

東京海上 日本株TOPIXファンド

第16期 運用報告書（全体版）
（決算日 2016年3月22日）

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（課税上は株式投資信託として取扱われます。）	
信託期間	2000年3月21日から2020年3月19日	
運用方針	信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	東京海上日本株TOPIXファンド	「TMA日本株TOPIXマザーファンド」を主要投資対象とします。
	TMA日本株TOPIXマザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている銘柄を主要投資対象とします。
投資制限	東京海上日本株TOPIXファンド	株式への投資割合は、制限なし 外貨建資産への実質投資割合は、20%以下
	TMA日本株TOPIXマザーファンド	株式への投資割合は、制限なし 外貨建資産への投資割合は、20%以下
分配方針	毎決算時に経費控除後の利子、配当収入および売買益などのうちから、基準価額水準等を勘案して、分配を行う方針です。	

受益者のみなさまへ

毎々格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

さて、ご投資いただいております「東京海上日本株TOPIXファンド」は、2016年3月22日に第16期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-3-1 東京銀行協会ビル

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

※土日祝日・年末年始を除く9時～17時

<http://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税金	期騰落率	期騰落率	中率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
12期(2012年3月21日)	5,555	0	0.6	858.78	△1.1	99.0	1.0	1,274
13期(2013年3月21日)	6,958	0	25.3	1,058.10	23.2	98.8	1.2	1,460
14期(2014年3月20日)	7,638	0	9.8	1,145.97	8.3	99.4	0.6	819
15期(2015年3月20日)	10,681	0	39.8	1,580.51	37.9	97.2	2.3	644
16期(2016年3月22日)	9,368	0	△12.3	1,369.93	△13.3	98.5	1.6	507

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークはTOPIXです。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。(株)東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。(株)東京証券取引所は、委託会社又は当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものでありません。以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2015年3月20日	10,681	—	1,580.51	—	97.2	2.3
3月末	10,506	△ 1.6	1,543.11	△ 2.4	96.9	3.1
4月末	10,842	1.5	1,592.79	0.8	98.0	2.0
5月末	11,397	6.7	1,673.65	5.9	97.3	2.0
6月末	11,104	4.0	1,630.40	3.2	98.6	1.5
7月末	11,292	5.7	1,659.52	5.0	98.9	1.2
8月末	10,454	△ 2.1	1,537.05	△ 2.7	95.7	4.6
9月末	9,668	△ 9.5	1,411.16	△ 10.7	97.3	2.7
10月末	10,673	△ 0.1	1,558.20	△ 1.4	98.0	2.4
11月末	10,816	1.3	1,580.25	△ 0.0	97.7	2.4
12月末	10,598	△ 0.8	1,547.30	△ 2.1	97.9	2.1
2016年1月末	9,806	△ 8.2	1,432.07	△ 9.4	97.5	2.7
2月末	8,881	△ 16.9	1,297.85	△ 17.9	97.9	2.4
(期 末)						
2016年3月22日	9,368	△ 12.3	1,369.93	△ 13.3	98.5	1.6

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

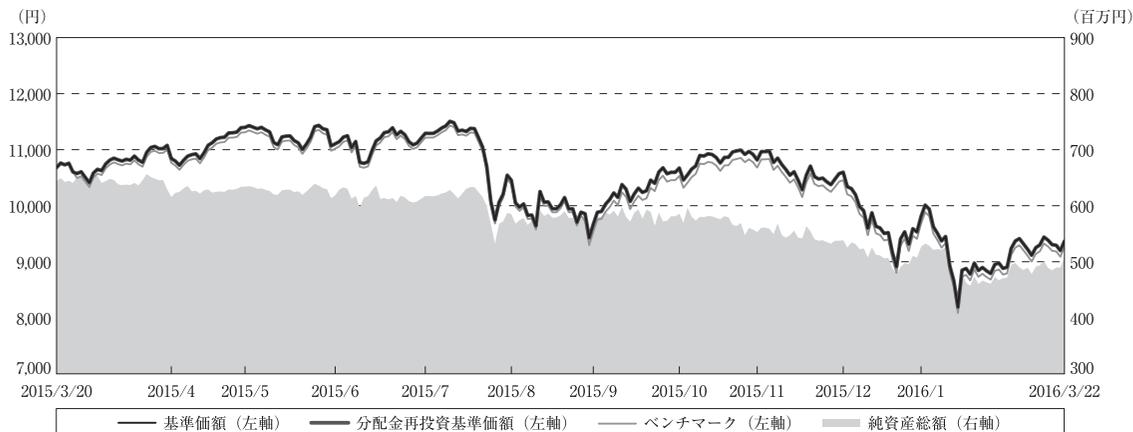
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2015年3月21日～2016年3月22日)

■期中の基準価額等の推移



期 首：10,681円

期 末：9,368円（既払分配金（税込み）：0円）

騰 落 率：△12.3%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首（2015年3月20日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) ベンチマークはTOPIXです。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・ 賃金のベースアップや外国人旅行者の増加による国内消費の拡大
- ・ 日銀やECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和

マイナス要因

- ・ 原油価格の下落によるリスク回避姿勢の広がり
- ・ 中国経済の先行きに対する懸念
- ・ 米国の利上げ見通しの後退による円高米ドル安

■投資環境

後述の「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の運用報告書をご覧ください。

■ポートフォリオについて

<東京海上日本株TOPIXファンド>

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。

当ファンドの基準価額は、マザーファンドの値動きを反映し、12.3%下落しました。

<TMA日本株TOPIXマザーファンド>

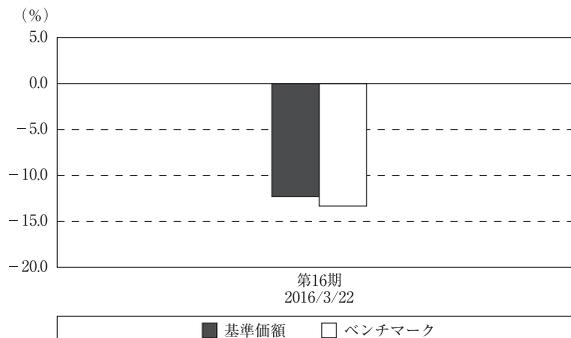
後述の「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の運用報告書をご覧ください。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額は12.3%下落し、ベンチマークであるTOPIXにほぼ連動しました。

また、TOPIXからの乖離度合いを表すトラッキングエラーは、過去1年で1.0%となりました。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークはTOPIXです。

■分配金

当期においては、市況動向や運用の効率性などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第16期
	2015年3月21日～ 2016年3月22日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	6,700

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

<東京海上日本株TOPIXファンド>

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

<TMA日本株TOPIXマザーファンド>

後述の「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の運用報告書をご覧ください。

○1万口当たりの費用明細

(2015年3月21日～2016年3月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 68	% 0.652	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(29)	(0.271)	*委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(30)	(0.282)	*運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(10)	(0.098)	*運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.005	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 *売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.005)	
(c) そ の 他 費 用	5	0.043	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(5)	(0.043)	*監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	73	0.700	
期中の平均基準価額は、10,503円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2015年3月21日～2016年3月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 430,474	千円 489,336	千口 489,482	千円 564,242

○株式売買比率

(2015年3月21日～2016年3月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	TMA日本株TOPIXマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	100,210,994千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	121,844,219千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.82	

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月21日～2016年3月22日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

<TMA日本株TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	329	475	1,002

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは東京海上ホールディングス株式会社です。

○組入資産の明細

(2016年3月22日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	545,930	486,922	507,859

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

○投資信託財産の構成

(2016年3月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	507,859	99.6
コール・ローン等、その他	1,962	0.4
投資信託財産総額	509,821	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月22日現在)

○損益の状況 (2015年3月21日～2016年3月22日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	509,821,724
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	507,859,938
未収入金	1,961,786
(B) 負債	1,961,786
未払解約金	98,418
未払信託報酬	1,746,990
その他未払費用	116,378
(C) 純資産総額(A-B)	507,859,938
元本	542,098,448
次期繰越損益金	△ 34,238,510
(D) 受益権総口数	542,098,448口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,368円

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△ 49,063,935
売買益	24,773,299
売買損	△ 73,837,234
(B) 信託報酬等	△ 4,020,488
(C) 当期損益金(A+B)	△ 53,084,423
(D) 前期繰越損益金	79,284,332
(E) 追加信託差損益金	△ 60,438,419
(配当等相当額)	(276,037,826)
(売買損益相当額)	(△336,476,245)
(F) 計(C+D+E)	△ 34,238,510
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	△ 34,238,510
追加信託差損益金	△ 60,438,419
(配当等相当額)	(276,583,325)
(売買損益相当額)	(△337,021,744)
分配準備積立金	86,658,145
繰越損益金	△ 60,458,236

(注) 当ファンドの期首元本額は603,198,708円、期中追加設定元本額は477,679,201円、期中一部解約元本額は538,779,461円です。

(注) 当期末の元本の欠損は34,238,510円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は0.9368円です。

(注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,373,813円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(276,583,325円)および分配準備積立金(79,284,332円)より分配対象収益は363,241,470円(1万口当たり6,700円)でしたが、当期に分配した金額はありません。

○お知らせ

○2015年12月19日付で、信用リスクを適正に管理するため、所要の約款変更を行いました。

○2016年2月18日付で、信託期間を変更するため、所要の約款変更を行いました。

TMA日本株TOPIXマザーファンド

運用報告書 第16期（決算日 2016年3月22日）

（計算期間 2015年3月21日～2016年3月22日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率	純総資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
12期(2012年3月21日)	6,023	1.2	858.78	△1.1	99.0	1.0	136,925
13期(2013年3月21日)	7,590	26.0	1,058.10	23.2	98.8	1.2	151,771
14期(2014年3月20日)	8,387	10.5	1,145.97	8.3	99.4	0.6	138,907
15期(2015年3月20日)	11,801	40.7	1,580.51	37.9	97.2	2.3	161,556
16期(2016年3月22日)	10,430	△11.6	1,369.93	△13.3	98.5	1.6	131,902

（注）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークはTOPIXです。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。(株)東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。(株)東京証券取引所は、委託会社又は当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年3月20日	円 11,801	% -		% -	% 97.2	% 2.3
3月末	11,610	△ 1.6	1,543.11	△ 2.4	96.9	3.1
4月末	11,989	1.6	1,592.79	0.8	97.9	2.0
5月末	12,608	6.8	1,673.65	5.9	97.2	2.0
6月末	12,292	4.2	1,630.40	3.2	98.4	1.5
7月末	12,507	6.0	1,659.52	5.0	98.7	1.2
8月末	11,589	△ 1.8	1,537.05	△ 2.7	95.4	4.6
9月末	10,725	△ 9.1	1,411.16	△10.7	97.3	2.7
10月末	11,846	0.4	1,558.20	△ 1.4	97.9	2.4
11月末	12,012	1.8	1,580.25	△ 0.0	97.6	2.4
12月末	11,777	△ 0.2	1,547.30	△ 2.1	97.7	2.1
2016年1月末	10,904	△ 7.6	1,432.07	△ 9.4	97.3	2.6
2月末	9,884	△16.2	1,297.85	△17.9	97.5	2.4
(期 末) 2016年3月22日	10,430	△11.6	1,369.93	△13.3	98.5	1.6

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2015年3月21日～2016年3月22日)

■期中の基準価額等の推移

期首：11,801円

期末：10,430円

騰落率：△11.6%

◇基準価額の変動要因

プラス要因

- ・賃金のベースアップや外国人旅行者の増加による国内消費の拡大
- ・日銀やECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和

マイナス要因

- ・原油価格の下落によるリスク回避姿勢の広がり
- ・中国経済の先行きに対する懸念
- ・米国の利上げ見通しの後退による円高米ドル安

■投資環境

当期の国内株式市場は下落しました。

期初から2015年5月にかけては、賃金のベースアップや外国人旅行者の増加による国内消費拡大に対する期待のほか、日銀や公的年金による株式への資金フローなどを背景に、国内株式市場は上昇基調となりました。

6月に入り、ギリシャ債務問題の不透明感が強まり、世界的に株価が下落するなかで国内株式市場も6ヵ月ぶりの下落となりました。その後、ギリシャが財政緊縮案を受け入れ、EU（欧州連合）が金融支援協議を再開するとの報道が好感されたことから、国内株式市場は小幅に上昇しましたが、8月から9月にかけては、中国人民銀行による中国元の切り下げや低調な中国の各種経済指標を背景とする中国経済の減速懸念により下落した中国株式市場に連動して、国内株式市場も下落基調となりました。

10月から11月にかけては、ECBが12月の政策理事会で追加金融緩和を示唆したことで、日銀の追加金融緩和への期待感も高まったことから、国内株式市場は一時反発しましたが、12月から2016年2月にかけて、原油価格の下落が続いたことや、上海株式市場で導入したサーキットブレーカーの発動による取引停止の混乱などにより投資家心理が悪化し、国内株式市場は下落基調となりました。

その後期末にかけては、原油価格の反発がみられたものの、米国の利上げ見通しが後退し円高米ドル安が進んだため、国内株式市場の反発は鈍いものとなりました。



(注) ベンチマークは、期首（2015年3月20日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、TOPIXです。

■ポートフォリオについて

当ファンドは、日本の株式市場全体への投資を目的とし、TOPIXに連動した投資成果を目標として運用を行っています。個別の銘柄選択は、市場でのウェイトが一定以上の銘柄についてはそのウェイト通り組み入れ、一定以下の銘柄については当社独自の業種分類と時価総額による規模分類に基づいて選定します。これにより、業種配分および企業規模などの特性がファンド全体でTOPIXとほぼ一致するよう調整しています。

期首の保有銘柄数は1,031銘柄でした。期中では、ベンチマークとのトラッキングエラー*を一定程度に抑えるため、設定・解約に応じたTOPIX先物と現物株式の売買を行い、実質的な株式組入比率はほぼ100%を維持しました。なお、期末における保有銘柄数は1,035銘柄となりました。

上記運用の結果、当期の基準価額は11.6%下落し、ベンチマークであるTOPIXにほぼ連動しました。

また、TOPIXからの乖離度合いを表すトラッキングエラーは、過去1年で1.0%となりました。

※毎月の対ベンチマーク超過収益率（ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。

○今後の運用方針

引き続き、上記の当ファンドの基本方針に基づき、先物も使用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、TOPIXとの連動性を高位に保つことを目指して運用します。

○1万口当たりの費用明細

(2015年3月21日～2016年3月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
合 計	1	0.005	
期中の平均基準価額は、11,645円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2015年3月21日～2016年3月22日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		33,673	43,674,545	39,288	56,536,449
		(△ 1,310)	()		

(注) 金額は受渡代金です。

(注) () 内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		53,700	55,370	—	—

○株式売買比率

(2015年3月21日～2016年3月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	100,210,994千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	121,844,219千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.82

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月21日～2016年3月22日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 329	百万円 475	百万円 1,002

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは東京海上ホールディングス株式会社です。

○組入資産の明細

(2016年3月22日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	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				千株			千株		
	千円			千円				千円			千円		
水産・農林業 (0.1%)							日本電設工業	14.2	13.3	30,177			
日本水産	20	82.9	43,605				協和エクシオ	32	30.1	38,949			
マルハニチロ	14.2	14.6	32,090				新日本空調	24.7	21.4	21,977			
サカタのタネ	15.2	10.8	29,451				九電工	16	11	28,149			
ホクト	10.3	10.7	22,223				三機工業	27.1	28.7	26,891			
鉱業 (0.3%)							日揮	77	73	138,481			
日鉄鉱業	51	33	14,685				中外炉工業	79	67	13,869			
国際石油開発帝石	402.7	382.9	357,743				ヤマト	59	47.4	22,704			
石油資源開発	11.1	10.1	27,552				太平電業	25	21	22,050			
K&Oエナジーグループ	13.8	14.3	20,377				高砂熱学工業	22.7	23.7	35,668			
建設業 (3.2%)							三晃金属工業	41	43	12,255			
ショーボンドホールディングス	7.1	7.8	32,994				大氣社	10.1	9.7	27,780			
ミライト・ホールディングス	25.9	34	31,484				日比谷総合設備	12.9	14.7	25,239			
安藤・間	52.8	54	31,752				東芝プラントシステム	13.7	18.2	25,589			
コムシスホールディングス	34.7	31.2	56,440				東洋エンジニアリング	44	67	20,368			
ミサワホーム	22	23	18,515				千代田化工建設	56	55	52,085			
東建コーポレーション	—	2.7	24,705				新興プラントテック	26.4	28.7	25,370			
ヤマウラ	57.6	45.8	22,029				食料品 (5.0%)						
大成建設	389	377	288,405				日本製粉	44	48	43,872			
大林組	228	215.7	242,231				日清製粉グループ本社	84.8	80.3	151,767			
清水建設	232	217	210,490				鳥越製粉	21.1	23.4	15,561			
長谷工コーポレーション	95.2	86.6	94,740				日本甜菜製糖	118	117	23,049			
鹿島建設	335	341	247,907				三井製糖	57	50	25,400			
西松建設	82	86	42,656				森永製菓	83	61	36,356			
三井住友建設	305.5	—	—				中村屋	48	37	17,945			
前田建設工業	49	40	33,880				江崎グリコ	17.4	16.8	94,920			
奥村組	72	65	39,845				山崎製パン	55	50	116,150			
東鉄工業	9.3	8.8	29,920				カルビー	27.8	25.6	116,480			
戸田建設	93	86	48,332				森永乳業	68	61	36,051			
熊谷組	91	98	27,342				ヤクルト本社	41	38.1	201,930			
大東建託	29	27.1	441,188				明治ホールディングス	22.7	42.9	383,097			
N I P P O	17	15	27,675				雪印メグミルク	19.3	18	48,978			
前田道路	22	21	39,501				日本ハム	56	53	133,560			
五洋建設	88.6	86	40,936				伊藤ハム	46	36	26,244			
大林道路	30	17.2	13,502				丸大食品	55	50	22,950			
住友林業	56.8	50.9	66,068				S F o o d s	7.2	7.5	18,510			
日本基礎技術	55.6	52.4	23,003				サッポロホールディングス	126	116	65,308			
パナホーム	32	36	31,284				アサヒグループホールディングス	153.1	136.1	462,876			
大和ハウス工業	222.4	212.8	687,556				キリンホールディングス	326.1	294.2	463,070			
積水ハウス	234.2	238.1	472,866				宝ホールディングス	61	57.2	51,594			
ユアテック	30	20	18,520				オエノンホールディングス	52	54	11,070			
西部電気工業	48	36	15,300				コカ・コーラウエスト	25.5	24.4	64,025			
中電工	12.9	12.9	29,037				コカ・コーライーストジャパン	23.8	27.9	52,731			
関電工	40	33	26,664				サントリー食品インターナショナル	46.2	49.9	239,520			
きんでん	49	44.7	62,758				ダイドードリンコ	5.3	4.6	24,242			
東京エネシス	27	15	14,130				伊藤園	22.3	21.1	75,116			
トエネック	33	21	15,078				キーコーヒー	13	11.4	22,070			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	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
ジャパンフーズ	18.9		18.7		22,402		住友精化	28	27	17,118			
日清オイリオグループ	52		50		24,150		日産化学工業	45.8	40.8	119,217			
不二製油グループ本社	21		21		41,685		クレハ	41	59	22,479			
J-オイルミルズ	67		44		16,016		石原産業	265	253	19,734			
キッコーマン	62		54		202,500		片倉コープアグリ	57	56	13,384			
味の素	175		155		420,127		日本曹達	45	39	22,191			
キューピー	39.5		37.3		95,674		東ソー	180	183	89,670			
ハウス食品グループ本社	28.6		25		54,175		トクヤマ	124	120	21,000			
カゴメ	29.6		26.5		56,233		セントラル硝子	74	66	41,118			
アリアケジャパン	8.2		5.5		36,135		東亜合成	85	43.1	39,307			
ニチレイ	77		80		71,920		大阪ソーダ	61	54	23,220			
東洋水産	39.3		36		146,520		デンカ	147	139	64,913			
日清食品ホールディングス	32		30.9		169,332		信越化学工業	127.7	120.2	722,402			
永谷園ホールディングス	21		11		12,375		堺化学工業	61	59	18,408			
フジッコ	10		11.2		27,070		エア・ウォーター	63	54	90,504			
ロック・フィールド	11.4		6.2		21,607		大陽日酸	91	51.8	56,513			
日本たばこ産業	422.2		424.6	1,949,763			日本パーカライジング	16.8	34.4	35,225			
ユーグレナ	7		25.8		41,718		四国化成工業	27	16	15,584			
繊維製品 (0.8%)							ステラ ケミファ	11.6	8.6	17,776			
片倉工業	12.2		13.3		15,587		日本触媒	55	10.3	59,328			
グンゼ	79		80		26,800		カナカ	94	89	84,283			
東洋紡	293		291		50,052		三菱瓦斯化学	123	114	70,794			
日清紡ホールディングス	43		—		—		三井化学	324	278	104,250			
倉敷紡績	124		124		26,164		J S R	71.3	63.2	106,365			
日本毛織	29		26		20,306		東京応化工業	14.7	14	42,280			
帝国繊維	10.5		11.2		17,886		三菱ケミカルホールディングス	446.6	447.3	273,971			
帝人	288		280		109,760		ダイセル	100.7	96.5	140,600			
東レ	551		492		467,596		住友ベークライト	69	57	26,106			
日本フェルト	38.9		39.8		18,666		積水化学工業	164	148.3	203,467			
日本バイリーン	36		—		—		日本ゼオン	60	54	39,906			
セーレン	24.4		22		28,886		アイカ工業	21.5	20.7	48,417			
小松精練	36.6		31		19,902		宇部興産	366	357	74,256			
ワコールホールディングス	40		41		56,990		旭有機材工業	71	53	11,395			
ホギメディカル	4.2		4.3		26,531		日立化成	35.1	34.1	69,461			
T S I ホールディングス	39.1		35		26,285		群衆化学工業	58	46	13,984			
三陽商会	80		67		17,219		タイガースポリマー	29.6	27.2	16,673			
オンワードホールディングス	50		38		28,880		ミライアル	10.3	11.1	9,590			
デサント	21.4		18.2		28,737		日本化薬	46	42	46,662			
パルプ・紙 (0.3%)							A D E K A	32.8	32.7	51,993			
特種東海製紙	84		84		33,768		日油	58	49	39,347			
王子ホールディングス	294		281		133,756		ハリマ化成グループ	49.4	38.8	21,029			
日本製紙	35.3		34.5		73,105		花王	191.4	180.3	1,070,080			
三菱製紙	262		277		23,268		三洋化成工業	30	31	24,552			
北越紀州製紙	55.2		43.7		30,415		日本ペイントホールディングス	62.1	52.9	135,424			
大王製紙	31		27.9		27,342		関西ペイント	85	77.2	139,809			
レンゴ	61		56		33,600		中国塗料	27	28	22,204			
ザ・バック	11.2		11.1		30,336		太陽ホールディングス	6.2	6.9	27,048			
化学 (6.1%)							D I C	288	271	71,002			
クラレ	122		108.1		148,097		東洋インキ S C ホールディングス	69	63	29,295			
旭化成	445		424		307,696		富士フイルムホールディングス	163.1	152.9	688,814			
共和レザー	27.1		25		22,325		資生堂	127.7	129.2	322,483			
昭和電工	476		456		54,264		ライオン	79	78	97,110			
住友化学	528		500		259,500		高砂香料工業	40	7.6	19,851			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	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		千株	千円			千株	千株		千円	
マンダム	7.7		6.7		33,064		大塚ホールディングス	140.9	143.6		584,452		
ファンケル	17		19.7		28,210		大正製薬ホールディングス	17.3	16.5		149,325		
コーセー	11.6		10.6		112,360		ベプチドリーム	—	8.4		49,812		
シーズ・ホールディングス	6		12.5		29,212		石油・石炭製品 (0.5%)						
ポーラ・オルビスホールディングス	8		6.9		63,204		昭和シェル石油	64.4	67.5		66,420		
エスデー	19.3		16.2		19,294		コスモ石油	200	—		—		
長谷川香料	14		14.7		24,534		ニチレキ	19	14.9		12,143		
小林製薬	11.5		9.9		96,030		東燃ゼネラル石油	105	101		98,576		
荒川化学工業	18.5		14.4		14,097		出光興産	33.9	35.5		69,580		
メック	18.1		19.3		16,791		J Xホールディングス	794.1	791.3		363,364		
JCU	2.1		1.5		5,820		コスモエネルギーホールディングス	—	20.4		26,683		
アース製薬	5.2		5.3		23,505		ゴム製品 (1.0%)						
イハラケミカル工業	19.6		19		26,961		横浜ゴム	78	41.2		75,066		
大成ラミック	7.7		5		15,275		東洋ゴム工業	32.2	31.1		54,145		
クミアイ化学工業	29		18.2		19,292		ブリヂストン	223.3	226.6		935,404		
日本農薬	17.8		23.3		13,747		住友ゴム工業	56.1	61.4		104,195		
日東電工	55.2		52.4		363,236		オカモト	54	29		26,390		
レック	18		15.3		20,410		ニッタ	8	9		26,550		
前澤化成工業	19.2		13.3		14,430		住友理工	18.5	21.5		20,575		
エフビコ	8		6.7		33,198		三ツ星ベルト	28	22		20,812		
天馬	13.7		10.6		20,744		バンドー化学	55	43		22,274		
信越ポリマー	40.9		32.7		20,339		ガラス・土石製品 (0.9%)						
ニフコ	16.1		13.1		71,788		日東紡績	61	63		23,814		
日本バルカー工業	77		74		21,682		旭硝子	352	350		216,650		
ユニ・チャーム	144.6		137.5		341,618		日本板硝子	344	334		27,722		
医薬品 (5.0%)							日本山村硝子	111	72		12,456		
協和発酵キリン	83		82		145,222		日本電気硝子	137	138		81,420		
武田薬品工業	266.7		267.3	1,441,816			住友大阪セメント	130	131		61,046		
アステラス製薬	809.6		750.5	1,159,522			太平洋セメント	445	433		121,673		
大日本住友製薬	51		51.4		67,179		日本ヒューム	25.9	17.9		10,793		
塩野義製薬	111.7		98.7		537,816		東海カーボン	87	77		20,405		
田辺三菱製薬	83.9		79.8		157,126		日本カーボン	96	73		17,666		
あすか製薬	17		17.8		23,941		東洋炭素	11.2	11.4		17,727		
日本新薬	15		16.1		65,446		ノリタケカンパニーリミテド	86	69		18,078		
中外製薬	71.4		67.8		229,842		TOTO	103	50.1		178,356		
科研製薬	24		12.1		78,045		日本碍子	90	84		173,712		
エーザイ	94.1		83.3		575,936		日本特殊陶業	61.7	56.2		118,750		
ロート製薬	32.7		33.4		70,066		MARUWA	4.6	1.8		5,108		
小野薬品工業	32.1		30.4		685,064		ニチアス	35	34		24,004		
久光製薬	20.2		19.8		99,594		ニチハ	19.7	18.3		31,530		
持田製薬	5.3		4.6		37,076		鉄鋼 (1.2%)						
参天製薬	26.2		120.3		200,419		新日鐵住金	3,013	303.3		667,866		
日本ケミファ	33		15		7,515		神戸製鋼所	1,241	1,264		133,984		
ツムラ	22.1		21.5		58,716		合同製鐵	109	77		15,015		
日医工	16.7		16.2		42,962		ジェイ エフ イー ホールディングス	181.8	186.9		288,386		
キッセイ薬品工業	13.4		12.3		31,881		日新製鋼	30.2	30.8		41,918		
生化学工業	17.1		17.9		27,476		東京製鐵	38.8	39.7		27,551		
鳥居薬品	5.9		8.7		23,063		共英製鋼	8.9	14.5		25,462		
東和薬品	4.1		3.1		15,469		大和工業	15.6	15.3		37,974		
沢井製薬	11.1		11.1		80,697		大阪製鐵	10.5	10.5		20,338		
ゼリア新薬工業	12.4		13.9		21,197		淀川製鋼所	61	9.5		23,854		
第一三共	240.4		226.3		590,303		東洋鋼板	40	47		15,228		
キョーリン製薬ホールディングス	19.7		19.3		41,668		丸一鋼管	21.4	23.2		75,400		

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	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
大同特殊鋼	119	109	44,690				アイダエンジニアリング	19.9	22.3	22,277			
山陽特殊製鋼	56	48	25,248				富士機械製造	8	27.4	32,715			
愛知製鋼	55	50	23,000				牧野フライス製作所	35	32	23,008			
日立金属	73	79.7	95,799				オーエスジー	32.4	31.4	65,594			
大太平洋金属	57	61	21,594				旭ダイヤモンド工業	19	24.1	25,353			
新日本電工	64.6	70.6	13,343				DMG森精機	44.5	38.4	40,742			
三菱製鋼	87	74	14,208				ディスコ	8.2	8.6	83,936			
シンニッタン	40.9	32.3	21,996				日東工器	10.2	10.2	22,287			
非鉄金属 (0.9%)							島精機製作所	13.6	12.9	24,484			
日本軽金属ホールディングス	186.3	163.9	31,796				日阪製作所	24.7	22.6	18,419			
三井金属鉱業	190	181	35,838				ナブテスコ	43.3	33.8	83,688			
東邦亜鉛	55	52	16,432				SMC	21.3	20.3	548,404			
三菱マテリアル	446	426	147,396				新川	34.6	26.2	14,043			
住友金属鉱山	196	187	233,563				ユニオンツール	6.4	5.2	15,220			
DOWAホールディングス	83	83	58,432				オイレス工業	9.9	10.5	18,889			
古河機械金属	135	132	24,024				サトーホールディングス	8.6	14.7	35,574			
大阪チタニウムテクノロジーズ	9.3	14.5	24,548				小松製作所	353.3	330.9	642,276			
UACJ	94	117	28,665				住友重機械工業	193	188	91,932			
古河電気工業	217	216	54,000				日立建機	32.2	31.2	57,408			
住友電気工業	268.3	268	367,294				巴工業	10.3	7.7	11,319			
フジクラ	97	90	51,210				井関農機	98	103	23,484			
タツタ電線	30.7	33.6	12,499				クボタ	344	323.3	498,851			
リョービ	67	63	28,476				月島機械	20.1	22.2	22,333			
アサヒホールディングス	12	15.6	24,570				帝国電機製作所	14.4	18.5	13,264			
金属製品 (0.7%)							新東工業	24.9	24.9	25,099			
トーカロ	10.9	9.1	19,801				小森コーポレーション	20.5	21.2	28,810			
SUMCO	49.7	54.8	41,812				住友精密工業	40	30	10,770			
東洋製織グループホールディングス	51.1	45.6	99,180				荏原製作所	148	149	74,351			
ホッパンホールディングス	41	33	10,329				西島製作所	23.4	20.4	21,420			
コロナ	20.1	17.8	19,491				ダイキン工業	98.7	92.8	776,272			
横河ブリッジホールディングス	16.1	21.1	24,834				オルガン	32	24	10,296			
駒井ハルテック	55	55	12,870				栗田工業	40.2	38.8	101,074			
三和ホールディングス	71	70.6	56,197				椿本チエイン	34	46	34,224			
文化シャッター	24	26.3	25,537				ダイフク	33.8	34.1	65,096			
三協立山	10.2	16.8	24,864				タダノ	31	27	28,728			
LIXILグループ	106.5	94.9	237,155				フジテック	20.4	20.4	23,133			
ノーリツ	14	13.6	25,228				CKD	24.9	24.3	23,328			
長府製作所	8.2	9.2	24,380				平和	14.9	19.6	47,804			
リンナイ	13.1	11.7	117,819				SANKYO	20.7	18.7	81,532			
日東精工	57	52	15,340				日本金銭機械	6.7	9.7	9,661			
東プレ	14.5	13.1	27,313				福島工業	9.5	8.9	22,116			
高周波熱錬	28.4	28.7	23,648				アマノ	22.6	21.3	36,337			
バイオラックス	4.2	3.9	22,698				サンデンホールディングス	41	56	19,768			
日本発條	62.3	64.9	70,805				グローリー	21.8	21	78,855			
三益半導体工業	17.4	17.3	17,853				大和冷機工業	30.7	29.9	29,660			
機械 (4.6%)							セガサミーホールディングス	73.9	70.8	92,110			
日本製鋼所	99	112	43,680				リケン	51	46	17,940			
三浦工業	32.1	31.9	62,555				ホンザキ電機	14.6	13.9	132,328			
タクマ	31	26	28,652				大豊工業	17.5	16.7	18,887			
ツガミ	28	17	7,378				日本精工	141	134.6	140,657			
オークマ	44	52	42,588				NTN	154	159	58,353			
東芝機械	50	68	24,344				ジェイテクト	72.5	66.8	99,398			
アマダホールディングス	107.2	98.3	109,702				不二越	62	54	22,302			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	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		千株	千円			千株	千株		千株	千円
日本トムソン	41		35		14,595		ミツミ電機	31.3		38.6		22,581	
T H K	45.4		44.3		89,884		タムラ製作所	58		41		12,628	
ユーシン精機	9.1		3.7		7,163		アルプス電気	53.9		55.1		116,426	
キッツ	38.9		44.7		23,020		パイオニア	104.8		120.3		32,240	
日立工機	26.9		29.5		22,715		日本電波工業	23.1		11.1		8,358	
マキタ	44.7		42.3		299,061		日本トリム	6.1		4.6		26,220	
日立造船	54.2		57		31,635		フォスター電機	8.2		11.1		26,295	
三菱重工業	1,140		1,152		500,544		S M K	48		27		16,146	
I H I	490		500		115,500		ヨコオ	30.7		26.6		14,656	
電気機器 (11.7%)							ホンデン	33.8		29.1		19,846	
日清紡ホールディングス	—		37.9		43,964		ヒロセ電機	10.9		10.3		132,767	
イビデン	44.3		41.5		58,307		日本航空電子工業	18		17		21,828	
コニカミノルタ	163.5		163.2		165,974		アルパイン	16.1		19		24,624	
ブラザー工業	88.8		85.9		115,191		アイコム	7.4		6.2		13,857	
ミネベア	100		104		95,264		船井電機	8.9		14.5		15,210	
日立製作所	1,633		1,636		874,932		横河電機	69.5		67.9		77,677	
東芝	1,433		1,332		278,121		アズビル	22.3		20.9		60,066	
三菱電機	680		689		818,876		日本光電工業	14.2		27.8		83,149	
富士電機	187		199		79,202		堀場製作所	12.7		11.6		48,836	
東洋電機製造	54		41		15,170		アドバンテクト	46.7		47.1		52,893	
安川電機	80.1		75.3		96,760		キーエンス	15.4		14.5		873,335	
明電舎	63		56		29,512		日置電機	13.4		9.5		23,474	
山洋電気	20		20		10,940		シスメックス	52.9		50.3		356,124	
東芝テック	47		58		25,868		メガチップス	15.9		16.8		22,512	
マブチモーター	20.7		17.3		91,344		O B A R A G R O U P	—		5.3		21,968	
日本電産	73.6		77.8		633,136		コーセル	17.6		15		17,025	
東光高岳	12.9		13.3		19,152		オプテックス	10.4		8.7		28,362	
ダイヘン	51		47		25,004		千代田インテグレ	10.4		7		17,710	
オムロン	73.7		73.5		249,532		スタンレー電気	48.4		46.5		115,506	
日東工業	11.9		16.1		28,947		ウシオ電機	42.3		41		64,657	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	129		121		57,959		日本セラミック	9.7		3.8		7,410	
メルコホールディングス	12.3		10.1		25,058		日本デジタル研究所	13.4		13.5		21,870	
日本電気	886		894		255,684		双信電機	30.1		33.3		9,290	
富士通	657		626		264,985		図研	19.6		12.3		14,993	
沖電気工業	241		311		50,382		日本電子	45		35		18,830	
サンケン電気	37		36		12,816		カシオ計算機	67.7		65.6		148,518	
アイホン	12.4		10.4		20,196		ファナック	70.7		65.6		1,164,072	
ルネサスエレクトロニクス	36.8		35.3		26,192		日本シイエムケイ	51.9		—		—	
セイコーエプソン	46.5		93.2		181,087		エンプラス	4.1		7.1		30,281	
ワコム	54.4		61.8		32,506		ローム	33.7		32.1		161,784	
アルバック	—		11.1		37,351		浜松トニクス	28.5		51		161,415	
E I Z O	9.7		9.4		27,194		三井ハイテック	28.5		24.5		16,537	
ジャパンディスプレイ	108.2		140.7		31,938		新光電気工業	27.5		30.7		20,292	
日本信号	21.9		23.7		22,301		京セラ	111.4		106.3		542,130	
能美防災	10.3		12.8		20,710		太陽誘電	35.7		34.6		40,620	
ホーチキ	15		10.8		14,731		村田製作所	71.2		67.2		967,344	
パナソニック	828.9		732.3		744,749		双葉電子工業	13.1		16.8		27,837	
シャープ	582		523		67,467		ニチコン	28.5		27.8		22,601	
アンリツ	44.6		42		29,190		日本ケミコン	81		105		17,640	
富士通ゼネラル	18		18		30,726		K O A	7.1		14.4		12,844	
日立国際電気	15		19.5		25,447		小糸製作所	40.3		38		190,760	
ソニー	443.9		452		1,327,524		ミツバ	13.5		17		29,325	
T D K	41.2		39.1		268,226		スター精密	15.1		17.2		20,898	

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株		千株	千円
SCREENホールディングス	61	64	52,160			
キャノン電子	5.3	10.7	18,457			
キャノン	394.1	345.2	1,158,491			
リコー	206.4	208.7	242,300			
東京エレクトロン	57.1	53.1	382,373			
輸送用機器 (9.8%)						
トヨタ紡織	25.1	24.7	43,941			
ユニプレス	12.7	13.9	27,549			
豊田自動織機	62.2	59.1	294,909			
モリタホールディングス	19.7	21.1	28,801			
デンソー	168	157.7	704,761			
東海理化電機製作所	18	20	41,760			
三井造船	263	250	44,000			
川崎重工業	498	508	167,132			
日本車輛製造	60	59	16,697			
近畿車輛	55	49	16,905			
日産自動車	954.3	900.4	974,232			
いすゞ自動車	214	188.3	220,405			
トヨタ自動車	937.4	797.4	4,862,545			
日野自動車	97.1	90.5	114,573			
三菱自動車工業	248.7	246.9	207,396			
武蔵精密工業	8.3	11.6	25,624			
日産車体	29.9	31.2	35,755			
新明和工業	27	28	23,016			
極東開発工業	14	21.1	24,201			
日信工業	15	19.7	30,180			
トビー工業	107	98	24,010			
ティラド	96	89	17,088			
曙ブレーキ工業	50.8	53.8	14,687			
NOK	32.8	31.2	60,902			
フタバ産業	37.1	40.4	19,432			
KYB	73	77	25,487			
プレス工業	53	58.6	24,260			
カルソニックカンセイ	50	52	40,768			
ケーヒン	16	16.1	26,323			
アイシン精機	62.7	65.3	283,728			
マツダ	203	204.4	347,991			
ダイハツ工業	81.7	74.1	117,744			
今仙電機製作所	13.2	14.7	14,832			
本田技研工業	611.4	576.9	1,786,082			
スズキ	142.2	135.8	404,819			
富士重工業	231.1	202.5	800,482			
ヤマハ発動機	104.2	92.2	168,541			
ショーワ	20.5	22.2	21,556			
エクセディ	9	8.9	21,742			
豊田合成	21.8	23.5	50,760			
愛三工業	21.9	21.3	19,425			
ヨロズ	7.9	10.7	25,851			
エフ・シー・シー	12.2	12.8	24,908			
シマノ	29.4	26.1	480,240			
タカタ	14.8	—	—			
ティ・エス テック	14.3	14.4	37,526			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株		千株	千円
精密機器 (1.6%)						
テルモ	104.2	99.4	408,037			
クリエートメディック	21.9	20.2	17,654			
日機装	21.3	27.9	22,431			
島津製作所	79	83	144,171			
東京精密	11.6	13.4	28,984			
ニコン	127.8	116.7	209,826			
トプコン	20	21	31,059			
オリンパス	100.7	96.5	426,047			
理研計器	19.3	17	18,139			
タムロン	7.9	7.8	15,007			
HOYA	161.9	148.6	658,595			
ノーリツ鋼機	29.8	—	—			
シチズンホールディングス	83.7	83.7	53,902			
セイコーホールディングス	19	54	24,246			
ニプロ	44.2	49.4	55,081			
その他製品 (1.6%)						
パラマウントベッドホールディングス	7.2	7.3	31,463			
バンダイナムコホールディングス	75	67.6	166,634			
パイロットコーポレーション	5.8	10.6	44,785			
トッパン・フォームズ	15.1	22.5	28,485			
フジシールインターナショナル	8.1	8	31,440			
タカラトミー	35	35.6	31,150			
タカノ	30.6	28	17,948			
大建工業	75	62	18,538			
凸版印刷	197	184	179,952			
大日本印刷	211	188	198,528			
日本写真印刷	11.9	17.5	31,412			
アシックス	68.3	58.3	123,770			
小松ウオール工業	8.1	4.7	9,052			
ヤマハ	50.6	47.7	168,142			
クリナップ	18.1	19.9	15,760			
ビジョン	12.8	34.4	94,668			
キングジム	30.9	24.7	20,377			
リンテック	15.6	16.1	34,631			
イトーキ	35.5	35	27,335			
任天堂	41.9	39.3	649,039			
三菱鉛筆	6.5	6.2	29,109			
タカラスタンダード	28	25	26,600			
コクヨ	37.4	35.2	44,211			
岡村製作所	30.4	30.6	32,191			
美津濃	40	39	21,723			
アデランス	15.3	22.1	14,099			
電気・ガス業 (2.1%)						
東京電力	579.4	551.3	321,959			
中部電力	209.6	198.4	302,659			
関西電力	276.6	264.9	257,350			
中国電力	94.5	90.5	135,931			
北陸電力	67.5	60.6	94,778			
東北電力	171.6	157.9	226,744			
四国電力	61.8	59.5	87,167			
九州電力	150.3	144.7	149,909			
北海道電力	64.2	61.3	57,499			

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
		千株	千株	千円
沖縄電力	4.9	9.6	27,360	
電源開発	46.5	53.8	184,534	
東京瓦斯	828	723	370,899	
大阪瓦斯	707	672	283,113	
東邦瓦斯	174	153	118,881	
北海道瓦斯	83	66	18,480	
西部瓦斯	94	98	26,656	
静岡ガス	29.2	32.5	25,187	
陸運業 (4.5%)				
東武鉄道	366	340	191,420	
相鉄ホールディングス	113	107	73,081	
東京急行電鉄	372	377	348,725	
京浜急行電鉄	188	177	173,106	
小田急電鉄	217	207	253,368	
京王電鉄	191	182	177,996	
京成電鉄	100	97	148,022	
東日本旅客鉄道	124.6	117.1	1,193,834	
西日本旅客鉄道	65.4	62.3	432,050	
東海旅客鉄道	60.7	57.5	1,154,600	
西武ホールディングス	54.1	52.8	121,017	
西日本鉄道	84	81	61,155	
近鉄グループホールディングス	689	653	299,727	
阪急阪神ホールディングス	457	433	301,801	
南海電気鉄道	152	142	87,188	
京阪電気鉄道	152	143	113,113	
名糖運輸	28.5	—	—	
名古屋鉄道	248	221	115,362	
日本通運	272	244	126,148	
ヤマトホールディングス	120	117.2	274,130	
山九	79	84	42,504	
丸運	45	50.8	13,055	
センコー	36	39	26,520	
トナミホールディングス	58	45	13,050	
ニッコンホールディングス	22.5	22.3	46,673	
日本石油輸送	74	74	17,686	
福山通運	38	37	21,127	
セイノーホールディングス	51.9	45.9	54,299	
日立物流	15.1	13.3	23,062	
C&Fロジホールディングス	—	14.5	12,876	
海運業 (0.2%)				
日本郵船	581	588	134,064	
商船三井	356	324	78,732	
川崎汽船	295	285	63,840	
飯野海運	36.6	36	16,992	
空運業 (0.7%)				
日本航空	130.6	123.9	513,441	
ANAホールディングス	1,341	1,203	393,621	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	44	42	63,756	
三井倉庫ホールディングス	53	61	18,971	
住友倉庫	49	54	31,104	
東陽倉庫	79	76	18,544	
安田倉庫	18.3	19.1	13,885	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
		千株	千株	千円
上組	80	75	78,975	
キムラユニティ	15.7	11.4	13,509	
キユーソー流通システム	16.1	4	9,828	
郵船ロジスティクス	16.8	17.4	22,950	
近鉄エクスプレス	6.3	17.3	27,385	
情報・通信業 (8.2%)				
NECネットエスアイ	9.1	13.4	24,669	
新日鉄住金ソリューションズ	6.5	14.1	31,302	
I Tホールディングス	22.4	21.3	55,401	
グリー	38.9	43.7	25,695	
コーエーテックモホールディングス	15	18.4	33,782	
ネクソン	64.9	59.5	111,919	
コプロ	11.9	18.3	43,224	
ティーガイア	16.5	18.3	26,077	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	120.4	35,999	
GMOペイメントゲートウェイ	—	5.4	39,960	
ザッパラス	26.7	29.7	11,820	
インターネットイニシアティブ	10.8	12.5	30,012	
バナソニック インフォメーションシステムズ	6.7	—	—	
野村総合研究所	38.3	45.1	182,204	
フジ・メディア・ホールディングス	70.5	70	92,190	
オービック	23	21.4	125,404	
ヤフー	486.4	452.3	217,556	
トレンドマイクロ	35.8	31.3	136,311	
日本オラクル	10.6	9.8	60,270	
フューチャアークテクト	30.9	24.2	20,860	
C A C H o l d i n g s	12.8	15.9	13,069	
ソフトバンク・テクノロジー	14.3	14.6	22,323	
伊藤忠テクノソリューションズ	7.6	14.5	32,422	
大塚商会	17.8	17.2	97,696	
サイボウズ	61.1	63.2	21,298	
電通国際情報サービス	17.9	10.8	24,591	
ウェザーニューズ	6.6	4.4	17,270	
ネットワンシステムズ	38	35.1	22,569	
アルゴグラフィックス	8.1	7	12,215	
エイベックス・グループ・ホールディングス	13.6	16.8	23,822	
日本ユニシス	27.7	20.8	29,348	
兼松エレクトロニクス	12.6	10.4	20,020	
東京放送ホールディングス	39.6	39.4	70,723	
日本テレビホールディングス	62.1	56.3	105,787	
テレビ朝日ホールディングス	18.8	18.9	39,047	
スカパーJ S A Tホールディングス	52.8	55	36,630	
テレビ東京ホールディングス	10.4	10.9	21,854	
日本電信電話	262.4	489.1	2,431,805	
K D D I	227.2	644	2,007,992	
光通信	6.6	7.9	67,387	
N T T ドコモ	552.9	487.1	1,273,035	
GMOインターネット	23.5	22.9	32,380	
カドカワ	17.6	19.5	33,208	
ゼンリン	13.9	16.2	34,020	
松竹	43	45	45,855	
東宝	48.1	46.2	137,722	
東映	39	32	29,088	

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株			千円
エヌ・ティ・ティ・データ	41.5	38.5	213,290			
D T S	7.6	10.9	23,413			
スクウェア・エニックス・ホールディングス	24.4	26.7	79,752			
カプコン	18	17.4	47,258			
S C S K	15.8	14.7	62,107			
アイネクス	23.3	14.5	16,544			
T K C	10.3	9.3	29,109			
富士ソフト	10.3	9.8	23,647			
NSD	17.9	15.2	26,113			
コナミホールディングス	26.7	28.5	87,352			
ソフトバンクグループ	354.6	359.1	2,022,451			
卸売業 (4.3%)						
伊藤忠食品	5.5	4.1	17,855			
エレマテック	8.1	6.1	14,097			
J A L U X	11.5	4.9	11,250			
双日	452.8	422.7	102,293			
アルフレッサ ホールディングス	80.1	80.9	178,708			
横浜冷凍	22.3	25.8	27,657			
あい ホールディングス	11.5	12.9	39,925			
マクニカ・富士エレホールディングス	—	22.4	32,166			
U K Cホールディングス	12.1	10.1	23,937			
シップヘルスケアホールディングス	11.8	13.8	41,814			
エコートレーディング	16	17.3	10,224			
ナガイレーベン	10.6	11	24,178			
三菱食品	8.7	9	26,523			
松田産業	16.8	13.2	16,856			
第一興商	—	11.6	54,404			
メディバルホールディングス	67.3	61.7	111,800			
アドヴァン	13.5	22.3	23,526			
ドウシシャ	9.6	11.8	26,679			
黒田電気	14.3	13.8	24,094			
丸文	24.4	21.6	17,280			
ガリバーインターナショナル	28.3	30.4	38,942			
進和	17.5	7.5	11,235			
オーハシテクニカ	14.9	14	17,500			
マクニカ	5.1	—	—			
白銅	15.4	11.6	13,177			
伊藤忠商事	561.9	497.7	718,678			
丸紅	587.7	628	387,664			
長瀬産業	41.4	40.9	52,392			
豊田通商	75.3	69.3	183,645			
兼松	150	165	27,555			
三井物産	569.6	573.5	813,796			
日本紙パルプ商事	74	72	24,192			
日立ハイテクロジーズ	23.2	21.5	67,295			
山善	32.2	28.6	26,369			
住友商事	397.6	398.3	482,142			
内田洋行	53	38	16,264			
三菱商事	513.3	474.8	973,340			
キャノンマーケティングジャパン	19.2	19.2	39,168			
西華産業	89	60	14,460			
菱洋エレクトロ	19.8	17.7	24,018			
東京産業	53.6	48	20,880			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株			千円
阪和興業	67	58	28,246			
菱電商事	27	17	11,254			
岩谷産業	75	75	48,600			
イワキ	91	85	16,235			
三菱石油	20	19	16,587			
稲畑産業	25.2	25.2	29,232			
東邦ホールディングス	23.7	21.1	50,492			
サンゲツ	11.8	22.8	49,156			
シナネンホールディングス	45	29	13,456			
伊藤忠エネクス	29.9	27.7	25,761			
サンリオ	19.8	20.6	48,142			
リョーサン	10.7	10	30,600			
モスフードサービス	9.7	13	40,400			
加賀電子	16.3	13.7	21,193			
立花エレテック	14.3	14.5	17,820			
トラスコ中山	10.2	8.7	38,323			
オートバックスセブン	24.4	24.7	48,165			
加藤産業	9.9	8.5	25,296			
イノテック	32	33.4	15,063			
富士エレクトロニクス	14.3	—	—			
杉本商事	21.3	10.4	13,260			
因幡電機産業	9.7	9.1	33,033			
ミスミグループ本社	25.3	69.3	113,721			
スズケン	27.6	29.7	116,127			
ジェコス	10.4	10.3	11,484			
小売業 (4.8%)						
ローソン	25.6	24.3	229,878			
エービーシー・マート	9.3	8.6	60,630			
ハードオフコーポレーション	21.4	10.8	17,366			
アスクル	7.3	8.1	36,450			
ゲオホールディングス	20.6	20.3	40,173			
アダストリア	8.2	12.2	39,955			
エディオン	33.8	32.9	29,050			
あみやき亭	5.2	4.4	19,866			
ハニーズ	21.6	12.4	15,723			
ビックカメラ	28.5	32.1	32,324			
D C Mホールディングス	37.7	38.8	32,320			
M o n o t a R O	13	23.2	74,008			
J・フロント リテイリング	84.8	77.9	109,683			
ドトール・日レスホールディングス	13.2	20.6	38,789			
マツモトキヨシホールディングス	14.8	13.8	79,350			
スタートトゥデイ	21.3	18.5	81,585			
ココカラファイン	7.6	6.2	30,070			
三越伊勢丹ホールディングス	134.7	123.1	165,446			
ウエルシアホールディングス	—	5.2	33,176			
すかいらーく	25.8	22.3	33,450			
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20.6	24.9	26,244			
ブックオフコーポレーション	23.7	24.6	22,951			
あさひ	14.4	8.9	12,807			
コスモス薬品	3.4	2.9	54,955			
セブン&アイ・ホールディングス	280.7	264.4	1,258,015			
ツルハホールディングス	14.2	14.6	160,162			
サンマルクホールディングス	2.9	9.5	30,067			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	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		千株	千円			千株	千株		千株	千円
クスリのアオキ	—		6.3		37,674		ヤマザワ	7.9		8.1		14,004	
ライトオン	28.7		13.8		24,840		ペルーナ	50.5		42.6		24,324	
良品計画	8.1		7.3		163,812		銀行業 (7.8%)						
三城ホールディングス	35.7		37.6		17,521		東京TYフィナンシャルグループ	9.6		8.2		24,280	
ワタミ	19.5		—		—		九州フィナンシャルグループ	—		99.7		68,693	
ドンキホーテホールディングス	21.8		41.7		167,425		ゆうちょ銀行	—		124		176,328	
西松屋チェーン	17.8		24		26,448		新生銀行	641		571		86,221	
ゼンショーホールディングス	37.1		36.3		52,017		あおぞら銀行	453		407		161,986	
サイゼリヤ	14.7		12.9		30,689		三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,378.5		5,074.2		2,806,032	
ユナイテッドアローズ	9		8.8		41,976		りそなホールディングス	786.1		742		304,442	
京都市もの友禅	21		22		20,284		三井住友トラスト・ホールディングス	1,486		1,334		456,094	
コロワイド	23.4		23.7		42,991		三井住友フィナンシャルグループ	507.1		506.9		1,829,402	
壺番屋	3.7		5.2		34,892		第四銀行	83		74		30,192	
スギホールディングス	12		11		65,780		北越銀行	115		97		19,109	
スクロール	54.5		56.9		24,467		西日本シティ銀行	232		208		43,472	
ファミリーマート	22.9		19.9		114,624		千葉銀行	258		247		138,073	
木曽路	13.2		13.8		31,712		横浜銀行	465		430		229,835	
千趣会	26.2		25.5		18,717		常陽銀行	243		232		96,048	
ケーヨー	43		28.5		14,449		群馬銀行	156		144		73,584	
上新電機	20		24		21,720		武蔵野銀行	10.5		9.5		28,319	
日本瓦斯	8.6		12		30,276		千葉興業銀行	23.2		31.1		16,420	
島忠	16.1		16.3		43,635		七十七銀行	111		99		39,996	
チョダ	8.3		10		31,400		青森銀行	81		61		21,350	
ライフコーポレーション	12.3		6.6		18,209		秋田銀行	72		68		21,420	
AOKIホールディングス	16		19		26,524		山形銀行	45		47		21,056	
オークワ	25		16		16,560		岩手銀行	4.3		5.4		23,463	
コメリ	11.6		11.9		28,548		東邦銀行	63		66		24,420	
青山商事	16.5		12.2		53,131		東北銀行	103		57		8,151	
しまむら	7.8		7.3		94,973		ふくおかフィナンシャルグループ	271		275		106,975	
高島屋	97		90		82,620		静岡銀行	196		186		158,844	
松屋	14.9		26		25,844		十六銀行	81		74		25,678	
エイチ・ツー・オー リテイリング	32.1		33.4		65,196		スルガ銀行	71		60.7		121,400	
ニッセンホールディングス	68.1		78.8		10,953		八十二銀行	121		116		60,784	
バルコ	25.6		12.4		11,333		山梨中央銀行	45		49		21,903	
丸井グループ	81.4		75		119,400		大垣共立銀行	88		86		30,788	
イオン	277.8		259.9		416,619		福井銀行	92		93		19,716	
ユニグループ・ホールディングス	64.9		66.1		52,020		北國銀行	74		83		26,228	
イズミ	15		13.4		64,990		滋賀銀行	66		56		27,496	
平和堂	14.1		13		31,252		南都銀行	64		73		23,141	
フジ	8.5		9		20,610		百五銀行	63		51		22,797	
ヤオコー	3.8		6.8		32,708		京都銀行	128		122		92,720	
ゼビオホールディングス	9.6		14		26,922		紀陽銀行	26.1		25.7		34,746	
ケーズホールディングス	15.1		13.9		53,515		三重銀行	72		70		14,840	
アインホールディングス	7.9		7.9		45,267		ほくほくフィナンシャルグループ	462		444		73,704	
ヤマダ電機	268.8		198		113,850		広島銀行	195		188		81,592	
ニトリホールディングス	29		27.8		262,432		山陰合同銀行	40		36.7		27,855	
グルメ杵屋	22		15		15,495		中国銀行	48.9		45.4		55,161	
吉野家ホールディングス	18.8		24.2		32,766		鳥取銀行	81		59		10,443	
プレナス	8.8		14.5		29,565		伊予銀行	72.6		70.3		54,482	
アークス	12.1		12.3		31,918		百十四銀行	77		71		23,643	
パローホールディングス	14.5		13.6		39,072		四国銀行	88		92		21,252	
ファーストリテイリング	13.4		12.7		452,882		阿波銀行	52		44		24,772	
サンドラッグ	14.3		13.2		109,032		鹿児島銀行	47		—		—	

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	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		千株	千円			千株	千株		千円	
大分銀行	70	51	18,972				アイフル	116.5	113.1	44,561			
宮崎銀行	65	69	20,286				リコーリース	6.6	6.6	21,714			
肥後銀行	55	—	—				イオンフィナンシャルサービス	43.7	40.2	108,982			
佐賀銀行	92	86	19,522				アコム	135.2	134.1	73,620			
十八銀行	66	64	16,960				オリエントコーポレーション	169.7	288.6	64,646			
沖縄銀行	5.3	5.2	19,812				日立キャピタル	12.8	14.2	35,727			
琉球銀行	13.3	18.5	24,235				オリックス	475.8	451.3	733,136			
セブン銀行	228.2	243.2	114,060				三菱UFJリース	172.7	165.4	84,354			
みずほフィナンシャルグループ	9,291.4	8,911.2	1,595,995				日本取引所グループ	99.1	188.9	340,020			
山口フィナンシャルグループ	67	56	59,360				NECキャピタルソリューション	8	7.1	11,814			
長野銀行	89	48	9,072				不動産業 (2.8%)						
名古屋銀行	68	58	22,620				ヒューリック	113.4	134.9	141,105			
北洋銀行	100.2	99	29,898				野村不動産ホールディングス	40.1	42.8	90,950			
愛知銀行	3.5	3.6	18,180				東急不動産ホールディングス	175.9	154.8	117,957			
第三銀行	88	33	5,280				飯田グループホールディングス	42.9	55.7	123,097			
中京銀行	97	55	10,890				パーク24	34.7	32.6	96,496			
東日本銀行	74	57	16,416				三井不動産	355	335	934,817			
愛媛銀行	99	98	23,912				三菱地所	499	472	1,031,084			
トマト銀行	98	69	10,350				平和不動産	14.1	17.4	25,021			
京葉銀行	56	58	25,462				東京建物	148	66.9	95,064			
関西アーバン銀行	10.7	14.9	17,298				ダイビル	20	22	21,010			
栃木銀行	54	45	21,555				京阪神ビルディング	30.6	32.1	19,998			
北日本銀行	5.8	2.5	7,550				住友不動産	160	152	497,344			
トモニホールディングス	58	62.2	22,143				大京	128	138	25,530			
フィデアホールディングス	114.8	71.9	13,445				テーオーシー	34.4	27.5	26,565			
池田泉州ホールディングス	55.4	65.2	27,644				東京薬天地	41	25	12,175			
証券、商品先物取引業 (1.1%)							レオパレス21	75.5	78.9	52,863			
SBIホールディングス	80.3	80.5	94,426				スターツコーポレーション	9.5	9.9	24,948			
ジャフコ	9.1	10.6	37,471				空港施設	31.5	25	12,850			
大和証券グループ本社	628	598	421,410				住友不動産販売	5.9	7.8	17,807			
野村ホールディングス	1,373.5	1,212.2	631,677				ゴールドクレスト	6.7	12	20,928			
岡三証券グループ	56	47	29,751				日本エスリード	15.7	16.2	18,225			
丸三証券	26.2	—	—				サンヨーハウジング名古屋	14.9	13.5	13,581			
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	76.3	78.9	51,679				イオンモール	43.7	41.7	70,473			
いちよし証券	16.8	18.4	19,209				エヌ・ティ・ティ都市開発	41.7	42.3	47,037			
松井証券	34.9	35.9	36,618				日本空港ビルデング	23.6	21.4	87,954			
マネックスグループ	80.7	85.6	26,964				サービス業 (3.7%)						
カブドットコム証券	42.9	66.6	25,174				日本M&Aセンター	10.7	10.1	62,418			
保険業 (2.3%)							アコーディア・ゴルフ	28.2	33.3	35,764			
かんぽ生命保険	—	19.7	52,973				パソナグループ	38.4	23.3	19,292			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	149.1	141.9	449,964				テンブホールディングス	14.8	49	76,930			
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	213.5	187.9	570,276				クックパッド	—	16	34,368			
ソニーフィナンシャルホールディングス	65	58.8	91,963				スタジオアリス	10.7	7.9	19,671			
第一生命保険	430.5	406.8	558,129				シミックホールディングス	11.2	10.7	15,429			
東京海上ホールディングス	275.6	257.2	1,002,308				総合警備保障	24.5	22.8	137,484			
T&Dホールディングス	243.8	221.7	235,888				カクコム	47.9	45.5	99,690			
その他金融業 (1.4%)							エムスリー	61.4	59.1	161,993			
全国保証	17.4	16.2	61,479				ディー・エヌ・エー	35.1	31.5	61,645			
クレディセゾン	55.2	45.4	93,024				博報堂DYホールディングス	98.8	92.2	115,434			
芙蓉総合リース	7.4	7.1	33,938				ぐるなび	12.3	11.4	29,275			
興銀リース	13	13	26,728				ファンコミュニケーションズ	13.5	26.8	21,842			
東京センチュリーリース	15.6	15.2	62,016				EPSホールディングス	20.1	19.8	28,452			
日本証券金融	39.4	37.4	17,802				ドリームインキュベータ	8.6	7.7	19,265			

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
ケネディクス	104.8	100.8	49,896	
電通	79.4	75.4	419,224	
みらかホールディングス	18.9	16.8	79,884	
日本空調サービス	28.4	18.9	21,791	
オリエンタルランド	19.2	72.7	584,944	
ダスキン	21.5	20.6	43,816	
秀英予備校	23.5	—	—	
リゾートトラスト	26.3	28.3	71,683	
ビー・エム・エル	4.8	6.8	31,586	
りらいあコミュニケーションズ	17.4	23.9	23,350	
ユー・エス・エス	88.2	82.7	151,010	
サイバーエージェント	12.7	16.4	82,328	
楽天	309.4	316.9	336,072	
テクノプロ・ホールディングス	—	11.3	36,273	
リクルートホールディングス	80.7	136.4	467,170	
日本郵政	—	146.4	223,260	
リロ・ホールディング	—	2.6	38,038	
エイチ・アイ・エス	12.5	11.5	37,547	
共立メンテナンス	4.1	5.3	47,859	
建設技術研究所	11	13.9	13,344	
よみうりランド	33	35	17,080	
東京都競馬	79	99	22,176	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
カナモト	9.9	10	27,110	
東京ドーム	56	56	28,784	
トランス・コスモス	10.1	7.9	21,480	
乃村工務社	21.2	18.8	30,324	
日本管財	8.3	16.2	29,484	
白洋舎	89	86	22,360	
セコム	69	69.4	591,288	
セントラル警備保障	17.6	13.4	31,409	
メイテック	10	9.1	37,401	
アサツー ディ・ケイ	13.4	12.3	36,678	
応用地質	9	14.5	17,356	
ベネッセホールディングス	26.5	23.5	81,897	
イオンディライト	8.9	9.9	36,630	
ニチイ学館	14.8	18.7	15,034	
ダイセキ	11.7	16.9	32,194	
合 計	株 数 ・ 金 額	111,599	104,674	129,866,191
	銘柄数<比率>	1,031	1,035	<98.5%>

(注) 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です。

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		2,074	—

○投資信託財産の構成

(2016年3月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
	129,866,191	97.2
コール・ローン等、その他	3,721,063	2.8
投資信託財産総額	133,587,254	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	134,467,632,639
コール・ローン等	3,504,319,448
株式(評価額)	129,866,191,520
未収入金	15,759,680
未収配当金	165,895,987
未収利息	4
差入委託証拠金	915,466,000
(B) 負債	2,565,485,248
未払金	1,331,107,939
未払解約金	351,877,309
差入委託証拠金代用有価証券	882,500,000
(C) 純資産総額(A-B)	131,902,147,391
元本	126,460,855,200
次期繰越損益金	5,441,292,191
(D) 受益権総口数	126,460,855,200口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,430円

(注) 当親ファンドの期首元本額は136,898,858,294円、期中追加設定元本額は58,023,385,786円、期中一部解約元本額は68,461,388,880円です。

(元本の内訳)

TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	52,452,832,887円
東京海上・TOPIXインデックスファンド<適格機関投資家限定>	42,382,857,561円
東京海上セレクション・日本株TOPIX	16,424,835,433円
TMA世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	11,874,144,849円
TMA世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	2,706,739,898円
東京海上日本株TOPIXファンド	486,922,280円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	47,447,575円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	35,780,161円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	27,191,353円
TMA資産分散型バランスVA (適格機関投資家限定)	9,541,928円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	6,152,284円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	4,108,637円
TMA債券重視型バランスVA (適格機関投資家限定)	2,057,173円
TMA新興国重視型バランスVA (適格機関投資家限定)	243,181円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1,0430円です。

○損益の状況 (2015年3月21日～2016年3月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,550,296,171
受取配当金	2,546,876,793
受取利息	1,267,798
その他収益金	2,151,580
(B) 有価証券売買損益	△14,245,553,214
売買益	6,528,377,797
売買損	△20,773,931,011
(C) 先物取引等取引損益	△ 14,907,560
取引益	981,450,920
取引損	△ 996,358,480
(D) 当期損益金(A+B+C)	△11,710,164,603
(E) 前期繰越損益金	24,657,193,186
(F) 追加信託差損益金	4,920,391,806
(G) 解約差損益金	△12,426,128,198
(H) 計(D+E+F+G)	5,441,292,191
次期繰越損益金(H)	5,441,292,191

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (G)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

○お知らせ

2015年8月29日付で、信用リスクを適正に管理するため、所要の約款変更を行いました。