

野村RAFI[®]日本株投信

運用報告書(全体版)

第28期(決算日2021年7月13日)

作成対象期間(2021年1月14日~2021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。
なお、当ファンドは、運用開始以来永らくご愛顧いただきましたが、2022年7月13日に信託期間満了となります。
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	基準価額 (分配落)	基準価額		参考指数		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税金 分配	み 金 騰 落 率	東証株 価指数 (TOPIX)	期 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
27期(2021年1月13日)	12,603	100	17.5	1,864.40	18.5	98.9	0.4	2,101
28期(2021年7月13日)	13,903	100	11.1	1,967.64	5.5	98.4	0.9	2,233

* 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	基準価額		参考指数		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	騰落率	東証株 価指数 (TOPIX)	騰落率		
(期首) 2021年1月13日	円 12,603	% —	% —	1,864.40	% —	% 98.9	% 0.4
1月末	12,288	△2.5	△3.0	1,808.78	△3.0	99.1	0.4
2月末	12,989	3.1	0.0	1,864.49	0.0	99.1	0.4
3月末	13,943	10.6	4.8	1,954.00	4.8	97.8	1.2
4月末	13,447	6.7	1.8	1,898.24	1.8	97.7	1.5
5月末	13,748	9.1	3.1	1,922.98	3.1	97.8	1.5
6月末	13,835	9.8	4.2	1,943.57	4.2	97.9	1.4
(期末) 2021年7月13日	円 14,003	11.1	5.5	1,967.64	5.5	98.4	0.9

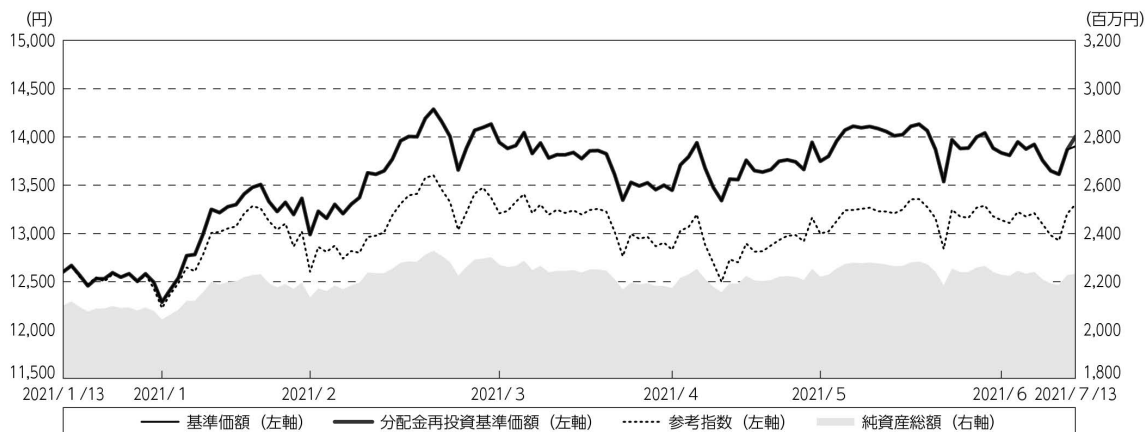
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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



期 首：12,603円

期 末：13,903円（既払分配金（税込み）：100円）

騰落率： 11.1%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2021年1月13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（2021年1月13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新規感染者数増加を背景に緊急事態宣言が発令され、再度、経済の落ち込みが懸念されたこと。
- (上昇)・国内企業の2020年10－12月期決算が売上高の回復に費用削減効果も加わり前年比増益に転じたこと。2020年度業績予想の上方修正が相次いだこと。
 - ・FRB（米連邦準備制度理事会）が現状のゼロ金利政策の当面維持を示したことや、国内において首都圏の緊急事態宣言解除の意向が伝わったこと。

○投資環境

今期の日本株市場は、新型コロナウイルス新規感染者数の増加、および経済活動停滞への懸念により一時下落する局面も見られたものの、国内企業の2020年度業績予想の上方修正が相次いだことや、FRB（米連邦準備制度理事会）によるゼロ金利政策の当面維持が示されたことなどから、上昇基調となりました。

○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、輸送用機器、銀行業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+5.5%となったのに対し、基準価額の騰落率は+11.1%となりました。

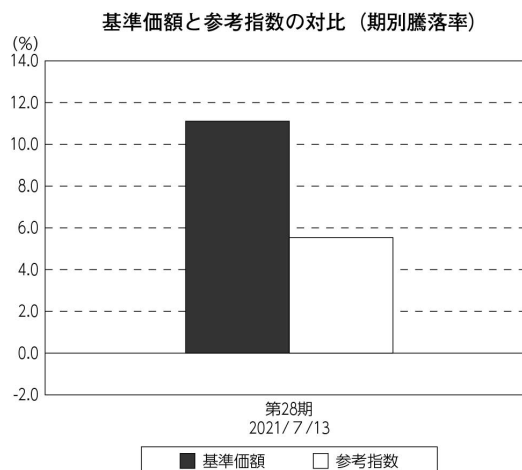
(主なプラス要因)

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。（'21/2）

オーバーウェイトとした輸送用機器が市場を上回って推移したこと。（'21/3）

(主なマイナス要因)

オーバーウェイトとした輸送用機器が市場を下回って推移したこと。（'21/4）



(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28期
	2021年1月14日～ 2021年7月13日
当期分配金	100
(対基準価額比率)	0.714%
当期の収益	100
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,525

(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、2021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

(2021年 1月14日～2021年 7月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 73	% 0.545	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(33)	(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 ）	(36)	(0.273)	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 ）	(4)	(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	73	0.549	
期中の平均基準価額は、13,375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。

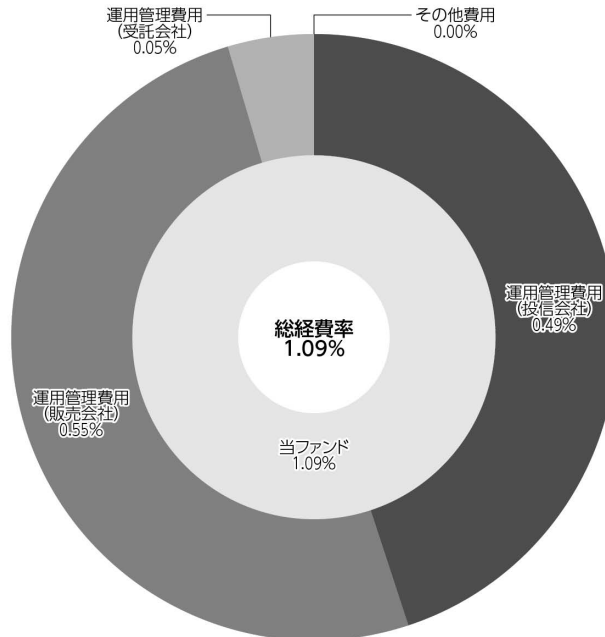
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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

(2021年1月14日～2021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 4,313	千円 6,900	千口 73,040	千円 122,400

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年1月14日～2021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	2,289,408千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,156,248千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.55	

* (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

(2021年1月14日～2021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			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 788	百万円 80	% 10.2	百万円 1,500	百万円 38	% 2.5

平均保有割合 51.7%

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

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)	35千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.403千円
(B) / (A)	1.1%

* 売買委託手数料総額は、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野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021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	1,340,407	1,271,680	2,229,129

* 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

(2021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	2,229,129	98.6
コール・ローン等、その他	32,607	1.4
投資信託財産総額	2,261,736	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 (2021年7月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,261,736,643
コール・ローン等	32,507,397
野村RAFI®日本株投信 マザーファンド(評価額)	2,229,129,246
未収入金	100,000
(B) 負債	28,156,724
未払収益分配金	16,065,885
未払信託報酬	12,054,713
未払利息	24
その他未払費用	36,102
(C) 純資産総額(A-B)	2,233,579,919
元本	1,606,588,539
次期繰越損益金	626,991,380
(D) 受益権総口数	1,606,588,539口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,903円

(注) 期首元本額は1,667,699,746円、期中追加設定元本額は7,436,488円、期中一部解約元本額は68,547,695円、1口当たり純資産額は1,3903円です。

○損益の状況 (2021年1月14日～2021年7月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,147
支払利息	△ 1,147
(B) 有価証券売買損益	236,605,652
売買益	242,297,768
売買損	△ 5,692,116
(C) 信託報酬等	△ 12,090,815
(D) 当期損益金(A+B+C)	224,513,690
(E) 前期繰越損益金	408,710,196
(F) 追加信託差損益金	9,833,379
(配当等相当額)	(98,634,041)
(売買損益相当額)	(△ 88,800,662)
(G) 計(D+E+F)	643,057,265
(H) 収益分配金	△ 16,065,885
次期繰越損益金(G+H)	626,991,380
追加信託差損益金	9,833,379
(配当等相当額)	(98,635,773)
(売買損益相当額)	(△ 88,802,394)
分配準備積立金	628,428,352
繰越損益金	△ 11,270,351

*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(2021年1月14日～2021年7月13日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年1月14日～ 2021年7月13日
a. 配当等収益(経費控除後)	29,976,404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	98,635,773円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	614,517,833円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	743,130,010円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,625円
g. 分配金	16,065,885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14期（決算日2021年7月13日）

作成対象期間（2020年7月14日～2021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		参考指数		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	騰落率	中率	東証株価指数(TOPIX)	騰落率			
10期(2017年7月13日)	円 13,617	% 29.2	1,619.11	% 24.5	% 95.6	% 1.5	百万円 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
14期(2021年7月13日)	17,529	32.1	1,967.64	25.1	98.6	0.9	4,177

* 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		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	中率	東証株価指数(TOPIX)	騰落率		
(期首) 2020年7月13日	円 13,270	% —	1,573.02	% —	% 99.2	% 0.4
7月末	12,479	△ 6.0	1,496.06	△ 4.9	99.3	—
8月末	13,674	3.0	1,618.18	2.9	99.2	—
9月末	13,648	2.8	1,625.49	3.3	98.4	1.2
10月末	13,272	0.0	1,579.33	0.4	98.5	1.2
11月末	14,503	9.3	1,754.92	11.6	98.3	1.3
12月末	15,089	13.7	1,804.68	14.7	99.0	0.4
2021年1月末	15,300	15.3	1,808.78	15.0	99.3	0.4
2月末	16,188	22.0	1,864.49	18.5	99.3	0.4
3月末	17,395	31.1	1,954.00	24.2	98.0	1.2
4月末	16,791	26.5	1,898.24	20.7	97.9	1.5
5月末	17,183	29.5	1,922.98	22.2	97.9	1.5
6月末	17,308	30.4	1,943.57	23.6	98.0	1.4
(期末) 2021年7月13日	円 17,529	% 32.1	1,967.64	% 25.1	% 98.6	% 0.9

* 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。

○基準価額の変動要因

- (上昇) ・ 米国大統領選挙において民主党のバイデン氏勝利との見方が強まったことで投資家心理が改善したこと。
 ・ 米大手製薬会社の新型コロナウイルスワクチンが高い有効性を示したことで世界的な経済活動回復への期待が広がったこと。
- (下落) ・ 米国の2020年4－6月期実質GDP（国内総生産）成長率が前期比で戦後最大の落ち込みとなったことや米中対立が再度激化するとの懸念が高まったこと。

○投資環境

今期の日本株市場は、米国の2020年4－6月期実質GDP（国内総生産）成長率が前期比で戦後最大の落ち込みとなったことから一時下落したものの、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏勝利との見方が強まったことや、米大手製薬会社の新型コロナウイルスワクチンが高い有効性を示したことなどから投資家心理が改善し、期を通じて堅調に推移しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

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+25.1%となったのに対し、基準価額の騰落率は+32.1%となりました。

（主なプラス要因）

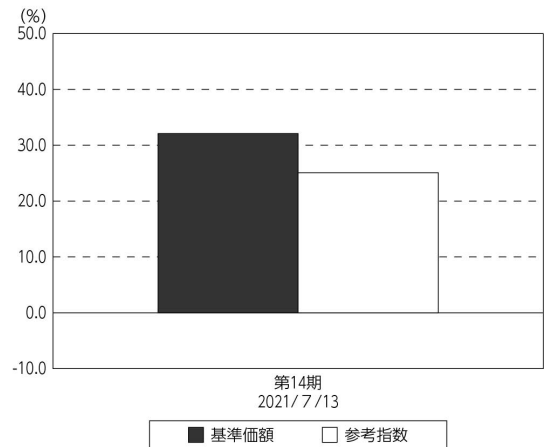
オーバーウェイトとした銀行業が市場を上回って推移したこと。（'21/2）

オーバーウェイトとした輸送用機器が市場を上回って推移したこと。（'21/3）

（主なマイナス要因）

アンダーウェイトとした電気機器が市場を上回って推移したこと。（'20/11）

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、2021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7月14日～2021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	%	(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	0.003	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
合 計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は、15,235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

(2020年7月14日～2021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 960 (△367)	千円 1,371,801 ()	千株 1,286	千円 2,176,466

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 288	百万円 270	百万円 -	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

(2020年7月14日～2021年7月13日)

○株式売買比率

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	3,548,267千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,060,815千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.87

* (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7月14日～2021年7月13日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 80	% 5.8	百万円 2,176	百万円 83	% 3.8	

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)	0.757千円
(B) / (A)	0.7%

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野村證券株式会社です。

(2021年7月13日現在)

○組入資産の明細

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)					日本道路	0.1	0.1	0.1	809
日本水産	2.3	2.6	1,422		日本国土開発	—	0.9	0.9	531
マルハニチロ	0.5	0.5	1,203		東洋建設	1	0.8	0.8	472
サカタのタネ	0.2	0.2	767		五洋建設	1.9	1.8	1.8	1,400
ホクト	0.3	0.3	585		福田組	0.2	0.1	0.1	501
鉱業 (0.5%)					住友林業	1.6	1.2	1.2	2,487
日鉄鉱業	0.2	0.1	597		大和ハウス工業	5.8	6.4	6.4	21,817
I N P E X	18.9	19.4	16,315		ライト工業	0.4	0.3	0.3	580
石油資源開発	0.8	1	1,947		積水ハウス	5.2	6.2	6.2	14,325
K&Oエナジーグループ	0.3	0.3	403		ユアテック	1.4	1.1	1.1	832
建設業 (3.3%)					中電工	0.6	0.6	0.6	1,410
ショーボンドホールディングス	0.2	0.2	955		関電工	1.5	2	2	1,820
ミライト・ホールディングス	0.8	0.7	1,469		きんでん	1.7	1.6	1.6	2,990
安藤・間	1.6	1.8	1,573		トーエネック	0.2	0.2	0.2	764
東急建設	1.4	1.4	1,136		住友電設	0.2	0.2	0.2	462
コムシスホールディングス	0.7	0.7	2,180		日本電設工業	0.5	0.5	0.5	1,006
高松コンストラクショングループ	0.3	0.3	618		協和エクシオ	0.7	0.7	0.7	1,945
東建コーポレーション	0.2	0.1	1,049		九電工	0.5	0.6	0.6	2,244
大成建設	1.9	2.5	9,450		三機工業	0.5	0.5	0.5	737
大林組	6.3	9.7	8,962		日揮ホールディングス	1.4	1.8	1.8	1,873
清水建設	6.1	8.8	7,876		太平電業	0.2	0.2	0.2	538
長谷工コーポレーション	3.2	3.2	4,864		高砂熱学工業	0.5	0.5	0.5	979
鹿島建設	5.1	5.7	8,287		大気社	0.3	0.3	0.3	1,059
西松建設	0.7	0.5	1,810		日比谷総合設備	0.3	0.3	0.3	560
三井住友建設	1.7	2	1,000		レイズネクスト	0.4	0.4	0.4	480
大豊建設	0.2	0.2	853		食料品 (3.6%)				
前田建設工業	1.8	1.8	1,776		ニッポン	0.7	0.7	0.7	1,125
奥村組	0.5	0.5	1,517		日清製粉グループ本社	1.4	1.7	1.7	2,878
東鉄工業	0.3	0.3	720		昭和産業	0.3	0.3	0.3	925
戸田建設	2.8	3	2,361		DM三井製糖ホールディングス	0.4	0.4	0.4	755
熊谷組	0.4	0.4	1,152		森永製菓	0.2	0.3	0.3	1,107
大東建託	0.6	0.6	7,842		江崎グリコ	0.4	0.4	0.4	1,686
新日本建設	0.8	0.8	696		山崎製パン	1.4	1.6	1.6	2,502
N I P P O	1.1	0.8	2,520		亀田製菓	0.1	0.1	0.1	467
前田道路	0.3	0.7	1,565		カルビー	0.5	0.7	0.7	1,823

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
森永乳業	0.3	0.3	1,842	
ヤクルト本社	0.6	0.6	3,882	
明治ホールディングス	0.8	0.9	6,183	
雪印メグミルク	0.6	0.6	1,279	
ブリマハム	0.4	0.3	915	
日本ハム	0.8	0.8	3,504	
丸大食品	0.3	0.3	518	
S Foods	0.3	0.2	680	
伊藤ハム米久ホールディングス	1.9	2.1	1,558	
サッポロホールディングス	0.6	0.6	1,418	
アサヒグループホールディングス	2.2	2.4	12,396	
キリンホールディングス	4.9	5.5	11,836	
宝ホールディングス	1	0.7	971	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	1.2	1.4	2,497	
サントリー食品インターナショナル	1.7	1.9	7,970	
ダイドーグループホールディングス	0.2	0.2	1,016	
伊藤園	0.3	0.3	2,028	
日清オイリオグループ	0.3	0.3	931	
不二製油グループ本社	0.5	0.5	1,287	
J-オイルミルズ	0.2	0.3	566	
キッコーマン	0.5	0.4	2,848	
味の素	3.6	2.5	7,356	
キュービー	0.9	0.8	1,997	
ハウス食品グループ本社	0.5	0.5	1,737	
カゴメ	0.4	0.3	875	
アリアケジャパン	0.1	0.1	706	
ニチレイ	0.8	0.7	2,081	
東洋水産	0.5	0.5	2,135	
日清食品ホールディングス	0.4	0.4	3,216	
フジッコ	0.3	0.3	581	
日本たばこ産業	19.7	21.6	46,569	
わらべや日洋ホールディングス	0.2	0.2	495	
理研ビタミン	0.4	0.4	648	
繊維製品 (0.6%)				
グンゼ	0.2	0.2	956	
東洋紡	0.9	1	1,348	
ユニチカ	—	1.2	422	
倉敷紡績	0.3	0.3	604	
日本毛織	0.6	0.6	595	
帝人	2	2.6	4,381	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東レ	13.7	13.3	9,743	
セーレン	0.5	0.4	888	
ワコールホールディングス	0.6	0.6	1,535	
ホギメディカル	0.2	0.2	710	
T S I ホールディングス	1	1.6	604	
ワールド	0.4	0.5	725	
オンワードホールディングス	1.7	1.7	600	
ゴールドウイン	0.1	0.1	634	
デサント	0.4	0.3	878	
パルプ・紙 (0.4%)				
特種東海製紙	0.2	0.1	458	
王子ホールディングス	9.3	9.5	6,194	
日本製紙	1.4	1.8	2,293	
三菱製紙	0.9	1.2	433	
北越コーポレーション	2.5	2.1	1,262	
大王製紙	1.1	0.9	1,658	
レンゴー	2.5	2.4	2,229	
トーモク	0.3	0.3	584	
ザ・バック	0.2	0.2	563	
化学 (6.0%)				
クラレ	3.9	4.5	4,666	
旭化成	14.1	11.3	13,978	
昭和電工	1.4	1.4	4,662	
住友化学	30.8	18.3	10,650	
住友精化	0.2	0.2	734	
日産化学	0.6	0.4	2,160	
クレハ	0.2	0.2	1,362	
石原産業	0.8	0.6	686	
日本曹達	0.4	0.3	990	
東ソー	3.8	3.3	6,669	
トクヤマ	0.4	0.6	1,374	
セントラル硝子	0.5	0.5	1,104	
東亜合成	1.2	1.2	1,401	
大阪ソーダ	0.2	0.2	495	
関東電化工業	0.5	0.5	514	
デンカ	0.8	0.7	2,628	
信越化学工業	1.7	1.3	23,829	
堺化学工業	0.2	0.2	379	
エア・ウォーター	1.6	1.7	2,861	
日本酸素ホールディングス	1.7	2.1	5,037	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本パーカライジング	1.1	1	1,155
高圧ガス工業	0.5	0.5	343
四国化成工業	0.5	0.4	538
日本触媒	0.4	0.4	2,152
大日精化工業	0.3	0.3	705
カネカ	0.8	0.6	2,745
三菱瓦斯化学	3	2	4,736
三井化学	2.1	1.6	5,896
J S R	1.9	1.1	3,943
東京応化工業	0.3	0.2	1,416
三菱ケミカルホールディングス	20.1	18.1	17,176
KHネオケム	0.4	0.3	790
ダイセル	3.8	4.3	4,033
住友ベークライト	0.4	0.3	1,471
積水化学工業	3.3	3.4	6,545
日本ゼオン	1.7	1.4	2,067
アイカ工業	0.4	0.4	1,598
宇部興産	1.4	1.4	3,178
積水樹脂	0.4	0.4	882
タキロンシーアイ	0.9	1.1	672
積水化成成品工業	0.6	0.6	373
ダイキョーニシカワ	1.2	1.4	999
森六ホールディングス	0.3	0.3	712
日本化薬	1.4	1.7	1,871
扶桑化学工業	0.2	0.2	851
ADEKA	1	0.7	1,514
日油	0.5	0.3	1,773
花王	1.5	2	13,590
三洋化成工業	0.2	0.2	1,104
日本ペイントホールディングス	1	3.2	4,387
関西ペイント	0.9	0.8	2,211
中国塗料	0.5	0.5	437
太陽ホールディングス	0.2	0.2	1,034
エスケー化研	0.1	0.1	4,010
D I C	1.2	1.2	3,362
サカタインクス	0.7	0.6	619
東洋インキＳＣホールディングス	0.7	0.7	1,412
富士フイルムホールディングス	2.4	2.1	17,535
資生堂	0.6	0.6	4,843
ライオン	0.8	1	1,978

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高砂香料工業	0.3	0.2	557
マンダム	0.3	0.3	605
ファンケル	0.3	0.2	716
コーセー	0.2	0.2	3,500
ポーラ・オルビスホールディングス	0.9	0.9	2,611
ノエビアホールディングス	0.2	0.2	1,134
コニシ	0.3	0.3	492
長谷川香料	0.3	0.3	760
上村工業	0.1	0.2	926
小林製薬	0.2	0.2	1,894
デクセリアルズ	0.6	0.3	711
アース製薬	0.1	0.1	651
クミアイ化学工業	0.5	0.5	440
日本農薬	0.7	—	—
日東電工	1.4	0.9	7,479
藤森工業	0.2	0.2	855
未来工業	0.2	—	—
J S P	0.4	0.4	662
エフビコ	0.2	0.3	1,248
天馬	0.3	0.2	528
信越ポリマー	0.6	0.5	530
ニフコ	0.7	0.5	1,982
ユニ・チャーム	1.5	1.1	4,959
医薬品 (3.6%)			
協和キリン	1.9	1.4	5,488
武田薬品工業	7.2	9.3	34,642
アステラス製薬	10.8	10.3	19,796
大日本住友製薬	1.9	2	4,464
塩野義製薬	1.3	1.5	8,760
日本新薬	0.2	0.2	1,758
中外製薬	1.8	2.2	9,363
科研製薬	0.3	0.4	1,920
エーザイ	1.2	1.2	12,936
ロート製薬	0.4	0.4	1,230
小野薬品工業	2.2	2.2	5,548
久光製薬	0.5	0.3	1,620
持田製薬	0.3	0.3	1,116
参天製薬	1.6	2.1	3,294
ツムラ	0.5	0.4	1,396
日医工	0.7	0.9	774

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キッセイ薬品工業	0.4	0.4	903
生化学工業	0.4	0.4	454
鳥居薬品	0.2	0.3	746
東和薬品	0.4	0.4	1,050
沢井製薬	0.3	—	—
ゼリア新薬工業	0.3	0.3	631
第一三共	1.6	4.9	11,463
キョーリン製薬ホールディングス	0.7	0.5	904
大塚ホールディングス	3.1	3.1	13,909
大正製薬ホールディングス	0.6	0.6	3,660
サワイグループホールディングス	—	0.4	1,892
石油・石炭製品 (0.8%)			
日本コークス工業	4.8	2.9	301
ニチレキ	0.4	0.2	274
出光興産	2.2	2.9	7,708
ENEOSホールディングス	49.6	44.1	20,991
コスモエネルギーホールディングス	1.2	1.2	3,104
ゴム製品 (1.1%)			
横浜ゴム	1.7	1.8	4,116
TOYO TIRE	1.1	0.8	1,774
ブリヂストン	7.8	6.2	30,925
住友ゴム工業	4	3.4	5,093
オカモト	0.2	0.2	842
西川ゴム工業	0.3	0.3	477
ニッタ	0.3	0.3	803
住友理工	1.1	1.4	1,012
三ツ星ベルト	0.4	0.4	737
バンドー化学	0.6	0.6	562
ガラス・土石製品 (0.9%)			
日東紡績	0.2	0.2	667
AGC	2.4	2	9,560
日本電気硝子	1.4	1	2,541
住友大阪セメント	0.4	0.5	1,530
太平洋セメント	1.4	1.8	4,615
東海カーボン	1.4	1.2	1,803
ノリタケカンパニーリミテド	0.2	0.2	873
TOTO	0.8	0.6	3,534
日本碍子	2.6	2.3	4,278
日本特殊陶業	1.8	2.3	3,790
MARUWA	—	0.1	1,124

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フジインコーポレーテッド	0.2	0.1	492
ニチアス	0.5	0.5	1,430
ニチハ	0.3	0.3	890
鉄鋼 (1.3%)			
日本製鉄	23.8	11.3	20,803
神戸製鋼所	9.7	5.5	3,927
合同製鐵	0.2	0.3	493
ジェイ エフ イー ホールディングス	16.3	9.8	12,691
東京製鐵	1.6	1.1	1,175
共英製鋼	0.4	0.6	853
大和工業	0.7	0.6	2,175
大阪製鐵	0.5	0.6	676
淀川製鋼所	0.4	0.3	714
丸一鋼管	0.7	0.7	1,882
大同特殊鋼	0.5	0.4	2,156
山陽特殊製鋼	0.8	0.6	973
愛知製鋼	0.3	0.3	927
日立金属	3.5	2.1	4,494
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	8.1	1	1,905
三井金属鉱業	0.6	0.4	1,244
東邦亜鉛	0.2	—	—
三菱マテリアル	1.9	1.8	4,064
住友金属鉱山	2.2	1.5	6,630
DOWAホールディングス	0.6	0.5	2,175
古河機械金属	0.5	0.5	641
東邦チタニウム	—	0.4	421
UACJ	0.6	0.5	1,443
古河電気工業	0.8	0.8	2,220
住友電気工業	8.4	8.1	12,947
フジクラ	3.7	2.7	1,525
リョービ	0.5	0.7	1,090
アールスティ	1.1	1.1	544
アサヒホールディングス	0.3	0.3	689
金属製品 (0.6%)			
トーカロ	0.4	0.3	429
SUMCO	1.6	1.2	3,358
川田テクノロジーズ	0.1	0.1	376
東洋製罐グループホールディングス	1.6	1.9	2,751
ホッカンホールディングス	0.3	0.3	426

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コロナ	0.3	—	—
横河ブリッジホールディングス	0.3	0.3	629
三和ホールディングス	1.5	1.4	1,919
文化シャッター	0.7	0.6	702
三協立山	0.5	0.5	436
L I X I L	2.7	1.8	5,454
ノーリツ	0.5	0.4	757
長府製作所	0.3	0.3	627
リンナイ	0.3	0.2	2,128
岡部	0.5	0.5	334
ジーテクト	0.7	0.7	1,096
東プレ	0.8	0.8	1,277
バイオラックス	0.4	0.4	624
エイチワン	0.9	0.7	521
日本発條	2.7	2.7	2,343
三益半導体工業	0.2	0.2	527
機械 (4.0%)			
日本製鋼所	0.4	0.3	854
三浦工業	0.3	0.2	1,006
タクマ	0.6	0.3	518
オークマ	0.3	0.2	1,120
芝浦機械	0.2	0.2	523
アマダ	3.1	3.3	3,923
アイダエンジニアリング	0.7	0.7	700
F U J I	0.7	0.5	1,307
牧野フライス製作所	0.3	0.3	1,336
オーエスジー	0.7	0.7	1,458
旭ダイヤモンド工業	0.7	—	—
DMG森精機	0.9	0.8	1,513
ソディック	0.6	0.5	529
ディスコ	0.1	0.1	3,255
日東工器	0.2	0.2	373
島精機製作所	0.3	0.3	586
やまびこ	0.5	0.4	511
ナブテスコ	0.7	0.5	2,152
三井海洋開発	0.6	0.5	990
SMC	0.2	0.1	6,812
ユニオンツール	0.2	0.1	419
オイレス工業	0.3	0.3	486
サトーホールディングス	0.2	0.2	552

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小松製作所	8.7	7.1	19,642
住友重機械工業	1.2	1.2	3,774
日立建機	1.5	1.2	3,990
井関農機	0.3	—	—
ハーモニック・ドライブ・システムズ	0.2	0.1	621
クボタ	8.2	6.1	13,975
月島機械	0.3	0.3	363
新東工業	0.5	0.5	408
澁谷工業	0.2	0.2	639
アイチ コーポレーション	0.8	0.6	510
小森コーポレーション	0.7	0.7	584
荏原製作所	0.7	0.4	2,208
ダイキン工業	1	0.7	15,519
栗田工業	0.7	0.4	2,288
椿本チエイン	0.5	0.5	1,657
ダイフク	0.3	0.2	1,982
加藤製作所	0.3	—	—
タダノ	1.3	1	1,134
フジテック	0.6	0.4	1,007
CKD	0.4	0.3	687
平和	1.1	1.1	2,223
理想科学工業	0.4	0.4	718
SANKYO	0.7	0.7	2,021
マースグループホールディングス	0.2	0.2	328
フクシマガリレイ	0.2	0.2	912
ユニバーサルエンターテインメント	0.7	1	2,381
竹内製作所	0.5	0.3	878
アマノ	0.4	0.4	1,162
マックス	0.3	0.3	554
グローリー	0.5	0.6	1,458
大和冷機工業	0.4	0.4	430
セガサミーホールディングス	1.5	1.6	2,424
リケン	0.2	0.2	535
T P R	0.6	0.7	1,055
ツバキ・ナカシマ	0.4	0.4	677
ホンザキ	0.3	0.2	1,890
大豊工業	0.7	0.5	483
日本精工	5.8	5.9	5,504
N T N	6.5	7.2	2,124
ジェイテクト	4.1	4.3	4,983

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
不二越	0.3	0.3	1,317
THK	0.9	0.7	2,436
イーグル工業	0.9	0.7	802
キッツ	1.1	0.9	720
マキタ	1.3	0.9	4,968
日立造船	1.7	0.9	746
三菱重工業	4.2	4.3	14,164
I H I	1.3	1.2	3,141
スター精密	0.4	0.3	522
電気機器 (10.0%)			
日清紡ホールディングス	1.7	1.5	1,437
イビデン	0.7	0.3	1,797
コニカミノルタ	6.7	6.5	4,062
ブラザー工業	2.2	2	4,590
ミネベアミツミ	2	1.6	4,984
日立製作所	8.4	5.1	34,812
三菱電機	15.8	14.7	22,042
富士電機	1.1	0.7	3,668
安川電機	0.7	0.5	2,850
明電舎	0.4	0.4	938
山洋電気	0.1	0.1	791
東芝テック	0.2	0.2	933
マブチモーター	0.6	0.5	2,145
日本電産	1.4	0.8	10,552
ダイヘン	0.2	0.2	976
JVCケンウッド	1.9	1.9	454
日新電機	0.8	0.8	1,104
オムロン	0.9	0.6	5,694
日東工業	0.3	0.3	568
I D E C	0.2	0.2	464
MC J	—	0.4	538
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.8	0.5	1,443
メルコホールディングス	0.2	0.1	567
日本電気	1.4	1.3	7,488
富士通	1.2	0.7	14,798
沖電気工業	0.9	1.1	1,138
サンケン電気	0.2	0.1	544
ルネサスエレクトロニクス	10.7	6.1	7,503
セイコーエプソン	4.2	2.9	5,858
アルバック	0.4	0.3	1,713

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
E I Z O	0.2	0.2	990
日本信号	0.4	0.4	374
能美防災	0.3	0.3	651
エレコム	0.2	0.3	626
パナソニック	24.5	18.8	25,004
シャープ	1.5	1.3	2,329
アンリツ	0.4	0.4	818
富士通ゼネラル	0.5	0.4	1,176
ソニーグループ	5.1	4.3	49,729
TDK	0.7	0.6	8,190
アルプスアルパイン	1.4	2.8	3,278
フォスター電機	0.3	0.5	476
ホシデン	0.4	0.5	513
ヒロセ電機	0.3	0.2	3,350
日本航空電子工業	0.7	0.7	1,310
マクセルホールディングス	0.6	0.6	777
横河電機	1.3	1.5	2,559
新電元工業	0.2	—	—
アズビル	0.6	0.4	1,842
日本光電工業	0.4	0.3	1,008
堀場製作所	0.2	0.2	1,456
アドバンテス	0.4	0.3	2,823
キーエンス	0.3	0.2	11,748
シスメックス	0.5	0.3	3,976
OBARA GROUP	0.2	0.2	809
イリソ電子工業	0.1	0.1	535
スタンレー電気	1.2	1	3,150
ウシオ電機	0.8	0.8	1,660
カシオ計算機	1.3	1.4	2,711
ファナック	1.2	0.7	19,652
フクダ電子	0.2	0.2	1,974
エンプラス	0.2	—	—
ローム	0.7	0.5	5,160
浜松ホトニクス	0.5	0.3	2,022
新光電気工業	0.9	0.3	1,179
京セラ	2.1	2.3	15,906
太陽誘電	0.6	0.3	1,653
村田製作所	2.8	2.2	20,004
双葉電子工業	0.4	0.4	323
KO A	0.3	0.3	500

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
市光工業	0.6	0.6	421
小糸製作所	1	0.8	5,352
ミツバ	0.8	0.8	654
S C R E E Nホールディングス	0.3	0.2	1,958
キャノン電子	0.5	0.5	857
キャノン	14.1	13.6	34,612
リコー	5.3	4.4	5,407
象印マホービン	0.3	0.3	487
東京エレクトロン	0.6	0.3	13,920
輸送用機器 (13.1%)			
トヨタ紡織	2	1.7	3,831
ユニプレス	0.9	1.3	1,251
豊田自動織機	2.8	1.9	17,993
モリタホールディングス	0.4	0.3	492
デンソー	7.9	4.3	32,555
東海理化電機製作所	1	1	1,785
三井E&Sホールディングス	1.1	—	—
川崎重工業	2.1	1.8	4,406
三菱ロジスネクスト	0.6	0.7	716
日産自動車	142.9	86.4	50,725
いすゞ自動車	11.6	6.9	10,439
トヨタ自動車	32	23.1	227,881
日野自動車	5.7	6	5,892
三菱自動車工業	15.6	19	5,871
武蔵精密工業	0.7	0.4	963
日産車体	1	1.2	900
新明和工業	0.6	0.8	778
極東開発工業	0.5	0.4	634
日信工業	0.6	—	—
トビー工業	0.4	0.5	648
タチエス	0.4	—	—
NOK	2.4	2.7	3,742
フタバ産業	0.9	1.5	805
KYB	0.4	0.3	1,123
大同メタル工業	0.8	0.8	490
プレス工業	1.8	2.2	800
太平洋工業	0.6	0.7	849
ケーヒン	0.7	—	—
河西工業	1	1.7	683
アイシン	4	3.1	14,864

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マツダ	16.6	9.9	10,632
本田技研工業	22.7	19.9	71,381
スズキ	3.9	3.6	17,092
S U B A R U	11	12	26,178
ヤマハ発動機	3.3	2.5	7,197
ショーワ	0.5	—	—
エクセディ	0.7	1	1,674
ハイレックスコーポレーション	0.6	0.6	1,050
豊田合成	1.3	1.1	2,973
愛三工業	1	1	906
日本精機	0.7	0.9	1,140
ヨロズ	0.5	0.4	492
エフ・シー・シー	0.5	0.6	954
シマノ	0.3	0.2	5,622
テイ・エス テック	0.8	1.4	2,368
精密機器 (0.9%)			
テルモ	1.7	1.6	7,054
日機装	0.5	0.5	584
島津製作所	0.8	0.6	2,664
ナカニシ	0.4	0.3	720
東京精密	0.3	0.2	948
ニコン	3.5	4	4,484
トプコン	0.6	0.4	664
オリンパス	2.5	2	4,528
タムロン	0.2	0.2	494
HOYA	1	0.7	10,535
朝日インテック	0.2	0.2	562
シチズン時計	3.6	4.2	1,793
セイコーホールディングス	0.5	0.5	1,214
ニプロ	1.5	1.2	1,641
その他製品 (1.2%)			
パラマウントベッドホールディングス	0.2	0.4	812
パンダイナムコホールディングス	0.8	0.7	5,177
パイロットコーポレーション	0.3	0.3	1,168
トッパン・フォームズ	1	0.8	869
フジシールインターナショナル	0.4	0.3	678
タカラトミー	0.5	0.7	683
大建工業	0.3	0.3	648
凸版印刷	3	3.5	6,422
大日本印刷	2	2.4	5,920

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
共同印刷	0.2	0.2	557
N I S S H A	0.9	0.4	648
アシックス	0.9	0.7	1,845
ヤマハ	0.7	0.6	3,660
ビジョン	0.3	0.4	1,274
リンテック	0.7	0.6	1,456
任天堂	0.3	0.2	12,668
三菱鉛筆	0.4	0.4	596
タカラスタンダード	0.6	0.7	1,148
コクヨ	0.9	0.8	1,465
オカムラ	1	0.7	1,079
美津濃	0.2	0.2	516
電気・ガス業 (3.2%)			
東京電力ホールディングス	82.3	90.9	30,269
中部電力	8.7	12.2	16,689
関西電力	11.7	17.4	18,444
中国電力	4.1	6	6,156
北陸電力	3.7	4.1	2,521
東北電力	10	12.1	10,514
四国電力	3.1	4.2	3,217
九州電力	7.6	9.9	8,434
北海道電力	5.4	6	3,150
沖縄電力	0.6	0.8	1,148
電源開発	2.7	4.3	7,082
東京瓦斯	4.6	5.4	11,288
大阪瓦斯	4.3	4.1	8,487
東邦瓦斯	0.7	0.5	2,815
北海道瓦斯	0.3	0.3	480
西部ガスホールディングス	0.4	0.3	767
静岡ガス	0.8	0.8	885
メタウォーター	0.2	0.2	415
陸運業 (3.4%)			
S B Sホールディングス	—	0.1	332
東武鉄道	1.1	1.4	4,096
相鉄ホールディングス	0.6	0.8	1,769
東急	3.2	4.5	7,101
京浜急行電鉄	1.1	1.6	2,204
小田急電鉄	1.4	1.2	3,402
京王電鉄	0.5	0.4	2,628
京成電鉄	0.7	0.8	2,872

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東日本旅客鉄道	3.4	2.6	21,088
西日本旅客鉄道	1.3	1.9	12,283
東海旅客鉄道	1.9	1.5	25,507
西武ホールディングス	2.3	3.3	4,455
鴻池運輸	0.6	0.6	749
西日本鉄道	0.6	0.5	1,367
ハマキョウレックス	0.2	0.2	644
サカイ引越センター	0.1	0.1	589
近鉄グループホールディングス	0.7	1	3,955
阪急阪神ホールディングス	1.5	2	6,950
南海電気鉄道	0.8	0.9	2,166
京阪ホールディングス	0.4	0.6	2,016
名古屋鉄道	0.9	1.5	3,058
日本通運	0.7	0.5	4,165
ヤマトホールディングス	2.5	1.4	4,648
山九	0.4	0.4	2,004
丸全昭和運輸	0.2	0.2	677
センコーグループホールディングス	1.4	1.2	1,309
トナミホールディングス	0.1	0.1	528
ニッコンホールディングス	0.6	0.7	1,715
福山通運	0.4	0.4	1,664
セイノーホールディングス	1.8	1.9	2,698
神奈川中央交通	0.2	—	—
日立物流	0.7	0.6	2,688
九州旅客鉄道	0.7	1	2,588
S Gホールディングス	1.5	1.5	4,423
海運業 (0.2%)			
日本郵船	1.8	0.7	3,766
商船三井	1.2	0.7	3,521
川崎汽船	0.6	0.2	724
N Sユナイテッド海運	0.5	0.4	948
飯野海運	1.9	1.4	614
空運業 (0.6%)			
日本航空	6.1	5.9	14,596
A N Aホールディングス	3.1	4.1	11,094
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
日新	0.3	0.3	462
三菱倉庫	0.6	0.5	1,662
三井倉庫ホールディングス	0.3	0.2	529
住友倉庫	0.8	0.7	1,127

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本トランスシティ	0.8	0.8	454
名港海運	0.4	0.4	465
上組	0.9	0.9	2,103
近鉄エクスプレス	0.6	0.4	1,040
情報・通信業 (10.4%)			
NECネットエスアイ	0.9	0.5	917
日鉄ソリューションズ	0.4	0.4	1,410
T I S	0.9	0.8	2,320
グリーン	2.1	1.4	863
コーエーテクモホールディングス	0.5	0.2	1,022
三菱総合研究所	—	0.1	413
ネクソン	1.8	2.1	4,863
コロブラ	0.9	0.9	740
ティーガイア	0.4	0.5	1,013
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.9	0.7	1,463
インターネットイニシアティブ	0.3	0.3	1,108
L I N E	0.2	—	—
アルテリア・ネットワークス	0.3	0.3	581
フジ・メディア・ホールディングス	2.9	3.4	4,236
オービック	0.2	0.1	2,077
ジャストシステム	—	0.1	652
Zホールディングス	26.9	23.9	13,407
トレンドマイクロ	0.6	0.6	3,498
日本オラクル	0.3	0.5	4,070
オービックビジネスコンサルタント	0.2	0.2	1,294
伊藤忠テクノソリューションズ	0.8	0.7	2,408
大塚商会	0.7	0.6	3,504
電通国際情報サービス	0.2	0.2	943
東映アニメーション	0.2	0.1	1,345
デジタルガレージ	0.2	0.1	495
WOWOW	0.3	0.3	742
ネットワンシステムズ	0.3	0.2	763
エイベックス	0.5	0.3	528
日本ユニシス	0.4	0.4	1,390
兼松エレクトロニクス	0.2	0.2	742
TBSホールディングス	1.6	1.6	2,824
日本テレビホールディングス	3.1	3.4	4,386
朝日放送グループホールディングス	0.6	0.6	424
テレビ朝日ホールディングス	1	1.1	1,944
スカパーJ SATホールディングス	3.7	3.8	1,584

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	0.3	0.3	645
コネクシオ	0.4	0.4	634
日本電信電話	40.3	41.1	119,683
KDD I	16.7	18.8	66,082
ソフトバンク	21.4	25.7	37,779
光通信	0.2	0.2	4,120
沖縄セルラー電話	0.3	0.2	1,036
NTTドコモ	24.7	—	—
GMOインターネット	0.5	0.2	605
KADOKAWA	0.3	0.2	860
ゼンリン	0.3	0.3	343
松竹	0.1	—	—
東宝	0.7	0.7	3,188
東映	0.1	0.1	2,010
エヌ・ティ・ティ・データ	6.6	6	10,578
D T S	0.3	0.2	548
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.4	0.3	1,590
カプコン	0.4	0.3	934
S C S K	0.5	0.4	2,740
T K C	0.2	0.2	666
富士ソフト	0.2	0.2	1,140
NSD	0.4	0.3	555
コナミホールディングス	0.6	0.4	2,508
ソフトバンクグループ	15.1	13.2	100,782
卸売業 (6.1%)			
伊藤忠食品	0.1	0.1	536
あらた	0.2	0.2	870
双日	14.8	16	5,504
アルフレッサ ホールディングス	1.4	2.1	3,662
横浜冷凍	0.4	0.4	360
神戸物産	0.2	0.2	769
あい ホールディングス	0.3	0.3	655
ダイワボウホールディングス	0.2	0.5	1,040
マクニカ・富士エレホールディングス	0.5	0.4	1,079
パイタルケーエスケー・ホールディングス	0.7	0.7	537
TOKAIホールディングス	1	1	915
シップヘルスケアホールディングス	0.3	0.4	1,098
コメダホールディングス	—	0.2	419
小野建	0.4	0.4	528
ナガイレベーン	0.2	0.2	513

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱食品	0.5	0.4	1,153
第一興商	0.4	0.4	1,776
メディアバルホールディングス	1.5	1.6	3,512
アズワン	0.1	0.1	1,504
ドウシシャ	0.4	0.3	510
岡谷鋼機	0.2	0.2	1,944
日本ライフライン	—	0.3	420
シークス	0.4	0.3	440
伊藤忠商事	12.6	11.3	37,041
丸紅	30.8	16.3	16,044
長瀬産業	1.2	1.2	2,053
蝶理	0.3	0.3	553
豊田通商	3	2.3	12,282
兼松	0.9	0.8	1,202
三井物産	21.7	14.7	38,095
日本紙パルプ商事	0.2	0.2	738
カメイ	0.6	0.6	717
山善	0.9	0.9	932
住友商事	16.9	17.1	25,769
三菱商事	17.6	16.4	51,381
キヤノンマーケティングジャパン	1	0.9	2,346
三谷商事	0.2	0.2	1,494
ユアサ商事	0.3	0.3	949
阪和興業	0.6	0.5	1,575
菱電商事	0.3	0.3	501
岩谷産業	0.5	0.3	1,926
三菱石油	0.7	0.6	851
稲畑産業	0.7	0.6	1,036
ワキタ	0.6	0.6	626
東邦ホールディングス	0.7	0.8	1,540
サンゲツ	0.5	0.5	819
ミツウロコグループホールディングス	0.4	0.4	540
伊藤忠エネクス	1.6	1.2	1,213
サンリオ	0.5	0.5	998
リョーサン	0.3	0.3	650
加賀電子	0.3	0.3	898
PALTAC	0.3	0.3	1,584
日鉄物産	0.4	0.5	2,280
トラスコ中山	0.4	0.3	867
オートバックスセブン	0.7	0.7	1,101

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
加藤産業	0.3	0.3	1,020
イエローハット	0.4	0.4	831
日伝	0.3	0.2	446
因幡電機産業	0.5	0.4	1,082
ミスミグループ本社	0.7	0.6	2,361
スズケン	0.6	0.8	2,716
ジェコス	0.5	0.5	458
小売業 (3.7%)			
ローソン	1	1.1	5,852
サンエー	0.2	0.2	834
カワチ薬品	0.3	0.2	446
エービーシー・マート	0.4	0.5	3,225
アスクル	0.2	0.4	663
ゲオホールディングス	0.7	0.6	741
アダストリア	0.3	0.4	792
くら寿司	—	0.1	414
日本マクドナルドホールディングス	0.2	0.3	1,486
パルグループホールディングス	0.4	0.3	518
エディオン	1.1	1.3	1,435
セリア	0.3	0.2	801
ナフコ	0.6	0.4	796
アルペン	0.4	0.2	602
ビックカメラ	1	1	1,124
DCMホールディングス	1.4	1.3	1,420
MonotaRO	0.2	0.2	537
J. フロント リテイリング	2.1	3	3,054
ドトール・日レスホールディングス	0.4	0.4	702
マツモトキヨシホールディングス	0.5	0.5	2,487
ZOZO	0.5	0.4	1,398
ココカラファイン	0.2	0.2	1,678
三越伊勢丹ホールディングス	3.2	3.3	2,686
ウエルシアホールディングス	0.3	0.5	1,740
クリエイトSDホールディングス	0.3	0.3	1,015
ジョイフル本田	0.6	0.5	690
すかいらーくホールディングス	0.9	1.1	1,661
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	1.1	0.8	822
日本調剤	0.4	0.3	506
コスモス薬品	0.2	0.1	1,773
セブン&アイ・ホールディングス	6.5	5.4	27,820
ツルハホールディングス	0.2	0.2	2,550

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サンマルクホールディングス	0.3	—	—
トリドールホールディングス	0.4	0.3	572
クスリのアオキホールディングス	0.1	0.1	757
FOOD & LIFE COMPANIE	0.4	0.1	440
LIXILビバ	0.5	—	—
ノジマ	0.5	0.4	1,125
良品計画	1	1.1	2,358
コーナン商事	0.5	0.3	1,192
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1.4	1.3	3,166
西松屋チェーン	0.6	0.3	418
ゼンショーホールディングス	0.5	0.4	1,128
ワークマン	0.1	0.1	716
サイゼリヤ	0.3	0.3	800
VTホールディングス	1.3	1.3	611
ユナイテッドアローズ	0.2	0.2	413
壺番屋	0.1	0.1	498
スギホールディングス	0.3	0.2	1,612
ヨンドシーホールディングス	0.2	0.2	369
ファミリーマート	2	—	—
リテールパートナーズ	—	0.4	497
上新電機	0.3	0.2	542
日本瓦斯	0.3	0.4	762
島忠	0.5	—	—
チヨダ	0.4	0.6	540
ライフコーポレーション	0.4	0.2	702
AOKIホールディングス	1.1	1.7	1,164
オークワ	0.4	0.4	450
コメリ	0.6	0.5	1,325
青山商事	1.2	1.9	1,438
しまむら	0.4	0.3	3,045
高島屋	2.2	2.1	2,639
エイチ・ツー・オー リテイリング	1.6	1.6	1,518
丸井グループ	0.8	0.9	1,898
アクシアル リテイリング	0.2	0.2	778
イオン	4.1	3.9	11,518
イズミ	0.5	0.5	2,072
平和堂	0.6	0.5	1,043
フジ	0.3	0.3	592
ヤオコー	0.2	0.2	1,272
ゼビオホールディングス	0.5	0.5	504

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ケーズホールディングス	1.6	1.8	2,259
ATグループ	0.8	0.8	1,197
アインホールディングス	0.2	0.2	1,354
ヤマダホールディングス	6.2	7.5	3,810
アークランドサカモト	0.5	0.3	447
ニトリホールディングス	0.3	0.3	5,932
吉野家ホールディングス	0.2	—	—
王将フードサービス	0.1	0.1	584
プレナス	0.3	0.3	640
ミニストップ	0.3	—	—
アークス	0.6	0.5	1,127
パローホールディングス	0.6	0.5	1,141
ベルク	0.2	0.1	519
ファーストリテイリング	0.2	0.1	8,084
サンドラッグ	0.6	0.6	2,136
ペルルーナ	1.1	0.6	565
銀行業 (9.8%)			
めぶきフィナンシャルグループ	20.6	26.4	6,388
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1.2	1	1,552
九州フィナンシャルグループ	8.3	9.7	3,899
ゆうちょ銀行	5.2	4.6	4,333
コンコルディア・フィナンシャルグループ	18.8	19.2	7,852
西日本フィナンシャルホールディングス	3.4	4.2	2,725
関西みらいフィナンシャルグループ	6.9	—	—
三十三フィナンシャルグループ	1	1	1,416
第四北越フィナンシャルグループ	0.9	0.9	2,244
ひろぎんホールディングス	—	5.3	3,158
新生銀行	3	3.3	4,903
あおぞら銀行	2.2	2	5,048
三菱UFJフィナンシャル・グループ	218.2	164	98,728
りそなホールディングス	53	44.3	18,938
三井住友トラスト・ホールディングス	5.3	5.3	19,127
三井住友フィナンシャルグループ	26	20.9	79,691
千葉銀行	9.8	8.6	5,710
群馬銀行	8	8.4	3,015
武蔵野銀行	0.8	0.7	1,209
千葉興業銀行	2.4	2.4	619
筑波銀行	1.8	1.8	311
七十七銀行	1.4	1.8	2,170
青森銀行	0.3	0.3	627

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
秋田銀行	0.4	0.5	0.5	714
山形銀行	0.5	0.8	0.8	710
岩手銀行	0.4	0.5	0.5	870
東邦銀行	4.1	4.8	4.8	1,027
ふくおかフィナンシャルグループ	2.3	2.8	2.8	5,398
静岡銀行	7.1	6.4	6.4	5,388
十六銀行	0.7	0.8	0.8	1,586
スルガ銀行	2.9	3.4	3.4	1,142
八十二銀行	8	10.1	10.1	3,686
山梨中央銀行	0.9	0.9	0.9	755
大垣共立銀行	0.7	0.7	0.7	1,339
福井銀行	0.4	0.4	0.4	574
北國銀行	0.4	0.5	0.5	1,096
滋賀銀行	0.7	0.8	0.8	1,596
南都銀行	0.6	0.7	0.7	1,336
百五銀行	4.6	5.1	5.1	1,596
京都銀行	0.8	0.7	0.7	3,514
紀陽銀行	0.9	0.9	0.9	1,376
ほくほくフィナンシャルグループ	3.2	3.9	3.9	3,233
広島銀行	5.8	—	—	—
山陰合同銀行	2.7	3	3	1,677
中国銀行	2.6	2.9	2.9	2,560
伊予銀行	5.1	5.5	5.5	3,052
百十四銀行	0.7	0.8	0.8	1,228
四国銀行	0.9	1.1	1.1	792
阿波銀行	0.6	0.6	0.6	1,252
大分銀行	0.4	0.5	0.5	869
宮崎銀行	0.4	0.4	0.4	814
佐賀銀行	0.4	0.4	0.4	554
沖縄銀行	0.3	0.3	0.3	772
琉球銀行	0.7	1.1	1.1	801
セブン銀行	8.6	12.8	12.8	3,046
みずほフィナンシャルグループ	457.9	38.3	38.3	61,567
山口フィナンシャルグループ	4.7	5.2	5.2	3,338
名古屋銀行	0.4	0.3	0.3	773
北洋銀行	9.6	8.7	8.7	2,148
愛知銀行	0.3	0.3	0.3	870
中京銀行	0.3	0.3	0.3	442
大光銀行	0.3	0.3	0.3	403
愛媛銀行	0.6	0.8	0.8	621

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
京葉銀行	2.7	3.6	3.6	1,515
栃木銀行	3.7	3.7	3.7	643
東和銀行	1	1.5	1.5	760
トモニホールディングス	3.2	4.2	4.2	1,293
フィデアホールディングス	5.1	4.1	4.1	508
池田泉州ホールディングス	8.4	9.7	9.7	1,561
証券・商品先物取引業 (0.8%)				
F P G	0.5	1	1	762
GMOフィナンシャルホールディングス	—	0.8	0.8	676
S B I ホールディングス	1.7	1.5	1.5	4,011
ジャフコ グループ	0.4	0.2	0.2	1,280
大和証券グループ本社	40.4	30.9	30.9	18,082
岡三証券グループ	2.9	2.5	2.5	1,067
丸三証券	1.1	0.7	0.7	437
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	4.9	3.4	3.4	1,370
松井証券	2	2.1	2.1	1,734
マネックスグループ	2	0.8	0.8	574
極東証券	0.6	0.4	0.4	336
岩井コスモホールディングス	0.4	0.3	0.3	510
保険業 (2.7%)				
かんぽ生命保険	2.7	1.9	1.9	3,819
SOMPOホールディングス	3.7	3.7	3.7	16,513
MS&ADインシュアランスグループホール	6.1	6.7	6.7	22,579
ソニーフィナンシャルホールディングス	2.5	—	—	—
第一生命ホールディングス	15.4	11.9	11.9	23,817
東京海上ホールディングス	5.6	6.6	6.6	34,478
T&Dホールディングス	6.7	5.8	5.8	8,410
その他金融業 (1.7%)				
全国保証	0.4	0.3	0.3	1,524
アルヒ	0.3	0.2	0.2	289
クレディセゾン	1.7	2.3	2.3	3,144
芙蓉総合リース	0.3	0.2	0.2	1,444
みずほリース	0.4	0.3	0.3	1,096
東京センチュリー	0.6	0.6	0.6	3,672
日本証券金融	7.1	1.1	1.1	929
リコーリース	0.3	0.3	0.3	1,050
イオンフィナンシャルサービス	2.5	3.2	3.2	4,483
アコム	3.3	4.2	4.2	2,007
ジャックス	0.4	0.4	0.4	1,037
オリエントコーポレーション	12.2	15.3	15.3	2,264

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日立キャピタル	1	—	—	—
アブラスフィナンシャル	7.3	—	—	—
オリックス	19	16.8	32,482	
三菱HCキャピタル	12.2	15.8	9,638	
日本取引所グループ	2.7	2.1	5,394	
NECキャピタルソリューション	0.3	0.3	655	
不動産業 (1.8%)				
いちご	1.9	2.3	848	
ヒューリック	3.5	4.1	5,309	
サムティ	0.3	0.3	690	
プレサンスコーポレーション	0.5	0.5	775	
オープンハウス	0.4	0.3	1,635	
東急不動産ホールディングス	5	5.4	3,558	
飯田グループホールディングス	3.1	1.9	5,162	
パーク24	0.8	1	2,143	
三井不動産	6.9	5.8	15,842	
三菱地所	7.1	8.3	14,927	
平和不動産	0.3	0.2	773	
東京建物	1.6	1.5	2,527	
ダイビル	0.8	0.7	988	
京阪神ビルディング	0.4	0.3	429	
住友不動産	2.5	2.7	10,500	
テーオーシー	0.8	0.8	538	
スターツコーポレーション	0.5	0.4	1,149	
ゴールドクレスト	0.4	0.4	674	
タカラレーベン	1.2	2	704	
イオンモール	2	2.2	3,799	
シノケングループ	—	0.4	533	
サンフロンティア不動産	0.4	0.4	447	
日本空港ビルデング	0.3	0.3	1,548	
サービス業 (2.5%)				
ミクシィ	1.6	1.1	3,063	
日本M&Aセンター	0.2	0.3	934	
パーソルホールディングス	0.9	0.8	1,825	
総合警備保障	0.4	0.5	2,530	
カカコム	0.5	0.5	1,612	
ディップ	0.2	0.2	697	
ベネフィット・ワン	—	0.1	346	
エムスリー	0.4	0.2	1,544	
アウトソーシング	—	0.3	646	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ディー・エヌ・エー	1.2	0.6	1,350	
博報堂DYホールディングス	1.7	1.7	2,990	
ぐるなび	0.4	—	—	
ケネディクス	1.1	—	—	
電通グループ	3.7	2	8,110	
H. U. グループホールディングス	0.6	0.4	1,140	
オリエンタルランド	0.5	0.4	6,472	
ダスキン	0.4	0.3	776	
ラウンドワン	0.8	0.6	831	
リゾートトラスト	0.8	0.7	1,315	
ビー・エム・エル	0.3	0.2	782	
りらいあコミュニケーションズ	0.3	0.3	422	
ユー・エス・エス	1.3	1.3	2,497	
サイバーエージェント	0.4	0.5	1,172	
楽天グループ	7.1	5.2	6,926	
エン・ジャパン	0.1	0.1	389	
テクノプロ・ホールディングス	0.2	0.3	825	
リクルートホールディングス	3	2.4	13,524	
日本郵政	18.7	18.5	17,242	
ベルシステム24ホールディングス	1.3	0.4	719	
カーブスホールディングス	—	0.6	576	
リログループ	0.3	0.3	736	
エイチ・アイ・エス	0.4	0.4	1,011	
共立メンテナンス	0.2	0.2	767	
東京都競馬	0.2	0.1	456	
カナモト	0.4	0.5	1,293	
東京ドーム	0.9	—	—	
西尾レントオール	0.3	0.3	927	
帝国ホテル	0.3	—	—	
トランス・コスモス	0.3	0.2	622	
乃村工藝社	0.4	0.6	528	
日本管財	—	0.2	521	
トーカイ	0.2	0.2	490	
セコム	1.1	1.2	10,165	
メイテック	0.2	0.2	1,254	
ベネッセホールディングス	0.6	0.6	1,633	
イオンディライト	0.3	0.3	1,098	
ニチイ学館	0.3	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
ダイセキ	千株 0.2	千株 0.2	千円 989	
合 計	株 数 ・ 金 額	2,955	2,261	4,120,309
	銘柄数 < 比率 >	976	961	< 98.6% >

*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 39	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年7月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 4,120,309	% 98.6
コール・ローン等、その他	57,735	1.4
投資信託財産総額	4,178,044	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 (2021年7月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,178,044,040
コール・ローン等	49,691,408
株式(評価額)	4,120,309,340
未収入金	410,183
未収配当金	5,893,109
差入委託証拠金	1,740,000
(B) 負債	100,037
未払解約金	100,000
未払利息	37
(C) 純資産総額(A-B)	4,177,944,003
元本	2,383,439,003
次期繰越損益金	1,794,505,000
(D) 受益権総口数	2,383,439.003口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,529円

(注) 期首元本額は2,929,595,185円、期中追加設定元本額は751,905,414円、期中一部解約元本額は1,298,061,596円、1口当たり純資産額は1,7529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 1,271,680,784円
 ・ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式 1,111,758,219円

○損益の状況 (2020年7月14日～2021年7月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	118,473,941
受取配当金	118,442,835
その他収益金	43,584
支払利息	△ 12,478
(B) 有価証券売買損益	1,069,471,781
売買益	1,129,879,120
売買損	△ 60,407,339
(C) 先物取引等取引損益	5,880,455
取引益	6,318,215
取引損	△ 437,760
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,193,826,177
(E) 前期繰越損益金	958,089,414
(F) 追加信託差損益金	459,701,112
(G) 解約差損益金	△ 817,111,703
(H) 計(D+E+F+G)	1,794,505,000
次期繰越損益金(H)	1,794,505,000

* 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。