

Yjamプラス!

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 追加型投信／内外／株式 |
| 信託期間 | 無期限です。ただし、元本金額が10億円を下回った場合などはファンドを終了（繰上償還）させる場合があります。 |
| 運用方針 | この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。 |
| 主要運用対象 | 主として国内外の金融商品取引所に上場している株式に投資を行ないます。 |
| 組入制限 | ①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| 分配方針 | ①毎決算期に収益の分配を行なう方針です。ただし、基準価額の水準や市場動向等を勘案して収益の分配を行わない場合もあります。 ②分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。 ③信託財産に留保した収益の運用については、特に制限を設けず、「基本方針」および「運用方法」に基づき元本と同一の運用を行ないます。 |

運用報告書（全体版）

第2期

（2017年11月10日決算）

受益者のみなさまへ

平素は「Yjamプラス！」にご投資いただき、厚くお礼申し上げます。

さて、当ファンドは、このたび第2期決算を行ないましたので、期中の運用状況につきまして、ご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

アストマックス投信投資顧問株式会社

東京都品川区東五反田二丁目10番2号

サポートダイヤル

0120-580446

〈受付時間〉 営業日の午前9時～午後5時

<http://www.astmaxam.com>

■ 設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 株式 組入比率 | 信用 取引比率 | 株式 先物比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|----------------|-----------|------------|------------|------------|-----------|
| | (分配落) | 収益分配金 (課税前) | 期中 騰落率 | | | | |
| (設定日) | 円 | 円 | % | % | % | % | 百万円 |
| 2016年12月20日 | 10,000 | — | — | — | — | — | 8,033 |
| 1期(2017年5月10日) | 10,357 | 0 | 3.6 | 68.9 | — | 26.2 | 14,196 |
| 2期(2017年11月10日) | 12,123 | 0 | 17.1 | 95.0 | — | 8.0 | 12,548 |

*基準価額の騰落率は収益分配金(課税前)込み。

*信用取引比率は、買建比率－売建比率。

*株式先物比率は、買建比率－売建比率。

*設定日の基準価額は当初設定時の価額です。また、設定日の純資産総額は、当初設定元本総額を記載しています。

*当ファンドは、特定の指数を上回るまたは連動することを運用の基本方針とはしていないため、該当するベンチマーク等はありません。

■ 当期中の基準価額等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 株式 組入比率 | 信用 取引比率 | 株式 先物比率 |
|-------------|--------|------|------------|------------|------------|
| | | 騰落率 | | | |
| (期首) | 円 | % | % | % | % |
| 2017年5月10日 | 10,357 | — | 68.9 | — | 26.2 |
| 5月末 | 10,368 | 0.1 | 90.3 | — | 9.0 |
| 6月末 | 10,621 | 2.5 | 85.5 | — | 15.7 |
| 7月末 | 10,648 | 2.8 | 89.2 | — | 11.2 |
| 8月末 | 10,653 | 2.9 | 85.1 | — | 15.3 |
| 9月末 | 11,171 | 7.9 | 95.7 | — | 5.3 |
| 10月末 | 11,878 | 14.7 | 89.1 | — | 12.5 |
| (期末) | | | | | |
| 2017年11月10日 | 12,123 | 17.1 | 95.0 | — | 8.0 |

*期末基準価額は収益分配金(課税前)込み。騰落率は期首比。

*信用取引比率は、買建比率－売建比率。

*株式先物比率は、買建比率－売建比率。

■ 当期の運用実績

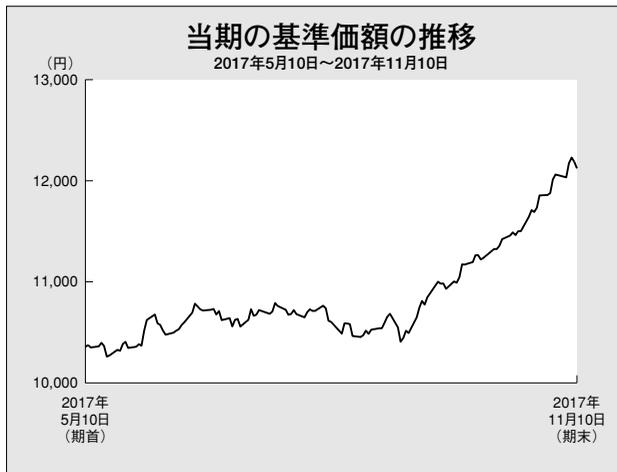
〈基準価額の動き〉

当期末の基準価額は、12,123円となり、前期末との比較では17.1%の上昇となりました。

〈基準価額の主な変動要因〉

トランプ米政権の税制改革案に対する期待感や衆議院選挙での自民党の勝利などを背景に国内株式市場が底堅く推移したことなどから基準価額は上昇しました。

※当期は外国の株式への投資は行ないませんでした。当ファンドは、国内外の株式を投資対象としていますので、今後、外国の株式への投資を行なう場合があります。



〈収益分配金〉

収益分配金（1万口当たり、課税前、以下同じ）については、基準価額の水準や分配原資の積み上がり状況を勘案し、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった利益につきましては、信託財産内に留保し元本部分と同一の運用を行ないます。

なお、分配原資の内訳は以下の通りです。

■ 分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項 目 | 第2期 |
|------------|----------------------------|
| | 2017年5月11日 ～2017年11月10日 |
| 当期分配金(税込み) | －円 |
| (対基準価額比率) | －% |
| 当期の収益 | －円 |
| 当期の収益以外 | －円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,122円 |

* 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（評価益を含む）」から分配に充当した金額です。
また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
* 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下を切捨てて表示しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。
* 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

〈市況〉

当期の国内株式市場は上昇しました。

国内株式市場は堅調な企業業績や日本銀行による金融緩和政策の維持、フランス大統領選挙の結果を受けた欧州の政治リスクの後退などが相場の下支え要因となる一方、北朝鮮を巡る地政学的リスクの高まりやトランプ米政権のロシア疑惑などが上値を抑える展開となり、2017年9月上旬までは概ねレンジ内での推移となりました。その後は、北朝鮮情勢の緊張の緩和やトランプ米政権の税制改革案に対する期待感などを背景に反発に転じました。米国の長期金利の上昇などを受けて円安ドル高が進行したことや衆議院選挙で自民党が勝利し、アベノミクス継続への期待感が高まったことなども追い風となり、国内株式市場は11月上旬にかけて上昇基調で推移しました。

■ 当期の運用経過

当ファンドは、主として国内外の金融商品取引所に上場している株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本としています。運用にあたっては、ヤフー株式会社が提供するビッグデータの解析等を通じて市場の歪み（マーケットアノマリー）を見出し、今後の株価の上昇が高い確度で予測される銘柄の組入れを行なうことを基本としています。また、信用取引を活用した株式の売建てや株式に関連するデリバティブ取引（株価指数先物取引等を含みます。）等を行なう場合があります。

当期も運用の基本方針に則り、ビッグデータの解析等を通じて、企業イベント（アナリストの評価の変更や、企業の業績発表、増配や自社株買い、M&A計画の公表等をいいます。）により注目度が大きく高まり、今後の株価の上昇が高い確度で期待できると判断された銘柄や、株価の季節性により最適な投資タイミングと判断された銘柄の組入れなどを行ないました。また、市場全体の値動きに追随するため、TOPIX先物取引を活用しました。一方、当期は信用取引を活用した株式の売建てや外国の株式への投資は行ないませんでした。

■ 今後の運用方針

今後も主として国内外の金融商品取引所に上場している株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なってまいります。運用にあたっては、ヤフー株式会社が提供するビッグデータの解析等を通じて市場の歪み（マーケットアノマリー）を見出し、今後の株価の上昇が高い確度で予測される銘柄の組入れを行なう方針です。また、信用取引や株式に関連するデリバティブ取引（株価指数先物取引等を含みます。）等も活用してまいります。

今後も投資環境の変化には注意を払いながら運用にあたり、運用成果の向上に全力で取り組む所存ですので、引き続きご愛顧賜りますようよろしくお願い申し上げます。

※上記は作成日時点の見通しであり、今後予告なしに変更することがあります。また市場の変動等により方針通りの運用が行なわれない場合があります。

1 万口 (元本10,000円) 当たりの費用の明細

| 項 目 | 第 2 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------|----------------------------|---------|--|
| | (2017. 5. 11~2017. 11. 10) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信託報酬 | 55円 | 0.501% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率。期中の平均基準価額（月末値の平均値）は10,889円です。 |
| （投信会社） | (25) | (0.229) | 委託した資金の運用の対価 |
| （販売会社） | (27) | (0.245) | 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| （受託会社） | (3) | (0.027) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| 売買委託手数料 | 28 | 0.254 | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数。売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | (27) | (0.246) | |
| （先物・オプション） | (1) | (0.009) | |
| その他費用 | 5 | 0.042 | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| （監査費用） | (1) | (0.009) | 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （法定開示に係る費用） | (4) | (0.032) | 印刷会社等に支払う目論見書、運用報告書等の作成、印刷、交付等に係る費用 |
| （信用取引） | (0) | (0.000) | 信用取引に係る品貸料、未払配当金等 |
| 合 計 | 88 | 0.797 | |

* 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 「金額」欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2017年5月11日から2017年11月10日まで)

(1) 株式

| | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|--------------------|-------------------|--------|------------|
| | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国内 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 上 場 | 24,119 (△1,687) | 33,730,917 (-) | 22,280 | 33,400,317 |

*金額は受渡し代金。

*単位未満は切捨て。

* () 内は増資割当、株式転換・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。

*一印は該当なし。

(2) 先物取引の銘柄別取引状況

| | 買 建 | | 売 建 | |
|--------------|--------|--------|-------|-------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国内 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式先物取引 TOPIX | 13,762 | 16,539 | - | - |

*単位未満は切捨て。

*一印は該当なし。

■ 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 | 67,131,234千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 10,526,244千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 6.37 |

*期中の株式売買金額は、受渡し代金。

*期中の平均組入株式時価総額は、各月末現在の組入株式時価総額の単純平均。

*単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄 (自2017年5月11日 至2017年11月10日)

● 株 式

| 当 | | | | 期 | | | |
|----------|-------|---------|-------|----------|-------|---------|--------|
| 買 付 | | | | 売 付 | | | |
| 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| セイコーエプソン | 104.5 | 280,352 | 2,682 | セイコーエプソン | 144.2 | 405,612 | 2,812 |
| 日東電工 | 27.4 | 271,626 | 9,913 | 大東建託 | 15.9 | 290,414 | 18,265 |
| SUBARU | 62.6 | 249,978 | 3,993 | SUBARU | 67.7 | 266,817 | 3,941 |
| 富士通 | 260 | 225,886 | 868 | ビジョン | 57.6 | 230,551 | 4,002 |
| トヨタ自動車 | 31.1 | 199,918 | 6,428 | ライオン | 95.4 | 217,896 | 2,284 |
| 資生堂 | 47.2 | 181,754 | 3,850 | ミネベアミツミ | 118.5 | 213,277 | 1,799 |
| ダイフク | 47 | 177,283 | 3,771 | 三井化学 | 341 | 210,257 | 616 |
| コニカミノルタ | 193.9 | 176,466 | 910 | 東洋ゴム工業 | 94.6 | 207,969 | 2,198 |
| 松竹 | 79.3 | 176,353 | 2,223 | 良品計画 | 6.8 | 206,165 | 30,318 |
| D I C | 42 | 176,097 | 4,192 | 日本電信電話 | 38.5 | 206,151 | 5,354 |

*金額は受渡し代金。

*単位未満は切捨て。

■ 利害関係人との取引状況 (自2017年5月11日 至2017年11月10日)

期中における利害関係人との取引はありません。

*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細 (2017年11月10日現在)

(1) 国内株式 (上場株式)

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|---------------------|---------|------|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業(0.8%) | | | |
| 日本水産 | — | 40.5 | 24,988 |
| マルハニチロ | — | 22.1 | 70,057 |
| 鉱業(0.1%) | | | |
| 石油資源開発 | 32.4 | — | — |
| K&Oエナジーグループ | — | 5.4 | 10,454 |
| 建設業(2.8%) | | | |
| ルーデン・ホールディングス | — | 9.5 | 2,470 |
| 明豊ファンリティアワークス | — | 10 | 4,270 |
| コムシスホールディングス | 9.7 | 27.1 | 77,831 |
| 日本電技 | — | 1.5 | 4,257 |
| ビーアールホールディングス | — | 22.5 | 10,507 |
| 藤田エンジニアリング | — | 5 | 3,885 |
| 常磐開発 | — | 0.6 | 4,500 |
| アジアゲートホールディングス | — | 58.8 | 4,939 |
| 守谷商会 | — | 2 | 4,104 |
| 大成建設 | 122 | — | — |
| 清水建設 | 97 | — | — |
| 長谷工コーポレーション | 75.3 | 51.5 | 86,880 |
| 銭高組 | — | 1.5 | 9,195 |
| 鹿島建設 | 136 | — | — |
| 西松建設 | 167 | — | — |
| 大東建託 | 6.3 | — | — |
| 東亜道路工業 | — | 2.3 | 10,120 |
| 前田道路 | 30 | — | — |
| 大成温調 | — | 1.5 | 2,940 |
| 大和ハウス工業 | 31.7 | 19.4 | 83,458 |
| 中電工 | — | 8.3 | 27,099 |
| 食料品(4.9%) | | | |
| 日本甜菜製糖 | — | 4.1 | 10,020 |
| 日新製糖 | — | 4.8 | 9,979 |
| 森永製菓 | 19.3 | — | — |
| 江崎グリコ | 17.6 | 11.9 | 67,949 |
| 寿スビリッツ | — | 5.7 | 28,414 |
| カルビー | 26.2 | — | — |
| 明治ホールディングス | 5.7 | 8.3 | 81,257 |
| 日本ハム | 32 | 22 | 61,710 |
| S Foods | — | 5.8 | 26,448 |
| 柿安本店 | — | 2.3 | 4,947 |
| 麒麟ホールディングス | — | 27.8 | 74,782 |
| ユニカフェ | — | 5 | 5,635 |
| 不二製油グループ本社 | 15.3 | — | — |
| キッコーマン | — | 21.8 | 86,437 |
| 焼津水産化学工業 | — | 1 | 1,229 |
| アリアケジャパン | — | 3 | 26,310 |
| ビエトロ | — | 2.5 | 4,130 |
| ニチレイ | — | 24.1 | 73,746 |
| ケンコーマヨネーズ | — | 3.3 | 9,966 |
| なとり | — | 4.8 | 9,628 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|---------------------|---------|------|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 繊維製品(1.4%) | | | |
| 帝人 | — | 33.1 | 80,300 |
| 東レ | — | 68.7 | 80,310 |
| T S Iホールディングス | 10.5 | — | — |
| パルプ・紙(0.0%) | | | |
| 光ビジネスフォーム | — | 3.5 | 1,890 |
| 昭和パックス | — | 2 | 3,428 |
| 化学(12.4%) | | | |
| 旭化成 | — | 54.6 | 82,254 |
| 住友化学 | — | 106 | 88,934 |
| 住友精化 | — | 4.9 | 34,055 |
| 石原産業 | — | 16.3 | 27,318 |
| 日本曹達 | — | 38 | 29,868 |
| 東ソー | 102 | 30.5 | 80,245 |
| トクヤマ | 180 | — | — |
| セントラル硝子 | — | 30.5 | 70,089 |
| 大阪ソーダ | — | 3.4 | 10,067 |
| 関東電化工業 | — | 21.7 | 25,692 |
| 大陽日酸 | — | 55.4 | 80,496 |
| 東邦アセチレン | — | 0.5 | 823 |
| 日本触媒 | 12.9 | — | — |
| カネカ | 23 | 85 | 82,025 |
| 三井化学 | 181 | — | — |
| 三菱ケミカルホールディングス | — | 63.6 | 76,415 |
| 積水化学工業 | — | 37.3 | 84,708 |
| 積水化成成品工業 | — | 6.8 | 9,676 |
| タイガースポリマー | — | 4.4 | 3,682 |
| ウルトラファブックス・ホールディングス | — | 2 | 5,862 |
| ポラテックノ | — | 5.7 | 5,916 |
| アテクト | — | 2.7 | 4,455 |
| ダイキョーニシカワ | — | 13.6 | 25,568 |
| 日本化薬 | — | 42 | 72,702 |
| トリケミカル研究所 | — | 1.7 | 6,647 |
| 日油 | 25 | — | — |
| ハリマ化成グループ | — | 10 | 9,000 |
| 三洋化成工業 | — | 3.7 | 21,238 |
| 日本ペイントホールディングス | 25.4 | — | — |
| 関西ペイント | 43.1 | — | — |
| 日本特殊塗料 | — | 5.4 | 12,198 |
| 太陽ホールディングス | — | 4.7 | 26,414 |
| D I C | — | 18 | 73,080 |
| サカタインクス | — | 13.2 | 27,904 |
| ライオン | 52 | — | — |
| コーセー | 9.7 | — | — |
| コタ | — | 5 | 7,455 |
| ハーバー研究所 | — | 0.8 | 4,768 |
| シーボン | — | 3 | 8,496 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | — | 20.6 | 81,473 |
| ノエビアホールディングス | — | 4 | 30,760 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|-----------------------|---------|------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| エステー | — | 3.4 | 9,350 |
| JCU | — | 5.2 | 31,096 |
| クミアイ化学工業 | — | 30.4 | 22,800 |
| 日本農薬 | — | 38.4 | 24,729 |
| 日東電工 | — | 6.5 | 73,222 |
| 三光合成 | — | 8.9 | 5,375 |
| 天馬 | — | 4.3 | 10,337 |
| 信越ポリマー | — | 10 | 11,620 |
| ニフコ | 17.5 | 10.3 | 78,898 |
| ユニ・チャーム | 19.2 | — | — |
| 石油・石炭製品(0.1%) | | | |
| 昭和シェル石油 | 87.1 | — | — |
| MORESCO | — | 4.8 | 9,945 |
| ゴム製品(0.2%) | | | |
| 東洋ゴム工業 | 52.2 | — | — |
| 朝日ラバー | — | 4.9 | 5,889 |
| フコク | — | 4.5 | 4,864 |
| 三ツ星ベルト | — | 7 | 10,136 |
| ガラス・土石製品(1.6%) | | | |
| 日東紡績 | — | 7.6 | 25,004 |
| 旭硝子 | 60 | — | — |
| テクノクオーツ | — | 0.5 | 5,285 |
| 東海カーボン | — | 31.3 | 35,682 |
| 東洋炭素 | — | 3.8 | 11,856 |
| TOTO | 22.3 | — | — |
| 日本碍子 | 39.7 | — | — |
| 日本特殊陶業 | 36.5 | 35.3 | 91,427 |
| ニチアス | 19 | — | — |
| ニチハ | — | 5.5 | 22,165 |
| 鉄鋼(2.1%) | | | |
| 新日鐵住金 | — | 26.7 | 72,931 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | — | 30.6 | 78,167 |
| 東京製鐵 | — | 25.8 | 25,645 |
| 丸一鋼管 | 31.8 | 21.7 | 68,680 |
| パウダーテック | — | 1 | 4,035 |
| 非鉄金属(1.9%) | | | |
| 日本軽金属ホールディングス | 381.6 | — | — |
| 三菱マテリアル | 29.4 | — | — |
| FCM | — | 0.5 | 1,515 |
| 古河電気工業 | — | 12.3 | 73,308 |
| 住友電気工業 | — | 77.1 | 148,918 |
| フジクラ | 123.1 | — | — |
| 三ツ星 | — | 1.5 | 2,995 |
| 金属製品(0.9%) | | | |
| 三ツ知 | — | 1 | 1,764 |
| 山王 | — | 4.1 | 4,702 |
| 菊池製作所 | — | 4 | 3,576 |
| ホッカンホールディングス | — | 20 | 8,940 |
| シンボ | — | 5.4 | 5,394 |
| 三和ホールディングス | 92.9 | — | — |
| ジーテクト | — | 11.8 | 26,502 |
| 東プレ | — | 8.1 | 26,689 |
| イワブチ | — | 0.5 | 3,020 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|-------------------|---------|------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アドバネクス | — | 3.4 | 11,220 |
| イハラサイエンス | — | 2.4 | 4,617 |
| 三益半導体工業 | — | 5.6 | 11,978 |
| 機械(9.8%) | | | |
| 日本製鋼所 | 40.8 | — | — |
| 三浦工業 | 24.6 | — | — |
| ツガミ | — | 28 | 31,724 |
| オークマ | — | 14 | 99,820 |
| アマダホールディングス | 75.8 | — | — |
| アイダエンジニアリング | — | 21.6 | 28,684 |
| 牧野フライス製作所 | — | 28 | 30,996 |
| DMG森精機 | 56.2 | 36.5 | 90,082 |
| 日特エンジニアリング | — | 1 | 4,480 |
| ディスコ | — | 3.7 | 98,346 |
| タケダ機械 | — | 12 | 4,968 |
| 和井田製作所 | — | 2.5 | 2,032 |
| 太陽工機 | — | 2.6 | 7,449 |
| 島精機製作所 | — | 4.8 | 35,088 |
| やまびこ | — | 20.8 | 31,948 |
| 藤商事 | — | 4.1 | 4,944 |
| 平田機工 | — | 0.8 | 11,376 |
| レオン自動機 | — | 7 | 11,830 |
| ホソカワミクロン | — | 1.5 | 10,620 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | — | 2.3 | 12,098 |
| 日精樹脂工業 | — | 7.8 | 11,902 |
| ローツェ | — | 3.4 | 9,605 |
| ハーモニック・ドライブ・システムズ | — | 0.8 | 5,472 |
| タカキタ | — | 7.5 | 5,557 |
| 北川精機 | — | 9.1 | 4,886 |
| 帝国電機製作所 | — | 8.4 | 10,500 |
| ブラコー | — | 42 | 5,040 |
| 荏原製作所 | 28.2 | — | — |
| ダイキン工業 | — | 6.5 | 85,052 |
| 栗田工業 | 17.5 | — | — |
| 椿本チエイン | — | 27 | 24,894 |
| アネスト岩田 | — | 9.6 | 11,078 |
| ダイフク | — | 15.5 | 90,830 |
| 昭和真空 | — | 2.1 | 5,061 |
| サムコ | — | 8 | 9,232 |
| 加藤製作所 | — | 7.3 | 27,338 |
| 油研工業 | — | 3.5 | 9,600 |
| タダノ | 77.2 | — | — |
| 水道機工 | — | 2 | 3,938 |
| 鈴木器工 | — | 1.9 | 5,078 |
| CKD | — | 11.2 | 27,955 |
| キトー | — | 17.6 | 26,347 |
| JUKI | — | 15.9 | 33,930 |
| 新晃工業 | — | 5.3 | 11,077 |
| 日本ビストンリング | — | 4.1 | 9,376 |
| 日本精工 | 47.4 | — | — |
| NTN | 167 | — | — |
| ジェイテクト | — | 52.4 | 107,839 |
| 不二越 | — | 113 | 83,394 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|---------------------|-------|------|--------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本トムソン | — | 38 | 26,106 |
| I H I | 293 | — | — |
| 電気機器 (16.7%) | | | |
| コニカミノルタ | — | 80.6 | 85,919 |
| ミネベアミツミ | 65.7 | — | — |
| 日立製作所 | — | 97 | 85,689 |
| 安川電機 | — | 21.4 | 98,119 |
| デンヨー | — | 5.5 | 10,708 |
| 東芝テック | — | 41 | 29,684 |
| ダブル・スコープ | — | 11.3 | 22,893 |
| ダイヘン | — | 26 | 28,288 |
| SEMITEC | — | 1.4 | 6,209 |
| テクノホライゾン・ホールディングス | — | 14 | 6,440 |
| ヤーマン | — | 7 | 9,541 |
| ネクスグループ | — | 10 | 4,070 |
| 寺崎電気産業 | — | 3.7 | 5,320 |
| ミマキエンジニアリング | — | 11.3 | 10,542 |
| 大崎電気工業 | — | 28.7 | 23,849 |
| I D E C | — | 4.2 | 10,999 |
| シライ電子工業 | — | 15.7 | 11,680 |
| シーシーエス | — | 1.6 | 4,872 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 36 | — | — |
| 富士通 | — | 88 | 76,524 |
| サンケン電気 | — | 45 | 31,410 |
| ルネサスエレクトロニクス | — | 23 | 34,224 |
| セイコーエプソン | 39.7 | — | — |
| アルバック | — | 4.1 | 34,809 |
| 日本信号 | — | 20.6 | 25,399 |
| パナソニック | — | 46.6 | 81,480 |
| 日立国際電気 | — | 8.9 | 28,124 |
| OSGコーポレーション | — | 2.7 | 2,511 |
| ソニー | 27.3 | — | — |
| アルプス電気 | — | 24.8 | 91,016 |
| 池上通信機 | — | 60 | 10,080 |
| s a n t e c | — | 4.5 | 5,670 |
| メイコー | — | 2.4 | 4,867 |
| ヨコオ | — | 6.9 | 9,873 |
| ティアック | — | 232 | 10,440 |
| アルパイン | — | 12.1 | 32,004 |
| 大井電気 | — | 15 | 4,800 |
| 新コスモス電機 | — | 2.5 | 3,710 |
| 本多通信工業 | — | 5.7 | 13,759 |
| 精工技研 | — | 2.7 | 5,302 |
| 京写 | — | 8 | 4,688 |
| 船井電機 | — | 11.2 | 9,710 |
| 堀場製作所 | 16.4 | — | — |
| アドバンテスト | 47.8 | 31.4 | 78,280 |
| キーエンス | — | 1.2 | 81,384 |
| ミナトホールディングス | — | 10.9 | 4,817 |
| シスメックス | 15.1 | — | — |
| OBARA GROUP | — | 4 | 32,200 |
| フェローテックホールディングス | — | 2.7 | 6,407 |
| 原田工業 | — | 6.4 | 5,356 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|---------------------|-------|------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 千代田インテグレ | — | 11 | 29,634 |
| スタンレー電気 | 8.8 | — | — |
| ヘリオス テクノ ホールディング | — | 14 | 16,282 |
| エノモト | — | 2.8 | 5,294 |
| 図研 | — | 5.1 | 9,975 |
| 日本電子 | — | 48 | 29,712 |
| カシオ計算機 | — | 47.7 | 78,514 |
| 日本シイエムケイ | — | 22.3 | 24,530 |
| ローム | — | 9.1 | 107,198 |
| 浜松ホトニクス | — | 21.4 | 80,785 |
| 三井ハイテック | — | 4.4 | 10,621 |
| 新光電気工業 | — | 28 | 24,556 |
| 太陽誘電 | — | 45.9 | 92,029 |
| K O A | — | 4.6 | 11,233 |
| 小糸製作所 | 16.3 | 11 | 85,360 |
| ミツバ | — | 14.2 | 22,322 |
| SCREENホールディングス | 7.3 | — | — |
| キャノン | — | 17.5 | 77,437 |
| 東京エレクトロン | 8 | 4.3 | 97,223 |
| 輸送用機器 (6.0%) | | | |
| 豊田自動織機 | — | 11.6 | 80,040 |
| デンソー | — | 12.6 | 82,492 |
| 東海理化電機製作所 | — | 31.4 | 72,879 |
| 川崎重工 | — | 20.2 | 79,386 |
| トヨタ自動車 | — | 10.6 | 75,344 |
| ファルテック | — | 3 | 4,254 |
| 新明和工業 | — | 24.5 | 26,778 |
| N O K | 37.3 | — | — |
| ケーヒン | — | 12.9 | 29,515 |
| 河西工業 | — | 15.8 | 28,092 |
| マツダ | — | 46.2 | 71,979 |
| タツミ | — | 5 | 2,100 |
| S U B A R U | 24 | 18.9 | 69,192 |
| 安永 | — | 2.9 | 8,476 |
| ショーワ | — | 18.9 | 26,856 |
| エクセディ | — | 7.4 | 25,123 |
| 八千代工業 | — | 3.9 | 6,657 |
| ジャムコ | — | 10.5 | 30,030 |
| 精密機器 (2.9%) | | | |
| 島津製作所 | 54 | 33.8 | 88,319 |
| ナカニシ | — | 1 | 5,370 |
| 国際計測器 | — | 4.1 | 4,891 |
| 東京精密 | — | 6.6 | 30,921 |
| 理研計器 | — | 4.4 | 10,621 |
| H O Y A | — | 12 | 75,744 |
| シード | — | 3 | 10,575 |
| シチズン時計 | — | 98.6 | 80,654 |
| 日本精密 | — | 30 | 5,250 |
| ジャパン・ティッシュ・エンジニアリング | — | 4.3 | 5,684 |
| セイコーホールディングス | — | 10.4 | 28,652 |
| ニプロ | 62.5 | — | — |
| その他製品 (0.5%) | | | |
| トランザクション | — | 8.2 | 9,143 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|-----------------------|---------|------|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アールシーコア | — | 3.5 | 4,256 |
| SHOEI | — | 2.8 | 11,116 |
| パイロットコーポレーション | 6 | — | — |
| グラフィトデザイン | — | 7.3 | 4,920 |
| 総合商研 | — | 5 | 4,035 |
| ピープル | — | 2.7 | 5,211 |
| 廣済堂 | — | 20 | 8,980 |
| サンメッセ | — | 9.6 | 4,473 |
| 研創 | — | 4.5 | 2,146 |
| ビジョン | 33.2 | — | — |
| 任天堂 | 3.6 | — | — |
| 電気・ガス業(0.6%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 229.3 | — | — |
| 東北電力 | 67 | — | — |
| 九州電力 | 42.2 | — | — |
| 北海道電力 | 71.4 | — | — |
| 電源開発 | 39.7 | — | — |
| 大阪瓦斯 | — | 33.6 | 74,961 |
| 陸運業(3.9%) | | | |
| 相鉄ホールディングス | — | 25.7 | 75,146 |
| 京成電鉄 | — | 22.1 | 75,140 |
| 西日本旅客鉄道 | 13.1 | 9.3 | 76,548 |
| 西武ホールディングス | — | 39.6 | 81,457 |
| 西日本鉄道 | — | 25.7 | 75,018 |
| 日本通運 | — | 10.1 | 71,609 |
| 山九 | 114 | — | — |
| トナミホールディングス | — | 1.7 | 9,044 |
| 海運業(0.8%) | | | |
| 川崎汽船 | — | 25.1 | 73,041 |
| N S ユナイテッド海運 | — | 4.2 | 11,814 |
| 東栄リーファーライン | — | 8 | 4,768 |
| 倉庫・運輸関連業(1.1%) | | | |
| 上組 | — | 28 | 75,908 |
| 郵船ロジスティクス | — | 10 | 14,980 |
| 近鉄エクスプレス | — | 13.5 | 32,278 |
| エーアイテイー | — | 7.6 | 10,282 |
| 情報・通信業(3.7%) | | | |
| カイカ | — | 75.7 | 5,071 |
| 夢の街創造委員会 | — | 3.2 | 5,424 |
| 電算 | — | 2 | 4,956 |
| AGS | — | 10.2 | 9,832 |
| ブレインパッド | — | 7.8 | 9,765 |
| ポルトクウィン・ビットクルーホールディ | — | 5.7 | 9,963 |
| ネクソン | 51.5 | — | — |
| ソフトウェア・サービス | — | 0.9 | 4,797 |
| 日本アジアグループ | — | 19 | 9,481 |
| ケイブ | — | 2.9 | 5,541 |
| システムリサーチ | — | 4.4 | 9,873 |
| ブロードバンドタワー | — | 23.9 | 5,019 |
| ジオネクスト | — | 102 | 4,896 |
| ユニリタ | — | 2 | 3,512 |
| フィスコ | — | 14.9 | 5,051 |
| アイフリークモバイル | — | 17.7 | 4,725 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|----------------------|---------|------|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本一ソフトウェア | — | 2.9 | 4,959 |
| プロトコーポレーション | — | 2.8 | 4,415 |
| 野村総合研究所 | 24.2 | — | — |
| ユークス | — | 5.5 | 3,569 |
| インフォコム | — | 1.8 | 4,842 |
| アイサンテクノロジ | — | 1.4 | 5,124 |
| クレスコ | — | 1.8 | 9,648 |
| オービック | 16.6 | — | — |
| 菱友システムズ | — | 1 | 5,360 |
| ビーイング | — | 2 | 914 |
| 昭和システムエンジニアリング | — | 2.5 | 2,275 |
| SAMURAI&J PARTNERS | — | 3.8 | 16,359 |
| 大塚商会 | 16.6 | — | — |
| 東映アニメーション | — | 0.5 | 5,320 |
| アイレックス | — | 14 | 3,374 |
| エイベックス | — | 15.9 | 23,245 |
| 兼松エレクトロニクス | — | 3.2 | 11,008 |
| 日本テレビホールディングス | — | 36.4 | 76,876 |
| 日本BS放送 | — | 7.7 | 9,771 |
| エスジェイホールディングス | — | 1.3 | 4,953 |
| クロップス | — | 9.4 | 9,776 |
| 日本電信電話 | 20 | — | — |
| KDDI | 34.7 | — | — |
| 沖縄セルラー電話 | — | 1.3 | 5,141 |
| サカイホールディングス | — | 2.5 | 1,655 |
| 昭文社 | — | 8.5 | 6,392 |
| SEホールディングス・アンド・インキュベ | — | 21.2 | 5,427 |
| 松竹 | — | 4.3 | 78,518 |
| 東映 | — | 1.9 | 23,066 |
| ビー・シー・エー | — | 5 | 8,870 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 28.2 | — | — |
| KSK | — | 2 | 3,326 |
| 福井コンピュータホールディングス | — | 3.5 | 11,165 |
| 卸売業(5.2%) | | | |
| イメージワン | — | 11.8 | 4,956 |
| エレマテック | — | 3.5 | 9,653 |
| JALUX | — | 3.8 | 10,966 |
| 双日 | 176.5 | — | — |
| アルコニックス | — | 4.9 | 11,211 |
| グリムス | — | 3 | 5,022 |
| OCHIホールディングス | — | 2 | 2,860 |
| 大阪工機 | — | 6.5 | 7,306 |
| 東京日産コンピュータシステム | — | 2 | 6,190 |
| テリロジ | — | 14.7 | 4,909 |
| 明治電機工業 | — | 5.4 | 9,795 |
| 高見澤 | — | 10 | 4,980 |
| 初穂商事 | — | 0.5 | 2,065 |
| ナ・デックス | — | 4.8 | 4,828 |
| メディバルホールディングス | — | 33.3 | 74,059 |
| 萩原電気 | — | 3 | 10,935 |
| たけびし | — | 4 | 6,648 |
| リックス | — | 2 | 3,826 |
| 丸文 | — | 12.5 | 12,125 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|------------------|---------|------|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| シークス | — | 5.2 | 24,830 |
| Na I T O | — | 24.3 | 4,957 |
| 白銅 | — | 4.4 | 10,705 |
| 三共生興 | — | 22.6 | 10,938 |
| 内田洋行 | — | 2.8 | 9,506 |
| 第一実業 | — | 2.7 | 9,315 |
| 佐藤商事 | — | 6.5 | 7,975 |
| 菱洋エレクトロ | — | 12 | 26,196 |
| 東京産業 | — | 7.5 | 3,967 |
| ユアサ商事 | — | 6.9 | 28,704 |
| 阪和興業 | 72 | 19 | 81,415 |
| 三菱石油 | — | 8 | 11,200 |
| 明和産業 | — | 10 | 4,950 |
| 川辺 | — | 10 | 2,160 |
| 伊藤忠エネクス | — | 20.4 | 23,439 |
| トミタ | — | 1.5 | 1,522 |
| モスフードサービス | — | 7.1 | 24,743 |
| 加賀電子 | — | 3.4 | 11,016 |
| 立花エレテック | — | 5.9 | 11,593 |
| タカチホ | — | 1 | 1,696 |
| イノテック | — | 10.5 | 11,140 |
| 藤井産業 | — | 1.5 | 2,454 |
| 杉本商事 | — | 4.5 | 8,113 |
| バイテックホールディングス | — | 5.7 | 10,066 |
| ミスミグループ本社 | — | 26.5 | 87,052 |
| 小売業(5.4%) | | | |
| ハードオフコーポレーション | — | 3.3 | 3,854 |
| 大戸屋ホールディングス | — | 2.4 | 5,004 |
| アイケイ | — | 0.5 | 5,415 |
| エディオン | — | 24.1 | 31,040 |
| ハローズ | — | 4.2 | 11,235 |
| ナフコ | — | 2 | 3,560 |
| アプライド | — | 2 | 3,642 |
| ビックカメラ | — | 19.4 | 27,742 |
| MonotaRO | 29.5 | — | — |
| ライフフーズ | — | 0.8 | 1,420 |
| WDI | — | 3.5 | 5,302 |
| DDホールディングス | — | 2.5 | 12,650 |
| マツモトキヨシホールディングス | 17.9 | — | — |
| スタートトゥデイ | 41.5 | — | — |
| ありがとうサービス | — | 1.7 | 5,032 |
| シュッピン | — | 3.9 | 10,881 |
| 白鳩 | — | 2.5 | 1,295 |
| セブン&アイ・ホールディングス | — | 16.1 | 75,138 |
| ツルハホールディングス | 8.8 | — | — |
| トリドールホールディングス | — | 7 | 25,830 |
| 丸千代山岡家 | — | 2 | 2,578 |
| 総合メディカル | — | 1.6 | 10,080 |
| 良品計画 | 4.4 | — | — |
| アルビス | — | 2.3 | 10,304 |
| G-7ホールディングス | — | 1.9 | 4,664 |
| イオン北海道 | — | 2.5 | 1,687 |
| アールピバン | — | 7.5 | 4,860 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|-------------------------|---------|-------|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 幸楽苑ホールディングス | — | 4.4 | 8,712 |
| ニチリョク | — | 0.8 | 1,780 |
| マックハウス | — | 4 | 3,676 |
| ハイデイ日高 | — | 7.6 | 25,422 |
| ピーシーデポコーポレーション | — | 11.7 | 10,319 |
| ユニ・ファミリーマートホールディングス | — | 11.7 | 76,869 |
| S R Sホールディングス | — | 10.7 | 9,951 |
| リンガーハット | — | 10.2 | 25,459 |
| 青山商事 | 3.1 | — | — |
| しまむら | 6.8 | — | — |
| 丸井グループ | — | 49.4 | 92,180 |
| 日産東京販売ホールディングス | — | 24.6 | 10,356 |
| アインホールディングス | — | 3.1 | 23,219 |
| ニトリホールディングス | 7.4 | — | — |
| 銀座ルノアール | — | 2.1 | 1,955 |
| 松屋フーズ | — | 2.3 | 9,775 |
| カンセキ | — | 2.5 | 2,237 |
| パローホールディングス | 13.2 | — | — |
| ファーストリテイリング | — | 2 | 81,300 |
| サンドラッグ | 25.7 | — | — |
| 銀行業(2.3%) | | | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | — | 96.4 | 71,972 |
| 群馬銀行 | — | 102.1 | 70,959 |
| 秋田銀行 | — | 3 | 10,320 |
| スルガ銀行 | 37.5 | — | — |
| 大垣共立銀行 | — | 23.8 | 73,185 |
| 紀陽銀行 | 7.6 | — | — |
| 中国銀行 | 8.2 | — | — |
| 四国銀行 | — | 6.2 | 10,471 |
| 高知銀行 | — | 7.9 | 10,262 |
| 北洋銀行 | 155.4 | — | — |
| 愛知銀行 | — | 1.4 | 9,324 |
| 栃木銀行 | — | 23.5 | 11,538 |
| 証券・商品先物取引業(3.2%) | | | |
| F P G | — | 18.2 | 24,333 |
| フューチャーベンチャーキャピタル | — | 3.1 | 4,588 |
| S B Iホールディングス | 59.7 | 45.4 | 76,272 |
| 丸三証券 | — | 25.1 | 26,053 |
| 東洋証券 | — | 37 | 11,507 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | — | 114.6 | 83,199 |
| 松井証券 | — | 85.9 | 85,298 |
| だいち証券ビジネス | — | 5.5 | 4,218 |
| 丸八証券 | — | 25 | 3,700 |
| カブドットコム証券 | 18.7 | — | — |
| トレイダーズホールディングス | — | 29.5 | 4,808 |
| 極東証券 | — | 16 | 26,944 |
| 岩井コスモホールディングス | — | 7.3 | 10,957 |
| 藍澤證券 | — | 23 | 18,538 |
| インヴァスト証券 | — | 1.5 | 1,785 |
| 保険業(3.3%) | | | |
| ニュートン・フィナンシャル・コンサルティ | — | 2.5 | 4,972 |
| S O M P Oホールディングス | — | 17.3 | 79,337 |
| MS&ADインシュアランスグループホール | — | 20.2 | 76,457 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|---------------------|-------|------|--------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 第一生命ホールディングス | — | 36.5 | 77,088 |
| 東京海上ホールディングス | — | 16.7 | 80,226 |
| T&Dホールディングス | — | 45.1 | 78,180 |
| その他金融業(0.2%) | | | |
| アイフル | 297.6 | — | — |
| リコーリース | — | 6.5 | 26,325 |
| アコム | 211.8 | — | — |
| オリエントコーポレーション | 473.9 | — | — |
| オリックス | 28.6 | — | — |
| 不動産業(1.9%) | | | |
| ハウスコム | — | 2.1 | 6,300 |
| エストラスト | — | 1.9 | 1,706 |
| 東武住販 | — | 3.5 | 4,553 |
| パーク24 | — | 28.5 | 74,926 |
| 三井不動産 | — | 27.3 | 75,730 |
| スターツコーポレーション | — | 8.8 | 25,511 |
| 日本エスリード | — | 4.7 | 9,653 |
| 日神不動産 | — | 13 | 11,154 |
| ラ・アトレ | — | 4.5 | 3,091 |
| アバマンショップホールディングス | — | 6 | 5,214 |
| センチュリー21・ジャパン | — | 2 | 2,722 |
| サンウッド | — | 4.5 | 2,776 |
| 和田興産 | — | 5 | 4,650 |
| 日本空港ビルデング | 11.8 | — | — |
| サービス業(3.3%) | | | |
| 日本M&Aセンター | 28.5 | — | — |
| UTグループ | — | 2.2 | 5,280 |
| 幼児活動研究会 | — | 2.6 | 4,417 |
| トラスト・テック | — | 2.9 | 10,019 |
| アルトナー | — | 3.3 | 5,610 |
| 成学社 | — | 0.3 | 289 |
| パーソルホールディングス | 17 | — | — |
| シイエム・シイ | — | 1 | 5,050 |
| アイ・ケイ・ケイ | — | 7.6 | 6,824 |
| きよくとう | — | 1.4 | 977 |
| カカクコム | 46.7 | — | — |
| ルネサンス | — | 5.6 | 9,984 |
| エムスリー | 35.4 | — | — |
| ヒューマンホールディングス | — | 3.2 | 5,404 |
| アウトソーシング | — | 16.4 | 27,945 |
| ウェルネット | — | 20.8 | 23,192 |
| 共同ビーアール | — | 1 | 1,190 |
| エスアールジータカミヤ | — | 11 | 7,381 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------|---------|-------|--------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| ブラップジャパン | — | 3.2 | 4,576 | |
| ACKグループ | — | 3 | 4,497 | |
| セブテニ・ホールディングス | — | 15.6 | 5,070 | |
| レイ | — | 3.6 | 1,213 | |
| ケネディクス | 53 | — | — | |
| 電通 | 9.3 | — | — | |
| びあ | — | 1.7 | 9,248 | |
| シーティーエス | — | 12.6 | 11,277 | |
| アルプス技研 | — | 2.7 | 9,936 | |
| 市進ホールディングス | — | 7 | 3,192 | |
| 日本空調サービス | — | 12.6 | 10,004 | |
| エイジス | — | 1.9 | 4,903 | |
| ユー・エス・エス | 51.4 | — | — | |
| 東京個別指導学院 | — | 10.3 | 10,011 | |
| 楽天 | 91.7 | — | — | |
| 山田コンサルティンググループ | — | 2.4 | 6,451 | |
| セントラルスポーツ | — | 2.4 | 9,888 | |
| シダックス | — | 11.2 | 4,995 | |
| ユニバーサル園芸社 | — | 2.4 | 5,016 | |
| チャーム・ケア・コーポレーション | — | 2.7 | 5,783 | |
| ジェイエスエス | — | 3.1 | 3,224 | |
| バリューHR | — | 2.5 | 11,400 | |
| アビスト | — | 2 | 8,730 | |
| ウィルグループ | — | 7.8 | 12,113 | |
| リログループ | — | 8.9 | 26,424 | |
| 東洋 | — | 8 | 26,680 | |
| 共立メンテナンス | — | 7.5 | 29,550 | |
| イチネンホールディングス | — | 7.1 | 10,969 | |
| スバル興業 | — | 1.2 | 9,816 | |
| 三協フロンテア | — | 1.7 | 4,783 | |
| ナガワ | — | 2 | 9,800 | |
| 精養軒 | — | 2 | 1,884 | |
| 進学会ホールディングス | — | 1.8 | 1,130 | |
| 学究社 | — | 6.1 | 9,955 | |
| ディーエムエス | — | 4.3 | 6,660 | |
| 合 計 | 株数、金額 | 6,656 | 6,807 | 11,916,435 |
| | 銘柄数<比率> | 114 | 475 | <95.0%> |

*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。

*合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切捨て。

*一印は組入れなし。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別 | 当 期 末 | | |
|--------|-------|-------|-------|---------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 | 評 価 損 益 |
| 国内 | | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式先物取引 | TOPIX | 1,002 | — | 4 |

*単位未満は切捨て。

*一印は組入れなし。

投資信託財産の構成

(2017年11月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株 式 | 11,916,435 | 86.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,852,425 | 13.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 13,768,860 | 100.0 |

*評価額の単位未満は切捨て。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2017年11月10日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資 産 | 13,766,526,224 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 1,324,673,973 |
| 株 式 (評 価 額) | 11,916,435,190 |
| 未 収 入 金 | 455,199,361 |
| 未 収 配 当 金 | 65,977,700 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 4,240,000 |
| (B) 負 債 | 1,218,367,933 |
| 未 払 金 | 988,085,640 |
| 未 払 解 約 金 | 166,130,583 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 59,255,644 |
| 未 払 利 息 | 2,079 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 4,893,987 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 12,548,158,291 |
| 元 本 | 10,351,084,365 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 2,197,073,926 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 10,351,084,365口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,123円 |

損益の状況

(自2017年5月11日 至2017年11月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配 当 等 収 益 | 63,125,913 |
| 受 取 配 当 金 | 63,381,201 |
| 受 取 利 息 | 2,802 |
| そ の 他 収 益 金 | 7,483 |
| 支 払 利 息 | △265,573 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 1,446,188,958 |
| 売 買 益 | 2,470,572,951 |
| 売 買 損 | △1,024,383,993 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | 48,827,223 |
| 取 引 益 | 145,647,869 |
| 取 引 損 | △96,820,646 |
| (D) 信 託 報 酬 等 | △64,208,131 |
| (E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D) | 1,493,933,963 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | 243,496,408 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 459,643,555 |
| (配 当 等 相 当 額) | (201,498,057) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (258,145,498) |
| (H) 計 (E + F + G) | 2,197,073,926 |
| (I) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H + I) | 2,197,073,926 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 459,643,555 |
| (配 当 等 相 当 額) | (201,498,057) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (258,145,498) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 1,737,430,371 |

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

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

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

〈注記事項〉

- ・期首元本額 13,707,699,244円
- ・期中追加設定元本額 6,025,628,962円
- ・期中一部解約元本額 9,382,243,841円

■ 収益分配金のお知らせ

当期の収益分配は、見送らせていただきました。