

■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/内外/資産複合
信託期間	無期限（設定日：2001年3月13日）
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本を含む世界各国の株式および公社債に投資し、各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。 ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。
主要投資対象	各ベビーファンドは以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 SMAM・国内株式バシッブ・ファンド（適格機関投資家専用） 日本の株式 SMAM・年金国内債券バシッブファンド<適格機関投資家限定> 日本の公社債 SMAM・外国株式バシッブ・ファンド（適格機関投資家専用） 日本を除く世界各国の株式 SMAM・年金外国債券バシッブ・ファンド<適格機関投資家限定> 日本を除く世界各国の債券 SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定> 円貨建ての短期公社債および短期金融商品
当ファンドの運用方法	■投資信託証券への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います（グローバル・バランス型ファンド）。 ■各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。 ※各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。 <2010>・・・西暦2010年 <2020>・・・西暦2020年 <2030>・・・西暦2030年 <2040>・・・西暦2040年
組入制限	■外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	■年1回（原則として毎年12月20日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;">ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)</div>

三井住友・ DC年金プラン・ファンド (ターゲット・イヤー型) 2010/2020/2030/2040

【運用報告書(全体版)】

(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

第 20 期

決算日 2020年12月21日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

各ファンドは投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本を含む世界各国の株式および公社債に投資し、各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

■最近5期の運用実績

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

決算期	基準価額 (分配落)			投資信託証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%		
16期(2016年12月20日)	12,457	0	0.9	99.7	553
17期(2017年12月20日)	12,663	0	1.7	99.7	527
18期(2018年12月20日)	12,491	0	△1.4	99.8	504
19期(2019年12月20日)	12,755	0	2.1	99.4	463
20期(2020年12月21日)	12,864	0	0.9	99.6	432

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

決算期	基準価額 (分配落)			投資信託証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%		
16期(2016年12月20日)	14,620	0	1.6	99.8	1,350
17期(2017年12月20日)	15,080	0	3.1	99.7	1,407
18期(2018年12月20日)	14,809	0	△1.8	99.9	1,344
19期(2019年12月20日)	15,214	0	2.7	99.5	1,307
20期(2020年12月21日)	15,337	0	0.8	97.8	1,170

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

決算期	基準価額 (分配落)			投資信託証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%		
16期(2016年12月20日)	15,465	0	2.1	99.8	1,379
17期(2017年12月20日)	16,512	0	6.8	99.8	1,688
18期(2018年12月20日)	15,856	0	△4.0	99.9	1,655
19期(2019年12月20日)	16,885	0	6.5	99.5	1,846
20期(2020年12月21日)	17,371	0	2.9	99.7	1,887

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

決算期	基準価額 (分配落)			投資信託証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%		
16期(2016年12月20日)	16,160	0	2.7	99.8	2,076
17期(2017年12月20日)	17,845	0	10.4	99.8	2,421
18期(2018年12月20日)	16,732	0	△6.2	100.0	2,468
19期(2019年12月20日)	18,299	0	9.4	99.6	2,887
20期(2020年12月21日)	19,072	0	4.2	99.8	3,010

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※各ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載していません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首)	円	%	%
2019年12月20日	12,755	—	99.4
12月末	12,766	0.1	99.1
2020年1月末	12,770	0.1	99.5
2月末	12,697	△0.5	99.4
3月末	12,550	△1.6	98.9
4月末	12,608	△1.2	99.4
5月末	12,678	△0.6	99.7
6月末	12,671	△0.7	99.5
7月末	12,695	△0.5	99.5
8月末	12,739	△0.1	99.7
9月末	12,753	△0.0	99.7
10月末	12,703	△0.4	99.7
11月末	12,841	0.7	99.7
(期 末)			
2020年12月21日	12,864	0.9	99.6

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首)	円	%	%
2019年12月20日	15,214	—	99.5
12月末	15,228	0.1	100.6
2020年1月末	15,237	0.2	99.7
2月末	15,147	△0.4	99.1
3月末	14,931	△1.9	99.4
4月末	15,003	△1.4	99.6
5月末	15,097	△0.8	99.9
6月末	15,081	△0.9	99.8
7月末	15,112	△0.7	99.7
8月末	15,163	△0.3	99.8
9月末	15,193	△0.1	99.9
10月末	15,122	△0.6	99.9
11月末	15,306	0.6	99.7
(期 末)			
2020年12月21日	15,337	0.8	97.8

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首)	円	%	%
2019年12月20日	16,885	—	99.5
12月末	16,924	0.2	99.1
2020年1月末	16,886	0.0	99.6
2月末	16,582	△1.8	99.3
3月末	16,048	△5.0	99.5
4月末	16,240	△3.8	99.6
5月末	16,567	△1.9	99.8
6月末	16,548	△2.0	99.7
7月末	16,619	△1.6	99.5
8月末	16,838	△0.3	99.7
9月末	16,918	0.2	99.6
10月末	16,737	△0.9	99.8
11月末	17,298	2.4	100.0
(期 末)			
2020年12月21日	17,371	2.9	99.7

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首)	円	%	%
2019年12月20日	18,299	—	99.6
12月末	18,345	0.3	99.2
2020年1月末	18,190	△0.6	99.8
2月末	17,608	△3.8	99.1
3月末	16,741	△8.5	99.3
4月末	17,044	△6.9	99.8
5月末	17,648	△3.6	100.0
6月末	17,609	△3.8	99.7
7月末	17,686	△3.3	99.7
8月末	18,119	△1.0	99.6
9月末	18,270	△0.2	99.6
10月末	17,977	△1.8	99.9
11月末	18,967	3.7	100.0
(期 末)			
2020年12月21日	19,072	4.2	99.8

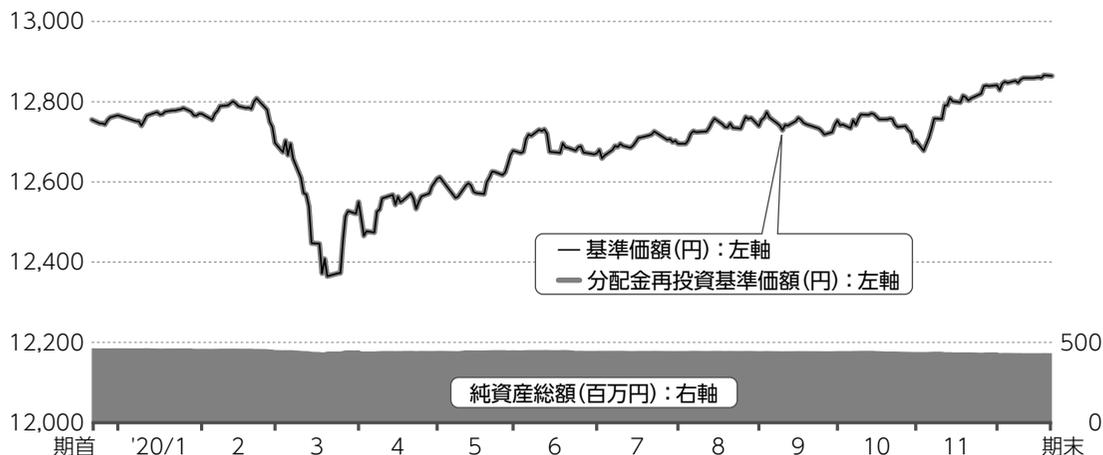
※騰落率は期首比です。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	12,755円
期末	12,864円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+0.9% (分配金再投資ベース)

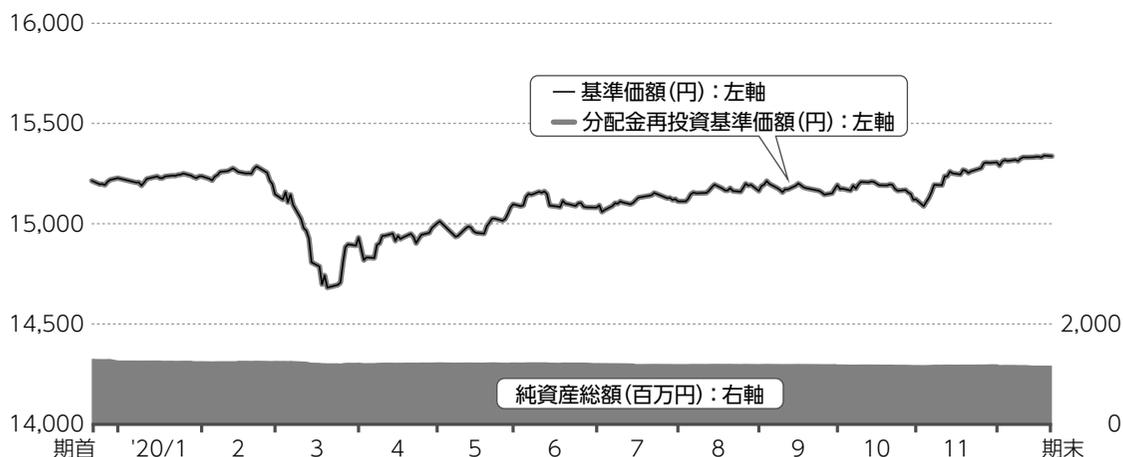
分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	15,214円
期末	15,337円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+0.8% (分配金再投資ベース)

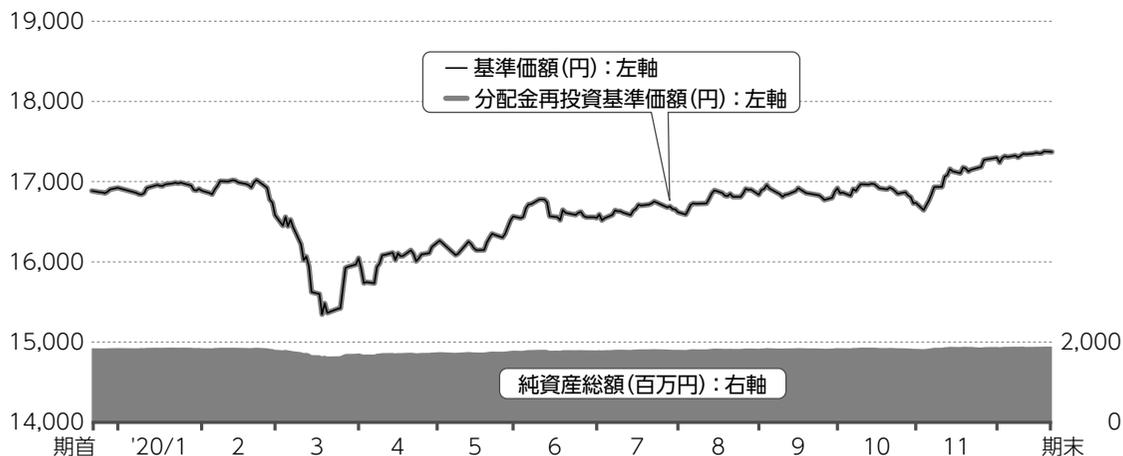
分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	16,885円
期末	17,371円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+2.9% (分配金再投資ベース)

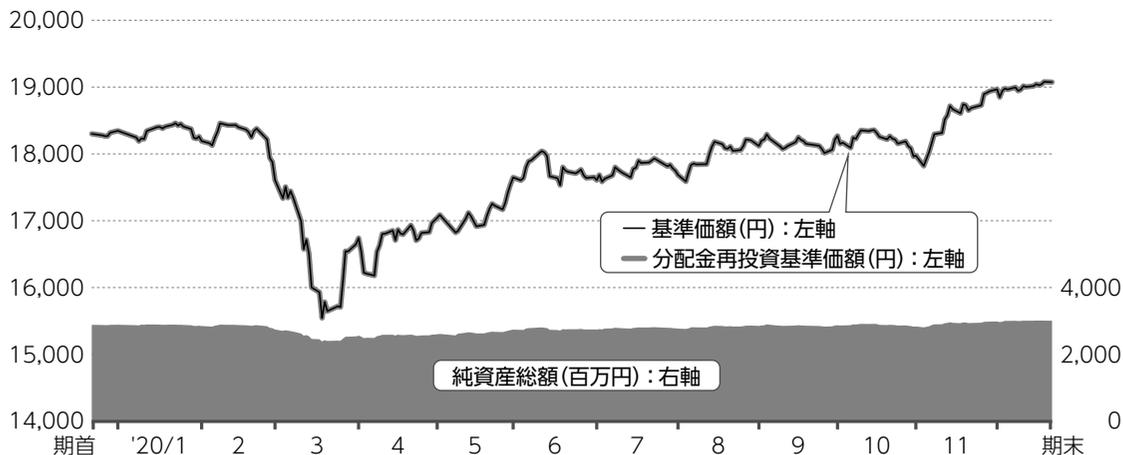
分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	18,299円
期末	19,072円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+4.2% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

基準価額の主な変動要因(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

各ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本を含む世界各国の株式および公社債に投資し、各ファンドのターゲット・イヤー^{*}に向けて運用を行いました。

上昇要因

- 内外の株式市場が上昇基調で推移したこと
- 海外の債券利回りが低下(価格は上昇)したこと
- ユーロが円に対して上昇基調で推移したこと

下落要因

- 米ドルが円に対して下落基調で推移したこと

※各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。

<2010>……西暦2010年、<2020>……西暦2020年

<2030>……西暦2030年、<2040>……西暦2040年

組入れファンドの状況

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

組入れファンド	投資資産	投資資産配分	期末組入比率
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	国内株式	5%	5.0%
SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	35%	34.9%
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	外国株式	5%	4.9%
SMAM・年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	5%	4.9%
SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	短期金融資産	50%	49.9%

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

組入れファンド	投資資産	投資資産配分	期末組入比率
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	国内株式	6%	5.1%
SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	45%	42.9%
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	外国株式	5%	5.1%
SMAM・年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	7%	5.1%
SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	短期金融資産	37%	39.5%

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

組入れファンド	投資資産	投資資産配分	期末組入比率
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	国内株式	18%	17.2%
SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	56%	56.8%
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	外国株式	12%	11.2%
SMAM・年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	12%	12.7%
SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	短期金融資産	2%	1.9%

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

組入れファンド	投資資産	投資資産配分	期末組入比率
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	国内株式	33%	31.2%
SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	38%	38.8%
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	外国株式	17%	17.1%
SMAM・年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	10%	10.8%
SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	短期金融資産	2%	1.9%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

内外株式市場は上昇しました。内外債券市場は長期金利(10年国債利回り)が米欧で低下、日本では概ね横ばいとなりました。為替は米ドルが対円で下落、ユーロが対円で上昇しました。

国内株式市場

国内株式は、期初から2020年1月中旬にかけては、米中貿易交渉の進展(12月に第一段階の合意発表)などを背景に、底堅く推移しました。2月下旬から3月中旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受け、大幅に下落しました。3月下旬から期末にかけては、感染拡大に伴う景気後退懸念に対して世界主要国の政府・中央銀行が矢継ぎ早に財政・金融政策を打ち出したことや、企業業績の先行き改善期待などを背景に、上昇基調で推移しました。

当期の市場の動きをTOPIX(東証株価指数、配当込み)で見ると、期首に比べて5.8%上昇しました。

国内債券市場

長期債利回り(10年国債利回り)は、期初から2020年1月中旬まで、方向感の出にくい展開となり、もみ合いで推移しました。1月下旬から3月上旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受け、債券利回りが低下しました。3月中旬には、世界的な金融市

場の混乱を受けた現金化目的の売りが債券市場にも波及し、利回りが急上昇するなど、荒い展開となりました。4月以降は、期末までもみ合いで推移しました。

当期の市場の動きを10年国債利回りで見ると、期首0.014%から期末0.011%へと概ね横ばいとなりました。

外国株式市場

先進国外国株式は、期初から2020年2月中旬にかけて、米中貿易協議の進展などを背景に、底堅く推移しました。2月下旬から3月中旬にかけては、感染拡大に伴う世界経済の減速懸念などを背景に、大幅に下落しました。しかし、3月下旬から期末にかけては、主要国の中央銀行による政策対応や企業業績の先行きの改善期待などを背景に、上昇基調で推移しました。

当期の市場の動きをMSCIコクサインデックス(配当込み、米ドルベース)で見ると、期首に比べて16.6%上昇しました。

外国債券市場

米国国債利回りは、期初から2020年1月中旬にかけては、もみ合いで推移しました。1月下旬以降は、感染拡大や、3月に入ってからF R B (米連邦準備制度理事会)の緊急利下げ等を受けて、3月上旬にかけて、債券利回りは大きく低下しました。その後は、金融緩和環境が維持される中、期末まで低位でもみ合いとなりました。

欧州では、期初から2020年1月上旬にかけては、方向感に乏しい相場展開となりました。1月中旬から3月上旬にかけては、感染拡大を受けたF R Bによる緊急利下げなどを背景に、欧州でも債券利回りが大きく低下しました。3月中旬には、市場の混乱を受けて現金化目的の債券売りが強まり、利回りが急上昇するなど、値動きの荒い展開となりました。4月以降は、米国債と同様に期末までは横ばいで推移しました。

当期の市場の動きを米国10年国債利回りでみると、期首1.92%から期末0.95%へと低下し、ドイツ10年国債利回りでみると、期首-0.24%から期末-0.57%へと低下しました。

外国為替市場

●米ドル・円

米ドル・円は期初から2020年2月中旬まで、米国株価の上昇などを背景に、米ドルはじり高の展開となりました。その後3月上旬にかけては、感染拡大やF R Bによる緊急利下げなどを受け、米ドルは大幅に下落しました。3月中旬以降は、米ドル資金需要の高まりを背景に米ドルが急上昇するなど、非常に荒い展開となりました。4月以降は、F R Bの金融緩和策が長期化するとの見方などを背景に、米ドルは期末までじり安で推移しました。

当期の米ドル・円相場は、期首109円43銭から期末には103円40銭と6円03銭の米ドル安・円高となりました。

●ユーロ・円

ユーロ・円は、期初から2020年1月上旬にかけて、方向感の出にくい展開となりました。その後は、感染拡大を受けてリスク回避的な動きが強まると5月上旬にかけてユーロが下落しました。5月中旬から期末にかけては、欧州復興基金の設立を巡る動き(7月下旬に設立で合意)や、全般的な米ドル安傾向が続く中で、ユーロは円に対しても期末まで上昇基調で推移しました。

当期のユーロ・円は、期首121円68銭から期末126円30銭と4円62銭のユーロ高・円安となりました。

ポートフォリオについて(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010 / 2020 / 2030 / 2040

各ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産に国際分散投資を行いました。投資資産配分(基本資産配分)は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率を計画値とし、原則1年(計算期間)毎に見直しました。当期の投資資産配分は、それぞれ以下の通りでした。

	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
2010	5%	35%	5%	5%	50%
2020	6%	45%	5%	7%	37%
2030	18%	56%	12%	12%	2%
2040	33%	38%	17%	10%	2%

SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>

SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

各ファンドはベンチマークの動きに連動する投資成果を目指した運用を行いました。

各ファンドのベンチマークは以下の通りです。

国内株式：TOPIX(東証株価指数、配当込み)

国内債券：NOMURA-BPI(総合)

外国株式：MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)

外国債券：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指しました。

ベンチマークとの差異について(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

各ファンドはベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

分配金について(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

当期の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、各ファンドとも見送りとしたしました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	2010	2020	2030	2040
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	2,863	6,124	9,104	11,190

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「対基準価額比率」は、「当期分配金」(税引前)の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

引き続き、投資信託証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式および公社債に国際分散投資を行うバランス型運用により、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

2020年12月決算日の翌営業日以降の資産配分方針は下記の通りです。

	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
2010	5%	35%	5%	5%	50%
2020	5%	35%	5%	5%	50%
2030	17%	57%	11%	13%	2%
2040	31%	39%	17%	11%	2%

SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>

SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

各ファンドとも、ベンチマークの動きに連動した投資成果を目指したパッシブ運用を行います。

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

3 お知らせ

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

約款変更について

該当事項はございません。

■ 1万口当たりの費用明細(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2010

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	56円	0.441%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数)
(投信会社)	(8)	(0.066)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(42)	(0.331)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、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)	(6)	(0.044)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.004	その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.003)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	56	0.445	

期中の平均基準価額は12,705円です。

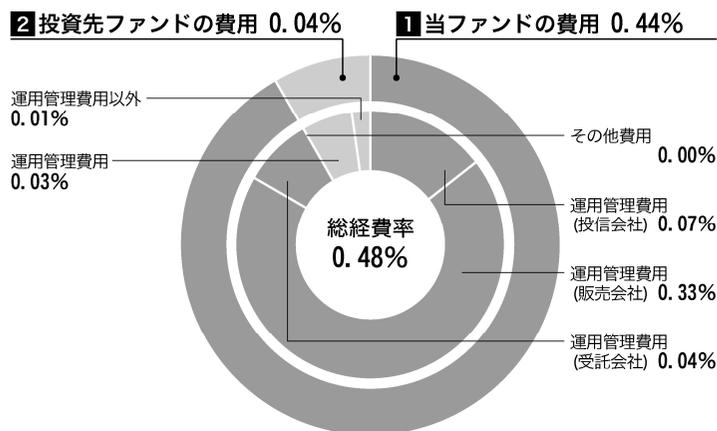
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。当該投資信託証券の費用は後掲の「1万口当たりの費用明細」をご覧ください。

参考情報 総経費率(年率換算)



総経費率(■+■)	0.48%
■ 当ファンドの費用の比率	0.44%
投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.03%
■ 投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01%

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

- ※**1**の各費用は、前掲「1万円当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。「1万円当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。
- ※**2**の各費用は、投資先ファンド(当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く))の「1万円当たりの費用明細」をもとに、委託会社が年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。
- ※**1**と**2**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。
- ※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は0.48%です。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	82円	0.540%	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数)
(a) 投信会社	(25)	(0.165)	投信会社: ファンド運用の指図等の対価
(a) 販売会社	(50)	(0.331)	販売会社: 交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(a) 受託会社	(7)	(0.044)	受託会社: ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	1	0.003	その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数
(b) 監査費用	(0)	(0.003)	監査費用: 監査法人に支払うファンドの監査費用
(b) その他	(0)	(0.000)	その他: 信託事務の処理等に要するその他費用
合計	83	0.543	

期中の平均基準価額は15,135円です。

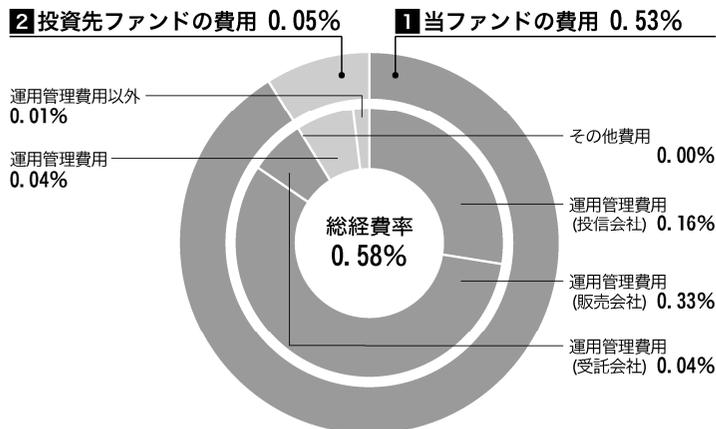
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万円当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。当該投資信託証券の費用は後掲の「1万円当たりの費用明細」をご覧ください。

参考情報 総経費率（年率換算）



総経費率 (1 + 2)	0.58%
1 当ファンドの費用の比率	0.53%
投資先ファンドの 運用管理費用の比率	0.04%
2 投資先ファンドの 運用管理費用以外の比率	0.01%

※ **1** の各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、各比率は、年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※ **2** の各費用は、投資先ファンド（当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く））の「1万口当たりの費用明細」をもとに、委託会社が年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※ **1** と **2** の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率（年率）は0.58%です。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	90円	0.540%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、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：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(投信会社)	(28)	(0.165)	
(販売会社)	(55)	(0.331)	
(受託会社)	(7)	(0.044)	
(b) その他費用	1	0.004	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：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
(監査費用)	(1)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	91	0.544	

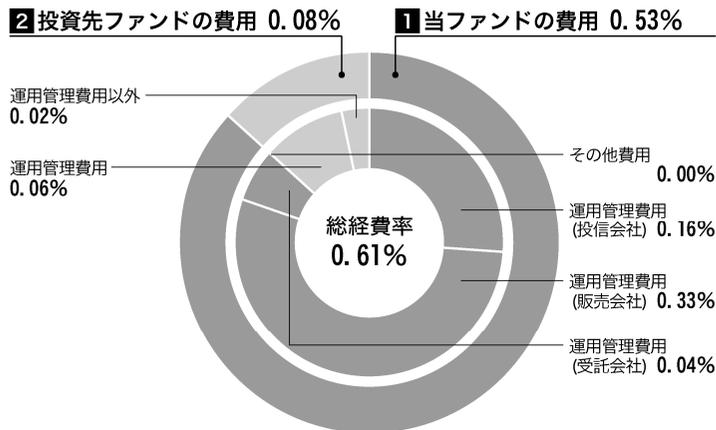
期中の平均基準価額は16,683円です。

※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、簡便法により算出しています。
 ※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。当該投資信託証券の費用は後掲の「1万口当たりの費用明細」をご覧ください。

参考情報 総経費率 (年率換算)



総経費率 (1 + 2)	0.61%
1 当ファンドの費用の比率	0.53%
投資先ファンドの 運用管理費用の比率	0.06%
2 投資先ファンドの 運用管理費用以外の比率	0.02%

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

- ※**1**の各費用は、前掲「1万円当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。「1万円当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。
- ※**2**の各費用は、投資先ファンド(当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く))の「1万円当たりの費用明細」をもとに、委託会社が年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。
- ※**1**と**2**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。
- ※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は0.61%です。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	96円	0.540%	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数)
(投信会社)	(30)	(0.165)	投信会社: ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(59)	(0.331)	販売会社: 交付運用報告書等各種資料の送付、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)	(8)	(0.044)	受託会社: ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	1	0.004	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)	(1)	(0.003)	監査費用: 監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他: 信託事務の処理等に要するその他費用
合計	97	0.544	

期中の平均基準価額は17,850円です。

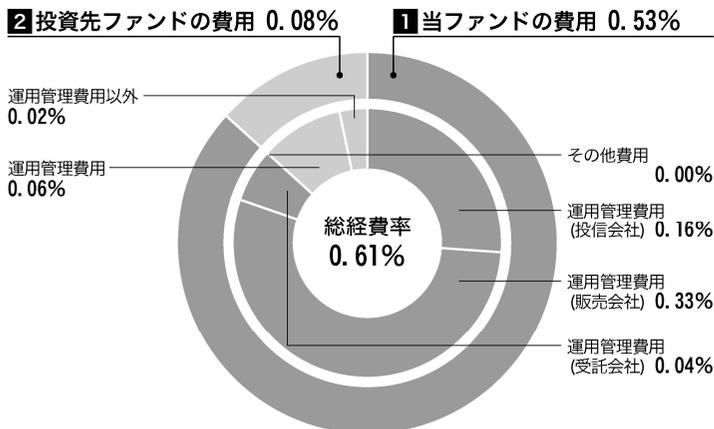
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万円当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。当該投資信託証券の費用は後掲の「1万円当たりの費用明細」をご覧ください。

参考情報 総経費率（年率換算）



総経費率 (1 + 2)	0.61%
1 当ファンドの費用の比率	0.53%
投資先ファンドの 運用管理費用の比率	0.06%
2 投資先ファンドの 運用管理費用以外の比率	0.02%

※ **1**の各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、各比率は、年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※ **2**の各費用は、投資先ファンド（当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く））の「1万口当たりの費用明細」をもとに、委託会社が年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※ **1**と**2**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率（年率）は0.61%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

投資信託証券

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2010

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内		口	千円	口	千円
	SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	7,017,528	10,220	8,389,090	13,790
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	4,688,220	11,830	5,712,254	16,460
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,633,735	4,800	3,982,659	7,320
	SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	8,790,134	11,510	16,101,272	21,140
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	5,329,667	5,360	20,544,033	20,660
合 計		28,459,284	43,720	54,729,308	79,370

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2020

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内		口	千円	口	千円
	SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	14,265,451	21,380	25,910,463	45,000
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	8,640,462	21,320	16,078,043	47,440
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	5,456,090	9,960	37,655,598	69,340
	SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	28,400,203	37,230	170,709,404	223,990
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	168,061,028	169,060	44,078,664	44,330
合 計		224,823,234	258,950	294,432,172	430,100

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内		口	千円	口	千円
	SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	60,491,674	90,090	86,259,314	146,570
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	26,567,818	69,410	42,266,236	127,280
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	22,332,644	41,430	17,485,699	31,870
	SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	180,433,843	236,547	112,850,418	149,010
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	298,211	300	994,036	1,000
合 計		290,124,190	437,777	259,855,703	455,730

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内		口	千円	口	千円
	SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	155,762,222	245,330	225,074,394	387,540
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	58,701,925	157,790	66,441,897	196,680
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	46,997,306	87,020	33,706,974	61,220
	SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	302,053,977	395,760	191,417,737	252,430
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	2,506,175	2,520	884,964	890
合 計		566,021,605	888,420	517,525,966	898,760

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※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す。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2019年12月21日から2020年12月21日まで)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■組入れ資産の明細(2020年12月21日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

ファンド名	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	千円	%
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	12,589,929	11,218,367	21,526	5.0
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	7,346,806	6,322,772	21,260	4.9
SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	12,577,246	11,228,322	21,205	4.9
SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	122,809,487	115,498,349	151,152	34.9
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	229,995,625	214,781,259	215,898	49.9
合 計	385,319,093	359,049,069	431,044	99.6

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

ファンド名	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	千円	%
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	42,978,886	31,333,874	60,126	5.1
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	25,258,811	17,821,230	59,925	5.1
SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	63,914,530	31,715,022	59,896	5.1
SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	525,736,986	383,427,785	501,791	42.9
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	336,381,816	460,364,180	462,758	39.5
合 計	994,271,029	924,662,091	1,144,499	97.8

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

ファンド名	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	千円	%
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	194,480,792	168,713,152	323,743	17.2
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	78,448,082	62,749,664	211,002	11.2
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	121,819,889	126,666,834	239,222	12.7
SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	752,018,768	819,602,193	1,072,613	56.8
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	35,477,824	34,781,999	34,962	1.9
合 計	1,182,245,355	1,212,513,842	1,881,544	99.7

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

ファンド名	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	千円	%
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	558,740,711	489,428,539	939,164	31.2
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	160,416,938	152,676,966	513,391	17.1
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	158,914,485	172,204,817	325,226	10.8
SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	782,913,465	893,549,705	1,169,388	38.8
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	55,582,955	57,204,166	57,501	1.9
合 計	1,716,568,554	1,765,064,193	3,004,672	99.8

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

■投資信託財産の構成

(2020年12月21日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	431,044	99.2
コール・ローン等、その他	3,390	0.8
投資信託財産総額	434,434	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年12月21日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	434,434,531円
コール・ローン等	3,390,036
投資信託受益証券(評価額)	431,044,495
(B) 負 債	1,756,286
未払解約金	767,746
未払信託報酬	981,213
未払利息	9
その他未払費用	7,318
(C) 純資産総額(A-B)	432,678,245
元 本	336,350,129
次期繰越損益金	96,328,116
(D) 受益権総口数	336,350,129口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,864円

※当期における期首元本額363,521,029円、期中追加設定元本額24,618,758円、期中一部解約元本額51,789,658円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■分配金のお知らせ

	当 期
1万口当たり分配金(税引前)	-円

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

■損益の状況

(自2019年12月21日 至2020年12月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,501円
支 払 利 息	△ 1,501
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	5,937,394
売 買 損 益	8,361,862
売 買 損 益	△ 2,424,468
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,994,396
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	3,941,497
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	32,388,488
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	59,998,131
(配 当 等 相 当 額)	(56,599,496)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,398,635)
(G) 計 (D+E+F)	96,328,116
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	96,328,116
追 加 信 託 差 損 益 金	59,998,131
(配 当 等 相 当 額)	(56,599,496)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,398,635)
分 配 準 備 積 立 金	36,331,486
繰 越 損 益 金	△ 1,501

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,942,134円)、信託約款に規定される収益調整金(59,996,630円)および分配準備積立金(32,389,352円)より分配可能額は96,328,116円(1万口当たり2,863円)ですが、分配は行っておりません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

■ 投資信託財産の構成

(2020年12月21日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,144,499	97.3
コール・ローン等、その他	31,680	2.7
投資信託財産総額	1,176,179	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年12月21日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,176,179,806円
コール・ローン等	31,680,564
投資信託受益証券(評価額)	1,144,499,242
(B) 負 債	5,950,525
未払解約金	2,678,326
未払信託報酬	3,252,252
未払利息	86
その他未払費用	19,861
(C) 純資産総額(A-B)	1,170,229,281
元 本	763,004,834
次期繰越損益金	407,224,447
(D) 受益権総口数	763,004,834口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,337円

※当期における期首元本額859,233,953円、期中追加設定元本額45,421,713円、期中一部解約元本額141,650,832円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 分配金のお知らせ

	当 期
1万口当たり分配金(税引前)	-1円

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

■ 損益の状況

(自2019年12月21日 至2020年12月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 3,414円
支 払 利 息	△ 3,414
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	16,403,473
売 買 益	22,851,202
売 買 損	△ 6,447,729
(C) 信 託 報 酬 等	△ 6,661,067
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	9,738,992
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	157,207,137
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	240,278,318
(配 当 等 相 当 額)	(300,363,224)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 60,084,906)
(G) 計 (D+E+F)	407,224,447
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	407,224,447
追 加 信 託 差 損 益 金	240,278,318
(配 当 等 相 当 額)	(300,363,224)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 60,084,906)
分 配 準 備 積 立 金	166,949,543
繰 越 損 益 金	△ 3,414

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(9,740,375円)、信託約款に規定される収益調整金(300,363,224円)および分配準備積立金(157,209,168円)より分配可能額は467,312,767円(1万口当たり6,124円)ですが、分配は行っておりません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

■ 投資信託財産の構成

(2020年12月21日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	1,881,544	98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	25,233	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	1,906,777	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年12月21日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,906,777,557円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	25,232,634
投資信託受益証券(評価額)	1,881,544,923
(B) 負 債	19,771,779
未 払 金	14,000,000
未 払 解 約 金	748,857
未 払 信 託 報 酬	4,992,324
未 払 利 息	68
そ の 他 未 払 費 用	30,530
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,887,005,778
元 本	1,086,294,186
次 期 繰 越 損 益 金	800,711,592
(D) 受 益 権 総 口 数	1,086,294,186口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	17,371円

※当期における期首元本額1,093,736,304円、期中追加設定元本額107,839,372円、期中一部解約元本額115,281,490円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当 期
	- 円

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

■ 損益の状況

(自2019年12月21日 至2020年12月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 5,830円
支 払 利 息	△ 5,830
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	65,160,992
売 買 損 益	81,684,812
売 買 損 益	△ 16,523,820
(C) 信 託 報 酬 等	△ 9,865,323
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	55,289,839
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	251,125,412
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	494,296,341
(配 当 等 相 当 額)	(682,563,072)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△188,266,731)
(G) 計 (D + E + F)	800,711,592
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	800,711,592
追 加 信 託 差 損 益 金	494,296,341
(配 当 等 相 当 額)	(682,563,072)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△188,266,731)
分 配 準 備 積 立 金	306,421,081
繰 越 損 益 金	△ 5,830

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(55,291,553円)、信託約款に規定される収益調整金(682,563,072円)および分配準備積立金(251,129,528円)より分配可能額は988,984,153円(1万口当たり9,104円)ですが、分配は行っておりません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

■投資信託財産の構成

(2020年12月21日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	3,004,672	98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	45,286	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	3,049,958	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年12月21日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	3,049,958,542円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	36,286,412
投資信託受益証券(評価額)	3,004,672,130
未 収 入 金	9,000,000
(B) 負 債	39,089,200
未 払 金	19,500,000
未 払 解 約 金	11,765,708
未 払 信 託 報 酬	7,775,812
未 払 利 息	98
そ の 他 未 払 費 用	47,582
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	3,010,869,342
元 本	1,578,702,648
次 期 繰 越 損 益 金	1,432,166,694
(D) 受 益 権 総 口 数	1,578,702,648口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	19,072円

※当期における期首元本額1,577,910,109円、期中追加設定元本額258,095,009円、期中一部解約元本額257,302,470円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■分配金のお知らせ

	当 期
1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	-円

■損益の状況

(自2019年12月21日 至2020年12月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 9,465円
支 払 利 息	△ 9,465
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	151,744,063
売 買 益	182,791,498
売 買 損	△ 31,047,435
(C) 信 託 報 酬 等	△ 15,203,886
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	136,530,712
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	342,019,564
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	953,616,418
(配 当 等 相 当 額)	(1,288,131,544)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 334,515,126)
(G) 計 (D + E + F)	1,432,166,694
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	1,432,166,694
追 加 信 託 差 損 益 金	953,616,418
(配 当 等 相 当 額)	(1,288,131,544)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 334,515,126)
分 配 準 備 積 立 金	478,559,741
繰 越 損 益 金	△ 9,465

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(136,533,935円)、信託約款に規定される収益調整金(1,288,131,544円)および分配準備積立金(342,025,806円)より分配可能額は1,766,691,285円(1万口当たり11,190円)ですが、分配は行っておりません。

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

第 20 期

決算日 2020年11月30日

■当ファンドの概要

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（設定日：2001年4月6日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、日本の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） 日本の取引所に上場している株式
当ファンドの運用方法	■主として日本の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。 ■株式の実質組入比率は原則として高位を保ちます。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） ■株式への投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	年1回（毎年11月30日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、以下の方針に基づき分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

■ 1万口当たりの費用明細（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	14円	0.082%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（経過日数／年日数） 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、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：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
（投信会社）	(5)	(0.027)	
（販売会社）	(2)	(0.011)	
（受託会社）	(7)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	1	0.005	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：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）	(1)	(0.004)	
(c) その他費用	1	0.007	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：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
（監査費用）	(1)	(0.007)	
（その他）	(0)	(0.001)	
合計	16	0.094	

期中の平均基準価額は16,564円です。

※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、簡便法により算出しています。
 ※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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マザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

■ 当期中の売買及び取引の状況（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	千口 970,029	千円 2,425,914	千口 1,274,031	千円 3,248,982

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 組入れ資産の明細（2020年11月30日現在）

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)		期 末	
	口 数	金 額	口 数	評 価 額
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	千口 3,810,058	千円 3,506,055	千口 3,506,055	千円 10,063,782

※国内株式インデックス・マザーファンド（B号）の期末の受益権総口数は62,877,618千口です。

※単位未満は切捨て。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2020年11月30日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	10,126,612,394円
コール・ローン等	51,519,828
国内株式インテックス・マザーファンド(B号)(評価額)	10,063,782,571
未 収 入 金	11,309,995
(B) 負 債	66,898,681
未 払 解 約 金	62,809,997
未 払 信 託 報 酬	3,770,809
未 払 利 息	128
そ の 他 未 払 費 用	317,747
(C) 純資産総額(A-B)	10,059,713,713
元 本	5,357,769,984
次 期 繰 越 損 益 金	4,701,943,729
(D) 受 益 権 総 口 数	5,357,769,984口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,776円

※当期における期首元本額5,817,374,884円、期中追加設定元本額1,642,301,795円、期中一部解約元本額2,101,906,695円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

（自2019年12月3日 至2020年11月30日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,055円
支 払 利 息	△ 1,055
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	650,266,690
売 買 損 益	836,899,605
売 買 損 益	△ 186,632,915
(C) 信 託 報 酬 等	△ 8,344,390
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	641,921,245
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,865,993,529
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,194,028,955
(配 当 等 相 当 額)	(4,317,644,120)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,123,615,165)
(G) 計 (D+E+F)	4,701,943,729
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	4,701,943,729
追 加 信 託 差 損 益 金	1,194,028,955
(配 当 等 相 当 額)	(4,324,191,604)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,130,162,649)
分 配 準 備 積 立 金	3,507,914,774

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※期末における、費用控除後の配当等収益(211,681,642円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(199,660,597円)、信託約款に規定される収益調整金(4,324,191,604円)および分配準備積立金(3,096,572,535円)より分配可能額は7,832,106,378円(1万口当たり14,618円)ですが、分配は行っておりません。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第18期 (2019年12月3日から2020年11月30日まで)

信託期間	無期限 (設定日: 2003年2月17日)
運用方針	主として東京証券取引所第一部に上場している株式に投資を行い、TOPIX (東証株価指数、配当込み) の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) TOPIX (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株 比	株式先物率 比 (買建-売建)	純資産額
	円	騰落率 %	円	騰落率 %			
14期 (2016年11月30日)	21,863	△ 5.0	2,091.95	△ 4.9	97.9	2.1	204,698
15期 (2017年11月30日)	27,242	24.6	2,604.86	24.5	98.5	1.5	193,025
16期 (2018年11月30日)	25,937	△ 4.8	2,475.92	△ 4.9	97.1	2.8	173,547
17期 (2019年12月2日)	27,359	5.5	2,611.46	5.5	97.7	2.3	174,398
18期 (2020年11月30日)	28,704	4.9	2,738.72	4.9	97.7	2.0	180,486

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※TOPIX (東証株価指数、配当込み) の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 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) TOPIX (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株 比	株式先物率 比 (買建-売建)
	円	騰落率 %	円	騰落率 %		
(期首) 2019年12月2日	27,359	—	2,611.46	—	97.7	2.3
12月末	27,507	0.5	2,625.91	0.6	98.3	1.6
2020年1月末	26,915	△ 1.6	2,569.77	△ 1.6	97.9	2.1
2月末	24,151	△11.7	2,305.76	△11.7	97.6	2.4
3月末	22,719	△17.0	2,167.60	△17.0	97.5	1.9
4月末	23,700	△13.4	2,261.88	△13.4	97.8	2.1
5月末	25,313	△ 7.5	2,416.04	△ 7.5	97.8	1.6
6月末	25,270	△ 7.6	2,411.45	△ 7.7	97.7	2.2
7月末	24,252	△11.4	2,314.39	△11.4	97.9	2.1
8月末	26,234	△ 4.1	2,503.59	△ 4.1	98.2	1.8
9月末	26,571	△ 2.9	2,536.14	△ 2.9	98.1	1.5
10月末	25,821	△ 5.6	2,464.21	△ 5.6	97.9	1.5
(期末) 2020年11月30日	28,704	4.9	2,738.72	4.9	97.7	2.0

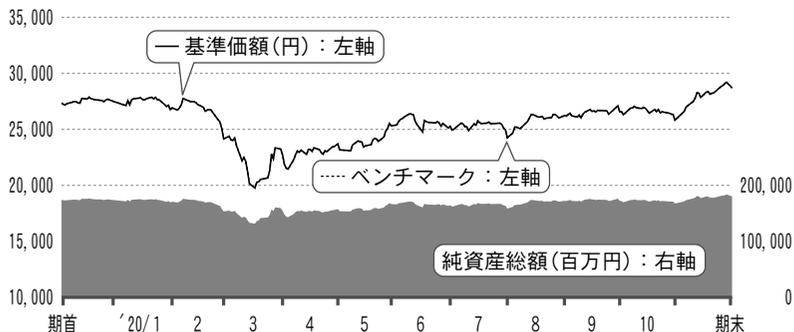
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	27,359円
期末	28,704円
騰落率	+4.9%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）です。

※TOPIX（東証株価指数、配当込み）の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

当ファンドは、主として日本の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。また、運用の効率化を図るため、TOPIX先物取引を利用しました。

上昇要因

- ・ 3月下旬から6月上旬にかけて、各国中央銀行による金融緩和の強化が発表されたことや大規模な経済対策への期待が高まったこと
- ・ 期末にかけて、米大統領選挙の結果を受け、大幅な増税やハイテク企業への規制強化懸念が和らいだことや国内企業業績の回復期待が高まったこと

下落要因

- ・ 2月下旬から3月中旬にかけて、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大が嫌気されたこと

▶ 投資環境について（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期初から2020年2月中旬までは、米国とイランの対立や中国での新型コロナウイルスの感染拡大といった懸念材料があった一方、12月の米中貿易協議での部分合意や国内企業業績の改善期待など株価の下支え要因もあり、保ち合いで推移しました。2月下旬から3月中旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大が嫌気され、大幅に下落しました。

3月下旬から6月上旬にかけては、各国中央銀行による金融緩和策の強化が発表されたことや政府による大規模な経済対策への期待が高まったことから、国内株式市場は上昇しました。その後は、米国での追加経済対策への期待が高まる一方、新型コロナウイルスの感染再拡大への警戒から10月まで一進一退の展開になりました。

期末にかけては、米国大統領選挙の結果を受け、大幅な増税やハイテク企業への規制強化懸念が和らいだことや、企業業績の回復期待から上昇しました。

当期の市場の動きをベンチマークであるTOPIX（東証株価指数、配当込み）で見ると、期首に比べて4.9%上昇しました。

▶ ポートフォリオについて（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

株式組入比率

TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、期を通じて、先物を含めた実質株式投資比率は100%に近い高位を保ちました。

ポートフォリオの特性

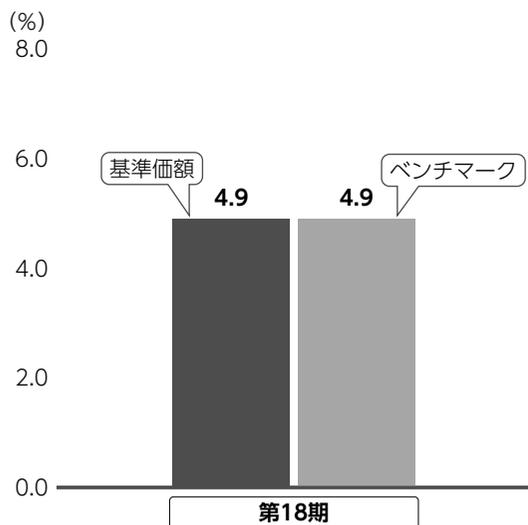
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

東証1部上場銘柄のうち、流動性や信用リスクを考慮し、銘柄組入れを行いました。またファンドの資金流入に機動的に対応するため、株式先物の売買を行いました。

推定トラッキングエラー（ポートフォリオとベンチマークのリターンの乖離）が拡大する場合は、リバランス（投資配分比率の調整）を実施し、トラッキングエラーを低く抑えました。

▶ ベンチマークとの差異について（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



当ファンドはTOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は+4.9%となり、ベンチマークの騰落率+4.9%を追随しました。

2 今後の運用方針

TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。流動性や信用リスクに懸念のある銘柄を除き、個別銘柄においてもTOPIX時価ウェイトに沿った投資を行い、トラッキングエラーを抑制します。また、先物を含めた実質株式組入比率を概ね100%に保つことを基本とします。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 1万口当たりの費用明細（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	1円 (0) (1)	0.005% (0.001) (0.004)	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：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.001 (0.001)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	1	0.006	

期中の平均基準価額は25,313円です。

※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、簡便法により算出しています。
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 10,503 (△ 7,692)	千円 17,255,229 ()	千株 8,898	千円 17,919,319

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国 内	内	証 券 — (27,200)	千円 — (—)	証 券 — (27,200)	千円 — (—)

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※（ ）内は権利付与、権利行使およ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。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建		
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	
国内 株式先物取引	T O P I X	百万円 49,002	百万円 49,274	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 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12月3日から2020年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	35,174,549千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	162,591,890千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.21

※単位未満は切捨て。

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末（ただし、決算日の属する月については決算日）の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計、(b)は各月末の同仲値で換算した邦貨金額合計の平均です。

■ 利害関係人との取引状況等 (2019年12月3日から2020年11月30日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
株 式	百万円 17,255	百万円 6,800	% 39.4	百万円 17,919	百万円 9,595	% 53.5
株 式 先 物 取 引	49,002	45,359	92.6	49,274	45,650	92.6

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	百万円 164	百万円 135	百万円 1,517

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種	類	買	付	額
株	式			百万円 7

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項	目	当	期
(a)	売買委託手数料総額		7,733千円
(b)	うち利害関係人への支払額		6,072千円
(c)	(b) / (a)		78.5%

利害関係人とは、投資信託およ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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社関西みらいフィナンシャルグループ、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2019年12月3日から2020年11月30日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2020年11月30日現在)

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
		千株		千株	千円
水産・農林業 (0.1%)					
極洋	3.6		3.8		10,621
日本水産	95.8		97.5		39,097
マルハニチロ	13.8		14.1		29,948
雪国まいたけ	—		5.7		10,607
カネコ種苗	4.3		4.6		7,097
サカタのタネ	10.9		11.6		39,034
ホクト	7.2		7.1		14,626
鉱業 (0.1%)					
日鉄鉱業	2.5		2.4		12,696
三井松島ホールディングス	3.3		5.6		4,132
国際石油開発帝石	384.9		361.1		210,882
石油資源開発	12.4		12.4		21,799
K&Oエナジーグループ	5.3		5.6		8,176
建設業 (2.4%)					
ヒノキヤグループ	3.2		3.4		7,395
ショーボンドホールディングス	13.5		15.1		78,520
ミライト・ホールディングス	27.6		27.3		42,724
タマホーム	5.5		6.5		9,353
スペースバリューホールディングス	13.8		15.4		9,409
安藤・間	57.3		59.5		40,936
東急建設	28		30.2		14,163
コムシスホールディングス	33.8		34.7		107,223
ミサワホーム	8.5		—		—
ビーアールホールディングス	13		13.4		9,514

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
高松コンストラクショングループ		6		6.2	12,629
東建コーポレーション		2.8		3	24,270
大成建設		73.4		75.4	278,226
大林組		220.7		224.9	206,908
清水建設		223.8		228.5	181,200
飛島建設		8		8.7	9,369
長谷工コーポレーション		84.4		86.7	97,884
松井建設		11.2		11.8	8,649
銭高組		1.3		1.6	7,352
鹿島建設		172.2		177	243,021
不動テトラ		7		7.4	12,417
大末建設		5.4		6.3	5,625
鉄建建設		5.1		6.1	10,998
西松建設		17.7		18	34,920
三井住友建設		56		55.8	23,938
大豊建設		5.1		5.6	19,432
前田建設工業		56.7		58.8	48,098
奥村組		12.6		10.4	25,386
東鉄工業		9		9.2	25,760
浅沼組		3		3	11,925
戸田建設		92.7		94.9	58,173
熊谷組		10.3		10.5	24,801
北野建設		2		2.2	5,995
矢作建設工業		12.1		12.1	10,914
ピーエス三菱		10.6		10.6	6,020
日本ハウスホールディングス		20		26.1	6,211

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
大東建託	26.5	24.9	254,976
新日本建設	10.4	10.5	8,925
N I P P O	17.7	18.1	49,358
東亜道路工業	1.8	2	7,390
前田道路	23.2	21	35,217
日本道路	2.3	2.3	16,997
東亜建設工業	8.3	8.3	16,517
日本国土開発	15	22.9	12,480
若築建設	5.3	6	6,906
東洋建設	26.1	29.9	11,870
五洋建設	89.3	91.5	71,095
世紀東急工業	13.3	13.6	10,975
福田組	2.8	2.8	14,812
住友林業	55.3	58	110,258
日本基礎技術	12.2	11.7	5,756
バコーポレーション	14.4	15.7	6,656
大和ハウス工業	218.4	225	720,000
ライト工業	12.6	12.6	21,105
積水ハウス	241.5	246.6	463,114
ユアテック	13.8	14.8	9,842
日本リーテック	—	5.5	13,689
中電工	8.2	7.2	15,350
関電工	29.2	27.9	22,264
きんでん	51.8	52.8	88,334
東京エネシス	9.4	9.8	8,722
トーエネック	2.9	2.9	10,759
住友電設	6.3	6.2	16,082
日本電設工業	11.2	11.2	24,158
協和エクシオ	33.3	33.8	90,820
新日本空調	6.1	6.7	15,001
九電工	15.5	16.1	48,058
三機工業	15.7	16	18,384
日揮ホールディングス	68.6	70.5	65,917
中外炉工業	3.2	4.1	6,609
ヤマト	9.4	9.4	6,965
太平電業	5.7	6.1	14,707
高砂熱学工業	18.6	16	22,928
朝日工業社	2.1	2.2	7,084
明星工業	14.7	15.6	12,121
大気社	10.7	10.7	29,713
ダイダシ	5.5	5.4	15,022
日比谷総合設備	7.4	7.8	14,297
東芝プラントシステム	17	—	—
OSJBホールディングス	41.7	43.1	10,171
レイズネクスト	12.6	13	14,443
食料品 (3.5%)			
日本製粉	20.2	19.3	31,401
日清製粉グループ本社	79.4	81.9	138,984
昭和産業	6.1	6.4	20,224
鳥越製粉	8.5	8.2	8,618
中部飼料	8.9	8.9	12,433
フィード・ワン	53.4	11.1	9,823
日本甜菜製糖	4.7	4.7	7,501
三井製糖	5.9	5.7	10,197

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
日新製糖	3.4	3.6	6,660
森永製菓	16.5	17.2	65,532
中村屋	2.5	1.9	7,685
江崎グリコ	21	20	86,900
名糖産業	4.9	3.7	5,439
井村屋グループ	3.8	4.8	12,326
不二家	4.3	4.8	11,347
山崎製パン	53.3	54.7	94,740
モロゾフ	1.7	1.3	8,073
亀田製菓	4	4.2	20,643
寿スブリッツ	6.7	6.9	36,846
カルビー	32.2	33	101,805
森永乳業	13.3	13.6	68,952
六甲バター	5.3	5.9	11,133
ヤクルト本社	48.5	50.1	249,247
明治ホールディングス	46.5	47.9	353,502
雪印メグミルク	17.1	17.2	38,476
プリマハム	10.7	10.9	31,468
日本ハム	26.9	27.7	123,403
丸大食品	7	7.7	12,758
S Foods	5.4	5.8	18,212
柿安本店	—	3.2	8,032
伊藤ハム米久ホールディングス	45.3	42.4	27,729
サッポロホールディングス	24.4	25.2	49,140
アサヒグループホールディングス	148	158.5	639,864
キリンホールディングス	299.6	307.9	700,010
宝ホールディングス	53.7	54.8	65,705
オエノンホールディングス	22.2	24.1	9,905
養命酒製造	3.5	3.5	6,576
ユカ・コーラ ボトラーズジャパンホルデ	49.8	56.3	90,417
サントリー食品インターナショナル	47	48.6	185,409
ダイドグループホールディングス	3.5	3.8	21,204
伊藤園	21.3	22	177,320
キーコーヒー	6.7	6.4	13,491
日清オイリオグループ	8.8	8.9	25,863
不二製油グループ本社	17.3	17.8	49,768
かどや製油	1.3	1.3	5,044
J-オイルミルズ	3.6	3.8	13,528
キッコーマン	50.6	52.2	338,778
味の素	157.2	160.9	350,842
キユーピー	39.4	40.4	87,829
ハウス食品グループ本社	26.3	26.9	96,840
カゴメ	27.1	29.5	112,395
焼津水産化学工業	5.7	4.1	4,063
アリアケジャパン	6.4	6.8	46,988
ニチレイ	33.6	34.8	98,623
東洋水産	36.1	37.5	192,375
イートアンドホールディングス	3.7	2.6	4,732
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4.4	5.1	4,426
日清食品ホールディングス	29.9	31	267,220
永谷園ホールディングス	4.2	4.2	9,450
一正蒲鉾	4.3	2.9	3,343
フジッコ	7.6	7.7	15,084
ロック・フィールド	7.8	8.2	11,947

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
日本たばこ産業	407.7		389		824,680
ケンコーマヨネーズ	4.4		4.8		8,572
わらべ日洋ホールディングス	5.1		6		8,352
なとり	5.4		4.6		9,154
ビックルスコーポレーション	2		2.1		6,140
北の達人コーポレーション	23.6		26.4		13,437
ユージェナ	29.1		31		25,451
ミヨシ油脂	4.3		4.5		5,548
理研ビタミン	3		7.1		9,457
繊維製品 (0.5%)					
片倉工業	11.1	11.4			15,595
グンゼ	5.1	5.1			18,360
東洋紡	28.2	29.2			38,106
ユニチカ	23.7	25.2			9,525
富士紡ホールディングス	3.9	4			14,420
倉敷紡績	7.1	7.6			13,999
日本毛織	22.5	22.9			24,182
ダイドーリミテッド	15	—			—
帝国繊維	8.3	8.3			21,355
帝人	55.3	57.7			102,936
東レ	500.4	514.8			291,428
住江織物	2.6	2.6			5,662
アヅギ	9.6	11.3			5,932
ダイニック	6.4	6			5,226
セーレン	16.9	17.8			27,162
小松マテーレ	12.8	13.5			12,865
ワコールホールディングス	18.2	18.3			36,618
ホギメディカル	8	8.3			26,228
レナウン	35	—			—
T S I ホールディングス	24.5	26.4			5,306
マツオカコーポレーション	2.8	3			7,596
ワールド	10	10.7			13,717
三陽商会	5.1	—			—
オンワードホールディングス	41.7	45.9			8,491
ゴルドウイン	12.6	13.1			91,962
デサント	13.9	14.4			24,825
パルプ・紙 (0.2%)					
特種東海製紙	4.4	4.4			23,540
王子ホールディングス	285.3	293.3			139,024
日本製紙	30.7	31.4			35,325
三菱製紙	11.7	12.5			4,012
北越コーポレーション	45.7	42.2			14,812
中越パルプ工業	4.3	4.8			6,465
大王製紙	29.4	32			57,792
レンゴー	65.3	68.9			54,775
トーモク	5.1	5.3			9,169
ザ・バック	5	5.8			16,773
化学 (7.6%)					
クラレ	108	110.5			114,478
旭化成	459.4	469.2			449,071
昭和電工	48.7	53.6			103,823
住友化学	507.3	515.3			190,661
住友精化	3.3	3.2			13,280
日産化学	38.5	39.1			243,984

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
ラサ工業	3.3		3.3		6,596
クレハ	5.8		5.9		31,270
多木化学	2.3		2.8		18,620
テイカ	5.2		5.8		8,485
石原産業	12.9		14.3		8,236
日本書達	10.2		10.5		28,843
東ソー	105.2		109		179,414
トクヤマ	19.9		20.5		45,448
セントラル硝子	14.5		14.5		32,248
東亜合成	43.6		43.3		54,125
大阪ソーダ	6.9		6.7		16,394
関東電化工業	16.8		16.6		11,653
デンカ	24.9		25.9		83,657
信越化学工業	118.4		121.6		2,083,616
日本カーバイド工業	3.2		4.7		6,152
堺化学工業	4.6		5		9,715
第一稀元素化学工業	9.4		9.8		6,830
エア・ウォーター	55.7		66.1		113,758
日本酸素ホールディングス	66.2		68.3		119,115
日本化学工業	2.4		2.9		7,406
日本パーカライジング	35.4		36.1		39,529
高压ガス工業	12.4		13		9,841
チタン工業	1.8		2.1		4,088
四国化成工業	10.4		10.3		12,277
戸田工業	2.5		—		—
ステラ ケミファ	4		3.7		12,395
保土谷化学工業	2.8		2.6		11,973
日本触媒	10.8		11		57,420
大日精化工業	6.2		5.9		14,089
カネカ	17.7		18.1		56,834
三菱瓦斯化学	64.5		65.8		145,681
三井化学	62.6		65.4		191,818
J S R	64.3		66.3		191,275
東京応化工業	12		12.3		80,934
大阪有機化学工業	7.2		6.4		18,553
三菱ケミカルホールディングス	461		472.6		272,926
K I H ネオケム	12.3		11.6		32,329
ダイセル	94		88.2		64,738
住友ベークライト	10.9		11.5		37,030
積水化学工業	148.2		148		266,844
日本ゼオン	62.3		64.4		83,269
アイカ工業	20.7		21.1		77,859
宇部興産	34.2		35.1		62,302
積水樹脂	12.3		12.6		27,594
タキロンシーアイ	16.1		16		11,328
旭有機材	4.5		5.1		7,430
日立化成	31.9		—		—
ニチバン	4.1		4.8		7,780
リケンテクノス	19.2		20.9		9,321
大倉工業	3.9		3.8		7,132
積水化成成品工業	10.2		10.9		5,864
群栄化学工業	2.4		2.4		6,079
ミライアル	3.3		3.8		4,601
ダイキョーニシカワ	14.4		15.9		10,891

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
森六ホールディングス	4.1	4.9	9,746
日本化薬	43.1	44.9	41,173
カーリットホールディングス	9.5	11.5	6,900
日本精化	6.7	6.7	9,735
扶桑化学工業	6.9	7	24,185
トリケミカル研究所	1.6	1.6	22,576
ADEKA	31.9	32.4	53,719
日油	25.9	26.4	122,232
ハリマ化成グループ	6.2	7	7,154
花王	168.5	173.2	1,352,345
第一工業製薬	2.9	2.6	11,726
ニイタカ	—	2	6,220
三洋化成工業	4	4	17,920
大日本塗料	9.1	9.1	8,399
日本ペイントホールディングス	56.8	58.4	780,808
関西ペイント	77.6	79.6	251,934
中国塗料	20.3	20.8	20,675
日本特殊塗料	5.9	6.5	7,442
藤倉化成	13.2	12.6	6,388
太陽ホールディングス	5	5.2	33,332
DIC	28.7	29.7	76,239
サカタインクス	15.1	15.2	17,601
東洋インキSCホールディングス	13.9	14	27,454
T&K TOKA	7.1	7.6	6,536
富士フイルムホールディングス	134.8	138.6	779,625
資生堂	139.8	143.7	1,057,632
ライオン	91.3	94.3	232,732
高砂香料工業	4.6	5	12,600
マンダム	15.8	16.6	27,174
ミルボン	9.4	9.9	59,004
ファンケル	28.6	29.4	124,509
コーセー	13.2	13.6	216,784
コタ	5.1	5.9	8,018
ポーラ・オルビスホールディングス	30	31.2	65,052
ノエビアホールディングス	6.6	6	25,770
エステー	5.4	5.6	11,407
アグロ カネシヨウ	3.3	3.9	6,805
コニシ	11.8	11.4	18,148
長谷川香料	9.7	12.4	24,948
小林製薬	19.7	20.2	253,510
荒川化学工業	7	7	7,840
メック	5.4	5.8	13,218
タカラバイオ	18.7	19.1	56,784
JCU	8.7	8.6	31,691
デクセリアルズ	19	19	24,225
アース製薬	5.3	5.3	32,595
北興化学工業	9.1	8.1	9,104
大成ラミック	3.3	3.5	10,164
クミアイ化学工業	29.5	30.5	31,140
日本農薬	14.6	16.1	8,549
アキレス	5.6	5.9	8,401
有沢製作所	11.7	12.6	11,554
日東電工	48.2	49.8	430,272
レック	8.1	7.5	11,610

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
三光合成	11.6	15.3	4,467
藤森工業	6.1	6.1	28,822
前澤化成工業	6.6	7.1	6,972
未来工業	4.5	4.9	9,212
JSP	4.6	5	7,535
エフピコ	7.8	15	62,775
天馬	5.3	5.4	10,297
信越ポリマー	12.6	12.7	11,938
東リ	23.1	23.1	5,913
ニフコ	25.5	26.5	97,387
バルカー	5.9	6.6	12,342
ユニ・チャーム	136.1	153.3	776,157
医薬品 (6.1%)			
協和キリン	70.2	72.6	205,821
武田薬品工業	586	601.8	2,253,741
アステラス製薬	619.5	627.6	931,044
大日本住友製薬	52.5	54.3	71,838
塩野義製薬	89.9	90.9	508,403
田辺三菱製薬	85.2	—	—
あすか製薬	9	8	13,632
日本新薬	18.4	19	141,740
中外製薬	73.4	226.2	1,140,952
科研製薬	12.2	12.2	46,482
エーザイ	84.3	86.7	683,802
ロート製薬	35.9	37	126,725
小野薬品工業	162	166.3	549,288
久光製薬	20.7	19.1	116,892
持田製薬	10	10.1	40,501
参天製薬	130.9	135.1	234,398
扶桑薬品工業	3.6	3.7	10,482
日本ケミファ	1.5	2.2	5,434
ツムラ	22.1	22.5	68,512
日医工	20.1	20	20,000
キッセイ薬品工業	12.8	12.5	26,125
生化学工業	14.2	14.4	14,299
栄研化学	12.8	12.4	24,018
鳥居薬品	4.5	4.5	14,242
JCRファーマ	5	20.8	56,576
東和薬品	9	9.2	17,489
富士製薬工業	5.6	6.8	8,486
沢井製薬	14.7	14.8	69,782
ゼリア新薬工業	13	13	24,284
第一三共	201.4	621.1	2,294,343
キョーリン製薬ホールディングス	14.7	16.1	30,219
大幸薬品	3.3	9.2	15,502
ダイト	4.4	4.6	16,652
大塚ホールディングス	134.1	150.2	637,148
大正製薬ホールディングス	14.8	15	99,600
ペプチドリーム	35.7	36.7	195,244
石油・石炭製品 (0.4%)			
日本コークス工業	81.7	99.6	7,071
ニチレキ	9.5	9.1	14,887
ユシロ化学工業	5.9	6.4	7,449
富士石油	25.2	—	—

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
出光興産	79.1	80.8	175,659	
E N E O Sホールディングス	1,090.7	1,088	390,048	
コスエネルギーホールディングス	20.7	21.7	38,495	
ゴム製品 (0.5%)				
横浜ゴム	40.7	41.5	63,204	
TOYO TIRE	41.2	39	64,233	
ブリヂストン	216.7	192.6	701,834	
住友ゴム工業	63.4	64	59,072	
オカモト	4.5	4.6	18,745	
ニッタ	7.9	7.8	17,206	
住友理工	13.7	16.1	8,259	
三ツ星ベルト	9.6	10	16,310	
バンドー化学	13.5	14.4	8,294	
ガラス・土石製品 (0.8%)				
日東紡績	10.6	11.1	47,175	
A G C	69.5	66.2	230,045	
日本板硝子	21.5	15.4	6,175	
日本山村硝子	5.4	5.4	4,660	
日本電気硝子	28.5	27.1	61,842	
オハラ	3.6	4	6,032	
住友大阪セメント	13.7	14	43,260	
太平洋セメント	44.5	45.9	128,795	
日本ヒューム	9.3	10.6	8,268	
日本コンクリート工業	20.5	22.2	7,059	
三谷セキサン	3.5	3.4	14,195	
アジアパイルホールディングス	13.3	15	6,825	
東海カーボン	73.8	71	81,366	
日本カーボン	3.7	4.2	15,687	
東洋炭素	4.6	4.9	8,741	
ノリタケカンパニーリミテド	4	4	11,724	
T O T O	50.3	51.7	305,547	
日本碍子	85.4	86.5	143,503	
日本特殊陶業	54.6	54.9	103,815	
M A R U W A	2.8	2.8	31,024	
品川リフラクトリーズ	2.4	2.4	5,901	
黒崎播磨	1.5	1.8	6,471	
ヨータイ	8.2	8.2	6,765	
東京窯業	16.5	16.5	5,692	
フジインコーポレーテッド	6.4	6.7	24,388	
ニチアス	19.3	19	46,303	
ニチハ	9.7	10	32,600	
鉄鋼 (0.6%)				
日本製鉄	311.5	319.8	408,224	
神戸製鋼所	129.3	130.3	65,801	
中山製鋼所	13	13	4,888	
合同製鐵	4.1	4.7	8,718	
ジェイエフイーホールディングス	187.9	191	182,596	
東京製鐵	34.2	34	22,304	
共英製鋼	8	9.2	13,744	
大和工業	15.1	15.5	41,013	
東京製鋼	4	4	8,828	
大阪製鐵	4.5	4.5	5,346	
淀川製鋼所	9.1	8.9	17,559	
丸一鋼管	22.9	22.8	50,068	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
モリ工業	2.7	2.7	6,590	
大同特殊鋼	11.4	11.7	50,778	
日本冶金工業	5.9	6.9	11,385	
山陽特殊製鋼	5.4	6	7,500	
愛知製鋼	3.9	4.4	11,220	
日立金属	74.9	77	118,041	
大平洋金属	4.9	5.6	10,360	
新日本電工	50.2	49.6	11,308	
栗本鐵工所	4.3	4.4	7,528	
三菱製鋼	6.7	8.9	4,930	
シンニッタン	14.7	19.9	3,641	
非鉄金属 (0.7%)				
大紀アルミニウム工業所	11.2	12.7	8,648	
日本軽金属ホールディングス	178	18.1	32,435	
三井金属鉱業	18.9	19.5	57,681	
東邦亜鉛	4	—	—	
三菱マテリアル	45.7	47.5	94,145	
住友金属鉱山	89.2	91.5	355,660	
D O W Aホールディングス	17.6	18.3	63,135	
古河機械金属	12.5	12.7	14,427	
大阪チタニウムテクノロジーズ	7.8	9.7	8,148	
東邦チタニウム	13.7	15.2	10,472	
U A C J	10.7	11	19,701	
C Kサンエツ	1.8	2.1	8,095	
古河電気工業	21.5	22.6	59,754	
住友電気工業	260	267.1	318,917	
フジクラ	85.9	89.6	36,467	
昭和電線ホールディングス	9.6	8	12,896	
タツタ電線	15.3	16.3	10,106	
リョービ	8.5	9.7	11,795	
アールスティ	11.5	15.7	5,055	
アサヒホールディングス	12.5	13.2	40,986	
金属製品 (0.6%)				
稲葉製作所	5.5	5.4	7,354	
宮地エンジニアリンググループ	3.3	3.3	7,128	
トーカロ	19.4	20.8	25,896	
アルファC o	4.3	4.3	4,171	
S U M C O	83.5	92	194,488	
川田テクノロジーズ	1.7	1.8	7,587	
R S Technologies	2.2	2.8	12,502	
東洋製罐グループホールディングス	44.6	46.3	46,624	
ホッカンホールディングス	4.8	4.8	6,624	
コロナ	5.9	5.9	5,327	
横河ブリッジホールディングス	13	13.5	26,757	
三和ホールディングス	66.8	68	86,360	
文化シャッター	21.2	21.4	19,516	
三協立山	10.5	11.1	8,491	
アルインコ	7	7.9	7,173	
L I X I Lグループ	103	105.9	265,279	
ノーリツ	14.9	15	24,165	
長府製作所	7.2	7.2	14,688	
リンナイ	13.6	14	170,520	
日東精工	13	12.4	5,332	
岡部	14.6	14.7	11,848	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
ジーテクト	8.7		9.3		12,927
東ブレ	12.9		13.9		18,125
高周波熱錬	14.2		16.2		7,225
東京製綱	6.7		8.2		6,125
バイオラックス	10.2		10.6		16,546
エイチワン	9.3		9.3		6,510
日本発條	75		77.1		48,804
三益半導体工業	6.2		5.7		15,960
機械（5.7%）					
日本製鋼所	21.5		21.5		54,825
三浦工業	30.1		31		170,190
タクマ	23.7		23.9		42,852
ツガミ	14.8		14.7		24,255
オークマ	8		8.2		49,364
芝浦機械	7.9		8.2		18,868
アマダ	87.3		88		88,528
アイダエンジニアリング	18.2		18.4		16,265
F U J I	28.7		29.9		75,617
牧野フライス製作所	8		8.2		34,440
オーエスジー	32.4		35.2		66,422
旭ダイヤモンド工業	19.1		20.3		8,607
D M G森精機	43.9		45.5		70,161
ソディック	16.7		15.8		13,161
ディスコ	9.4		9.7		322,525
日東工器	4.3		4.5		7,488
日進工具	2.1		3.4		9,965
パンチ工業	9.2		11.3		4,972
豊和工業	5.7		5.7		4,617
島精機製作所	11.3		11		19,151
オプトラン	8		9		19,656
イワキポンプ	4.5		5.9		4,725
フリュー	8.6		8.9		10,510
ヤマシンフィルタ	15.2		15		15,990
日阪製作所	10.3		10.6		8,882
やまびこ	13.8		13.9		19,654
平田機工	3.3		3.3		27,522
ベガサスミシン製造	10.7		15.3		4,482
マルマエ	3.5		4.2		4,502
タツモ	3.6		3.9		5,873
ナフテスコ	40.9		42.1		181,451
三井海洋開発	7.6		7.2		12,744
レオン自動機	6.9		7.9		8,745
S M C	22.1		22.7		1,505,464
ホソカワミクロン	2.7		2.4		15,192
ユニオンツール	2.6		2.7		8,275
オイレス工業	9.3		8.6		13,708
日精エー・エス・ピー機械	2.6		2.4		13,680
サトーホールディングス	10.1		10.2		20,634
技研製作所	6.4		6.2		25,420
日精樹脂工業	7.3		7.7		6,637
ワイエシイホールディングス	4.1		—		—
小松製作所	318.7		327.4		831,596
住友重機械工業	39.8		40.9		92,147
日立建機	27.5		29.1		84,128

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
日工		12.4		13.1	8,685
巴工業		3.9		4	7,676
井関農機		7.9		8.1	11,088
T O W A		7.8		7	12,698
北川鉄工所		3.6		4.1	5,243
ローツエ		3.2		3.1	16,802
クボタ		373.2		378.6	783,891
荏原実業		2.6		2.3	8,441
三菱化工機		3.7		3.6	8,082
月島機械		13.4		13.6	16,333
帝国電機製作所		7.1		7.3	9,088
新東工業		16.7		16.6	11,802
澁谷工業		6.3		6.3	22,995
アイチ コーポレーション		13.7		12	11,136
小森コーポレーション		17.6		17.9	12,762
鶴見製作所		6.1		6.1	10,437
住友精密工業		1.8		2.2	4,406
酒井重工業		1.9		1.9	4,721
荏原製作所		29.3		30.1	100,534
西島製作所		8.9		10.9	9,156
北越工業		8.5		9.3	9,681
ダイキン工業		89.7		92.2	2,181,913
オルガノ		2.6		2.6	15,418
トーヨーカネツ		3.9		4.2	8,950
栗田工業		37.8		38.9	149,765
椿本チエイン		9.6		9.4	23,772
大同工業		6.2		7	4,732
アネスト岩田		11.9		12.6	12,436
ダイフク		35.6		36.7	444,070
サムコ		—		2.3	8,199
加藤製作所		4.5		6	6,096
タダノ		34.8		35	28,805
フジテック		25.1		26.2	55,858
C K D		19.7		20	44,500
キトー		6		6.9	10,943
平和		19.7		19.8	28,135
理想科学工業		6.6		7.4	9,553
S A N K Y O		16.1		16	41,088
日本金銭機械		9.4		10.7	5,788
マースグループホールディングス		5.5		5.7	9,108
フクシマガリレイ		4.4		4.5	19,777
ダイコク電機		4.5		5.8	5,109
竹内製作所		11.6		12.1	29,729
アマノ		18.5		19	46,626
J U K I		10.6		13.2	7,154
マックス		10.7		11	15,400
グローリー		19.7		18.7	39,270
新晃工業		6.9		7.5	12,885
大和冷機工業		10.7		11.5	11,799
セガサミーホールディングス		70.4		71.9	105,477
日本ピストンリング		4.4		4.4	4,114
リケン		3.4		3.9	8,638
T P R		9		9.8	12,818
ツバキ・ナカシマ		14.6		13.5	11,893

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ホシザキ	20.6	22.8	235,524	
大豊工業	7.4	8.2	4,985	
日本精工	130.7	133.9	113,145	
NTN	161.9	170.5	37,169	
ジェイテクト	65.9	68.2	55,310	
不二越	6.6	6.5	28,015	
日本トムソン	22.9	25.8	8,462	
THK	40.8	45	145,125	
ユーシン精機	6.7	8	6,296	
前澤給装工業	3.7	3.6	8,316	
イーグル工業	8.9	9.6	8,668	
日本ピラー工業	7.8	7.9	12,805	
キッツ	29	28.2	15,876	
マキタ	91.5	94.1	508,140	
日立造船	56	56	22,512	
三菱重工業	117.7	121	284,531	
IHI	50.9	52.6	81,582	
スター精密	11.2	11.3	16,622	
電気機器 (17.0%)				
日清紡ホールディングス	47.8	45.1	33,374	
イビデン	43.5	44.4	217,116	
コニカミノルタ	155.1	160	53,440	
ブラザー工業	85.5	88	176,000	
ミネベアミツミ	130.1	133.9	291,098	
日立製作所	338.3	347.7	1,378,978	
三菱電機	704	722.9	1,108,567	
富士電機	42.2	43.6	161,756	
東洋電機製造	3.8	4.2	4,641	
安川電機	75.6	77.7	390,831	
シンフォニアテクノロジー	9.4	10.2	13,443	
明電舎	13.1	13.9	25,270	
オリジン	3.4	3.6	4,935	
山洋電気	3.5	3.5	18,060	
デンヨー	6.5	6.5	13,578	
東芝テック	8.8	9.1	34,125	
芝浦メカトロニクス	1.6	1.8	6,993	
マブチモーター	19.3	19.9	92,734	
日本電産	84.7	174.1	2,316,400	
トレックス・セミコンダクター	4.9	5.9	7,699	
東光高岳	5.5	5.8	7,725	
宮越ホールディングス	3.9	5.2	3,562	
ダイヘン	7.7	7.8	35,412	
ヤーマン	11.2	12.4	28,817	
JVCケンウッド	60	—	—	
ミマキエンジニアリング	9.3	11.9	6,069	
IPEX	3	4.2	8,253	
日新電機	16.7	16.8	19,572	
大崎電気工業	16.2	18	9,936	
オムロン	65.3	64.6	609,178	
日東工業	10.7	10.5	19,488	
IDEC	10.5	11.2	20,664	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	24.1	24.7	62,342	
サクサホールディングス	3	—	—	
メルコホールディングス	2.8	3	9,180	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本電気	85.4	87.8	494,314	
富士通	67.9	69.7	1,010,998	
沖電気工業	29.9	29	26,274	
電気興業	3.7	4	11,600	
サンケン電気	8	8	30,520	
アイホン	5.1	5.1	7,848	
ルネサスエレクトロニクス	336.3	311.1	288,700	
セイコーエプソン	86.9	90.1	140,285	
ワコム	47.8	48.6	46,899	
アルバック	14.1	13.6	57,392	
EIZO	5.5	5.8	21,054	
日本信号	18.5	18.9	17,595	
京三製作所	19	19.7	8,293	
能美防災	9.6	9.6	21,724	
ホーチキ	6	6.2	7,725	
エレコム	7.7	8.4	40,110	
パナソニック	805.2	826.1	919,036	
シャープ	81.6	84.4	118,160	
アンリツ	45.7	47	111,813	
富士通ゼネラル	19.8	19.9	62,983	
ソニー	444.9	453.1	4,396,882	
TDK	33.8	34.9	513,728	
帝国通信工業	5.8	5.5	6,424	
タムラ製作所	24.2	26.3	14,070	
アルプスアルパイン	62.2	64	83,712	
日本トリム	1.3	1.6	6,504	
ローランド ディー・ジー	4.8	5.8	9,900	
フォスター電機	7.7	9.1	10,173	
SMK	2.4	2.5	7,612	
ヨコオ	4.6	5	12,140	
ホンデン	19.3	20.2	17,695	
ヒロセ電機	10.9	11.1	163,836	
日本航空電子工業	16	17.1	23,940	
TOA	8.9	9.6	8,352	
マクセルホールディングス	15.4	16.4	19,680	
古野電気	10.1	10.5	12,474	
ユニデンホールディングス	2.8	3	7,167	
スミダコーポレーション	6.4	8	8,416	
アイコム	4.6	4.2	11,163	
リオン	3.5	3.8	12,179	
船井電機	9.5	12.9	5,418	
横河電機	64.7	66.7	122,994	
新電元工業	2.8	3.3	7,741	
アズビル	44.1	45.5	213,167	
東亜ディーケーケー	5.5	5.5	4,680	
日本光電工業	29.6	30.3	99,990	
チノー	4.2	4.2	5,980	
共和電業	15.2	15.2	6,110	
堀場製作所	14	14.5	81,200	
アドバンテスト	52.4	53.7	389,862	
エスベック	6.5	6.9	13,386	
キーエンス	63.8	65.5	3,490,495	
日置電機	3.9	3.5	13,737	
シスメックス	50.5	51.7	565,081	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本マイクロニクス	11.5	12.1	11,918	
メガチップス	7	7	19,999	
OBARA GROUP	3.8	4.4	14,916	
コーセル	9.9	11.7	12,928	
イリソ電子工業	6	6.1	25,772	
オブテックスグループ	11.9	12.6	23,776	
千代田インテグレ	3.8	4.5	6,871	
レーザーテック	14.4	31.7	348,700	
スタンレー電気	49.3	50.9	156,263	
岩崎電気	4.6	4.1	5,682	
ウシオ電機	41.4	40.9	53,783	
ヘリオス テクノ ホールディング	9.2	13.3	4,016	
日本セラミック	7.4	7.7	22,075	
古河電池	—	6.2	10,515	
山一電機	5.7	6.3	9,531	
図研	5.1	5.1	13,474	
日本電子	14	14.6	59,787	
カシオ計算機	62.6	64.5	120,937	
ファナック	66.9	68	1,724,820	
日本シイエムケイ	17.8	20.8	8,340	
エンプラス	3.6	4.6	13,013	
ローム	31.2	30	261,300	
浜松ホトニクス	50.4	51.7	303,479	
三井ハイテック	8	8.5	24,471	
新光電気工業	23.6	24.7	57,081	
京セラ	99.1	101.9	607,629	
太陽誘電	31.3	32.3	152,940	
村田製作所	206.8	212.5	1,939,912	
双葉電子工業	11.5	12.9	11,158	
北陸電気工業	4.2	5.7	5,215	
ニチコン	24.2	25.3	27,678	
日本ケミコン	5.9	—	—	
KOA	11	11.6	16,599	
市光工業	11.2	12.8	6,758	
小糸製作所	42.1	43.1	270,668	
ミツバ	14	—	—	
SCREENホールディングス	12.3	12.6	87,696	
キャノン電子	7.5	7.6	11,042	
キャノン	378.8	359	665,406	
リコー	179.1	184.7	128,735	
象印マホービン	21.1	19.9	37,531	
東京エレクトロン	46.9	45.9	1,628,073	
輸送用機器 (7.0%)				
トヨタ紡織	20.2	21.3	29,181	
ユニプレス	13.8	14.6	13,067	
豊田自動織機	56.9	58.1	438,074	
モリタホールディングス	12.5	12.7	22,656	
三櫻工業	8.5	11.1	7,337	
デンソー	155	159.2	784,696	
東海理化電機製作所	18.4	19	30,343	
三井E&Sホールディングス	14.9	—	—	
川崎重工業	54.7	56.5	85,597	
名村造船所	27.4	29.6	4,469	
日本車輛製造	3.3	3.4	8,438	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
三菱ロジスネクスト	9.2	10.7	11,855	
日産自動車	830.6	851.4	419,314	
いすゞ自動車	204.9	209.5	213,271	
トヨタ自動車	784.8	807.1	5,648,892	
日野自動車	87.7	90	81,450	
三菱自動車工業	261.1	270.9	50,929	
エフテック	7.6	8.8	4,998	
武蔵精密工業	15.9	16	24,624	
日産車体	14.2	14.4	12,988	
新明和工業	19.2	19	15,694	
極東開発工業	12.7	13.5	18,643	
日信工業	14.3	—	—	
トビー工業	6	7.2	7,761	
ティアラド	3.5	4.1	5,243	
タチエス	12	11.9	13,387	
NOK	38.1	39	44,928	
フタバ産業	20.1	21.3	10,756	
KYB	8	8.2	20,647	
大同メタル工業	16.8	18.3	8,546	
プレス工業	35.7	40.5	12,271	
太平洋工業	15	15.3	16,416	
ケーヒン	16	—	—	
河西工業	11	13.4	4,649	
アイシン精機	57.7	59.3	183,533	
マツダ	206.8	213.5	131,729	
今仙電機製作所	9.5	8.9	7,760	
本田技研工業	554.3	569.4	1,635,032	
スズキ	139.7	143.4	803,613	
SUBARU	218.9	224.4	465,181	
安永	4.1	4.5	5,175	
ヤマハ発動機	92	102.1	205,221	
ショーワ	16.6	—	—	
TBK	15.3	13.1	5,921	
エクセディ	9.4	10.2	12,586	
豊田合成	22.7	23.4	66,268	
愛三工業	12.3	14.6	6,467	
日本プラスト	8.4	8.8	3,960	
ヨロズ	7.7	8.9	10,057	
エフ・シー・シー	11.3	12	23,904	
シマノ	26.3	27.1	670,454	
テイ・エス テック	16.4	16.6	50,630	
ジャムコ	4.8	6.7	4,160	
精密機器 (2.8%)				
テルモ	199.3	204.5	848,061	
日機装	21.6	23.8	23,681	
日本エム・ディ・エム	4.6	5	11,725	
島津製作所	84.3	86.1	323,305	
JMS	9.6	8.3	7,793	
長野計器	7.8	7.4	5,809	
ブイ・テクノロジー	3.3	3.5	18,445	
東京計器	6.4	6.4	5,715	
インターアクション	4.2	4.6	8,648	
東京精密	12.8	13.2	60,786	
マニー	28.3	28.9	73,926	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ニコン	113.6	110.8	71,909	
トプコン	36.1	37.2	49,364	
オリンパス	390	400.4	903,502	
理研計器	6.1	6.2	17,347	
タムロン	5.9	6.4	10,233	
H O Y A	141.8	143.6	1,997,476	
ノーリツ鋼機	5.2	5.6	12,476	
エー・アンド・デイ	7.9	9.1	8,281	
朝日インテック	59.7	82	313,650	
シチズン時計	82.7	80	22,000	
メニコン	9.6	10.1	65,448	
松風	4.3	4.3	7,838	
セイコーホールディングス	9.8	9.6	12,902	
ニプロ	49.9	51.4	57,568	
その他製品（2.7%）				
スノーピーク	4.5	5.8	9,077	
パラマウントベッドホールディングス	7.3	7.5	31,987	
トランザクション	5.3	6	5,628	
ニホンフラッシュ	3.7	7.6	10,366	
前田工織	8.1	7.7	19,996	
永大産業	14.7	15.6	4,524	
アートネイチャー	8.2	10.6	7,091	
パンダイナムコホールディングス	73	74.6	710,938	
SHOEI	3.4	6.2	22,351	
フランスベッドホールディングス	11.8	12.5	10,637	
パイロットコーポレーション	12.5	12.6	37,283	
萩原工業	4.4	5.2	7,971	
トッパン・フォームズ	14.9	14.8	14,770	
フジシールインターナショナル	15.9	15.9	30,798	
タカラトミー	31.8	32.1	29,949	
廣済堂	7.6	8.8	5,552	
プロネクサス	7.2	7.6	8,170	
大建工業	5	5.5	10,862	
凸版印刷	99.2	100.6	143,355	
大日本印刷	91.7	94.3	184,450	
共同印刷	2	2.9	8,462	
N I S S H A	14.8	14.6	20,089	
TAKARA & COMPANY	3.7	4.5	8,721	
アシックス	58.9	63.5	119,380	
小松ウオール工業	2.6	3.1	5,400	
ヤマハ	41.7	42.9	255,684	
河合楽器製作所	2.5	2.8	7,560	
クリナップ	9	9.3	4,296	
ビジョン	42.6	46.4	216,224	
オリバー	—	2	4,722	
キングジム	6.8	8.2	7,339	
リンテック	17	17	36,635	
イトーキ	18.5	20	6,760	
任天堂	43.2	44.4	2,631,144	
三菱鉛筆	11.5	11.5	16,583	
タカラスタンダード	14.1	13.2	18,216	
コクヨ	34	34.1	45,762	
ナカバヤシ	7.4	9.9	6,009	
グローブライド	3.6	3.1	12,539	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
オカムラ	24.3	24.5	22,956	
美津濃	6.5	6.3	11,415	
電気・ガス業（1.3%）				
東京電力ホールディングス	558.3	572.3	155,665	
中部電力	215.4	221.4	278,410	
関西電力	267.2	273.6	261,370	
中国電力	96.8	104.5	138,671	
北陸電力	66	66	48,510	
東北電力	176	179.1	156,712	
四国電力	63.8	66.2	47,002	
九州電力	143.7	147.7	130,123	
北海道電力	68.1	68.7	26,930	
沖縄電力	13	14.5	21,039	
電源開発	55.7	57.4	80,589	
イーレックス	10.4	10	19,640	
レノバ	11.5	12.6	32,634	
東京瓦斯	136	139.1	326,119	
大阪瓦斯	136.7	139.9	280,359	
東邦瓦斯	34.9	35.5	242,465	
北海道瓦斯	4.6	5.8	8,816	
広島ガス	17	22.7	8,421	
西部瓦斯	7.8	8.4	29,820	
静岡ガス	20.4	20.3	20,076	
メタウォーター	3.2	7.4	17,486	
陸運業（3.5%）				
S B Sホールディングス	6.6	5.4	13,597	
東武鉄道	73.9	74.7	233,811	
相鉄ホールディングス	22.8	23.3	59,391	
東急	177.4	180.7	228,946	
京浜急行電鉄	90.4	92.1	164,582	
小田急電鉄	104	106.9	338,338	
京王電鉄	36.5	37.3	276,393	
京成電鉄	48.8	50.1	175,600	
富士急行	9.8	10	48,250	
新京成電鉄	2.8	3.3	7,095	
東日本旅客鉄道	124	127.6	827,868	
西日本旅客鉄道	62.8	64.7	308,230	
東海旅客鉄道	58.5	60.2	800,660	
西武ホールディングス	94.6	94.5	97,807	
鴻池運輸	10.6	11.6	12,029	
西日本鉄道	20	19.9	58,884	
ハマキョウレックス	5.5	5.8	16,941	
サカイ引越センター	3.7	3.9	20,163	
近鉄グループホールディングス	66.6	68.1	315,303	
阪急阪神ホールディングス	88.9	90.9	309,969	
南海電気鉄道	32.1	33	86,526	
京阪ホールディングス	29.6	30.3	148,924	
神戸電鉄	1.7	2.3	8,268	
名古屋鉄道	54.5	55.7	159,970	
山陽電気鉄道	5.9	6	12,198	
日本通運	23.5	23.6	164,728	
ヤマトホールディングス	117.1	113	297,981	
山九	18.5	19.1	73,439	
丸全昭和運輸	5.7	5.9	19,735	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
センコーグループホールディングス	35.9	37.8	36,666	
トナミホールディングス	1.8	1.9	11,115	
ニッコンホールディングス	23.8	24.7	50,190	
福山通運	8.4	8.8	40,744	
セイノーホールディングス	49.7	51	74,562	
神奈川中央交通	2.3	2.3	8,878	
日立物流	11.8	12.8	39,808	
丸和運輸機関	6.9	7.3	33,762	
C&Fロジホールディングス	7.6	7.5	13,935	
九州旅客鉄道	59.6	60.2	132,319	
S Gホールディングス	70	143.8	448,656	
海運業 (0.2%)				
日本郵船	55.4	58.2	132,463	
商船三井	41.9	44.3	120,850	
川崎汽船	19.8	14.3	24,152	
N Sユナイテッド海運	4.4	5.5	7,287	
飯野海運	38.2	39.1	15,131	
乾汽船	5.8	8.1	7,597	
空運業 (0.3%)				
日本航空	122.3	152.2	300,899	
A N Aホールディングス	122.2	125.8	316,701	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム	2	2	16,760	
日新	6.3	6.7	8,120	
三菱倉庫	21.3	22	65,780	
三井倉庫ホールディングス	8.1	8.4	18,874	
住友倉庫	24	22.8	30,780	
滋澤倉庫	4.6	4.5	10,107	
東陽倉庫	20.9	20.9	6,353	
日本トランスシティ	17.3	18	10,188	
川西倉庫	3.2	4	4,564	
安田倉庫	7.5	7.6	7,508	
東洋埠頭	4.9	4.9	7,075	
上組	38.6	36.9	66,604	
近鉄エクスプレス	14	14.5	31,465	
エーアイティー	6.4	8	7,952	
日本コンセプト	3.6	4.3	7,494	
情報・通信業 (9.4%)				
N E C ネットエスアイ	6.5	20.3	37,291	
システナ	24.4	25.5	54,825	
デジタルアーツ	3.5	3.6	32,148	
日鉄ソリューションズ	10.2	10.6	32,701	
キューブシステム	6.8	5.4	7,808	
コア	3.9	4.1	5,719	
ソリトンシステムズ	4.7	4.5	9,688	
ソフトクリエイトホールディングス	4	3.4	10,829	
T I S	23	71.5	148,577	
電算システム	3.3	3.3	10,972	
グリー	49.7	45.6	26,676	
コーエーテックモホールディングス	14.1	14.7	81,585	
三菱総合研究所	3.3	3.2	13,312	
ファインデックス	7.6	8	10,896	
ブレインパッド	1.5	2.1	8,977	
K L a b	14	14.8	15,066	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ポルトゥガイン・ピットクルーホールディ	9.5	10.6	10,176	
ネクソン	196.8	179.5	566,322	
アイスタイル	18.7	—	—	
エムアップホールディングス	2.5	2.5	6,572	
エイチーム	6.7	7.8	7,620	
エニグモ	6.5	7.7	10,202	
コロプラ	23.2	24.9	22,758	
ブロードリーフ	36.1	36.7	23,781	
デジタルハーツホールディングス	5.4	6.1	7,228	
システム情報	4.3	6.3	7,371	
メディアドゥ	2.5	2.5	18,750	
じげん	19.6	23.9	7,815	
ブイキューブ	—	4.7	15,839	
フィックスターズ	8	9.3	9,662	
CART A HOLDINGS	4.5	4.8	6,115	
オブティム	2.4	4.3	13,244	
セレス	3.2	3.5	9,859	
S H I F T	1.8	3	46,410	
ティーガイア	6.1	6.1	11,217	
セック	1.5	1.6	4,848	
豆蔵ホールディングス	5.4	—	—	
テックマトリックス	5	10.6	24,337	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17.3	17.8	47,223	
GMOペイメントゲートウェイ	11.5	15.1	221,064	
システムリサーチ	2.6	2.9	4,738	
インターネットイニシアティブ	10.6	10.9	54,227	
さくらインターネット	8.4	10.9	8,022	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1.8	1.7	17,544	
S R Aホールディングス	4.4	4.8	11,904	
e B A S E	4.8	9.8	10,378	
アバント	5.8	7.8	8,619	
アドソル日進	2.8	3.4	10,057	
フリービット	5.5	6.2	5,704	
コムチュア	7.9	8.3	26,809	
アステリア	5.7	6.4	7,008	
アイル	—	4.6	6,568	
マークラインズ	4.3	4.1	11,139	
メディカル・データ・ビジョン	6.1	8.7	27,144	
g u m i	10.2	10.9	9,461	
モバイルファクトリー	2.3	2.8	2,780	
テラスカイ	3	2.9	14,181	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3.9	4.6	6,941	
ダブルスタンダード	1.1	1.3	5,752	
オープンドア	4	5.3	6,683	
アカツキ	2.6	2.8	12,558	
U b i c o mホールディングス	2.3	2.3	8,234	
L I N E	16.1	14.8	79,624	
カナミックネットワーク	—	8.1	6,593	
チェンジ	1.8	5.1	41,310	
オークネット	5.8	5.8	7,940	
A O I T Y O Holdings	8.7	11.2	4,670	
マクロミル	13.6	17.1	11,115	
オロ	2.2	2.8	10,892	
サインポスト	1.5	—	—	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ソルクシーズ	4.4	4.7	4,963	
プロトコーポレーション	7.5	8.4	8,845	
野村総合研究所	115.1	100.7	354,967	
サイバネットシステム	6.5	8	7,744	
インテジホールディングス	10.7	11.1	11,488	
ソースネクスト	34.8	39.3	12,300	
インフォコム	7.7	7.9	28,914	
HEROZ	—	1.2	3,489	
ラクスル	3.9	6.1	30,927	
アルテリア・ネットワークス	8.5	9	14,319	
フォーカスシステムズ	6.2	6.9	6,230	
クレスコ	2.5	5.9	7,552	
フジ・メディア・ホールディングス	67.1	67.5	73,372	
オービック	23.9	24.6	577,362	
ジャストシステム	11.2	11.6	81,548	
TDCソフト	7.2	7.4	7,725	
Zホールディングス	949.7	976.3	641,429	
トレンドマイクロ	30.9	38.2	216,594	
IDホールディングス	3.9	3.9	4,773	
日本オラクル	13.9	14.5	167,765	
アルファシステムズ	2.7	2.7	9,504	
フューチャー	8.7	9	15,993	
CAC Holdings	5.9	6.1	8,967	
S Bテクノロジー	3	3	10,860	
オービックビジネスコンサルタント	7	7.3	54,020	
伊藤忠テクノソリューションズ	31.4	32.4	119,394	
アイティフォー	10.3	10.9	10,038	
大塚商会	37.2	38.4	194,304	
サイボウズ	9.7	8.9	25,543	
ソフトブレイン	5.5	—	—	
電通国際情報サービス	4.3	4.5	31,455	
ACCESS	—	9	7,380	
デジタルガレージ	12.7	13	54,925	
EMシステムズ	5.3	12.2	10,004	
ウェザーニューズ	3	2.6	14,560	
C I J	8.2	7.1	6,908	
WOWOW	3.5	3.8	10,780	
スカラ	6.4	7.7	6,660	
IMAGICA GROUP	7.8	10.1	4,070	
ネットワンシステムズ	26.5	27.4	101,928	
アルゴグラフィックス	6	6.2	19,840	
マーベラス	13.1	14.1	12,788	
エイベックス	12.6	13.5	12,717	
日本ユニシス	21.7	22.5	86,850	
兼松エレクトロニクス	3.8	3.9	15,756	
TBSホールディングス	42.3	43.1	80,553	
日本テレビホールディングス	58.3	58.4	66,400	
朝日放送グループホールディングス	10.8	10.6	7,345	
テレビ朝日ホールディングス	19.7	19.5	32,838	
スカパーJ S A Tホールディングス	47	49.2	23,271	
テレビ東京ホールディングス	6	5.9	13,859	
ビジョン	6.7	10.8	12,484	
USEN-NEXT HOLDINGS	—	3.8	5,145	
コネクシオ	4.8	5	6,135	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本通信	—	39.5	8,018	
日本電信電話	461.8	948.9	2,339,038	
KDDI	514.8	517.3	1,542,847	
ソフトバンク	627.4	645	828,502	
光通信	7.1	7.3	183,011	
NTTドコモ	510.1	144.7	560,423	
エムティーアイ	9.1	10.3	8,672	
GMOインターネット	27.5	26	76,336	
KADOKAWA	19.1	19.6	64,876	
学研ホールディングス	2.5	9.9	16,176	
ゼンリン	14	15.1	19,569	
アイネット	4.7	5.2	7,737	
松竹	4.6	4.8	62,448	
東宝	41.5	41.9	185,198	
東映	2.6	2.6	43,524	
エヌ・ティ・ティ・データ	182.8	188.9	262,193	
ピー・シー・エー	1.3	1.6	7,256	
D T S	14.9	15.5	34,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29.7	30.5	195,505	
シーイーシー	7.7	8.2	12,439	
カプコン	33.1	33.7	198,156	
ジャステック	6.4	6.1	8,326	
S C S K	16	16.5	102,795	
日本システムウエア	2.6	3.1	6,519	
アイネス	8.3	8.1	11,534	
T K C	5.7	5.9	40,946	
富士ソフト	9	7.6	38,456	
N S D	11.4	23.2	46,284	
コナミホールディングス	25.2	25.9	141,673	
福井コンピュータホールディングス	3	3.3	11,071	
J B C Cホールディングス	5.6	6.2	9,182	
ミロク情報サービス	6.3	7	14,273	
ソフトバンクグループ	548.1	563.2	4,095,590	
卸売業（4.5%）				
伊藤忠食品	1.9	2.1	11,802	
エレマテック	8.1	8.6	8,238	
J A L U X	2.7	3.5	4,707	
あらた	5.6	5.6	27,776	
東京エレクトロン デバイス	3.6	3.4	10,642	
フィールズ	8.5	11.1	4,129	
双日	378.2	393.1	90,019	
アルフレッサ ホールディングス	76.5	79.2	165,528	
横浜冷凍	20.7	18.8	15,980	
アルコニックス	8.3	8	11,032	
神戸物産	23.8	49	178,360	
あい ホールディングス	10.5	10.2	19,859	
ダイワボウホールディングス	5.9	6	39,120	
マクニ・富士エレホールディングス	16.9	17.4	35,965	
ラクト・ジャパン	2.8	3.2	9,417	
バイタルケ-エスケ-ホールディングス	13.5	14	12,054	
八洲電機	8.4	8.8	8,289	
レスタ-ホールディングス	7.4	7.8	17,487	
ジュ-テックホールディングス	2.4	3.2	3,244	
T O K A Iホールディングス	36.2	37.2	36,865	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
三洋貿易	4.1	8.9			9,069
ウイン・パートナーズ	5.6	6.5			7,442
シップヘルスケアホールディングス	11.2	11.4			59,280
コメダホールディングス	15.9	15.5			28,830
小野建	7.5	7.5			9,112
佐鳥電機	7.3	7.6			5,874
伯東	5.3	5.7			6,019
コンドーテック	5.8	7.7			7,823
ナガイレーベン	10.6	9.3			25,128
三菱食品	7	6.9			19,030
松田産業	5.8	6.5			11,186
第一興商	10.6	10.5			35,385
メディバルホールディングス	74.3	76.4			149,973
S P K	2.6	5.4			6,739
萩原電気ホールディングス	3.2	3.5			8,456
アズワン	4.6	4.7			75,388
尾家産業	3.6	3.6			5,313
シモジマ	6.1	6			7,974
ドウシシャ	6.8	6.9			13,862
高速	5.5	5.6			8,825
ハビネット	6.7	7.3			10,409
日本ライフライン	20.4	21.6			31,060
マルカ	3.3	3.8			7,524
I D O M	21	19.1			10,925
進和	4.7	5.4			11,647
ダイトロン	3.9	4.3			6,342
シークス	9.2	9.5			14,877
オーハシテクニカ	5.7	5.6			7,560
伊藤忠商事	484.9	498.4			1,374,836
丸紅	722.3	742.5			451,811
長瀬産業	39	39.4			56,539
蝶理	4.9	5.4			8,316
豊田通商	77.4	79.1			285,551
三共生興	15	16.4			7,166
兼松	24.9	26.5			31,932
三井物産	609.2	616.9			1,098,082
日本紙バルブ商事	4.1	3.9			13,435
日立ハイテク	24.1	—			—
カメイ	9.6	9.9			11,612
スターゼン	2.7	2.6			11,037
山善	26.1	26.7			26,539
椿本興業	1.6	1.9			6,925
住友商事	437.8	449.3			578,024
内田洋行	3.2	2.8			14,364
三菱商事	486.7	467.2			1,136,697
第一実業	3.8	3.5			14,087
キャンマーケティングジャパン	20.3	17.9			39,075
西華産業	5.4	6.2			7,812
佐藤商事	7.7	7.7			7,915
菱洋エレクトロ	7.2	7.2			19,814
東京産業	9.1	10.5			5,848
ユアサ商事	6.2	6.6			21,615
神鋼商事	2.2	2.7			5,022
阪和興業	13.1	13.3			33,250

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
正栄食品工業	4.7	4.8			18,096
カナデン	7	7.4			9,538
菱電商事	6.1	6.5			9,802
フルサト工業	5.2	5			6,265
岩谷産業	15.6	18.7			106,216
極東貿易	3.2	3.3			4,544
イワキ	12.3	12.9			6,785
三菱石油	17.2	17.4			20,079
稲畑産業	14.3	14.9			20,532
明和産業	8.4	10			4,070
ヤマエ久野	—	6.8			8,098
ワキタ	15.7	15.4			17,633
東邦ホールディングス	22.6	23			43,769
サンゲツ	19	20.1			29,446
ミツロコグループホールディングス	10.7	10.8			13,953
シナネンホールディングス	3.9	3.8			11,240
伊藤忠エネクス	14.8	15.1			15,100
サンリオ	19.5	20			31,500
サンワテクノス	6.6	7			6,587
リョーサン	7.7	7.9			14,654
新光商事	11.7	13.8			10,598
トーホー	4.3	4.7			9,559
三信電気	4.4	5.1			10,944
東陽テクニカ	10	9.6			10,156
モスフードサービス	9.3	9.6			25,948
加賀電子	7.1	6.7			14,505
ソーダニッカ	10.5	12			6,480
立花エレテック	5.8	6			9,882
P A L T A C	11	11.4			68,172
太平洋興発	6.6	7.5			4,635
西本Wismettacホールディングス	1.7	2.8			6,314
国際紙バルブ商事	20.5	24.7			6,298
ヤマタネ	4.8	6.5			8,911
日鉄物産	4.6	4.5			15,975
泉州電業	2.8	3			8,625
トラスコ中山	14.2	16.3			42,477
オートボックスセブン	26.1	27			34,992
モリト	7.7	9.7			5,936
加藤産業	10.6	9.6			33,168
イノテック	5.8	6			5,436
イエローハット	13.1	13.9			22,379
J Kホールディングス	9.3	8.5			6,885
日伝	6.6	6.8			16,034
杉本商事	4.7	4.7			11,209
因幡電機産業	19.4	19.6			46,981
東テク	2.8	3.1			7,812
ミスミグループ本社	86.7	89.2			292,130
タキヒヨー	2.8	3.8			7,121
スズケン	29.4	30.4			121,296
ジェコス	7.2	7			6,699
小売業(4.8%)					
ローソン	17.7	18.3			86,559
サンエー	5.6	5.4			21,789
カワチ薬品	5.5	5.6			16,788

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
イービーシー・マート	10.8	11	59,840	
アスクル	7.5	7.4	30,895	
ゲオホールディングス	12.7	13.2	16,750	
アダストリア	9.8	10.4	17,680	
くら寿司	3.7	4.3	24,295	
キャンドウ	5	5	9,210	
バルグループホールディングス	3.7	8.7	9,918	
エディオン	31.1	30.8	30,030	
サーラコーポレーション	16.3	16.4	9,249	
ハローズ	2.9	2.8	9,688	
フジオフードグループ本社	3.4	7.5	10,665	
あみやき亭	2.2	2.3	6,559	
ひらまつ	20.5	26.9	4,949	
大黒天物産	2.1	2.1	12,054	
ハニースホールディングス	7.1	7.5	7,162	
アルベン	5.9	5.9	12,891	
クオールホールディングス	10.6	10.2	10,628	
ジンスホールディングス	3.8	3.8	27,018	
ビックカメラ	40.3	42.1	47,194	
DCMホールディングス	36.4	41.7	49,456	
MonotaRO	49.4	50.8	323,596	
DDホールディングス	3.3	—	—	
アークランドサービスホールディングス	5.6	6.5	13,396	
J. フロント リテイリング	82.7	85.8	71,814	
ドール・日レスホールディングス	10.5	9.5	13,708	
マツモトキヨシホールディングス	28.4	29.2	142,642	
ブロンコビリー	3.9	4.3	9,894	
ZOZO	48	49.7	129,418	
物語コーポレーション	1.8	1.9	21,907	
ココカラファイン	7.2	7.3	55,407	
三越伊勢丹ホールディングス	121.4	123.9	69,507	
Hamee	2.8	3.6	6,346	
ウエルシアホールディングス	20.6	42.3	177,448	
クリエイトSDホールディングス	9.5	11.7	43,407	
チムニー	3	3.5	4,308	
シュッピン	5.9	7.6	6,330	
オイシックス・ラ・大地	—	7.1	22,897	
ネクステージ	10.3	12.8	17,766	
ジョイフル本田	20.4	20.2	29,350	
鳥貴族	3	3.4	4,664	
キリン堂ホールディングス	3.2	—	—	
ホットランド	6.3	7.5	9,390	
すかいらーくホールディングス	77.9	80.6	127,428	
SFPホールディングス	3.7	5.4	6,879	
綿半ホールディングス	3.1	6.8	9,350	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	18.5	20	21,620	
B E E N O S	3.4	4.3	10,900	
あさひ	6.2	5.8	9,042	
日本調剤	2.3	5.4	8,181	
コスモス薬品	3.1	6.3	113,400	
セブン&アイ・ホールディングス	271.5	278.8	923,664	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	18.6	40.3	22,205	
ツルハホールディングス	15	15.5	236,840	
サンマルクホールディングス	5.4	6.3	9,053	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
トリドールホールディングス	8.7	18.1	25,376	
TOKYO BASE	7.3	9.8	4,772	
JMホールディングス	3.9	5.7	13,879	
パロックジャパンリミテッド	6.7	8.4	5,653	
クスリのアオキホールディングス	6.9	6.4	55,680	
力の源ホールディングス	4.1	4.5	2,646	
スシローグローバルホールディングス	7.6	39.3	130,476	
LIXILビバ	7	—	—	
メディカルシステムネットワーク	9.2	9.8	6,134	
ノジマ	11.6	12.8	34,944	
カップ・クリエイト	10.2	10.8	15,195	
良品計画	92	95	203,965	
アドヴァン	11.3	11.5	14,961	
アルビス	3.3	3.6	9,201	
コナカ	15.2	18.7	4,824	
G-7ホールディングス	2.1	4.5	10,962	
イオン北海道	8.4	12.1	11,567	
コジマ	14.1	14.6	11,023	
コーナン商事	9.4	10.3	33,269	
エコス	3.3	3.2	7,372	
ワタミ	9	10.1	8,958	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	166	156.8	386,825	
西松屋チェーン	15.4	16.4	25,780	
ゼンショーホールディングス	33.5	34.3	89,523	
幸楽苑ホールディングス	5.2	6.1	10,821	
サイゼリヤ	11.4	10.8	19,332	
VTホールディングス	30.1	33.2	12,450	
フジ・コーポレーション	2.5	3	6,993	
ユナイテッドアローズ	7.5	8.2	11,996	
ハイデイ日高	9.6	9.7	16,422	
コロワイド	23.9	22	33,924	
ピーシードポコーポレーション	11.8	12.8	7,641	
壱番屋	4.9	5	25,600	
スギホールディングス	13.9	14.3	99,099	
薬王堂ホールディングス	3.2	3.6	8,643	
ヴィア・ホールディングス	13.3	—	—	
スクロール	15.8	14.3	11,053	
ヨンドシーホールディングス	7.3	7.5	13,980	
ファミリーマート	55.5	—	—	
木曽路	9.1	8.7	20,523	
SRSホールディングス	11.2	12	10,416	
千趣会	17.8	17.8	5,909	
リテールパートナーズ	—	10.2	15,106	
ケーヨー	18.8	14.8	10,981	
上新電機	8	7.9	21,661	
日本瓦斯	11.2	11.3	59,664	
ロイヤルホールディングス	11.8	12.4	22,096	
いなげや	8.9	8.7	17,739	
島忠	13.2	13.2	72,336	
チヨダ	7.6	9.6	8,572	
ライフコーポレーション	5.4	5.7	21,004	
リンガーハット	8.8	9.3	20,571	
M R M a x H D	12.5	12.5	10,675	
AOKIホールディングス	13.6	17.2	7,034	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
オークワ	11	11.5	15,398	
コメリ	10.5	11.2	31,752	
青山商事	14.6	18.9	8,429	
しまむら	8	8.2	88,560	
高島屋	51.6	52.4	42,077	
松屋	14.9	15.7	11,288	
エイチ・ツー・オー リテイリング	33	32.2	20,704	
近鉄百貨店	2.8	3	9,885	
バルコ	7.2	—	—	
丸井グループ	63.6	65.7	125,224	
アクシアル リテイリング	5.6	5.8	27,521	
イオン	266.4	274.2	851,391	
イズミ	14.2	14.8	53,280	
平和堂	13.6	13.2	28,036	
フジ	8.5	8.2	15,752	
ヤオコー	7.6	7.9	56,406	
ゼビオホールディングス	8.8	9.8	7,448	
ケーズホールディングス	67.1	68	86,224	
Olympicグループ	6.3	5.8	5,800	
日産東京販売ホールディングス	17.8	18.4	4,600	
Genky DrugStores	3.7	3.3	13,695	
総合メディカルホールディングス	6.3	—	—	
ブックオフグループホールディングス	4.9	5.9	4,950	
アインホールディングス	9.5	8.9	63,279	
元氣寿司	2.4	2.6	6,045	
ヤマダホールディングス	210.5	215.4	106,838	
アークランドサカモト	10.9	11.8	21,110	
ニトリホールディングス	30	30.8	684,684	
グルメ杵屋	6.2	8.4	8,240	
吉野家ホールディングス	23.5	24.4	46,506	
松屋フーズホールディングス	3.3	3.1	10,633	
サガミホールディングス	9.8	10.1	12,554	
関西スーパーマーケット	6.6	6.9	8,638	
王将フードサービス	5	5	30,000	
ブレナス	7.8	7.5	13,027	
ミニストップ	5.8	6.5	8,775	
アークス	13.4	14.2	30,984	
パローホールディングス	14.8	15.2	39,398	
ベルク	3.2	3.6	21,996	
大庄	5.2	5.4	5,184	
ファーストリテイリング	9.3	9.5	816,430	
サンドラッグ	26	26.7	116,946	
サックスパー ホールディングス	8.3	9.2	4,885	
ペルーナ	15.3	16.6	15,869	
銀行業 (4.6%)				
じもとホールディングス	59.1	5.5	4,933	
めぶきフィナンシャルグループ	361.1	370.2	79,222	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10	10.6	12,084	
九州フィナンシャルグループ	112.6	155.3	79,203	
ゆうちょ銀行	196.3	202	166,044	
富山第一銀行	19.6	18.1	5,285	
コンソルディア・フィナンシャルグループ	409.1	407.2	151,071	
西日本フィナンシャルホールディングス	47.3	47	33,981	
関西みらいフィナンシャルグループ	41.1	42.5	22,185	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
三十三フィナンシャルグループ	6.5	6.7	8,582	
第四北越フィナンシャルグループ	12.1	12.9	30,495	
ひろぎんホールディングス	—	106.6	61,934	
新生銀行	50.8	52.8	65,577	
あおぞら銀行	41.1	42.4	80,348	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,780.6	4,879.9	2,188,635	
りそなホールディングス	760.7	774.1	283,088	
三井住友トラスト・ホールディングス	131.1	134.5	410,359	
三井住友フィナンシャルグループ	480.3	493.2	1,495,382	
千葉銀行	238.2	237.8	140,777	
群馬銀行	135.4	138.6	45,045	
武蔵野銀行	10.6	11.2	17,785	
千葉興業銀行	20.6	20.2	5,312	
筑波銀行	30.8	30.1	5,899	
七十七銀行	23.7	24.2	35,477	
青森銀行	5.4	5.6	13,624	
秋田銀行	5.2	4.8	6,686	
山形銀行	8.7	8.7	10,274	
岩手銀行	5	5	11,080	
東邦銀行	60	63.6	14,437	
東北銀行	4	4	4,304	
みちのく銀行	5	5.5	6,506	
ふくおかフィナンシャルグループ	58.3	60.2	112,152	
静岡銀行	171.2	170.4	126,436	
十六銀行	9	9.1	18,045	
スルガ銀行	72.7	74.4	25,072	
八十二銀行	166.8	166.6	61,808	
山梨中央銀行	9.2	9.2	6,798	
大垣共立銀行	13.7	14.2	33,341	
福井銀行	5.9	6	11,970	
北國銀行	7.6	7.3	21,053	
清水銀行	2.9	3	5,670	
富山銀行	1.6	1.5	5,190	
滋賀銀行	13.7	14.1	33,459	
南都銀行	11.9	12	22,452	
百五銀行	64.7	66.3	21,017	
京都銀行	24.7	25.4	132,334	
紀陽銀行	24.5	25.6	40,704	
ほくほくフィナンシャルグループ	46.8	47.4	49,153	
広島銀行	101.2	—	—	
山陰合同銀行	42	44.2	24,089	
中国銀行	60	61	56,181	
伊予銀行	97.6	100.7	69,684	
百十四銀行	7.6	7.9	12,782	
四国銀行	10.4	11.5	8,142	
阿波銀行	11.4	11.6	29,788	
大分銀行	4.2	4.2	9,765	
宮崎銀行	4.5	5	11,500	
佐賀銀行	4.7	4.7	6,439	
沖縄銀行	6.5	6.5	19,194	
琉球銀行	15.7	17.1	14,928	
セブン銀行	235.6	240.4	55,051	
みずほフィナンシャルグループ	9,433.6	969.1	1,286,480	
山口フィナンシャルグループ	87.8	89.2	58,158	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
名古屋銀行	6	5.5	14,883	
北洋銀行	108.3	110.4	25,723	
愛知銀行	2.9	2.5	7,700	
中京銀行	3	3	6,417	
大光銀行	2.5	2.5	3,132	
愛媛銀行	10.2	10.3	11,072	
京葉銀行	30.8	31.9	14,578	
栃木銀行	39.6	40.1	7,338	
北日本銀行	—	2.7	5,510	
東和銀行	12.3	14.2	9,116	
トモニホールディングス	57.6	58.5	19,539	
フィデアホールディングス	73	75	8,175	
池田泉州ホールディングス	78.2	88.8	13,497	
証券・商品先物取引業 (0.8%)				
F P G	22.8	22	10,934	
S B Iホールディングス	77.7	81.8	231,494	
ジャフコグループ	10.6	11.2	50,176	
大和証券グループ本社	557.3	572.1	259,790	
野村ホールディングス	1,223.1	1,254.4	657,305	
岡三証券グループ	62.6	62.6	23,099	
丸三証券	22.5	22.1	10,475	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82.4	82.5	25,410	
水戸証券	26.5	26.5	6,254	
いちよし証券	13.6	16.3	7,661	
松井証券	40.9	41.9	35,196	
マネックスグループ	56.1	56.3	19,648	
極東証券	11.1	10.9	7,869	
岩井コスモホールディングス	8	7	9,324	
藍澤證券	12.5	14.5	10,498	
スパークス・グループ	30	35.8	8,413	
保険業 (1.9%)				
かんぽ生命保険	24.9	25.5	44,370	
S O M P Oホールディングス	130.6	134.1	537,741	
アニコムホールディングス	5.8	24.5	26,778	
M S & A Dインシュアランスグループホール	181.7	186.4	565,724	
ソニーフィナンシャルホールディングス	56.9	—	—	
第一生命ホールディングス	393.1	403.2	663,062	
東京海上ホールディングス	248.3	252.2	1,308,918	
T & Dホールディングス	214.5	213.2	259,890	
アドバンスクリエイト	1.5	1.8	3,456	
その他金融業 (1.1%)				
全国保証	19.6	20.4	97,410	
日本モーゲージサービス	—	3.5	3,986	
C a s a	3	3	3,840	
アルヒ	11.2	11.8	22,667	
プレミアグループ	4	4	8,980	
クレディセゾン	48.9	50.1	59,869	
芙蓉総合リース	7.3	7.4	47,212	
みずほリース	10.9	11.2	31,102	
東京センチュリー	14	14.3	98,813	
日本証券金融	32.2	34.7	17,350	
アイフル	111.7	110.9	29,610	
リコーリース	5.8	6	17,406	
イオンフィナンシャルサービス	42.5	44.2	50,299	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
アコム	138.8	143.6	71,943	
ジャックス	7.8	8.5	15,436	
オリエントコーポレーション	195.6	203.5	23,402	
日立キャピタル	16.2	17.4	41,655	
アプラスフィナンシャル	44.1	—	—	
オリックス	434.3	441.2	685,183	
三菱UFJリース	176.2	175.5	84,064	
日本取引所グループ	199.5	204.6	528,584	
イー・ギャランティ	7.1	8.8	18,189	
NECキャピタルソリューション	3.3	3.3	5,982	
不動産業 (2.0%)				
いちご	90.2	89	29,370	
日本駐車場開発	85.3	99.2	12,598	
スター・マイカ・ホールディングス	4.5	4.8	6,624	
ヒューリック	149	152	160,664	
三栄建築設計	4	3.8	6,593	
野村不動産ホールディングス	42.2	43.2	97,632	
三重交通グループホールディングス	18	18.8	8,779	
サムティ	9.9	10.3	17,036	
ディア・ライフ	10.3	14.3	5,977	
日本商業開発	6.1	6.1	10,443	
プレサンスコーポレーション	11.1	11.3	19,820	
ユニゾホールディングス	10.8	—	—	
日本管理センター	5.8	6	7,806	
フージャースホールディングス	16.6	17.3	11,660	
オープンハウス	20.1	22.6	93,451	
東急不動産ホールディングス	188.2	194.4	98,366	
飯田グループホールディングス	56.6	59	123,782	
ムゲンエステート	8.2	10.2	5,212	
ビーロッド	2.5	5.7	4,731	
ハウスドゥ	4.8	4.7	5,560	
ジェイ・エス・ビー	1.2	2.1	6,856	
パーク24	37.7	39	60,684	
バラカ	3.1	3.1	5,090	
三井不動産	347.3	346.5	755,889	
三菱地所	487	500	902,000	
平和不動産	13	13.1	44,802	
東京建物	77	71.1	101,886	
タイビル	18.4	18.8	25,248	
京阪神ビルディング	12.1	11.1	21,289	
住友不動産	156.5	160.2	545,481	
テーオーシー	15	16.9	10,799	
東京楽天地	1.7	1.7	7,403	
スターツコーポレーション	9.2	8.9	25,089	
フジ住宅	11.8	11.8	7,257	
空港施設	13.3	11.4	5,289	
ゴールドクレスト	5.9	6.9	9,694	
エスリード	3.8	4	5,268	
日神グループホールディングス	14.1	14.5	5,466	
日本エスコン	14.1	13.5	12,447	
タカラレーベン	33.5	36.4	10,774	
A V A N T I A	7	7	5,635	
イオンモール	35.7	36.1	60,467	
ファースト住建	5.2	4.8	5,131	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
カチタス	8.8	18	55,800	
トーセイ	9.9	11.6	13,490	
サンフロンティア不動産	10.2	12.4	11,420	
エフ・ジェー・ネクスト	7.8	7.6	7,486	
ランドビジネス	7.4	11.6	3,897	
日本空港ビルデング	22.4	22.8	138,624	
サービス業 (6.1%)				
日本工営	4.6	4.9	13,891	
L I F U L L	24.8	28.5	11,143	
ミクシィ	—	13.4	38,203	
ジェイエイシーリクルートメント	5	5.8	10,753	
日本M&Aセンター	50.9	53	386,900	
メンバーズ	2.3	2.8	6,412	
U T グループ	—	11	36,245	
アイティメディア	—	3.3	8,448	
タケエイ	8.1	8.6	11,205	
ビーネックスグループ	8.1	10.5	11,970	
コシダカホールディングス	16.6	19.8	7,860	
パソナグループ	8.4	8	14,432	
リンクアンドモチベーション	16.3	16.8	9,374	
G C A	9.8	12.1	8,603	
エス・エム・エス	21.3	22	83,270	
パーソルホールディングス	67.3	69.6	133,075	
リニカル	4.7	5.9	4,165	
クックパッド	28.3	30	9,600	
学情	3.4	4.1	4,460	
スタジオアリス	4.3	4.6	8,661	
シミックホールディングス	4.7	5.1	6,992	
総合警備保障	26.7	27.3	152,607	
カカクコム	50.8	51.5	150,843	
アイロムグループ	3.3	3.3	5,989	
ルネサンス	4.9	6.2	5,363	
ディップ	9.5	9.7	23,609	
デジタルホールディングス	4.2	5.8	10,828	
新日本科学	9.3	10.2	6,905	
ツクイホールディングス	18.4	19.6	11,328	
ベネフィット・ワン	18.1	25.4	85,598	
エムスリー	148.3	152.4	1,466,392	
アウトソーシング	38.3	40.3	57,790	
ウェルネット	9.1	11.7	5,744	
ワールドホールディングス	2.7	3	6,102	
ディー・エヌ・エー	33.7	30.1	55,083	
博報堂D Yホールディングス	93	95.4	144,054	
ぐるなび	13.5	15.2	7,858	
タカミヤ	9.4	12.5	6,837	
ジャパンベストレスキューシステム	5.6	7.1	6,816	
ファンコミュニケーションズ	21	22.8	9,530	
ライク	3.2	3.2	6,697	
エスプール	14.2	18	13,698	
WD Bホールディングス	3.3	3.6	10,224	
バリューコマース	4.3	4.9	17,052	
インフォマート	37.5	71.1	76,148	
J Pホールディングス	27.2	28.8	8,092	
E P Sホールディングス	10.7	10.8	10,357	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
プレステージ・インターナショナル	26	26.8	25,781	
アミューズ	4.1	4.5	11,587	
ドリームインキュベータ	3.1	4	5,804	
クイック	4.9	5.4	6,075	
ケネディクス	65.4	58	44,022	
電通グループ	69.2	77.9	264,860	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3.4	—	—	
びあ	2.1	1	2,715	
イオンファンタジー	2.8	3.4	7,480	
シーティーエス	9	9.3	8,742	
ネクシィーズグループ	2.8	4.8	4,118	
H. U. グループホールディングス	19.4	19.6	55,389	
アルプス技研	6.3	6.4	13,408	
日本空調サービス	9.6	10	7,620	
オリエンタルランド	71.5	73.5	1,305,727	
ダスキン	17.4	16.6	46,048	
明光ネットワークジャパン	10.1	12.4	6,547	
ファルコホールディングス	5.1	5.1	8,093	
ラウンドワン	19.3	20.4	17,523	
リゾートトラスト	31.7	32.3	52,584	
ビー・エム・エル	8.6	8.7	28,536	
りらいあコミュニケーションズ	12.2	12.6	15,548	
リソー教育	32.3	37.9	11,938	
ユー・エス・エス	75.4	76.8	167,731	
サイバーエージェント	39	42.8	306,020	
楽天	313.9	323.1	377,703	
クリーク・アンド・リバー社	4.5	5	5,170	
テー・オー・ダブリュ	8.3	17.7	4,956	
山田コンサルティンググループ	3.8	5.6	5,432	
セントラルスポーツ	2.9	3.4	7,310	
フルキャストホールディングス	6.6	7.1	12,020	
エン・ジャパン	11.9	12.3	39,975	
テクノプロ・ホールディングス	13.5	13.9	122,320	
アイ・アールジャパンホールディングス	3.1	2.8	46,620	
K e e P e r 技研	—	6.2	13,051	
G u n o s y	5.3	5.8	4,355	
イー・ガーディアン	3.6	3.5	11,095	
ジャパンマテリアル	20.6	21.5	31,196	
ベクトル	9.3	10.3	9,476	
チャーム・ケア・コーポレーション	2.5	6.9	9,308	
I B J	5.6	7.6	5,829	
アサンテ	3.7	4.7	6,612	
N ・ フィールド	7	7.2	5,652	
バリューHR	1.7	4.2	7,795	
M & A キャピタルパートナーズ	4.8	5.6	35,280	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.7	3.8	7,679	
シグマクシス	5	5.5	9,020	
ウィルグループ	5.1	6.3	6,167	
メドピア	—	3.3	21,813	
リクルートホールディングス	481.7	495.3	2,179,320	
エラン	4.4	4.9	15,631	
日本郵政	551.6	564	435,802	
ベルシステム24ホールディングス	11.6	12	19,236	
鎌倉新書	5.4	6.4	6,860	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
LITALICO	2.9	3			10,650
エアトリ	3.5	—			—
アトラエ	2	2.4			7,368
ストライク	2.6	2.7			17,064
ソラスト	18.9	19.3			29,278
インソース	3.5	3.4			12,546
ペイカレント・コンサルティング	4.2	4.2			72,996
グレイステクノロジー	3.3	3.3			27,489
ジャパンエレベーターサービスホールディング	7.3	8.1			39,406
グリーンズ	4.3	—			—
日総工業	5.2	6.7			5,038
キュービーネットホールディングス	4.7	4			6,348
RPAホールディングス	4.4	6.6			4,441
スプリックス	3.1	4.1			3,452
マネジメントソリューションズ	—	4.5			6,786
プロレド・パートナーズ	—	1.1			5,357
カープスホールディングス	—	20			14,440
アドバンテッジリスコムマネジメント	4.7	5.9			4,082
リログループ	36.8	38.3			111,567
東祥	4.8	5.7			7,581
エイチ・アイ・エス	10.6	11.1			17,871
共立メンテナンス	11	11.7			42,529
イチネンホールディングス	8.3	8.8			11,545
建設技術研究所	5.6	5.4			11,421
スペース	—	6			4,842
燦ホールディングス	4.4	4.5			5,490
東京テアトル	4.7	4.4			5,667
ナガワ	2.1	2.3			21,022
よみうりランド	2.1	1			6,040
東京都競馬	4.6	4.4			22,748
常磐興産	4.9	—			—
カナモト	11.1	12.5			27,162
東京ドーム	28.2	28.8			38,793
西尾レントオール	6.8	6.3			12,807
トランス・コスモス	6.4	6.9			18,630
乃村工藝社	28.8	30.2			23,556
藤田観光	3.7	—			—
KNT-CTホールディングス	4.8	—			—
日本管財	6.4	6.3			13,066
トーカイ	6.6	6.5			13,214
セコム	71.3	73.3			761,953

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
セントラル警備保障	3.3	3.4			11,815
丹青社	13.1	15.8			12,039
メイテック	8.5	8.5			40,842
応用地質	7.9	8.3			10,084
船井総研ホールディングス	13.7	14.7			36,985
オオバ	8.2	8.2			6,174
ベネッセホールディングス	22.7	23.7			51,950
イオンディライト	8.1	8.1			21,335
ナック	6	6			5,490
ニチイ学館	9.9	—			—
ダイセキ	11.3	11.8			34,939
合計	株数・金額	81,710	75,624	176,346,813	
	銘柄数<比率>	1,661	1,648	<97.7%>	

※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。

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※評価額の単位未満は切捨て。ただし、評価額が単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	期		末	
	買	建		建
国内	TOPIX		3,616	—
			百万円	百万円

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

■ 投資信託財産の構成

(2020年11月30日現在)

項目	期		末
	評価額	比率	
株	176,346,813	97.4	
コール・ローン等、その他	4,629,863	2.6	
投資信託財産総額	180,976,676	100.0	

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2020年11月30日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	182,707,781,463円
コール・ローン等	2,068,196,828
株式(評価額)	176,346,813,610
未 収 入 金	1,490,479,706
未 収 配 当 金	1,157,091,319
差入委託証拠金	1,645,200,000
(B) 負 債	2,221,773,203
未 払 金	74,697,472
未 払 解 約 金	390,456,554
未 払 利 息	5,163
差入委託証拠金代用有価証券	1,756,600,000
その他未払費用	14,014
(C) 純資産総額(A-B)	180,486,008,260
元 本	62,877,618,349
次期繰越損益金	117,608,389,911
(D) 受益権総口数	62,877,618,349口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,704円

※当期における期首元本額63,743,430,458円、期中追加設定元本額16,414,885,649円、期中一部解約元本額17,280,697,758円です。

※代用として、担保に供している資産は、株式2,799,600,000円です。（受渡しベース）

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

（自2019年12月3日 至2020年11月30日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,977,494,527円
受 取 配 当 金	3,977,638,105
受 取 利 息	13
そ の 他 収 益 金	1,507,242
支 払 利 息	△ 1,650,833
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,604,156,195
売 買 益	25,626,270,617
売 買 損	△ 19,022,114,422
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 110,849,500
取 引 益	1,230,195,000
取 引 損	△ 1,341,044,500
(D) 信 託 報 酬 等	△ 923,029
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	10,469,878,193
(F) 前期繰越損益金	110,654,863,523
(G) 追加信託差損益金	23,133,127,061
(H) 解約差損益金	△ 26,649,478,866
(I) 計 (E+F+G+H)	117,608,389,911
次期繰越損益金(I)	117,608,389,911

※有価証券売買損益および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。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,593,112,435円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	2,066,309,075円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	924,099,772円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	7,670,534,834円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,437,512,099円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	47,626,634円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,182,148,801円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	197,754,086円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	171,397,205円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	533,150円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	5,673,022円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	845,219,384円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	23,413,868円	SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	54,367,762円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	66,326,513円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	341,176,214円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	127,855,299円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,003,227,262円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	95,770,146円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	773,646,515円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	191,642,664円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,435,179,848円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,182,656,821円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	777,157円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	14,894,965,209円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	53,935,752円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	373,453,945円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	61,624,654円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	408,583,033円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,563,364円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	266,224,089円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	20,614,021円
イオン・バランス戦略ファンド	24,685,046円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	151,409,094円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,780,552円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	304,450,841円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	119,160,393円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	86,690,924円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	94,968,523円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	48,801,662円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	312,450,363円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,014,718円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	154,728,514円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	60,239,936円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	169,643,016円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	785,065,293円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	21,524,925円	SMAM・国内株式インデックスファンド・VA（適格機関投資家専用）	180,416,835円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	126,244,586円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	1,078,473円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	6,314,117円	SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	440,633,490円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	31,885,382円	SMAM・グローバルバランスファンド（債券重視型）VA<適格機関投資家限定>	155,973,301円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	27,185,537円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,261,312,360円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,079,650円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	94,325,682円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,506,055,801円	SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	20,538,793円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	19,074,070円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	59,665,207円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	162,193,127円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	82,302,624円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	2,502,207,801円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	277,593,080円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

SMAM・年金国内債券パッシブファンド 〈適格機関投資家限定〉

(2019年6月21日から2020年6月22日まで)

第 16 期

決算日 2020年6月22日

■当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2004年5月21日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、NOMURA-BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指します。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド 日本の公社債および短期金融資産
当ファンドの運用方法	■マザーファンドおよび日本の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ■マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、ファンド設定当初や解約・償還への対応などの事情により変更することもあります。
組入制限	当ファンド ■株式への投資は、転換社債の転換、ならびに新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ■外貨建資産への投資は行いません。 国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	年1回（毎年6月20日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、以下の方針に基づき分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

■ 1 万 口 当 た り の 費 用 明 細 (2 0 1 9 年 6 月 2 1 日 か ら 2 0 2 0 年 6 月 2 2 日 ま で)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 信託報酬	7円	0.055%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数)
(投信会社)	(2)	(0.014)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(2)	(0.013)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、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)	(4)	(0.028)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.003	その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.003)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	7	0.058	

期中の平均基準価額は13,240円です。

※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、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

■ 当 期 中 の 売 買 及 び 取 引 の 状 況 (2 0 1 9 年 6 月 2 1 日 か ら 2 0 2 0 年 6 月 2 2 日 ま で)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド	9,967,244	14,253,673	2,935,279	4,174,528

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 組 入 れ 資 産 の 明 細 (2 0 2 0 年 6 月 2 2 日 現 在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド	22,128,610	29,160,574	41,215,555

※国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンドの期末の受益権総口数は88,893,770千口です。

※単位未満は切捨て。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年6月22日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	41,220,306,665円
コール・ローン等	10,755
国内債券(NOMURA-BPI) マザーファンド(評価額)	41,215,555,913
未 収 入 金	4,739,997
(B) 負 債	16,035,456
未 払 解 約 金	4,739,997
未 払 信 託 報 酬	10,800,417
そ の 他 未 払 費 用	495,042
(C) 純資産総額(A-B)	41,204,271,209
元 本	31,512,589,462
次期繰越損益金	9,691,681,747
(D) 受益権総口数	31,512,589,462口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,075円

※当期における期首元本額23,899,072,188円、期中追加設定元本額10,869,288,599円、期中一部解約元本額3,255,771,325円です。
 ※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。
 ※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2019年6月21日 至2020年6月22日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 705円
支 払 利 息	△ 705
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 634,011,828
売 買 益	36,791,445
売 買 損	△ 670,803,273
(C) 信 託 報 酬 等	△ 20,500,589
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 654,513,122
(E) 前期繰越損益金	3,910,612,864
(F) 追加信託差損益金	6,435,582,005
(配 当 等 相 当 額)	(6,918,905,886)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 483,323,881)
(G) 計 (D+E+F)	9,691,681,747
(H) 収 益 分 配 金	0
次期繰越損益金(G+H)	9,691,681,747
追加信託差損益金	6,435,582,005
(配 当 等 相 当 額)	(6,924,490,341)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 488,908,336)
分 配 準 備 積 立 金	4,469,171,306
繰 越 損 益 金	△ 1,213,071,564

※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。
 ※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 ※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 ※期末における、費用控除後の配当等収益(282,974,345円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(6,924,490,341円)および分配準備積立金(4,186,196,961円)より分配可能額は11,393,661,647円(1万口当たり3,615円)ですが、分配は行っておりません。

国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド

第20期(2019年6月21日から2020年6月22日まで)

信託期間	無期限(設定日:2000年6月21日)
運用方針	主として日本の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク)NOMURA-BPI		債券組入 比率	純資産 総額
	円	%	(総合)	騰落率		
16期(2016年6月20日)	14,175	7.1	388.79	7.1	99.3	115,394
17期(2017年6月20日)	13,844	△2.3	379.60	△2.4	99.2	111,362
18期(2018年6月20日)	13,955	0.8	382.52	0.8	99.2	107,741
19期(2019年6月20日)	14,376	3.0	393.94	3.0	99.5	115,199
20期(2020年6月22日)	14,134	△1.7	387.27	△1.7	99.6	125,640

※NOMURA-BPI(総合)は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証券株式会社およびその許諾者は、NOMURA-BPI(総合)を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村証券株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■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)NOMURA-BPI		債券組入 比率
	円	%	(総合)	騰落率	
(期首) 2019年6月20日	14,376	—	393.94	—	99.5
6月末	14,327	△0.3	392.69	△0.3	99.5
7月末	14,344	△0.2	393.15	△0.2	99.5
8月末	14,537	1.1	398.50	1.2	99.4
9月末	14,382	0.0	394.27	0.1	99.5
10月末	14,326	△0.3	392.61	△0.3	99.5
11月末	14,277	△0.7	391.33	△0.7	99.4
12月末	14,236	△1.0	390.14	△1.0	99.5
2020年1月末	14,295	△0.6	391.77	△0.6	99.5
2月末	14,407	0.2	394.74	0.2	99.5
3月末	14,177	△1.4	388.45	△1.4	99.6
4月末	14,224	△1.1	389.79	△1.1	99.5
5月末	14,163	△1.5	388.13	△1.5	99.5
(期末) 2020年6月22日	14,134	△1.7	387.27	△1.7	99.6

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について (2019年6月21日から2020年6月22日まで)

基準価額等の推移



期首	14,376円
期末	14,134円
騰落率	-1.7%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）です。

※NOMURA-BPI（総合）は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証券株式会社およびその許諾者は、NOMURA-BPI（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村証券株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因 (2019年6月21日から2020年6月22日まで)

当ファンドは、NOMURA-BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指しました。

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ 期初から9月初旬にかけて、米中通商摩擦の激化を背景に景気減速懸念が高まったことから、国内債券利回りが低下（債券価格は上昇）したこと ・ 1月下旬から3月上旬にかけて、新型コロナウイルス感染拡大に伴う景気悪化懸念から、国内債券利回りが低下したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ 9月初旬から12月にかけて、米中通商交渉の進展期待や部分合意の成立を背景に、国内債券利回りが上昇（債券価格は下落）したこと ・ 3月中旬に、金融市場において投資を縮小する動きから、国内債券利回りが上昇したこと

▶ 投資環境について (2019年6月21日から2020年6月22日まで)

日本の長期金利の代表である10年国債利回りは上昇（債券価格は低下）しました。

長期金利は、米中通商交渉の長期化が懸念されるなか、期初から-0.1%台で推移しました。8月に米中通商摩擦が激化すると、内外での追加金融緩和期待の高まりとともに、-0.3%近辺へと低下しました。

しかし9月初旬以降は、米中通商摩擦への懸念が後退したことで長期金利は上昇基調に転じました。12月には、米中通商交渉で第一段階の合意が成立すると、株高・債券安の流れのなかで長期金利は一時+0.01%と小幅プラス圏へと上昇しました。

しばらく0%近辺で推移していた長期金利は、新型コロナウイルス感染拡大に伴う景気下振れリスクへの警戒から、1月下旬以降に再度低下基調となりました。世界各地で新型コロナウイルスの感染が拡大すると、3月に入り、米国で緊急利下げが実施されるなど、各国が政策対応に動くなかで、長期金利は一時-0.1%台後半へ低下しました。しかし、3月の中旬以降、資産価格のボラティリティ（価格変動性）の上昇を受けて投資全般を縮小する動きが広がると、長期金利は0.1%近辺へと急上昇しました。金利の急上昇に対しては、日銀が国債買入れを積極化したことから、次第に長期金利は上昇幅を縮小しました。

期末にかけては、政府の財政政策拡大に伴う国債増発への警戒や経済活動再開への期待と、日銀の国債買入の一段の積極化への期待が交錯し、長期金利は0%前後での推移となりました。

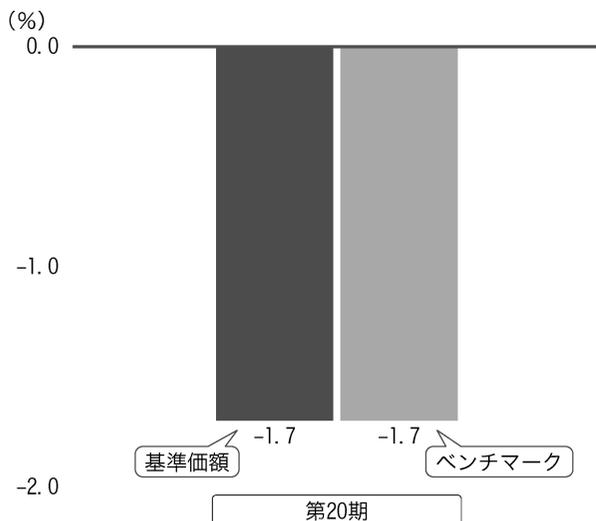
当期の市場の動きを10年国債利回りでみると、期首-0.165%から期末0.012%へと上昇しました。

▶ ポートフォリオについて (2019年6月21日から2020年6月22日まで)

デュレーション（投資資金の平均回収期間）、残存期間別配分、種別配分ともに概ねベンチマークに合わせた運用を継続しました。

▶ ベンチマークとの差異について (2019年6月21日から2020年6月22日まで)

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



当ファンドは、NOMURA-BPI（総合）をベンチマークとしています。左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は-1.7%となり、ベンチマークの騰落率-1.7%に概ね連動した運用成果となりました。

2 今後の運用方針

債券組入比率を高位に保ち、デュレーション、残存期間別配分、種別配分、流動性などを考慮した債券に分散投資することで、NOMURA-BPI（総合）との連動をできる限り高めるように運用を行います。

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細(2019年6月21日から2020年6月22日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用 (その他)	0円 (0)	0.000% (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	0	0.000	

期中の平均基準価額は14,307円です。

※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、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2019年6月21日から2020年6月22日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	37,636,274	22,537,196
	地方債証券	1,423,272	1,807,081
	特殊債証券	302,279	1,105,432 (741,345)
	社債証券 (投資法人債券を含む)	1,900,000	1,011,004 (400,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

※社債証券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等(2019年6月21日から2020年6月22日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 41,261	百万円 4,588	% 11.1	百万円 26,460	百万円 4,052	% 15.3

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	期末保有額
公社債	百万円 -	百万円 -	百万円 100

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 600

利害関係人とは、投資信託およ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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2019年6月21日から2020年6月22日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細(2020年6月22日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	93,975,000 (11,962,000)	102,011,824 (13,225,871)	81.2 (10.5)	— (—)	57.1 (8.8)	15.4 (1.8)	8.7 (—)
地 方 債 証 券	7,750,000 (7,750,000)	8,080,267 (8,080,267)	6.4 (6.4)	— (—)	2.2 (2.2)	3.6 (3.6)	0.6 (0.6)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	8,267,647 (8,267,647)	8,746,331 (8,746,331)	7.0 (7.0)	— (—)	3.1 (3.1)	2.7 (2.7)	1.1 (1.1)
金 融 債 券	100,000 (100,000)	100,017 (100,017)	0.1 (0.1)	— (—)	— (—)	0.1 (0.1)	— (—)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	6,100,000 (6,000,000)	6,194,636 (6,095,116)	4.9 (4.9)	— (—)	1.8 (1.7)	2.7 (2.7)	0.4 (0.4)
合 計	116,192,647 (34,079,647)	125,133,075 (36,247,603)	99.6 (28.9)	— (—)	64.2 (15.8)	24.5 (10.9)	10.8 (2.2)

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド

B 個別銘柄開示 国内(邦貨建)公社債

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第404回 利付国債(2年)	0.1	50,000	50,158	2021/9/1
	第405回 利付国債(2年)	0.1	60,000	60,206	2021/10/1
	第407回 利付国債(2年)	0.1	105,000	105,401	2021/12/1
	第409回 利付国債(2年)	0.1	1,660,000	1,667,104	2022/2/1
	第410回 利付国債(2年)	0.1	270,000	271,209	2022/3/1
	第411回 利付国債(2年)	0.1	410,000	411,968	2022/4/1
	第412回 利付国債(2年)	0.1	760,000	763,815	2022/5/1
	第127回 利付国債(5年)	0.1	45,000	45,088	2021/3/20
	第128回 利付国債(5年)	0.1	655,000	656,722	2021/6/20
	第129回 利付国債(5年)	0.1	405,000	406,312	2021/9/20
	第130回 利付国債(5年)	0.1	440,000	441,742	2021/12/20
	第131回 利付国債(5年)	0.1	935,000	939,235	2022/3/20
	第132回 利付国債(5年)	0.1	275,000	276,427	2022/6/20
	第133回 利付国債(5年)	0.1	450,000	452,583	2022/9/20
	第134回 利付国債(5年)	0.1	830,000	835,295	2022/12/20
	第135回 利付国債(5年)	0.1	750,000	755,257	2023/3/20
	第136回 利付国債(5年)	0.1	850,000	856,511	2023/6/20
	第137回 利付国債(5年)	0.1	1,170,000	1,179,523	2023/9/20
	第138回 利付国債(5年)	0.1	1,050,000	1,059,030	2023/12/20
	第139回 利付国債(5年)	0.1	760,000	766,855	2024/3/20
	第140回 利付国債(5年)	0.1	730,000	736,883	2024/6/20
	第141回 利付国債(5年)	0.1	1,140,000	1,151,183	2024/9/20
	第142回 利付国債(5年)	0.1	410,000	414,071	2024/12/20
	第143回 利付国債(5年)	0.1	700,000	707,168	2025/3/20
	第2回 利付国債(40年)	2.2	132,000	190,060	2049/3/20
	第3回 利付国債(40年)	2.2	150,000	217,710	2050/3/20
	第4回 利付国債(40年)	2.2	205,000	299,851	2051/3/20
	第5回 利付国債(40年)	2.0	222,000	314,507	2052/3/20
	第6回 利付国債(40年)	1.9	230,000	321,496	2053/3/20
	第7回 利付国債(40年)	1.7	313,000	421,432	2054/3/20
	第8回 利付国債(40年)	1.4	305,000	384,537	2055/3/20
	第9回 利付国債(40年)	0.4	451,000	425,703	2056/3/20
	第10回 利付国債(40年)	0.9	448,000	495,922	2057/3/20
	第11回 利付国債(40年)	0.8	325,000	349,300	2058/3/20
	第12回 利付国債(40年)	0.5	420,000	408,723	2059/3/20
	第317回 利付国債(10年)	1.1	830,000	843,080	2021/9/20
	第319回 利付国債(10年)	1.1	590,000	601,168	2021/12/20
	第320回 利付国債(10年)	1.0	575,000	585,022	2021/12/20
	第321回 利付国債(10年)	1.0	395,000	402,990	2022/3/20
	第322回 利付国債(10年)	0.9	460,000	468,505	2022/3/20
	第323回 利付国債(10年)	0.9	295,000	301,248	2022/6/20
	第324回 利付国債(10年)	0.8	545,000	555,453	2022/6/20
	第325回 利付国債(10年)	0.8	345,000	352,417	2022/9/20
	第326回 利付国債(10年)	0.7	620,000	633,261	2022/12/20
	第327回 利付国債(10年)	0.8	570,000	583,623	2022/12/20

国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	第328回 利付国債 (10年)	0.6	900,000	918,693	2023/3/20
	第329回 利付国債 (10年)	0.8	850,000	874,267	2023/6/20
	第330回 利付国債 (10年)	0.8	560,000	577,337	2023/9/20
	第332回 利付国債 (10年)	0.6	595,000	610,559	2023/12/20
	第333回 利付国債 (10年)	0.6	330,000	339,177	2024/3/20
	第334回 利付国債 (10年)	0.6	345,000	355,174	2024/6/20
	第335回 利付国債 (10年)	0.5	95,000	97,553	2024/9/20
	第336回 利付国債 (10年)	0.5	115,000	118,247	2024/12/20
	第337回 利付国債 (10年)	0.3	305,000	310,785	2024/12/20
	第338回 利付国債 (10年)	0.4	607,000	622,041	2025/3/20
	第339回 利付国債 (10年)	0.4	615,000	630,897	2025/6/20
	第340回 利付国債 (10年)	0.4	883,000	906,982	2025/9/20
	第341回 利付国債 (10年)	0.3	715,000	731,402	2025/12/20
	第342回 利付国債 (10年)	0.1	960,000	971,923	2026/3/20
	第343回 利付国債 (10年)	0.1	957,000	969,412	2026/6/20
	第344回 利付国債 (10年)	0.1	1,230,000	1,246,629	2026/9/20
	第345回 利付国債 (10年)	0.1	1,675,000	1,697,997	2026/12/20
	第346回 利付国債 (10年)	0.1	670,000	679,547	2027/3/20
	第347回 利付国債 (10年)	0.1	925,000	938,347	2027/6/20
	第348回 利付国債 (10年)	0.1	855,000	867,790	2027/9/20
	第349回 利付国債 (10年)	0.1	755,000	766,392	2027/12/20
	第350回 利付国債 (10年)	0.1	915,000	928,542	2028/3/20
	第351回 利付国債 (10年)	0.1	920,000	933,312	2028/6/20
	第352回 利付国債 (10年)	0.1	935,000	948,174	2028/9/20
	第353回 利付国債 (10年)	0.1	1,310,000	1,327,318	2028/12/20
	第354回 利付国債 (10年)	0.1	920,000	931,702	2029/3/20
	第355回 利付国債 (10年)	0.1	1,100,000	1,112,892	2029/6/20
	第356回 利付国債 (10年)	0.1	1,095,000	1,107,165	2029/9/20
	第357回 利付国債 (10年)	0.1	1,510,000	1,525,054	2029/12/20
	第358回 利付国債 (10年)	0.1	940,000	948,685	2030/3/20
	第2回 利付国債 (30年)	2.4	150,000	184,786	2030/2/20
	第4回 利付国債 (30年)	2.9	160,000	207,657	2030/11/20
	第5回 利付国債 (30年)	2.2	100,000	123,188	2031/5/20
	第7回 利付国債 (30年)	2.3	180,000	226,461	2032/5/20
	第10回 利付国債 (30年)	1.1	230,000	257,473	2033/3/20
	第11回 利付国債 (30年)	1.7	150,000	179,628	2033/6/20
	第12回 利付国債 (30年)	2.1	230,000	288,054	2033/9/20
	第14回 利付国債 (30年)	2.4	220,000	285,868	2034/3/20
	第15回 利付国債 (30年)	2.5	250,000	329,157	2034/6/20
	第16回 利付国債 (30年)	2.5	175,000	231,063	2034/9/20
	第18回 利付国債 (30年)	2.3	160,000	207,809	2035/3/20
	第19回 利付国債 (30年)	2.3	160,000	208,449	2035/6/20
	第21回 利付国債 (30年)	2.3	102,000	133,486	2035/12/20
	第22回 利付国債 (30年)	2.5	149,000	200,071	2036/3/20
	第23回 利付国債 (30年)	2.5	151,000	203,398	2036/6/20
	第24回 利付国債 (30年)	2.5	135,000	182,271	2036/9/20
	第25回 利付国債 (30年)	2.3	185,000	244,684	2036/12/20
	第26回 利付国債 (30年)	2.4	219,000	293,943	2037/3/20
	第27回 利付国債 (30年)	2.5	206,000	281,227	2037/9/20

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	第28回 利付国債(30年)	2.5	271,000	372,045	2038/3/20
	第29回 利付国債(30年)	2.4	170,000	231,550	2038/9/20
	第30回 利付国債(30年)	2.3	270,000	364,834	2039/3/20
	第31回 利付国債(30年)	2.2	277,000	371,063	2039/9/20
	第32回 利付国債(30年)	2.3	377,000	514,160	2040/3/20
	第33回 利付国債(30年)	2.0	380,000	498,529	2040/9/20
	第34回 利付国債(30年)	2.2	379,000	514,075	2041/3/20
	第35回 利付国債(30年)	2.0	430,000	568,606	2041/9/20
	第36回 利付国債(30年)	2.0	355,000	470,957	2042/3/20
	第37回 利付国債(30年)	1.9	415,000	543,820	2042/9/20
	第38回 利付国債(30年)	1.8	325,000	420,277	2043/3/20
	第39回 利付国債(30年)	1.9	280,000	368,818	2043/6/20
	第40回 利付国債(30年)	1.8	270,000	350,014	2043/9/20
	第41回 利付国債(30年)	1.7	260,000	331,871	2043/12/20
	第42回 利付国債(30年)	1.7	260,000	332,199	2044/3/20
	第43回 利付国債(30年)	1.7	250,000	320,092	2044/6/20
	第44回 利付国債(30年)	1.7	267,000	342,197	2044/9/20
	第45回 利付国債(30年)	1.5	322,000	398,346	2044/12/20
	第46回 利付国債(30年)	1.5	365,000	451,822	2045/3/20
	第47回 利付国債(30年)	1.6	305,000	385,093	2045/6/20
	第48回 利付国債(30年)	1.4	445,000	541,444	2045/9/20
	第49回 利付国債(30年)	1.4	305,000	371,264	2045/12/20
	第50回 利付国債(30年)	0.8	340,000	364,922	2046/3/20
	第51回 利付国債(30年)	0.3	337,000	320,389	2046/6/20
	第52回 利付国債(30年)	0.5	377,000	376,562	2046/9/20
	第53回 利付国債(30年)	0.6	262,000	267,813	2046/12/20
	第54回 利付国債(30年)	0.8	140,000	150,082	2047/3/20
	第55回 利付国債(30年)	0.8	360,000	385,682	2047/6/20
	第56回 利付国債(30年)	0.8	365,000	391,254	2047/9/20
	第57回 利付国債(30年)	0.8	355,000	380,279	2047/12/20
	第58回 利付国債(30年)	0.8	530,000	567,349	2048/3/20
	第59回 利付国債(30年)	0.7	360,000	375,832	2048/6/20
	第60回 利付国債(30年)	0.9	330,000	361,326	2048/9/20
	第61回 利付国債(30年)	0.7	340,000	354,307	2048/12/20
	第62回 利付国債(30年)	0.5	185,000	182,929	2049/3/20
	第63回 利付国債(30年)	0.4	355,000	341,257	2049/6/20
	第64回 利付国債(30年)	0.4	345,000	331,127	2049/9/20
	第65回 利付国債(30年)	0.4	335,000	321,023	2049/12/20
	第66回 利付国債(30年)	0.4	170,000	162,856	2050/3/20
	第50回 利付国債(20年)	1.9	223,000	226,443	2021/3/22
	第52回 利付国債(20年)	2.1	210,000	215,940	2021/9/21
	第54回 利付国債(20年)	2.2	275,000	284,713	2021/12/20
	第56回 利付国債(20年)	2.0	320,000	333,811	2022/6/20
	第58回 利付国債(20年)	1.9	300,000	313,881	2022/9/20
	第59回 利付国債(20年)	1.7	280,000	292,997	2022/12/20
	第61回 利付国債(20年)	1.0	140,000	144,447	2023/3/20
	第63回 利付国債(20年)	1.8	156,000	165,141	2023/6/20
	第64回 利付国債(20年)	1.9	210,000	223,994	2023/9/20
	第65回 利付国債(20年)	1.9	370,000	396,495	2023/12/20

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	第69回 利付国債(20年)	2.1	200,000	216,800	2024/3/20
	第70回 利付国債(20年)	2.4	380,000	418,573	2024/6/20
	第72回 利付国債(20年)	2.1	300,000	328,548	2024/9/20
	第74回 利付国債(20年)	2.1	278,000	305,877	2024/12/20
	第75回 利付国債(20年)	2.1	230,000	254,278	2025/3/20
	第78回 利付国債(20年)	1.9	340,000	374,299	2025/6/20
	第82回 利付国債(20年)	2.1	288,000	321,569	2025/9/20
	第84回 利付国債(20年)	2.0	424,000	473,442	2025/12/20
	第85回 利付国債(20年)	2.1	332,000	374,486	2026/3/20
	第88回 利付国債(20年)	2.3	329,000	376,820	2026/6/20
	第90回 利付国債(20年)	2.2	418,000	478,706	2026/9/20
	第92回 利付国債(20年)	2.1	295,000	337,524	2026/12/20
	第93回 利付国債(20年)	2.0	242,000	276,576	2027/3/20
	第95回 利付国債(20年)	2.3	186,000	217,430	2027/6/20
	第97回 利付国債(20年)	2.2	400,000	467,128	2027/9/20
	第99回 利付国債(20年)	2.1	337,000	392,824	2027/12/20
	第100回 利付国債(20年)	2.2	310,000	365,186	2028/3/20
	第102回 利付国債(20年)	2.4	285,000	341,709	2028/6/20
	第105回 利付国債(20年)	2.1	337,000	397,471	2028/9/20
	第107回 利付国債(20年)	2.1	418,000	494,652	2028/12/20
	第109回 利付国債(20年)	1.9	315,000	368,594	2029/3/20
	第111回 利付国債(20年)	2.2	393,000	472,012	2029/6/20
	第113回 利付国債(20年)	2.1	395,000	472,550	2029/9/20
	第114回 利付国債(20年)	2.1	323,000	387,574	2029/12/20
	第116回 利付国債(20年)	2.2	320,000	388,377	2030/3/20
	第118回 利付国債(20年)	2.0	245,000	293,519	2030/6/20
	第119回 利付国債(20年)	1.8	260,000	306,300	2030/9/20
	第121回 利付国債(20年)	1.9	200,000	238,194	2030/9/20
	第122回 利付国債(20年)	1.8	225,000	265,671	2030/9/20
	第123回 利付国債(20年)	2.1	205,000	249,126	2030/12/20
	第124回 利付国債(20年)	2.0	230,000	277,104	2030/12/20
	第125回 利付国債(20年)	2.2	155,000	190,598	2031/3/20
	第126回 利付国債(20年)	2.0	185,000	223,535	2031/3/20
	第127回 利付国債(20年)	1.9	190,000	227,547	2031/3/20
	第128回 利付国債(20年)	1.9	220,000	264,057	2031/6/20
	第129回 利付国債(20年)	1.8	210,000	249,763	2031/6/20
	第130回 利付国債(20年)	1.8	340,000	405,392	2031/9/20
	第131回 利付国債(20年)	1.7	225,000	265,765	2031/9/20
	第132回 利付国債(20年)	1.7	270,000	319,628	2031/12/20
	第133回 利付国債(20年)	1.8	235,000	280,872	2031/12/20
	第134回 利付国債(20年)	1.8	163,000	195,151	2032/3/20
	第135回 利付国債(20年)	1.7	305,000	361,623	2032/3/20
	第136回 利付国債(20年)	1.6	205,000	240,680	2032/3/20
	第137回 利付国債(20年)	1.7	190,000	225,754	2032/6/20
	第138回 利付国債(20年)	1.5	150,000	174,676	2032/6/20
	第139回 利付国債(20年)	1.6	160,000	188,216	2032/6/20
	第140回 利付国債(20年)	1.7	670,000	797,735	2032/9/20
	第141回 利付国債(20年)	1.7	190,000	226,670	2032/12/20
	第142回 利付国債(20年)	1.8	180,000	216,954	2032/12/20

国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	第143回 利付国債 (20年)	1.6	200,000	236,548	2033/3/20
	第144回 利付国債 (20年)	1.5	215,000	251,597	2033/3/20
	第145回 利付国債 (20年)	1.7	682,000	816,708	2033/6/20
	第146回 利付国債 (20年)	1.7	330,000	395,907	2033/9/20
	第147回 利付国債 (20年)	1.6	590,000	701,285	2033/12/20
	第148回 利付国債 (20年)	1.5	482,000	567,304	2034/3/20
	第149回 利付国債 (20年)	1.5	357,000	420,738	2034/6/20
	第150回 利付国債 (20年)	1.4	495,000	577,264	2034/9/20
	第151回 利付国債 (20年)	1.2	680,000	774,683	2034/12/20
	第152回 利付国債 (20年)	1.2	530,000	604,152	2035/3/20
	第153回 利付国債 (20年)	1.3	482,000	556,738	2035/6/20
	第154回 利付国債 (20年)	1.2	515,000	587,702	2035/9/20
	第155回 利付国債 (20年)	1.0	500,000	555,930	2035/12/20
	第156回 利付国債 (20年)	0.4	550,000	560,791	2036/3/20
	第157回 利付国債 (20年)	0.2	393,000	388,185	2036/6/20
	第158回 利付国債 (20年)	0.5	455,000	470,183	2036/9/20
	第159回 利付国債 (20年)	0.6	563,000	590,468	2036/12/20
	第160回 利付国債 (20年)	0.7	450,000	479,070	2037/3/20
	第161回 利付国債 (20年)	0.6	565,000	591,922	2037/6/20
	第162回 利付国債 (20年)	0.6	415,000	434,343	2037/9/20
	第163回 利付国債 (20年)	0.6	565,000	591,204	2037/12/20
	第164回 利付国債 (20年)	0.5	395,000	406,249	2038/3/20
	第165回 利付国債 (20年)	0.5	665,000	683,613	2038/6/20
	第166回 利付国債 (20年)	0.7	390,000	414,117	2038/9/20
	第167回 利付国債 (20年)	0.5	565,000	579,718	2038/12/20
	第168回 利付国債 (20年)	0.4	305,000	307,141	2039/3/20
	第169回 利付国債 (20年)	0.3	520,000	513,536	2039/6/20
	第170回 利付国債 (20年)	0.3	430,000	424,207	2039/9/20
	第171回 利付国債 (20年)	0.3	505,000	497,667	2039/12/20
	第172回 利付国債 (20年)	0.4	320,000	320,880	2040/3/20
	小 計	—	93,975,000	102,011,824	—
地方債証券	第1回 東京都公募公債 (20年)	1.54	200,000	209,098	2023/6/20
	第7回 東京都公募公債 (20年)	2.16	100,000	111,063	2025/9/19
	第8回 東京都公募公債 (30年)	2.23	100,000	131,208	2038/9/17
	第13回 東京都公募公債 (30年)	1.93	200,000	256,566	2042/3/19
	平成26年度第13回 北海道公募公債	0.461	100,000	101,897	2024/12/26
	平成29年度第5回 北海道公募公債	0.18	100,000	100,592	2027/6/30
	平成29年度第6回 北海道公募公債 (5年)	0.01	200,000	199,878	2022/7/28
	第7回 神奈川県公募公債 (20年)	2.22	200,000	228,992	2027/3/19
	第78回 神奈川県公募公債 (5年)	0.005	100,000	99,940	2024/6/20
	第192回 神奈川県公募公債	0.805	200,000	203,530	2022/9/20
	第147回 大阪府公募公債 (5年)	0.001	100,000	99,908	2023/2/27
	第361回 大阪府公募公債 (10年)	0.92	100,000	101,785	2022/6/28
	第395回 大阪府公募公債 (10年)	0.435	200,000	203,920	2025/4/28
	第397回 大阪府公募公債 (10年)	0.566	100,000	102,554	2025/6/27
	平成27年度第11回 京都府公募公債	0.469	200,000	204,644	2025/12/18
	平成30年度第6回 京都府公募公債	0.03	200,000	200,064	2023/9/20
	平成30年度第12回 京都府公募公債	0.02	300,000	300,000	2024/3/19
	第3回 兵庫県公募公債 (12年)	0.56	100,000	102,548	2025/4/16

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

種類	銘柄	期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
	第5回 兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	109,642	2028/5/26
	第9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	119,814	2029/11/19
	第7回 静岡県公募公債(30年)	1.988	100,000	130,297	2043/6/19
	平成20年度第1回 静岡県公募公債	2.18	100,000	111,168	2025/9/19
	平成26年度第10回 静岡県公募公債	0.515	100,000	102,189	2024/11/25
	平成26年度第14回 愛知県公募公債(10年)	0.535	100,000	102,282	2024/11/28
	平成26年度第18回 愛知県公募公債(10年)	0.44	100,000	102,022	2025/3/27
	平成29年度第16回 愛知県公募公債(10年)	0.26	100,000	101,406	2028/2/14
	平成26年度第1回 広島県公募公債	0.67	100,000	102,551	2024/5/27
	平成30年度第2回 広島県公募公債	0.18	200,000	201,526	2028/7/25
	第13回 埼玉県公募公債(20年)	1.599	100,000	116,584	2033/5/20
	平成24年度第9回 埼玉県公募公債	0.844	100,000	102,149	2023/1/31
	平成26年度第4回 埼玉県公募公債	0.654	100,000	102,541	2024/6/26
	平成29年度第2回 埼玉県公募公債(5年)	0.01	200,000	199,964	2022/4/19
	平成25年度第11回 福岡県公募公債	0.694	100,000	102,480	2024/2/26
	平成26年度第5回 福岡県公募公債	0.525	200,000	204,390	2024/10/28
	平成26年度第3回 千葉県公募公債	0.611	300,000	307,245	2024/7/25
	平成26年度第5回 千葉県公募公債	0.476	200,000	204,110	2024/12/25
	令和元年度第2回 千葉県公募公債	0.01	100,000	99,960	2024/5/24
	第11回 群馬県公募公債(10年)	0.505	100,000	102,145	2024/11/25
	第91回 共同発行市場公募地方債	0.9	300,000	300,888	2020/10/23
	第115回 共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	305,481	2022/10/25
	第137回 共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	102,275	2024/8/23
	第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,145	2024/11/25
	第149回 共同発行市場公募地方債	0.5	100,000	102,349	2025/8/25
	第154回 共同発行市場公募地方債	0.405	150,000	153,009	2026/1/23
	第175回 共同発行市場公募地方債	0.215	200,000	202,044	2027/10/25
	平成23年度第4回 京都市公募公債	1.067	100,000	101,571	2021/12/22
	平成28年度第2回 神戸市公募公債(5年)	0.005	100,000	99,985	2021/6/14
	第16回 横浜市公募公債(20年)	2.35	100,000	118,551	2028/9/21
	平成26年度第5回 福岡市公募公債	0.539	200,000	204,512	2024/10/28
	平成27年度第5回 福岡市公募公債	0.476	100,000	102,300	2025/10/28
	平成27年度第7回 福岡市公募公債(5年)	0.101	100,000	100,041	2020/12/24
	平成29年度第11回 福岡市公募公債(5年)	0.04	300,000	300,162	2023/3/16
	平成27年度第1回 三重県公募公債	0.464	100,000	102,302	2025/12/25
	小計	-	7,750,000	8,080,267	-
特殊債券 (除く金融債)	第1回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	11,126	11,271	2036/5/10
	第1回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	13,323	13,843	2037/11/10
	第2回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.61	11,309	11,477	2036/5/10
	第5回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	11,745	11,952	2036/11/10
	第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	12,802	13,249	2037/5/10
	第10回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	13,215	13,682	2037/5/10
	第12回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	10,354	10,430	2038/9/10
	第14回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7	11,863	11,988	2032/5/10
	第18回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.89	10,166	10,209	2039/5/10
	第29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	27,303	29,355	2044/10/10
	第30回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	11,592	11,798	2040/5/10
	第32回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	13,978	14,406	2040/7/10
	第32回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	26,612	28,398	2045/1/10

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
第35回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	14,636	15,204	2040/10/10
第37回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	13,825	14,354	2040/12/10
第37回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	28,554	30,200	2045/6/10
第40回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	15,055	15,745	2041/3/10
第42回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	12,934	13,487	2041/5/10
第48回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.33	13,118	13,658	2041/11/10
第49回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	29,264	31,047	2046/6/10
第51回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	32,518	34,438	2046/8/10
第55回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	42,864	45,324	2046/12/10
第57回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	40,735	43,102	2047/2/10
第59回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	41,825	44,259	2047/4/10
第67回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	47,970	50,125	2047/12/10
第69回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	48,573	51,232	2048/2/10
第70回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	42,454	44,602	2048/3/10
第73回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	47,953	50,615	2048/6/10
第88回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.93	52,100	54,076	2049/9/10
第113回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	84,232	84,857	2051/10/10
第123回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	88,265	89,431	2052/8/10
第124回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	88,038	88,957	2052/9/10
第125回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	88,496	89,416	2052/10/10
第130回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	100,000	118,050	2032/12/20
第132回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	90,617	91,418	2053/5/10
第138回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	93,877	95,352	2053/11/10
第146回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	96,823	96,220	2054/7/10
第151回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	98,402	98,086	2054/12/10
第157回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	100,000	100,266	2055/6/10
第2回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	14,148	14,774	2042/6/10
第3回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	13,983	14,571	2037/11/10
第27回	道路債券	2.42	100,000	108,955	2024/3/20
第32回	道路債券	2.44	100,000	110,174	2024/9/20
第42回	道路債券	2.22	100,000	110,350	2025/3/21
第42回	地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,900	2022/11/28
第61回	地方公共団体金融機構債券	0.69	100,000	102,647	2024/6/28
第9回	政府保証日本政策投資銀行社債	1.0	101,000	101,243	2020/9/14
第15回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	103,079	2021/12/22
第22回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	106,677	2023/6/19
第29回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.165	300,000	300,645	2021/6/22
第34回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.001	500,000	500,320	2022/6/30
第42回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.155	100,000	100,895	2027/12/15
第6回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	202,660	2021/2/26
第79回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	118,104	2029/4/27
第92回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	118,816	2029/10/31
第99回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	120,152	2030/1/31
第120回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	100,338	2020/10/30
第173回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	300,000	305,799	2022/9/30
第207回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	200,000	204,840	2023/12/28
第209回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.747	100,000	102,678	2024/1/31
第220回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	300,000	307,695	2024/6/28
第221回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.466	100,000	116,326	2034/6/30

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	第227回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.544	300,000	306,909	2024/9/30
	第246回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.178	100,000	112,567	2035/5/31
	第333回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.155	100,000	100,899	2027/12/28
	第339回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	100,000	101,226	2028/2/29
	第208回 政府保証預金保険機構債	0.1	400,000	400,172	2020/10/6
	第66回 日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位)	0.09	100,000	99,971	2026/4/17
	第4回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.59	100,000	132,720	2035/12/20
	第22回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	200,000	297,770	2047/2/20
	第37回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	118,162	2028/6/20
	第122回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.704	200,000	205,074	2024/3/19
	第1回 政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.576	200,000	201,574	2021/9/24
	第4回 公営企業債券(20年)	2.09	200,000	213,396	2023/9/20
	第18回 公営企業債券(20年)	2.58	100,000	114,872	2026/6/19
	第22回 公営企業債券(20年)	2.32	200,000	230,650	2027/6/18
	第39回 地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	101,733	2022/8/26
	第48回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.121	100,000	110,856	2035/12/28
	第59回 地方公共団体金融機構債券(10年)	0.724	100,000	102,664	2024/4/26
	第62回 地方公共団体金融機構債券	0.631	300,000	307,371	2024/7/26
	第281回 地方公共団体金融機構債券	0.999	100,000	108,780	2033/9/21
	第6回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.11	100,000	109,817	2025/3/19
	第190回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.08	100,000	99,910	2026/6/19
	小 計	-	8,267,647	8,746,331	-
金 融 債 券	第350回 信金中金債(5年)	0.08	100,000	100,017	2024/1/26
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第499回 中部電力	1.194	100,000	103,213	2023/6/23
	第507回 中部電力	0.605	100,000	102,069	2026/1/23
	第527回 関西電力	0.28	200,000	200,608	2024/4/25
	第476回 東北電力	0.57	100,000	101,623	2025/1/24
	第508回 東北電力	0.465	200,000	202,058	2029/4/25
	第522回 東北電力	0.16	200,000	199,702	2025/6/25
	第253回 四国電力	1.0	100,000	102,632	2023/6/23
	第328回 北海道電力	0.42	100,000	100,631	2023/1/25
	第13回 大和ハウス工業	0.285	100,000	99,425	2027/6/1
	第30回 東レ	0.375	100,000	99,520	2027/7/16
	第7回 クラレ	0.19	100,000	99,522	2025/4/25
	第56回 住友化学	0.38	100,000	99,860	2027/9/13
	第47回 三井化学	0.26	100,000	99,656	2025/6/19
	第24回 三菱ケミカルホールディングス	0.37	100,000	100,188	2028/2/25
	第11回 プリチストン	0.295	200,000	199,600	2027/4/21
	第3回 新日鐵住金	0.22	100,000	100,092	2024/5/20
	第7回 ジェイテクト	0.345	100,000	99,552	2028/3/8
	第35回 ソニー	0.18	100,000	98,527	2026/10/9
	第1回 明治安田生命2019基金特定目的会社特定社債	0.29	200,000	197,504	2024/8/2
	第51回 住友商事	1.241	100,000	106,814	2029/4/23
第69回 クレディセゾン	0.18	100,000	99,697	2023/6/19	
第25回 三菱東京UFJ銀行	1.31	100,000	100,474	2020/11/12	
第57回 東京三菱銀行	2.22	100,000	104,893	2022/10/27	
第1回 三井住友フィナンシャル	0.849	100,000	100,898	2024/9/12	
第9回 三菱UFJ信託銀行	1.68	100,000	101,332	2021/4/28	
第1回 みずほフィナンシャルグループ	0.95	100,000	100,785	2024/7/16	

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	第62回 ホンダファイナンス	0.01	300,000	299,979	2023/6/19
	第63回 ホンダファイナンス	0.16	300,000	300,000	2025/6/19
	第93回 トヨタファイナンス	0.13	400,000	400,096	2025/6/10
	第1回 野村ホールディングス	0.3	100,000	99,772	2023/9/4
	第65回 三菱地所	2.04	100,000	117,437	2032/12/20
	第73回 東京急行電鉄	1.422	100,000	100,655	2020/12/16
	第38回 京王電鉄	0.295	100,000	100,366	2027/11/29
	第32回 東日本旅客鉄道	2.26	100,000	108,047	2024/3/19
	第69回 東日本旅客鉄道	1.222	100,000	100,098	2020/7/22
	第126回 東日本旅客鉄道	0.275	200,000	200,896	2028/1/26
	第10回 西日本旅客鉄道	2.04	100,000	106,346	2023/9/20
	第13回 西日本旅客鉄道	2.34	100,000	114,144	2027/2/19
	第13回 東海旅客鉄道	2.015	100,000	106,708	2023/12/20
	第32回 東海旅客鉄道	2.31	100,000	114,970	2027/9/17
	第63回 日本電信電話	0.69	100,000	101,294	2023/3/20
	第27回 KDDI	0.23	100,000	99,598	2026/4/24
	第38回 電源開発	0.978	100,000	102,856	2023/12/20
	第24回 東京電力パワーグリッド	0.61	100,000	101,210	2024/4/24
	第37回 東京電力パワーグリッド	0.29	100,000	100,023	2023/6/9
	第7回 ファーストリテイリング	0.405	100,000	99,770	2028/6/6
	第2回 ビー・ビー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20	0.645	100,000	99,435	2023/7/12
	第11回 ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	100,000	100,061	2021/1/22
	小 計	—	6,100,000	6,194,636	—
	合 計	—	116,192,647	125,133,075	—

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 投資信託財産の構成

(2020年6月22日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	125,133,075	99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	710,792	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	125,843,867	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年6月22日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	125,843,867,661円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	542,249,859
公 社 債 (評 価 額)	125,133,075,863
未 収 利 息	167,130,154
前 払 費 用	1,411,785
(B) 負 債	203,199,785
未 払 解 約 金	203,181,120
未 払 利 息	1,326
そ の 他 未 払 費 用	17,339
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	125,640,667,876
元 本	88,893,770,132
次 期 繰 越 損 益 金	36,746,897,744
(D) 受 益 権 総 口 数	88,893,770,132口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	14,134円

※当期における期首元本額80,135,880,996円、期中追加設定元本額20,499,036,130円、期中一部解約元本額11,741,146,994円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・日本債券インデックス・ファンド	55,029,891,060円
三井住友DS・国内債券インデックス年金ファンド	21,718,211円
SMAM・国内債券インデックス・ファンド	4,503,777,627円
国内債券インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	177,808,794円
SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	29,160,574,440円

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2019年6月21日 至2020年6月22日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,034,010,378円
受 取 利 息	1,034,421,458
支 払 利 息	△ 411,080
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 3,154,725,109
売 買 損 益	14,378,600
売 買 損 益	△ 3,169,103,709
(C) 信 託 報 酬 等	△ 243,794
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 2,120,958,525
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	35,063,864,240
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,821,419,476
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 5,017,427,447
(H) 計 (D + E + F + G)	36,746,897,744
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	36,746,897,744

※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。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

第 20 期

決算日 2020年11月30日

■当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2001年4月6日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 外国株式インデックス・マザーファンド 日本を除く世界各国の株式
当ファンドの運用方法	■主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。 ■外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 外国株式インデックス・マザーファンド ■株式への投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	年1回（毎年11月30日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、以下の方針に基づき収益分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

■ 1万口当たりの費用明細(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	24円 (3) (3) (17)	0.082% (0.011) (0.011) (0.060)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、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：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション)	2 (2) (0) (0) (1)	0.008 (0.006) (0.000) (0.000) (0.002)	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：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (投資信託証券)	3 (2) (0) (0)	0.009 (0.009) (0.000) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	19 (11) (4) (4)	0.066 (0.039) (0.015) (0.012)	その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	48	0.165	

期中の平均基準価額は28,996円です。

※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、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

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

■ 当期中の売買及び取引の状況(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国株式インデックス・マザーファンド	千口 255,307	千円 850,139	千口 687,182	千円 2,623,212

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 組入れ資産の明細 (2020年11月30日現在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス・マザーファンド	1,410,498	978,623	4,167,078

※外国株式インデックス・マザーファンドの期末の受益権総口数は59,674,216千口です。

※単位未満は切捨て。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	4,195,939,645円
コール・ローン等	5,591,272
外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	4,167,078,386
未 収 入 金	23,269,987
(B) 負 債	25,573,702
未 払 解 約 金	23,509,990
未 払 信 託 報 酬	1,729,820
未 払 利 息	13
そ の 他 未 払 費 用	333,879
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	4,170,365,943
元 本	1,266,721,044
次 期 繰 越 損 益 金	2,903,644,899
(D) 受 益 権 総 口 数	1,266,721,044口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	32,923円

※当期における期首元本額1,823,431,400円、期中追加設定元本額374,721,142円、期中一部解約元本額931,431,498円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2019年12月3日 至2020年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 2,832円
支 払 利 息	△ 2,832
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	467,639,332
売 買 損 益	626,277,824
売 買 損 益	△ 158,638,492
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,363,973
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A + B + C)	463,272,527
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,764,074,966
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	676,297,406
(配 当 等 相 当 額)	(1,401,566,023)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 725,268,617)
(G) 計 (D + E + F)	2,903,644,899
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	2,903,644,899
追 加 信 託 差 損 益 金	676,297,406
(配 当 等 相 当 額)	(1,402,606,217)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 726,308,811)
分 配 準 備 積 立 金	2,227,347,493

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※期末における、費用控除後の配当等収益(65,707,213円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(397,565,314円)、信託約款に規定される収益調整金(1,402,606,217円)および分配準備積立金(1,764,074,966円)より分配可能額は3,629,953,710円(1万口当たり28,656円)ですが、分配は行っておりません。

外国株式インデックス・マザーファンド

第18期（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年5月19日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行わないものとします。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	投資信託 証券組入率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率				
14期 (2016年11月30日)	円 27,558	% △ 5.1	284.85	% △ 5.0	% 95.6	% 2.0	% 2.4	百万円 165,583
15期 (2017年11月30日)	33,807	22.7	350.45	23.0	95.2	2.5	2.3	196,182
16期 (2018年11月30日)	34,678	2.6	360.38	2.8	93.7	3.9	2.3	174,245
17期 (2019年12月2日)	38,813	11.9	404.43	12.2	95.2	2.1	2.7	232,418
18期 (2020年11月30日)	42,581	9.7	444.41	9.9	96.8	0.9	2.3	254,097

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）は、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したもので、設定時を100として2020年11月30日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

※MSCIコクサイインデックス（配当込み）の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 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) MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	投資信託 証券組入率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2019年12月2日	円 38,813	% —	404.43	% —	% 95.2	% 2.1	% 2.7
12月末	40,115	3.4	417.79	3.3	96.0	1.6	2.6
2020年1月末	40,168	3.5	418.52	3.5	95.2	2.2	2.6
2月末	37,016	△ 4.6	385.76	△ 4.6	95.6	1.8	2.7
3月末	31,452	△ 19.0	328.34	△ 18.8	95.4	2.2	2.5
4月末	34,540	△ 11.0	360.09	△ 11.0	96.4	1.5	2.4
5月末	36,029	△ 7.2	375.64	△ 7.1	94.4	3.2	2.3
6月末	36,725	△ 5.4	383.02	△ 5.3	95.0	2.7	2.4
7月末	37,947	△ 2.2	395.29	△ 2.3	95.4	2.2	2.4
8月末	40,868	5.3	426.30	5.4	95.9	1.7	2.3
9月末	39,268	1.2	409.61	1.3	94.9	3.0	2.3
10月末	38,175	△ 1.6	398.22	△ 1.5	95.8	1.4	2.3
(期末) 2020年11月30日	42,581	9.7	444.41	9.9	96.8	0.9	2.3

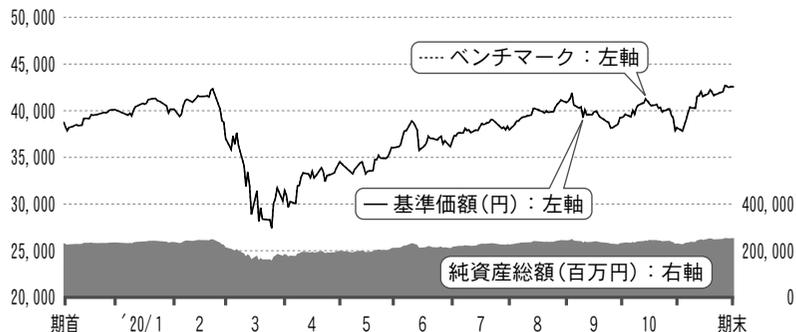
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	38,813円
期末	42,581円
騰落率	+9.7%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）です。

※MSCIコクサイインデックス（配当込み）の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- ・ 期初から2020年2月中旬にかけて、米中貿易摩擦問題の緩和期待などから株式市場が上昇したこと
- ・ 3月下旬から期末にかけて、新型コロナウイルス感染拡大ペースの減速とそれに伴う世界景気の急回復期待で株式市場が上昇したこと

下落要因

- ・ 2月下旬から3月中旬にかけて、新型コロナウイルスのパンデミック（世界的大流行）による世界経済の急激な落ち込みを受け、株式市場が急落したこと
- ・ 3月下旬以降、米国の金融政策の緩和強化が当面維持されるとの見方から米ドルが対円で下落したこと

▶ 投資環境について（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

当期の世界の株式市場は上昇しました。為替市場では、米ドルが対円で下落、ユーロは対円で上昇しました。

株式市場

期初から2020年2月中旬にかけては、米中貿易交渉が進展し、12月には第一段階の合意に達したことや中国景気の先行き不透明感が後退したこともあって、世界の株式市場は堅調に推移しました。2月下旬から3月中旬にかけては中国の武漢が発生源とされる新型コロナウイルスの感染が拡大するとともに、世界の株式市場は急落しました。

その後は、8月まで、欧米の感染者数・死者数の増加ペースが鈍化し始めたことから欧米の経済活動再開への期待が高まり、世界的に株式に対する買い安心感が広がりました。世界各国の政府・中央銀行から景気刺激策の発表が相次いだことや、情報技術セクターを中心に企業の業績見通しが概ね良好な内容となったことも、株式市場の押し上げ要因となりました。

9月以降、米国や中国の追加景気対策に対する期待が後退し、世界の株式市場は軟調に推移しました。11月以降は、新型コロナウイルスに対するワクチンの開発進展期待や、米国大統領選においてバイデン候補の勝利が確実視されたことなどもあって、世界的に株式市場は期末にかけて上昇しました。

当期のMSCIコクサイインデックス（配当込み、米ドルベース）は、期首に比べて16.0%上昇しました。

為替市場

米ドル・円相場は、期初から2月中旬まで概ねもみあい推移しました。その後、市場の混乱を受け、3月中旬にかけ、乱高下する展開となりましたが、3月下旬以降は、期末まで米ドル安・円高の展開となりました。新型コロナウイルスの感染拡大に伴い世界景気が急速な落ち込みをみせたことを受け、3月にFRB（米連邦準備制度理事会）ゼロ金利政策を選択したことで、米ドル・円レートは月間で102円台～111円台と大きく変動しました。3月下旬以降は、未曾有の世界景気の落ち込みに対して、金融緩和策は長期化するとの観測から、米ドルは対円で軟調に推移しました。

ユーロ・円相場は、期初から1月中旬までは世界景気の回復期待や日本の消費増税後の景気停

滞観測からユーロ高で推移しました。その後、イタリアで新型コロナウイルスの感染が急速に拡大するなどしたことから、ユーロは弱含む動きとなりました。5月以降は欧州復興基金設立に向けた政治的な取り組み（7月に設立が合意されました）や経済活動再開の動きなどが好感され、ユーロ高・円安の動きが強まりました。

当期の米ドル・円は期首109円68銭から期末103円89銭へと5円79銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首120円86銭から期末124円38銭へと3円52銭のユーロ高・円安となりました。

▶ ポートフォリオについて（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

株式組入比率

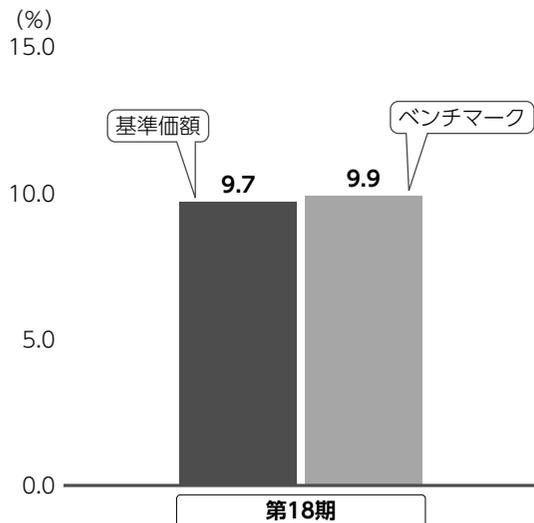
M S C I コクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

日々の追加設定・解約による資金変動に対しては、売買にかかるコストなどを勘案し、株式先物取引を利用した組入比率の調整を実施してトラッキングエラー（ポートフォリオとベンチマークのリターンの乖離）を低く抑えました。

また2、5、8、11月末のM S C I コクサイインデックスの定期銘柄見直しに応じて、ポートフォリオの修正を行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2019年12月3日から2020年11月30日まで)

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



当ファンドは、MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース) をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は+9.7%となり、ベンチマークの騰落率+9.9%から0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

引き続き、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。流動性や信用リスクに懸念のある銘柄を除き、個別銘柄においてもベンチマーク時価ウェイトに沿った投資を行い、トラッキングエラーを抑制します。

また、株式組入比率（投資信託証券、先物含む）を概ね100%程度に保つことを基本とします。

■ 1万口当たりの費用明細（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	3円 (3) (0) (0) (1)	0.009% (0.007) (0.000) (0.000) (0.002)	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：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券)	3 (3) (0) (0)	0.009 (0.009) (0.000) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	20 (15) (5)	0.053 (0.040) (0.013)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	26	0.071	

期中の平均基準価額は37,482円です。

※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、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引状況 (2019年12月3日から2020年11月30日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 30,330 (9,716)	千米ドル 272,978 (1,449)	百株 30,120 (334)	千米ドル 249,128 (7,318)
	カ ナ ダ	4,943 (△ 209)	千カナダドル 19,237 (-)	4,177 (569)	千カナダドル 16,472 (415)
	ユ ー ロ		千ユーロ		千ユーロ
	ド イ ツ	3,349 (397)	12,095 (199)	2,683 (198)	9,204 (395)
	イ タ リ ア	4,927	2,840	2,986	1,719
	フ ラ ン ス	2,583 (96)	12,157 (△ 1)	2,466	11,160
	オ ラ ン ダ	1,275 (9)	6,636 (-)	2,195 (-)	9,275 (2)
	ス ペ イ ン	4,677 (17,021)	2,944 (126)	22,727 (2,014)	3,152 (127)
	ベ ル ギ ー	263	1,394	178	837
	オ ー ス ト リ ア	154	367	131	377
	ルクセンブルク	349 (63)	269 (-)	178	113
	フィンランド	927 (252)	1,153 (144)	1,031 (-)	1,337 (144)
	アイルランド	195 (0.7)	1,209 (-)	1,026	816
	ポルトガル	529 (1,359)	328 (-)	1,806	260
国	イ ギ リ ス	28,996 (3,015)	千英ポンド 18,327 (235)	71,243	千英ポンド 14,613
	ス イ ス	1,838 (0.17)	千スイスフラン 13,309 (△ 188)	1,693 (-)	千スイスフラン 11,269 (11)
	ス ウ ェ ー デ ン	3,125 (154)	千スウェーデンクローナ 47,880 (-)	2,405 (-)	千スウェーデンクローナ 32,359 (51)

外国株式インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ノ ル ウ ェ ー	614	千ノルウェークローネ 9,084	567	千ノルウェークローネ 7,138
	デ ン マ ー ク	626	千デンマーククローネ 22,934	491	千デンマーククローネ 18,751
	オ ー ス ト ラ リ ア	8,988 (360)	千オーストラリアドル 12,866 (124)	9,260 (177)	千オーストラリアドル 10,822 (124)
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	1,583	千ニューージーランドドル 892	1,758	千ニューージーランドドル 944
	香 港	11,230 (△ 2,078)	千香港ドル 32,116 (-)	10,992	千香港ドル 32,715
	シ ン ガ ポ ー ル	4,555 (1,115)	千シンガポールドル 1,710 (65)	7,344 (739)	千シンガポールドル 1,981 (65)
国	イ ス ラ エ ル	183 (25)	千イスラエルシェケル 830 (-)	290	千イスラエルシェケル 687

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外	ア メ リ カ	証 券 — (5,525)	千米ドル — (77)	証 券 5,525	千米ドル 28
	国	ス イ ス	— (55,710)	千スイスフラン — (11)	— —

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※（ ）内は権利付与、権利行使およ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。

外国株式インデックス・マザーファンド

(3) 投資信託証券

		買 付		売 付		
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外	アメリカ	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	1,520	228	751	111
		AMERICAN TOWER CORP	5,068	1,170	4,790	1,115
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	18,628	137	13,507	132
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,785	443	2,510	421
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2,785	468	2,118	348
			(21,967)	(2,949)		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	6,359	868	2,918	394
		DUKE REALTY CORP	12,085	403	11,323	386
		EQUINIX INC	1,424	986	1,039	686
		EQUITY RESIDENTIAL	2,593	158	1,711	128
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,020	117	—	—
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	—	—	614	71
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,243	251	4,724	133
		INVITATION HOMES INC	4,560	96	6,894	196
		IRON MOUNTAIN INC	2,200	60	4,391	133
		KIMCO REALTY CORPORATION	—	—	21,090	234
		LIBERTY PROPERTY TRUST	—	—	—	—
			(△ 9,193)	(△ 566)		
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	9,511	175	7,436	159
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	3,908	120	2,418	99
		PROLOGIS INC	10,334	929	9,599	897
			(6,205)	(566)		
		PUBLIC STORAGE	727	122	443	92
		REALTY INCOME CORPORATION	1,751	93	—	—
		REGENCY CENTERS CORP	1,197	62	2,359	135
		SL GREEN REALTY CORP	—	—	3,945	166
		SIMON PROPERTY GROUP INC	2,397	164	3,142	354
	SUN COMMUNITIES INC	1,052	156	—	—	
	UDR INC	2,344	88	—	—	
	VENTAS INC	6,565	212	5,717	270	
VICI PROPERTIES INC	—	—	3,035	77		
WELLTOWER INC	6,593	327	4,389	280		
WEYERHAEUSER CO	9,778	292	8,604	236		
小 計	126,427	8,138	129,467	7,263		
	(18,979)	(2,949)				
カナダ		CAN APARTMENT PROP	—	—	726	40
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,546	141	—	—
			—	—	10,391	136
小 計	6,546	141	11,117	177		
国	フランス	ICADE	796	55	—	—
		KLEPIERRE	—	—	—	—
			(—)	(△ 7)	—	—
		GECINA SA	—	—	500	80
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	3,334	165	2,015	152	
小 計	4,130	220	2,515	232		
	(—)	(△ 7)				
ユ ー ー 口 計	4,130	220	2,515	232		
	(—)	(△ 7)				

外国株式インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付		
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外	イギリス	SEGR0 PLC	□ 19,544	千英ポンド 160	□ 20,981	千英ポンド 180
		LAND SECURITIES GROUP PLC	7,158	41	-	-
	小	計	26,702	202	20,981	180
	オーストラリア	MIRVAC GROUP	□ 29,561	千オーストラリアドル 53	□ 55,876	千オーストラリアドル 169
		TRANSURBAN GROUP	20,397	252	16,172	240
		APA GROUP	24,828	249	23,644	269
		LENDLEASE GROUP	51,032	630	40,031	463
		STOCKLAND	23,976	97	-	-
		DEXUS	8,552	99	16,681	202
		SYDNEY AIRPORT	24,139	133	-	-
		SCENTRE GROUP	-	-	15,795	56
		SYDNEY AIRPORT-RIGHTS	-	-	9,662	7
		SYDNEY AIRPORT-RIGHTS NEW	-	-	-	-
	VICINITY CENTRES	(9,662)	(11)	-	-	
	小	計	285,866 (9,662)	1,658 (11)	177,861 (-)	1,409 (11)
香 港	LINK REIT	□ 9,800	千香港ドル 631	□ 12,200	千香港ドル 879	
	HKT TRUST AND HKT LTD	27,000	282	-	-	
小	計	36,800	914	12,200	879	
シンガポール	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	□ 23,900	千シンガポールドル 47	□ 40,100	千シンガポールドル 90	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST N	-	-	-	-	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	(93,888)	(262)	(-)	(33)	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,500 (-)	203 (△ 4)	53,900	174	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	-	-	-	-	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	(△130,400)	(△ 262)	-	-	
	SUNTEC REIT	38,100 (-)	44 (△0.14922)	-	-	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	138,100 (-)	277 (△ 1)	-	-	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	-	-	-	-		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	(-)	(△0.60842)	-	-		
小	計	262,600 (△ 36,512)	572 (△ 6)	94,000 (-)	265 (33)	

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

※銘柄コードの変更等、管理上の都合により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

(4) 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	
外 国	株式先物取引		百万円	百万円	百万円	百万円
		S P M I N I	53,232	55,014	—	—
		S P I 2 0 0	3,173	3,281	—	—
		F T S E	3,553	3,649	—	—
	D J E U R O	11,711	12,040	—	—	

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※外国の取引金額は、各月末（ただし、決算日の属する月については決算日）の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

■ 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12月3日から2020年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	80,451,964千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	214,309,702千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	0.37

※単位未満は切捨て。

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末（ただし、決算日の属する月については決算日）の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計、(b)は各月末の同仲値で換算した邦貨金額合計の平均です。

■ 利害関係人との取引状況等 (2019年12月3日から2020年11月30日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※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す。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2020年11月30日現在)

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC	378	354	1,603	166,578	保険
AES CORPORATION	336	336	708	73,566	公益事業
AT&T INC	3,819	3,819	11,087	1,151,833	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	919	948	10,207	1,060,416	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	768	947	9,941	1,032,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	22	22	622	64,630	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	410	412	3,221	334,663	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	18	—	—	—	資本財
ADOBE INC	253	258	12,315	1,279,406	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	40	34	513	53,364	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	552	632	5,517	573,191	半導体・半導体製造装置
AGILENT TECHNOLOGIES INC	160	171	1,954	203,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	114	119	3,331	346,076	素材
AKAMA TECHNOLOGIES	83	83	868	90,181	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORPORATION	63	55	763	79,344	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	113	115	1,426	148,188	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	38	38	1,832	190,386	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORPORATION	8	6	406	42,223	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	22	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	132	121	638	66,328	公益事業
ALLSTATE CORP	168	166	1,734	180,181	保険
ALLY FINANCIAL INC	201	201	617	64,169	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	56	56	728	75,725	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	163	161	28,967	3,009,401	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	156	160	28,629	2,974,354	メディア・娯楽
ALTICE USA INC-A	63	180	620	64,454	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	975	977	3,945	409,862	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	219	226	72,224	7,503,379	小売
AMERCO	3	3	158	16,508	運輸
AMEREN CORPORATION	124	124	983	102,200	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	56	—	—	—	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER	263	257	2,184	226,972	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	370	370	4,467	464,140	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	35	35	329	34,240	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	464	447	1,776	184,594	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	91	91	1,407	146,198	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	79	79	824	85,696	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	67	64	1,223	127,066	各種金融
AMETEK INC	121	128	1,535	159,555	資本財
AMGEN INC	314	316	7,108	738,524	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORPORATION -CL A	151	156	2,071	215,192	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES INC	187	192	2,658	276,170	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	42	44	1,476	153,438	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	135	136	4,267	443,321	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORPORATION	190	—	—	—	エネルギー
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	77	339	35,299	各種金融
APPLE INC	2,354	9,240	107,729	11,191,982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	474	482	3,989	414,435	半導体・半導体製造装置
AQUA AMERICA INC	126	—	—	—	公益事業
ARAMARK	132	132	479	49,773	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	284	309	1,563	162,410	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	190	—	—	—	資本財

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株	数	株	数	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ARISTA NETWORKS INC	27	32			898	93,358	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	41	41			384	39,907	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	31	31			416	43,282	保険
ATMOS ENERGY CORP	64	69			674	70,058	公益事業
AUTODESK INC	111	115			3,138	326,105	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	40	40			365	37,970	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	229	224			3,936	408,977	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	12	12			1,422	147,789	小売
AVALARA INC	—	43			730	75,843	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	—	256			674	70,096	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVERY DENNISON CORP	48	48			726	75,450	素材
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	228	—			—	—	各種金融
BB & T CORPORATION	388	—			—	—	銀行
BAKER HUGHES COMPANY	319	319			632	65,704	エネルギー
BALL CORPORATION	161	181			1,744	181,226	素材
BANK OF AMERICA CORP	4,621	4,184			12,129	1,260,128	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP (THE)	436	422			1,686	175,176	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	245	264			2,008	208,630	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	141	153			3,506	364,292	ヘルスケア機器・サービス
BEIGENE LTD-ADR	19	22			654	68,045	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
W. R. BERKLEY CORPORATION	74	74			478	49,704	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	688	741			17,177	1,784,598	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	130	121			1,366	141,958	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	13	12			652	67,817	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	90	90			730	75,843	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	98	85			2,076	215,678	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	87	76			690	71,695	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	61	82			5,881	611,058	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	356	346			2,099	218,109	各種金融
BOEING CO	279	289			6,262	650,608	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	22	22			4,546	472,352	小売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	81	80			707	73,512	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	120	120			476	49,551	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	718	745			2,505	260,252	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,221	1,216			7,666	796,518	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	58	58			868	90,180	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	205	214			8,486	881,640	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	140	140			640	66,523	保険
BROWN-FORMAN CORPORATION	156	161			1,308	135,902	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	37	33			751	78,060	小売
CBS CORP-CL B	182	—			—	—	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	56	56			519	53,936	各種金融
CBRE GROUP INC-A	161	182			1,115	115,863	不動産
CDK GLOBAL INC	74	58			271	28,202	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	74	74			979	101,711	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	120	120			465	48,341	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE, INC.	69	69			642	66,706	運輸
CIGNA CORPORATION	199	193			4,118	427,889	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC.	186	187			3,270	339,751	各種金融
CMS ENERGY CORPORATION	150	140			870	90,404	公益事業
CSX CORPORATION	389	415			3,792	393,951	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	677	706			4,792	497,921	ヘルスケア機器・サービス
CABLE ONE INC	—	2			482	50,144	メディア・娯楽
CABOT OIL & GAS CORPORATION	196	196			348	36,243	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC	142	142			1,661	172,588	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	78	106			521	54,131	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	251	236			2,075	215,662	各種金融

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
CARDINAL HEALTH INC	151	151	812	84,445	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	84	84	803	83,494	小売
CARLYLE GROUP INC/THE	—	93	267	27,783	各種金融
CARNIVAL CORP	213	222	480	49,970	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	—	456	1,727	179,450	資本財
CATALENT INC	—	89	870	90,412	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	295	292	5,118	531,739	資本財
CELANESE CORPORATION	64	64	858	89,161	素材
CENTENE CORP	209	305	1,928	200,347	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	254	254	612	63,676	公益事業
CENTURYLINK INC	497	497	520	54,071	電気通信サービス
CERNER CORP	165	155	1,151	119,607	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	79	78	5,019	521,488	メディア・娯楽
CHENIERE ENERGY INC	117	117	690	71,734	エネルギー
CHEVRON CORPORATION	984	1,033	9,434	980,161	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	14	13	1,792	186,193	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	124	124	1,077	111,897	家庭用品・パーソナル用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	78	78	611	63,521	保険
CISCO SYSTEMS INC	2,241	2,266	9,679	1,005,651	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	45	46	1,666	173,125	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	1,184	1,123	6,367	661,472	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	232	207	710	73,769	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	66	64	794	82,554	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	64	65	1,328	138,029	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO/THE	2,126	2,186	11,520	1,196,901	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	86	86	648	67,320	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATI	288	287	2,253	234,092	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	433	441	3,750	389,687	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CLASS A	2,374	2,440	12,629	1,312,125	メディア・娯楽
COMERICA INC	88	76	396	41,141	銀行
CONAGRA BRANDS INC	246	246	885	91,997	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	101	101	630	65,540	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	584	557	2,386	247,984	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	180	183	1,425	148,146	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	90	88	1,818	188,967	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	45	—	—	—	エネルギー
COOPER COMPANIES INC (THE)	25	27	944	98,083	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	104	109	1,264	131,385	商業・専門サービス
CORNING INC	397	397	1,472	153,009	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	381	417	1,605	166,791	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	228	237	9,207	956,573	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	18	20	1,816	188,717	商業・専門サービス
COTY INC-CL A	169	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
COUPA SOFTWARE INC	—	34	1,141	118,540	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	74	1,117	116,128	ソフトウェア・サービス
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	218	—	—	—	不動産
CROWN HOLDINGS INC	68	68	655	68,134	素材
CUMMINS INC	79	80	1,832	190,351	資本財
D. R. HORTON INC	190	193	1,472	153,016	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	92	104	1,349	140,152	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	158	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	335	342	7,429	771,804	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	67	74	816	84,813	消費者サービス
DATADOG INC - CLASS A	—	68	661	68,707	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	51	41	454	47,237	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	152	161	4,219	438,335	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-C	79	126	879	91,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
DELTA AIR LINES INC	82	82	340	35,401	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	118	118	612	63,673	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	210	—	—	—	エネルギー
DEXCOM INC	46	47	1,516	157,525	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	79	79	345	35,867	エネルギー
THE WALT DISNEY CO.	941	962	14,154	1,470,495	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	164	164	1,295	134,583	各種金融
DISCOVERY INC-A	70	70	194	20,198	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	182	182	448	46,630	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP.	122	129	464	48,263	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-RIGHTS	6	—	—	—	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	54	90	2,059	213,964	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	130	137	2,995	311,220	小売
DOLLAR TREE INC	120	120	1,323	137,546	小売
DOMINION ENERGY INC	435	455	3,597	373,769	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	22	21	828	86,040	消費者サービス
DOVER CORP	79	82	1,022	106,215	資本財
DOW INC	379	386	2,141	222,473	素材
DROPBOX INC-CLASS A	105	105	206	21,447	ソフトウェア・サービス
DUKE ENERGY CORP	375	398	3,770	391,763	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	381	389	2,514	261,202	素材
DYNATRACE INC	—	111	430	44,680	ソフトウェア・サービス
EOG RESOURCES INC	310	308	1,585	164,726	エネルギー
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	124	—	—	—	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	88	92	402	41,810	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	70	70	701	72,930	素材
EATON VANCE CORP	55	—	—	—	各種金融
EBAY INC	419	366	1,882	195,576	小売
ECOLAB INC	138	139	3,127	324,921	素材
EDISON INTERNATIONAL	179	212	1,334	138,619	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	105	323	2,756	286,421	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	179	208	651	67,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	150	153	1,906	198,041	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO	328	311	2,436	253,166	資本財
ENTERGY CORP	107	108	1,211	125,880	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	30	31	1,019	105,923	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	61	61	1,009	104,862	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	—	228	593	61,640	各種金融
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12	12	291	30,318	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	138	635	66,033	公益事業
EVERGY INC	123	112	628	65,315	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	175	175	1,543	160,384	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	84	84	996	103,485	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	492	508	2,121	220,447	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	75	68	852	88,617	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	95	86	772	80,304	運輸
EXXON MOBIL CORPORATION	2,208	2,269	9,119	947,413	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	68	68	268	27,915	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FMC CORPORATION	66	66	772	80,225	素材
FACEBOOK INC-A	1,252	1,283	35,650	3,703,704	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	19	19	625	65,015	各種金融
FAIR ISAAC CORP	—	14	707	73,495	ソフトウェア・サービス
FASTENAL COMPANY	290	298	1,452	150,864	資本財
FEDEX CORP	129	134	3,874	402,529	運輸
F5 NETWORKS INC	35	29	478	49,729	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	320	333	4,951	514,412	ソフトウェア・サービス
FNF GROUP	139	139	509	52,935	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
FIFTH THIRD BANCORP	372	371			976	101,428	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	91	88			1,159	120,474	銀行
FISERV INC	306	301			3,482	361,800	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP	269	269			720	74,806	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	43	43			1,169	121,518	ソフトウェア・サービス
FLOWSERVE CORPORATION	66	—			—	—	資本財
FORD MOTOR COMPANY	1,987	2,080			1,891	196,486	自動車・自動車部品
FORTINET INC	73	73			911	94,653	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	161	157			1,125	116,878	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	64	71			609	63,287	資本財
FOX CORPORATION—CLASS A	197	169			494	51,385	メディア・娯楽
FOX CORPORATION—CLASS B	87	87			252	26,185	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	178	142			318	33,080	各種金融
FREEMPORT—MCMORAN INC	807	754			1,774	184,315	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	93	98			1,146	119,103	保険
GAP INC/THE	92	—			—	—	小売
GARTNER INC	45	45			696	72,395	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	131	126			1,922	199,712	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	4,551	4,736			4,926	511,810	資本財
GENERAL MILLS INC	325	314			1,893	196,708	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	662	677			3,054	317,334	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	74	74			728	75,679	小売
GILEAD SCIENCES INC	662	661			3,972	412,657	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	159	156			3,090	321,063	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	59	60			579	60,252	保険
GODADDY INC - CLASS A	89	89			707	73,548	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	169	177			4,171	433,428	各種金融
WW GRAINGER INC	23	23			990	102,939	資本財
GRUBHUB INC	44	—			—	—	小売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	47	47			580	60,312	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	138	143			2,196	228,202	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	77	77			434	45,149	資本財
HP INC	763	731			1,629	169,267	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	443	443			778	80,847	エネルギー
HANESBRANDS INC	222	—			—	—	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	73	—			—	—	自動車・自動車部品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	183	183			840	87,278	保険
HASBRO INC	73	74			691	71,847	耐久消費財・アパレル
HEICO CORP	18	18			239	24,922	資本財
HEICO CORP—CLASS A	44	44			504	52,396	資本財
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	39	39			617	64,181	ソフトウェア・サービス
THE HERSHEY COMPANY	75	75			1,112	115,572	食品・飲料・タバコ
HESS CORPORATION	145	153			779	81,026	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	679	638			716	74,462	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	140	146			1,526	158,552	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	94	—			—	—	エネルギー
HOLOGIC INC	135	135			944	98,153	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	572	575			15,879	1,649,764	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	377	377			7,900	820,817	資本財
HORMEL FOODS CORPORATION	149	149			705	73,254	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	—	190			467	48,619	資本財
HUMANA INC.	72	68			2,804	291,346	ヘルスケア機器・サービス
J. B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	44	44			596	61,997	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	530	530			661	68,687	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	21	21			346	36,014	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	—	39			566	58,824	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	39	—			—	—	メディア・娯楽

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
IPG PHOTONICS CORP	17	17	361	37,551	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEX CORP	38	38	738	76,719	資本財
IDEX LABORATORIES INC	43	46	2,127	220,990	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	171	166	3,542	367,990	資本財
ILLUMINA INC	74	76	2,426	252,126	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	92	92	769	79,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	—	205	918	95,426	資本財
INGREDION INC	33	33	265	27,575	食品・飲料・タバコ
INSULET CORP	34	34	855	88,829	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	2,313	2,270	10,773	1,119,266	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	285	289	3,035	315,365	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	460	478	5,954	618,612	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	48	48	549	57,117	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	191	191	970	100,794	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	196	196	447	46,487	メディア・娯楽
INTUIT INC	137	140	4,992	518,687	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	61	63	4,601	478,051	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	67	67	345	35,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQVIA HOLDINGS INC	85	99	1,674	173,991	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	1,669	1,628	19,745	2,051,350	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	69	69	733	76,181	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	128	—	—	—	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	1,378	1,407	20,274	2,106,300	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	26	26	350	36,434	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	174	174	387	40,287	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KLA CORPORATION	81	81	2,072	215,357	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC	248	286	1,107	115,053	各種金融
KANSAS CITY SOUTHERN	51	51	966	100,404	運輸
KELLOGG CO	129	129	822	85,397	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	—	183	564	58,605	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	511	511	834	86,739	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	95	95	1,136	118,036	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	183	178	2,516	261,427	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	1,091	1,059	1,562	162,340	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	83	79	327	34,010	運輸
KOHL'S CORP	82	—	—	—	小売
KRAFT HEINZ COMPANY	340	380	1,251	129,973	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	409	408	1,324	137,606	食品・生活必需品小売り
LKQ CORPORATION	159	159	572	59,515	小売
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	118	112	2,180	226,582	資本財
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	49	49	999	103,786	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	76	75	3,461	359,566	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	74	74	542	56,396	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	176	176	997	103,672	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	118	122	3,013	313,123	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	35	27	403	41,868	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	66	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	69	69	710	73,817	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	156	144	1,126	117,014	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	20	20	596	61,934	資本財
LIBERTY BROADBAND-A	—	13	206	21,418	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	54	54	855	88,917	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	41	41	174	18,094	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	76	76	322	33,553	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	102	102	438	45,521	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	454	463	6,834	710,044	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	112	116	571	59,346	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	75	75	505	52,467	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	133	136	5,103	530,150	資本財
LOEWS CORPORATION	139	139	604	62,750	保険
LOWE'S COMPANIES INC	409	406	6,289	653,400	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	56	64	2,368	246,021	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	65	73	895	92,995	銀行
MGM MIRAGE	258	258	740	76,943	消費者サービス
MSCI INC-A	42	43	1,763	183,164	各種金融
MANPOWERGROUP	32	-	-	-	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	470	-	-	-	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	335	339	1,405	146,017	エネルギー
MARKEL CORP	7	7	705	73,243	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	19	19	1,020	106,050	各種金融
MARSH & MCLENNAN COS	259	266	3,044	316,327	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	143	147	1,888	196,213	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	33	30	837	87,055	素材
MASCO CORP	148	148	807	83,876	資本財
MASIMO CORPORATION	-	29	748	77,732	ヘルスケア機器・サービス
MASTERCARD INC-CL A	469	478	16,211	1,684,189	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	37	-	-	-	メディア・娯楽
MATCH GROUP INC	-	127	1,783	185,287	メディア・娯楽
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	138	138	1,138	118,269	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	62	65	1,219	126,740	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORPORATION	395	398	8,707	904,638	消費者サービス
MCKESSON CORP	96	84	1,513	157,287	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	115	133	247	25,732	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	22	23	3,577	371,692	小売
MERCK & CO. INC.	1,328	1,353	10,805	1,122,545	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	409	415	1,970	204,745	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	12	12	1,417	147,249	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	3,779	3,840	82,656	8,587,138	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	120	127	1,695	176,115	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	588	595	3,822	397,088	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	28	-	-	-	資本財
MODERNA INC	-	144	1,830	190,157	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC	28	28	373	38,830	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	-	34	722	75,060	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	96	96	450	46,816	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	751	772	4,439	461,193	食品・飲料・タバコ
MONGODDB INC	18	26	717	74,591	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	206	211	1,776	184,603	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	86	90	2,506	260,384	各種金融
MORGAN STANLEY	639	734	4,686	486,893	各種金融
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	135	135	55	5,736	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE	185	185	421	43,788	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	83	92	1,602	166,529	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	135	135	440	45,754	公益事業
NVR INC	1	1	712	74,052	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC	65	65	833	86,608	各種金融
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	221	258	340	35,372	エネルギー
NETAPP INC	125	109	581	60,416	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	226	235	11,581	1,203,238	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	50	41	400	41,557	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	523	523	220	22,929	不動産
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	115	115	608	63,201	資本財
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	131	106	253	26,319	資本財
NEWELL BRANDS INC	184	251	528	54,956	耐久消費財・アパレル

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
NEWMONT CORPORATION	415	418	2,449	254,453	素材
NEWS CORP-CLASS A	166	166	295	30,656	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	249	1,051	7,903	821,097	公益事業
NIKE INC -CL B	652	665	8,940	928,802	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	189	189	463	48,174	公益事業
NOBLE ENERGY INC	267	—	—	—	エネルギー
NORDSON CORP	—	32	655	68,091	資本財
NORDSTROM INC	47	—	—	—	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	134	139	3,384	351,563	運輸
NORTHERN TRUST CORP	104	112	1,078	112,005	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	85	82	2,538	263,726	資本財
NORTONLIFELOCK INC	313	313	567	58,977	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	154	154	851	88,421	素材
NVIDIA CORP	300	328	17,448	1,812,682	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	116	118	399	41,496	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	39	38	1,698	176,466	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	453	442	732	76,054	エネルギー
OKTA INC	52	59	1,395	144,975	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	32	49	995	103,370	運輸
OMNICOM GROUP	118	104	656	68,179	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP	209	209	599	62,243	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	209	255	952	98,973	エネルギー
ORACLE CORPORATION	1,226	1,104	6,377	662,565	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	—	211	1,421	147,691	資本財
OWENS CORNING	65	52	386	40,177	資本財
P G & E CORPORATION	—	635	808	84,028	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	236	225	3,148	327,140	銀行
PPG INDUSTRIES INC	119	122	1,811	188,164	素材
PPL CORPORATION	365	427	1,243	129,216	公益事業
PVH CORP	33	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PTC INC	54	54	593	61,630	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	175	180	1,582	164,449	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	53	46	621	64,581	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	48	52	1,541	160,179	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORPORATION	65	66	1,825	189,665	資本財
PAYCHEX INC	164	177	1,655	172,023	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	25	25	1,051	109,198	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	579	597	12,639	1,313,132	ソフトウェア・サービス
PELOTON INTERACTIVE INC-A	—	102	1,113	115,664	耐久消費財・アパレル
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	202	202	259	26,987	銀行
PEPSICO INC	725	743	10,757	1,117,598	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	56	56	726	75,523	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	2,871	2,976	11,082	1,151,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	807	838	6,366	661,367	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	230	224	1,467	152,422	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	59	59	503	52,288	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	109	210	1,470	152,752	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	85	88	975	101,292	エネルギー
POLARIS INC	24	—	—	—	耐久消費財・アパレル
T ROWE PRICE GROUP INC	119	123	1,800	187,061	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	141	141	725	75,421	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,307	1,319	18,285	1,899,673	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	296	305	2,700	280,598	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	205	207	1,618	168,161	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	256	275	1,634	169,758	公益事業
PULTE GROUP INC	130	157	698	72,607	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	60	60	906	94,224	半導体・半導体製造装置

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
QUALCOMM INC	632	604	8,689	902,766	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	68	68	850	88,346	ヘルスケア機器・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	76	76	668	69,412	素材
RALPH LAUREN CORPORATION	33	19	173	18,015	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	64	64	595	61,892	各種金融
RAYTHEON COMPANY	147	—	—	—	資本財
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	816	6,033	626,827	資本財
REGENERON PHARMACEUTICALS	40	52	2,722	282,884	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	558	557	870	90,430	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	30	30	363	37,743	保険
REPUBLIC SERVICES INC	114	114	1,107	115,080	商業・専門サービス
RESMED INC	72	80	1,684	175,020	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	41	39	1,168	121,407	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC	70	55	363	37,806	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	60	62	1,591	165,354	資本財
ROKU INC	46	56	1,547	160,760	メディア・娯楽
ROLLINS INC	64	76	436	45,396	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	52	56	2,346	243,781	資本財
ROSS STORES INC	186	187	2,058	213,855	小売
S&P GLOBAL INC	128	130	4,454	462,733	各種金融
SBA COMMUNICATIONS CORP	57	59	1,690	175,613	不動産
SEI INVESTMENTS COMPANY	76	54	304	31,665	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	115	115	803	83,510	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	26	26	934	97,033	銀行
SABRE CORP	139	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM, INC.	431	481	11,932	1,239,672	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	44	38	532	55,338	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENRY SCHEIN INC	75	75	481	50,008	ヘルスケア機器・サービス
SCHLUMBERGER LTD	736	734	1,606	166,946	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	609	828	4,119	427,973	各種金融
SEAGEN INC	—	66	1,125	116,909	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEALED AIR CORP	78	78	351	36,524	素材
SEATTLE GENETICS INC	57	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY	139	153	1,996	207,422	公益事業
SERVICENOW INC	99	103	5,434	564,603	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	44	43	3,186	330,999	素材
SIGNATURE BANK	25	25	288	30,016	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	817	676	443	46,038	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	87	87	1,192	123,873	半導体・半導体製造装置
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	—	224	913	94,898	ソフトウェア・サービス
SMITH (A.O.) CORP	71	71	408	42,441	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	57	57	671	69,811	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	32	31	558	58,052	資本財
SNAP INC-A	351	455	2,096	217,837	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	15	494	51,407	ソフトウェア・サービス
SOUTHERN CO	544	573	3,477	361,270	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES	63	96	459	47,702	運輸
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	51	—	—	—	資本財
SPLUNK INC	76	82	1,683	174,914	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	367	—	—	—	電気通信サービス
SQUARE INC-A	170	197	4,195	435,855	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	76	80	1,502	156,146	資本財
STARBUCKS CORP	629	629	6,211	645,347	消費者サービス
STATE STREET CORP	189	186	1,338	139,036	各種金融
STEEL DYNAMICS, INC.	101	101	383	39,861	素材
STRYKER CORP	175	182	4,259	442,566	ヘルスケア機器・サービス
SUNRUN INC	—	61	407	42,384	資本財

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SUNTRUST BANKS INC	225	—	—	—	銀行
SYNOPSIS INC	76	78	1,773	184,283	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	314	278	865	89,873	各種金融
SYSCO CORP	261	251	1,792	186,249	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	140	—	—	—	各種金融
TJX COMPANIES INC	625	649	4,104	426,442	小売
T-MOBILE US INC	173	290	3,827	397,649	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	57	57	1,006	104,593	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	147	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	270	270	4,867	505,679	小売
TARGA RESOURCES CORP	117	—	—	—	エネルギー
TELADOC HEALTH INC	—	61	1,202	124,945	ヘルスケア機器・サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	20	20	795	82,660	資本財
TELEFLEX INC	23	23	868	90,203	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	98	85	934	97,084	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	71	395	23,145	2,404,608	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	569	599	588	61,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	486	493	7,845	815,054	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	118	118	553	57,472	資本財
TRADE DESK INC/THE- CLASS A	—	21	1,868	194,111	ソフトウェア・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	207	211	9,605	997,892	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M COMPANY	300	310	5,492	570,627	資本財
TIFFANY & CO	55	55	729	75,825	小売
TRACTOR SUPPLY COMPANY	61	61	852	88,568	小売
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	52	312	32,435	各種金融
TRANSDIGM GROUP INC	24	26	1,585	164,761	資本財
TRANSUNION	94	94	881	91,609	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC (THE)	132	131	1,764	183,330	保険
TRIMBLE INC	127	127	771	80,128	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC-W/I	40	—	—	—	メディア・娯楽
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	—	703	3,410	354,298	銀行
TWILIO INC-A	56	65	2,087	216,874	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	370	407	1,900	197,457	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	22	20	859	89,245	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	149	149	971	100,948	食品・飲料・タバコ
UGI CORPORATION	105	105	393	40,875	公益事業
US BANCORP	788	707	3,127	324,920	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	93	496	2,516	261,457	運輸
ULTA BEAUTY INC	30	27	777	80,802	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	86	—	—	—	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	82	—	—	—	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	367	364	7,503	779,570	運輸
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	28	—	—	—	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	363	379	6,405	665,484	運輸
UNITED RENTALS INC	42	35	837	87,012	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	425	—	—	—	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	491	505	17,069	1,773,369	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	42	42	555	57,685	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	97	—	—	—	保険
VF CORP	171	171	1,467	152,434	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	20	20	576	59,849	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	211	220	1,246	129,450	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	51	47	820	85,237	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	64	70	1,936	201,186	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	54	52	1,048	108,888	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,163	2,208	13,381	1,390,180	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	78	79	1,571	163,290	商業・専門サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	131	135	3,067	318,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC-CLASS B	202	—	—	—	メディア・娯楽
VIACOMCBS INC	—	323	1,133	117,767	メディア・娯楽
VIATRIS INC	—	630	1,075	111,720	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC	902	901	19,029	1,976,948	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	183	257	504	52,461	公益事業
VMWARE INC	41	41	595	61,906	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	73	73	433	45,045	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	66	66	953	99,041	素材
WABCO HOLDINGS INC	25	—	—	—	資本財
WEC ENERGY GROUP INC	159	164	1,573	163,499	公益事業
WABTEC CORP	92	92	681	70,794	資本財
WALMART INC	742	759	11,513	1,196,112	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	394	396	1,546	160,670	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	133	135	1,414	147,001	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	226	220	2,624	272,703	商業・専門サービス
WATERS CORP	35	35	805	83,642	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC-CLASS A	28	32	851	88,449	小売
WELLCARE HEALTH PLANS INC	25	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & COMPANY	2,190	2,103	5,986	621,955	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	42	37	1,050	109,127	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	148	148	681	70,769	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION COMPANY	218	218	491	51,096	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	14	—	—	—	素材
WESTROCK CO	130	130	574	59,661	素材
WHIRLPOOL CORP	32	32	645	67,059	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	614	648	1,390	144,474	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	88	90	2,032	211,171	ソフトウェア・サービス
WYNN RESORTS LTD	49	49	497	51,663	消費者サービス
XPO LOGISTICS INC	47	47	499	51,846	運輸
XCEL ENERGY INC	260	269	1,822	189,388	公益事業
XILINX INC	128	128	1,770	183,918	半導体・半導体製造装置
XYLEM INC	91	91	886	92,078	資本財
XEROX HOLDINGS CORP	96	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUM! BRANDS INC	155	155	1,666	173,137	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	119	—	—	—	電気通信サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	27	27	1,031	107,198	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC-C	53	79	854	88,747	メディア・娯楽
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	103	108	1,628	169,197	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORPORATION	88	88	350	36,378	銀行
ZOETIS INC	253	257	4,154	431,590	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZSCALER INC	—	42	639	66,488	ソフトウェア・サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	83	3,917	407,006	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	47	47	544	56,560	資本財
ALLERGAN PLC	174	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC	823	823	944	98,158	素材
AON PLC	—	120	2,479	257,646	保険
AON PLC	121	—	—	—	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	204	204	676	70,263	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	81	81	376	39,114	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	125	125	363	37,813	素材
ACCENTURE PLC-CL A	331	342	8,559	889,283	ソフトウェア・サービス
BUNGE LIMITED	71	71	436	45,344	食品・飲料・タバコ
CAPRI HOLDINGS LTD	62	—	—	—	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	125	126	554	57,594	食品・飲料・タバコ
EATON CORP PLC	214	212	2,590	269,152	資本財
EVEREST RE GROUP LTD	20	20	482	50,082	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等	
	株数	株数	評価額	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
IHS MARKIT LTD	192	195	1,813	188,361	商業・専門サービス	
INGERSOLL-RAND PLC	122	—	—	—	資本財	
INVESCO LIMITED	183	183	311	32,388	各種金融	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	26	26	373	38,761	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	403	386	1,776	184,556	資本財	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	84	84	191	19,867	電気通信サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	210	210	459	47,783	電気通信サービス	
LINDE PLC	279	282	7,268	755,101	素材	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	317	349	1,577	163,914	半導体・半導体製造装置	
MEDTRONIC PLC	703	720	8,254	857,606	ヘルスケア機器・サービス	
APTIV PLC	130	141	1,723	179,101	自動車・自動車部品	
NIELSEN HOLDINGS PLC	180	180	292	30,412	商業・専門サービス	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	109	—	—	—	消費者サービス	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	22	30	523	54,343	保険	
SEAGATE TECHNOLOGY	126	126	738	76,757	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PENTAIR PLC-REGISTERED	99	82	436	45,346	資本財	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	95	76	384	39,912	資本財	
STERIS PLC	42	42	821	85,374	ヘルスケア機器・サービス	
TECHNIPFMC PLC	215	—	—	—	エネルギー	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	127	1,830	190,213	資本財	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	65	68	1,429	148,537	保険	
PERRIGO CO PLC	77	61	297	30,872	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHUBB LTD	239	245	3,710	385,457	保険	
GARMIN LTD	67	81	950	98,790	耐久消費財・アパレル	
TE CONNECTIVITY LTD	170	174	2,009	208,743	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	65	64	767	79,725	ソフトウェア・サービス	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	23	20	232	24,167	ソフトウェア・サービス	
WIX.COM LTD	24	27	699	72,624	ソフトウェア・サービス	
AERCAP HOLDINGS NV	70	69	266	27,733	資本財	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	142	139	1,223	127,159	素材	
MYLAN NV	261	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NXP SEMICONDUCTORS NV	149	144	2,297	238,717	半導体・半導体製造装置	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	90	90	736	76,489	消費者サービス	
FLEX LTD	232	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	156,142 614	165,734 592	1,696,694 —	176,269,641 <69.4%>
(カナダ)				千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	119	138	1,162	92,941	素材	
AIR CANADA	57	57	142	11,402	運輸	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	302	313	640	51,246	公益事業	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	462	459	1,974	157,879	食品・生活必需品小売り	
ALTAGAS LTD	173	173	330	26,448	公益事業	
ATCO LTD-CLASS I	30	30	120	9,609	公益事業	
AURORA CANNABIS INC	285	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BCE INC	83	83	477	38,204	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	336	330	3,198	255,754	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	629	633	4,107	328,433	銀行	
BARRICK GOLD CORP	932	930	2,741	219,201	素材	
BAUSCH HEALTH COS INC	190	193	490	39,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BLACKBERRY LIMITED	259	259	207	16,604	ソフトウェア・サービス	
BOMBARDIER INC 'B'	758	—	—	—	資本財	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	464	730	3,894	311,376	各種金融	
B2GOLD CORP	—	656	461	36,898	素材	
CAE INC	128	128	431	34,495	資本財	
CCL INDUSTRIES INC-CL B	91	65	393	31,477	素材	
CGI INC-CL A	124	128	1,258	100,602	ソフトウェア・サービス	
CI FINANCIAL CORP	110	110	192	15,403	各種金融	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
CAMECO CORP	163	266	353	28,237	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	225	235	2,613	208,928	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	372	378	5,362	428,719	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES	628	648	2,034	162,696	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	70	71	3,001	239,938	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	35	35	593	47,454	小売
CANADIAN UTILITIES LIMITED	73	73	240	19,264	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	112	112	421	33,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENOVUS ENERGY INC	540	540	375	30,058	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE	11	10	1,662	132,912	ソフトウェア・サービス
CRONOS GROUP INC	80	80	87	6,955	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	145	170	897	71,773	小売
EMERA INC	134	142	777	62,137	公益事業
EMPIRE CO LTD A	72	91	326	26,081	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	663	—	—	—	エネルギー
ENBRIDGE INC	1,042	1,101	4,592	367,206	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	13	13	620	49,582	保険
FIRST CAPITAL REALTY INC	65	—	—	—	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	316	316	571	45,680	素材
FORTIS INC	219	241	1,279	102,305	公益事業
FRANCO-NEVADA CORPORATION	94	101	1,722	137,710	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	90	90	316	25,318	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC	142	142	433	34,637	保険
HUSKY ENERGY INC	145	—	—	—	エネルギー
HYDRO ONE LTD	150	150	446	35,705	公益事業
IGM FINANCIAL INC	64	64	224	17,954	各種金融
IA FINANCIAL CORP INC	48	48	283	22,676	保険
IMPERIAL OIL LTD	129	129	314	25,181	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORPORATION	70	70	1,014	81,088	保険
INTER PIPELINE LTD	252	193	262	20,947	エネルギー
KEYERA CORP	113	113	266	21,333	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	635	635	592	47,367	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	113	156	812	64,955	素材
LOBLAW COMPANIES LTD	85	86	558	44,637	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	282	282	291	23,274	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	166	143	1,149	91,906	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	998	998	2,237	178,907	保険
METHANEX CORPORATION	24	—	—	—	素材
METRO INC	142	131	787	62,946	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	169	169	1,248	99,829	銀行
NUTRIEN LTD	300	298	1,922	153,699	素材
ONEX CORPORATION	42	42	300	24,038	各種金融
OPEN TEXT CORPORATION	136	136	795	63,573	ソフトウェア・サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	117	448	35,887	素材
PARKLAND FUEL CORP	76	—	—	—	エネルギー
PARKLAND CORP	—	76	303	24,264	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	274	274	933	74,664	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	145	332	988	78,992	保険
POWER FINANCIAL CORP	162	—	—	—	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	90	—	—	—	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	99	99	327	26,219	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	130	145	1,101	88,084	消費者サービス
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	—	56	502	40,183	商業・専門サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	183	201	1,226	98,041	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	753	767	8,299	663,523	銀行
SSR MINING INC	—	115	265	21,233	素材
SAPUTO INC	134	134	483	38,650	食品・飲料・タバコ

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	265	272	617	49,378	メディア・娯楽
SHOPIFY INC-CLASS A	51	58	7,796	623,299	ソフトウェア・サービス
STARS GROUP INC/THE	145	-	-	-	消費者サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	300	324	1,922	153,743	保険
SUNCOR ENERGY INC	814	786	1,762	140,901	エネルギー
TMX GROUP LTD	-	31	396	31,734	各種金融
TC ENERGY CORP	481	504	2,993	239,334	エネルギー
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	248	248	517	41,403	素材
TELUS CORPORATION	76	152	384	30,717	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	110	101	1,049	83,919	商業・専門サービス
TORONTO-DOMINION BANK	950	966	6,855	548,099	銀行
WSP GLOBAL INC	63	61	587	46,956	資本財
WEST FRASER TIMBER CO LTD	28	-	-	-	素材
WESTON (GEORGE) LTD	42	42	417	33,370	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	246	241	1,230	98,355	素材
YAMANA GOLD INC	-	535	356	28,533	素材
小計	20,806	20,792	105,791	8,458,059	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	86	82	-	<3.3%>	
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	94	102	2,775	345,211	耐久消費財・アパレル
FRESENIUS SE & CO KGAA	211	221	844	104,997	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	68	52	176	21,967	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE-PREF	33	33	162	20,228	素材
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	30	30	425	52,907	保険
GEA GROUP AG	81	81	235	29,294	資本財
CONTINENTAL AG	55	55	652	81,138	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	519	513	2,083	259,155	運輸
MERCK KGAA	65	65	874	108,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	296	347	1,211	150,667	公益事業
SAP SE	509	560	5,613	698,250	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	1,158	1,166	1,066	132,646	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	57	59	478	59,555	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	38	59	492	61,223	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	480	532	2,637	327,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA	90	90	812	101,071	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	481	499	3,043	378,497	素材
BEIERSDORF AG	56	51	487	60,647	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	8	19	156	19,418	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	83	84	510	63,510	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO. KGAA	109	111	787	97,933	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	220	225	4,462	555,022	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	92	165	166	20,759	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	76	75	1,785	222,077	保険
VOLKSWAGEN AG	19	19	319	39,705	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	94	98	1,440	179,117	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	484	444	2,512	312,530	自動車・自動車部品
NEMETSCHKE SE	-	30	195	24,361	ソフトウェア・サービス
THYSSENKRUPP AG	193	193	107	13,402	素材
SIEMENS AG-REG	402	409	4,615	574,046	資本財
DEUTSCHE BANK AG -REG	995	1,024	971	120,862	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	167	178	1,306	162,482	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE (BMW) AG-PFD	25	25	139	17,312	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,734	1,815	2,751	342,204	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	18	18	656	81,674	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	655	650	1,926	239,653	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	22	22	252	31,467	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	96	100	1,374	170,991	各種金融

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	77	77	427	53,119	自動車・自動車部品
FRAPORT AG	18	18	87	10,836	運輸
WIRECARD AG	59	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LANXESS	44	44	262	32,618	素材
MTU AERO ENGINES AG	28	29	604	75,176	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	181	181	743	92,526	不動産
SYMRISE AG	65	65	687	85,486	素材
BRENTAG AG	91	73	472	58,713	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	118	133	334	41,625	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	403	468	112	13,963	電気通信サービス
COMMERZBANK AG	466	466	251	31,282	銀行
LEG IMMOBILIEN AG	—	36	434	54,010	不動産
KION GROUP AG	31	31	222	27,717	資本財
VONOVIA SE	275	280	1,587	197,477	不動産
KNORR-BREMSE AG	21	38	417	51,979	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	87	141	543	67,630	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG	83	93	73	9,158	食品・生活必需品小売り
TEAMVIEWER AG	—	95	379	47,162	ソフトウェア・サービス
AXEL SPRINGER SE-TEND	23	—	—	—	メディア・娯楽
SIEMENS ENERGY AG	—	198	494	61,541	資本財
ZALANDO SE	82	79	636	79,170	小売
SCOUT24 AG	—	56	353	43,994	メディア・娯楽
COVESTRO AG	80	93	443	55,158	素材
UNIPER SE	123	104	295	36,752	公益事業
DELIVERY HERO SE	53	66	660	82,193	小売
小計	12,251	13,116	61,038	7,592,020	
	銘柄数	銘柄数	比率	比率	
	58	61	—	< 3.0% >	
(ユーロ・・・イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	586	573	829	103,132	保険
INTESA SANPAOLO	7,792	8,785	1,708	212,499	銀行
MEDIOBANCA SPA	267	352	272	33,902	銀行
ENEL SPA	4,202	4,327	3,679	457,640	公益事業
ENI SPA	1,304	1,331	1,143	142,177	エネルギー
SNAM SPA	896	1,067	501	62,392	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	4,919	4,919	197	24,550	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	2,513	2,513	107	13,403	電気通信サービス
ATLANTIA SPA	265	265	404	50,332	運輸
TERNA SPA	804	789	500	62,202	公益事業
RECORDATI SPA	45	45	207	25,800	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEONARDO SPA	183	291	174	21,679	資本財
PRYSMIAN SPA	119	119	320	39,902	資本財
DIASORIN SPA	—	13	226	28,220	ヘルスケア機器・サービス
MONCLER SPA	77	104	428	53,237	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA	—	206	327	40,737	ソフトウェア・サービス
FINECOBANK SPA	320	320	420	52,255	銀行
UNICREDIT SPA	1,068	1,205	1,095	136,301	銀行
POSTE ITALIANE SPA	265	265	233	29,073	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	—	158	169	21,111	電気通信サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	361	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PIRELLI & C SPA	174	174	75	9,448	自動車・自動車部品
小計	26,169	27,830	13,024	1,620,002	
	銘柄数	銘柄数	比率	比率	
	19	21	—	< 0.6% >	
(ユーロ・・・フランス)					
BOUYGUES SA	110	110	373	46,422	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	290	285	565	70,320	公益事業
L'OREAL	129	135	4,190	521,201	家庭用品・パーソナル用品
LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	146	149	7,399	920,390	耐久消費財・アパレル

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
DASSAULT AVIATION SA	1	1	153	19,147	資本財
THALES SA	54	54	431	53,667	資本財
CAPGEMINI SA	80	80	965	120,034	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	18	—	—	—	食品・生活必需品小売り
INGENICO S. A.	26	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PUBLICIS GROUPE	107	107	412	51,357	メディア・娯楽
FAURECIA	31	31	133	16,615	自動車・自動車部品
BOLLORE	394	394	128	15,969	メディア・娯楽
MICHELIN (CGDE) -B	87	87	946	117,757	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD SA	110	111	1,774	220,723	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	88	88	301	37,467	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	12	12	190	23,655	食品・飲料・タバコ
SEB SA	10	10	153	19,059	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE	285	294	3,458	430,174	資本財
VIVENDI SA	475	441	1,122	139,571	メディア・娯楽
ORANGE S. A.	1,048	1,061	1,134	141,115	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	16	16	1,380	171,646	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	66	70	1,090	135,657	ソフトウェア・サービス
KERING	39	41	2,505	311,624	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	89	89	121	15,052	保険
CARREFOUR SA	351	358	492	61,272	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	45	60	464	57,802	ソフトウェア・サービス
SANOFI	593	606	5,172	643,302	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA	106	104	316	39,308	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	410	410	710	88,419	銀行
TELEPERFORMANCE	29	29	816	101,587	商業・専門サービス
EURAZEO	17	17	93	11,590	各種金融
SODEXO	39	39	285	35,508	消費者サービス
AXA SA	1,028	1,063	2,097	260,898	保険
PSA PEUGEOT CITROEN	321	281	562	69,963	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA	28	28	50	6,292	メディア・娯楽
ESSILORLUXOTTICA	147	153	1,857	231,042	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA	581	581	573	71,331	銀行
BNP PARIBAS	577	604	2,648	329,433	銀行
ORPEA	—	26	282	35,146	ヘルスケア機器・サービス
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	255	255	1,030	128,235	資本財
WENDEL	10	10	101	12,623	各種金融
ILIAD SA	10	10	176	21,937	電気通信サービス
SAFRAN SA	171	173	2,139	266,167	資本財
ENGIE	962	948	1,187	147,760	公益事業
ALSTOM RPPT	96	96	436	54,341	資本財
EUTELSAT COMMUNICATIONS	87	—	—	—	メディア・娯楽
ELECTRICITE DE FRANCE (EDF)	286	296	385	47,895	公益事業
IPSEN	14	14	119	14,905	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARKEMA	32	32	316	39,404	素材
LEGRAND SA	143	149	1,071	133,221	資本財
EIFFAGE SA	46	49	419	52,236	資本財
TOTAL SE	1,260	1,334	5,030	625,754	エネルギー
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	13	13	146	18,164	運輸
NATIXIS	453	453	120	14,991	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	52	47	374	46,565	メディア・娯楽
SCOR SE	95	70	206	25,623	保険
VINCI S. A.	264	276	2,434	302,769	資本財
DANONE	319	320	1,693	210,604	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE SA	244	256	3,540	440,312	素材
BUREAU VERITAS SA	172	178	383	47,734	商業・専門サービス
GETLINK	223	223	317	39,488	運輸

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	金額	株数	金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SUEZ	145		307	38,196	公益事業
EDENRED	121		590	73,484	ソフトウェア・サービス
VALEO SA	140		470	58,569	自動車・自動車部品
BIOMERIEUX	17		309	38,446	ヘルスケア機器・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—		203	25,298	消費者サービス
WORLDLINE SA	62		999	124,341	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	15		456	56,785	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	39		268	33,376	各種金融
小計	13,762		70,596	8,780,771	
	株数	金額			
	銘柄数	<比率>	—	<3.5%>	
(ユーロ・・・オランダ)					
AIRBUS SE	300		2,831	352,214	資本財
RANDSTAD NV	46		374	46,553	商業・専門サービス
WOLTERS KLUWER-CVA	149		1,016	126,489	商業・専門サービス
VOPAK	31		143	17,807	エネルギー
AEGON NV	916		280	34,843	保険
KONINKLIJKE KPN NV	1,996	1,736	440	54,802	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	376	332	1,104	137,389	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV	469	480	2,075	258,104	ヘルスケア機器・サービス
HEINEKEN NV	131	131	1,172	145,882	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	65	61	482	60,069	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	92	89	1,232	153,258	素材
UNILEVER NV	763	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ASML HOLDING NV	218	228	8,367	1,040,787	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	600	594	1,415	176,066	食品・生活必需品小売り
FERRARI NV	65	64	1,152	143,286	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV	570	547	503	62,637	資本財
AKZO NOBEL	122	103	932	115,942	素材
PROSUS NV	254	264	2,462	306,328	小売
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	—	280	267	33,298	食品・飲料・タバコ
NN GROUP NV	159	159	548	68,164	保険
ARGENX SE	—	23	547	68,104	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	594	642	850	105,743	自動車・自動車部品
JUST EAT TAKEAWAY	—	63	560	69,700	小売
ABN AMRO BANK NV-CVA	189	189	179	22,346	銀行
EXOR NV	63	62	364	45,311	各種金融
ALTICE NV -A W/I	376	376	169	21,059	電気通信サービス
QIAGEN N.V.	138	125	510	63,449	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADYEN NV	6	9	1,522	189,340	ソフトウェア・サービス
ING GROEP NV-CVA	2,031	2,052	1,727	214,838	銀行
小計	10,729		33,235	4,133,821	
	株数	金額			
	銘柄数	<比率>	—	<1.6%>	
(ユーロ・・・スペイン)					
ENDESA S. A.	183	141	342	42,610	公益事業
BANKINTER, S. A.	364	364	151	18,900	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,430	3,528	1,396	173,725	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	154	154	307	38,233	公益事業
REPSOL SA	736	791	671	83,515	エネルギー
BANCO SANTANDER SA	8,522	8,933	2,202	273,895	銀行
TELEFONICA S. A.	2,406	2,737	1,022	127,183	電気通信サービス
ENAGAS	104	144	300	37,401	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	114	114	331	41,215	資本財
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	145	157	421	52,426	資本財
FERROVIAL SA	231	275	649	80,815	資本財
MAPPRE SA	463	463	73	9,106	保険
BANCO DE SABADELL SA	3,280	—	—	—	銀行
CAIXABANK	1,819	1,819	400	49,864	銀行

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
IBERDROLA SA	3,198	3,189	3,658	454,986	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA	222	237	1,434	178,448	ソフトウェア・サービス
RED ELECTRICA CORPORATION SA	207	236	404	50,351	公益事業
FERROVIAL SA-RIGHTS	231	—	—	—	資本財
FERROVIAL SA RTS	—	275	6	817	資本財
INDITEX	556	580	1,643	204,357	小売
AENA SME SA	37	35	511	63,602	運輸
CELLNEX TELECOM SA	137	163	842	104,788	電気通信サービス
GRIFOLS S. A.	170	151	370	46,092	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANKIA SA	820	—	—	—	銀行
小計	株数 27,539	株数 24,495	評価額 17,143	評価額 2,132,339	
	株数 23	株数 21	評価額 —	評価額 <0.8%>	
(ユーロ・・・ベルギー)					
KBC GROUPE SA	129	144	859	106,943	銀行
SOFINA	—	8	211	26,300	各種金融
SOLVAY SA	37	37	362	45,106	素材
UCB SA	72	66	599	74,584	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT NV	24	28	141	17,555	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	47	59	490	60,994	各種金融
PROXIMUS SA	63	96	174	21,704	電気通信サービス
GALAPAGOS NV	23	23	243	30,301	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELIA GROUP SA/NV	—	19	186	23,245	公益事業
TELENET GROUP HOLDINGS NV	21	21	76	9,510	メディア・娯楽
AGEAS	87	87	366	45,624	保険
UMICORE	113	105	404	50,318	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	392	398	2,284	284,103	食品・飲料・タバコ
小計	株数 1,012	株数 1,097	評価額 6,402	評価額 796,293	
	株数 11	株数 13	評価額 —	評価額 <0.3%>	
(ユーロ・・・オーストリア)					
OMV AG	77	81	239	29,762	エネルギー
VERBUND AG	36	38	228	28,458	公益事業
VOESTALPINE AG	50	60	163	20,284	素材
ERSTE GROUP BANK AG	169	149	373	46,505	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	55	93	156	19,453	銀行
ANDRITZ AG	37	26	92	11,559	資本財
小計	株数 427	株数 450	評価額 1,254	評価額 156,025	
	株数 6	株数 6	評価額 —	評価額 <0.1%>	
(ユーロ・・・ルクセンブルク)					
EUROFINS SCIENTIFIC	7	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS S. A.	259	259	174	21,649	エネルギー
SES	176	278	220	27,375	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA	458	521	312	38,891	不動産
EUROFINS SCIENTIFIC	—	70	473	58,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL	359	366	561	69,792	素材
小計	株数 1,262	株数 1,496	評価額 1,741	評価額 216,570	
	株数 5	株数 5	評価額 —	評価額 <0.1%>	
(ユーロ・・・フィンランド)					
WARTSILA OYJ-B SHARES	189	267	215	26,793	資本財
UPM-KYMMENE OYJ	290	306	867	107,897	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	247	302	438	54,546	素材
SAMPO OYJ-A SHS	236	245	885	110,076	保険
FORTUM OYJ	244	243	468	58,316	公益事業
ELISA OYJ	83	69	317	39,477	電気通信サービス
METSO OYJ	58	—	—	—	資本財
NOKIA OYJ	2,857	2,968	1,014	126,195	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	227	221	1,273	158,434	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	55	—	—	—	自動車・自動車部品

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
KONE OYJ-B	182	176	1,226	152,560	資本財
ORION OYJ	42	63	255	31,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株数: 4,715 銘柄数: 12	株数: 4,864 銘柄数: 10	6,962	866,027	
(ユーロ・・・アイルランド)				<0.3%>	
CRH PLC	406	410	1,403	174,537	素材
KERRY GROUP PLC-A	83	85	990	123,148	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC	76	80	577	71,830	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	114	129	459	57,181	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC	521	—	—	—	銀行
AIB GROUP PLC	369	—	—	—	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	45	82	1,268	157,775	消費者サービス
小 計	株数: 1,617 銘柄数: 7	株数: 787 銘柄数: 5	4,699	584,473	
(ユーロ・・・ポルトガル)				<0.2%>	
BANCO ESPIRITO SANTO, S.A (BES)	1,879	1,879	1	233	銀行
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,363	1,359	625	77,791	公益事業
GALP ENERGIA SGPS S.A	241	304	291	36,237	エネルギー
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	123	147	208	25,959	食品・生活必需品小売り
小 計	株数: 3,607 銘柄数: 4	株数: 3,690 銘柄数: 4	1,127	140,222	
ユーロ計	株数: 103,095 銘柄数: 238	株数: 101,904 銘柄数: 240	217,225	27,018,567	
(イギリス)			千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC	194	194	240	33,315	素材
ASHTAD GROUP PLC	236	236	746	103,373	資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	587	466	293	40,692	耐久消費財・アパレル
AVIVA PLC	1,986	1,986	643	89,179	保険
DIAGEO PLC	1,219	1,222	3,585	496,718	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	62	62	200	27,838	各種金融
DCC PLC	47	59	338	46,905	資本財
BAE SYSTEMS PLC	1,706	1,781	897	124,415	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,178	1,238	3,316	459,439	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC	211	198	440	61,020	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC	1,415	1,465	679	94,159	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	496	500	706	97,891	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	10,485	10,767	4,359	603,985	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,022	3,405	872	120,926	保険
MEGGITT PLC	369	—	—	—	資本財
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	1,462	1,462	268	37,198	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	167	167	356	49,400	食品・飲料・タバコ
PEARSON PLC	396	396	257	35,683	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	169	169	456	63,186	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	1,330	1,401	1,698	235,390	保険
RIO TINTO PLC	586	608	2,996	415,134	素材
ST JAMES'S PLACE PLC	319	261	266	36,947	各種金融
SSE PLC	548	558	771	106,840	公益事業
BP PLC	10,558	10,572	2,779	385,101	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	36,841	37,565	1,400	194,108	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	1,476	2,304	362	50,202	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	5,160	5,065	1,153	159,884	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	443	443	644	89,261	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,589	2,708	3,747	519,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	167	—	—	—	資本財
ASTRAZENECA PLC	681	703	5,465	757,233	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	4,542	4,699	569	78,973	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	80	—	—	—	消費者サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,247	—	—	—	小売
BARCLAYS PLC	9,260	9,047	1,262	174,865	銀行
INTERTEK GROUP PLC	81	81	450	62,386	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	230	230	397	55,015	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	76	68	447	61,950	小売
KINGFISHER PLC	1,096	1,096	297	41,165	小売
ITV PLC	2,150	—	—	—	メディア・娯楽
SAINSBURY (J) PLC	1,128	1,128	244	33,839	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	742	—	—	—	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	121	115	328	45,500	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	53	71	336	46,651	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	2,549	—	—	—	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,237	2,204	2,952	409,019	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,944	2,020	2,635	365,101	エネルギー
BUNZL PLC	170	170	395	54,755	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	905	905	444	61,575	商業・専門サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	75	199	27,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	159	174	1,385	191,898	各種金融
UNILEVER PLC	588	1,399	6,416	889,057	家庭用品・パーソナル用品
TUI AG-DI	176	—	—	—	消費者サービス
EXPERIAN PLC	479	488	1,263	175,118	商業・専門サービス
MONDI PLC	251	251	424	58,819	素材
SEVERN TRENT PLC	144	124	296	41,085	公益事業
WHITBREAD PLC	68	112	356	49,425	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	144	195	280	38,872	各種金融
SMITHS GROUP PLC	235	241	354	49,138	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	559	669	1,515	210,014	素材
3I GROUP PLC	493	493	530	73,552	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	366	386	2,515	348,486	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,029	1,009	1,758	243,704	商業・専門サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	332	332	298	41,370	公益事業
OCADO GROUP PLC	221	221	491	68,150	小売
GLENCORE PLC	5,567	5,380	1,148	159,184	素材
GVC HOLDINGS PLC	238	288	300	41,692	消費者サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	869	4,951	533	73,856	資本財
EVRAZ PLC	282	282	110	15,364	素材
NMC HEALTH PLC	68	39	0.0394	5	ヘルスケア機器・サービス
EASYJET PLC	76	—	—	—	運輸
NATWEST GROUP PLC	2,452	2,452	393	54,586	銀行
SAGE GROUP PLC/THE	620	559	341	47,302	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	639	639	479	66,437	メディア・娯楽
COCA-COLA HBC AG-CDI	87	87	190	26,325	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	35	35	119	16,492	ソフトウェア・サービス
COMPASS GROUP PLC	826	930	1,318	182,746	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	1,783	1,925	1,682	233,107	公益事業
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,232	1,232	334	46,281	各種金融
BHP GROUP PLC	1,070	1,101	1,914	265,234	素材
VODAFONE GROUP PLC	13,673	14,408	1,799	249,336	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	97	103	493	68,338	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	151	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	74	66	394	54,622	素材
FERGUSON PLC	122	125	1,041	144,311	資本財
M&G PLC	1,330	1,330	257	35,664	各種金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	522	522	352	48,863	保険
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENTITLEMENT	39,981	—	—	—	資本財
INFORMA PLC	690	781	422	58,492	メディア・娯楽
AUTO TRADER GROUP PLC	420	439	240	33,384	メディア・娯楽

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	36	36	399	55,395	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	632	632	188	26,051	保険
JD SPORTS FASHION PLC	288	288	211	29,317	小売
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,463	2,463	392	54,371	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	100	100	226	31,390	素材
小計	196,431	157,200	84,084	11,649,901	
	株数	株数	金額	金額	
	94	84	—	< 4.6% >	
(スイス)			千スイスフラン		
SGS SA	2	3	797	91,643	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	283	32,647	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM AG-REG	14	13	673	77,381	電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG	0.49	0.59	455	52,400	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	0.05	0.05	410	47,137	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	4	4	1,763	202,716	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	77	82	3,053	351,072	保険
NOVARTIS AG-REG SHS	1,124	1,182	9,585	1,102,092	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	964	981	2,370	272,529	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	363	374	11,319	1,301,373	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	70	87	473	54,445	商業・専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD	257	272	1,309	150,539	素材
CLARIANT AG-REG	101	101	185	21,339	素材
NESTLE SA-REGISTERED	1,551	1,590	16,275	1,871,231	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG	24	24	393	45,215	保険
TEMENOS GROUP AG-REG	36	31	360	41,432	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG	26	26	595	68,411	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	5	6	623	71,668	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,296	1,267	1,484	170,666	各種金融
THE SWATCH GROUP AG-B	13	16	388	44,625	耐久消費財・アパレル
THE SWATCH GROUP AG-REG	25	25	111	12,849	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	37	39	2,198	252,746	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG	17	17	709	81,604	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	5	420	48,398	素材
SWISS PRIME SITE-REG	39	39	319	36,734	不動産
PARGESA HOLDING SA-BR	18	—	—	—	各種金融
DUFREY AG-REG	22	—	—	—	小売
PARTNERS GROUP HOLDING AG	9	9	940	108,107	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	23	21	532	61,229	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	12	9	227	26,181	資本財
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	23	30	613	70,577	運輸
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	—	96	754	86,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEBERIT AG-REG	19	19	1,078	124,029	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD	126	124	650	74,759	各種金融
SWISS RE AG	154	151	1,270	146,031	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	272	278	2,138	245,887	耐久消費財・アパレル
SIKA AG	64	73	1,706	196,162	素材
ALCON INC	210	265	1,537	176,725	ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOISE REG	—	15	150	17,310	銀行
UBS GROUP AG	2,037	1,911	2,516	289,269	各種金融
VIFOR PHARMA AG	26	26	349	40,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	9,085	9,230	71,027	8,166,020	
	株数	株数	金額	金額	
	39	39	—	< 3.2% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS	31	33	1,509	18,446	各種金融
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	887	883	8,248	100,800	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	459	459	7,178	87,719	銀行
SWEDISH MATCH AB	101	84	5,857	71,573	食品・飲料・タバコ
SECURITAS AB-B SHS	199	161	2,303	28,154	商業・専門サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
INVESTOR AB-B SHS	242	236	14,050	171,695	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	437	428	7,824	95,611	小売
ERICSSON LM-B SHS	1,594	1,615	17,145	209,512	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB	1,269	1,280	4,714	57,612	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	157	208	4,320	52,794	資本財
LUNDIN ENERGY AB	113	85	1,844	22,544	エネルギー
ALFA LAVAL AB	139	139	3,098	37,865	資本財
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	26	—	—	—	電気通信サービス
ICA GRUPPEN AB	35	56	2,310	28,237	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	185	185	1,698	20,753	耐久消費財・アパレル
ELECTROLUX AB-SER B	91	150	3,098	37,858	耐久消費財・アパレル
SKF AB-B SHARES	206	206	4,430	54,140	資本財
VOLVO AB-B SHS	795	800	15,997	195,495	資本財
SANDVIK AB	609	610	11,981	146,419	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	62	109	2,887	35,287	各種金融
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	—	343	4,779	58,401	素材
HEXAGON AB-B SHS	132	147	10,496	128,268	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS	291	255	2,829	34,576	電気通信サービス
ATLAS COPCO AB-A SHS	359	344	15,140	185,018	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	197	197	7,558	92,366	資本財
EPIROC AB-A	302	393	5,681	69,431	資本財
EPIROC AB-B	161	251	3,454	42,212	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	327	327	8,950	109,372	家庭用品・パーソナル用品
EQT AB	—	156	2,983	36,452	各種金融
BOLIDEN AB	162	130	3,912	47,813	素材
EVOLUTION GAMING GROUP	—	66	4,575	55,910	消費者サービス
KINNEVIK AB-B SHS	112	—	—	—	各種金融
KINNEVIK AB-REDEMPTION SHARE	112	—	—	—	各種金融
KINNEVIK AB-B SHS	—	136	5,603	68,479	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	776	776	6,851	83,729	銀行
ASSA ABLOY AB-B	534	521	10,778	131,709	資本財
NIBE INDUSTRIER-B	—	184	4,409	53,880	資本財
NORDEA BANK ABP	1,704	1,679	12,516	152,954	銀行
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	—	49	1,089	13,310	資本財
小計	株数 銘柄数	12,822 33	13,696 36	232,112 —	2,836,412 < 1.1% >
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	510	490	8,021	94,336	銀行
TELENOR ASA	396	374	5,752	67,645	電気通信サービス
EQUINOR ASA	507	518	7,617	89,578	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	90	90	3,277	38,547	素材
MOWI ASA	222	222	4,073	47,905	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA	790	643	2,347	27,603	素材
AKER BP ASA	53	—	—	—	エネルギー
ORKLA ASA	339	434	3,738	43,970	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	110	135	2,610	30,698	保険
ADEVINTA ASA-B	—	141	2,055	24,173	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS	39	54	1,874	22,400	メディア・娯楽
小計	株数 銘柄数	3,060 10	3,107 10	41,369 —	486,500 < 0.2% >
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B	58	55	5,248	87,707	食品・飲料・タバコ
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	3	3	4,332	72,401	運輸
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	1	1	1,935	32,339	運輸
GN STORE NORD A/S	—	72	3,659	61,153	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	327	401	4,179	69,842	銀行
GENMAB A/S	32	33	7,692	128,535	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	95	104	12,942	216,264	資本財
H LUNDBECK A/S	28	28	561	9,385	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DSV PANALPINA A S	116	108	11,095	185,412	運輸
PANDORA A/S	47	47	3,092	51,669	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	60	55	3,359	56,135	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES	102	115	4,136	69,116	素材
COLOPLAST-B	60	66	6,172	103,134	ヘルスケア機器・サービス
AMBU A/S-B	-	83	1,683	28,135	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B	928	922	38,655	645,936	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S	85	-	-	-	商業・専門サービス
TRYG A/S	82	57	1,041	17,406	保険
ORSTED A/S	95	103	11,653	194,732	公益事業
DEMANT A/S	44	44	974	16,280	ヘルスケア機器・サービス
小計	2,172	2,306	122,417	2,045,589	
株数 銘柄数	17	18	-	< 0.8% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	95	94	601	46,263	ヘルスケア機器・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,466	1,480	3,417	262,829	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION	1,853	1,975	4,035	310,362	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	701	921	1,710	131,546	素材
TELSTRA CORPORATION LIMITED	2,169	2,169	674	51,890	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	198	-	-	-	銀行
COCA-COLA AMATIL LIMITED	234	343	434	33,408	食品・飲料・タバコ
ASX LTD	92	111	863	66,415	各種金融
BHP GROUP LTD	1,516	1,595	6,176	475,043	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	133	-	-	-	エネルギー
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	205	-	-	-	小売
COMPUTERSHARE LIMITED	300	279	397	30,564	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	234	241	7,327	563,554	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	28	28	400	30,802	メディア・娯楽
COCHLEAR LIMITED	29	37	843	64,908	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	893	1,094	568	43,687	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	920	949	7,663	589,368	銀行
BORAL LIMITED	753	-	-	-	素材
RIO TINTO LIMITED	197	193	1,972	151,687	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	291	307	1,020	78,467	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,171	1,171	623	47,948	保険
TPG CORP LTD	177	-	-	-	電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	26	-	-	-	消費者サービス
ORICA LIMITED	179	179	303	23,343	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	230	230	399	30,720	素材
WORLEY LIMITED	133	-	-	-	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	639	639	650	50,055	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,532	1,666	3,887	298,974	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	412	421	1,141	87,779	素材
OIL SEARCH LTD	705	1,056	385	29,649	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD	613	-	-	-	素材
AMP LIMITED	2,235	2,235	388	29,910	各種金融
QANTAS AIRWAYS LIMITED	458	458	252	19,457	運輸
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	670	855	878	67,551	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	-	385	495	38,132	素材
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	230	-	-	-	各種金融
SANTOS LTD	916	845	528	40,659	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	210	210	701	53,925	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATINSON	76	52	155	11,933	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LIMITED	1,040	1,308	514	39,536	消費者サービス
WESFARMERS LIMITED	585	596	2,977	228,971	小売
ALUMINA LTD	1,069	-	-	-	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	501	503	1,144	88,027	エネルギー

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
WOOLWORTHS GROUP LTD	677	680	2,554	196,471	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	80	57	352	27,122	各種金融
SEEK LIMITED	181	181	473	36,449	メディア・娯楽
BRAMBLES LIMITED	883	837	929	71,476	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	169	173	2,383	183,317	各種金融
CROWN RESORTS LTD	218	218	217	16,730	消費者サービス
EVOLUTION MINING LTD	—	844	430	33,112	素材
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	258	247	964	74,164	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	364	364	336	25,885	食品・飲料・タバコ
AURIZON HOLDINGS LTD	868	944	406	31,232	運輸
AFTERPAY LTD	—	115	1,095	84,254	ソフトウェア・サービス
AMPOL LTD	—	133	410	31,534	エネルギー
TPG TELECOM LTD	—	177	137	10,612	電気通信サービス
AUSNET SERVICES	852	852	158	12,190	公益事業
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287	1,287	372	28,611	保険
AGL ENERGY LIMITED	341	324	445	34,285	公益事業
SOUTH32 LTD	2,946	3,006	739	56,886	素材
CIMIC GROUP LTD	40	40	103	7,985	資本財
COLES GROUP LIMITED	574	664	1,191	91,675	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	79	79	236	18,218	ソフトウェア・サービス
小計	株数 銘柄数	35,962 58	35,873 53	67,476 5	5,189,594 <2.0%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LIMITED	211	240	360	26,361	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	349	374	548	40,135	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	306	286	973	71,181	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	406	—	—	—	素材
SPARK NEW ZEALAND LIMITED	878	897	417	30,498	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	302	467	280	20,516	公益事業
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	552	707	541	39,573	運輸
MERIDIAN ENERGY LTD	818	677	418	30,588	公益事業
小計	株数 銘柄数	3,825 8	3,650 7	3,540 —	258,856 <0.1%>
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	123	193	1,792	24,025	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	980	980	1,964	26,329	不動産
BANK OF EAST ASIA	872	872	1,433	19,214	銀行
CLP HOLDINGS LTD	851	851	6,212	83,244	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	606	629	24,291	325,512	各種金融
MTR CORPORATION	670	845	3,620	48,519	運輸
HANG SENG BANK LTD	388	388	5,338	71,540	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	633	833	2,693	36,090	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	715	715	2,945	39,473	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	5,450	5,775	6,987	93,638	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	1,180	1,180	7,286	97,639	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	275	275	550	7,370	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,875	1,875	4,725	63,315	銀行
NWS HOLDINGS LTD	695	—	—	—	資本財
PCCW LIMITED	2,690	2,560	1,195	16,019	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	270	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,563	—	—	—	不動産
SINO LAND CO	1,242	2,242	2,354	31,544	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	850	680	7,160	95,949	不動産
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	270	270	1,255	16,823	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	420	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WHEELLOCK&COMPANY LTD	520	—	—	—	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	780	705	7,134	95,603	資本財
SJM HOLDINGS LIMITED	800	800	728	9,765	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	708	708	971	13,016	消費者サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
AIA GROUP LTD	6,326	6,482	57,365	768,700	保険
SANDS CHINA LTD	1,356	1,160	3,839	51,450	消費者サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	—	460	1,596	21,389	ヘルスケア機器・サービス
SWIRE PROPERTIES LIMITED	530	530	1,248	16,725	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	720	1,020	3,840	51,460	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	1,110	1,250	973	13,048	公益事業
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	650	896	2,486	33,317	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LIMITED	5,170	5,345	3,506	46,984	食品・飲料・タバコ
NEW WORLD DEVELOPMENT	—	848	3,512	47,061	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,434	1,509	8,678	116,286	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	300	300	1,201	16,100	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,394	1,399	6,121	82,030	不動産
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	185,014	2,479,192	
	金額 比率	金額 比率	—	<1.0%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	991	991	398	30,950	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD	942	950	2,439	189,532	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	258	258	203	15,774	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	47	51	107	8,320	小売
SATS LTD	268	—	—	—	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	356	428	394	30,657	各種金融
CAPITALAND LTD	1,366	1,366	428	33,323	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,167	—	—	—	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD	250	779	351	27,317	運輸
UNITED OVERSEAS BANK LTD	639	645	1,487	115,553	銀行
UOL GROUP LIMITED	217	217	163	12,728	不動産
VENTURE CORP LTD	119	115	220	17,127	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	690	—	—	—	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,391	4,655	1,126	87,521	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	437	—	—	—	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,762	1,834	1,861	144,620	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,170	1,032	442	34,395	食品・飲料・タバコ
KEPPEL CORP LTD	699	699	366	28,455	資本財
YANGZIJIAN SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	900	663	60	4,738	資本財
GENTING SINGAPORE LTD	3,702	3,275	276	21,499	消費者サービス
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	10,329	802,518	
	金額 比率	金額 比率	—	<0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
BANK HAPUALIM BM	650	664	1,474	46,199	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	839	701	1,343	42,101	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	13	13	593	18,605	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	546	546	625	19,602	銀行
ICL GROUP LIMITED	287	287	446	13,991	素材
NICE LTD	27	32	2,588	81,121	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	54	92	673	21,102	銀行
AZRIELI GROUP	21	21	430	13,500	不動産
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	8,175	256,225	
	金額 比率	金額 比率	—	<0.1%>	
合計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	—	245,917,079	
	金額 比率	金額 比率	—	<96.8%>	

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

※<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

※銘柄コードの変更等、管理上の都合により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

※一部の銘柄において、資産区分を変更しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国新株予約権証券

銘	柄	期首(前期末)		期		末	
		証 券 数		証 券 数		評 価 額	
		証 券 数		証 券 数		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(スイス)		証券	証券	千スイスフラン	千円		
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG WRT 231122		—	55,710	12	1,409		
合 計	証 券 数 ・ 金 額	—	55,710	12	1,409		
	銘 柄 数 <比 率>	—	1	—	<0.0%>		

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

※〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

(3) 外国投資信託証券

銘	柄	期首(前期末)		期		末	
		口 数		口 数		評 価 額	
		口 数		口 数		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)		口	口	千米ドル	千円	%	
AGNC INVESTMENT CORPORATION		25,432	25,432	395	41,137	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.		5,727	6,496	1,053	109,423	0.0	
AMERICAN TOWER CORP		23,336	23,614	5,527	574,283	0.2	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		80,296	85,417	697	72,411	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC		7,069	7,344	1,232	128,079	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC		7,835	7,835	802	83,375	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST		4,902	4,902	479	49,775	0.0	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP		—	22,634	3,783	393,091	0.2	
DIGITAL REALTY TRUST INC		10,561	14,002	1,914	198,896	0.1	
DUKE REALTY CORP		20,240	21,002	806	83,763	0.0	
EQUINIX INC		4,426	4,811	3,370	350,130	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC		8,664	8,664	508	52,845	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL		18,789	19,671	1,164	120,982	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC		3,332	3,332	833	86,543	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC		6,463	7,483	823	85,514	0.0	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST		4,227	3,613	319	33,170	0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		24,237	28,756	859	89,265	0.0	
HOST HOTELS AND RESORTS INC		37,569	37,569	549	57,062	0.0	
INVITATION HOMES INC		30,069	27,735	797	82,868	0.0	
IRON MOUNTAIN INC		16,395	14,204	378	39,281	0.0	
KIMCO REALTY CORPORATION		21,090	—	—	—	—	
LIBERTY PROPERTY TRUST		9,193	—	—	—	—	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		29,675	31,750	621	64,551	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES		5,780	5,780	716	74,460	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		8,249	8,249	316	32,899	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC		12,872	14,362	514	53,490	0.0	
PROLOGIS INC		33,100	40,040	4,028	418,471	0.2	
PUBLIC STORAGE		7,965	8,249	1,815	188,563	0.1	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首 (前期末)		期		末		
	口数	金額	口数	金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	組入比率
REALTY INCOME CORPORATION	16,047		17,798	1,097	113,974	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	9,451		8,289	388	40,379	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	3,945		—	—	—	—	
SIMON PROPERTY GROUP INC	16,451		15,706	1,343	139,591	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	4,598		5,650	783	81,361	0.0	
UDR INC	14,289		16,633	652	67,772	0.0	
VENTAS INC	20,469		21,317	1,021	106,080	0.0	
VEREIT INC	54,273		54,273	398	41,386	0.0	
VICI PROPERTIES INC	26,533		23,498	603	62,690	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	8,706		8,706	351	36,477	0.0	
WP CAREY INC	8,640		8,640	603	62,733	0.0	
WELLTOWER INC	20,533		22,737	1,467	152,452	0.1	
WEYERHAEUSER CO	37,766		38,940	1,117	116,145	0.0	
小計	口数	金額	709,194	725,133	44,136	4,585,385	
	銘柄数	<比率>	40	38	—	<1.8%>	
(カナダ)					千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP	4,697		3,971	203	16,299	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—		6,546	102	8,164	0.0	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,391		—	—	—	—	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441		7,441	135	10,809	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585		3,585	86	6,950	0.0	
小計	口数	金額	26,114	21,543	528	42,223	
	銘柄数	<比率>	4	4	—	<0.0%>	
(ユーロ・・・フランス)					千ユーロ		
ICADE	1,265		2,061	123	15,355	0.0	
KLEPIERRE	9,305		9,305	180	22,429	0.0	
GECINA SA	2,689		2,189	278	34,605	0.0	
COVIVIO	2,388		2,388	171	21,385	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,311		8,630	545	67,795	0.0	
ユーロ計	口数	金額	22,958	24,573	1,299	161,571	
	銘柄数	<比率>	5	5	—	<0.1%>	
(イギリス)					千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC	44,962		44,962	211	29,284	0.0	
SEGRO PLC	61,311		59,874	539	74,776	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703		39,861	265	36,731	0.0	
小計	口数	金額	138,976	144,697	1,016	140,792	
	銘柄数	<比率>	3	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)					千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP	226,368		200,053	522	40,157	0.0	
TRANSURBAN GROUP	141,455		145,680	2,062	158,652	0.1	
APA GROUP	67,160		68,344	722	55,559	0.0	
GPT GROUP	97,296		97,296	461	35,469	0.0	
LENLEASE GROUP	25,262		36,263	514	39,603	0.0	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首 (前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額		組 入 比 率
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
STOCKLAND		103,417		127,393		588	45,265	0.0
DEXUS		62,385		54,256		532	40,977	0.0
GOODMAN GROUP		86,301		86,301		1,606	123,522	0.0
SYDNEY AIRPORT		49,760		73,899		496	38,193	0.0
SCENTRE GROUP		290,995		275,200		792	60,957	0.0
VICINITY CENTRES		146,656		250,037		417	32,114	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,297,055		1,414,722		8,717	670,473	
	銘 柄 数 <比 率>	11		11		-	<0.3%>	
(香港)						千香港ドル		
LINK REIT		112,500		110,100		7,541	101,060	0.0
HKT TRUST AND HKT LTD		170,000		197,000		2,040	27,348	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	282,500		307,100		9,582	128,409	
	銘 柄 数 <比 率>	2		2		-	<0.1%>	
(シンガポール)						千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		160,800		238,488		474	36,870	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		150,400		159,000		480	37,305	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		130,400		-		-	-	-
SUNTEC REIT		64,600		102,700		157	12,207	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		-		138,100		270	21,028	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		104,900		104,900		217	16,869	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	611,100		743,188		1,599	124,282	
	銘 柄 数 <比 率>	5		5		-	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	3,087,897		3,380,956		-	5,853,137	
	銘 柄 数 <比 率>	70		68		-	<2.3%>	

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※-印は組入れなし。

※銘柄コードの変更等、管理上の都合により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	期		末			
			買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額		
外	S	P	I	2	0	0	百万円	百万円
							88	-
国	D	J	E	U	R	0	382	-
							105	-
	F	T	S	E			1,718	-

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

※-印は組入れなし。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2020年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	245,917,080	96.5
新 株 予 約 権 証 券	1,409	0.0
投 資 証 券	5,853,137	2.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,165,609	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	254,937,235	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※期末における外貨建資産（253,578,568千円）の投資信託財産総額（254,937,235千円）に対する比率は99.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=103.89円、1カナダドル=79.95円、1ユーロ=124.38円、1英ポンド=138.55円、1スイスフラン=114.97円、1スウェーデンクローナ=12.22円、1ノルウェークローネ=11.76円、1デンマーククローネ=16.71円、1オーストラリアドル=76.91円、1ニュージーランドドル=73.11円、1香港ドル=13.40円、1シンガポールドル=77.69円、1イスラエルシェケル=31.34円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	255,224,931,819円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,192,443,838
株 式(評価額)	245,917,080,208
新株予約権証券(評価額)	1,409,095
投資証券(評価額)	5,853,137,269
未 収 入 金	381,543,821
未 収 配 当 金	294,778,194
差 入 委 託 証 拠 金	584,539,394
(B) 負 債	1,127,777,808
未 払 金	788,431,720
未 払 解 約 金	339,339,658
未 払 利 息	2,144
そ の 他 未 払 費 用	4,286
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	254,097,154,011
元 本	59,674,216,686
次 期 繰 越 損 益 金	194,422,937,325
(D) 受 益 権 総 口 数	59,674,216,686口
1万口当たり基準価額(C/D)	42,581円

※当期における期首元本額59,882,488,969円、期中追加設定元本額20,425,474,003円、期中一部解約元本額20,633,746,286円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2019年12月3日 至2020年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,945,792,767円
受 取 配 当 金	3,940,134,235
受 取 利 息	951,812
そ の 他 収 益 金	4,980,533
支 払 利 息	△ 273,813
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	20,238,998,308
売 買 益	44,391,204,869
売 買 損	△ 24,152,206,561
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 79,843,737
取 引 益	2,378,100,774
取 引 損	△ 2,457,944,511
(D) 信 託 報 酬 等	△ 117,203,167
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	23,987,744,171
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	172,536,430,782
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	54,373,403,543
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 56,474,641,171
(I) 計 (E+F+G+H)	194,422,937,325
次 期 繰 越 損 益 金(I)	194,422,937,325

※有価証券売買損益および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。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	27,350,003,523円	バランスファンドVA (安定運用型) <適格機関投資家限定>	6,562,285円
三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型)	310,543,606円	SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	54,145,635円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	1,288,391,378円	SMAM・バランスファンドVA 2 5 <適格機関投資家専用>	1,147,060,453円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	858,477,735円	SMAM・バランスファンドVA 3 7. 5 <適格機関投資家専用>	1,224,505,679円
SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	58,960,178円	SMAM・バランスファンドVA 5 0 <適格機関投資家専用>	5,209,550,359円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020 (4資産タイプ)	1,706,572円	SMAM・バランスファンドVL 3 0 <適格機関投資家限定>	16,031,634円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025 (4資産タイプ)	7,515,777円	SMAM・バランスファンドVL 5 0 <適格機関投資家限定>	88,024,004円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030 (4資産タイプ)	21,641,411円	世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	274,725円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035 (4資産タイプ)	53,017,751円	SMAM・バランスファンドVA 7 5 <適格機関投資家専用>	648,403,413円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040 (4資産タイプ)	46,975,874円	SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	54,665,475円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045 (4資産タイプ)	95,272,923円	SMAM・インデックス・バランスVA 2 5 <適格機関投資家専用>	154,273,858円
外国株式指数ファンド	565,690,254円	SMAM・インデックス・バランスVA 5 0 <適格機関投資家専用>	679,107,005円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	7,816,684,732円	SMAM・バランスファンドVA 4 0 <適格機関投資家専用>	523,402,551円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	275,982,943円	SMAM・バランスファンドVA 3 5 <適格機関投資家専用>	1,244,537,154円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	280,503,009円	SMAM・バランスVA株4 0 T <適格機関投資家限定>	516,296円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	177,883,661円	三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用)	261,805,221円
イオン・バランス戦略ファンド	16,925,077円	SMAM・グローバルバランス4 0 VA <適格機関投資家限定>	108,092,846円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	11,438,962円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 0 A <適格機関投資家専用>	13,733,300円
三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)	88,460,460円	SMAM・アセットバランスファンドVA 3 5 A <適格機関投資家専用>	11,124,088円
三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型)	72,449,250円	SMAM・アセットバランスファンドVA 5 0 A <適格機関投資家専用>	5,922,681円
三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型)	232,812,161円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 0 L <適格機関投資家専用>	33,604,511円
三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型)	112,882,937円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 5 L <適格機関投資家専用>	89,623,024円
三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型)	122,445,007円	SMAM・グローバルバランスファンド (標準型) VA <適格機関投資家限定>	302,499,958円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	29,486,288円	SMAM・グローバルバランスファンド (債券重視型) VA <適格機関投資家限定>	101,952,579円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	119,850,668円	SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	4,548,116,430円
三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)	2,018,507円	SMAM・世界バランスファンドVA 2 <適格機関投資家限定>	200,729,573円
三井住友DS・年金バランス50 (標準型)	9,294,678円	SMAM・外国株式インデックスファンドSA <適格機関投資家限定>	1,582,545,591円
三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)	7,425,834円	SMAM・年金ワリスクコントロールファンド <適格機関投資家限定>	11,572,621円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,858,286円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	34,675,816円
SMBC・DCインデックスファンド (MSC I コクサイ)	4,845,211円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン <適格機関投資家限定>	47,860,932円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	978,623,890円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII <適格機関投資家限定>	249,228,446円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド 〈適格機関投資家限定〉

(2019年12月18日から2020年12月17日まで)

第 17 期

決算日 2020年12月17日

■当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2003年12月18日）
運用方針	F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドおよびベンチマーク採用国の国債等を主要投資対象とします。 外国債券パッシブ・マザーファンド ベンチマーク採用国の国債
当ファンドの運用方法	■ベンチマーク採用国の国債等に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ■ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。 ■ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。 ■保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 外国債券パッシブ・マザーファンド ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	年1回（毎年12月17日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、次の方針に基づき分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

■ 1万口当たりの費用明細(2019年12月18日から2020年12月17日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	12円	0.066%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数)
(a) 信託報酬 (投信会社)	(2)	(0.009)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(a) 信託報酬 (販売会社)	(2)	(0.013)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(a) 信託報酬 (受託会社)	(8)	(0.044)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	8	0.043	その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数
(b) その他費用 (保管費用)	(7)	(0.037)	保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
(b) その他費用 (監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
(b) その他費用 (その他)	(0)	(0.001)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	20	0.109	

期中の平均基準価額は18,535円です。

※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、簡便法により算出しています。
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2019年12月18日から2020年12月17日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券パッシブ・マザーファンド	千口 795,502	千円 1,490,250	千口 1,436,960	千円 2,641,344

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 組入れ資産の明細(2020年12月17日現在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期	末
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券パッシブ・マザーファンド	千口 2,659,394	千口 2,017,936	千円 3,856,074

※外国債券パッシブ・マザーファンドの期末の受益権総口数は84,615,543千口です。

※単位未満は切捨て。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	3,876,384,449円
コール・ローン等	310,447
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	3,856,074,003
未 収 入 金	19,999,999
(B) 負 債	21,804,722
未 払 解 約 金	20,299,998
未 払 信 託 報 酬	1,389,027
そ の 他 未 払 費 用	115,697
(C) 純資産総額(A-B)	3,854,579,727
元 本	2,039,887,257
次 期 繰 越 損 益 金	1,814,692,470
(D) 受益権総口数	2,039,887,257口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,896円

※当期における期首元本額2,686,779,565円、期中追加設定元本額811,614,485円、期中一部解約元本額1,458,506,793円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2019年12月18日 至2020年12月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 53円
支 払 利 息	△ 53
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	139,568,251
売 買 損 益	174,176,235
売 買 損 益	△ 34,607,984
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,826,181
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	136,742,017
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	126,369,620
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,551,580,833
(配 当 等 相 当 額)	(2,196,397,932)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 644,817,099)
(G) 一 計 (D+E+F)	1,814,692,470
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	1,814,692,470
追 加 信 託 差 損 益 金	1,551,580,833
(配 当 等 相 当 額)	(2,197,405,933)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 645,825,100)
分 配 準 備 積 立 金	263,111,637

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※期末における、費用控除後の配当等収益(78,289,756円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(23,789,000円)、信託約款に規定される収益調整金(2,197,405,933円)および分配準備積立金(161,032,881円)より分配可能額は2,460,517,570円(1万口当たり12,062円)ですが、分配は行っておりません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

第17期（2019年12月18日から2020年12月17日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年12月18日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ・ 保有する外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。

■ 最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		(ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
13期 (2016年12月19日)	円 17,116	% △5.1	172.59	% △5.7	% 98.4	百万円 180,203
14期 (2017年12月18日)	17,897	4.6	181.01	4.9	98.9	196,212
15期 (2018年12月17日)	17,553	△1.9	177.36	△2.0	98.7	168,894
16期 (2019年12月17日)	18,248	4.0	184.64	4.1	98.6	171,892
17期 (2020年12月17日)	19,109	4.7	193.48	4.8	99.0	161,689

※ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したもので、設定時を100として2020年12月17日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

※ F T S E 世界国債インデックス（除く日本）の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 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) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 率 比
	騰 落	率	騰 落	率	
(期 首) 2019年12月17日	円 18,248	% —	184.64	% —	% 98.6
12月末	18,289	0.2	184.76	0.1	98.0
2020年1月末	18,430	1.0	186.45	1.0	98.4
2月末	18,646	2.2	188.52	2.1	98.6
3月末	18,646	2.2	189.13	2.4	97.9
4月末	18,321	0.4	185.30	0.4	97.8
5月末	18,576	1.8	187.85	1.7	97.8
6月末	18,865	3.4	191.10	3.5	98.2
7月末	19,053	4.4	192.35	4.2	98.6
8月末	19,034	4.3	192.65	4.3	98.2
9月末	19,120	4.8	193.62	4.9	99.0
10月末	18,839	3.2	190.58	3.2	99.0
11月末	19,036	4.3	192.55	4.3	98.9
(期 末) 2020年12月17日	19,109	4.7	193.48	4.8	99.0

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2019年12月18日から2020年12月17日まで）

基準価額等の推移



期首	18,248円
期末	19,109円
騰落率	+4.7%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

※FTSE世界国債インデックス（除く日本）の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因（2019年12月18日から2020年12月17日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の公社債に分散投資し、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に対し、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション（投資資金の平均回収期間）等を可能な限り近似させることにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因	・ 新型コロナウイルスの感染拡大による景気の悪化や各国の中央銀行が大規模な金融緩和政策を行ったことなどを受けて、欧米の長期金利（10年国債利回り）が低下（債券価格は上昇）したこと
下落要因	・ 米金利の低下や米中関係悪化懸念に伴うリスクセンチメント（リスクに対する投資家心理）の悪化を背景に、米ドルが対円で下落したこと

▶ 投資環境について（2019年12月18日から2020年12月17日まで）

長期金利は米国、欧州ともに低下しました。為替市場では、米ドルが対円で下落した一方で、ユーロは対円で上昇しました。

債券市場

米国では、1月から3月にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大を受けたリスクセンチメントの悪化や、F R B（米連邦準備制度理事会）による緊急利下げなど大規模な金融緩和政策を受けて、金利が大幅に低下しました。その後は、経済活動再開の動きの一方で感染拡大が引き続き警戒されたことなどから、金利は一進一退の推移となりました。11月に行われた米大統領選挙の結果について、ねじれ議会（民主党バイデン氏が新大統領、上院は共和党、下院は民主党が過半数）となる可能性が高いとの見方から、大規模な財政拡大への期待は後退しました。しかし、新型コロナウイルスのワクチン開発が進展したことなどから、期末にかけて金利は緩やかに上昇傾向となりました。

欧州でも、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、3月上旬にかけて金利は一時急低下しました。その後、投資家による保有資産売却の動きや大規模な財政支援策への思惑から3月中旬にかけて金利は急上昇しましたが、E C B（欧州中央銀行）が資産購入策の拡大など大規模な金融緩和政策を発表したことで再び低下する展開となりました。その後は、E U（欧州連合）復興基金設立で合意（7月）したことや経済再開の動きを背景としたリスクセンチメント回復の一方で、大規模な金融緩和政策が継続されたことから、金利は期末まで一進一退の推移となりました。

当期の市場の動きを米国10年国債利回りで見ると、期首1.87%から期末0.92%へと低下し、ドイツ10年国債利回りで見ると、期首-0.28%から期末-0.57%へと低下しました。

為替市場

米ドル・円相場は、新型コロナウイルスの感染拡大によるリスク回避的な動きやF R Bの緊急利下げを背景に、3月上旬にかけて米ドル安・円高が進行したものの、その後、米ドル確保の動きが強まり、3月中旬にかけて一転して米ドルが上昇する展開となりました。その後は、F R Bなど各国中央銀行による米ドル供給策を受けて米ドル安・円高となりました。4月以降も、経済活動再開の動きの一方で、米中関係悪化への懸念や感染拡大への懸念などを背景に期末まで、米ドル安・円高傾向での推移となりました。

ユーロ・円は、期初から5月上旬にかけて、欧州各国での新型コロナウイルス感染拡大への懸念などリスクセンチメントの悪化から、円高傾向となりました。その後は、欧州復興基金設立への合意や経済活動再開に伴うリスク選好度の改善などを背景に、期末までユーロ高・円安基調となりました。

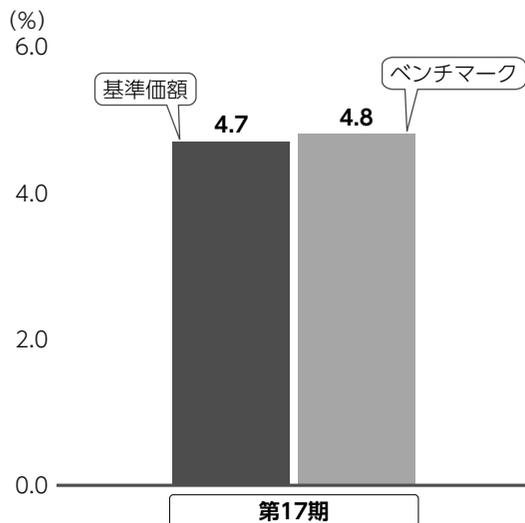
当期の米ドル・円は、期首109円56銭から期末103円44銭と6円12銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首122円01銭から期末126円06銭と4円05銭のユーロ高・円安となりました。

▶ポートフォリオについて（2019年12月18日から2020年12月17日まで）

F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。インデックス構成銘柄の変更が実施される毎月末において、ファンドの特性値（通貨・国別配分、満期構成、デュレーション等）をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資配分比率の調整）を行いました。

▶ベンチマークとの差異について（2019年12月18日から2020年12月17日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



当ファンドは、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は+4.7%となり、ベンチマークの騰落率+4.8%を0.1%下方乖離しました。

下方乖離要因

・カストディフィーやポートフォリオの維持のための売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

米国では、新型コロナウイルスのワクチン開発進展や財政支出の拡大が金利上昇要因となる一方で、感染拡大による悪影響が懸念されることやF R Bの金融緩和政策の継続を背景に金利の上昇が抑制されることから、長期金利は低位のレンジ内での推移を予想します。ユーロ圏でも、財政支出の拡大が見込まれる一方で、低インフレ環境やE C Bの金融緩和政策が続くことから、長期金利は低位での推移を予想します。

為替相場は、米ドル・円では、米景気の底堅さは米ドルの支援材料ですが、F R Bの金融緩和政策が続くことから、レンジ相場を予想します。ユーロ・米ドルに関しては、ワクチン開発の進展に伴うリスクセンチメントの改善や復興基金による投資拡大への期待がユーロの支援材料となり、ユーロの底堅い推移を予想します。

引き続き、債券組入比率を高位に保ち、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション等を可能な限りベンチマークに近似させるよう運用を行います。また月次のベンチマークの構成銘柄の更新や、日々の資金流出入に対応し、迅速なリバランスを行います。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細 (2019年12月18日から2020年12月17日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) そ の 他 費 用	7円	0.038%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
（保 管 費 用）	(7)	(0.037)	
（そ の 他）	(0)	(0.001)	
合 計	7	0.038	

期中の平均基準価額は18,737円です。

※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、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2019年12月18日から2020年12月17日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 131,070	千米ドル 251,100
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 7,968	千カナダドル 9,155
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 16,220	千メキシコペソ 22,178
	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	33,962	17,657
	イ タ リ ア	国 債 証 券	18,897	27,462
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	21,406	29,633
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	4,428	4,857
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	14,085	13,692
	ベルギー	国 債 証 券	7,380	10,110
	オーストリア	国 債 証 券	2,962	4,611
フィンランド	国 債 証 券	711	1,675	
アイルランド	国 債 証 券	1,653	2,034	
国	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 11,651	千英ポンド 15,037
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 6,482	千スウェーデンクローナ 11,425

外国債券パッシブ・マザーファンド

			買 付 額	売 付 額
外 国	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 7,676	千ノルウェークローネ 8,337
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 8,942	千デンマーククローネ 12,811
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 17,027	千ポーランドズロチ 16,130
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 18,153	千オーストラリアドル 5,821
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 1,610	千シンガポールドル 1,824
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリングット 1,718	千マレーシアリングット -
	イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 21,180	千イスラエルシェケル -
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド -	千南アフリカランド 117,912

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等 (2019年12月18日から2020年12月17日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※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す。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2019年12月18日から2020年12月17日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2020年12月17日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千米ドル 605,970	千米ドル 664,300	千円 68,715,242	% 42.5	% -	% 18.8	% 16.3	% 7.4
カ ナ ダ	千カナダドル 34,300	千カナダドル 39,185	3,179,505	2.0	-	1.1	0.5	0.3
メ キ シ コ	千メキシコペソ 233,000	千メキシコペソ 264,976	1,380,527	0.9	-	0.5	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	79,100	95,520	12,041,282	7.4	-	4.8	2.1	0.6
イ タ リ ア	101,320	122,959	15,500,287	9.6	-	5.8	2.7	1.1
フ ラ ン ス	109,170	134,841	16,998,179	10.5	-	7.0	2.6	0.9
オ ラ ン ダ	20,700	25,529	3,218,304	2.0	-	1.3	0.4	0.3
ス ペ イ ン	61,850	77,684	9,792,846	6.1	-	4.2	1.5	0.4
ベルギー	25,450	32,558	4,104,348	2.5	-	1.9	0.5	0.2
オーストリア	16,150	20,562	2,592,066	1.6	-	1.1	0.3	0.2
フィンランド	8,000	9,187	1,158,207	0.7	-	0.3	0.3	0.1
アイルランド	9,000	10,592	1,335,248	0.8	-	0.6	0.2	0.1
イ ギ リ ス	千英ポンド 56,100	千英ポンド 76,679	10,706,720	6.6	-	5.1	1.2	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 39,000	千スウェーデンクローナ 44,152	546,166	0.3	-	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 30,200	千ノルウェークローネ 32,218	384,049	0.2	-	0.1	0.1	-
デンマーク	千デンマーククローネ 37,900	千デンマーククローネ 49,672	841,446	0.5	-	0.4	0.1	-
ポーランド	千ポーランドズロチ 32,500	千ポーランドズロチ 36,035	1,024,121	0.6	-	0.3	0.2	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 48,150	千オーストラリアドル 56,066	4,392,805	2.7	-	2.1	0.4	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 7,750	千シンガポールドル 8,975	698,679	0.4	-	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 29,700	千マレーシアリンギット 32,108	820,039	0.5	-	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 17,800	千イスラエルシェケル 20,650	657,084	0.4	-	0.2	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド -	千南アフリカランド -	-	-	-	-	-	-
合 計	-	-	160,087,159	99.0	-	56.2	29.8	12.9

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売相場の仲値により邦貨換算したものです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※-印は組入れなし。

外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 外国（外貨建）公社債

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千 米 ド ル	千 米 ド ル	千 円		
(アメリカ)	国債証券	US TREASURY N/B 0.125		0.125	4,300	4,295	444,340	2023/7/15
		US TREASURY N/B 0.125		0.125	8,000	7,993	826,808	2023/8/15
		US TREASURY N/B 0.125		0.125	5,700	5,692	588,824	2023/10/15
		US TREASURY N/B 0.25		0.25	5,000	5,011	518,412	2023/4/15
		US TREASURY N/B 0.25		0.25	7,700	7,717	798,292	2023/6/15
		US TREASURY N/B 0.25		0.25	2,400	2,391	247,344	2025/6/30
		US TREASURY N/B 0.25		0.25	3,300	3,286	339,911	2025/7/31
		US TREASURY N/B 0.375		0.375	1,500	1,504	155,656	2022/3/31
		US TREASURY N/B 0.375		0.375	3,000	3,008	311,217	2025/4/30
		US TREASURY N/B 0.375		0.375	9,100	8,947	925,566	2027/9/30
		US TREASURY N/B 0.5		0.5	1,500	1,512	156,444	2025/3/31
		US TREASURY N/B 0.5		0.5	3,000	2,987	309,035	2027/4/30
		US TREASURY N/B 0.5		0.5	3,000	2,985	308,792	2027/5/31
		US TREASURY N/B 0.625		0.625	1,500	1,506	155,826	2027/3/31
		US TREASURY N/B 0.625		0.625	7,500	7,325	757,799	2030/5/15
		US TREASURY N/B 0.625		0.625	5,800	5,649	584,390	2030/8/15
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	4,000	4,048	418,802	2022/2/28
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	1,500	1,552	160,542	2025/2/28
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	3,000	3,106	321,326	2027/2/28
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	3,000	3,086	319,265	2023/7/31
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	5,100	4,601	476,026	2050/5/15
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	4,000	4,090	423,166	2022/10/15
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	3,080	318,635	2023/2/15
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	500	515	53,320	2023/6/30
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,500	2,582	267,125	2023/8/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	3,102	320,890	2023/9/30
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	1,000	1,044	108,062	2025/1/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,600	2,732	282,622	2026/8/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,500	2,327	240,720	2050/8/15
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	3,045	315,071	2022/1/31
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,500	3,583	370,695	2022/9/15
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	3,089	319,605	2023/2/28
US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	3,092	319,872	2023/3/31		
US TREASURY N/B 1.5		1.5	2,000	2,097	216,949	2024/11/30		
US TREASURY N/B 1.5		1.5	1,500	1,586	164,093	2026/8/15		
US TREASURY N/B 1.5		1.5	1,000	1,058	109,500	2027/1/31		
US TREASURY N/B 1.5		1.5	4,500	4,754	491,772	2030/2/15		
US TREASURY N/B 1.625		1.625	2,000	2,050	212,068	2022/8/15		
US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,400	3,486	360,625	2022/8/31		
US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,500	3,599	372,363	2022/11/15		
US TREASURY N/B 1.625		1.625	4,000	4,119	426,075	2022/12/15		

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末			
				利	率	額	評 価 額		償 還 年 月 日	
							面	金		額
		US TREASURY N/B 1.625		1.625		3,000		3,104	321,108	2023/4/30
		US TREASURY N/B 1.625		1.625		3,000		3,107	321,447	2023/5/31
		US TREASURY N/B 1.625		1.625		3,000		3,126	323,363	2023/10/31
		US TREASURY N/B 1.625		1.625		2,400		2,550	263,772	2026/2/15
		US TREASURY N/B 1.625		1.625		6,050		6,438	666,000	2026/5/15
		US TREASURY N/B 1.625		1.625		3,900		4,154	429,732	2026/9/30
		US TREASURY N/B 1.625		1.625		3,000		3,196	330,684	2026/11/30
		US TREASURY N/B 1.625		1.625		5,450		5,823	602,373	2029/8/15
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		3,000		3,046	315,120	2021/11/30
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		3,000		3,059	316,429	2022/2/28
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		1,800		1,837	190,090	2022/3/31
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		2,400		2,453	253,783	2022/4/30
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		1,600		1,636	169,318	2022/5/15
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		3,000		3,070	317,617	2022/5/31
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		3,000		3,074	318,053	2022/6/30
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		3,000		3,087	319,411	2022/9/30
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		3,000		3,103	320,987	2023/1/31
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		2,700		2,803	290,023	2023/5/15
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		11,800		12,435	1,286,294	2024/6/30
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		850		896	92,752	2024/7/31
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		2,400		2,577	266,584	2026/12/31
		US TREASURY N/B 1.75		1.75		4,000		4,318	446,666	2029/11/15
		US TREASURY N/B 1.875		1.875		2,400		2,446	253,104	2022/1/31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875		2,000		2,045	211,534	2022/3/31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875		3,000		3,071	317,738	2022/4/30
		US TREASURY N/B 1.875		1.875		3,000		3,076	318,199	2022/5/31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875		1,700		1,748	180,821	2022/7/31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875		4,800		4,942	511,252	2022/8/31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875		3,000		3,097	320,429	2022/10/31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875		1,800		1,908	197,407	2024/8/31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875		3,500		3,775	390,494	2026/6/30
		US TREASURY N/B 1.875		1.875		3,200		3,452	357,074	2026/7/31
		US TREASURY N/B 2		2.0		3,500		3,567	369,054	2021/12/31
		US TREASURY N/B 2		2.0		3,100		3,168	327,703	2022/2/15
		US TREASURY N/B 2		2.0		3,000		3,090	319,678	2022/7/31
		US TREASURY N/B 2		2.0		3,500		3,622	374,683	2022/10/31
		US TREASURY N/B 2		2.0		5,000		5,182	536,029	2022/11/30
		US TREASURY N/B 2		2.0		3,800		3,952	408,887	2023/2/15
		US TREASURY N/B 2		2.0		2,000		2,121	219,454	2024/4/30
		US TREASURY N/B 2		2.0		3,300		3,503	362,366	2024/5/31
		US TREASURY N/B 2		2.0		2,500		2,657	274,843	2024/6/30
		US TREASURY N/B 2		2.0		3,500		3,746	387,524	2025/2/15
		US TREASURY N/B 2		2.0		4,300		4,631	479,054	2025/8/15
		US TREASURY N/B 2		2.0		5,000		5,436	562,333	2026/11/15

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末										
				利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
		US TREASURY	N/B	2	2.0	2,800	3,026	313,074	2050/2/15								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	3,000	3,062	316,744	2021/12/31								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	2,500	2,570	265,893	2022/5/15								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	3,000	3,092	319,847	2022/6/30								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	4,000	4,161	430,504	2022/12/31								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	3,100	3,279	339,227	2023/11/30								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	2,000	2,123	219,680	2024/2/29								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	6,500	6,910	714,855	2024/3/31								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	3,500	3,739	386,788	2024/7/31								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	4,000	4,282	442,981	2024/9/30								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	1,800	1,931	199,807	2024/11/30								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	4,900	5,288	547,048	2025/5/15								
		US TREASURY	N/B	2.125	2.125	900	982	101,620	2026/5/31								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	4,300	4,421	457,336	2022/4/15								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	3,000	3,188	329,860	2023/12/31								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	2,200	2,341	242,253	2024/1/31								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	3,800	4,062	420,187	2024/4/30								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	1,500	1,615	167,075	2024/10/31								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	6,300	6,789	702,278	2024/11/15								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	3,100	3,345	346,091	2024/12/31								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	4,000	4,366	451,644	2025/11/15								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	2,700	2,961	306,322	2026/3/31								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	4,400	4,858	502,569	2027/2/15								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	4,200	4,653	481,320	2027/8/15								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	4,400	4,881	504,987	2027/11/15								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	2,850	3,243	335,477	2046/8/15								
		US TREASURY	N/B	2.25	2.25	3,500	3,988	412,584	2049/8/15								
		US TREASURY	N/B	2.375	2.375	3,600	3,700	382,799	2022/3/15								
		US TREASURY	N/B	2.375	2.375	1,200	1,256	130,014	2023/1/31								
		US TREASURY	N/B	2.375	2.375	3,700	3,958	409,429	2024/2/29								
		US TREASURY	N/B	2.375	2.375	5,600	6,037	624,519	2024/8/15								
		US TREASURY	N/B	2.375	2.375	4,900	5,461	564,986	2027/5/15								
		US TREASURY	N/B	2.375	2.375	5,200	5,869	607,141	2029/5/15								
		US TREASURY	N/B	2.375	2.375	1,900	2,222	229,916	2049/11/15								
		US TREASURY	N/B	2.5	2.5	1,900	1,948	201,556	2022/1/15								
		US TREASURY	N/B	2.5	2.5	3,500	3,596	372,024	2022/2/15								
		US TREASURY	N/B	2.5	2.5	5,000	5,313	549,605	2023/8/15								
		US TREASURY	N/B	2.5	2.5	5,700	6,145	635,671	2024/5/15								
		US TREASURY	N/B	2.5	2.5	3,400	3,709	383,733	2025/1/31								
		US TREASURY	N/B	2.5	2.5	1,400	1,551	160,462	2026/2/28								
		US TREASURY	N/B	2.5	2.5	4,100	4,875	504,302	2045/2/15								
		US TREASURY	N/B	2.5	2.5	2,900	3,453	357,264	2046/2/15								
		US TREASURY	N/B	2.5	2.5	4,100	4,884	505,230	2046/5/15								
		US TREASURY	N/B	2.625	2.625	3,000	3,074	317,981	2021/12/15								

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		US TREASURY N/B 2. 625		2. 625	4, 000	4, 218	436, 322	2023/ 2 /28
		US TREASURY N/B 2. 625		2. 625	2, 300	2, 527	261, 480	2025/ 3 /31
		US TREASURY N/B 2. 625		2. 625	4, 400	4, 892	506, 125	2025/12/31
		US TREASURY N/B 2. 625		2. 625	4, 700	5, 389	557, 497	2029/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	2, 900	3, 078	318, 466	2023/ 4 /30
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	1, 000	1, 063	110, 010	2023/ 5 /31
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	2, 000	2, 135	220, 925	2023/ 7 /31
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	3, 800	4, 066	420, 587	2023/ 8 /31
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	4, 200	4, 515	467, 133	2023/11/15
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	5, 100	5, 513	570, 283	2024/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	2, 000	2, 205	228, 133	2025/ 2 /28
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	4, 600	5, 102	527, 755	2025/ 6 /30
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	2, 100	2, 334	241, 508	2025/ 8 /31
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	4, 800	5, 502	569, 204	2028/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	2, 000	2, 473	255, 836	2042/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	300	370	38, 343	2042/11/15
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	3, 800	4, 749	491, 309	2047/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	1, 500	1, 876	194, 071	2047/11/15
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	1, 000	1, 077	111, 472	2023/10/31
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	2, 000	2, 159	223, 381	2023/11/30
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	2, 200	2, 445	252, 956	2025/ 4 /30
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	1, 100	1, 224	126, 700	2025/ 5 /31
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	2, 500	2, 807	290, 399	2025/11/30
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	5, 000	5, 792	599, 143	2028/ 5 /15
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	5, 500	6, 386	660, 658	2028/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	3, 000	3, 786	391, 633	2043/ 5 /15
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	4, 000	5, 075	524, 974	2045/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	3, 600	4, 585	474, 295	2046/11/15
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	1, 400	1, 800	186, 280	2049/ 5 /15
		US TREASURY N/B 3		3. 0	4, 000	4, 502	465, 706	2025/ 9 /30
		US TREASURY N/B 3		3. 0	3, 100	3, 494	361, 473	2025/10/31
		US TREASURY N/B 3		3. 0	800	1, 026	106, 194	2042/ 5 /15
		US TREASURY N/B 3		3. 0	3, 500	4, 519	467, 470	2044/11/15
		US TREASURY N/B 3		3. 0	3, 000	3, 881	401, 464	2045/ 5 /15
		US TREASURY N/B 3		3. 0	2, 700	3, 502	362, 277	2045/11/15
		US TREASURY N/B 3		3. 0	2, 500	3, 258	337, 109	2047/ 2 /15
		US TREASURY N/B 3		3. 0	2, 200	2, 871	296, 994	2047/ 5 /15
		US TREASURY N/B 3		3. 0	3, 100	4, 053	419, 268	2048/ 2 /15
		US TREASURY N/B 3		3. 0	5, 400	7, 076	731, 996	2048/ 8 /15
		US TREASURY N/B 3		3. 0	3, 800	4, 993	516, 490	2049/ 2 /15
		US TREASURY N/B 3. 125		3. 125	4, 200	4, 969	514, 074	2028/11/15
		US TREASURY N/B 3. 125		3. 125	1, 100	1, 435	148, 505	2041/11/15
		US TREASURY N/B 3. 125		3. 125	1, 000	1, 308	135, 320	2042/ 2 /15
		US TREASURY N/B 3. 125		3. 125	2, 300	3, 010	311, 423	2043/ 2 /15

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		US TREASURY N/B 3. 125	3. 125	3, 300	4, 342	449, 211	2044/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 3. 125	3. 125	2, 400	3, 211	332, 236	2048/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 3. 375	3. 375	3, 000	4, 094	423, 538	2044/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 3. 375	3. 375	3, 100	4, 338	448, 729	2048/11/15	
		US TREASURY N/B 3. 5	3. 5	800	1, 085	112, 290	2039/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 3. 625	3. 625	2, 400	3, 384	350, 050	2043/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 3. 625	3. 625	3, 600	5, 087	526, 239	2044/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 3. 75	3. 75	1, 500	2, 128	220, 145	2041/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 3. 75	3. 75	700	1, 005	104, 044	2043/11/15	
		US TREASURY N/B 3. 875	3. 875	500	715	74, 032	2040/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 4. 25	4. 25	1, 000	1, 483	153, 442	2039/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 4. 25	4. 25	600	900	93, 188	2040/11/15	
		US TREASURY N/B 4. 375	4. 375	500	743	76, 856	2038/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 4. 375	4. 375	700	1, 058	109, 452	2039/11/15	
		US TREASURY N/B 4. 375	4. 375	1, 400	2, 125	219, 814	2040/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 4. 375	4. 375	300	459	47, 517	2041/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 4. 5	4. 5	750	1, 101	113, 915	2036/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 4. 5	4. 5	200	301	31, 235	2038/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 4. 5	4. 5	1, 000	1, 529	158, 202	2039/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 4. 625	4. 625	600	935	96, 744	2040/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 4. 75	4. 75	1, 500	2, 394	247, 710	2041/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 5	5. 0	500	783	81, 038	2037/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 5. 25	5. 25	500	674	69, 807	2028/11/15	
		US TREASURY N/B 5. 375	5. 375	320	460	47, 608	2031/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 5. 5	5. 5	500	679	70, 314	2028/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 6	6. 0	1, 000	1, 286	133, 049	2026/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 6. 125	6. 125	1, 000	1, 373	142, 116	2027/11/15	
		US TREASURY N/B 6. 25	6. 25	800	929	96, 192	2023/ 8 /15	
	小	計	—	—	—	68, 715, 242	—	
(カ ナ ダ)	国 債 証 券	CANADA-GOV' T 0. 5	0. 5	2, 000	2, 007	162, 847	2022/ 3 / 1	
		CANADA-GOV' T 0. 5	0. 5	600	601	48, 800	2025/ 9 / 1	
		CANADA-GOV' T 1	1. 0	3, 000	3, 040	246, 691	2022/ 9 / 1	
		CANADA-GOV' T 1	1. 0	1, 300	1, 339	108, 708	2027/ 6 / 1	
		CANADA-GOV' T 1. 25	1. 25	3, 400	3, 560	288, 924	2030/ 6 / 1	
		CANADA-GOV' T 1. 5	1. 5	2, 000	2, 060	167, 180	2023/ 6 / 1	
		CANADA-GOV' T 1. 5	1. 5	1, 000	1, 042	84, 558	2024/ 9 / 1	
		CANADA-GOV' T 1. 5	1. 5	3, 100	3, 271	265, 468	2026/ 6 / 1	
		CANADA-GOV' T 1. 75	1. 75	1, 100	1, 135	92, 138	2023/ 3 / 1	
		CANADA-GOV' T 2	2. 0	1, 200	1, 254	101, 814	2023/ 9 / 1	
		CANADA-GOV' T 2	2. 0	900	993	80, 583	2028/ 6 / 1	
		CANADA-GOV' T 2. 25	2. 25	1, 000	1, 061	86, 144	2024/ 3 / 1	
		CANADA-GOV' T 2. 25	2. 25	1, 400	1, 514	122, 918	2025/ 6 / 1	
		CANADA-GOV' T 2. 25	2. 25	1, 100	1, 244	101, 011	2029/ 6 / 1	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末							
				利	率	額	価		額	償	還	年	月	日
							外	貨						
		CANADA-GOV' T 2.5		2.5		2,100		2,256		183,108		2024/6/1		
		CANADA-GOV' T 2.75		2.75		1,800		1,866		151,485		2022/6/1		
		CANADA-GOV' T 2.75		2.75		1,100		1,478		119,997		2048/12/1		
		CANADA-GOV' T 2.75		2.75		500		744		60,389		2064/12/1		
		CANADA-GOV' T 3.5		3.5		1,300		1,931		156,732		2045/12/1		
		CANADA-GOV' T 4		4.0		1,500		2,280		185,075		2041/6/1		
		CANADA-GOV' T 5		5.0		1,450		2,324		188,595		2037/6/1		
		CANADA-GOV' T 5.75		5.75		250		354		28,757		2029/6/1		
		CANADA-GOV' T 5.75		5.75		500		787		63,899		2033/6/1		
		CANADA-GOV' T 8		8.0		700		1,031		83,669		2027/6/1		
	小	計		-		-		-		3,179,505		-		
(メキシコ)	国債証券	MEXICAN BONOS 10		10.0		千メキシコペソ 32,000		千メキシコペソ 38,208		199,063		2024/12/5		
		MEXICAN BONOS 5.75		5.75		20,000		20,806		108,399		2026/3/5		
		MEXICAN BONOS 6.5		6.5		42,000		43,290		225,543		2022/6/9		
		MEXICAN BONOS 7.5		7.5		25,000		28,264		147,258		2027/6/3		
		MEXICAN BONOS 7.75		7.75		6,000		6,988		36,408		2031/5/29		
		MEXICAN BONOS 7.75		7.75		18,000		20,985		109,335		2034/11/23		
		MEXICAN BONOS 8		8.0		27,000		29,622		154,333		2023/12/7		
		MEXICAN BONOS 8.5		8.5		23,000		27,860		145,152		2029/5/31		
		MEXICAN BONOS 8.5		8.5		40,000		48,950		255,033		2038/11/18		
	小	計		-		-		-		1,380,527		-		
(ユーロ)						千ユーロ		千ユーロ						
(ドイツ)	国債証券	BUNDESUBL-120 0		-		3,500		3,616		455,950		2025/4/11		
		BUNDESUBL-176 0		-		2,000		2,027		255,586		2022/10/7		
		BUNDESUBL-177 0		-		1,900		1,934		243,861		2023/4/14		
		BUNDESUBL-178 0		-		1,600		1,635		206,207		2023/10/13		
		BUNDESUBL-179 0		-		1,300		1,333		168,114		2024/4/5		
		BUNDESSCHATZANW 0		-		3,400		3,430		432,448		2022/3/11		
		DEUTSCHLAND REP 0		-		2,400		2,503		315,619		2026/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 0		-		3,500		3,695		465,794		2029/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 0		-		1,300		1,373		173,138		2030/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 0		-		2,300		2,415		304,463		2050/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.25		0.25		3,800		4,036		508,799		2027/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.25		0.25		2,900		3,111		392,217		2028/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.25		0.25		1,900		2,044		257,673		2029/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5		2,500		2,634		332,130		2025/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5		1,900		2,025		255,384		2026/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5		3,400		3,682		464,242		2027/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5		4,100		4,460		562,318		2028/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 1		1.0		1,300		1,385		174,705		2024/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 1		1.0		2,050		2,221		280,068		2025/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 1.25		1.25		1,650		2,326		293,222		2048/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 1.5		1.5		2,100		2,204		277,885		2023/2/15		

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末		
				利	率	額	評 価 額		償 還 年 月 日
							面	金	
				1.5	1,300	1,372	172,976	2023/5/15	
				1.5	2,000	2,157	271,944	2024/5/15	
				1.75	2,200	2,285	288,125	2022/7/4	
				1.75	2,200	2,378	299,826	2024/2/15	
				2.0	2,000	2,149	270,991	2023/8/15	
				2.5	2,200	3,693	465,573	2044/7/4	
				2.5	2,600	4,485	565,424	2046/8/15	
				3.25	1,200	2,159	272,285	2042/7/4	
				4.0	1,800	3,121	393,556	2037/1/4	
				4.25	950	1,794	226,199	2039/7/4	
				4.75	1,600	2,280	287,493	2028/7/4	
				4.75	2,000	3,475	438,159	2034/7/4	
				4.75	1,650	3,362	423,906	2040/7/4	
				5.5	900	1,470	185,346	2031/1/4	
				5.625	1,000	1,461	184,245	2028/1/4	
				6.25	1,200	1,460	184,157	2024/1/4	
				6.25	500	822	103,697	2030/1/4	
				6.5	1,000	1,487	187,539	2027/7/4	
(イタリア)	国債証券			0.35	2,700	2,762	348,203	2025/2/1	
				0.65	2,000	2,058	259,524	2023/10/15	
				0.85	1,700	1,778	224,151	2027/1/15	
				0.9	2,250	2,300	290,016	2022/8/1	
				0.95	2,000	2,061	259,827	2023/3/1	
				0.95	2,000	2,062	259,973	2023/3/15	
				0.95	1,800	1,884	237,563	2030/8/1	
				1.0	1,000	1,023	129,046	2022/7/15	
				1.2	1,000	1,021	128,796	2022/4/1	
				1.25	1,600	1,714	216,131	2026/12/1	
				1.35	2,000	2,048	258,178	2022/4/15	
				1.45	2,000	2,068	260,692	2022/9/15	
				1.45	1,800	1,919	241,913	2024/11/15	
				1.45	1,000	1,070	134,971	2025/5/15	
				1.45	600	646	81,538	2036/3/1	
				1.5	2,700	2,899	365,562	2025/6/1	
				1.6	1,200	1,305	164,617	2026/6/1	
				1.65	1,200	1,334	168,191	2030/12/1	
				1.65	1,800	2,002	252,387	2032/3/1	
				1.85	1,000	1,072	135,256	2024/5/15	
				1.85	1,000	1,090	137,418	2025/7/1	
				2.0	1,300	1,435	180,926	2025/12/1	
				2.0	1,600	1,801	227,113	2028/2/1	
				2.05	1,500	1,686	212,635	2027/8/1	
				2.1	1,000	1,116	140,796	2026/7/15	
				2.15	500	513	64,722	2021/12/15	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		BTPS 2.2		2.2	1,000	1,132	142,824	2027/6/1
		BTPS 2.25		2.25	1,200	1,433	180,708	2036/9/1
		BTPS 2.45		2.45	1,100	1,327	167,367	2033/9/1
		BTPS 2.45		2.45	900	1,129	142,350	2050/9/1
		BTPS 2.5		2.5	600	664	83,768	2024/12/1
		BTPS 2.5		2.5	2,100	2,368	298,571	2025/11/15
		BTPS 2.7		2.7	1,550	2,017	254,325	2047/3/1
		BTPS 2.8		2.8	300	358	45,247	2028/12/1
		BTPS 2.8		2.8	900	1,212	152,824	2067/3/1
		BTPS 2.95		2.95	1,300	1,701	214,444	2038/9/1
		BTPS 3		3.0	3,500	4,282	539,846	2029/8/1
		BTPS 3.1		3.1	700	938	118,258	2040/3/1
		BTPS 3.25		3.25	1,500	2,132	268,791	2046/9/1
		BTPS 3.35		3.35	850	1,134	143,061	2035/3/1
		BTPS 3.45		3.45	1,400	2,068	260,732	2048/3/1
		BTPS 3.5		3.5	4,900	6,262	789,449	2030/3/1
		BTPS 3.75		3.75	2,000	2,296	289,547	2024/9/1
		BTPS 3.85		3.85	900	1,428	180,044	2049/9/1
		BTPS 4		4.0	2,600	3,767	474,967	2037/2/1
		BTPS 4.5		4.5	2,300	2,570	324,086	2023/5/1
		BTPS 4.5		4.5	3,000	3,465	436,847	2024/3/1
		BTPS 4.5		4.5	1,800	2,225	280,555	2026/3/1
		BTPS 4.75		4.75	2,500	2,842	358,335	2023/8/1
		BTPS 4.75		4.75	2,500	3,347	421,954	2028/9/1
		BTPS 4.75		4.75	1,600	2,740	345,422	2044/9/1
		BTPS 5		5.0	2,000	2,132	268,835	2022/3/1
		BTPS 5		5.0	1,000	1,219	153,694	2025/3/1
		BTPS 5		5.0	2,070	3,192	402,420	2034/8/1
		BTPS 5		5.0	1,800	2,996	377,681	2039/8/1
		BTPS 5		5.0	1,700	2,857	360,265	2040/9/1
		BTPS 5.5		5.5	1,200	1,322	166,707	2022/9/1
		BTPS 5.5		5.5	2,000	2,222	280,173	2022/11/1
		BTPS 5.75		5.75	1,700	2,699	340,328	2033/2/1
		BTPS 6		6.0	2,200	3,408	429,639	2031/5/1
		BTPS 6.5		6.5	1,700	2,429	306,235	2027/11/1
		BTPS 7.25		7.25	400	569	71,750	2026/11/1
		BTPS 9		9.0	300	381	48,063	2023/11/1
(フランス)	国債証券	FRANCE O. A. T. 0		—	2,000	2,017	254,263	2022/2/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,200	2,222	280,216	2022/5/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,000	2,032	256,186	2023/3/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	4,000	4,093	516,008	2024/3/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	1,200	1,234	155,590	2025/3/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	4,500	4,663	587,918	2029/11/25
		FRANCE O. A. T. 0.25		0.25	4,900	5,149	649,153	2026/11/25

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		FRANCE O. A. T. 0. 5	0. 5	2, 900	3, 052	384, 821	2025/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 0. 5	0. 5	4, 500	4, 778	602, 389	2026/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 0. 5	0. 5	2, 800	3, 027	381, 625	2029/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 0. 75	0. 75	2, 500	2, 738	345, 209	2028/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 0. 75	0. 75	3, 200	3, 518	443, 585	2028/11/25	
		FRANCE O. A. T. 0. 75	0. 75	1, 000	1, 111	140, 150	2052/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 1	1. 0	2, 050	2, 219	279, 773	2025/11/25	
		FRANCE O. A. T. 1	1. 0	2, 500	2, 757	347, 578	2027/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 1. 25	1. 25	2, 700	3, 214	405, 207	2034/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 1. 25	1. 25	2, 400	2, 885	363, 772	2036/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 1. 5	1. 5	3, 850	4, 592	578, 980	2031/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 1. 5	1. 5	2, 400	3, 192	402, 456	2050/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 1. 75	1. 75	4, 200	4, 453	561, 409	2023/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 1. 75	1. 75	2, 600	2, 854	359, 790	2024/11/25	
		FRANCE O. A. T. 1. 75	1. 75	2, 400	3, 168	399, 358	2039/ 6 /25	
		FRANCE O. A. T. 1. 75	1. 75	800	1, 220	153, 904	2066/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 2	2. 0	2, 200	3, 201	403, 531	2048/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 2. 25	2. 25	1, 900	2, 005	252, 864	2022/10/25	
		FRANCE O. A. T. 2. 25	2. 25	3, 400	3, 750	472, 818	2024/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 2. 5	2. 5	3, 500	4, 472	563, 800	2030/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 2. 75	2. 75	2, 550	3, 140	395, 866	2027/10/25	
		FRANCE O. A. T. 3	3. 0	5, 000	5, 250	661, 928	2022/ 4 /25	
		FRANCE O. A. T. 3. 25	3. 25	2, 200	3, 796	478, 616	2045/ 5 /25	
		FRANCE O. A. T. 3. 5	3. 5	2, 500	3, 063	386, 134	2026/ 4 /25	
		FRANCE O. A. T. 4	4. 0	2, 000	3, 441	433, 860	2038/10/25	
		FRANCE O. A. T. 4	4. 0	1, 370	2, 967	374, 040	2055/ 4 /25	
		FRANCE O. A. T. 4	4. 0	1, 400	3, 214	405, 249	2060/ 4 /25	
		FRANCE O. A. T. 4. 25	4. 25	4, 000	4, 575	576, 805	2023/10/25	
		FRANCE O. A. T. 4. 5	4. 5	2, 900	5, 490	692, 075	2041/ 4 /25	
		FRANCE O. A. T. 4. 75	4. 75	2, 200	3, 770	475, 299	2035/ 4 /25	
		FRANCE O. A. T. 5. 5	5. 5	2, 750	4, 152	523, 453	2029/ 4 /25	
		FRANCE O. A. T. 5. 75	5. 75	2, 100	3, 628	457, 351	2032/10/25	
		FRANCE O. A. T. 6	6. 0	3, 000	3, 989	502, 952	2025/10/25	
		FRANCE O. A. T. 8. 5	8. 5	600	731	92, 176	2023/ 4 /25	
(オランダ)	国債証券	NETHERLANDS GOVT 0	—	1, 800	1, 813	228, 641	2022/ 1 /15	
		NETHERLANDS GOVT 0	—	1, 000	1, 022	128, 934	2024/ 1 /15	
		NETHERLANDS GOVT 0	—	1, 900	1, 991	251, 070	2030/ 7 /15	
		NETHERLANDS GOVT 0. 25	0. 25	1, 000	1, 045	131, 778	2025/ 7 /15	
		NETHERLANDS GOVT 0. 25	0. 25	500	535	67, 498	2029/ 7 /15	
		NETHERLANDS GOVT 0. 5	0. 5	1, 200	1, 280	161, 429	2026/ 7 /15	
		NETHERLANDS GOVT 0. 5	0. 5	800	917	115, 683	2040/ 1 /15	
		NETHERLANDS GOVT 0. 75	0. 75	900	984	124, 094	2027/ 7 /15	
		NETHERLANDS GOVT 0. 75	0. 75	1, 000	1, 104	139, 281	2028/ 7 /15	
		NETHERLANDS GOVT 1. 75	1. 75	1, 600	1, 704	214, 814	2023/ 7 /15	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		NETHERLANDS GOVT 2	2.0	1,000	1,099	138,560	2024/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 2.25	2.25	1,500	1,570	198,028	2022/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 2.5	2.5	1,000	1,361	171,681	2033/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 2.75	2.75	1,200	2,145	270,490	2047/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 3.75	3.75	700	765	96,537	2023/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 3.75	3.75	1,300	2,429	306,219	2042/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 4	4.0	1,600	2,746	346,160	2037/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 5.5	5.5	700	1,010	127,399	2028/1/15	
(スペイン)	国債証券	SPANISH GOV'T 0	—	500	510	64,350	2025/1/31	
		SPANISH GOV'T 0.25	0.25	1,000	1,029	129,786	2024/7/30	
		SPANISH GOV'T 0.4	0.4	2,000	2,028	255,677	2022/4/30	
		SPANISH GOV'T 0.45	0.45	500	509	64,255	2022/10/31	
		SPANISH GOV'T 0.5	0.5	1,000	1,050	132,408	2030/4/30	
		SPANISH GOV'T 1.25	1.25	2,000	2,242	282,644	2030/10/31	
		SPANISH GOV'T 1.3	1.3	2,700	2,972	374,718	2026/10/31	
		SPANISH GOV'T 1.4	1.4	2,000	2,240	282,490	2028/4/30	
		SPANISH GOV'T 1.4	1.4	1,600	1,797	226,619	2028/7/30	
		SPANISH GOV'T 1.45	1.45	2,600	2,908	366,677	2027/10/31	
		SPANISH GOV'T 1.45	1.45	2,900	3,285	414,155	2029/4/30	
		SPANISH GOV'T 1.5	1.5	1,200	1,342	169,214	2027/4/30	
		SPANISH GOV'T 1.6	1.6	2,200	2,404	303,146	2025/4/30	
		SPANISH GOV'T 1.85	1.85	2,400	2,918	367,950	2035/7/30	
		SPANISH GOV'T 1.95	1.95	2,600	2,935	370,098	2026/4/30	
		SPANISH GOV'T 1.95	1.95	1,700	2,022	254,997	2030/7/30	
		SPANISH GOV'T 2.15	2.15	2,400	2,710	341,720	2025/10/31	
		SPANISH GOV'T 2.35	2.35	1,700	2,153	271,520	2033/7/30	
		SPANISH GOV'T 2.7	2.7	1,550	2,292	288,933	2048/10/31	
		SPANISH GOV'T 2.75	2.75	2,100	2,370	298,825	2024/10/31	
		SPANISH GOV'T 2.9	2.9	1,400	2,111	266,136	2046/10/31	
		SPANISH GOV'T 3.45	3.45	1,100	2,018	254,443	2066/7/30	
		SPANISH GOV'T 3.8	3.8	1,400	1,608	202,718	2024/4/30	
		SPANISH GOV'T 4.2	4.2	1,650	2,638	332,569	2037/1/31	
		SPANISH GOV'T 4.4	4.4	2,000	2,288	288,463	2023/10/31	
		SPANISH GOV'T 4.65	4.65	1,800	2,233	281,527	2025/7/30	
		SPANISH GOV'T 4.7	4.7	1,500	2,701	340,537	2041/7/30	
		SPANISH GOV'T 4.8	4.8	1,500	1,754	221,123	2024/1/31	
		SPANISH GOV'T 4.9	4.9	1,500	2,726	343,703	2040/7/30	
		SPANISH GOV'T 5.15	5.15	1,500	2,133	268,954	2028/10/31	
		SPANISH GOV'T 5.15	5.15	1,200	2,382	300,315	2044/10/31	
		SPANISH GOV'T 5.4	5.4	2,250	2,537	319,928	2023/1/31	
		SPANISH GOV'T 5.75	5.75	1,500	2,476	312,142	2032/7/30	
		SPANISH GOV'T 5.85	5.85	2,200	2,360	297,505	2022/1/31	
		SPANISH GOV'T 5.9	5.9	500	679	85,635	2026/7/30	
		SPANISH GOV'T 6	6.0	2,200	3,307	416,952	2029/1/31	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末		
				利	率	額	評 価 額		償 還 年 月 日
							面	金	
外	貨	建	金	額	額	額	額		
(ベルギー)	国債証券	BELGIAN 0326 4	4.0	700	1,044	131,679	2032/3/28		
		BELGIAN 0.1	0.1	1,300	1,360	171,465	2030/6/22		
		BELGIAN 0.8	0.8	800	854	107,707	2025/6/22		
		BELGIAN 0.8	0.8	1,000	1,092	137,702	2027/6/22		
		BELGIAN 0.8	0.8	500	550	69,441	2028/6/22		
		BELGIAN 0291 5.5	5.5	1,100	1,594	200,997	2028/3/28		
		BELGIAN 0304 5	5.0	1,600	2,790	351,820	2035/3/28		
		BELGIAN 0308 4	4.0	700	742	93,596	2022/3/28		
		BELGIAN 0320 4.25	4.25	1,200	2,185	275,464	2041/3/28		
		BELGIAN 0324 4.5	4.5	700	893	112,668	2026/3/28		
		BELGIAN 0325 4.25	4.25	1,700	1,852	233,486	2022/9/28		
		BELGIAN 0328 2.25	2.25	1,500	1,613	203,426	2023/6/22		
		BELGIAN 0332 2.6	2.6	2,300	2,571	324,226	2024/6/22		
		BELGIAN 0333 3	3.0	700	1,002	126,341	2034/6/22		
		BELGIAN 0338 0.5	0.5	1,000	1,047	132,001	2024/10/22		
		BELGIAN 0338 2.25	2.25	500	812	102,367	2057/6/22		
		BELGIAN 0344 1.45	1.45	400	496	62,576	2037/6/22		
		BELGIAN 0347 0.9	0.9	1,300	1,452	183,084	2029/6/22		
		BELGIAN 0348 1.7	1.7	500	690	87,057	2050/6/22		
		BELGIAN 1	1.0	1,400	1,528	192,708	2026/6/22		
		BELGIAN 1	1.0	1,000	1,140	143,772	2031/6/22		
		BELGIAN 1.25	1.25	400	474	59,800	2033/4/22		
		BELGIAN 1.6	1.6	850	1,130	142,533	2047/6/22		
		BELGIAN 1.9	1.9	1,000	1,327	167,301	2038/6/22		
		BELGIAN 2.15	2.15	500	841	106,117	2066/6/22		
		BELGIAN 3.75	3.75	800	1,467	185,002	2045/6/22		
(オーストリア)	国債証券	REP OF AUSTRIA 0	—	1,100	1,120	141,228	2023/7/15		
		REP OF AUSTRIA 0.5	0.5	800	857	108,080	2027/4/20		
		REP OF AUSTRIA 0.5	0.5	850	920	116,043	2029/2/20		
		REP OF AUSTRIA 0.75	0.75	900	974	122,845	2026/10/20		
		REP OF AUSTRIA 0.75	0.75	700	766	96,667	2028/2/20		
		REP OF AUSTRIA 0.75	0.75	1,000	1,195	150,687	2051/3/20		
		REP OF AUSTRIA 1.2	1.2	1,000	1,093	137,813	2025/10/20		
		REP OF AUSTRIA 1.5	1.5	700	967	121,996	2047/2/20		
		REP OF AUSTRIA 1.5	1.5	200	337	42,565	2086/11/2		
		REP OF AUSTRIA 1.65	1.65	1,100	1,201	151,452	2024/10/21		
		REP OF AUSTRIA 1.75	1.75	1,000	1,070	134,977	2023/10/20		
		REP OF AUSTRIA 2.4	2.4	900	1,226	154,551	2034/5/23		
		REP OF AUSTRIA 3.15	3.15	600	1,052	132,704	2044/6/20		
		REP OF AUSTRIA 3.4	3.4	1,100	1,187	149,726	2022/11/22		
		REP OF AUSTRIA 3.65	3.65	1,000	1,058	133,401	2022/4/20		
		REP OF AUSTRIA 3.8	3.8	700	1,708	215,396	2062/1/26		
		REP OF AUSTRIA 4.15	4.15	1,000	1,712	215,902	2037/3/15		
		REP OF AUSTRIA 4.85	4.85	500	647	81,685	2026/3/15		

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末										
				利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
		REP OF AUSTRIA	6.25	6.25	1,000					1,462		184,338	2027/7/15				
(フィンランド)	国債証券	FINNISH GOV'T 0		—	400					403		50,910	2022/4/15				
		FINNISH GOV'T 0.25		0.25	300					318		40,203	2040/9/15				
		FINNISH GOV'T 0.5		0.5	400					432		54,547	2028/9/15				
		FINNISH GOV'T 0.5		0.5	800					869		109,578	2029/9/15				
		FINNISH GOV'T 0.75		0.75	500					559		70,574	2031/4/15				
		FINNISH GOV'T 1.125		1.125	200					236		29,872	2034/4/15				
		FINNISH GOV'T 1.375		1.375	300					411		51,853	2047/4/15				
		FINNISH GOV'T 1.5		1.5	1,000					1,052		132,707	2023/4/15				
		FINNISH GOV'T 1.625		1.625	1,000					1,041		131,324	2022/9/15				
		FINNISH GOV'T 2		2.0	1,000					1,092		137,696	2024/4/15				
		FINNISH GOV'T 2.625		2.625	500					796		100,409	2042/7/4				
		FINNISH GOV'T 2.75		2.75	600					753		94,959	2028/7/4				
		FINNISH GOV'T 4		4.0	1,000					1,218		153,570	2025/7/4				
(アイルランド)	国債証券	IRISH GOVT 0		—	400					405		51,077	2022/10/18				
		IRISH GOVT 0.8		0.8	700					713		89,889	2022/3/15				
		IRISH GOVT 0.9		0.9	700					771		97,238	2028/5/15				
		IRISH GOVT 1		1.0	1,000					1,086		136,989	2026/5/15				
		IRISH GOVT 1.1		1.1	1,600					1,804		227,420	2029/5/15				
		IRISH GOVT 1.35		1.35	500					585		73,746	2031/3/18				
		IRISH GOVT 1.5		1.5	400					531		67,025	2050/5/15				
		IRISH GOVT 1.7		1.7	300					383		48,372	2037/5/15				
		IRISH GOVT 2		2.0	1,000					1,427		179,975	2045/2/18				
		IRISH GOVT 2.4		2.4	600					757		95,494	2030/5/15				
		IRISH GOVT 3.4		3.4	500					566		71,434	2024/3/18				
		IRISH GOVT 3.9		3.9	500					552		69,610	2023/3/20				
		IRISH GOVT 5.4		5.4	800					1,007		126,972	2025/3/13				
	小	計		—	—					—		66,740,770	—				
(イギリス)	国債証券	UK TSY GILT 0.125		0.125	1,500	千英ポンド				1,507	千英ポンド	210,508	2026/1/30				
		UK TSY GILT 0.375		0.375	1,000					1,008		140,786	2030/10/22				
		UK TSY GILT 0.5		0.5	1,800					1,816		253,633	2022/7/22				
		UK TSY GILT 0.625		0.625	2,000					2,058		287,495	2025/6/7				
		UK TSY GILT 0.75		0.75	2,650					2,706		377,904	2023/7/22				
		UK TSY GILT 0.875		0.875	1,000					1,057		147,621	2029/10/22				
		UK TSY GILT 1		1.0	1,600					1,656		231,327	2024/4/22				
		UK TSY GILT 1.25		1.25	1,000					1,076		150,370	2027/7/22				
		UK TSY GILT 1.5		1.5	1,000					1,084		151,384	2026/7/22				
		UK TSY GILT 1.5		1.5	1,700					1,972		275,357	2047/7/22				
		UK TSY GILT 1.625		1.625	2,000					2,233		311,810	2028/10/22				
		UK TSY GILT 1.625		1.625	500					619		86,497	2054/10/22				
		UK TSY GILT 1.625		1.625	550					775		108,223	2071/10/22				
		UK TSY GILT 1.75		1.75	1,200					1,237		172,849	2022/9/7				
		UK TSY GILT 1.75		1.75	2,700					3,165		442,056	2037/9/7				

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		UK TSY GILT 1. 75	1. 75	750	924	129, 098	2049/ 1 / 22	
		UK TSY GILT 2	2. 0	1, 100	1, 205	168, 354	2025/ 9 / 7	
		UK TSY GILT 2. 25	2. 25	2, 700	2, 870	400, 759	2023/ 9 / 7	
		UK TSY GILT 2. 5	2. 5	1, 600	2, 653	370, 499	2065/ 7 / 22	
		UK TSY GILT 2. 75	2. 75	1, 300	1, 435	200, 413	2024/ 9 / 7	
		UK TSY GILT 3. 25	3. 25	1, 600	2, 424	338, 536	2044/ 1 / 22	
		UK TSY GILT 3. 5	3. 5	1, 650	2, 619	365, 741	2045/ 1 / 22	
		UK TSY GILT 3. 5	3. 5	1, 450	3, 049	425, 762	2068/ 7 / 22	
		UK TSY GILT 3. 75	3. 75	1, 600	2, 910	406, 457	2052/ 7 / 22	
		UK TSY GILT 4	4. 0	1, 500	1, 574	219, 866	2022/ 3 / 7	
		UK TSY GILT 4	4. 0	1, 700	3, 550	495, 706	2060/ 1 / 22	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 100	1, 419	198, 134	2027/ 12 / 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	900	1, 291	180, 290	2032/ 6 / 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 050	1, 613	225, 245	2036/ 3 / 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 750	2, 845	397, 385	2039/ 9 / 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 300	2, 151	300, 435	2040/ 12 / 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 500	2, 702	377, 357	2046/ 12 / 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	900	1, 697	236, 994	2049/ 12 / 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 700	3, 489	487, 180	2055/ 12 / 7	
		UK TSY GILT 4. 5	4. 5	1, 100	1, 685	235, 290	2034/ 9 / 7	
		UK TSY GILT 4. 5	4. 5	1, 350	2, 368	330, 720	2042/ 12 / 7	
		UK TSY GILT 4. 75	4. 75	1, 150	1, 656	231, 289	2030/ 12 / 7	
		UK TSY GILT 4. 75	4. 75	1, 200	2, 036	284, 404	2038/ 12 / 7	
		UK TSY GILT 5	5. 0	1, 300	1, 577	220, 307	2025/ 3 / 7	
		UK TSY GILT 6	6. 0	650	950	132, 659	2028/ 12 / 7	
	小	計	—	—	—	10, 706, 720	—	
(スウェーデン)	国債証券	SWEDISH GOVRNMNT 0. 75	0. 75	4, 000	4, 277	52, 910	2028/ 5 / 12	
		SWEDISH GOVRNMNT 0. 75	0. 75	4, 000	4, 304	53, 246	2029/ 11 / 12	
		SWEDISH GOVRNMNT 1	1. 0	6, 400	6, 885	85, 175	2026/ 11 / 12	
		SWEDISH GOVRNMNT 1. 5	1. 5	7, 000	7, 392	91, 442	2023/ 11 / 13	
		SWEDISH GOVRNMNT 2. 5	2. 5	5, 000	5, 631	69, 665	2025/ 5 / 12	
		SWEDISH GOVRNMNT 3. 5	3. 5	8, 000	8, 456	104, 608	2022/ 6 / 1	
		SWEDISH GOVRNMNT 3. 5	3. 5	4, 600	7, 204	89, 117	2039/ 3 / 30	
	小	計	—	—	—	546, 166	—	
(ノルウェー)	国債証券	NORWEGIAN GOV' T 1. 375	1. 375	2, 000	2, 091	24, 925	2030/ 8 / 19	
		NORWEGIAN GOV' T 1. 5	1. 5	3, 500	3, 665	43, 688	2026/ 2 / 19	
		NORWEGIAN GOV' T 1. 75	1. 75	3, 000	3, 160	37, 675	2025/ 3 / 13	
		NORWEGIAN GOV' T 1. 75	1. 75	2, 700	2, 907	34, 657	2029/ 9 / 6	
		NORWEGIAN GOV' T 2	2. 0	6, 000	6, 251	74, 523	2023/ 5 / 24	
		NORWEGIAN GOV' T 2	2. 0	9, 000	9, 802	116, 844	2028/ 4 / 26	
		NORWEGIAN GOV' T 3	3. 0	4, 000	4, 340	51, 735	2024/ 3 / 14	
	小	計	—	—	—	384, 049	—	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末		
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(デンマーク)	国債証券	DENMARK - BULLET 0.25	0.25	1,300	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	1,420	24,063	2052/11/15
		DENMARK - BULLET 0.5	0.5	11,100			11,884	201,328	2027/11/15
		DENMARK - BULLET 0.5	0.5	4,000			4,340	73,526	2029/11/15
		DENMARK - BULLET 1.5	1.5	5,000			5,305	89,875	2023/11/15
		DENMARK - BULLET 1.75	1.75	6,000			6,691	113,348	2025/11/15
		DENMARK - BULLET 4.5	4.5	10,500			20,029	339,304	2039/11/15
		小 計		—	—	—	—	—	841,446
(ポーランド)	国債証券	POLAND GOVT BOND	—	6,000	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	5,998	170,482	2022/ 7 /25
		POLAND GOVT BOND 2.25	2.25	3,000			3,091	87,869	2022/ 4 /25
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	1,000			1,078	30,655	2024/ 4 /25
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	3,000			3,297	93,705	2026/ 7 /25
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	3,000			3,311	94,124	2027/ 7 /25
		POLAND GOVT BOND 2.75	2.75	4,500			5,098	144,887	2029/10/25
		POLAND GOVT BOND 3.25	3.25	6,900			7,777	221,035	2025/ 7 /25
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	2,400			2,643	75,129	2022/ 9 /23
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	2,700			3,737	106,231	2029/ 4 /25
小 計		—	—	—	—	—	1,024,121	—	
(オーストラリア)	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	0.25	900	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	896	70,204	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 1.5	1.5	3,300			3,455	270,732	2031/ 6 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 2	2.0	1,000			1,018	79,791	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	1,500			1,561	122,358	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	3,000			3,338	261,563	2028/ 5 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.5	2.5	1,350			1,541	120,771	2030/ 5 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	2,500			2,720	213,141	2024/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	3,600			4,121	322,930	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	1,800			2,079	162,942	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	4,300			4,990	391,011	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	800			947	74,200	2035/ 6 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 3	3.0	1,400			1,727	135,316	2047/ 3 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	1,900			2,142	167,875	2025/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	2,100			2,513	196,915	2029/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	2,550			3,210	251,578	2039/ 6 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 3.75	3.75	1,200			1,604	125,689	2037/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 4.25	4.25	2,650			3,189	249,879	2026/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 4.5	4.5	1,400			1,941	152,107	2033/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 4.75	4.75	6,400			8,092	634,020	2027/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVT. 5.5	5.5	2,000			2,251	176,365	2023/ 4 /21
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	5.75	2,500			2,723	213,405	2022/ 7 /15		
小 計		—	—	—	—	—	4,392,805	—	
(シンガポール)	国債証券	SINGAPORE GOV' T 2.25	2.25	1,000	千シンガポールドル	千シンガポールドル	1,157	90,114	2036/ 8 / 1
		SINGAPORE GOV' T 2.625	2.625	400			452	35,208	2028/ 5 / 1

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末								
				利	率	額	面	金	額	額	償	還	年	月	日
		SINGAPORE GOV T 2.75		2.75		1,200			1,271		98,984		2023/7/1		
		SINGAPORE GOV T 2.75		2.75		400			512		39,858		2042/4/1		
		SINGAPORE GOV T 2.75		2.75		700			924		71,992		2046/3/1		
		SINGAPORE GOV T 2.875		2.875		400			472		36,806		2030/9/1		
		SINGAPORE GOV T 3		3.0		700			766		59,676		2024/9/1		
		SINGAPORE GOV T 3.125		3.125		800			837		65,224		2022/9/1		
		SINGAPORE GOV T 3.375		3.375		650			825		64,238		2033/9/1		
		SINGAPORE GOV T 3.5		3.5		1,500			1,754		136,575		2027/3/1		
	小	計		—		—			—		698,679		—		
(マレーシア)	国債証券	MALAYSIA GOVT 3.418		3.418		7,000	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	7,184		183,495		2022/8/15		
		MALAYSIA GOVT 3.502		3.502		7,900			8,393		214,363		2027/5/31		
		MALAYSIA GOVT 3.955		3.955		5,300			5,731		146,383		2025/9/15		
		MALAYSIA GOVT 4.498		4.498		5,000			5,682		145,130		2030/4/15		
		MALAYSIA GOVT 4.736		4.736		4,500			5,116		130,666		2046/3/15		
	小	計		—		—			—		820,039		—		
(イスラエル)	国債証券	ISRAEL FIXED 0.75		0.75		6,200	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル	6,259		199,175		2022/7/31		
		ISRAEL FIXED 1.5		1.5		2,900			3,005		95,626		2023/11/30		
		ISRAEL FIXED 2.25		2.25		1,500			1,675		53,310		2028/9/28		
		ISRAEL FIXED 3.75		3.75		3,700			5,044		160,505		2047/3/31		
		ISRAEL FIXED 6.25		6.25		3,500			4,665		148,465		2026/10/30		
	小	計		—		—			—		657,084		—		
	合	計		—		—			—		160,087,159		—		

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2020年12月17日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	160,087,159	98.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,304,343	2.0
	163,391,502	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※期末における外貨建資産（162,833,597千円）の投資信託財産総額（163,391,502千円）に対する比率は99.7%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=103.44円、1カナダドル=81.14円、1メキシコペソ=5.21円、1ユーロ=126.06円、1英ポンド=139.63円、1スウェーデンクローナ=12.37円、1ノルウェークローネ=11.92円、1デンマーククローネ=16.94円、1ポーランドズロチ=28.42円、1オーストラリアドル=78.35円、1シンガポールドル=77.84円、1マレーシアリンギット=25.54円、1イスラエルシェケル=31.82円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	164,890,831,324円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	826,983,271
公 社 債(評価額)	160,087,159,769
未 収 入 金	2,994,182,294
未 収 利 息	968,033,713
前 払 費 用	14,472,277
(B) 負 債	3,200,974,995
未 払 金	1,500,123,866
未 払 解 約 金	1,700,849,039
未 払 利 息	1,355
そ の 他 未 払 費 用	735
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	161,689,856,329
元 本	84,615,543,547
次 期 繰 越 損 益 金	77,074,312,782
(D) 受 益 権 総 口 数	84,615,543,547口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	19,109円

※当期における期首元本額94,197,787,250円、期中追加設定元本額11,551,425,788円、期中一部解約元本額21,133,669,491円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2019年12月18日 至2020年12月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,438,949,861円
受 取 利 息	3,439,491,274
そ の 他 収 益 金	10,905
支 払 利 息	△ 552,318
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,044,298,920
売 買 益	10,325,791,900
売 買 損	△ 6,281,492,980
(C) 信 託 報 酬 等	△ 62,095,645
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	7,421,153,136
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	77,694,842,875
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,050,970,303
(G) 解 約 差 損 益 金	△18,092,653,532
(H) 計 (D + E + F + G)	77,074,312,782
次 期 繰 越 損 益 金(H)	77,074,312,782

※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。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	23,035,739,593円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	34,927,566円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	687,913,532円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	95,799,532円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,907,870,886円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	364,139円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	965,102,548円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	709,890,350円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	139,031,137円	SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	120,185,798円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,181,893円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,129,253,665円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	30,332,931円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,453,491,138円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	97,121,134円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,690,913,511円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	160,110,998円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,368,971,214円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	101,490,751円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	734,643円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	185,719,883円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,851,000,802円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,968,025円	三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	358,285,851円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	28,443,819円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	156,538,305円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	37,277,320円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	92,185,533円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	33,762,121円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,742,152円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	10,669,316円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	12,770,670円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	59,577,040円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	111,149,382円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	36,427,917円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	454,669,380円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	86,705,063円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	126,544,227円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	26,365,618円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	41,682,415円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	17,204,362円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,588,209円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	67,013,290円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,130,964,529円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	87,821,681円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	597,174円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	5,295,145円	SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	1,046,909,175円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	15,009,222円	SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	1,125,954,317円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	9,114,469円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,627,594,689円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,469,262円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	500,283,384円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,017,936,053円	SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド<適格機関投資家限定>	38,447,253円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	57,240,371円	SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	49,486,543円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	8,701,123,426円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	156,964,760円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,915,662,739円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	148,871,868円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	11,232,661,455円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	149,418,373円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

SMAM・ マネーインカム ファンド

〈適格機関投資家限定〉

【運用報告書(全体版)】

(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

第 **12** 期
決算日 2020年4月13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／資産複合
信託期間	無期限（設定日：2008年3月31日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 マネーインカム・マザーファンド 円貨建の短期公社債および短期金融商品
当ファンドの運用方法	マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。 ■主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ■外貨建資産への投資は行いません。 マネーインカム・マザーファンド ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	年1回（毎年4月13日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、以下の方針に基づき収益分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

 **三井住友DSアセットマネジメント**
〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1
<https://www.smd-am.co.jp>

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比	純資産額
	(分配落)	税込 分配金	期騰 落率	期騰 落率	期騰 落率		
8期(2016年4月13日)	円 10,089	円 0	% △0.0	101.01	% 0.1	% 64.1	百万円 437
9期(2017年4月13日)	10,080	0	△0.1	100.97	△0.0	76.0	494
10期(2018年4月13日)	10,073	0	△0.1	100.92	△0.0	75.0	599
11期(2019年4月15日)	10,066	0	△0.1	100.85	△0.1	72.5	707
12期(2020年4月13日)	10,058	0	△0.1	100.80	△0.0	70.2	789

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※無担保コール翌日物は、設定時を100として日々の無担保コール翌日物で運用したと仮定した当社計算値です。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2019年4月15日	円 10,066	% -	100.85	% -	% 72.5
4月末	10,066	0.0	100.85	△0.0	70.0
5月末	10,065	△0.0	100.85	△0.0	71.9
6月末	10,065	△0.0	100.84	△0.0	70.2
7月末	10,064	△0.0	100.83	△0.0	73.0
8月末	10,063	△0.0	100.83	△0.0	70.8
9月末	10,063	△0.0	100.83	△0.0	65.3
10月末	10,063	△0.0	100.82	△0.0	69.7
11月末	10,062	△0.0	100.82	△0.0	68.8
12月末	10,062	△0.0	100.82	△0.0	70.5
2020年1月末	10,061	△0.0	100.81	△0.0	71.7
2月末	10,060	△0.1	100.81	△0.0	73.7
3月末	10,057	△0.1	100.81	△0.0	71.8
(期末) 2020年4月13日	10,058	△0.1	100.80	△0.0	70.2

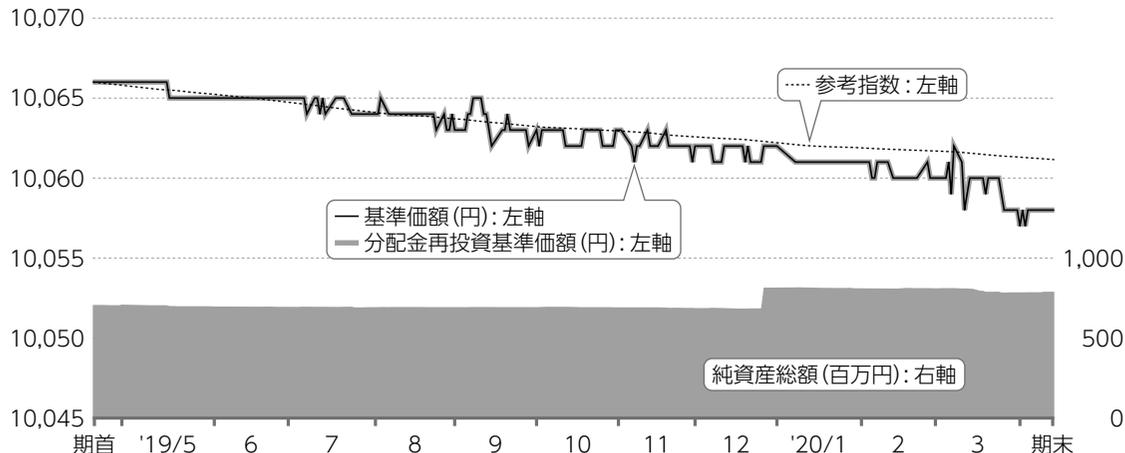
※騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額および参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	10,066円
期末	10,058円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	-0.1% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの参考指数は、無担保コール翌日物です。

※無担保コール翌日物は、設定時を100として日々の無担保コール翌日物で運用したと仮定した当社計算値です。

基準価額の主な変動要因(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

下落要因

- 日銀によるマイナス金利政策が継続され、主要投資対象である短期公社債や短期金融商品におけるマイナス利回りが続いたこと

組入れファンドの状況

組入れファンド	投資資産	騰落率	期末組入比率
マネーインカム・マザーファンド	短期金融資産	-0.1%	100.0%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

当期の短期金利は小幅に上昇しました。

物価上昇率の伸びが徐々に鈍化したことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。短期国債利回りは、一時的な需給要因から上下に振れる局面もありましたが、日銀が需給動向を勘案しながら短期国債の買い入れ額を調整したことから、概ねレンジ推移となりました。

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、日銀当座預金付利金利である-0.10%程度を上限に、マイナス圏で推移しました。国庫短期証券3ヵ月物利回りは期首-0.190%に対し、期末は-0.152%と小幅に上昇しました。

ポートフォリオについて(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

当ファンド

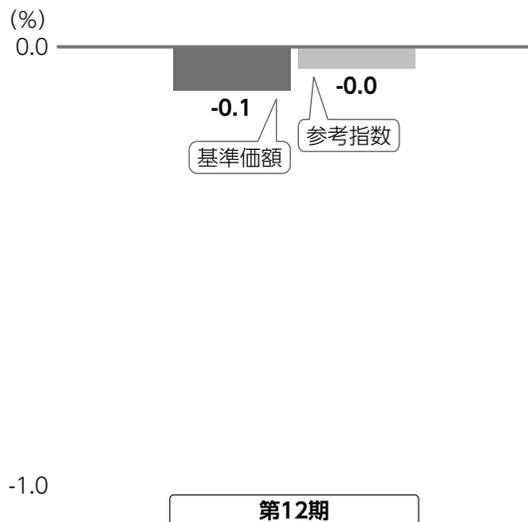
期を通じて「マネーインカム・マザーファンド」を高位に組み入れました。

マネーインカム・マザーファンド

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、残存0年から1年3ヵ月までの円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを継続しました。また、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮しながら、短期公社債の組入れを行いました。

ベンチマークとの差異について(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

基準価額と参考指数の対比(騰落率)



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数として無担保コール翌日物を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

分配金について(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第12期
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	1,281

当期の分配は、基準価額水準等を勘案し、見送りとしたしました。なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「対基準価額比率」は、「当期分配金」(税引前)の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、「マネーインカム・マザーファンド」を高位に組み入れて運用を行います。

マネーインカム・マザーファンド

2%の物価安定目標が展望出来ない中、日銀によるマイナス金利政策が継続され、短期国債利回りやコールローン翌日物金利など、主要投資対象である短期公社債および短期金融商品の利回りは引き続きマイナス圏での推移を想定します。

残存0年から1年3ヵ月までの公社債や短期金融商品で利回りのマイナス幅が小さい投資対象を選定し、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮して運用を行います。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

運用担当者に係る事項について(2020年4月1日現在)

運用担当部署の概要

グローバル戦略運用第一部、ファンドマネージャー数：30名、平均運用経験年数：15年(兼務者含む)

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

■ 1万口当たりの費用明細 (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	1円 (1)	0.011% (0.011)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	1	0.011	

期中の平均基準価額は10,062円です。

※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、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
マネーインカム・マザーファンド	千口 159,693	千円 161,230	千口 77,329	千円 78,079

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等 (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

利害関係人との取引状況

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

当期中における利害関係人との取引等はありません。

マネーインカム・マザーファンド

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B A		うち利害関係人 との取引状況D	D C	
公 社 債	百万円 1,863	百万円 100	% 5.4	百万円 -	百万円 -	% -

※平均保有割合 28.4%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託およ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、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2020年4月13日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首 (前期末)		期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
マネーインカム・マザーファンド	千口 699,943	千口 782,308	千円 789,583	千円 789,583

※マネーインカム・マザーファンドの期末の受益権総口数は2,617,198千口です。

※単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2020年4月13日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
マネーインカム・マザーファンド	千円 789,583	% 100.0
コール・ローン等、その他	1	0.0
投資信託財産総額	789,584	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年4月13日現在)

項目	期 末
(A) 資 産	789,584,831円
コール・ローン等	968
マネーインカム・マザーファンド(評価額)	789,583,863
(B) 純 資 産 総 額(A)	789,584,831
元 本	785,000,484
次期繰越損益金	4,584,347
(C) 受 益 権 総 口 数	785,000,484口
1万口当たり基準価額(B/C)	10,058円

※当期における期首元本額702,357,104円、期中追加設定元本額161,024,470円、期中一部解約元本額78,381,090円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	当	期

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

■ 損益の状況

(自2019年4月16日 至2020年4月13日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 2円
支 払 利 息	△ 2
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 549,777
売 買 損 益	4,331
売 買 損 益	△ 554,108
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△ 549,779
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 409,952
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,544,078
(配 当 等 相 当 額)	(66,090,287)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△60,546,209)
(F) 計 (C+D+E)	4,584,347
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	4,584,347
追 加 信 託 差 損 益 金	5,544,078
(配 当 等 相 当 額)	(66,114,405)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△60,570,327)
分 配 準 備 積 立 金	34,457,216
繰 越 損 益 金	△35,416,947

※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。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※期末における、費用控除後の配当等収益(5,462,919円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(66,114,405円)および分配準備積立金(28,994,297円)より分配可能額は100,571,621円(1万口当たり1,281円)ですが、分配は行っていません。

マネーインカム・マザーファンド

第12期（2019年4月16日から2020年4月13日まで）

信託期間	無期限（設定日：2008年3月31日）
運用方針	主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比	純総資産額
	期騰落率	中率	期騰落率	中率		
8期（2016年4月13日）	円 10,124	% 0.0	101.01	% 0.1	% 64.1	百万円 1,306
9期（2017年4月13日）	10,115	△0.1	100.97	△0.0	76.0	1,323
10期（2018年4月13日）	10,108	△0.1	100.92	△0.0	75.0	2,421
11期（2019年4月15日）	10,101	△0.1	100.85	△0.1	72.5	2,495
12期（2020年4月13日）	10,093	△0.1	100.80	△0.0	70.2	2,641

※無担保コール翌日物は、設定時を100として日々の無担保コール翌日物で運用したと仮定した当社計算値です。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

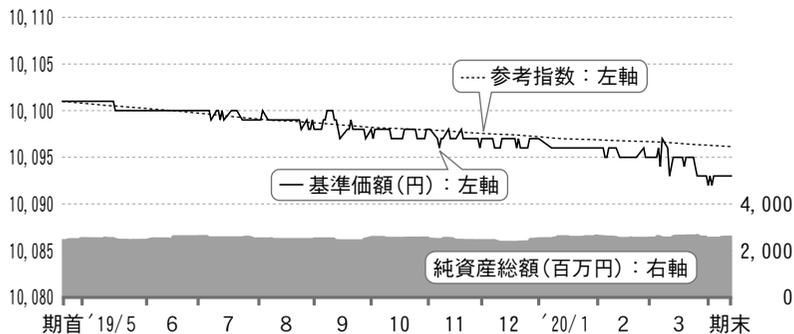
年月日	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2019年4月15日	円 10,101	% -	100.85	% -	% 72.5
4月末	10,101	0.0	100.85	△0.0	70.1
5月末	10,100	△0.0	100.85	△0.0	71.9
6月末	10,100	△0.0	100.84	△0.0	70.2
7月末	10,099	△0.0	100.83	△0.0	73.0
8月末	10,098	△0.0	100.83	△0.0	70.8
9月末	10,098	△0.0	100.83	△0.0	65.3
10月末	10,098	△0.0	100.82	△0.0	69.7
11月末	10,097	△0.0	100.82	△0.0	68.8
12月末	10,097	△0.0	100.82	△0.0	70.5
2020年1月末	10,096	△0.0	100.81	△0.0	71.7
2月末	10,095	△0.1	100.81	△0.0	73.7
3月末	10,092	△0.1	100.81	△0.0	71.8
(期末) 2020年4月13日	10,093	△0.1	100.80	△0.0	70.2

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2019年4月16日から2020年4月13日まで）

基準価額等の推移



期首	10,101円
期末	10,093円
騰落率	-0.1%

※参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドの参考指数は、無担保コール翌日物です。

※無担保コール翌日物は、設定時を100として日々の無担保コール翌日物で運用したと仮定した当社計算値です。

▶ 基準価額の主な変動要因（2019年4月16日から2020年4月13日まで）

当ファンドは、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

下落要因

- ・日銀によるマイナス金利政策が継続され、主要投資対象である短期公社債や短期金融商品におけるマイナス利回りが続いたこと

▶ 投資環境について (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

当期の短期金利は小幅に上昇しました。

物価上昇率の伸びが徐々に鈍化したことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。短期国債利回りは、一時的な需給要因から上下に振れる局面もありましたが、日銀が需給動向を勘案しながら短期国債の買入れ額を調整したことから、概ねレンジ推移となりました。

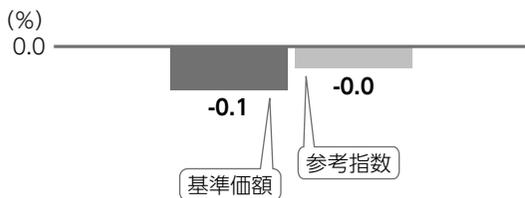
国庫短期証券3ヵ月物利回りは、日銀当座預金付利金利である-0.10%程度を上限に、マイナス圏で推移しました。国庫短期証券3ヵ月物利回りは期首-0.190%に対し、期末は-0.152%と小幅に上昇しました。

▶ ポートフォリオについて (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、残存0年から1年3ヵ月までの円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを継続しました。また、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮しながら、短期公社債の組入れを行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

基準価額と参考指数の対比 (騰落率)



当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数として無担保コール翌日物を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

2 今後の運用方針

2%の物価安定目標が展望出来ない中、日銀によるマイナス金利政策が継続され、短期国債利回りやコールローン翌日物金利など、主要投資対象である短期公社債および短期金融商品の利回りは引き続きマイナス圏での推移を想定します。

残存0年から1年3ヵ月までの公社債や短期金融商品で利回りのマイナス幅が小さい投資対象を選定し、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮して運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細 (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用 (その他)	1円 (1)	0.011% (0.011)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	1	0.011	

期中の平均基準価額は10,097円です。

※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、簡便法により算出しています。
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

公社債

国内	特 殊 債 券	買 付 額	売 付 額
		千円	千円
		1,863,211	(1,796,600)

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

利害関係人との取引状況

区分	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
公社債	百万円 1,863	百万円 100	% 5.4	百万円 -	百万円 -	% -

利害関係人とは、投資信託およ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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2020年4月13日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区分	期			末			
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
特殊債券(除く金融債)	1,844,000 (1,844,000)	1,854,685 (1,854,685)	70.2 (70.2)	— (—)	— (—)	— (—)	70.2 (70.2)
合計	1,844,000 (1,844,000)	1,854,685 (1,854,685)	70.2 (70.2)	— (—)	— (—)	— (—)	70.2 (70.2)

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

B 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債

種類	銘柄	期		末	
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
特殊債券(除く金融債)	第14回 政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.199	200,000	200,082	2020/6/18
	第17回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	100,486	2020/10/21
	第57回 政府保証関西国際空港債券	1.2	100,000	100,825	2020/12/14
	第25回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.147	100,000	100,109	2020/11/25
	第2回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	101,292	2020/12/27
	第9回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	203,670	2021/3/26
	第104回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	200,000	200,132	2020/4/30
	第112回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	300,000	301,011	2020/7/31
	第115回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	244,000	244,961	2020/8/31
	第126回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	100,980	2021/1/29
	第129回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	101,075	2021/2/26
	第208回 政府保証預金保険機構債	0.1	100,000	100,062	2020/10/6
	合計		—	1,844,000	1,854,685

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 投資信託財産の構成

(2020年4月13日現在)

項目	期		末	
	評価額	比率	評価額	比率
			千円	%
公社債	1,854,685	70.2		
コール・ローン等、その他	787,280	29.8		
投資信託財産総額	2,641,965	100.0		

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年4月13日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	2,641,965,861円
コーポレート債(評価額)	780,346,222
未収利息	1,854,685,360
前払費用	5,508,528
(B) 負 債	550,816
未払解約金	1,425,751
未払利息	470,000
その他未払費用	867
(C) 純資産総額(A-B)	79,949
元 本	2,641,415,045
次期繰越損益金	2,617,198,028
(D) 受益権総口数	24,217,017
1万円当たり基準価額(C/D)	2,617,198,028口
	10,093円

※当期における期首元本額2,470,784,621円、期中追加設定元本額1,387,344,474円、期中一部解約元本額1,240,931,067円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	13,868,252円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	94,104,342円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	75,050,091円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	17,362,669円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	22,920,681円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	12,836,318円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	27,309,935円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	782,308,395円
SMAM・バランス先物ファンドVA20<適格機関投資家限定>	468,868,961円
SMAM・FGマネーファンドVA<適格機関投資家限定>	1,102,171,872円

※上記表中の受益権総口数および1万円当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2019年4月16日 至2020年4月13日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	19,459,743円
受 取 利 息	19,914,514
支 払 利 息	△ 454,771
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△21,333,850
売 買 損 益	△21,333,850
(C) 信 託 報 酬 等	△ 274,866
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 2,148,973
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	24,947,481
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	13,468,754
(G) 解 約 差 損 益 金	△12,050,245
(H) 計 (D+E+F+G)	24,217,017
次 期 繰 越 損 益 金(H)	24,217,017

※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。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。