

iFreeNEXT 日本小型株 インデックス

運用報告書（全体版） 第1期

（決算日 2019年10月18日）

（作成対象期間 2018年10月19日～2019年10月18日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の株式に投資し、日本の小型株市場の動きを捉える指数との連動をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況を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。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
（営業日の9：00～17：00）
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

★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／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果を日本の小型株市場の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	日本小型株インデックス・マザーファンドの受益証券
	日本小型株インデックス・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）および国内株式を対象とした株価指数先物取引
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			TOPIX Small (ベンチマーク)	期 中 騰 落 率	株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 配 分 金	期 中 騰 落 率					
1 期末(2019年10月18日)	円 9,494	円 0	% △5.1	9,266	% △7.3	% 98.3	% 1.7	百万円 481

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) TOPIX Smallは、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

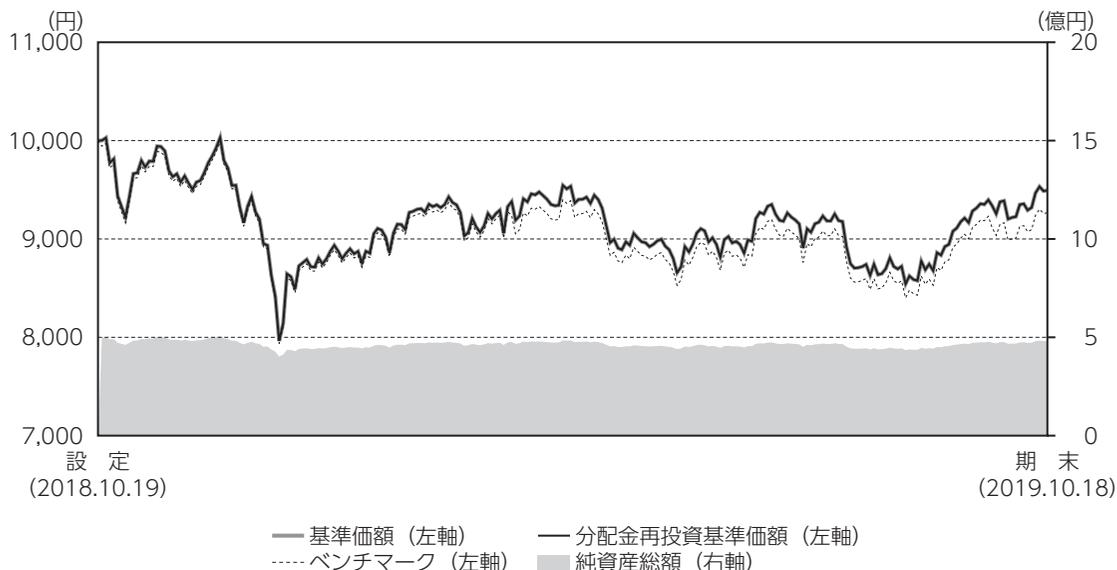
(注4) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注5) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

- *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。
- *分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。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、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- *ベンチマークはTOPIX Smallです。

■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期末：9,494円（分配金0円）

騰落率：△5.1%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（TOPIX Small）への連動をめざした運用を行った結果、ベンチマークの動きを反映して、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		TOPIX (ベンチマーク)	Small		株 組 入 比 率	株 式 先 物 率 比
	騰 落 率	騰 落 率		騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2018年10月19日	円 10,000	% -	10,000	% -	% -	% -	
10月末	9,664	△ 3.4	9,614	△ 3.9	97.2	2.7	
11月末	9,925	△ 0.8	9,883	△ 1.2	98.6	1.3	
12月末	8,616	△13.8	8,576	△14.2	98.3	1.7	
2019年 1 月末	8,875	△11.3	8,828	△11.7	98.2	1.7	
2 月末	9,318	△ 6.8	9,265	△ 7.3	98.1	2.0	
3 月末	9,234	△ 7.7	9,094	△ 9.1	97.6	2.4	
4 月末	9,399	△ 6.0	9,254	△ 7.5	98.0	2.0	
5 月末	8,801	△12.0	8,669	△13.3	97.6	2.4	
6 月末	8,975	△10.3	8,826	△11.7	98.8	1.0	
7 月末	9,187	△ 8.1	9,036	△ 9.6	99.0	1.0	
8 月末	8,774	△12.3	8,622	△13.8	98.6	1.4	
9 月末	9,257	△ 7.4	9,036	△ 9.6	98.3	1.7	
(期末) 2019年10月18日	9,494	△ 5.1	9,266	△ 7.3	98.3	1.7	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2018.10.19~2019.10.18)

■国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、下落しました。2018年11月には、米中首脳会談において通商協議に何らかの進展が見られるとの期待などにより株価が上昇したものの、12月に入ると、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に開催された米中閣僚級協議などにより通商協議の進展期待が再び高まり、株価は反発しました。しかし5月に入り、米国が中国製品への関税率の引き上げや対象範囲の拡大方針を発表したこと、また中国の通信機器大手メーカーに対する取引制限措置を実施したことなどにより不透明感が高まり、株価は下落しました。下落一巡後は、世界景気の動向などに不透明感がある中で、6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことや米国の利下げ期待が支えとなり、株価は底堅く推移しました。その後8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月に入ると米中間で一部妥協の動きも見られたことで安心感が広がり、株価は上昇しました。10月には、米国の景気減速懸念を受けて株価は一時下落したものの、当作成期末にかけては、米中貿易協議が部分合意に達したことが好材料となり、再び上昇しました。

ポートフォリオについて

(2018.10.19~2019.10.18)

■当ファンド

「日本小型株インデックス・マザーファンド」の受益証券の組入比率を高位に維持しました。

■日本小型株インデックス・マザーファンド

株式を中心に、国内の株価指数先物取引も一部利用し、実質株式組入比率を高位に維持しました。

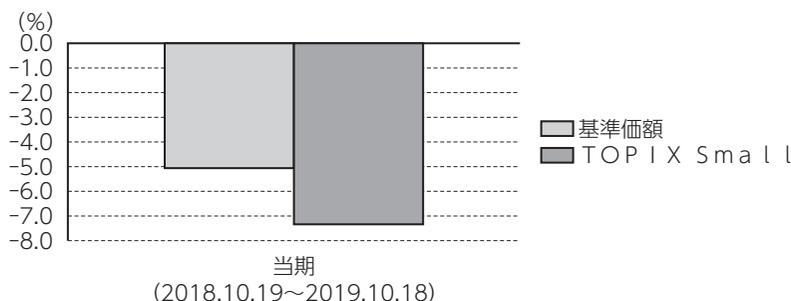
株式ポートフォリオにつきましては、ベンチマーク（TOP I X S m a l l）に連動する投資成果をめざして、時価総額加重ウェイトに基づきポートフォリオを構築しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△7.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△5.1%となりました。

ファンドには保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないことが、かい離要因となりました。その他、マザーファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、先物取引の影響、運用管理費用（信託報酬）等のコストがかい離の要因として挙げられます。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、分配対象額が計上できなかったため、収益の分配を行いませんでした。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2018年10月19日 ～2019年10月18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	(円)	—

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」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。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 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。



今後の運用方針

■当ファンド

「日本小型株インデックス・マザーファンド」の受益証券の組入比率を高位に維持します。

■日本小型株インデックス・マザーファンド

ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行ってまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2018.10.19~2019.10.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	40円	0.432%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,159円です。
(投 信 会 社)	(19)	(0.205)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(19)	(0.205)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、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	0	0.005	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成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)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	41	0.443	

(注1) 当作成期中の費用（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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

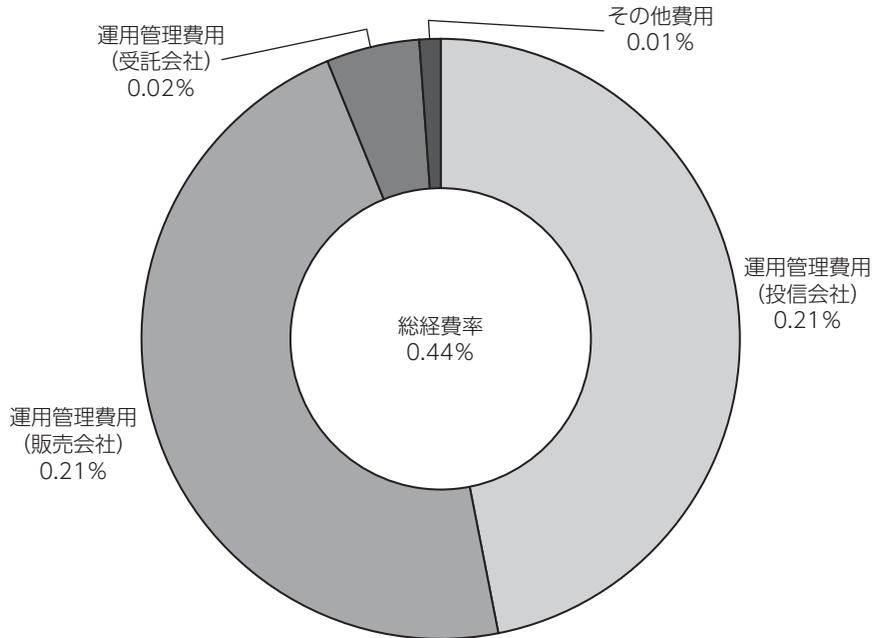
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.44%です。



(注1) 1万口当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2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2018年10月19日から2019年10月18日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本小型株インデックス・マザーファンド	528,726	526,542	23,777	21,873

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2018年10月19日から2019年10月18日まで)

項 目	当 期
	日本小型株インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	563,475千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	455,667千円
(c) 売買高比率(a)÷(b)	1.23

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2018年10月19日から2019年10月18日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
株式	百万円 534	百万円 0	% 0.0	百万円 28	百万円 1	% 4.2
新株予約権証券	—	—	—	0	—	—
株式先物取引	68	68	100.0	60	60	100.0
コール・ローン	3,018	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合100.0%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2018年10月19日から2019年10月18日まで)

種 類	当 期		
	日本小型株インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株式	百万円 0	百万円 —	百万円 0

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2018年10月19日から2019年10月18日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	22千円
うち利害関係人への支払額 (B)	8千円
(B)÷(A)	38.8%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

※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、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、マネーパートナーズグループです。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円 500	百万円 —	百万円 —	百万円 500	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
日本小型株インデックス・マザーファンド	千口 504,949	千円 481,519

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年10月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本小型株インデックス・マザーファンド	千円 481,519	% 99.8
コール・ローン等、その他	1,068	0.2
投資信託財産総額	482,587	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年10月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	482,587,576円
コール・ローン等	1,048,057
日本小型株インデックス・マザーファンド(評価額)	481,519,519
未収入金	20,000
(B) 負債	1,039,186
未払解約金	28,493
未払信託報酬	998,099
その他未払費用	12,594
(C) 純資産総額(A - B)	481,548,390
元本	507,187,820
次期繰越損益金	△ 25,639,430
(D) 受益権総口数	507,187,820口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,494円

* 期首における元本額は500,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は36,675,380円、同解約元本額は29,487,560円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,494円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は25,639,430円です。

■損益の状況

当期 自2018年10月19日 至2019年10月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 194円
受取利息	2
支払利息	△ 196
(B) 有価証券売買損益	△20,797,760
売買益	2,245,588
売買損	△23,043,348
(C) 信託報酬等	△ 2,022,986
(D) 当期損益金(A + B + C)	△22,820,940
(E) 追加信託差損益金	△ 2,818,490
(売買損益相当額)	(△ 2,818,490)
(F) 合計(D + E)	△25,639,430
次期繰越損益金(F)	△25,639,430
追加信託差損益金	△ 2,818,490
(売買損益相当額)	(△ 2,818,490)
繰越損益金	△22,820,940

(注1) 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おります。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	0
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	0
(h) 受益権総口数	507,187,820口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

日本小型株インデックス・マザーファンド

運用報告書 第1期（決算日 2019年10月18日）

（作成対象期間 2018年10月19日～2019年10月18日）

日本小型株インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

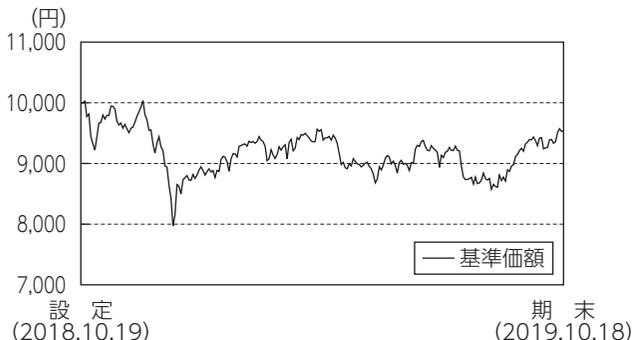
運用方針	投資成果を日本の小型株市場の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）および国内株式を対象とした株価指数先物取引
株式組入制限	無制限

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		TOPIX Small		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2018年10月19日	10,000	-	10,000	-	-	-
10月末	9,665	△ 3.4	9,614	△ 3.9	97.2	2.7
11月末	9,930	△ 0.7	9,883	△ 1.2	98.6	1.3
12月末	8,623	△13.8	8,576	△14.2	98.3	1.7
2019年1月末	8,886	△11.1	8,828	△11.7	98.2	1.7
2月末	9,333	△ 6.7	9,265	△ 7.3	98.1	2.0
3月末	9,252	△ 7.5	9,094	△ 9.1	97.6	2.4
4月末	9,420	△ 5.8	9,254	△ 7.5	98.0	2.0
5月末	8,825	△11.8	8,669	△13.3	97.6	2.4
6月末	9,002	△10.0	8,826	△11.7	98.9	1.0
7月末	9,218	△ 7.8	9,036	△ 9.6	99.0	1.0
8月末	8,807	△11.9	8,622	△13.8	98.6	1.4
9月末	9,295	△ 7.1	9,036	△ 9.6	98.3	1.7
(期末)2019年10月18日	9,536	△ 4.6	9,266	△ 7.3	98.3	1.7

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) TOPIX Smallは、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

設定時：10,000円 期末：9,536円 騰落率：△4.6%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク (TOPIX Small) への連動をめざした運用を行った結果、ベンチマークの動きを反映して、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、下落しました。2018年11月には、米中首脳会談において通商協議に何らかの進展が見られるとの期待などにより株価が上昇したものの、12月に入ると、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF

R B (米国連邦準備制度理事会) 議長の発言などが嫌気され、下落しました。しかし2019年1月には、FRB議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に開催された米中間僚級協議などにより通商協議の進展期待が再び高まり、株価は反発しました。しかし5月に入り、米国が中国製品への関税率の引き上げや対象範囲の拡大方針を発表したこと、また中国の通信機器大手メーカーに対する取引制限措置を実施したことなどにより不透明感が高まり、株価は下落しました。下落一巡後は、世界景気の動向などに不透明感がある中で、6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことや米国の利下げ期待が支えとなり、株価は底堅く推移しました。その後8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月に入ると米中間で一部妥協の動きも見られたことで安心感が広がり、株価は上昇しました。10月には、米国の景気減速懸念を受けて株価は一時下落したものの、当作成期末にかけては、米中貿易協議が部分合意に達したことが好材料となり、再び上昇しました。

◆ポートフォリオについて

株式を中心に、国内の株価指数先物取引も一部利用し、実質株式組入比率を高位に維持しました。

株式ポートフォリオにつきましては、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、時価総額加重ウエートに基づきポートフォリオを構築しました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△7.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△4.6%となりました。

ファンドには保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないことが、かい離要因となりました。その他、ファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、先物取引の影響、売買コスト等がかい離の要因として挙げられます。

《今後の運用方針》

ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行ってまいります。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合計	0

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株式

(2018年10月19日から2019年10月18日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 387.2 (4.635)	千円 534,947 (—)	千株 19.735	千円 28,528

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、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。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

株式

(2018年10月19日から2019年10月18日まで)

当					期				
買				付	売				付
銘柄	柄	株 数	金 額	平均単価	銘柄	柄	株 数	金 額	平均単価
ルネサスエレクトロニクス		千株 9.2	千円 5,986	円 650	東海カーボン		千株 1.7	千円 2,847	円 1,674
東海カーボン		1.7	3,410	2,006	コスモエネルギーHLDGS		0.6	2,467	4,112
コスモエネルギーHLDGS		0.6	2,639	4,399	アンリツ		1.4	2,245	1,604
アンリツ		1.4	2,558	1,827	ファンケル		0.5	2,198	4,397
ファンケル		0.5	2,225	4,451	ネットワンシステムズ		0.8	1,705	2,132
アリアケジャパン		0.2	1,993	9,967	コロワイド		0.6	1,617	2,696
ネットワンシステムズ		0.8	1,946	2,432	GMOペイメントゲートウェイ		0.3	1,593	5,310
GMOペイメントゲートウェイ		0.3	1,814	6,049	オープンハウス		0.3	1,239	4,132
シップヘルスケアHD		0.4	1,719	4,297	シーズ・ホールディングス		0.2	1,180	5,900
マニー		0.3	1,711	5,706	大京		0.3	891	2,970

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権証券

(2018年10月19日から2019年10月18日まで)

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証券 — (3,000)	千円 — (—)	証券 3,000 (—)	千円 11 (—)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2018年10月19日から2019年10月18日まで)

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 68	百万円 60	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	当 期 末		銘柄	当 期 末		銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額		株 数	評 価 額		株 数	評 価 額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0.4%)			世紀東急	0.3	221	養命酒	0.1	192
極洋	0.1	287	福田組	0.1	445	ダイドールグループHD	0.1	448
カネコ種苗	0.1	133	日本基礎技術	0.2	77	キーコーヒー	0.2	446
サカタのタネ	0.3	1,030	巴コーポレーション	0.3	125	ユニカフェ	0.1	101
ホクト	0.2	379	ライト工業	0.4	633	日清オイリオグループ	0.3	1,075
鉱業 (0.4%)			日特建設	0.2	137	J-オイルミルズ	0.1	430
住石ホールディングス	0.6	82	北陸電気工事	0.1	94	焼津水産化工	0.1	104
日鉄鉱業	0.1	426	ユアテック	0.3	204	アリアケジャパン	0.2	1,674
三井松島HLDGS	0.1	124	中電工	0.3	732	イートアンド	0.1	171
石油資源開発	0.4	1,069	関電工	1	1,012	ヨシムラ・フード・HLDGS	0.1	113
K&Oエナジーグループ	0.1	156	東京エネシス	0.2	187	永谷園ホールディングス	0.1	208
建設業 (5.8%)			トーエネック	0.1	344	一正簿録	0.1	107
ヒノキヤグループ	0.1	199	住友電設	0.2	428	フジッコ	0.2	397
ショーボンドHD	0.4	1,622	日本電設工業	0.4	925	ロックフィールド	0.2	297
ミライト・ホールディングス	0.7	1,163	新日本空調	0.2	397	ケンコーマヨネーズ	0.1	250
タマホーム	0.1	175	三機工業	0.5	647	わらべや日洋HD	0.1	190
日本アクア	0.1	64	中外炉工業	0.1	155	なとり	0.1	163
ファーストコーポレーション	0.1	63	ヤマト	0.2	152	北の達人コーポ	0.8	515
ベステラ	0.1	122	太平電業	0.1	256	ユーグレナ	0.8	672
TATERU	0.3	58	高砂熱学	0.5	926	ミヨシ油脂	0.1	119
スペースバリューHD	0.3	154	明星工業	0.4	325	理研ビタミン	0.1	360
ダイセキ環境ソリューション	0.1	78	大気社	0.3	1,008	繊維製品 (2.4%)		
安藤・間	1.7	1,387	ダイダグ	0.1	233	片倉工業	0.2	274
東急建設	0.8	672	日比谷総合設備	0.2	383	グンゼ	0.1	454
ミサワホーム	0.2	227	東芝プラントシステム	0.5	1,006	ユニチカ	0.6	198
ピーアールホールディングス	0.2	89	OSJBHD	1	257	富士紡ホールディングス	0.1	316
高松コンストラクションGP	0.2	514	東洋エンジニア	0.3	224	倉敷紡績	0.2	483
東建コーポレーション	0.1	687	レイズネクスト	0.4	439	シキボウ	0.1	92
ヤマウラ	0.1	89	食料品 (3.7%)			日本毛織	0.6	636
飛島建設	0.2	256	日本製粉	0.6	1,033	ダイトウボウ	0.3	24
松井建設	0.2	160	昭和産業	0.2	628	トーア紡コーポレーション	0.1	54
不動テトラ	0.2	274	鳥越製粉	0.2	181	ダイドーリミテッド	0.2	56
大末建設	0.1	94	中部飼料	0.2	242	帝国繊維	0.2	381
鉄建建設	0.1	287	フィード・ワン	1.3	211	住江織物	0.1	282
大豊建設	0.2	614	日本甜菜糖	0.1	200	日本フェルト	0.1	48
佐田建設	0.1	42	三井製糖	0.2	456	アツギ	0.2	165
ナカノフドー建設	0.2	97	塩水港精糖	0.2	41	ダイニック	0.1	74
東鉄工業	0.3	1,009	日新製糖	0.1	195	セーレン	0.5	639
富士ピー・エス	0.1	52	中村屋	0.1	464	ソトー	0.1	97
浅沼組	0.1	390	名糖産業	0.1	125	小松マテーレ	0.3	247
熊谷組	0.3	963	井村屋グループ	0.1	203	ホギメディカル	0.2	652
矢作建設	0.3	216	不二家	0.1	205	レナウン	0.6	66
ピーエス三菱	0.2	149	亀田製菓	0.1	479	T S Iホールディングス	0.7	394
日本ハウスHLDGS	0.4	208	寿スピリッツ	0.2	1,448	マツオカコーポレーション	0.1	198
新日本建設	0.3	246	六甲バター	0.1	179	ワールド	0.2	490
NIPPO	0.6	1,294	プリマハム	0.3	761	三陽商会	0.1	146
日本道路	0.1	669	林兼産業	0.1	61	ナイガイ	0.1	47
東亜建設	0.2	283	丸大食品	0.2	463	オンワードホールディングス	1.2	738
日本国土開発	0.4	231	S Foods	0.2	583	ルックホールディングス	0.1	109
若築建設	0.1	161	伊藤ハム米久HLDGS	1.3	894	キムラタン	0.9	30
東洋建設	0.8	381	オエノンホールディングス	0.5	197	ゴールドウイン	0.4	3,376

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	当期末		銘柄	当期末		銘柄	当期末	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
デサント	0.5	688	第一工業製薬	0.1	326	日医工	0.5	619
キング	0.1	53	日華化学	0.1	88	生化学工業	0.4	466
ヤマトインターナショナル	0.1	38	三洋化成	0.1	512	栄研化学	0.3	477
パルプ・紙 (0.7%)			有機合成薬品	0.1	23	日水製薬	0.1	124
特種東海製紙	0.1	397	大日本塗料	0.2	215	鳥居薬品	0.1	281
三菱製紙	0.3	142	神東塗料	0.1	19	JCRファーマ	0.1	812
北越コーポレーション	1.3	704	中国塗料	0.6	568	東和薬品	0.3	760
中越パルプ	0.1	152	日本特殊塗料	0.1	113	富士製薬工業	0.1	133
巴川製紙	0.1	94	藤倉化成	0.3	162	ゼリア新薬工業	0.4	778
大王製紙	0.9	1,305	太陽ホールディングス	0.2	758	大幸薬品	0.1	278
トーモク	0.1	160	サカタインクス	0.4	474	ダイト	0.1	300
ザ・パックス	0.1	405	東洋インキSCホールディング	0.4	1,040	石油・石炭製品 (0.2%)		
化学 (6.7%)			T & K TOKA	0.1	99	日本コークス工業	1.7	141
共和レザー	0.1	73	高砂香料	0.1	260	ニチレキ	0.2	234
住友精化	0.1	324	マンダム	0.4	1,064	ユシロ化学	0.1	137
ラサ工業	0.1	142	ミルボン	0.2	1,110	ビービー・カストロール	0.1	144
クレハ	0.2	1,332	コタ	0.1	127	富士石油	0.5	123
多木化学	0.1	432	ノエビアホールディングス	0.2	1,120	MORESCO	0.1	130
テイカ	0.2	412	エステー	0.1	154	ゴム製品 (0.5%)		
石原産業	0.4	437	アグロカネショウ	0.1	153	藤倉コンポジット	0.2	85
片倉コープアグリ	0.1	116	コニシ	0.3	452	オカモト	0.1	401
日本曹達	0.3	818	長谷川香料	0.2	398	フコク	0.1	70
大阪ソーダ	0.2	578	星光PMC	0.1	81	ニッタ	0.2	590
関東電化	0.5	455	荒川化学工業	0.2	328	住友理工	0.4	366
日本カーバイド	0.1	126	メック	0.1	181	三ツ星ベルト	0.3	603
堺化学	0.1	266	日本高純度化学	0.1	252	バンドー化学	0.4	352
第一稀元素化学工	0.2	162	タカラバイオ	0.5	1,080	ガラス・土石製品 (1.6%)		
日本化学工業	0.1	334	JCU	0.3	763	日東紡績	0.3	928
高圧ガス	0.3	255	新田セラチン	0.1	68	日本板硝子	0.9	603
四国化成	0.3	357	デクセリアルズ	0.5	417	日本山村硝子	0.1	126
ステラケミファ	0.1	287	アース製薬	0.1	557	オハラ	0.1	152
保土谷化学	0.1	389	北興化学	0.2	108	日本ヒューム	0.2	159
大日精化	0.2	653	大成ラミック	0.1	289	日本コンクリート	0.4	121
大阪有機化学	0.2	224	クミアイ化学	0.8	798	三谷セキサン	0.1	336
KHネオケム	0.3	748	日本農業	0.3	163	アジアパイルHD	0.3	163
積水樹脂	0.3	634	アキレス	0.1	180	日本カーボン	0.1	400
タキロンシーアイ	0.4	256	有沢製作所	0.3	322	東洋炭素	0.1	245
旭有機材	0.1	137	レック	0.2	204	ノリタケ	0.1	432
ニチパン	0.1	171	三光合成	0.2	78	ダントーホールディングス	0.2	22
リケンテクノス	0.5	244	きもと	0.3	51	MARUWA	0.1	745
大倉工業	0.1	187	藤森工業	0.2	695	品川リフラクトリーズ	0.1	279
積水化成成品	0.3	232	前澤化成工業	0.1	115	ヨータイ	0.2	136
タイガース ポリマー	0.1	60	未来工業	0.1	206	イソライト	0.1	50
ミライアル	0.1	149	ジェイ エス ピー	0.1	187	東京窯業	0.2	60
ダイキアクシス	0.1	85	エフピコ	0.2	1,322	ニッカトール	0.1	75
ダイキョーニシカワ	0.4	330	天馬	0.1	197	フジミンコーポレートッド	0.2	549
竹本容器	0.1	96	信越ポリマー	0.4	330	クニミネ工業	0.1	94
森六ホールディングス	0.1	234	東リ	0.5	129	ニチアス	0.5	1,056
カーリットホールディングス	0.2	123	バルカー	0.2	467	ニチハ	0.3	916
日本精化	0.2	241	医薬品 (1.2%)			鉄鋼 (1.0%)		
扶桑化学工業	0.2	544	わかもと製薬	0.2	53	中山製鋼所	0.3	139
新日本理化	0.3	61	あすか製薬	0.2	222	合同製鐵	0.1	230
ハリマ化成グループ	0.2	251	扶桑薬品	0.1	209	東京製鐵	1	864

銘柄	当期末		銘柄	当期末		銘柄	当期末	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
共英製鋼	0.2	416	モリテックスチル	0.1	34	ローツェ	0.1	385
東京製鋼	0.1	137	パイオラックス	0.3	597	タカキタ	0.1	54
大阪製鐵	0.1	135	エイチワン	0.2	134	荏原実業	0.1	211
淀川製鋼所	0.3	613	立川ブラインド	0.1	138	三菱化工機	0.1	178
モリ工業	0.1	215	三益半導体	0.2	401	月島機械	0.4	631
日本高周波	0.1	41	機械 (7.1%)			帝国電機製作所	0.1	121
日本冶金工	0.1	228	日本ドライケミカル	0.1	115	東京機械	0.1	37
山陽特殊製鋼	0.2	298	タクマ	0.7	881	新東工業	0.5	505
愛知製鋼	0.1	343	ツガミ	0.4	360	渋谷工業	0.2	575
大平洋金属	0.1	248	東芝機械	0.2	457	アイチ コーポレーション	0.3	212
新日本電工	1.2	213	アイダエンジニア	0.5	440	小森コーポレーション	0.5	600
栗本鉄工所	0.1	168	海澤鉄工所	0.1	128	鶴見製作所	0.2	420
三菱製鋼	0.1	114	F U J I	0.8	1,349	西島製作所	0.2	204
日亜鋼業	0.3	98	牧野フライス	0.2	1,000	北越工業	0.2	245
エンビプロHD	0.1	65	旭ダイヤモンド	0.5	324	オルガノ	0.1	536
シンニッタン	0.3	127	ソディック	0.4	330	トーヨーカネツ	0.1	194
非鉄金属 (0.8%)			日東工器	0.1	225	椿本チエイン	0.3	1,057
大紀アルミニウム	0.3	215	日進工具	0.1	208	大同工業	0.1	82
東邦亜鉛	0.1	209	パンチ工業	0.2	99	木村化工機	0.2	78
古河機金	0.3	450	富士ダイス	0.1	62	アナスト岩田	0.3	309
エス・サイエンス	0.9	46	豊和工業	0.1	76	サムコ	0.1	101
大阪チタニウム	0.2	335	OKK	0.1	71	加藤製作所	0.1	195
東邦チタニウム	0.3	264	東洋機械金属	0.1	58	フジテック	0.7	1,019
UACJ	0.3	573	島精機製作所	0.3	791	CKD	0.5	742
昭和電線HLDGS	0.2	185	オプトラン	0.2	660	キトー	0.1	159
タツタ電線	0.4	206	NCホールディングス	0.1	49	平和	0.5	1,095
平河ヒューテック	0.1	107	イワキポンプ	0.1	99	理想科学工業	0.2	346
リョービ	0.2	373	フリュー	0.2	187	日本金銭機械	0.2	187
アールステイ	0.2	104	ヤマシンフィルタ	0.3	266	マースグループHLDGS	0.1	197
アサヒHD	0.4	900	日阪製作所	0.2	180	福島工業	0.1	327
金属製品 (1.6%)			やまびこ	0.4	475	オーイズミ	0.1	56
稲葉製作所	0.1	142	平田機工	0.1	764	ダイコク電機	0.1	151
宮地エンジニアリング	0.1	176	ベガサスミシン製造	0.2	103	竹内製作所	0.3	512
トーカロ	0.5	494	マルマエ	0.1	98	JUKI	0.3	284
アルファCO	0.1	122	タツモ	0.1	127	サンデンホールディングス	0.2	133
信和	0.1	95	三井海洋開発	0.2	550	蛇の目ミシン	0.2	80
ホッカンホールディングス	0.1	167	レオン自動車	0.2	319	マックス	0.3	568
コロナ	0.1	112	ヤマハモーターロボHLDGS	0.2	100	新晃工業	0.2	356
横河ブリッジHLDGS	0.4	694	ホンカワミクロン	0.1	381	大和冷機工業	0.3	358
文化シャッター	0.6	564	ユニオンツール	0.1	360	日本ピストンリング	0.1	130
三協立山	0.3	353	オイレス工業	0.3	482	リケン	0.1	405
アルインコ	0.2	221	日精エーエスピー	0.1	378	T P R	0.3	546
日本フィルコン	0.1	50	サトーホールディングス	0.2	587	ツバキ・ナカシマ	0.3	519
ノーリツ	0.4	520	技研製作所	0.2	752	大豊工業	0.2	159
長府製作所	0.2	497	日本エアージェット	0.1	63	日本トムソン	0.6	274
ダイニチ工業	0.1	68	日精樹脂工業	0.2	208	ユーシン精機	0.2	199
日東精工	0.3	172	オカダアイヨン	0.1	127	前澤給装工業	0.1	210
岡部	0.4	354	ワイエイシイホールディングス	0.1	76	イーグル工業	0.2	205
ジーテクト	0.2	349	日工	0.5	337	前澤工業	0.1	38
東プレ	0.4	706	巴工業	0.1	238	日本ピラー工業	0.2	287
高周波熱練	0.4	369	井関農機	0.2	318	キッツ	0.8	573
東京製鋼	0.1	106	TOWA	0.2	190	日立造船	1.6	561
サンコール	0.1	46	北川鉄工所	0.1	204	スター精密	0.3	486

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	当期末		銘柄	当期末		銘柄	当期末	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
電気機器 (8.7%)	千株	千円		千株	千円		千株	千円
東洋電機製造	0.1	161	ユニデンホールディングス	0.1	200	サノヤスホールディングス	0.3	56
シンフォニアテクノロジー	0.3	382	スミダコーポレーション	0.2	219	日本車輛	0.1	256
明電舎	0.4	775	アイコム	0.1	236	三菱ロジスネクスト	0.2	207
オリジン	0.1	140	リオン	0.1	259	エフテック	0.1	69
山洋電気	0.1	506	本多通信工業	0.2	99	レシップホールディングス	0.1	66
デンヨー	0.2	357	船井電機	0.2	120	武蔵精密工業	0.5	704
東芝テック	0.2	731	新電元工業	0.1	366	日産車体	0.4	368
ユーエムシーエレクトロニクス	0.1	42	東亜ディーケーケー	0.1	85	新明和工業	0.8	1,021
トレックス・セミコンダクター	0.1	138	チノー	0.1	142	極東開発工業	0.4	550
東光高岳	0.1	119	共和電業	0.2	85	日信工業	0.4	624
ダブル・スコープ	0.3	166	日本電子材料	0.1	62	トビー工業	0.2	410
宮越ホールディングス	0.1	102	小野測器	0.1	51	ティラド	0.1	206
ダイヘン	0.2	658	エスベック	0.2	384	曙ブレーキ	1.1	247
ヤーマン	0.3	208	日置電機	0.1	361	タチエス	0.3	414
JVCケンウッド	1.5	472	日本マイクロニクス	0.3	286	フタバ産業	0.6	448
ミマキエンジニアリング	0.2	104	メガチップス	0.2	360	K Y B	0.2	673
第一精工	0.1	261	OBARA GROUP	0.1	384	大同メタル工業	0.3	197
日新電機	0.5	685	原田工業	0.1	87	プレス工業	1	459
大崎電気	0.4	283	コーセル	0.3	351	ミクニ	0.2	64
日東工業	0.3	637	イリソ電子工業	0.2	1,060	太平洋工業	0.4	637
I D E C	0.3	641	オプテックスグループ	0.3	502	ケーヒン	0.4	682
メルコホールディングス	0.1	274	千代田インテグレ	0.1	231	河西工業	0.2	171
岩崎通信機	0.1	81	アイ・オー・データ	0.1	88	今仙電機製作所	0.2	177
電気興業	0.1	343	レーザーテック	0.4	3,072	安永	0.1	130
サンケン電気	0.2	484	岩崎電気	0.1	137	ショーワ	0.5	832
アイホン	0.1	168	岡谷電機	0.1	38	T B K	0.2	85
ルネサスエレクトロニクス	9.2	6,752	ヘリオステクノH	0.2	118	エクセディ	0.3	655
ワコム	1.4	567	日本セラミック	0.2	551	愛三工業	0.3	277
アクセル	0.1	59	遠藤照明	0.1	68	日本プラスト	0.2	139
E I Z O	0.2	781	古河電池	0.1	63	ヨロズ	0.2	272
ジャパンディスプレイ	4.6	271	双信電機	0.1	41	エフ・シー・シー	0.3	640
日本信号	0.5	614	山一電機	0.1	138	ジャムコ	0.1	149
京三製作所	0.4	179	図研	0.1	198	精密機器 (2.0%)		
能美防災	0.3	623	日本電子	0.4	1,139	クリエートメディック	0.1	98
ホーチキ	0.1	145	日本シイエムケイ	0.5	323	日機装	0.6	696
星和電機	0.1	52	エンプラス	0.1	393	日本エム・ディ・エム	0.1	186
エレコム	0.2	824	大真空	0.1	106	J M S	0.2	129
帝国通信工業	0.1	119	三井ハイテック	0.2	367	長野計器	0.2	137
タムラ製作所	0.8	491	新光電気工業	0.7	740	ブイ・テクノロジー	0.1	652
池上通信機	0.1	111	双葉電子工業	0.3	409	東京計器	0.1	91
日本電波工業	0.2	95	北陸電気工業	0.1	111	インターアクション	0.1	195
鈴木	0.1	64	ニチコン	0.6	627	オーバル	0.2	48
ローランド ディー.ジー.	0.1	206	日本ケミコン	0.1	171	東京精密	0.4	1,354
フォスター電機	0.2	404	K O A	0.3	422	マニー	0.9	2,320
S M K	0.1	276	市光工業	0.3	248	理研計器	0.2	426
ヨコオ	0.1	316	ミツバ	0.4	278	タムロン	0.2	468
ティアック	0.1	19	キャノン電子	0.2	382	シード	0.1	86
ホシデン	0.6	633	象印マホービン	0.5	753	ノーリツ鋼機	0.2	303
日本航空電子	0.4	687	輸送用機器 (2.8%)			エー・アンド・デイ	0.2	162
T O A	0.2	244	ユニプレス	0.4	692	リズム時計	0.1	103
マクセルホールディングス	0.4	613	モリタホールディングス	0.3	542	大研医器	0.2	103
古野電気	0.3	312	三桜工業	0.2	169	メニコン	0.3	1,120
			名村造船所	0.6	183	松風	0.1	155

銘柄	当期末		銘柄	当期末		銘柄	当期末	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
セイコーHD	0.3	753	富士急行	0.3	1,317	アイスタイル	0.5	369
その他製品 (2.4%)			鴻池運輸	0.3	493	エムアップ	0.1	191
中本パックス	0.1	139	ハマキョウレックス	0.1	349	エイチーム	0.1	105
スノーピーク	0.1	119	サカイ引越センター	0.1	645	エニゴモ	0.2	194
パラマウントベッドHD	0.2	814	山陽電鉄	0.1	213	テクノスジャパン	0.2	105
トランザクション	0.1	90	丸運	0.1	26	enish	0.1	87
S H O - B I	0.1	38	丸全昭和運輸	0.1	306	コロブラ	0.5	708
ニホンフラッシュ	0.1	277	センコーグループHLDGS	1	855	オルトプラス	0.1	81
前田工織	0.2	339	福山通運	0.2	764	ブロードリーフ	0.9	527
永大産業	0.3	101	エスライン	0.1	90	クロス・マーケティングG	0.1	35
アートネイチャー	0.2	131	日立物流	0.4	1,276	デジタルハーツHLDGS	0.1	88
共立印刷	0.3	47	丸和運輸機関	0.2	554	システム情報	0.1	90
S H O E I	0.1	465	C&Fロジホールディングス	0.2	260	メディアドゥHLDGS	0.1	356
フランスベッドHLDGS	0.3	298	海運業 (0.2%)			じげん	0.2	112
萩原工業	0.1	160	N S ユナイテッド海運	0.1	241	バイキューブ	0.1	40
トッパン・フォームズ	0.4	413	明治海運	0.2	69	ディー・エル・イー	0.1	17
フジシールインターナショナル	0.4	1,074	飯野海運	0.9	325	フィックスターズ	0.2	298
タカラトミー	0.8	934	乾汽船	0.2	233	CAR TA HOLDINGS	0.1	109
廣済堂	0.2	142	倉庫・運輸関連業 (0.9%)			オプティム	0.1	270
エステールホールディングス	0.1	64	トランコム	0.1	621	セレス	0.1	123
アーク	0.8	76	日新	0.2	328	ティーガイア	0.1	227
タカノ	0.1	79	三井倉庫HOLD	0.2	346	日本アジアグループ	0.2	70
プロネクス	0.2	232	住友倉庫	0.7	1,017	豆蔵ホールディングス	0.1	171
ホクシン	0.1	16	渋沢倉庫	0.1	200	テクマトリックス	0.1	224
ウッドワン	0.1	114	東陽倉庫	0.3	99	プロシッパ	0.1	128
大建工業	0.1	194	日本トランスシティ	0.4	211	ザッパラス	0.1	37
共同印刷	0.1	268	中央倉庫	0.1	115	インターネットイニシアティブ	0.3	751
N I S S H A	0.4	464	安田倉庫	0.2	186	さくらインターネット	0.2	122
宝印刷	0.1	170	東洋埠頭	0.1	137	ヴィンクス	0.1	112
ツツミ	0.1	199	宇徳	0.2	105	S R Aホールディングス	0.1	249
小松ウオール工業	0.1	203	近鉄エクスプレス	0.3	483	システムインテグレータ	0.1	75
河合楽器	0.1	307	東海運	0.1	28	朝日ネット	0.2	131
クリナップ	0.2	114	エーアイティ	0.1	97	e B A S E	0.1	115
キングジム	0.2	173	内外トランスライン	0.1	137	アバント	0.1	210
イトーキ	0.4	188	日本コンセプト	0.1	139	アドソル日進	0.1	229
三菱鉛筆	0.3	528	情報・通信業 (9.2%)			フリービット	0.1	89
タカラスタンダード	0.4	746	N E C ネットスアイ	0.2	610	コムチュア	0.2	375
ナカバヤシ	0.2	105	システナ	0.7	1,101	アステリア	0.1	65
グローブライド	0.1	270	デジタルアーツ	0.1	667	マークラインズ	0.1	187
オカムラ	0.7	740	日鉄ソリューションズ	0.3	1,074	メディカル・データ・ビジ	0.2	234
美津濃	0.2	564	キューブシステム	0.1	76	g u m i	0.2	138
電気・ガス業 (0.7%)			コア	0.1	134	モバイルファクトリー	0.1	149
沖縄電力	0.4	714	ソリトンシステムズ	0.1	97	デジタル・インフォメーション	0.1	166
エフオン	0.1	71	ソフトクリエイティブHD	0.1	177	オーブンドア	0.1	200
イーレックス	0.3	408	ネオス	0.1	73	マイネット	0.1	54
レノバ	0.3	278	電算システム	0.1	296	アカツキ	0.1	628
北海道瓦斯	0.1	156	グリーン	1.3	642	シンクロ・フード	0.1	48
広島ガス	0.4	138	コーエーテクモHD	0.4	952	オークネット	0.1	136
西部瓦斯	0.2	483	三菱総合研究所	0.1	366	A O I T Y O HOLDINGS	0.2	125
静岡ガス	0.6	547	A G S	0.1	70	マクロミル	0.3	266
メタウォーター	0.1	368	ファインデックス	0.2	190	ソルクシーズ	0.1	92
陸運業 (1.6%)			K L a b	0.3	289	フェイス	0.1	79
S B Sホールディングス	0.2	347	ポールトゥウィン・ピットクル	0.3	305	プロトコーポレーション	0.2	225

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	当 期 末			銘柄	当 期 末			銘柄	当 期 末		
	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額		株	数	評 価 額
		千株	千円			千株	千円			千株	千円
サイバネットシステム	0.2	138		インプレスホールディングス	0.2	30		萩原電気HL DGS	0.1	276	
CEホールディングス	0.2	81		アイネット	0.1	137		アズワン	0.1	878	
インテジホールディングス	0.2	189		東映	0.1	1,512		スズデン	0.1	134	
東邦システムサイエンス	0.1	100		D T S	0.4	916		尾家産業	0.1	126	
ソースネクスト	0.8	400		シーイーシー	0.2	394		シモジマ	0.1	118	
インフォコム	0.2	472		ジャステック	0.1	109		ドウシシャ	0.2	344	
F I G	0.2	63		日本システムウエア	0.1	236		高速	0.1	131	
アルテリア・ネットワークス	0.2	287		アイネス	0.2	227		たけびし	0.1	138	
フォーカスシステムズ	0.1	86		T K C	0.2	894		丸文	0.2	119	
グレスコ	0.1	336		富士ソフト	0.2	899		ハピネット	0.2	264	
ジャストシステム	0.3	1,278		N S D	0.3	931		日本ライフライン	0.6	1,026	
TDCソフト	0.2	169		福井コンピュータHL D S	0.1	255		タカショー	0.1	47	
IDホールディングス	0.1	123		J B C Cホールディングス	0.2	296		エクセル	0.1	119	
アルファシステムズ	0.1	280		ミロク情報サービス	0.2	580		マルカ	0.1	218	
フューチャー	0.2	382		卸売業 (8.6%)				I D O M	0.6	319	
CAC HOLDINGS	0.1	131		高千穂交易	0.1	113		進和	0.1	228	
S B テクノロジー	0.1	192		エレマテック	0.2	207		ダイترون	0.1	143	
トーセ	0.1	84		J A L U X	0.1	243		シークス	0.2	326	
オービックビジネスC	0.2	868		あらた	0.1	402		田中商事	0.1	64	
アイティフォー	0.2	172		東京エレクトロンデバイス	0.1	207		オーハシテクニカ	0.1	143	
サイボウズ	0.2	204		フィールズ	0.2	108		白銅	0.1	133	
ソフトブレイン	0.1	70		横浜冷凍	0.5	539		蝶理	0.1	169	
電通国際情報S	0.1	346		ラサ商事	0.1	85		三共生興	0.3	158	
デジタルガレージ	0.4	1,374		ラクーンホールディングス	0.1	70		兼松	0.8	999	
イーエムシステムズ	0.2	354		アルコニックス	0.2	264		日本紙バルブ	0.1	389	
ウェザーニューズ	0.1	334		神戸物産	0.3	1,731		カメイ	0.2	238	
C I J	0.1	83		あいホールディングス	0.3	556		スターゼン	0.1	455	
日本エンタープライズ	0.2	45		ディーブイエックス	0.1	87		山善	0.7	667	
WOWOW	0.1	256		ダイワボウHD	0.2	926		内田洋行	0.1	423	
スカラ	0.2	187		マクニカ・富士エレHL DGS	0.5	762		第一実業	0.1	330	
インテリジェント ウェイブ	0.1	73		ラクト・ジャパン	0.1	363		西華産業	0.1	136	
I M A G I C A G R O U P	0.2	111		パイタルK S K H D	0.4	427		佐藤商事	0.2	167	
システムソフト	0.5	53		八洲電機	0.1	86		菱洋エレクトロ	0.2	383	
アルゴグラフィックス	0.2	505		メディアスホールディングス	0.1	75		東京産業	0.2	105	
マーベラス	0.3	235		レスターホールディングス	0.2	364		ユアサ商事	0.2	647	
エイベックス	0.3	385		大光	0.1	67		小林産業	0.1	31	
日本ユニシス	0.6	2,091		O C H Iホールディングス	0.1	134		正栄食品	0.1	332	
兼松エレクトロニクス	0.1	317		T O K A Iホールディングス	1	1,049		カナデン	0.2	253	
朝日放送グループHD	0.2	144		三洋貿易	0.1	215		菱電商事	0.2	309	
スカパーJ S A T H D	1.2	530		ウイン・パートナーズ	0.1	135		フルサト工業	0.1	161	
テレビ東京HD	0.2	443		ミタチ産業	0.1	72		すてきなイスグループ	0.1	90	
日本BS放送	0.1	107		シップヘルスケアHD	0.4	1,882		昭光通商	0.1	63	
ビジョン	0.3	500		明治電機工業	0.1	136		極東貿易	0.1	181	
USEN-NEXT HL DGS	0.1	94		コメダホールディングス	0.4	828		イワキ	0.2	91	
ワイヤレスゲート	0.1	75		富士興産	0.1	66		三菱石油	0.5	529	
コネクシオ	0.1	138		小野建	0.2	276		稲畑産業	0.5	675	
日本通信	1.7	329		佐鳥電機	0.1	87		G S Iクレオス	0.1	106	
エムティーアイ	0.2	145		伯東	0.1	121		明和産業	0.2	105	
GMOインターネット	0.7	1,224		コンドーテック	0.1	97		クワザワ	0.1	55	
K A D O K A W A	0.6	893		中山福	0.1	53		ワキタ	0.4	424	
学研ホールディングス	0.1	562		ナガイレーベン	0.3	743		ミツウロコグループ	0.3	331	
ゼンリン	0.4	728		三菱食品	0.2	552		シナネンホールディングス	0.1	185	
昭文社	0.1	39		松田産業	0.1	144		伊藤忠エネクス	0.4	336	

銘柄	当期末		銘柄	当期末		銘柄	当期末	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
サンワテクノス	0.1	90	クオールホールディングス	0.3	441	コジマ	0.3	129
リョーサン	0.2	562	ジーンズホールディングス	0.1	629	ヒマラヤ	0.1	82
新光商事	0.4	367	ビックカメラ	1.1	1,281	コーナン商事	0.3	753
トーホー	0.1	172	DCMホールディングス	1	1,066	エコス	0.1	172
三信電気	0.1	159	ベッパーフードサービス	0.2	320	ワタミ	0.3	417
東陽テクニカ	0.2	217	きちりホールディングス	0.1	79	マルシェ	0.1	77
モスフード サービス	0.3	798	アーランドサービスHD	0.1	189	西松屋チェーン	0.4	382
加賀電子	0.2	413	ドトール・日レスHD	0.3	654	幸楽苑ホールディングス	0.1	212
ソーダニッカ	0.2	120	ブロンコビリー	0.1	253	サイゼリヤ	0.3	770
立花エレテック	0.1	176	トレジャー・ファクトリー	0.1	117	V Tホールディングス	0.9	420
フォーバル	0.1	99	物語コーポレーション	0.1	956	魚力	0.1	149
PALTAC	0.3	1,563	ココカラファイン	0.2	1,184	ユナイテッドアローズ	0.2	667
三谷産業	0.2	61	Hamee	0.1	110	ハイデイ日高	0.3	623
太平洋興発	0.1	79	クリエイトSDH	0.3	810	京都きもの友禅	0.1	35
国際紙パルプ商事	0.3	94	丸善CHIHHD	0.2	73	ピーシーデポコーポ	0.3	145
ヤマタネ	0.1	138	チムニー	0.1	238	壱番屋	0.1	514
日鉄物産	0.1	442	シュッピン	0.1	105	トップカルチャー	0.1	35
泉州電業	0.1	285	ネクステージ	0.3	356	薬王堂ホールディングス	0.1	263
トラスコ中山	0.4	1,072	ジョイフル本田	0.6	831	ヴィア・ホールディングス	0.2	129
モリト	0.1	79	鳥貴族	0.1	212	スクロール	0.3	100
加藤産業	0.3	1,041	キリン堂ホールディングス	0.1	210	ヨンドシーホールディングス	0.2	523
イノテック	0.1	95	ホットランド	0.1	117	木曽路	0.2	546
イエローハット	0.4	647	SFPホールディングス	0.1	215	SRSホールディングス	0.2	207
JKホールディングス	0.2	108	綿半ホールディングス	0.1	196	千趣会	0.3	84
日伝	0.2	426	ユナイテッド・スーパーマーケット	0.6	574	タカキユー	0.1	18
北沢産業	0.2	54	ゴルフダイジェスト・オン	0.1	65	ケーヨー	0.4	210
杉本商事	0.1	197	BEE NOS	0.1	124	上新電機	0.2	445
因幡電機産業	0.3	1,447	あさひ	0.2	236	日本瓦斯	0.3	970
東テク	0.1	212	日本調剤	0.1	386	ロイヤルホールディングス	0.3	806
アルテック	0.1	24	トーエル	0.1	79	いなげや	0.2	312
タキヒヨー	0.1	186	クリエイト・レストランツ・ホール	0.5	929	チヨダ	0.2	321
ジェコス	0.1	90	サンマルクホールディングス	0.2	478	ライフコーポレーション	0.1	247
グローセル	0.2	85	トリドールホールディングス	0.2	456	リンガーハット	0.2	482
小売業 (10.5%)			TOKYO BASE	0.2	141	MrMaxHD	0.3	143
サンエー	0.1	502	ジャパンミート	0.1	220	テナアライド	0.2	86
カワチ薬品	0.1	215	アレンザホールディングス	0.1	79	AOKIホールディングス	0.4	436
ハードオフコーポレーション	0.1	79	パロックジャパン	0.2	183	オークワ	0.3	405
アスクル	0.2	575	クスリのアオキHLDGS	0.2	1,508	コメリ	0.3	684
ゲオホールディングス	0.3	402	力の源HD	0.1	81	はせがわ	0.1	40
アダストリア	0.3	771	スシローグローバルHLDGS	0.2	1,492	松屋	0.4	359
ジーフット	0.1	61	LIXILビバ	0.2	345	近鉄百貨店	0.1	332
くら寿司	0.1	445	メディカルシステムネットワーク	0.2	104	パルコ	0.2	257
キャンドウ	0.1	160	はるやまHLDGS	0.1	80	アクシアル リテイリング	0.2	833
パルグループHLDGS	0.1	357	ノジマ	0.3	560	井筒屋	0.1	24
エディオン	0.8	856	カップ・クリエイト	0.3	417	平和堂	0.4	818
サーラコーポレーション	0.4	247	ライトオン	0.2	115	フジ	0.2	392
ワッツ	0.1	60	ジーンズメイト	0.1	32	ヤオコー	0.2	996
ハローズ	0.1	248	三城ホールディングス	0.2	55	ゼビオホールディングス	0.2	241
フジオフードシステム	0.1	300	アドヴァン	0.3	340	OLYMPICグループ	0.1	59
ひらまつ	0.4	128	アルピス	0.1	241	日産東京販売HD	0.3	92
ハニーズホールディングス	0.2	264	コナカ	0.2	81	GENKY DRUGS STORES	0.1	242
アルペン	0.1	173	G-7ホールディングス	0.1	359	総合メディカルHD	0.2	341
ハブ	0.1	108	イオン北海道	0.2	153	ブックオフGHD	0.1	112

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	当期末		銘柄	当期末		銘柄	当期末	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
元気寿司	0.1	267	大光銀行	0.1	165	サムティ	0.3	591
アーランドサカモト	0.3	380	愛媛銀行	0.3	331	ディア・ライフ	0.2	97
グルメ軒屋	0.1	117	トマト銀行	0.1	105	コーセーアルイー	0.1	74
愛眼	0.2	48	京葉銀行	0.8	516	イー・ディー・ワークス	5.9	177
ケユーホールディングス	0.1	85	栃木銀行	1	202	日本商業開発	0.1	148
松屋フーズHLDGS	0.1	395	北日本銀行	0.1	181	プレサンスコーポレーション	0.3	525
サガミホールディングス	0.3	410	東和銀行	0.3	253	ユニゾホールディングス	0.3	1,476
関西スーパーマーケット	0.1	109	福島銀行	0.2	43	THEグローバル社	0.1	47
王将フードサービス	0.1	664	大東銀行	0.1	57	日本管理センター	0.1	143
プレナス	0.2	362	トモニホールディングス	1.5	541	サンセイラディック	0.1	87
ミニストップ	0.1	145	フィデアホール	1.9	229	フージャースHD	0.4	260
アークス	0.4	916	池田泉州HD	2	372	ムゲンエステート	0.1	66
ベルク	0.1	512	証券、商品先物取引業 (0.8%)			ファーストブラザーズ	0.1	116
大庄	0.1	158	F P G	0.6	650	ハウスドゥ	0.1	177
サックスパーホールディング	0.2	181	マーキュリアインベストメント	0.1	72	シーアールイー	0.1	105
ペルーナ	0.5	342	日本アジア投資	0.2	63	ケイアイスター不動産	0.1	193
銀行業 (3.4%)			岡三証券グループ	1.6	609	平和不動産	0.4	1,052
じもとホールディングス	1.3	130	丸三証券	0.6	307	ダイビル	0.6	712
東京きらぼしFG	0.3	424	東洋証券	0.7	116	京阪神ビルディング	0.3	391
富山第一銀行	0.5	156	水戸証券	0.6	144	テオーシー	0.5	407
関西みらいFG	0.9	621	いちよし証券	0.4	272	スターツコーポレーション	0.3	821
33FG	0.2	341	だいこう証券ビジ	0.1	56	フジ住宅	0.2	133
千葉興業銀行	0.5	154	マネックスG	1.8	464	空港施設	0.2	108
筑波銀行	0.8	160	極東証券	0.3	240	明和地所	0.1	54
青森銀行	0.1	280	岩井コスモホールディング	0.2	223	ゴールドクレスト	0.2	451
秋田銀行	0.1	211	藍澤証券	0.4	286	エスリード	0.1	172
山形銀行	0.2	295	マネーパートナーズGP	0.2	50	日神不動産	0.3	144
岩手銀行	0.1	251	スパークス・グループ	0.8	202	日本エスコン	0.3	265
東邦銀行	1.7	431	小林洋行	0.1	24	タカラレーベン	0.9	380
東北銀行	0.1	101	保険業 (0.2%)			サンヨーハウス 名古屋	0.1	92
みちのく銀行	0.1	164	アニコムホールディングス	0.2	799	ファースト住建	0.1	135
十六銀行	0.3	707	その他金融業 (1.4%)			ランド	7.8	62
山梨中央銀行	0.2	211	イントラスト	0.1	69	カチタス	0.2	892
大垣共立銀行	0.4	984	C a s a	0.1	120	トーセイ	0.3	405
福井銀行	0.2	291	アルビ	0.2	464	サンフロンティア不動産	0.3	390
北國銀行	0.2	586	プレミアグループ	0.1	183	エフ・ジェー・ネクスト	0.2	214
清水銀行	0.1	193	芙蓉総合リース	0.2	1,378	インテリックス	0.1	74
南都銀行	0.3	756	みずほリース	0.4	1,196	ランドビジネス	0.1	75
百五銀行	1.7	576	日本証券金融	0.8	404	グランディアハウス	0.2	95
鳥取銀行	0.1	143	リコーリース	0.2	694	サービス業 (9.5%)		
百十四銀行	0.2	429	ジャックス	0.2	452	日本工営	0.1	324
四国銀行	0.3	299	オリコ	5.2	754	L I F U L L	0.7	473
阿波銀行	0.3	759	アプラスフィナンシャル	0.9	88	ジェイエイシリアルメント	0.1	198
大分銀行	0.1	283	九州リースサービス	0.1	59	メンバーズ	0.1	181
宮崎銀行	0.1	268	イー・ギャランティ	0.2	289	タケエイ	0.2	212
佐賀銀行	0.1	153	アサックス	0.1	61	トラスト・テック	0.2	257
沖縄銀行	0.2	710	NECキャピタルソリューション	0.1	216	コシダカホールディングス	0.4	648
琉球銀行	0.4	465	不動産業 (2.9%)			パソナグループ	0.2	287
高知銀行	0.1	79	いちご	2.4	1,056	リンクアンドモチベーション	0.3	165
長野銀行	0.1	164	日本駐車場開発	2.1	336	G C A	0.2	161
名古屋銀行	0.2	628	スター・マイカ・HLDGS	0.1	190	エス・エム・エス	0.7	1,880
愛知銀行	0.1	353	三栄建築設計	0.1	153	リニカル	0.1	96
中京銀行	0.1	210	三重交通グループHD	0.4	231	クックパッド	0.6	184

銘柄	当期末		銘柄	当期末		銘柄	当期末	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
エスクリ	0.1	86	山田コンサルティングGP	0.1	176	東京ドーム	0.7	672
アイ・ケイ・ケイ	0.1	69	セントラルスポーツ	0.1	321	西尾レントオール	0.2	580
学情	0.1	147	フルキャストホールディングス	0.2	442	アゴーラ・ホスピタリティーG	1	32
スタジオアリス	0.1	185	エン・ジャパン	0.3	1,273	トランス・コスモス	0.2	531
シミックホールディングス	0.1	173	アイ・アールジャパンHD	0.1	371	乃村工藝社	0.9	1,174
アイロムグループ	0.1	153	Keep Research	0.1	144	藤田観光	0.1	283
セントレア・ホールディング	0.1	49	Gunosy	0.1	167	KNT-CTホールディングス	0.1	167
ルネサンス	0.1	164	イー・ガーディアン	0.1	164	日本管財	0.2	377
ディップ	0.3	847	リブセンス	0.1	27	トーカイ	0.2	470
オプトホールディング	0.1	155	ジャパンマテリアル	0.5	751	セントラル警備保障	0.1	617
新日本科学	0.3	185	ベクトル	0.2	193	丹青社	0.4	453
ツクイ	0.4	170	ウチヤマホールディングス	0.1	49	応用地質	0.2	238
ベネフィット・ワン	0.5	1,035	キャリアリンク	0.1	59	船井総研ホールディング	0.4	1,018
ツカダ・グローバルHOLD	0.1	59	I B J	0.1	98	進学会ホールディングス	0.1	50
アウトソーシング	1	1,083	アサンテ	0.1	201	オオバ	0.1	72
ウエルネット	0.2	142	N・フィールド	0.1	61	学究社	0.1	124
ワールドホールディングス	0.1	169	M&Aキャピタルパートナー	0.1	695	イオンディライト	0.2	720
ぐるなび	0.3	215	ライドオンエクスプレスHD	0.1	138	ナック	0.1	97
タカミヤ	0.2	132	ERIホールディングス	0.1	79	ニチ学館	0.3	537
ジャパンベストレスキューS	0.1	103	シグマクシス	0.1	143	ダイセキ	0.3	867
ファンコミュニケーションズ	0.5	257	ウィルグループ	0.1	98	ステップ	0.1	143
ライク	0.1	174	エスクローAJ	0.3	65			
ビジネス・ブレイクスルー	0.1	35	エラン	0.1	166	合計	株数、金額	千株 千円
WDBホールディングス	0.1	275	土木管理総合試験	0.1	45	銘柄数<比率>	1,361銘柄	<98.3%>
ティア	0.1	59	ベルシステム24HLDGS	0.3	516			
バリューコマース	0.1	160	鎌倉新書	0.1	148	(注1) 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。		
インフォーマット	1	1,501	エポラブルアジア	0.1	192	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。		
J Pホールディングス	0.5	147	ストライク	0.1	348	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。		
エコナックホールディングス	0.4	50	ソラスト	0.5	602			
E P Sホールディングス	0.3	380	インソース	0.1	262			
プレスステージ・インター	0.8	725	ベikalentコンサルティング	0.1	516			
アミューズ	0.1	283	キャリアインデックス	0.1	46			
ドリームインキュベータ	0.1	158	MS-Japan	0.1	126			
クイック	0.1	140	グレイステクノロジー	0.1	289			
TAC	0.1	19	ジャパンエレベーターSHD	0.1	276			
ケネディクス	1.6	921	グリーンズ	0.1	130			
テイクアンドギヴニーズ	0.1	122	日総工産	0.1	126			
ぴあ	0.1	464	キュービーネットHLDGS	0.1	222			
イオンファンタジー	0.1	312	RPAホールディングス	0.1	122			
シーティーエス	0.2	158	スプリックス	0.1	144			
ネクシィーズグループ	0.1	206	アドバンテッジリスクマネ	0.1	84			
アルプス技研	0.2	306	東祥	0.1	216			
サニックス	0.3	114	エイチ・アイ・エス	0.3	820			
日本空調サービス	0.2	140	共立メンテナンス	0.3	1,386			
明光ネットワークジャパン	0.2	194	イチネンホールディングス	0.2	255			
ファルコホールディングス	0.1	164	建設技術研究所	0.1	170			
ラウンドワン	0.6	843	スペース	0.1	127			
ビー・エム・エル	0.2	623	長大	0.1	98			
りらいあコミュニケーション	0.3	417	東京テアトル	0.1	137			
リソー教育	0.9	382	ナガワ	0.1	622			
東京個別指導学院	0.1	90	東京都競馬	0.1	339			
クリーグ・アンド・リバー社	0.1	113	常磐興産	0.1	167			
テー・オー・ダブリュー	0.2	151	カナモト	0.3	860			

(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
ミニTOPIX	8	-

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年10月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	473,157	98.2
コール・ローン等、その他	8,702	1.8
投資信託財産総額	481,859	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年10月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	481,525,245円
コール・ローン等	4,680,305
株式(評価額)	473,157,500
未収入金	313,960
未収配当金	3,475,480
差入委託証拠金	△ 102,000
(B) 負債	20,000
未払解約金	20,000
(C) 純資産総額(A - B)	481,505,245
元本	504,949,161
次期繰越損益金	△ 23,443,916
(D) 受益権総口数	504,949,161口
1万口当り基準価額(C/D)	9,536円

* 期首における元本額は499,950,000円、当作成期間中における追加設定元本額は28,776,760円、同解約元本額は23,777,599円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、iFreeNEXT 日本小型株インデックス504,949,161円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,536円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は23,443,916円です。

■損益の状況

当期 自2018年10月19日 至2019年10月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	10,264,038円
受取配当金	10,273,372
受取利息	5
その他収益金	675
支払利息	△ 10,014
(B) 有価証券売買損益	△33,249,774
売買益	33,225,582
売買損	△66,475,356
(C) 先物取引等損益	△ 177,698
取引益	646,104
取引損	△ 823,802
(D) その他費用	△ 321
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	△23,163,755
(F) 解約差損益金	1,904,599
(G) 追加信託差損益金	△ 2,184,760
(H) 合計(E + F + G)	△23,443,916
次期繰越損益金(H)	△23,443,916

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。