

■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	各ペーパ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)】

(2020年12月22日から2021年12月20日まで)

第 **21** 期

決算日 2021年12月20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)

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

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■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	%		
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
21期(2021年12月20日)	13,097	0	1.8	99.3	409

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	%		
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
21期(2021年12月20日)	15,615	0	1.8	99.6	1,085

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	%		
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
21期(2021年12月20日)	18,320	0	5.5	98.1	2,026

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	%		
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
21期(2021年12月20日)	20,811	0	9.1	98.3	3,273

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当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はありません。

■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	%	%
2020年12月21日	12,864	—	99.6
12月末	12,874	0.1	99.4
2021年1月末	12,882	0.1	99.5
2月末	12,884	0.2	99.6
3月末	12,990	1.0	99.6
4月末	12,994	1.0	99.5
5月末	13,021	1.2	99.7
6月末	13,036	1.3	99.5
7月末	13,058	1.5	99.5
8月末	13,074	1.6	99.6
9月末	13,069	1.6	98.8
10月末	13,108	1.9	99.1
11月末	13,082	1.7	99.4
(期 末)			
2021年12月20日	13,097	1.8	99.3

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	%	%
2020年12月21日	15,337	—	97.8
12月末	15,349	0.1	99.7
2021年1月末	15,359	0.1	99.8
2月末	15,363	0.2	99.8
3月末	15,489	1.0	99.8
4月末	15,494	1.0	99.8
5月末	15,526	1.2	100.0
6月末	15,545	1.4	99.7
7月末	15,570	1.5	99.8
8月末	15,590	1.6	99.8
9月末	15,582	1.6	99.5
10月末	15,629	1.9	99.8
11月末	15,597	1.7	99.9
(期 末)			
2021年12月20日	15,615	1.8	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)2030

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首)	円	%	%
2020年12月21日	17,371	—	99.7
12月末	17,426	0.3	99.7
2021年1月末	17,474	0.6	99.7
2月末	17,568	1.1	99.8
3月末	17,918	3.1	99.8
4月末	17,897	3.0	99.6
5月末	18,012	3.7	100.1
6月末	18,067	4.0	99.7
7月末	18,114	4.3	99.7
8月末	18,187	4.7	99.7
9月末	18,244	5.0	99.3
10月末	18,364	5.7	99.8
11月末	18,251	5.1	99.9
(期 末)			
2021年12月20日	18,320	5.5	98.1

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	%	%
2020年12月21日	19,072	—	99.8
12月末	19,186	0.6	99.8
2021年1月末	19,297	1.2	99.7
2月末	19,602	2.8	99.9
3月末	20,135	5.6	99.7
4月末	20,067	5.2	99.5
5月末	20,269	6.3	99.9
6月末	20,363	6.8	99.8
7月末	20,381	6.9	99.7
8月末	20,529	7.6	99.8
9月末	20,738	8.7	99.7
10月末	20,906	9.6	99.9
11月末	20,702	8.5	100.0
(期 末)			
2021年12月20日	20,811	9.1	98.3

※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(2020年12月22日から2021年12月20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	12,864円
期末	13,097円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+1.8% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

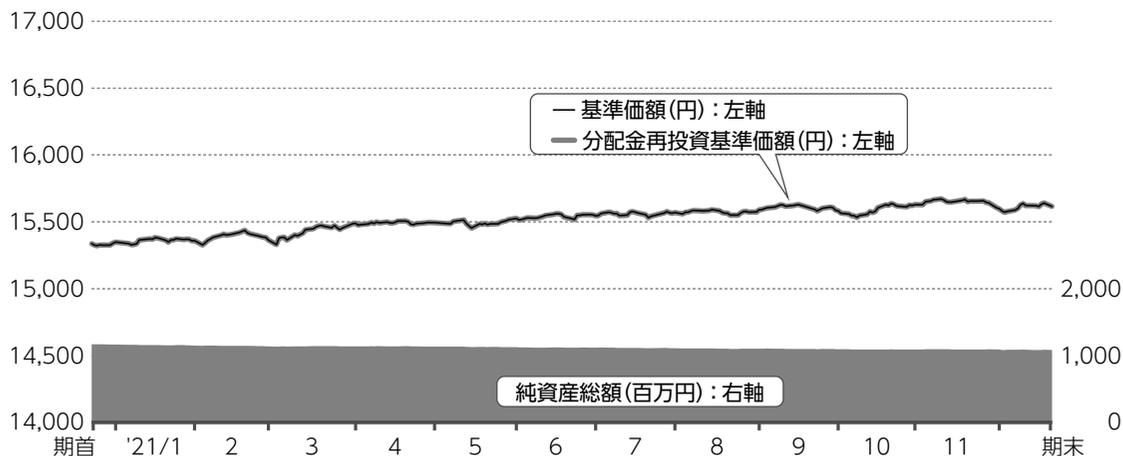
分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※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)

※当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はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

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	15,337円
期末	15,615円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+1.8% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

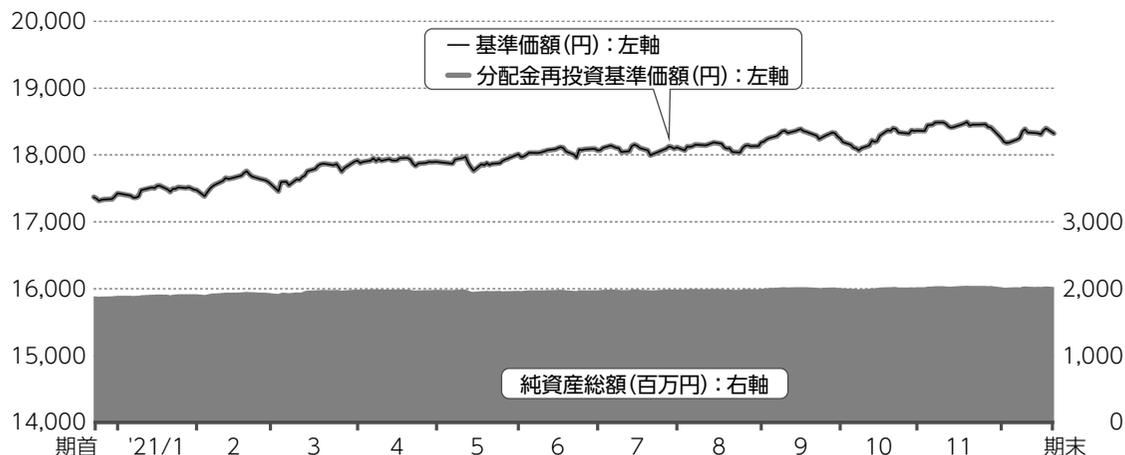
分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※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)

※当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はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

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	17,371円
期末	18,320円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+5.5% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

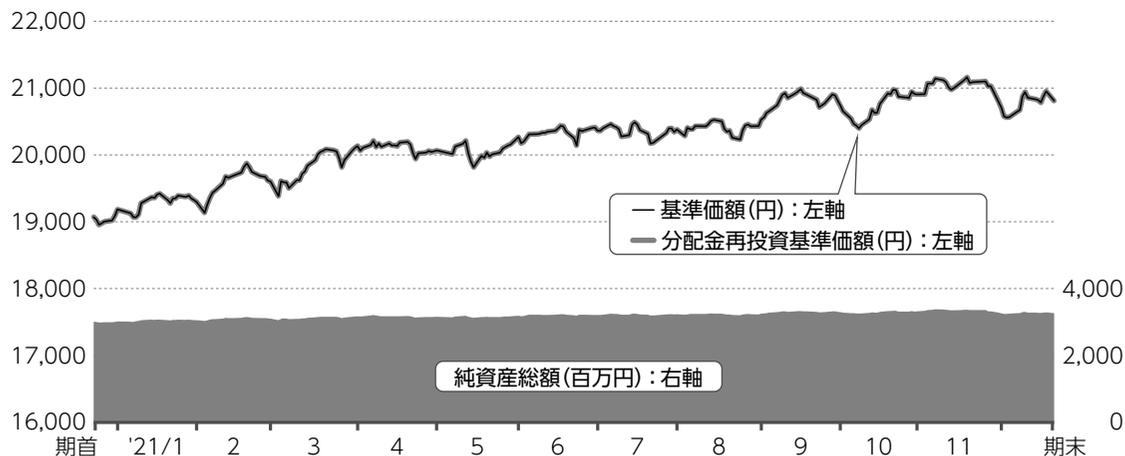
分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※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はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

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	19,072円
期末	20,811円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+9.1% (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はありません。

基準価額の主な変動要因(2020年12月22日から2021年12月20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

- 国内外の株式市場が上昇したこと
- 円に対して米ドルが上昇したこと

※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%	4.8%
SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	35%	35.0%
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%	4.7%
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%	4.8%
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	50%	50.0%

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	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%	35.0%
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%	5.0%
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%	49.8%

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

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	17%	16.1%
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	57%	57.0%
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	11%	10.0%
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	13%	13.1%
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	2%	1.8%

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	31%	30.2%
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	39%	39.2%
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%	16.0%
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	11%	11.0%
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%	2.0%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について(2020年12月22日から2021年12月20日まで)

期を通してみると、内外の株式市場は上昇しました。債券市場では内外の10年国債利回りは上昇(価格は下落)しました。為替は米ドル・ユーロともに円に対して上昇しました。

国内株式市場

国内株式は上昇しました。

期初から2021年5月中旬にかけては、日本銀行の金融緩和スタンスが維持される中、米国を中心とした株価上昇等に連れる形で上昇しました。その後は、8月後半までは上値は重くもみ合いで推移しましたが、9月に入ると、自民党総裁選への期待感を背景に大きく上昇しました。その後、期末にかけては米国でのインフレ懸念や中国不動産大手のデフォルト(債務不履行)懸念、また変異ウイルスの検出がマイナス材料となり下落基調となりました。

国内債券市場

日本の10年債利回りは小幅上昇しました。

期初から2月にかけては、海外債券利回りの上昇や株価の上昇等を背景に、債券利回りは上昇しました。その後、8月にかけては日銀の金融緩和政策の継続や米国債利回りの低下等を背景に金利は低下しました。その後はFOMC(米連邦公開市場委員会)で政策金利見通しが引き上げられたことによる米国金利の上昇やインフレ長期化懸念の強まり等を背

景に、海外金利の上昇に連れて、国内金利も上昇しました。期末にかけては、オミクロン型が検出され感染拡大懸念が高まったことから、金利は再び低下しました。

外国株式市場

先進国外国株式は、期を通して大幅上昇しました。

米国市場は、期初から8月下旬にかけて、世界の主要国・中央銀行の景気支援的な政策対応の継続や新型コロナウイルスワクチンの接種進展に伴う経済回復に対する期待等を背景に、堅調に推移しました。その後は、軟調な雇用統計やFOMCで年内のテーパリング(量的緩和の段階的縮小)開始が示唆されたことを背景に下落しました。10月から期末にかけては、企業業績が概ね予想を上回る決算となったことで業績拡大が続いていることを好感し、大きく上昇しました。

欧州市場も米国市場に連れる形で推移しました。ECB(欧州中央銀行)が金融緩和政策を当面維持するとの見方等が安心材料となり、大きく上昇しました。しかし、期末は欧州を中心とした感染再拡大を受けて、下落しました。

外国債券市場

期初から3月にかけては、経済活動の再開や堅調な企業業績などを背景に株価が堅調に推移したことなどから、米国債券利回りは上昇しました。7月にかけては、感染再拡大によるインフレ期待の低下などを背景に債券利回りは低下しました。その後はFOMCにて政策金利予想が引き上げられたことやテーパリングの開始が示唆されたことを受け、債券利回りは上昇しました。期末にかけては、オミクロン型の感染拡大懸念から、債券利回りは下落しました。期を通して見れば、米国10年債利回りは上昇しました。

欧州では、期初から5月中旬にかけて、米債利回りの上昇や欧州景気の改善期待等から、債券利回りが大きく上昇しました。その後は感染再拡大や米国金利の低下を受けて低下するなど、後半は米国債に連れる動きで推移しました。期を通して見れば、ドイツ10年債利回りは上昇しました。

為替市場

米金利の上昇などを背景に、米ドルが円に対して底堅く推移しました。4月以降は、米国債利回りの低下等を背景に、米ドルがやや上値の重い展開となりました。しかし、9月以降は、米国の利上げに対する織り込みが加速したことや株価の上昇などリスク選好度の改善を背景に上昇しました。期を通して見れば、米ドル高・円安となりました。

ユーロは、期初から5月下旬にかけて、米金利の上昇やユーロ圏の景気回復期待などを背景に、対円でじり高の展開となりました。その後は、感染再拡大を受けてリスク回避的な動きが強まると、9月にかけてユーロは下落しました。その後は利上げの織り込みが進んだことでユーロは上昇しましたが、期末にかけては感染再拡大を受けて下落しました。期を通して見れば、ユーロ高・円安となりました。

ポートフォリオについて(2020年12月22日から2021年12月20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	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(2020年12月22日から2021年12月20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(2020年12月22日から2021年12月20日まで)

期間の分配は、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	0	0	0	0
(対基準価額比率)	(0.00%)	(0.00%)	(0.00%)	(0.00%)
当期の収益	-	-	-	-
当期の収益以外	-	-	-	-
翌期繰越分配対象額	3,096	6,396	10,005	12,789

※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。

2021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	16%	57%	10%	14%	3%
2040	30%	41%	16%	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(2020年12月22日から2021年12月20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	57円	0.439%	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) 期中の平均基準価額は13,015円です。
(投 信 会 社)	(9)	(0.066)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(販 売 会 社)	(43)	(0.329)	販売会社：交付運用報告書等各种資料の送付、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) 売買委託手数料	-	-	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
(株 式)	(-)	(-)	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
(先物・オプション)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) 有価証券取引税	-	-	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
(株 式)	(-)	(-)	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
(公 社 債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) 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
(保 管 費 用)	(-)	(-)	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金・資産の移転等に要する費用
(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	58	0.442	

※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。

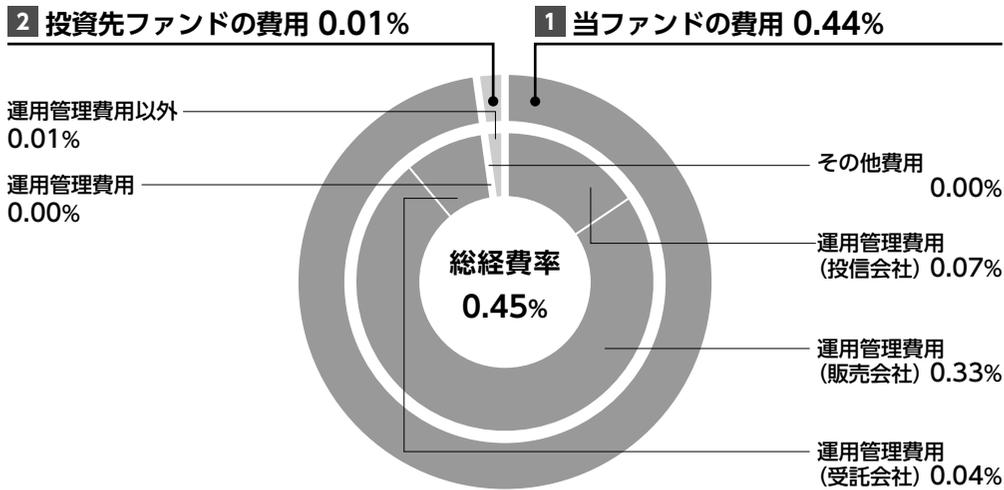
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



総経費率(1+2)	0.45%
1 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	0.00%
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、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0.45%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	68円	0.439%	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) [期中の平均基準価額は15,519円です。]
(投 信 会 社)	(10)	(0.066)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(販 売 会 社)	(51)	(0.329)	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)	(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) 売買委託手数料	－	－	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
(株 式)	(－)	(－)	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
(先物・オプション)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	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
(株 式)	(－)	(－)	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
(公 社 債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) 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
(保 管 費 用)	(－)	(－)	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)	(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	69	0.442	

※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。

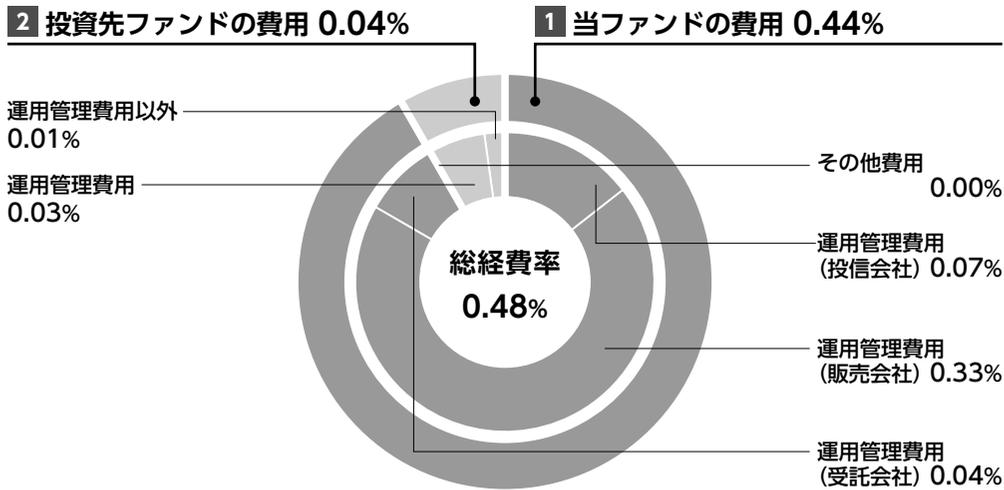
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



総経費率(1+2)	0.48%
1 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%
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、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)2030

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	97円	0.537%	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) [期中の平均基準価額は17,995円です。]
(投 信 会 社)	(30)	(0.164)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(販 売 会 社)	(59)	(0.329)	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) 売買委託手数料	－	－	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
(株 式)	(－)	(－)	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
(先物・オプション)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	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
(株 式)	(－)	(－)	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
(公 社 債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) 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
(保 管 費 用)	(－)	(－)	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)	(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	0.541	

※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。

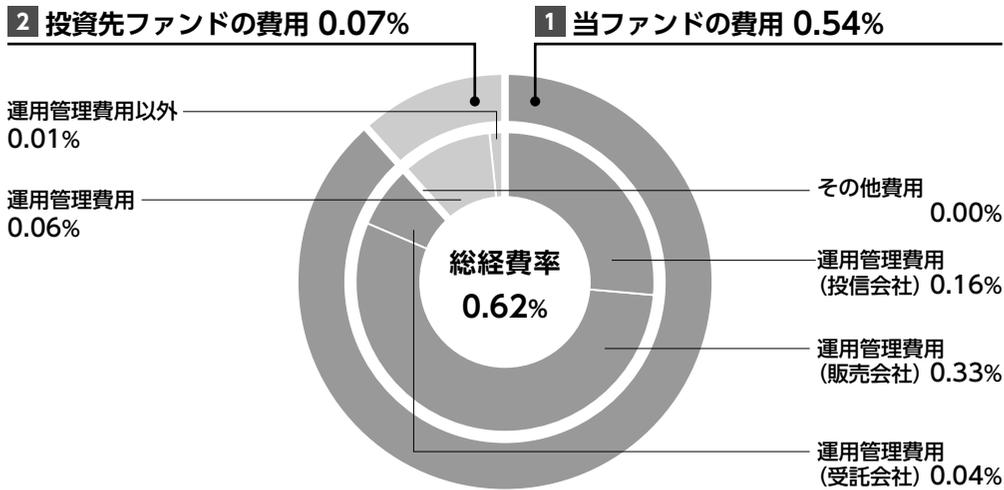
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



総経費率(1+2)	0.62%
1 当ファンドの費用の比率	0.54%
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	0.01%

※ **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、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0.62%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	109円	0.537%	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) [期中の平均基準価額は20,241円です。]
(投 信 会 社)	(33)	(0.165)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(販 売 会 社)	(67)	(0.329)	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)	(9)	(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) 売買委託手数料	－	－	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
(株 式)	(－)	(－)	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
(先物・オプション)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	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
(株 式)	(－)	(－)	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
(公 社 債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) 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
(保 管 費 用)	(－)	(－)	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)	(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	109	0.541	

※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。

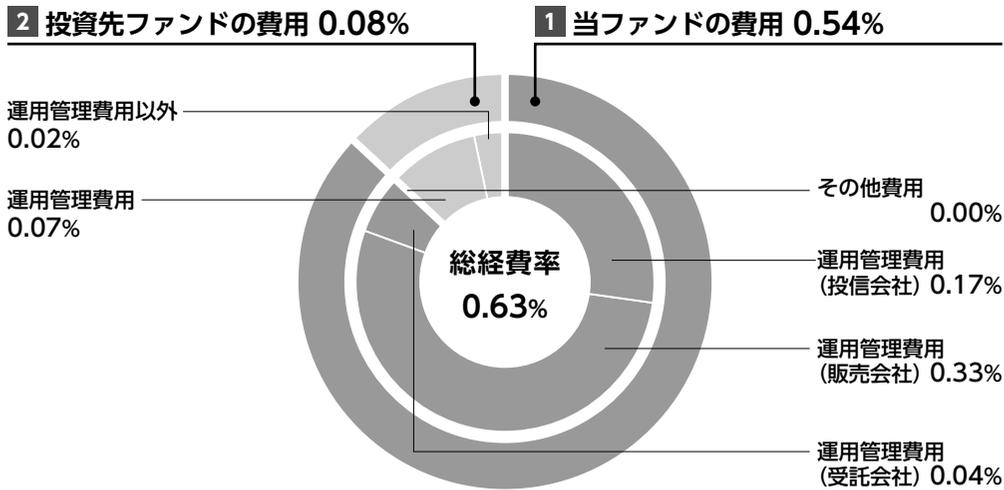
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



総経費率(1+2)	0.63%
1 当ファンドの費用の比率	0.54%
投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.07%
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、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0.63%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2020年12月22日から2021年12月20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)	1,630,813	3,410	3,715,176	7,910
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	163,366	660	2,177,320	8,760
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	679,625	1,320	1,950,564	3,780
	SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,880,547	6,370	10,969,971	14,330
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	646,768	650	11,704,676	11,760

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)	3,113,251	6,560	9,611,675	20,110
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	221,792	880	6,228,108	24,340
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	979,265	1,880	5,064,578	9,700
	SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	9,600,661	12,530	102,397,682	133,900
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	116,096,964	116,700	38,516,005	38,696

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)	19,013,838	39,890	36,773,861	78,560
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,361,684	5,510	18,705,702	76,530
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	10,594,294	20,220	2,352,606	4,530
	SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	94,744,000	123,640	31,169,881	40,700
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	1,960,089	1,970	79,642	80

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)	65,909,373	138,960	99,572,656	213,940
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	7,335,102	30,370	43,070,020	177,430
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	23,099,194	44,330	11,588,554	22,410
	SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	178,562,031	233,060	92,131,361	120,200
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	9,752,962	9,800	2,887,088	2,900

※金額は受渡し代金。

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等(2020年12月22日から2021年12月20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
(2020年12月22日から2021年12月20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(2021年12月20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)	11,218,367	9,134,004	19,797	4.8
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	6,322,772	4,308,818	19,247	4.7
SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	11,228,322	9,957,383	19,549	4.8
SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	115,498,349	109,408,925	143,172	35.0
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	214,781,259	203,723,351	204,640	50.0
合 計	359,049,069	336,532,481	406,406	99.3

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
	□	□	千円	%
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	31,333,874	24,835,450	53,828	5.0
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	17,821,230	11,814,914	52,777	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>	31,715,022	27,629,709	54,245	5.0
SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	383,427,785	290,630,764	380,319	35.0
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	460,364,180	537,945,139	540,365	49.8
合 計	924,662,091	892,855,976	1,081,536	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)2030

ファンド名	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	□	□	千円	%
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	168,713,152	150,953,129	327,175	16.1
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	62,749,664	45,405,646	202,827	10.0
SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	126,666,834	134,908,522	264,865	13.1
SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	819,602,193	883,176,312	1,155,724	57.0
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	34,781,999	36,662,446	36,827	1.8
合 計	1,212,513,842	1,251,106,055	1,987,420	98.1

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
	□	□	千円	%
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	489,428,539	455,765,256	987,825	30.2
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	152,676,966	116,942,048	522,380	16.0
SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	172,204,817	183,715,457	360,688	11.0
SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	893,549,705	979,980,375	1,282,402	39.2
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	57,204,166	64,070,040	64,358	2.0
合 計	1,765,064,193	1,800,473,176	3,217,654	98.3

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

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

(2021年12月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	406,406	99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,926	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	410,333	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	410,333,403円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,926,918
投資信託受益証券(評価額)	406,406,485
(B) 負 債	925,300
未 払 信 託 報 酬	918,482
そ の 他 未 払 費 用	6,818
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	409,408,103
元 本	312,608,012
次 期 繰 越 損 益 金	96,800,091
(D) 受 益 権 総 口 数	312,608,012口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	13,097円

※当期における期首元本額336,350,129円、期中追加設定元本額10,780,827円、期中一部解約元本額34,522,944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
	0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2020年12月22日 至2021年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,956円
受 取 利 息	58
支 払 利 息	△ 2,014
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,010,020
売 買 益	9,668,372
売 買 損	△ 658,352
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,869,573
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	7,138,491
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	32,668,279
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	56,993,321
(配 当 等 相 当 額)	(53,701,594)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,291,727)
(G) 合 計 (D + E + F)	96,800,091
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	96,800,091
追 加 信 託 差 損 益 金	56,993,321
(配 当 等 相 当 額)	(53,701,594)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,291,727)
分 配 準 備 積 立 金	39,808,726
繰 越 損 益 金	△ 1,956

※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。
 ※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。
 ※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。
 ※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	-円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	7,139,094
(c) 収益調整金	56,993,321
(d) 分配準備積立金	32,669,632
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	96,802,047
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	3,096.60
(f) 分配金	-
1 万 口 当 た り 分 配 金	-

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

(2021年12月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 1,081,536	% 99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,533	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	1,088,069	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,088,069,524円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,533,234
投資信託受益証券(評価額)	1,081,536,290
(B) 負 債	2,587,341
未 払 解 約 金	153,690
未 払 信 託 報 酬	2,415,595
そ の 他 未 払 費 用	18,056
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,085,482,183
元 本	695,164,511
次 期 繰 越 損 益 金	390,317,672
(D) 受 益 権 総 口 数	695,164,511口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	15,615円

※当期における期首元本額763,004,834円、期中追加設定元本額23,259,203円、期中一部解約元本額91,099,526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)	0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2020年12月22日 至2021年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 3,224円
受 取 利 息	73
支 払 利 息	△ 3,297
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	23,853,546
売 買 損 益	25,764,910
売 買 損 益	△ 1,911,364
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,957,287
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A + B + C)	18,893,035
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	147,285,010
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	224,139,627
(配 当 等 相 当 額)	(278,475,055)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 54,335,428)
(G) 合 計 (D + E + F)	390,317,672
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	390,317,672
追 加 信 託 差 損 益 金	224,139,627
(配 当 等 相 当 額)	(278,475,055)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 54,335,428)
分 配 準 備 積 立 金	166,181,269
繰 越 損 益 金	△ 3,224

※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。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	-円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	18,893,238
(c) 収益調整金	278,475,055
(d) 分配準備積立金	147,288,031
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	444,656,324
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	6,396.42
(f) 分配金	-
1 万 口 当 た り 分 配 金	-

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

(2021年12月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	1,987,420	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	48,525	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	2,035,945	100.0

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	2,035,945,756円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	12,525,076
投資信託受益証券(評価額)	1,987,420,680
未 収 入 金	36,000,000
(B) 負 債	9,241,450
未 払 解 約 金	3,810,849
未 払 信 託 報 酬	5,397,611
そ の 他 未 払 費 用	32,990
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,026,704,306
元 本	1,106,286,759
次 期 繰 越 損 益 金	920,417,547
(D) 受 益 権 総 口 数	1,106,286,759口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	18,320円

※当期における期首元本額1,086,294,186円、期中追加設定元本額99,837,337円、期中一部解約元本額79,844,764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
	0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2020年12月22日 至2021年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 6,746円
受 取 利 息	119
支 払 利 息	△ 6,865
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	110,402,313
売 買 益	115,089,638
売 買 損	△ 4,687,325
(C) 信 託 報 酬 等	△ 10,710,856
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	99,684,711
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	284,991,053
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	535,741,783
(配 当 等 相 当 額)	(722,189,569)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△186,447,786)
(G) 合 計 (D + E + F)	920,417,547
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	920,417,547
追 加 信 託 差 損 益 金	535,741,783
(配 当 等 相 当 額)	(722,189,569)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△186,447,786)
分 配 準 備 積 立 金	384,682,510
繰 越 損 益 金	△ 6,746

※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。
※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	-円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	99,686,030
(c) 収益調整金	722,189,569
(d) 分配準備積立金	284,996,480
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,106,872,079
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	10,005.29
(f) 分配金	-
1 万 口 当 た り 分 配 金	-

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

(2021年12月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	3,217,654	97.8
コール・ローン等、その他	72,354	2.2
投資信託財産総額	3,290,009	100.0

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	3,290,009,328円
コール・ローン等	16,894,356
投資信託受益証券(評価額)	3,217,654,972
未 収 入 金	55,460,000
(B) 負 債	16,388,077
未 払 解 約 金	7,516,649
未 払 信 託 報 酬	8,817,472
その他未払費用	53,956
(C) 純資産総額(A-B)	3,273,621,251
元 本	1,573,014,555
次 期 繰 越 損 益 金	1,700,606,696
(D) 受 益 権 総 口 数	1,573,014,555口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,811円

※当期における期首元本額1,578,702,648円、期中追加設定元本額210,373,478円、期中一部解約元本額216,061,571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
	0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2020年12月22日 至2021年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 10,991円
受 取 利 息	501
支 払 利 息	△ 11,492
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	268,808,352
売 買 益	292,488,842
売 買 損	△ 23,680,490
(C) 信 託 報 酬 等	△ 17,335,110
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	251,462,251
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	417,535,739
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,031,608,706
(配 当 等 相 当 額)	(1,342,780,311)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 311,171,605)
(G) 合 計 (D+E+F)	1,700,606,696
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	1,700,606,696
追 加 信 託 差 損 益 金	1,031,608,706
(配 当 等 相 当 額)	(1,342,780,311)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 311,171,605)
分 配 準 備 積 立 金	669,008,981
繰 越 損 益 金	△ 10,991

※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。
※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	-円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	251,464,976
(c) 収益調整金	1,342,780,311
(d) 分配準備積立金	417,544,005
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,011,789,292
1万口当たり当期分配対象額	12,789.39
(f) 分配金	-
1万口当たり分配金	-

SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

第 21 期

決算日 2021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。

SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 1万口当たりの費用明細（2020年12月1日から2021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)	17円 (6) (2) (9)	0.082% (0.027) (0.011) (0.044)	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) (先物・オプション)	1 (0) (1)	0.003 (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) その他費用 (監査費用) (その他)	1 (1) (0)	0.007 (0.007) (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 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	19	0.092	

期中の平均基準価額は20,914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（2020年12月1日から2021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 122,335	千円 399,172	千口 788,594	千円 2,504,829

■ 組入れ資産の明細（2021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 3,506,055	千円 2,839,797	千口 9,147,555	千円 9,147,555

※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61,173,269,127口です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2021年11月30日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	9,152,653,736円
コール・ローン等	48,486
国内株式インテックス・マザーファンド（B号）（評価額）	9,147,555,252
未 収 入 金	5,049,998
(B) 負 債	9,365,137
未 払 解 約 金	5,049,998
未 払 信 託 報 酬	3,997,395
そ の 他 未 払 費 用	317,744
(C) 純資産総額（A - B）	9,143,288,599
元 本	4,343,114,030
次 期 繰 越 損 益 金	4,800,174,569
(D) 受益権総口数	4,343,114,030口
1万口当たり基準価額（C/D）	21,052円

※当期における期首元本額5,357,769,984円、期中追加設定元本額266,464,660円、期中一部解約元本額1,281,120,614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2020年12月1日 至2021年11月30日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 937円
受 取 利 息	23
支 払 利 息	△ 960
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	932,784,031
売 買 損 益	1,168,693,931
売 買 損 益	△ 235,909,900
(C) 信 託 報 酬 等	△ 8,736,737
(D) 当 期 損 益 金（A + B + C）	924,046,357
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,683,718,502
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,192,409,710
（ 配 当 等 相 当 額 ）	（ 3,666,853,960 ）
（ 売 買 損 益 相 当 額 ）	（ △ 2,474,444,250 ）
(G) 合 計（D + E + F）	4,800,174,569
次 期 繰 越 損 益 金（G）	4,800,174,569
追 加 信 託 差 損 益 金	1,192,409,710
（ 配 当 等 相 当 額 ）	（ 3,667,258,302 ）
（ 売 買 損 益 相 当 額 ）	（ △ 2,474,848,592 ）
分 配 準 備 積 立 金	3,607,764,859

※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。
※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	189,176,164円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	734,870,193
(c) 収益調整金	3,667,258,302
(d) 分配準備積立金	2,683,718,502
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	7,275,023,161
1万口当たり当期分配対象額	16,750.71
(f) 分配金	—
1万口当たり分配金	—

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第19期 (2020年12月1日から2021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1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。

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 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 (買建-売建)	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
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
19期 (2021年11月30日)	32,212	12.2	3,073.26	12.2	97.7	2.4	197,054

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※指数の著作権、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) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年11月30日	円 28,704	% -	2,738.72	% -	% 97.7	% 2.0
12月末	29,560	3.0	2,819.93	3.0	98.8	1.7
2021年1月末	29,632	3.2	2,826.50	3.2	99.2	0.8
2月末	30,556	6.5	2,914.58	6.4	98.9	1.2
3月末	32,298	12.5	3,080.87	12.5	98.4	1.6
4月末	31,386	9.3	2,993.46	9.3	97.7	2.3
5月末	31,816	10.8	3,034.76	10.8	97.5	2.6
6月末	32,195	12.2	3,070.81	12.1	98.0	2.0
7月末	31,497	9.7	3,003.91	9.7	98.0	2.0
8月末	32,494	13.2	3,099.08	13.2	98.3	1.6
9月末	33,910	18.1	3,234.08	18.1	98.1	1.9
10月末	33,427	16.5	3,188.28	16.4	97.8	2.7
(期 末) 2021年11月30日	32,212	12.2	3,073.26	12.2	97.7	2.4

※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（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	28,704円
期末	32,212円
騰落率	+12.2%

※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。

※指数の著作権、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（2020年12月1日から2021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

- ・米国の追加経済対策への期待と国内製造業の好業績により、国内株式市場が上昇したこと
- ・9月の菅総理の辞任表明により、新政権の政策期待から国内株式市場が上昇したこと

下落要因

- ・期末にかけて、欧州を中心とした新型コロナウイルスの感染再拡大に加え、南アフリカでの新たな変異ウイルス（オミクロン型）の検出が嫌気され下落したこと

▶ 投資環境について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期初は米国の追加経済対策への期待と国内製造業の好業績から、上昇しました。2月から8月にかけては、変異ウイルス（デルタ型）の感染が拡大する一方、国内製造業の好業績発表により、もみ合う展開となりました。

9月になると、菅総理の辞任表明により、新政権の政策期待から国内株式市場は高値を更新しました。その後、中国の不動産大手の信用不安で日本を含む世界的な株安が進行しました。しかし、債務が履行されたことや企業業績が好調な米国株が上昇したことで、国内株式市場も上昇に転じました。

期末には欧州を中心とした新型コロナウイルスの感染再拡大に加え、南アフリカでの新たな変異ウイルス（オミクロン型）の検出が嫌気され下落しました。

▶ ポートフォリオについて（2020年12月1日から2021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

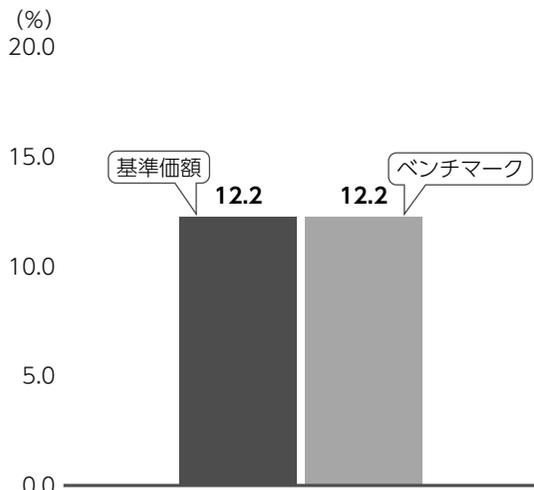
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

指数採用銘柄のうち、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出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（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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】

基準価額の騰落率は+12.2%となり、ベンチマークの騰落率+12.2%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（2020年12月1日から2021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)	0.003% (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) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (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	1	0.003	

期中の平均基準価額は31,986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（2020年12月1日から2021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 8,334.3 (3,590.575)	千円 19,219,723 ()	千株 8,658.775	千円 20,409,478

※金額は受渡し代金。

※（ ）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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 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	百万円 49,971	百万円 48,975	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	39,629,201千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	189,332,738千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.20

※(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（2020年12月1日から2021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 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	
株 式	百万円 19,219	百万円 6,507	% 33.9	百万円 20,409	百万円 8,618	% 42.2
株 式 先 物 取 引	49,971	47,251	94.6	48,975	46,260	94.5

(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 114	百万円 97	百万円 1,842

(3) 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	5,504千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	4,651千円
(c) (b)／(a)	84.5%

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、SMB C日興証券株式会社、株式会社三井住友フィナンシャルグループです。

■ 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

（2020年12月1日から2021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。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 組入れ資産の明細（2021年11月30日現在）

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
	千株		千円	
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	3.8	3.7	10,730	
日本水産	97.5	97.1	55,638	
マルハニチロ	14.1	15	34,155	
雪国まいたけ	5.7	8.1	9,857	
カネコ種苗	4.6	5	6,740	
サカタのタネ	11.6	11.6	36,250	
ホクト	7.1	8	14,736	
鉱業 (0.2%)				
日鉄鉱業	2.4	2.3	14,168	
三井松島ホールディングス	5.6	4.8	6,206	
I N P E X	361.1	396.9	371,895	
石油資源開発	12.4	11.7	26,804	
K & O エナジーグループ	5.6	5.5	8,261	
建設業 (2.2%)				
ヒノキヤグループ	3.4	2.9	6,142	
ショーボンドホールディングス	15.1	14.1	68,878	
ミライト・ホールディングス	27.3	31.3	61,504	
タマホーム	6.5	6.1	13,969	
ベストテラ	—	3.9	4,976	
Robot Home	—	20.8	4,596	
スペースバリューホールディングス	15.4	—	—	
ダイセキ環境ソリューション	—	2.7	4,476	
安藤・間	59.5	54.1	45,498	
東急建設	30.2	30.2	19,479	
コムシスホールディングス	34.7	31.6	78,241	
ビーアールホールディングス	13.4	17	6,001	
高松コンストラクショングループ	6.2	6.7	12,522	
東建コーポレーション	3	2.9	25,955	
オリエンタル白石	—	36.7	8,330	
大成建設	75.4	66	218,460	
大林組	224.9	227.9	190,524	
清水建設	228.5	213.8	153,294	
飛島建設	8.7	8.7	8,499	
長谷工コーポレーション	86.7	67.2	90,988	
松井建設	11.8	11.6	8,154	
銭高組	1.6	1.7	6,400	
鹿島建設	177	167	208,917	
不動テトラ	7.4	5.8	9,349	
大末建設	6.3	5.1	5,701	
鉄建建設	6.1	6.5	11,160	
西松建設	18	14	47,390	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
三井住友建設	55.8	53.2	22,024	
大豊建設	5.6	3.5	12,670	
前田建設工業	58.8	—	—	
奥村組	10.4	13.3	41,762	
東鉄工業	9.2	9.9	22,502	
浅沼組	3	2.9	15,254	
戸田建設	94.9	95.7	63,927	
熊谷組	10.5	11.2	29,433	
北野建設	2.2	2.7	5,535	
矢作建設工業	12.1	12.5	8,637	
ピーエス三菱	10.6	9.3	5,514	
日本ハウスホールディングス	26.1	20.7	7,182	
大東建託	24.9	23.4	287,586	
新日本建設	10.5	10.6	7,897	
N I P P O	18.1	18.6	74,586	
東亜道路工業	2	1.4	6,510	
前田道路	21	—	—	
日本道路	2.3	2.2	17,160	
東亜建設工業	8.3	5.9	14,036	
日本国土開発	22.9	22.2	11,810	
若築建設	6	4.8	9,120	
東洋建設	29.9	25.7	13,466	
五洋建設	91.5	91.2	59,371	
世紀東急工業	13.6	12.8	10,547	
福田組	2.8	2.8	11,508	
住友林業	58	58.5	133,789	
日本基礎技術	11.7	—	—	
巴コーポレーション	15.7	14.6	6,307	
大和ハウス工業	225	211.2	700,339	
ライト工業	12.6	14.8	29,970	
積水ハウス	246.6	247.9	547,859	
北陸電気工事	—	5.2	5,465	
ユアテック	14.8	14.1	8,474	
日本リーテック	5.5	5.8	8,079	
中電工	7.2	9.9	20,067	
関電工	27.9	37.5	30,375	
きんでん	52.8	50	82,150	
東京エネシス	9.8	8.8	9,081	
トーエネック	2.9	2.9	9,048	
住友電設	6.2	5.8	11,170	
日本電設工業	11.2	11.7	18,123	
エクシオグループ	33.8	33.9	81,563	
新日本空調	6.7	6.3	13,185	

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
九電工	16.1	17.7	59,472	
三機工業	16	13.6	18,672	
日揮ホールディングス	70.5	70.9	67,851	
中外炉工業	4.1	3.6	5,587	
ヤマト	9.4	8.8	6,494	
太平電業	6.1	5.3	14,341	
高砂熱学工業	16	21.1	40,258	
朝日工業社	2.2	2.2	6,179	
明星工業	15.6	17	11,084	
大気社	10.7	11.1	32,190	
ダイダシ	5.4	5.4	11,070	
日比谷総合設備	7.8	7.5	13,980	
フィル・カンパニー	—	1.7	3,726	
テスホールディングス	—	4.7	11,383	
インフロニア・ホールディングス	—	97.4	91,458	
OSJBホールディングス	43.1	—	—	
東洋エンジニアリング	—	11.1	7,881	
レイズネクスト	13	10.8	12,106	
食料品（3.3%）				
ニッポン	19.3	20.1	31,496	
日清製粉グループ本社	81.9	82.2	134,479	
昭和産業	6.4	6.4	16,748	
鳥越製粉	8.2	8.7	6,177	
中部飼料	8.9	8.6	8,118	
フィード・ワン	11.1	10.3	7,354	
日本甜菜製糖	4.7	5.3	8,453	
DM三井製糖ホールディングス	5.7	6.4	11,916	
日新製糖	3.6	4.3	7,004	
森永製菓	17.2	17.3	61,069	
中村屋	1.9	2.5	9,012	
江崎グリコ	20	20	70,100	
名糖産業	3.7	5	8,250	
井村屋グループ	4.8	4.5	9,729	
不二家	4.8	4.4	9,820	
山崎製パン	54.7	54.7	80,682	
モロゾフ	1.3	1.7	8,993	
亀田製菓	4.2	4.1	17,732	
寿スピリッツ	6.9	7	43,120	
カルビー	33	33.4	85,103	
森永乳業	13.6	13.6	73,984	
六甲バター	5.9	6.5	9,932	
ヤクルト本社	50.1	54.1	306,747	
明治ホールディングス	47.9	48.1	320,346	
雪印メグミルク	17.2	17.4	33,408	
プリマハム	10.9	8.4	19,916	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本ハム	27.7	27.7	107,199	
丸大食品	7.7	7.8	11,177	
S Foods	5.8	6.3	20,695	
柿安本店	3.2	2.9	7,511	
伊藤ハム米久ホールディングス	42.4	41.4	26,578	
サッポロホールディングス	25.2	25	54,500	
アサヒグループホールディングス	158.5	171.8	720,529	
キリンホールディングス	307.9	268.3	487,501	
宝ホールディングス	54.8	50.2	61,244	
オエノンホールディングス	24.1	24.5	8,722	
養命酒製造	3.5	3.7	6,549	
コカ・コーラ ボトラーズ ジャパンホールディングス	56.3	50.9	64,388	
サントリー食品インターナショナル	48.6	48.8	195,444	
ダイドーグループホールディングス	3.8	3.7	18,167	
伊藤園	22	22.2	148,074	
キーコーヒー	6.4	6.9	13,392	
日清オイリオグループ	8.9	8.4	23,335	
不二製油グループ本社	17.8	15.8	35,328	
かどや製油	1.3	1.4	5,656	
J-オイルミルズ	3.8	7.4	12,217	
キッコーマン	52.2	52.6	455,516	
味の素	160.9	161.3	549,549	
ブルドックソース	—	3.9	7,991	
キュービー	40.4	38.3	88,434	
ハウス食品グループ本社	26.9	27.2	75,860	
カゴメ	29.5	27.6	76,314	
焼津水産化学工業	4.1	7.7	7,168	
アリアケジャパン	6.8	6.7	42,880	
ニチレイ	34.8	34.9	90,774	
東洋水産	37.5	35	161,000	
イトアトホールディングス	2.6	3.6	7,484	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5.1	—	—	
日清食品ホールディングス	31	28.6	238,524	
永谷園ホールディングス	4.2	4.1	7,925	
一正蒲鉾	2.9	6.6	5,629	
フジッコ	7.7	7.5	13,560	
ロック・フィールド	8.2	7.9	11,360	
日本たばこ産業	389	391.8	890,757	
ケンコーマヨネーズ	4.8	5.2	6,609	
わらべや日洋ホールディングス	6	5.3	9,762	
なとり	4.6	5.2	9,885	
ピックルスコーポレーション	2.1	4.1	7,236	
ファーマフーズ	—	7	15,904	
ユーグレナ	31	38.5	30,607	

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
紀文食品	—	5	4,895	
ミヨシ油脂	4.5	5.1	6,461	
理研ビタミン	7.1	8.1	12,984	
繊維製品（0.5%）				
片倉工業	11.4	—	—	
グンゼ	5.1	5.1	20,119	
東洋紡	29.2	29.2	34,894	
ユニチカ	25.2	23.1	6,675	
富士紡ホールディングス	4	3.5	13,177	
倉敷紡績	7.6	6.7	12,207	
シキボウ	—	8.2	7,330	
日本毛織	22.9	23.3	19,595	
帝国繊維	8.3	9.1	17,954	
帝人	57.7	68	88,468	
東レ	514.8	519.2	343,087	
住江織物	2.6	3.3	5,062	
アツギ	11.3	10.2	6,793	
ダイニック	6	7.4	5,069	
セーレン	17.8	15.5	35,231	
小松マテール	13.5	13	15,301	
ワコールホールディングス	18.3	18.4	37,039	
ホギメディカル	8.3	10.2	30,600	
T S Iホールディングス	26.4	27.3	9,418	
マツオカコーポレーション	3	3.5	4,259	
ワールド	10.7	11	13,079	
オンワードホールディングス	45.9	47.4	13,651	
ゴールドウイン	13.1	13	83,850	
デサント	14.4	14.2	65,462	
パルプ・紙（0.2%）				
特種東海製紙	4.4	4.7	18,917	
王子ホールディングス	293.3	297.1	155,977	
日本製紙	31.4	35.2	37,523	
三菱製紙	12.5	—	—	
北越コーポレーション	42.2	47.8	37,284	
中越パルプ工業	4.8	—	—	
大王製紙	32	35.2	63,324	
レンゴー	68.9	68.6	52,616	
トーモク	5.3	5.6	9,861	
ザ・バック	5.8	5.9	15,812	
化学（6.8%）				
北の達人コーポレーション	26.4	26.6	9,469	
クラレ	110.5	103.4	97,609	
旭化成	469.2	473	506,819	
昭和電工	53.6	61.9	154,873	
住友化学	515.3	520.7	272,846	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
住友精化	3.2	3.6	10,872	
日産化学	39.1	38.8	253,752	
ラサ工業	3.3	2.8	4,642	
クレハ	5.9	5.6	44,240	
多木化学	2.8	2.9	15,805	
テイカ	5.8	6.2	7,210	
石原産業	14.3	12.2	14,225	
日本曹達	10.5	9	28,935	
東ソー	109	102.6	167,340	
トクヤマ	20.5	23	41,032	
セントラル硝子	14.5	12	23,328	
東亜合成	43.3	40.9	48,098	
大阪ソーダ	6.7	6.4	16,352	
関東電化工業	16.6	16.2	16,329	
デンカ	25.9	25.9	86,635	
信越化学工業	121.6	122.6	2,329,400	
日本カーバイド工業	4.7	—	—	
堺化学工業	5	5.2	10,899	
第一稀元素化学工業	9.8	8.4	10,735	
エア・ウォーター	66.1	67.3	112,862	
日本酸素ホールディングス	68.3	68.5	164,605	
日本化学工業	2.9	2.6	6,552	
日本パーカライジング	36.1	36.4	38,584	
高压ガス工業	13	13.1	9,641	
チタン工業	2.1	—	—	
四国化成工業	10.3	9.4	12,840	
ステラ ケミファ	3.7	4	10,000	
保土谷化学工業	2.6	2.4	11,100	
日本触媒	11	12.1	61,347	
大日精化工業	5.9	5.7	12,540	
カネカ	18.1	18.4	68,080	
三菱瓦斯化学	65.8	66.2	125,051	
三井化学	65.4	64.5	196,402	
J S R	66.3	66.5	281,960	
東京応化工業	12.3	12.3	87,576	
大阪有機化学工業	6.4	6	21,900	
三菱ケミカルホールディングス	472.6	476.7	425,311	
KHネオケム	11.6	11.8	36,344	
ダイセル	88.2	103.3	80,883	
住友ペークライト	11.5	11.3	60,003	
積水化学工業	148	148.6	274,167	
日本ゼオン	64.4	64.7	77,834	
アイカ工業	21.1	20	66,300	
宇部興産	35.1	33.2	63,080	
積水樹脂	12.6	10.8	21,805	

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
タキロンシーアイ	16	16.5	8,613	
旭有機材	5.1	4.9	7,301	
ニチバン	4.8	5.7	9,957	
リケンテクノス	20.9	19.3	9,283	
大倉工業	3.8	4.2	8,618	
積水化成成品工業	10.9	—	—	
群栄化学工業	2.4	2.5	8,187	
ミライアル	3.8	2.9	4,718	
ダイキョーニシカワ	15.9	16.3	8,753	
森六ホールディングス	4.9	5	8,550	
恵和	—	1.9	11,647	
日本化薬	44.9	56.8	63,275	
カーリットホールディングス	11.5	8.8	5,746	
日本精化	6.7	6	12,000	
扶桑化学工業	7	6.4	30,208	
トリケミカル研究所	1.6	7.3	25,550	
A D E K A	32.4	32.8	79,080	
日油	26.4	24.3	136,080	
新日本理化	—	20.1	4,904	
ハリマ化成グループ	7	7.3	5,774	
花王	173.2	161.3	933,443	
第一工業製薬	2.6	3.1	9,594	
石原ケミカル	—	4.5	5,692	
ニイタカ	2	2.4	5,400	
三洋化成工業	4	4.1	20,869	
大日本塗料	9.1	11	8,701	
日本ペイントホールディングス	58.4	268.5	320,320	
関西ペイント	79.6	74.1	188,955	
中国塗料	20.8	17.7	15,257	
日本特殊塗料	6.5	7	5,551	
藤倉化成	12.6	11.7	5,733	
太陽ホールディングス	5.2	10.4	33,540	
D I C	29.7	30.1	85,634	
サカタインクス	15.2	14.4	13,996	
東洋インキS Cホールディングス	14	13.8	25,875	
T & K T O K A	7.6	8.4	6,266	
富士フイルムホールディングス	138.6	128.1	1,144,061	
資生堂	143.7	135.8	883,107	
ライオン	94.3	88	141,768	
高砂香料工業	5	5	13,750	
マンダム	16.6	15.7	22,356	
ミルボン	9.9	9.1	52,416	
ファンケル	29.4	29.5	101,037	
コーセー	13.6	13.7	187,279	
コタ	5.9	6	9,030	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ポーラ・オルビスホールディングス	31.2	31.4	63,490	
ノエビアホールディングス	6	6.1	32,025	
新日本製薬	—	3.6	4,474	
エステー	5.6	5.6	8,607	
アグロ カネショウ	3.9	—	—	
コニシ	11.4	11.9	19,016	
長谷川香料	12.4	12.4	34,868	
小林製薬	20.2	20.4	181,968	
荒川化学工業	7	7.2	8,128	
メック	5.8	5.5	22,660	
タカラバイオ	19.1	19	50,141	
J C U	8.6	8	38,400	
デクセリアルズ	19	18.9	63,220	
アース製薬	5.3	6	36,840	
北興化学工業	8.1	7.8	6,598	
大成ラミック	3.5	3.3	9,042	
クミアイ化学工業	30.5	27.5	21,945	
日本農薬	16.1	16.1	7,486	
アキレス	5.9	6.2	7,495	
有沢製作所	12.6	11.7	10,822	
日東電工	49.8	44	347,600	
レック	7.5	11	9,009	
三光合成	15.3	—	—	
藤森工業	6.1	6.4	22,912	
前澤化成工業	7.1	6.8	8,506	
未来工業	4.9	3.8	6,140	
J S P	5	5.2	7,878	
エフピコ	15	13.6	50,932	
天馬	5.4	6	14,412	
信越ポリマー	12.7	13.4	12,743	
東リ	23.1	27.3	5,978	
ニフコ	26.5	24.4	76,128	
バルカー	6.6	6	14,652	
ユニ・チャーム	153.3	140.5	686,764	
医薬品（4.8%）				
協和キリン	72.6	85.3	270,401	
武田薬品工業	601.8	572.5	1,735,247	
アステラス製薬	627.6	631.5	1,123,754	
大日本住友製薬	54.3	45.3	62,604	
塩野義製薬	90.9	91.5	724,954	
あすか製薬	8	—	—	
日本新薬	19	19.1	160,440	
中外製薬	226.2	227.8	838,304	
科研製薬	12.2	11.5	46,517	
エーザイ	86.7	87.1	598,638	

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
ロート製薬	37	37.5	121,312	
小野薬品工業	166.3	167	418,418	
久光製薬	19.1	19.2	76,608	
持田製薬	10.1	9.4	29,892	
参天製薬	135.1	135.8	204,243	
扶桑薬品工業	3.7	3.4	8,054	
日本ケミファ	2.2	2.5	5,102	
ツムラ	22.5	22.6	73,111	
日医工	20	23.3	15,657	
キッセイ薬品工業	12.5	13.2	30,148	
生化学工業	14.4	13	12,194	
栄研化学	12.4	12.7	24,041	
鳥居薬品	4.5	4.1	11,389	
JCRファーマ	20.8	20.7	51,729	
東和薬品	9.2	10.2	26,785	
富士製薬工業	6.8	6.3	6,804	
沢井製薬	14.8	—	—	
ゼリア新薬工業	13	13.1	25,138	
第一三共	621.1	572.5	1,617,026	
キョーリン製薬ホールディングス	16.1	14.5	24,476	
大幸薬品	9.2	12.9	10,423	
ダイト	4.6	4.8	13,636	
大塚ホールディングス	150.2	151.3	627,289	
大正製薬ホールディングス	15	17.2	95,976	
ペプチドリーム	36.7	38.4	109,900	
あすか製薬ホールディングス	—	9.2	8,850	
サワイグループホールディングス	—	16	67,200	
石油・石炭製品（0.4%）				
日本コークス工業	99.6	69.2	8,442	
ニチレキ	9.1	10.4	13,592	
ユシロ化学工業	6.4	7	7,266	
MORESCO	—	5.4	5,815	
出光興産	80.8	80.6	236,238	
ENEOSホールディングス	1,088	1,096.1	464,088	
コスモエネルギーホールディングス	21.7	21.2	47,170	
ゴム製品（0.7%）				
横浜ゴム	41.5	41.8	73,818	
TOYO TIRE	39	38.6	66,623	
ブリヂストン	192.6	209.8	966,129	
住友ゴム工業	64	65.4	74,490	
藤倉コンポジット	—	7.4	5,831	
オカモト	4.6	4.4	16,588	
ニッタ	7.8	7.6	19,775	
住友理工	16.1	15.8	9,069	
三ツ星ベルト	10	8.9	17,194	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
バンドー化学	14.4	13	11,050	
ガラス・土石製品（0.8%）				
日東紡績	11.1	11	29,326	
AGC	66.2	66.8	370,740	
日本板硝子	15.4	19.6	9,839	
日本山村硝子	5.4	—	—	
日本電気硝子	27.1	29.5	86,700	
オハラ	4	3.8	5,179	
住友大阪セメント	14	13.8	47,610	
太平洋セメント	45.9	41.6	91,478	
日本ヒューム	10.6	12.1	8,058	
日本コンクリート工業	22.2	22.9	5,770	
三谷セキサン	3.4	3.6	25,488	
アジアパイルホールディングス	15	16.5	6,798	
東海カーボン	71	61.2	72,032	
日本カーボン	4.2	3.8	15,751	
東洋炭素	4.9	4.8	14,928	
ノリタケカンパニーリミテド	4	4.1	18,983	
TOTO	51.7	52.1	262,063	
日本碍子	86.5	78.7	141,423	
日本特殊陶業	54.9	55.4	104,595	
MARUWA	2.8	2.6	34,840	
品川リフラクトリーズ	2.4	2	6,950	
黒崎播磨	1.8	1.6	6,240	
ヨータイ	8.2	5.4	6,539	
東京窯業	16.5	15.3	4,498	
フジミンコーポレートッド	6.7	6	44,100	
ニチアス	19	17.7	45,418	
ニチハ	10	10.2	28,468	
鉄鋼（0.7%）				
日本製鉄	319.8	322.2	547,578	
神戸製鋼所	130.3	133.7	73,401	
中山製鋼所	13	14.9	6,153	
合同製鐵	4.7	5.2	6,832	
ジェイエフイーホールディングス	191	194	255,304	
東京製鐵	34	24.6	29,593	
共英製鋼	9.2	9.1	11,384	
大和工業	15.5	14	48,790	
東京製鋼	4	4.7	5,832	
大阪製鐵	4.5	—	—	
淀川製鋼所	8.9	9.6	21,888	
丸一鋼管	22.8	25.6	62,131	
モリ工業	2.7	2.6	6,692	
大同特殊鋼	11.7	11.9	46,767	
日本冶金工業	6.9	5.5	11,236	

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
山陽特殊製鋼	6	7.6	13,816	
愛知製鋼	4.4	4.7	11,406	
日立金属	77	77.3	162,484	
大平洋金属	5.6	4.9	9,947	
新日本電工	49.6	47.2	13,782	
栗本鐵工所	4.4	4.7	6,923	
三菱製鋼	8.9	5.7	5,529	
日本精線	—	1.5	6,562	
エンビプロ・ホールディングス	—	3.4	6,449	
シンニッタン	19.9	—	—	
非鉄金属（0.7%）				
大紀アルミニウム工業所	12.7	10.6	15,497	
日本軽金属ホールディングス	18.1	18.4	30,709	
三井金属鉱業	19.5	19.3	56,549	
東邦亜鉛	—	4.6	9,761	
三菱マテリアル	47.5	47.4	92,619	
住友金属鉱山	91.5	92.1	389,859	
DOWAホールディングス	18.3	19.5	82,290	
古河機械金属	12.7	11.8	14,136	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9.7	11	8,580	
東邦チタニウム	15.2	13.5	12,798	
UACJ	11	10.8	24,786	
CKサンエツ	2.1	2	6,710	
古河電気工業	22.6	22.6	50,963	
住友電気工業	267.1	269.8	401,867	
フジクラ	89.6	80.4	46,069	
昭和電線ホールディングス	8	6.4	12,019	
タツタ電線	16.3	14.9	6,868	
平河ヒューテック	—	5.4	5,950	
リョービ	9.7	10.2	10,271	
アーレスティ	15.7	—	—	
アサヒホールディングス	13.2	28.7	54,931	
金属製品（0.6%）				
稲葉製作所	5.4	—	—	
宮地エンジニアリンググループ	3.3	3.2	9,299	
トーカロ	20.8	18.4	27,305	
アルファ	4.3	4.9	5,243	
SUMCO	92	110.9	275,919	
川田テクノロジーズ	1.8	2.1	7,759	
RS Technologies	2.8	2.4	15,456	
東洋製罐グループホールディングス	46.3	46.3	64,171	
ホッカンホールディングス	4.8	5.4	7,614	
コロナ	5.9	—	—	
横河ブリッジホールディングス	13.5	12.4	26,300	
駒井ハルテック	—	3.1	5,332	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
三和ホールディングス	68	68.4	82,969	
文化シャッター	21.4	23	23,207	
三協立山	11.1	12	8,208	
アルインコ	7.9	8	7,472	
LIXIL	105.9	113.4	316,272	
ノーリツ	15	13.9	22,643	
長府製作所	7.2	7.3	14,607	
リンナイ	14	13.6	145,792	
日東精工	12.4	13	7,709	
岡部	14.7	18	12,132	
ジーテクト	9.3	9.2	12,263	
東プレ	13.9	13.7	14,946	
高周波熱錬	16.2	16.3	9,013	
東京製綱	8.2	7	5,320	
パイオラックス	10.6	11	17,710	
エイチワン	9.3	9.9	6,147	
日本発条	77.1	66.8	56,579	
立川ブラインド工業	—	5	5,450	
三益半導体工業	5.7	5.6	13,109	
機械（5.4%）				
日本製鋼所	21.5	22.2	76,035	
三浦工業	31	31.3	124,730	
タクマ	23.9	24.1	33,017	
ツガミ	14.7	17.4	24,551	
オークマ	8.2	8.5	40,332	
芝浦機械	8.2	8.3	27,971	
アマダ	88	113.4	120,544	
アイダエンジニアリング	18.4	19	17,518	
FUJI	29.9	33	82,137	
牧野フライス製作所	8.2	7.8	26,949	
オーエスジー	35.2	34	55,964	
旭ダイヤモンド工業	20.3	19.4	12,299	
DMG森精機	45.5	42.9	76,104	
ソディック	15.8	16.8	12,885	
ディスコ	9.7	10.6	345,560	
日東工器	4.5	4.8	8,352	
日進工具	3.4	6.3	9,002	
パンチ工業	11.3	—	—	
豊和工業	5.7	—	—	
島精機製作所	11	10.8	20,606	
オプトラン	9	9.3	20,859	
NCホールディングス	—	3	4,164	
イワキ	5.9	—	—	
フリーユー	8.9	7.2	9,158	
ヤマシンフィルタ	15	15.4	8,054	

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
日阪製作所	10.6	11.3	8,904	
やまびこ	13.9	13.9	17,347	
野村マイクロ・サイエンス	—	2	9,690	
平田機工	3.3	3.5	20,895	
ペガサスミシン製造	15.3	—	—	
マルマエ	4.2	3.3	9,876	
タツモ	3.9	4.2	7,009	
ナブテスコ	42.1	41.1	135,013	
三井海洋開発	7.2	8.2	11,463	
レオン自動機	7.9	8.6	11,257	
S M C	22.7	21.3	1,547,445	
ホソカワミクロン	2.4	5.1	14,494	
ユニオンツール	2.7	2.8	10,486	
オイレス工業	8.6	10	16,430	
日精エー・エス・ピー機械	2.4	2.7	7,678	
サトーホールディングス	10.2	9.7	20,622	
技研製作所	6.2	6.4	26,432	
日本エアーテック	—	4.7	5,687	
日精樹脂工業	7.7	6.5	6,370	
小松製作所	327.4	330.5	856,656	
住友重機械工業	40.9	41.6	104,873	
日立建機	29.1	29.2	96,360	
日工	13.1	13.6	8,296	
巴工業	4	3.5	8,008	
井関農機	8.1	7.7	10,849	
T O W A	7	6.5	20,800	
北川鉄工所	4.1	4.8	6,686	
ローツェ	3.1	3.6	43,020	
クボタ	378.6	355.8	842,890	
荏原実業	2.3	3.6	9,036	
三菱化工機	3.6	3	6,795	
月島機械	13.6	13.8	14,738	
帝国電機製作所	7.3	6.1	8,485	
新東工業	16.6	18.5	12,524	
澁谷工業	6.3	6.4	18,291	
アイチ コーポレーション	12	11.8	9,192	
小森コーポレーション	17.9	20.4	12,852	
鶴見製作所	6.1	6.3	9,639	
住友精密工業	2.2	—	—	
酒井重工業	1.9	—	—	
荏原製作所	30.1	30.3	184,830	
西島製作所	10.9	10	8,630	
北越工業	9.3	9.1	8,608	
ダイキン工業	92.2	92.9	2,150,635	
オルガノ	2.6	2	13,640	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
トーヨーカネツ	4.2	3.4	8,479	
栗田工業	38.9	39.4	208,820	
椿本チエイン	9.4	9.5	27,312	
大同工業	7	5.3	4,515	
木村化工機	—	7.5	7,395	
アネスト岩田	12.6	12.8	10,931	
ダイフク	36.7	40	363,600	
サムコ	2.3	2.3	6,695	
加藤製作所	6	—	—	
タダノ	35	39	39,312	
フジテック	26.2	27.3	65,028	
C K D	20	21.4	47,572	
キトー	6.9	7.2	12,628	
平和	19.8	20.4	37,699	
理想科学工業	7.4	6.4	12,940	
S A N K Y O	16	16.1	46,593	
日本金銭機械	10.7	9.1	6,260	
マースグループホールディングス	5.7	6.2	9,858	
フクシマガリレイ	4.5	5.1	21,318	
ダイコク電機	5.8	5	5,950	
竹内製作所	12.1	11	29,898	
アマノ	19	19.3	48,076	
J U K I	13.2	11.8	10,844	
ジャノメ	—	8.1	5,038	
マックス	11	9.9	17,770	
グローリー	18.7	19.2	39,840	
新晃工業	7.5	7	12,817	
大和冷機工業	11.5	10.5	12,663	
セガサミーホールディングス	71.9	72.5	133,762	
日本ピストンリング	4.4	4.4	5,363	
リケン	3.9	3.7	9,016	
T P R	9.8	10	13,680	
ツバキ・ナカシマ	13.5	16.5	22,605	
ホンザキ	22.8	21.3	183,606	
大豊工業	8.2	8.2	5,969	
日本精工	133.9	136.1	104,933	
N T N	170.5	157.9	33,159	
ジェイテクト	68.2	69.6	69,043	
不二越	6.5	6.1	23,546	
日本トムソン	25.8	22.1	15,271	
T H K	45	42.5	115,217	
ユーシン精機	8	8.7	6,333	
前澤給装工業	3.6	7.3	7,307	
イーグル工業	9.6	10	10,250	
日本ビラー工業	7.9	7.4	23,680	

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
キッツ	28.2	25.3	17,735	
マキタ	94.1	88.9	443,077	
日立造船	56	61.6	51,805	
三菱重工業	121	114.6	293,490	
IHI	52.6	45.6	97,629	
スター精密	11.3	11.6	16,773	
電気機器（19.8%）				
日清紡ホールディングス	45.1	44.9	36,773	
イビデン	44.4	38.2	270,074	
コニカミノルタ	160	160.3	75,180	
ブラザー工業	88	88.8	173,515	
ミネベアミツミ	133.9	125.2	375,600	
日立製作所	347.7	350.5	2,344,144	
東芝	—	127.3	576,287	
三菱電機	722.9	729	1,038,460	
富士電機	43.6	43.9	260,766	
東洋電機製造	4.2	—	—	
安川電機	77.7	78.3	398,547	
シンフォニアテクノロジー	10.2	9.5	11,979	
明電舎	13.9	12.6	32,608	
オリジン	3.6	4.3	5,426	
山洋電気	3.5	3.3	18,711	
デンヨー	6.5	7	11,599	
PHCホールディングス	—	8	18,384	
東芝テック	9.1	7.9	34,404	
芝浦メカトロニクス	1.8	1.4	11,550	
マブチモーター	19.9	17.1	63,783	
日本電産	174.1	188.9	2,455,700	
トレックス・セミコンダクター	5.9	4.2	15,897	
東光高岳	5.8	5.2	6,780	
ダイヘン	7.8	8	34,400	
ヤーマン	12.4	12.4	12,499	
JVCケンウッド	—	65.9	10,873	
ミマキエンジニアリング	11.9	8.5	7,497	
IPEX	4.2	4.1	7,954	
日新電機	16.8	17.2	24,372	
大崎電気工業	18	18	7,938	
オムロン	64.6	60.7	665,575	
日東工業	10.5	9.8	14,572	
IDEC	11.2	9.4	25,267	
ジーエス・ユアサコーポレーション	24.7	24.4	56,266	
メルコホールディングス	3	2.2	8,580	
日本電気	87.8	92.5	473,600	
富士通	69.7	65.6	1,232,952	
沖電気工業	29	31.1	26,061	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
電気興業	4	4.4	11,079	
サンケン電気	8	6.9	39,882	
アイホン	5.1	4.7	9,808	
ルネサスエレクトロニクス	311.1	394.7	569,157	
セイコーエプソン	90.1	90.5	165,615	
ワコム	48.6	56.5	49,381	
アルバック	13.6	13.5	87,750	
EIZO	5.8	5.7	22,458	
日本信号	18.9	19.1	16,445	
京三製作所	19.7	18.7	8,059	
能美防災	9.6	9.9	19,790	
ホーチキ	6.2	6.5	8,099	
エレコム	8.4	16.8	22,260	
パナソニック	826.1	777.6	966,168	
シャープ	84.4	83.3	105,791	
アンリツ	47	46.9	82,778	
富士通ゼネラル	19.9	19.9	51,342	
ソニーグループ	453.1	456.5	6,311,112	
TDK	34.9	105.5	474,750	
帝国通信工業	5.5	5	6,125	
タムラ製作所	26.3	29.1	20,049	
アルプスアルパイン	64	65.1	66,597	
日本電波工業	—	8.2	13,808	
メイコー	—	6	23,220	
日本トリム	1.6	2.1	7,056	
ローランド ディー・ジー	5.8	4.8	12,403	
フォスター電機	9.1	9.8	6,889	
SMK	2.5	2.5	5,702	
ヨコオ	5	5.5	14,762	
ホシデン	20.2	17.4	20,427	
ヒロセ電機	11.1	11.2	213,360	
日本航空電子工業	17.1	17	30,855	
TOA	9.6	9.8	7,105	
マクセル	16.4	15	19,635	
古野電気	10.5	9.6	11,001	
ユニデンホールディングス	3	2.1	7,035	
スミダコーポレーション	8	7.9	8,863	
アイコム	4.2	3.4	7,854	
リオン	3.8	3.6	7,686	
船井電機	12.9	—	—	
横河電機	66.7	73.1	156,068	
新電元工業	3.3	3.1	10,478	
アズビル	45.5	42.7	214,354	
東亜ディーケーケー	5.5	5.4	4,536	
日本光電工業	30.3	29.9	100,015	

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
チノー	4.2	—	—	—
共和電業	15.2	16.2	6,285	6,285
日本電子材料	—	4	8,776	8,776
堀場製作所	14.5	13.4	90,450	90,450
アドバンテスト	53.7	54.1	540,459	540,459
エスベック	6.9	6.2	13,038	13,038
キーエンス	65.5	66	4,641,780	4,641,780
日置電機	3.5	3.5	31,010	31,010
シスメックス	51.7	61.6	872,256	872,256
日本マイクロニクス	12.1	13.1	23,501	23,501
メガチップス	7	6.9	32,809	32,809
OBARA GROUP	4.4	3.7	12,284	12,284
コーセル	11.7	10.6	9,518	9,518
イリソ電子工業	6.1	6.3	28,822	28,822
オブテックスグループ	12.6	12.7	18,859	18,859
千代田インテグレ	4.5	4	8,676	8,676
レーザータック	31.7	32	951,840	951,840
スタンレー電気	50.9	50.9	150,256	150,256
岩崎電気	4.1	3.6	8,085	8,085
ウシオ電機	40.9	37.6	79,223	79,223
ヘリオス テクノ ホールディング	13.3	—	—	—
日本セラミック	7.7	6.9	19,747	19,747
遠藤照明	—	4.8	4,910	4,910
古河電池	6.2	5.6	8,192	8,192
山一電機	6.3	6.1	14,060	14,060
図研	5.1	4.8	17,928	17,928
日本電子	14.6	15.2	143,944	143,944
カシオ計算機	64.5	53	78,122	78,122
ファナック	68	64	1,423,680	1,423,680
日本シイエムケイ	20.8	18.2	9,172	9,172
エンプラス	4.6	2.2	5,546	5,546
大真空	—	11.6	18,212	18,212
ローム	30	32.6	346,538	346,538
浜松ホトニクス	51.7	52.2	364,356	364,356
三井ハイテック	8.5	7.2	65,952	65,952
新光電気工業	24.7	21.3	113,955	113,955
京セラ	101.9	102.6	690,600	690,600
太陽誘電	32.3	35.3	220,978	220,978
村田製作所	212.5	214	1,793,320	1,793,320
双葉電子工業	12.9	14.5	9,990	9,990
北陸電気工業	5.7	6.1	7,722	7,722
ニチコン	25.3	23.1	26,842	26,842
日本ケミコン	—	7.3	13,147	13,147
KOA	11.6	11.2	17,136	17,136
市光工業	12.8	10.7	5,307	5,307

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
小糸製作所	43.1	39.9	260,547	260,547
ミツバ	—	15.6	7,160	7,160
SCREENホールディングス	12.6	12.7	146,050	146,050
キヤノン電子	7.6	7.7	11,442	11,442
キヤノン	359	362	905,000	905,000
リコー	184.7	202.3	202,906	202,906
象印マホービン	19.9	19.7	31,342	31,342
東京エレクトロン	45.9	46.2	2,764,608	2,764,608
輸送用機器 (8.1%)				
トヨタ紡織	21.3	29.6	66,274	66,274
ユニプレス	14.6	12.6	8,946	8,946
豊田自動織機	58.1	58.9	548,948	548,948
モリタホールディングス	12.7	12.4	15,785	15,785
三櫻工業	11.1	11.1	10,400	10,400
デンソー	159.2	160.5	1,337,125	1,337,125
東海理化電機製作所	19	19.3	28,641	28,641
川崎重工業	56.5	53.2	101,505	101,505
名村造船所	29.6	—	—	—
日本車輛製造	3.4	3.6	7,228	7,228
三菱ロジスネクスト	10.7	10.6	10,886	10,886
日産自動車	851.4	859.2	483,643	483,643
いすゞ自動車	209.5	228.5	350,062	350,062
トヨタ自動車	807.1	3,691.1	7,385,891	7,385,891
日野自動車	90	91.5	86,376	86,376
三菱自動車工業	270.9	269.9	98,783	98,783
エフテック	8.8	—	—	—
武蔵精密工業	16	16.4	29,060	29,060
日産車体	14.4	12.7	8,585	8,585
新明和工業	19	20.3	17,153	17,153
極東開発工業	13.5	13.4	18,786	18,786
トビー工業	7.2	7.9	8,302	8,302
ティラド	4.1	2.5	7,137	7,137
曙ブレーキ工業	—	44.8	8,691	8,691
タチエス	11.9	13.3	15,215	15,215
NOK	39	36	43,704	43,704
フタバ産業	21.3	20.8	8,008	8,008
KYB	8.2	7.5	21,780	21,780
大同メタル工業	18.3	18.4	10,451	10,451
プレス工業	40.5	39.7	14,808	14,808
太平洋工業	15.3	15.6	16,395	16,395
河西工業	13.4	—	—	—
アイシン	59.3	53.1	221,427	221,427
マツダ	213.5	228.8	210,038	210,038
今仙電機製作所	8.9	—	—	—
本田技研工業	569.4	573.8	1,779,353	1,779,353

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
スズキ	143.4	166.5	763,402	
SUBARU	224.4	208.7	447,139	
安永	4.5	5	4,815	
ヤマハ発動機	102.1	95	271,605	
TBK	13.1	14.5	5,698	
エクセディ	10.2	10.9	17,549	
豊田合成	23.4	23.5	53,321	
愛三工業	14.6	13.4	10,197	
日本ブラスト	8.8	—	—	
ヨロズ	8.9	8.9	9,380	
エフ・シー・シー	12	11.8	16,944	
シマノ	27.1	29.4	923,160	
テイ・エス テック	16.6	30.8	41,056	
ジャムコ	6.7	6.3	5,210	
精密機器 (3.0%)				
テルモ	204.5	206.3	954,756	
日機装	23.8	21.7	18,401	
日本エム・ディ・エム	5	4.7	9,099	
島津製作所	86.1	93.5	449,735	
JMS	8.3	8.1	4,779	
長野計器	7.4	5.9	9,976	
ブイ・テクノロジー	3.5	3.4	11,713	
東京計器	6.4	6.8	6,589	
インターアクション	4.6	3.9	9,067	
東京精密	13.2	12.2	58,560	
マニー	28.9	29.6	49,136	
ニコン	110.8	111.7	131,470	
トプコン	37.2	34.7	62,147	
オリンパス	400.4	382.7	971,675	
理研計器	6.2	5.7	30,609	
タムロン	6.4	5.7	14,381	
HOYA	143.6	142.3	2,564,246	
ノーリツ鋼機	5.6	6.7	18,378	
エー・アンド・ディ	9.1	7.6	8,496	
朝日インテック	82	80.1	199,288	
シチズン時計	80	83.8	43,492	
リズム	—	3.4	4,046	
メニコン	10.1	24	90,120	
松風	4.3	3.6	7,297	
セイコーホールディングス	9.6	10.1	22,199	
ニプロ	51.4	55.6	59,770	
その他製品 (2.2%)				
スノーピーク	5.8	9.6	37,200	
パラマウントベッドホールディングス	7.5	14	27,034	
トランザクション	6	5.5	5,318	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ニホンフラッシュ	7.6	7.2	7,668	
前田工織	7.7	8	28,080	
永大産業	15.6	20.5	5,576	
アートネイチャー	10.6	9.3	6,007	
バンダイナムコホールディングス	74.6	65.3	577,056	
SHOEI	6.2	7.2	34,560	
フランスベッドホールディングス	12.5	12.4	10,577	
パイロットコーポレーション	12.6	12.7	52,641	
萩原工業	5.2	5.8	7,690	
トッパン・フォームズ	14.8	—	—	
フジシールインターナショナル	15.9	17.7	36,426	
タカラトミー	32.1	31	30,969	
広済堂ホールディングス	8.8	5.4	4,422	
プロネクサス	7.6	7.6	7,714	
大建工業	5.5	4.6	9,926	
凸版印刷	100.6	110.4	190,219	
大日本印刷	94.3	86	229,018	
共同印刷	2.9	3.1	8,559	
NISSHA	14.6	15.2	23,985	
TAKARA & COMPANY	4.5	4.8	8,308	
アシックス	63.5	64.7	182,324	
ローランド	—	5.2	22,516	
小松ウオール工業	3.1	—	—	
ヤマハ	42.9	43.3	252,006	
河合楽器製作所	2.8	2.4	7,704	
クリナップ	9.3	—	—	
ピジョン	46.4	44.3	101,934	
オリバー	2	—	—	
キングジム	8.2	8.4	7,165	
リンテック	17	15.8	39,500	
イトーキ	20	19.7	6,737	
任天堂	44.4	41.2	2,064,120	
三菱鉛筆	11.5	12.1	14,677	
タカラスタンダード	13.2	16.4	22,402	
コクヨ	34.1	35.1	58,125	
ナカバヤシ	9.9	11.4	5,688	
グローブライト	3.1	6.5	22,490	
オカムラ	24.5	26.7	34,042	
美津濃	6.3	7.4	15,769	
電気・ガス業 (1.1%)				
東京電力ホールディングス	572.3	545.7	165,347	
中部電力	221.4	221	253,266	
関西電力	273.6	275.5	282,938	
中国電力	104.5	113.7	101,306	
北陸電力	66	68.2	38,396	

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
東北電力	179.1	168	132,048	
四国電力	66.2	66.5	50,207	
九州電力	147.7	147.8	119,865	
北海道電力	68.7	64.2	30,109	
沖縄電力	14.5	15.5	21,529	
電源開発	57.4	62.1	89,734	
エフオン	—	6.4	4,192	
イーレックス	10	10.9	27,882	
レノバ	12.6	14.2	75,970	
東京瓦斯	139.1	139.3	270,938	
大阪瓦斯	139.9	131.1	239,519	
東邦瓦斯	35.5	33.4	107,047	
北海道瓦斯	5.8	5.5	8,090	
広島ガス	22.7	20.4	7,160	
西部ガスホールディングス	8.4	8.4	17,808	
静岡ガス	20.3	18.8	18,198	
メタウォーター	7.4	8.5	16,575	
陸運業 (3.0%)				
SBSホールディングス	5.4	5.2	18,018	
東武鉄道	74.7	70.3	180,319	
相鉄ホールディングス	23.3	23.7	46,807	
東急	180.7	182.9	287,335	
東浜急行電鉄	92.1	93.3	104,682	
小田急電鉄	106.9	107.7	235,539	
京王電鉄	37.3	37.7	192,647	
京成電鉄	50.1	50.7	157,677	
富士急行	10	8.8	36,124	
新京成電鉄	3.3	3.5	6,895	
東日本旅客鉄道	127.6	128.4	897,002	
西日本旅客鉄道	64.7	88.4	432,983	
東海旅客鉄道	60.2	60.7	946,920	
西武ホールディングス	94.5	95.6	103,726	
鴻池運輸	11.6	11.9	12,959	
西日本鉄道	19.9	20.5	52,152	
ハマキョウレックス	5.8	5.2	14,820	
サカイ引越センター	3.9	3.3	13,843	
近鉄グループホールディングス	68.1	68.4	222,984	
阪急阪神ホールディングス	90.9	85.7	288,380	
南海電気鉄道	33	31.5	64,008	
京阪ホールディングス	30.3	30.8	78,478	
神戸電鉄	2.3	2.8	8,974	
名古屋鉄道	55.7	56.5	93,790	
山陽電気鉄道	6	6.7	12,931	
日本通運	23.6	23.8	153,986	
ヤマトホールディングス	113	96.6	241,886	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
山九	19.1	19.1	86,141	
丸全昭和運輸	5.9	5.7	18,040	
センコーグループホールディングス	37.8	33.2	30,743	
トナミホールディングス	1.9	1.9	6,688	
ニッコンホールディングス	24.7	23.7	46,997	
福山通運	8.8	11.2	42,112	
セイノーホールディングス	51	46.6	53,450	
神奈川中央交通	2.3	2.5	8,050	
日立物流	12.8	13.6	62,968	
丸和運輸機関	7.3	14.3	19,734	
C&Fロジホールディングス	7.5	7.8	11,715	
九州旅客鉄道	60.2	53.7	128,611	
S Gホールディングス	143.8	130.4	327,304	
海運業 (0.4%)				
日本郵船	58.2	57.5	425,500	
商船三井	44.3	38.1	247,650	
川崎汽船	14.3	21.3	103,731	
N Sユナイテッド海運	5.5	4	12,920	
明治海運	—	9.3	6,379	
飯野海運	39.1	33	17,061	
乾汽船	8.1	5.3	10,647	
空運業 (0.4%)				
日本航空	152.2	158.6	326,081	
ANAホールディングス	125.8	175.6	393,256	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム	2	2	16,100	
日新	6.7	6.3	9,594	
三菱倉庫	22	22.1	61,305	
三井倉庫ホールディングス	8.4	7.5	17,100	
住友倉庫	22.8	23.7	43,062	
澁澤倉庫	4.5	4.6	9,646	
東陽倉庫	20.9	19.9	6,069	
日本トランスシティ	18	16.4	9,085	
川西倉庫	4	3.5	3,734	
安田倉庫	7.6	7.4	6,882	
東洋埠頭	4.9	5.9	8,301	
上組	36.9	37.3	78,292	
近鉄エクスプレス	14.5	12.7	34,645	
エーアイティー	8	5.9	6,720	
内外トランスライン	—	3.2	5,843	
日本コンセプト	4.3	3	4,932	
情報・通信業 (8.6%)				
NECネットエスアイ	20.3	23.2	41,968	
システナ	25.5	101.2	47,766	
デジタルアーツ	3.6	3.9	36,777	

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	株数	株数	評価額	評価額
日鉄ソリューションズ	10.6		10.1		34,744	
キューブシステム	5.4		—		—	
コア	4.1		4		6,120	
ラクーンホールディングス	—		6		9,198	
ソリトンシステムズ	4.5		5		5,985	
ソフトクリエイティブホールディングス	3.4		3.3		14,470	
T I S	71.5		68.1		239,031	
電算システム	3.3		—		—	
グリー	45.6		44.1		44,011	
コーエーテックモホールディングス	14.7		22.8		108,414	
三菱総合研究所	3.2		3.1		11,501	
ファインデックス	8		8.7		8,821	
ブレインパッド	2.1		2		11,280	
K L a b	14.8		15.4		8,562	
ポルトゥウィン・ビット クルーホールディングス	10.6		11.6		11,182	
ネクソン	179.5		161.4		363,795	
アイスタイル	—		26		7,150	
エムアップホールディングス	2.5		2.3		9,890	
エイチーム	7.8		5.9		6,242	
エニグモ	7.7		8.9		8,677	
コロブラ	24.9		24.4		16,909	
ブロードリーフ	36.7		37.1		17,808	
デジタルハーツホールディングス	6.1		4.2		10,407	
システム情報	6.3		7		6,160	
メディアドゥ	2.5		2.7		12,352	
じげん	23.9		25.2		7,786	
ブイキューブ	4.7		7.8		8,853	
フィックスターズ	9.3		10.6		8,808	
CARTA HOLDINGS	4.8		3.5		7,455	
オブティム	4.3		6		8,622	
セレス	3.5		3		6,756	
S H I F T	3		3.6		91,152	
ティーガイア	6.1		7		11,312	
セック	1.6		—		—	
テクマトリックス	10.6		12.6		24,633	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17.8		19.8		60,192	
GMOペイメントゲートウェイ システムリサーチ	15.1		13.9		211,697	
インターネットイニシアティブ	2.9		3.1		5,660	
インターネット	10.9		19.1		92,826	
さくらインターネット	10.9		12.8		6,796	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1.7		1.8		7,191	
S R Aホールディングス	4.8		4.2		11,583	
e B A S E	9.8		10.2		6,568	
アバント	7.8		8.3		11,130	

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	株数	株数	株数	株数	評価額	評価額
アドソル日進	3.4		3.7		6,319	
フリービット	6.2		5.3		6,466	
コムチュア	8.3		8		28,280	
アステリア	6.4		7.9		6,343	
アイル	4.6		4.4		6,824	
マークライNZ	4.1		4.1		10,856	
メディカル・データ・ビジョン	8.7		10		13,290	
g u m i	10.9		11		8,976	
モバイルファクトリー	2.8		—		—	
テラスカイ	2.9		3.3		6,761	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4.6		4.3		5,981	
P C Iホールディングス	—		5.9		6,726	
P R T I M E S	—		1.7		5,414	
ラクス	—		24.7		75,829	
ダブルスタンダード	1.3		2.4		8,988	
オーブントア	5.3		4.7		8,586	
アカツキ	2.8		3.5		9,583	
Ubicomホールディングス	2.3		2.5		7,150	
L I N E	14.8		—		—	
カナミックネットワーク	8.1		10.6		5,204	
チェンジ	5.1		13.2		27,852	
オークネット	5.8		4.5		7,587	
A O I T Y O H O L D I N G S	11.2		—		—	
マクロミル	17.1		17.5		16,082	
オロ	2.8		2.6		8,840	
ユーザーローカル	—		3.4		5,528	
マネーフォワード	—		10.9		85,238	
電算システムホールディングス	—		3.3		7,441	
ソルクシーズ	4.7		—		—	
プロトコーポレーション	8.4		8.6		10,930	
野村総合研究所	100.7		138.1		673,928	
サイバネットシステム	8		—		—	
インテージホールディングス	11.1		9.3		16,284	
ソースネクスト	39.3		37.9		7,011	
インフォコム	7.9		8.1		15,462	
シンプレクス・ホールディングス	—		7.4		20,646	
H E R O Z	1.2		2.4		3,456	
ラクスル	6.1		7.9		49,454	
I P S	—		2.7		5,459	
イースル	—		6.5		4,329	
アルテリア・ネットワークス	9		9.8		15,082	
ウイングアーク1 s t	—		4.7		9,870	
サーバーワークス	—		1.4		5,110	
S a n s a n	—		25.6		80,128	
ギフティ	—		6.5		16,848	

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	
	株数	株数	評価額	評価額
ベース	—	1.5	6,262	
フォーカスシステムズ	6.9	7.2	7,365	
クレスコ	5.9	6.1	11,712	
フジ・メディア・ホールディングス	67.5	69.2	78,057	
オービック	24.6	22.5	472,275	
ジャストシステム	11.6	10.2	52,938	
TDCソフト	7.4	7.4	8,828	
Zホールディングス	976.3	1,040.9	782,756	
トレンドマイクロ	38.2	38.3	250,865	
IDホールディングス	3.9	—	—	
日本オラクル	14.5	14.6	162,936	
アルファシステムズ	2.7	2.1	8,001	
フューチャー	9	7.4	30,007	
CAC Holdings	6.1	5.3	7,934	
S Bテクノロジー	3	3.6	9,705	
オービックビジネスコンサルタント	7.3	6.8	34,680	
伊藤忠テクノソリューションズ	32.4	32.5	120,087	
アイティフォー	10.9	10.4	8,236	
大塚商会	38.4	38.6	200,334	
サイボウズ	8.9	9.8	21,197	
電通国際情報サービス	4.5	10.2	37,536	
ACCESS	9	10.5	8,011	
デジタルガレージ	13	11.9	59,262	
イーエムシステムズ	12.2	14.8	10,286	
ウェザーニューズ	2.6	2.2	21,164	
C I J	7.1	7.3	5,876	
WOWOW	3.8	4	8,136	
スカラ	7.7	10.3	6,262	
IMAGICA GROUP	10.1	7.3	5,745	
ネットワンシステムズ	27.4	27.3	93,093	
アルゴグラフィックス	6.2	5.7	16,193	
マーベラス	14.1	14.3	10,238	
エイベックス	13.5	13	22,035	
日本ユニシス	22.5	22.5	73,800	
兼松エレクトロニクス	3.9	3.9	14,040	
都築電気	—	4.4	7,576	
TBSホールディングス	43.1	43.7	74,945	
日本テレビホールディングス	58.4	59.8	68,770	
朝日放送グループホールディングス	10.6	10.9	7,433	
テレビ朝日ホールディングス	19.5	17.6	26,259	
スカパーJ SATホールディングス	49.2	60.7	24,583	
テレビ東京ホールディングス	5.9	5.8	11,756	
ビジョン	10.8	12.7	16,751	
USEN-NEXT HOLDINGS	3.8	7	22,645	
コネクシオ	5	5.7	8,019	

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	—	—	
日本電信電話	948.9	836.5	2,614,062	
KDDI	517.3	521.6	1,721,280	
ソフトバンク	645	1,083.9	1,693,593	
光通信	7.3	8.4	138,264	
NTTドコモ	144.7	—	—	
エムティーアイ	10.3	10.4	6,073	
GMOインターネット	26	25.7	73,450	
ファイバーゲート	—	3.4	3,668	
KADOKAWA	19.6	21	126,420	
学研ホールディングス	9.9	11.1	10,855	
ゼンリン	15.1	13.6	12,716	
アイネット	5.2	5.8	7,540	
松竹	4.8	4.9	53,704	
東宝	41.9	42.2	213,110	
東映	2.6	2.3	42,780	
エヌ・ティ・ティ・データ	188.9	190	454,860	
ビー・シー・エー	1.6	4.9	7,168	
ビジネスブレイン太田昭和	—	3.3	6,481	
DTS	15.5	13.1	31,007	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30.5	33.3	197,469	
シーイーシー	8.2	8.8	10,929	
カブコン	33.7	67.4	190,674	
アイ・エス・ビー	—	4.7	4,761	
ジャステック	6.1	5.9	6,006	
SCSK	16.5	49.6	106,888	
日本システムウエア	3.1	3.3	7,101	
アイネス	8.1	7.6	10,564	
TKC	5.9	11.9	39,151	
富士ソフト	7.6	7.6	40,128	
NSD	23.2	22.8	48,267	
コナミホールディングス	25.9	26.1	151,641	
福井コンピュータホールディングス	3.3	3.7	14,134	
JBCホールディングス	6.2	5.9	10,401	
ミロク情報サービス	7	7.6	11,126	
ソフトバンクグループ	563.2	429.1	2,587,473	
卸売業（5.1%）				
伊藤忠食品	2.1	2	9,810	
エレマテック	8.6	7	7,063	
JALUX	3.5	—	—	
あらた	5.6	5.6	21,560	
トーメンデバイス	—	1.2	8,064	
東京エレクトロン デバイス	3.4	2.1	14,217	
フィールズ	11.1	10	5,320	
双日	393.1	78.9	126,713	

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
アルフレッサ ホールディングス	79.2	79.7	122,578	
横浜冷凍	18.8	21.5	17,264	
アルコニックス	8	7.9	9,282	
神戸物産	49	55.7	238,396	
あい ホールディングス	10.2	10.6	20,542	
ダイワボウホールディングス	6	34.8	62,953	
マクニカ・富士エレホールディングス	17.4	16.9	43,230	
ラクト・ジャパン	3.2	2.8	6,540	
グリムス	—	3.3	8,332	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14	14.7	11,245	
八洲電機	8.8	8.4	7,560	
レスターホールディングス	7.8	6.6	12,223	
ジュテックホールディングス	3.2	3.1	3,202	
TOKAIホールディングス	37.2	33.6	27,753	
三洋貿易	8.9	8.9	8,624	
ビューティガレージ	—	1.5	5,602	
ウイン・パートナーズ	6.5	5.6	5,264	
シップヘルスケアホールディングス	11.4	22.9	57,937	
コメダホールディングス	15.5	16.3	31,687	
アセンテック	—	3.7	4,317	
フルサト・マルカホールディングス	—	7.1	14,192	
ヤマエグループホールディングス	—	6.2	6,218	
小野建	7.5	7.3	11,475	
佐鳥電機	7.6	6.2	5,772	
伯東	5.7	4.8	10,680	
コンドーテック	7.7	7.6	7,296	
ナガイレーベン	9.3	9.8	22,951	
三菱食品	6.9	6.4	17,216	
松田産業	6.5	5.3	14,315	
第一興商	10.5	13.9	49,762	
メディバルホールディングス	76.4	77.1	157,284	
S P K	5.4	5.3	6,890	
萩原電気ホールディングス	3.5	3.5	6,972	
アズワン	4.7	5.1	71,655	
尾家産業	3.6	5	5,230	
シモジマ	6	6.3	6,797	
ドウシシャ	6.9	7.5	11,010	
高速	5.6	5.2	7,659	
丸文	—	8.6	7,361	
ハビネット	7.3	6.9	9,860	
日本ライフライン	21.6	21.9	23,170	
タカショー	—	7.4	5,291	
マルカ	3.8	—	—	
IDOM	19.1	22.5	15,502	
進和	5.4	5	9,700	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ダイترون	4.3	3.6	7,250	
シークス	9.5	11.1	14,774	
オーハシテクニカ	5.6	5.4	7,932	
白銅	—	2.8	6,594	
伊藤忠商事	498.4	501.7	1,635,542	
丸紅	742.5	706.9	719,270	
長瀬産業	39.4	39.2	65,973	
蝶理	5.4	4.8	8,217	
豊田通商	79.1	71.9	356,264	
三共生興	16.4	12.8	7,001	
兼松	26.5	25.5	31,390	
三井物産	616.9	557	1,424,249	
日本紙パルプ商事	3.9	3.9	13,942	
カメイ	9.9	8.8	8,729	
スターゼン	2.6	5.9	10,879	
山善	26.7	28.6	27,799	
椿本興業	1.9	1.8	6,984	
住友商事	449.3	452.5	699,565	
内田洋行	2.8	3.2	14,832	
三菱商事	467.2	537.7	1,823,340	
第一実業	3.5	3.3	16,137	
キャノンマーケティングジャパン	17.9	17.7	38,940	
西華産業	6.2	5.2	7,836	
佐藤商事	7.7	6.9	7,334	
菱洋エレクトロ	7.2	5.4	12,144	
東京産業	10.5	8.5	6,281	
ユアサ商事	6.6	6.6	18,460	
神鋼商事	2.7	2	6,290	
阪和興業	13.3	14.1	43,287	
正栄食品工業	4.8	4.6	17,365	
カナデン	7.4	7.7	7,592	
菱電商事	6.5	6.5	10,900	
フルサト工業	5	—	—	
岩谷産業	18.7	17.1	97,983	
ナイス	—	3	4,836	
極東貿易	3.3	2.7	6,296	
アステナホールディングス	12.9	12.1	5,880	
三愛石油	17.4	17.7	20,956	
稲畑産業	14.9	14.7	22,476	
G S I クレオス	—	5.4	5,513	
明和産業	10	7	5,733	
ヤマエ久野	6.8	—	—	
ワキタ	15.4	15.6	16,005	
東邦ホールディングス	23	23	38,916	
サンゲツ	20.1	20.2	30,683	

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
ミツウロコグループホールディングス	10.8	10.9	12,698	
シナネンホールディングス	3.8	3	10,260	
伊藤忠エネクス	15.1	14.9	14,169	
サンリオ	20	22.6	56,025	
サンワテクノス	7	5.1	8,542	
リョーサン	7.9	8.1	17,074	
新光商事	13.8	12.7	11,087	
トーヨー	4.7	5.2	7,150	
三信電気	5.1	4.4	6,138	
東陽テクニカ	9.6	8.7	9,369	
モスフードサービス	9.6	9.4	28,717	
加賀電子	6.7	6.5	19,058	
ソーダニッカ	12	10.9	7,368	
立花エレクトック	6	6.2	9,417	
PALTA C	11.4	10.1	44,490	
太平洋興発	7.5	7.7	4,550	
西本Wismettacホールディングス	2.8	2	6,440	
コア商事ホールディングス	—	7.7	4,566	
国際紙バルブ商事	24.7	17.8	5,535	
ヤマタネ	6.5	4.7	7,125	
日鉄物産	4.5	4.9	22,564	
泉州電業	3	2.2	10,098	
トラスコ中山	16.3	14.5	38,149	
オートボックスセブン	27	24.8	32,463	
モリト	9.7	9.5	6,089	
加藤産業	9.6	9.7	30,749	
イノテック	6	5.5	7,447	
イエローハット	13.9	12.2	18,910	
J Kホールディングス	8.5	6.8	7,004	
日伝	6.8	6	13,080	
杉本商事	4.7	4.2	8,778	
因幡電機産業	19.6	18.6	45,737	
東テク	3.1	3	6,975	
ミスミグループ本社	89.2	90	430,650	
タキヒヨー	3.8	3.8	6,422	
スズケン	30.4	28.2	86,997	
ジェコス	7	7.5	5,760	
小売業 (4.2%)				
ローソン	18.3	15.9	88,086	
サンエー	5.4	5	19,950	
カワチ薬品	5.6	5.9	12,738	
エービーシー・マート	11	11.1	59,274	
アスクル	7.4	11.9	16,886	
ゲオホールディングス	13.2	10.2	12,127	
アダストリア	10.4	7.9	14,717	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
くら寿司	4.3	7.5	28,050	
キャンドゥ	5	3.9	9,028	
バルグループホールディングス	8.7	7	10,822	
エディオン	30.8	30.8	30,769	
サーラコーポレーション	16.4	16.5	9,388	
ハローズ	2.8	3.4	8,999	
フジオフードグループ本社	7.5	7.9	10,617	
あみやき亭	2.3	2.7	7,749	
ひらまつ	26.9	—	—	
大黒天物産	2.1	2.4	14,688	
ハニーズホールディングス	7.5	7.1	7,100	
アルベン	5.9	5.7	12,391	
クオールホールディングス	10.2	9.3	12,843	
ジンズホールディングス	3.8	5	32,250	
ビックカメラ	42.1	41.5	38,885	
D C Mホールディングス	41.7	43.3	45,508	
Monotaro	50.8	90.9	205,070	
アークランドサービスホールディングス	6.5	6.1	13,749	
J. フロント リテイリング	85.8	86.3	80,431	
ドール・日レスホールディングス	9.5	12.2	18,507	
マツキヨココカラ&カンパニー	29.2	44	195,800	
ブロンコビリー	4.3	5.1	11,617	
Z O Z O	49.7	49.6	179,304	
物語コーポレーション	1.9	3.8	27,550	
ココカラファイン	7.3	—	—	
三越伊勢丹ホールディングス	123.9	125.5	97,388	
Hamee	3.6	—	—	
ウエルシアホールディングス	42.3	37.9	152,547	
クリエイトSDホールディングス	11.7	10.2	31,824	
テムニー	3.5	4.8	5,899	
シュッピン	7.6	7.1	6,908	
オイシックス・ラ・大地	7.1	10.3	34,402	
ネクステージ	12.8	14.4	32,976	
ジョイフル本田	20.2	20.1	31,356	
鳥貴族ホールディングス	3.4	3.6	5,958	
ホットランド	7.5	7.6	9,880	
すかいらーくホールディングス	80.6	93.1	136,763	
S F Pホールディングス	5.4	5.1	6,635	
綿半ホールディングス	6.8	7	8,505	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20	19.4	19,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	5	5,045	
B E E N O S	4.3	4	10,928	
あさひ	5.8	6.3	8,089	
日本調剤	5.4	5.2	6,588	

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
コスモス薬品	6.3	7.2	126,792	
セブン&アイ・ホールディングス	278.8	280.9	1,279,218	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	40.3	38.8	26,384	
ツルハホールディングス	15.5	15.6	199,680	
サンマルクホールディングス	6.3	7.7	10,841	
トリドールホールディングス	18.1	17.7	42,851	
TOKYO BASE	9.8	8.3	5,552	
JMホールディングス	5.7	5.6	9,643	
アレンザホールディングス	—	6.4	6,534	
串カツ田中ホールディングス	—	2.5	4,832	
パロックジャパンリミテッド	8.4	7.7	6,344	
クスリのアオキホールディングス	6.4	7.2	51,768	
力の源ホールディングス	4.5	—	—	
FOOD & LIFE COMPANIES	39.3	42	202,650	
メディカルシステムネットワーク	9.8	8.6	5,332	
ノジマ	12.8	11.5	25,587	
カッパ・クリエイト	10.8	11.3	14,995	
良品計画	95	82.7	151,754	
アドヴァングループ	11.5	9.4	8,300	
アルビス	3.6	3.3	6,976	
コナカ	18.7	—	—	
G-7ホールディングス	4.5	8.1	13,397	
イオン北海道	12.1	13.2	17,608	
コジマ	14.6	13.4	7,450	
コーナン商事	10.3	10.3	34,196	
エコス	3.2	3.3	5,768	
ワタミ	10.1	10.4	8,840	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	156.8	143.5	277,816	
西松屋チェーン	16.4	15.7	23,502	
ゼンショーホールディングス	34.3	35.4	91,367	
幸楽苑ホールディングス	6.1	6.8	9,608	
サイゼリヤ	10.8	10.9	31,893	
V Tホールディングス	33.2	27.9	11,745	
フジ・コーポレーション	3	5.6	6,518	
ユナイテッドアローズ	8.2	7.8	14,843	
ハイデイ日高	9.7	10.3	16,181	
コロワイド	22	30.2	45,964	
ピーシーデポコーポレーション	12.8	—	—	
荳番屋	5	5.2	23,062	
スギホールディングス	14.3	14.4	102,816	
薬王堂ホールディングス	3.6	3.9	8,338	
スクロール	14.3	11.9	9,127	
ヨンドシーホールディングス	7.5	7.6	12,122	
木曽路	8.7	10	20,880	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
SRSホールディングス	12	14.6	10,833	
千趣会	17.8	17.9	6,945	
リテールパートナーズ	10.2	9.6	11,635	
ケーヨー	14.8	15.2	12,205	
上新電機	7.9	7.8	15,974	
日本瓦斯	11.3	34.9	49,453	
ロイヤルホールディングス	12.4	12.7	23,101	
いなげや	8.7	9.3	12,099	
島忠	13.2	—	—	
チヨダ	9.6	12.1	8,494	
ライフコーポレーション	5.7	6.7	22,478	
リンガーハット	9.3	9.7	20,719	
MrMaxHD	12.5	11.6	6,136	
AOKIホールディングス	17.2	15.6	9,578	
オークワ	11.5	12.5	11,937	
コメリ	11.2	10.7	26,150	
青山商事	18.9	17.1	12,294	
しまむら	8.2	8.3	80,510	
高島屋	52.4	52.7	52,436	
松屋	15.7	15.4	12,905	
エイチ・ツー・オー リテイリング	32.2	33.2	26,228	
近鉄百貨店	3	3.4	8,255	
丸井グループ	65.7	61	127,246	
アクシアル リテイリング	5.8	5.5	17,930	
イオン	274.2	276.1	730,146	
イズミ	14.8	13.1	41,199	
平和堂	13.2	12.5	23,162	
フジ	8.2	8.7	16,704	
ヤオコー	7.9	8.2	54,858	
ゼビオホールディングス	9.8	10.6	9,317	
ケーズホールディングス	68	65.7	75,489	
Olympicグループ	5.8	—	—	
日産東京販売ホールディングス	18.4	21.5	4,837	
Genky DrugStores	3.3	3.2	16,384	
ブックオフグループホールディングス	5.9	5.6	5,432	
ギフト	—	1.6	4,217	
アインホールディングス	8.9	10.6	64,766	
元気寿司	2.6	2.8	6,848	
ヤマダホールディングス	215.4	263.4	104,306	
アークランドサカモト	11.8	11.5	19,078	
ニトリホールディングス	30.8	28.6	515,658	
グルメ杵屋	8.4	10.8	10,605	
吉野家ホールディングス	24.4	25.6	56,960	
松屋フーズホールディングス	3.1	3.6	12,348	
サガミホールディングス	10.1	13.7	13,576	

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
関西スーパーマーケット	6.9	5.9	10,820	
王将フードサービス	5	4.7	27,166	
ブレナス	7.5	8.3	16,060	
ミニストップ	6.5	6.6	8,982	
アークス	14.2	13.1	27,077	
パローホールディングス	15.2	15.4	32,586	
ベルク	3.6	3.2	16,832	
大庄	5.4	—	—	
ファーストリテイリング	9.5	9.6	647,040	
サンドラッグ	26.7	27	80,703	
サックスパー ホールディングス	9.2	—	—	
ペルーナ	16.6	16.7	11,138	
銀行業（4.7%）				
じもとホールディングス	5.5	—	—	
めぶきフィナンシャルグループ	370.2	369.6	82,790	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10.6	9.7	13,512	
九州フィナンシャルグループ	155.3	141.4	53,732	
ゆうちょ銀行	202	168.2	156,089	
富山第一銀行	18.1	16.8	4,468	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	407.2	406.8	168,008	
西日本フィナンシャルホールディングス	47	47	32,054	
関西みらいフィナンシャルグループ	42.5	—	—	
三十三フィナンシャルグループ	6.7	8.7	11,788	
第四北越フィナンシャルグループ	12.9	11.7	26,910	
ひろぎんホールディングス	106.6	106.2	66,056	
おきなわフィナンシャルグループ	—	7	14,462	
十六フィナンシャルグループ	—	10.1	19,957	
北國フィナンシャルホールディングス	—	7.4	15,643	
新生銀行	52.8	46.7	89,477	
あおぞら銀行	42.4	39.4	97,396	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,879.9	4,609.1	2,771,912	
りそなホールディングス	774.1	822.5	341,831	
三井住友トラスト・ホールディングス	134.5	135.1	480,956	
三井住友フィナンシャルグループ	493.2	497.6	1,842,612	
千葉銀行	237.8	240.4	158,904	
群馬銀行	138.6	133.9	44,320	
武蔵野銀行	11.2	11.2	17,449	
千葉興業銀行	20.2	—	—	
筑波銀行	30.1	—	—	
七十七銀行	24.2	22.9	26,472	
青森銀行	5.6	5.6	8,920	
秋田銀行	4.8	4.3	6,149	
山形銀行	8.7	10.6	8,596	
岩手銀行	5	6	9,660	
東邦銀行	63.6	73.1	14,181	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
東北銀行	4	4	3,856	
みちのく銀行	5.5	4.5	3,289	
ふくおかフィナンシャルグループ	60.2	59.8	109,912	
静岡銀行	170.4	173.8	139,040	
十六銀行	9.1	—	—	
スルガ銀行	74.4	63.4	29,861	
八十二銀行	166.6	155.6	55,393	
山梨中央銀行	9.2	10.8	8,510	
大垣共立銀行	14.2	14.2	25,148	
福井銀行	6	8	10,656	
北國銀行	7.3	—	—	
清水銀行	3	4.4	6,670	
富山銀行	1.5	2.4	4,070	
滋賀銀行	14.1	13.5	23,638	
南都銀行	12	11.6	20,764	
百五銀行	66.3	69.9	22,228	
京都銀行	25.4	25.5	123,037	
紀陽銀行	25.6	25.1	34,110	
ほくほくフィナンシャルグループ	47.4	44.6	34,342	
山陰合同銀行	44.2	43.9	24,759	
中国銀行	61	55.9	46,732	
伊予銀行	100.7	91.9	48,155	
百十四銀行	7.9	9.2	12,420	
四国銀行	11.5	13.4	9,433	
阿波銀行	11.6	11.3	22,995	
大分銀行	4.2	5.5	9,240	
宮崎銀行	5	5.4	10,540	
佐賀銀行	4.7	4.5	6,336	
沖縄銀行	6.5	—	—	
琉球銀行	17.1	18.2	12,958	
セブン銀行	240.4	210.5	47,994	
みずほフィナンシャルグループ	969.1	919.4	1,288,998	
山口フィナンシャルグループ	89.2	83.1	51,605	
名古屋銀行	5.5	5.8	12,719	
北洋銀行	110.4	109.8	25,363	
愛知銀行	2.5	2.9	10,164	
中京銀行	3	4.7	5,569	
大光銀行	2.5	—	—	
愛媛銀行	10.3	13.1	9,432	
京葉銀行	31.9	33.5	14,137	
栃木銀行	40.1	46	8,004	
北日本銀行	2.7	—	—	
東和銀行	14.2	17.4	8,352	
トモニホールディングス	58.5	60.3	17,547	
フィデアホールディングス	75	8.5	10,174	

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
池田泉州ホールディングス証券・商品先物取引業 (0.7%)	88.8	94.2	14,035	
F P G	22	26.4	14,546	
ジャパンインベストメントアドバイザー	—	6.7	7,658	
S B Iホールディングス	81.8	88.2	257,896	
ジャフコグループ	11.2	9.2	65,504	
大和証券グループ本社	572.1	538.1	339,487	
野村ホールディングス	1,254.4	1,098.6	524,471	
岡三証券グループ	62.6	56.7	20,922	
丸三証券	22.1	24.3	12,125	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82.5	79.2	29,462	
水戸証券	26.5	24.7	6,644	
いちよし証券	16.3	16.3	10,089	
松井証券	41.9	35.3	27,569	
マネックスグループ	56.3	58.6	54,556	
極東証券	10.9	9.7	7,100	
岩井コスモホールディングス	7	8.1	10,465	
アイザワ証券グループ	14.5	12.5	12,325	
スパークス・グループ	35.8	38.7	12,074	
保険業 (1.9%)				
かんぽ生命保険	25.5	72.5	127,455	
SOMPOホールディングス	134.1	126.8	592,663	
アニコムホールディングス	24.5	22.2	17,249	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	186.4	161	533,876	
第一生命ホールディングス	403.2	353.9	809,369	
東京海上ホールディングス	252.2	236.7	1,351,083	
T & Dホールディングス	213.2	186.2	249,880	
アドバンスクリエイト	1.8	4	3,924	
その他金融業 (1.1%)				
全国保証	20.4	17.3	85,808	
ジェイリース	—	2.8	5,754	
イントラスト	—	5.1	3,697	
日本モーゲージサービス	3.5	4.1	4,255	
C A S A	3	—	—	
アルヒ	11.8	12.2	12,212	
プレミアアグループ	4	4.2	14,700	
クレディセゾン	50.1	45.8	51,479	
芙蓉総合リース	7.4	7.4	53,132	
みずほリース	11.2	11.1	32,900	
東京センチュリー	14.3	13.7	74,254	
日本証券金融	34.7	29.4	23,931	
アイフル	110.9	121.5	42,768	
リコーリース	6	6.8	24,582	
イオンフィナンシャルサービス	44.2	38.5	47,239	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
アコム	143.6	141.9	47,820	
ジャックス	8.5	8.2	22,574	
オリエントコーポレーション	203.5	196.9	24,415	
日立キャピタル	17.4	—	—	
オリックス	441.2	436.7	980,391	
三菱HCキャピタル	175.5	261	139,374	
日本取引所グループ	204.6	181.9	447,292	
イー・ギャランティ	8.8	11.2	27,518	
NECキャピタルソリューション	3.3	3.4	6,507	
不動産業 (1.9%)				
いちご	89	83.3	23,657	
日本駐車場開発	99.2	93.1	12,661	
スター・マイカ・ホールディングス	4.8	5.2	6,442	
S R Eホールディングス	—	1.9	17,195	
ヒューリック	152	170.8	183,780	
三栄建築設計	3.8	3.9	6,321	
野村不動産ホールディングス	43.2	38.1	93,916	
三重交通グループホールディングス	18.8	18.4	8,390	
サムティ	10.3	10.1	23,088	
ディア・ライフ	14.3	12.8	6,732	
日本商業開発	6.1	7	11,837	
プレサンスコーポレーション	11.3	10.8	18,511	
日本管理センター	6	5.6	5,723	
フージャースホールディングス	17.3	13.3	8,379	
オープンハウス	22.6	22.8	146,832	
東急不動産ホールディングス	194.4	210.2	123,177	
飯田グループホールディングス	59	60.2	141,349	
ムゲンエステート	10.2	—	—	
ビーロッド	5.7	—	—	
ハウズドゥ	4.7	—	—	
シーアールイー	—	3.1	5,186	
ケイアイスター不動産	—	3.4	29,002	
グッドコムアセット	—	4.4	5,319	
ジェイ・エス・ビー	2.1	2.1	5,741	
パーク24	39	38.9	62,629	
バラカ	3.1	4.4	6,626	
宮越ホールディングス	5.2	4.3	5,172	
三井不動産	346.5	327.6	765,273	
三菱地所	500	471.9	738,523	
平和不動産	13.1	13	44,200	
東京建物	71.1	71	114,168	
ダイビル	18.8	18.9	27,669	
京阪神ビルディング	11.1	12.9	17,763	
住友不動産	160.2	150.8	533,681	
テーオーシー	16.9	16.2	9,007	

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
東京楽天地	1.7	2.1	8,358	
スターツコーポレーション	8.9	10.4	25,261	
フジ住宅	11.8	11.6	7,702	
空港施設	11.4	13.2	6,930	
ゴールドクレスト	6.9	6.9	10,294	
エスリード	4	—	—	
日神グループホールディングス	14.5	15.4	7,161	
日本エスコン	13.5	16.1	12,075	
タカラレーベン	36.4	37.4	9,948	
A V A N T I A	7	7.8	6,458	
イオンモール	36.1	35.8	57,530	
ファースト住建	4.8	—	—	
カチタス	18	18.2	76,258	
トーセイ	11.6	11.5	11,074	
サンフロンティア不動産	12.4	11.7	11,208	
FJネクストホールディングス	7.6	8.8	8,562	
ランドビジネス	11.6	—	—	
日本空港ビルデング	22.8	27.5	137,500	
サービス業（6.4%）				
日本工営	4.9	4.3	13,631	
L I F U L L	28.5	27.1	6,991	
ミクシィ	13.4	16	32,336	
ジェイエイシーリクルートメント	5.8	6.1	12,126	
日本M&Aセンターホールディングス	53	114.5	381,857	
メンバーズ	2.8	2.6	6,065	
U Tグループ	11	10.1	40,905	
アイティメディア	3.3	3.9	7,823	
タケエイ	8.6	—	—	
E・Jホールディングス	—	4.8	5,659	
夢真ビーネックスグループ	10.5	18.8	31,320	
コシダカホールディングス	19.8	19.2	11,481	
パソナグループ	8	7.5	26,587	
リンクアンドモチベーション	16.8	16.6	11,736	
G C A	12.1	—	—	
エス・エム・エス	22	23.9	101,216	
パーソルホールディングス	69.6	69.7	228,616	
リニカル	5.9	6.8	5,786	
クックパッド	30	29.6	7,577	
学情	4.1	—	—	
スタジオアリス	4.6	4	8,088	
シミックホールディングス	5.1	5.4	8,348	
総合警備保障	27.3	27.6	133,584	
カカクコム	51.5	51.7	164,147	
アイロムグループ	3.3	3.2	5,468	
ルネサンス	6.2	6.7	7,564	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ディップ	9.7	12.3	48,954	
デジタルホールディングス	5.8	5.4	7,506	
新日本科学	10.2	9.2	14,858	
ツクイホールディングス	19.6	—	—	
ベネフィット・ワン	25.4	25.3	134,596	
エムスリー	152.4	123	752,637	
アウトソーシング	40.3	40.4	60,761	
ウェルネット	11.7	15.2	6,824	
ワールドホールディングス	3	3.2	8,092	
ディー・エヌ・エー	30.1	27	45,360	
博報堂DYホールディングス	95.4	96.8	163,882	
ぐるなび	15.2	14.7	6,894	
タカミヤ	12.5	14.9	6,407	
ジャパンバスターシスシステム	7.1	5.7	5,443	
ファンコミュニケーションズ	22.8	23.3	9,413	
ライク	3.2	—	—	
エスプール	18	19.8	25,245	
W D Bホールディングス	3.6	3.5	10,937	
手間いらず	—	1.1	5,676	
アドウェイズ	—	11.5	8,774	
バリューコマース	4.9	5.5	24,860	
インフォマート	71.1	77.1	79,104	
J Pホールディングス	28.8	26.3	6,443	
E P Sホールディングス	10.8	—	—	
プレステージ・インターナショナル	26.8	26.8	18,492	
アミューズ	4.5	4.7	8,906	
ドリームインキュベータ	4	—	—	
クイック	5.4	6.1	8,558	
ケネディクス	58	—	—	
電通グループ	77.9	71.9	259,559	
びあ	1	2.8	10,556	
イオンファンタジー	3.4	3.7	6,430	
シーティーエス	9.3	9.8	7,634	
ネクシィーズグループ	4.8	—	—	
H. U. グループホールディングス	19.6	18.6	53,233	
アルプス技研	6.4	6.8	12,716	
日本空調サービス	10	10	7,790	
オリエンタルランド	73.5	82.3	1,468,232	
ダスキン	16.6	16.5	43,180	
明光ネットワークジャパン	12.4	12.3	6,654	
ファルコホールディングス	5.1	4.5	7,618	
ラウンドワン	20.4	19.8	25,918	
リゾートトラスト	32.3	32.5	60,450	
ビー・エム・エル	8.7	9	31,770	
りらいあコミュニケーションズ	12.6	11.5	11,603	

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
リゾー教育	37.9	33.8	13,689	
ユー・エス・エス	76.8	78.2	130,281	
東京個別指導学院	—	8.5	5,304	
サイバーエージェント	42.8	172	359,996	
楽天グループ	323.1	358.3	415,986	
クリーク・アンド・リバー社	5	4.2	8,395	
モーニングスター	—	16.6	10,026	
テー・オー・ダブリュー	17.7	—	—	
山田コンサルティンググループ	5.6	5	5,565	
セントラルスポーツ	3.4	3.9	9,137	
フルキャストホールディングス	7.1	6.1	16,152	
エン・ジャパン	12.3	11.3	40,002	
テクノプロ・ホールディングス	13.9	41.9	130,728	
アイ・アールジャパンホールディングス	2.8	3.3	23,397	
KeepPer 技研	6.2	4.6	11,840	
Gunosy	5.8	—	—	
イー・ガーディアン	3.5	3.3	11,500	
ジャパンマテリアル	21.5	21.5	33,368	
ベクトル	10.3	10.5	13,114	
チャーム・ケア・コーポレーション	6.9	6	8,892	
キャリアリンク	—	3.4	4,297	
IBJ	7.6	7.4	7,548	
アサンテ	4.7	5.2	8,782	
N・フィールド	7.2	—	—	
バリューHR	4.2	4	10,024	
M&Aキャピタルパートナーズ	5.6	5.7	31,350	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.8	4	6,852	
ERIホールディングス	—	2.6	3,603	
シグマクシス・ホールディングス	5.5	4.5	12,604	
ウィルグループ	6.3	6.1	8,296	
メドピア	3.3	5.4	19,305	
リクルートホールディングス	495.3	537.4	3,708,597	
エラン	4.9	9.7	12,018	
日本郵政	564	910.1	779,045	
ベルシステム24ホールディングス	12	10.3	12,926	
鎌倉新書	6.4	9.2	7,130	
LITALICO	3	—	—	
エアトリ	—	4.7	14,828	
アトラエ	2.4	5.6	13,893	
ストライク	2.7	2.9	16,414	
ソラスト	19.3	17.3	21,348	
セラク	—	2.8	4,922	
インソース	3.4	7	17,171	
ペイカレント・コンサルティング	4.2	4.9	231,770	
Orchestra Holdings	—	1.8	7,146	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
アイモバイル	—	2.8	3,586	
グレイステクノロジー	3.3	11.9	5,021	
ジャパンエレベーターサービズホールディングス	8.1	21.9	46,537	
ウェルビー	—	5.6	7,778	
エル・ティー・エス	—	1.3	3,556	
ミダックホールディングス	—	3.1	15,391	
日総工産	6.7	7.7	6,221	
キュービーネットホールディングス	4	4.4	7,273	
RPAホールディングス	6.6	12.1	4,501	
スプリックス	4.1	—	—	
マネジメントソリューションズ	4.5	3.6	11,736	
プロレド・パートナーズ	1.1	—	—	
カーブスホールディングス	20	19.7	15,247	
ダイレクトマーケティングミックス	—	4	15,360	
ポピンズホールディングス	—	2.1	6,520	
LITALICO	—	5.9	24,721	
アドバンテッジリスクマネジメント	5.9	5.7	3,744	
リログループ	38.3	38.6	80,789	
東祥	5.7	6	10,044	
TREホールディングス	—	9.8	17,395	
人・夢・技術グループ	—	3.5	6,345	
エイチ・アイ・エス	11.1	15.6	30,279	
ラックランド	—	3.7	10,759	
共立メンテナンス	11.7	12.5	49,937	
イチネンホールディングス	8.8	8.2	10,660	
建設技術研究所	5.4	4.6	10,874	
スペース	6	—	—	
燦ホールディングス	4.5	4.4	6,098	
東京テアトル	4.4	6.1	7,374	
ナガワ	2.3	2.2	25,124	
よみうりランド	1	—	—	
東京都競馬	4.4	5.3	21,147	
カナモト	12.5	12.2	26,278	
東京ドーム	28.8	—	—	
西尾レントオール	6.3	6.5	16,373	
トランス・コスモス	6.9	9	28,350	
乃村工芸社	30.2	30.1	30,190	
日本管財	6.3	7.2	19,699	
トーカイ	6.5	6.1	11,888	
セコム	73.3	68.7	526,516	
セントラル警備保障	3.4	3.9	9,387	
丹青社	15.8	15.5	12,555	
メイテック	8.5	8.6	57,276	
応用地質	8.3	7.6	14,918	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	株数	期首(前期末)	期	末
		株数	株数	評価額
船井総研ホールディングス	14.7	14.4	36,849	
オオバ	8.2	8.1	6,156	
ベネッセホールディングス	23.7	23.8	52,336	
イオンディライト	8.1	8.5	30,132	
ナック	6	—	—	
ダイセキ	11.8	12.8	66,048	
合計	株数・金額	千株	千株	千円
	銘柄数<比率>	75,624.8	78,890.9	192,569,963
		1,648銘柄	1,659銘柄	<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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	期	末
	買建額	売建額
国内	百万円 4,815	百万円 —
T O P I X		

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

項目	期	末
	評価額	比率
株式	千円 192,569,963	% 97.6
コール・ローン等、その他	4,789,350	2.4
投資信託財産総額	197,359,314	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2021年11月30日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	197,359,314,147円
コール・ローン等	3,159,862,470
株式（評価額）	192,569,963,990
未収配当金	1,330,297,687
差入委託証拠金	299,190,000
(B) 負 債	304,994,395
未払金	280,946,773
未払解約金	24,033,101
その他未払費用	14,521
(C) 純資産総額(A-B)	197,054,319,752
元 本	61,173,269,127
次期繰越損益金	135,881,050,625
(D) 受益権総口数	61,173,269,127口
1万口当たり基準価額(C/D)	32,212円

※当期における期首元本額62,877,618,349円、期中追加設定元本額10,732,324,295円、期中一部解約元本額12,436,673,517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2020年12月1日 至2021年11月30日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,117,818,618円
受 取 配 当 金	4,119,293,254
受 取 利 息	1,572
そ の 他 収 益 金	711,505
支 払 利 息	△ 2,187,713
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	17,412,905,832
売 買 益	28,936,137,486
売 買 損	△ 11,523,231,654
(C) 先 物 取 引 等 損 益	204,008,900
取 引 益	744,403,500
取 引 損	△ 540,394,600
(D) そ の 他 費 用 等	△ 299,666
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	21,734,433,684
(F) 前期繰越損益金	117,608,389,911
(G) 解約差損益金	△ 27,114,163,119
(H) 追加信託差損益金	23,652,390,149
(I) 合 計(E+F+G+H)	135,881,050,625
次期繰越損益金(I)	135,881,050,625

※有価証券売買損益および先物取引等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。

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	9,444,432,886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>	108,824,691円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	893,111,379円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,852,669,865円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,314,610,252円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,648,623,694円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,302,572,824円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,291,332,987円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	123,293,850円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,040,556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）	4,679,600円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	166,358,728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）	20,378,358円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	748,263,991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）	62,968,056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>	46,344,355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）	145,617,764円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	259,277,705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）	123,379,159円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	856,981,897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）	223,865,395円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	603,670,244円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,383,108,545円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,898,722,676円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	18,142,394,620円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	374,931円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	277,082,196円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	42,261,700円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	326,588,940円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	47,434,130円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	215,307,143円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	34,163,089円
イオン・バランス戦略ファンド	14,508,106円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,669,461円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	29,487,863円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	115,063,306円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	154,290,540円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	248,882,682円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	142,287,008円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	61,933,489円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	489,286,600円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	39,574,438円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	261,074,601円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,375,595円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	295,921,518円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	45,508,490円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	33,623,909円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	613,464,436円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	440,586,720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）	180,359,966円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	14,302,327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>	237,022,466円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	71,078,321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>	110,132,461円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	69,299,615円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	259,324,316円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,018,342円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	64,476,018円
日興FWS・日本株インデックス	300,009,523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>	37,709,634円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	1,878,586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>	55,155,389円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,839,797,359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>	59,877,017円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	12,523,734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>	197,029,085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〉

(2020年6月23日から2021年6月21日まで)

第 **17** 期

決算日 2021年6月21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。

SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 1万口当たりの費用明細(2020年6月23日から2021年6月21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：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)	(2)	(0.014)	
(販売会社)	(2)	(0.013)	
(受託会社)	(4)	(0.027)	
(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：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)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	7	0.058	

期中の平均基準価額は13,041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(2020年6月23日から2021年6月21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
国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド	千口 2,654,525	千円 3,738,935	千口 4,130,753	千円 5,818,919

■ 組入れ資産の明細(2021年6月21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
国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド	千口 29,160,574	千口 27,684,346	千円 39,129,056

※国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンドの期末の受益権総口数は86,729,456千口です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年6月21日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	39,130,315,871円
コール・ローン等	9,866
国内債券(NOMURA-BPI) マザーファンド(評価額)	39,129,056,005
未 収 入 金	1,250,000
(B) 負 債	12,452,037
未 払 解 約 金	1,250,000
未 払 信 託 報 酬	10,707,037
そ の 他 未 払 費 用	495,000
(C) 純資産総額(A-B)	39,117,863,834
元 本	29,934,308,511
次 期 繰 越 損 益 金	9,183,555,323
(D) 受益権総口数	29,934,308,511口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	13,068円

※当期における期首元本額31,512,589,462円、期中追加設定元本額2,975,813,798円、期中一部解約元本額4,554,094,749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2020年6月23日 至2021年6月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 703円
支 払 利 息	△ 703
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	12,478,848
売 買 損 益	87,969,025
売 買 損 益	△ 75,490,177
(C) 信 託 報 酬 等	△ 22,754,674
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 10,276,529
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,807,852,723
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,385,979,129
(配 当 等 相 当 額)	(6,971,198,504)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 585,219,375)
(G) 計 (D+E+F)	9,183,555,323
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	9,183,555,323
追 加 信 託 差 損 益 金	6,385,979,129
(配 当 等 相 当 額)	(6,973,741,552)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 587,762,423)
分 配 準 備 積 立 金	4,143,751,608
繰 越 損 益 金	△1,346,175,414

※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(290,303,974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(6,973,741,552円)および分配準備積立金(3,853,447,634円)より分配可能額は11,117,493,160円(1万口当たり3,713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21期 (2020年6月23日から2021年6月21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。

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 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
		期中騰落率	(総合)	期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
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
21期(2021年6月21日)	14,134	0.0	387.33	0.0	99.5	122,582

※NOMURA-BPI (総合) は、野村證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證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證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、野村證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

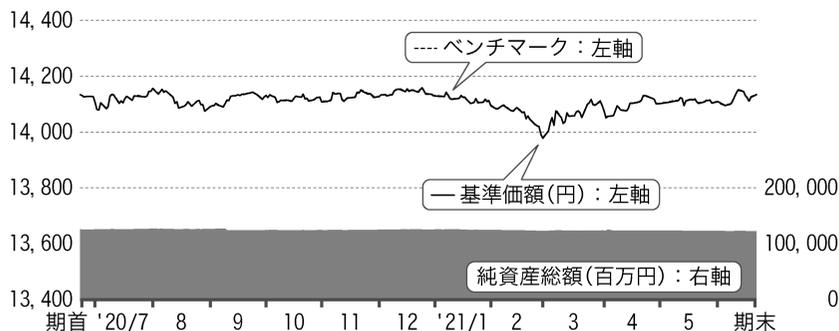
年月日	基準価額		(ベンチマーク)NOMURA-BPI		債券組入比率
		騰落率	(総合)	騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2020年6月22日	14,134	-	387.27	-	99.6
6月末	14,107	△0.2	386.56	△0.2	99.4
7月末	14,156	0.2	387.91	0.2	99.5
8月末	14,091	△0.3	386.09	△0.3	99.4
9月末	14,131	△0.0	387.22	△0.0	99.5
10月末	14,108	△0.2	386.63	△0.2	99.5
11月末	14,127	△0.0	387.12	△0.0	99.4
12月末	14,129	△0.0	387.20	△0.0	99.5
2021年1月末	14,094	△0.3	386.25	△0.3	99.5
2月末	13,978	△1.1	383.06	△1.1	99.4
3月末	14,076	△0.4	385.72	△0.4	99.5
4月末	14,102	△0.2	386.44	△0.2	99.5
5月末	14,109	△0.2	386.62	△0.2	99.4
(期末)					
2021年6月21日	14,134	0.0	387.33	0.0	99.5

※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 (2020年6月23日から2021年6月21日まで)

基準価額等の推移



期首	14,134円
期末	14,134円
騰落率	0.0%

※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、野村證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證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證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、野村證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 (2020年6月23日から2021年6月21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"> ・ 3月の日銀による金融政策の点検の結果、警戒されていた長期金利の変動幅拡大が実施されず、期末にかけて金利が低下（債券価格は上昇）したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ 新型コロナウイルス対策のための財政政策が大規模化したことに伴い、国債増発による需給悪化を警戒して、期初から超長期ゾーン中心に金利が上昇（債券価格は下落）したこと ・ 1月から2月にかけて、日銀が3月の金融政策の点検において金利の変動幅拡大を検討しているとの観測報道を受けて警戒感が強まる中で、金利が上昇したこと

▶ 投資環境について (2020年6月23日から2021年6月21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（債券価格は下落）しました。

新型コロナウイルス感染症の拡大が続く中、景気対策のための財政政策の拡大に伴う国債増発リスクが意識され、期初から長期金利はプラス圏で推移しました。日銀のイールドカーブコントロール（長短金利操作）により、長期金利の上昇が抑制される状況がしばらく続きましたが、12月に日銀は2%の物価目標を実現するためのより効果的で持続的な金融緩和の点検を行い、3月会合を目的に結果を公表することを決定しました。2021年1月から3月初めにかけては、大規模な経済対策への警戒感から米長期金利が上昇基調で推移したことや、日銀が長期金利の許容変動幅の拡大を検討しているとの報道から、3月に発表される金融政策の点検結果への警戒感が強まり、長期金利は上昇しました。3月の日銀による金融政策の点検の結果、長期金利の変動幅が±0.25%程度に明確化されるにとどまり、会合後の日銀総裁会見では、コロナ禍においてはイールドカーブ（利回り曲線）全体を低位に抑制する姿勢が示されたことから、期末にかけて長期金利は緩やかに低下しました。

当期の市場の動きを10年国債利回りで見ると、期首0.012%から期末0.050%へと上昇しました。

▶ ポートフォリオについて (2020年6月23日から2021年6月21日まで)

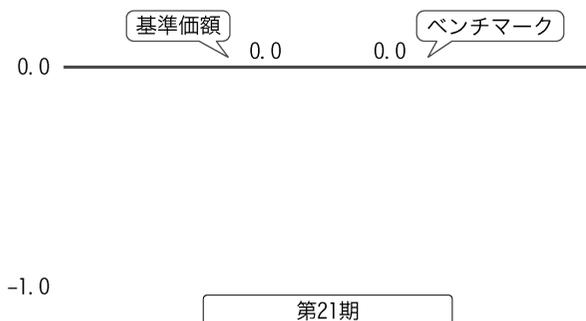
デュレーション（投資資金の平均回収期間）、残存期間別配分、種別配分ともに概ねベンチマークに合わせた運用を継続しました。

▶ ベンチマークとの差異について (2020年6月23日から2021年6月21日まで)

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）

(%)
1.0

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0.0%となり、ベンチマークの騰落率0.0%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(2020年6月23日から2021年6月21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14,100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(2020年6月23日から2021年6月21日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	24,283,127	27,219,030
	地方債証券	1,239,855	100,005 (400,000)
	特殊債証券	3,445,408	602,419 (961,076)
	社債証券 (投資法人債券を含む)	1,900,006	3,234,032 (500,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※()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(2020年6月23日から2021年6月21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 30,868	百万円 2,880	% 9.3	百万円 31,155	百万円 2,243	% 7.2

(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 101

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 2,000

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 (2020年6月23日から2021年6月21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(2021年6月21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	91,527,000 (11,307,000)	98,158,039 (12,386,208)	80.1 (10.1)	— (—)	54.9 (7.5)	15.9 (1.8)	9.3 (0.8)
地 方 債 証 券	8,450,000 (8,450,000)	8,778,007 (8,778,007)	7.2 (7.2)	— (—)	2.2 (2.2)	3.3 (3.3)	1.6 (1.6)
特 殊 債 券 (除く金融債)	9,906,571 (9,906,571)	10,549,510 (10,549,510)	8.6 (8.6)	— (—)	5.0 (5.0)	2.4 (2.4)	1.2 (1.2)
金 融 債 券	100,000 (100,000)	100,089 (100,089)	0.1 (0.1)	— (—)	— (—)	0.1 (0.1)	— (—)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	4,300,000 (4,200,000)	4,381,925 (4,281,298)	3.6 (3.5)	— (—)	2.3 (2.2)	1.2 (1.2)	0.2 (0.2)
合 計	114,283,571 (33,963,571)	121,967,571 (36,095,112)	99.5 (29.4)	— (—)	64.4 (16.9)	22.8 (8.6)	12.3 (3.9)

※()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。

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416回 利付国債(2年)	0.1	750,000	752,017	2022/9/1
	第418回 利付国債(2年)	0.1	260,000	260,795	2022/11/1
	第419回 利付国債(2年)	0.1	490,000	491,592	2022/12/1
	第420回 利付国債(2年)	0.1	310,000	311,066	2023/1/1
	第421回 利付国債(2年)	0.1	550,000	551,996	2023/2/1
	第422回 利付国債(2年)	0.1	470,000	471,790	2023/3/1
	第423回 利付国債(2年)	0.005	925,000	927,136	2023/4/1
	第132回 利付国債(5年)	0.1	275,000	275,574	2022/6/20
	第133回 利付国債(5年)	0.1	450,000	451,179	2022/9/20
	第134回 利付国債(5年)	0.1	830,000	832,672	2022/12/20
	第135回 利付国債(5年)	0.1	750,000	752,880	2023/3/20
	第136回 利付国債(5年)	0.1	1,150,000	1,155,048	2023/6/20
	第137回 利付国債(5年)	0.1	970,000	974,908	2023/9/20
	第138回 利付国債(5年)	0.1	980,000	985,635	2023/12/20
	第139回 利付国債(5年)	0.1	760,000	764,810	2024/3/20
	第140回 利付国債(5年)	0.1	640,000	644,422	2024/6/20
	第141回 利付国債(5年)	0.1	1,090,000	1,097,989	2024/9/20
	第142回 利付国債(5年)	0.1	500,000	503,950	2024/12/20
	第143回 利付国債(5年)	0.1	510,000	514,406	2025/3/20
	第144回 利付国債(5年)	0.1	1,430,000	1,443,198	2025/6/20
	第145回 利付国債(5年)	0.1	480,000	484,608	2025/9/20
	第146回 利付国債(5年)	0.1	1,540,000	1,554,953	2025/12/20
	第147回 利付国債(5年)	0.005	600,000	603,288	2026/3/20
	第2回 利付国債(40年)	2.2	132,000	184,868	2049/3/20
	第3回 利付国債(40年)	2.2	150,000	210,903	2050/3/20
	第4回 利付国債(40年)	2.2	215,000	303,349	2051/3/20
	第5回 利付国債(40年)	2.0	232,000	316,299	2052/3/20
	第6回 利付国債(40年)	1.9	220,000	295,471	2053/3/20
	第7回 利付国債(40年)	1.7	253,000	326,921	2054/3/20
	第8回 利付国債(40年)	1.4	275,000	332,073	2055/3/20
	第9回 利付国債(40年)	0.4	461,000	417,103	2056/3/20
	第10回 利付国債(40年)	0.9	418,000	442,532	2057/3/20
	第11回 利付国債(40年)	0.8	345,000	354,045	2058/3/20
	第12回 利付国債(40年)	0.5	350,000	324,261	2059/3/20
	第13回 利付国債(40年)	0.5	445,000	410,984	2060/3/20
	第325回 利付国債(10年)	0.8	345,000	348,915	2022/9/20
	第326回 利付国債(10年)	0.7	620,000	627,520	2022/12/20
	第327回 利付国債(10年)	0.8	570,000	577,769	2022/12/20
	第328回 利付国債(10年)	0.6	900,000	911,232	2023/3/20
	第329回 利付国債(10年)	0.8	850,000	865,631	2023/6/20
	第330回 利付国債(10年)	0.8	560,000	571,664	2023/9/20
	第332回 利付国債(10年)	0.6	595,000	605,799	2023/12/20
	第333回 利付国債(10年)	0.6	330,000	336,629	2024/3/20
	第334回 利付国債(10年)	0.6	345,000	352,569	2024/6/20

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335回	利付国債(10年)	0.5	95,000	96,935	2024/9/20
第336回	利付国債(10年)	0.5	115,000	117,523	2024/12/20
第337回	利付国債(10年)	0.3	305,000	309,550	2024/12/20
第338回	利付国債(10年)	0.4	607,000	619,097	2025/3/20
第339回	利付国債(10年)	0.4	615,000	628,087	2025/6/20
第340回	利付国債(10年)	0.4	883,000	902,788	2025/9/20
第341回	利付国債(10年)	0.3	765,000	779,343	2025/12/20
第342回	利付国債(10年)	0.1	960,000	969,609	2026/3/20
第343回	利付国債(10年)	0.1	577,000	582,937	2026/6/20
第344回	利付国債(10年)	0.1	1,230,000	1,242,964	2026/9/20
第345回	利付国債(10年)	0.1	1,275,000	1,289,088	2026/12/20
第346回	利付国債(10年)	0.1	630,000	637,276	2027/3/20
第347回	利付国債(10年)	0.1	915,000	926,034	2027/6/20
第348回	利付国債(10年)	0.1	175,000	177,143	2027/9/20
第349回	利付国債(10年)	0.1	65,000	65,806	2027/12/20
第350回	利付国債(10年)	0.1	645,000	653,088	2028/3/20
第351回	利付国債(10年)	0.1	250,000	253,165	2028/6/20
第352回	利付国債(10年)	0.1	685,000	693,980	2028/9/20
第353回	利付国債(10年)	0.1	740,000	749,479	2028/12/20
第354回	利付国債(10年)	0.1	720,000	728,956	2029/3/20
第355回	利付国債(10年)	0.1	1,000,000	1,012,030	2029/6/20
第356回	利付国債(10年)	0.1	1,045,000	1,056,662	2029/9/20
第357回	利付国債(10年)	0.1	1,070,000	1,081,384	2029/12/20
第358回	利付国債(10年)	0.1	1,010,000	1,020,160	2030/3/20
第359回	利付国債(10年)	0.1	1,090,000	1,099,799	2030/6/20
第360回	利付国債(10年)	0.1	1,360,000	1,370,662	2030/9/20
第361回	利付国債(10年)	0.1	1,150,000	1,157,613	2030/12/20
第362回	利付国債(10年)	0.1	680,000	683,957	2031/3/20
第2回	利付国債(30年)	2.4	150,000	181,510	2030/2/20
第4回	利付国債(30年)	2.9	160,000	203,296	2030/11/20
第5回	利付国債(30年)	2.2	100,000	121,260	2031/5/20
第7回	利付国債(30年)	2.3	180,000	223,216	2032/5/20
第10回	利付国債(30年)	1.1	230,000	256,247	2033/3/20
第11回	利付国債(30年)	1.7	150,000	178,023	2033/6/20
第12回	利付国債(30年)	2.1	230,000	284,618	2033/9/20
第14回	利付国債(30年)	2.4	220,000	282,066	2034/3/20
第15回	利付国債(30年)	2.5	250,000	324,675	2034/6/20
第16回	利付国債(30年)	2.5	175,000	228,117	2034/9/20
第18回	利付国債(30年)	2.3	160,000	205,488	2035/3/20
第19回	利付国債(30年)	2.3	150,000	193,276	2035/6/20
第21回	利付国債(30年)	2.3	102,000	132,174	2035/12/20
第22回	利付国債(30年)	2.5	149,000	197,791	2036/3/20
第23回	利付国債(30年)	2.5	151,000	200,973	2036/6/20
第24回	利付国債(30年)	2.5	135,000	180,272	2036/9/20
第25回	利付国債(30年)	2.3	175,000	229,029	2036/12/20
第26回	利付国債(30年)	2.4	219,000	290,536	2037/3/20
第27回	利付国債(30年)	2.5	206,000	277,929	2037/9/20
第28回	利付国債(30年)	2.5	251,000	340,112	2038/3/20

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29回 利付国債(30年)	2.4	170,000	228,541	2038/9/20
	第30回 利付国債(30年)	2.3	270,000	359,753	2039/3/20
	第31回 利付国債(30年)	2.2	277,000	365,518	2039/9/20
	第32回 利付国債(30年)	2.3	377,000	506,299	2040/3/20
	第33回 利付国債(30年)	2.0	380,000	491,286	2040/9/20
	第34回 利付国債(30年)	2.2	379,000	506,139	2041/3/20
	第35回 利付国債(30年)	2.0	375,000	487,833	2041/9/20
	第36回 利付国債(30年)	2.0	305,000	398,086	2042/3/20
	第37回 利付国債(30年)	1.9	405,000	522,425	2042/9/20
	第38回 利付国債(30年)	1.8	325,000	413,530	2043/3/20
	第39回 利付国債(30年)	1.9	170,000	220,214	2043/6/20
	第40回 利付国債(30年)	1.8	240,000	306,136	2043/9/20
	第41回 利付国債(30年)	1.7	260,000	326,723	2043/12/20
	第42回 利付国債(30年)	1.7	260,000	327,048	2044/3/20
	第43回 利付国債(30年)	1.7	260,000	327,381	2044/6/20
	第44回 利付国債(30年)	1.7	267,000	336,529	2044/9/20
	第45回 利付国債(30年)	1.5	292,000	355,261	2044/12/20
	第46回 利付国債(30年)	1.5	335,000	407,825	2045/3/20
	第47回 利付国債(30年)	1.6	345,000	428,138	2045/6/20
	第48回 利付国債(30年)	1.4	345,000	413,037	2045/9/20
	第49回 利付国債(30年)	1.4	325,000	389,255	2045/12/20
	第50回 利付国債(30年)	0.8	300,000	317,715	2046/3/20
	第51回 利付国債(30年)	0.3	327,000	308,020	2046/6/20
	第52回 利付国債(30年)	0.5	317,000	312,790	2046/9/20
	第53回 利付国債(30年)	0.6	282,000	284,515	2046/12/20
	第54回 利付国債(30年)	0.8	120,000	126,621	2047/3/20
	第55回 利付国債(30年)	0.8	340,000	358,513	2047/6/20
	第56回 利付国債(30年)	0.8	395,000	415,741	2047/9/20
	第57回 利付国債(30年)	0.8	385,000	404,916	2047/12/20
	第58回 利付国債(30年)	0.8	400,000	420,372	2048/3/20
	第59回 利付国債(30年)	0.7	310,000	317,570	2048/6/20
	第60回 利付国債(30年)	0.9	330,000	354,010	2048/9/20
	第61回 利付国債(30年)	0.7	320,000	326,780	2048/12/20
	第62回 利付国債(30年)	0.5	175,000	169,426	2049/3/20
	第63回 利付国債(30年)	0.4	355,000	333,976	2049/6/20
	第64回 利付国債(30年)	0.4	345,000	323,641	2049/9/20
	第65回 利付国債(30年)	0.4	245,000	229,444	2049/12/20
	第66回 利付国債(30年)	0.4	235,000	219,706	2050/3/20
	第67回 利付国債(30年)	0.6	320,000	315,324	2050/6/20
	第68回 利付国債(30年)	0.6	400,000	393,632	2050/9/20
	第69回 利付国債(30年)	0.7	290,000	292,502	2050/12/20
	第70回 利付国債(30年)	0.7	260,000	261,934	2051/3/20
	第58回 利付国債(20年)	1.9	200,000	205,018	2022/9/20
	第59回 利付国債(20年)	1.7	280,000	287,593	2022/12/20
	第61回 利付国債(20年)	1.0	140,000	142,724	2023/3/20
	第63回 利付国債(20年)	1.8	156,000	161,971	2023/6/20
	第64回 利付国債(20年)	1.9	210,000	219,529	2023/9/20
	第65回 利付国債(20年)	1.9	370,000	388,707	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	212,216	2024/3/20
	第70回 利付国債(20年)	2.4	380,000	408,777	2024/6/20
	第72回 利付国債(20年)	2.1	300,000	321,705	2024/9/20
	第74回 利付国債(20年)	2.1	278,000	299,664	2024/12/20
	第75回 利付国債(20年)	2.1	230,000	249,241	2025/3/20
	第78回 利付国債(20年)	1.9	340,000	367,638	2025/6/20
	第82回 利付国債(20年)	2.1	288,000	315,288	2025/9/20
	第84回 利付国債(20年)	2.0	424,000	464,419	2025/12/20
	第85回 利付国債(20年)	2.1	332,000	366,889	2026/3/20
	第88回 利付国債(20年)	2.3	329,000	368,726	2026/6/20
	第90回 利付国債(20年)	2.2	418,000	468,703	2026/9/20
	第92回 利付国債(20年)	2.1	295,000	330,863	2026/12/20
	第93回 利付国債(20年)	2.0	242,000	271,349	2027/3/20
	第95回 利付国債(20年)	2.3	186,000	212,919	2027/6/20
	第97回 利付国債(20年)	2.2	400,000	457,828	2027/9/20
	第99回 利付国債(20年)	2.1	337,000	385,349	2027/12/20
	第100回 利付国債(20年)	2.2	310,000	358,034	2028/3/20
	第102回 利付国債(20年)	2.4	285,000	334,715	2028/6/20
	第105回 利付国債(20年)	2.1	337,000	390,545	2028/9/20
	第107回 利付国債(20年)	2.1	418,000	486,347	2028/12/20
	第109回 利付国債(20年)	1.9	315,000	363,024	2029/3/20
	第111回 利付国債(20年)	2.2	393,000	463,971	2029/6/20
	第113回 利付国債(20年)	2.1	395,000	464,745	2029/9/20
	第114回 利付国債(20年)	2.1	323,000	381,437	2029/12/20
	第116回 利付国債(20年)	2.2	320,000	382,044	2030/3/20
	第118回 利付国債(20年)	2.0	245,000	289,073	2030/6/20
	第119回 利付国債(20年)	1.8	260,000	302,094	2030/6/20
	第121回 利付国債(20年)	1.9	200,000	234,810	2030/9/20
	第122回 利付国債(20年)	1.8	225,000	262,084	2030/9/20
	第123回 利付国債(20年)	2.1	205,000	245,296	2030/12/20
	第124回 利付国債(20年)	2.0	230,000	273,030	2030/12/20
	第125回 利付国債(20年)	2.2	175,000	211,785	2031/3/20
	第126回 利付国債(20年)	2.0	185,000	220,294	2031/3/20
	第127回 利付国債(20年)	1.9	190,000	224,403	2031/3/20
	第129回 利付国債(20年)	1.8	40,000	46,961	2031/6/20
	第130回 利付国債(20年)	1.8	300,000	353,160	2031/9/20
	第131回 利付国債(20年)	1.7	225,000	262,577	2031/9/20
	第132回 利付国債(20年)	1.7	270,000	315,854	2031/12/20
	第133回 利付国債(20年)	1.8	235,000	277,358	2031/12/20
	第134回 利付国債(20年)	1.8	163,000	192,962	2032/3/20
	第135回 利付国債(20年)	1.7	285,000	334,350	2032/3/20
	第136回 利付国債(20年)	1.6	205,000	238,314	2032/3/20
	第137回 利付国債(20年)	1.7	190,000	223,422	2032/6/20
	第139回 利付国債(20年)	1.6	160,000	186,403	2032/6/20
	第140回 利付国債(20年)	1.7	500,000	589,295	2032/9/20
	第141回 利付国債(20年)	1.7	310,000	366,162	2032/12/20
	第142回 利付国債(20年)	1.8	180,000	214,655	2032/12/20
	第143回 利付国債(20年)	1.6	100,000	117,205	2033/3/20

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144回 利付国債(20年)	1.5	285,000	330,731	2033/3/20
	第145回 利付国債(20年)	1.7	392,000	465,233	2033/6/20
	第146回 利付国債(20年)	1.7	380,000	451,915	2033/9/20
	第147回 利付国債(20年)	1.6	460,000	542,478	2033/12/20
	第148回 利付国債(20年)	1.5	102,000	119,216	2034/3/20
	第149回 利付国債(20年)	1.5	427,000	499,837	2034/6/20
	第150回 利付国債(20年)	1.4	505,000	585,466	2034/9/20
	第151回 利付国債(20年)	1.2	600,000	680,634	2034/12/20
	第152回 利付国債(20年)	1.2	540,000	613,040	2035/3/20
	第153回 利付国債(20年)	1.3	452,000	520,039	2035/6/20
	第154回 利付国債(20年)	1.2	635,000	722,458	2035/9/20
	第155回 利付国債(20年)	1.0	370,000	410,829	2035/12/20
	第156回 利付国債(20年)	0.4	480,000	491,284	2036/3/20
	第157回 利付国債(20年)	0.2	483,000	479,507	2036/6/20
	第158回 利付国債(20年)	0.5	455,000	471,357	2036/9/20
	第159回 利付国債(20年)	0.6	458,000	481,193	2036/12/20
	第160回 利付国債(20年)	0.7	450,000	479,218	2037/3/20
	第161回 利付国債(20年)	0.6	535,000	561,204	2037/6/20
	第162回 利付国債(20年)	0.6	345,000	361,591	2037/9/20
	第163回 利付国債(20年)	0.6	575,000	602,111	2037/12/20
	第164回 利付国債(20年)	0.5	405,000	416,915	2038/3/20
	第165回 利付国債(20年)	0.5	585,000	601,485	2038/6/20
	第166回 利付国債(20年)	0.7	350,000	371,129	2038/9/20
	第167回 利付国債(20年)	0.5	575,000	589,702	2038/12/20
	第168回 利付国債(20年)	0.4	295,000	296,967	2039/3/20
	第169回 利付国債(20年)	0.3	595,000	587,473	2039/6/20
	第170回 利付国債(20年)	0.3	290,000	285,795	2039/9/20
	第171回 利付国債(20年)	0.3	465,000	457,778	2039/12/20
	第172回 利付国債(20年)	0.4	270,000	270,234	2040/3/20
	第173回 利付国債(20年)	0.4	530,000	529,528	2040/6/20
	第174回 利付国債(20年)	0.4	525,000	523,593	2040/9/20
	第175回 利付国債(20年)	0.5	430,000	436,196	2040/12/20
	第176回 利付国債(20年)	0.5	440,000	446,010	2041/3/20
	小 計	—	91,527,000	98,158,039	—
地 方 債 証 券	第1回 東京都公募公債(20年)	1.54	200,000	206,090	2023/6/20
	第7回 東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	109,154	2025/9/19
	第8回 東京都公募公債(30年)	2.23	100,000	130,127	2038/9/17
	第11回 東京都公募公債(20年)	2.22	100,000	112,486	2027/3/19
	第13回 東京都公募公債(30年)	1.93	200,000	255,412	2042/3/19
	平成26年度第13回 北海道公募公債	0.461	100,000	101,550	2024/12/26
	平成29年度第5回 北海道公募公債	0.18	100,000	100,780	2027/6/30
	平成29年度第6回 北海道公募公債(5年)	0.01	200,000	199,966	2022/7/28
	第7回 神奈川県公募公債(20年)	2.22	200,000	224,972	2027/3/19
	第78回 神奈川県公募公債(5年)	0.005	100,000	99,984	2024/6/20
	第192回 神奈川県公募公債	0.805	200,000	201,972	2022/9/20
	第147回 大阪府公募公債(5年)	0.001	100,000	99,959	2023/2/27
	第361回 大阪府公募公債(10年)	0.92	100,000	100,912	2022/6/28

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395回 大阪府公募公債(10年)	0.435	200,000	203,238	2025/4/28
	第397回 大阪府公募公債(10年)	0.566	100,000	102,212	2025/6/27
	第425回 大阪府公募公債(10年)	0.195	200,000	201,836	2027/10/29
	平成27年度第11回 京都府公募公債	0.469	200,000	204,168	2025/12/18
	平成30年度第6回 京都府公募公債	0.03	200,000	200,066	2023/9/20
	平成30年度第12回 京都府公募公債	0.02	300,000	300,030	2024/3/19
	第3回 兵庫県公募公債(12年)	0.56	100,000	102,083	2025/4/16
	第5回 兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	108,696	2028/5/26
	第9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	118,230	2029/11/19
	第7回 静岡県公募公債(30年)	1.988	100,000	129,372	2043/6/19
	平成20年度第1回 静岡県公募公債	2.18	100,000	109,240	2025/9/19
	平成26年度第10回 静岡県公募公債	0.515	100,000	101,730	2024/11/25
	平成26年度第14回 愛知県公募公債(10年)	0.535	100,000	101,803	2024/11/28
	平成26年度第18回 愛知県公募公債(10年)	0.44	100,000	101,641	2025/3/27
	平成29年度第16回 愛知県公募公債(10年)	0.26	100,000	101,459	2028/2/14
	平成26年度第1回 広島県公募公債	0.67	100,000	101,929	2024/5/27
	平成30年度第2回 広島県公募公債	0.18	200,000	201,864	2028/7/25
	第13回 埼玉県公募公債(20年)	1.599	100,000	116,280	2033/5/20
	平成24年度第9回 埼玉県公募公債	0.844	100,000	101,337	2023/1/31
	平成26年度第4回 埼玉県公募公債	0.654	100,000	101,940	2024/6/26
	平成29年度第2回 埼玉県公募公債(5年)	0.01	200,000	199,996	2022/4/19
	平成25年度第11回 福岡県公募公債	0.694	100,000	101,820	2024/2/26
	平成26年度第5回 福岡県公募公債	0.525	200,000	203,448	2024/10/28
	平成26年度第3回 千葉県公募公債	0.611	300,000	305,571	2024/7/25
	平成26年度第5回 千葉県公募公債	0.476	200,000	203,274	2024/12/25
	令和元年度第2回 千葉県公募公債	0.01	100,000	99,994	2024/5/24
	第11回 群馬県公募公債(10年)	0.505	100,000	101,696	2024/11/25
	第115回 共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	303,165	2022/10/25
	第137回 共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	101,761	2024/8/23
	第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	101,696	2024/11/25
	第149回 共同発行市場公募地方債	0.5	100,000	102,070	2025/8/25
	第154回 共同発行市場公募地方債	0.405	150,000	152,754	2026/1/23
	第175回 共同発行市場公募地方債	0.215	200,000	202,214	2027/10/25
	第183回 共同発行市場公募地方債	0.205	400,000	404,328	2028/6/23
	第185回 共同発行市場公募地方債	0.245	200,000	202,840	2028/8/25
	第482回 名古屋市公募公債(10年)	0.639	200,000	202,178	2023/3/20
	平成23年度第4回 京都市公募公債	1.067	100,000	100,532	2021/12/22
	第9回 横浜市公募公債(20年)	2.35	100,000	111,708	2026/6/19
	第16回 横浜市公募公債(20年)	2.35	100,000	116,650	2028/8/21
	平成26年度第5回 福岡市公募公債	0.539	200,000	203,542	2024/10/28
	平成27年度第5回 福岡市公募公債	0.476	100,000	102,053	2025/10/28
	平成29年度第11回 福岡市公募公債(5年)	0.04	300,000	300,129	2023/3/16
	平成27年度第1回 三重県公募公債	0.464	100,000	102,070	2025/12/25
	小 計	-	8,450,000	8,778,007	-
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	9,868	9,900	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	11,860	12,159	2037/11/10
	第2回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.61	10,011	10,046	2036/5/10

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5回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	10,295	10,346	2036/11/10
第9回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	11,428	11,663	2037/5/10
第10回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	11,822	12,129	2037/5/10
第29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	24,411	26,160	2044/10/10
第30回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	10,221	10,264	2040/5/10
第32回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	12,197	12,471	2040/7/10
第32回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	23,662	25,142	2045/1/10
第35回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	13,032	13,454	2040/10/10
第37回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	12,280	12,610	2040/12/10
第37回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	24,303	25,681	2045/6/10
第40回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	13,497	14,030	2041/3/10
第42回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	11,529	11,810	2041/5/10
第48回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.33	11,714	12,121	2041/11/10
第49回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	24,136	25,481	2046/6/10
第51回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	27,907	29,453	2046/8/10
第55回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	37,584	39,703	2046/12/10
第57回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	35,503	37,470	2047/2/10
第59回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	37,829	39,991	2047/4/10
第67回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	43,465	45,408	2047/12/10
第69回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	44,046	46,444	2048/2/10
第70回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	38,203	40,112	2048/3/10
第73回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	43,644	46,054	2048/6/10
第88回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.93	47,664	49,469	2049/9/10
第113回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	79,505	80,143	2051/10/10
第123回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	83,078	84,267	2052/8/10
第124回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	82,778	83,741	2052/9/10
第125回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	83,210	84,174	2052/10/10
第130回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	100,000	117,374	2032/12/20
第132回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	85,151	86,038	2053/5/10
第138回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	88,140	89,670	2053/11/10
第146回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	92,019	91,746	2054/7/10
第151回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	94,112	94,145	2054/12/10
第157回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	95,887	96,469	2055/6/10
第160回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	97,258	98,084	2055/9/10
第166回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	198,140	200,610	2056/3/10
第2回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	12,857	13,289	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	12,325	12,666	2037/11/10
第27回	道路債券	2.42	100,000	106,568	2024/3/20
第32回	道路債券	2.44	100,000	107,837	2024/9/20
第42回	道路債券	2.22	100,000	108,242	2025/3/21
第42回	地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,129	2022/11/28
第61回	地方公共団体金融機構債券	0.69	100,000	102,021	2024/6/28
第22回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	104,407	2023/6/19
第34回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.001	500,000	500,055	2022/6/30
第42回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.155	100,000	100,939	2027/12/15
第60回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.001	100,000	99,961	2027/1/29
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	116,156	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	117,064	2029/10/31

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	118,328	2030/1/31
	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	303,174	2022/9/30
	第185回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.757	100,000	117,987	2033/2/28
	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	203,442	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	101,925	2024/1/31
	第210回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.547	400,000	465,112	2034/1/31
	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	305,739	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	115,622	2034/6/30
	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	305,238	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	112,424	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	100,944	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	101,202	2028/2/29
	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	100,313	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	131,633	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	291,348	2047/3/20
	第27回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.34	100,000	114,303	2027/10/20
	第37回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	700,000	814,485	2028/6/20
	第104回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	400,000	404,884	2023/3/20
	第122回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.704	200,000	203,716	2024/3/19
	第4回 公営企業債券(20年)	2.09	200,000	209,284	2023/9/20
	第16回 公営企業債券(20年)	2.1	100,000	109,367	2025/12/19
	第18回 公営企業債券(20年)	2.58	100,000	112,800	2026/6/19
	第22回 公営企業債券(20年)	2.32	200,000	226,906	2027/6/18
	第39回 地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	100,944	2022/8/26
	第48回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.121	100,000	110,893	2035/12/28
	第59回 地方公共団体金融機構債券(10年)	0.724	100,000	101,992	2024/4/26
	第62回 地方公共団体金融機構債券	0.631	300,000	305,667	2024/7/26
	第102回 地方公共団体金融機構債券	0.2	100,000	100,896	2027/11/26
	第106回 地方公共団体金融機構債券	0.215	300,000	302,928	2028/3/28
	第281回 地方公共団体金融機構債券	0.999	100,000	108,848	2033/9/21
	第6回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.11	100,000	107,819	2025/3/19
	第117回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.438	100,000	108,531	2027/9/17
	第190回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.08	100,000	100,274	2026/6/19
	第222回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.21	200,000	201,850	2027/11/19
	第226回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.24	200,000	202,198	2027/12/20
	第85回 中日本高速道路社債	0.07	100,000	100,110	2025/10/21
	第50回 西日本高速道路社債	0.04	100,000	100,000	2024/6/20
	小 計	-	9,906,571	10,549,510	-
金 融 債 券	第350回 信金中金債(5年)	0.08	100,000	100,089	2024/1/26
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第508回 東北電力	0.465	200,000	203,856	2029/4/25
	第13回 大和ハウス工業	0.285	100,000	100,532	2027/6/1
	第19回 キリンホールディングス	0.09	100,000	100,093	2026/6/3
	第30回 東レ	0.375	100,000	100,627	2027/7/16
	第56回 住友化学	0.38	100,000	100,618	2027/9/13
	第24回 三菱ケミカルホールディングス	0.37	100,000	100,998	2028/2/25
	第11回 プリチストン	0.295	200,000	200,926	2027/4/21
	第7回 ジェイテクト	0.345	100,000	99,587	2028/3/8

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 ソニー	0.18	100,000	99,451	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	200,094	2024/8/2
	第51回 住友商事	1.241	100,000	107,471	2029/4/23
	第57回 東京三菱銀行	2.22	100,000	102,894	2022/10/27
	第1回 三井住友フィナンシャル	0.849	100,000	101,383	2024/9/12
	第1回 みずほフィナンシャルグループ	0.95	100,000	101,406	2024/7/16
	第17回 NTTファイナンス	0.28	200,000	201,690	2027/12/20
	第93回 トヨタファイナンス	0.13	400,000	401,584	2025/6/10
	第1回 野村ホールディングス	0.3	100,000	100,140	2023/9/4
	第65回 三菱地所	2.04	100,000	118,202	2032/12/20
	第135回 三菱地所	0.26	200,000	200,064	2031/6/20
	第38回 京王電鉄	0.295	100,000	100,708	2027/11/29
	第32回 東日本旅客鉄道	2.26	100,000	106,064	2024/3/19
	第126回 東日本旅客鉄道	0.275	200,000	201,896	2028/1/26
	第13回 西日本旅客鉄道	2.34	100,000	112,543	2027/2/19
	第32回 東海旅客鉄道	2.31	100,000	113,525	2027/9/17
	第45回 東京地下鉄	0.215	200,000	200,822	2030/9/18
	第27回 KDDI	0.23	100,000	100,090	2026/4/24
	第37回 東京電力パワーグリッド	0.29	100,000	100,262	2023/6/9
	第38回 東京電力パワーグリッド	0.58	100,000	101,215	2025/7/16
	第41回 大阪瓦斯	0.22	300,000	300,918	2031/6/3
	第7回 ファーストリテイリング	0.405	100,000	101,595	2028/6/6
	第2回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20)	0.645	100,000	100,671	2023/7/12
	小 計	—	4,300,000	4,381,925	—
	合 計	—	114,283,571	121,967,571	—

■ 投資信託財産の構成

(2021年6月21日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
公 社 債	121,967,571	99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	765,277	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	122,732,848	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年6月21日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	122,732,848,201円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	551,107,130
公 社 債 (評 価 額)	121,967,571,194
未 収 入 金	50,334,500
未 収 利 息	162,561,105
前 払 費 用	1,274,272
(B) 負 債	150,289,129
未 払 金	100,889,000
未 払 解 約 金	49,396,336
未 払 利 息	1,447
そ の 他 未 払 費 用	2,346
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	122,582,559,072
元 本	86,729,456,752
次 期 繰 越 損 益 金	35,853,102,320
(D) 受 益 権 総 口 数	86,729,456,752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88,893,770,132円、期中追加設定元本額10,728,557,492円、期中一部解約元本額12,892,870,872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	55,225,948,955円
三井住友DS・国内債券インデックス年金ファンド	224,000,195円
S M A M ・ 国 内 債 券 イン デ ッ ク ス ・ フ ァ ン ド	3,548,401,322円
国内債券インデックスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	46,759,311円
S M A M ・ 年 金 国 内 債 券 バ ッ シ ュ フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	27,684,346,969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2020年6月23日 至2021年6月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	999,537,467円
受 取 利 息	999,992,606
支 払 利 息	△ 455,139
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,017,339,489
売 買 損 益	90,409,910
売 買 損 益	△ 1,107,749,399
(C) 信 託 報 酬 等	△ 77,655
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 17,879,677
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	36,746,897,744
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,406,099,147
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 5,282,014,894
(H) 計 (D + E + F + G)	35,853,102,320
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	35,853,102,320

※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)

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

第 21 期

決算日 2021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。

SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 1万口当たりの費用明細（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	33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)	(4)	(0.011)	
(販売会社)	(4)	(0.011)	
(受託会社)	(24)	(0.060)	
(b) 売買委託手数料	1	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
(株式)	(1)	(0.003)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	1	0.003	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
(株式)	(1)	(0.003)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	24	0.060	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
(保管費用)	(14)	(0.034)	
(監査費用)	(7)	(0.017)	
(その他)	(3)	(0.008)	
合計	59	0.149	

期中の平均基準価額は39,748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（2020年12月1日から2021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 19,554	千円 96,410	千口 406,733	千円 2,040,832

■ 組入れ資産の明細 (2021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	口 数	評 価 額
外国株式インデックス・マザーファンド	千口 978, 623	千口 591, 445	千円 3, 450, 315	

※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60, 650, 874, 522口です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	3, 469, 971, 209円
コール・ローン等	5, 346, 019
外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	3, 450, 315, 199
未 収 入 金	14, 309, 991
(B) 負 債	16, 173, 167
未 払 解 約 金	14, 309, 991
未 払 信 託 報 酬	1, 529, 298
そ の 他 未 払 費 用	333, 878
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	3, 453, 798, 042
元 本	766, 714, 885
次 期 繰 越 損 益 金	2, 687, 083, 157
(D) 受 益 権 総 口 数	766, 714, 885口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	45, 047円

※当期における期首元本額1, 266, 721, 044円、期中追加設定元本額48, 125, 319円、期中一部解約元本額548, 131, 478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2020年12月1日 至2021年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 3, 583円
受 取 利 息	376
支 払 利 息	△ 3, 959
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	907, 445, 329
売 買 損 益	1, 177, 267, 312
売 買 損 益	△ 269, 821, 983
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3, 842, 668
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A + B + C)	903, 599, 078
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1, 285, 460, 055
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	498, 024, 024
(配 当 等 相 当 額)	(913, 575, 095)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 415, 551, 071)
(G) 合 計 (D + E + F)	2, 687, 083, 157
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	2, 687, 083, 157
追 加 信 託 差 損 益 金	498, 024, 024
(配 当 等 相 当 額)	(913, 729, 147)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 415, 705, 123)
分 配 準 備 積 立 金	2, 189, 059, 133

※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。
 ※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。
 ※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。
 ※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	48, 314, 082円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	855, 284, 996
(c) 収益調整金	913, 729, 147
(d) 分配準備積立金	1, 285, 460, 055
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	3, 102, 788, 280
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	40, 468. 61
(f) 分配金	—
1 万 口 当 た り 分 配 金	—

外国株式インデックス・マザーファンド

第19期（2020年12月1日から2021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、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 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		株式組入 比	株式先物 率 (買建-売建)	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率	(配当込み、 円ベース)	騰落率				
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
19期 (2021年11月30日)	58,337	37.0	609.64	37.2	95.5	2.2	2.4	353,818

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※ベンチマークは、当報告書作成時に知れた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※指数の著作権、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		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	(配当込み、 円ベース)	騰 落 率				
(期 首) 2020年11月30日	円 42,581	% -	444.41	% -	% 96.8	% 0.9	% 2.3
12月末	43,814	2.9	457.26	2.9	96.3	2.0	2.2
2021年 1 月末	44,722	5.0	467.15	5.1	96.4	1.3	2.3
2 月末	46,242	8.6	483.94	8.9	96.9	0.8	2.3
3 月末	49,339	15.9	515.16	15.9	96.6	0.9	2.3
4 月末	51,661	21.3	539.56	21.4	96.3	1.4	2.3
5 月末	52,422	23.1	547.82	23.3	95.7	2.1	2.3
6 月末	53,738	26.2	561.70	26.4	96.9	0.8	2.3
7 月末	54,506	28.0	569.82	28.2	95.8	2.0	2.3
8 月末	55,856	31.2	583.91	31.4	95.6	2.1	2.3
9 月末	54,560	28.1	570.44	28.4	95.4	2.3	2.3
10 月末	58,559	37.5	612.25	37.8	95.1	2.7	2.3
(期 末) 2021年11月30日	58,337	37.0	609.64	37.2	95.5	2.2	2.4

※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（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	42,581円
期末	58,337円
騰落率	+37.0%

※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。

※指数の著作権、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（2020年12月1日から2021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

- ・ 米国などの主要国経済が予想以上に堅調に回復したこと
- ・ 世界的に企業業績の想定以上の上振れが続いたこと
- ・ 先進国を中心に、ワクチン接種の広がりにより、新型コロナウイルス感染者数が減少したこと
- ・ 主要通貨に対して円安が進行したこと

▶ 投資環境について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

期間における世界の株式市場は、上昇しました。為替市場では、米ドルとユーロが対円で上昇しました。

株式市場

期初から2021年1月までは米バイデン新政権の大規模な景気対策案が好感され、2月も経済正常化への期待が高まり、上昇が続きました。他方、相場過熱への警戒感や長期金利の大幅な上昇により、3月中旬にかけては頭の重い展開となりました。

4月は各国の企業決算発表が押し並べて事前予想を上回ったことや、FOMC（米連邦公開市場委員会）で金融緩和政策の長期的な維持が確認されたことが安心材料となり、上昇しました。

5月は、物価指数が予想以上に上昇して一進一退となりました。

6月は、物価指数の上振れなどが警戒される場面もありましたが、一時的という見方から持ち直しました。7月から8月にかけては、感染拡大懸念や、世界景気の回復一巡感などから上値の重い展開となりました。

9月は、中国の大手不動産グループの経営不安や長期金利の上昇などから、株価は全般的に調整しました。10月から11月中旬にかけては、米国の7－9月期の企業業績が概ね事前予想を上回る決算となり上昇しました。しかし期末には新たな変異ウイルス（オミクロン型）が複数の国で報告され、下落しました。

期間を通じてみると、世界の株式市場は、大きく上昇しました。

為替市場

米ドル・円相場は、安全通貨とされる円を売る動きが強まる中で、期初から3月下旬にかけて円安基調となりました。4月から6月中旬までは米金利の動きに連れて一進一退となりました。

6月下旬には、FOMCでのタカ派（インフレ抑制を重視する立場）的な内容を受けて、米ドル高・円安となりました。7月から9月中旬にかけては、リスク回避的な動きが重石となり一進一退となりました。9月下旬には、米金利の上昇を受けて米ドル高・円安となりました。10月はリスク選好度の改善を背景に引き続き米ドル高・円安となりましたが、11月から期末にかけては米金利の動きに連れて一進一退となりました。

ユーロ・円相場は、期初から5月末までユーロ高基調が続きました。米ドルや円に比べて景気

回復局面に選好されやすい通貨であることも影響し、ユーロの上昇が継続しました。6月から8月中旬にかけてECB高官によるハト派（景気を重視する立場）的な発言を背景にユーロ安・円高となりましたが、8月下旬から9月下旬にかけてはリスク選好度や欧州金利の動きにつれて一進一退となりました。10月は中旬までユーロ圏でも利上げの織込みが進み、ユーロ高・円安となりましたが、10月下旬から期末にかけてはユーロ圏で感染が再拡大したことなどを背景に、ユーロ安・円高となりました。

期間を通じてみると、為替市場では、米ドル、ユーロとも対円で上昇しました。

▶ポートフォリオについて（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

株式組入比率

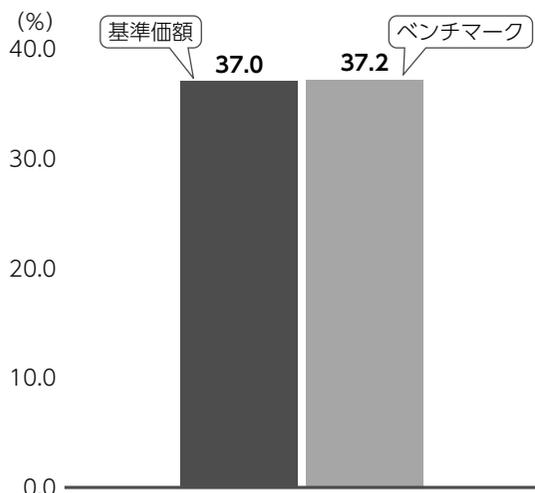
MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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MSCI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（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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】

基準価額の騰落率は+37.0%となり、ベンチマークの騰落率+37.2%を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（2020年12月1日から2021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） （先 物 ・ オ プ シ ョ ン） （投 資 信 託 証 券）	2円 （1） （0） （0） （0）	0.004％ （0.003） （0.000） （0.001） （0.000）	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） （投 資 信 託 証 券）	2 （2） （0）	0.003 （0.003） （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）	22 （18） （4）	0.043 （0.034） （0.009）	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 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	25	0.049	

期中の平均基準価額は51,446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 (2020年12月1日から2021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 15,401.97 (△ 621.98)	千アメリカ・ドル 169,438 (△ 1,555)	百株 12,306.33	千アメリカ・ドル 113,305
	カ ナ ダ	(2,311.89 273.32)	千カナダ・ドル 11,741 (△ 124)	1,703.76	千カナダ・ドル 6,821
	オーストラリア	(3,476.46 702.8)	千オーストラリア・ドル 6,595 (△ 136)	5,519.06	千オーストラリア・ドル 4,131
	香 港	(7,757 288.75)	千香港・ドル 16,831 (△ 28)	7,969.2	千香港・ドル 16,060
	シンガポール	(2,247 1,629.48)	千シンガポール・ドル 1,384 (△ 158)	4,981.48	千シンガポール・ドル 1,616
	ニュージーランド	1,355.71	千ニュージーランド・ドル 1,074	1,130.81	千ニュージーランド・ドル 937
	イギリス	12,978.5 (△ 2,713.75)	千イギリス・ポンド 6,984 (△ 457)	10,357.68	千イギリス・ポンド 4,950
	スイス	(530.87 -)	千スイス・フラン 5,382 (△ 138)	418.35	千スイス・フラン 4,186
	デンマーク	(270.26 822.16)	千デンマーク・クローネ 10,740 ()	622.97	千デンマーク・クローネ 9,472
	ノルウェー	382.99	千ノルウェー・クローネ 4,726	179.18	千ノルウェー・クローネ 2,868
国	スウェーデン	(1,214.19 3,955.6)	千スウェーデン・クローナ 31,613 (△ 4,424)	1,307.89	千スウェーデン・クローナ 12,485
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	アイルランド	53.01	415	25.84	232
	オランダ	(1,059.85 875.14)	(5,419 442)	1,105.43	2,401

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 国	ベルギー	96.33	528	178.72	809
	ルクセンブルグ	191.85	222	356.97	235
	フランス	(776.95 319.6)	(△ 5,374 493)	1,466.99	4,578
	ドイツ	(1,064.12 610.92)	(5,909 61)	1,164.95	4,804
	ポルトガル	299.29	323	191.1	217
	スペイン	(1,538.61 465.43)	(△ 1,659 46)	2,243.64	1,250
	イタリア	(3,933.92 -)	(△ 1,309 1)	3,789.01	1,075
	フィンランド	241.52	730	252.87	359
	オーストリア	126.57	491	135.73	463

※金額は受渡し代金。

※（ ）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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	ス イ ス	証券 -	千スイス・フラン -	証券 55,710	千スイス・フラン 9

※金額は受渡し代金。

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	SIMON PROPERTY GROUP INC	口	3,186	千アメリカ・ドル	344	口	1,547	千アメリカ・ドル	180
		VEREIT INC	—	(△ 54,273)	—	(—)	—	(—)	—	(—)
		EQUITY RESIDENTIAL	—	—	—	—	898	—	68	—
		EQUINIX INC	253	—	196	—	156	—	108	—
		AMERICAN TOWER CORP	1,608	—	451	—	574	—	125	—
		SUN COMMUNITIES INC	1,024	—	180	—	586	—	84	—
		REALTY INCOME CORP	2,848	(7,652)	200	(—)	—	(—)	—	(—)
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	—	—	—	8,249	—	310	—
		INVITATION HOMES INC	4,897	—	198	—	—	—	—	—
		VICI PROPERTIES INC	15,698	—	429	—	3,171	—	92	—
		ORION OFFICE REIT INC	—	(2,829)	—	(—)	2,829	(—)	54	(—)
		VENTAS INC	—	—	—	—	1,938	—	95	—
		PROLOGIS INC	3,055	—	422	—	2,917	—	316	—
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,166	—	240	—	—	—	—	—
		DUKE REALTY CORP	7,983	—	389	—	7,318	—	299	—
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	—	—	—	3,613	—	315	—
		WELLTOWER INC	2,373	—	203	—	1,722	—	107	—
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	—	—	—	—	20,481	—	163	—
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	—	—	—	3,998	—	140	—
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,124	—	182	—	—	—	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,212	—	193	—	1,319	—	148	—		
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	7,876	—	167	—	7,768	—	160	—		
カナダ	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	口	—	千カナダ・ドル	—	口	6,546	千カナダ・ドル	101	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	—	—	—	—	3,585	—	86	—	
オーストラリア	TRANSURBAN GROUP	口	16,809	千オーストラリア・ドル	223	口	17,152	千オーストラリア・ドル	227	
	SYDNEY AIRPORT	(16,148)	—	(225)	—	(—)	—	(—)	—	
	APA GROUP	—	—	—	—	11,713	—	69	—	
	GPT GROUP	—	—	—	—	12,700	—	130	—	
	VICINITY CENTRES	23,925	—	109	—	—	—	—	—	
香港	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	159,671	—	265	—	168,467	—	276	—	
香	港	口	68,500	千香港・ドル	540	口	—	千香港・ドル	—	

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	シンガポール	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	口 40,800 (-)	千シンガポール・ドル 124 (△ 4)	口 29,300 (-)	千シンガポール・ドル 86 (-)
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	- (21,128)	- (28)	- (-)	- (-)
		SUNTEC REIT	-	-	102,700	145
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	70,000 (-)	137 (△ 2)	- (-)	- (-)
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	58,300 (-)	118 (△ 0)	50,800 (-)	109 (-)
国	イギリス	SEGRO PLC	口 8,749	千イギリス・ポンド 119	口 -	千イギリス・ポンド -
		ユ ー ロ	フランス	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	-	-
ICADE	-			-	2,061	127
KLEPIERRE	4,295 (-)			89 (△ 9)	- (-)	- (-)

※金額は受渡し代金。

※()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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっ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 66,749	百万円 63,003	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

※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

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	43,010,068千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	294,102,700千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.14

※(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 (2020年12月1日から2021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
(2020年12月1日から2021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 (2021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	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	58.89	58.89	1,033	117,590	ソフトウェア・サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	98.95	110.28	1,817	206,779	保険
ABBOTT LABORATORIES	948.44	957.32	12,256	1,394,429	ヘルスケア機器・サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	30.92	35.59	1,488	169,388	素材
CONCHO RESOURCES INC	101.72	—	—	—	エネルギー
VERISK ANALYTICS INC	79.29	79.29	1,817	206,721	商業・専門サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	20.6	23.71	1,023	116,499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LAS VEGAS SANDS CORP	176.34	176.34	657	74,751	消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	22.43	1,265	144,006	半導体・半導体製造装置
SVB FINANCIAL GROUP	26.4	31.11	2,253	256,428	銀行
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	333.93	339.4	3,576	406,948	ソフトウェア・サービス
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	13.81	14.69	2,465	280,457	消費者サービス
AFLAC INC	354.11	341.85	1,904	216,629	保険
DARDEN RESTAURANTS INC	74.25	76.06	1,078	122,661	消費者サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	211.16	222.02	1,928	219,376	食品・飲料・タバコ
ADOBE INC	258.16	257.02	17,669	2,010,300	ソフトウェア・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	120.02	120.02	755	85,969	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	64.81	64.81	3,002	341,581	耐久消費財・アパレル
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	202	—	—	—	銀行
GARMIN LTD	81.24	84.44	1,175	133,764	耐久消費財・アパレル
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	119.9	118.18	3,443	391,729	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	377.29	375.49	7,797	887,113	資本財
WR BERKLEY CORP	74.28	74.28	590	67,158	保険
AUTOZONE INC	12.71	11.37	2,090	237,846	小売
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	599.62	637.19	547	62,271	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DR HORTON INC	193.85	181.62	1,793	204,066	耐久消費財・アパレル
DENTSPLY SIRONA INC	118.64	118.64	577	65,720	ヘルスケア機器・サービス
AUTODESK INC	115.06	115.06	3,004	341,855	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	121.01	121.01	693	78,859	公益事業
CITIGROUP INC	1,123.53	1,105.27	7,188	817,855	銀行
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	41.86	41.86	354	40,356	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	224.63	223.87	5,281	600,829	ソフトウェア・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	257.27	257.27	2,143	243,845	公益事業
HESS CORP	153.62	143.44	1,091	124,139	エネルギー
DAVITA INC	41.38	41.38	401	45,623	ヘルスケア機器・サービス
DOMINO'S PIZZA INC	21.21	21.21	1,132	128,845	消費者サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	289.13	307.81	4,060	461,907	各種金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	309.87	303.41	1,966	223,717	食品・飲料・タバコ
BUNGE LTD	71.74	71.74	649	73,930	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 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
TE CONNECTIVITY LTD	174.25	174.25	2,777	315,981	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	9,240	8,929.29	143,082	16,278,546	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	164.25	164.25	1,861	211,757	各種金融
BOEING CO/THE	289.26	301.3	5,980	680,436	資本財
CINCINNATI FINANCIAL CORP	78.58	78.58	930	105,903	保険
BECTON DICKINSON AND CO	153.15	151.4	3,688	419,612	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	133.96	179.45	181	20,661	消費者サービス
NISOURCE INC	189.19	189.19	477	54,348	公益事業
ABBVIE INC	947.79	952.34	11,131	1,266,476	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,208.86	2,231.32	11,526	1,311,426	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	741.86	712.57	20,103	2,287,121	各種金融
KINDER MORGAN INC	1,059.4	1,059.4	1,696	192,965	エネルギー
TRUIST FINANCIAL CORP	703.16	703.16	4,293	488,470	銀行
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,216.01	1,210.07	6,611	752,227	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	139.37	139.37	696	79,201	保険
CBOE GLOBAL MARKETS INC	56.61	56.61	734	83,533	各種金融
JPMORGAN CHASE & CO	1,628.89	1,618.84	26,100	2,969,460	銀行
T ROWE PRICE GROUP INC	123.64	123.14	2,549	290,027	各種金融
FAIR ISAAC CORP	14.94	14.94	523	59,602	ソフトウェア・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	21.07	21.07	382	43,560	資本財
CIGNA CORP	193.82	183.24	3,657	416,131	ヘルスケア機器・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	30.52	30.52	473	53,854	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	161.3	161.3	1,196	136,146	食品・飲料・タバコ
CADENCE DESIGN SYS INC	142.5	154	2,875	327,091	ソフトウェア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	64.12	65.01	1,909	217,233	各種金融
MERCADOLIBRE INC	23.64	24.57	3,032	344,971	小売
DOLLAR GENERAL CORP	137.41	127.46	2,868	326,376	小売
SERVICENOW INC	103.03	106.96	7,196	818,743	ソフトウェア・サービス
CATERPILLAR INC	292.34	297.38	5,826	662,854	資本財
BROWN & BROWN INC	140.36	142.73	933	106,215	保険
CHARLES RIVER LABORATORIES	-	25.77	967	110,035	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	305.28	305.28	2,252	256,215	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	397.09	456.88	1,757	199,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	44.11	44.11	863	98,295	運輸
MOSAIC CO/THE	185.84	185.84	669	76,178	素材
CISCO SYSTEMS INC	2,266.97	2,269.38	12,654	1,439,652	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MORGAN STANLEY	734.12	755.61	7,346	835,844	各種金融
BROADCOM INC	214.87	220.01	12,416	1,412,573	半導体・半導体製造装置
DELL TECHNOLOGIES -C	126.02	145.5	837	95,298	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DTE ENERGY COMPANY	104.96	105.36	1,174	133,640	公益事業
DOMINION ENERGY INC	455.18	443.47	3,300	375,475	公益事業
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	56.13	68.1	1,230	140,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DEERE & CO	161.07	157.22	5,472	622,625	資本財
VMWARE INC-CLASS A	41.94	106.05	1,276	145,242	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE INC	346.84	372.5	5,545	630,943	各種金融
NASDAQ INC	65.58	65.09	1,360	154,829	各種金融
ZOETIS INC	257.28	252.46	5,643	642,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONSOLIDATED EDISON INC	183.36	183.99	1,478	168,192	公益事業
KKR & CO INC	286.09	285.69	2,180	248,030	各種金融
COGNEX CORP	86.98	86.98	684	77,839	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALPHABET INC-CL C	161.54	156.03	45,596	5,187,495	メディア・娯楽
COLGATE-PALMOLIVE CO	441.81	430.41	3,344	380,528	家庭用品・パーソナル用品
HCA HEALTHCARE INC	143.52	143.12	3,290	374,373	ヘルスケア機器・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	63.05	192.52	6,444	733,181	ヘルスケア機器・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	139.31	139.31	1,242	141,328	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	237.07	238.46	13,231	1,505,366	食品・生活必需品小売り

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	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
CUMMINS INC	80	82.07	1,783	202,867	資本財		
ACTIVISION BLIZZARD INC	412.25	400.92	2,417	275,090	メディア・娯楽		
DELTA AIR LINES INC	82.99	82.99	300	34,216	運輸		
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	69.25	69.25	662	75,334	運輸		
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	95.42	95.42	1,886	214,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
COTERRA ENERGY INC	196.32	402.61	839	95,457	エネルギー		
TRANSDIGM GROUP INC	26.81	26.81	1,566	178,197	資本財		
MASIMO CORP	29.41	29.41	847	96,461	ヘルスケア機器・サービス		
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	38.33	36.41	2,345	266,830	小売		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	396.55	378.73	1,745	198,550	食品・生活必需品小売り		
SEAGEN INC	66.54	77.9	1,287	146,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
COCA-COLA CO/THE	2,186.12	2,206.53	12,043	1,370,159	食品・飲料・タバコ		
EXPEDITORS INTL WASH INC	86.89	86.89	1,101	125,308	運輸		
BURLINGTON STORES INC	33.91	33.91	994	113,180	小売		
FRANKLIN RESOURCES INC	142.98	142.98	482	54,900	各種金融		
CSX CORP	415.38	1,218.27	4,339	493,702	運輸		
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	49.95	49.95	1,458	165,892	ヘルスケア機器・サービス		
EXPEDIA GROUP INC	68.94	80.61	1,342	152,697	消費者サービス		
AMAZON.COM INC	226.03	242.97	86,535	9,845,139	小売		
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	323.36	340.18	3,766	428,472	ヘルスケア機器・サービス		
EXXON MOBIL CORP	2,269.07	2,278.12	14,030	1,596,300	エネルギー		
EVEREST RE GROUP LTD	20.65	20.65	545	62,109	保険		
EOG RESOURCES INC	308.3	308.3	2,725	310,030	エネルギー		
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	83.21	83.21	950	108,167	ソフトウェア・サービス		
AMERISOURCEBERGEN CORP	79.93	79.93	960	109,332	ヘルスケア機器・サービス		
AGILENT TECHNOLOGIES INC	171.3	168.73	2,588	294,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
FORD MOTOR CO	2,080.63	2,091.41	4,113	468,027	自動車・自動車部品		
HORMEL FOODS CORP	149.39	149.39	634	72,216	食品・飲料・タバコ		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	84.32	84.32	233	26,515	電気通信サービス		
KRAFT HEINZ CO/THE	380.96	384.38	1,336	152,096	食品・飲料・タバコ		
AMERICAN WATER WORKS CO INC	91.54	102.41	1,774	201,938	公益事業		
EVERSOURCE ENERGY	175.57	175.57	1,497	170,323	公益事業		
PAYPAL HOLDINGS INC	597.93	601.25	11,257	1,280,800	ソフトウェア・サービス		
MSCI INC	43.83	43.83	2,829	321,876	各種金融		
FORTINET INC	73.6	73.6	2,526	287,461	ソフトウェア・サービス		
ALLY FINANCIAL INC	201.39	201.39	960	109,313	各種金融		
ANTHEM INC	136.42	133.09	5,539	630,225	ヘルスケア機器・サービス		
NEXTERA ENERGY INC	1,051.98	1,059.66	9,394	1,068,862	公益事業		
PALO ALTO NETWORKS INC	52.21	53.93	2,972	338,182	ソフトウェア・サービス		
T-MOBILE US INC	290.19	333.35	3,780	430,072	電気通信サービス		
ELECTRONIC ARTS INC	153.52	153.52	1,917	218,115	メディア・娯楽		
FREEMPORT-MCMORAN INC	754.31	808.28	3,069	349,256	素材		
SYNCHRONY FINANCIAL	278.25	321.12	1,513	172,147	各種金融		
MARATHON PETROLEUM CORP	339.33	339.33	2,096	238,505	エネルギー		
KEURIG DR PEPPER INC	183.39	382.44	1,345	153,025	食品・飲料・タバコ		
US BANCORP	707.43	746.23	4,283	487,317	銀行		
AUTOLIV INC	40.01	40.01	383	43,666	自動車・自動車部品		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	125.9	-	-	-	素材		
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	638.81	638.81	933	106,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
F5 INC	29.09	29.09	672	76,474	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
OLD DOMINION FREIGHT LINE	49.26	55.39	1,978	225,110	運輸		
FASTENAL CO	298.92	298.92	1,821	207,245	資本財		
FISERV INC	301.44	315.64	3,076	350,018	ソフトウェア・サービス		
GENERAL ELECTRIC CO	4,736.99	589.47	5,800	659,909	資本財		
ALIGN TECHNOLOGY INC	38.54	41.54	2,635	299,850	ヘルスケア機器・サービス		
PAYCOM SOFTWARE INC	25.22	25.22	1,128	128,380	ソフトウェア・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	外 貨 建 金 額	評 価 額 邦貨換算金額	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	115.82	1,182	134,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	54.81	54.81	337	38,362	各種金融
TRANSUNION	94.97	94.97	1,083	123,314	商業・専門サービス
MATCH GROUP INC	127.73	137.29	1,840	209,426	メディア・娯楽
GODADDY INC - CLASS A	89.05	89.05	615	69,996	ソフトウェア・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	37.79	37.79	1,690	192,345	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	677.88	689.43	4,126	469,520	自動車・自動車部品
DIAMONDBACK ENERGY INC	79.33	—	—	—	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	71.66	71.66	737	83,940	資本財
HOLOGIC INC	135.92	135.92	1,032	117,477	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	126.42	126.42	2,458	279,659	資本財
GOLDMAN SACHS GROUP INC	177.23	181.67	7,022	798,923	各種金融
ALPHABET INC-CL A	160.21	161.11	46,892	5,334,998	メディア・娯楽
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	42.03	42.03	509	57,988	ヘルスケア機器・サービス
WABTEC CORP	92.31	92.31	853	97,112	資本財
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	27.37	27.37	1,661	189,075	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST REPUBLIC BANK/CA	88.97	88.97	1,907	217,068	銀行
CELANESE CORP	64.2	55.98	894	101,767	素材
VAIL RESORTS INC	20.38	20.38	679	77,314	消費者サービス
MOLINA HEALTHCARE INC	34.9	34.28	1,019	116,037	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	78.09	70.02	4,678	532,291	メディア・娯楽
GENERAL MILLS INC	314.89	314.89	2,000	227,560	食品・飲料・タバコ
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	108.56	108.56	1,340	152,533	ヘルスケア機器・サービス
FIRSTENERGY CORP	269.48	269.48	1,052	119,722	公益事業
GENUINE PARTS CO	74.06	74.06	984	111,987	小売
FORTIVE CORP	157.5	183.73	1,400	159,343	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	371.5	371.5	1,597	181,699	銀行
XYLEM INC	91.24	91.24	1,129	128,509	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	112.15	110.79	2,378	270,595	資本財
LKQ CORP	159.22	159.22	917	104,339	小売
HALLIBURTON CO	443.17	443.17	986	112,183	エネルギー
TELADOC HEALTH INC	61.22	74.96	797	90,748	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	575.38	571.04	23,231	2,642,996	小売
ALBEMARLE CORP	55.48	65.6	1,809	205,905	素材
CDW CORP/DE	74.04	74.04	1,442	164,090	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	31.14	31.14	485	55,281	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	530.62	758.17	1,165	132,577	銀行
HERSHEY CO/THE	75.14	75.14	1,346	153,158	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	68.99	67.44	2,886	328,443	ヘルスケア機器・サービス
SQUARE INC - A	197.41	207.89	4,425	503,472	ソフトウェア・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	99.21	99.21	2,645	301,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPLUNK INC	82.52	82.52	1,031	117,353	ソフトウェア・サービス
S&P GLOBAL INC	130.4	127.67	5,935	675,311	各種金融
MARKETAXESS HOLDINGS INC	19.12	19.12	674	76,778	各種金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	207.99	207.99	1,014	115,428	銀行
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	41.41	41.41	206	23,504	メディア・娯楽
HP INC	731.61	653.88	2,349	267,290	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	39.15	39.15	596	67,840	ソフトウェア・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	478.85	471.43	5,586	635,569	ソフトウェア・サービス
EAST WEST BANCORP INC	92.01	—	—	—	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	30.22	—	—	—	保険
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	70.05	76.75	2,257	256,794	ヘルスケア機器・サービス
SNAP INC - A	455.53	496.43	2,425	275,899	メディア・娯楽
XPO LOGISTICS INC	47.16	—	—	—	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	57.07	57.07	967	110,118	メディア・娯楽
LEIDOS HOLDINGS INC	69.47	69.47	629	71,567	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	
DUPONT DE NEMOURS INC	389.56	279.44	2,152	244,924	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	210.79	210.79	588	66,956	電気通信サービス
BLACK KNIGHT INC	76.23	76.23	557	63,432	ソフトウェア・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	79.4	79.4	459	52,239	運輸
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	81.99	81.95	690	78,550	保険
JUNIPER NETWORKS INC	174.6	174.6	555	63,247	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JM SMUCKER CO/THE	57.68	57.68	746	84,895	食品・飲料・タバコ
INGERSOLL-RAND INC	205.03	210.13	1,256	142,960	資本財
JOHNSON & JOHNSON	1,407.94	1,413.74	22,584	2,569,438	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ON SEMICONDUCTOR CORP	209.12	209.12	1,317	149,934	半導体・半導体製造装置
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	—	26.34	914	104,048	半導体・半導体製造装置
HOWMET AEROSPACE INC	190.24	190.24	542	61,684	資本財
QORVO INC	60.42	60.42	911	103,687	半導体・半導体製造装置
IDEXX LABORATORIES INC	46.83	46.01	2,904	330,457	ヘルスケア機器・サービス
ARISTA NETWORKS INC	32.97	129.52	1,639	186,551	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EXACT SCIENCES CORP	84.28	84.28	729	83,007	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	26.18	—	—	—	不動産
EVERGY INC	112.73	112.73	735	83,697	公益事業
RINGCENTRAL INC-CLASS A	39.92	39.92	886	100,862	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	87.57	87.57	1,356	154,344	半導体・半導体製造装置
KIMBERLY-CLARK CORP	178	178	2,403	273,470	家庭用品・パーソナル用品
INGREDION INC	33.2	—	—	—	食品・飲料・タバコ
NORDSON CORP	32.07	28.84	756	86,014	資本財
KROGER CO	408.43	389.55	1,649	187,691	食品・生活必需品小売り
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	75.12	87.7	945	107,608	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	182.83	174.17	418	47,655	メディア・娯楽
POOL CORP	—	21.07	1,180	134,263	小売
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	106.9	999	113,690	消費者サービス
DOCUSIGN INC	90.78	100.78	2,534	288,363	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS B	87.73	87.73	302	34,424	メディア・娯楽
DOW INC	386.54	415.16	2,360	268,565	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	52.2	52.2	507	57,784	各種金融
CBRE GROUP INC - A	182.44	182.44	1,787	203,327	不動産
COUPA SOFTWARE INC	34.9	34.9	707	80,467	ソフトウェア・サービス
KLA CORP	81.57	81.57	3,375	384,052	半導体・半導体製造装置
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	83.07	110.98	2,430	276,488	ソフトウェア・サービス
COPART INC	109.77	109.77	1,624	184,842	商業・専門サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	61.17	61.17	1,386	157,767	小売
NRG ENERGY INC	135.47	135.47	496	56,455	公益事業
DISCOVERY INC - A	70.75	70.75	173	19,793	メディア・娯楽
TWILIO INC - A	65.43	89.93	2,637	300,013	ソフトウェア・サービス
CORTEVA INC	417.98	393.48	1,833	208,565	素材
LOCKHEED MARTIN CORP	136.32	133.59	4,558	518,619	資本財
IDEX CORP	38.39	38.39	899	102,385	資本財
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	224.6	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12.88	12.88	262	29,921	保険
EPAM SYSTEMS INC	31.28	30.95	1,962	223,302	ソフトウェア・サービス
LENNOX INTERNATIONAL INC	20.56	15.27	491	55,960	資本財
EQUITABLE HOLDINGS INC	228.2	228.2	735	83,702	各種金融
CERNER CORP	155.37	155.37	1,132	128,790	ヘルスケア機器・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	156.85	153.31	1,843	209,758	ソフトウェア・サービス
RESMED INC	80.36	75.95	1,951	222,000	ヘルスケア機器・サービス
BATH & BODY WORKS INC	—	154	1,168	132,928	小売
DATADOG INC - CLASS A	68.59	104.23	1,907	216,994	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	257.77	257.77	517	58,916	公益事業
GENERAC HOLDINGS INC	—	33	1,401	159,404	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	
LOWE'S COS INC	406.63	377.98	9,395	1,068,963	小売
UNITED RENTALS INC	35.96	41.13	1,468	167,062	資本財
ELI LILLY & CO	463.55	439.37	11,196	1,273,821	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZENDESK INC	—	60.67	577	65,648	ソフトウェア・サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	80.29	80.29	691	78,630	商業・専門サービス
LAM RESEARCH CORP	75.81	77.79	5,293	602,289	半導体・半導体製造装置
OKTA INC	59.12	63.06	1,410	160,425	ソフトウェア・サービス
CARVANA CO	—	38.03	1,110	126,325	小売
LOEWS CORP	139.14	127.27	701	79,796	保険
BIO-RAD LABORATORIES-A	12.2	12.2	914	104,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARKEL CORP	7.02	7.02	873	99,333	保険
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	74.11	98.74	2,217	252,274	ソフトウェア・サービス
NORTONLIFELOCK INC	313.47	313.47	793	90,264	ソフトウェア・サービス
ROLLINS INC	76.62	114.93	406	46,196	商業・専門サービス
ETSY INC	—	71.68	2,017	229,547	小売
DYNATRACE INC	111.94	95.87	618	70,318	ソフトウェア・サービス
LINCOLN NATIONAL CORP	116.2	86.77	592	67,464	保険
PLUG POWER INC	—	285.84	1,189	135,348	資本財
MCDONALD'S CORP	398.83	402.64	10,078	1,146,583	消費者サービス
CABLE ONE INC	2.46	2.46	449	51,104	メディア・娯楽
3M CO	310.51	306.04	5,393	613,600	資本財
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	77.45	105.66	775	88,173	各種金融
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,283.26	1,284.02	43,403	4,938,042	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	—	72.93	1,872	212,998	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	44.7	44.7	1,777	202,261	ソフトウェア・サービス
COSTAR GROUP INC	20.54	205.4	1,642	186,923	商業・専門サービス
IAC/INTERACTIVECORP	—	39.74	519	59,142	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	15.05	100.46	3,664	416,919	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	115.46	115.46	906	103,090	ソフトウェア・サービス
VIATRIS INC	630.72	630.72	789	89,839	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOORDASH INC - A	—	38.44	703	80,036	小売
ZSCALER INC	42.74	45.51	1,619	184,283	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	128.23	121.71	1,704	193,871	資本財
MODERNA INC	144.09	178.13	6,564	746,816	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLAR TREE INC	120.47	120.47	1,702	193,732	小売
PELTON INTERACTIVE INC-A	102.16	125.99	559	63,628	耐久消費財・アパレル
FOX CORP - CLASS A	169.62	169.62	626	71,246	メディア・娯楽
PHILLIPS 66	224.92	224.92	1,571	178,765	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	258.78	221.98	913	103,872	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	65.42	130.84	1,138	129,490	食品・飲料・タバコ
METLIFE INC	415.34	397.03	2,377	270,523	保険
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	349.76	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MOTOROLA SOLUTIONS INC	92.41	92.12	2,390	271,968	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCKWELL AUTOMATION INC	62.19	62.19	2,118	240,972	資本財
MERCK & CO. INC.	1,353.01	1,364.93	10,221	1,162,952	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MASCO CORP	148.85	148.85	1,002	114,038	資本財
MARSH & MCLENNAN COS	266.25	266.25	4,447	505,954	保険
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	422.07	445.47	2,539	288,933	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	147.15	147.15	2,218	252,407	消費者サービス
WORKDAY INC-CLASS A	90.8	98.64	2,777	316,007	ソフトウェア・サービス
SUNRUN INC	61.12	106.69	510	58,093	資本財
BAKER HUGHES CO	319.74	374.18	880	100,168	エネルギー
AMERCO	3.9	6.5	466	53,039	運輸
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	451.11	3,384	385,023	半導体・半導体製造装置
CHENIERE ENERGY INC	117.47	137.63	1,467	166,916	エネルギー
NETAPP INC	109.19	109.19	999	113,691	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	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
NIKE INC -CL B	665.94	687.23	11,673	1,328,148	耐久消費財・アパレル
NORFOLK SOUTHERN CORP	139.42	137.09	3,684	419,146	運輸
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	127.45	287.04	2,422	275,621	半導体・半導体製造装置
NORTHROP GRUMMAN CORP	82.95	82.15	2,927	333,089	資本財
NEWMONT CORP	418.82	418.82	2,320	263,976	素材
MCKESSON CORP	84.11	84.11	1,877	213,651	ヘルスケア機器・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	138.14	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	838.74	843.16	7,365	837,916	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP	154.55	154.55	1,732	197,054	素材
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	276.58	1,018	115,922	メディア・娯楽
WESTERN UNION CO	218.4	218.4	352	40,153	ソフトウェア・サービス
NEWELL BRANDS INC	251.06	175.87	393	44,719	耐久消費財・アパレル
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	442.07	485.8	1,460	166,140	エネルギー
PAYCHEX INC	177.34	177.29	2,193	249,566	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	977.25	989.56	4,302	489,507	食品・飲料・タバコ
P G & E CORP	635.37	765.38	947	107,801	公益事業
PFIZER INC	2,976.7	3,012.01	15,782	1,795,624	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	269.59	292.37	1,917	218,171	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	66.91	66.91	2,068	235,328	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	88.58	121.84	2,234	254,168	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,319.2	1,315.39	19,601	2,230,112	家庭用品・パーソナル用品
EXELON CORP	508.37	508.37	2,753	313,304	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	115.19	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVR INC	1.73	1.73	913	103,956	耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS	557.97	734.21	5,297	602,676	エネルギー
ABIOMED INC	22.88	22.88	730	83,068	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	743.95	744.41	12,218	1,390,126	食品・飲料・タバコ
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	207.28	207.28	2,177	247,684	保険
ACCENTURE PLC-CL A	342.23	339.89	12,433	1,414,599	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	82.2	—	631	71,822	資本財
QUALCOMM INC	604.16	608.94	11,188	1,272,934	半導体・半導体製造装置
ADVANCE AUTO PARTS INC	34.26	34.26	778	88,584	小売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	141.24	141.24	1,001	113,960	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	52.97	54.95	3,595	409,108	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REPUBLIC SERVICES INC	114.15	114.15	1,577	179,517	商業・専門サービス
BOOKING HOLDINGS INC	22.15	22.31	4,868	553,839	消費者サービス
ROSS STORES INC	187.92	187.92	2,098	238,725	小売
PACKAGING CORP OF AMERICA	46.82	46.82	625	71,218	素材
QUEST DIAGNOSTICS INC	68.14	68.14	1,067	121,478	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC	55.55	55.55	637	72,527	商業・専門サービス
RALPH LAUREN CORP	19.71	—	—	—	耐久消費財・アパレル
RPM INTERNATIONAL INC	76.21	76.96	715	81,445	素材
PERKINELMER INC	56.24	56.24	1,041	118,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEICO CORP	18.88	18.88	264	30,110	資本財
HEICO CORP-CLASS A	44.35	45.7	580	66,030	資本財
REGIONS FINANCIAL CORP	557.26	470.41	1,107	125,982	銀行
CHEVRON CORP	1,033.25	1,041.57	11,962	1,360,965	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	212.5	217.01	1,433	163,121	公益事業
IPG PHOTONICS CORP	17.76	17.76	289	32,971	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TESLA INC	395.14	438.7	49,879	5,674,819	自動車・自動車部品
STANLEY BLACK & DECKER INC	80.07	91.29	1,681	191,259	資本財
SYNOPSIS INC	78.69	78.69	2,800	318,594	ソフトウェア・サービス
SOUTHERN CO/THE	573.36	556.86	3,498	397,989	公益事業
SYSCO CORP	251.65	268.62	1,966	223,705	食品・生活必需品小売り
TRAVELERS COS INC/THE	131.26	131.26	2,000	227,585	保険
SIGNATURE BANK	25.08	—	—	—	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	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
SCHLUMBERGER LTD	734.44	734.44			2,177	247,747	エネルギー
AT&T INC	3,819.17	3,854.89			9,209	1,047,745	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	96.2	70.76			315	35,856	運輸
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	43.3	136.16			4,551	517,830	素材
SEMPRA ENERGY	153.04	163.53			2,031	231,071	公益事業
TIFFANY & CO	55.41	—			—	—	小売
SEAGATE TECHNOLOGY	126.34	—			—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TYLER TECHNOLOGIES INC	20.16	20.16			1,050	119,560	ソフトウェア・サービス
TEXAS INSTRUMENTS INC	493.45	498.76			9,694	1,102,988	半導体・半導体製造装置
SALESFORCE.COM INC	481.87	522.57			15,506	1,764,202	ソフトウェア・サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	386.44	388.03			3,040	345,929	資本財
TERADYNE INC	85.42	85.42			1,319	150,098	半導体・半導体製造装置
UNION PACIFIC CORP	364.9	359.04			8,597	978,145	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	816.34	820.39			6,804	774,126	資本財
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	379.28	391.13			8,004	910,624	運輸
DEXCOM INC	47.65	50.47			2,881	327,872	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	124.54	147.6			1,255	142,886	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	505.11	506.62			22,899	2,605,244	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	52.27	52.27			1,277	145,374	ソフトウェア・サービス
VALERO ENERGY CORP	220.07	214.47			1,462	166,336	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	27.65	27.65			1,109	126,276	小売
WALT DISNEY CO/THE	962.03	976.83			14,438	1,642,670	メディア・娯楽
WELLS FARGO & CO	2,103.54	2,228.62			10,955	1,246,452	銀行
INSULET CORP	34	34			1,005	114,447	ヘルスケア機器・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	220.23	220.23			3,674	418,002	商業・専門サービス
WHIRLPOOL CORP	32.12	32.12			715	81,410	耐久消費財・アパレル
WALMART INC	759.45	833.65			11,890	1,352,765	食品・生活必需品小売り
WYNN RESORTS LTD	49.13	49.13			407	46,393	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	649.28	638.82			4,514	513,619	小売
WATERS CORP	35.27	34.25			1,168	132,960	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WASTE CONNECTIONS INC	135.56	135.56			1,859	211,583	商業・専門サービス
WESTERN DIGITAL CORP	148.57	148.57			876	99,709	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEC ENERGY GROUP INC	164.38	164.38			1,487	169,229	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	275.32	272.31			1,749	199,051	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	901.86	908.92			17,841	2,029,792	ソフトウェア・サービス
PPL CORP	427.27	395.61			1,125	128,004	公益事業
PULTEGROUP INC	157.55	130.75			673	76,623	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	122.56	122.56			1,928	219,417	素材
NORTHERN TRUST CORP	112.14	110.23			1,322	150,415	各種金融
NVIDIA CORP	328.93	1,335.64			44,578	5,071,675	半導体・半導体製造装置
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	225.26	231.68			4,653	529,484	銀行
TYSON FOODS INC-CL A	149.49	149.49			1,224	139,257	食品・飲料・タバコ
NETFLIX INC	235.71	238.52			15,833	1,801,424	メディア・娯楽
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	211.85	211.63			13,729	1,562,052	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBE LIFE INC	60.4	43.33			383	43,612	保険
TEXTRON INC	118.03	118.03			859	97,744	資本財
NEWS CORP - CLASS A	166.62	231.02			504	57,349	メディア・娯楽
OMNICOM GROUP	104.17	104.17			702	79,961	メディア・娯楽
ORACLE CORP	1,104.15	1,012.06			9,406	1,070,130	ソフトウェア・サービス
MASTERCARD INC - A	478.11	475.6			15,362	1,747,775	ソフトウェア・サービス
LUMEN TECHNOLOGIES INC	—	497.58			644	73,309	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	56.03	56.57			2,723	309,879	資本財
YUM! BRANDS INC	155.49	155.49			1,947	221,568	消費者サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	96.29	96.29			436	49,658	食品・飲料・タバコ
BANK OF AMERICA CORP	4,184.01	4,143.47			18,890	2,149,124	銀行
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	90.8	90.8			793	90,286	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 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
AMERICAN EXPRESS CO	370.48	370.2	5,843	664,869	各種金融
ANALOG DEVICES INC	192.98	292.73	5,362	610,127	半導体・半導体製造装置
ADVANCED MICRO DEVICES	632.79	656.29	10,625	1,208,919	半導体・半導体製造装置
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	447.45	447.45	2,458	279,730	保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	90.36	118.9	830	94,541	消費者サービス
AVERY DENNISON CORP	48.32	42.32	912	103,772	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	287.37	293.48	2,339	266,145	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	311.78	311.78	2,832	322,291	資本財
AMGEN INC	316.21	311.56	6,339	721,223	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EATON CORP PLC	212.53	213.26	3,569	406,107	資本財
CONSTELLATION BRANDS INC-A	88.81	88.81	2,015	229,328	食品・飲料・タバコ
APPLIED MATERIALS INC	482.6	496.83	7,513	854,761	半導体・半導体製造装置
CME GROUP INC	187.12	187.12	4,216	479,696	各種金融
ECOLAB INC	139.12	141.57	3,215	365,857	素材
EQUIFAX INC	61.27	68.41	1,943	221,084	商業・専門サービス
GILEAD SCIENCES INC	661.68	656.73	4,639	527,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STATE STREET CORP	186.94	186.94	1,742	198,198	各種金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	828.87	773	6,191	704,433	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	264.34	264.34	2,009	228,652	ヘルスケア機器・サービス
CAMPBELL SOUP CO	106.38	106.38	438	49,863	食品・飲料・タバコ
CROWN HOLDINGS INC	68.63	68.63	743	84,639	素材
CARDINAL HEALTH INC	151.14	151.14	717	81,625	ヘルスケア機器・サービス
FEDEX CORP	134.81	130.83	3,147	358,077	運輸
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	236.54	236.54	3,477	395,647	各種金融
FMC CORP	66.76	66.76	691	78,641	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	48.71	139.22	2,049	233,135	素材
CITRIX SYSTEMS INC	64.9	64.9	534	60,819	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	2,270.51	2,177.38	10,886	1,238,602	半導体・半導体製造装置
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	196.26	196.26	667	75,961	メディア・娯楽
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	183.31	183.31	1,257	143,087	保険
ILLINOIS TOOL WORKS	166.9	168.69	4,016	456,977	資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	676.56	676.56	424	48,261	メディア・娯楽
ILLUMINA INC	76.55	76.55	2,838	322,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	64.1	64	711	80,902	ソフトウェア・サービス
SNAP-ON INC	31.57	31.06	661	75,204	資本財
CARMAX INC	84.27	84.27	1,234	140,436	小売
COMERICA INC	76.91	-	-	-	銀行
DANAHER CORP	342.7	346.32	11,308	1,286,515	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DUKE ENERGY CORP	398.62	420.41	4,213	479,352	公益事業
TARGET CORP	270.76	268.17	6,681	760,179	小売
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	69.27	69.27	1,011	115,131	商業・専門サービス
CINTAS CORP	46.15	51.69	2,247	255,654	商業・専門サービス
CONAGRA BRANDS INC	246.39	246.39	776	88,328	食品・飲料・タバコ
CLOROX COMPANY	65.42	65.42	1,106	125,902	家庭用品・パーソナル用品
ENTERGY CORP	108.66	108.66	1,141	129,890	公益事業
MICROSOFT CORP	3,840.36	3,828.65	128,883	14,663,115	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	92.43	92.43	650	73,999	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CVS HEALTH CORP	706.17	693.53	6,381	726,064	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	720.39	726.98	8,017	912,109	ヘルスケア機器・サービス
MICRON TECHNOLOGY INC	595.08	612.23	5,273	599,994	半導体・半導体製造装置
BLACKROCK INC	82.25	82.52	7,657	871,234	各種金融
HASBRO INC	74.91	74.91	742	84,483	耐久消費財・アパレル
KEYCORP	511.28	511.28	1,167	132,798	銀行
KANSAS CITY SOUTHERN	51	48.66	1,441	163,972	運輸
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	772.58	751.11	4,554	518,191	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	27.71	27.71	1,056	120,172	ヘルスケア機器・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	
CHUBB LTD	245.03	245.24	4,537	516,279	保険
ARROW ELECTRONICS INC	41.3	41.3	513	58,461	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALLSTATE CORP	166.54	164.19	1,857	211,344	保険
EBAY INC	366.68	355.51	2,508	285,349	小売
EASTMAN CHEMICAL CO	70.27	70.27	774	88,084	素材
XILINX INC	128.76	128.76	3,001	341,439	半導体・半導体製造装置
DISH NETWORK CORP-A	129.37	129.37	428	48,762	メディア・娯楽
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	122.55	124	4,216	479,724	家庭用品・パーソナル用品
TRIMBLE INC	127.59	127.59	1,104	125,606	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LENNAR CORP-A	144.94	144.94	1,554	176,853	耐久消費財・アパレル
LEAR CORP	27.49	37.36	631	71,832	自動車・自動車部品
STRYKER CORP	182.98	179.83	4,378	498,182	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	336.56	336.56	794	90,441	公益事業
PROGRESSIVE CORP	305.43	305.43	2,900	330,009	保険
AIRBNB INC-CLASS A	—	65.54	1,180	134,276	消費者サービス
ALLEGHANY CORP	6.89	6.89	457	52,106	保険
ALTICE USA INC- A	180.72	96.67	154	17,586	メディア・娯楽
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	35.39	35.39	488	55,619	保険
AMPHENOL CORP-CL A	156.98	313.96	2,603	296,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARAMARK	132.42	132.42	455	51,794	消費者サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	88.08	440	50,164	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	69.65	69.65	653	74,327	公益事業
AVALARA INC	43.19	43.19	616	70,118	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	256.06	304.28	1,210	137,710	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PACCAR INC	180.41	180.41	1,553	176,763	資本財
BIO-TECHNE CORP	—	19.91	955	108,657	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CDK GLOBAL INC	58.08	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	140.4	169.96	1,038	118,203	公益事業
CARLYLE GROUP INC/THE	93.41	100.94	573	65,228	各種金融
CARRIER GLOBAL CORP	456.84	432.53	2,421	275,471	資本財
CATALENT INC	89.35	89.35	1,196	136,175	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTERPOINT ENERGY INC	254.64	320.03	850	96,813	公益事業
CENTURYLINK INC	497.58	—	—	—	電気通信サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	69.79	788	89,698	ソフトウェア・サービス
CHEWY INC - CLASS A	—	39.69	272	31,003	小売
CHURCH & DWIGHT CO INC	124.85	124.85	1,170	133,164	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	—	126.73	2,421	275,514	ソフトウェア・サービス
DEVON ENERGY CORP	—	361.96	1,589	180,863	エネルギー
DOVER CORP	82.53	82.25	1,413	160,763	資本財
DRAFTKINGS INC - CL A	—	167.42	589	67,046	消費者サービス
DROPBOX INC-CLASS A	105.65	165.84	413	47,074	ソフトウェア・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	208.11	208.11	628	71,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ESSENTIAL UTILITIES INC	138.81	139.09	673	76,652	公益事業
FLIR SYSTEMS INC	68.67	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	19.39	19.39	910	103,556	各種金融
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	43.71	43.71	930	105,912	ソフトウェア・サービス
GARTNER INC	45.68	45.68	1,484	168,902	ソフトウェア・サービス
WW GRAINGER INC	23.9	23.9	1,184	134,753	資本財
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	47.31	47.31	560	63,765	ソフトウェア・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	77.87	—	—	—	資本財
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	146.17	146.17	2,018	229,607	消費者サービス
HUBSPOT INC	—	22.75	1,938	220,497	ソフトウェア・サービス
IAC/INTERACTIVECORP	39.74	—	—	—	メディア・娯楽
INTERNATIONAL PAPER CO	191.4	191.4	903	102,824	素材
IONIS PHARMACEUTICALS INC	67.6	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KELLOGG CO	129.49	129.49	827	94,093	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	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	74.17	74.17	395	44,967	食品・飲料・タバコ
LIBERTY BROADBAND-A	13.12	13.12	205	23,336	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	54.18	81.96	1,310	149,137	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	76.48	76.48	380	43,270	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	102.88	102.88	617	70,286	メディア・娯楽
LYFT INC-A	-	131.45	549	62,542	運輸
M & T BANK CORP	73.99	72.37	1,101	125,281	銀行
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	12.58	12.58	1,932	219,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONGODB INC	26.59	31.55	1,659	188,797	ソフトウェア・サービス
MOODY'S CORP	90.41	92.47	3,673	417,940	各種金融
BIOGEN INC	85.16	79.87	1,885	214,548	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	258.92	-	-	-	エネルギー
OGE ENERGY CORP	118.7	-	-	-	公益事業
NOVAVAX INC	-	36.01	698	79,462	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	255.89	247.25	1,544	175,697	エネルギー
OTIS WORLDWIDE CORP	211.11	211.11	1,764	200,742	資本財
OWENS CORNING	52.05	52.05	453	51,596	資本財
PPD INC	-	64.13	302	34,437	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	-	820.71	1,729	196,735	ソフトウェア・サービス
PINNACLE WEST CAPITAL	59.96	59.96	397	45,220	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	210.89	285.63	1,157	131,739	メディア・娯楽
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	64.26	96.39	969	110,287	各種金融
ROKU INC	56.2	60.12	1,390	158,192	メディア・娯楽
SAREPTA THERAPEUTICS INC	38.28	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENRY SCHEIN INC	75.59	75.59	557	63,441	ヘルスケア機器・サービス
SEALED AIR CORP	78.95	78.95	506	57,665	素材
SMITH (A. O.) CORP	71.57	71.57	578	65,840	資本財
STEEL DYNAMICS INC	101.91	101.91	625	71,189	素材
UNITY SOFTWARE INC	-	28.53	485	55,286	ソフトウェア・サービス
10X GENOMICS INC-CLASS A	-	38.14	550	62,679	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STARBUCKS CORP	629.62	638.21	7,066	804,001	消費者サービス
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	21.4	241	2,580	293,543	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	407.95	407.95	1,867	212,476	メディア・娯楽
UGI CORP	105.88	105.88	459	52,279	公益事業
UBER TECHNOLOGIES INC	496.19	671.87	2,667	303,461	運輸
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	47.18	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
VOYA FINANCIAL INC	73.08	73.08	454	51,756	各種金融
WAYFAIR INC- CLASS A	32.66	37.56	1,004	114,312	小売
WESTROCK CO	130.34	130.34	601	68,390	素材
PTC INC	54.62	54.62	602	68,554	ソフトウェア・サービス
WILLIAMS COS INC	648.02	648.02	1,815	206,504	エネルギー
PERRIGO CO PLC	61.87	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZILLOW GROUP INC - A	-	31.54	170	19,434	不動産
ZILLOW GROUP INC - C	79.06	79.06	428	48,805	不動産
ZIONS BANCORP NA	88.74	-	-	-	銀行
BOSTON BEER COMPANY INC-A	-	4.67	206	23,503	食品・飲料・タバコ
OAK STREET HEALTH INC	-	62.12	190	21,675	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	140.94	147.65	10,256	1,166,899	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	120.75	120.75	541	61,558	自動車・自動車部品
BEST BUY CO INC	121.32	121.32	1,346	153,139	小売
BALL CORP	181.03	171.66	1,627	185,161	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	745.56	745.56	2,877	327,329	ヘルスケア機器・サービス
VULCAN MATERIALS CO	66.98	75.55	1,506	171,347	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	135.3	135.3	2,572	292,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	171.17	171.17	1,262	143,581	耐久消費財・アパレル
VIAKOMCBS INC - CLASS B	323.28	323.81	1,045	118,919	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	
MOHAWK INDUSTRIES INC	28.63	28.63	499	56,799	耐久消費財・アパレル
CARNIVAL CORP	222.89	481.56	874	99,493	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	2,440.57	2,468.63	12,720	1,447,251	メディア・娯楽
APTIV PLC	141.47	141.47	2,341	266,356	自動車・自動車部品
STERIS PLC	42.87	52.82	1,197	136,225	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	68.23	68.23	1,571	178,840	保険
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	126.11	122.53	634	72,238	食品・飲料・タバコ
LINDE PLC	282.34	280.91	9,009	1,025,057	素材
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	74.31	307	34,949	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NIELSEN HOLDINGS PLC	180.26	—	—	—	商業・専門サービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	76	76	440	50,063	資本財
NXP SEMICONDUCTORS NV	144.57	144.57	3,237	368,330	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	69.05	—	—	—	資本財
SEA LTD-ADR	—	37.25	1,109	126,273	メディア・娯楽
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	115	115	671	76,368	資本財
TELEFLEX INC	23.4	23.4	722	82,249	ヘルスケア機器・サービス
WIX.COM LTD	27.03	31.94	509	57,912	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	20.55	20.55	363	41,372	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	47.64	47.64	613	69,744	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	204.76	204.76	854	97,212	保険
TRANE TECHNOLOGIES PLC	127.59	127.59	2,461	280,055	資本財
NOVOOCURE LTD	—	45.17	421	47,972	ヘルスケア機器・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	—	118	1,227	139,699	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	26.04	26.04	318	36,264	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIGENE LTD-ADR	22.91	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	135	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	523	523	290	33,082	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	106	—	—	—	資本財
AMCOR PLC	823.02	823.02	953	108,429	素材
AON PLC-CLASS A	120.05	120.05	3,561	405,221	保険
IHS MARKIT LTD	195.84	195.84	2,548	289,938	商業・専門サービス
INVESCO LTD	183.28	183.28	425	48,459	各種金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	—	31.59	159	18,146	各種金融
CLARIVATE PLC	—	199.39	455	51,788	商業・専門サービス
小 計	株 数	金 額	2,202,902	250,624,236	
	591銘柄	598銘柄	—	<70.8%>	
(カナダ)			千カナダ・ドル		
IMPERIAL OIL LTD	129.99	129.99	557	49,718	エネルギー
METRO INC/CN	131.09	131.09	814	72,722	食品・生活必需品小売り
HYDRO ONE LTD	150.52	188.21	585	52,280	公益事業
TECK RESOURCES LTD-CLS B	248.14	248.14	840	75,062	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	170.08	332	29,709	資本財
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	44.38	473	42,279	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC	10.26	10.26	2,262	201,964	ソフトウェア・サービス
WSP GLOBAL INC	61.41	61.41	1,116	99,674	資本財
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	156.18	133.85	681	60,836	素材
ATCO LTD -CLASS I	30.3	30.3	128	11,505	公益事業
AIR CANADA	57.37	120.83	257	22,972	運輸
NUTRIEN LTD	298.98	298.98	2,608	232,870	素材
QUEBECOR INC -CL B	99.53	99.53	288	25,763	メディア・娯楽
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	313.59	313.59	550	49,096	公益事業
LUNDIN MINING CORP	282.09	464.46	483	43,198	素材
ALTAGAS LTD	173.47	173.47	432	38,616	公益事業
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	241.17	243.35	1,312	117,187	素材
INTACT FINANCIAL CORP	70.58	100.95	1,628	145,398	保険
BCE INC	83.79	55.09	357	31,893	電気通信サービス

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	
FRANCO-NEVADA CORP	101.65	101.65	1,829	163,282	素材
SUNCOR ENERGY INC	786.42	786.42	2,512	224,275	エネルギー
NATIONAL BANK OF CANADA	169.93	169.93	1,731	154,515	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	633.07	633.07	5,155	460,143	銀行
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	235.13	235.13	3,423	305,559	銀行
TORONTO-DOMINION BANK	966.93	984.88	9,217	822,753	銀行
ROYAL BANK OF CANADA	767.31	770.35	9,993	892,042	銀行
TC ENERGY CORP	504.73	539.18	3,290	293,672	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	930.98	930.98	2,274	203,011	素材
THOMSON REUTERS CORP	101.22	97.1	1,514	135,207	商業・専門サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	91.48	91.48	339	30,302	食品・生活必需品小売り
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	201.36	182.36	1,052	93,953	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	138.08	134.47	868	77,538	素材
KINROSS GOLD CORP	635.01	635.01	488	43,644	素材
BANK OF MONTREAL	330.57	354.24	4,853	433,218	銀行
CAMECO CORP	266.96	188.9	601	53,669	エネルギー
TELUS CORP	152.22	152.22	448	40,068	電気通信サービス
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	35.7	30.01	522	46,622	小売
IVANHOE MINES LTD-CL A	-	326.98	337	30,149	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	648.7	643.74	3,439	307,010	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	13.93	13.93	789	70,467	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	143.64	163.31	1,639	146,309	自動車・自動車部品
WESTON (GEORGE) LTD	42.81	35.78	488	43,587	食品・生活必需品小売り
PAN AMERICAN SILVER CORP	117.63	117.63	383	34,249	素材
BLACKBERRY LTD	259.93	259.93	326	29,140	ソフトウェア・サービス
ENBRIDGE INC	1,101.69	1,077.03	5,249	468,565	エネルギー
MANULIFE FINANCIAL CORP	998.1	998.1	2,387	213,104	保険
BAUSCH HEALTH COS INC	193.8	164.47	522	46,669	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	71.15	347.38	3,176	283,529	運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	90.66	90.66	483	43,115	耐久消費財・アパレル
CGI INC	128.82	114.93	1,234	110,208	ソフトウェア・サービス
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	272.32	272.32	1,014	90,520	メディア・娯楽
IGM FINANCIAL INC	64.33	49.49	241	21,588	各種金融
CI FINANCIAL CORP	110.41	-	-	-	各種金融
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	316.72	316.72	889	79,355	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	459.24	442.7	2,103	187,737	食品・生活必需品小売り
YAMANA GOLD INC	535.88	535.88	276	24,681	素材
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	56.67	56.67	502	44,847	商業・専門サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	730.84	694.48	5,130	457,914	各種金融
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	-	63.36	302	26,988	公益事業
B2GOLD CORP	656.5	429.63	219	19,634	素材
CAE INC	128.91	128.91	406	36,291	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B	65.63	87.05	552	49,308	素材
CANADIAN NATL RAILWAY CO	378.75	386.87	6,335	565,496	運輸
CANADIAN UTILITIES LTD-A	73.44	73.44	259	23,140	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	112.51	112.51	158	14,150	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENOVUS ENERGY INC	540.18	750.6	1,190	106,259	エネルギー
CRONOS GROUP INC	80.26	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	170.25	170.25	960	85,723	小売
EMERA INC	142.79	142.79	847	75,644	公益事業
FIRSTSERVICE CORP	-	25.16	636	56,836	不動産
FORTIS INC	241.71	241.71	1,352	120,733	公益事業
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	-	99.13	507	45,285	商業・専門サービス
GREAT-WEST LIFECO INC	142	142	531	47,467	保険
IA FINANCIAL CORP INC	48.51	48.51	338	30,258	保険
INTER PIPELINE LTD	193.94	-	-	-	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	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
KEYERA CORP	113.74	113.74	327	29,228	エネルギー
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	63.63	433	38,712	ソフトウェア・サービス
LOBLAW COMPANIES LTD	86.83	86.83	841	75,070	食品・生活必需品小売り
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC	—	30.84	378	33,812	ソフトウェア・サービス
NORTHLAND POWER INC	—	108.7	422	37,684	公益事業
ONEX CORPORATION	42.17	42.17	403	35,988	各種金融
OPEN TEXT CORP	136.65	136.65	847	75,672	ソフトウェア・サービス
PARKLAND CORP	76.66	76.66	261	23,381	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	274.11	321.72	1,240	110,702	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	332.78	317.68	1,328	118,613	保険
RESTAURANT BRANDS INTERN	145.1	145.1	1,058	94,495	消費者サービス
SSR MINING INC	115.52	—	—	—	素材
SAPUTO INC	134.25	134.25	389	34,727	食品・飲料・タバコ
SHOPIFY INC - CLASS A	58.05	60.82	12,164	1,085,758	ソフトウェア・サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	324.94	305.5	2,097	187,255	保険
TMX GROUP LTD	31.42	31.42	404	36,069	各種金融
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	38.43	426	38,055	資本財
小 計	株 数 20,792.08	株 数 21,673.53	134,073	11,967,436	
	銘柄 数 82銘柄	銘柄 数 88銘柄	—	—	< 3.4% >
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル		
AURIZON HOLDINGS LTD	944.4	944.4	322	26,178	運輸
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	57.83	57.83	188	15,339	各種金融
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	385.84	658.44	636	51,704	素材
BHP GROUP LTD	1,595.2	1,575.18	6,075	493,874	素材
REA GROUP LTD	28.33	28.33	456	37,077	メディア・娯楽
AUSNET SERVICES	852.2	1,377.72	347	28,222	公益事業
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	37.94	493	40,146	消費者サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287.24	1,287.24	432	35,158	保険
CIMIC GROUP LTD	40.62	—	—	—	資本財
SOUTH32 LTD	3,006.71	2,763.48	986	80,197	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	503.54	503.54	1,069	86,941	エネルギー
WISETECH GLOBAL LTD	79.09	79.09	409	33,309	ソフトウェア・サービス
XERO LTD	—	74.59	1,053	85,621	ソフトウェア・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	52.94	140.25	436	35,468	エネルギー
AFTERPAY LTD	115.68	114.91	1,270	103,265	ソフトウェア・サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	921.05	884.48	1,556	126,542	素材
COLES GROUP LTD	664.43	735.52	1,326	107,802	食品・生活必需品小売り
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	656.07	449	36,532	食品・生活必需品小売り
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,666.95	1,731.85	4,710	382,927	銀行
WESTPAC BANKING CORP	1,975.23	2,017.31	4,220	343,061	銀行
SANTOS LTD	845.86	1,003.76	641	52,139	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,480.02	1,480.02	3,939	320,267	銀行
RIO TINTO LTD	193.36	193.36	1,844	149,936	素材
ORIGIN ENERGY LTD	1,094.48	880.6	433	35,219	公益事業
EVOLUTION MINING LTD	844.2	844.2	347	28,273	素材
OIL SEARCH LTD	1,056.18	1,056.18	412	33,570	エネルギー
SEEK LTD	181.86	172.66	592	48,141	メディア・娯楽
AGL ENERGY LTD	324.92	324.92	173	14,077	公益事業
TREASURY WINE ESTATES LTD	364.64	364.64	434	35,332	食品・飲料・タバコ
NEWCREST MINING LTD	421.31	421.31	1,018	82,812	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	949.46	960.41	9,006	732,156	銀行
AMPOL LTD	133.86	109.27	316	25,697	エネルギー
ORICA LTD	179.81	179.81	258	21,018	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	855.23	808.63	938	76,250	保険
WOOLWORTHS GROUP LTD	680.13	656.07	2,630	213,861	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	343.39	—	—	—	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		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
TABCORP HOLDINGS LTD	1,308.04	1,128.17	562	45,762			消費者サービス
CROWN RESORTS LTD	218.63	218.63	242	19,727			消費者サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	458.31	458.31	224	18,255			運輸
TELSTRA CORP LTD	2,169.43	2,169.43	867	70,541			電気通信サービス
AMP LTD	2,235.04	—	—	—			各種金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	247.13	261.08	1,434	116,579			素材
MACQUARIE GROUP LTD	173.36	189.53	3,677	298,909			各種金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	307.49	307.49	1,371	111,456			消費者サービス
CSL LTD	241.83	247.47	7,597	617,586			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESFARMERS LTD	596.74	606.28	3,529	286,885			小売
COCHLEAR LTD	37.98	33.68	763	62,058			ヘルスケア機器・サービス
BLUESCOPE STEEL LTD	230.89	254.62	517	42,079			素材
SUNCORP GROUP LTD	639.33	639.33	680	55,349			保険
ASX LTD	111.8	111.8	1,017	82,720			各種金融
COMPUTERSHARE LTD	279.67	335.63	642	52,220			ソフトウェア・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,171.87	1,171.87	512	41,629			保険
SONIC HEALTHCARE LTD	210.81	242.58	1,035	84,201			ヘルスケア機器・サービス
BRAMBLES LTD	837.26	746.38	753	61,279			商業・専門サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	94.46	94.46	625	50,832			ヘルスケア機器・サービス
TPG TELECOM LTD	177.58	—	—	—			電気通信サービス
REECE LTD	—	193.09	452	36,823			資本財
小計	株数 35,873.64	株数 34,533.84	金額 75,938	金額 6,173,027			
	銘柄数 53銘柄	銘柄数 53銘柄		<1.7%>			
(香港)			千香港・ドル				
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	715	715	3,417	49,864			公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,180	1,180	5,150	75,148			消費者サービス
MTR CORP	845	845	3,549	51,779			運輸
SUN HUNG KAI PROPERTIES	680	680	6,579	95,987			不動産
SINO LAND CO	2,242	2,482	2,395	34,944			不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	270	270	1,189	17,352			不動産
CLP HOLDINGS LTD	851	851	6,535	95,355			公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	833.84	833.84	2,755	40,207			不動産
HONG KONG & CHINA GAS	5,775.14	6,063.89	7,179	104,751			公益事業
HANG SENG BANK LTD	388	388	5,466	79,762			銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	848.33	848.33	2,680	39,111			不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,509.24	1,539.24	7,773	113,410			資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,399.24	1,029.24	4,662	68,025			不動産
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	629	629	27,990	408,381			各種金融
WH GROUP LTD	5,345	5,815	2,965	43,268			食品・飲料・タバコ
HANG LUNG PROPERTIES LTD	980	980	1,568	22,877			不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	193	—	—	—			半導体・半導体製造装置
KERRY PROPERTIES LTD	275	—	—	—			不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	872.2	—	—	—			銀行
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	460	—	—	—			ヘルスケア機器・サービス
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	—	940	1,821	26,578			資本財
SJM HOLDINGS LTD	800	800	446	6,512			消費者サービス
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	896	896	1,809	26,406			食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,020	910	3,662	53,439			不動産
SWIRE PROPERTIES LTD	530	530	1,028	15,001			不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	300	300	1,395	20,353			公益事業
PCCW LTD	2,560	—	—	—			電気通信サービス
ATA GROUP LTD	6,482	6,540	54,870	800,562			保険
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	700	2,016	29,413			運輸
SANDS CHINA LTD	1,160	1,160	2,166	31,614			消費者サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	1,170	1,703	24,854			小売
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	705	705	11,611	169,409			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	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,875	1,875	4,500	65,655	銀行
WYNN MACAU LTD	708	708	509	7,427	消費者サービス
ESR CAYMAN LTD	—	1,020	2,636	38,469	不動産
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	182,037	2,655,927	
	金額 比率	金額 比率	—	< 0.8% >	
(シンガポール)					
UNITED OVERSEAS BANK LTD	645	647	1,716	142,829	銀行
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	663	—	—	—	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD	950	966	2,974	247,492	銀行
SINGAPORE AIRLINES LTD	779.66	779.66	382	31,853	運輸
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	—	1,366	460	38,305	不動産
KEPPEL CORP LTD	699	547	284	23,713	資本財
UOL GROUP LTD	217	172	118	9,832	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	258	258	180	15,027	不動産
CAPITALAND LTD	1,366	—	—	—	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	51	—	—	—	小売
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,834	1,812	2,054	170,980	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	3,275	3,275	258	21,528	消費者サービス
VENTURE CORP LTD	115	87	163	13,617	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,655.15	4,398.15	1,059	88,198	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	991	1,086	417	34,700	資本財
SINGAPORE EXCHANGE LTD	428	428	395	32,871	各種金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,032	1,032	432	35,980	食品・飲料・タバコ
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	10,899	906,932	
	金額 比率	金額 比率	—	< 0.3% >	
(ニュージーランド)					
SPARK NEW ZEALAND LTD	897.12	1,114.59	485	37,633	電気通信サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	677.01	884.45	397	30,788	公益事業
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	707.11	707.11	550	42,679	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	286.78	312.5	1,031	79,952	ヘルスケア機器・サービス
RYMAN HEALTHCARE LTD	240.38	240.28	290	22,540	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	374.22	347.17	215	16,687	食品・飲料・タバコ
MERCURY NZ LTD	467.71	269.13	157	12,206	公益事業
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	3,127	242,489	
	金額 比率	金額 比率	—	< 0.1% >	
(イギリス)					
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	632.89	632.89	169	25,630	保険
BP PLC	10,572.5	10,791.42	3,536	535,968	エネルギー
ASHTED GROUP PLC	236.86	236.86	1,451	220,057	資本財
UNILEVER PLC	1,399.23	1,418.43	5,561	842,925	家庭用品・パーソナル用品
NMC HEALTH PLC	39.4	39.4	0	5	ヘルスケア機器・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	288.6	288.6	329	49,929	小売
BHP GROUP PLC	1,101.6	1,164.84	2,351	356,440	素材
AUTO TRADER GROUP PLC	439.54	439.54	321	48,790	メディア・娯楽
AVEVA GROUP PLC	35.27	60.37	194	29,461	ソフトウェア・サービス
BARCLAYS PLC	9,047.41	9,047.41	1,657	251,208	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,951.88	4,941.44	605	91,743	資本財
PRUDENTIAL PLC	1,401.78	1,434.05	1,856	281,352	保険
NATWEST GROUP PLC	2,452.44	3,162.87	665	100,858	銀行
EVRAZ PLC	282.75	282.75	161	24,512	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	100.74	100.74	214	32,566	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,781.01	1,657.53	911	138,118	資本財
AVIVA PLC	1,986.01	1,986.01	751	113,838	保険
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,708.24	2,665.28	4,064	616,023	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RELX PLC	1,009.74	1,062.84	2,490	377,419	商業・専門サービス
DIAGEO PLC	1,222.34	1,268.68	4,850	735,186	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		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
RIO TINTO PLC	608.69	611.3	2,825	428,175	素材
STANDARD CHARTERED PLC	1,465.61	1,465.61	607	92,005	銀行
TESCO PLC	—	3,999.3	1,115	169,111	食品・生活必需品小売り
PEARSON PLC	396.23	396.23	243	36,908	メディア・娯楽
NEXT PLC	68.6	68.6	546	82,781	小売
TAYLOR WIMPEY PLC	2,304.98	2,255.88	350	53,165	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC	170.64	170.64	489	74,146	資本財
VODAFONE GROUP PLC	14,408.41	15,460.57	1,702	257,986	電気通信サービス
KINGFISHER PLC	1,096.78	1,096.78	357	54,190	小売
WPP PLC	639.87	639.87	678	102,845	メディア・娯楽
UNITED UTILITIES GROUP PLC	332.07	332.07	361	54,782	公益事業
SEVERN TRENT PLC	124.18	124.18	360	54,711	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	905.52	905.52	560	84,897	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	386.01	373.85	2,304	349,256	家庭用品・パーソナル用品
SSE PLC	558.79	558.79	870	131,947	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	466.94	647.66	448	68,004	耐久消費財・アパレル
ASTRAZENECA PLC	703.4	835.63	6,991	1,059,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,405.4	3,136.37	893	135,426	保険
3I GROUP PLC	493.38	493.38	684	103,790	各種金融
SAGE GROUP PLC/THE	559.87	559.87	435	65,931	ソフトウェア・サービス
NATIONAL GRID PLC	1,925.47	1,918.51	1,920	291,118	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	37,565.26	38,170.21	1,786	270,741	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	500.03	500.03	781	118,451	食品・飲料・タバコ
Berkeley Group Holdings/The	71.87	66.37	287	43,505	耐久消費財・アパレル
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,238.72	1,143.93	2,923	443,144	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	10,767.78	11,079.75	4,613	699,238	銀行
ANGLO AMERICAN PLC	669.08	669.35	1,796	272,232	素材
COMPASS GROUP PLC	930.18	930.18	1,415	214,568	消費者サービス
PERSIMMON PLC	169.16	169.16	466	70,734	耐久消費財・アパレル
SAINSBURY (J) PLC	1,128.14	1,134.8	328	49,825	食品・生活必需品小売り
BT GROUP PLC	4,699.07	4,699.07	767	116,372	電気通信サービス
BURBERRY GROUP PLC	230.66	190.12	341	51,722	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC	443.55	443.55	550	83,358	ヘルスケア機器・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	174.88	177.16	1,217	184,462	各種金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,204.08	2,192.98	3,497	530,060	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,020.83	1,991.91	3,175	481,218	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	75.81	75.81	169	25,622	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADMIRAL GROUP PLC	115.35	115.35	347	52,674	保険
ANTOFAGASTA PLC	194.39	194.39	271	41,187	素材
ABRDN PLC	1,232.63	1,232.63	290	44,051	各種金融
EXPERIAN PLC	488.95	488.95	1,654	250,698	商業・専門サービス
TESCO PLC	5,065.78	—	—	—	食品・生活必需品小売り
SCHRODERS PLC	62.13	62.13	218	33,117	各種金融
HALMA PLC	198.39	198.39	600	91,075	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,462.35	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	167.71	167.71	319	48,472	食品・飲料・タバコ
ST JAMES' S PLACE PLC	261.57	261.57	408	61,943	各種金融
INTERTEK GROUP PLC	81.84	81.84	448	67,972	商業・専門サービス
MONDI PLC	251.28	251.28	439	66,570	素材
WHITBREAD PLC	112.82	112.82	324	49,159	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	195.72	195.72	262	39,793	各種金融
SMITHS GROUP PLC	241.68	243.69	354	53,775	資本財
OCADO GROUP PLC	221.77	273.79	502	76,102	食品・生活必需品小売り
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	368.51	237	35,968	保険
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	103.34	95.87	441	66,838	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	66.26	78.38	788	119,564	素材

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	
M&G PLC	1,330.64	1,330.64	253	38,378	各種金融
RSA INSURANCE GROUP LTD	522.95	—	—	—	保険
INFORMA PLC	781.52	781.52	370	56,143	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	36.85	36.85	583	88,466	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,463.49	2,217.14	323	49,060	資本財
GLENCORE PLC	5,380.15	5,395.65	1,926	292,023	素材
COCA-COLA HBC AG-DI	87.04	87.04	204	31,040	食品・飲料・タバコ
DCC PLC	59.54	59.54	335	50,840	資本財
ENTAIN PLC	288.65	288.65	503	76,383	消費者サービス
FERGUSON PLC	125.13	120.17	1,388	210,450	資本財
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	94,813	14,369,899	
	金額 <比率>	金額 <比率>	—	<4.1%>	
(イスラエル)			イスラエル・シケル		
BANK HAPOALIM BM	664.03	664.03	2,041	73,507	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	701.5	701.5	2,177	78,412	銀行
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	546.74	546.74	1,079	38,885	銀行
NICE LTD	32.51	32.51	2,876	103,573	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	92.49	92.49	1,083	39,002	銀行
AZRIELI GROUP LTD	21.4	21.4	622	22,417	不動産
ICL GROUP LTD	287.11	287.11	818	29,487	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	13.89	13.89	654	23,559	資本財
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	11,353	408,845	
	金額 <比率>	金額 <比率>	—	<0.1%>	
(スイス)			スイス・フラン		
UBS GROUP AG-REG	1,911.89	1,911.89	3,012	371,251	各種金融
JULIUS BAER GROUP LTD	124	125.5	717	88,445	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	21.32	21.32	512	63,143	資本財
HOLCIM LTD	272.39	272.39	1,238	152,685	素材
SWISS PRIME SITE-REG	39.06	39.06	346	42,653	不動産
VIFOR PHARMA AG	26.38	26.38	277	34,204	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.59	0.59	668	82,388	食品・飲料・タバコ
ADECCO GROUP AG-REG	87.86	91.18	398	49,154	商業・専門サービス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.05	0.05	561	69,204	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	9.73	12.03	1,894	233,524	各種金融
SCHINDLER HOLDING AG-REG	9.41	9.41	220	27,138	資本財
SIKA AG-REG	73.99	78	2,836	349,642	素材
ALCON INC	265.85	265.85	1,942	239,454	ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	15.7	15.7	111	13,699	銀行
ROCHE HOLDING AG-BR	—	19.21	735	90,680	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	25.16	25.16	133	16,450	耐久消費財・アパレル
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	374.19	377.96	13,512	1,665,362	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD-REG	981.55	908.36	2,901	357,585	資本財
SWISS RE AG	151.68	151.68	1,314	162,007	保険
NESTLE SA-REG	1,590.99	1,547.36	18,583	2,290,452	食品・飲料・タバコ
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,267.13	1,454.88	1,289	158,979	各種金融
SGS SA-REG	3.08	3.08	876	108,037	商業・専門サービス
SWATCH GROUP AG/THE-BR	16.92	17.16	468	57,780	耐久消費財・アパレル
BALOISE HOLDING AG - REG	24.75	24.75	342	42,187	保険
CLARIANT AG-REG	101.01	101.01	182	22,546	素材
NOVARTIS AG-REG	1,182.57	1,195.88	8,878	1,094,239	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	278.55	283.58	3,938	485,472	耐久消費財・アパレル
SWISSCOM AG-REG	13.99	13.99	718	88,523	電気通信サービス
GIVAUDAN-REG	4.84	4.84	2,189	269,870	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	82.02	80.94	3,090	380,878	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG	6.02	5.31	1,032	127,291	ヘルスケア機器・サービス
SONOVA HOLDING AG-REG	26.6	26.6	915	112,844	ヘルスケア機器・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	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	96.24	81.5	614	75,778	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG-REG	39.84	39.84	2,909	358,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEMENOS AG - REG	31.31	37.43	454	55,958	ソフトウェア・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	17.35	18.34	962	118,580	保険
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	30.3	29.81	793	97,767	運輸
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.44	1.83	404	49,845	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5.14	3.56	316	39,050	素材
GEBERIT AG-REG	19.86	19.86	1,386	170,852	資本財
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	評 価 額 外貨建金額	評 価 額 邦貨換算金額	
	9,230.75	9,343.27	83,685	10,314,264	
	39銘柄	40銘柄	—	< 2.9% >	
(デンマーク)			千デンマーク・クローネ		
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.68	1.68	3,111	53,733	運輸
PANDORA A/S	47.63	47.63	4,015	69,342	耐久消費財・アパレル
ORSTED A/S	103.45	95.55	8,085	139,635	公益事業
NOVO NORDISK A/S-B	922.02	908.61	65,029	1,123,054	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHR HANSEN HOLDING A/S	55.09	55.09	2,710	46,818	素材
DANSKE BANK A/S	401.89	391.03	4,289	74,081	銀行
H LUNDBECK A/S	28.96	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	524.4	11,615	200,598	資本財
GN STORE NORD A/S	72.99	64.84	2,500	43,178	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG AS-B	55.85	55.85	5,936	102,529	食品・飲料・タバコ
NOVOZYMES A/S-B SHARES	115.12	115.12	5,624	97,139	素材
COLOPLAST-B	66.38	63.99	6,875	118,743	ヘルスケア機器・サービス
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	3.49	3.11	6,114	105,593	運輸
TRYG A/S	57.52	169.89	2,688	46,430	保険
GENMAB A/S	33.17	36.88	9,404	162,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	—	5.13	1,407	24,301	資本財
DSV A/S	108.73	109.5	15,631	269,949	運輸
AMBU A/S-B	83.56	83.56	1,595	27,562	ヘルスケア機器・サービス
DEMANT A/S	44.55	44.55	1,401	24,204	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	104.88	—	—	—	資本財
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	評 価 額 外貨建金額	評 価 額 邦貨換算金額	
	2,306.96	2,776.41	158,037	2,729,313	
	18銘柄	18銘柄	—	< 0.8% >	
(ノルウェー)			千ノルウェー・クローネ		
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	135.96	114.12	2,365	29,831	保険
NORSK HYDRO ASA	643.44	832.94	5,039	63,545	素材
DNB BANK ASA	—	459.57	9,274	116,946	銀行
DNB ASA	490.48	—	—	—	銀行
ORKLA ASA	434.56	469.55	3,948	49,795	食品・飲料・タバコ
TELENOR ASA	374.98	349.37	4,817	60,752	電気通信サービス
EQUINOR ASA	518.71	518.71	11,782	148,577	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	90.05	90.05	4,010	50,576	素材
MOWI ASA	222.42	233.18	4,906	61,866	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-CL A	—	33.38	1,369	17,274	メディア・娯楽
ADEVINTA ASA	141.86	155.4	2,050	25,856	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS	54.8	54.8	1,961	24,738	メディア・娯楽
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	評 価 額 外貨建金額	評 価 額 邦貨換算金額	
	3,107.26	3,311.07	51,527	649,762	
	10銘柄	11銘柄	—	< 0.2% >	
(スウェーデン)			千スウェーデン・クローネ		
SWEDBANK AB - A SHARES	459.21	459.21	8,429	105,618	銀行
ERICSSON LM-B SHS	1,615.17	1,596.85	14,981	187,720	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VOLVO AB-B SHS	800.3	803.38	15,932	199,635	資本財
ICA GRUPPEN AB	56.14	56.14	2,998	37,577	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	109.3	106.42	2,889	36,202	各種金融
LUNDBERGS AB-B SHS	33.68	33.68	1,710	21,429	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B	327.01	299.42	8,755	109,700	家庭用品・パーソナル用品

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	外貨建金額	邦貨換算金額	
EPIROC AB-A	-	342.3	7,468	93,586	資本財
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	49.51	82.23	2,811	35,227	資本財
KINNEVIK AB - B	-	124.65	4,095	51,315	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	-	98.51	2,709	33,944	各種金融
SKF AB-B SHARES	206.07	206.07	4,333	54,300	資本財
ELECTROLUX AB-B	150.98	115.55	2,353	29,492	耐久消費財・アパレル
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	428.37	401.48	6,528	81,806	小売
NORDEA BANK ABP	1,679.42	1,679.42	18,010	225,666	銀行
SWEDISH MATCH AB	-	846.4	5,669	71,034	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	255.37	255.37	3,349	41,965	電気通信サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	883.17	883.17	11,613	145,519	銀行
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	776.68	776.68	7,482	93,756	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	343.7	343.7	5,179	64,899	素材
SKANSKA AB-B SHS	208.21	171.83	3,613	45,278	資本財
SANDVIK AB	610.7	610.7	14,009	175,538	資本財
INVESTOR AB-B SHS	-	1,012.75	21,455	268,832	各種金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	344.34	373.42	20,821	260,898	資本財
SECURITAS AB-B SHS	161.23	161.23	2,143	26,858	商業・専門サービス
TELIA CO AB	1,280.45	1,434.04	5,072	63,563	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	139.39	186.97	6,760	84,713	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	197.87	197.87	9,404	117,841	資本財
ASSA ABLLOY AB-B	521.19	521.19	13,498	169,140	資本財
BOLIDEN AB	-	130.86	4,009	50,239	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	185.93	185.93	2,444	30,623	資本財
HEXAGON AB-B SHS	-	1,031.1	13,765	172,477	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUNDIN ENERGY AB	85.81	85.81	2,906	36,417	エネルギー
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	-	53.23	3,645	45,674	不動産
SWEDISH MATCH AB	84.64	-	-	-	食品・飲料・タバコ
EPIROC AB-B	251.32	-	-	-	資本財
EQT AB	156.14	154.43	8,206	102,826	各種金融
EVOLUTION AB	66.29	90.21	9,051	113,417	消費者サービス
KINNEVIK AB-B SHS	136.78	-	-	-	各種金融
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	184.41	-	-	-	資本財
INVESTOR AB-B SHS	236.14	-	-	-	各種金融
VOLVO AB-A SHS	-	132.83	2,683	33,620	資本財
HEXAGON AB-B SHS	147.3	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EPIROC AB-A	393.07	-	-	-	資本財
BOLIDEN AB	130.86	-	-	-	素材
EMBRACER GROUP AB	-	300.12	2,853	35,754	メディア・娯楽
EPIROC AB-B	-	198.36	3,580	44,862	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	-	737.64	9,375	117,473	資本財
SINCH AB	-	276.9	3,421	42,866	ソフトウェア・サービス
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	13,696.15 36銘柄	17,558.05 41銘柄	300,025 3,759,319 <1.1%>
(ユーロ・・・アイルランド)					
KINGSPAN GROUP PLC	80.21	80.84	808	103,785	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	129.21	129.21	592	76,106	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	82.37	88.69	1,082	138,998	消費者サービス
KERRY GROUP PLC-A	85.06	81.93	887	113,991	食品・飲料・タバコ
CRH PLC	410.91	434.26	1,884	242,012	素材
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	787.76 5銘柄	814.93 5銘柄	5,255 674,895 <0.2%>
(ユーロ・・・オランダ)					
KONINKLIJKE PHILIPS NV	480.02	477.6	1,516	194,687	ヘルスケア機器・サービス
AIRBUS SE	314.64	320.94	3,199	410,841	資本財
HEINEKEN HOLDING NV	61.68	61.68	476	61,224	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	金額	株数	金額	株数	金額	
NN GROUP NV	159.22		140.69		617	79,291	保険
QIAGEN N. V.	125.43		125.43		617	79,292	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABN AMRO BANK NV-CVA	189.16		287.87		364	46,842	銀行
STELLANTIS NV	—		1,055.16		1,642	210,935	自動車・自動車部品
VOPAK	31.3		31.3		103	13,335	エネルギー
FERRARI NV	64.52		69.49		1,638	210,409	自動車・自動車部品
ADYEN NV	9.42		10.69		2,630	337,753	ソフトウェア・サービス
PROSUS NV	264.14		510.18		3,605	463,040	小売
CNH INDUSTRIAL NV	547.75		547.75		818	105,118	資本財
ASM INTERNATIONAL NV	—		24.55		973	124,963	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—		384.96		962	123,631	メディア・娯楽
HEINEKEN NV	131.43		131.43		1,228	157,697	食品・飲料・タバコ
AEGON NV	916.09		916.09		360	46,336	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	594.52		556.57		1,683	216,229	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL N. V.	103.99		98.86		933	119,913	素材
KONINKLIJKE DSM NV	89.94		94.22		1,807	232,054	素材
WOLTERS KLUWER	145.78		145.78		1,462	187,757	商業・専門サービス
ING GROEP NV	2,052.37		2,052.37		2,495	320,417	銀行
KONINKLIJKE KPN NV	1,736.03		1,736.03		454	58,383	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	228.41		225.44		15,889	2,040,307	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	72.79		62.41		350	44,958	商業・専門サービス
JDE PEET'S NV	—		21.66		54	6,967	食品・飲料・タバコ
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	280.21		280.21		366	47,082	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE	23.3		26.44		663	85,184	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	642.8		—		—	—	自動車・自動車部品
JUST EAT TAKEAWAY	63.55		93.07		541	69,495	小売
EXOR NV	62.04		62.04		489	62,840	各種金融
STMICROELECTRONICS NV	332.61		378.04		1,626	208,861	半導体・半導体製造装置
ALTICE EUROPE NV	376.25		—		—	—	電気通信サービス
小計	10,099.39		10,928.95		49,574	6,365,856	
	株数	金額	株数	金額			
	28銘柄	<比率>	30銘柄	<比率>	—	<1.8%>	
(ユーロ・・・ベルギー)							
SOFINA	8.04		8.04		327	41,998	各種金融
UCB SA	66.23		66.23		642	82,528	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KBC GROUP NV	144.07		130.92		950	122,017	銀行
COLRUYT SA	28.7		21.64		89	11,490	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	59.14		59.14		572	73,526	各種金融
SOLVAY SA	37.58		37.58		372	47,880	素材
UMICORE	105.6		102.88		443	56,899	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	398.98		409.43		2,081	267,290	食品・飲料・タバコ
AGEAS	87.65		112.47		520	66,882	保険
PROXIMUS	96.97		46.17		74	9,503	電気通信サービス
GALAPAGOS NV	23.18		—		—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELIA GROUP SA/NV	19.57		20.63		225	28,901	公益事業
TELENET GROUP HOLDINGS NV	21.81		—		—	—	メディア・娯楽
小計	1,097.52		1,015.13		6,299	808,919	
	株数	金額	株数	金額			
	13銘柄	<比率>	11銘柄	<比率>	—	<0.2%>	
(ユーロ・・・ルクセンブルグ)							
ARCELORMITTAL	366.89		366.89		896	115,142	素材
SES	278.6		—		—	—	メディア・娯楽
TENARIS SA	259.63		259.63		231	29,745	エネルギー
EUROFINS SCIENTIFIC	70.1		70.1		791	101,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AROUNDTOWN SA	521.14		525.6		290	37,255	不動産
INPOST SA	—		109.02		112	14,436	運輸
小計	1,496.36		1,331.24		2,322	298,278	
	株数	金額	株数	金額			
	5銘柄	<比率>	5銘柄	<比率>	—	<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		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ・・・フランス)			千ユーロ		
BUREAU VERITAS SA	178.17	178.17	—	64,769	商業・専門サービス
ORANGE	1,061.32	1,061.32	1,019	130,887	電気通信サービス
JCDECAUX SA	28.28	—	—	—	メディア・娯楽
GETLINK SE	223.11	223.11	287	36,943	運輸
SUEZ	189.86	189.86	375	48,199	公益事業
DASSAULT AVIATION SA	1.72	17.2	145	18,652	資本財
FAURECIA	31.27	60.9	226	29,044	自動車・自動車部品
TOTALENERGIES SE	1,334.48	1,354.3	5,579	716,491	エネルギー
TELEPERFORMANCE	29.7	29.7	1,061	136,304	商業・専門サービス
WORLDCOM SA	127.74	127.74	606	77,865	ソフトウェア・サービス
ESSILORLUXOTTICA	153.58	157.04	2,832	363,745	耐久消費財・アパレル
AMUNDI SA	39.55	39.55	296	38,115	各種金融
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	15.55	15.55	798	102,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICHELIN (CGDE)	87.46	87.46	1,122	144,146	自動車・自動車部品
AIR LIQUIDE SA	256.34	251.83	3,710	476,525	素材
KERING	41.33	39.06	2,670	342,973	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE	294.47	293.3	4,435	569,609	資本財
BOUYGUES SA	110.49	110.49	330	42,436	資本財
BNP PARIBAS	604.36	612.93	3,394	435,875	銀行
PEUGEOT SA	281.39	—	—	—	自動車・自動車部品
THALES SA	54.03	54.03	399	51,257	資本財
DANONE	320.81	343	1,863	239,294	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	358.27	359.9	545	70,107	食品・生活必需品小売り
VIVENDI SE	441.96	384.96	431	55,364	メディア・娯楽
L'OREAL	135.48	136.29	5,476	703,190	家庭用品・パーソナル用品
LEGRAND SA	149.97	133.23	1,276	163,861	資本財
PERNOD RICARD SA	111.12	111.08	2,294	294,689	食品・飲料・タバコ
SOCIETE GENERALE SA	410.25	410.25	1,127	144,791	銀行
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	149.19	148.67	10,365	1,331,004	耐久消費財・アパレル
ACCOR SA	104.51	104.51	278	35,791	消費者サービス
CAPGEMINI SE	80.59	89.61	1,809	232,322	ソフトウェア・サービス
VALEO	140.48	144.44	354	45,571	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	107.36	133.01	770	98,994	メディア・娯楽
SODEXO SA	39	39	293	37,630	消費者サービス
SEB SA	10.25	11.27	150	19,290	耐久消費財・アパレル
AXA SA	1,063.04	1,004.73	2,434	312,673	保険
EDENRED	121.39	121.39	491	63,130	ソフトウェア・サービス
RENAULT SA	88.3	88.3	257	33,046	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	16.76	16.76	2,748	352,952	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	60.86	45.92	171	22,029	ソフトウェア・サービス
DASSAULT SYSTEMES SE	70.23	351.15	1,876	240,922	ソフトウェア・サービス
ALSTOM	96.68	176.65	571	73,426	資本財
CNP ASSURANCES	89.78	89.78	193	24,878	保険
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	255.83	264.13	1,511	194,140	資本財
SANOFI	606.98	615.68	5,270	676,828	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VINCI SA	276.68	293.09	2,466	316,741	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	285.61	361.22	1,020	130,989	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	581.4	581.4	705	90,574	銀行
ENGIE	948.86	948.86	1,223	157,104	公益事業
UBISOFT ENTERTAINMENT	47.45	47.45	213	27,351	メディア・娯楽
EDF	296.44	207.79	256	32,939	公益事業
SAFRAN SA	173.98	182.12	1,850	237,602	資本財
ILIAD SA	10.16	—	—	—	電気通信サービス
ARKEMA	32.5	32.5	377	48,410	素材
SCOR SE	70.99	109.07	291	37,395	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	
IPSEN	14.98	14.98	129	16,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOLLORE	394.33	394.33	187	24,133	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	12.73	12.73	271	34,883	食品・飲料・タバコ
EURAZEO SE	17.92	17.92	131	16,901	各種金融
ORPEA	26.95	26.95	225	28,931	ヘルスケア機器・サービス
WENDEL	10.82	10.82	111	14,380	各種金融
EIFFAGE	49.89	49.89	410	52,737	資本財
ADP	13.46	13.46	140	18,044	運輸
NATIXIS	453.62	—	—	—	各種金融
BIOMERIEUX	25.91	15.7	199	25,674	ヘルスケア機器・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	57.85	57.85	241	31,073	消費者サービス
小 計	13,975.82	13,605.38	82,819	10,634,812	
	66銘柄	62銘柄	—	< 3.0% >	
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ		
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	18.56	—	—	—	運輸
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	468.95	468.95	110	14,193	電気通信サービス
BAYER AG-REG	532.63	517.33	2,344	301,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA	59.74	59.74	399	51,243	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	84.4	86.77	517	66,429	素材
EVONIK INDUSTRIES AG	133.12	109.52	292	37,549	素材
VONOVIA SE	280.71	395	1,942	249,399	不動産
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	77.65	77.65	582	74,782	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	25.08	25.64	180	23,211	自動車・自動車部品
KION GROUP AG	31.79	31.79	298	38,331	資本財
ZALANDO SE	79.11	123.67	1,007	129,425	小売
BECHTLE AG	—	43.05	272	34,959	ソフトウェア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	52.69	52.69	173	22,341	電気通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,024.59	1,134.78	1,211	155,596	各種金融
COVESTRO AG	93.46	117.97	597	76,772	素材
MTU AERO ENGINES AG	29.57	29.57	495	63,658	資本財
UNIPER SE	104.56	46.97	181	23,329	公益事業
COMMERZBANK AG	466.44	466.44	290	37,344	銀行
METRO AG	93.68	—	—	—	食品・生活必需品小売り
VOLKSWAGEN AG	19.84	19.6	500	64,279	自動車・自動車部品
SARTORIUS AG-VORZUG	18.04	13.08	758	97,416	ヘルスケア機器・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	98.69	97.76	1,608	206,527	自動車・自動車部品
LEG IMMOBILIEN SE	36.8	36.8	456	58,666	不動産
DEUTSCHE WOHNEN SE	181.44	—	—	—	不動産
NEMETSCHKE SE	30.11	30.11	323	41,583	ソフトウェア・サービス
RATIONAL AG	—	3.5	284	36,476	資本財
SYMRISE AG	65.24	65.24	821	105,472	素材
DELIVERY HERO SE	66.75	80.61	961	123,488	小売
SIEMENS ENERGY AG	198.55	198.55	478	61,419	資本財
TEAMVIEWER AG	95.85	90.59	111	14,366	ソフトウェア・サービス
VONOVIA SE-RTS	—	293.04	90	11,627	不動産
SIEMENS AG-REG	409.59	409.05	5,913	759,317	資本財
E.ON SE	1,166.81	1,269.98	1,395	179,255	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	178.73	178.73	1,533	196,871	自動車・自動車部品
GEA GROUP AG	81.78	81.78	364	46,804	資本財
CONTINENTAL AG	55.78	55.78	520	66,792	自動車・自動車部品
BASF SE	499.52	494.39	2,866	368,083	素材
ALLIANZ SE-REG	225.21	217.83	4,184	537,277	保険
THYSSENKRUPP AG	193.67	—	—	—	素材
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	90.43	90.43	642	82,562	家庭用品・パーソナル用品
RWE AG	347.39	346.73	1,214	155,921	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	165.74	331.48	182	23,415	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	株 数	評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
BRENTAG SE	73.92	73.92	564	72,462	資本財
FRESENIUS SE & CO KGAA	221.74	213.63	721	92,666	ヘルスケア機器・サービス
SAP SE	560.6	550.37	6,428	825,460	ソフトウェア・サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	75.72	73.64	1,760	226,095	保険
BEIERSDORF AG	51.38	51.38	458	58,891	家庭用品・パーソナル用品
MERCK KGAA	65.53	68.32	1,500	192,654	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADIDAS AG	102.34	101.46	2,580	331,314	耐久消費財・アパレル
PUMA SE	59.94	50.52	537	68,992	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,815.43	1,830.3	2,935	376,986	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	111.18	111.18	595	76,408	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	444.02	466.8	3,865	496,318	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE	650.83	715.33	2,877	369,442	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE POST AG-REG	30.58	30.58	475	61,061	保険
DEUTSCHE BOERSE AG	513.45	544.53	2,917	374,647	運輸
LANXESS AG	100.31	107.01	1,521	195,399	各種金融
FUCHS PETROLUB SE-PREF	44.09	44.09	225	29,010	素材
HOCHTIEF AG	33.7	33.7	134	17,223	素材
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	19.31	—	—	—	資本財
KNORR-BREMSE AG	22.69	19.24	341	43,853	ヘルスケア機器・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	38.81	38.81	350	45,071	資本財
SCOUT24 SE	141.82	164.26	1,058	135,963	ヘルスケア機器・サービス
HELLOFRESH SE	56.1	46.71	279	35,844	メディア・娯楽
	—	97.9	925	118,799	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 13,116.18	株 数 13,626.27	外 貨 建 金 額 69,167	邦 貨 換 算 金 額 8,881,824	
	金 額 61銘柄	金 額 60銘柄	比 率 —	比 率 < 2.5% >	
(ユーロ・・・ポルトガル)			千ユーロ		
GALP ENERGIA SGPS SA	304.82	296.87	249	31,983	エネルギー
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	1,879.06	1,879.06	1	241	銀行
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,359.64	1,459.1	709	91,170	公益事業
JERONIMO MARTINS	147.29	163.97	319	41,058	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 3,690.81	株 数 3,799	外 貨 建 金 額 1,280	邦 貨 換 算 金 額 164,453	
	金 額 4銘柄	金 額 4銘柄	比 率 —	比 率 < 0.0% >	
(ユーロ・・・スペイン)			千ユーロ		
BANKINTER SA	364.05	—	—	—	銀行
TELEFONICA SA	2,737	2,742.78	1,086	139,506	電気通信サービス
FERROVIAL SA	275.2	246.93	619	79,587	資本財
AENA SME SA	35.56	43.77	566	72,701	運輸
EDP RENOVAVEIS SA	—	147.91	332	42,658	公益事業
CAIXABANK SA	1,819.81	2,181.03	498	64,051	銀行
CELLNEX TELECOM SA	163.78	270.81	1,441	185,140	電気通信サービス
ENDESA SA	141.04	141.04	284	36,493	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA	3,528.89	3,528.89	1,694	217,600	銀行
IBERDROLA SA	3,189.22	3,127.16	3,100	398,185	公益事業
REPSOL SA	791.25	793.58	786	101,006	エネルギー
GRIFOLS SA	151.69	151.69	253	32,587	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANCO SANTANDER SA	8,933.41	9,272.2	2,580	331,356	銀行
AMADEUS IT GROUP SA	237.77	245.7	1,427	183,244	ソフトウェア・サービス
NATURGY ENERGY GROUP SA	154.39	154.39	380	48,829	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	157.16	129.31	278	35,766	資本財
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	580.98	583.28	1,730	222,225	小売
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	114.82	114.82	269	34,618	資本財
ENAGAS SA	144.71	144.71	291	37,387	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	236.32	236.32	437	56,200	公益事業
MAPFRE SA	463.67	—	—	—	保険
FERROVIAL SA RTS	275.2	—	—	—	資本財
小 計	株 数 24,495.92	株 数 24,256.32	外 貨 建 金 額 18,060	邦 貨 換 算 金 額 2,319,148	
	金 額 21銘柄	金 額 19銘柄	比 率 —	比 率 < 0.7% >	

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	
(ユーロ・・・イタリア)					
MONCLER SPA	104.37	122.09	千ユーロ 788	101,277	耐久消費財・アパレル
PRYSMIAN SPA	119.26	125.26	416	53,545	資本財
DIASORIN SPA	13.13	13.13	243	31,208	ヘルスケア機器・サービス
TELECOM ITALIA-RSP	2,513.78	3,783.08	168	21,617	電気通信サービス
LEONARDO SPA	291.18	—	—	—	資本財
POSTE ITALIANE SPA	265.62	265.62	297	38,184	保険
FINECOBANK SPA	320.34	320.34	498	63,985	銀行
ASSICURAZIONI GENERALI	573.03	573.03	1,019	130,977	保険
MEDIOBANCA SPA	352.62	313.03	304	39,086	銀行
UNICREDIT SPA	1,205.02	1,128.45	1,192	153,163	銀行
INTESA SANPAOLO	8,785.7	9,050.32	1,939	249,049	銀行
ATLANTIA SPA	265.01	265.01	428	54,992	運輸
ENI SPA	1,331.96	1,369.72	1,616	207,545	エネルギー
ENEL SPA	4,327.66	4,316.52	2,930	376,303	公益事業
SNAM SPA	1,067.07	1,067.07	533	68,470	公益事業
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	789.8	871.42	566	72,689	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	4,919.82	3,905.36	183	23,620	電気通信サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	45.78	45.78	251	32,308	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPLIFON SPA	—	75.67	323	41,548	ヘルスケア機器・サービス
NEXI SPA	206.12	206.12	284	36,512	ソフトウェア・サービス
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	158.04	158.04	162	20,851	電気通信サービス
PIRELLI & C SPA	174.84	—	—	—	自動車・自動車部品
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 —	金額 —	
	27,830.15 21銘柄	27,975.06 20銘柄	14,149 —	1,816,938 < 0.5% >	
(ユーロ・・・フィンランド)					
WARTSILA OYJ ABP	267.53	267.53	千ユーロ 329	42,375	資本財
NESTE OYJ	221.53	214.27	920	118,256	エネルギー
UPM-KYMMENE OYJ	306.53	280.55	917	117,803	素材
NOKIA OYJ	2,968.4	2,801.61	1,406	180,560	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	302.34	302.34	466	59,943	素材
ELISA OYJ	69.88	86.81	462	59,392	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS	245.63	284.54	1,225	157,331	保険
FORTUM OYJ	243.12	243.12	621	79,795	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	—	134.02	374	48,134	食品・生活必需品小売り
KONE OYJ-B	176.18	176.18	1,042	133,839	資本財
ORION OYJ-CLASS B	63.79	62.61	231	29,690	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 —	金額 —	
	4,864.93 10銘柄	4,853.58 11銘柄	7,998 —	1,027,124 < 0.3% >	
(ユーロ・・・オーストリア)					
OMV AG	81.06	83.89	千ユーロ 396	50,899	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	149.68	193.83	751	96,472	銀行
VOESTALPINE AG	60.56	60.56	178	22,925	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	93.32	70.66	180	23,173	銀行
ANDRITZ AG	26.6	—	—	—	資本財
VERBUND AG	38.78	31.9	286	36,764	公益事業
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 —	金額 —	
	450 6銘柄	440.84 5銘柄	1,792 —	230,234 < 0.1% >	
ユーロ通貨計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 —	金額 —	
	101,904.84 240銘柄	102,646.7 232銘柄	258,721 —	33,222,487 < 9.4% >	
合計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 —	金額 —	
	577,082.82 1,215銘柄	583,591.19 1,223銘柄	— —	338,023,942 < 95.5% >	

※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。

※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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

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		評 価 額	
		証 券 数	証 券 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(スイス) CIE FINANCIERE RIC-W		証券 55,710	証券 —	千スイス・フラン —	千円 —
小 計	証 券 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	55,710 1銘柄	— —	— —	— <—>
合 計	証 券 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	55,710 1銘柄	— —	— —	— <—>

※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。

(3) 外国投資信託証券

銘	柄	期首(前期末)		期 末		組 入 比 率
		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	千アメリカ・ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORP		25,432	25,432	402	45,802	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC		7,344	7,344	1,768	201,178	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC		15,706	17,345	2,774	315,616	0.1
BOSTON PROPERTIES INC		7,835	7,835	864	98,355	0.0
VORNADO REALTY TRUST		8,706	8,706	361	41,184	0.0
VEREIT INC		54,273	—	—	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP		5,916	5,916	2,103	239,321	0.1
EQUITY RESIDENTIAL		19,671	18,773	1,618	184,149	0.1
EQUINIX INC		4,811	4,908	4,024	457,874	0.1
AMERICAN TOWER CORP		23,614	24,648	6,579	748,553	0.2
SUN COMMUNITIES INC		5,650	6,088	1,197	136,275	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC		37,569	37,569	616	70,182	0.0
REALTY INCOME CORP		17,798	28,298	1,975	224,718	0.1
MID-AMERICA APARTMENT COMM		5,780	5,780	1,213	138,094	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		8,249	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC		27,735	32,632	1,346	153,216	0.0
VICI PROPERTIES INC		23,498	36,025	1,013	115,292	0.0
VENTAS INC		21,317	19,379	951	108,297	0.0
WEYERHAEUSER CO		38,940	38,940	1,508	171,670	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP		22,634	22,634	4,206	478,525	0.1
IRON MOUNTAIN INC		14,204	14,204	665	75,725	0.0
PROLOGIS INC		40,040	40,178	6,158	700,650	0.2
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		6,496	7,662	1,572	178,926	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST		4,902	4,902	827	94,167	0.0
DUKE REALTY CORP		21,002	21,667	1,288	146,547	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		3,332	3,332	1,154	131,351	0.0

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	口数	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	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,613	—	—	—	—	—
WELLTOWER INC	22,737	23,388	1,918	218,296	0.1	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756	28,756	979	111,429	0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,664	8,664	734	83,607	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	85,417	64,936	542	61,687	0.0	
PUBLIC STORAGE	8,249	8,249	2,737	311,475	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	8,289	8,289	586	66,729	0.0	
UDR INC	16,633	16,633	955	108,752	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	14,362	10,364	287	32,732	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	14,002	15,126	2,553	290,468	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	7,483	7,376	1,497	170,392	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,750	31,858	684	77,890	0.0	
WP CAREY INC	8,640	8,640	680	77,409	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	731,049 39銘柄	672,476 36銘柄	60,354	6,866,548 <1.9%>	1.9
(カナダ)				千カナダ・ドル		
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,546	—	—	—	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	3,585	—	—	—	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971	3,971	232	20,721	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441	7,441	164	14,691	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	21,543 4銘柄	11,412 2銘柄	396	35,412 <0.0%>	0.0
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル		
SCENTRE GROUP	275,200	275,200	836	68,007	0.0	
LENDLEASE GROUP	36,263	36,263	384	31,246	0.0	
DEXUS/AU	54,256	54,256	588	47,853	0.0	
TRANSURBAN GROUP	145,680	161,485	2,210	179,710	0.1	
SYDNEY AIRPORT	73,899	62,186	512	41,654	0.0	
APA GROUP	68,344	55,644	539	43,876	0.0	
GPT GROUP	97,296	121,221	629	51,142	0.0	
MIRVAC GROUP	200,053	200,053	580	47,160	0.0	
STOCKLAND	127,393	127,393	554	45,047	0.0	
GOODMAN GROUP	86,301	86,301	2,118	172,228	0.0	
VICINITY CENTRES	250,037	241,241	408	33,239	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	1,414,722 11銘柄	1,421,243 11銘柄	9,363	761,167 <0.2%>	0.2
(香港)				千香港・ドル		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000	197,000	2,092	30,524	0.0	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	125,000	193,500	1,480	21,597	0.0	
LINK REIT	110,100	110,100	7,563	110,356	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	432,100 3銘柄	500,600 3銘柄	11,136	162,478 <0.0%>	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	評価額	組入比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)					
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	159,000	170,500	千シンガポール・ドル 509	42,420	0.0
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	238,488	259,616	555	46,229	0.0
SUNTEC REIT	102,700	—	—	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	138,100	208,100	397	33,073	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	104,900	112,400	234	19,547	0.0
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	743,188 5銘柄	750,616 4銘柄	1,697 <0.0%>	141,270 <0.0%>
(イギリス)					
LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861	39,861	千イギリス・ポンド 299	45,370	0.0
SEGRO PLC	59,874	68,623	972	147,427	0.0
BRITISH LAND CO PLC	44,962	44,962	234	35,530	0.0
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	144,697 3銘柄	153,446 3銘柄	1,506 <0.1%>	228,328 <0.1%>
(ユーロ・・・フランス)					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,630	7,024	千ユーロ 421	54,117	0.0
ICADE	2,061	—	—	—	—
GECINA SA	2,189	2,189	261	33,548	0.0
KLEPIERRE	9,305	13,600	259	33,277	0.0
COVIVIO	2,388	2,388	175	22,495	0.0
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	24,573 5銘柄	25,201 4銘柄	1,117 <0.0%>	143,437 <0.0%>
ユーロ通貨計	口数・金額 銘柄数 <比率>	24,573 5銘柄	25,201 4銘柄	1,117 <0.0%>	143,437 <0.0%>
合計	口数・金額 銘柄数 <比率>	3,511,872 70銘柄	3,534,994 63銘柄	— <2.4%>	8,338,643 <2.4%>

※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。

※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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっ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	
		買建額	売建額
外国	S & P 500 EMINI FUT	百万円 5,899	百万円 —
	S P I 200 FUTURE S	249	—
	F T S E 100 I D X F U T	323	—
	E U R O S T O X X 50	1,138	—

※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。

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

(2021年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	338,023,942	95.5
投 資 証 券	8,338,643	2.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,605,914	2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	353,968,499	100.0

※期末における外貨建資産（352,603,331千円）の投資信託財産総額（353,968,499千円）に対する比率は99.6%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アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、1スイス・フラン=123.25円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローナ=12.53円、1ユーロ=128.41円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	355,195,433,447円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,107,560,927
株 式(評価額)	338,023,942,089
投 資 証 券(評価額)	8,338,643,304
未 収 入 金	1,276,906,399
未 収 配 当 金	378,251,525
差 入 委 託 証 拠 金	2,070,129,203
(B) 負 債	1,377,196,655
未 払 金	1,295,843,875
未 払 解 約 金	81,347,754
そ の 他 未 払 費 用	5,026
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	353,818,236,792
元 本	60,650,874,522
次 期 繰 越 損 益 金	293,167,362,270
(D) 受 益 権 総 口 数	60,650,874,522口
1万口当たり基準価額(C/D)	58,337円

※当期における期首元本額59,674,216,686円、期中追加設定元本額13,275,575,985円、期中一部解約元本額12,298,918,149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2020年12月1日 至2021年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,981,491,031円
受 取 配 当 金	4,944,288,559
受 取 利 息	212
そ の 他 収 益 金	37,690,887
支 払 利 息	△ 488,627
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	86,164,449,326
売 買 損 益	93,253,928,084
売 買 損 益	△ 7,089,478,758
(C) 先 物 取 引 等 損 益	1,224,205,499
取 引 損 益	1,380,162,208
取 引 損 益	△ 155,956,709
(D) そ の 他 費 用 等	△ 130,283,930
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	92,239,861,926
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	194,422,937,325
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 49,229,658,029
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	55,734,221,048
(I) 合 計(E+F+G+H)	293,167,362,270
次 期 繰 越 損 益 金(I)	293,167,362,270

※有価証券売買損益および先物取引等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	31,877,680,130円	三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	12,792,410円
三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型)	257,237,232円	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	591,445,429円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	1,092,113,150円	バランスファンドVA (安定運用型) <適格機関投資家限定>	3,447,518円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	759,876,748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>	32,980,346円
SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	63,296,820円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	704,179,317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)	1,131,648円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	824,854,056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)	5,750,140円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	3,604,698,411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)	17,334,902円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	12,109,077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)	47,583,616円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	64,600,386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)	49,206,031円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	508,707,107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)	93,432,630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>	41,029,721円
外国株式指数ファンド	762,591,588円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	102,099,408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	12,154,970,474円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	495,008,013円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	136,154,453円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	350,695,262円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	161,478,755円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	829,398,471円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	106,177,098円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	218,848円
イオン・バランス戦略ファンド	26,039,960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)	218,605,667円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,113,153円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	75,145,593円
三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)	110,598,046円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	8,737,379円
三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型)	97,319,132円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	7,911,776円
三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型)	330,128,909円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	4,096,558円
三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型)	170,705,412円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	21,448,701円
三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型)	195,254,066円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	60,189,060円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	38,559,109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>	139,958,110円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	509,621,059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>	63,429,174円
三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)	4,097,387円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	817,767,596円
三井住友DS・年金バランス50 (標準型)	17,354,910円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	118,979,244円
三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)	15,630,593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>	1,028,620,924円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,093,613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>	27,233,124円
SMBC・DCインデックスファンド (MSCIコクサイ)	110,450,992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>	37,994,675円
日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジあり)	67,713,873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>	41,244,635円
日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジなし)	281,821,366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>	222,731,531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〉

(2020年12月18日から2021年12月17日まで)

第 18 期

決算日 2021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。

S M A M ・ 年 金 外 国 債 券 パ ッ シ ブ ・ フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 1 万 口 当 た り の 費 用 明 細 (2020 年 12 月 18 日 から 2021 年 12 月 17 日 まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 信託報酬	13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) 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)	(2)	(0.009)	
(販売会社)	(3)	(0.013)	
(受託会社)	(9)	(0.044)	
(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 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
(保管費用)	(7)	(0.037)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合 計	21	0.110	

期中の平均基準価額は19,327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 (2020 年 12 月 18 日 から 2021 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 461,423	千円 899,960	千口 88,885	千円 174,061

■ 組 入 れ 資 産 の 明 細 (2021 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 2,017,936	千口 2,390,473	千円 4,768,277

※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81,412,102,331口です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	4,768,287,897円
コール・ローン等	10,441
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	4,768,277,456
(B) 負 債	1,667,511
未払信託報酬	1,539,290
その他未払費用	128,221
(C) 純資産総額(A-B)	4,766,620,386
元 本	2,418,278,214
次期繰越損益金	2,348,342,172
(D) 受益権総口数	2,418,278,214口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,711円

※当期における期首元本額2,039,887,257円、期中追加設定元本額467,507,202円、期中一部解約元本額89,116,245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2020年12月18日 至2021年12月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 7円
支 払 利 息	△ 7
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	182,477,940
売 買 損 益	187,503,769
売 買 損 益	△ 5,025,829
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,152,695
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	179,325,238
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	253,250,427
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,915,766,507
(配 当 等 相 当 額)	(2,664,398,213)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 748,631,706)
(G) 合 計 (D+E+F)	2,348,342,172
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	2,348,342,172
追 加 信 託 差 損 益 金	1,915,766,507
(配 当 等 相 当 額)	(2,665,125,210)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 749,359,213)
分 配 準 備 積 立 金	432,575,665

※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。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	83,596,980円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	95,728,258
(c) 収益調整金	2,665,125,720
(d) 分配準備積立金	253,250,427
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	3,097,701,385
1万口当たり当期分配対象額	12,809.53
(f) 分配金	—
1万口当たり分配金	—

外国債券パッシブ・マザーファンド

第18期（2020年12月18日から2021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、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 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)		公 社 債 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
14期（2017年12月18日）	円	%		%	%	百万円
15期（2018年12月17日）	17,897	4.6	181.01	4.9	98.9	196,212
16期（2019年12月17日）	17,553	△1.9	177.36	△2.0	98.7	168,894
17期（2020年12月17日）	18,248	4.0	184.64	4.1	98.6	171,892
18期（2021年12月17日）	19,109	4.7	193.48	4.8	99.0	161,689
18期（2021年12月17日）	19,947	4.4	201.87	4.3	99.1	162,393

※ベンチマークは、当報告書作成時に知れた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※指数の著作権、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

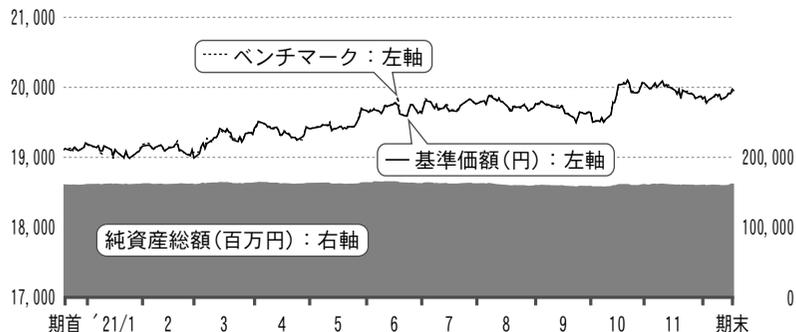
年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		公 社 債 率 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2020年12月17日	円 19,109	% —	193.48	% —	% 99.0
12月末	19,189	0.4	194.18	0.4	98.6
2021年1月末	19,162	0.3	194.26	0.4	98.7
2月末	18,992	△0.6	193.11	△0.2	98.8
3月末	19,424	1.6	196.58	1.6	98.8
4月末	19,409	1.6	196.54	1.6	98.7
5月末	19,669	2.9	199.12	2.9	98.9
6月末	19,632	2.7	198.94	2.8	99.1
7月末	19,768	3.4	200.30	3.5	98.9
8月末	19,768	3.4	200.22	3.5	98.8
9月末	19,635	2.8	198.94	2.8	99.0
10月末	20,063	5.0	203.09	5.0	98.8
11月末	19,840	3.8	200.65	3.7	98.5
(期 末) 2021年12月17日	19,947	4.4	201.87	4.3	99.1

※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（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

基準価額等の推移



期首	19,109円
期末	19,947円
騰落率	+4.4%

※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。

※指数の著作権、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（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の国債に分散投資し、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	・グローバルに金利先高観が強まる中、米ドルを中心に対円で投資通貨が上昇したこと
下落要因	・グローバルに中央銀行の将来の金融緩和策の縮小が意識され、米欧金利が上昇（債券価格は下落）したこと

▶ 投資環境について（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

債券市場は米国、欧州ともに下落しました。為替市場は米ドルを中心に投資通貨が対円で上昇しました。

債券市場

米欧を中心に新型コロナウイルスワクチンの接種が進展し、経済再開の動きが本格化する中、グローバルに中央銀行の将来の金融緩和策の縮小が意識され、米欧金利は上昇（債券価格は下落）しました。また、エネルギー価格の高騰や、人手不足に起因する供給制約を背景にインフレ率上昇への懸念が強まったことも、米欧金利の上昇要因となりました。

為替市場

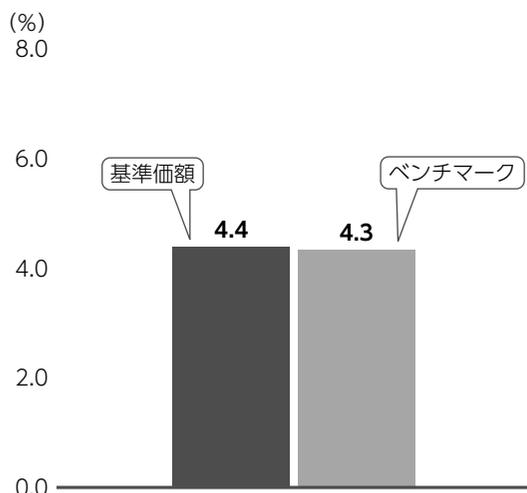
米欧を中心とした経済再開の本格化やインフレ率上昇懸念の高まりから、グローバルに中央銀行の金融緩和策の縮小が意識される中、米欧の金利先高観が強まり、米ドルを中心に対円で投資通貨が上昇しました。

▶ ポートフォリオについて（2020年12月18日から2021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（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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】

基準価額の騰落率は+4.4%となり、ベンチマークの騰落率+4.3%と0.1%の上方乖離となりました。

上方乖離要因 ・ キャッシュフローに伴う売買のタイミング

2 今後の運用方針

米国では、当面は変異ウイルスの感染拡大が警戒されますが、景気の回復や金融政策の正常化を背景に、長期金利は緩やかに水準を切り上げていく見通しです。ユーロ圏でも、資産購入ペースの減速など金融政策の正常化観測が長期金利の上昇要因となっていく見通しですが、当面はECB（欧州中央銀行）が緩和的な姿勢を維持していることや感染再拡大への懸念から、長期金利の上昇ペースは緩やかになると予想します。

為替相場は、米ドル・円は、米国の景気回復や金融政策の正常化を背景に、米ドル高・円安圧力がかかる見通しです。ユーロ・米ドルに関しては、米国とユーロ圏の中央銀行の政策姿勢や景気格差などを反映し、ユーロ安・米ドル高圧力がかかる見通しです。

上記見通しのもと、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、日々の資金流入出に対応し、迅速なりバランスを行います。

■ 1万口当たりの費用明細 (2020年12月18日から2021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付金・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19,551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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年12月18日から2021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	千アメリカ・ドル 195,849	千アメリカ・ドル 163,553
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 12,407	千カナダ・ドル 14,579
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 1,902	千オーストラリア・ドル 23,215
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 1,174	千シンガポール・ドル 932
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 7,602	千イギリス・ポンド 16,887
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シェケル 9,140	千イスラエル・シェケル 8,450
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 1,771	千デンマーク・クローネ 8,663
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 1,555	千ノルウェー・クローネ 2,049
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 2,614	千スウェーデン・クローナ 8,806
	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 20,788	千メキシコ・ペソ 52,993
	中 国	国 債 証 券	千オフショア・人民元 39,140	千オフショア・人民元 -
	マレーシア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 4,583	千マレーシア・リンギット 7,324
	国	ポーランド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 35,968
ユ ー ロ			千ユーロ	千ユーロ
アイルランド		国 債 証 券	1,270	1,111
オランダ		国 債 証 券	4,395	5,272
ベルギー		国 債 証 券	4,624	8,181

外国債券パッシブ・マザーファンド

			買 付 額	売 付 額
外	フ ラ ン ス	国 債 証 券	26,142	32,170
	ド イ ツ	国 債 証 券	22,150	24,196
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	7,855	8,933
	イ タ リ ア	国 債 証 券	15,196	23,507
国	フィンランド	国 債 証 券	1,451	3,116
	オーストリア	国 債 証 券	2,517	4,650

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年12月18日から2021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 (2020年12月18日から2021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。

■ 組入れ資産の明細 (2021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	千アメリカ・ドル 644,020	千アメリカ・ドル 672,251	千円 76,549,238	% 47.1	% -	% 21.6	% 17.3	% 8.3
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 32,300	千カナダ・ドル 35,262	3,142,202	1.9	-	1.0	0.7	0.2
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 29,350	千オーストラリア・ドル 32,046	2,618,502	1.6	-	1.2	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,950	千シンガポール・ドル 8,624	720,460	0.4	-	0.3	0.0	0.1

外国債券パッシブ・マザーファンド

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
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 48,450	千イギリス・ポンド 64,546	9,793,053	6.0	—	4.8	0.7	0.6
イ ス ラ エ ル	千イスラエル・シェケル 18,400	千イスラエル・シェケル 20,818	763,243	0.5	—	0.2	0.1	0.2
デ ン マ ー ク	千デンマーク・クローネ 31,900	千デンマーク・クローネ 41,093	712,971	0.4	—	0.4	0.0	0.0
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェー・クローネ 29,700	千ノルウェー・クローネ 30,253	383,313	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデン・クローナ 33,000	千スウェーデン・クローナ 36,917	465,525	0.3	—	0.1	0.1	0.1
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 201,000	千メキシコ・ペソ 208,282	1,139,138	0.7	—	0.4	0.2	0.1
中 国	千オフショア・人民元 39,000	千オフショア・人民元 39,234	700,385	0.4	—	0.2	0.2	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシア・リンギット 26,900	千マレーシア・リンギット 27,865	753,031	0.5	—	0.3	0.1	—
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 27,600	千ポーランド・ズロチ 27,894	776,753	0.5	—	0.2	0.1	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	9,000	10,300	1,328,861	0.8	—	0.6	0.2	0.0
オランダ	19,500	23,835	3,074,959	1.9	—	1.3	0.4	0.2
ベルギー	22,750	27,521	3,550,490	2.2	—	1.6	0.5	0.1
フランス	105,370	123,265	15,902,433	9.8	—	6.3	2.9	0.6
ドイツ	78,500	91,073	11,749,439	7.2	—	4.5	2.0	0.7
スペイン	60,950	73,322	9,459,337	5.8	—	3.7	1.7	0.4
イタリア	93,470	109,645	14,145,323	8.7	—	5.5	2.3	0.9
フィンランド	6,300	7,279	939,103	0.6	—	0.4	0.1	0.1
オーストリア	14,500	17,402	2,245,153	1.4	—	0.9	0.3	0.2
合 計	—	—	160,912,922	99.1	—	55.6	30.4	13.1

※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。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

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

区 分	銘 柄	種 類	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		
ア メ リ カ	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	千アメリカ・ドル 3,800	千アメリカ・ドル 3,872	千円 441,000	2023/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,300	2,792	318,002	2043/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	2,700	2,749	313,032	2023/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	5,000	5,160	587,671	2023/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,200	4,370	497,623	2023/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,400	2,811	320,088	2043/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	2,400	3,138	357,343	2043/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	700	933	106,243	2043/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	5,700	5,935	675,878	2024/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	5,100	5,325	606,388	2024/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,000	3,806	433,441	2044/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	5,600	5,828	663,701	2024/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	3,600	4,722	537,777	2044/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	3,300	4,038	459,906	2044/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	5,100	5,298	603,374	2024/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,500	3,613	411,465	2025/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,500	4,210	479,497	2044/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	4,100	4,549	518,072	2045/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	4,900	5,081	578,624	2025/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,000	3,621	412,357	2045/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	4,300	4,445	506,239	2025/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,700	4,384	499,229	2045/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,000	4,176	475,584	2025/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	5,000	5,081	578,641	2022/11/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	4,000	4,074	463,929	2022/12/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	3,000	3,046	346,959	2023/01/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,700	3,272	372,612	2045/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	4,700	4,792	545,764	2026/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	2,900	3,233	368,145	2046/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,000	3,041	346,344	2023/02/28	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,000	3,040	346,266	2023/03/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,000	3,048	347,079	2023/04/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	14,950	15,246	1,736,131	2026/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,600	4,015	457,295	2046/05/15		
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,000	3,050	347,331	2023/05/31		
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	500	506	57,701	2023/06/30		
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	3,000	3,034	345,586	2023/07/31		
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,500	2,533	288,543	2023/08/31		
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,850	3,041	346,305	2046/08/15		

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	国債証券	1.3750	3,000	3,042	346,399	2023/09/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,000	3,056	348,080	2023/10/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	5,000	5,193	591,366	2026/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	3,100	3,190	363,269	2023/11/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,600	4,299	489,577	2046/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,000	3,096	352,616	2023/12/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,631	527,407	2027/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,200	2,272	258,780	2024/01/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,500	3,055	347,901	2047/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	6,500	6,703	763,366	2024/03/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,000	2,059	234,465	2024/04/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,000	2,062	234,811	2024/02/29	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	4,900	5,196	591,742	2027/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,200	2,696	307,014	2047/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,300	3,397	386,923	2024/05/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	4,100	4,224	480,999	2024/06/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	3,500	3,620	412,227	2024/07/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,200	4,429	504,333	2027/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,800	4,467	508,663	2047/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,800	3,905	444,704	2024/08/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	4,000	4,140	471,453	2024/09/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	800	831	94,654	2024/10/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,500	1,764	200,921	2047/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,643	528,779	2027/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,600	2,693	306,655	2024/11/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,100	3,224	367,116	2024/12/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,200	1,227	139,722	2023/01/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,400	3,563	405,741	2025/01/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,800	5,215	593,931	2028/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,100	3,821	435,206	2048/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,000	4,104	467,418	2023/02/28	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	2,113	240,620	2025/02/28	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,300	2,422	275,873	2025/03/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,900	2,989	340,374	2023/04/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,200	2,336	266,090	2025/04/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	9,000	9,866	1,123,541	2028/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,400	3,030	345,026	2048/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,000	1,032	117,623	2023/05/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,100	1,169	133,143	2025/05/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,600	4,874	555,020	2025/06/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	2,070	235,806	2023/07/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	4,500	4,947	563,333	2028/08/15	

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	国債証券	3.0000	5,400	6,674	760,020	2048/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,100	2,228	253,716	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,800	3,939	448,642	2023/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	4,000	4,286	488,110	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,000	1,042	118,663	2023/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,100	3,324	378,613	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,900	3,244	369,486	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,100	4,098	466,672	2048/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,000	2,087	237,658	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,900	1,975	224,963	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,500	2,673	304,422	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,400	4,667	531,440	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,700	2,864	326,135	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,700	2,938	334,661	2029/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,800	4,720	537,567	2049/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	3,700	3,834	436,688	2024/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	8,500	8,980	1,022,639	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	13,300	13,919	1,584,984	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,800	3,933	447,898	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	4,100	4,399	500,966	2029/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,400	1,703	193,990	2049/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	6,200	6,348	722,867	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	850	870	99,159	2024/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	4,450	4,545	517,646	2029/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,500	3,786	431,189	2049/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	7,100	7,171	816,561	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,900	3,981	453,352	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	5,500	5,596	637,244	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	4,000	4,125	469,782	2029/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,900	2,111	240,404	2049/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	200	204	23,256	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	800	813	92,675	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	4,500	4,551	518,256	2030/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,800	2,876	327,552	2050/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,992	226,938	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,500	1,477	168,222	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	1,500	1,455	165,773	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	2,400	2,466	280,822	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,000	1,015	115,648	2027/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	5,000	4,988	568,012	2023/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,500	1,507	171,670	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,000	1,013	115,377	2025/01/31

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	国債証券	1.3750	3,000	3,035	345,651	2023/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	4,000	4,052	461,437	2022/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,500	7,058	803,782	2030/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	5,100	4,380	498,795	2050/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,500	3,092	352,086	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	3,000	2,884	328,451	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	7,700	7,673	873,747	2023/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,938	334,576	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	3,000	2,888	328,932	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,400	2,334	265,857	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	4,300	4,273	486,654	2023/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	4,400	4,227	481,412	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	3,300	3,205	365,054	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	4,700	4,481	510,350	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	8,800	8,264	941,070	2030/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	4,500	3,986	453,963	2050/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	8,000	7,943	904,510	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,000	1,939	220,853	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	7,800	7,417	844,602	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	5,700	5,651	643,503	2023/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	7,000	6,704	763,460	2030/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,200	3,013	343,118	2050/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	8,500	8,310	946,339	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	5,800	5,799	660,393	2051/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	6,700	6,486	738,606	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,000	1,943	221,297	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,912	331,679	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,100	2,020	230,047	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,200	6,924	788,471	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	3,000	2,978	339,205	2023/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	7,700	7,608	866,382	2024/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	1,800	1,797	204,644	2022/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,300	3,367	383,459	2031/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,500	4,436	505,128	2031/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	4,700	4,843	551,576	2051/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	3,600	3,511	399,810	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	5,900	5,777	657,865	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,500	4,473	509,412	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	4,400	4,371	497,836	2024/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,100	3,087	351,521	2031/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	5,200	5,179	589,808	2024/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,200	4,215	480,061	2026/11/30

外国債券パッシブ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	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	国債証券	1.3750	6,000	6,013	684,709	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	6.2500	800	876	99,752	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.0000	1,000	1,199	136,616	2026/02/15
	US TREASURY BOND	国債証券	6.1250	1,000	1,278	145,611	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.2500	500	630	71,782	2028/11/15
	US TREASURY BOND	国債証券	5.3750	320	431	49,154	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	200	254	28,937	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	300	416	47,400	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	300	428	48,775	2039/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	700	986	112,314	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	600	870	99,178	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	900	1,273	145,037	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	500	666	75,883	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	600	836	95,260	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	900	1,334	151,986	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	300	426	48,545	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	1,500	1,974	224,875	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,000	1,213	138,156	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	800	954	108,695	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	2,297	261,632	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	300	344	39,255	2042/11/15
	小計		—	644,020	672,251	76,549,238	—
カナダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	千カナダ・ドル 250	千カナダ・ドル 330	29,439	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	500	723	64,494	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	1,450	2,125	189,361	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,500	2,085	185,799	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	1,300	1,769	157,641	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,000	2,020	180,018	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	2,100	2,175	193,856	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,000	1,040	92,680	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,400	1,724	153,699	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,900	2,944	262,354	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	600	594	52,939	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,100	1,113	99,213	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,200	1,223	108,985	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	700	733	65,392	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,900	2,039	181,729	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,000	1,027	91,601	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,000	2,025	180,497	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	5,900	5,890	524,934	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	2,700	2,640	235,318	2025/09/01

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	CANADA GOVERNMENT	国債証券	2.7500	800	1,035	92,243	2064/12/01
	小 計		-	32,300	35,262	3,142,202	-
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	5.5000	千オーストラリア・ドル 1,400	千オーストラリア・ドル 1,495	122,163	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	2,500	2,618	213,996	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	1,300	1,459	119,252	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5000	1,100	1,429	116,785	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	1,300	1,388	113,484	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	2,650	2,977	243,307	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	1,200	1,498	122,415	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	800	894	73,104	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,100	1,182	96,619	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	2,550	3,011	246,042	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	2,800	2,936	239,952	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,200	1,379	112,699	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	216	17,711	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	3,100	3,386	276,711	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	1,850	1,991	162,760	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,900	2,884	235,724	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	800	718	58,668	2051/06/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	600	576	47,100	2025/11/21	
	小 計		-	29,350	32,046	2,618,502	-
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 1,500	千シンガポール・ドル 1,659	138,592	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	700	738	61,688	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	500	550	45,967	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	454	37,967	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,200	1,237	103,345	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	750	874	73,055	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	802	67,015	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,200	1,258	105,135	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	700	749	62,629	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	200	200	16,737	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	100	99	8,324	2026/11/01
	小 計		-	7,950	8,624	720,460	-
イギリス	UK GILT	国債証券	6.0000	千イギリス・ポンド 650	千イギリス・ポンド 889	134,884	2028/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	700	943	143,123	2032/06/07
	UK GILT	国債証券	5.0000	1,300	1,485	225,342	2025/03/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,050	1,519	230,485	2036/03/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,200	1,922	291,748	2038/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,700	3,383	513,335	2055/12/07

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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 GILT	国債証券	4.2500	1,500	2,583	391,933	2046/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	1,092	165,754	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,350	2,256	342,300	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,150	1,555	236,044	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	1,631	247,546	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,250	1,923	291,837	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,100	1,584	240,337	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	1,700	3,479	527,862	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	4.2500	700	1,098	166,655	2040/12/07
	UK GILT	国債証券	3.7500	1,200	2,102	318,974	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	1,600	2,315	351,327	2044/01/22
	UK GILT	国債証券	2.2500	2,700	2,785	422,543	2023/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,450	3,024	458,881	2068/07/22
	UK GILT	国債証券	2.7500	600	636	96,588	2024/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,650	2,505	380,078	2045/01/22
	UK GILT	国債証券	2.0000	1,100	1,159	175,957	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	1,600	2,644	401,252	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	1,300	1,357	205,930	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	1,700	1,901	288,431	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	900	1,002	152,139	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.2500	1,200	1,246	189,055	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	0.7500	2,650	2,666	404,607	2023/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	900	962	146,054	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.0000	800	810	122,993	2024/04/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	850	1,011	153,498	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	500	602	91,426	2054/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	1,000	1,018	154,472	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	800	804	122,031	2025/06/07
	UK GILT	国債証券	0.3750	1,800	1,749	265,471	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	500	499	75,711	2023/01/31
	UK GILT	国債証券	0.1250	1,500	1,475	223,897	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.6250	600	575	87,304	2035/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	1,600	1,523	231,175	2031/07/31
	UK TSY GILT	国債証券	1.1250	800	817	124,058	2039/01/31
	小 計		-	48,450	64,546	9,793,053	-
イスラエル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	4,100	5,358	196,456	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	2,900	2,980	109,271	2023/11/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	3,300	4,218	154,657	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	1,500	1,651	60,548	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.1500	6,600	6,609	242,309	2023/07/31
	小 計		-	18,400	20,818	763,243	-

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 9,800	千デンマーク・クローネ 17,825	309,272	2039/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5000	3,000	3,122	54,178	2023/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.7500	3,000	3,261	56,594	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	10,100	10,600	183,919	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	4,000	4,231	73,409	2029/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.2500	2,000	2,051	35,595	2052/11/15
小 計			—	31,900	41,093	712,971	—
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	千ノルウェー・クローネ 4,000	千ノルウェー・クローネ 4,052	51,341	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	4,000	4,153	52,618	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	3,000	3,034	38,441	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	3,500	3,506	44,431	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	9,000	9,267	117,416	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	4,200	4,265	54,049	2029/09/06
NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.3750	2,000	1,974	25,014	2030/08/19	
小 計			—	29,700	30,253	383,313	—
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローナ 4,600	千スウェーデン・クローナ 7,008	88,373	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	7,000	7,230	91,179	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.5000	5,000	5,450	68,724	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.0000	6,400	6,720	84,743	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	4,000	4,184	52,767	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	6,000	6,323	79,737	2029/11/12
小 計			—	33,000	36,917	465,525	—
メキシコ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	8.0000	千メキシコ・ペソ 34,000	千メキシコ・ペソ 34,633	189,418	2023/12/07
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	10.0000	32,000	34,470	188,523	2024/12/05
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	25,000	25,308	138,414	2027/06/03
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	23,000	24,601	134,551	2029/05/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	40,000	42,603	233,005	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	5,000	5,131	28,066	2031/05/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	18,000	18,440	100,855	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	19,000	18,056	98,755	2026/03/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	5,000	5,036	27,546	2047/11/07
小 計			—	201,000	208,282	1,139,138	—
中 国	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	千オフショア・人民元 6,000	千オフショア・人民元 5,998	107,077	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	8,000	7,983	142,519	2024/09/02
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5600	8,000	8,013	143,052	2023/10/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	8,000	8,014	143,063	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7200	3,000	3,161	56,434	2051/04/12

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0200	6,000	6,063	108,237	2031/05/27
小 計			-	39,000	39,234	700,385	-
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	千マレーシア・リンギット 7,700	千マレーシア・リンギット 7,780	210,259	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	5,000	5,301	143,269	2030/04/15
	MALAYSIA GOVERNMENT	国債証券	3.9550	5,300	5,481	148,119	2025/09/15
	MALAYSIA GOVERNMENT	国債証券	4.7360	6,400	6,767	182,876	2046/03/15
	MALAYSIA GOVT	国債証券	3.4780	2,500	2,535	68,507	2024/06/14
小 計			-	26,900	27,865	753,031	-
ポーランド	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 6,100	千ポーランド・ズロチ 7,141	198,867	2029/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	6,000	5,843	162,726	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,000	3,989	111,096	2023/01/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,463	124,281	2024/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,800	2,599	72,395	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,544	43,010	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,400	2,311	64,375	2023/04/25
小 計			-	27,600	27,894	776,753	-
ユ ー ロ				千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	5.4000	800	954	123,183	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.9000	500	528	68,167	2023/03/20
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.4000	500	545	70,415	2024/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	600	727	93,860	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.0000	1,000	1,324	170,837	2045/02/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	1,000	1,064	137,300	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	300	360	46,461	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	700	752	97,038	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3000	1,000	1,126	145,385	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	500	564	72,852	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	1,600	1,748	225,540	2029/05/15
オランダ	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	500	603	77,818	2050/05/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	5.5000	700	958	123,661	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,800	2,916	376,262	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	500	524	67,674	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	1,300	2,288	295,292	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	600	779	100,557	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,600	1,663	214,625	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,000	1,069	137,918	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,600	2,698	348,141	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	1,700	1,750	225,850	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,784	230,184	2026/07/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	400	428	55,245	2027/07/15	

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
ベルギー	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	1,000	1,014	130,818	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	1,500	1,619	208,889	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	500	523	67,474	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,869	241,198	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	1,900	1,946	251,163	2030/07/15
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	1,100	1,516	195,651	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0000	1,000	1,637	211,238	2035/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.2500	1,200	2,039	263,141	2041/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	700	854	110,206	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	500	709	91,559	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	1,300	1,357	175,149	2023/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6000	800	865	111,716	2024/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	800	1,362	175,811	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	200	271	34,990	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	800	839	108,246	2025/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,300	1,433	184,932	2031/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	1,000	1,251	161,404	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,800	1,923	248,129	2026/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	850	1,040	134,248	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.1500	500	743	95,885	2066/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	1,000	1,068	137,839	2027/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.5000	1,300	1,342	173,207	2024/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	500	728	94,016	2057/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	400	468	60,377	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	1,000	1,075	138,783	2028/06/22
BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	400	456	58,888	2033/04/22	
BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	1,300	1,413	182,384	2029/06/22	
BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	500	630	81,285	2050/06/22	
BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	700	715	92,343	2030/06/22	
BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	300	296	38,243	2040/06/22	
BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	200	179	23,130	2071/06/22	
BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	1,300	1,299	167,677	2031/10/22	
フランス	FRANCE OAT.	国債証券	8.5000	600	674	87,003	2023/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	6.0000	3,000	3,768	486,237	2025/10/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.5000	2,750	3,930	507,016	2029/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.7500	400	650	83,935	2032/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.7500	2,200	3,538	456,439	2035/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	1,370	2,714	350,245	2055/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	2,000	3,224	415,982	2038/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.2500	1,000	1,091	140,819	2023/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.5000	2,300	4,061	523,914	2041/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	1,400	2,924	377,282	2060/04/25

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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 OAT.	国債証券	3.5000	2,500	2,937	378,928	2026/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	3,850	4,568	589,355	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.2500	1,700	2,727	351,905	2045/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	4,200	4,344	560,535	2023/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.2500	3,400	3,640	469,662	2024/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	2,600	2,780	358,660	2024/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	3,500	4,295	554,105	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	2,900	3,004	387,578	2025/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	2,050	2,172	280,225	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	2,550	2,926	377,502	2031/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	3,500	3,650	470,928	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	3,400	3,873	499,740	2036/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	800	1,078	139,136	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.2500	2,400	2,481	320,117	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	1,800	2,244	289,578	2039/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	2,500	2,691	347,259	2027/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	2,200	2,962	382,254	2048/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	2,000	2,016	260,125	2023/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,300	3,528	455,223	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	3,200	3,623	467,408	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,500	3,751	483,973	2028/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	4,800	4,868	628,103	2024/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	2,400	2,933	378,459	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	800	843	108,825	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,900	1,933	249,452	2025/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	4,500	4,562	588,626	2029/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,300	3,349	432,140	2052/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,100	3,161	407,889	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,900	3,928	506,837	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,900	1,925	248,462	2024/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	100	85	11,006	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,800	3,794	489,546	2031/11/25
ド イ ツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	1,200	1,374	177,354	2024/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.5000	1,000	1,403	181,086	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.6250	1,000	1,385	178,769	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,600	2,171	280,141	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	500	779	100,539	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.5000	900	1,399	180,605	2031/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	600	994	128,290	2034/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.0000	1,800	2,985	385,124	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.2500	950	1,715	221,346	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,650	3,211	414,261	2040/07/04

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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		
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	3.2500	700	1,205	155,578	2042/07/04	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	2,200	3,550	458,051	2044/07/04	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	2,100	2,154	277,937	2023/02/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.0000	2,000	2,091	269,821	2023/08/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	1,300	1,341	173,019	2023/05/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	3,600	3,794	489,575	2024/05/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7500	2,200	2,319	299,207	2024/02/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	2,500	4,144	534,649	2046/08/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,500	2,595	334,900	2025/02/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,300	1,359	175,442	2024/08/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	2,050	2,175	280,653	2025/08/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	3,100	3,246	418,859	2026/02/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	2,300	2,399	309,520	2027/02/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	3,400	3,606	465,276	2027/08/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.2500	1,650	2,229	287,661	2048/08/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,100	2,236	288,582	2028/02/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	900	947	122,196	2028/08/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	800	843	108,852	2029/02/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,500	3,627	468,043	2029/08/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,700	2,725	351,594	2050/08/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,300	1,348	173,967	2030/02/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,800	3,896	502,699	2035/05/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	5,800	6,015	776,070	2030/08/15	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,000	2,073	267,522	2031/08/15	
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,900	1,918	247,477	2023/04/14	
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,600	1,621	209,245	2023/10/13	
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,300	1,322	170,562	2024/04/05	
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	600	612	78,995	2024/10/18	
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	3,500	3,579	461,762	2025/04/11	
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,800	1,845	238,067	2025/10/10	
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	800	822	106,123	2026/10/09	
スペイン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	2,200	3,145	405,814	2029/01/31	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	500	524	67,616	2040/10/31	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	1,500	2,341	302,086	2032/07/30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	1,650	2,489	321,166	2037/01/31	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.9000	1,500	2,567	331,249	2040/07/30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.8000	3,000	3,342	431,182	2024/01/31	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	1,500	2,543	328,131	2041/07/30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.6500	1,800	2,129	274,725	2025/07/30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.9000	500	643	83,008	2026/07/30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.4000	2,250	2,401	309,860	2023/01/31	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,500	2,031	262,038	2028/10/31	

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,000	1,863	240,463	2044/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.8000	1,400	1,544	199,213	2024/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7500	2,100	2,297	296,368	2024/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.6000	1,700	1,816	234,333	2025/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.1500	2,400	2,635	339,945	2025/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	1,700	1,952	251,878	2030/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	2,600	2,854	368,260	2026/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.4000	2,000	2,188	282,335	2023/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.9000	1,400	1,975	254,813	2046/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	1,300	2,083	268,744	2066/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.3000	2,700	2,905	374,890	2026/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.5000	1,200	1,308	168,817	2027/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.3500	500	604	77,965	2033/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	2,600	2,836	365,973	2027/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	2,200	2,400	309,703	2028/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7000	1,250	1,720	221,900	2048/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	1,600	1,751	225,897	2028/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	2,900	3,191	411,758	2029/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.8500	2,700	3,119	402,432	2035/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.2500	700	713	92,056	2024/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	1,000	1,025	132,348	2030/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	400	420	54,241	2027/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	300	288	37,206	2050/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	1,000	1,013	130,761	2025/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2500	3,000	3,264	421,127	2030/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	400	376	48,626	2071/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	1,000	1,010	130,389	2031/10/31
イタリア	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	9.0000	300	352	45,450	2023/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	7.2500	400	537	69,286	2026/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.5000	1,700	2,302	297,071	2027/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	2,000	2,558	330,131	2028/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	2,300	2,458	317,128	2023/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	2,200	2,352	303,507	2030/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.0000	2,200	3,227	416,432	2031/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.7500	1,700	2,548	328,738	2033/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	2,070	3,004	387,672	2034/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	2,600	3,555	458,644	2037/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,800	2,798	361,010	2039/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	2,500	2,709	349,610	2023/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,000	1,161	149,896	2025/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,700	2,685	346,446	2040/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,800	2,132	275,073	2026/03/01

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,000	1,104	142,505	2024/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	1,600	2,555	329,716	2044/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.7500	2,300	2,542	328,015	2024/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	4,400	5,384	694,671	2030/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	600	645	83,335	2024/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	1,500	1,972	254,456	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	2,700	2,840	366,509	2025/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	1,300	1,399	180,534	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6000	1,200	1,276	164,695	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.7000	1,550	1,866	240,804	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	2,000	2,035	262,584	2023/03/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2500	500	565	72,906	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.2500	800	840	108,412	2026/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.6500	2,000	2,037	262,857	2023/10/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	600	701	90,518	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	1,100	1,262	162,858	2033/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2000	2,300	2,534	327,027	2027/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	3,000	3,148	406,207	2024/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	1,400	1,910	246,476	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0500	1,500	1,640	211,703	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	1,800	1,881	242,711	2024/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	1,300	1,603	206,925	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	3,900	4,271	551,098	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	2,000	2,034	262,434	2023/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	1,000	1,050	135,474	2025/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	1,300	1,501	193,720	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	2,100	2,300	296,831	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.3500	850	1,069	137,943	2035/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	1,100	1,607	207,330	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0000	3,000	3,529	455,340	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1000	1,000	1,087	140,346	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	900	1,132	146,103	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.3500	2,700	2,735	352,865	2025/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.8500	1,700	1,749	225,674	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	1,800	1,822	235,113	2030/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	200	205	26,475	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	900	1,032	133,224	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	1,000	1,064	137,364	2025/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	800	825	106,504	2027/09/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	1,000	1,015	131,003	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.7000	1,500	1,470	189,698	2051/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9000	2,000	2,001	258,234	2031/04/01

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	4.0000	600	699	90,303	2025/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	483	62,356	2028/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	1,000	1,499	193,450	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	1,000	1,029	132,841	2023/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,000	1,064	137,280	2024/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	500	542	69,955	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	300	386	49,852	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	400	422	54,531	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	800	848	109,416	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	300	303	39,114	2040/09/15
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	1,000	1,381	178,195	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	500	806	104,054	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	500	616	79,560	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	700	1,526	196,928	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	600	983	126,904	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.7500	1,000	1,045	134,881	2023/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.4000	300	388	50,150	2034/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.6500	800	853	110,086	2024/10/21
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.2000	1,000	1,068	137,830	2025/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	900	953	123,061	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	900	1,152	148,632	2047/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	1,100	1,111	143,447	2023/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	800	840	108,394	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	700	748	96,547	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	550	580	74,863	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	900	912	117,734	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	1,100	1,197	154,455	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	200	280	36,199	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.8500	150	148	19,188	2120/06/30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	800	806	104,036	2031/02/20
小 計			—	410,340	483,645	62,395,101	—
合 計			—	—	—	160,912,922	—

※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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2021年12月17日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	160,912,922	97.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,496,304	2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	164,409,226	100.0

※期末における外貨建資産（162,014,412千円）の投資信託財産総額（164,409,226千円）に対する比率は98.5%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アメリカ・ドル=113.87円、1カナダ・ドル=89.11円、1オーストラリア・ドル=81.71円、1シンガポール・ドル=83.54円、1イギリス・ポンド=151.72円、1イスラエル・シケル=36.661円、1デンマーク・クローネ=17.35円、1ノルウェー・クローネ=12.67円、1スウェーデン・クローネ=12.61円、1メキシコ・ペソ=5.469円、1オフショア・人民元=17.851円、1マレーシア・リングギット=27.023円、1ポーランド・ズロチ=27.846円、1ユーロ=129.01円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	164,409,226,262円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,578,784,960
公 社 債(評価額)	160,912,922,160
未 収 利 息	888,434,735
前 払 費 用	29,084,407
(B) 負 債	2,015,915,423
未 払 金	1,724,888,171
未 払 解 約 金	291,025,136
そ の 他 未 払 費 用	2,116
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	162,393,310,839
元 本	81,412,102,331
次 期 繰 越 損 益 金	80,981,208,508
(D) 受 益 権 総 口 数	81,412,102,331口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	19,947円

※当期における期首元本額84,615,543,547円、期中追加設定元本額10,172,463,204円、期中一部解約元本額13,375,904,420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2020年12月18日 至2021年12月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,166,650,876円
受 取 利 息	3,167,076,148
支 払 利 息	△ 425,272
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,840,609,519
売 買 益	10,688,072,440
売 買 損	△ 6,847,462,921
(C) そ の 他 費 用 等	△ 61,469,784
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	6,945,790,611
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	77,074,312,782
(F) 解 約 差 損 益 金	△12,777,364,915
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,738,470,030
(H) 合 計(D + E + F + G)	80,981,208,508
次 期 繰 越 損 益 金(H)	80,981,208,508

※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。

※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	24,487,844,372円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,563,065,943円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	760,198,503円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	10,603,737,345円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,105,125,950円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,392,217円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,119,007,643円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	93,650,011円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	155,624,983円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	718,495,736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)	6,821,569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>	117,631,749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)	29,780,404円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,068,564,548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)	100,943,914円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,438,731,860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)	215,809,603円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,547,910,459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)	146,490,369円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,874,996,538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)	247,645,688円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	627,347円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	25,113,488円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,237,337,020円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	75,454,990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)	331,971,594円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	112,630,498円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	150,359,802円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	63,013,857円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	81,175,759円
イオン・バランス戦略ファンド	117,794,452円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	33,971,193円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,988,179円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	66,333,551円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	96,352,849円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	49,304,278円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	426,754,581円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	119,676,115円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	104,874,447円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	34,468,587円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,181,590円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	16,515,743円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	117,826,123円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,046,403,883円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	227,846,301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>	648,746,322円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	12,061,797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>	960,695,213円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	35,271,630円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,134,108,974円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	23,882,832円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	404,802,053円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,248,709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>	51,663,081円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	163,477,935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>	141,011,485円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	3,442,227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>	295,647,332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>	2,390,473,483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>	321,381,894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>	44,105,389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>	1,395,550,617円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	7,335,907,258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)】

(2020年4月14日から2021年4月13日まで)

第 **13** 期
決算日 2021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**
〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1
<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 分 配	込 金 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率		
	円	円	%		%		百万円
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
13期 (2021年4月13日)	10,049	0	△0.1	100.76	△0.0	76.3	898

※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) 2020年4月13日	円	%		%	%
	10,058	—	100.80	—	70.2
4月末	10,057	△0.0	100.80	△0.0	70.3
5月末	10,057	△0.0	100.80	△0.0	70.8
6月末	10,057	△0.0	100.79	△0.0	68.7
7月末	10,056	△0.0	100.79	△0.0	73.7
8月末	10,055	△0.0	100.79	△0.0	73.4
9月末	10,054	△0.0	100.78	△0.0	72.6
10月末	10,053	△0.0	100.78	△0.0	81.4
11月末	10,052	△0.1	100.78	△0.0	70.3
12月末	10,051	△0.1	100.77	△0.0	70.1
2021年1月末	10,050	△0.1	100.77	△0.0	73.8
2月末	10,050	△0.1	100.77	△0.0	68.0
3月末	10,049	△0.1	100.77	△0.0	72.4
(期末) 2021年4月13日	10,049	△0.1	100.76	△0.0	76.3

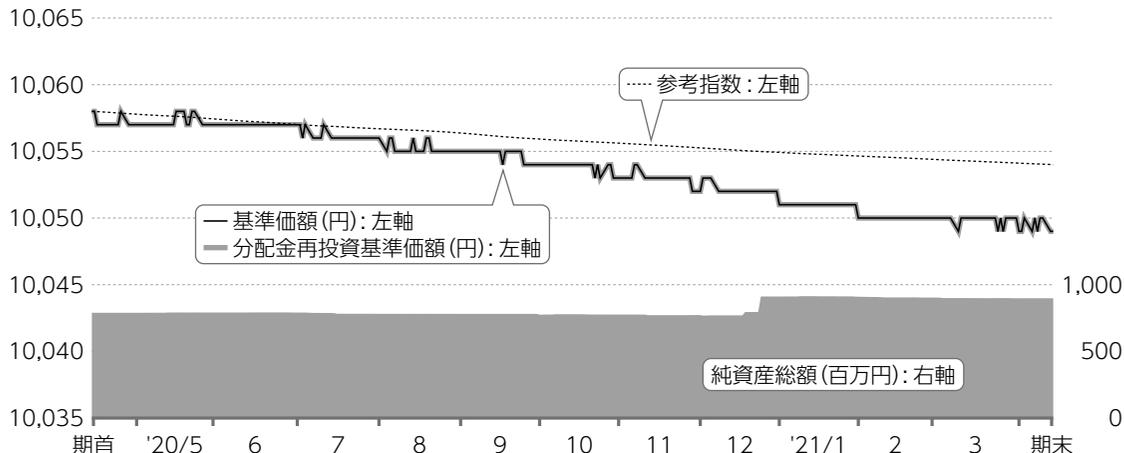
※騰落率は期首比です。

※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(2020年4月14日から2021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	10,058円
期末	10,049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、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(2020年4月14日から2021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(2020年4月14日から2021年4月13日まで)

当期の短期金利は小幅に上昇しました。

新型コロナウイルスの感染拡大により景気が大きく落ち込んだことや、物価上昇率の伸びが下落に転じたことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を据え置き、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。

世界的な新型コロナウイルスの感染拡大による景気の落ち込みを緩和するため、政府による大規模経済対策が策定され、5月から短期国債が大幅に増発されたことから、国庫短期証券3ヵ月物利回りは上昇基調をたどりました。しかし、短期国債の需給緩和を受け、日銀が短期国債買入額を増額したことから、利回り上昇は一服し、その後は-0.10%を挟んで概ねレンジ内での推移となりました。国庫短期証券3ヵ月物利回りは期首-0.152%に対し、期末は-0.100%と小幅に上昇しました。

ポートフォリオについて(2020年4月14日から2021年4月13日まで)

当ファンド

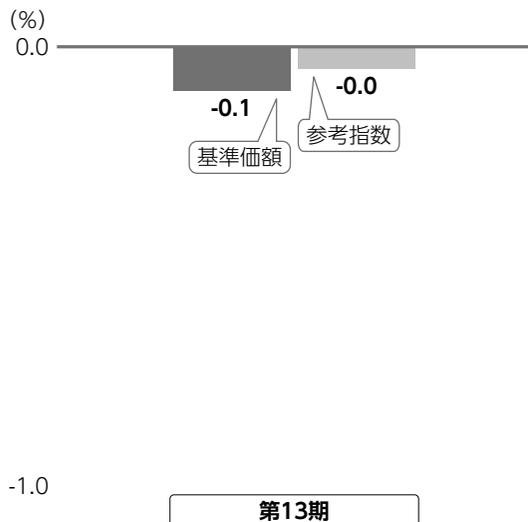
期を通じて「マネーインカム・マザーファンド」を高位に組み入れました。

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続くとの見通しから、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維持しました。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(2020年4月14日から2021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。

※基準価額は分配金再投資ベース

分配金について(2020年4月14日から2021年4月13日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第13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	1,348

当期の分配は、基準価額水準等を勘案し、見送りといたしました。

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%の物価安定目標の達成が展望出来ない中、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(金融機関同士のごく短期の資金の貸借)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11月2日現在)

運用担当部署の概要

運用部、ファンドマネージャー数：127名、平均運用経験年数：16年(兼務者含む)

■ 1万口当たりの費用明細 (2020年4月14日から2021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)	0.006% (0.006)	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10,053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 (2020年4月14日から2021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 152,075	千円 153,400	千口 43,487	千円 43,869

※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 (2020年4月14日から2021年4月13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

(2020年4月14日から2021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 (2021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	金 額	口 数	評 価 額
マネーインカム・マザーファンド	千口 782,308	千円 890,895	千口 890,895	千円 898,379

※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2,257,314千口です。

※単位未満は切捨て。

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

■ 投資信託財産の構成

(2021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 898,379	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1	0.0
投 資 信 託 財 産 総 額	898,380	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

(2021年4月13日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	898,380,211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)	898,379,243
(B) 純 資 産 総 額 (A)	898,380,211
元 本	893,961,565
次 期 繰 越 損 益 金	4,418,646
(C) 受 益 権 総 口 数	893,961,565口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (B / C)	10,049円

※当期における期首元本額785,000,484円、期中追加設定元本額152,604,662円、期中一部解約元本額43,643,581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2020年4月14日 至2021年4月13日)

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 712,175円
売 買 損 益	11,540
売 買 損	△ 723,715
(B) 当 期 損 益 金 (A)	△ 712,175
(C) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 905,607
(D) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,036,428
(配 当 等 相 当 額)	(81,864,189)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△75,827,761)
(E) 計 (B + C + D)	4,418,646
(F) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (E + F)	4,418,646
追 加 信 託 差 損 益 金	6,036,428
(配 当 等 相 当 額)	(81,935,349)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△75,898,921)
分 配 準 備 積 立 金	38,651,626
繰 越 損 益 金	△40,269,408

※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(5,980,325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(81,935,349円)および分配準備積立金(32,671,301円)より分配可能額は120,586,975円(1万口当たり1,348円)ですが、分配は行っておりません。

マネーインカム・マザーファンド

第13期（2020年4月14日から2021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	純資産額
	円	騰落率	100	騰落率		
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
13期（2021年4月13日）	10,084	△0.1	100.76	△0.0	76.3	2,276

※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

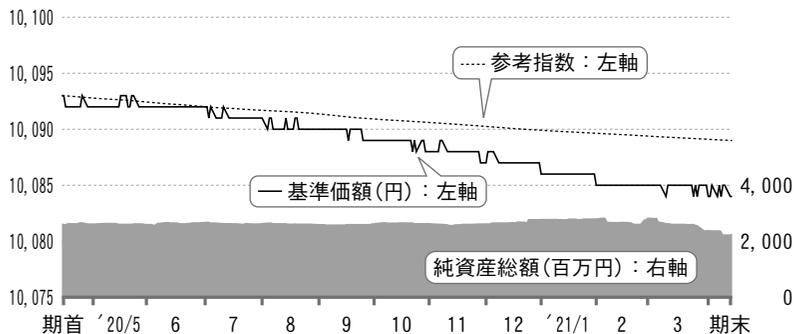
年月日	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比
	円	騰落率	100	騰落率	
(期首) 2020年4月13日	10,093	—	100.80	—	70.2
4月末	10,092	△0.0	100.80	△0.0	70.3
5月末	10,092	△0.0	100.80	△0.0	70.8
6月末	10,092	△0.0	100.79	△0.0	68.7
7月末	10,091	△0.0	100.79	△0.0	73.7
8月末	10,090	△0.0	100.79	△0.0	73.4
9月末	10,089	△0.0	100.78	△0.0	72.6
10月末	10,088	△0.0	100.78	△0.0	81.4
11月末	10,087	△0.1	100.78	△0.0	70.3
12月末	10,086	△0.1	100.77	△0.0	70.1
2021年1月末	10,085	△0.1	100.77	△0.0	73.8
2月末	10,085	△0.1	100.77	△0.0	68.0
3月末	10,084	△0.1	100.77	△0.0	72.4
(期末) 2021年4月13日	10,084	△0.1	100.76	△0.0	76.3

※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（2020年4月14日から2021年4月13日まで）

基準価額等の推移



期首	10,093円
期末	10,084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（2020年4月14日から2021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 (2020年4月14日から2021年4月13日まで)

当期の短期金利は小幅に上昇しました。

新型コロナウイルスの感染拡大により景気が大きく落ち込んだことや、物価上昇率の伸びが下落に転じたことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を据え置き、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。

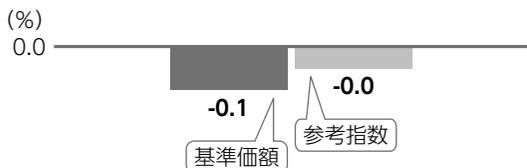
世界的な新型コロナウイルスの感染拡大による景気の落ち込みを緩和するため、政府による大規模経済対策が策定され、5月から短期国債が大幅に増発されたことから、国庫短期証券3ヵ月物利回りは上昇基調をたどりました。しかし、短期国債の需給緩和を受け、日銀が短期国債買入額を増額したことから、利回り上昇は一服し、その後は-0.10%を挟んで概ねレンジ内での推移となりました。国庫短期証券3ヵ月物利回りは期首-0.152%に対し、期末は-0.100%と小幅に上昇しました。

▶ ポートフォリオについて (2020年4月14日から2021年4月13日まで)

短期金利は低位での推移が続くとの見通しから、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維持しました。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 (2020年4月14日から2021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%の物価安定目標の達成が展望出来ない中、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（金融機関同士のごく短期の資金の貸借）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 (2020年4月14日から2021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)	0.006% (0.006)	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10,088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 (2020年4月14日から2021年4月13日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	760,175	(540,000)
	特殊債券	1,527,709	(1,844,000)

※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 (2020年4月14日から2021年4月13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 (2020年4月14日から2021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。

マネーインカム・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2021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	%	%	%	%	%
国 債 証 券	220,000 (220,000)	220,025 (220,025)	9.7 (9.7)	— (—)	— (—)	— (—)	9.7 (9.7)
特殊債券(除く金融債)	1,509,600 (1,509,600)	1,517,370 (1,517,370)	66.7 (66.7)	— (—)	— (—)	— (—)	66.7 (66.7)
合 計	1,729,600 (1,729,600)	1,737,396 (1,737,396)	76.3 (76.3)	— (—)	— (—)	— (—)	76.3 (76.3)

※()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。

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969回	国庫短期証券	—	20,000	20,001	2021/5/10
	第970回	国庫短期証券	—	100,000	100,009	2021/5/17
	第976回	国庫短期証券	—	100,000	100,015	2021/6/7
小	計		—	220,000	220,025	—
特殊債券(除く金融債)	第19回	政府保証日本政策金融公庫債券	1.1	100,000	100,757	2021/12/17
	第25回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	200,000	200,412	2021/6/14
	第30回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	100,600	2021/11/15
	第14回	政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.9	200,000	201,678	2022/3/14
	第15回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	101,396	2021/12/22
	第135回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	100,000	100,146	2021/5/31
	第137回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	200,000	200,518	2021/6/30
	第139回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	200,000	200,658	2021/7/30
	第142回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	209,600	210,415	2021/8/31
	第152回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	100,000	100,790	2021/12/28
	小	計		—	1,509,600	1,517,370
合	計		—	1,729,600	1,737,396	—

※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

(2021年4月13日現在)

項 目	期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
	千円	%	千円	%
公 社 債	1,737,396	76.3		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	540,193	23.7		
投 資 信 託 財 産 総 額	2,277,589	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

(2021年4月13日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	2,277,589,174円
コール・ローン等	536,958,808
公社債(評価額)	1,737,396,304
未 収 利 息	3,234,062
(B) 負 債	1,205,452
未 払 解 約 金	1,200,000
未 払 利 息	502
その他未払費用	4,950
(C) 純資産総額(A-B)	2,276,383,722
元 本	2,257,314,469
次期繰越損益金	19,069,253
(D) 受益権総口数	2,257,314,469口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,084円

※当期における期首元本額2,617,198,028円、期中追加設定元本額1,166,758,748円、期中一部解約元本額1,526,642,307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・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	100,839,042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)	116,052,823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)	47,825,996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)	32,545,911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)	20,369,659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)	38,075,492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>	890,895,719円
SMAM・バランス先物ファンドVA20<適格機関投資家限定>	164,438,276円
SMAM・FGマネーファンドVA<適格機関投資家限定>	845,875,039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2020年4月14日 至2021年4月13日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	19,199,315円
受 取 利 息	19,779,104
支 払 利 息	△ 579,789
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△21,173,160
売 買 損	△21,173,160
(C) 信 託 報 酬 等	△ 170,016
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,143,861
(E) 前期繰越損益金	24,217,017
(F) 追加信託差損益金	10,276,343
(G) 解約差損益金	△13,280,246
(H) 計 (D+E+F+G)	19,069,253
次期繰越損益金(H)	19,069,253

※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。