

野村RAFI®日本株投信

運用報告書(全体版)

第26期（決算日2020年7月13日）

作成対象期間（2020年1月15日～2020年7月13日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式	
信託期間	2007年5月30日から2022年7月13日までです。	
運用方針	野村RAFI®日本株投信マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に投資し、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。株式への投資にあたっては、ファンダメンタル・インデックス構成手法を活用して、委託会社が独自に銘柄・ウェイトを選定・計算し、これをベースに株式ポートフォリオを構成することを基本とします。	
主な投資対象	野村RAFI®日本株投信	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村RAFI®日本株投信	株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
	マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
分配方針	毎決算時に原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		参 考 指 数		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 込 分	み 金 騰 落 中 率	東証株価指数 (T O P I X)	期 騰 落 中 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
22期(2018年7月13日)	12,602	120	△ 8.4	1,730.07	△ 8.2	99.0	0.6	2,486
23期(2019年1月15日)	11,515	100	△ 7.8	1,542.72	△10.8	97.7	1.5	2,299
24期(2019年7月16日)	11,462	100	0.4	1,568.74	1.7	98.9	—	2,194
25期(2020年1月14日)	12,452	100	9.5	1,740.53	11.0	99.0	0.4	2,293
26期(2020年7月13日)	10,808	100	△12.4	1,573.02	△ 9.6	99.0	0.4	1,902

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	参 考 指 数 東証株価指数 (T O P I X)	指 数	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2020年 1 月14日	円	%		%	%	%
	12,452	—	1,740.53	—	99.0	0.4
1 月末	12,067	△ 3.1	1,684.44	△ 3.2	98.9	0.4
2 月末	10,873	△12.7	1,510.87	△13.2	99.0	0.4
3 月末	10,033	△19.4	1,403.04	△19.4	97.3	1.5
4 月末	10,386	△16.6	1,464.03	△15.9	97.8	1.6
5 月末	10,965	△11.9	1,563.67	△10.2	97.9	1.6
6 月末	10,833	△13.0	1,558.77	△10.4	98.4	1.2
(期 末) 2020年 7 月13日	10,908	△12.4	1,573.02	△ 9.6	99.0	0.4

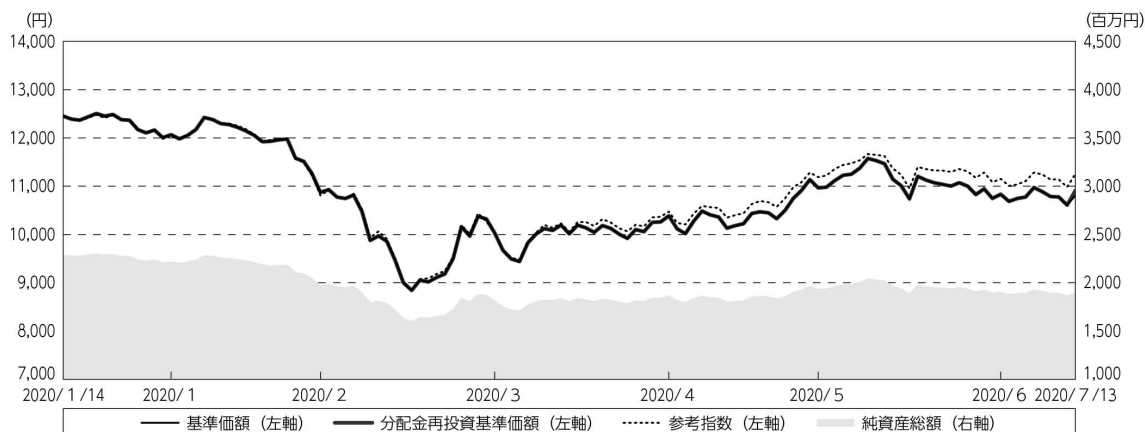
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2020年1月14日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、東証株価指数（TOPIX）です。参考指数は、作成期首（2020年1月14日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

- (下落)・新型コロナウイルス感染者数の急拡大を受け、WHO（世界保健機関）がパンデミック（世界的な大流行）を表明したこと。
- ・東京都の新型コロナウイルス感染者数急増を受けて、ロックダウン（都市封鎖）により国内経済が大きく落ち込むとの見方が広がったこと。
- (上昇)・新型コロナウイルスのワクチン開発報道が相次いだことや国内外の経済活動再開による景気回復期待が高まったこと。

○投資環境

今期前半の日本株市場は、新型コロナウイルスの影響で急落しました。後半は景気回復期待から上昇しましたが、通期では下落となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

【野村RAFI®日本株投信】

主要投資対象である「野村RAFI®日本株投信マザーファンド」受益証券にほぼ全額を投資しました。

【野村RAFI®日本株投信マザーファンド】

・株式組入比率

運用の基本方針に基づき高水準（フルインベストメント）を維持しました。

・期中の主な動き

ファンダメンタル・インデックス構成手法を活用して、野村アセットマネジメントが独自に選定したファンダメンタル指標に基づき、約1,000の銘柄に投資しました。（ファンダメンタル・インデックス構成手法は、株価情報は一切用いず、企業規模尺度である、株主資本、配当額、キャッシュフロー等のファンダメンタル情報のみをもとに銘柄のウェイト付けを行う構成手法です。）

業種配分については、トップダウンに業種配分は行いませんが、ファンダメンタルの大きさに基づいた個別銘柄選択の結果、期末には、銀行業、輸送用機器をオーバーウェイト（市場より多めの投資割合）、電気機器、医薬品をアンダーウェイト（市場より少なめの投資割合）としました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

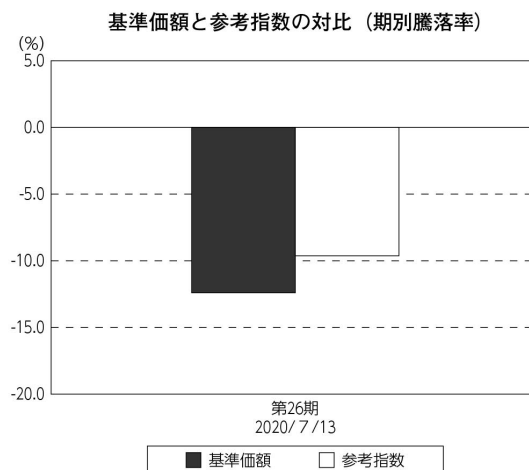
参考指数としている東証株価指数（TOPIX）の騰落率が－9.6%となったのに対し、基準価額の騰落率は－12.4%となりました。

（主なプラス要因）

オーバーウェイトとした情報・通信業が市場を上回って推移したこと。（'20/2）

（主なマイナス要因）

アンダーウェイトとした医薬品が市場を上回って推移したこと。（'20/5）



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

（注）参考指数は、東証株価指数（TOPIX）です。

○分配金

- （１）基準価額水準を勘案し、１万口当たり100円とさせていただきます。
- （２）留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり・税込み）

項 目	第26期
	2020年１月15日～ 2020年７月13日
当期分配金	100
（対基準価額比率）	0.917%
当期の収益	100
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,393

（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

[野村RAFI®日本株投信]

野村RAFI®日本株投信マザーファンドへの投資比率を高位に維持していく方針です。

[野村RAFI®日本株投信マザーファンド]

引き続き、ファンダメンタル・インデックス構成手法に基づいた運用を行っていく方針です。

今後とも変わらぬご愛顧を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

※「RAFI®」は、Research Affiliates, LLCの登録商標であり、当社はその使用を許諾されております。

※当該手法は、株主資本、配当額、キャッシュフロー等のファンダメンタル指標をもとに銘柄のウェイト付けを行なう運用手法で、2020年7月現在、リサーチ・アフィリエイツ社（Research Affiliates, LLC）が知的所有権を申請中です。

※リサーチ・アフィリエイツ社は、野村アセットマネジメントがファンドまたはアカウントの運用のために用いるRAFインデックスの収益性、有効性に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行なうものではなく、いかなる責任も負わないことを明記します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年 1 月15日～2020年 7 月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 59	% 0.544	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(27)	(0.245)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(30)	(0.272)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.002)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.002	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	59	0.548	
期中の平均基準価額は、10,859円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

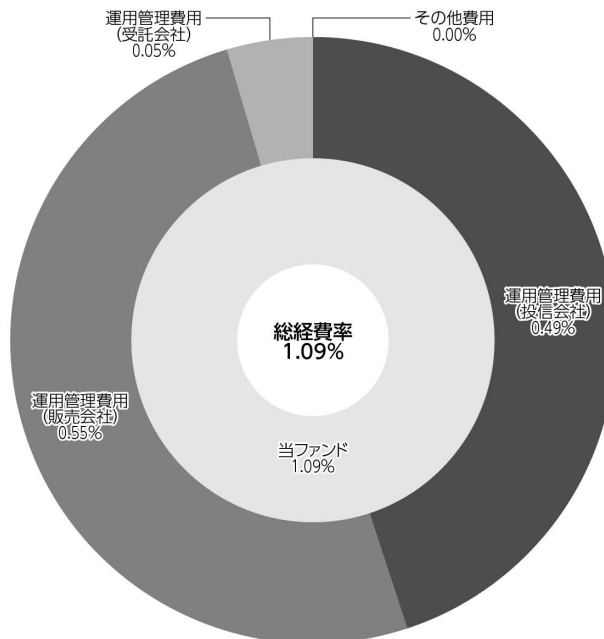
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.09%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2020年1月15日～2020年7月13日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
野村RAFI®日本株投信マザーファンド	千口 2,219	千円 3,200	千口 89,792	千円 117,700

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年1月15日～2020年7月13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
	野村RAFI®日本株投信マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	535,040千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,857,692千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.13

* (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

(2020年1月15日～2020年7月13日)

利害関係人との取引状況

<野村RAFI®日本株投信>

該当事項はございません。

<野村RAFI®日本株投信マザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	269	—	—	265	4	1.5

平均保有割合 49.6%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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

○組入資産の明細

(2020年7月13日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
野村RAFI®日本株投信マザーファンド	1,518,335	1,430,762	1,898,621

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

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

○投資信託財産の構成

(2020年7月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
野村RAFI®日本株投信マザーファンド	1,898,621	98.3
コール・ローン等、その他	32,174	1.7
投資信託財産総額	1,930,795	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年7月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,930,795,433
コール・ローン等	32,174,151
野村RAFI®日本株投信 マザーファンド(評価額)	1,898,621,282
(B) 負債	28,768,500
未払収益分配金	17,599,132
未払解約金	520,935
未払信託報酬	10,616,623
未払利息	18
その他未払費用	31,792
(C) 純資産総額(A－B)	1,902,026,933
元本	1,759,913,292
次期繰越損益金	142,113,641
(D) 受益権総口数	1,759,913,292口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,808円

(注) 期首元本額は1,841,731,845円、期中追加設定元本額は7,626,272円、期中一部解約元本額は89,444,825円、1口当たり純資産額は1.0808円です。

○損益の状況 (2020年1月15日～2020年7月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,685
支払利息	△ 1,685
(B) 有価証券売買損益	△261,324,811
売買益	14,226,440
売買損	△275,551,251
(C) 信託報酬等	△ 10,648,415
(D) 当期損益金(A+B+C)	△271,974,911
(E) 前期繰越損益金	423,624,544
(F) 追加信託差損益金	8,063,140
(配当等相当額)	(101,986,773)
(売買損益相当額)	(△ 93,923,633)
(G) 計(D+E+F)	159,712,773
(H) 収益分配金	△ 17,599,132
次期繰越損益金(G+H)	142,113,641
追加信託差損益金	8,063,140
(配当等相当額)	(101,990,212)
(売買損益相当額)	(△ 93,927,072)
分配準備積立金	671,210,009
繰越損益金	△537,159,508

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2020年1月15日～2020年7月13日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2020年1月15日～ 2020年7月13日
a. 配当等収益(経費控除後)	19,788,495円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	101,990,212円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	669,020,646円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	790,799,353円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,493円
g. 分配金	17,599,132円
h. 分配金(1万口当たり)	100円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	100円
-----------------	------

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。
※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。
※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

野村RAFI[®]日本株投信マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日2020年7月13日）

作成対象期間（2019年7月17日～2020年7月13日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。 わが国の株式を主要投資対象とし、ファンダメンタル・インデックス構成手法を活用して、委託会社が独自に銘柄・ウェイトを選定・計算し、これをベースに株式ポートフォリオを構成することを基本とします。 株式の組入比率は高位を基本とします。 非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。
主な投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率	参 考 指 数 東証株価指数 (T O P I X)	期 騰 落 中 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
9期(2016年7月13日)	円 10,538	% △17.5	1,300.26	% △19.4	% 99.6	% —	百万円 10,050
10期(2017年7月13日)	13,617	29.2	1,619.11	24.5	95.6	1.5	13,971
11期(2018年7月13日)	14,645	7.5	1,730.07	6.9	99.1	0.6	5,934
12期(2019年7月16日)	13,692	△ 6.5	1,568.74	△ 9.3	99.1	—	19,146
13期(2020年7月13日)	13,270	△ 3.1	1,573.02	0.3	99.2	0.4	3,887

*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

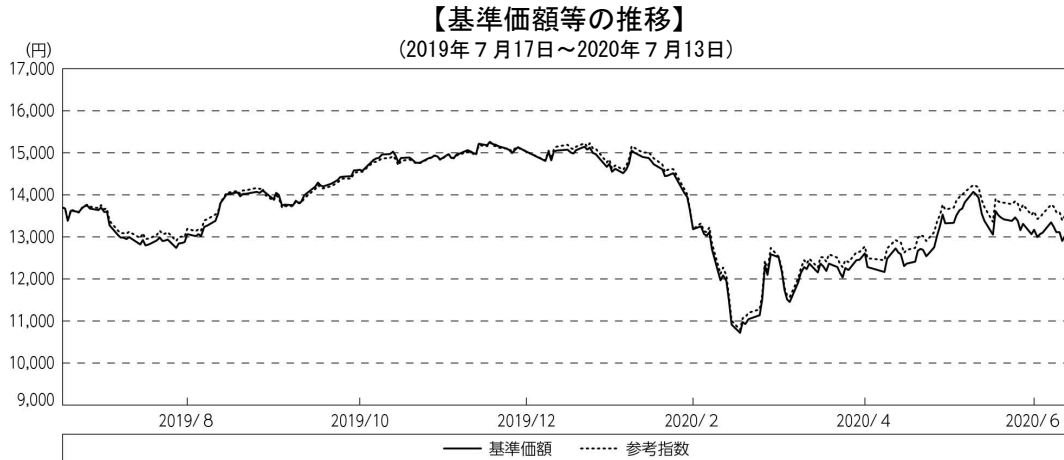
年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	参 考 指 数 東証株価指数 (T O P I X)	騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
(期 首) 2019年7月16日	円 13,692	% —	1,568.74	% —	% 99.1	% —
7月末	13,587	△ 0.8	1,565.14	△ 0.2	99.6	—
8月末	13,064	△ 4.6	1,511.86	△ 3.6	99.3	—
9月末	13,893	1.5	1,587.80	1.2	98.0	1.2
10月末	14,597	6.6	1,667.01	6.3	97.7	1.8
11月末	14,844	8.4	1,699.36	8.3	94.4	5.1
12月末	15,028	9.8	1,721.36	9.7	99.2	0.4
2020年1月末	14,618	6.8	1,684.44	7.4	99.1	0.4
2月末	13,180	△ 3.7	1,510.87	△ 3.7	99.2	0.4
3月末	12,171	△11.1	1,403.04	△10.6	97.5	1.5
4月末	12,609	△ 7.9	1,464.03	△ 6.7	98.0	1.6
5月末	13,321	△ 2.7	1,563.67	△ 0.3	98.1	1.6
6月末	13,173	△ 3.8	1,558.77	△ 0.6	98.4	1.2
(期 末) 2020年7月13日	13,270	△ 3.1	1,573.02	0.3	99.2	0.4

*騰落率は期首比です。

*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

- (上昇) ・ トランプ米大統領が中国との貿易協議の継続に前向きな姿勢を示したことや米政権が対中制裁関税の一部撤回を検討していると報じられたこと。
- ・ 英国の総選挙において保守党が大勝し英国のEU（欧州連合）離脱を巡る不透明感が薄らいだこと。
 - ・ 新型コロナウイルスのワクチン開発報道が相次いだことや国内外の経済活動再開による景気回復期待が高まったこと。
- (下落) ・ 新型コロナウイルス感染者数の急拡大を受け、WHO（世界保健機関）がパンデミック（世界的な大流行）を表明したこと。
- ・ 東京都の新型コロナウイルス感染者数急増を受けて、ロックダウン（都市封鎖）により国内経済が大きく落ち込むとの見方が広がったこと。

○投資環境

今期の日本株市場は、前半は堅調に推移した一方、後半は新型コロナウイルスの影響で乱高下する展開となり、通期ではわずかな上昇となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

運用の基本方針に基づき高水準（フルインベストメント）を維持しました。

・期中の主な動き

ファンダメンタル・インデックス構成手法を活用して、野村アセットマネジメントが独自に選定したファンダメンタル指標に基づき、約1,000の銘柄に投資しました。（ファンダメンタル・インデックス構成手法は、株価情報は一切用いず、企業規模尺度である、株主資本、配当額、キャッシュフロー等のファンダメンタル情報のみをもとに銘柄のウェイト付けを行う構成手法です。）

業種配分については、トップダウンに業種配分は行いませんが、ファンダメンタルの大きさに基づいた個別銘柄選択の結果、期末には、銀行業、輸送用機器をオーバーウェイト（市場より多めの投資割合）、電気機器、医薬品をアンダーウェイト（市場より少なめの投資割合）としました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数としている東証株価指数（TOPIX）の騰落率が+0.3%となったのに対し、基準価額の騰落率は-3.1%となりました。

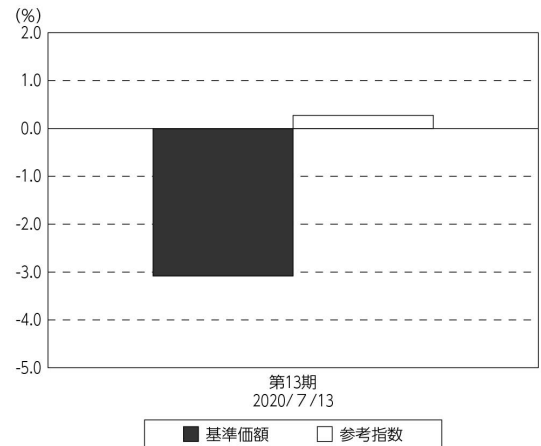
（主なプラス要因）

オーバーウェイトとした銀行業が市場を上回って推移したこと。（'19/9）

（主なマイナス要因）

アンダーウェイトとした医薬品が市場を上回って推移したこと。（'20/5）

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



（注）参考指数は、東証株価指数（TOPIX）です。

◎今後の運用方針

引き続き、ファンダメンタル・インデックス構成手法に基づいた運用を行っていく方針です。

今後とも変わらぬご愛顧を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

※「RAFI®」は、Research Affiliates, LLCの登録商標であり、当社はその使用を許諾されています。

※当該手法は、株主資本、配当額、キャッシュフロー等のファンダメンタル指標をもとに銘柄のウェイト付けを行なう運用手法で、2020年7月現在、リサーチ・アフィリエイツ社（Research Affiliates, LLC）が知的所有権を申請中です。

※リサーチ・アフィリエイツ社は、野村アセットマネジメントがファンドまたはアカウントの運用のために用いるRAFインデックスの収益性、有効性に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行なうものではなく、いかなる責任も負わないことを明記します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年 7 月17日～2020年 7 月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 0	% 0.001	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、13,673円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年 7 月17日～2020年 7 月13日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 1,077 (35)	千円 1,407,469 (ー)	千株 10,925	千円 17,066,290

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国 内		証券 ー (2,400)	千円 ー (ー)	証券 ー (2,400)	千円 ー (ー)

*()内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

先物取引の種類別取引状況

種 別	内 容	買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 414	百万円 416	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2019年7月17日～2020年7月13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	18,473,760千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,410,678千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.19

* (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

(2019年7月17日～2020年7月13日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 1,407	百万円 —	% —	百万円 17,066	百万円 119	% 0.7

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)	107千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	1.0%

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野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2020年7月13日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	8.6	2.3	1,071
マルハニチロ	1.5	0.5	1,064
サカタのタネ	0.7	0.2	663
ホクト	1.4	0.3	603
鉱業 (0.4%)			
日鉄鉱業	0.7	0.2	832
国際石油開発帝石	68.8	18.9	11,988
石油資源開発	4.2	0.8	1,456
K&Oエナジーグループ	1.6	0.3	442
建設業 (2.8%)			
ショーボンドホールディングス	0.6	0.2	960
ミライト・ホールディングス	2.8	0.8	1,253
安藤・間	9.2	1.6	968
東急建設	3.8	1.4	770
コムシスホールディングス	3.1	0.7	2,219
ミサワホーム	3.2	—	—
高松コンストラクショングループ	1.1	0.3	708
東建コーポレーション	0.6	0.2	1,438
大成建設	8.9	1.9	7,372
大林組	31.7	6.3	6,318
清水建設	30.6	6.1	5,191
長谷工コーポレーション	14	3.2	4,329
鹿島建設	20.2	5.1	6,420
西松建設	2.6	0.7	1,454
三井住友建設	5.6	1.7	785
大豊建設	0.6	0.2	485
前田建設工業	7.2	1.8	1,411
奥村組	1.8	0.5	1,261
東鉄工業	1	0.3	813
戸田建設	12.8	2.8	1,990
熊谷組	1.4	0.4	1,034
大東建託	2.5	0.6	5,992
新日本建設	2.8	0.8	672
N I P P O	5.4	1.1	2,970
	千株	千株	千円
前田道路	3.9	0.3	592
日本道路	0.4	0.1	729
東洋建設	2.6	1	390
五洋建設	8.8	1.9	1,109
福田組	0.5	0.2	974
住友林業	8.6	1.6	2,179
大和ハウス工業	27.4	5.8	14,384
ライト工業	1.6	0.4	598
積水ハウス	29.8	5.2	10,782
ユアテック	4.4	1.4	901
中電工	2.8	0.6	1,338
関電工	6.5	1.5	1,350
きんでん	7.3	1.7	3,000
トーエネック	0.9	0.2	740
住友電設	1.3	0.2	478
日本電設工業	2	0.5	1,152
協和エクシオ	2.6	0.7	1,793
九電工	1.8	0.5	1,565
三機工業	2	0.5	604
日揮ホールディングス	7.8	1.4	1,603
太平電業	0.7	0.2	449
高砂熱学工業	2.3	0.5	778
大気社	1.3	0.3	916
日比谷総合設備	1.1	0.3	550
東芝プラントシステム	2.8	—	—
レイズネクト	1.6	0.4	503
食料品 (3.5%)			
日本製粉	2.9	0.7	1,176
日清製粉グループ本社	5.9	1.4	2,231
昭和産業	1.2	0.3	993
三井製糖	1.3	0.4	787
森永製菓	0.9	0.2	818
江崎グリコ	1.4	0.4	2,020
山崎製パン	6.6	1.4	2,539
亀田製菓	0.3	0.1	536

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カルビー	2.4	0.5	1,530
森永乳業	1.8	0.3	1,474
ヤクルト本社	2.1	0.6	3,828
明治ホールディングス	2.9	0.8	6,792
雪印メグミルク	2.2	0.6	1,526
プリマハム	1.7	0.4	1,136
日本ハム	4	0.8	3,536
丸大食品	1.2	0.3	573
S F o o d s	0.6	0.3	762
伊藤ハム米久ホールディングス	9.5	1.9	1,216
サッポロホールディングス	2.9	0.6	1,183
アサヒグループホールディングス	10.2	2.2	8,140
キリンホールディングス	23.1	4.9	10,414
宝ホールディングス	4	1	975
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	5.1	1.2	2,304
サントリー食品インターナショナル	7.6	1.7	7,403
ダイドーグループホールディングス	0.5	0.2	964
伊藤園	1.6	0.3	1,872
日清オイリオグループ	1.2	0.3	1,015
不二製油グループ本社	1.7	0.5	1,449
Jーオイルミルズ	0.7	0.2	808
キッコーマン	2.1	0.5	2,490
味の素	15.8	3.6	6,361
キュービー	3.9	0.9	1,734
ハウス食品グループ本社	1.8	0.5	1,690
カゴメ	1.3	0.4	1,300
アリアケジャパン	0.5	0.1	678
ニチレイ	3	0.8	2,512
東洋水産	2.8	0.5	3,150
日清食品ホールディングス	2	0.4	3,872
フジッコ	0.9	0.3	608
日本たばこ産業	88.9	19.7	38,572
わらべや日洋ホールディングス	0.9	0.2	320
理研ビタミン	0.7	0.4	901
繊維製品 (0.5%)			
グンゼ	0.6	0.2	829
東洋紡	4.5	0.9	1,338
倉敷紡績	1.3	0.3	627
日本毛織	3.5	0.6	594
帝人	9.7	2	3,400

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東レ	62.5	13.7	6,851
セーレン	1.7	0.5	661
ワコールホールディングス	2.8	0.6	1,169
ホギメディカル	0.9	0.2	607
T S I ホールディングス	4.1	1	354
ワールド	1	0.4	588
オンワードホールディングス	8.2	1.7	515
ゴールドウイン	0.1	0.1	662
デサント	1.5	0.4	665
パルプ・紙 (0.4%)			
特種東海製紙	0.5	0.2	930
王子ホールディングス	42	9.3	4,501
日本製紙	7.8	1.4	2,044
三菱製紙	4.3	0.9	307
北越コーポレーション	11	2.5	940
大王製紙	6	1.1	1,593
レンゴー	9.8	2.5	2,087
トーモク	1.3	0.3	535
ザ・バック	0.7	0.2	578
化学 (5.8%)			
クラレ	16.5	3.9	4,348
旭化成	57.3	14.1	11,942
昭和電工	6	1.4	3,250
住友化学	107.5	30.8	10,040
住友精化	0.7	0.2	722
日産化学	2	0.6	3,354
クレハ	0.7	0.2	918
石原産業	2.6	0.8	564
日本曹達	1.8	0.4	1,128
東ソー	16.7	3.8	5,608
トクヤマ	1.7	0.4	996
セントラル硝子	2.2	0.5	969
東亜合成	5.3	1.2	1,299
大阪ソーダ	0.8	0.2	471
関東電化工業	1.5	0.5	429
デンカ	3.6	0.8	2,084
信越化学工業	10.3	1.7	21,794
堺化学工業	0.8	0.2	406
エア・ウォーター	7.4	1.6	2,398
大陽日酸	8.6	1.7	3,058

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本バーカライジング	4.1	1.1	1,218
高圧ガス工業	2.3	0.5	404
四国化成工業	2.2	0.5	533
日本触媒	1.6	0.4	2,204
大日精化工業	1.1	0.3	707
カネカ	3.1	0.8	2,117
三菱瓦斯化学	15.5	3	4,995
三井化学	9.8	2.1	4,712
J S R	9.5	1.9	4,086
東京応化工業	1.6	0.3	1,758
三菱ケミカルホールディングス	100.7	20.1	12,622
KHネオケム	1.7	0.4	846
ダイセル	17.6	3.8	3,024
住友ベークライト	1.4	0.4	1,146
積水化学工業	17.5	3.3	5,049
日本ゼオン	9.7	1.7	1,666
アイカ工業	1.6	0.4	1,424
宇部興産	5.8	1.4	2,529
積水樹脂	1.6	0.4	883
タキロンシーアイ	3.9	0.9	631
日立化成	6.2	—	—
積水化成品工業	2.1	0.6	331
ダイキョーニシカワ	3.9	1.2	567
森六ホールディングス	0.9	0.3	499
日本化薬	7.2	1.4	1,531
扶桑化学工業	1	0.2	840
A D E K A	4.4	1	1,468
日油	1.9	0.5	1,950
花王	7.4	1.5	12,768
三洋化成工業	0.9	0.2	932
日本ペイントホールディングス	5.8	1	8,020
関西ペイント	6	0.9	1,971
中国塗料	2.5	0.5	416
太陽ホールディングス	1.1	0.2	1,038
エスケー化研	0.1	0.1	3,680
D I C	4.8	1.2	3,308
サカタインクス	2.7	0.7	739
東洋インキＳＣホールディングス	3.2	0.7	1,459
富士フイルムホールディングス	13.4	2.4	11,126
資生堂	2.4	0.6	4,057

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ライオン	3.2	0.8	2,131
高砂香料工業	0.8	0.3	639
マンダム	1.2	0.3	570
ファンケル	1.3	0.3	937
コーセー	0.5	0.2	2,418
ポーラ・オルビスホールディングス	3.3	0.9	1,604
ノエビアホールディングス	0.7	0.2	907
コニシ	1.2	0.3	437
長谷川香料	1.6	0.3	708
上村工業	0.3	0.1	672
小林製薬	1	0.2	1,874
デクセリアルズ	3.9	0.6	493
アース製薬	0.4	0.1	691
クミアイ化学工業	3	0.5	508
日本農薬	0.7	0.7	348
日東電工	6.6	1.4	8,400
藤森工業	0.9	0.2	721
未来工業	0.7	0.2	378
J S P	1.3	0.4	582
エフピコ	0.8	0.2	1,736
天馬	1.2	0.3	492
信越ポリマー	2.9	0.6	551
ニフコ	3.3	0.7	1,593
ユニ・チャーム	6.5	1.5	7,336
医薬品 (3.6%)			
協和キリン	10.4	1.9	5,213
武田薬品工業	36.9	7.2	26,798
アステラス製薬	57.6	10.8	18,835
大日本住友製薬	6.6	1.9	2,650
塩野義製薬	5.2	1.3	8,121
田辺三菱製薬	27	—	—
日本新薬	0.6	0.2	1,600
中外製薬	5.2	1.8	9,720
科研製薬	1.5	0.3	1,572
エーザイ	6.5	1.2	10,366
ロート製薬	1.7	0.4	1,388
小野薬品工業	10.7	2.2	6,408
久光製薬	2	0.5	2,530
持田製薬	0.8	0.3	1,203
参天製薬	10	1.6	3,004

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツムラ	2.3	0.5	1,408
日医工	2.3	0.7	870
キッセイ薬品工業	1.7	0.4	983
生化学工業	2	0.4	432
鳥居薬品	1	0.2	631
東和薬品	1.2	0.4	764
沢井製薬	1.4	0.3	1,584
ゼリア新薬工業	1.3	0.3	579
第一三共	10.2	1.6	13,721
キョーリン製薬ホールディングス	2.9	0.7	1,467
大塚ホールディングス	17.5	3.1	14,232
大正製薬ホールディングス	1.7	0.6	3,798
石油・石炭製品 (0.7%)			
日本コークス工業	18.4	4.8	307
ニチレキ	0.9	0.4	647
富士石油	7.1	—	—
出光興産	7.9	2.2	5,031
ENEOSホールディングス	176.8	49.6	19,021
コスモエネルギーホールディングス	4.8	1.2	1,837
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	8	1.7	2,575
TOYO TIRE	5.8	1.1	1,580
ブリヂストン	33.4	7.8	27,073
住友ゴム工業	19.5	4	3,960
オカモト	0.5	0.2	798
西川ゴム工業	1.1	0.3	430
ニッタ	0.9	0.3	713
住友理工	5.2	1.1	660
三ツ星ベルト	1.4	0.4	700
バンドー化学	2.1	0.6	390
ガラス・土石製品 (0.8%)			
日東紡績	1.8	0.2	1,024
AGC	11.7	2.4	7,452
日本電気硝子	5.3	1.4	2,382
住友大阪セメント	1.9	0.4	1,496
太平洋セメント	5.8	1.4	3,351
東海カーボン	4.3	1.4	1,386
ノリタケカンパニーリミテド	0.5	0.2	676
TOTO	4.1	0.8	3,424
日本碍子	13.4	2.6	3,741

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本特殊陶業	7.9	1.8	2,658
フジミインコーポレーテッド	0.7	0.2	740
ニチアス	2.6	0.5	1,154
ニチハ	1.2	0.3	686
鉄鋼 (1.4%)			
日本製鉄	65.2	23.8	24,514
神戸製鋼所	35.7	9.7	3,618
合同製鐵	1.1	0.2	363
ジェイ エフ イー ホールディングス	45	16.3	13,007
東京製鐵	5.3	1.6	1,012
共英製鋼	2.1	0.4	511
大和工業	2.8	0.7	1,495
大阪製鐵	1.8	0.5	614
淀川製鋼所	1.7	0.4	730
丸一鋼管	3	0.7	1,880
大同特殊鋼	2.2	0.5	1,710
山陽特殊製鋼	1.9	0.8	689
愛知製鋼	1.4	0.3	912
日立金属	20.6	3.5	4,630
新日本電工	7.8	—	—
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	32.8	8.1	1,522
三井金属鉱業	2.9	0.6	1,408
東邦亜鉛	0.6	0.2	308
三菱マテリアル	8.1	1.9	4,421
住友金属鉱山	10.7	2.2	7,075
DOWAホールディングス	3.4	0.6	2,001
古河機械金属	2.2	0.5	553
UACJ	3	0.6	1,131
古河電気工業	2.7	0.8	2,102
住友電気工業	40.7	8.4	10,815
フジクラ	17.1	3.7	1,169
リョービ	1.5	0.5	568
アーレスティ	3.9	1.1	376
アサヒホールディングス	1.4	0.3	836
金属製品 (0.6%)			
トーカロ	1.2	0.4	464
SUMCO	9.6	1.6	2,611
川田テクノロジーズ	0.1	0.1	483
東洋製罐グループホールディングス	6.6	1.6	1,897

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ホッカンホールディングス	1.1	0.3	515
コロナ	1.7	0.3	307
横河ブリッジホールディングス	1.2	0.3	630
三和ホールディングス	6.5	1.5	1,393
文化シヤッター	3.8	0.7	533
三協立山	2.6	0.5	465
L I X I Lグループ	13.1	2.7	4,101
ノーリツ	2.3	0.5	678
長府製作所	1.3	0.3	661
リンナイ	1.5	0.3	2,682
岡部	2.6	0.5	406
ジーテクト	3.1	0.7	678
東ブレ	2.6	0.8	918
高周波熱錬	2	—	—
バイオラックス	1.4	0.4	642
エイチワン	2.7	0.9	493
日本発條	13	2.7	1,806
三益半導体工業	1.1	0.2	472
機械 (4.1%)			
日本製鋼所	1.8	0.4	622
三浦工業	1.8	0.3	1,290
タクマ	2.4	0.6	910
オークマ	1	0.3	1,381
芝浦機械	1.1	0.2	423
アマダ	15.6	3.1	2,480
アイダエンジニアリング	3.8	0.7	518
F U J I	3.6	0.7	1,339
牧野フライス製作所	1.1	0.3	994
オーエスジー	2.8	0.7	1,160
旭ダイヤモンド工業	3	0.7	324
DMG森精機	3.7	0.9	1,175
ソディック	2.5	0.6	497
ディスコ	0.8	0.1	2,765
日東工器	0.8	0.2	383
島精機製作所	0.8	0.3	410
やまびこ	1.8	0.5	475
ニューフレアテクノロジー	0.6	—	—
ナブテスコ	3.2	0.7	2,390
三井海洋開発	1.7	0.6	922
SMC	1.2	0.2	11,374

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニオンツール	0.5	0.2	531
オイレス工業	1.3	0.3	425
サトーホールディングス	1	0.2	490
小松製作所	35.2	8.7	19,131
住友重機械工業	4.7	1.2	2,746
日立建機	7.9	1.5	4,695
井関農機	1.2	0.3	344
ハーモニック・ドライブ・システムズ	1	0.2	1,220
クボタ	35.6	8.2	12,976
月島機械	1.3	0.3	348
新東工業	2.4	0.5	385
澁谷工業	0.4	0.2	582
アイチ コーポレーション	3.5	0.8	629
小森コーポレーション	3.4	0.7	484
荏原製作所	3.4	0.7	1,820
ダイキン工業	4.9	1	18,770
栗田工業	3.3	0.7	2,110
椿本チエイン	1.8	0.5	1,309
ダイフク	1.3	0.3	3,033
加藤製作所	0.8	0.3	364
タダノ	5.9	1.3	1,159
フジテック	3.7	0.6	1,175
CKD	3	0.4	871
平和	5.4	1.1	1,989
理想科学工業	1.6	0.4	550
SANKYO	3.4	0.7	1,928
マースグループホールディングス	0.9	0.2	328
フクシマガリレイ	0.3	0.2	673
ユニバーサルエンターテインメント	1.5	0.7	1,374
竹内製作所	1.5	0.5	919
アマノ	2.1	0.4	910
マックス	1.9	0.3	460
グローリー	2.9	0.5	1,251
大和冷機工業	1.6	0.4	389
セガサミーホールディングス	7.8	1.5	1,957
リケン	0.5	0.2	560
T P R	2.3	0.6	885
ツバキ・ナカシマ	1.6	0.4	330
ホンザキ	1.2	0.3	2,676
大豊工業	2.5	0.7	378

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本精工	27.6	5.8	4,535
NTN	31.2	6.5	1,371
ジェイテクト	19.5	4.1	3,321
不二越	1.2	0.3	1,029
THK	4.3	0.9	2,480
イーグル工業	3.3	0.9	635
キッツ	3.4	1.1	748
マキタ	5.9	1.3	5,271
日立造船	9.4	1.7	651
三菱重工業	13.5	4.2	10,911
I H I	4.7	1.3	2,044
スター精密	1.5	0.4	522
電気機器 (10.0%)			
日清紡ホールディングス	10.3	1.7	1,307
イビデン	4.2	0.7	2,215
コニカミノルタ	21.8	6.7	2,499
ブラザー工業	10.8	2.2	4,177
ミネベアミツミ	10.3	2	3,780
日立製作所	35.5	8.4	28,635
三菱電機	75.4	15.8	21,914
富士電機	4.9	1.1	3,159
安川電機	3.9	0.7	2,866
明電舎	2.6	0.4	653
山洋電気	0.6	0.1	484
東芝テック	1.2	0.2	859
マブチモーター	2.7	0.6	2,007
日本電産	3.4	1.4	9,927
ダイヘン	1.2	0.2	823
JVCケンウッド	7.2	1.9	298
日新電機	4.7	0.8	839
オムロン	4.7	0.9	6,633
日東工業	1.7	0.3	549
I D E C	0.8	0.2	331
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3.4	0.8	1,467
メルコホールディングス	0.5	0.2	658
日本電気	6.7	1.4	8,078
富士通	7.3	1.2	15,948
沖電気工業	6	0.9	956
サンケン電気	0.9	0.2	413
ルネサスエレクトロニクス	49.6	10.7	6,623

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セイコーエプソン	17.2	4.2	5,220
ワコム	4.3	—	—
アルバック	1.4	0.4	1,330
E I Z O	0.7	0.2	834
日本信号	2.6	0.4	437
能美防災	1.6	0.3	629
エレコム	0.7	0.2	1,072
パナソニック	110	24.5	24,394
シャープ	7.3	1.5	1,723
アンリツ	2.3	0.4	1,007
富士通ゼネラル	4.1	0.5	1,209
ソニー	28.7	5.1	41,310
TDK	4.4	0.7	7,602
アルプスアルパイン	6.5	1.4	1,982
フォスター電機	1.8	0.3	342
ホシデン	0.9	0.4	378
ヒロセ電機	1.1	0.3	3,573
日本航空電子工業	4.6	0.7	1,046
マクセルホールディングス	2.6	0.6	564
横河電機	5.6	1.3	2,154
新電元工業	0.6	0.2	415
アズビル	3.2	0.6	2,070
日本光電工業	1.5	0.4	1,430
堀場製作所	1.2	0.2	1,172
アドバンテスト	1.9	0.4	2,796
キーエンス	0.9	0.3	13,650
シスメックス	2.4	0.5	4,011
OBARA GROUP	0.7	0.2	693
イリソ電子工業	0.5	0.1	318
スタンレー電気	4.8	1.2	3,148
ウシオ電機	5.2	0.8	1,079
カシオ計算機	8.9	1.3	2,399
ファナック	5	1.2	24,438
フクダ電子	0.6	0.2	1,334
エンプラス	0.8	0.2	461
ローム	3.3	0.7	5,005
浜松ホトニクス	2.1	0.5	2,432
新光電気工業	7.6	0.9	1,563
京セラ	9.7	2.1	12,257
太陽誘電	3.9	0.6	2,082

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
村田製作所	16.4	2.8	18,370
双葉電子工業	1.4	0.4	395
K O A	1.2	0.3	287
市光工業	1.4	0.6	291
小糸製作所	3.3	1	4,435
ミツバ	5.1	0.8	308
S C R E E Nホールディングス	1.5	0.3	1,620
キャノン電子	2.2	0.5	810
キャノン	53.5	14.1	29,758
リコー	26.1	5.3	4,245
象印マホービン	2	0.3	414
東京エレクトロン	3.9	0.6	17,562
輸送用機器 (13.3%)			
トヨタ紡織	8.5	2	2,814
ユニプレス	3.3	0.9	798
豊田自動織機	14.1	2.8	15,876
モリタホールディングス	1.3	0.4	726
デンソー	33.9	7.9	33,717
東海理化電機製作所	4.9	1	1,516
三井E&Sホールディングス	5.4	1.1	469
川崎重工業	9.7	2.1	3,273
三菱ロジスネクスト	2.9	0.6	547
日産自動車	373.1	142.9	55,973
いすゞ自動車	38.6	11.6	11,184
トヨタ自動車	154	32	216,384
日野自動車	33.7	5.7	4,104
三菱自動車工業	66	15.6	4,274
武蔵精密工業	3.1	0.7	622
日産車体	5.7	1	906
新明和工業	2.9	0.6	605
極東開発工業	2.1	0.5	675
日信工業	4	0.6	1,330
トビー工業	1.4	0.4	468
タチエス	1.6	0.4	356
N O K	11.3	2.4	3,177
フタバ産業	5.7	0.9	387
K Y B	2.3	0.4	777
大同メタル工業	3.1	0.8	428
プレス工業	5.8	1.8	534
太平洋工業	2.3	0.6	540

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ケーヒン	3.9	0.7	1,787
河西工業	4.4	1	428
アイシン精機	18.3	4	12,480
マツダ	42.6	16.6	11,337
本田技研工業	113.1	22.7	63,401
スズキ	15	3.9	15,026
S U B A R U	44.2	11	24,739
ヤマハ発動機	17.5	3.3	5,603
ショーワ	2.6	0.5	1,128
エクセディ	3.1	0.7	1,041
ハイレックスコーポレーション	2.7	0.6	693
豊田合成	6.6	1.3	2,841
愛三工業	5.2	1	514
日本精機	2.9	0.7	880
ヨロズ	2.1	0.5	520
エフ・シー・シー	2.1	0.5	899
シマノ	1.5	0.3	6,327
テイ・エス テック	3.5	0.8	2,320
精密機器 (0.9%)			
テルモ	8.6	1.7	6,674
日機装	2.5	0.5	476
島津製作所	4.1	0.8	2,334
ナカニシ	1.6	0.4	584
東京精密	1.4	0.3	1,038
ニコン	14.1	3.5	3,118
トプコン	2.3	0.6	502
オリンパス	17.6	2.5	5,095
タムロン	1.3	0.2	362
HOYA	5.5	1	10,860
朝日インテック	0.8	0.2	594
シチズン時計	17.8	3.6	1,195
セイコーホールディングス	2.3	0.5	834
ニプロ	5.9	1.5	1,723
その他製品 (1.2%)			
パラマウントベッドホールディングス	0.8	0.2	900
バンダイナムコホールディングス	4.4	0.8	4,726
パイロットコーポレーション	0.7	0.3	1,006
トッパン・フォームズ	6.3	1	1,074
フジシールインターナショナル	0.8	0.4	794
タカラトミー	2.1	0.5	428

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大建工業	0.6	0.3	538
凸版印刷	18.6	3	5,229
大日本印刷	11.4	2	4,954
共同印刷	0.7	0.2	547
N I S S H A	1.6	0.9	885
アシックス	5.2	0.9	1,141
ヤマハ	3.3	0.7	3,405
ビジョン	1.3	0.3	1,330
リンテック	2.9	0.7	1,815
任天堂	1.3	0.3	14,640
三菱鉛筆	1.4	0.4	510
タカラスタンダード	3.1	0.6	922
コクヨ	3.6	0.9	1,137
オカムラ	3.5	1	760
美津濃	1	0.2	404
電気・ガス業 (3.0%)			
東京電力ホールディングス	292.4	82.3	26,171
中部電力	47.4	8.7	11,905
関西電力	57.4	11.7	12,671
中国電力	20.3	4.1	5,768
北陸電力	18	3.7	2,523
東北電力	44.5	10	10,310
四国電力	10.2	3.1	2,476
九州電力	30.6	7.6	6,908
北海道電力	21.4	5.4	2,203
沖縄電力	2.9	0.6	1,066
電源開発	12	2.7	4,919
東京瓦斯	21	4.6	12,121
大阪瓦斯	21	4.3	9,326
東邦瓦斯	3.1	0.7	3,843
北海道瓦斯	1.4	0.3	474
西部瓦斯	1.8	0.4	1,032
静岡ガス	3.7	0.8	711
メタウォーター	0.7	0.2	955
陸運業 (3.4%)			
東武鉄道	6.8	1.1	3,778
相鉄ホールディングス	2.6	0.6	1,672
東急	16	3.2	4,486
京浜急行電鉄	6.1	1.1	1,743
小田急電鉄	7.4	1.4	3,696

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
京王電鉄	2.3	0.5	2,970
京成電鉄	3.7	0.7	2,215
東日本旅客鉄道	13.8	3.4	24,578
西日本旅客鉄道	6.3	1.3	7,051
東海旅客鉄道	6.6	1.9	29,317
西武ホールディングス	10.2	2.3	2,633
鴻池運輸	2.3	0.6	651
西日本鉄道	2.7	0.6	1,723
ハマキョウレックス	0.6	0.2	647
サカイ引越センター	0.3	0.1	528
近鉄グループホールディングス	4.2	0.7	3,262
阪急阪神ホールディングス	8.7	1.5	5,235
南海電気鉄道	3.4	0.8	1,930
京阪ホールディングス	2.2	0.4	1,864
名古屋鉄道	5.1	0.9	2,651
日本通運	3.3	0.7	3,997
ヤマトホールディングス	7.5	2.5	6,860
山九	1.5	0.4	1,610
丸全昭和運輸	0.8	0.2	618
センコーグループホールディングス	6	1.4	1,139
トナミホールディングス	0.3	0.1	570
ニッコンホールディングス	2.7	0.6	1,252
福山通運	1.6	0.4	1,512
セイノーホールディングス	7.8	1.8	2,514
神奈川中央交通	0.5	0.2	804
日立物流	2.7	0.7	2,051
九州旅客鉄道	2.8	0.7	1,796
S Gホールディングス	5.6	1.5	5,632
海運業 (0.2%)			
日本郵船	8.2	1.8	2,709
商船三井	6.4	1.2	2,370
川崎汽船	4.9	0.6	634
N S ユナイテッド海運	1.5	0.5	740
飯野海運	7.9	1.9	646
空運業 (0.5%)			
日本航空	21	6.1	12,108
A N Aホールディングス	14.2	3.1	7,630
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
日新	1.1	0.3	451
三菱倉庫	2.8	0.6	1,653

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井倉庫ホールディングス	0.9	0.3	460
住友倉庫	4	0.8	1,014
日本トランスシティ	3.9	0.8	382
名港海運	1.8	0.4	458
上組	4	0.9	1,868
近鉄エクスプレス	2.6	0.6	1,137
情報・通信業 (12.1%)			
NEC ネットエスアイ	2	0.9	2,010
日鉄ソリューションズ	2	0.4	1,144
T I S	1.5	0.9	2,046
グリー	13.3	2.1	997
コーエーテクモホールディングス	3.3	0.5	1,772
ネクソン	10.7	1.8	4,710
コロブラ	6.2	0.9	979
ティーガイア	2.3	0.4	798
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3.19	0.9	1,833
インターネットイニシアティブ	1.1	0.3	1,078
L I N E	1.2	0.2	1,112
アルテリア・ネットワークス	0.8	0.3	594
フジ・メディア・ホールディングス	12.2	2.9	2,868
オービック	1.1	0.2	3,886
Zホールディングス	167	26.9	14,391
トレンドマイクロ	3	0.6	3,780
日本オラクル	2.2	0.3	4,035
オービックビジネスコンサルタント	1	0.2	1,196
伊藤忠テクノソリューションズ	4.5	0.8	3,396
大塚商会	3.4	0.7	4,004
電通国際情報サービス	0.6	0.2	1,004
東映アニメーション	0.5	0.2	1,030
デジタルガレージ	0.3	0.2	741
WOWOW	1	0.3	732
ネットワンシステムズ	1.2	0.3	1,071
エイベックス	2.1	0.5	442
日本ユニシス	1.8	0.4	1,312
兼松エレクトロニクス	0.8	0.2	807
東京放送ホールディングス	6.9	1.6	2,673
日本テレビホールディングス	12.1	3.1	3,658
朝日放送グループホールディングス	2.5	0.6	444
テレビ朝日ホールディングス	4.8	1	1,528
スカパーJ S A Tホールディングス	17.4	3.7	1,565

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
テレビ東京ホールディングス	1	0.3	704
コネクシオ	2.2	0.4	561
日本電信電話	98.4	40.3	102,503
K D D I	96.2	16.7	55,277
ソフトバンク	111.9	21.4	30,024
光通信	0.7	0.2	4,534
沖縄セルラー電話	1.1	0.3	1,252
N T T ドコモ	139.4	24.7	72,877
GMO インターネット	3.3	0.5	1,520
KADOKAWA	2.8	0.3	697
ゼンリン	0.7	0.3	355
松竹	0.2	0.1	1,439
東宝	3.5	0.7	2,541
東映	0.3	0.1	1,446
エヌ・ティ・ティ・データ	29.8	6.6	8,078
D T S	1	0.3	677
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2.6	0.4	2,220
カプコン	1.8	0.4	1,688
S C S K	2.7	0.5	2,620
T K C	0.7	0.2	1,202
富士ソフト	0.7	0.2	907
N S D	1	0.4	778
コナミホールディングス	2.6	0.6	2,043
ソフトバンクグループ	69.1	15.1	98,633
卸売業 (5.4%)			
伊藤忠食品	0.4	0.1	499
あらた	0.6	0.2	950
双日	64.9	14.8	3,507
アルフレッサ ホールディングス	5	1.4	3,150
横浜冷凍	1.9	0.4	357
神戸物産	0.2	0.2	1,340
あい ホールディングス	1.1	0.3	462
ダイワボウホールディングス	0.5	0.2	1,424
マクニカ・富士エレホールディングス	2.2	0.5	768
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2.4	0.7	718
T O K A I ホールディングス	4.9	1	1,000
シップヘルスケアホールディングス	1.1	0.3	1,389
小野建	1.2	0.4	482
ナガイレーベン	0.9	0.2	555
三菱食品	2.1	0.5	1,410

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一興商	1.6	0.4	1,262
メディバルホールディングス	6.4	1.5	3,046
アズワン	0.3	0.1	1,135
ドウシシャ	1.6	0.4	668
岡谷銅機	0.5	0.2	1,696
シークス	1.5	0.4	376
伊藤忠商事	72.4	12.6	29,830
丸紅	108.2	30.8	15,088
長瀬産業	5.4	1.2	1,576
蝶理	1.5	0.3	503
豊田通商	14.7	3	8,289
兼松	4	0.9	1,155
三井物産	95.1	21.7	34,774
日本紙パルプ商事	0.7	0.2	758
日立ハイテク	2.9	—	—
カメイ	3.1	0.6	619
山善	3.4	0.9	843
住友商事	65.4	16.9	21,158
三菱商事	75	17.6	40,092
キヤノンマーケティングジャパン	5.4	1	2,179
三谷商事	0.8	0.2	1,320
ユアサ商事	1.1	0.3	904
阪和興業	2.3	0.6	1,200
菱電商事	1.1	0.3	436
岩谷産業	2	0.5	1,872
三愛石油	3.4	0.7	643
稲畑産業	2.9	0.7	898
ワキタ	2.5	0.6	568
東邦ホールディングス	2.5	0.7	1,360
サンゲツ	2.1	0.5	743
ミツウロコグループホールディングス	3	0.4	458
伊藤忠エネクス	6.5	1.6	1,372
サンリオ	2.8	0.5	786
リョーサン	1	0.3	652
加賀電子	1.4	0.3	610
PALTAC	1.3	0.3	1,548
日鉄物産	1.6	0.4	1,374
トラスコ中山	1.3	0.4	1,070
オートバックスセブン	3.1	0.7	957
加藤産業	1.2	0.3	1,023

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イエローハット	2	0.4	602
日伝	1.3	0.3	677
因幡電機産業	1.1	0.5	1,256
ミスミグループ本社	3.1	0.7	1,896
スズケン	2.3	0.6	2,343
ジェコス	1.9	0.5	437
小売業 (4.2%)			
ローソン	4.4	1	5,710
サンエー	0.9	0.2	820
カワチ薬品	1.2	0.3	874
エービーシー・マート	2.1	0.4	2,436
アスクル	1.4	0.2	735
ゲオホールディングス	2.5	0.7	1,014
アダストリア	1.8	0.3	483
日本マクドナルドホールディングス	0.8	0.2	1,114
パルグループホールディングス	0.6	0.4	480
エディオン	6.2	1.1	1,170
セリア	0.9	0.3	1,243
ナフコ	2.2	0.6	880
アルペン	1.8	0.4	689
ビックカメラ	4.1	1	1,218
DCMホールディングス	6	1.4	1,836
MonotaRO	0.4	0.2	918
J. フロント リテイリング	12.8	2.1	1,417
ドトール・日レスホールディングス	1.6	0.4	665
マツモトキヨシホールディングス	2.7	0.5	1,960
ZOZO	3.4	0.5	1,350
ココカラファイン	0.7	0.2	1,210
三越伊勢丹ホールディングス	15	3.2	1,891
ウエルシアホールディングス	1.4	0.3	2,661
クリエイトSDホールディングス	1.2	0.3	1,042
ジョイフル本田	2.8	0.6	883
すかいらーくホールディングス	6.1	0.9	1,453
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	4.2	1.1	1,369
日本調剤	0.6	0.4	674
コスモス薬品	0.3	0.2	3,646
セブン&アイ・ホールディングス	31.6	6.5	22,535
ツルハホールディングス	0.9	0.2	2,934
サンマルクホールディングス	0.9	0.3	473
トリドールホールディングス	1	0.4	469

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
クスリのアオキホールディングス	0.3	0.1	1,019	
スシローグローバルホールディングス	0.4	0.4	977	
L I X I L ビバ	2.7	0.5	1,298	
ノジマ	1.9	0.5	1,354	
良品計画	0.4	1	1,350	
コーナン商事	1.5	0.5	1,810	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1.6	1.4	3,367	
西松屋チェーン	2.9	0.6	667	
ゼンショーホールディングス	1.7	0.5	1,041	
ワークマン	0.8	0.1	991	
サイゼリヤ	1.4	0.3	573	
V Tホールディングス	6.9	1.3	461	
ユナイテッドアローズ	0.8	0.2	331	
老番屋	0.2	0.1	492	
スギホールディングス	1.5	0.3	2,289	
ヨンドシーホールディングス	1	0.2	380	
ファミリーマート	7.2	2	4,636	
上新電機	1.2	0.3	640	
日本瓦斯	0.9	0.3	1,441	
島忠	2	0.5	1,505	
チヨダ	1.7	0.4	401	
ライフコーポレーション	1.6	0.4	1,670	
A O K I ホールディングス	4.9	1.1	653	
オークワ	2	0.4	622	
コメリ	2.2	0.6	1,696	
青山商事	3.5	1.2	763	
しまむら	1.5	0.4	2,972	
高島屋	9.2	2.2	1,777	
エイチ・ツー・オー リテイリング	6.1	1.6	1,078	
パルコ	4.3	—	—	
丸井グループ	4.4	0.8	1,401	
アクシアル リテイリング	0.7	0.2	914	
イオン	27.3	4.1	10,061	
イズミ	1.8	0.5	1,677	
平和堂	2.2	0.6	1,149	
フジ	1.4	0.3	545	
ヤオコー	0.7	0.2	1,630	
ゼビオホールディングス	2.5	0.5	396	
ケーズホールディングス	10.9	1.6	2,241	
A Tグループ	2.8	0.8	1,056	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アインホールディングス	0.5	0.2	1,400
ヤマダ電機	31.2	6.2	3,124
アークランドサカモト	1.8	0.5	931
ニトリホールディングス	1.5	0.3	6,658
吉野家ホールディングス	1.1	0.2	413
王将フードサービス	0.3	0.1	575
プレナス	1.7	0.3	514
ミニストップ	1.1	0.3	461
アークス	2.1	0.6	1,576
パローホールディングス	2	0.6	1,321
ベルク	0.5	0.2	1,560
ファーストリテイリング	0.7	0.2	12,128
サンドラッグ	3	0.6	2,118
ペルーナ	3.8	1.1	710
銀行業 (10.0%)			
めぶきフィナンシャルグループ	88.3	20.6	5,211
東京きらぼしフィナンシャルグループ	6.1	1.2	1,378
九州フィナンシャルグループ	47.4	8.3	3,726
ゆうちょ銀行	23	5.2	4,300
コンコルディア・フィナンシャルグループ	94	18.8	6,523
西日本フィナンシャルホールディングス	15	3.4	2,410
関西みらいフィナンシャルグループ	16.1	6.9	2,766
三十三フィナンシャルグループ	3.8	1	1,335
第四北越フィナンシャルグループ	2.7	0.9	1,847
新生銀行	13.6	3	3,924
あおぞら銀行	10.9	2.2	4,142
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,003.8	218.2	92,102
りそなホールディングス	203.3	53	19,636
三井住友トラスト・ホールディングス	21.5	5.3	15,881
三井住友フィナンシャルグループ	102.4	26	79,846
千葉銀行	44.3	9.8	5,076
群馬銀行	32.6	8	2,696
武蔵野銀行	2.9	0.8	1,246
千葉興業銀行	11.5	2.4	535
筑波銀行	11.5	1.8	293
七十七銀行	6.3	1.4	2,168
青森銀行	1.3	0.3	657
秋田銀行	1.9	0.4	589
山形銀行	2	0.5	637
岩手銀行	1.5	0.4	1,012

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東邦銀行	19.3	4.1	918
みちのく銀行	1.4	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	11.1	2.3	3,896
静岡銀行	32.5	7.1	4,962
十六銀行	4	0.7	1,363
スルガ銀行	14.1	2.9	1,078
八十二銀行	41.8	8	3,264
山梨中央銀行	3.8	0.9	767
大垣共立銀行	3.4	0.7	1,544
福井銀行	2	0.4	644
北國銀行	2	0.4	1,178
清水銀行	1.2	—	—
滋賀銀行	3.6	0.7	1,731
南都銀行	3.3	0.6	1,228
百五銀行	21.5	4.6	1,490
京都銀行	3.8	0.8	3,128
紀陽銀行	4.6	0.9	1,468
ほくほくフィナンシャルグループ	14.3	3.2	2,857
広島銀行	24.8	5.8	2,946
山陰合同銀行	10.7	2.7	1,425
中国銀行	13.8	2.6	2,553
伊予銀行	24.9	5.1	3,381
百十四銀行	2.9	0.7	1,261
四国銀行	4.1	0.9	691
阿波銀行	2.3	0.6	1,419
大分銀行	1.5	0.4	944
宮崎銀行	1.7	0.4	932
佐賀銀行	1.8	0.4	478
沖縄銀行	1.2	0.3	925
琉球銀行	3.5	0.7	655
セブン銀行	43.6	8.6	2,476
みずほフィナンシャルグループ	1,930.5	457.9	61,450
山口フィナンシャルグループ	16.6	4.7	3,055
名古屋銀行	1.5	0.4	951
北洋銀行	50.4	9.6	2,025
愛知銀行	1.2	0.3	829
中京銀行	1.2	0.3	616
大光銀行	1.1	0.3	413
愛媛銀行	3.2	0.6	709
京葉銀行	12.8	2.7	1,387

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
栃木銀行	19.3	3.7	592
東和銀行	6.6	1	676
トモニホールディングス	15.5	3.2	1,100
フィデアホールディングス	25.2	5.1	510
池田泉州ホールディングス	30.8	8.4	1,344
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	1.9	0.5	273
S B I ホールディングス	7.3	1.7	3,716
ジャフコ	1.9	0.4	1,488
大和証券グループ本社	207.6	40.4	18,951
岡三証券グループ	13.9	2.9	957
丸三証券	4	1.1	447
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19.3	4.9	1,136
いちよし証券	2.8	—	—
松井証券	8	2	1,694
マネックスグループ	8.5	2	440
極東証券	2.4	0.6	306
岩井コスモホールディングス	1.8	0.4	446
保険業 (2.5%)			
かんぽ生命保険	11.5	2.7	3,906
SOMPOホールディングス	15.2	3.7	13,838
MS & ADインシュアランスグループホール	27.2	6.1	17,635
ソニーフィナンシャルホールディングス	10.7	2.5	6,495
第一生命ホールディングス	65.3	15.4	20,335
東京海上ホールディングス	26.5	5.6	26,572
T & Dホールディングス	31.6	6.7	6,311
その他金融業 (1.6%)			
全国保証	1.5	0.4	1,562
アルヒ	1	0.3	490
クレディセゾン	9.3	1.7	1,902
芙蓉総合リース	1.2	0.3	1,767
みずほリース	1.8	0.4	947
東京センチュリー	2.9	0.6	3,294
J トラスト	6.6	—	—
日本証券金融	23.9	7.1	3,500
リコーリース	1.3	0.3	888
イオンフィナンシャルサービス	9.2	2.5	2,257
アコム	17.9	3.3	1,260
ジャックス	2.6	0.4	666
オリエントコーポレーション	76.2	12.2	1,342

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立キャピタル	5.9	1	2,385
アプラスフィナンシャル	35.1	7.3	474
オリックス	78.9	19	24,491
三菱UFJリース	69.1	12.2	5,965
日本取引所グループ	11.6	2.7	7,001
NECキャピタルソリューション	1.4	0.3	580
不動産業 (1.5%)			
いちご	8.3	1.9	484
ヒューリック	18	3.5	3,398
サムディ	0.7	0.3	382
プレサンスコーポレーション	1.9	0.5	618
ユニゾホールディングス	1.7	—	—
オープンハウス	0.8	0.4	1,370
東急不動産ホールディングス	24.5	5	2,220
飯田グループホールディングス	12.1	3.1	5,462
パーク24	3.5	0.8	1,390
三井不動産	24.7	6.9	12,357
三菱地所	31.7	7.1	10,980
平和不動産	1.7	0.3	884
東京建物	8.9	1.6	1,867
ダイビル	4.2	0.8	827
京阪神ビルディング	1	0.4	531
住友不動産	10.2	2.5	6,751
テアオーシー	4.2	0.8	548
レオパレス21	28.8	—	—
スターツコーポレーション	2.1	0.5	1,094
ゴールドクレスト	2.1	0.4	561
タカラレーベン	7.5	1.2	427
イオンモール	8.9	2	2,642
サンフロンティア不動産	0.9	0.4	332
日本空港ビルデング	1.2	0.3	1,315
サービス業 (2.6%)			
ミクシィ	5.7	1.6	3,536
日本M&Aセンター	0.8	0.2	994
パーソルホールディングス	3.6	0.9	1,294
総合警備保障	2	0.4	1,998
カカココム	2.8	0.5	1,413
ディップ	0.6	0.2	452
エムスリー	3.2	0.4	1,994
ディー・エヌ・エー	4.1	1.2	1,588

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
博報堂DYホールディングス		7.8	1.7	2,034
ぐるなび		2.8	0.4	285
ケネディクス		4.4	1.1	533
電通グループ		10.9	3.7	9,327
H. U. グループホールディングス		2.6	0.6	1,530
オリエンタルランド		2.4	0.5	7,000
ダスキン		1.7	0.4	1,078
ラウンドワン		2.7	0.8	575
リゾートトラスト		4.3	0.8	1,071
ビー・エム・エル		0.9	0.3	837
りらいあコミュニケーションズ		2.8	0.3	330
ユー・エス・エス		6.7	1.3	2,219
サイバーエージェント		1.7	0.4	2,384
楽天		22.3	7.1	7,100
エン・ジャパン		0.2	0.1	257
テクノプロ・ホールディングス		0.6	0.2	1,174
リクルートホールディングス		15.1	3	11,178
日本郵政		71.2	18.7	14,514
ベルシステム 2 4 ホールディングス		7.8	1.3	2,198
リロググループ		1	0.3	611
エイチ・アイ・エス		1	0.4	643
共立メンテナンス		0.6	0.2	722
東京都競馬		0.6	0.2	805
カナモト		1.7	0.4	955
東京ドーム		4.4	0.9	649
西尾レントオール		1	0.3	666
帝国ホテル		1	0.3	516
トランス・コスモス		1.6	0.3	776
乃村工藝社		0.8	0.4	326
トーカイ		0.8	0.2	467
セコム		5.4	1.1	10,294
メイテック		0.8	0.2	1,024
ベネッセホールディングス		3.2	0.6	1,706
イオンディライト		1.2	0.3	937
ニチイ学館		1.4	0.3	483
ダイセキ		0.9	0.2	505
合 計	株 数 ・ 金 額	12,766	2,955	3,855,502
	銘柄数 < 比率 >	993	976	<99.2% >

*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいて
います。

*銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	末
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 15	百万円 —

* 単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年7月13日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
株式	千円 3,855,502	% 98.8
コール・ローン等、その他	48,425	1.2
投資信託財産総額	3,903,927	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年7月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,903,927,535
コール・ローン等	38,559,461
株式(評価額)	3,855,502,240
未収配当金	7,092,034
差入委託証拠金	2,773,800
(B) 負債	16,242,936
未払金	16,242,914
未払利息	22
(C) 純資産総額(A－B)	3,887,684,599
元本	2,929,595,185
次期繰越損益金	958,089,414
(D) 受益権総口数	2,929,595,185口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,270円

(注) 期首元本額は13,983,212,067円、期中追加設定元本額は1,045,449,798円、期中一部解約元本額は12,099,066,680円、1口当たり純資産額は1,3270円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額
・野村RAFI®日本株投信 1,430,762,082円
・野村RAFI®日本株投信F(適格機関投資家専用) 972,116,680円
・ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式 526,716,423円

○損益の状況 (2019年7月17日～2020年7月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	308,418,736
受取配当金	308,256,842
その他収益金	215,456
支払利息	△ 53,562
(B) 有価証券売買損益	538,540,770
売買益	1,371,787,652
売買損	△ 833,246,882
(C) 先物取引等取引損益	18,014,090
取引益	23,430,235
取引損	△ 5,416,145
(D) 当期損益金(A+B+C)	864,973,596
(E) 前期繰越損益金	5,162,924,306
(F) 追加信託差損益金	418,824,896
(G) 解約差損益金	△5,488,633,384
(H) 計(D+E+F+G)	958,089,414
次期繰越損益金(H)	958,089,414

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

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

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

○お知らせ

該当事項はございません。