ħ	評	価	額	比	率	
				千円		%	
株式				7, 251, 307		88. 6	
コール・ローン等、その他				930, 263		11. 4	
投資信託財産総額				8, 181, 570		100.0	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年3月23日現在)

〇損益の状況

(2017年3月24日~2018年3月23日)

_		
	項目	当期末
		円
(A)	資産	8, 181, 570, 225
	コール・ローン等	193, 977, 559
	株式(評価額)	7, 251, 307, 660
	未収入金	722, 936, 306
	未収配当金	13, 348, 700
(B)	負債	700, 002, 829
	未払解約金	700, 002, 483
	未払利息	346
(C)	純資産総額(A-B)	7, 481, 567, 396
	元本	2, 683, 464, 526
	次期繰越損益金	4, 798, 102, 870
(D)	受益権総口数	2, 683, 464, 526 □
	1万口当たり基準価額(C/D)	27, 880円

<	注	記	事	項	>
<	汪	記	争	垻	-

①期首元本額 2,412,580,861円 期中追加設定元本額 1,335,983,362円 期中一部解約元本額 1,065,099,697円 また、1口当たり純資産額は、期末2.7880円です。

		-
	項目	当 期
		円
(A)	配当等収益	95, 177, 281
	受取配当金	95, 268, 848
	受取利息	1, 023
	その他収益金	1, 539
	支払利息	△ 94, 129
(B)	有価証券売買損益	1, 280, 026, 028
	売買益	1, 869, 810, 832
	売買損	△ 589, 784, 804
(C)	保管費用等	△ 601, 243
(D)	当期損益金(A+B+C)	1, 374, 602, 066
(E)	前期繰越損益金	2, 766, 543, 332
(F)	追加信託差損益金	2, 408, 216, 428
(G)	解約差損益金	△1, 751, 258, 956
(H)	計(D+E+F+G)	4, 798, 102, 870
	次期繰越損益金(H)	4, 798, 102, 870

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- (注) (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) (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。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

 三菱UFJ 日本株オープン「35」
 2,226,717,391円

 三菱UFJ 日本株オープン「35」VA
 420,984,339円

 三菱UFJ <DC>日本株オープン「35」
 35,762,796円

 合計
 2,683,464,526円

[お知らせ]

当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。 (変更前 (旧) http://www.am.mufg.jp/ \rightarrow 変更後 (新) https://www.am.mufg.jp/) (2018年1月1日)



日本・小型株・ファンド・マザーファンド

《第37期》決算日2018年12月10日

[計算期間:2018年6月12日~2018年12月10日]

「日本・小型株・ファンド・マザーファンド」は、12月10日に第37期の決算を行いました。 以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第37期の運用状況をご報告申し上げます。

中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行います。主としてわが国の小型株式の中から、ボトムアップアプローチにより成長性が高いと判断される銘柄を厳選して投資することを基本とします。RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスをベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は、原則として高位を維持します。

主 要 運 用 対 象 わが国の株式を主要投資対象とします。

主 な 組 入 制 限 株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。

〇最近5期の運用実績

	fata		基	準	価 額		RUSSELL/NOMURA Small		Cap	株式	株式	純資	産
決	算	期			期騰	中 客 率	インデックス	期騰落	中率		先 物 比 率		額
				円		%			%	%	%	百	万円
33期(2	2016年12	月12日)		40, 265		1.8	465. 10		11.6	96.6	_	6	, 998
34期(2	2017年6	月12日)		52, 853		31.3	504. 62		8.5	98. 2	_	7	, 200
35期(2	2017年12	月11日)		64, 336		21.7	588. 29		16.6	97.8	_	8	3, 537
36期(2	2018年6.	月11日)		71, 110		10.5	595. 29		1.2	97. 1	_	11	, 569
37期(2	2018年12	月10日)		56, 322		△20.8	508. 52	\triangle	14.6	96. 1	_	10	, 030

- (注) RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスは、RUSSELL/NOMURA 日本株インデックスを構成するインデックスの一つです。 RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスは、わが国の全金融商品取引所全上場銘柄の全時価総額(時価総額は全て安定持株控除後)の 98%超をカバーするRUSSELL/NOMURA Total Marketインデックスのうち、時価総額下位約15%の銘柄により構成されています。 RUSSELL/NOMURA 日本株インデックスは、Russell Investmentsと野村證券株式会社が作成している株価指数で、当該指数に関する一切の知的財産権その他一切の権利はRussell Investmentsと野村證券株式会社に帰属します。また、Russell Investmentsと野村證券株式会社は、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。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率 売建比率。

〇当期中の基準価額と市況等の推移

年	П	日	基	準	価	å	領	RUSSELL/NOMU	RA S	Small	Cap	株			式	株			式
+	月	П			騰	落	率	インデックス	騰	落	率	組	入	比	率	株先	物	比	率
	(期 首)			円			%				%				%				%
20	018年6月11日	1		71, 110			_	595. 29			_			9	7. 1				_
	6月末			68, 961		△ 3	0.	576. 56		Δ	3.1			9.	5.6				
	7月末			67, 424		△ 5	. 2	577. 61		Δ	3.0			9	7. 9				_
	8月末			67, 150		△ 5	. 6	566. 42		Δ	4.8			9	6.2				_
	9月末			68, 867		△ 3	. 2	586. 61		Δ	1.5			9	7. 1				_
	10月末			58, 844		$\triangle 17$. 2	525. 22		Δ	11.8			9.	5. 9				
	11月末			59, 987		△15	. 6	540.65		Δ	9.2			9	6.3				_
	(期 末)					·													
20	018年12月10日	1		56, 322		$\triangle 20$. 8	508. 52		Δ	14.6			9	6.1				_

- (注)騰落率は期首比。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率 売建比率。

〇運用経過

- ●当期中の基準価額等の推移について
- ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ20.8%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマーク(RUSSELL/NOMURA Small Cap インデックス)の騰落率 (-14.6%)を6.2%下回りました。

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎国内株式市況

- ・期首から2018年9月下旬にかけては、世界的な 貿易摩擦懸念が強まる一方、堅調な企業業績な どから小型株式市況は一進一退の動きが続きま した。
- ・その後は米中間の貿易戦争が激化したことなど を背景に世界経済の減速懸念が強まったこと、 国内企業の2018年度第2四半期決算発表で慎重 な業績見通しが相次いだことなどから期末まで 下落基調となりました。
- ●当該投資信託のポートフォリオについて
- ・国内小型株式のうち独自の技術やノウハウを有 し、中長期的な成長が見込める企業などを中心 に選別投資を行いました。
- ・組入銘柄数は概ね90~100銘柄程度で推移させました。目標株価への到達もしくは接近、ファンダメンタルズの変化、新規投資候補銘柄との相対比較等を勘案し、適宜入れ替えを行いました。期首、期末の比較では、土木資材製造などを手掛ける前田工繊やシステムインテグレーターの日本ユニシスなど、29銘柄を新規に組み入れました。また、公開買付けが発表された

D. A. コンソーシアムホールディングスやインターネットインフラ事業などを手掛ける GMOインターネットなど27銘柄を全株売却しました。

- ●当該投資信託のベンチマークとの差異について
- ファンドの騰落率は、ベンチマーク (RUSSELL/NOMURA Small Capインデックス) の騰落率 (-14.6%) を6.2%下回りました。
- ・当期は、セクター内の個別銘柄判断の結果、日本化学工業や山洋電気などの銘柄選択がマイナスに影響し、ベンチマークを6.2%下回りました。パフォーマンスに寄与、影響した主な銘柄は以下の通りです。

(プラス要因)

◎銘柄

・D. A. コンソーシアムホールディングス:同社グループで手掛けるインターネット広告の拡大に着目し、期首より保有しました。インターネット広告市場は広告市場全体を上回る成長となり、同社業績も恩恵を受けたほか、2018年8月には同社に対する公開買付けが発表されたことなどから株価が上昇しプラスに寄与しました。なお、期中に全株売却しました。

(マイナス要因)

◎銘柄

- ・日本化学工業:リチウムイオン電池用正極材料 や電子セラミック材料などの拡大に着目し、期 中より保有しました。足下の増益基調は続いて いたものの、年間の慎重な業績見通しが据え置 かれたことなどから株価は下落し、マイナスに 影響しました。
- ・山洋電気:主に省力化、自動化投資に使われる 同社のサーボシステムに着目し期首より保有し ました。増収増益が続く一方、受注には減速感 がみられたことなどから株価は下落し、マイナ スに影響しました。

〇今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・2018年度第2四半期決算では、今後の業績見通 しについて国内、海外のマクロ環境の不透明感 などから慎重な見方をする企業が多くみられ、 2018年10月以降の株価下落はこの見方を反映し たものと考えております。
- ・足下では米中の貿易摩擦に関する懸念や英国の 欧州連合(EU)離脱に関する動き、中国景気 減速懸念など海外に端を発する不安定要素が依 然として存在しており、今後の動向に注意が必 要だと考えております。
- ・こういった不安定要因が重なることから小型株式市場も当面は軟調な推移を想定しておりますが、個別企業の堅調な業績推移が確認されれば再度上昇トレンドに回帰するものと考えています。

◎今後の運用方針

- ・今後も、主としてわが国の小型株式の中から、ボトムアップアプローチにより成長性が高いと判断される銘柄を厳選して投資することを基本とします。
- ・日本の小型株市場は成長力のある企業が増加する一方、各社固有の競争力や戦略等による銘柄 間格差は拡大すると判断し、銘柄選別を強化する方針です。
- ・今後の業績見通しに慎重な見方をする企業が多くみられたものの、足下の株価下落によりバリュエーション面では割安感が強まった銘柄も増えていると考えており、中長期的な成長性や競争力などを勘案し、投資判断を行う方針です。また、個別銘柄選別をコアの投資戦略としつつ、マーケット全体の方向性やセクター動向なども注視していく方針です。
- ・ここ数年の株価上昇において、小型株の上昇は 大型株を上回るものでしたが、今年に入ってからは調整局面が続いております。しかしながら、 日本の小型株市場はいまだ非効率的で、投資家 に十分に認知されていない成長企業は多く存在 すると考えており、こうした成長企業への投資

を継続する方針です。

・今後も個別企業の業績動向に焦点をあてた基本 戦略である「ボトムアップアプローチ」を継続 し、企業訪問など直接コンタクトを積極化して いく方針です。

〇1万口当たりの費用明細

(2018年6月12日~2018年12月10日)

	172	ī		П		弄	á	期			項	П	Ø	概	mi
	項	Į		Image: second content of the s		金	額	比	率		垻		0)	彻	要
							円		%						
(a)	売	買 委	託	手 数	料		53	0.0	083	(a)売買委託手 有価証券等の					中の平均受益権口数 われる手数料
	(株		式)	(53)	(0.0	083)						
(b)	そ	<i>(</i>)	他	費	用		0	0 (000	(b) その他費用	=期中の)その他輩	事用÷期「	中の平均で	受益権口数
(5)	_		,_		,		v	•	000	.,,,	. ,,.,		,,,,	. ,	
	(そ	0)	他)	(0)	(0.0	000)	信託事務の処理	理等に要	するその	他諸費用		
	合			計			53	0.0	083						
	期中の平均基準価額は、64,352円です。														

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

〇売買及び取引の状況

(2018年6月12日~2018年12月10日)

株式

			買	付			売	付	
		株	数	金	額	株	数	金	額
玉			千株		千円		千株		千円
l .	上場		2, 545	6,	423, 691		2,529	5, 3	394, 906
内			(△ 208)	(-)				

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

〇株式売買比率

(2018年6月12日~2018年12月10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	B	当	期
(a) 期中の株式売買金額			11,818,598千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	Į.		11,030,947千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)			1.07

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

〇利害関係人との取引状況等

(2018年6月12日~2018年12月10日)

利害関係人との取引状況

		四山水水			主仏姫炊		
	区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u> C
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
材	式	6, 423	1, 119	17.4	5, 394	1, 301	24. 1

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当	期
売買委託手数料総額(A)		9,335千円
うち利害関係人への支払額 (B)		1,912千円
(B) / (A)		20.5%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱 UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFG証券です。

○組入資産の明細

(2018年12月10日現在)

国内株式

銘 柄		期首(前	期末)	当	其	末
嫍	11/1	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	手門
水産・農林業 (1.1%)						
サカタのタネ			27. 9		27. 9	107, 55
建設業 (1.8%)						
前田建設工業			43. 7		96. 3	106, 218
九電工			48. 2		12	48, 180
中外炉工業			32. 4		8	17, 920
食料品 (2.0%)						
不二製油グループ本社			14. 3		14. 3	51, 766
アリアケジャパン			12.8		14.8	137, 640
繊維製品 (1.2%)						
セーレン			87		67	118, 450
化学 (9.5%)						
日本化学工業			-		59. 9	146, 45
住友ベークライト			307		25. 2	96, 013
旭有機材			_		64. 9	105, 26
ウルトラファブリックス・ホー	・ルディングス		_		39. 5	95, 07
トリケミカル研究所			11. 1		11. 1	53, 113
第一工業製薬			153		_	_
ファンケル			11.3		_	_
ハーバー研究所			_		9.8	79, 18
エステー			25. 3		_	_
タカラバイオ			70.6		81	220, 80
OATアグリオ			17. 2		_	_
クミアイ化学工業			_		185. 1	123, 27
医薬品 (3.9%)						
JCRファーマ			16. 1		9. 2	49, 22
ペプチドリーム			23. 6		50.8	244, 602
ヘリオス			31. 7		45. 9	85, 83
ゴム製品 (1.0%)						
相模ゴム工業			-		43. 7	95, 57
ガラス・土石製品 (5.8%)						
オハラ			-		54. 7	116, 182
東洋炭素			44. 4		34. 9	87, 250
黒崎播磨			_		25. 4	171, 196

銘	柄	期首(前期末)	当其	用 末
珀	ניוו	株 数	株 数	評価額
		千株	千株	千円
ニチアス		77	38. 5	78, 001
ニチハ		37. 2	37. 2	106, 801
金属製品 (1.7%)				
トーカロ		123. 6	180. 1	163, 530
RS Technol	ogies	26. 4	-	-
東プレ		43. 9	_	_
機械 (7.3%)				
タクマ		_	87. 9	130, 619
小田原エンジニアリン	グ	20	_	-
マルマエ		46. 5	_	-
レオン自動機		62. 5	111.8	182, 345
ホソカワミクロン		15. 5	_	_
技研製作所		42. 3	40. 9	156, 851
TOWA		99. 3	_	_
三精テクノロジーズ		_	54. 5	98, 754
酒井重工業		10.6	10.6	26, 669
竹内製作所		42.7	56. 5	108, 819
電気機器 (3.8%)				
山洋電気		24. 6	11. 3	44, 013
サンケン電気		70	14	31, 122
エスペック		45.8	_	_
アバールデータ		18. 6	-	_
レーザーテック		58. 5	66. 6	216, 117
三井ハイテック		36. 4	_	-
太陽誘電		94	39. 9	77, 007
市光工業		35. 4	_	-
輸送用機器 (1.9%)				
武蔵精密工業		27. 9	25. 8	42, 879
エフ・シー・シー		36. 6	54. 2	142, 058
精密機器 (2.2%)				
東京精密		25. 2	52. 1	157, 081
ジャパン・ティッシュ・	エンジニアリング	118. 9	54. 9	52, 539
その他製品(3.5%)				
前田工繊		_	78. 5	211, 400

Rid.	銘 柄		前期末)	当	其	末
路	枘	株	数	株	数	評価額
			千株		千株	千円
フルヤ金属			22. 6		7	37, 730
SHOEI			21.7		21.7	89, 946
電気・ガス業 (0.7%)						
レノバ			_		64. 1	62, 433
陸運業 (0.7%)						
丸和運輸機関			21.5		21.5	66, 005
情報・通信業 (16.3%)						
システナ			_		90.7	138, 317
夢の街創造委員会			28. 5		28. 5	49, 960
ブレインパッド			_		9. 1	58, 968
ポールトゥウィン・ピットク	1ルーホールディ		_		42. 2	90, 05
テクマトリックス			64. 5		52. 4	97, 883
GMOペイメントゲート	ウェイ		5. 1		12.8	85, 248
ラクス			33. 8		33. 8	67, 56
オープンドア			_		42. 3	127, 53
マクロミル			21		_	_
ラクスル			_		31. 1	93, 30
チームスピリット			_		31	95, 94
電通国際情報サービス			_		25. 1	84, 96
デジタルガレージ			17. 6		_	_
日本ユニシス			_		65	186, 55
ビジョン			76. 5		47.6	220, 38
GMOインターネット			100.3		_	_
学研ホールディングス			8		8	34, 84
ゼンリン			19.8		21. 1	56, 69
富士ソフト			_		18. 1	84, 25
卸売業 (6.4%)						
ダイワボウホールディン	グス		_		30. 4	164, 768
ラクト・ジャパン			_		19. 6	161, 504
シップヘルスケアホール	ディングス		26. 3		35. 3	151, 084
日本ライフライン			84. 8		28. 9	45, 604
日本エム・ディ・エム			_		75. 7	93, 792
小売業 (7.8%)						
Hamee			_		79. 9	150, 69
ウエルシアホールディン	グス		_		20. 1	116, 178
シュッピン			157. 6		146. 7	148, 31
ネクステージ			134. 9		136. 1	162, 367
ゴルフダイジェスト・オ	ンライン		48. 2		48. 2	37, 06
ケーズホールディングス			99. 4		121.6	138, 137

N/a	42"	期首(前期末)	当 其	期 末
銘	柄	株 数	株 数	評価額
		千株	千株	千円
証券、商品先物取引	業(1.8%)			
ジャパンインベスト	メントアドバイザー	62	47.8	168, 495
その他金融業(1.2	%)			
アルヒ		-	37. 1	72, 419
プレミアグループ		-	10. 3	44, 135
不動産業 (4.1%)				
いちご		224. 4	224. 4	80, 110
オープンハウス		33. 4	37. 2	149, 916
エリアリンク		39. 9	39. 9	56, 179
カチタス		35. 9	35. 9	106, 910
サービス業(14.3%	6)			
日本M&Aセンター	-	29. 6	29. 6	79, 712
UTグループ		50.6	33. 7	71, 983
タケエイ		32. 5	_	-
FRONTEO		46. 7	_	_
リンクアンドモチ〜	ベーション	34.6	34. 6	32, 835
エス・エム・エス		11	50. 5	88, 728
リニカル		57. 8	57.8	91, 035
ディップ		18.9	_	-
総医研ホールディン	/ グス	74. 3	_	-
ツクイ		27. 4	51.4	48, 830
ジャパンベストレス	(キューシステム	45. 1	48.6	72, 316
ライク		32. 2	_	-
イオンファンタジー	-	7. 5	_	-
クリーク・アンド・	リバー社	60.3	_	_
エン・ジャパン		24. 4	24. 4	102, 724
テクノプロ・ホール	<i>、</i> ディングス	-	21.6	111, 240
ジャパンマテリアル		171. 4	133.6	148, 028
ベクトル		101.7	54. 9	92, 177
アトラエ		24. 7	_	-
ソラスト		16. 5	66. 3	88, 908
ベイカレント・コン	グサルティング	42. 5	21. 1	54, 332
D. A. コンソーシフ	ン ムホールディングス	126	_	-
東京都競馬		19. 4	_	-
カナモト		29. 6	22.8	72, 276
乃村工藝社		45. 5	59. 6	179, 694
船井総研ホールディ	·ングス	35. 7	22. 7	41, 450
合 計	株数・金額	4,770	4, 578	9, 635, 924
□ 計	銘柄数 < 比率 >	92	94	<96.1%>
(注) 約垣棚の()内は 国内性士の	三正 (正 (公安百)	ァ州ナスタう	医話の比索

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。 (注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2018年12月10日現在)

電			当	其	朝 末	₹
項	Ħ	評	価	額	比	率
				千円		%
株式				9, 635, 924		95. 7
コール・ローン等、その他				438, 077		4.3
投資信託財産総額				10, 074, 001		100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年12月10日現在)

項 目 当 期 末 円 (A) 資産 10, 074, 001, 961 コール・ローン等 401, 731, 816 株式(評価額) 9,635,924,000 未収入金 21, 964, 725 未収配当金 14, 381, 420 (B) 負債 43, 341, 076 未払金 43, 329, 742 9,598 未払解約金 未払利息 803 その他未払費用 933 (C) 純資産総額(A-B) 10, 030, 660, 885 元本 1, 780, 959, 024 次期繰越損益金 8, 249, 701, 861 (D) 受益権総口数 1, 780, 959, 024 🗆

<注記事項>

合計

①期首元本額 1,627,005,908円 期中追加設定元本額 242,632,077円 期中一部解約元本額 88,678,961円

1万口当たり基準価額(C/D)

また、1口当たり純資産額は、期末5.6322円です。

〇損益の状況

(2018年6月12日~2018年12月10日)

	項目	当 期
		円
(A)	配当等収益	52, 644, 852
	受取配当金	52, 777, 450
	受取利息	519
	その他収益金	2, 753
	支払利息	△ 135, 870
(B)	有価証券売買損益	△2, 628, 616, 833
	売買益	606, 035, 313
	売買損	$\triangle 3, 234, 652, 146$
(C)	保管費用等	Δ 933
(D)	当期損益金(A+B+C)	△2, 575, 972, 914
(E)	前期繰越損益金	9, 942, 665, 359
(F)	追加信託差損益金	1, 363, 095, 061
(G)	解約差損益金	△ 480, 085, 645
(H)	計(D+E+F+G)	8, 249, 701, 861
	次期繰越損益金(H)	8, 249, 701, 861

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- (注) (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) (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。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFI ジャパン・アクティブ・プラス 40, 375, 397円 国内株式セレクション (ラップ向け) 78,718,433円 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型) 1,686,175円 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型) 11,760,948円 日本・小型株・ファンド 865, 562, 707円 日本株スタイル・ミックス・ファンド 29, 248, 868円 三菱UF I 日本株スタイル・ミックス・ファンドF (適格機関投資家限定) 4,617,447円 三菱UF | 国際 日本・小型株・ファンド (適格機関投資家用) 348, 183, 350円 <DC>日本株スタイル・ミックス・ファンド 400,805,699円

56.322円

1,780,959,024円