

iFreeNEXT 日本小型株 インデックス

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2020年10月19日）
（作成対象期間 2019年10月19日～2020年10月19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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
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、分配を行わないことがあります。		

◇TUZ0337520201019◇

<3375>

設定以来の運用実績

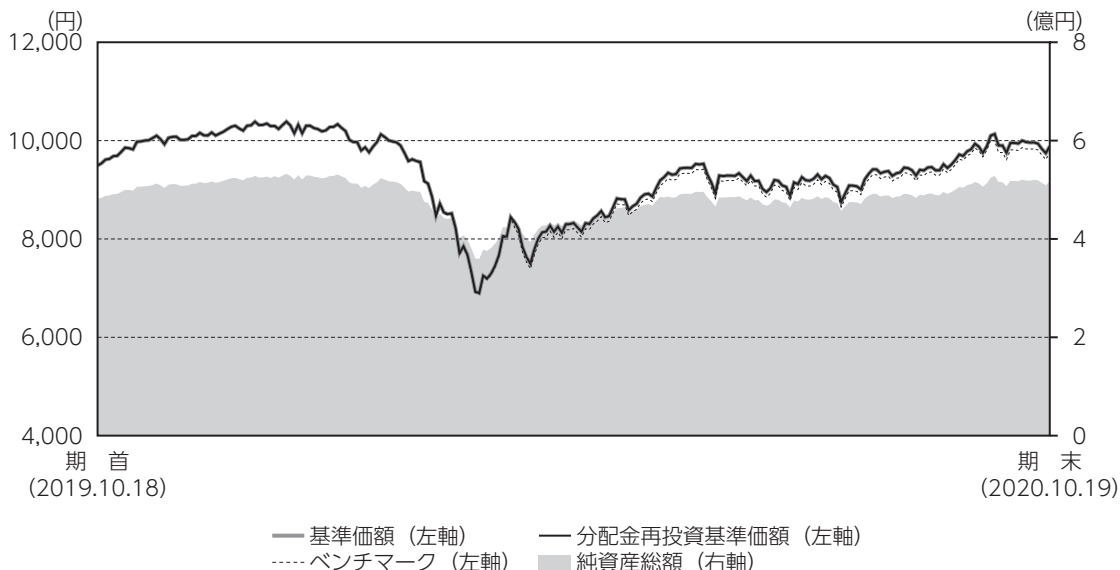
決 算 期	基 準 価 額			T O P I X S m a l l (ベンチマーク)	期 中 騰 落 率	株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 配 金	期 中 騰 落 率					
1 期 末 (2019 年 10 月 18 日)	円 9,494	円 0	% △5.1	9,266	% △7.3	% 98.3	% 1.7	百万円 481
2 期 末 (2020 年 10 月 19 日)	9,886	0	4.1	9,522	2.8	96.6	2.8	516

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) T O P I X S m a l l は、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメント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、期首の基準価額をもとに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TOP I X S m a l l です。

■基準価額・騰落率

期 首：9,494円

期 末：9,886円（分配金0円）

騰落率：4.1%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（TOP I X S m a l l）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、基準価額は上昇しました。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	騰 落 率	T O P I X (ベンチマーク)	S m a l l 騰 落 率	株 組 入 比 率	株 式 先 物 率 比
(期首) 2019年10月18日	円 9,494	% -	9,266	% -	% 98.3	% 1.7
10月末	9,845	3.7	9,615	3.8	98.1	1.7
11月末	10,103	6.4	9,865	6.5	97.8	2.0
12月末	10,309	8.6	10,054	8.5	96.8	2.9
2020年 1 月末	9,863	3.9	9,624	3.9	96.6	3.3
2 月末	8,471	△10.8	8,245	△11.0	95.8	4.1
3 月末	8,199	△13.6	7,895	△14.8	97.3	2.6
4 月末	8,567	△ 9.8	8,252	△10.9	97.4	2.6
5 月末	9,306	△ 2.0	8,972	△ 3.2	98.3	1.6
6 月末	9,183	△ 3.3	8,863	△ 4.4	97.9	2.0
7 月末	8,752	△ 7.8	8,441	△ 8.9	97.9	2.0
8 月末	9,406	△ 0.9	9,076	△ 2.0	98.1	1.6
9 月末	9,900	4.3	9,524	2.8	97.6	2.2
(期末) 2020年10月19日	9,886	4.1	9,522	2.8	96.6	2.8

(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

(2019.10.19~2020.10.19)

■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落したことに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念されたことに加えて、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策を受けて株価は上昇に転じました。新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したことや、国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感されました。しかし6月中旬以降は、米国において新型コロナウイルスの感染拡大が再び懸念され、株価は頭打ちとなりました。7月には、国内における感染拡大が再び目立ち始めたほか、米国の雇用回復への不透明感もあって7月下旬に株価は再度下落したものの、8月に入ると、ワクチン開発への期待の高まりや米国の緩和的な金融政策の長期化期待により、株価は反発しました。8月下旬に安倍首相が健康問題を理由に退任を表明した際には株価が一時下落する場面が見られたものの、後任の首相として菅官房長官が有力との見方が早期に広がり、政策の継続性が保たれるとの安心感から、株価は直ぐに落ち着きを取り戻しました。

前作成期末における「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（TOPIX Small）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。

ポートフォリオについて

(2019.10.19~2020.10.19)

■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。

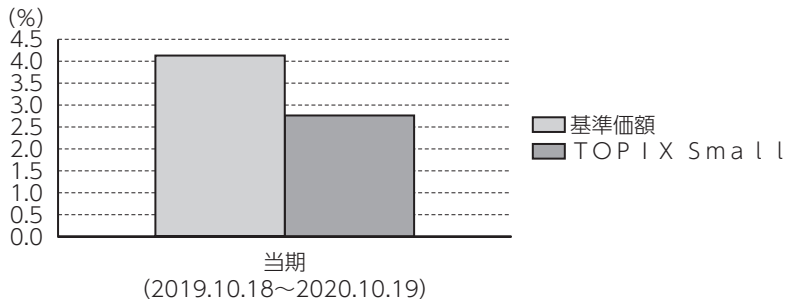
株式ポートフォリオにつきましては、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、時価総額加重ウェイトに基づきポートフォリオを構築しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（TOPIX Small）の騰落率は2.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.1%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、経費控除後の配当等収益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。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2019年10月19日 ～2020年10月19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）	22

（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

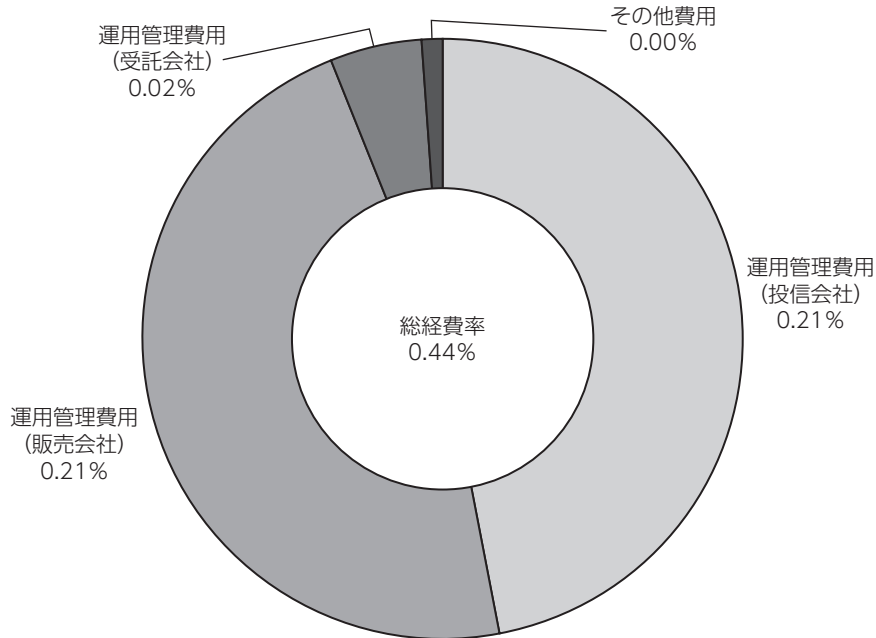
項 目	当期 (2019.10.19～2020.10.19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	41円	0.441%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,342円です。
(投 信 会 社)	(20)	(0.209)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(20)	(0.209)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.004	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)	(0.002)	
(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	42	0.450	

- (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

(2019年10月19日から2020年10月19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	40,326	36,958	27,164	25,023

(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
(2019年10月19日から2020年10月19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	99,645千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	470,593千円
(c) 売買高比率(a)÷(b)	0.21

(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

(2019年10月19日から2020年10月19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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	56	—	—	43	—	—
株式先物取引	78	78	100.0	71	71	100.0
コール・ローン	2,485	—	—	—	—	—

(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の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

(2019年10月19日から2020年10月19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	当作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	—	—	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

(2019年10月19日から2020年10月19日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	18千円
うち利害関係人への支払額 (B)	10千円
(B)÷(A)	57.3%

(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、サムティです。

■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	百万円	百万円	百万円	当初設定時における取得
500	—	—	500	

(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	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本小型株インデックス・マザーファンド	504,949	518,111	516,764

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年10月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本小型株インデックス・マザーファンド	516,764	99.8
コール・ローン等、その他	1,248	0.2
投資信託財産総額	518,012	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

2020年10月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	518,012,961円
コール・ローン等	1,248,334
日本小型株インデックス・マザーファンド(評価額)	516,764,627
(B) 負債	1,217,681
未払解約金	148,887
未払信託報酬	1,055,566
その他未払費用	13,228
(C) 純資産総額(A - B)	516,795,280
元本	522,738,215
次期繰越損益金	△ 5,942,935
(D) 受益権総口数	522,738,215口
1万口当り基準価額(C / D)	9,886円

* 期首における元本額は507,187,820円、当作成期間中における追加設定元本額は54,045,736円、同解約元本額は38,495,341円です。
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は9,886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5,942,935円です。

■損益の状況

当期 自2019年10月19日 至2020年10月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 95円
受取利息	4
支払利息	△ 99
(B) 有価証券売買損益	24,546,591
売買益	26,028,808
売買損	△ 1,482,217
(C) 信託報酬等	△ 2,160,845
(D) 当期損益金(A + B + C)	22,385,651
(E) 前期繰越損益金	△ 21,195,624
(F) 追加信託差損益金	△ 7,132,962
(売買損益相当額)	(△ 7,132,962)
(G) 合計(D + E + F)	△ 5,942,935
次期繰越損益金(G)	△ 5,942,935
追加信託差損益金	△ 7,132,962
(売買損益相当額)	(△ 7,132,962)
分配準備積立金	1,190,122
繰越損益金	△ 95

(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	1,190,122
(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)	1,190,122
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,190,122
(h) 受益権総口数	522,738,215口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

《訂正のお知らせ》

「iFreeNEXT 日本小型株インデックス」の運用報告書（全体版）（決算日2019年10月18日）につきまして、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の記載に誤りがございました。
お詫び申し上げますとともに訂正させていただきます。

訂正箇所および訂正内容：
運用報告書（全体版） 9 ページ

■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において、下線部を訂正します。

<誤>

当作成期自保有額	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 <u>500</u>	百万円 二	当初設定時における取得とその処分

<正>

当作成期自保有額	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 二	百万円 <u>500</u>	当初設定時における取得

日本小型株インデックス・マザーファンド

運用報告書 第2期（決算日 2020年10月19日）

（作成対象期間 2019年10月19日～2020年10月19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。

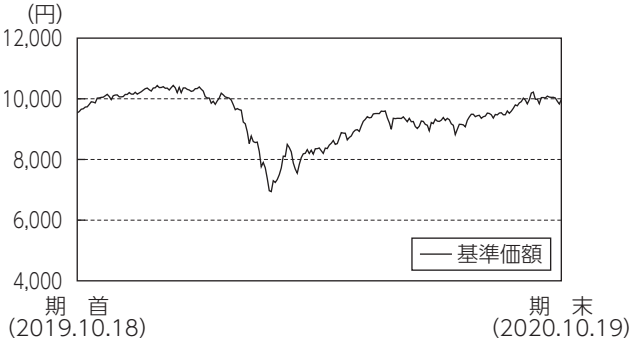
運 用 方 針	投資成果を日本の小型株市場の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）および国内株式を対象とした株価指数先物取引
株 式 組 入 制 限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
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)2019年10月18日	9,536	—	9,266	—	98.3	1.7
10月末	9,890	3.7	9,615	3.8	98.1	1.7
11月末	10,152	6.5	9,865	6.5	97.8	2.0
12月末	10,363	8.7	10,054	8.5	96.8	2.9
2020年1月末	9,919	4.0	9,624	3.9	96.6	3.3
2月末	8,522	△10.6	8,245	△11.0	95.8	4.1
3月末	8,251	△13.5	7,895	△14.8	97.3	2.6
4月末	8,625	△ 9.6	8,252	△10.9	97.4	2.6
5月末	9,372	△ 1.7	8,972	△ 3.2	98.3	1.6
6月末	9,252	△ 3.0	8,863	△ 4.4	97.9	2.0
7月末	8,821	△ 7.5	8,441	△ 8.9	97.9	2.0
8月末	9,484	△ 0.5	9,076	△ 2.0	98.1	1.6
9月末	9,986	4.7	9,524	2.8	97.6	2.2
(期末)2020年10月19日	9,974	4.6	9,522	2.8	96.6	2.9

(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として大和アセットマネジメント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】

期首：9,536円 期末：9,974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、基準価額は上昇しました。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

国内株式市況は上昇しました。
国内株式市況は、当作成期首より、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落したことに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が

懸念されたことに加えて、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策を受けて株価は上昇に転じました。新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したことや、国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感されました。しかし6月中旬以降は、米国において新型コロナウイルスの感染拡大が再び懸念され、株価は頭打ちとなりました。7月には、国内における感染拡大が再び目立ち始めたほか、米国の雇用回復への不透明感もあって7月下旬に株価は再度下落したものの、8月に入ると、ワクチン開発への期待の高まりや米国の緩和的な金融政策の長期化期待により、株価は反発しました。8月下旬に安倍首相が健康問題を理由に退任を表明した際には株価が一時下落する場面が見られたものの、後任の首相として菅官房長官が有力との見方が早期に広がり、政策の継続性が保たれるとの安心感から、株価は直ぐに落ち着きを取り戻しました。

◆ 前作成期末における「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。

◆ 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2.8%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	0円
(株式)	(0)
(先物・オプション)	(0)
有価証券取引税	—
その他費用	0
(その他)	(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

(2019年10月19日から2020年10月19日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
	千株	千円	千株	千円
国内	58.3 (1.63)	56,003 (—)	25.03	43,641

(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

(2019年10月19日から2020年10月19日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘	柄	株 数	金 額	平均単価	銘	柄	株 数	金 額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
紀陽銀行		0.7	1,194	1,706	ルネサスエレクトロニクス		9.2	6,847	744
川崎汽船		0.6	962	1,604	レーザーテック		0.4	3,320	8,301
キョーリン製薬HD		0.5	950	1,900	ゴールドウイン		0.4	3,304	8,261
パローホールディングス		0.5	935	1,870	マニー		0.9	2,414	2,682
J C R ファーマ		0.1	910	9,103	日本ユニシス		0.6	2,133	3,556
三井E & S HD		0.8	835	1,044	エス・エム・エス		0.7	1,965	2,808
レオパレス21		2.8	827	295	シップヘルスケアHD		0.4	1,890	4,725
ミクシィ		0.4	821	2,054	神戸物産		0.6	1,859	3,099
アイフル		3.2	786	245	ユニゾホールディングス		0.3	1,800	6,000
山陰合同銀行		1.2	777	647	アリアケジャパン		0.2	1,658	8,291

(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

(2019年10月19日から2020年10月19日まで)

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
	証券	千円	証券	千円
国内	— (500)	— (—)	— (500)	— (—)

(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

(2019年10月19日から2020年10月19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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	78	71	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

日本小型株インデックス・マザーファンド

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首当期末			銘柄	期首当期末			銘柄	期首当期末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.4%)				ライト工業	0.4	0.4	619	焼津水産化工	0.1	0.1	100
極洋	0.1	0.1	277	日特建設	0.2	0.2	154	アリアケジャパン	0.2	—	—
カネコ種苗	0.1	0.1	154	北陸電気工事	0.1	0.1	117	エバラ食品工業	—	0.1	241
サカタのタネ	0.3	0.3	1,155	ユアテック	0.3	0.4	260	イトアンドHLDGS	0.1	0.1	188
ホクト	0.2	0.2	453	日本リーテック	—	0.1	241	ヨシムラ・フード・HLDGS	0.1	0.1	82
鉱業 (0.3%)				中電工	0.3	0.3	658	永谷園ホールディングス	0.1	0.1	237
住石ホールディングス	0.6	0.6	74	関電工	1	0.9	759	一正蒲鉾	0.1	0.1	117
日鉄鉱業	0.1	0.1	472	東京エネシス	0.2	0.2	150	フジッコ	0.2	0.2	407
三井松島HLDGS	0.1	0.1	71	トーエネック	0.1	0.1	345	ロックフィールド	0.2	0.2	297
石油資源開発	0.4	0.4	684	住友電設	0.2	0.2	510	ケンコーマヨネーズ	0.1	0.1	182
K&Oエナジーグループ	0.1	0.1	147	日本電設工業	0.4	0.4	835	わらべや日洋HD	0.1	0.1	151
建設業 (5.5%)				新日本空調	0.2	0.2	447	なとり	0.1	0.1	206
ヒノキヤグループ	0.1	0.1	200	三機工業	0.5	0.5	586	北の達人コーポ	0.8	0.7	334
ショーボンドHD	0.4	0.5	2,615	中外炉工業	0.1	0.1	149	ユグレナ	0.8	0.9	810
ミライト・ホールディングス	0.7	0.9	1,426	ヤマト	0.2	0.2	133	ミヨシ油脂	0.1	0.1	113
タマホーム	0.1	0.2	293	太平電業	0.1	0.2	448	理研ビタミン	0.1	0.2	284
日本アクア	0.1	0.1	72	高砂熱学	0.5	0.6	879	繊維製品 (1.6%)			
ファーストコーポレーション	0.1	0.1	72	明星工業	0.4	0.4	321	片倉工業	0.2	0.3	361
ベステラ	0.1	0.1	154	大気社	0.3	0.3	851	グンゼ	0.1	0.2	787
TATERU	0.3	0.6	117	ダイダン	0.1	0.2	532	ユニチカ	0.6	0.6	236
スペースバリューHD	0.3	0.4	236	日比谷総合設備	0.2	0.2	350	富士紡ホールディングス	0.1	0.1	366
ダイセキ環境ソリューション	0.1	0.1	71	東芝プラントシステム	0.5	—	—	倉敷紡績	0.2	0.2	373
安藤・間	1.7	1.7	1,181	OSJBHD	1	1.1	269	シキボウ	0.1	0.1	95
東急建設	0.8	0.8	381	東洋エンジニア	0.3	0.3	96	日本毛織	0.6	0.7	714
ミサワホーム	0.2	—	—	レイズネクスト	0.4	0.4	506	ダイトウボウ	0.3	0.3	32
ピーアールホールディングス	0.2	0.3	215	食料品 (3.2%)				トーア紡コーポレーション	0.1	0.1	49
高松コンストラクショングP	0.2	0.2	437	日本製粉	0.6	0.6	1,041	ダイドーリミテッド	0.2	0.3	59
東建コーポレーション	0.1	0.1	806	昭和産業	0.2	0.2	653	帝国繊維	0.2	0.2	524
ヤマウラ	0.1	0.1	90	鳥越製粉	0.2	0.2	206	サカイオーベックス	—	0.1	201
飛鳥建設	0.2	0.2	218	中部飼料	0.2	0.3	472	住江織物	0.1	0.1	214
松井建設	0.2	0.3	216	フィード・ワン	1.3	0.2	185	日本フェルト	0.1	0.1	48
不動テトラ	0.2	0.2	303	日本甜菜糖	0.1	0.1	181	アツギ	0.2	0.2	113
大木建設	0.1	0.1	84	三井製糖	0.2	0.2	384	ダイニック	0.1	0.1	81
鉄建建設	0.1	0.1	202	塩水港精糖	0.2	0.2	44	セーレン	0.5	0.5	796
大豊建設	0.2	0.2	635	日新製糖	0.1	0.1	190	ソトー	0.1	0.1	94
佐田建設	0.1	0.1	44	中村屋	0.1	0.1	398	小松マテール	0.3	0.3	244
ナカノフード建設	0.2	0.2	83	名糖産業	0.1	0.1	145	ホギメディカル	0.2	0.2	684
東鉄工業	0.3	0.3	815	井村屋グループ	0.1	0.1	235	レナウン	0.6	—	—
富士ビー・エス	0.1	0.1	59	不二家	0.1	0.1	232	クラウディアHLDGS	—	0.1	29
浅沼組	0.1	0.1	407	亀田製菓	0.1	0.1	519	TSIホールディングス	0.7	0.7	195
熊谷組	0.3	0.3	758	寿スピリッツ	0.2	0.2	1,030	マツオカコーポレーション	0.1	0.1	226
矢作建設	0.3	0.3	260	六甲バター	0.1	0.1	178	ワールド	0.2	0.3	408
ビーエス三菱	0.2	0.2	117	プリマハム	0.3	0.3	940	三陽商会	0.1	0.1	48
日本ハウスHLDGS	0.4	0.5	136	林兼産業	0.1	0.1	57	ナイガイ	0.1	0.1	38
新日本建設	0.3	0.3	273	丸大食品	0.2	0.2	339	オンワードホールディングス	1.2	1.3	286
NIPPO	0.6	0.6	1,680	S Foods	0.2	0.2	696	ルックホールディングス	0.1	0.1	84
日本道路	0.1	0.1	753	柿安本店	—	0.1	258	キムラタン	0.9	1.1	29
東亜建設	0.2	0.2	366	伊藤ハム米久HLDGS	1.3	1.4	1,009	ゴールドウイン	0.4	—	—
日本国土開発	0.4	0.5	290	オエノンホールディングス	0.5	0.6	258	デサント	0.5	0.4	668
若葉建設	0.1	0.1	120	養命酒	0.1	0.1	188	キング	0.1	0.1	58
東洋建設	0.8	0.7	296	ダイドーグループHD	0.1	0.1	530	ヤマトインターナショナル	0.1	0.1	33
世紀東急	0.3	0.3	241	キーコーヒー	0.2	0.2	442	パルプ・紙 (0.7%)			
福田組	0.1	0.1	483	ユニカフェ	0.1	0.1	101	特種東海製紙	0.1	0.1	452
日本基礎技術	0.2	0.2	90	日清オイリオグループ	0.3	0.3	909	三菱製紙	0.3	0.3	99
巴コーポレーション	0.3	0.3	110	J-オイルミルズ	0.1	0.1	384	北越コーポレーション	1.3	1.4	505

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
中越パルプ	0.1	0.1	138	太陽ホールディングス	0.2	0.2	1,108	石油・石炭製品 (0.2%)			
巴川製紙	0.1	0.1	94	サカタインクス	0.4	0.5	563	日本コークス工業	1.7	1.8	115
大王製紙	0.9	0.9	1,342	東洋インキSCホールディングス	0.4	0.4	820	ニチレキ	0.2	0.3	503
阿波製紙	—	0.1	44	T & K T O K A	0.1	0.2	164	ユシロ化学	0.1	0.1	136
トーモク	0.1	0.1	171	高砂香料	0.1	0.1	218	ビーピー・カストロール	0.1	0.1	124
ザ・パックス	0.1	0.2	585	マンダム	0.4	0.5	916	富士石油	0.5	0.6	111
化学 (6.8%)				ミルボン	0.2	0.3	1,602	M O R E S C O	0.1	0.1	100
共和レザー	0.1	0.1	60	コタ	0.1	0.1	133	ゴム製品 (0.4%)			
住友精化	0.1	0.1	358	ノビアホールディングス	0.2	0.2	957	藤倉コンボジット	0.2	0.2	69
ラサ工業	0.1	0.1	210	エステー	0.1	0.1	209	オカモト	0.1	0.1	425
クレハ	0.2	0.2	920	アグロカネショウ	0.1	0.1	164	フコク	0.1	0.1	64
多木化学	0.1	0.1	687	コニシ	0.3	0.3	447	ニッタ	0.2	0.2	458
テイカ	0.2	0.2	281	長谷川香料	0.2	0.3	636	住友理工	0.4	0.4	224
石原産業	0.4	0.4	286	星光PMC	0.1	0.1	65	三ツ星ベルト	0.3	0.3	504
片倉コープアグリ	0.1	0.1	125	荊川化学工業	0.2	0.2	247	バンドー化学	0.4	0.4	241
日本曹達	0.3	0.3	859	メック	0.1	0.1	221	ガラス・土石製品 (1.8%)			
大阪ソーダ	0.2	0.2	513	日本高純度化学	0.1	0.1	258	日東紡績	0.3	0.3	1,290
関東電化	0.5	0.5	361	タカラバイオ	0.5	0.6	1,690	日本板硝子	0.9	1	389
日本カーバイド	0.1	0.1	128	J C U	0.3	0.3	982	日本山村硝子	0.1	0.1	85
堺化学	0.1	0.1	200	新田セラチン	0.1	0.1	69	オハラ	0.1	0.1	125
第一稀元素化学工業	0.2	0.2	143	デクセラアルズ	0.5	0.5	575	日本ヒューム	0.2	0.2	155
日本化学工業	0.1	0.1	236	アース製薬	0.1	0.2	1,380	日本コンクリート	0.4	0.5	155
高圧ガス	0.3	0.3	244	北興化学	0.2	0.2	168	三谷セキサン	0.1	0.1	527
四国化成	0.3	0.3	349	大成ラミック	0.1	0.1	279	アジアパイルHD	0.3	0.3	140
ステラ ケミファ	0.1	0.1	297	クマイ化学	0.8	0.9	941	日本カーボン	0.1	0.1	372
保土谷化学	0.1	0.1	503	日本農薬	0.3	0.4	200	東洋炭素	0.1	0.1	180
大日精化	0.2	0.2	456	アキレス	0.1	0.1	171	ノリタケ	0.1	0.1	315
大阪有機化学	0.2	0.2	511	有沢製作所	0.3	0.3	287	ダントーホールディングス	0.2	0.2	134
K Hネオケム	0.3	0.4	1,052	レック	0.2	0.2	306	M A R U W A	0.1	0.1	975
積水樹脂	0.3	0.4	842	三光合成	0.2	0.2	59	品川リフラクトリーズ	0.1	0.1	245
タキロンシーアイ	0.4	0.5	349	きもと	0.3	0.4	66	ヨータイ	0.2	0.2	159
旭有機材	0.1	0.1	135	藤森工業	0.2	0.2	866	イソライト	0.1	0.1	47
ニチバン	0.1	0.1	166	前澤化成工業	0.1	0.1	98	東京窯業	0.2	0.3	95
リケンテクノス	0.5	0.5	205	未来工業	0.1	0.1	194	ニッカトー	0.1	0.1	70
大倉工業	0.1	0.1	184	ウェーブロックHLDGS	—	0.1	76	フジミインコーポレーテッド	0.2	0.2	775
積水化成製品	0.3	0.3	176	ジェイ エス ビー	0.1	0.1	162	クニミネ工業	0.1	0.1	103
タイガース ポリマー	0.1	0.1	42	エフピコ	0.2	—	—	ニチアス	0.5	0.6	1,463
ミライアル	0.1	0.1	115	天馬	0.1	0.1	185	ニチハ	0.3	0.3	937
ダイキアクシス	0.1	0.1	90	信越ポリマー	0.4	0.4	367	鉄鋼 (0.9%)			
ダイキョーニシカワ	0.4	0.4	252	東リ	0.5	0.5	131	中山製鋼所	0.3	0.3	107
竹本容器	0.1	0.1	106	バルカー	0.2	0.2	369	合同製鐵	0.1	0.1	202
森六ホールディングス	0.1	0.1	184	医薬品 (1.7%)				東京製鐵	1	1	738
カーリットホールディングス	0.2	0.2	102	わかもと製薬	0.2	0.3	77	共英製鋼	0.2	0.2	282
日本精化	0.2	0.2	318	あすか製薬	0.2	0.2	281	東京製鋼	0.1	0.1	179
扶桑化学工業	0.2	0.2	758	扶桑薬品	0.1	0.1	269	大阪製鐵	0.1	0.1	111
新日本理化	0.3	0.3	48	日医工	0.5	0.6	666	淀川製鋼所	0.3	0.3	597
ハリマ化成グループ	0.2	0.2	230	生化学工業	0.4	0.4	400	モリ工業	0.1	0.1	260
第一工業製薬	0.1	0.1	391	栄研化学	0.3	0.4	912	日本高周波	0.1	0.1	35
石原ケミカル	—	0.1	211	日水製薬	0.1	0.1	110	日本冶金工	0.1	0.2	314
日華化学	0.1	0.1	98	鳥居薬品	0.1	0.1	305	山陽特殊製鋼	0.2	0.2	220
三洋化成	0.1	0.1	479	J C Rファーマ	0.1	0.8	2,185	愛知製鋼	0.1	0.1	256
有機合成薬品	0.1	0.2	65	東和薬品	0.3	0.3	605	大平洋金属	0.1	0.1	165
大日本塗料	0.2	0.2	187	富士製薬工業	0.1	0.1	120	新日本電工	1.2	1.4	326
神東塗料	0.1	0.2	34	ゼリア新薬工業	0.4	0.4	754	栗本鉄工所	0.1	0.1	189
中国塗料	0.6	0.6	609	キョーリン製薬HD	—	0.5	1,007	三菱製鋼	0.1	0.2	108
日本特殊塗料	0.1	0.2	197	大幸薬品	0.1	0.3	597	日亜鋼業	0.3	0.3	90
藤倉化成	0.3	0.3	153	ダイト	0.1	0.1	410	エンビプロHD	0.1	0.1	52

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
シニッタン	千株	千株	千円	日進工具	千株	千株	千円	大同工業	千株	千株	千円
非鉄金属 (0.9%)	0.3	0.3	63	バンチ工業	0.1	0.1	218	木村化工機	0.1	0.1	58
大紀アルミニウム	0.3	0.3	179	富士ダイス	0.2	0.2	80	アネスト岩田	0.2	0.2	84
東邦亜鉛	0.1	0.1	199	豊和工業	0.1	0.1	64	サムコ	0.3	0.3	253
古河機金	0.1	0.1	453	OK K	0.1	0.1	82	加藤製作所	0.1	0.1	293
エス・サイエンス	0.3	0.4	41	石川製作所	0.1	0.1	36	フジテック	0.1	0.1	103
大阪チタニウム	0.9	0.9	41	東洋機械金属	—	0.1	165	C K D	0.7	0.8	1,980
東邦チタニウム	0.2	0.2	178	エンシュウ	0.1	0.2	81	キトー	0.5	0.6	1,060
U A C J	0.3	0.4	272	島精機製作所	—	0.1	98	平和	0.1	0.2	257
昭和電線 H L D G S	0.3	0.3	498	オプトラン	0.3	0.3	523	理想科学工業	0.5	0.6	1,026
タツタ電線	0.2	0.2	237	N C ホールディングス	0.2	0.2	444	日本金銭機械	0.2	0.2	271
平河ヒューテック	0.4	0.4	239	イワキポンプ	0.1	0.1	60	マースグループ H L D G S	0.2	0.2	108
リョービ	0.1	0.1	109	フリユー	0.1	0.1	87	フクシマガリレイ	0.1	0.1	165
アーレステイ	0.2	0.2	357	ヤマシンフィルタ	0.2	0.2	272	オーイズミ	0.1	0.1	388
アサヒ H D	0.2	0.3	99	日阪製作所	0.3	0.5	562	ダイコク電機	0.1	0.1	40
金属製品 (1.5%)	0.4	0.4	1,448	やまびこ	0.2	0.3	272	竹内製作所	0.1	0.1	99
稲葉製作所	0.4	0.4	137	平田機工	0.4	0.4	546	J U K I	0.3	0.4	971
宮地エンジニアリング	0.1	0.1	168	ベガスミシン製造	0.1	0.1	661	サンデンホールディングス	0.3	0.3	134
トーカロ	0.2	0.2	659	マルマエ	0.2	0.2	58	蛇の目ミシン	0.2	0.3	94
アルファ C O	0.1	0.1	97	タツモ	0.1	0.1	93	マックス	0.2	0.2	116
R S TECHNOLOGIES	0.1	0.1	363	三井海洋開発	0.1	0.1	164	新晃工業	0.3	0.3	453
信和	—	0.1	67	レオン自動車	0.2	0.2	317	大和冷機工業	0.2	0.2	300
ホッカンホールディングス	0.1	0.1	145	ヤマハモーターロボ H L D G S	0.2	0.2	208	日本ビストンリング	0.3	0.3	279
コロナ	0.1	0.1	101	ホソカワミクロン	—	—	—	リケン	0.1	0.1	102
横河ブリッジ H L D G S	0.1	0.1	101	ユニオンツール	0.1	0.1	524	T P R	0.1	0.1	263
文化シャッター	0.4	0.4	764	オイレス工業	0.1	0.1	312	ツバキ・ナカシマ	0.3	0.3	391
三協立山	0.3	0.3	516	日精エーエスピー	0.3	0.3	447	大豊工業	0.3	0.4	345
アルインコ	0.2	0.2	300	サトーホールディングス	0.1	0.1	420	日本トムソン	0.2	0.2	110
東洋シャッター	0.2	0.2	191	技研製作所	0.6	0.6	661	ユージン精機	0.6	0.6	218
日本フィルコン	—	0.1	74	日本エアーテック	0.2	0.2	790	前澤給装工業	0.2	0.2	141
ノーリツ	0.1	0.2	109	カワタ	0.1	0.1	172	イーグル工業	0.1	0.1	227
長府製作所	0.4	0.4	615	日精樹脂工業	—	0.1	88	前澤工業	0.2	0.3	238
ダイニチ工業	0.2	0.2	431	オカダアイオン	0.1	0.1	177	日本ビラー工業	0.1	0.1	45
日東精工	0.1	0.1	76	ワイエイシイホールディングス	0.1	0.1	103	キッツ	0.2	0.2	307
岡部	0.3	0.3	143	日工	0.1	0.1	67	日立造船	0.8	0.9	522
ジーテクト	0.4	0.4	320	巴工業	0.5	0.3	207	スター精密	1.6	1.7	717
東プレ	0.2	0.3	366	井関農機	0.1	0.1	205	東洋電機製造	0.3	0.3	428
高周波熱錬	0.4	0.4	444	T O W A	0.2	0.2	282	シンフォニアテクノロジー	0.1	0.1	117
東京製綱	0.2	0.2	212	北川鉄工所	0.2	0.2	247	明電舎	0.3	0.3	351
サンコール	0.1	0.1	103	ローツェ	0.1	0.1	139	オリジン	0.4	0.4	634
モリテックスチル	0.1	0.1	41	タカキタ	0.1	0.1	513	山洋電気	0.1	0.1	135
パイオラックス	0.1	0.2	58	荏原実業	0.1	0.1	62	デンヨー	0.1	0.1	465
エイチワン	0.3	0.3	466	三菱化工機	0.1	0.1	316	東芝テック	0.2	0.2	465
立川ブラインド	0.2	0.2	119	月島機械	0.1	0.1	188	ユエムシーエレクトロニクス	0.2	0.3	1,290
三益半導体	0.1	0.1	122	帝国電機製作所	0.4	0.4	509	トックス・セミコンダクター	0.1	0.1	34
機械 (7.0%)	0.2	0.2	477	東京機械	0.1	0.2	219	東光高岳	0.1	0.1	129
日本ドライケミカル	0.1	0.1	141	新東工業	0.1	0.1	28	ダブル・スコープ	0.1	0.1	106
タクマ	0.5	0.5	356	渋谷工業	0.5	0.5	356	宮越ホールディングス	0.3	0.3	235
ツガミ	0.7	0.7	1,139	アイチ コーポレーション	0.2	0.2	664	ダイヘン	0.1	0.1	71
芝浦機械	0.4	0.4	562	小森コーポレーション	0.3	0.4	362	ヤーマン	0.2	0.2	819
アイダエンジニア	0.2	0.2	431	鶴見製作所	0.5	0.5	363	J V C ケンウッド	0.3	0.3	457
滝澤鉄工所	0.2	0.2	470	日本ギア工業	0.2	0.2	351	ミマキエンジニアリング	1.5	1.7	246
F U J I	0.1	0.1	100	西島製作所	—	0.1	29	I - P E X	0.2	0.2	85
牧野フライス	0.8	0.9	1,920	北越工業	0.2	0.2	161	日新電機	0.1	0.1	200
旭ダイヤモンド	0.2	0.2	739	オルガノ	0.2	0.2	210	大崎電気	0.5	0.5	545
ソディック	0.5	0.6	294	トーヨーカネツ	0.1	0.1	569	日東工業	0.4	0.4	248
日東工業	0.4	0.5	386	椿本チエイン	0.4	0.3	226		0.3	0.3	603
	0.1	0.1	203		0.3	0.3	697				

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
I D E C	0.3	0.3	557	岡谷電機	0.1	0.2	72	愛三工業	0.3	0.3	143
メルコホールディングス	0.1	0.1	248	ヘリオステクノH	0.2	0.2	64	日本プラスト	0.2	0.2	85
岩崎通信機	0.1	0.1	83	エノモト	—	0.1	113	ヨロズ	0.2	0.2	225
電気興業	0.1	0.1	257	日本セラミック	0.2	0.2	507	エフ・シー・シー	0.3	0.3	608
サンケン電気	0.2	0.2	544	速藤照明	0.1	0.1	63	ジャムコ	0.1	0.1	65
アイホン	0.1	0.1	147	古河電池	0.1	0.2	209	精密機器 (1.6%)			
ルネサスエレクトロニクス	9.2	—	—	双信電機	0.1	0.1	41	クリエートメディック	0.1	0.1	102
ワコム	1.4	1.4	936	山一電機	0.1	0.2	279	日機装	0.6	0.6	630
アクセル	0.1	0.1	91	図研	0.1	0.1	275	日本エム・ディ・エム	0.1	0.1	212
E I Z O	0.2	0.2	756	日本電子	0.4	0.4	1,432	J M S	0.2	0.2	178
ジャパンディスプレイ	4.6	6.2	316	日本シイエムケイ	0.5	0.5	239	クボテック	—	0.1	31
日本信号	0.5	0.5	495	エンブラス	0.1	0.1	221	長野計器	0.2	0.2	169
京三製作所	0.4	0.5	214	大真空	0.1	0.1	230	ブイ・テクノロジ	0.1	0.1	480
能美防災	0.3	0.3	693	三井ハイテック	0.2	0.2	422	東京計器	0.1	0.1	91
ホーチキ	0.1	0.2	251	新光電気工業	0.7	0.7	1,402	インターアクション	0.1	0.1	175
星和電機	0.1	0.1	62	双葉電子工業	0.3	0.3	274	オーパウル	0.2	0.2	44
エレコム	0.2	0.2	967	北陸電気工業	0.1	0.1	92	東京精密	0.4	0.4	1,462
帝国通信工業	0.1	0.1	111	ニチコン	0.6	0.7	581	マニー	0.9	—	—
タムラ製作所	0.8	0.7	381	日本ケミコン	0.1	0.2	271	理研計器	0.2	0.2	554
池上通信機	0.1	0.1	81	K O A	0.3	0.3	369	タムロン	0.2	0.2	307
日本電波工業	0.2	0.2	85	市光工業	0.3	0.3	144	シード	0.1	0.1	65
鈴木	0.1	0.1	67	ミツバ	0.4	0.4	156	ノーリツ鋼機	0.2	0.2	391
ローランドディー・ジー	0.1	0.1	131	キャノン電子	0.2	0.2	283	エー・アンド・ディ	0.2	0.2	131
フオスター電機	0.2	0.2	249	象印マホービン	0.5	0.6	1,098	リズム	0.1	0.1	63
S M K	0.1	0.1	263	輸送用機器 (1.8%)				大研医器	0.2	0.2	104
ヨコオ	0.1	0.1	259	ユニプレス	0.4	0.4	340	メニコン	0.3	0.3	2,154
ティアック	0.1	0.2	23	モリタホールディングス	0.3	0.4	792	松風	0.1	0.1	139
ホシデン	0.6	0.6	573	三桜工業	0.2	0.3	180	セイコーHD	0.3	0.3	416
日本航空電子	0.4	0.5	755	三井E & S H D	—	0.8	300	その他製品 (2.3%)			
T O A	0.2	0.2	163	名村造船所	0.6	0.7	112	中本バックス	0.1	0.1	161
マクセルホールディングス	0.4	0.5	531	サノヤスホールディングス	0.3	0.3	53	スノーピーク	0.1	0.1	203
古野電気	0.3	0.3	366	日本車輛	0.1	0.1	265	パラマウントベッドHD	0.2	0.2	844
ユニデンホールディングス	0.1	0.1	198	三菱ロジスネクスト	0.2	0.3	288	トランザクション	0.1	0.1	100
スミダコーポレーション	0.2	0.2	175	エフテック	0.1	0.1	53	粧美堂	0.1	0.1	36
アイコム	0.1	0.1	271	レシップホールディングス	0.1	0.1	55	ニホンフラッシュ	0.1	0.2	263
リオン	0.1	0.1	246	武蔵精密工業	0.5	0.5	588	前田工織	0.2	0.2	554
本多通信工業	0.2	0.2	104	日産車体	0.4	0.4	363	永大産業	0.3	0.3	91
船井電機	0.2	0.2	93	新明和工業	0.8	0.6	522	アートネイチャー	0.2	0.2	127
新電元工業	0.1	0.1	195	極東開発工業	0.4	0.4	553	アイフィスジャパン	—	0.1	74
東亜ディーケーケー	0.1	0.1	83	日信工業	0.4	—	—	共立印刷	0.3	0.4	52
チノ	0.1	0.1	133	トビー工業	0.2	0.2	218	S H O E I	0.1	0.2	631
共和電業	0.2	0.2	82	ティラド	0.1	0.1	127	フランスベッドHLDGS	0.3	0.3	266
日本電子材料	0.1	0.1	195	曙ブレーキ	1.1	1.2	176	萩原工業	0.1	0.1	157
小野測器	0.1	0.1	52	タチエス	0.3	0.3	328	トップラン・フォームズ	0.4	0.5	509
エスベック	0.2	0.2	353	フタバ産業	0.6	0.6	330	フジールインターナショナル	0.4	0.5	1,025
日置電機	0.1	0.1	374	K Y B	0.2	0.2	437	タカラトミー	0.8	1	960
日本マイクロニクス	0.3	0.4	434	大同メタル工業	0.3	0.4	212	廣済堂	0.2	0.2	130
メガチップス	0.2	0.2	608	プレス工業	1	1.1	327	エステールホールディングス	0.1	0.1	61
O B A R A G R O U P	0.1	0.1	366	ミクニ	0.2	0.3	78	アーク	0.8	—	—
原田工業	0.1	0.1	87	太平洋工業	0.4	0.4	399	タカノ	0.1	0.1	59
コーセル	0.3	0.3	315	ケービン	0.4	—	—	プロネックス	0.2	0.2	224
イリシ電子工業	0.2	0.2	891	河西工業	0.2	0.3	114	ホクシン	0.1	0.1	11
オプテックスグループ	0.3	0.3	494	今仙電機製作所	0.2	0.2	132	ウッドワン	0.1	0.1	121
千代田インテグレ	0.1	0.1	166	安永	0.1	0.1	118	大建工業	0.1	0.1	187
アイ・オー・データ	0.1	0.1	102	ショーワ	0.5	—	—	共同印刷	0.1	0.1	259
レーザーテック	0.4	—	—	T B K	0.2	0.3	130	N I S S H A	0.4	0.4	520
岩崎電気	0.1	0.1	144	エクセディ	0.3	0.3	392	TAKARA&COMPANY	0.1	0.1	210

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
ツツミ	0.1	0.1	234	キューソー流通システム	—	0.1	172	ヴィンクス	0.1	0.1	130
小松ウオール工業	0.1	0.1	174	近鉄エクスプレス	0.3	0.4	958	S R Aホールディングス	0.1	0.1	237
河合楽器	0.1	0.1	261	東海運	0.1	0.1	31	システムインテグレータ	0.1	0.1	71
クリナップ	0.2	0.2	100	エーアイティー	0.1	0.1	107	朝日ネット	0.2	0.2	204
キングジム	0.2	0.2	177	内外トランスライン	0.1	0.1	123	e B A S E	0.1	0.2	245
イトーキ	0.4	0.5	173	日本コンセプト	0.1	0.1	150	アバント	0.1	0.2	246
三菱鉛筆	0.3	0.4	537	情報・通信業 (12.1%)				アドソル日進	0.1	0.1	267
タカスタンダード	0.4	0.4	575	N E Cネットエスアイ	0.2	0.6	1,209	フリービット	0.1	0.1	101
ナカバヤシ	0.2	0.2	129	クロスキャット	—	0.1	153	コムチュア	0.2	0.2	580
グローブライド	0.1	0.1	335	システナ	0.7	0.7	1,406	アステリア	0.1	0.1	83
オカムラ	0.7	0.7	517	デジタルアーツ	0.1	0.1	804	アイル	—	0.1	146
美津濃	0.2	0.2	369	日鉄ソリューションズ	0.3	0.3	960	マークラインズ	0.1	0.1	252
電気・ガス業 (0.7%)				キューブシステム	0.1	0.1	153	メディカル・データ・ビジ	0.2	0.2	628
沖縄電力	0.4	0.4	637	コア	0.1	0.1	148	g u m i	0.2	0.3	283
エフオン	0.1	0.1	89	ラクーンホールディングス	0.1	0.1	232	モバイルファクトリー	0.1	0.1	121
イーレックス	0.3	0.3	393	ソリトンシステムズ	0.1	0.1	217	テラスカイ	—	0.1	457
レノバ	0.3	0.4	620	ソフトクリエイトHD	0.1	0.1	327	デジタル・インフォメーション	0.1	0.1	152
北海道瓦斯	0.1	0.1	154	J N Sホールディングス	0.1	0.1	67	オーブントピア	0.1	0.1	132
広島ガス	0.4	0.4	150	電算システム	0.1	0.1	393	マイネット	0.1	0.1	121
西部瓦斯	0.2	0.2	525	グリー	1.3	1.4	736	アカツキ	0.1	0.1	486
静岡ガス	0.6	0.6	561	コーエーテックモHD	0.4	0.4	2,092	カナミックネットワーク	—	0.1	89
メタウォーター	0.1	0.2	462	三菱総合研究所	0.1	0.1	427	シンクロ・フード	0.1	0.1	32
陸運業 (1.9%)				A G S	0.1	0.1	96	オークネット	0.1	0.1	151
S B Sホールディングス	0.2	0.2	476	ファインデックス	0.2	0.2	312	AOI TYO HOLDINGS	0.2	0.2	85
富士急行	0.3	0.3	1,312	ブレインパッド	—	0.1	435	マクロミル	0.3	0.4	300
新京成電鉄	—	0.1	215	K L a b	0.3	0.4	382	オロ	—	0.1	362
鴻池運輸	0.3	0.3	343	ホルトクウィン・ピットフル	0.3	0.3	300	ソルクシーズ	0.1	0.1	115
ハマキョウレックス	0.1	0.2	627	アイスタイル	0.5	0.6	243	フェイス	0.1	0.1	97
サカイ引越センター	0.1	0.1	514	エムアップホールディングス	0.1	0.1	292	プロトコボレーション	0.2	0.2	258
山陽電鉄	0.1	0.1	209	エイチーム	0.1	0.1	88	サイバネットシステム	0.2	0.2	191
丸運	0.1	0.1	24	エニグモ	0.2	0.2	318	C Eホールディングス	0.2	0.1	69
丸全昭和運輸	0.1	0.2	674	テクノスジャパン	0.2	0.2	175	インテージホールディングス	0.2	0.3	294
センコーグループHLDGS	1	1.1	1,070	e n i s h	0.1	0.1	54	東邦システムサイエンス	0.1	0.1	93
福山通運	0.2	0.3	1,396	コロブラ	0.5	0.7	642	ソースネクスト	0.8	1	319
エスライン	0.1	0.1	98	オルトプラス	0.1	0.2	95	インフォコム	0.2	0.2	875
日立物流	0.4	0.4	1,362	ブロードリーフ	0.9	1	543	ラクスル	—	0.1	464
丸和運輸機関	0.2	0.2	932	クロス・マーケティングG	0.1	0.1	37	F I G	0.2	0.2	54
C & Fロジホールディングス	0.2	0.2	348	デジタルハーツHLDGS	0.1	0.1	114	イーソル	—	0.1	128
海運業 (0.3%)				システム情報	0.1	0.1	132	アルテリア・ネットワークス	0.2	0.2	359
川崎汽船	—	0.6	801	メディアドゥ	0.1	0.1	851	フォーカスシステムズ	0.1	0.1	97
N Sユニテッド海運	0.1	0.1	147	じげん	0.2	0.5	176	クレスコ	0.1	0.2	261
明治海運	0.2	0.2	79	バイキューブ	0.1	0.1	253	ジャストシステム	0.3	0.3	2,124
飯野海運	0.9	1	381	ディー・エル・イー	0.1	0.2	84	T D Cソフト	0.2	0.2	226
乾汽船	0.2	0.1	91	フィックスターズ	0.2	0.2	210	I Dホールディングス	0.1	0.1	142
倉庫・運輸関連業 (1.0%)				CARTA HOLDINGS	0.1	0.1	135	アルファシステムズ	0.1	0.1	344
トランコム	0.1	0.1	764	オプティム	0.1	0.1	317	フューチャー	0.2	0.3	678
日新	0.2	0.2	310	セレス	0.1	0.1	234	CAC HOLDINGS	0.1	0.1	139
三井倉庫HOLD	0.2	0.2	386	S H I F T	—	0.1	1,686	S Bテクノロジ	0.1	0.1	373
住友倉庫	0.7	0.7	910	ティーガイア	0.1	0.2	389	トーセ	0.1	0.1	87
渋沢倉庫	0.1	0.1	223	日本アジアグループ	0.2	0.2	62	オービックビジネスC	0.2	0.2	1,112
東陽倉庫	0.3	0.4	132	豆蔵ホールディングス	0.1	—	—	アイティフォー	0.2	0.3	274
日本トランスシティ	0.4	0.4	240	テクマトリックス	0.1	0.2	485	サイボウズ	0.2	0.2	660
中央倉庫	0.1	0.1	120	プロシッパ	0.1	0.1	149	ソフトブレーン	0.1	0.1	86
安田倉庫	0.2	0.2	191	ザッパラス	0.1	0.1	42	電通国際情報S	0.1	0.1	673
東洋埠頭	0.1	0.1	149	システムリサーチ	—	0.1	189	A C C E S S	—	0.2	168
宇徳	0.2	0.2	97	インターネットイニシアティブ	0.3	0.3	1,539	デジタルガレージ	0.4	0.4	1,476
キムラユニティー	—	0.1	109	さくらインターネット	0.2	0.2	160	イーエムシステムズ	0.2	0.4	332

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
ウェザーニューズ	0.1	0.1	553	神戸物産	0.3	—	—	内田洋行	0.1	0.1	556
C I J	0.1	0.1	90	あいホールディングス	0.3	0.3	584	第一実業	0.1	0.1	374
日本エンタープライズ	0.2	0.2	52	ディーブイエックス	0.1	0.1	103	西華産業	0.1	0.1	139
WOWOW	0.1	0.1	294	ダイワボウHD	0.2	0.2	1,310	佐藤商事	0.2	0.2	197
スカラ	0.2	0.2	187	マクニカ・富士ELHDGS	0.5	0.5	932	菱洋エレクトロ	0.2	0.2	575
インテリジェントウェイブ	0.1	0.1	78	ラクト・ジャパン	0.1	0.1	359	東京産業	0.2	0.2	111
IMAGICA GROUP	0.2	0.2	76	バイタルKSKHD	0.4	0.4	413	ユアサ商事	0.2	0.2	651
システムソフト	0.5	0.5	51	八洲電機	0.1	0.2	186	神鋼商事	—	0.1	184
アルゴグラフィックス	0.2	0.2	677	メディアスホールディングス	0.1	0.1	89	トルク	0.1	0.1	28
マーベラス	0.3	0.3	238	レスターホールディングス	0.2	0.2	443	正栄食品	0.1	0.1	403
エイベックス	0.3	0.4	441	大光	0.1	0.1	70	カナデン	0.2	0.2	301
日本ユニシス	0.6	—	—	OCHIホールディングス	0.1	0.1	169	菱電商事	0.2	0.2	307
兼松エレクトロニクス	0.1	0.1	429	TOKAIホールディングス	1	1.1	1,183	フルサト工業	0.1	0.1	140
都築電気	—	0.1	170	三洋貿易	0.1	0.2	206	ナイス	0.1	0.1	125
朝日放送グループHD	0.2	0.2	141	ウイン・パートナーズ	0.1	0.2	213	昭光通商	0.1	0.1	61
スカパーJ SATHD	1.2	1.4	637	ミタチ産業	0.1	0.1	62	極東貿易	0.1	0.1	142
テレビ東京HD	0.2	0.2	479	シップヘルスケアHD	0.4	—	—	イフキ	0.2	0.3	162
日本BS放送	0.1	0.1	108	明治電機工業	0.1	0.1	134	三菱石油	0.5	0.5	528
ビジョン	0.3	0.2	195	デリカフーズHLDGS	—	0.1	61	稲畑産業	0.5	0.5	650
スマートパリュウ	—	0.1	112	コメダホールディングス	0.4	0.5	918	G S I クレオス	0.1	0.1	189
USEN-NEXT HLDGS	0.1	0.1	142	富士興産	0.1	0.1	81	明和産業	0.2	0.2	82
ワイヤレスゲート	0.1	0.1	77	小野建	0.2	0.2	234	クワザホールディングス	0.1	0.1	55
コネクシオ	0.1	0.1	121	佐島電機	0.1	0.1	83	ヤマエ久野	—	0.2	236
日本通信	1.7	1.6	344	伯東	0.1	0.1	117	ワキタ	0.4	0.4	420
エムティーアイ	0.2	0.2	185	コンドーテック	0.1	0.2	216	ミツウロコグループ	0.3	0.3	380
GMOインターネット	0.7	0.8	2,400	中山福	0.1	0.1	50	シナネンホールディングス	0.1	0.1	307
ファイバーゲート	—	0.1	245	ナガイレベン	0.3	0.3	796	伊藤忠エネクス	0.4	0.5	488
アйдママーケティングコミュ	—	0.1	42	三菱食品	0.2	0.2	560	サンワ テクノス	0.1	0.1	85
KADOKAWA	0.6	0.6	1,740	松田産業	0.1	0.2	299	リョーサン	0.2	0.2	411
学研ホールディングス	0.1	0.4	609	秋原電気HLDGS	0.1	0.1	221	新光商事	0.4	0.3	261
ゼンリン	0.4	0.4	490	アズワン	0.1	0.1	1,554	トーホー	0.1	0.1	184
昭文社ホールディングス	0.1	0.1	48	スズデン	0.1	0.1	117	三信電気	0.1	0.1	207
インプレスホールディングス	0.2	0.2	36	尾家産業	0.1	0.1	157	東陽テクニカ	0.2	0.2	197
アイネット	0.1	0.1	154	シモジマ	0.1	0.1	140	モスフード サービス	0.3	0.3	845
東映	0.1	0.1	1,674	ドウシシャ	0.2	0.2	402	加賀電子	0.2	0.2	436
D T S	0.4	0.5	1,138	高速	0.1	0.1	155	ソーダニツカ	0.2	0.2	114
シーイーシー	0.2	0.2	329	たけびし	0.1	0.1	155	立花エレテック	0.1	0.2	351
ジャステック	0.1	0.1	151	丸文	0.2	0.2	105	フォーバル	0.1	0.1	92
日本システムウエア	0.1	0.1	207	ハビネット	0.2	0.2	291	PAL TAC	0.3	—	—
アイネス	0.2	0.2	328	日本ライフライン	0.6	0.6	823	三谷産業	0.2	0.3	122
T K C	0.2	0.2	1,388	タカショー	0.1	0.1	69	太平洋興発	0.1	0.1	61
富士ソフト	0.2	0.3	1,734	エクセル	0.1	—	—	国際紙パルプ商事	0.3	0.5	140
N S D	0.3	0.7	1,365	マルカ	0.1	0.1	218	ヤマタネ	0.1	0.1	136
福井コンピュータHLDGS	0.1	0.1	316	I DOM	0.6	0.6	373	日鉄物産	0.1	0.1	312
J B C Cホールディングス	0.2	0.2	321	進和	0.1	0.1	196	泉州電業	0.1	0.1	319
ミロク情報サービス	0.2	0.2	450	ダイترون	0.1	0.1	158	トラスコ中山	0.4	0.4	1,091
卸売業 (8.2%)				シークス	0.2	0.3	383	モリト	0.1	0.2	137
高千穂交易	0.1	0.1	94	田中商事	0.1	0.1	69	加藤産業	0.3	0.3	1,102
伊藤忠食品	—	0.1	539	オーハシテクニカ	0.1	0.1	143	イノテック	0.1	0.1	101
エレマテック	0.2	0.2	197	白銅	0.1	0.1	133	イエローハット	0.4	0.4	725
J A L U X	0.1	0.1	151	蝶理	0.1	0.1	162	J Kホールディングス	0.2	0.2	166
あらた	0.1	0.2	1,020	三共生興	0.3	0.3	132	日伝	0.2	0.2	460
東京エレクトロンデバイス	0.1	0.1	323	兼松	0.8	0.8	1,033	北沢産業	0.2	0.2	56
フィールズ	0.2	0.2	66	日本紙パルプ	0.1	0.1	373	杉本商事	0.1	0.1	189
横浜冷凍	0.5	0.6	517	カメイ	0.2	0.3	324	因幡電機産業	0.3	0.6	1,560
ラサ商事	0.1	0.1	90	スターゼン	0.1	0.1	401	東テック	0.1	0.1	236
アルコニックス	0.2	0.2	308	山善	0.7	0.8	896	アルテック	0.1	0.2	59

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
タキヒヨー	0.1	0.1	183	トーエル	0.1	0.1	81	いなげや	0.2	0.3	557
ジェコス	0.1	0.1	92	クリエイト・レストランツ・ホール	0.5	1.1	651	チヨダ	0.2	0.2	193
グローセル	0.2	0.2	81	サンマルクホールディングス	0.2	0.2	321	ライフコーポレーション	0.1	0.2	772
小売業 (12.3%)				トリドールホールディングス	0.2	0.6	834	リンガーハット	0.2	0.3	666
サンエー	0.1	0.2	867	T O K Y O B A S E	0.2	0.2	73	M r M a x H D	0.3	0.3	222
カワチ薬品	0.1	0.2	573	J Mホールディングス	0.1	0.1	252	テンアライド	0.2	0.2	71
ハードオフコーポレーション	0.1	0.1	67	アレンザホールディングス	0.1	0.1	144	A O K Iホールディングス	0.4	0.4	194
アスクル	0.2	0.2	887	パロックジャパン	0.2	0.2	133	オークワ	0.3	0.3	429
ゲオホールディングス	0.3	0.4	648	グスリのアオキHLDGS	0.2	—	—	コメリ	0.3	0.3	936
アダストリア	0.3	0.3	512	力の源HD	0.1	0.1	62	青山商事	—	0.4	211
ジューソフト	0.1	0.1	46	スシローグローバルHLDGS	0.2	1.1	3,130	はせがわ	0.1	0.1	30
くら寿司	0.1	0.1	628	L I X I Lビバ	0.2	—	—	松屋	0.4	0.4	280
キャンドウ	0.1	0.1	197	メディカルシステムネットワーク	0.2	0.2	93	近鉄百貨店	0.1	0.1	318
パルグループHLDGS	0.1	0.2	231	はるやまHLDGS	0.1	0.1	67	パルコ	0.2	—	—
エディオン	0.8	1	1,075	ノジマ	0.3	0.4	1,129	アクシアリテイリング	0.2	0.2	908
サラーコーポレーション	0.4	0.4	235	カッパ・クリエイト	0.3	0.3	442	井筒屋	0.1	0.1	17
ワッツ	0.1	0.1	79	ライトオン	0.2	0.2	124	平和堂	0.4	0.4	910
ハローズ	0.1	0.1	359	ジーンズメイト	0.1	0.1	41	フジ	0.2	0.3	582
フジオフードG本社	0.1	0.2	284	三城ホールディングス	0.2	0.2	54	ヤオコー	0.2	0.2	1,500
ひらまつ	0.4	0.4	82	アドヴァン	0.3	0.3	404	ゼビオホールディングス	0.2	0.3	219
大黒天物産	—	0.1	550	アルビス	0.1	0.1	261	O L Y M P I Cグループ	0.1	0.1	99
ハニースホールディングス	0.2	0.2	201	コナカ	0.2	0.2	51	日産東京販売HD	0.3	0.3	77
ファーマライズHD	—	0.1	75	G-7ホールディングス	0.1	0.2	484	GENKY DRUGSTORES	0.1	0.1	384
アルペン	0.1	0.2	417	イオン北海道	0.2	0.3	265	総合メディカルHD	0.2	—	—
ハブ	0.1	0.1	62	コジマ	0.3	0.4	272	ブックオフGHD	0.1	0.1	86
ウォールホールディングス	0.3	0.3	350	ヒマラヤ	0.1	0.1	85	元気寿司	0.1	0.1	235
ジンスホールディングス	0.1	0.1	837	コーナン商事	0.3	0.3	1,092	アークランドサカモト	0.3	0.3	678
ビックカメラ	1.1	1.2	1,429	エコス	0.1	0.1	240	グルメ軒屋	0.1	0.1	97
DCMホールディングス	1	1.2	1,752	ワタミ	0.3	0.3	292	愛眼	0.2	0.2	46
ペッパーフードサービス	0.2	0.2	61	マルシェ	0.1	0.1	55	ケユーホールディングス	0.1	0.1	82
東京一番フーズ	—	0.1	56	西松屋チェーン	0.4	0.5	799	松屋フーズHLDGS	0.1	0.1	355
DDホールディングス	—	0.1	68	幸楽苑ホールディングス	0.1	0.1	174	サガミホールディングス	0.3	0.3	385
きちりホールディングス	0.1	0.1	65	サイゼリヤ	0.3	0.3	575	関西スーパーマーケット	0.1	0.2	257
アークランドサービスHD	0.1	0.2	408	V Tホールディングス	0.9	0.9	357	王将フードサービス	0.1	0.2	1,194
ドトール・日レスHD	0.3	0.3	455	魚力	0.1	0.1	166	ブレナス	0.2	0.2	346
ブロンコビリー	0.1	0.1	232	ボブラ	—	0.1	41	ミニストップ	0.1	0.2	282
トレジャー・ファクトリー	0.1	0.1	72	フジ・コーポレーション	—	0.1	241	アークス	0.4	0.4	964
物語コーポレーション	0.1	0.1	1,107	ユナイテッドアローズ	0.2	0.2	289	パローホールディングス	—	0.5	1,309
ココカラファイン	0.2	0.2	1,406	ハイデイ日高	0.3	0.3	509	ベルク	0.1	0.1	673
Hamee	0.1	0.1	222	京都きもの友禅	0.1	0.1	22	大庄	0.1	0.1	119
クリエイトSDH	0.3	0.4	1,386	ピーシーデポコーポ	0.3	0.3	198	サックスパーホールディング	0.2	0.2	113
丸善CHIHD	0.2	0.2	74	壺番屋	0.1	0.1	534	ペルーナ	0.5	0.5	475
チムニー	0.1	0.1	129	トップカルチャー	0.1	0.1	39	銀行業 (3.6%)			
シュッピン	0.1	0.1	93	P L A N T	—	0.1	86	じもとホールディングス	1.3	0.1	99
オイシックス・ラ・大地	—	0.2	701	薬王堂ホールディングス	0.1	0.1	253	東京きらぼしFG	0.3	0.3	347
ネクステージ	0.3	0.3	426	ヴィア・ホールディングス	0.2	0.3	88	富山第一銀行	0.5	0.5	151
ジョイフル本田	0.6	0.6	943	スクロール	0.3	0.3	296	関西西みらいFG	0.9	1.2	512
鳥貴族	0.1	0.1	160	ヨンドシーホールディングス	0.2	0.2	353	33FG	0.2	0.2	268
キリン堂ホールディングス	0.1	0.1	349	木曽路	0.2	0.3	758	武蔵野銀行	—	0.3	480
ホットランド	0.1	0.1	122	S R Sホールディングス	0.2	0.2	179	千葉興業銀行	0.5	0.5	135
SFPホールディングス	0.1	0.1	142	千趣会	0.3	0.4	152	筑波銀行	0.8	0.9	170
綿半ホールディングス	0.1	0.2	277	タカキユー	0.1	0.2	28	青森銀行	0.1	0.2	490
ユナイテッド・スーパーマーケット	0.6	0.6	671	リテールパートナーズ	—	0.3	441	秋田銀行	0.1	0.1	156
ゴルフダイジェスト・オン	0.1	0.1	79	ケーヨー	0.4	0.4	292	山形銀行	0.2	0.2	276
B E E N O S	0.1	0.1	182	上新電機	0.2	0.2	525	岩手銀行	0.1	0.1	247
あさひ	0.2	0.2	357	日本瓦斯	0.3	0.3	1,563	東邦銀行	1.7	1.9	440
日本調剤	0.1	0.2	356	ロイヤルホールディングス	0.3	0.4	728	東北銀行	0.1	0.1	111

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
みちのく銀行	0.1	0.1	126	保険業 (0.2%)				タカラレーベン	0.9	1	309
十六銀行	0.3	0.3	592	アニコムホールディングス	0.2	0.8	974	AVANTIA	0.1	0.1	87
山梨中央銀行	0.2	0.2	171	その他金融業 (1.4%)				毎日コムネット	—	0.1	72
大垣共立銀行	0.4	0.4	938	ジェイリース	—	0.1	82	ファースト住建	0.1	0.1	108
福井銀行	0.2	0.2	373	イントラスト	0.1	0.1	97	ランド	7.8	11.4	102
北國銀行	0.2	0.2	606	Casa	0.1	0.1	128	カチタス	0.2	0.5	1,657
清水銀行	0.1	0.1	178	アルビ	0.2	0.3	579	トーセイ	0.3	0.3	321
南都銀行	0.3	0.3	582	プレミアグループ	0.1	0.1	216	サンフロンティア不動産	0.3	0.3	269
百五銀行	1.7	1.9	628	芙蓉総合リース	0.2	0.2	1,252	エフ・ジェー・ネクスト	0.2	0.2	188
紀陽銀行	—	0.7	1,098	みずほリース	0.4	0.3	832	インテリックス	0.1	0.1	51
山陰合同銀行	—	1.2	656	日本証券金融	0.8	0.9	465	ランドビジネス	0.1	0.1	32
鳥取銀行	0.1	0.1	114	アイフル	—	3.2	918	サンネクスタグループ	—	0.1	102
百十四銀行	0.2	0.2	352	リコーリース	0.2	0.2	562	グランディハウス	0.2	0.2	74
四国銀行	0.3	0.3	222	ジャックス	0.2	0.2	345	サービス業 (9.8%)			
阿波銀行	0.3	0.3	758	オリコ	5.2	5.7	655	明豊ファシリティアークス	—	0.1	60
大分銀行	0.1	0.1	251	アブラスフィナンシャル	0.9	1	78	日本工営	0.1	0.1	274
宮崎銀行	0.1	0.1	236	九州リースサービス	0.1	0.1	61	LIFULL	0.7	0.7	290
佐賀銀行	0.1	0.1	133	イー・ギャランティ	0.2	0.2	456	ミクシィ	—	0.4	1,175
沖縄銀行	0.2	0.2	610	アサックス	0.1	0.1	75	ジェイエイシーリクルートメント	0.1	0.1	138
琉球銀行	0.4	0.5	446	NECキャピタルソリューション	0.1	0.1	187	メンバーズ	0.1	0.1	216
高知銀行	0.1	0.1	75	不動産業 (2.6%)				UTグループ	—	0.2	757
長野銀行	0.1	0.1	141	いちご	2.4	2.7	872	アイティメディア	—	0.1	276
名古屋銀行	0.2	0.2	558	日本駐車場開発	2.1	2.3	303	タケエイ	0.2	0.2	218
北洋銀行	—	3.2	732	スター・マイカ・HLDGS	0.1	0.1	139	ビーネックスグループ	0.2	0.3	356
愛知銀行	0.1	0.1	299	ADワークスグループ	—	0.3	47	コジカホールディングス	0.4	0.5	222
中京銀行	0.1	0.1	216	三栄建築設計	0.1	0.1	185	パソナグループ	0.2	0.2	381
大光銀行	0.1	0.1	130	三重交通グループHD	0.4	0.4	181	CDS	—	0.1	131
愛媛銀行	0.3	0.3	353	サムディ	0.3	0.3	515	リンクアンドモチベーション	0.3	0.4	167
トマト銀行	0.1	0.1	104	ディア・ライフ	0.2	0.3	124	GCA	0.2	0.2	138
京葉銀行	0.8	0.9	440	コーセーアールイー	0.1	0.1	57	エス・エム・エス	0.7	—	—
栃木銀行	1	1	185	エー・ディ・ワークス	5.9	—	—	サニーサイドアップG	—	0.1	67
北日本銀行	0.1	0.1	199	日本商業開発	0.1	0.1	179	リニカル	0.1	0.1	79
東和銀行	0.3	0.4	286	プレサンスコーポレーション	0.3	0.3	446	クックパッド	0.6	0.7	262
福島銀行	0.2	0.2	47	ユニゾホールディングス	0.3	—	—	エスクリ	0.1	0.1	35
大東銀行	0.1	0.1	61	THEグローバル社	0.1	0.1	21	アイ・ケイ・ケイ	0.1	0.1	65
トモニホールディングス	1.5	1.6	531	日本管理センター	0.1	0.1	128	学情	0.1	0.1	115
フィデアホール	1.9	2	218	サンセイランディック	0.1	0.1	76	スタジオアリス	0.1	0.1	195
池田泉州HD	2	2.4	403	フージャースHD	0.4	0.4	261	シミックホールディングス	0.1	0.1	135
証券・商品先物取引業 (0.8%)				ムゲンエステート	0.1	0.1	51	アイロムグループ	0.1	0.1	191
FPG	0.6	0.6	319	ファーストブラザーズ	0.1	0.1	97	セントケア・ホールディング	0.1	0.1	73
マキュリアインベストメント	0.1	0.1	65	ハウスドゥ	0.1	0.1	141	ルネサンス	0.1	0.1	87
日本アジア投資	0.2	0.2	45	シーアールイー	0.1	0.1	133	ディップ	0.3	0.3	660
岡三証券グループ	1.6	1.8	657	ケイアイスター不動産	0.1	0.1	274	デジタルホールディングス	0.1	0.1	142
丸三証券	0.6	0.6	303	バラカ	—	0.1	159	新日本科学	0.3	0.2	141
東洋証券	0.7	0.8	99	平和不動産	0.4	0.4	1,240	ツクイホールディングス	0.4	0.5	274
東海東京HD	—	2.4	684	ダイビル	0.6	0.5	622	キャリアデザインセンター	—	0.1	100
光世証券	—	0.1	70	京阪神ビルディング	0.3	0.3	537	ベネフィット・ワン	0.5	0.7	2,041
水戸証券	0.6	0.6	132	テオオーシー	0.5	0.4	264	ツカダ・グローバルHOLD	0.1	0.1	27
いちよし証券	0.4	0.4	188	レオパレス21	—	2.8	462	アウトソーシング	1	1.2	1,317
だいちこう証券ビジ	0.1	—	—	スターツコーポレーション	0.3	0.3	731	ウェルネット	0.2	0.2	117
マネックスG	1.8	1.6	448	フジ住宅	0.2	0.2	107	ワールドホールディングス	0.1	0.1	221
極東証券	0.3	0.3	219	空港施設	0.2	0.2	95	ぐるなび	0.3	0.4	287
岩井コスモホールディング	0.2	0.2	277	明和地所	0.1	0.1	49	タカミヤ	0.2	0.2	110
監理證券	0.4	0.4	282	ゴールドクレスト	0.2	0.2	271	ジャパンベストレスキューS	0.1	0.1	111
マネーパートナーズGP	0.2	0.2	40	エスリード	0.1	0.1	137	ファンコミュニケーションズ	0.5	0.6	299
スパークス・グループ	0.8	0.7	175	日神グループHLDGS	0.3	0.3	125	ライク	0.1	0.1	212
小林洋行	0.1	0.1	26	日本エスコン	0.3	0.4	394	ビジネス・ブレイクスルー	0.1	0.1	38

銘柄				銘柄				銘柄			
期首		当 期		期首		当 期		期首		当 期	
株数	千株	株数	千株	株数	千株	株数	千株	株数	千株	株数	千株
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			
千円				千円				千円			

■投資信託財産の構成

2020年10月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	499,112	96.6
コール・ローン等、その他	17,702	3.4
投資信託財産総額	516,815	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

2020年10月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	516,781,042円
コール・ローン等	10,256,822
株式(評価額)	499,112,700
未収入金	3,520,010
未収配当金	3,263,010
差入委託証拠金	628,500
(B) 負債	－
(C) 純資産総額(A－B)	516,781,042
元本	518,111,718
次期繰越損益金	△ 1,330,676
(D) 受益権総口数	518,111,718口
1万口当り基準価額(C／D)	9,974円

* 期首における元本額は504,949,161円、当作成期間中における追加設定元本額は40,326,640円、同解約元本額は27,164,083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518,111,718円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,974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1,330,676円です。

■損益の状況

当期 自2019年10月19日 至2020年10月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	10,141,465円
受取配当金	10,143,915
受取利息	32
その他収益金	1,348
支払利息	△ 3,830
(B) 有価証券売買損益	13,593,129
売買益	66,649,694
売買損	△53,056,565
(C) 先物取引等損益	△ 393,730
取引益	3,942,910
取引損	△ 4,336,640
(D) その他費用	△ 67
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	23,340,797
(F) 前期繰越損益金	△23,443,916
(G) 解約差損益金	2,141,083
(H) 追加信託差損益金	△ 3,368,640
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	△ 1,330,676
次期繰越損益金(I)	△ 1,330,676

(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。