

iFreeNEXT 日本小型株 インデックス

運用報告書（全体版） 繰上償還

（償還日 2021年6月11日）

（作成対象期間 2020年10月20日～2021年6月11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、信託期間中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、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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した。

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)	Small 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)	税込み 分配金	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
償還(2021年6月11日)	10,717.54	—	8.4	10,511	10.4	—	—	568

(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。

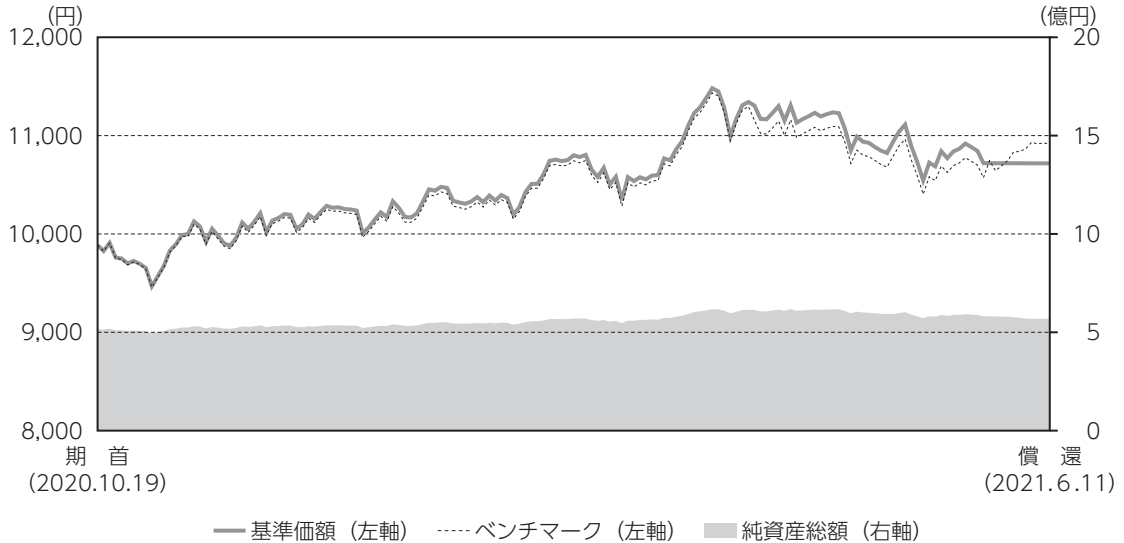
(注4) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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。

*ベンチマークはTOPIX Smallです。

■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：10,717円54銭（既払分配金0円）

騰落率：7.2%

■基準価額の主な変動要因

ベンチマーク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「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X (ベンチマーク)	S m a l l		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) 2020年10月19日	円 9,886	% -	9,522	% -	% 96.6	% 2.8	
10月末	9,467	△ 4.2	9,110	△ 4.3	96.5	3.5	
11月末	10,019	1.3	9,618	1.0	95.9	4.0	
12月末	10,265	3.8	9,835	3.3	96.0	4.0	
2021年 1 月末	10,195	3.1	9,777	2.7	97.3	2.3	
2 月末	10,342	4.6	9,904	4.0	97.3	2.4	
3 月末	11,170	13.0	10,617	11.5	94.2	5.5	
4 月末	10,823	9.5	10,287	8.0	93.8	6.1	
5 月末	10,719	8.4	10,251	7.7	-	-	
(償還) 2021年 6 月11日	10,717.54	8.4	10,511	10.4	-	-	

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2018.10.19~2021.6.11)

■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、当ファンド設定時より、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。2019年に入ると、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って通商協議の進展期待が高まり、株価は反発しました。さらに2019年の後半には、米中通商協議が部分合意に達したことが好材料となり、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て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、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、株価は上昇基調で推移しました。その後は、国内外の感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場展開となりましたが、11月に入ると、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数のワクチンが承認されて接種が始まったことが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月は米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大統領府および上下両院共に民主党が制したことで大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には米国の追加経済対策が発表されたことで同国の景気回復期待が高まったことが好感され、株価は強含みで推移しました。4月からは、国内の感染状況が悪化して再び緊急事態宣言が発出されたことや、米国においてインフレ懸念が高まったことが嫌気され、株価は下落したものの、5月中旬以降は、インフレ懸念の一服や国内でワクチンの高齢者向け大規模接種が開始されたことが好感され、株価は反発しました。

信託期間中の運用方針

■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

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運用を行います。

信託期間中のポートフォリオについて

(2018.10.19~2021.6.11)

■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。

2021年6月10日に繰上償還を迎えるため、2021年5月にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は株式の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

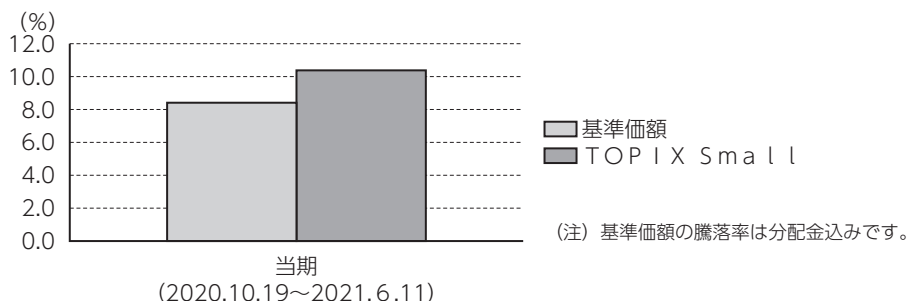
組入ファンド	ベンチマーク
日本小型株インデックス・マザーファンド	TOPIX Small

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は10.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は8.4%となりました。

- ・当ファンドが組み入れているマザー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ため、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）等のコストに加え、2021年5月に安定運用に切替えたことがかい離の要因として挙げられます。

以下のグラフは、当作成期における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。



*ベンチマークはTOPIX Smallです。

分配金について

信託期間中は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を行いませんでした。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020.10.20~2021.6.11)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	30円	0.283%	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10,545円です。
(投 信 会 社)	(14)	(0.134)	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)	(14)	(0.134)	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)	(1)	(0.014)	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	0.003	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)	(0.001)	
(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	0	0.003	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)	(0)	(0.003)	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	30	0.288	

(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。

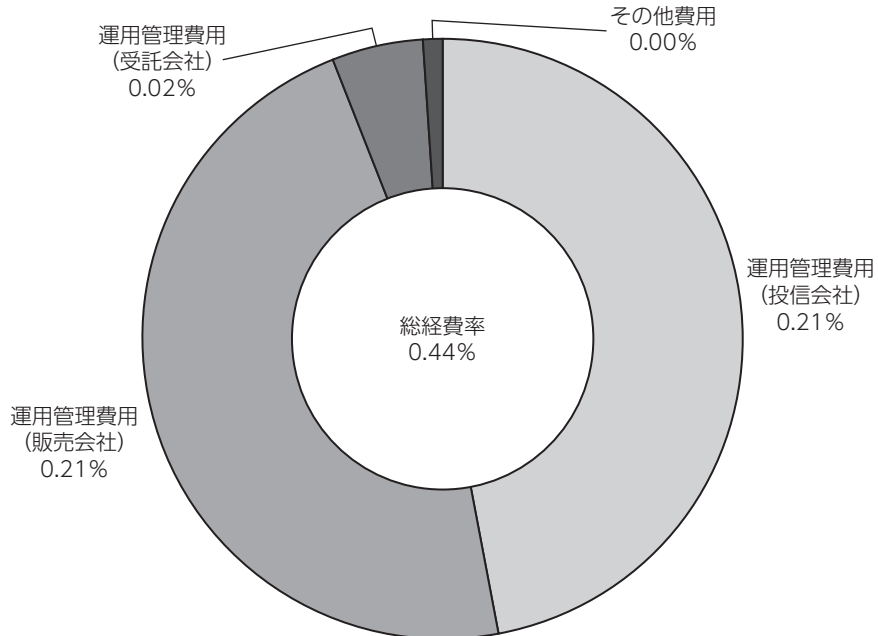
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2020年10月20日から2021年6月11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	42,756	46,396	560,867	607,764

(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

(2020年10月20日から2021年6月11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	651,353千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	525,941千円
(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

(2020年10月20日から2021年6月11日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 58	百万円 1	% 2.9	百万円 592	百万円 0	% 0.1
株式先物取引	77	77	100.0	95	95	100.0
コール・ローン	8,220	-	-	-	-	-

(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

(2020年10月20日から2021年6月11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
株式	百万円 -	百万円 0	百万円 -

(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

(2020年10月20日から2021年6月11日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	14千円
うち利害関係人への支払額 (B)	12千円
(B)÷(A)	85.1%

(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、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 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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	期 首
	口 数
日本小型株インデックス・マザーファンド	千口 518,111

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年6月11日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 568,781	% 100.0
投資信託財産総額	568,781	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

2021年6月11日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	568,781,476円
コール・ローン等	568,781,476
(B) 負債	583,299
未払解約金	199,737
未払信託報酬	382,497
未払利息	1,065
(C) 純資産総額(A - B)	568,198,177
元本	530,157,069
償還差損益金	38,041,108
(D) 受益権総口数	530,157,069口
1万口当り償還価額(C / D)	10,717円54銭

* 期首における元本額は522,738,215円、当作成期間中における追加設定元本額は57,164,153円、同解約元本額は49,745,299円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は10,717円54銭です。

■損益の状況

当期 自2020年10月20日 至2021年6月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,099円
支払利息	△ 1,099
(B) 有価証券売買損益	41,129,564
売買益	44,628,482
売買損	△ 3,498,918
(C) 信託報酬等	△ 1,611,074
(D) 当期損益金(A + B + C)	39,517,391
(E) 前期繰越損益金	1,084,365
(F) 追加信託差損益金	△ 2,560,648
(配当等相当額)	(122,565)
(売買損益相当額)	(△ 2,683,213)
(G) 合計(D + E + F)	38,041,108
償還差損益金(G)	38,041,108

(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。

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2018年10月19日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年6月11日		資産総額	568,781,476円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	583,299円
				純資産総額	568,198,177円
受益権口数	500,000,000口	530,157,069口	30,157,069口	受益権口数	530,157,069口
元本額	500,000,000円	530,157,069円	30,157,069円	1単位当り償還金	10,717円54銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1単位当り分配金	
				金額	分配率
第1期	円 507,187,820	円 481,548,390	円 9,494	円 0	% 0.00
第2期	522,738,215	516,795,280	9,886	0	0.00

(注) 1単位は受益権1万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	10,717円54銭

日本小型株インデックス・マザーファンド

運用報告書 繰上償還（償還日 2021年6月10日）

（作成対象期間 2020年10月20日～2021年6月10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した。

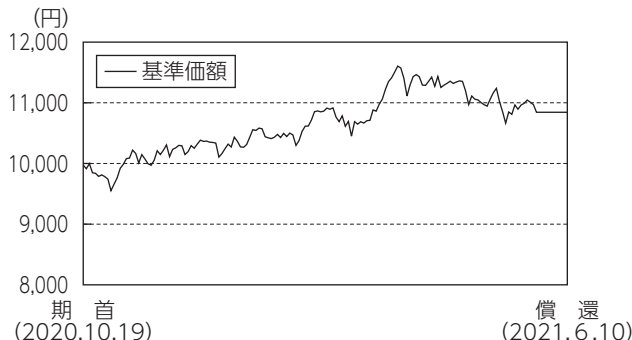
運用方針	投資成果を日本の小型株市場の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）および国内株式を対象とした株価指数先物取引
株式組入制限	無制限

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		株 式 先 物 比 率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %	組 入 比 率 %	%	
(期首)2020年10月19日	9,974	-	9,522	-	96.6	2.9	
10月末	9,552	△ 4.2	9,110	△ 4.3	96.5	3.5	
11月末	10,113	1.4	9,618	1.0	95.9	4.0	
12月末	10,365	3.9	9,835	3.3	96.0	4.0	
2021年1月末	10,298	3.2	9,777	2.7	97.3	2.3	
2月末	10,450	4.8	9,904	4.0	97.3	2.4	
3月末	11,292	13.2	10,617	11.5	94.2	5.5	
4月末	10,945	9.7	10,287	8.0	93.8	6.1	
5月末	10,844	8.7	10,251	7.7	-	-	
(償還)2021年6月10日	10,843.77	8.7	10,524	10.5	-	-	

(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】

設定時：10,000円 償還時：10,843円77銭 騰落率：8.4%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの運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「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

◆設定以来の投資環境について

○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、当ファンド設定時より、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったFRB（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。2019年に入ると、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閣僚級協議などによって通商協議の進展期待が高まり、株価は反発しました。さらに2019年の後半には、米中通商協議が部分合意に達したことが好材料となり、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て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、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、株価は上昇基調で推移しました。その後は、国内外の感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場展開となりましたが、11月に入ると、米大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数のワクチンが承認されて接種が始まったことが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月は米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大統領府および上下両院共に民主党が制したことなどで大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には米国の追加経済対策が発表されたことで同国の景気回復期待が高まったことが好感され、株価は強含みで推移しました。4月からは、国内の感染状況が悪化して再び緊急事態宣言が発出されたことや、米国においてインフレ懸念が高まったことが嫌気され、株価は下落したものの、5月中旬以降は、インフレ懸念の一服や国内でワクチンの高齢者向け大規模接種が開始されたことが好感され、株価は反発しました。

◆信託期間中の運用方針

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運動をめざして運用を行います。

◆信託期間中の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、時価総額加重ウェイトに基づきポートフォリオを構築しました。

2021年6月10日に繰上償還を迎えるため、2021年5月にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は株式の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は10.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は8.7%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ため、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、売買コスト等に加え、2021年5月に安定運用に切替えたことがかい離の要因として挙げられます。

■ 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しております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

(2020年10月20日から2021年6月10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	50.7 (5.33)	58,589 (-)	463.03	592,763

(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。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2020年10月20日から2021年6月10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 77	百万円 95	百万円 -	百万円 -
株式先物取引				

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄
株 式

(2020年10月20日から2021年6月10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
Sansan		0.2	1,873	9,365	バイカレントコンサルティング		0.1	3,235	32,350
チェンジ		0.2	1,648	8,240	FOOD&LIFE COMPAN		1.1	3,204	2,913
ラクス		0.7	1,621	2,317	新光電気工業		0.8	2,748	3,435
奥村組		0.4	993	2,484	KADOKAWA		0.6	2,538	4,230
不二越		0.2	844	4,220	ショーボンドHD		0.5	2,535	5,070
阪和興業		0.4	826	2,067	アウトソーシング		1.2	2,424	2,020
シチズン時計		2.9	818	282	GMOインターネット		0.8	2,275	2,844
第四北越フィナンシャルG		0.4	800	2,000	東映		0.1	2,222	22,220
フジクラ		2.7	786	291	JCRファーマ		0.8	2,218	2,773
トリケミカル		0.2	780	3,900	メニコン		0.3	2,205	7,350

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

国内株式

銘柄	株数	首数	銘柄	株数	首数	銘柄	株数	首数
		千株			千株			千株
水産・農林業			世紀東急		0.3	伊藤ハム米久HLDGS		1.4
極洋		0.1	福田組		0.1	オエノンホールディングス		0.6
カネコ種苗		0.1	日本基礎技術		0.2	養命酒		0.1
サカタのタネ		0.3	巴コーポレーション		0.3	ダイドーグループHD		0.1
ホクト		0.2	ライト工業		0.4	キーコーヒー		0.2
鉱業			日特建設		0.2	ユニカフェ		0.1
住石ホールディングス		0.6	北陸電気工事		0.1	日清オイリオグループ		0.3
日鉄鉱業		0.1	ユアテック		0.4	J-オイルミルズ		0.1
三井松島HLDGS		0.1	日本リーテック		0.1	焼津水産化工		0.1
石油資源開発		0.4	中電工		0.3	エバラ食品工業		0.1
K&Oエナジーグループ		0.1	関電工		0.9	イートアンドHLDGS		0.1
建設業			東京エネシス		0.2	ヨシムラ・フード・HLDGS		0.1
ヒノキヤグループ		0.1	トーエネック		0.1	永谷園ホールディングス		0.1
ショーボンドHD		0.5	住友電設		0.2	一正蒲鉾		0.1
ミライト・ホールディングス		0.9	日本電設工業		0.4	フジッコ		0.2
タマホーム		0.2	新日本空調		0.2	ロックフィールド		0.2
日本アクア		0.1	三機工業		0.5	ケンコーマヨネーズ		0.1
ファーストコーポレーション		0.1	中外炉工業		0.1	わらべや日洋HD		0.1
ベステラ		0.1	ヤマト		0.2	なとり		0.1
ROBOT HOME		0.6	太平電業		0.2	北の達人コーポ		0.7
スペースバリューHD		0.4	高砂熱学		0.6	ユーグレナ		0.9
ダイセキ環境ソリューション		0.1	明星工業		0.4	ミヨシ油脂		0.1
安藤・間		1.7	大気社		0.3	理研ビタミン		0.2
東急建設		0.8	ダイダン		0.2	繊維製品		
ピーアールホールディングス		0.3	日比谷総合設備		0.2	片倉工業		0.3
高松コンストラクションGP		0.2	OSJBHD		1.1	グンゼ		0.2
東建コーポレーション		0.1	東洋エンジニア		0.3	ユニチカ		0.6
ヤマウラ		0.1	レイズネクスト		0.4	富士紡ホールディングス		0.1
飛鳥建設		0.2	食料品			倉敷紡績		0.2
松井建設		0.3	ニッポン		0.6	シキボウ		0.1
不動テトラ		0.2	昭和産業		0.2	日本毛織		0.7
大末建設		0.1	鳥越製粉		0.2	ダイトウボウ		0.3
鉄建建設		0.1	中部飼料		0.3	トーア紡コーポレーション		0.1
大豊建設		0.2	フィード・ワン		0.2	ダイドーリミテッド		0.3
佐田建設		0.1	日本甜菜糖		0.1	帝国繊維		0.2
ナカノフード建設		0.2	DM三井製糖ホールディ		0.2	サカイオーベックス		0.1
東鉄工業		0.3	塩水港精糖		0.2	住江織物		0.1
富士ビー・エス		0.1	日新製糖		0.1	日本フェルト		0.1
浅沼組		0.1	中村屋		0.1	アツギ		0.2
熊谷組		0.3	名糖産業		0.1	ダイニック		0.1
矢作建設		0.3	井村屋グループ		0.1	セーレン		0.5
ピーエス三菱		0.2	不二家		0.1	ソトー		0.1
日本ハウスHLDGS		0.5	亀田製菓		0.1	小松マテーレ		0.3
新日本建設		0.3	寿スピリッツ		0.2	ホギメディカル		0.2
NIPPO		0.6	六甲バター		0.1	クラウディアHLDGS		0.1
日本道路		0.1	プリマハム		0.3	T S Iホールディングス		0.7
東亜建設		0.2	林兼産業		0.1	マツオカコーポレーション		0.1
日本国土開発		0.5	丸大食品		0.2	ワールド		0.3
若築建設		0.1	S Foods		0.2	三陽商会		0.1
東洋建設		0.7	柿安本店		0.1	ナイガイ		0.1

銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数
		千株			千株			千株
オンワードホールディングス		1.3	ハリマ化成グループ		0.2	生化学工業		0.4
ルックホールディングス		0.1	第一工業製薬		0.1	栄研化学		0.4
キムラタン		1.1	石原ケミカル		0.1	日水製薬		0.1
デサント		0.4	日華化学		0.1	鳥居薬品		0.1
キング		0.1	三洋化成		0.1	JCRファーマ		0.8
ヤマトインターナショナル		0.1	有機合成薬品		0.2	東和薬品		0.3
パルプ・紙			大日本塗料		0.2	富士製薬工業		0.1
特種東海製紙		0.1	神東塗料		0.2	ゼリア新薬工業		0.4
三菱製紙		0.3	中国塗料		0.6	キョーリン製薬HD		0.5
北越コーポレーション		1.4	日本特殊塗料		0.2	大幸薬品		0.3
中越パルプ		0.1	藤倉化成		0.3	ダイト		0.1
巴川製紙		0.1	太陽ホールディングス		0.2	石油・石炭製品		
大王製紙		0.9	サカタインクス		0.5	日本コークス工業		1.8
阿波製紙		0.1	東洋インキS Cホールディン		0.4	ニチレキ		0.3
トーモク		0.1	T & K TOKA		0.2	ユシロ化学		0.1
ザ・パック		0.2	高砂香料		0.1	ビービー・カストロール		0.1
化学			マンダム		0.5	富士石油		0.6
共和レザー		0.1	ミルボン		0.3	MORESCO		0.1
住友精化		0.1	コタ		0.1	ゴム製品		
ラサ工業		0.1	ノエビアホールディングス		0.2	藤倉コンポジット		0.2
フレハ		0.2	エステー		0.1	オカモト		0.1
多木化学		0.1	アグロカネショウ		0.1	フコク		0.1
テイカ		0.2	コニシ		0.3	ニッタ		0.2
石原産業		0.4	長谷川香料		0.3	住友理工		0.4
片倉コープアグリ		0.1	星光PMC		0.1	三ツ星ベルト		0.3
日本曹達		0.3	荒川化学工業		0.2	バンドー化学		0.4
大阪ソーダ		0.2	メック		0.1	ガラス・土石製品		
関東電化		0.5	日本高純度化学		0.1	日東紡績		0.3
日本カーバイド		0.1	タカラパイオ		0.6	日本板硝子		1
堺化学		0.1	JCU		0.3	日本山村硝子		0.1
第一稀元素化学工		0.2	新田ゼラチン		0.1	オハラ		0.1
日本化学工業		0.1	デクセリアルズ		0.5	日本ヒューム		0.2
高圧ガス		0.3	アース製薬		0.2	日本コンクリート		0.5
四国化成		0.3	北興化学		0.2	三谷セキサン		0.1
ステラケミファ		0.1	大成ラミック		0.1	アジアパイルHD		0.3
保土谷化学		0.1	クミアイ化学		0.9	日本カーボン		0.1
大日精化		0.2	日本農薬		0.4	東洋炭素		0.1
大阪有機化学		0.2	アキレス		0.1	ノリタケ		0.1
KHネオケム		0.4	有沢製作所		0.3	ダントーホールディングス		0.2
積水樹脂		0.4	レック		0.2	MARUWA		0.1
タキロンシーアイ		0.5	三光合成		0.2	品川リフラクトリーズ		0.1
旭有機材		0.1	きもと		0.4	ヨータイ		0.2
ニチパン		0.1	藤森工業		0.2	イソライト		0.1
リケンテクノス		0.5	前澤化成工業		0.1	東京薬業		0.3
大倉工業		0.1	未来工業		0.1	ニッカトー		0.1
積水化成品		0.3	ウェーブロックHLDGS		0.1	フジミンコーポレーテッド		0.2
タイガース ポリマー		0.1	ジェイ エス ピー		0.1	クニミネ工業		0.1
ミライアル		0.1	天馬		0.1	ニチアス		0.6
ダイキアクシス		0.1	信越ポリマー		0.4	ニチハ		0.3
ダイキョーニシカワ		0.4	東リ		0.5	鉄鋼		
竹本容器		0.1	バルカー		0.2	中山製鋼所		0.3
森六ホールディングス		0.1	医薬品			合同製鐵		0.1
カーリットホールディングス		0.2	わかもと製薬		0.3	東京製鐵		1
日本精化		0.2	あすか製薬		0.2	共英製鋼		0.2
扶桑化学工業		0.2	扶桑薬品		0.1	東京製鋼		0.1
新日本理化		0.3	日医工		0.6	大阪製鐵		0.1

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首	銘柄	株数	期首	銘柄	株数	期首
	千株			千株			千株	
淀川製鋼所	0.3		三益半導体	0.2		帝国電機製作所	0.2	
モリ工業	0.1		機械			東京機械	0.1	
日本高周波	0.1		日本ドライケミカル	0.1		新東工業	0.5	
日本冶金工	0.2		タクマ	0.7		渋谷工業	0.2	
山陽特殊製鋼	0.2		ツガミ	0.4		アイチ コーポレーション	0.4	
愛知製鋼	0.1		芝浦機械	0.2		小森コーポレーション	0.5	
大平洋金属	0.1		アイダエンジニア	0.6		鶴見製作所	0.2	
新日本電工	1.4		滝澤鉄工所	0.1		日本ギア工業	0.1	
栗本鉄工所	0.1		F U J I	0.9		西島製作所	0.2	
三菱製鋼	0.2		牧野フライス	0.2		北越工業	0.2	
日亜鋼業	0.3		旭ダイヤモンド	0.6		オルガン	0.1	
エンビプロHD	0.1		ソディック	0.5		トーヨーカネツ	0.1	
シンニッタン	0.3		日東工器	0.1		椿本チエイン	0.3	
非鉄金属			日進工具	0.1		大同工業	0.1	
大紀アルミニウム	0.3		パンチ工業	0.2		木村化工機	0.2	
東邦亜鉛	0.1		富士ダイス	0.1		アネスト岩田	0.3	
古河機金	0.4		豊和工業	0.1		サムコ	0.1	
エス・サイエンス	0.9		〇K K	0.1		加藤製作所	0.1	
大阪チタニウム	0.2		石川製作所	0.1		フジテック	0.8	
東邦チタニウム	0.4		東洋機械金属	0.2		C K D	0.6	
U A C J	0.3		エンシュウ	0.1		キトー	0.2	
昭和電線H L D G S	0.2		島精機製作所	0.3		平和	0.6	
タツタ電線	0.4		オプトラン	0.2		理想科学工業	0.2	
平河ヒューテック	0.1		N C ホールディングス	0.1		日本金銭機械	0.2	
リョービ	0.3		イワキポンプ	0.1		マースグループH L D G S	0.1	
アーレステイ	0.3		フリュー	0.2		フクシマガリレイ	0.1	
アサヒHD	0.4		ヤマシンフィルタ	0.5		オーイズミ	0.1	
金属製品			日阪製作所	0.3		ダイコク電機	0.1	
稲葉製作所	0.1		やまびこ	0.4		竹内製作所	0.4	
宮地エンジニアリングG	0.1		平田機工	0.1		J U K I	0.3	
トーカロ	0.6		ペガサスミシン製造	0.2		サンデンホールディングス	0.3	
アルファCO	0.1		マルマエ	0.1		蛇の目ミシン	0.2	
R S T E C H N O L O G I E S	0.1		タツモ	0.1		マックス	0.3	
信和	0.1		三井海洋開発	0.2		新晃工業	0.2	
ホッカンホールディングス	0.1		レオン自動機	0.2		大和冷機工業	0.3	
コロナ	0.1		ホソカワミクロン	0.1		日本ピストンリング	0.1	
横河ブリッジH L D G S	0.4		ユニオンツール	0.1		リケン	0.1	
文化シャッター	0.6		オイレス工業	0.3		T P R	0.3	
三協立山	0.3		日精エーエスビー	0.1		ツバキ・ナカシマ	0.4	
アルインコ	0.2		サトーホールディングス	0.3		大豊工業	0.2	
東洋シャッター	0.1		技研製作所	0.2		日本トムソン	0.6	
日本ファイルコン	0.2		日本エアーテック	0.1		ユージン精機	0.2	
ノーリツ	0.4		カワタ	0.1		前澤給装工業	0.1	
長府製作所	0.2		日精樹脂工業	0.2		イーグル工業	0.3	
ダイニチ工業	0.1		オカダアイヨン	0.1		前澤工業	0.1	
日東精工	0.3		ワイエイシイホールディングス	0.1		日本ビラー工業	0.2	
岡部	0.4		日工	0.3		キッツ	0.9	
ジーテクト	0.3		巴工業	0.1		日立造船	1.7	
東プレ	0.4		井関農機	0.2		スター精密	0.3	
高周波熱練	0.4		T O W A	0.2		電気機器		
東京製綱	0.2		北川鉄工所	0.1		東洋電機製造	0.1	
サンコール	0.1		ローツェ	0.1		シンフォニア テクノロジー	0.3	
モリテックスチル	0.2		タカキタ	0.1		明電舎	0.4	
パイオラックス	0.3		荏原実業	0.1		オリジン	0.1	
エイチワン	0.2		三菱化工機	0.1		山洋電気	0.1	
立川プラインド	0.1		月島機械	0.4		デンヨー	0.2	

銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数
		千株			千株			千株
東芝テック		0.3	小野測器		0.1	フタバ産業		0.6
ユーエムシーエレクトロニクス		0.1	エスベック		0.2	K Y B		0.2
トレックス・セミコンダクター		0.1	日置電機		0.1	大同メタル工業		0.4
東光高岳		0.1	日本マイクロニクス		0.4	プレス工業		1.1
ダブル・スコープ		0.3	メガチップス		0.2	ミクニ		0.3
宮越ホールディングス		0.1	OBARA GROUP		0.1	太平洋工業		0.4
ダイヘン		0.2	原田工業		0.1	河西工業		0.3
ヤーマン		0.3	コーセル		0.3	今仙電機製作所		0.2
JVCケンウッド		1.7	イリソ電子工業		0.2	安永		0.1
ミマキエンジニアリング		0.2	オプテックスグループ		0.3	T B K		0.3
イー P E X		0.1	千代田インテグレ		0.1	エクセディ		0.3
日新電機		0.5	アイ・オー・データ		0.1	愛三工業		0.3
大崎電気		0.4	岩崎電気		0.1	日本プラスト		0.2
日東工業		0.3	岡谷電機		0.2	ヨロズ		0.2
I D E C		0.3	ヘリオステクノH		0.2	エフ・シー・シー		0.3
メルコホールディングス		0.1	エノモト		0.1	ジャムコ		0.1
岩崎通信機		0.1	日本セラミック		0.2	精密機器		
電気興業		0.1	遠藤照明		0.1	クリートメディック		0.1
サンケン電気		0.2	古河電池		0.2	日機装		0.6
アイホン		0.1	双信電機		0.1	日本エム・ディ・エム		0.1
ワコム		1.4	山一電機		0.2	J M S		0.2
アグセル		0.1	図研		0.1	クボテック		0.1
E I Z O		0.2	日本電子		0.4	長野計器		0.2
ジャパンディスプレイ		6.2	日本シイエムケイ		0.5	ブイ・テクノロジー		0.1
日本信号		0.5	エンプラス		0.1	東京計器		0.1
京三製作所		0.5	大真空		0.1	インターアクション		0.1
能美防災		0.3	三井ハイテック		0.2	オーバル		0.2
ホーチキ		0.2	新光電気工業		0.7	東京精密		0.4
星和電機		0.1	双葉電子工業		0.3	理研計器		0.2
エレコム		0.2	北陸電気工業		0.1	タムロン		0.2
帝国通信工業		0.1	ニチコン		0.7	シード		0.1
タムラ製作所		0.7	日本ケミコン		0.2	ノーリツ鋼機		0.2
池上通信機		0.1	K O A		0.3	エー・アンド・ディ		0.2
日本電波工業		0.2	市光工業		0.3	リズム		0.1
鈴木		0.1	ミツバ		0.4	大研医器		0.2
ローランド ディー.ジー.		0.1	キャノン電子		0.2	メニコン		0.3
フオスター電機		0.2	象印マホービン		0.6	松風		0.1
SMK		0.1	輸送用機器			セイコーHD		0.3
ヨコオ		0.1	ユニプレス		0.4	その他製品		
ティアック		0.2	モリタホールディングス		0.4	中本パックス		0.1
ホシデン		0.6	三桜工業		0.3	スノーピーク		0.1
日本航空電子		0.5	三井 E & S HD		0.8	パラマウントベッドHD		0.2
T O A		0.2	名村造船所		0.7	トランザクシオン		0.1
マクセルホールディングス		0.5	サノヤスホールディングス		0.3	粧美堂		0.1
古野電気		0.3	日本車輛		0.1	ニホンフラッシュ		0.2
ユニデンホールディングス		0.1	三菱ロジスネクスト		0.3	前田工業		0.2
スマダコーポレーション		0.2	エフテック		0.1	永大産業		0.3
アイコム		0.1	レシップホールディングス		0.1	アートネイチャー		0.2
リオン		0.1	武蔵精密工業		0.5	アイフィスジャパン		0.1
本多通信工業		0.2	日産車体		0.4	共立印刷		0.4
船井電機		0.2	新明和工業		0.6	S H O E I		0.2
新電元工業		0.1	極東開発工業		0.4	フランスベッドH L D G S		0.3
東亜ディーケーケー		0.1	トビー工業		0.2	萩原工業		0.1
チノー		0.1	ティラド		0.1	トッパン・フォームズ		0.5
共和電業		0.2	曙ブレーキ		1.2	フジシールインターナショナル		0.5
日本電子材料		0.1	タチエス		0.3	タカラトミー		1

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数
		千株			千株			千株
廣済堂		0.2	日新		0.2	オプティム		0.1
エステールホールディングス		0.1	三井倉庫HOLD		0.2	セレス		0.1
タカノ		0.1	住友倉庫		0.7	SHIFT		0.1
プロネクサス		0.2	渋沢倉庫		0.1	ティーガイア		0.2
ホクシン		0.1	東陽倉庫		0.4	日本アジアグループ		0.2
ウッドワン		0.1	日本トランスシティ		0.4	テクマトリックス		0.2
大建工業		0.1	中央倉庫		0.1	プロシップ		0.1
共同印刷		0.1	安田倉庫		0.2	ザッパラス		0.1
N I S S H A		0.4	東洋埠頭		0.1	システムリサーチ		0.1
TAKARA&COMPANY		0.1	宇徳		0.2	インターネットイニシアティブ		0.3
ツツミ		0.1	キムラユニティー		0.1	さくらインターネット		0.2
小松ウオール工業		0.1	キューソー流通システム		0.1	ヴァンクス		0.1
河合楽器		0.1	近鉄エクスプレス		0.4	S R Aホールディングス		0.1
グリナップ		0.2	東海運		0.1	システムインテグレータ		0.1
キングジム		0.2	エーアイティー		0.1	朝日ネット		0.2
イトーキ		0.5	内外トランスライン		0.1	e B A S E		0.2
三菱鉛筆		0.4	日本コンセプト		0.1	アバント		0.2
タカラスタンダード		0.4	情報・通信業			アドソル日進		0.1
ナカバヤシ		0.2	NECネットエスアイ		0.6	フリービット		0.1
グローブライド		0.1	クロスキャット		0.1	コムチュア		0.2
オカムラ		0.7	システナ		0.7	アステリア		0.1
美津濃		0.2	デジタルアーツ		0.1	アイル		0.1
電気・ガス業			日鉄ソリューションズ		0.3	マークラインズ		0.1
沖縄電力		0.4	キューブシステム		0.1	メディカル・データ・ビジ		0.2
エフオン		0.1	コア		0.1	g u m i		0.3
イーレックス		0.3	ラクーンホールディングス		0.1	モバイルファクトリー		0.1
レノバ		0.4	ソリトンシステムズ		0.1	テラスカイ		0.1
北海道瓦斯		0.1	ソフトクリエイトHD		0.1	デジタル・インフォメーション		0.1
広島ガス		0.4	J N Sホールディングス		0.1	オープンドア		0.1
西部ガスHLDGS		0.2	電算システム		0.1	マイネット		0.1
静岡ガス		0.6	グリー		1.4	アカツキ		0.1
メタウォーター		0.2	コーエーテックモHD		0.4	カナミックネットワーク		0.1
陸運業			三菱総合研究所		0.1	シンクロ・フード		0.1
S B Sホールディングス		0.2	AGS		0.1	オークネット		0.1
富士急行		0.3	ファインデックス		0.2	AOI T Y O H O L D I N G S		0.2
新京成電鉄		0.1	ブレインパッド		0.1	マクロミル		0.4
鴻池運輸		0.3	K L a b		0.4	オロ		0.1
ハマキョウレックス		0.2	ポールトゥウィン・ピットフル		0.3	ソルクシーズ		0.1
サカイ引越センター		0.1	アイスタイル		0.6	フェイス		0.1
山陽電鉄		0.1	エムアップホールディングス		0.1	プロトコーポレーション		0.2
丸運		0.1	エイチーム		0.1	サイバネットシステム		0.2
丸全昭和運輸		0.2	エニゴモ		0.2	C Eホールディングス		0.1
センコーグループHLDGS		1.1	テクノスジャパン		0.2	インテージホールディングス		0.3
福山通運		0.3	e n i s h		0.1	東邦システムサイエンス		0.1
エスライン		0.1	コロプラ		0.7	ソースネクスト		1
日立物流		0.4	オルトプラス		0.2	インフォコム		0.2
丸和運輸機関		0.2	ブロードリーフ		1	ラクスル		0.1
C & F ロジホールディングス		0.2	クロス・マーケティングG		0.1	F I G		0.2
海運業			デジタルハーツHLDGS		0.1	イソソル		0.1
川崎汽船		0.6	システム情報		0.1	アルテリア・ネットワークス		0.2
N S ユナイテッド海運		0.1	メディアドゥ		0.1	フォーカスシステムズ		0.1
明治海運		0.2	じげん		0.5	クレスコ		0.2
飯野海運		1	ブイキューブ		0.1	ジャストシステム		0.3
乾汽船		0.1	ディー・エル・イー		0.2	T D C ソフト		0.2
倉庫・運輸関連業			フィックスターズ		0.2	I Dホールディングス		0.1
トランコム		0.1	CART A H O L D I N G S		0.1	アルファシステムズ		0.1

銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数
		千株			千株			千株
フューチャー		0.3	ミロク情報サービス		0.2	田中商事		0.1
CAC HOLDINGS		0.1	卸売業			オーハシテクニカ		0.1
S Bテクノロジー		0.1	高千穂交易		0.1	白銅		0.1
トーセ		0.1	伊藤忠食品		0.1	蝶理		0.1
オービックビジネスC		0.2	エレマテック		0.2	三共生興		0.3
アイティフォー		0.3	J A L U X		0.1	兼松		0.8
サイボウズ		0.2	あらた		0.2	日本紙パルプ		0.1
ソフトブレーン		0.1	東京エレクトロンデバイス		0.1	カメイ		0.3
電通国際情報S		0.1	フィールズ		0.2	スターゼン		0.1
ACCESS		0.2	横浜冷凍		0.6	山善		0.8
デジタルガレージ		0.4	ラサ商事		0.1	内田洋行		0.1
イーエムシステムズ		0.4	アルコニックス		0.2	第一実業		0.1
ウェザーニューズ		0.1	あいホールディングス		0.3	西華産業		0.1
C I J		0.1	ディーブイエックス		0.1	佐藤商事		0.2
日本エンタープライズ		0.2	ダイワボウHD		0.2	菱洋エレクトロ		0.2
WOWOW		0.1	マクニカ・富士エレHLDGS		0.5	東京産業		0.2
スカラ		0.2	ラクト・ジャパン		0.1	ユアサ商事		0.2
インテリジェント ウェイブ		0.1	バイタルK S KHD		0.4	神鋼商事		0.1
I M A G I C A G R O U P		0.2	八洲電機		0.2	トルク		0.1
システムソフト		0.5	メディアスホールディングス		0.1	正栄食品		0.1
アルゴグラフィックス		0.2	レスターホールディングス		0.2	カナデン		0.2
マーベラス		0.3	大光		0.1	菱電商事		0.2
エイベックス		0.4	OCHIホールディングス		0.1	フルサト工業		0.1
兼松エレクトロニクス		0.1	TOKAIホールディングス		1.1	ナイス		0.1
都築電気		0.1	三洋貿易		0.2	昭光通商		0.1
朝日放送グループHD		0.2	ウイン・パートナーズ		0.2	極東貿易		0.1
スカパーJ S A T H D		1.4	ミタチ産業		0.1	アステナホールディングス		0.3
テレビ東京HD		0.2	明治電機工業		0.1	三菱石油		0.5
日本BS放送		0.1	デリカフーズHLDGS		0.1	稲畑産業		0.5
ビジョン		0.2	コメダホールディングス		0.5	G S Iクレオス		0.1
スマートバリュー		0.1	富士興産		0.2	明和産業		0.2
USEN-NEXT HLDGS		0.1	小野建		0.1	クワザワホールディングス		0.1
ワイヤレスゲート		0.1	佐島電機		0.1	ヤマエ久野		0.2
コネクシオ		0.1	伯東		0.1	ワキタ		0.4
日本通信		1.6	コンドーテック		0.2	ミツウロコグループ		0.3
エムティーアイ		0.2	中山福		0.1	シナネンホールディングス		0.1
GMOインターネット		0.8	ナガイレーベン		0.3	伊藤忠エネクス		0.5
ファイバーゲート		0.1	三菱食品		0.2	サンワ テクノス		0.1
アйдママーケティングコミュ		0.1	松田産業		0.2	リョーサン		0.2
KADOKAWA		0.6	萩原電気HLDGS		0.1	新光商事		0.3
学研ホールディングス		0.4	アズワン		0.1	トーホー		0.1
ゼンリン		0.4	スズデン		0.1	三信電気		0.1
昭文社ホールディングス		0.1	尾家産業		0.1	東陽テクニカ		0.2
インプレスホールディングス		0.2	シモジマ		0.1	モスフード サービス		0.3
アイネット		0.1	ドウシシャ		0.2	加賀電子		0.2
東映		0.1	高速		0.1	ソーダニツカ		0.2
D T S		0.5	たけびし		0.1	立花エレテック		0.2
シーイーシー		0.2	丸文		0.2	フォーバル		0.1
ジャステック		0.1	ハビネット		0.2	三谷産業		0.3
日本システムウエア		0.1	日本ライフライン		0.6	太平洋興発		0.1
アイネス		0.2	タカショー		0.1	国際紙パルプ商事		0.5
T K C		0.2	マルカ		0.1	ヤマタネ		0.1
富士ソフト		0.3	I D O M		0.6	日鉄物産		0.1
NSD		0.7	進和		0.1	泉州電業		0.1
福井コンピュータHLDGS		0.1	ダイトロン		0.1	トラスコ中山		0.4
J B C Cホールディングス		0.2	シークス		0.3	モリト		0.2

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数
		千株			千株			千株
加藤産業		0.3	ジョイフル本田		0.6	ヨンドシーホールディングス		0.2
イノテック		0.1	鳥貴族ホールディングス		0.1	木曾路		0.3
イエローハット		0.4	キリン堂ホールディングス		0.1	S R Sホールディングス		0.2
J Kホールディングス		0.2	ホットランド		0.1	千趣会		0.4
日伝		0.2	S F Pホールディングス		0.1	タカキユー		0.2
北沢産業		0.2	綿半ホールディングス		0.2	リテールパートナーズ		0.3
杉本商事		0.1	ユナイテッド・スーパーマーケ		0.6	ケーヨー		0.4
因幡電機産業		0.6	ゴルフダイジェスト・オン		0.1	上新電機		0.2
東テック		0.1	BEENOS		0.1	日本瓦斯		0.3
アルテック		0.2	あさひ		0.2	ロイヤルホールディングス		0.4
タキヒヨー		0.1	日本調剤		0.2	いなげや		0.3
ジェコス		0.1	トーエル		0.1	チヨダ		0.2
グローセル		0.2	クリエイト・レストランツ・ホール		1.1	ライフコーポレーション		0.2
小売業			サンマルクホールディングス		0.2	リンガーハット		0.3
サンエー		0.2	トリドールホールディングス		0.6	Mr Ma x HD		0.3
カワチ薬品		0.2	TOKYO BASE		0.2	テンアライド		0.2
ハードオフコーポレーション		0.1	J Mホールディングス		0.1	AOKIホールディングス		0.4
アスクル		0.2	アレンザホールディングス		0.1	オークワ		0.3
ゲオホールディングス		0.4	パロックジャパン		0.2	コメリ		0.3
アダストリア		0.3	カの源HD		0.1	青山商事		0.4
ジーフット		0.1	FOOD & LIFE COMPAN		1.1	はせがわ		0.1
くら寿司		0.1	メディカルシステムネットワーク		0.2	松屋		0.4
キャンドウ		0.1	はるやまHLDGS		0.1	近鉄百貨店		0.1
パルグループHLDGS		0.2	ノジマ		0.4	アクシアルリテイリング		0.2
エディオン		1	カップ・クリエイト		0.3	井筒屋		0.1
サーラコーポレーション		0.4	ライトオン		0.2	平和堂		0.4
ワッツ		0.1	ジーンズメイト		0.1	フジ		0.3
ハローズ		0.1	三城ホールディングス		0.2	ヤオコー		0.2
フジオフードG本社		0.2	アドヴァン		0.3	ゼビオホールディングス		0.3
ひらまつ		0.4	アルビス		0.1	OLYMPICグループ		0.1
大黒天物産		0.1	コナカ		0.2	日産東京販売HD		0.3
ハニーズホールディングス		0.2	G-7ホールディングス		0.2	GENKY DRUGSTORES		0.1
ファーマライズHD		0.1	イオン北海道		0.3	ブックオフGHD		0.1
アルペン		0.2	コジマ		0.4	元気寿司		0.1
ハブ		0.1	ヒマラヤ		0.1	アークランドサカモト		0.3
クオールホールディングス		0.3	コーナン商事		0.3	グルメ軒屋		0.1
ジンスホールディングス		0.1	エコス		0.1	愛眼		0.2
ビックカメラ		1.2	ワタミ		0.3	ケーユーホールディングス		0.1
DCMホールディングス		1.2	マルシェ		0.1	松屋フーズHLDGS		0.1
ペッパーフードサービス		0.2	西松屋チェーン		0.5	サガミホールディングス		0.3
東京一番フーズ		0.1	幸楽苑ホールディングス		0.1	関西スーパーマーケット		0.2
DDホールディングス		0.1	サイゼリヤ		0.3	王将フードサービス		0.2
きちりホールディングス		0.1	V Tホールディングス		0.9	プレナス		0.2
アークランドサービスHD		0.2	魚力		0.1	ミニストップ		0.2
ドトール・日レスHD		0.3	ポプラ		0.1	アークス		0.4
ブロンコビリー		0.1	フジ・コーポレーション		0.1	パローホールディングス		0.5
トレジャー・ファクトリー		0.1	ユナイテッドアローズ		0.2	ベルク		0.1
物語コーポレーション		0.1	ハイデイ日高		0.3	大庄		0.1
ココカラファイン		0.2	京都きもの友禅		0.1	サックスパーホールディング		0.2
Hamee		0.1	ピーシーデポコーポ		0.3	ペルーナ		0.5
クリエイトSDH		0.4	壺番屋		0.1	銀行業		
丸善CHIHD		0.2	トップカルチャー		0.1	じもとホールディングス		0.1
チムニー		0.1	PLANT		0.1	東京きらぼしFG		0.3
シュッピン		0.1	薬王堂ホールディングス		0.1	富山第一銀行		0.5
オイシックス・ラ・大地		0.2	ヴィア・ホールディングス		0.3	関西みらいFG		1.2
ネクステージ		0.3	スクロール		0.3	33Frai		0.2

銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数	銘柄	期株	首数
		千株			千株			千株
武蔵野銀行		0.3	水戸証券		0.6	スターツコーポレーション		0.3
千葉興業銀行		0.5	いちよし証券		0.4	フジ住宅		0.2
筑波銀行		0.9	マネックスG		1.6	空港施設		0.2
青森銀行		0.2	極東証券		0.3	明和地所		0.1
秋田銀行		0.1	岩井コスモホールディング		0.2	ゴールドフレスト		0.2
山形銀行		0.2	藍澤証券		0.4	エスリード		0.1
岩手銀行		0.1	マネーパートナーズG P		0.2	日神グループHLDGS		0.3
東邦銀行		1.9	スパークス・グループ		0.7	日本エスコ		0.4
東北銀行		0.1	小林洋行		0.1	タカラレーベン		1
みちのく銀行		0.1	保険業			AVANTIA		0.1
十六銀行		0.3	アニコムホールディングス		0.8	毎日コムネット		0.1
山梨中央銀行		0.2	その他金融業			ファースト住建		0.1
大垣共立銀行		0.4	ジェイリース		0.1	ランド		11.4
福井銀行		0.2	イントラスト		0.1	カチタス		0.5
北國銀行		0.2	Casa		0.1	トーセイ		0.3
清水銀行		0.1	アルヒ		0.3	サンフロンティア不動産		0.3
南都銀行		0.3	プレミアグループ		0.1	エフ・ジェー・ネクスト		0.2
百五銀行		1.9	芙蓉総合リース		0.2	インテリックス		0.1
紀陽銀行		0.7	みずほリース		0.3	ランドビジネス		0.1
山陰合同銀行		1.2	日本証券金融		0.9	サンネクスタグループ		0.1
鳥取銀行		0.1	アイフル		3.2	グランディハウス		0.2
百十四銀行		0.2	リコーリース		0.2	サービス業		
四国銀行		0.3	ジャックス		0.2	明豊ファシリティアワークス		0.1
阿波銀行		0.3	オリコ		5.7	日本工営		0.1
大分銀行		0.1	アプラスフィナンシャル		1	LIFULL		0.7
宮崎銀行		0.1	九州リースサービス		0.1	ミクシィ		0.4
佐賀銀行		0.1	イー・ギャランティ		0.2	ジェイエイシーリクルートメント		0.1
沖縄銀行		0.2	アサックス		0.1	メンバーズ		0.1
琉球銀行		0.5	NECキャピタルソリューション		0.1	UTグループ		0.2
高知銀行		0.1	不動産業			アイティメディア		0.1
長野銀行		0.1	いちご		2.7	タケエイ		0.2
名古屋銀行		0.2	日本駐車場開発		2.3	夢真ビーネックスグループ		0.3
北洋銀行		3.2	スター・マイカ・HLDGS		0.1	コシダカホールディングス		0.5
愛知銀行		0.1	ADワークスグループ		0.3	パソナグループ		0.2
中京銀行		0.1	三栄建築設計		0.1	CDS		0.1
大光銀行		0.1	三重交通グループHD		0.4	リンクアンドモチベーション		0.4
愛媛銀行		0.3	サムティ		0.3	GCA		0.2
トマト銀行		0.1	ディア・ライフ		0.3	サニーサイドアップG		0.1
京葉銀行		0.9	コーセーアールイー		0.1	リニカル		0.1
栃木銀行		1	日本商業開発		0.1	クックパッド		0.7
北日本銀行		0.1	プレサンスコーポレーション		0.3	エスクリ		0.1
東和銀行		0.4	THEグローバル社		0.1	アイ・ケイ・ケイ		0.1
福島銀行		0.2	日本管理センター		0.1	学情		0.1
大東銀行		0.1	サンセイランディック		0.1	スタジオアリス		0.1
トモニホールディングス		1.6	フージャースHD		0.4	シミックホールディングス		0.1
フィデアホール		2	ムゲンエステート		0.1	アイロムグループ		0.1
池田泉州HD		2.4	ファーストブラザーズ		0.1	セントケア・ホールディング		0.1
証券・商品先物取引業			ハウストゥ		0.1	ルネサンス		0.1
FPG		0.6	シーアールイー		0.1	ディップ		0.3
マーキュリアインベストメント		0.1	ケイアイスター不動産		0.1	デジタルホールディングス		0.1
日本アジア投資		0.2	パラカ		0.1	新日本科学		0.2
岡三証券グループ		1.8	平和不動産		0.4	ツクイホールディングス		0.5
丸三証券		0.6	ダイビル		0.5	キャリアデザインセンター		0.1
東洋証券		0.8	京阪神ビルディング		0.3	ベネフィット・ワン		0.7
東海東京HD		2.4	テオオーシー		0.4	ツカダ・グローバルHOLD		0.1
光世証券		0.1	レオパレス21		2.8	アウトソーシング		1.2

日本小型株インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首	銘柄	株数	期首	銘柄	株数	期首
		数			数			数
ウェルネット	0.2	千株	N・フィールド	0.1	千株	丹青社	0.4	千株
ワールドホールディングス	0.1		M&Aキャピタルパートナー	0.1		応用地質	0.2	
ぐるなび	0.4		ライドオンエクスプレスHD	0.1		船井総研ホールディング	0.4	
タカミヤ	0.2		ERIホールディングス	0.1		進学会ホールディングス	0.1	
ジャパンベストレスキューS	0.1		シグマクシス	0.1		オオバ	0.1	
ファンコミュニケーションズ	0.6		ウィルグループ	0.1		学究社	0.1	
ライク	0.1		エスクローAJ	0.3		イオンディライト	0.3	
ビジネス・ブレイクスルー	0.1		エラン	0.1		ナック	0.1	
エスプール	0.4		土木管理総合試験	0.1		ニチイ学館	0.2	
WDBホールディングス	0.1		ネットマーケティング	0.1		ダイセキ	0.3	
ティア	0.1		ベルシステム24HLDGS	0.3		ステップ	0.1	
バリューコマース	0.1		鎌倉新書	0.2				
JPホールディングス	0.6		LITALICO	0.1		合計		千株
エコナックホールディングス	0.4		エアトリ	0.1		株数		407
EPSホールディングス	0.3		アトラエ	0.1		銘柄		銘柄
レッグス	0.1		ストライク	0.1				
プレステージ・インター	0.8		ソラスト	0.6				
アミューズ	0.1		セラク	0.1				
ドリームインキュベータ	0.1		インソース	0.1				
クイック	0.1		バイカレントコンサルティング	0.1				
TAC	0.1		アイモパイル	0.1				
ケネディクス	1.9		キャリアインデックス	0.1				
テイクアンドギヴニーズ	0.1		MS-Japan	0.1				
びあ	0.1		グレイステクノロジー	0.1				
イオンファンタジー	0.1		ジャパンエレベーターSHD	0.2				
シーティーエス	0.2		グリーンズ	0.1				
ネクシィーズグループ	0.1		日総工産	0.1				
アルプス技研	0.2		キュービーネットHLDGS	0.1				
サニックス	0.4		RPAホールディングス	0.1				
日本空調サービス	0.2		スプリックス	0.1				
明光ネットワークジャパン	0.2		カーブスホールディングス	0.5				
ファルコホールディングス	0.1		フォーラムエンジニアリング	0.1				
ラウンドワン	0.6		アドバンテッジリスクマネ	0.1				
ビー・エム・エル	0.3		東祥	0.1				
りらいあコミュニケーション	0.4		エイチ・アイ・エス	0.3				
リソー教育	0.9		共立メンテナンス	0.3				
早稲田アカデミー	0.1		イチネンホールディングス	0.2				
東京個別指導学院	0.1		建設技術研究所	0.1				
クリーク・アンド・リバー社	0.1		スペース	0.1				
テー・オー・ダブリュー	0.4		長大	0.1				
山田コンサルティングGP	0.1		燦ホールディングス	0.1				
セントラルスポーツ	0.1		東京テアトル	0.1				
フルキャストホールディングス	0.2		ナガワ	0.1				
エン・ジャパン	0.4		東京都競馬	0.1				
アイ・アールジャパンHD	0.1		常磐興産	0.1				
Keepertech	0.2		カナモト	0.3				
Gunosy	0.1		東京ドーム	0.8				
イー・ガーディアン	0.1		西尾レントオール	0.2				
リブセンス	0.1		アゴーラ ホスピタリティーG	1.3				
ジャパンマテリアル	0.6		トランス・コスモス	0.2				
ベクトル	0.3		乃村工務社	0.9				
ウチヤマホールディングス	0.1		藤田観光	0.1				
チャームケアコーポレーション	0.2		KNT-CTホールディングス	0.1				
キャリアリンク	0.1		日本管財	0.2				
IBJ	0.1		トーカイ	0.2				
アサンテ	0.1		セントラル警備保障	0.1				

■投資信託財産の構成

2021年6月10日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	539,928	100.0
投資信託財産総額	539,928	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

2021年6月10日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	539,928,419円
コール・ローン等	539,928,419
(B) 負債	474
未払利息	474
(C) 純資産総額(A - B)	539,927,945
元本	497,915,305
償還差損益金	42,012,640
(D) 受益権総口数	497,915,305口
1万口当り償還価額(C / D)	10,843円77銭

* 期首における元本額は518,111,718円、当作成期間中における追加設定元本額は42,756,075円、同解約元本額は62,952,488円です。

* 償還時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497,915,305円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は10,843円77銭です。

■損益の状況

当期 自2020年10月20日 至2021年6月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	7,033,883円
受取配当金	7,042,565
受取利息	2
その他収益金	1,032
支払利息	△ 9,716
(B) 有価証券売買損益	35,060,946
売買益	65,631,610
売買損	△30,570,664
(C) 先物取引等損益	2,493,090
取引益	3,198,810
取引損	△ 705,720
(D) その他費用	△ 16
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	44,587,903
(F) 前期繰越損益金	△ 1,330,676
(G) 解約差損益金	△ 4,884,512
(H) 追加信託差損益金	3,639,925
(I) 合計(E + F + G + H)	42,012,640
償還差損益金(I)	42,012,640

(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。