

■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)】

(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

第 **22** 期

決算日 2022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	%		
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
22期(2022年12月20日)	12,832	0	△2.0	99.4	364

### 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	%		
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
22期(2022年12月20日)	15,298	0	△2.0	99.6	1,002

### 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	%		
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
22期(2022年12月20日)	17,748	0	△3.1	99.7	1,950

### 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	%		
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
22期(2022年12月20日)	20,342	0	△2.3	99.8	3,132

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※各ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

## ■ 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	%	%
2021年12月20日	13,097	—	99.3
12月末	13,125	0.2	99.3
2022年1月末	12,991	△0.8	99.5
2月末	12,930	△1.3	99.5
3月末	13,034	△0.5	99.4
4月末	12,967	△1.0	99.6
5月末	12,983	△0.9	99.6
6月末	12,916	△1.4	99.4
7月末	12,989	△0.8	99.5
8月末	12,981	△0.9	99.5
9月末	12,867	△1.8	99.3
10月末	12,940	△1.2	100.1
11月末	12,911	△1.4	99.6
(期 末)			
2022年12月20日	12,832	△2.0	99.4

## 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	%	%
2021年12月20日	15,615	—	99.6
12月末	15,650	0.2	99.7
2022年1月末	15,488	△0.8	99.7
2月末	15,416	△1.3	99.8
3月末	15,540	△0.5	99.9
4月末	15,460	△1.0	99.8
5月末	15,479	△0.9	99.8
6月末	15,399	△1.4	99.7
7月末	15,487	△0.8	99.8
8月末	15,477	△0.9	99.8
9月末	15,340	△1.8	99.3
10月末	15,427	△1.2	99.9
11月末	15,392	△1.4	100.0
(期 末)			
2022年12月20日	15,298	△2.0	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	%	%
2021年12月20日	18,320	—	98.1
12月末	18,423	0.6	98.4
2022年1月末	17,980	△1.9	99.3
2月末	17,825	△2.7	99.8
3月末	18,229	△0.5	99.6
4月末	17,987	△1.8	99.9
5月末	18,065	△1.4	99.9
6月末	17,914	△2.2	99.7
7月末	18,145	△1.0	99.7
8月末	18,135	△1.0	99.8
9月末	17,792	△2.9	99.4
10月末	18,044	△1.5	100.2
11月末	18,009	△1.7	99.9
(期 末) 2022年12月20日	17,748	△3.1	99.7

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首)	円	%	%
2021年12月20日	20,811	—	98.3
12月末	21,019	1.0	99.4
2022年1月末	20,287	△2.5	99.2
2月末	20,144	△3.2	99.9
3月末	20,889	0.4	99.9
4月末	20,397	△2.0	99.9
5月末	20,583	△1.1	100.1
6月末	20,369	△2.1	99.8
7月末	20,739	△0.3	99.6
8月末	20,777	△0.2	99.9
9月末	20,246	△2.7	99.5
10月末	20,683	△0.6	99.9
11月末	20,780	△0.1	99.9
(期 末) 2022年12月20日	20,342	△2.3	99.8

※騰落率は期首比です。

# 1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年12月21日から2022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	13,097円
期末	12,832円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-2.0% (分配金再投資ベース)

### 分配金再投資基準価額について

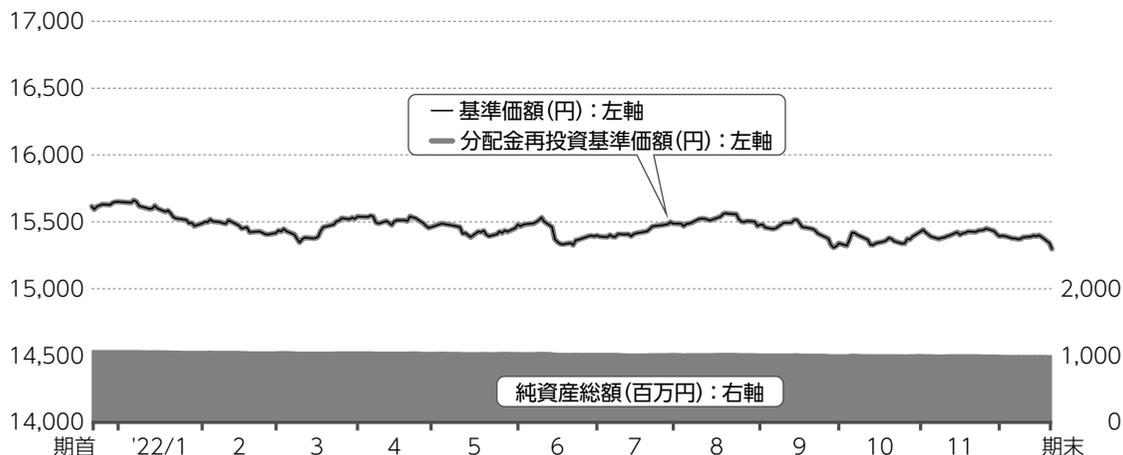
分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※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	15,615円
期末	15,298円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-2.0% (分配金再投資ベース)

## 分配金再投資基準価額について

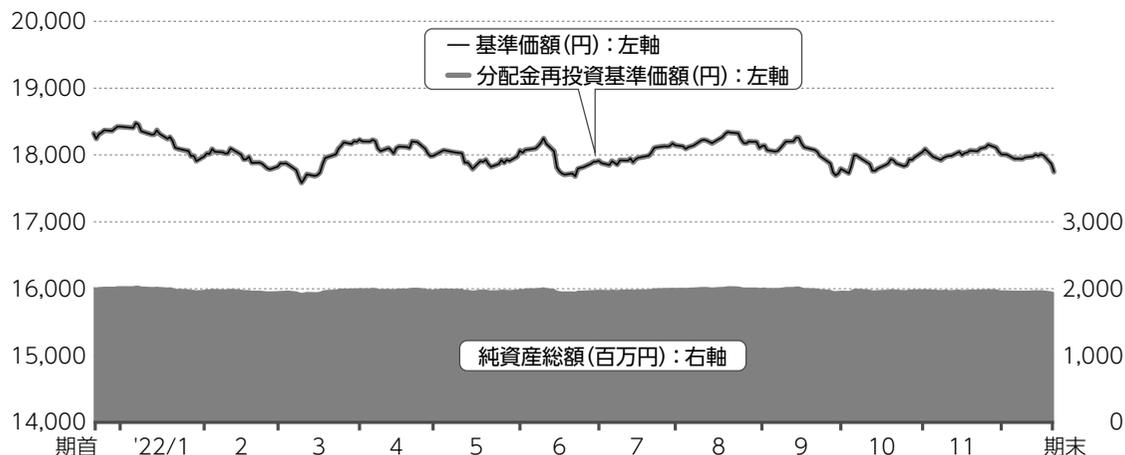
分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※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	18,320円
期末	17,748円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-3.1% (分配金再投資ベース)

### 分配金再投資基準価額について

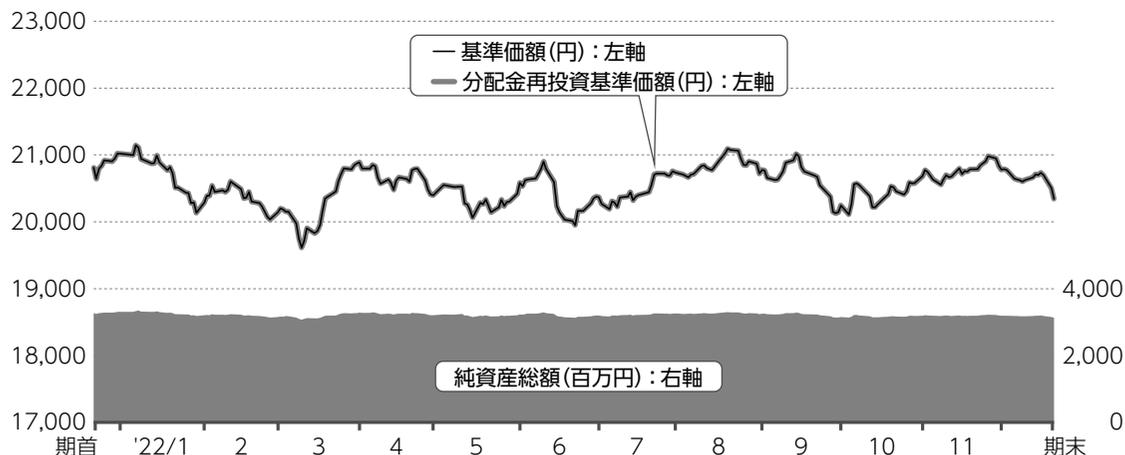
分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※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。

## 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	20,811円
期末	20,342円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-2.3% (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(2021年12月21日から2022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<sup>\*</sup>に向けて運用を行いました。

**上昇要因**

- 国内株式市場(TOPIX(東証株価指数、配当込み))が上昇したこと

**下落要因**

- 国内外の債券市場が下落したこと
- 外国株式市場が下落したこと

※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%	50.2%

## 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%	4.9%
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%	50.2%

## 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	16%	14.5%
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%	58.3%
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	10%	9.5%
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	14%	13.9%
SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	短期金融資産	3%	3.5%

## 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	30%	29.4%
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	41%	42.4%
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	16%	14.9%
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	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%	2.1%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

## 投資環境について(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

期間における内外の株式市場は下落しました。内外債券市場は長期金利が欧米・日本で上昇しました。為替市場は米ドル・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、期を通じて下落しました。

期初から2022年3月上旬にかけては、物価上昇の企業業績への影響や中国による都市封鎖、世界各国の中央銀行により金融引き締め姿勢が懸念され、下落しました。その後は、金融引き締めに伴う景気悪化懸念から世界各国の金利が低下し、国内株式市場に追い風となる局面もありましたが上値は重く、期初と比較すると下落での着地となりました。

### 国内債券市場

日本の長期金利(10年国債利回り)は、期を通じて上昇しました。

期初から2022年4月にかけて、日銀は一貫して金融緩和継続の姿勢を維持しましたが、世界各国との金利差拡大に伴う大幅な円安を受けて日銀は緩和姿勢の修正を迫られるとの見方から、金利は上昇しました。その後、一時的に金融引き締めに伴う景気悪化懸念から、世界各国の金利が低下したことに連れて低下する局面もありましたが、期末には日銀の金融政策スタンスが大きく修正され金利は急上昇しました。

### 外国株式市場

先進国外国株式は、期を通じて下落しました。

米国株式は、期初から2022年6月中旬にかけて、FRB(米連邦準備制度理事会)の金融政策スタンスがインフレ懸念の高まりから積極的な利上げ姿勢へ転じたことから金利が上昇し、バリュエーション(投資価値評価)調整から成長株主導で下落しました。その後、期末にかけてFRBによる利上げペースの緩和期待や堅調な企業の決算発表に伴い反発する局面もみられ、一進一退の展開となりましたが、期を通じてみると、米国株式市場は下落しました。

欧州株式市場も米国に連れる形で推移しました。中国による都市封鎖やロシアによるウクライナ侵攻等により、世界的に経済に対する不透明感が広がったことも不安材料となりました。

### 外国債券市場

米国の長期金利(10年国債利回り)は、期を通じて上昇しました。インフレ懸念の高まりに伴い、FRBが金融引き締め姿勢を明確

にしたため、金利は上昇基調で推移しました。景気後退懸念から一時金利が低下する局面がありましたが、FRBが金融引き締め姿勢を崩さなかったことで、期初と比較して上昇基調で推移しました。

欧州の長期金利(ドイツ10年国債利回り)は、期を通じて上昇しました。欧州圏内での物価上昇やFRBの金融引き締め政策を受けて、ECB(欧州中央銀行)も利上げを実施するなど金融引き締め姿勢へ転じました。その結果、金利は上昇しました。エネルギー価格高騰等に伴う景気悪化懸念から、一時金利が低下する局面もありましたが、期初と比較して上昇で着地しました。

## 為替市場

期末の米ドル・円は、期初と比較して円安となりました。期中にFRBが金融引き締めを積極化した一方で、日銀が緩和姿勢を維持したことによる日米金利差拡大などを背景に、米ドル高・円安基調となりました。期末にかけて、日銀の金融政策スタンスの変更により円高方向に推移しましたが、期を通じては、米ドルが円に対して上昇基調で推移しました。

期末のユーロ・円についても、期初と比較して円安となりました。期を通じては、日欧金利差拡大等を背景に、ユーロが円に対して上昇基調で推移しました。

## ポートフォリオについて(2021年12月21日から2022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	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(2021年12月21日から2022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(2021年12月21日から2022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	2,991	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。

2022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	14%	58%	10%	14%	4%
2040	29%	43%	15%	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(2021年12月21日から2022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	0.440%	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12,962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)	(0.330)	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	57	0.443	

※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。

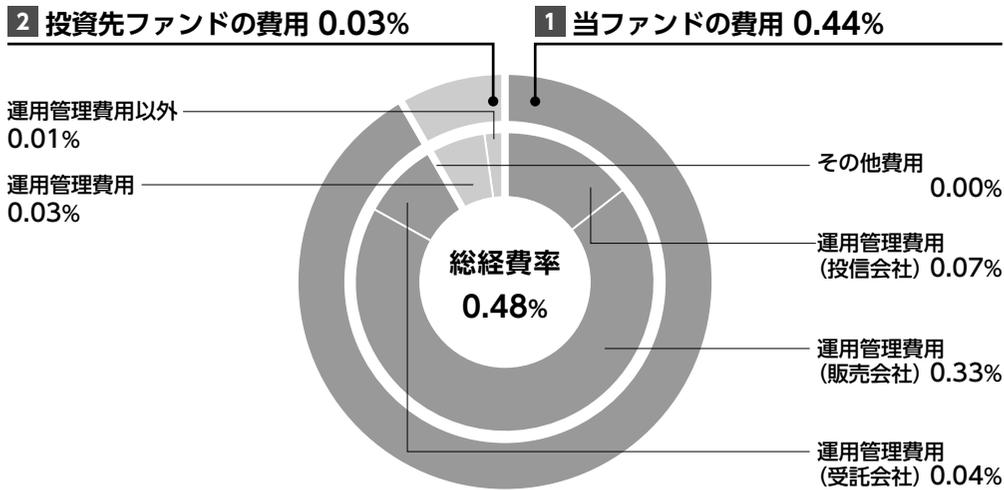
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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)



<b>総経費率(1+2)</b>	<b>0.48%</b>
<b>1 当ファンドの費用の比率</b>	<b>0.44%</b>
投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.03%
<b>2 投資先ファンドの運用管理費用以外の比率</b>	<b>0.01%</b>

※ **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)2020

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	68円	0.440%	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15,454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)	(0.330)	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	68	0.443	

※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。

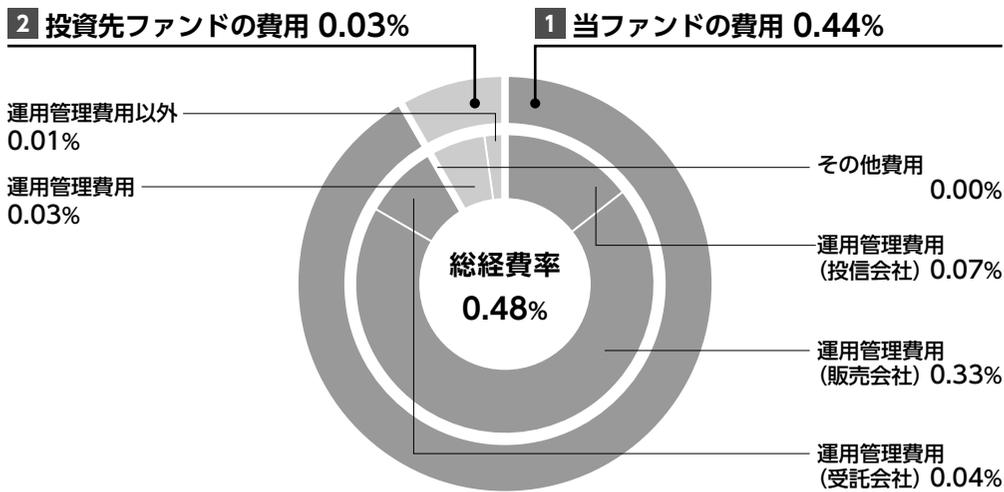
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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)



<b>総経費率(1+2)</b>	<b>0.48%</b>
<b>1 当ファンドの費用の比率</b>	<b>0.44%</b>
投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.03%
<b>2 投資先ファンドの運用管理費用以外の比率</b>	<b>0.01%</b>

※ **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	0.539%	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18,025円です。]
( 投 信 会 社 )	(30)	(0.165)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
( 販 売 会 社 )	(59)	(0.330)	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	98	0.542	

※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。

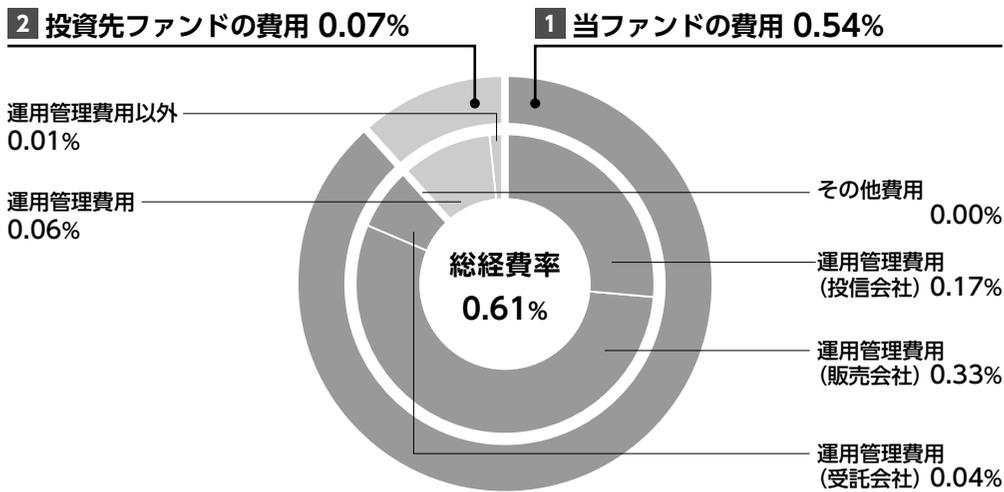
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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)



<b>総経費率(1+2)</b>	<b>0.61%</b>
<b>1 当ファンドの費用の比率</b>	<b>0.54%</b>
投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.06%
<b>2 投資先ファンドの運用管理費用以外の比率</b>	<b>0.01%</b>

※ **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0.61%です。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	111円	0.539%	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20,549円です。]
( 投 信 会 社 )	(34)	(0.165)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
( 販 売 会 社 )	(68)	(0.330)	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	111	0.542	

※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。

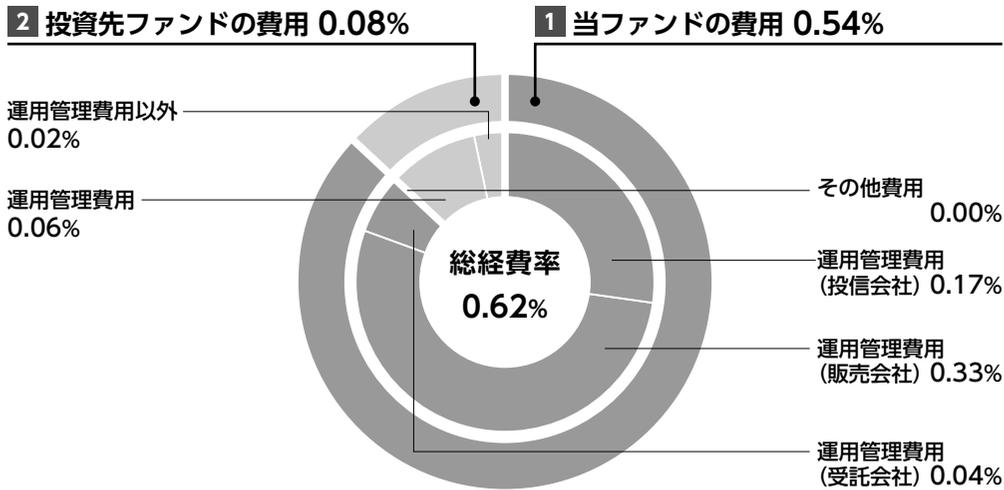
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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)



<b>総経費率(1+2)</b>	<b>0.62%</b>
<b>1 当ファンドの費用の比率</b>	<b>0.54%</b>
投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.06%
<b>2 投資先ファンドの運用管理費用以外の比率</b>	<b>0.02%</b>

※ **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。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2021年12月21日から2022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)	806,956	1,700	1,868,199	4,090
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	626,401	2,770	1,117,330	5,310
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	519,230	1,030	1,428,985	2,850
	SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	2,737,926	3,520	10,343,701	13,200
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	1,095,372	1,100	22,842,689	22,940

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)	1,465,976	3,070	3,876,170	8,430
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,602,045	7,020	2,833,795	13,430
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	261,586	520	2,825,468	5,630
	SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,574,527	7,140	15,483,452	19,730
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	4,052,325	4,070	40,577,631	40,750

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)	22,332,161	46,240	42,818,250	93,000
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,997,913	26,330	9,731,466	45,500
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	14,052,244	27,700	7,946,848	16,010
	SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	79,556,578	101,580	53,529,875	68,630
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	31,572,715	31,710	189,224	190

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)	49,137,372	102,570	80,585,128	174,520
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	20,773,979	92,510	33,016,857	153,990
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	9,999,226	19,810	14,679,877	29,270
	SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	225,571,419	289,170	142,115,921	181,860
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	3,423,582	3,437	2,528,873	2,540

※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。

■ 利害関係人との取引状況等(2021年12月21日から2022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  
(2021年12月21日から2022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(2022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)	9,134,004	8,072,761	17,508	4.8
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	4,308,818	3,817,889	16,997	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>	9,957,383	9,047,628	17,436	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>	109,408,925	101,803,150	127,294	35.0
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	203,723,351	181,976,034	182,722	50.2
合 計	336,532,481	304,717,462	361,958	99.4

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)	24,835,450	22,425,256	48,635	4.9
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	11,814,914	10,583,164	47,116	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>	27,629,709	25,065,827	48,306	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>	290,630,764	280,721,839	351,014	35.0
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	537,945,139	501,419,833	503,475	50.2
合 計	892,855,976	840,215,919	998,549	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)	150,953,129	130,467,040	282,956	14.5
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	45,405,646	41,672,093	185,524	9.5
SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	134,908,522	141,013,918	271,762	13.9
SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	883,176,312	909,203,015	1,136,867	58.3
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	36,662,446	68,045,937	68,324	3.5
合 計	1,251,106,055	1,290,402,003	1,945,435	99.7

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

ファンド名	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	□	□	千円	%
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	455,765,256	424,317,500	920,259	29.4
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	116,942,048	104,699,170	466,120	14.9
SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	183,715,457	179,034,806	345,035	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>	979,980,375	1,063,435,873	1,329,720	42.4
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	64,070,040	64,964,749	65,231	2.1
合 計	1,800,473,176	1,836,452,098	3,126,367	99.8

※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

(2022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	361,958	99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,782	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	365,741	100.0

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	365,741,390円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,452,564
投資信託受益証券(評価額)	361,958,826
未 収 入 金	330,000
(B) 負 債	1,523,770
未 払 金	250,000
未 払 解 約 金	431,926
未 払 信 託 報 酬	835,617
そ の 他 未 払 費 用	6,227
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	364,217,620
元 本	283,825,717
次 期 繰 越 損 益 金	80,391,903
(D) 受 益 権 総 口 数	283,825,717口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	12,832円

※当期における期首元本額312,608,012円、期中追加設定元本額9,479,724円、期中一部解約元本額38,262,019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2021年12月21日 至2022年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 771円
受 取 利 息	60
支 払 利 息	△ 831
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 5,656,841
売 買 益	885,814
売 買 損	△ 6,542,655
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,727,539
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 7,385,151
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	35,019,851
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	52,757,203
( 配 当 等 相 当 額 )	( 49,879,027)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 2,878,176)
(G) 合 計 (D + E + F)	80,391,903
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	80,391,903
追 加 信 託 差 損 益 金	52,757,203
( 配 当 等 相 当 額 )	( 49,879,027)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 2,878,176)
分 配 準 備 積 立 金	35,021,575
繰 越 損 益 金	△ 7,386,875

※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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	49,879,027
(d) 分配準備積立金	35,021,575
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	84,900,602
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	2,991.29
(f) 分配金	0
1 万 口 当 た り 分 配 金	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

## ■ 投資信託財産の構成

(2022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 998,549	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,570	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	1,006,119	100.0

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,006,119,410円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,450,167
投資信託受益証券(評価額)	998,549,243
未 収 入 金	1,120,000
(B) 負 債	3,842,139
未 払 金	120,000
未 払 解 約 金	1,435,280
未 払 信 託 報 酬	2,269,884
そ の 他 未 払 費 用	16,975
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,002,277,271
元 本	655,178,910
次 期 繰 越 損 益 金	347,098,361
(D) 受 益 権 総 口 数	655,178,910口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	15,298円

※当期における期首元本額695,164,511円、期中追加設定元本額17,925,196円、期中一部解約元本額57,910,797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2021年12月21日 至2022年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,448円
受 取 利 息	89
支 払 利 息	△ 1,537
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 15,840,582
売 買 損 益	1,899,323
売 買 損 益	△ 17,739,905
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,642,238
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 20,484,268
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	152,533,592
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	215,049,037
( 配 当 等 相 当 額 )	( 266,543,101)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 51,494,064)
(G) 合 計 (D + E + F)	347,098,361
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	347,098,361
追 加 信 託 差 損 益 金	215,049,037
( 配 当 等 相 当 額 )	( 266,543,101)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 51,494,064)
分 配 準 備 積 立 金	152,536,555
繰 越 損 益 金	△ 20,487,231

※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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	266,543,101
(d) 分配準備積立金	152,536,555
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	419,079,656
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	6,396.42
(f) 分配金	0
1 万 口 当 た り 分 配 金	0

## 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

(2022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	1,945,435	99.0
コール・ローン等、その他	19,110	1.0
投資信託財産総額	1,964,546	100.0

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,964,546,371円
コール・ローン等	12,810,901
投資信託受益証券(評価額)	1,945,435,470
未 収 入 金	6,300,000
(B) 負 債	13,728,210
未 払 金	7,000,000
未 払 解 約 金	1,301,908
未 払 信 託 報 酬	5,393,309
そ の 他 未 払 費 用	32,993
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,950,818,161
元 本	1,099,191,787
次 期 繰 越 損 益 金	851,626,374
(D) 受 益 権 総 口 数	1,099,191,787口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	17,748円

※当期における期首元本額1,106,286,759円、期中追加設定元本額73,279,809円、期中一部解約元本額80,374,781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2021年12月21日 至2022年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 3,628円
受 取 利 息	282
支 払 利 息	△ 3,910
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 50,019,228
売 買 益	7,228,285
売 買 損	△ 57,247,513
(C) 信 託 報 酬 等	△ 10,821,753
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 60,844,609
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	357,712,905
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	554,758,078
( 配 当 等 相 当 額 )	( 742,054,243 )
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( △187,296,165 )
(G) 合 計 (D + E + F)	851,626,374
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	851,626,374
追 加 信 託 差 損 益 金	554,758,078
( 配 当 等 相 当 額 )	( 742,054,243 )
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( △187,296,165 )
分 配 準 備 積 立 金	357,719,185
繰 越 損 益 金	△ 60,850,889

※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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	742,054,243
(d) 分配準備積立金	357,719,185
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,099,773,428
1 万口当たり当期分配対象額	10,005.29
(f) 分配金	0
1 万口当たり分配金	0

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

(2022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	3,126,367	99.2
コール・ローン等、その他	26,481	0.8
投資信託財産総額	3,152,849	100.0

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	3,152,849,651円
コール・ローン等	16,481,956
投資信託受益証券(評価額)	3,126,367,695
未 収 入 金	10,000,000
(B) 負 債	20,306,157
未 払 金	6,000,000
未 払 解 約 金	5,573,063
未 払 信 託 報 酬	8,679,943
そ の 他 未 払 費 用	53,151
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	3,132,543,494
元 本	1,539,915,161
次 期 繰 越 損 益 金	1,592,628,333
(D) 受 益 権 総 口 数	1,539,915,161口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	20,342円

※当期における期首元本額1,573,014,555円、期中追加設定元本額190,504,404円、期中一部解約元本額223,603,798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2021年12月21日 至2022年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 5,712円
受 取 利 息	549
支 払 利 息	△ 6,261
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 50,767,106
売 買 益	18,039,776
売 買 損	△ 68,806,882
(C) 信 託 報 酬 等	△ 17,458,055
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 68,230,873
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	579,944,195
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,080,915,011
( 配 当 等 相 当 額 )	( 1,389,503,733)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 308,588,722)
(G) 合 計 (D + E + F)	1,592,628,333
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	1,592,628,333
追 加 信 託 差 損 益 金	1,080,915,011
( 配 当 等 相 当 額 )	( 1,389,503,733)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 308,588,722)
分 配 準 備 積 立 金	579,953,726
繰 越 損 益 金	△ 68,240,404

※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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,389,503,733
(d) 分配準備積立金	579,953,726
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,969,457,459
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	12,789.39
(f) 分配金	0
1 万 口 当 た り 分 配 金	0

# SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

第 22 期

決算日 2022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、TOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、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。
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（2021年12月1日から2022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)	18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) (0.003)	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)	2 (2) (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	20	0.093	

期中の平均基準価額は21,248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（2021年12月1日から2022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 143,788	千円 464,512	千口 419,494	千円 1,379,413

### ■ 組入れ資産の明細（2022年11月30日現在）

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期	末
	口 数	口 数	評 価 額
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	千口 2,839,797	千口 2,564,092	千円 8,736,887

※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65,393,298,021口です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2022年11月30日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	8,763,775,578円
コール・ローン等	48,112
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	8,736,887,472
未 収 入 金	26,839,994
(B) 負 債	30,755,087
未 払 解 約 金	26,839,994
未 払 信 託 報 酬	3,597,349
その他未払費用	317,744
(C) 純資産総額(A-B)	8,733,020,491
元 本	3,924,922,862
次期繰越損益金	4,808,097,629
(D) 受益権総口数	3,924,922,862口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,250円

※当期における期首元本額4,343,114,030円、期中追加設定元本額273,108,324円、期中一部解約元本額691,299,492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2021年12月1日 至2022年11月30日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 350円
受 取 利 息	9
支 払 利 息	△ 359
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	474,332,131
売 買 損 益	509,163,347
売 買 損 益	△ 34,831,216
(C) 信 託 報 酬 等	△ 7,924,002
(D) 当期損益金(A+B+C)	466,407,779
(E) 前期繰越損益金	3,055,711,082
(F) 追加信託差損益金	1,285,978,768
( 配 当 等 相 当 額 )	( 3,520,280,211)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△2,234,301,443)
(G) 合 計 (D+E+F)	4,808,097,629
次期繰越損益金(G)	4,808,097,629
追加信託差損益金	1,285,978,768
( 配 当 等 相 当 額 )	( 3,521,889,782)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△2,235,911,014)
分 配 準 備 積 立 金	3,522,118,861

※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	212,290,088円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	254,117,691
(c) 収益調整金	3,521,889,782
(d) 分配準備積立金	3,055,711,082
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	7,044,008,643
1万口当たり当期分配対象額	17,946.87
(f) 分配金	0
1万口当たり分配金	0

# 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第20期 (2021年12月1日から2022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T O P I X (東証株価指数) に採用されている銘柄の株式に投資を行い、T O P I X (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) T O P I X (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			
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
20期 (2022年11月30日)	34,074	5.8	3,249.61	5.7	97.9	2.0	222,819

※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 比	株式先物 率 (買建-売建)
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2021年11月30日	円 32,212	% -	3,073.26	% -	% 97.7	% 2.4
12月末	33,341	3.5	3,179.28	3.4	98.1	1.9
2022年1月末	31,728	△1.5	3,025.69	△1.5	98.4	1.6
2月末	31,588	△1.9	3,012.57	△2.0	98.8	1.2
3月末	32,945	2.3	3,142.06	2.2	97.6	2.4
4月末	32,159	△0.2	3,066.68	△0.2	97.4	2.6
5月末	32,401	0.6	3,090.73	0.6	97.3	2.6
6月末	31,742	△1.5	3,027.34	△1.5	98.1	1.9
7月末	32,927	2.2	3,140.07	2.2	98.7	1.2
8月末	33,322	3.4	3,177.98	3.4	99.0	0.9
9月末	31,493	△2.2	3,003.39	△2.3	96.6	3.4
10月末	33,100	2.8	3,156.44	2.7	97.7	2.3
(期末) 2022年11月30日	34,074	5.8	3,249.61	5.7	97.9	2.0

※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

### 基準価額等の推移



期首	32,212円
期末	34,074円
騰落率	+5.8%

※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（2021年12月1日から2022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	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 日本銀行の金融緩和政策の維持が示されたこと</li> <li>・ 米CPI（消費者物価指数）の結果を受けて、インフレがピークアウトし利上げペースが鈍化すると期待が広がったこと</li> </ul>
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 新型コロナの新たな変異ウイルス（オミクロン型）の感染拡大やウクライナ情勢が緊迫化したこと</li> <li>・ 欧米において金融引き締めの方針が確認され、長期金利（10年国債利回り）が上昇したこと</li> </ul>

---

▶ 投資環境について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

---

国内株式市場は上昇しました。

期初から3月中旬にかけては、変異ウイルス（オミクロン型）の感染急拡大や、ウクライナ情勢の緊迫化、ロシアへの経済制裁を背景とした原油市況の高騰などから世界景気の回復の遅れが懸念され、下落しました。

その後、ウクライナ情勢に対する過度な警戒感の緩和や米国の金融政策イベント通過により投資家心理が持ち直し、国内でも日本銀行の金融緩和政策の維持が示されたことで、上昇しました。6月から期末にかけては、欧米の金融政策動向に左右される形で一進一退の展開が続きました。

---

▶ ポートフォリオについて（2021年12月1日から2022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**

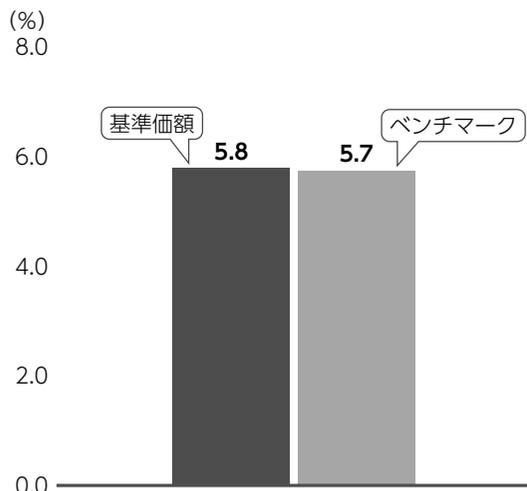
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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の乖離）が拡大する場合は、リバランス（投資配分比率の調整）を実施し、トラッキングエラーを低く抑えました。

## ▶ ベンチマークとの差異について（2021年12月1日から2022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+5.8%となり、ベンチマークの騰落率+5.7%を0.1%上方乖離しました。

## 上方乖離要因

・先物と現物のリターンに、差が生じたこと

## 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。

■ 1万口当たりの費用明細（2021年12月1日から2022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) (0.003)	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32,526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（2021年12月1日から2022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 14,312.2 (1,313.824)	千円 31,388,823 ( )	千株 6,390.324	千円 12,178,963

※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。

(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 49,332	百万円 50,112	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

（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	43,567,786千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	204,530,294千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.21

※(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（2021年12月1日から2022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 31,388	百万円 -	% -	百万円 12,178	百万円 24	% 0.2
株 式 先 物 取 引	49,332	28,561	57.9	50,112	33,581	67.0

### (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 206	百万円 9	百万円 2,553

### (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	6,618千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	3,594千円
(c) (b)／(a)	54.3%

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

（2021年12月1日から2022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（2022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	
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			
極洋	3.7	3.9	14,410
日本水産	97.1	106.9	55,801
マルハニチロ	15	16.2	39,787
雪国まいたけ	8.1	10.6	10,610
カネコ種苗	5	5.3	7,573
サカタのタネ	11.6	13.5	63,315
ホクト	8	9.4	17,766
<b>鉱業 (0.3%)</b>			
住石ホールディングス	—	21.8	5,537
日鉄鉱業	2.3	4.3	13,523
三井島ホールディングス	4.8	5	16,125
INPEX	396.9	394	604,002
石油資源開発	11.7	12.3	53,320
K&Oエナジーグループ	5.5	4.9	11,892
<b>建設業 (1.9%)</b>			
ヒノキヤグループ	2.9	—	—
ショーボンドホールディングス	14.1	14.5	87,870
ミライト・ワン	31.3	37.2	56,320
タマホーム	6.1	7.6	18,840
日本アクア	—	5.9	5,192
ベステラ	3.9	—	—
Robot Home	20.8	0.8	147
ダイセキ環境ソリューション	2.7	—	—
安藤・間	54.1	61.9	54,100
東急建設	30.2	32.6	21,385
コムシスホールディングス	31.6	35.9	88,565
ビーアールホールディングス	17	22.2	7,481
高松コンストラクショングループ	6.7	7.2	14,112
東建コーポレーション	2.9	3.4	27,030
ヤマウラ	—	7.6	7,630
オリエンタル白石	36.7	41.3	11,481
大成建設	66	74.2	309,043
大林組	227.9	265.9	272,281
清水建設	213.8	223.6	165,016
飛鳥建設	8.7	10.4	10,628
長谷工コーポレーション	67.2	76.9	116,657
松井建設	11.6	2.7	1,517
銭高組	1.7	2.1	5,640
鹿島建設	167	164.9	255,595
不動テトラ	5.8	6	9,144

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
大木建設	5.1	3.7	4,425
鉄建建設	6.5	7	12,733
西松建設	14	13.1	51,286
三井住友建設	53.2	63.2	26,670
大豊建設	3.5	3.3	14,652
奥村組	13.3	12.3	36,112
東鉄工業	9.9	10.3	26,285
浅沼組	2.9	6.3	18,396
戸田建設	95.7	92.7	67,856
熊谷組	11.2	13	33,007
北野建設	2.7	3	7,338
矢作建設工業	12.5	11.3	8,350
ピーエス三菱	9.3	11.1	6,693
日本ハウスホールディングス	20.7	17.8	7,778
新日本建設	10.6	10.7	8,003
NIPPO	18.6	—	—
東亜道路工業	1.4	1.7	10,370
日本道路	2.2	1.7	10,557
東亜建設工業	5.9	6.8	16,007
日本国土開発	22.2	23.7	13,556
若築建設	4.8	3.8	10,385
東洋建設	25.7	24.8	20,757
五洋建設	91.2	106.9	69,164
世紀東急工業	12.8	11.2	8,937
福田組	2.8	2.9	14,108
住友林業	58.5	57.2	135,621
バコーポレーション	14.6	15.1	5,768
大和ハウス工業	211.2	208.4	658,335
ライト工業	14.8	13.5	27,918
積水ハウス	247.9	233.7	599,907
日特建設	—	8	7,288
北陸電気工事	5.2	—	—
ユアテック	14.1	16.6	11,935
日本リーテック	5.8	6.3	4,624
四電工	—	1.8	3,193
中電工	9.9	10.1	21,058
関電工	37.5	38.3	33,244
きんでん	50	51.5	75,756
東京エネシス	8.8	8.5	7,998
トーエネック	2.9	2.7	9,234
住友電設	5.8	6.9	17,526
日本電設工業	11.7	11.9	20,170

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
エクシオグループ	33.9	36.4	77,422	
新日本空調	6.3	4.4	8,439	
九電工	17.7	18.3	60,207	
三機工業	13.6	16.2	25,887	
日揮ホールディングス	70.9	74.1	140,271	
中外炉工業	3.6	2.6	4,152	
ヤマト	8.8	10.1	6,969	
太平電業	5.3	4.8	15,096	
高砂熱学工業	21.1	17.8	31,933	
朝日工業社	2.2	3.5	7,462	
明星工業	17	14	10,136	
大気社	11.1	8.9	31,461	
ダイダグ	5.4	5.1	11,220	
日比谷総合設備	7.5	6.8	12,886	
フィル・カンパニー	1.7	—	—	
テスホールディングス	4.7	8.7	9,674	
インフロニア・ホールディングス	97.4	78.4	80,752	
東洋エンジニアリング	11.1	11.2	6,518	
レイズネクスト	10.8	10.5	13,177	
<b>食料品（3.5%）</b>				
ニッポン	20.1	19.4	30,787	
日清製粉グループ本社	82.2	69.1	111,596	
日東富士製粉	—	1.7	7,607	
昭和産業	6.4	6.2	15,177	
鳥越製粉	8.7	—	—	
中部飼料	8.6	10.8	11,221	
フィード・ワン	10.3	11.1	7,425	
日本甜菜製糖	5.3	5.3	8,623	
DM三井製糖ホールディングス	6.4	7.4	14,474	
日新製糖	4.3	4.1	6,900	
森永製菓	17.3	15.6	57,642	
中村屋	2.5	2.9	9,019	
江崎グリコ	20	21.6	77,436	
名糖産業	5	1.6	2,576	
井村屋グループ	4.5	4.4	9,816	
不二家	4.4	5	13,165	
山崎製パン	54.7	50.5	79,840	
モロゾフ	1.7	2.7	9,693	
亀田製菓	4.1	4.8	20,904	
寿スピリッツ	7	8	62,160	
カルビー	33.4	34.5	100,188	
森永乳業	13.6	13.8	61,341	
六甲バター	6.5	5.9	8,230	
ヤクルト本社	54.1	53.5	468,125	
明治ホールディングス	48.1	46.3	305,580	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
雪印メグミルク	17.4	18.6	32,159	
プリマハム	8.4	9.9	20,205	
日本ハム	27.7	29.3	108,410	
丸大食品	7.8	8.6	12,255	
S Foods	6.3	8.4	24,469	
柿安本店	2.9	3.2	6,947	
伊藤ハム米久ホールディングス	41.4	53.4	36,525	
サッポロホールディングス	25	24.8	89,032	
アサヒグループホールディングス	171.8	173.1	761,293	
キリンホールディングス	268.3	338.2	732,203	
宝ホールディングス	50.2	51	54,468	
オエノンホールディングス	24.5	25.6	7,219	
養命酒製造	3.7	—	—	
コカ・コーラ ボトラーズ ジャパンホールディングス	50.9	58.9	85,994	
サントリー食品インターナショナル	48.8	52.5	244,912	
ダイドーグループホールディングス	3.7	4.2	20,370	
伊藤園	22.2	27.9	147,033	
キーコーヒー	6.9	8.5	17,595	
日清オイリオグループ	8.4	10.4	34,684	
不二製油グループ本社	15.8	17.7	37,400	
かどや製油	1.4	2.9	10,150	
J-オイルミルズ	7.4	7.8	11,809	
キッコーマン	52.6	49.5	382,140	
味の素	161.3	183.4	795,039	
ブルドックソース	3.9	3.5	6,020	
キュービー	38.3	40.2	98,369	
ハウス食品グループ本社	27.2	22.9	62,150	
カゴメ	27.6	35	106,750	
焼津水産化学工業	7.7	11.7	9,734	
アリアケジャパン	6.7	6.6	30,393	
ニチレイ	34.9	34.6	96,222	
東洋水産	35	37.8	218,106	
イトアンドホールディングス	3.6	3.9	8,704	
日清食品ホールディングス	28.6	26.6	278,768	
永谷園ホールディングス	4.1	4.1	8,212	
一正蒲鉾	6.6	—	—	
フジッコ	7.5	7.8	14,781	
ロック・フィールド	7.9	9.6	14,169	
日本たばこ産業	391.8	492.9	1,387,759	
ケンコーマヨネーズ	5.2	5.5	9,080	
わらべや日洋ホールディングス	5.3	6.1	11,272	
なとり	5.2	5.2	10,712	
ピックルスコオペレーション	4.1	—	—	
ファーマフーズ	7	11.8	15,163	

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
ユーグレナ	38.5	49.3	44,419	
紀文食品	5	6.9	6,506	
ピクルスホールディングス	—	1.5	1,624	
ミヨシ油脂	5.1	3.8	3,746	
理研ビタミン	8.1	6.8	12,076	
<b>繊維製品 (0.4%)</b>				
片倉工業	—	8.2	16,195	
グンゼ	5.1	5.8	23,084	
東洋紡	29.2	34.3	35,500	
ユニチカ	23.1	27.8	7,450	
富士紡ホールディングス	3.5	3.2	10,832	
倉敷紡績	6.7	6.1	13,291	
シキボウ	8.2	7.9	6,936	
日本毛織	23.3	22.2	22,377	
帝国繊維	9.1	9	14,967	
帝人	68	73.5	97,608	
東レ	519.2	511.5	377,793	
住江織物	3.3	—	—	
アツギ	10.2	3	1,140	
ダイニック	7.4	6.3	3,899	
セーレン	15.5	14.7	38,558	
小松マテーレ	13	12.3	9,827	
ワコールホールディングス	18.4	14.9	34,702	
ホギメディカル	10.2	10.3	35,947	
T S Iホールディングス	27.3	29.1	13,997	
マツオカコーポレーション	3.5	—	—	
ワールド	11	10.4	13,676	
三陽商会	—	4	5,288	
オンワードホールディングス	47.4	52.1	17,193	
ルックホールディングス	—	3.4	8,489	
ゴールドウイン	13	13.4	126,228	
デサント	14.2	13.1	43,885	
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>				
特種東海製紙	4.7	4.3	12,181	
王子ホールディングス	297.1	316.8	167,270	
日本製紙	35.2	40.3	38,889	
北越コーポレーション	47.8	48.3	37,529	
大王製紙	35.2	34.2	36,388	
レンゴー	68.6	70.5	61,053	
トーモク	5.6	5.4	8,640	
ザ・バック	5.9	6	15,126	
<b>化学 (6.1%)</b>				
北の達人コーポレーション	26.6	34.5	10,419	
クラレ	103.4	121	132,616	
旭化成	473	475.3	484,330	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
昭和電工	61.9	73.7	161,255	
住友化学	520.7	562.9	280,324	
住友精化	3.6	3.3	13,992	
日産化学	38.8	36.1	243,314	
ラサ工業	2.8	3.4	7,197	
クレハ	5.6	6.5	63,245	
多木化学	2.9	3	15,750	
テイカ	6.2	5.4	6,885	
石原産業	12.2	14.3	16,030	
日本曹達	9	8.2	35,096	
東ソー	102.6	101.2	164,247	
トクヤマ	23	25	47,825	
セントラル硝子	12	12.3	42,988	
東亜合成	40.9	38.8	45,667	
大阪ソーダ	6.4	4.6	18,998	
関東電化工業	16.2	15.3	15,697	
デンカ	25.9	27.7	91,687	
信越化学工業	122.6	130.3	2,289,371	
日本カーバイド工業	—	4.4	5,750	
堺化学工業	5.2	6.2	11,649	
第一稀元素化学工業	8.4	7.6	9,142	
エア・ウォーター	67.3	71.8	115,957	
日本酸素ホールディングス	68.5	73.3	166,610	
日本化学工業	2.6	3.2	5,945	
日本パーカライジング	36.4	36.6	36,270	
高压ガス工業	13.1	12	7,776	
四国化成工業	9.4	9.2	12,429	
ステラ ケミファ	4	4.8	12,561	
保土谷化学工業	2.4	2.5	7,762	
日本触媒	12.1	11.6	63,916	
大日精化学工業	5.7	5.7	9,786	
カネカ	18.4	17.2	60,200	
三菱瓦斯化学	66.2	56.5	110,796	
三井化学	64.5	63.7	197,470	
J S R	66.5	71.2	204,557	
東京応化工業	12.3	13.3	90,972	
大阪有機化学工業	6	5.9	12,466	
三菱ケミカルグループ	476.7	515.3	375,756	
K Hネオケム	11.8	12.7	35,140	
ダイセル	103.3	112.2	111,975	
住友ベークライト	11.3	11.2	48,384	
積水化学工業	148.6	157.2	302,924	
日本ゼオン	64.7	45.7	60,552	
アイカ工業	20	19.2	62,112	
U B E	33.2	39.3	78,560	

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
積水樹脂	10.8	10.7	19,356	
タキロンシーアイ	16.5	16.8	8,534	
旭有機材	4.9	5.2	13,800	
ニチバン	5.7	5.3	9,296	
リケンテクノス	19.3	17.4	8,682	
大倉工業	4.2	4	8,056	
群栄化学工業	2.5	2.2	5,332	
ミライアル	2.9	3.6	6,177	
ダイキョーニシカワ	16.3	17.4	10,266	
森六ホールディングス	5	4.4	7,730	
恵和	1.9	2.5	9,312	
日本化薬	56.8	58.1	72,508	
カーリットホールディングス	8.8	8.5	6,111	
日本精化	6	4.3	9,623	
扶桑化学工業	6.4	6.9	24,322	
トリケミカル研究所	7.3	10.3	24,833	
ADEKA	32.8	26.2	59,002	
日油	24.3	23.5	135,830	
新日本理化	20.1	19.1	4,870	
ハリマ化成グループ	7.3	6.6	5,550	
花王	161.3	185.7	1,014,107	
第一工業製薬	3.1	3.4	6,830	
石原ケミカル	4.5	4.1	5,059	
ニイタカ	2.4	2.1	4,399	
三洋化成工業	4.1	4.5	19,822	
大日本塗料	11	11.8	9,050	
日本ペイントホールディングス	268.5	336.9	377,328	
関西ペイント	74.1	70	131,390	
中国塗料	17.7	14.9	15,391	
日本特殊塗料	7	6.2	5,406	
藤倉化成	11.7	4	1,636	
太陽ホールディングス	10.4	11.5	29,198	
DIC	30.1	29.7	74,428	
サカタインクス	14.4	17	18,785	
東洋インキSCホールディングス	13.8	14.3	26,884	
T&K TOKA	8.4	7.4	7,414	
富士フイルムホールディングス	128.1	146.3	1,070,184	
資生堂	135.8	159.4	924,360	
ライオン	88	92.1	134,926	
高砂香料工業	5	5.2	14,788	
マンダム	15.7	17	24,446	
ミルボン	9.1	11.4	64,980	
ファンケル	29.5	33.4	85,704	
コーセー	13.7	15.5	224,595	
コタ	6	6.3	10,602	

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	31.4	39.3	70,189	
ノエビアホールディングス	6.1	6.8	39,644	
新日本製薬	3.6	4.8	6,590	
エステー	5.6	6.6	10,150	
コニシ	11.9	12.6	21,709	
長谷川香料	12.4	15.7	48,277	
小林製薬	20.4	23.3	198,050	
荒川化学工業	7.2	7.5	7,462	
メック	5.5	6.3	16,197	
日本高純度化学	—	2.4	6,009	
タカラバイオ	19	20.5	36,920	
JCU	8	8.6	28,982	
新田セラチン	—	5.9	6,348	
OATアグリオ	—	3.5	6,216	
デクセリアルズ	18.9	22.1	71,383	
アース製薬	6	6.9	36,708	
北興化学工業	7.8	9.7	8,817	
大成ラミック	3.3	3.9	11,992	
クミアイ化学工業	27.5	30.7	28,336	
日本農薬	16.1	14.5	10,860	
アキレス	6.2	6	8,106	
有沢製作所	11.7	13	16,692	
日東電工	44	55.2	475,272	
レック	11	11.8	9,593	
三光合成	—	12.5	5,737	
きもと	—	19.4	4,617	
藤森工業	6.4	5.9	18,850	
前澤化成工業	6.8	6.2	8,587	
未来工業	3.8	3.2	4,761	
JSP	5.2	5.6	8,327	
エフピコ	13.6	14.6	55,261	
天馬	6	6.4	13,331	
信越ポリマー	13.4	13.8	17,208	
東リ	27.3	9.1	1,920	
ニフコ	24.4	27.4	98,366	
バルカー	6	6.5	17,745	
ユニ・チャーム	140.5	159	808,197	
<b>医薬品（5.8%）</b>				
協和キリン	85.3	91.8	291,465	
武田薬品工業	572.5	675	2,733,750	
アステラス製薬	631.5	730.9	1,555,355	
住友ファーマ	45.3	56.9	60,712	
塩野義製薬	91.5	97.6	678,320	
日本新薬	19.1	18	145,620	
中外製薬	227.8	238.5	864,324	

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
科研製薬	11.5	13.3	52,402	
エーザイ	87.1	92.9	866,942	
ロート製薬	37.5	37	166,130	
小野薬品工業	167	147.3	517,906	
久光製薬	19.2	17.2	66,564	
持田製薬	9.4	8.9	30,082	
参天製薬	135.8	144	160,416	
扶桑薬品工業	3.4	3.2	6,550	
日本ケミファ	2.5	—	—	
ツムラ	22.6	24.1	72,275	
日医工	23.3	—	—	
キッセイ薬品工業	13.2	11.8	29,901	
生化学工業	13	13.5	12,730	
栄研化学	12.7	11.9	22,645	
鳥居薬品	4.1	4	11,608	
JCRファーマ	20.7	26.2	50,094	
東和薬品	10.2	11.9	25,132	
富士製薬工業	6.3	6.6	6,725	
ゼリア新薬工業	13.1	10.5	23,373	
第一三共	572.5	664.4	3,001,759	
キョーリン製薬ホールディングス	14.5	16.6	29,382	
大幸薬品	12.9	15.9	8,315	
ダイト	4.8	5.4	14,007	
大塚ホールディングス	151.3	174.4	817,936	
大正製薬ホールディングス	17.2	17.5	98,000	
ペプチドリーム	38.4	37.4	64,028	
あすか製薬ホールディングス	9.2	8.4	10,743	
サワイグループホールディングス	16	17.4	73,776	
<b>石油・石炭製品（0.5%）</b>				
日本コークス工業	69.2	81.6	7,180	
ニチレキ	10.4	9.4	12,173	
ユシロ化学工業	7	10.5	8,694	
富士石油	—	20	5,500	
MORESCO	5.4	—	—	
出光興産	80.6	84.4	273,456	
ENEOSホールディングス	1,096.1	1,378.6	642,427	
コスモエネルギーホールディングス	21.2	29	112,520	
<b>ゴム製品（0.7%）</b>				
横浜ゴム	41.8	43.3	97,641	
TOYO TIRE	38.6	44.1	69,104	
ブリヂストン	209.8	243.5	1,258,164	
住友ゴム工業	65.4	75.2	89,337	
藤倉コンポジット	7.4	6.6	5,590	
オカモト	4.4	4.5	17,325	
ニッタ	7.6	7.6	22,268	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
住友理工	15.8	15.6	9,609	
三ツ星ベルト	8.9	11.3	38,759	
バンドー化学	13	12.7	12,687	
<b>ガラス・土石製品（0.7%）</b>				
日東紡績	11	9.4	20,529	
AGC	66.8	77.4	356,040	
日本板硝子	19.6	—	—	
日本電気硝子	29.5	31.5	79,758	
オハラ	3.8	5	6,325	
住友大阪セメント	13.8	11.3	36,555	
太平洋セメント	41.6	49.1	106,399	
日本ヒューム	12.1	9.5	6,156	
日本コンクリート工業	22.9	22.5	5,265	
三谷セキサン	3.6	3.6	15,156	
アジアパイルホールディングス	16.5	15.1	8,093	
東海カーボン	61.2	64.8	67,845	
日本カーボン	3.8	4.6	19,941	
東洋炭素	4.8	4.9	19,257	
ノリタケカンパニーリミテド	4.1	4.2	16,968	
TOYO	52.1	50.2	238,199	
日本碍子	78.7	89.7	162,446	
日本特殊陶業	55.4	58.2	155,976	
MARUWA	2.6	3	56,460	
品川リフラクトリーズ	2	2.3	9,073	
黒崎播磨	1.6	1.8	9,054	
ヨータイ	5.4	5	6,880	
東京窯業	15.3	22.5	6,075	
フジインコーポレーテッド	6	6.5	45,630	
ニチアス	17.7	20	48,360	
ニチハ	10.2	9.9	27,947	
<b>鉄鋼（0.8%）</b>				
日本製鉄	322.2	351.2	770,006	
神戸製鋼所	133.7	173	107,260	
中山製鋼所	14.9	17.3	13,061	
合同製鐵	5.2	4.4	8,373	
JFEホールディングス	194	215	328,090	
東京製鐵	24.6	21.9	30,725	
共英製鋼	9.1	13	16,809	
大和工業	14	14.8	69,708	
東京鐵鋼	4.7	4.5	6,354	
大阪製鐵	—	5.6	6,356	
淀川製鋼所	9.6	8.4	21,361	
丸一鋼管	25.6	27.2	77,329	
モリ工業	2.6	2.8	7,876	
大同特殊鋼	11.9	12	52,980	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本冶金工業	5.5	5.9	25,399	
山陽特殊製鋼	7.6	7.6	16,818	
愛知製鋼	4.7	7	15,911	
日立金属	77.3	—	—	
大太平洋金属	4.9	8	16,400	
新日本電工	47.2	52.1	21,986	
栗本鐵工所	4.7	4.4	7,902	
三菱製鋼	5.7	6.1	6,069	
日本精線	1.5	2	8,730	
エンビプロ・ホールディングス	3.4	10	7,200	
新家工業	—	3.1	7,167	
<b>非鉄金属 (0.7%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	10.6	11.1	14,374	
日本軽金属ホールディングス	18.4	21.7	33,244	
三井金属鉱業	19.3	22.9	71,791	
東邦亜鉛	4.6	5.1	11,010	
三菱マテリアル	47.4	52.6	115,036	
住友金属鉱山	92.1	91.1	423,159	
DOWAホールディングス	19.5	17.9	80,908	
古河機械金属	11.8	11.1	14,330	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11	11.7	49,081	
東邦チタニウム	13.5	14.4	39,571	
UACJ	10.8	11.1	25,585	
CKサンエツ	2	2.2	9,295	
古河電気工業	22.6	26.3	68,301	
住友電気工業	269.8	270.6	433,095	
フジクラ	80.4	85.3	95,280	
昭和電線ホールディングス	6.4	8.9	15,975	
タツタ電線	14.9	16.1	6,939	
平河ヒューテック	5.4	5	5,490	
リョービ	10.2	8.9	11,062	
アサヒホールディングス	28.7	31.7	64,794	
<b>金属製品 (0.6%)</b>				
稲葉製作所	—	8.9	12,344	
宮地エンジニアリンググループ	3.2	2.5	8,512	
トーカロ	18.4	21.4	26,578	
アルファ	4.9	7.4	7,081	
SUMCO	110.9	149.4	302,236	
川田テクノロジーズ	2.1	2.2	7,414	
RS Technologies	2.4	2.6	21,320	
信和	—	11.2	8,836	
東洋製罐グループホールディングス	46.3	52	82,888	
ホッカンホールディングス	5.4	5.8	7,673	
横河ブリッジホールディングス	12.4	10.3	19,909	
駒井ハルテック	3.1	—	—	

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	68.4	72	92,880	
文化シャッター	23	22.6	25,402	
三協立山	12	12.5	7,062	
アルインコ	8	7.5	7,500	
LIXIL	113.4	114.2	240,847	
ノーリツ	13.9	11.7	17,362	
長府製作所	7.3	7.9	15,578	
リンナイ	13.6	14.2	144,556	
日東精工	13	12.5	6,537	
岡部	18	14.2	10,209	
ジーテクト	9.2	8.6	13,192	
東プレ	13.7	13.9	17,500	
高周波熱錬	16.3	14.5	9,860	
東京製綱	7	5.8	5,167	
サンコール	—	8.4	5,342	
モリテックスチール	—	8.8	2,156	
パイオラックス	11	11.1	19,314	
エイチワン	9.9	—	—	
日本発条	66.8	69.5	63,592	
立川プラインド工業	5	—	—	
三益半導体工業	5.6	7	17,906	
<b>機械 (5.2%)</b>				
日本製鋼所	22.2	21.4	62,488	
三浦工業	31.3	32.2	104,972	
タクマ	24.1	24	30,624	
ツガミ	17.4	17.4	20,601	
オークマ	8.5	7.7	40,117	
芝浦機械	8.3	8.7	23,855	
アマダ	113.4	121.6	133,516	
アイダエンジニアリング	19	16.3	13,610	
FUJ I	33	33.3	69,064	
牧野フライス製作所	7.8	8.5	39,227	
オーエスジー	34	36.9	71,438	
旭ダイヤモンド工業	19.4	23.1	16,632	
DMG森精機	42.9	46.8	85,690	
ソディック	16.8	21	16,023	
ディスコ	10.6	12.3	499,380	
日東工器	4.8	4.4	6,714	
日進工具	6.3	6.7	7,550	
パンチ工業	—	3.3	1,389	
豊和工業	—	6.5	5,726	
石川製作所	—	3.5	5,078	
島精機製作所	10.8	12.3	25,731	
オプトラン	9.3	11.6	29,545	
NCホールディングス	3	2.5	5,240	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
イワキ	—	5.7	7,449	
フリー	7.2	8.9	10,279	
ヤマシンフィルタ	15.4	20.4	9,832	
日阪製作所	11.3	9.1	7,443	
やまびこ	13.9	13.1	14,855	
野村マイクロ・サイエンス	2	2.6	12,233	
平田機工	3.5	3.8	20,786	
ペガサスミシン製造	—	9.6	9,283	
マルマエ	3.3	4.2	7,984	
タツモ	4.2	5	8,830	
ナブテスコ	41.1	48.4	165,044	
三井海洋開発	8.2	9.9	15,137	
レオン自動機	8.6	8.7	10,179	
S M C	21.3	24.9	1,537,824	
ホソカワミクロン	5.1	6.1	17,958	
ユニオンツール	2.8	3.3	11,583	
オイレス工業	10	10.9	16,284	
日精エー・エス・ビー機械	2.7	3.6	15,156	
サトーホールディングス	9.7	11.1	21,689	
技研製作所	6.4	8.2	26,937	
日本エアーテック	4.7	5.3	6,211	
日精樹脂工業	6.5	7.2	6,890	
オカダアイヨン	—	1.4	2,165	
ワイエイシイホールディングス	—	4.1	6,010	
小松製作所	330.5	360	1,144,440	
住友重機械工業	41.6	45.3	131,913	
日立建機	29.2	30.6	98,226	
日工	13.6	13.7	8,494	
巴工業	3.5	4	9,672	
井関農機	7.7	8.5	10,854	
T O W A	6.5	8.1	15,948	
北川鉄工所	4.8	—	—	
ローツェ	3.6	4	33,560	
クボタ	355.8	406.5	825,195	
荏原実業	3.6	4	9,068	
三菱化工機	3	3.1	6,559	
月島機械	13.8	11.6	11,379	
帝国電機製作所	6.1	6.1	14,438	
新東工業	18.5	17.1	11,457	
澁谷工業	6.4	7.2	17,841	
アイチ コーポレーション	11.8	11.5	9,200	
小森コーポレーション	20.4	19.2	15,628	
鶴見製作所	6.3	6.1	12,175	
酒井重工業	—	1.8	6,345	
荏原製作所	30.3	31.4	165,164	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
西島製作所	10	7.7	11,935	
北越工業	9.1	8.8	10,146	
ダイキン工業	92.9	91.7	2,054,538	
オルガノ	2	10.5	29,589	
トーヨーカネツ	3.4	3.7	9,201	
栗田工業	39.4	42.9	261,690	
椿本チエイン	9.5	10.6	33,337	
大同工業	5.3	7.9	6,083	
木村化工機	7.5	8.6	6,020	
アネスト岩田	12.8	13.9	13,121	
ダイフク	40	39.6	278,784	
サムコ	2.3	2.7	10,435	
タダノ	39	41.4	40,572	
フジテック	27.3	28.2	84,882	
C K D	21.4	21.3	43,515	
キトー	7.2	—	—	
平和	20.4	25.8	63,081	
理想科学工業	6.4	7	16,646	
S A N K Y O	16.1	15.3	82,008	
日本金銭機械	9.1	10.5	10,647	
マースグループホールディングス	6.2	5.5	11,275	
フクシマガリレイ	5.1	5.7	24,795	
ダイコク電機	5	5.4	8,672	
竹内製作所	11	14	44,450	
アマノ	19.3	22	54,450	
J U K I	11.8	13.8	9,259	
ジャノメ	8.1	9.8	6,076	
マックス	9.9	9.4	19,354	
グローリー	19.2	20.4	47,001	
新晃工業	7	8.3	12,848	
大和冷機工業	10.5	11.6	14,210	
セガサミーホールディングス	72.5	62	113,026	
日本ピストンリング	4.4	1.2	1,449	
リケン	3.7	3.8	8,652	
T P R	10	9.8	12,073	
ツバキ・ナカシマ	16.5	18	18,630	
ホンザキ	21.3	49.5	229,432	
大豊工業	8.2	8	5,592	
日本精工	136.1	141.2	107,312	
N T N	157.9	155.1	44,979	
ジェイテクト	69.6	68	68,680	
不二越	6.1	5.7	22,059	
日本トムソン	22.1	20.4	12,423	
T H K	42.5	44.4	118,503	
ユースン精機	8.7	—	—	

# 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
前澤給装工業	7.3	6.8	6,344	
イーグル工業	10	9.2	10,202	
日本ピラー工業	7.4	7.3	20,184	
キッツ	25.3	29	24,476	
マキタ	88.9	95.9	300,167	
日立造船	61.6	63.5	56,896	
三菱重工業	114.6	134.5	733,966	
IHI	45.6	48.5	182,360	
スター精密	11.6	14.6	25,623	
<b>電気機器（17.4%）</b>				
日清紡ホールディングス	44.9	63.3	64,186	
イビデン	38.2	44	242,440	
コニカミノルタ	160.3	173.4	98,664	
ブラザー工業	88.8	102.2	226,270	
ミネベアミツミ	125.2	133	298,319	
日立製作所	350.5	385.5	2,813,764	
東芝	127.3	147.9	693,651	
三菱電機	729	793.7	1,093,321	
富士電機	43.9	46.6	261,892	
安川電機	78.3	90.9	404,050	
シンフォニアテクノロジー	9.5	9.2	13,864	
明電舎	12.6	12	23,844	
オリジン	4.3	3.7	4,869	
山洋電気	3.3	3.5	21,700	
デンヨー	7	6.6	9,900	
PHCホールディングス	8	10.9	17,385	
ソシオネクスト	—	7.5	50,025	
東芝テック	7.9	11.4	42,123	
芝浦メカトロニクス	1.4	1.5	16,470	
マブチモーター	17.1	19	78,470	
日本電産	188.9	186.6	1,592,444	
トレックス・セミコンダクター	4.2	3.9	11,411	
東光高岳	5.2	5.2	9,604	
ダブル・スコープ	—	19.5	36,426	
ダイヘン	8	7.1	28,968	
ヤーマン	12.4	15.7	20,504	
JVCケンウッド	65.9	75.6	27,972	
ミマキエンジニアリング	8.5	8.5	5,559	
IPEX	4.1	5.3	6,937	
日新電機	17.2	18.1	24,272	
大崎電気工業	18	21.4	11,406	
オムロン	60.7	70.4	495,897	
日東工業	9.8	10.5	24,475	
IDEC	9.4	11.5	37,547	
ジーエス・ユアサコーポレーション	24.4	25.6	55,321	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
メルコホールディングス	2.2	2.3	7,153	
日本電気	92.5	108.6	527,253	
富士通	65.6	76.5	1,412,572	
沖電気工業	31.1	36.6	26,644	
電気興業	4.4	4	8,400	
サンケン電気	6.9	7.2	47,736	
アイホン	4.7	5.1	9,776	
ルネサスエレクトロニクス	394.7	500.9	659,184	
セイコーエプソン	90.5	102.2	219,934	
ワコム	56.5	61.4	39,787	
アルバック	13.5	18.3	108,519	
アクセル	—	4	6,028	
EIZO	5.7	5.8	20,851	
日本信号	19.1	17.8	18,387	
京三製作所	18.7	19.4	8,031	
能美防災	9.9	10.4	16,536	
ホーチキ	6.5	6.4	9,248	
エレコム	16.8	18.5	26,862	
パナソニックホールディングス	777.6	907.3	1,155,900	
シャープ	83.3	92.8	90,294	
アンリツ	46.9	54.6	80,043	
富士通ゼネラル	19.9	21.9	70,846	
ソニーグループ	456.5	537.9	6,054,064	
TDK	105.5	121.6	593,408	
帝国通信工業	5	4.3	6,032	
タムラ製作所	29.1	34.1	27,825	
アルプスアルパイン	65.1	69.6	90,619	
日本電波工業	8.2	9.6	16,752	
鈴木	—	3	2,757	
メイコー	6	8.6	25,843	
日本トリム	2.1	2.4	5,908	
ローランドディー・ジー	4.8	4.5	13,882	
フォスター電機	9.8	9.1	8,745	
SMK	2.5	2.3	6,069	
ヨコオ	5.5	6.4	15,449	
ホシデン	17.4	18.7	30,406	
ヒロセ電機	11.2	12.7	231,140	
日本航空電子工業	17	15.7	36,847	
TOA	9.8	10.3	7,889	
マクセル	15	17.4	24,534	
古野電気	9.6	10.7	10,914	
ユニデンホールディングス	2.1	—	—	
スミダコーポレーション	7.9	8	11,696	
アイコム	3.4	3.2	8,912	
リオン	3.6	3.6	7,380	

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
横河電機	73.1	84	215,544	
新電元工業	3.1	3.2	10,672	
アズビル	42.7	53.1	221,692	
東亜ディーケーケー	5.4	7.6	6,452	
日本光電工業	29.9	35.3	112,783	
チノー	—	4.2	7,728	
共和電業	16.2	—	—	
日本電子材料	4	6.4	9,868	
堀場製作所	13.4	17	106,080	
アドバンテスト	54.1	59.8	545,974	
エスベック	6.2	6.6	13,582	
キーエンス	66	76.1	4,348,354	
日置電機	3.5	4	27,280	
シスメックス	61.6	65.5	544,829	
日本マイクロニクス	13.1	12.9	18,821	
メガチップス	6.9	6.5	17,192	
OBARA GROUP	3.7	4.4	15,334	
コーセル	10.6	11.5	9,786	
イリソ電子工業	6.3	7.1	33,796	
オブテックスグループ	12.7	14.3	30,687	
千代田インテグレ	4	4.3	10,350	
レーザータック	32	37.5	942,562	
スタンレー電気	50.9	54	150,822	
岩崎電気	3.6	3.1	7,892	
ウシオ電機	37.6	40	71,280	
ヘリオス テクノ ホールディング	—	11.5	5,129	
エノモト	—	2.5	4,855	
日本セラミック	6.9	8	21,176	
遠藤照明	4.8	—	—	
古河電池	5.6	6.2	6,962	
双信電機	—	2.8	1,190	
山一電機	6.1	7.1	13,099	
図研	4.8	6.7	22,043	
日本電子	15.2	19	86,640	
カシオ計算機	53	57.1	76,514	
ファナック	64	74.6	1,519,229	
日本シイエムケイ	18.2	18.6	10,750	
エンプラス	2.2	2.4	10,728	
大真空	11.6	10.2	8,557	
ローム	32.6	35.1	380,835	
浜松ホトニクス	52.2	60.8	435,328	
三井ハイテック	7.2	7.9	62,884	
新光電気工業	21.3	26.8	101,974	
京セラ	102.6	118.1	824,456	
太陽誘電	35.3	37	161,505	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
村田製作所	214	230.5	1,720,452	
双葉電子工業	14.5	17.6	10,419	
北陸電気工業	6.1	1.6	2,064	
ニチコン	23.1	15.9	22,482	
日本ケミコン	7.3	8.1	14,912	
KOA	11.2	11.8	25,948	
市光工業	10.7	12.9	5,495	
小糸製作所	39.9	91.1	197,231	
ミツバ	15.6	16.5	8,794	
SCREENホールディングス	12.7	13	117,390	
キャノン電子	7.7	8.7	13,746	
キャノン	362	417.3	1,340,367	
リコー	202.3	190	206,340	
象印マホービン	19.7	22.7	36,297	
東京エレクトロン	46.2	53.6	2,416,824	
イノテック	5.5	6	7,812	
輸送用機器 (7.7%)				
トヨタ紡織	29.6	32	61,152	
ユニプレス	12.6	15	13,230	
豊田自動織機	58.9	55.3	431,893	
モリタホールディングス	12.4	14	17,724	
三櫻工業	11.1	12.5	8,362	
デンソー	160.5	156.7	1,177,443	
東海理化電機製作所	19.3	20.9	32,436	
川崎重工業	53.2	57.6	168,537	
日本車輛製造	3.6	3.7	7,270	
三菱ロジスネクスト	10.6	14	12,516	
日産自動車	859.2	1,081.7	531,331	
いすゞ自動車	228.5	220.6	395,756	
トヨタ自動車	3,691.1	4,175.6	8,395,043	
日野自動車	91.5	99	61,380	
三菱自動車工業	269.9	297.8	189,400	
武蔵精密工業	16.4	18.6	32,884	
日産車体	12.7	13.7	11,398	
新明和工業	20.3	24.7	25,021	
極東開発工業	13.4	13.7	18,673	
トビー工業	7.9	6.9	11,937	
ティアラド	2.5	2.5	6,620	
曙ブレーキ工業	44.8	53.4	8,811	
タチエス	13.3	13.1	14,357	
NOK	36	30	37,920	
フタバ産業	20.8	24	9,000	
KYB	7.5	7.4	26,825	
大同メタル工業	18.4	19.6	9,702	
プレス工業	39.7	35.7	16,100	

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
ミクニ	—	13.5	4,590	
太平洋工業	15.6	17.9	19,314	
アイシン	53.1	58.3	219,499	
マツダ	228.8	252	274,932	
本田技研工業	573.8	618	2,074,008	
スズキ	166.5	139.8	686,837	
S U B A R U	208.7	241.1	566,946	
安永	5	—	—	
ヤマハ発動機	95	119.2	407,068	
T B K	14.5	18.5	4,828	
エクセディ	10.9	12.7	21,183	
豊田合成	23.5	22.2	50,660	
愛三工業	13.4	13.8	9,687	
日本プラスト	—	15.9	6,789	
ヨロズ	8.9	9	7,245	
エフ・シー・シー	11.8	13.4	19,095	
シマノ	29.4	31.1	727,118	
テイ・エス テック	30.8	34.9	56,084	
ジャムコ	6.3	2.4	3,866	
<b>精密機器（2.7%）</b>				
テルモ	206.3	237.5	960,212	
日機装	21.7	19.5	19,519	
日本エム・ディ・エム	4.7	5	5,180	
島津製作所	93.5	92.3	385,814	
J M S	8.1	—	—	
長野計器	5.9	6.4	7,392	
ブイ・テクノロジー	3.4	4.1	11,041	
東京計器	6.8	7	8,239	
愛知時計電機	—	3.8	5,202	
インターアクション	3.9	5.1	8,073	
オーバル	—	8	4,016	
東京精密	12.2	16.6	72,044	
マニー	29.6	33.6	75,936	
ニコン	111.7	118.4	157,945	
トプコン	34.7	40.3	66,374	
オリンパス	382.7	475.4	1,333,972	
理研計器	5.7	4.8	24,000	
タムロン	5.7	5.7	19,750	
H O Y A	142.3	164.3	2,310,058	
ノーリツ鋼機	6.7	7.3	19,228	
A & D ホロンホールディングス	7.6	11.1	11,577	
朝日インテック	80.1	100.5	242,607	
シチズン時計	83.8	83.7	50,220	
リズム	3.4	3	5,292	
メニコン	24	26.2	76,111	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
松風	3.6	3.7	8,991	
セイコーグループ	10.1	11.8	37,347	
ニプロ	55.6	64.5	65,596	
<b>その他製品（2.4%）</b>				
スノーピーク	9.6	13.3	30,124	
パラマウントベッドホールディングス	14	17.3	46,381	
トランザクション	5.5	6.6	8,487	
ニホンフラッシュ	7.2	7.8	7,527	
前田工織	8	8.4	27,258	
永大産業	20.5	27.2	6,147	
アートネイチャー	9.3	8.9	6,915	
バンダイナムコホールディングス	65.3	69.4	627,723	
S H O E I	7.2	8	44,320	
フランスベッドホールディングス	12.4	10.6	9,879	
パイロットコーポレーション	12.7	11.9	58,905	
萩原工業	5.8	6.5	6,909	
フジシールインターナショナル	17.7	15.5	28,969	
タカラトミー	31	35.3	44,336	
広済堂ホールディングス	5.4	5.5	10,697	
プロネクス	7.6	7.5	7,245	
ウッドワン	—	5	4,660	
大建工業	4.6	5	10,690	
凸版印刷	110.4	98.9	210,854	
大日本印刷	86	89.8	255,121	
共同印刷	3.1	2.7	7,840	
N I S S H A	15.2	14.6	25,681	
TAKARA & COMPANY	4.8	5.8	12,116	
アシックス	64.7	70.3	207,736	
ローランド	5.2	5.7	23,142	
小松ウオール工業	—	3	5,520	
ヤマハ	43.3	47.8	258,598	
河合楽器製作所	2.4	2.2	5,673	
クリナップ	—	9.7	6,499	
ビジョン	44.3	49	100,156	
キングジム	8.4	7.9	7,062	
リンテック	15.8	15.2	34,169	
イトーキ	19.7	18.1	9,683	
任天堂	41.2	480.2	2,830,298	
三菱鉛筆	12.1	10.9	15,194	
タカラスタンダード	16.4	14.2	18,800	
コクヨ	35.1	36.5	65,955	
ナカバヤシ	11.4	3.3	1,653	
グローブライド	6.5	6.2	16,603	
オカムラ	26.7	22.5	31,837	
美津濃	7.4	7.6	21,804	

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
<b>電気・ガス業 (1.2%)</b>				
東京電力ホールディングス	545.7	686.3	342,463	
中部電力	221	278.9	359,223	
関西電力	275.5	292.3	340,821	
中国電力	113.7	121.9	87,158	
北陸電力	68.2	73.7	39,576	
東北電力	168	186.2	121,588	
四国電力	66.5	65.8	49,547	
九州電力	147.8	174.3	125,147	
北海道電力	64.2	75.2	34,140	
沖縄電力	15.5	19.1	20,131	
電源開発	62.1	57.5	121,785	
エフオン	6.4	6.8	3,726	
イーレックス	10.9	13.5	34,047	
レノバ	14.2	20.3	55,439	
東京瓦斯	139.3	160.6	405,675	
大阪瓦斯	131.1	153.6	325,939	
東邦瓦斯	33.4	30	80,730	
北海道瓦斯	5.5	5	8,460	
広島ガス	20.4	13.7	4,658	
西部ガスホールディングス	8.4	7.1	11,913	
静岡ガス	18.8	17	18,700	
メタウォーター	8.5	9.4	16,816	
<b>陸運業 (3.2%)</b>				
SBSホールディングス	5.2	6.6	19,569	
東武鉄道	70.3	83.1	275,061	
相鉄ホールディングス	23.7	25.4	55,626	
東急	182.9	212.2	371,137	
京浜急行電鉄	93.3	86.6	124,704	
小田急電鉄	107.7	115	207,230	
京王電鉄	37.7	40.2	205,824	
京成電鉄	50.7	48.9	191,443	
富士急行	8.8	9.4	46,248	
新京成電鉄	3.5	—	—	
東日本旅客鉄道	128.4	129.1	1,008,400	
西日本旅客鉄道	88.4	97.5	569,010	
東海旅客鉄道	60.7	58.7	976,181	
西武ホールディングス	95.6	92.4	127,512	
鴻池運輸	11.9	13.1	20,711	
西日本鉄道	20.5	20.2	56,681	
ハマキョウレックス	5.2	5.9	20,207	
サカイ引越センター	3.3	3.7	17,001	
近鉄グループホールディングス	68.4	75.7	370,930	
阪急阪神ホールディングス	85.7	100.7	432,003	
南海電気鉄道	31.5	36.4	109,564	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
京阪ホールディングス	30.8	31.4	108,644	
神戸電鉄	2.8	2.8	9,058	
名古屋鉄道	56.5	84	189,756	
山陽電気鉄道	6.7	6.3	14,080	
アルプス物流	—	6	6,960	
日本通運	23.8	—	—	
ヤマトホールディングス	96.6	97.2	222,879	
山九	19.1	19.3	95,438	
丸全昭和運輸	5.7	4.7	15,134	
センコーグループホールディングス	33.2	39.8	40,436	
トナミホールディングス	1.9	1.8	6,570	
ニッコンホールディングス	23.7	24.3	58,781	
福山通運	11.2	6.3	22,050	
セイノーホールディングス	46.6	47	56,588	
神奈川中央交通	2.5	2.5	8,412	
日立物流	13.6	16.7	148,463	
AZ-COM丸和ホールディングス	14.3	18.5	27,010	
C&Fロジホールディングス	7.8	7.8	9,562	
九州旅客鉄道	53.7	54.1	163,652	
SGホールディングス	130.4	145.4	309,702	
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	28.1	227,329	
<b>海運業 (0.6%)</b>				
日本郵船	57.5	202	613,474	
商船三井	38.1	133.3	448,554	
川崎汽船	21.3	64.7	168,090	
NSユナイテッド海運	4	4.2	15,876	
明治海運	9.3	9.3	6,705	
飯野海運	33	29	27,057	
乾汽船	5.3	10.6	19,366	
<b>空運業 (0.5%)</b>				
日本航空	158.6	185.8	507,791	
ANAホールディングス	175.6	207.3	610,394	
パスコ	—	3.2	4,259	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.1%)</b>				
トランコム	2	2.2	17,424	
日新	6.3	6.3	12,814	
三菱倉庫	22.1	16.2	54,108	
三井倉庫ホールディングス	7.5	7.1	25,098	
住友倉庫	23.7	20.4	40,840	
澁澤倉庫	4.6	3.5	7,273	
東陽倉庫	19.9	27.4	7,041	
日本トランスシティ	16.4	16	8,016	
川西倉庫	3.5	5.2	5,231	
安田倉庫	7.4	—	—	

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
東洋埠頭	5.9		0.9		1,154	
上組	37.3		37.4		104,682	
キューソー流通システム	—		6.6		6,817	
近鉄エクスプレス	12.7		—		—	
エーアイテイー	5.9		5.4		7,759	
内外トランスライン	3.2		3.2		7,052	
日本コンセプト	3		2.9		5,066	
<b>情報・通信業 (8.8%)</b>						
NECネットエスアイ	23.2		25.3		41,542	
クロスキャット	—		4.8		7,675	
システナ	101.2		126.9		53,298	
デジタルアーツ	3.9		4.9		31,605	
日鉄ソリューションズ	10.1		12.7		43,624	
キューブシステム	—		5.7		5,796	
コア	4		3.9		5,733	
手間いらず	1.1		1.3		6,695	
ラクーンホールディングス	6		8.5		10,710	
ソリトンシステムズ	5		5.1		5,941	
ソフトクリエイトホールディングス	3.3		3.4		11,968	
T I S	68.1		85.4		332,206	
グリー	44.1		41.9		32,179	
ユーエテクモホールディングス	22.8		47.8		113,525	
三菱総合研究所	3.1		3.7		19,055	
ファインデックス	8.7		8		4,416	
ブレインパッド	2		8.2		7,322	
K L a b	15.4		17.2		8,428	
ポルトウウィンホールディングス	11.6		13.7		12,836	
ネクソン	161.4		197.1		570,407	
アイスタイル	26		25.3		13,611	
エムアップホールディングス	2.3		9.6		12,998	
エイチーム	5.9		7		5,803	
エニグモ	8.9		11.2		6,686	
コロプラ	24.4		30		20,580	
ブロードリーフ	37.1		46.4		23,014	
クロス・マーケティンググループ	—		4.2		3,288	
デジタルハーツホールディングス	4.2		5.2		9,828	
システム情報	7		7.4		6,645	
メディアドゥ	2.7		3.5		6,685	
じげん	25.2		25.2		8,996	
ブイキューブ	7.8		10.2		8,109	
サイバーリンクス	—		3.1		3,506	
ディー・エル・イー	—		8.6		2,889	
フィックスターズ	10.6		9.6		13,209	
CARTA HOLDINGS	3.5		4.2		7,140	
オプティム	6		7.3		8,482	

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	株数	株数	株数	株数	評価額	評価額
セレス		3		—		—
S H I F T		3.6		5.6		161,672
ティーガイア		7		8.1		13,381
テクマトリックス		12.6		14.3		23,537
プロシップ		—		3.9		5,955
ガンホー・オンライン・エンターテイメント		19.8		23.8		49,504
GMOペイメントゲートウェイ		13.9		17.4		211,584
システムリサーチ		3.1		2.7		5,483
インターネットイニシアティブ		19.1		42.4		103,880
さくらインターネット		12.8		11.1		5,849
ヴィンクス		—		1		1,682
GMOグローバルサイン・ホールディングス		1.8		2.5		10,000
S R Aホールディングス		4.2		4.1		12,812
朝日ネット		—		9.4		5,367
e B A S E		10.2		12.1		7,502
アバントグループ		8.3		9.8		14,700
アドソル日進		3.7		4		6,032
フリービット		5.3		5.7		6,589
コムチュア		8		10.3		26,852
アステリア		7.9		7.5		6,090
アイル		4.4		4.4		8,760
マークラインズ		4.1		4.5		12,523
メディカル・データ・ビジョン		10		12.2		12,224
g u m i		11		13.3		9,802
テラスカイ		3.3		3.6		10,080
デジタル・インフォメーション・テクノロジー		4.3		4.5		8,932
P C Iホールディングス		5.9		—		—
ネオジャパン		—		0.9		900
P R T I M E S		1.7		2.2		5,451
ラクス		24.7		36.2		62,264
ダブルスタンダード		2.4		3.4		7,524
オープンドア		4.7		5.7		11,211
アカツキ		3.5		4.2		9,550
U b i c o mホールディングス		2.5		2.8		6,426
カナミックネットワーク		10.6		12.8		8,256
チェンジ		13.2		18.8		41,002
シンクロ・フード		—		6.4		3,046
オークネット		4.5		4.3		8,389
マクロミル		17.5		18		19,854
オロ		2.6		2.9		5,414
ユーザーローカル		3.4		3.2		5,088
マネーフォワード		10.9		17.2		84,022
電算システムホールディングス		3.3		4		9,088
プロトコーポレーション		8.6		10		12,600
野村総合研究所		138.1		156.3		468,274

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
サイバネットシステム	—	—	8.4	—	8,122	—
日本システム技術	—	—	3.9	—	6,762	—
インテージホールディングス	9.3	—	10.6	—	16,239	—
ソースネクスト	37.9	—	41.1	—	11,466	—
インフォコム	8.1	—	9.9	—	20,255	—
シンプレクス・ホールディングス	7.4	—	12.9	—	29,940	—
HEROZ	2.4	—	3.3	—	4,115	—
ラクスル	7.9	—	11	—	33,715	—
メルカリ	—	—	33.6	—	94,449	—
I P S	2.7	—	2.7	—	8,302	—
F I G	—	—	11.9	—	4,867	—
システムサポート	—	—	3.9	—	5,818	—
イーソル	6.5	—	3.1	—	2,824	—
アルテリア・ネットワークス	9.8	—	8.3	—	10,375	—
ウイングアーク1st	4.7	—	8.1	—	17,973	—
サーバーワークス	1.4	—	1.8	—	5,052	—
S a n s a n	25.6	—	29	—	48,430	—
ギフトイ	6.5	—	8.5	—	19,218	—
ベース	1.5	—	2.6	—	10,049	—
J M D C	—	—	12.6	—	64,512	—
フォーカスシステムズ	7.2	—	7	—	7,014	—
クレスコ	6.1	—	6.3	—	10,930	—
フジ・メディア・ホールディングス	69.2	—	73.6	—	79,267	—
オービック	22.5	—	25.4	—	551,180	—
ジャストシステム	10.2	—	11.2	—	36,960	—
T D Cソフト	7.4	—	6.7	—	9,842	—
Zホールディングス	1,040.9	—	1,087.2	—	406,069	—
トレンドマイクロ	38.3	—	44.1	—	300,321	—
日本オラクル	14.6	—	14.8	—	118,844	—
アルファシステムズ	2.1	—	2.4	—	10,176	—
フューチャー	7.4	—	18.9	—	31,581	—
C A C Holdings	5.3	—	4.9	—	7,506	—
S Bテクノロジー	3.6	—	3.6	—	7,416	—
オービックビジネスコンサルタント	6.8	—	15	—	70,125	—
伊藤忠テクノソリューションズ	32.5	—	40.8	—	136,680	—
アイティフォー	10.4	—	11.3	—	9,051	—
東計電算	—	—	1.4	—	8,274	—
大塚商会	38.6	—	43.3	—	197,881	—
サイボウズ	9.8	—	10.8	—	23,965	—
電通国際情報サービス	10.2	—	9.1	—	41,632	—
A C C E S S	10.5	—	10.3	—	7,704	—
デジタルガレージ	11.9	—	13.6	—	54,468	—
イーエムシステムズ	14.8	—	13.5	—	13,338	—
ウェザーニューズ	2.2	—	2.8	—	21,308	—
C I J	7.3	—	7.8	—	7,285	—

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	株数	株数	株数	株数	評価額	評価額
ビジネスエンジニアリング	—	—	—	2	—	4,438
WOWOW	—	—	4	5.8	—	7,261
スカラ	—	—	10.3	10	—	7,470
インテリジェント ウェイブ	—	—	—	5.3	—	4,271
I M A G I C A GROUP	—	—	7.3	7	—	5,285
ネットワンシステムズ	—	—	27.3	28.6	—	97,240
アルゴグラフィックス	—	—	5.7	7	—	26,600
マーベラス	—	—	14.3	13.6	—	9,234
エイベックス	—	—	13	13.5	—	20,641
B I P R O G Y	—	—	22.5	28.2	—	92,637
兼松エレクトロニクス	—	—	3.9	4.8	—	21,912
都築電気	—	—	4.4	4.6	—	6,136
T B Sホールディングス	—	—	43.7	39.1	—	61,308
日本テレビホールディングス	—	—	59.8	67.6	—	71,588
朝日放送グループホールディングス	—	—	10.9	2.6	—	1,617
テレビ朝日ホールディングス	—	—	17.6	18.8	—	25,774
スカパーJSATホールディングス	—	—	60.7	68.6	—	34,848
テレビ東京ホールディングス	—	—	5.8	6	—	11,046
ビジョン	—	—	12.7	10.5	—	14,458
USEN-NEXT HOLDINGS	—	—	7	7	—	16,457
コネクシオ	—	—	5.7	5.3	—	6,354
日本通信	—	—	—	75.2	—	16,694
日本電信電話	—	—	836.5	977.2	—	3,732,904
K D D I	—	—	521.6	589.4	—	2,423,023
ソフトバンク	—	—	1,083.9	1,225.3	—	1,834,886
光通信	—	—	8.4	9	—	172,530
エムティーアイ	—	—	10.4	9.1	—	4,604
GMOインターネットグループ	—	—	25.7	28.5	—	72,247
ファイバーゲート	—	—	3.4	5.3	—	4,982
K A D O K A W A	—	—	21	40.5	—	102,991
学研ホールディングス	—	—	11.1	13.8	—	14,158
ゼンリン	—	—	13.6	13.6	—	11,709
アイネット	—	—	5.8	5.8	—	7,569
松竹	—	—	4.9	4.5	—	53,550
東宝	—	—	42.2	47.6	—	251,804
東映	—	—	2.3	2.1	—	39,711
エヌ・ティ・ティ・データ	—	—	190	238.5	—	501,327
ピー・シー・エー	—	—	4.9	5.3	—	6,794
ビジネスブレイン太田昭和	—	—	3.3	4	—	7,804
D T S	—	—	13.1	16.3	—	53,708
スクウェア・エニックス・ホールディングス	—	—	33.3	38.4	—	237,696
シーイーシー	—	—	8.8	11.1	—	16,794
カプコン	—	—	67.4	75.7	—	316,047
アイ・エス・ピー	—	—	4.7	4.5	—	5,886
ジャステック	—	—	5.9	5.6	—	6,708

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
SCSK	49.6	61.9	136,303	
NSW	3.3	3.3	7,161	
アイネス	7.6	6	8,664	
TKC	11.9	13.2	49,302	
富士ソフト	7.6	8.5	69,190	
NSD	22.8	26.7	68,352	
コナミグループ	26.1	32.7	210,915	
福井コンピュータホールディングス	3.7	5.4	15,897	
JBCCHホールディングス	5.9	5.9	11,558	
ミロク情報サービス	7.6	7.6	11,407	
ソフトバンクグループ	429.1	441.1	2,625,427	
卸売業 (5.9%)				
高千穂交易	—	3.3	7,227	
伊藤忠食品	2	1.8	9,342	
エレマテック	7	7.4	11,366	
あらた	5.6	6.2	24,955	
トーメンデバイス	1.2	1.3	7,241	
東京エレクトロン デバイス	2.1	3	20,610	
円谷フィールズホールディングス	10	7.2	17,078	
双日	78.9	85.3	207,961	
アルフレッサ ホールディングス	79.7	81.1	135,112	
横浜冷凍	21.5	24.1	23,979	
ラサ商事	—	5.8	5,852	
アルコニクス	7.9	11.4	14,991	
神戸物産	55.7	62.2	222,365	
あい ホールディングス	10.6	12.8	28,416	
ダイワボウホールディングス	34.8	32.9	71,590	
マクニカホールディングス	16.9	19.5	67,177	
ラクト・ジャパン	2.8	3.6	7,635	
グリムス	3.3	3.5	6,352	
バイタルケエスケー・ホールディングス	14.7	13.4	11,068	
八洲電機	8.4	7.8	7,917	
メディアスホールディングス	—	6.8	5,202	
レスターホールディングス	6.6	7.6	16,864	
ジュテックホールディングス	3.1	4.7	5,419	
TOKAIホールディングス	33.6	39.5	34,602	
三洋貿易	8.9	8.9	10,137	
ビューティガレージ	1.5	1.8	5,427	
ウイン・パートナーズ	5.6	5.6	5,555	
シップヘルスケアホールディングス	22.9	29.1	80,694	
コメダホールディングス	16.3	20.3	48,963	
アセンテック	3.7	—	—	
フルサト・マルカホールディングス	7.1	8	31,760	
ヤマエグループホールディングス	6.2	5	7,165	
小野建	7.3	8.2	11,840	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
佐島電機	6.2	6.1	8,222	
伯東	4.8	4.7	17,554	
コンドーテック	7.6	7.3	7,329	
ナガイレーベン	9.8	10.5	21,073	
三菱食品	6.4	8.3	26,975	
松田産業	5.3	6.2	14,278	
第一興商	13.9	15.7	64,213	
メディバルホールディングス	77.1	83.6	152,988	
SPK	5.3	4.8	6,676	
萩原電気ホールディングス	3.5	3.7	9,312	
アズワン	5.1	11.8	72,098	
スズデン	—	3.8	8,713	
尾家産業	5	4.7	4,352	
シモジマ	6.3	6.2	5,958	
ドウシシャ	7.5	8.5	12,954	
高速	5.2	4.4	7,779	
リックス	—	2	4,412	
丸文	8.6	8.6	7,826	
ハピネット	6.9	7.2	13,975	
日本ライフライン	21.9	24.3	23,012	
タカショー	7.4	9.1	6,406	
IDOM	22.5	25.1	18,774	
進和	5	5.8	11,936	
ダイトロン	3.6	3.6	8,805	
シークス	11.1	11.7	16,368	
オーハシテクニカ	5.4	4.9	6,855	
白銅	2.8	3.2	7,977	
伊藤忠商事	501.7	495.4	2,123,779	
丸紅	706.9	633	979,884	
高島	—	1	2,970	
長瀬産業	39.2	37.2	75,106	
蝶理	4.8	4.4	8,742	
豊田通商	71.9	70	366,100	
三共生興	12.8	17.3	8,355	
兼松	25.5	30.7	46,909	
三井物産	557	588.6	2,344,393	
日本紙バルブ商事	3.9	4.3	21,629	
カメイ	8.8	8.9	10,688	
スターゼン	5.9	6.4	13,292	
山善	28.6	21.4	21,400	
椿本興業	1.8	1.5	5,992	
住友商事	452.5	497.6	1,118,107	
内田洋行	3.2	3.7	17,168	
三菱商事	537.7	502.5	2,314,012	
第一実業	3.3	3.1	13,144	

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
キャンノマーケティングジャパン	17.7	18.6	57,846	
西華産業	5.2	4.1	6,359	
佐藤商事	6.9	6.1	7,295	
菱洋エレクトロ	5.4	7.4	17,375	
東京産業	8.5	8.4	6,636	
ユアサ商事	6.6	7.1	25,489	
神鋼商事	2	2.2	9,944	
阪和興業	14.1	14.3	51,194	
正栄食品工業	4.6	5.5	23,512	
カナデン	7.7	7.3	8,051	
菱電商事	6.5	6.7	11,296	
岩谷産業	17.1	18.4	106,168	
ナイス	3	3.4	4,481	
極東貿易	2.7	6	7,950	
アステナホールディングス	12.1	17.8	7,422	
三愛オプリー	17.7	22.3	28,811	
稲畑産業	14.7	16.3	38,614	
G S I クレオス	5.4	5.6	8,164	
明和産業	7	11.6	8,131	
ワキタ	15.6	15.5	18,569	
東邦ホールディングス	23	20.8	44,304	
サンゲツ	20.2	20.5	43,070	
ミツロコグループホールディングス	10.9	11.8	12,484	
シナネンホールディングス	3	2.7	10,260	
伊藤忠エネクス	14.9	19.3	19,686	
サンリオ	22.6	23	104,075	
サンワテクノス	5.1	4.8	7,324	
リョーサン	8.1	8.8	25,009	
新光商事	12.7	12.1	13,612	
トーヨー	5.2	4.2	7,270	
三信電気	4.4	3.7	8,310	
東陽テクニカ	8.7	9.5	13,290	
モスフードサービス	9.4	12	38,160	
加賀電子	6.5	6.6	28,974	
ソーダニッカ	10.9	—	—	
立花エレテック	6.2	6	10,656	
P A L T A C	10.1	12.7	54,800	
三谷産業	—	19.1	5,978	
太平洋興発	7.7	9.5	7,106	
西本Wismettacホールディングス	2	2.2	8,140	
コーア商事ホールディングス	7.7	6.6	4,098	
K P P グループホールディングス	17.8	19.3	18,759	
ヤマタネ	4.7	5	8,480	
日鉄物産	4.9	5.2	26,520	
泉州電業	2.2	3.8	10,594	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
トラスコ中山	14.5	16.8	35,061	
オートボックスセブン	24.8	29	42,282	
モリト	9.5	7.8	5,912	
加藤産業	9.7	9.5	33,202	
イエローハット	12.2	14.1	24,308	
J K ホールディングス	6.8	6.8	7,085	
日伝	6	5	8,500	
杉本商事	4.2	3.8	7,835	
因幡電機産業	18.6	20.2	56,196	
東テック	3	2.8	9,170	
ミスミグループ本社	90	121.3	406,355	
タキヒヨー	3.8	6.6	5,940	
スズケン	28.2	25	92,375	
ジェコス	7.5	2	1,606	
小売業（4.5%）				
ローソン	15.9	20.2	99,485	
サンエー	5	6	26,160	
カワチ薬品	5.9	6.6	13,932	
エービーシー・マート	11.1	11.7	81,549	
ハードオフコーポレーション	—	4.2	5,980	
アスクル	11.9	19.7	31,145	
ゲオホールディングス	10.2	8.8	17,256	
アダストリア	7.9	10	20,070	
くら寿司	7.5	9.6	32,160	
キャンドゥ	3.9	4.5	9,688	
バルグループホールディングス	7	8.2	19,852	
エディオン	30.8	31.5	39,501	
サーラコーポレーション	16.5	17.9	13,425	
ハローズ	3.4	3.7	11,077	
フジオフードグループ本社	7.9	7.5	10,410	
あみやき亭	2.7	—	—	
ひらまつ	—	26.4	4,910	
大黒天物産	2.4	3	15,840	
ハニーズホールディングス	7.1	7.8	9,578	
アルペン	5.7	6.8	13,804	
クオールホールディングス	9.3	11.7	13,338	
ジーンズホールディングス	5	5	21,625	
ビックカメラ	41.5	53.5	67,677	
D C M ホールディングス	43.3	49.3	56,596	
M o n o t a R O	90.9	113.9	266,070	
アークランドサービスホールディングス	6.1	6.9	15,331	
J・フロント リテイリング	86.3	100.6	116,595	
ドトール・日レスホールディングス	12.2	14.3	24,181	
マツキヨココカラ&カンパニー	44	48.8	279,136	
ブロンコビリー	5.1	5	12,500	

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	価額
ZOZO	49.6	53.3	182,552	
トレジャー・ファクトリー	—	2.6	6,229	
物語コーポレーション	3.8	4.5	31,590	
三越伊勢丹ホールディングス	125.5	135.7	179,666	
Hamee	—	4.3	3,788	
ウエルシアホールディングス	37.9	41.8	126,236	
クリエイトSDホールディングス	10.2	13	39,845	
チムニー	4.8	7.5	8,452	
シュッピン	7.1	6.5	9,555	
オイシックス・ラ・大地	10.3	11	21,197	
ネクステージ	14.4	18.4	56,764	
ジョイフル本田	20.1	25.6	47,334	
鳥貴族ホールディングス	3.6	3.7	9,046	
ホットランド	7.6	7.4	11,299	
すかいらーくホールディングス	93.1	110.6	176,517	
SFPホールディングス	5.1	5	8,555	
綿半ホールディングス	7	6.8	9,227	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	19.4	27.8	30,607	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5	4.2	7,312	
B E E N O S	4	4.7	14,946	
あさひ	6.3	6.8	9,057	
日本調剤	5.2	6.1	7,307	
コスモス薬品	7.2	9.1	127,036	
セブン&アイ・ホールディングス	280.9	277.3	1,547,056	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	38.8	61.1	57,372	
ツルハホールディングス	15.6	19.8	175,626	
サンマルクホールディングス	7.7	7.3	12,337	
フェリシモ	—	5	5,135	
トリドールホールディングス	17.7	20.1	54,109	
TOKYO BASE	8.3	—	—	
JMホールディングス	5.6	7.2	12,664	
アレンザホールディングス	6.4	6.6	6,494	
串カツ田中ホールディングス	2.5	3.6	6,490	
パロックジャパンリミテッド	7.7	1.4	1,118	
クスリのアオキホールディングス	7.2	8.1	61,398	
力の源ホールディングス	—	6.2	5,635	
FOOD & LIFE COMPANIES	42	46.4	115,768	
メディカルシステムネットワーク	8.6	5.3	2,141	
ノジマ	11.5	26.2	36,549	
カッパ・クリエイト	11.3	13.5	18,603	
ライトオン	—	9.2	5,851	
良品計画	82.7	104.1	150,840	
アドヴァングループ	9.4	11	9,790	
アルビス	3.3	3.1	7,390	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価	価額
G-7ホールディングス	8.1	9.9	15,077	
イオン北海道	13.2	13.2	15,549	
コジマ	13.4	16.2	9,946	
コーナン商事	10.3	10.9	36,079	
エコス	3.3	3.7	6,782	
ワタミ	10.4	11	11,649	
バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	143.5	180.4	430,073	
西松屋チェーン	15.7	18.1	25,249	
ゼンショーホールディングス	35.4	43.9	152,113	
幸楽苑ホールディングス	6.8	6.8	7,004	
サイゼリヤ	10.9	13.7	38,538	
VTホールディングス	27.9	31.1	15,798	
フジ・コーポレーション	5.6	5.1	6,568	
ユナイテッドアローズ	7.8	9	16,965	
ハイデイ日高	10.3	12.1	23,691	
コロワイド	30.2	37.7	67,445	
壱番屋	5.2	6.3	28,696	
スギホールディングス	14.4	16.3	100,897	
薬王堂ホールディングス	3.9	4.6	11,868	
スクロール	11.9	12.8	9,100	
ヨンドシーホールディングス	7.6	7.6	13,163	
木曾路	10	12.9	27,631	
SRSホールディングス	14.6	16	13,552	
千趣会	17.9	17.1	6,993	
リテールパートナーズ	9.6	12	14,844	
ケーヨー	15.2	13.9	12,551	
上新電機	7.8	7.1	13,525	
日本瓦斯	34.9	43.3	91,059	
ロイヤルホールディングス	12.7	15.8	37,872	
いなげや	9.3	8.1	9,590	
チヨダ	12.1	10.2	7,782	
ライフコーポレーション	6.7	7.1	17,444	
リンガーハット	9.7	11.3	24,803	
MrMaxHD	11.6	12.2	8,076	
AOKIホールディングス	15.6	15.9	10,907	
オークワ	12.5	13.5	12,717	
コメリ	10.7	12.3	31,857	
青山商事	17.1	18.2	18,181	
しまむら	8.3	9.4	117,406	
高島屋	52.7	61.3	109,481	
松屋	15.4	14.4	14,040	
エイチ・ツー・オー リテイリング	33.2	39.5	48,190	
近鉄百貨店	3.4	4	9,860	
丸井グループ	61	59.3	138,406	

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
アクシアル リテイリング	5.5	5.4	18,333	
イオン	276.1	272.8	770,114	
イズミ	13.1	12.4	37,386	
平和堂	12.5	13.2	26,809	
フジ	8.7	12.5	23,350	
ヤオコー	8.2	9.1	60,970	
ゼビオホールディングス	10.6	11.3	10,644	
ケーズホールディングス	65.7	64.3	73,302	
Olympicグループ	—	8	4,192	
日産東京販売ホールディングス	21.5	—	—	
シルバーライフ	—	2.5	3,892	
Genky DrugStores	3.2	4.1	14,186	
ブックオフグループホールディングス	5.6	5.2	6,832	
ギフトホールディングス	1.6	1.9	7,505	
アインホールディングス	10.6	11.2	75,376	
元気寿司	2.8	3.3	10,494	
ヤマダホールディングス	263.4	331	157,887	
アークランズ	11.5	12.3	18,425	
ニトリホールディングス	28.6	32.6	507,419	
グルメ杵屋	10.8	8.7	8,673	
ケーユーホールディングス	—	3.3	4,290	
吉野家ホールディングス	25.6	32	74,272	
松屋フーズホールディングス	3.6	3.8	15,181	
サガミホールディングス	13.7	14.2	17,338	
関西フードマーケット	5.9	8.1	11,250	
王将フードサービス	4.7	5.1	30,906	
ブレナス	8.3	—	—	
ミニストップ	6.6	7	9,961	
アークス	13.1	14.2	29,805	
パローホールディングス	15.4	15.1	26,545	
ベルク	3.2	3.9	22,308	
大庄	—	7.8	8,275	
ファーストリテイリング	9.6	12.1	977,801	
サンドラッグ	27	30.6	111,996	
サックスパー ホールディングス	—	9.4	7,520	
やまや	—	3.5	8,666	
ベルーナ	16.7	19.7	13,573	
<b>銀行業 (5.6%)</b>				
いよぎんホールディングス	—	88.1	64,224	
しずおかフィナンシャルグループ	—	168	168,840	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	—	62.3	60,306	
めぶきフィナンシャルグループ	369.6	372	116,064	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9.7	9.7	23,153	
九州フィナンシャルグループ	141.4	126.7	50,299	
ゆうちょ銀行	168.2	212.4	223,232	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
富山第一銀行	16.8	21.1	11,984	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	406.8	410.5	195,808	
西日本フィナンシャルホールディングス	47	47.6	41,602	
三十三フィナンシャルグループ	8.7	7.4	11,100	
第四北越フィナンシャルグループ	11.7	11.1	29,059	
ひろぎんホールディングス	106.2	97.8	61,809	
おきなわフィナンシャルグループ	7	7.6	16,294	
十六フィナンシャルグループ	10.1	10	26,400	
北國フィナンシャルホールディングス	7.4	6.4	28,512	
ブロックレアホールディングス	—	9.7	20,942	
あいちフィナンシャルグループ	—	10.4	23,036	
新生銀行	46.7	22.7	53,095	
あおぞら銀行	39.4	46.7	121,186	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,609.1	4,906.5	3,704,898	
りそなホールディングス	822.5	953.5	630,168	
三井住友トラスト・ホールディングス	135.1	138.1	608,606	
三井住友フィナンシャルグループ	497.6	546.5	2,553,794	
千葉銀行	240.4	207.6	173,138	
群馬銀行	133.9	144.5	65,169	
武蔵野銀行	11.2	9.9	18,641	
千葉興業銀行	—	22	8,272	
筑波銀行	—	41.1	8,713	
七十七銀行	22.9	24.1	46,946	
青森銀行	5.6	—	—	
秋田銀行	4.3	5.9	9,935	
山形銀行	10.6	10	12,170	
岩手銀行	6	6	11,610	
東邦銀行	73.1	67.9	14,259	
東北銀行	4	—	—	
みちのく銀行	4.5	—	—	
ふくおかフィナンシャルグループ	59.8	59.6	160,383	
静岡銀行	173.8	—	—	
スルガ銀行	63.4	67.7	29,043	
八十二銀行	155.6	150.8	78,265	
山梨中央銀行	10.8	9.4	9,804	
大垣共立銀行	14.2	14.5	26,738	
福井銀行	8	8.1	11,858	
清水銀行	4.4	1.5	2,293	
富山銀行	2.4	3.4	5,936	
滋賀銀行	13.5	12.4	32,438	
南都銀行	11.6	11.5	26,852	
百五銀行	69.9	72.4	25,340	
京都銀行	25.5	23.5	133,950	
紀陽銀行	25.1	26.4	40,154	
ほくほくフィナンシャルグループ	44.6	48.6	45,149	

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
山陰合同銀行	43.9	47	35,485	
中国銀行	55.9	—	—	
伊予銀行	91.9	—	—	
百十四銀行	9.2	8.1	14,531	
四国銀行	13.4	14.4	13,233	
阿波銀行	11.3	11.1	22,666	
大分銀行	5.5	5.8	11,484	
宮崎銀行	5.4	5.8	13,444	
佐賀銀行	4.5	5.4	8,694	
琉球銀行	18.2	21	17,535	
セブン銀行	210.5	268.2	70,000	
みずほフィナンシャルグループ	919.4	1,081.3	1,856,592	
山口フィナンシャルグループ	83.1	83.2	67,891	
長野銀行	—	3.3	4,118	
名古屋銀行	5.8	5.1	16,396	
北洋銀行	109.8	117.9	28,885	
愛知銀行	2.9	—	—	
中京銀行	4.7	—	—	
愛媛銀行	13.1	12	10,572	
京葉銀行	33.5	38.4	20,928	
栃木銀行	46	38.2	12,262	
東和銀行	17.4	16.6	9,080	
トモニホールディングス	60.3	64.9	22,650	
フィデアホールディングス	8.5	9.5	12,929	
池田泉州ホールディングス	94.2	106.3	24,661	
証券・商品先物取引業 (0.7%)				
F P G	26.4	31.2	36,348	
ジャパンインベストメントアドバイザー	6.7	6.7	8,220	
S B I ホールディングス	88.2	107.9	282,482	
ジャフコ グループ	9.2	25.4	61,137	
大和証券グループ本社	538.1	529.9	322,179	
野村ホールディングス	1,098.6	1,374.4	688,162	
岡三証券グループ	56.7	66.1	25,580	
丸三証券	24.3	29.9	12,617	
東洋証券	—	29.1	8,235	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	79.2	81.2	28,988	
水戸証券	24.7	23.7	5,356	
いちよし証券	16.3	17	10,404	
松井証券	35.3	44.7	35,134	
マネックスグループ	58.6	84.3	36,249	
極東証券	9.7	12.9	7,946	
岩井コスモホールディングス	8.1	10	12,740	
アイザワ証券グループ	12.5	11.9	8,175	
スパークス・グループ	38.7	8.7	14,850	
保険業 (2.4%)				
かんぽ生命保険	72.5	91.2	208,574	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
S O M P Oホールディングス	126.8	128.3	777,369	
アニコム ホールディングス	22.2	29	21,025	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	161	168.4	690,440	
第一生命ホールディングス	353.9	381.2	969,582	
東京海上ホールディングス	236.7	753.5	2,130,144	
T & Dホールディングス	186.2	201.2	335,601	
アドバンスクリエイト	4	7.4	7,932	
その他金融業 (1.1%)				
全国保証	17.3	19.7	100,470	
ジェイリース	2.8	2.8	8,694	
イントラスト	5.1	—	—	
日本モーゲージサービス	4.1	7.6	6,536	
アルヒ	12.2	16.2	16,313	
プレミアグループ	4.2	12.9	24,832	
ネットプロテクションズホールディングス	—	26	12,376	
クレディセゾン	45.8	47.8	83,984	
芙蓉総合リース	7.4	6.8	59,772	
みずほリース	11.1	10.9	36,024	
東京センチュリー	13.7	13.8	65,136	
日本証券金融	29.4	31.4	32,216	
アイフル	121.5	126.3	51,530	
リコーリース	6.8	7.3	26,645	
イオンフィナンシャルサービス	38.5	42.6	62,579	
アコム	141.9	140.9	45,228	
ジャックス	8.2	8	31,240	
オリエントコーポレーション	196.9	19.8	23,700	
オリックス	436.7	499.8	1,104,807	
三菱H Cキャピタル	261	287.4	187,959	
日本取引所グループ	181.9	210.6	416,040	
イー・ギャランティ	11.2	12.5	30,737	
N E Cキャピタルソリューション	3.4	4	8,320	
不動産業 (2.1%)				
大東建託	23.4	27.5	421,300	
いちご	83.3	89	27,501	
日本駐車場開発	93.1	95.8	23,566	
スター・マイカ・ホールディングス	5.2	9	6,444	
S R Eホールディングス	1.9	3.9	17,842	
ヒューリック	170.8	175	201,775	
三栄建築設計	3.9	4.7	7,228	
野村不動産ホールディングス	38.1	46.8	155,376	
三重交通グループホールディングス	18.4	18.9	9,298	
サムティ	10.1	10.1	22,967	
ディア・ライフ	12.8	13.5	8,410	
地主	7	7.3	14,862	

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
プレサンスコーポレーション	10.8	11.4	18,114	
J P M C	5.6	5.8	6,066	
フージャースホールディングス	13.3	13.7	10,918	
オープンハウスグループ	22.8	27.4	158,372	
東急不動産ホールディングス	210.2	225.5	167,321	
飯田グループホールディングス	60.2	65.6	143,860	
And Doホールディングス	—	5.8	4,947	
シーアールイー	3.1	4.2	6,262	
ケイアイスター不動産	3.4	4.4	21,692	
グッドコムアセット	4.4	8.4	6,342	
ジェイ・エス・ビー	2.1	2.1	9,166	
ロードスターキャピタル	—	3.7	6,438	
パーク24	38.9	58.8	117,894	
バラカ	4.4	4.4	8,395	
宮越ホールディングス	4.3	0.8	707	
三井不動産	327.6	325.8	904,583	
三菱地所	471.9	475.7	922,858	
平和不動産	13	13	53,170	
東京建物	71	71.6	137,543	
ダイビル	18.9	—	—	
京阪神ビルディング	12.9	11	14,102	
住友不動産	150.8	135.8	504,632	
テオオーシー	16.2	16.8	12,213	
東京築天地	2.1	1.9	8,274	
スターツコーポレーション	10.4	11.4	31,327	
フジ住宅	11.6	13.7	8,987	
空港施設	13.2	12.6	6,791	
明和地所	—	9.3	5,868	
ゴールドクレスト	6.9	8.1	14,288	
エスリード	—	4.5	8,496	
日神グループホールディングス	15.4	17.1	7,353	
日本エスコン	16.1	19.5	16,341	
M I R A R T Hホールディングス	37.4	43	16,770	
A V A N T I A	7.8	—	—	
イオンモール	35.8	39.5	65,372	
カチタス	18.2	20.6	65,199	
トーセイ	11.5	13.5	18,927	
サンフロンティア不動産	11.7	13.5	15,822	
F Jネクストホールディングス	8.8	9.2	8,887	
グランディハウス	—	4.1	2,246	
日本空港ビルデング	27.5	26.7	166,074	
<b>サービス業 (5.4%)</b>				
日本工営	4.3	5.8	20,445	
L I F U L L	27.1	34.3	8,540	
M I X I	16	18	44,352	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ジェイエイシーリクルートメント	6.1	7.1	18,367	
日本M&Aセンターホールディングス	114.5	134.6	247,664	
メンバーズ	2.6	2.6	5,891	
U Tグループ	10.1	11.6	31,262	
アイティメディア	3.9	3.3	6,144	
E・Jホールディングス	4.8	5.7	7,438	
夢真ビーネックスグループ	18.8	28.6	54,969	
コシダカホールディングス	19.2	23.8	27,298	
パソナグループ	7.5	9.5	19,551	
リンクアンドモチベーション	16.6	23.2	16,495	
エス・エム・エス	23.9	30	108,300	
パーソルホールディングス	69.7	87.8	276,570	
リニカル	6.8	6.4	4,659	
クックパッド	29.6	36	7,632	
学情	—	4.1	6,141	
スタジオアリス	4	4.7	9,808	
シミックホールディングス	5.4	5.1	8,858	
総合警備保障	27.6	29.3	109,142	
カカコム	51.7	58.7	142,523	
アイロムグループ	3.2	3.1	6,875	
セントケア・ホールディング	—	5.8	4,953	
ルネサンス	6.7	7.1	6,397	
ディップ	12.3	13.8	56,511	
デジタルホールディングス	5.4	6.8	8,071	
新日本科学	9.2	8.5	23,485	
ベネフィット・ワン	25.3	36.6	79,056	
エムスリー	123	154.6	650,093	
アウトソーシング	40.4	47.2	47,577	
ウェルネット	15.2	9.6	6,163	
ワールドホールディングス	3.2	4	11,620	
ディー・エヌ・エー	27	33.8	62,530	
博報堂D Yホールディングス	96.8	100.5	133,765	
ぐるなび	14.7	15	6,285	
タカミヤ	14.9	14	5,390	
ジャパンベストレスキューシステム	5.7	5.9	5,144	
ファンコミュニケーションズ	23.3	18.4	8,114	
ライク	—	3.4	7,078	
エスプール	19.8	22.8	21,409	
W D Bホールディングス	3.5	4.2	9,983	
アドウェイズ	11.5	11.5	6,290	
バリュウコマース	5.5	6.3	13,173	
インフォマート	77.1	82.9	37,636	
J Pホールディングス	26.3	27.4	7,617	
プレステージ・インターナショナル	26.8	33.8	24,065	
アミューズ	4.7	4.9	8,780	

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
ドリームインキュベータ	—	2.8	7,912	
クイック	6.1	6.5	13,539	
電通グループ	71.9	82.2	361,680	
びあ	2.8	2.9	9,512	
イオンファンタジー	3.7	3.7	10,815	
シーティーエス	9.8	10.2	8,517	
H. U. グループホールディングス	18.6	23.4	64,935	
アルプス技研	6.8	7.1	14,846	
日本空調サービス	10	10.3	7,292	
オリエンタルランド	82.3	82.8	1,632,816	
ダスキン	16.5	17.7	52,268	
明光ネットワークジャパン	12.3	14.3	8,823	
ファルコホールディングス	4.5	4.5	8,131	
ラウンドワン	19.8	66.3	40,443	
リゾートトラスト	32.5	31.3	76,215	
ビー・エム・エル	9	9.7	33,562	
りらいあコミュニケーションズ	11.5	13	13,351	
リソー教育	33.8	39.9	12,887	
早稲田アカデミー	—	5.6	6,456	
ユー・エス・エス	78.2	80.7	185,287	
東京個別指導学院	8.5	12.1	6,400	
サイバーエージェント	172	187.7	230,683	
楽天グループ	358.3	345.7	225,742	
クリーク・アンド・リバー社	4.2	4.9	10,084	
モーニングスター	16.6	15.2	7,144	
テー・オー・ダブリュー	—	22	6,534	
山田コンサルティンググループ	5	4.9	5,605	
セントラルスポーツ	3.9	3.6	8,697	
フルキャストホールディングス	6.1	7.5	23,062	
エン・ジャパン	11.3	14.3	35,006	
テクノプロ・ホールディングス	41.9	52.7	199,733	
アイ・アールジャパンホールディングス	3.3	4.4	7,955	
KeepPer 技研	4.6	5.7	24,253	
Gunosy	—	6.2	4,147	
イー・ガーディアン	3.3	3.3	9,457	
ジャパンマテリアル	21.5	24	58,392	
ベクトル	10.5	13	16,653	
チャーム・ケア・コーポレーション	6	7.3	8,453	
キャリアリンク	3.4	3.3	9,949	
I B J	7.4	5.6	5,488	
アサンテ	5.2	5.2	8,325	
バリューHR	4	7.5	12,562	
M&Aキャピタルパートナーズ	5.7	7.4	35,927	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4	4.2	4,716	
ERIホールディングス	2.6	3.8	4,104	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
シグマクス・ホールディングス	4.5	12.3	16,408	
ウィルグループ	6.1	7	9,520	
メドピア	5.4	6.5	10,718	
リクルートホールディングス	537.4	578.7	2,505,192	
エラン	9.7	10.5	10,762	
日本郵政	910.1	1,025.7	1,105,704	
ベルシステム24ホールディングス	10.3	10.9	14,693	
鎌倉新書	9.2	9.7	8,148	
エアトリ	4.7	5.4	14,434	
アトラエ	5.6	6.6	9,748	
ストライク	2.9	3.9	17,413	
ソラスト	17.3	22.1	18,144	
セラク	2.8	3.3	4,088	
インソース	7	9.8	33,075	
ペイカレント・コンサルティング	4.9	58	258,970	
Orchestra Holdings	1.8	2	4,610	
アイモバイル	2.8	5	6,330	
グレイステクノロジー	11.9	—	—	
ジャパンエレベーターサービズホールディングス	21.9	27.7	48,253	
ウエルビー	5.6	6.9	5,940	
エル・ティー・エス	1.3	1.3	4,543	
ミダックホールディングス	3.1	4.8	16,176	
日総工産	7.7	—	—	
キュービーネットホールディングス	4.4	5.2	7,763	
R P Aホールディングス	12.1	13.6	3,903	
マネジメントソリューションズ	3.6	4.6	17,595	
フロンティア・マネジメント	—	3.4	4,777	
カーブスホールディングス	19.7	24.4	23,960	
フォーラムエンジニアリング	—	0.7	609	
FAST FITNESS JAPAN	—	3.2	4,272	
ダイレクトマーケティングミックス	4	9.3	13,903	
ポピンズ	2.1	—	—	
L I T A L I C O	5.9	6.2	14,495	
アドバンテッジリスクマネジメント	5.7	—	—	
リロググループ	38.6	44	99,572	
東祥	6	7	8,582	
ビーウィズ	—	3.3	3,917	
T R Eホールディングス	9.8	16.7	26,235	
人・夢・技術グループ	3.5	3.8	8,002	
エイチ・アイ・エス	15.6	20.8	41,912	
ラックランド	3.7	3.3	9,764	
共立メンテナンス	12.5	13.4	81,740	
イチネンホールディングス	8.2	8.9	11,142	
建設技術研究所	4.6	4.2	13,671	

## 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
スペース	—	7.2	6,408	
燦ホールディングス	4.4	4.1	7,466	
東京テアトル	6.1	9	10,269	
ナガワ	2.2	2	15,320	
東京都競馬	5.3	6.8	27,404	
カナモト	12.2	14.6	32,777	
西尾レントオール	6.5	7.3	22,557	
トランス・コスモス	9	9.7	31,379	
乃村工藝社	30.1	34.3	35,397	
藤田観光	—	4.1	12,218	
KNT-CTホールディングス	—	5.7	9,861	
日本管財	7.2	7.9	20,081	
トーカイ	6.1	7.2	13,456	
セコム	68.7	79.6	675,406	
セントラル警備保障	3.9	4.6	11,219	
丹青社	15.5	16.1	12,847	
メイテック	8.6	31.6	80,516	
応用地質	7.6	7.7	16,139	
船井総研ホールディングス	14.4	16.5	46,117	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
オオバ	8.1	—	—	—
学究社	—	4.9	8,751	
ベネッセホールディングス	23.8	29.9	59,530	
イオンディライト	8.5	8.6	25,155	
ダイセキ	12.8	16	75,200	
ステップ	—	3.6	6,462	
合計	株数・金額	千株	千株	千円
	銘柄数<比率>	78,890.9	88,126.6	218,143,627
		1,659銘柄	1,724銘柄	<97.9%>

※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。

### (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 4,557	百万円 —
T O P I X		

## ■ 投資信託財産の構成

(2022年11月30日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 218,143,627	% 97.5
コール・ローン等、その他	5,615,182	2.5
投資信託財産総額	223,758,810	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2022年11月30日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	223,548,520,349円
コール・ローン等	3,272,840,597
株 式(評価額)	218,143,627,430
未 収 入 金	414,739,700
未 収 配 当 金	1,741,212,622
差 入 委 託 証 拠 金	△ 23,900,000
(B) 負 債	729,179,742
未 払 金	124,125,858
未 払 解 約 金	605,043,303
そ の 他 未 払 費 用	10,581
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	222,819,340,607
元 本	65,393,298,021
次 期 繰 越 損 益 金	157,426,042,586
(D) 受 益 権 総 口 数	65,393,298,021口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	34,074円

※当期における期首元本額61,173,269,127円、期中追加設定元本額11,653,465,066円、期中一部解約元本額7,433,436,172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2021年12月1日 至2022年11月30日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	5,416,252,082円
受 取 配 当 金	5,415,660,123
受 取 利 息	36,384
そ の 他 収 益 金	1,872,280
支 払 利 息	△ 1,316,705
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,363,803,273
売 買 益	21,992,241,699
売 買 損	△ 15,628,438,426
(C) 先 物 取 引 等 損 益	521,076,300
取 引 益	1,128,293,600
取 引 損	△ 607,217,300
(D) そ の 他 費 用 等	△ 109,623
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	12,301,022,032
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	135,881,050,625
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 16,899,287,962
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	26,143,257,891
(I) 合 計(E+F+G+H)	157,426,042,586
次 期 繰 越 損 益 金(I)	157,426,042,586

※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	9,574,760,676円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,456,182,387円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	1,036,137,254円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,446,188,375円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,637,683,641円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,623,103,466円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,605,989,911円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	37,493,396円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	147,542,223円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	135,694,110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）	4,234,860円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	684,565,549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）	19,508,324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>	44,118,775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）	63,979,125円	SMAM・インデックス・バランスVA25.5<適格機関投資家専用>	254,234,553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）	165,870,052円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	796,235,497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）	149,775,143円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	533,449,238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）	266,593,539円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,657,079,267円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,398,015,768円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	372,784円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	22,016,808,347円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	36,667,207円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	179,974,667円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	39,482,192円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	253,617,658円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	32,479,210円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	167,938,880円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,795,425円
イオン・バランス戦略ファンド	20,272,782円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	95,429,547円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	41,931,085円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	219,105,114円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	191,067,731円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	52,522,560円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	178,416,019円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	38,723,328円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	669,872,498円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,680,964円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	375,434,831円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	41,326,285円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	427,891,807円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	542,525,688円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	49,851,584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）	167,317,059円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	813,757,842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>	202,591,112円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	39,664,361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>	85,721,825円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	202,349,704円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	94,168,528円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	191,586,051円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	44,811,453円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,500,206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>	42,807,427円
日興FWS・日本株インデックス	1,276,658,198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>	5,577,900円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	18,140,230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>	7,187,543円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,564,092,115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>	92,673,351円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	11,882,906円	SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,136,348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>	74,050,540円		

### ■ お知らせ

#### <約款変更について>

・2022年4月の東京証券取引所の市場区分の見直しに伴い、関連する記載について、所要の変更を行いました。

（適用日：2022年4月4日）

# SMAM・年金国内債券パッシブファンド 〈適格機関投資家限定〉

(2021年6月22日から2022年6月20日まで)

第 18 期

決算日 2022年6月20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	■日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、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(2021年6月22日から2022年6月20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)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	7	0.057	

期中の平均基準価額は12,974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(2021年6月22日から2022年6月20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 8,082,665	千円 11,264,290	千口 6,518,079	千円 9,124,275

### ■ 組入れ資産の明細(2022年6月20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 27,684,346	千口 29,248,932	千円 40,085,662

※国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンドの期末の受益権総口数は89,046,647,330口です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年6月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	41,316,434,914円
コール・ローン等	12,430
国内債券(NOMURA-BPI)	40,085,662,487
マザーファンド(評価額)	
未 収 入 金	1,230,759,997
(B) 負 債	1,241,816,647
未 払 解 約 金	1,230,759,997
未 払 信 託 報 酬	10,561,650
その他未払費用	495,000
(C) 純資産総額(A-B)	40,074,618,267
元 本	31,644,206,150
次期繰越損益金	8,430,412,117
(D) 受益権総口数	31,644,206,150口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,664円

※当期における期首元本額29,934,308,511円、期中追加設定元本額8,878,051,074円、期中一部解約元本額7,168,153,435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2021年6月22日 至2022年6月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 369円
受 取 利 息	50
支 払 利 息	△ 419
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,106,092,039
売 買 損 益	88,081,698
売 買 損 益	△1,194,173,737
(C) 信 託 報 酬 等	△ 21,971,864
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,128,064,272
(E) 前期繰越損益金	2,205,637,713
(F) 追加信託差損益金	7,352,838,676
( 配 当 等 相 当 額 )	( 8,493,076,569)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△1,140,237,893)
(G) 合 計 (D+E+F)	8,430,412,117
次期繰越損益金(G)	8,430,412,117
追加信託差損益金	7,352,838,676
( 配 当 等 相 当 額 )	( 8,499,573,544)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△1,146,734,868)
分 配 準 備 積 立 金	3,534,292,768
繰 越 損 益 金	△2,456,719,327

※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。

※株式投資の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投資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	268,486,407円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	8,499,573,544
(d) 分配準備積立金	3,265,806,361
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	12,033,866,312
1万口当たり当期分配対象額	3,802.87
(f) 分配金	0
1万口当たり分配金	0

# 国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド

第22期 (2021年6月22日から2022年6月20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		公社債組入比率	純資産総額
		期中騰落率	(総合)	期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
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
22期(2022年6月20日)	13,705	△3.0	375.58	△3.0	99.5	122,039

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

## ■当期中の基準価額と市況等の推移

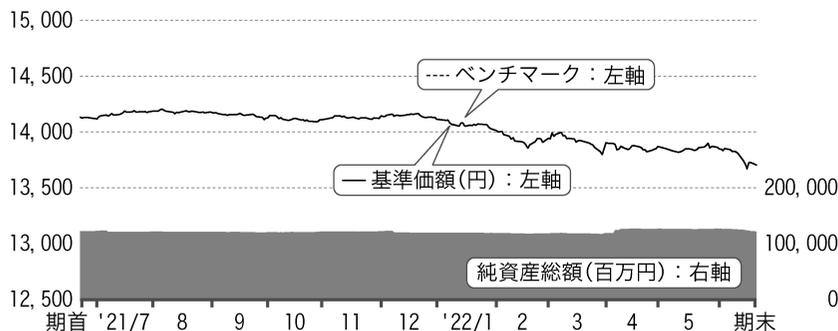
年月日	基準価額		(ベンチマーク)NOMURA-BPI		公社債組入比率
		騰落率	(総合)	騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2021年6月21日	14,134	-	387.33	-	99.5
6月末	14,117	△0.1	386.90	△0.1	99.5
7月末	14,187	0.4	388.81	0.4	99.5
8月末	14,176	0.3	388.46	0.3	99.4
9月末	14,127	△0.0	387.12	△0.1	99.5
10月末	14,111	△0.2	386.72	△0.2	99.5
11月末	14,146	0.1	387.65	0.1	99.4
12月末	14,114	△0.1	386.84	△0.1	99.5
2022年1月末	14,014	△0.8	384.06	△0.8	99.5
2月末	13,943	△1.4	382.13	△1.3	99.4
3月末	13,904	△1.6	381.04	△1.6	99.6
4月末	13,870	△1.9	380.12	△1.9	99.5
5月末	13,849	△2.0	379.54	△2.0	99.5
(期末)					
2022年6月20日	13,705	△3.0	375.58	△3.0	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 (2021年6月22日から2022年6月20日まで)

#### 基準価額等の推移



期首	14,134円
期末	13,705円
騰落率	-3.0%

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

### ▶ 基準価額の主な変動要因 (2021年6月22日から2022年6月20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。

#### 下落要因

- ・ 欧米の中央銀行のタカ派（インフレ抑制を重視する立場）姿勢が強まったことによる海外金利の上昇に追随し、国内金利が上昇（債券価格は下落）したこと
- ・ 商品市況の高騰や円安による物価上昇を受け、日銀による緩和政策が修正されるとの思惑から金利が上昇したこと

### ▶ 投資環境について (2021年6月22日から2022年6月20日まで)

日本の長期金利の代表とされる10年国債利回りは上昇（債券価格は下落）しました。

長期金利は期初からしばらくは低水準で推移しました。9月には自民党の総裁選に向けて新政権に対する政策期待の高まりから株価の上昇が進んだことに加え、欧米債券市場で中央銀行による金融政策の正常化を見込んだ金利上昇が続いたことから、長期金利は上昇しました。

11月から12月にかけては、新たな変異ウイルス（オミクロン型）の感染拡大による景気への悪影響が懸念され、金利は低下する局面もありました。しかし、インフレの長期化懸念を背景に欧米中央銀行のタカ派姿勢が強まる中、欧米の長期金利が上昇基調で推移したことや、日銀が緩和修正を検討しているとの観測報道を受け、長期金利は上昇しました。

2月に日銀が指値オペ（日銀が指定する利回りで国債を無制限に買い入れるオペ）の実施を通じて長期金利の上昇を止める姿勢を示したことや、ロシアによるウクライナ侵攻が景気の先行き不透明感を高めたことから、長期金利は低下しました。しかし、地政学リスクの高まりを受け商品市況が上昇しインフレ懸念が強まる中、欧米の中央銀行による利上げペースが速まるとの観測や日銀による緩和政策の修正が意識され、長期金利は上昇しました。

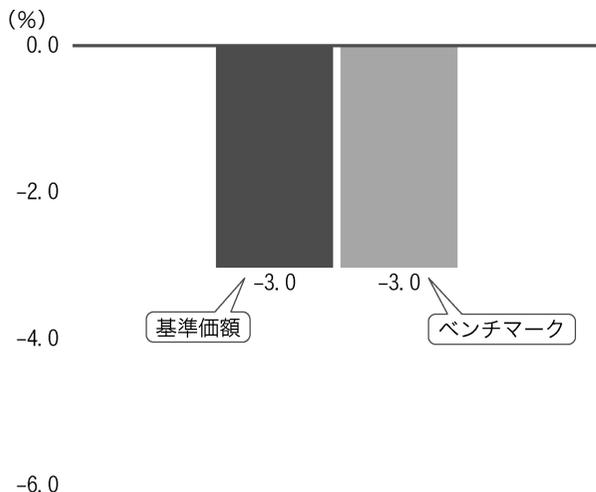
4月の日銀金融政策決定会合では、緩和政策維持と共に指値オペの原則毎営業日実施が決定されたことから、長期金利の上昇は一服しました。その後も欧米中央銀行の利上げペース加速を受け金利上昇圧力がかかりましたが、日銀が金利上昇抑制姿勢を強めたことから、期末にかけて長期金利は横ばい圏で推移しました。

### ▶ ポートフォリオについて (2021年6月22日から2022年6月20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 (2021年6月22日から2022年6月20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、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】

基準価額の騰落率は－3.0%となり、ベンチマークの騰落率－3.0%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（2021年6月22日から2022年6月20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14,036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（2021年6月22日から2022年6月20日まで）

#### 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	35,854,805	35,494,837
	地方債証券	4,264,771	1,104,108
	特殊債証券	—	1,003,842 (176,061)
	社債証券	2,712,170	905,321

※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。

※社債券には新株予約権付社債（転換社債）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（2021年6月22日から2022年6月20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 42,831	百万円 583	% 1.4	百万円 38,508	百万円 2,230	% 5.8

#### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

## 国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

### (3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 500

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 (2021年6月22日から2022年6月20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(2022年6月20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	92,181,000 (40,945,000)	94,318,389 (39,637,507)	77.3 (32.5)	— (—)	52.9 (18.9)	18.2 (8.4)	6.2 (5.1)
地 方 債 証 券	11,550,000 (11,550,000)	11,776,847 (11,776,847)	9.7 (9.7)	— (—)	3.3 (3.3)	4.6 (4.6)	1.8 (1.8)
特 殊 債 券 (除く金融債券)	8,630,510 (8,630,510)	9,048,950 (9,048,950)	7.4 (7.4)	— (—)	4.5 (4.5)	1.8 (1.8)	1.2 (1.2)
金 融 債 券	100,000 (100,000)	100,049 (100,049)	0.1 (0.1)	— (—)	— (—)	— (—)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 券	6,200,000 (6,200,000)	6,201,871 (6,201,871)	5.1 (5.1)	— (—)	2.5 (2.5)	2.4 (2.4)	0.2 (0.2)
合 計	118,661,510 (67,425,510)	121,446,108 (66,765,226)	99.5 (54.7)	— (—)	63.1 (29.1)	26.9 (17.1)	9.5 (8.4)

※( )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。

※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。

## 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	433 2年国債	0.0050	100,000	100,121	2024/02/01
	434 2年国債	0.0050	230,000	230,292	2024/03/01
	139 5年国債	0.1000	760,000	762,257	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	330,000	333,861	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	200,000	207,582	2024/03/20
	435 2年国債	0.0050	5,940,000	5,947,900	2024/04/01
	140 5年国債	0.1000	640,000	642,105	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	345,000	349,585	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	380,000	398,730	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	1,090,000	1,093,804	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	95,000	96,186	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	300,000	314,559	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	530,000	531,987	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	115,000	116,581	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	305,000	307,668	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	278,000	292,950	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	440,000	441,689	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	607,000	614,338	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	230,000	243,526	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	1,220,000	1,224,745	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	615,000	622,927	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	340,000	359,682	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	810,000	813,159	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	883,000	895,052	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	288,000	307,851	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	1,280,000	1,284,915	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	365,000	368,956	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	424,000	453,824	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	790,000	790,000	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	900,000	903,195	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	332,000	358,042	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	480,000	479,712	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	577,000	578,840	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	329,000	358,958	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	1,500,000	1,498,080	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	1,150,000	1,153,162	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	418,000	456,397	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	1,470,000	1,467,030	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	725,000	726,624	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	295,000	322,142	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	640,000	638,182	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	460,000	460,759	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	242,000	264,150	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	105,000	105,103	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	186,000	206,603	2027/06/20

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
	348 10年国債	0.1000	305,000	305,000	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	270,000	299,683	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	305,000	304,749	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	177,000	196,250	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	335,000	334,423	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	130,000	145,386	2028/03/20
	351 10年国債	0.1000	290,000	289,135	2028/06/20
	102 20年国債	2.4000	285,000	323,304	2028/06/20
	352 10年国債	0.1000	565,000	562,723	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	237,000	265,530	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	600,000	596,916	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	248,000	278,764	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	350,000	347,784	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	315,000	350,988	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	840,000	833,624	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	393,000	447,391	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	1,005,000	995,683	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	395,000	447,665	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	1,210,000	1,196,193	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	323,000	367,251	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	150,000	174,396	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	1,180,000	1,165,663	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	320,000	367,548	2030/03/20
	359 10年国債	0.1000	1,110,000	1,096,080	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	245,000	278,724	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	160,000	179,513	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	1,470,000	1,450,992	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	226,764	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	225,000	253,289	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	160,000	195,190	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	1,200,000	1,184,028	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	205,000	236,756	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	230,000	263,713	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	1,080,000	1,064,761	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	175,000	204,204	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	185,000	212,705	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	190,000	216,828	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	100,000	117,000	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	910,000	896,404	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	40,000	45,415	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	750,000	740,497	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	300,000	341,727	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	225,000	254,263	2031/09/20
	365 10年国債	0.1000	1,150,000	1,136,096	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	270,000	305,896	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	235,000	268,421	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	890,000	887,454	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	163,000	186,590	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	285,000	323,543	2032/03/20

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
	136 20年国債	1. 6000	205, 000	230, 778	2032/03/20
	7 30年国債	2. 3000	180, 000	215, 379	2032/05/20
	137 20年国債	1. 7000	190, 000	216, 237	2032/06/20
	139 20年国債	1. 6000	200, 000	225, 674	2032/06/20
	140 20年国債	1. 7000	430, 000	490, 101	2032/09/20
	141 20年国債	1. 7000	290, 000	330, 817	2032/12/20
	142 20年国債	1. 8000	150, 000	172, 636	2032/12/20
	10 30年国債	1. 1000	230, 000	248, 119	2033/03/20
	143 20年国債	1. 6000	100, 000	113, 120	2033/03/20
	144 20年国債	1. 5000	285, 000	319, 436	2033/03/20
	11 30年国債	1. 7000	150, 000	171, 444	2033/06/20
	145 20年国債	1. 7000	352, 000	402, 321	2033/06/20
	12 30年国債	2. 1000	230, 000	273, 118	2033/09/20
	146 20年国債	1. 7000	350, 000	400, 270	2033/09/20
	147 20年国債	1. 6000	390, 000	441, 932	2033/12/20
	14 30年国債	2. 4000	220, 000	269, 511	2034/03/20
	148 20年国債	1. 5000	332, 000	372, 550	2034/03/20
	15 30年国債	2. 5000	250, 000	309, 745	2034/06/20
	149 20年国債	1. 5000	357, 000	400, 578	2034/06/20
	16 30年国債	2. 5000	195, 000	241, 969	2034/09/20
	150 20年国債	1. 4000	665, 000	738, 336	2034/09/20
	151 20年国債	1. 2000	500, 000	542, 765	2034/12/20
	18 30年国債	2. 3000	160, 000	195, 324	2035/03/20
	152 20年国債	1. 2000	450, 000	488, 326	2035/03/20
	19 30年国債	2. 3000	150, 000	183, 397	2035/06/20
	153 20年国債	1. 3000	502, 000	550, 673	2035/06/20
	154 20年国債	1. 2000	455, 000	493, 042	2035/09/20
	21 30年国債	2. 3000	122, 000	149, 579	2035/12/20
	155 20年国債	1. 0000	680, 000	718, 896	2035/12/20
	22 30年国債	2. 5000	149, 000	186, 846	2036/03/20
	156 20年国債	0. 4000	480, 000	468, 700	2036/03/20
	23 30年国債	2. 5000	151, 000	189, 637	2036/06/20
	157 20年国債	0. 2000	483, 000	457, 458	2036/06/20
	24 30年国債	2. 5000	135, 000	169, 672	2036/09/20
	158 20年国債	0. 5000	565, 000	556, 118	2036/09/20
	25 30年国債	2. 3000	175, 000	215, 255	2036/12/20
	159 20年国債	0. 6000	458, 000	455, 870	2036/12/20
	26 30年国債	2. 4000	219, 000	272, 768	2037/03/20
	160 20年国債	0. 7000	450, 000	453, 024	2037/03/20
	161 20年国債	0. 6000	515, 000	510, 086	2037/06/20
	27 30年国債	2. 5000	206, 000	259, 955	2037/09/20
	162 20年国債	0. 6000	485, 000	478, 976	2037/09/20
	163 20年国債	0. 6000	465, 000	457, 857	2037/12/20
	28 30年国債	2. 5000	251, 000	317, 324	2038/03/20
	164 20年国債	0. 5000	465, 000	449, 892	2038/03/20
	165 20年国債	0. 5000	485, 000	468, 015	2038/06/20
	29 30年国債	2. 4000	190, 000	237, 992	2038/09/20
	166 20年国債	0. 7000	420, 000	416, 955	2038/09/20
	167 20年国債	0. 5000	465, 000	445, 967	2038/12/20

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
	30 30年国債	2.3000	270,000	334,497	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	555,000	522,216	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	415,000	382,804	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	277,000	339,120	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	420,000	386,118	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	425,000	389,389	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	377,000	468,147	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	390,000	362,376	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	500,000	463,070	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	380,000	453,336	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	475,000	438,458	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	480,000	449,904	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	379,000	465,108	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	480,000	448,483	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	480,000	439,281	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	335,000	400,053	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	480,000	446,299	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	460,000	426,999	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	315,000	377,203	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	420,000	411,919	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	345,000	406,527	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	385,000	446,742	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	240,000	282,883	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	220,000	255,090	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	200,000	227,998	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	250,000	285,075	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	260,000	296,288	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	327,000	372,384	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	302,000	331,864	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	315,000	346,109	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	315,000	352,311	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	335,000	360,614	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	315,000	338,971	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	410,000	389,405	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	317,000	266,825	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	317,000	279,251	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	312,000	280,541	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	170,000	159,767	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	270,000	253,125	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	525,000	490,964	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	295,000	275,181	2047/12/20
	58 30年国債	0.8000	370,000	344,273	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	310,000	280,956	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	310,000	293,780	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	330,000	296,825	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	132,000	164,039	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	235,000	200,274	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	215,000	177,929	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	315,000	260,048	2049/09/20

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
	65 30年国債	0.4000	275,000	226,930	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	187,869	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	285,000	235,093	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	320,000	277,148	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	360,000	311,472	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	320,000	284,211	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	215,000	268,999	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	430,000	381,195	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	300,000	265,731	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	310,000	274,362	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	330,000	291,825	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	222,000	267,376	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	300,000	286,218	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	220,000	260,136	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	263,000	298,373	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	285,000	300,874	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	451,000	351,667	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	438,000	400,861	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	345,000	305,135	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	350,000	277,270	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	440,000	346,918	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	485,000	408,961	2061/03/20
	15 40年国債	1.0000	30,000	27,714	2062/03/20
	小計	-	92,181,000	94,318,389	-
地方債証券	24-9 埼玉県公債	0.8440	100,000	100,508	2023/01/31
	147 大阪府5年	0.0010	100,000	99,984	2023/02/27
	29-11 福岡市5年	0.0400	300,000	300,066	2023/03/16
	482 名古屋市債	0.6390	200,000	200,934	2023/03/20
	1 東京都20年	1.5400	200,000	203,073	2023/06/20
	30-6 京都府5年	0.0300	200,000	199,987	2023/09/20
	30-7 福岡県5年	0.0200	100,000	99,939	2024/01/22
	25-11 福岡県公債	0.6940	100,000	101,066	2024/02/26
	30-12 京都府5年	0.0200	300,000	299,769	2024/03/19
	1-1 大阪市5年	0.0100	400,000	399,596	2024/05/21
	1-2 千葉県5年	0.0100	100,000	99,889	2024/05/24
	26-1 広島県公債	0.6700	100,000	101,164	2024/05/27
	78 神奈川県5年	0.0050	100,000	99,882	2024/06/20
	487 名古屋市債	0.6590	300,000	303,559	2024/06/20
	26-4 埼玉県公債	0.6540	100,000	101,186	2024/06/26
	26-3 千葉県公債	0.6110	300,000	303,409	2024/07/25
	26-3 横浜市公債	0.5710	300,000	303,228	2024/08/19
	137 共同発行地方	0.5660	100,000	101,075	2024/08/23
	138 共同発行地方	0.5540	100,000	101,085	2024/09/25
	1-2 北九州市5年	0.0010	100,000	99,829	2024/09/26
	26-5 福岡県公債	0.5250	200,000	202,102	2024/10/28
	26-5 福岡市公債	0.5390	200,000	202,163	2024/10/28
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,057	2024/11/25
	11 群馬県公債	0.5050	100,000	101,025	2024/11/25
	140 共同発行地方	0.5050	100,000	101,025	2024/11/25

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
	26-14 愛知県公債	0.5350	100,000	101,106	2024/11/28
	26-5 千葉県公債	0.4760	200,000	201,967	2024/12/25
	26-13 北海道公債	0.4610	100,000	100,931	2024/12/26
	6 東京都20年	2.0000	400,000	420,910	2025/03/19
	26-18 愛知県公債	0.4400	100,000	100,959	2025/03/27
	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	101,296	2025/04/16
	395 大阪府公債	0.4350	200,000	201,906	2025/04/28
	170 大阪府5年	0.0010	100,000	99,717	2025/04/28
	397 大阪府公債	0.5660	100,000	101,381	2025/06/27
	149 共同発行地方	0.5000	100,000	101,249	2025/08/25
	7 東京都20年	2.1600	100,000	106,644	2025/09/19
	1 静岡県20年	2.1800	100,000	106,712	2025/09/19
	27-5 福岡市公債	0.4760	100,000	101,217	2025/10/28
	27-11 京都府公債	0.4690	200,000	202,451	2025/12/18
	494 名古屋市債	0.4640	200,000	202,411	2025/12/19
	27-16 愛知県公債	0.4540	200,000	202,350	2025/12/25
	27-1 三重県公債	0.4640	100,000	101,203	2025/12/25
	154 共同発行地方	0.4050	150,000	151,498	2026/01/23
	407 大阪府公債	0.0900	100,000	99,785	2026/04/27
	9 横浜市20年	2.3500	100,000	108,776	2026/06/19
	1 兵庫県公債15年	1.6600	200,000	212,328	2026/07/29
	11 東京都20年	2.2200	100,000	109,645	2027/03/19
	7 神奈川県20年	2.2200	200,000	219,259	2027/03/19
	29-5 北海道公債	0.1800	100,000	99,900	2027/06/30
	175 共同発行地方	0.2150	200,000	199,957	2027/10/25
	425 大阪府公債	0.1950	200,000	199,618	2027/10/29
	176 共同発行地方	0.1850	100,000	99,774	2027/11/25
	29-16 愛知県公債	0.2600	100,000	100,107	2028/02/14
	179 共同発行地方	0.2400	100,000	99,982	2028/02/25
	233 神奈川県公債	0.1950	100,000	99,705	2028/03/17
	5 兵庫県公債15年	1.3100	100,000	106,059	2028/05/26
	183 共同発行地方	0.2050	600,000	597,619	2028/06/23
	30-2 広島県公債	0.1800	200,000	198,802	2028/07/25
	185 共同発行地方	0.2450	200,000	199,508	2028/08/25
	91 川崎市公債	0.1850	100,000	99,330	2028/09/20
	6 埼玉県20年	2.2600	100,000	112,179	2028/09/21
	16 横浜市20年	2.3500	100,000	112,739	2028/09/21
	30-6 福岡県公債	0.2000	100,000	99,317	2028/12/21
	30-2 岡山県公債	0.1550	100,000	98,950	2029/01/31
	30-18 北海道公債	0.1460	200,000	197,357	2029/02/28
	792 東京都公債	0.0500	300,000	294,534	2029/03/19
	793 東京都公債	0.0500	200,000	196,074	2029/06/20
	9 兵庫県公債20年	2.2500	100,000	113,533	2029/11/19
	13 埼玉県20年	1.5990	100,000	112,339	2033/05/20
	8 東京都30年	2.2300	100,000	121,627	2038/09/17
	13 東京都30年	1.9300	200,000	235,010	2042/03/19
	7 静岡県30年	1.9880	100,000	118,382	2043/06/19
	1-3 福岡県30年	0.4320	100,000	82,113	2049/06/18
	小 計	-	11,550,000	11,776,847	-

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
特殊債券 (除く金融債券)	104 道路機構	0.7150	400,000	402,108	2023/03/20
	22 政保政策投資B	2.2000	100,000	102,259	2023/06/19
	4 公営企業20年	2.0900	200,000	205,133	2023/09/20
	207 政保道路機構	0.6930	200,000	202,162	2023/12/28
	209 政保道路機構	0.7470	100,000	101,232	2024/01/31
	122 道路機構	0.7040	200,000	202,256	2024/03/19
	27 道路債券	2.4200	100,000	104,122	2024/03/20
	59 地方公共団体	0.7240	100,000	101,230	2024/04/26
	220 政保道路機構	0.6440	300,000	303,998	2024/06/28
	61 地方公共団体	0.6900	100,000	101,266	2024/06/28
	62 地方公共団体	0.6310	300,000	303,558	2024/07/26
	32 道路債券	2.4400	100,000	105,319	2024/09/20
	227 政保道路機構	0.5440	300,000	303,758	2024/09/30
	6 福祉医療機構	2.1100	100,000	105,517	2025/03/19
	42 道路債券	2.2200	100,000	105,824	2025/03/21
	85 中日本高速道	0.0700	100,000	99,790	2025/10/21
	16 公営企業20年	2.1000	100,000	106,909	2025/12/19
	66日本政策投資CO	0.0900	100,000	99,794	2026/04/17
	18 公営企業20年	2.5800	100,000	109,672	2026/06/19
	190 住宅支援機構	0.0800	100,000	99,702	2026/06/19
	60 政保政策投資C	0.0010	100,000	99,503	2027/01/29
	22 公営企業20年	2.3200	200,000	221,053	2027/06/18
	117 住宅支援機構	1.4380	100,000	106,264	2027/09/17
	27 道路機構	2.3400	100,000	111,089	2027/10/20
	222 住宅支援機構	0.2100	200,000	199,529	2027/11/19
	102 地方公共団体	0.2000	100,000	99,763	2027/11/26
	42 政保政策投資C	0.1550	100,000	99,923	2027/12/15
	226 住宅支援機構	0.2400	200,000	199,772	2027/12/20
	333 政保道路機構	0.1550	100,000	99,915	2027/12/28
	339 政保道路機構	0.1950	100,000	100,090	2028/02/29
	106 地方公共団体	0.2150	300,000	299,096	2028/03/28
	37 道路機構	2.4200	700,000	788,022	2028/06/20
	79 政保道路機構	2.1000	100,000	112,532	2029/04/27
	92 政保道路機構	2.1000	100,000	113,160	2029/10/31
	99 政保道路機構	2.2000	100,000	114,227	2030/01/31
130 住宅支援機構	1.7630	100,000	113,564	2032/12/20	
185 政保道路機構	1.7570	100,000	114,137	2033/02/28	
F281地方公共団体	0.9990	100,000	105,418	2033/09/21	
210 政保道路機構	1.5470	400,000	448,539	2034/01/31	
221 政保道路機構	1.4660	100,000	111,211	2034/06/30	
246 政保道路機構	1.1780	100,000	107,538	2035/05/31	
4 道路機構	2.5900	100,000	124,636	2035/12/20	
48 地方公共団体20	1.1210	100,000	105,815	2035/12/28	
S9 住宅金融RMBS	2.1900	10,104	10,163	2037/05/10	
S10住宅金融RMBS	2.1500	10,406	10,462	2037/05/10	
S1 住宅機構RMBS	2.0800	10,546	10,680	2037/11/10	
S3 住宅機構RMBS	2.0900	10,930	11,078	2037/11/10	
32 住宅金融RMBS	1.6900	10,919	11,030	2040/07/10	
35 住宅金融RMBS	1.7900	11,605	11,802	2040/10/10	

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
	37 住宅金融RMBS	1.8800	11,023	11,222	2040/12/10
	40 住宅金融RMBS	1.9300	12,094	12,402	2041/03/10
	42 住宅金融RMBS	2.3400	10,214	10,274	2041/05/10
	48 住宅金融RMBS	2.3300	10,501	10,657	2041/11/10
	2 住宅機構RMBS	2.1900	11,444	11,702	2042/06/10
	29 住宅機構RMBS	1.9500	21,614	22,921	2044/10/10
	32 住宅機構RMBS	1.8200	21,102	22,228	2045/01/10
	37 住宅機構RMBS	1.7100	21,374	22,417	2045/06/10
	49 住宅機構RMBS	1.7600	19,947	20,868	2046/06/10
	51 住宅機構RMBS	1.6400	22,014	23,015	2046/08/10
	55 住宅機構RMBS	1.4100	29,180	30,455	2046/12/10
	57 住宅機構RMBS	1.4400	28,172	29,403	2047/02/10
	22 道路機構	2.6700	200,000	262,940	2047/03/20
	59 住宅機構RMBS	1.4400	30,115	31,479	2047/04/10
	67 住宅機構RMBS	1.0900	38,803	40,040	2047/12/10
	69 住宅機構RMBS	1.2800	39,710	41,322	2048/02/10
	70 住宅機構RMBS	1.2500	34,718	36,033	2048/03/10
	73 住宅機構RMBS	1.3000	39,584	41,230	2048/06/10
	88 住宅機構RMBS	0.9300	43,421	44,476	2049/09/10
	113 住宅機構RMBS	0.3700	74,716	73,640	2051/10/10
	123 住宅機構RMBS	0.4600	77,855	76,850	2052/08/10
	124 住宅機構RMBS	0.4200	77,784	76,547	2052/09/10
	125 住宅機構RMBS	0.4200	77,770	76,541	2052/10/10
	132 住宅機構RMBS	0.4000	79,955	78,451	2053/05/10
	138 住宅機構RMBS	0.5000	82,452	81,314	2053/11/10
	146 住宅機構RMBS	0.2100	87,173	83,869	2054/07/10
	151 住宅機構RMBS	0.2600	89,717	86,648	2054/12/10
	157 住宅機構RMBS	0.3400	91,011	88,362	2055/06/10
	160 住宅機構RMBS	0.3700	92,883	90,375	2055/09/10
	166 住宅機構RMBS	0.4100	189,654	185,614	2056/03/10
	小 計	—	8,630,510	9,048,950	—
金 融 債 券	350 信金中金	0.0800	100,000	100,049	2024/01/26
	小 計	—	100,000	100,049	—
普 通 社 債 券	57 東京三菱銀行	2.2200	100,000	100,760	2022/10/27
	2 BPCE S. A.	0.6450	100,000	100,214	2023/07/12
	1 野村ホールディングス	0.3000	100,000	99,957	2023/09/04
	50 西日本高速道	0.0400	100,000	99,952	2024/06/20
	1 みずほFG劣後	0.9500	100,000	100,687	2024/07/16
	1 明治安田2019基	0.2900	200,000	197,809	2024/08/02
	1 三井住友FG劣後	0.8490	100,000	100,907	2024/09/12
	38 東京電力パワー	0.5800	100,000	100,126	2025/07/16
	163東日本旅客鉄	0.0500	300,000	297,775	2026/04/15
	90 中日本高速道	0.0500	300,000	298,498	2026/07/27
	64 阪急阪神HLDG	0.1000	100,000	99,217	2026/12/08
	73 ホンダファイナンス	0.1000	200,000	198,209	2026/12/18
	13 西日本旅客鉄	2.3400	100,000	109,370	2027/02/19
	553 中部電力	0.2500	100,000	99,147	2027/02/25
	2 三菱HCキャピタル	0.1900	200,000	197,373	2027/03/01
	11 プリチストン	0.2950	200,000	199,560	2027/04/21

## 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
	550 関西電力	0.3900	300,000	299,689	2027/05/25
	13 大和ハウス	0.2850	100,000	99,751	2027/06/01
	17 アサヒグループHD	0.2900	100,000	99,897	2027/06/01
	9 サントリーホールディング	0.3000	100,000	99,899	2027/06/08
	207 オリックス	0.3500	200,000	199,802	2027/06/15
	30 東レ	0.3750	100,000	100,084	2027/07/16
	56 住友化学	0.3800	100,000	99,682	2027/09/13
	32 東海旅客鉄道	2.3100	100,000	110,115	2027/09/17
	38 京王電鉄	0.2950	100,000	99,754	2027/11/29
	17 NTTファイナンス	0.2800	200,000	198,334	2027/12/20
	126東日本旅客鉄	0.2750	200,000	198,750	2028/01/26
	24三菱ケミカルホールデイ	0.3700	100,000	99,505	2028/02/25
	7 ジェイテクト	0.3450	100,000	99,146	2028/03/08
	7 ファーストリテイリング	0.4050	100,000	99,877	2028/06/06
	9 TDK	0.2600	100,000	97,864	2028/12/01
	51 住友商事	1.2410	100,000	104,774	2029/04/23
	508 東北電力	0.4650	200,000	198,016	2029/04/25
	547 東北電力	0.5000	100,000	100,001	2029/06/25
	52 東海旅客鉄道	2.1110	100,000	112,474	2030/06/21
	45 東京地下鉄	0.2150	200,000	195,145	2030/09/18
	41 大阪瓦斯	0.2200	300,000	292,175	2031/06/03
	135 三菱地所	0.2600	200,000	195,411	2031/06/20
	546 中部電力	0.2800	200,000	193,570	2031/09/25
	496 九州電力	0.3300	200,000	193,931	2031/10/24
	11 東急	0.4790	100,000	99,910	2032/06/01
	65 三菱地所	2.0400	100,000	114,735	2032/12/20
	小 計	—	6,200,000	6,201,871	—
	合 計	—	118,661,510	121,446,108	—

※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。

## ■ 投資信託財産の構成

(2022年6月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	121,446,108	98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,962,471	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	123,408,580	100.0

## 国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年6月20日現在)

項 目	期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>123,408,580,241円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	557,346,612
公 社 債 ( 評 価 額 )	121,446,108,855
未 収 入 金	1,243,113,900
未 収 利 息	156,454,366
前 払 費 用	5,556,508
<b>(B) 負 債</b>	<b>1,369,168,082</b>
未 払 金	78,485,800
未 払 解 約 金	1,290,681,320
そ の 他 未 払 費 用	962
<b>(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )</b>	<b>122,039,412,159</b>
元 本	89,046,647,330
次 期 繰 越 損 益 金	32,992,764,829
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>89,046,647,330口</b>
<b>1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D )</b>	<b>13,705円</b>

※当期における期首元本額86,729,456,752円、期中追加設定元本額16,766,114,392円、期中一部解約元本額14,448,923,814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	53,983,654,044円
三井住友DS・国内債券インデックス年金ファンド	727,951,005円
日興FWS・日本債インデックス	2,435,165,994円
SMAM・国内債券インデックス・ファンド	2,620,838,506円
国内債券インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	30,104,919円
SMAM・年金国内債券バップファンド<適格機関投資家限定>	29,248,932,862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2021年6月22日 至2022年6月20日)

項 目	当 期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>925,393,548円</b>
受 取 利 息	925,648,056
支 払 利 息	△ 254,508
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>△ 4,669,038,739</b>
売 買 損 益	19,084,810
売 買 損 益	△ 4,688,123,549
<b>(C) そ の 他 費 用 等</b>	<b>△ 38,455</b>
<b>(D) 当 期 損 益 金 ( A + B + C )</b>	<b>△ 3,743,683,646</b>
<b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>35,853,102,320</b>
<b>(F) 解 約 差 損 益 金</b>	<b>△ 5,824,541,893</b>
<b>(G) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>6,707,888,048</b>
<b>(H) 合 計 ( D + E + F + G )</b>	<b>32,992,764,829</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 ( H )</b>	<b>32,992,764,829</b>

※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。

# SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

第 22 期

決算日 2022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、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（2021年12月1日から2022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)	38円 (5) (5) (28)	0.082% (0.011) (0.011) (0.060)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資信託証券)	2 (2) (1) (0)	0.005 (0.004) (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
(c) 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	3 (3) (0)	0.007 (0.007) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	27 (16) (10) (1)	0.060 (0.034) (0.022) (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：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	70	0.154	

期中の平均基準価額は45,676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（2021年12月1日から2022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 53,048	千円 309,890	千口 195,197	千円 1,174,100

## ■ 組入れ資産の明細 (2022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		評 価 額	
外国株式インデックス・マザーファンド	千口 591,445		千円 2,752,299	

※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72,186,242,919口です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	2,765,148,533円
コール・ローン等	3,778,589
外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	2,752,299,948
未 収 入 金	9,069,996
(B) 負 債	10,599,114
未 払 解 約 金	9,069,996
未 払 信 託 報 酬	1,195,266
そ の 他 未 払 費 用	333,852
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,754,549,419
元 本	582,920,969
次 期 繰 越 損 益 金	2,171,628,450
(D) 受 益 権 総 口 数	582,920,969口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	47,254円

※当期における期首元本額766,714,885円、期中追加設定元本額80,591,485円、期中一部解約元本額264,385,401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2021年12月1日 至2022年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	52,308円
受 取 利 息	74
そ の 他 収 益 金	53,915
支 払 利 息	△ 1,681
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	129,737,247
売 買 益	172,344,768
売 買 損	△ 42,607,521
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,165,024
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	126,624,531
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,473,193,625
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	571,810,294
( 配 当 等 相 当 額 )	( 887,791,129)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 315,980,835)
(G) 合 計 (D + E + F)	2,171,628,450
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	2,171,628,450
追 加 信 託 差 損 益 金	571,810,294
( 配 当 等 相 当 額 )	( 888,110,087)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 316,299,793)
分 配 準 備 積 立 金	1,599,818,156

※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	46,302,982円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	80,321,549
(c) 収益調整金	888,110,087
(d) 分配準備積立金	1,473,193,625
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,487,928,243
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	42,680.37
(f) 分配金	0
1 万 口 当 た り 分 配 金	0

# 外国株式インデックス・マザーファンド

第20期（2021年12月1日から2022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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>

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 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	投 資 信 託 券 証 組 入 比 率	純 資 産 額 総
	期 騰 落 率	中 率	(配当込み、 円ベース)	期 騰 落 率				
16期（2018年11月30日）	円	%	%	%	%	%	%	百万円
17期（2019年12月2日）	34,678	2.6	360.38	2.8	93.7	3.9	2.3	174,245
18期（2020年11月30日）	38,813	11.9	404.43	12.2	95.2	2.1	2.7	232,418
19期（2021年11月30日）	42,581	9.7	444.41	9.9	96.8	0.9	2.3	254,097
20期（2022年11月30日）	58,337	37.0	609.64	37.2	95.5	2.2	2.4	353,818
20期（2022年11月30日）	61,258	5.0	641.79	5.3	93.1	4.7	2.3	442,201

※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 株 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	投 資 信 託 証 券 組 入 率
	騰 落 率	(配当込み、 円ベース)	騰 落 率				
(期 首) 2021年11月30日	円 58,337	% —	609.64	% —	% 95.5	% 2.2	% 2.4
12月末	60,720	4.1	634.87	4.1	95.7	1.7	2.4
2022年 1 月末	56,460	△3.2	590.55	△3.1	95.5	1.3	2.4
2 月末	56,082	△3.9	587.08	△3.7	96.2	1.2	2.4
3 月末	62,054	6.4	649.34	6.5	94.3	3.2	2.4
4 月末	59,396	1.8	621.24	1.9	95.7	1.8	2.7
5 月末	59,238	1.5	620.50	1.8	93.5	4.0	2.5
6 月末	57,862	△0.8	605.98	△0.6	94.9	2.7	2.5
7 月末	60,148	3.1	629.01	3.2	94.6	2.9	2.6
8 月末	60,564	3.8	633.65	3.9	95.5	2.0	2.5
9 月末	57,591	△1.3	602.08	△1.2	95.4	2.3	2.4
10 月末	63,111	8.2	660.71	8.4	94.4	3.3	2.3
(期 末) 2022年11月30日	61,258	5.0	641.79	5.3	93.1	4.7	2.3

※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

### 基準価額等の推移



期首	58,337円
期末	61,258円
騰落率	+5.0%

※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（2021年12月1日から2022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** ・ 主要通貨に対して円安が進行したこと

**下落要因** ・ インフレ懸念の高まりに伴うFRB（米連邦準備制度理事会）の金融引き締めへの転換、グローバルの景気減速懸念などから、2022年に入って以降、株式市場が下落したこと

## ▶ 投資環境について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

期間における世界の株式市場は、下落しました。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

期初から年末にかけて、好調な企業決算の発表が相次いだことを好感した他、世界的にロックダウン（都市封鎖）措置の解除などを受けて経済再開への期待が株式市場を押し上げました。

しかし、2022年1月に入るとFRBの金融政策スタンスがインフレ懸念の高まりから積極的な利上げ姿勢へ転じたことから金利が上昇し、バリュエーション（投資価値評価）調整から成長株主導で下落しました。加えて、中国のロックダウンやロシアによるウクライナ侵攻などにより、世界的に経済に対する不透明感が広がったこともマイナス要因となりました。

4月以降も、米国の雇用統計や消費者物価指数が強い内容となったことでFRB高官から利上げに前向きな発言が相次ぎ、株式市場は軟調な展開が継続しました。

また、期末にかけて米国を中心に世界各国の中央銀行による利上げが続きましたが、利上げペースの緩和期待や堅調な企業の決算発表に伴い反発する局面も見られ、一進一退の展開となりました。

期間を通じてみると、世界の株式市場は、下落しました。

### 為替市場

米ドル・円相場は、期初では米国で金融政策が正常化するとの見方が広がったことや経済指標が改善したことなどを受けて、米ドル高・円安が進みました。その後も日銀が金融緩和を継続する中、FRBが金融引き締めへ舵を切ったことなどから、円安が進みました。

期末にかけても、パウエル議長が利上げ継続を強調したことなどを受けて日米金利差が改めて意識され、円安が一段と進行しました。

ユーロ・円相場は、期初から2月中旬にかけては概ねもみ合いで推移しましたが、3月にかけてはロシアのウクライナ侵攻などの地政学リスクにより一時急激なユーロ安・円高となりました。4月以降は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。7月にはECB（欧州中央銀行）が11年ぶりの利上げを実施し、その後も物価上昇圧力が顕在化していることから更なる利上げ観測が進み、円安が一段と進みました。

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（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

**株式組入比率**

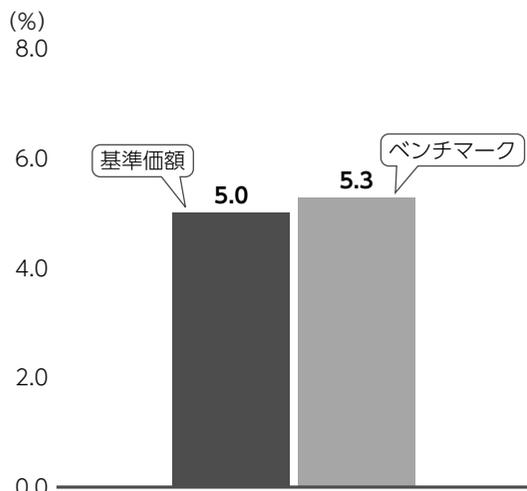
M S C I コクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について（2021年12月1日から2022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、M S C I 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+5.0%となり、ベンチマークの騰落率+5.3%から0.3%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（2021年12月1日から2022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) (投 資 信 託 証 券)	3円 ( 2 ) ( 1 ) ( 0 )	0.005% (0.003) (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)	4 ( 4 ) ( 0 )	0.007 (0.007) (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 (20) ( 2 )	0.037 (0.034) (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：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	29	0.049	

期中の平均基準価額は59,181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 (2021年12月1日から2022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 41,799.26 ( 14,016)	千アメリカ・ドル 435,643 (△ 7,275)	百株 8,357.87	千アメリカ・ドル 74,615	
	カ ナ ダ	4,965.97 ( 807.54)	千カナダ・ドル 30,627 (△ 0)	1,865.62	千カナダ・ドル 4,872	
	オーストラリア	9,288.91 (△ 47.93)	千オーストラリア・ドル 24,204 (△ 589)	3,208.07	千オーストラリア・ドル 4,291	
	香 港	7,567 ( -)	千香港・ドル 32,321 (△ 25)	3,596	千香港・ドル 3,635	
	シンガポール	2,587	千シンガポール・ドル 2,344	83	千シンガポール・ドル 98	
	ニュージーランド	1,305.94	千ニュージーランド・ドル 837	1,722.48	千ニュージーランド・ドル 1,052	
	イギリス	28,189.6 ( 3,198.26)	千イギリス・ポンド 20,435 (△ 428)	9,200.07	千イギリス・ポンド 6,947	
	イスラエル	2,721.7	千イスラエル・シケル 5,216	-	千イスラエル・シケル -	
	スイス	2,128.04 ( 1,794.49)	千スイス・フラン 17,459 (△ 181)	434.06	千スイス・フラン 3,373	
	デンマーク	634.44	千デンマーク・クローネ 29,747	225.58	千デンマーク・クローネ 5,984	
	ノルウェー	717.44 ( 128.85)	千ノルウェー・クローネ 17,485 ( 4,121)	247.34	千ノルウェー・クローネ 3,241	
	スウェーデン	5,820.22 ( 3,590.73)	千スウェーデン・クローナ 92,020 (△ 5,274)	2,504.37	千スウェーデン・クローナ 13,806	
	国	ユ ー ロ		千ユーロ		千ユーロ
		アイルランド	132.05	873	10.35	61
オランダ		3,002.34 ( 109.55)	9,979 (△ 15)	479.66	1,551	
ベルギー		334.79 ( 16.52)	1,845 ( -)	69.38	351	
ルクセンブルグ		263.09	342	136.38	145	
フランス		3,092.2 ( 391.11)	16,423 (△ 596)	1,022.29	3,086	

## 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	ド イ ツ	2,920.79 ( 233.4)	13,497 (△ 223)	880.37	2,556
	ポ ル ト ガ ル	572.07	384	1,985.62	170
	ス ペ イ ン	4,808.06 ( 354.11)	3,734 (△ 1)	739.68	540
	イ タ リ ア	7,307.6 ( -)	2,971 (△ 1)	4,778.89	593
	フ ィ ン ラ ン ド	1,227.86	1,648	227.23	370
	オ ー ス ト リ ア	71.7	309	96.31	160

※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。

### (2) 投資信託証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国	ア メ リ カ		千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル
	AGNC INVESTMENT CORP	-	-	25,432	311
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,792	606	1,040	205
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,220	386	-	-
	BOSTON PROPERTIES INC	1,769	174	-	-
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843	576	-	-
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,225	371	-	-
	EQUITY RESIDENTIAL	5,253	429	1,417	103
	EQUINIX INC	1,214	833	220	143
	AMERICAN TOWER CORP	5,596	1,395	1,367	324
	SUN COMMUNITIES INC	1,041	170	-	-
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613	850	-	-
	HOST HOTELS & RESORTS INC	8,620	171	-	-
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093	742	-	-
	REALTY INCOME CORP	8,388	574	-	-
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,086	365	-	-
	INVITATION HOMES INC	4,239	159	-	-
	VICI PROPERTIES INC	24,329	744	-	-
	KIMCO REALTY CORP	35,169	827	-	-
	VENTAS INC	3,984	190	-	-
	WEYERHAEUSER CO	11,541	422	3,261	127
	CROWN CASTLE INC	5,359	976	960	168
	IRON MOUNTAIN INC	5,455	281	-	-
	PROLOGIS INC	20,279	2,378	1,354	179
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,111	375	-	-
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,107	192	-	-
	DUKE REALTY CORP	3,277	202	24,944	1,229
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,047	309	-	-	
WELLTOWER INC	3,920	345	-	-	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,621	205	-	-	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,522	190	-	-	

## 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		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	25,074 (△67,508)	202 ( - )	- ( - )	- ( - )
		PUBLIC STORAGE	2,573	796	514	155
		REGENCY CENTERS CORP	1,319	80	-	-
		UDR INC	3,977	179	-	-
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	-	-	10,364	289
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4,788	652	1,777	232
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,154	198	-	-
		WP CAREY INC	2,427	185	-	-
	カ ナ ダ		□	千カナダ・ドル	□	千カナダ・ドル
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,199	179	-	-
オーストラリア		□	千オーストラリア・ドル	□	千オーストラリア・ドル	
		SCENTRE GROUP	75,111	205	-	-
		DEXUS/AU	48,116	453	22,768	244
		TRANSURBAN GROUP	28,586	402	-	-
		SYDNEY AIRPORT	15,879 (△78,065)	131 (△ 644)	- ( - )	- ( - )
		APA GROUP	28,695	314	8,621	97
		MIRVAC GROUP	51,566	105	-	-
		GOODMAN GROUP	19,950	438	-	-
香 港		□	千香港・ドル	□	千香港・ドル	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	79,000	835	-	-
		LINK REIT	26,500	1,709	-	-
シンガポール		□	千シンガポール・ドル	□	千シンガポール・ドル	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	48,500 ( - )	146 (△ 7)	- ( - )	- ( - )
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	43,900 ( - )	96 (△ 0)	- ( - )	- ( - )
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	-	-	-	-
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	- ( 4,102)	- ( - )	4,102 ( - )	4 ( - )
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	- ( - )	- (△ 0)	- ( - )	- ( - )
イ ギ リ ス		□	千イギリス・ポンド	□	千イギリス・ポンド	
		SEGRO PLC	10,208	105	-	-
	BRITISH LAND CO PLC	17,444	92	13,398	64	
ユ ー ロ	ベルギー フランス	□	千ユーロ	□	千ユーロ	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,913	340	-	-
		GECINA SA	893	97	-	-
		KLEPIERRE	- ( - )	- (△ 23)	- ( - )	- ( - )

※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。

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国株式先物取引	百万円 133,121	百万円 121,473	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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	93,114,424千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	371,314,612千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.25

※(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 (2021年12月1日から2022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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

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

# 外国株式インデックス・マザーファンド

## ■ 組入れ資産の明細 (2022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	評価額 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	72.44	1,034	143,673	ソフトウェア・サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	110.28	130.3	2,549	354,078	保険
ABBOTT LABORATORIES	957.32	1,108.13	11,635	1,615,803	ヘルスケア機器・サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	35.59	42.03	1,502	208,685	素材
VERISK ANALYTICS INC	79.29	96.74	1,711	237,692	商業・専門サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	23.71	28.44	1,162	161,446	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LAS VEGAS SANDS CORP	176.34	234.49	1,047	145,429	消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	22.43	28.87	1,024	142,305	半導体・半導体製造装置
SVB FINANCIAL GROUP	31.11	37.27	816	113,414	銀行
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	339.4	382.49	2,582	358,694	ソフトウェア・サービス
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	14.69	17.45	2,709	376,267	消費者サービス
AFLAC INC	341.85	377.79	2,677	371,862	保険
DARDEN RESTAURANTS INC	76.06	76.06	1,102	153,113	消費者サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	222.02	260.21	2,596	360,594	食品・飲料・タバコ
ADOBE INC	257.02	302.05	9,870	1,370,701	ソフトウェア・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	120.02	140.2	1,491	207,156	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	64.81	72.14	2,620	363,976	耐久消費財・アパレル
GARMIN LTD	84.44	107.74	967	134,372	耐久消費財・アパレル
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	118.18	136.78	4,133	573,979	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	375.49	434.97	9,426	1,309,081	資本財
WR BERKLEY CORP	74.28	144.86	1,087	150,955	保険
AUTOZONE INC	11.37	12.12	3,097	430,209	小売
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	637.19	738.73	640	88,943	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DR HORTON INC	181.62	209.92	1,767	245,514	耐久消費財・アパレル
DENTSPLY SIRONA INC	118.64	118.64	358	49,772	ヘルスケア機器・サービス
AUTODESK INC	115.06	133.58	2,607	362,063	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	121.01	166.41	916	127,263	公益事業
CITIGROUP INC	1,105.27	1,207.48	5,743	797,666	銀行
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	41.86	63.59	774	107,505	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	223.87	269.47	6,926	961,951	ソフトウェア・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	257.27	318.24	3,012	418,296	公益事業
HESS CORP	143.44	179.13	2,543	353,186	エネルギー
DAVITA INC	41.38	41.38	296	41,173	ヘルスケア機器・サービス
DOMINO'S PIZZA INC	21.21	21.21	812	112,827	消費者サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	307.81	353.37	3,722	516,929	各種金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	303.41	365.18	3,522	489,122	食品・飲料・タバコ
BUNGE LTD	71.74	102.63	1,068	148,451	食品・飲料・タバコ
TE CONNECTIVITY LTD	174.25	198.05	2,454	340,874	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	8,929.29	10,249.49	144,692	20,093,385	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	164.25	186.45	2,023	281,061	各種金融
BOEING CO/THE	301.3	353.54	6,198	860,752	資本財
CINCINNATI FINANCIAL CORP	78.58	105.1	1,136	157,818	保険
BECTON DICKINSON AND CO	151.4	184.31	4,442	616,893	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	179.45	-	-	-	消費者サービス
NISOURCE INC	189.19	258.29	703	97,670	公益事業
ABBVIE INC	952.34	1,124.3	17,786	2,470,000	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,231.32	2,671.77	10,243	1,422,524	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	712.57	814.17	25,656	3,562,979	各種金融
KINDER MORGAN INC	1,059.4	1,273.94	2,405	334,009	エネルギー
TRUIST FINANCIAL CORP	703.16	832.28	3,820	530,621	銀行
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,210.07	1,358.37	10,735	1,490,796	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	邦貨換算金額	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	139.37	190.58	754	104,725	保険
CBOE GLOBAL MARKETS INC	56.61	73.23	902	125,338	各種金融
JPMORGAN CHASE & CO	1,618.84	1,865.39	25,473	3,537,541	銀行
T ROWE PRICE GROUP INC	123.14	136.63	1,646	228,634	各種金融
FAIR ISAAC CORP	14.94	14.94	882	122,561	ソフトウェア・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	21.07	28.88	658	91,448	資本財
CIGNA CORP	183.24	203.47	6,525	906,166	ヘルスケア機器・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	30.52	—	—	—	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	161.3	189.5	1,347	187,158	食品・飲料・タバコ
CADENCE DESIGN SYS INC	154	174.92	2,860	397,208	ソフトウェア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	65.01	71.31	2,313	321,326	各種金融
MERCADOLIBRE INC	24.57	28.89	2,569	356,767	小売
DOLLAR GENERAL CORP	127.46	142.55	3,604	500,539	小売
SERVICENOW INC	106.96	129.25	5,129	712,303	ソフトウェア・サービス
CATERPILLAR INC	297.38	340.65	8,009	1,112,260	資本財
BROWN & BROWN INC	142.73	142.73	818	113,692	保険
CHARLES RIVER LABORATORIES	25.77	34.67	830	115,310	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	305.28	366.96	3,097	430,202	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	456.88	517.62	1,729	240,157	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	44.11	55.3	994	138,100	運輸
MOSAIC CO/THE	185.84	213.06	1,080	150,098	素材
CISCO SYSTEMS INC	2,269.38	2,640.08	12,746	1,770,079	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MORGAN STANLEY	755.61	830.31	7,562	1,050,199	各種金融
BROADCOM INC	220.01	257.42	13,421	1,863,860	半導体・半導体製造装置
DELL TECHNOLOGIES -C	145.5	187.97	818	113,601	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DTE ENERGY COMPANY	105.36	120.57	1,376	191,094	公益事業
DOMINION ENERGY INC	443.47	526.1	3,144	436,676	公益事業
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	68.1	79.12	1,620	225,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DEERE & CO	157.22	185.94	8,199	1,138,650	資本財
VMWARE INC-CLASS A	106.05	138.09	1,629	226,340	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE INC	372.5	453.04	3,996	554,961	各種金融
NASDAQ INC	65.09	229.24	1,515	210,426	各種金融
ZOETIS INC	252.46	294.34	4,351	604,336	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONSOLIDATED EDISON INC	183.99	221.6	2,134	296,349	公益事業
KKR & CO INC	285.69	373.08	1,885	261,897	各種金融
COGNEX CORP	86.98	86.98	415	57,676	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALPHABET INC-CL C	156.03	3,569.93	34,071	4,731,496	メディア・娯楽
COLGATE-PALMOLIVE CO	430.41	500.68	3,803	528,215	家庭用品・パーソナル用品
HCA HEALTHCARE INC	143.12	145.75	3,436	477,286	ヘルスケア機器・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	192.52	226.62	5,864	814,462	ヘルスケア機器・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	139.31	171.44	1,454	201,985	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	238.46	281.36	14,882	2,066,777	食品・生活必需品小売り
CUMMINS INC	82.07	91.44	2,253	312,910	資本財
ACTIVISION BLIZZARD INC	400.92	506.81	3,767	523,210	メディア・娯楽
DELTA AIR LINES INC	82.99	82.99	287	39,887	運輸
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	69.25	87.26	851	118,269	運輸
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	95.42	118.11	2,044	283,933	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COTERRA ENERGY INC	402.61	499.08	1,400	194,545	エネルギー
TRANSIDGM GROUP INC	26.81	33.74	2,057	285,757	資本財
MASIMO CORP	29.41	29.41	413	57,443	ヘルスケア機器・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	36.41	42.65	3,624	503,278	小売
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	378.73	462.12	1,898	263,629	食品・生活必需品小売り
SEAGEN INC	77.9	89.54	1,050	145,942	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COCA-COLA CO/THE	2,206.53	2,620.91	16,375	2,274,058	食品・飲料・タバコ
ENTEGRIS INC	—	99.61	721	100,135	半導体・半導体製造装置
EXPEDITORS INTL WASH INC	86.89	104.36	1,185	164,576	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	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
BURLINGTON STORES INC	33.91	48.02	924	128,362	小売
FRANKLIN RESOURCES INC	142.98	217.78	572	79,539	各種金融
CSX CORP	1,218.27	1,372.54	4,415	613,175	運輸
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	49.95	62.45	1,497	207,947	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDIA GROUP INC	80.61	100.81	1,032	143,424	消費者サービス
AMAZON.COM INC	242.97	5,804.71	53,647	7,449,976	小売
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	340.18	390.84	2,925	406,255	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	2,278.12	2,672.58	29,542	4,102,594	エネルギー
EVEREST RE GROUP LTD	20.65	27.55	916	127,324	保険
EOG RESOURCES INC	308.3	370.69	5,237	727,328	エネルギー
EQT CORP	—	192.98	823	114,325	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	83.21	103	937	130,205	ソフトウェア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	79.93	102.49	1,720	238,968	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	168.73	195.56	2,951	409,914	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FORD MOTOR CO	2,091.41	2,562.95	3,524	489,385	自動車・自動車部品
HORMEL FOODS CORP	149.39	194.75	938	130,329	食品・飲料・タバコ
LIBERTY GLOBAL PLC-A	84.32	84.32	166	23,091	電気通信サービス
KRAFT HEINZ CO/THE	384.38	441.24	1,722	239,217	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	102.41	117.21	1,724	239,499	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	175.57	221.16	1,783	247,696	公益事業
PAYPAL HOLDINGS INC	601.25	707.71	5,494	763,043	ソフトウェア・サービス
MSCI INC	43.83	50.79	2,470	343,011	各種金融
FORTINET INC	73.6	433.92	2,238	310,873	ソフトウェア・サービス
ALLY FINANCIAL INC	201.39	201.39	533	74,140	各種金融
ELEVANCE HEALTH INC	133.09	151.16	7,790	1,081,822	ヘルスケア機器・サービス
NEXTERA ENERGY INC	1,059.66	1,254.22	10,346	1,436,757	公益事業
PALO ALTO NETWORKS INC	53.93	186.42	3,178	441,418	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC	333.35	394.41	5,861	814,017	電気通信サービス
ELECTRONIC ARTS INC	153.52	183.78	2,344	325,629	メディア・娯楽
FREEMPORT-MCMORAN INC	808.28	941.69	3,532	490,527	素材
SYNCHRONY FINANCIAL	321.12	321.12	1,197	166,246	各種金融
MARATHON PETROLEUM CORP	339.33	343.63	4,242	589,197	エネルギー
KEURIG DR PEPPER INC	382.44	469.03	1,787	248,161	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	746.23	913.39	4,072	565,590	銀行
AUTOLIV INC	40.01	—	—	—	自動車・自動車部品
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	638.81	861.38	1,331	184,932	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	29.09	39.21	587	81,578	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OLD DOMINION FREIGHT LINE	55.39	62.92	1,837	255,202	運輸
FASTENAL CO	298.92	370.51	1,862	258,652	資本財
FISERV INC	315.64	379.74	3,855	535,360	ソフトウェア・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	589.47	707.21	6,057	841,269	資本財
ALIGN TECHNOLOGY INC	41.54	49.14	942	130,906	ヘルスケア機器・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	25.22	30.07	968	134,453	ソフトウェア・サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	115.82	139.45	1,098	152,522	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	336	46,719	各種金融
TRANSUNION	94.97	112.33	679	94,313	商業・専門サービス
MATCH GROUP INC	137.29	177.99	834	115,875	メディア・娯楽
GODADDY INC - CLASS A	89.05	89.05	668	92,834	ソフトウェア・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	37.79	42.41	947	131,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	689.43	871.13	3,462	480,870	自動車・自動車部品
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	110.49	1,621	225,154	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	71.66	71.66	471	65,420	資本財
HOLOGIC INC	135.92	165.91	1,233	171,347	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	126.42	148.67	3,734	518,663	資本財
GOLDMAN SACHS GROUP INC	181.67	219.77	8,432	1,171,062	各種金融
ALPHABET INC-CL A	161.11	3,806.93	36,238	5,032,394	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	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	42.03	42.03	548	76,198	ヘルスケア機器・サービス
WABTEC CORP	92.31	112.84	1,113	154,663	資本財
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	27.37	32.57	869	120,682	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST REPUBLIC BANK/CA	88.97	109.7	1,333	185,200	銀行
CELANESE CORP	55.98	66.43	701	97,371	素材
VAIL RESORTS INC	20.38	28.6	733	101,794	消費者サービス
MOLINA HEALTHCARE INC	34.28	34.28	1,106	153,629	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	70.02	72.56	2,795	388,223	メディア・娯楽
GENERAL MILLS INC	314.89	373.27	3,092	429,409	食品・飲料・タバコ
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	108.56	135.99	1,618	224,730	ヘルスケア機器・サービス
FIRSTENERGY CORP	269.48	319.66	1,272	176,676	公益事業
GENUINE PARTS CO	74.06	87.11	1,572	218,410	小売
FORTIVE CORP	183.73	219.81	1,441	200,244	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	371.5	424.45	1,528	212,196	銀行
LYLEM INC	91.24	122.01	1,340	186,175	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	110.79	119.65	2,699	374,868	資本財
LKQ CORP	159.22	159.22	842	117,032	小売
HALLIBURTON CO	443.17	548.52	2,038	283,058	エネルギー
TELADOC HEALTH INC	74.96	74.96	203	28,241	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	571.04	650.45	20,551	2,854,003	小売
ALBEMARLE CORP	65.6	74.33	2,007	278,720	素材
CDW CORP/DE	74.04	86.21	1,586	220,380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	31.14	31.14	393	54,656	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	758.17	881.61	1,348	187,316	銀行
HERSHEY CO/THE	75.14	89.25	2,057	285,672	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	67.44	80.18	4,274	593,629	ヘルスケア機器・サービス
BLOCK INC	207.89	314.99	1,956	271,685	ソフトウェア・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	99.21	124.01	2,635	365,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPLUNK INC	82.52	97.92	743	103,196	ソフトウェア・サービス
S&P GLOBAL INC	127.67	217.47	7,549	1,048,364	各種金融
MARKETAXESS HOLDINGS INC	19.12	26.53	679	94,345	各種金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	207.99	303.66	1,268	176,225	銀行
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	41.41	41.41	178	24,767	メディア・娯楽
HP INC	653.88	697.11	2,013	279,580	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	39.15	49.71	924	128,331	ソフトウェア・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	471.43	563.97	8,261	1,147,287	ソフトウェア・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	76.75	83.42	1,521	211,348	ヘルスケア機器・サービス
SNAP INC - A	496.43	640.99	629	87,412	メディア・娯楽
TARGA RESOURCES CORP	-	123.5	910	126,433	エネルギー
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	57.07	107.72	1,091	151,610	メディア・娯楽
LEIDOS HOLDINGS INC	69.47	88.63	961	133,542	商業・専門サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	279.44	304.9	2,117	294,103	素材
LIBERTY GLOBAL PLC-C	210.79	210.79	431	59,891	電気通信サービス
BLACK KNIGHT INC	76.23	106.56	647	89,897	ソフトウェア・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	79.4	79.4	435	60,412	運輸
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	81.95	-	-	-	保険
JUNIPER NETWORKS INC	174.6	174.6	556	77,274	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JM SMUCKER CO/THE	57.68	66.47	1,007	139,863	食品・飲料・タバコ
INGERSOLL-RAND INC	210.13	250.11	1,321	183,458	資本財
JOHNSON & JOHNSON	1,413.74	1,665.36	29,325	4,072,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ON SEMICONDUCTOR	209.12	278.91	1,972	273,914	半導体・半導体製造装置
SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	26.34	33.19	965	134,055	半導体・半導体製造装置
HOWMET AEROSPACE INC	190.24	238.89	889	123,476	資本財
QORVO INC	60.42	60.42	567	78,854	半導体・半導体製造装置
IDEXX LABORATORIES INC	46.01	55.48	2,268	315,083	ヘルスケア機器・サービス
ARISTA NETWORKS INC	129.52	148.47	1,985	275,683	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
EXACT SCIENCES CORP	84.28	97.71			402	55,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EVERGY INC	112.73	133.33			774	107,519	公益事業
RINGCENTRAL INC-CLASS A	39.92	39.92			140	19,452	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	87.57	106.77			963	133,844	半導体・半導体製造装置
KIMBERLY-CLARK CORP	178	213.36			2,841	394,543	家庭用品・パーソナル用品
NORDSON CORP	28.84	28.84			665	92,435	資本財
KROGER CO	389.55	419.15			2,068	287,253	食品・生活必需品小売り
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	87.7	110.8			777	108,030	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	174.17	-			-	-	メディア・娯楽
POOL CORP	21.07	25.78			826	114,830	小売
CAESARS ENTERTAINMENT INC	106.9	133.36			651	90,505	消費者サービス
DOCUSIGN INC	100.78	120.31			536	74,448	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS B	87.73	87.73			262	36,476	メディア・娯楽
DOW INC	415.16	445.43			2,256	313,305	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	52.2	52.2			305	42,428	各種金融
CBRE GROUP INC - A	182.44	207.93			1,589	220,780	不動産
COUPA SOFTWARE INC	34.9	34.9			214	29,786	ソフトウェア・サービス
KLA CORP	81.57	94.74			3,546	492,488	半導体・半導体製造装置
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	110.98	139.27			982	136,485	ソフトウェア・サービス
COPART INC	109.77	275.84			1,777	246,843	商業・専門サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	61.17	70.72			1,548	215,087	小売
NRG ENERGY INC	135.47	135.47			567	78,844	公益事業
WARNER BROS DISCOVERY INC	70.75	-			-	-	メディア・娯楽
TWILIO INC - A	89.93	109.05			498	69,282	ソフトウェア・サービス
CORTEVA INC	393.48	444.4			2,913	404,657	素材
LOCKHEED MARTIN CORP	133.59	153.36			7,424	1,030,992	資本財
IDEX CORP	38.39	47.88			1,106	153,634	資本財
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12.88	12.88			346	48,157	保険
EPAM SYSTEMS INC	30.95	37.33			1,283	178,299	ソフトウェア・サービス
LENNOX INTERNATIONAL INC	15.27	21.04			548	76,209	資本財
EQUITABLE HOLDINGS INC	228.2	228.2			703	97,732	各種金融
CERNER CORP	155.37	-			-	-	ヘルスケア機器・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	153.31	181.57			1,812	251,717	ソフトウェア・サービス
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	-	49.92			1,197	166,314	各種金融
RESMED INC	75.95	87.75			1,958	271,988	ヘルスケア機器・サービス
BATH & BODY WORKS INC	154	154			612	85,094	小売
DATADOG INC - CLASS A	104.23	140.23			1,010	140,327	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	257.77	257.77			624	86,734	公益事業
GENERAC HOLDINGS INC	33	39.73			399	55,537	資本財
LOWE'S COS INC	377.98	400.32			8,305	1,153,376	小売
UNITED RENTALS INC	41.13	47.98			1,644	228,360	資本財
ELI LILLY & CO	439.37	511.14			18,602	2,583,390	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZENDESK INC	60.67	-			-	-	ソフトウェア・サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	80.29	80.29			851	118,266	商業・専門サービス
LAM RESEARCH CORP	77.79	85.5			3,779	524,862	半導体・半導体製造装置
OKTA INC	63.06	103.37			529	73,569	ソフトウェア・サービス
CARVANA CO	38.03	-			-	-	小売
LOEWS CORP	127.27	127.27			735	102,120	保険
BIO-RAD LABORATORIES-A	12.2	12.2			487	67,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARKEL CORP	7.02	8.37			1,080	150,013	保険
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	98.74	130.21			1,796	249,535	ソフトウェア・サービス
GEN DIGITAL INC	313.47	417.79			945	131,237	ソフトウェア・サービス
ROLLINS INC	114.93	160.81			640	88,947	商業・専門サービス
ETSY INC	71.68	71.68			873	121,321	小売
DYNATRACE INC	95.87	95.87			348	48,447	ソフトウェア・サービス
LINCOLN NATIONAL CORP	86.77	86.77			330	45,897	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PLUG POWER INC	285.84	285.84	425	59,144	資本財
MCDONALD'S CORP	402.64	468.04	12,703	1,764,075	消費者サービス
BILL.COM HOLDINGS INC	—	60.04	688	95,609	ソフトウェア・サービス
CABLE ONE INC	2.46	3.88	279	38,793	メディア・娯楽
3M CO	306.04	351.01	4,427	614,817	資本財
APOLLO ASSET MANAGEMENT INC	105.66	—	—	—	各種金融
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,284.02	1,451.52	15,888	2,206,413	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	72.93	83.02	2,518	349,777	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	44.7	59.08	1,421	197,423	ソフトウェア・サービス
COSTAR GROUP INC	205.4	251.16	1,965	272,924	商業・専門サービス
IAC INC	39.74	39.74	193	26,815	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	100.46	147.43	2,013	279,587	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	115.46	144.87	747	103,869	ソフトウェア・サービス
VIATRIS INC	630.72	834.66	933	129,586	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	116.27	620	86,124	小売
ZSCALER INC	45.51	45.51	613	85,224	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	121.71	149.28	2,075	288,174	資本財
MODERNA INC	178.13	219.41	3,799	527,578	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	139.92	2,049	284,659	小売
PELTON INTERACTIVE INC-A	125.99	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FOX CORP - CLASS A	169.62	169.62	538	74,716	メディア・娯楽
PHILLIPS 66	224.92	312.8	3,408	473,349	エネルギー
ROBLOX CORP -CLASS A	—	227.45	678	94,220	メディア・娯楽
MGM RESORTS INTERNATIONAL	221.98	221.98	796	110,543	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	130.84	151.62	1,269	176,339	食品・飲料・タバコ
APA CORP	—	197.59	920	127,839	エネルギー
METLIFE INC	397.03	437.46	3,327	462,125	保険
MOTOROLA SOLUTIONS INC	92.12	106.92	2,827	392,669	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCKWELL AUTOMATION INC	62.19	70.31	1,825	253,501	資本財
MERCK & CO. INC.	1,364.93	1,609.11	17,513	2,432,107	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	742	103,085	資本財
MARSH & MCLENNAN COS	266.25	317.65	5,358	744,082	保険
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	445.47	496.81	2,227	309,360	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	147.15	181.85	2,932	407,238	消費者サービス
WORKDAY INC-CLASS A	98.64	120.69	1,729	240,173	ソフトウェア・サービス
SUNRUN INC	106.69	—	—	—	資本財
BAKER HUGHES CO	374.18	609.81	1,747	242,620	エネルギー
AMERCO	6.5	—	—	—	運輸
MARVELL TECHNOLOGY INC	451.11	533.45	2,289	317,878	半導体・半導体製造装置
CHENIERE ENERGY INC	137.63	149.77	2,585	359,087	エネルギー
QUANTA SERVICES INC	—	88.91	1,285	178,474	資本財
NETAPP INC	109.19	132.73	952	132,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NIKE INC -CL B	687.23	811.97	8,627	1,198,056	耐久消費財・アパレル
NORFOLK SOUTHERN CORP	137.09	150.62	3,816	529,942	運輸
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	287.04	364.42	2,704	375,605	半導体・半導体製造装置
AFFIRM HOLDINGS INC	—	90.77	116	16,147	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	—	72.52	312	43,415	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	82.15	95.11	5,025	697,840	資本財
NEWMONT CORP	418.82	508.98	2,329	323,441	素材
MCKESSON CORP	84.11	94.17	3,595	499,268	ヘルスケア機器・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	843.16	990.61	9,687	1,345,258	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP	154.55	174.84	2,569	356,892	素材
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	276.58	276.58	205	28,537	メディア・娯楽
WESTERN UNION CO	218.4	218.4	316	43,886	ソフトウェア・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	—	193.54	558	77,539	自動車・自動車部品
NEWELL BRANDS INC	175.87	269.97	347	48,250	耐久消費財・アパレル

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	485.8	586.43	4,052	562,814	エネルギー
LUCID GROUP INC	—	217.3	212	29,452	自動車・自動車部品
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	242.07	1,594	221,363	各種金融
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	6.7	535	74,398	銀行
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	96	512	71,190	銀行
CONSTELLATION ENERGY	—	202.34	1,910	265,338	公益事業
WARNER BROS DISCOVERY INC	—	1,361.45	1,516	210,617	メディア・娯楽
APPLOVIN CORP-CLASS A	—	89.26	119	16,659	ソフトウェア・サービス
ALCOA CORP	—	118.49	565	78,488	素材
CARLISLE COS INC	—	34.99	894	124,163	資本財
PAYCHEX INC	177.29	208.31	2,502	347,570	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	989.56	1,164.8	5,337	741,164	食品・飲料・タバコ
P G & E CORP	765.38	918.94	1,394	193,589	公益事業
PFIZER INC	3,012.01	3,564.55	17,640	2,449,799	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	292.37	335.65	2,310	320,921	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	66.91	80.47	2,368	328,865	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	121.84	145.47	3,502	486,409	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,315.39	1,518.47	22,090	3,067,735	家庭用品・パーソナル用品
EXELON CORP	508.37	643.53	2,574	357,468	公益事業
NVR INC	1.73	1.73	788	109,501	耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS	734.21	825.11	10,251	1,423,694	エネルギー
ABIOMED INC	22.88	27.31	1,030	143,103	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	744.41	879.89	16,065	2,231,073	食品・飲料・タバコ
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	207.28	229.33	2,444	339,457	保険
ACCENTURE PLC-CL A	339.89	404.16	11,638	1,616,307	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	82.2	82.2	367	51,002	資本財
QUALCOMM INC	608.94	716.9	8,486	1,178,542	半導体・半導体製造装置
ADVANCE AUTO PARTS INC	34.26	34.26	506	70,380	小売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	141.24	164.09	1,474	204,720	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	54.95	68.37	5,032	698,874	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	142.32	1,944	270,074	商業・専門サービス
BOOKING HOLDINGS INC	22.31	26.17	5,278	733,081	消費者サービス
ROSS STORES INC	187.92	222.58	2,599	360,994	小売
PACKAGING CORP OF AMERICA	46.82	55.5	736	102,267	素材
QUEST DIAGNOSTICS INC	68.14	68.14	1,015	141,002	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC	55.55	81.49	621	86,243	商業・専門サービス
RPM INTERNATIONAL INC	76.96	76.96	782	108,659	素材
PERKINELMER INC	56.24	83.23	1,112	154,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEICO CORP	18.88	30.85	483	67,076	資本財
HEICO CORP-CLASS A	45.7	45.7	559	77,698	資本財
REGIONS FINANCIAL CORP	470.41	629.79	1,442	200,368	銀行
TEXAS PACIFIC LAND CORP	—	4.17	1,045	145,141	エネルギー
AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	—	276.58	29	4,032	メディア・娯楽
CHEVRON CORP	1,041.57	1,181.31	21,385	2,969,770	エネルギー
JACOBS SOLUTIONS INC	—	84.22	1,033	143,587	商業・専門サービス
EDISON INTERNATIONAL	217.01	246.55	1,565	217,448	公益事業
IPG PHOTONICS CORP	17.76	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TESLA INC	438.7	1,671.95	30,233	4,198,577	自動車・自動車部品
AMERCO-NON VOTING	—	58.5	352	48,889	運輸
STANLEY BLACK & DECKER INC	91.29	91.29	734	102,066	資本財
SYNOPSYS INC	78.69	93.83	3,036	421,734	ソフトウェア・サービス
SOUTHERN CO/THE	556.86	685.72	4,507	625,920	公益事業
SYSCO CORP	268.62	311.26	2,648	367,798	食品・生活必需品小売り
TRAVELERS COS INC/THE	131.26	150.31	2,813	390,773	保険
SIGNATURE BANK	—	43.35	587	81,619	銀行
SCHLUMBERGER LTD	734.44	894.55	4,566	634,174	エネルギー

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
AT&T INC	3,854.89	4,577.81	8,702	1,208,504	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	70.76	70.76	277	38,568	運輸
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	136.16	151.87	3,668	509,475	素材
SEMPRA ENERGY	163.53	199	3,210	445,809	公益事業
TYLER TECHNOLOGIES INC	20.16	24.06	779	108,305	ソフトウェア・サービス
TEXAS INSTRUMENTS INC	498.76	588.9	10,186	1,414,639	半導体・半導体製造装置
SALESFORCE INC	522.57	635.19	9,634	1,337,951	ソフトウェア・サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	388.03	428.95	2,805	389,576	資本財
TERADYNE INC	85.42	106.42	949	131,809	半導体・半導体製造装置
UNION PACIFIC CORP	359.04	402.07	8,554	1,188,011	運輸
MARATHON OIL CORP	—	423.8	1,286	178,619	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	820.39	930.88	9,069	1,259,490	資本財
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	391.13	470.01	8,690	1,206,782	運輸
DEXCOM INC	50.47	248.41	2,742	380,809	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	147.6	169.37	1,477	205,192	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	506.62	593.75	31,350	4,353,574	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	52.27	64.25	1,252	173,951	ソフトウェア・サービス
VALERO ENERGY CORP	214.47	258.28	3,491	484,926	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	27.65	32.87	1,478	205,354	小売
WALT DISNEY CO/THE	976.83	1,161.43	10,997	1,527,234	メディア・娯楽
WELLS FARGO & CO	2,228.62	2,398.83	11,411	1,584,678	銀行
INSULET CORP	34	42.63	1,230	170,828	ヘルスケア機器・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	220.23	268.28	4,428	615,022	商業・専門サービス
WHIRLPOOL CORP	32.12	32.12	468	65,114	耐久消費財・アパレル
WALMART INC	833.65	964.31	14,751	2,048,478	食品・生活必需品小売り
WYNN RESORTS LTD	49.13	77.3	620	86,188	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	638.82	734.17	5,885	817,264	小売
WATERS CORP	34.25	40.95	1,352	187,752	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	161.22	2,270	315,276	商業・専門サービス
WESTERN DIGITAL CORP	148.57	184.92	666	92,524	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEC ENERGY GROUP INC	164.38	197.74	1,917	266,308	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	272.31	330.85	1,928	267,814	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	908.92	1,041.54	21,774	3,023,815	ソフトウェア・サービス
PPL CORP	395.61	471.99	1,369	190,212	公益事業
PULTEGROUP INC	130.75	130.75	576	80,055	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	122.56	151.81	2,001	277,922	素材
NORTHERN TRUST CORP	110.23	130.26	1,195	165,986	各種金融
NVIDIA CORP	1,335.64	1,588.98	24,850	3,450,927	半導体・半導体製造装置
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	231.68	262.02	4,306	598,088	銀行
TYSON FOODS INC-CL A	149.49	197.31	1,311	182,075	食品・飲料・タバコ
NETFLIX INC	238.52	284.48	7,992	1,109,953	メディア・娯楽
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	211.63	247.75	13,372	1,857,012	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBE LIFE INC	43.33	63.73	747	103,812	保険
TEXTRON INC	118.03	148.7	1,045	145,231	資本財
NEWS CORP - CLASS A	231.02	231.02	428	59,543	メディア・娯楽
OMNICOM GROUP	104.17	125.45	988	137,209	メディア・娯楽
ORACLE CORP	1,012.06	1,003.64	8,114	1,126,850	ソフトウェア・サービス
MASTERCARD INC - A	475.6	549.61	18,858	2,618,917	ソフトウェア・サービス
LUMEN TECHNOLOGIES INC	497.58	497.58	272	37,797	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	56.57	66.85	2,842	394,779	ソフトウェア・サービス
YUM! BRANDS INC	155.49	180.46	2,274	315,862	消費者サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	96.29	96.29	528	73,437	食品・飲料・タバコ
BANK OF AMERICA CORP	4,143.47	4,589.12	16,979	2,357,977	銀行
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	90.8	115.57	1,122	155,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN EXPRESS CO	370.2	405.11	6,255	868,730	各種金融
ANALOG DEVICES INC	292.73	334.95	5,489	762,326	半導体・半導体製造装置

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
ADVANCED MICRO DEVICES	656.29	1,013.83	7,440	1,033,262			半導体・半導体製造装置
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	447.45	505.66	3,106	431,437			保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	118.9	160.97	964	133,966			消費者サービス
AVERY DENNISON CORP	42.32	54.54	1,027	142,708			素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	293.48	327.59	1,953	271,225			ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	311.78	366.97	3,460	480,614			資本財
AMGEN INC	311.56	334.61	9,435	1,310,331			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EATON CORP PLC	213.26	250.62	4,063	564,340			資本財
CONSTELLATION BRANDS INC-A	88.81	104.39	2,647	367,692			食品・飲料・タバコ
APPLIED MATERIALS INC	496.83	539.08	5,566	772,950			半導体・半導体製造装置
CME GROUP INC	187.12	232.52	4,064	564,462			各種金融
ECOLAB INC	141.57	164.6	2,385	331,235			素材
EQUIFAX INC	68.41	79.22	1,496	207,836			商業・専門サービス
GILEAD SCIENCES INC	656.73	791.25	6,785	942,338			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	240.45	1,777	246,861			各種金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	773	912.82	7,338	1,019,050			各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	264.34	307.26	1,700	236,131			ヘルスケア機器・サービス
CAMPBELL SOUP CO	106.38	129.45	681	94,593			食品・飲料・タバコ
CROWN HOLDINGS INC	68.63	68.63	550	76,464			素材
CARDINAL HEALTH INC	151.14	180	1,415	196,598			ヘルスケア機器・サービス
FEDEX CORP	130.83	154.88	2,754	382,458			運輸
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	236.54	248.92	2,540	352,865			各種金融
FMC CORP	66.76	85.48	1,091	151,599			素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	139.22	156.29	1,600	222,248			素材
CITRIX SYSTEMS INC	64.9	-	-	-			ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	2,177.38	2,618.39	7,567	1,050,849			半導体・半導体製造装置
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	196.26	260.27	892	124,009			メディア・娯楽
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	183.31	217.67	1,650	229,217			保険
ILLINOIS TOOL WORKS	168.69	196.22	4,402	611,387			資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	676.56	565.5	362	50,338			メディア・娯楽
ILLUMINA INC	76.55	103.27	2,153	299,112			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	67.76	887	123,297			ソフトウェア・サービス
SNAP-ON INC	31.06	31.06	742	103,165			資本財
CARMAX INC	84.27	103.66	695	96,621			小売
DANAHER CORP	346.32	437.14	11,322	1,572,397			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DUKE ENERGY CORP	420.41	496.46	4,862	675,231			公益事業
TARGET CORP	268.17	293.11	4,876	677,195			小売
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	69.27	-	-	-			商業・専門サービス
CINTAS CORP	51.69	57.07	2,572	357,185			商業・専門サービス
CONAGRA BRANDS INC	246.39	308.96	1,141	158,577			食品・飲料・タバコ
CLOROX COMPANY	65.42	73.84	1,088	151,177			家庭用品・パーソナル用品
ENTERGY CORP	108.66	126.77	1,430	198,596			公益事業
MICROSOFT CORP	3,828.65	4,500.54	108,161	15,020,384			ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	92.43	118.42	921	127,941			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CVS HEALTH CORP	693.53	821.13	8,283	1,150,337			ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	726.98	842.2	6,441	894,481			ヘルスケア機器・サービス
MICRON TECHNOLOGY INC	612.23	722.06	3,979	552,701			半導体・半導体製造装置
BLACKROCK INC	82.52	95.88	6,845	950,680			各種金融
HASBRO INC	74.91	74.91	465	64,673			耐久消費財・アパレル
KEYCORP	511.28	627.41	1,165	161,797			銀行
KANSAS CITY SOUTHERN	48.66	-	-	-			運輸
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	751.11	889.48	5,875	815,863			食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	27.71	27.71	851	118,305			ヘルスケア機器・サービス
CHUBB LTD	245.24	269.75	5,844	811,687			保険
ARROW ELECTRONICS INC	41.3	41.3	438	60,926			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALLSTATE CORP	164.19	180.7	2,410	334,701			保険

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
EBAY INC	355.51	355.51	1,556	216,091	小売
EASTMAN CHEMICAL CO	70.27	70.27	599	83,190	素材
XILINX INC	128.76	—	—	—	半導体・半導体製造装置
DISH NETWORK CORP-A	129.37	129.37	202	28,170	メディア・娯楽
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	124	142.45	3,061	425,194	家庭用品・パーソナル用品
TRIMBLE INC	127.59	155.66	877	121,895	テクノロジ・ハードウェアおよび機器
LENNAR CORP-A	144.94	171.26	1,479	205,484	耐久消費財・アパレル
LEAR CORP	37.36	37.36	523	72,712	自動車・自動車部品
STRYKER CORP	179.83	215.14	4,887	678,793	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	336.56	418.93	1,183	164,407	公益事業
PROGRESSIVE CORP	305.43	366.19	4,801	666,781	保険
AIRBNB INC-CLASS A	65.54	232.6	2,218	308,088	消費者サービス
ALLEGHANY CORP	6.89	—	—	—	保険
ALTICE USA INC- A	96.67	—	—	—	メディア・娯楽
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	35.39	48.66	681	94,576	保険
AMPHENOL CORP-CL A	313.96	378.96	2,933	407,326	テクノロジ・ハードウェアおよび機器
ARAMARK	132.42	132.42	537	74,604	消費者サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	88.08	116.82	438	60,835	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	69.65	87.26	1,035	143,765	公益事業
AVALARA INC	43.19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	304.28	373.82	796	110,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PACCAR INC	180.41	218.97	2,282	317,037	資本財
BIO-TECHNE CORP	19.91	25.51	834	115,866	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CMS ENERGY CORP	169.96	169.96	1,023	142,086	公益事業
CARLYLE GROUP INC/THE	100.94	100.94	301	41,884	各種金融
CARRIER GLOBAL CORP	432.53	558.22	2,429	337,367	資本財
CATALENT INC	89.35	107.97	509	70,740	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTERPOINT ENERGY INC	320.03	370.91	1,134	157,512	公益事業
CERIDIAN HCM HOLDING INC	69.79	69.79	447	62,133	ソフトウェア・サービス
CHEWY INC - CLASS A	39.69	39.69	159	22,157	小売
CHURCH & DWIGHT CO INC	124.85	143.3	1,139	158,185	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	126.73	141.79	632	87,838	ソフトウェア・サービス
DEVON ENERGY CORP	361.96	401.69	2,711	376,533	エネルギー
DOVER CORP	82.25	89.29	1,244	172,814	資本財
DRAFTKINGS HOLDINGS INC	167.42	—	—	—	消費者サービス
DROPBOX INC-CLASS A	165.84	165.84	373	51,910	ソフトウェア・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	208.11	208.11	254	35,402	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ESSENTIAL UTILITIES INC	139.09	139.09	654	90,879	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	19.39	23.77	1,067	148,251	各種金融
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	43.71	43.71	831	115,451	ソフトウェア・サービス
GARTNER INC	45.68	53.57	1,821	252,994	ソフトウェア・サービス
VW GRAINGER INC	23.9	27.97	1,652	229,551	資本財
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	47.31	47.31	269	37,396	ソフトウェア・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	146.17	174.62	2,422	336,461	消費者サービス
HUBSPOT INC	22.75	25.61	723	100,534	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	191.4	234.72	852	118,419	素材
KELLOGG CO	129.49	158.43	1,147	159,288	食品・飲料・タバコ
LAMB WESTON HOLDINGS INC	74.17	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LIBERTY BROADBAND-A	13.12	—	—	—	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	81.96	81.96	732	101,787	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	76.48	123.83	531	73,754	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	102.88	134.38	794	110,363	メディア・娯楽
LYFT INC-A	131.45	187.51	201	28,018	運輸
M & T BANK CORP	72.37	110.46	1,887	262,184	銀行
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	12.58	13.69	1,933	268,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONGODB INC	31.55	41.5	590	82,008	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	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
MOODY'S CORP	92.47	105.11	3,043	422,616	各種金融
BIOGEN INC	79.87	95.74	2,789	387,441	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVAVAX INC	36.01	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	247.25	282.26	1,832	254,430	エネルギー
OTIS WORLDWIDE CORP	211.11	253.48	1,948	270,623	資本財
OWENS CORNING	52.05	52.05	466	64,786	資本財
PPD INC	64.13	—	—	—	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	987.35	699	97,076	ソフトウェア・サービス
PINNACLE WEST CAPITAL	59.96	—	—	—	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	285.63	383	919	127,649	メディア・娯楽
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	96.39	115.2	1,329	184,566	各種金融
ROKU INC	60.12	60.12	325	45,234	メディア・娯楽
HENRY SCHEIN INC	75.59	75.59	609	84,607	ヘルスケア機器・サービス
SEALED AIR CORP	78.95	78.95	410	57,044	素材
SMITH (A. O.) CORP	71.57	71.57	432	60,120	資本財
STEEL DYNAMICS INC	101.91	127.13	1,304	181,206	素材
UNITY SOFTWARE INC	28.53	190.66	686	95,369	ソフトウェア・サービス
10X GENOMICS INC-CLASS A	38.14	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STARBUCKS CORP	638.21	734.09	7,242	1,005,770	消費者サービス
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	241	289.06	1,407	195,450	メディア・娯楽
TWITTER INC	407.95	—	—	—	メディア・娯楽
UGI CORP	105.88	152.56	577	80,167	公益事業
UBER TECHNOLOGIES INC	671.87	962.42	2,671	371,015	運輸
VOYA FINANCIAL INC	73.08	—	—	—	各種金融
WAYFAIR INC- CLASS A	37.56	37.56	118	16,518	小売
WESTLAKE CORP	—	21.89	234	32,578	素材
WESTROCK CO	130.34	167.66	615	85,494	素材
PTC INC	54.62	72.95	897	124,676	ソフトウェア・サービス
WILLIAMS COS INC	648.02	755.29	2,592	359,972	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	31.54	—	—	—	不動産
ZILLOW GROUP INC - C	79.06	106.72	376	52,330	不動産
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—	153.82	408	56,670	メディア・娯楽
BOSTON BEER COMPANY INC-A	4.67	—	—	—	食品・飲料・タバコ
OAK STREET HEALTH INC	62.12	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	147.65	171.98	6,530	906,856	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	120.75	174.33	730	101,509	自動車・自動車部品
BEST BUY CO INC	121.32	121.32	1,021	141,790	小売
BALL CORP	171.66	194.1	1,062	147,549	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	745.56	896.31	3,988	553,894	ヘルスケア機器・サービス
VULCAN MATERIALS CO	75.55	87.62	1,563	217,134	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	135.3	161.59	5,111	709,844	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	171.17	205.83	668	92,782	耐久消費財・アパレル
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	323.81	409.64	809	112,351	メディア・娯楽
MOHAWK INDUSTRIES INC	28.63	28.63	288	40,132	耐久消費財・アパレル
CARNIVAL CORP	481.56	697.45	680	94,433	消費者サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	—	334.03	505	70,229	素材
COMCAST CORP-CLASS A	2,468.63	2,796.7	9,922	1,377,964	メディア・娯楽
APTIV PLC	141.47	174.16	1,774	246,402	自動車・自動車部品
STERIS PLC	52.82	62.71	1,118	155,351	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	68.23	68.23	1,627	225,981	保険
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	122.53	132.6	683	94,961	食品・飲料・タバコ
LINDE PLC	280.91	320.85	10,651	1,479,140	素材
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	74.31	207.85	895	124,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	76	76	334	46,438	資本財
NXP SEMICONDUCTORS NV	144.57	165.94	2,732	379,513	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	—	87.8	528	73,449	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	
SEA LTD-ADR	37.25	247.19	1,341	186,259	メディア・娯楽
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	-	966.61	273	37,987	運輸
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	115	116	563	78,289	資本財
TELEFLEX INC	23.4	30.67	693	96,320	ヘルスケア機器・サービス
WIX.COM LTD	31.94	31.94	270	37,502	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	20.55	23	347	48,194	ソフトウェア・サービス
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	-	62.49	133	18,588	運輸
ALLEGION PLC	47.64	47.64	527	73,282	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	204.76	253.2	1,493	207,384	保険
TRANE TECHNOLOGIES PLC	127.59	143.63	2,513	349,033	資本財
NOVOCURE LTD	45.17	69.29	517	71,859	ヘルスケア機器・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	118	118	607	84,309	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	26.04	40.89	636	88,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	523	791	314	43,718	不動産
AMCOR PLC	823.02	976.1	1,182	164,152	素材
AON PLC-CLASS A	120.05	131.51	3,981	552,869	保険
IHS MARKIT LTD	195.84	-	-	-	商業・専門サービス
INVESCO LTD	183.28	183.28	345	47,951	各種金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	31.59	53.75	314	43,665	各種金融
CLARIVATE PLC	199.39	199.39	182	25,391	商業・専門サービス
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	2,163,247	300,410,237	
	598銘柄	597銘柄	-	<67.9%>	
(カナダ)			千カナダ・ドル		
IMPERIAL OIL LTD	129.99	162.67	1,268	129,590	エネルギー
METRO INC/CN	131.09	147.65	1,149	117,428	食品・生活必需品小売り
HYDRO ONE LTD	188.21	188.21	689	70,392	公益事業
TECK RESOURCES LTD-CLS B	248.14	298.36	1,432	146,336	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	170.08	-	-	-	資本財
WEST FRASER TIMBER CO LTD	44.38	44.38	480	49,051	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC	10.26	13.38	2,821	288,283	ソフトウェア・サービス
WSP GLOBAL INC	61.41	76.68	1,228	125,455	資本財
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	133.85	-	-	-	素材
ATCO LTD -CLASS I	30.3	-	-	-	公益事業
AIR CANADA	120.83	120.83	228	23,354	運輸
NUTRIEN LTD	298.98	340.81	3,778	386,017	素材
QUEBECOR INC -CL B	99.53	145.78	421	43,085	メディア・娯楽
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	313.59	441.54	437	44,701	公益事業
LUNDIN MINING CORP	464.46	464.46	382	39,098	素材
ALTAGAS LTD	173.47	173.47	388	39,732	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	-	50.97	723	73,909	運輸
TOURMALINE OIL CORP	-	204.01	1,654	169,025	エネルギー
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	-	529.06	3,240	331,048	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	243.35	310.91	1,593	162,814	素材
ARC RESOURCES LTD	-	449.23	870	88,895	エネルギー
BRP INC/CA- SUB VOTING	-	30.82	299	30,575	耐久消費財・アパレル
INTACT FINANCIAL CORP	100.95	114.16	2,275	232,435	保険
BCE INC	55.09	55.09	352	36,024	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	101.65	127.89	2,465	251,871	素材
SUNCOR ENERGY INC	786.42	932.93	4,238	432,984	エネルギー
NATIONAL BANK OF CANADA	169.93	225.33	2,217	226,560	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	633.07	742.87	5,175	528,736	銀行
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	235.13	589.41	3,783	386,514	銀行
TORONTO-DOMINION BANK	984.88	1,164.32	10,431	1,065,645	銀行
ROYAL BANK OF CANADA	770.35	905.61	12,114	1,237,601	銀行
TC ENERGY CORP	539.18	618.97	3,791	387,371	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	930.98	1,147.92	2,477	253,071	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 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
THOMSON REUTERS CORP	97.1	113.7	1,753	179,112	商業・専門サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	91.48	91.48	334	34,186	食品・生活必需品小売り
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	182.36	225.95	1,386	141,683	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	134.47	272.43	1,845	188,585	素材
KINROSS GOLD CORP	635.01	635.01	347	35,485	素材
BANK OF MONTREAL	354.24	425.03	5,548	566,818	銀行
CAMECO CORP	188.9	266.27	842	86,094	エネルギー
TELUS CORP	152.22	152.22	434	44,413	電気通信サービス
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	30.01	30.01	446	45,650	小売
IVANHOE MINES LTD-CL A	326.98	326.98	374	38,281	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	643.74	723.31	5,837	596,393	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	13.93	13.93	1,094	111,854	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	163.31	189.21	1,548	158,194	自動車・自動車部品
WESTON (GEORGE) LTD	35.78	49.84	846	86,486	食品・生活必需品小売り
PAN AMERICAN SILVER CORP	117.63	117.63	243	24,923	素材
BLACKBERRY LTD	259.93	486.54	318	32,556	ソフトウェア・サービス
ENBRIDGE INC	1,077.03	1,275.5	7,081	723,453	エネルギー
MANULIFE FINANCIAL CORP	998.1	1,214.16	2,907	297,072	保険
BAUSCH HEALTH COS INC	164.47	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	347.38	581.52	6,333	647,072	運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	90.66	113.02	431	44,071	耐久消費財・アパレル
CGI INC	114.93	134.76	1,558	159,188	ソフトウェア・サービス
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	272.32	311.75	1,144	116,947	メディア・娯楽
IGM FINANCIAL INC	49.49	49.49	192	19,621	各種金融
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	316.72	414.52	1,298	132,631	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	442.7	—	—	—	食品・生活必需品小売り
YAMANA GOLD INC	535.88	—	—	—	素材
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	56.67	79.3	573	58,629	商業・専門サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	694.48	881.4	5,381	549,807	各種金融
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	63.36	63.36	270	27,587	公益事業
B2GOLD CORP	429.63	—	—	—	素材
CAE INC	128.91	179.63	515	52,667	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B	87.05	87.05	559	57,119	素材
CANADIAN NATL RAILWAY CO	386.87	364.38	6,194	632,788	運輸
CANADIAN UTILITIES LTD-A	73.44	73.44	266	27,249	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	112.51	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENOVUS ENERGY INC	750.6	856.69	2,371	242,253	エネルギー
DOLLARAMA INC	170.25	170.25	1,386	141,646	小売
EMERA INC	142.79	180	928	94,849	公益事業
FIRSTSERVICE CORP	25.16	25.16	426	43,613	不動産
FORTIS INC	241.71	301.71	1,612	164,747	公益事業
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	99.13	99.13	378	38,705	商業・専門サービス
GREAT-WEST LIFE CO INC	142	142	454	46,479	保険
IA FINANCIAL CORP INC	48.51	82.68	624	63,805	保険
KEYERA CORP	113.74	113.74	345	35,335	エネルギー
LIGHTSPEED COMMERCE INC	63.63	63.63	132	13,514	ソフトウェア・サービス
LOBLAW COMPANIES LTD	86.83	115.73	1,403	143,365	食品・生活必需品小売り
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC	30.84	50.42	195	19,990	ソフトウェア・サービス
NORTHLAND POWER INC	108.7	157.41	592	60,528	公益事業
ONEX CORPORATION	42.17	42.17	290	29,656	各種金融
OPEN TEXT CORP	136.65	153.37	604	61,748	ソフトウェア・サービス
PARKLAND CORP	76.66	76.66	214	21,928	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	321.72	373.48	1,804	184,363	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	317.68	317.68	1,063	108,656	保険
RESTAURANT BRANDS INTERN	145.1	192.7	1,701	173,809	消費者サービス
SAPUTO INC	134.25	134.25	433	44,244	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	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
SHOPIFY INC - CLASS A	60.82	709.5	3,579	365,674	ソフトウェア・サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	305.5	370.83	2,323	237,418	保険
TMX GROUP LTD	31.42	31.42	434	44,360	各種金融
TOROMONT INDUSTRIES LTD	38.43	60.27	613	62,686	資本財
小 計	21,673.53 88銘柄	25,581.42 85銘柄	154,244 —	15,757,631 —	< 3.6% >
<b>(オーストラリア)</b>					
AURIZON HOLDINGS LTD	944.4	1,302.51	487	45,201	運輸
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	57.83	—	—	—	各種金融
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	658.44	658.44	693	64,395	素材
BHP GROUP LTD	1,575.18	3,236.91	14,507	1,346,181	素材
REA GROUP LTD	28.33	28.33	347	32,267	メディア・娯楽
AUSNET SERVICES	1,377.72	—	—	—	公益事業
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	37.94	37.94	248	23,094	消費者サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287.24	1,287.24	374	34,757	保険
SOUTH32 LTD	2,763.48	2,763.48	1,124	104,364	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	503.54	1,194.9	4,400	408,351	エネルギー
IDP EDUCATION LTD	—	109.4	322	29,895	消費者サービス
WISETECH GLOBAL LTD	79.09	106.21	590	54,765	ソフトウェア・サービス
XERO LTD	74.59	86.83	603	55,995	ソフトウェア・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	140.25	127.22	354	32,923	エネルギー
AFTERPAY LTD	114.91	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	884.48	1,052	2,047	189,958	素材
COLES GROUP LTD	735.52	847.99	1,446	134,236	食品・生活必需品小売り
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	656.07	893.18	628	58,346	食品・生活必需品小売り
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,731.85	2,073.67	6,571	609,765	銀行
LOTTERY CORP LTD/THE	—	1,397.85	637	59,146	消費者サービス
WESTPAC BANKING CORP	2,017.31	2,273.53	5,417	502,719	銀行
TELSTRA GROUP LTD	—	2,733.43	1,093	101,453	電気通信サービス
SANTOS LTD	1,003.76	2,138.11	1,567	145,423	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,480.02	1,832.88	4,565	423,651	銀行
RIO TINTO LTD	193.36	227.51	2,453	227,636	素材
ORIGIN ENERGY LTD	880.6	1,109.98	884	82,087	公益事業
EVOLUTION MINING LTD	844.2	844.2	225	20,914	素材
OIL SEARCH LTD	1,056.18	—	—	—	エネルギー
SEEK LTD	172.66	219.57	488	45,291	メディア・娯楽
AGL ENERGY LTD	324.92	—	—	—	公益事業
TREASURY WINE ESTATES LTD	364.64	456.84	624	57,904	食品・飲料・タバコ
NEWCREST MINING LTD	421.31	540.82	1,061	98,508	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	960.41	1,070.36	11,569	1,073,535	銀行
AMPOL LTD	109.27	144.28	411	38,168	エネルギー
ORICA LTD	179.81	362.12	542	50,300	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	808.63	1,018.6	1,320	122,492	保険
WOOLWORTHS GROUP LTD	656.07	747.6	2,615	242,724	食品・生活必需品小売り
TABCORP HOLDINGS LTD	1,128.17	—	—	—	消費者サービス
CROWN RESORTS LTD	218.63	—	—	—	消費者サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	458.31	782.26	484	44,930	運輸
TELSTRA CORP LTD	2,169.43	—	—	—	電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	261.08	261.08	767	71,223	素材
MACQUARIE GROUP LTD	189.53	226.04	4,023	373,341	各種金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	307.49	377.19	1,337	124,073	消費者サービス
CSL LTD	247.47	304.42	9,211	854,701	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESFARMERS LTD	606.28	732.5	3,542	328,696	小売
COCHLEAR LTD	33.68	40.95	865	80,334	ヘルスケア機器・サービス
BLUESCOPE STEEL LTD	254.62	372.14	636	59,082	素材
SUNCORP GROUP LTD	639.33	882.34	1,058	98,246	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	
ASX LTD	111.8	111.8	775	71,922	各種金融
COMPUTERSHARE LTD	335.63	287.38	794	73,758	ソフトウェア・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,171.87	1,737.55	834	77,389	保険
SONIC HEALTHCARE LTD	242.58	311.26	986	91,497	ヘルスケア機器・サービス
BRAMBLES LTD	746.38	860.89	1,034	96,018	商業・専門サービス
MINERAL RESOURCES LTD	—	116.62	976	90,648	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	94.46	107.81	705	65,464	ヘルスケア機器・サービス
REECE LTD	193.09	130.59	202	18,782	資本財
小 計	株 数 銘柄 数	株 数 銘柄 数	98,465	9,136,574	
	金額 比率	金額 比率	—	< 2.1% >	
(香港)			千香港・ドル		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	715	915	3,660	65,074	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,180	1,490	6,801	120,936	消費者サービス
MTR CORP	845	845	3,147	55,964	運輸
SUN HUNG KAI PROPERTIES	680	890	8,250	146,690	不動産
SINO LAND CO	2,482	2,482	2,479	44,085	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	270	270	1,625	28,899	不動産
CLP HOLDINGS LTD	851	941	5,316	94,530	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	833.84	833.84	2,026	36,026	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	6,063.89	7,223.89	4,767	84,770	公益事業
HANG SENG BANK LTD	388	482	5,755	102,325	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	848.33	848.33	1,571	27,934	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,539.24	1,734.24	7,674	136,443	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,029.24	1,269.24	5,984	106,403	不動産
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	629	738	22,140	393,649	各種金融
WH GROUP LTD	5,815	5,610	2,524	44,885	食品・飲料・タバコ
HANG LUNG PROPERTIES LTD	980	980	1,319	23,453	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	940	940	1,351	24,033	資本財
SJM HOLDINGS LTD	800	—	—	—	消費者サービス
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	896	896	1,908	33,932	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	910	1,250	4,506	80,121	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD	530	530	931	16,566	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	300	410	1,594	28,357	公益事業
AIA GROUP LTD	6,540	7,632	58,155	1,034,010	保険
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	700	700	1,066	18,967	運輸
SANDS CHINA LTD	1,160	1,424	2,830	50,333	消費者サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,170	1,170	1,581	28,125	小売
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	705	830	7,378	131,193	資本財
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,875	2,470	6,162	109,571	銀行
WYNN MACAU LTD	708	—	—	—	消費者サービス
ESR GROUP LTD	1,020	1,570	2,615	46,505	不動産
小 計	株 数 銘柄 数	株 数 銘柄 数	175,129	3,113,794	
	金額 比率	金額 比率	—	< 0.7% >	
(シンガポール)			千シンガポール・ドル		
UNITED OVERSEAS BANK LTD	647	756	2,328	235,269	銀行
DBS GROUP HOLDINGS LTD	966	1,098	3,837	387,742	銀行
SINGAPORE AIRLINES LTD	779.66	779.66	426	43,090	運輸
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,366	1,762	646	65,337	不動産
KEPPEL CORP LTD	547	944	710	71,822	資本財
UOL GROUP LTD	172	309	200	20,262	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	258	258	213	21,532	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,812	2,114	2,615	264,221	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	3,275	3,275	286	28,954	消費者サービス
VENTURE CORP LTD	87	217	375	37,931	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,398.15	4,807.15	1,312	132,600	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,086	1,086	379	38,295	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	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	428	652	595	60,212	各種金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,032	1,300	531	53,722	食品・飲料・タバコ
小計	16,853.81	19,357.81	14,459.00	1,460,996.00	
	14銘柄	14銘柄		<0.3%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランド・ドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,114.59	990.68	512	44,156	電気通信サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	884.45	664.54	314	27,130	公益事業
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	707.11	788.08	616	53,080	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	312.5	390.17	889	76,653	ヘルスケア機器・サービス
RYMAN HEALTHCARE LTD	240.28	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	347.17	—	—	—	食品・飲料・タバコ
MERCURY NZ LTD	269.13	625.22	327	28,244	公益事業
小計	3,875.23	3,458.69	2,661.00	229,265.00	
	7銘柄	5銘柄		<0.1%>	
(イギリス)			千イギリス・ポンド		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	632.89	—	—	—	保険
BP PLC	10,791.42	12,227.97	6,016	1,000,066	エネルギー
ASHTED GROUP PLC	236.86	261.31	1,304	216,796	資本財
UNILEVER PLC	1,418.43	1,633.79	6,738	1,120,151	家庭用品・パーソナル用品
NMC HEALTH PLC	39.4	39.4	0	6	ヘルスケア機器・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	288.6	1,443	179	29,839	小売
BHP GROUP PLC	1,164.84	—	—	—	素材
AUTO TRADER GROUP PLC	439.54	513.19	289	48,181	メディア・娯楽
AVEVA GROUP PLC	60.37	60.37	191	31,872	ソフトウェア・サービス
BARCLAYS PLC	9,047.41	10,831.54	1,743	289,884	銀行
SHELL PLC	—	4,729.35	11,352	1,887,176	エネルギー
HALEON PLC	—	2,935.73	837	139,228	家庭用品・パーソナル用品
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,941.44	4,941.44	440	73,188	資本財
PRUDENTIAL PLC	1,434.05	1,780.81	1,718	285,603	保険
NATWEST GROUP PLC	3,162.87	3,474.2	905	150,442	銀行
EVRAZ PLC	282.75	—	—	—	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	100.74	100.74	215	35,786	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,657.53	2,092.6	1,695	281,899	資本財
AVIVA PLC	1,986.01	1,740.6	780	129,797	保険
GSK PLC	2,665.28	2,574.03	3,649	606,649	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RELX PLC	1,062.84	1,214.21	2,780	462,209	商業・専門サービス
DIAGEO PLC	1,268.68	1,457.4	5,491	912,849	食品・飲料・タバコ
RIO TINTO PLC	611.3	726.7	4,042	672,006	素材
STANDARD CHARTERED PLC	1,465.61	1,518.95	925	153,769	銀行
TESCO PLC	3,999.3	4,959.19	1,155	192,077	食品・生活必需品小売り
PEARSON PLC	396.23	396.23	389	64,811	メディア・娯楽
NEXT PLC	68.6	90.3	518	86,160	小売
TAYLOR WIMPEY PLC	2,255.88	2,255.88	230	38,286	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC	170.64	226.58	694	115,479	資本財
VODAFONE GROUP PLC	15,460.57	16,395.44	1,505	250,193	電気通信サービス
KINGFISHER PLC	1,096.78	1,096.78	264	43,902	小売
WPP PLC	639.87	785.03	681	113,322	メディア・娯楽
UNITED UTILITIES GROUP PLC	332.07	420.35	431	71,691	公益事業
SEVERN TRENT PLC	124.18	149.04	404	67,239	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	905.52	1,568.48	840	139,646	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	373.85	449.2	2,668	443,542	家庭用品・パーソナル用品
SSE PLC	558.79	705.32	1,182	196,503	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	647.66	647.66	257	42,859	耐久消費財・アパレル
ASTRAZENECA PLC	835.63	980.93	10,849	1,803,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,136.37	3,863.91	982	163,400	保険
3I GROUP PLC	493.38	608.07	815	135,497	各種金融

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株数	金額	株数	金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
SAGE GROUP PLC/THE	559.87	750.45	589	98,051			ソフトウェア・サービス
NATIONAL GRID PLC	1,918.51	2,243.29	2,262	376,071			公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	38,170.21	43,247.26	2,002	332,850			銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	500.03	594.22	1,261	209,703			食品・飲料・タバコ
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	66.37	66.37	251	41,736			耐久消費財・アパレル
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,143.93	1,385.71	4,642	771,776			食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	11,079.75	12,552.33	6,405	1,064,778			銀行
ANGLO AMERICAN PLC	669.35	803.77	2,644	439,512			素材
COMPASS GROUP PLC	930.18	1,100.16	2,013	334,761			消費者サービス
PERSIMMON PLC	169.16	169.16	214	35,711			耐久消費財・アパレル
SAINSBURY (J) PLC	1,134.8	1,134.8	253	42,085			食品・生活必需品小売り
BT GROUP PLC	4,699.07	4,039.57	496	82,459			電気通信サービス
BURBERRY GROUP PLC	190.12	262.33	561	93,319			耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC	443.55	572.78	617	102,639			ヘルスケア機器・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	177.16	213.45	1,716	285,415			各種金融
SHELL PLC	2,192.98	—	—	—			エネルギー
SHELL PLC	1,991.91	—	—	—			エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	75.81	145.9	218	36,294			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	233	38,866			保険
ANTOFAGASTA PLC	194.39	194.39	265	44,075			素材
ABRDN PLC	1,232.63	1,380.15	283	47,077			各種金融
EXPERIAN PLC	488.95	547.49	1,570	261,105			商業・専門サービス
SCHRODERS PLC	62.13	617.11	278	46,244			各種金融
HALMA PLC	198.39	243.75	518	86,223			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	167.71	242.58	384	63,913			食品・飲料・タバコ
ST JAMES'S PLACE PLC	261.57	338.23	390	64,854			各種金融
INTERTEK GROUP PLC	81.84	118.84	468	77,912			商業・専門サービス
MONDI PLC	251.28	339.05	527	87,696			素材
WHITBREAD PLC	112.82	112.82	291	48,498			消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	195.72	310.08	263	43,843			各種金融
SMITHS GROUP PLC	243.69	243.69	388	64,651			資本財
OCADO GROUP PLC	273.79	273.79	168	28,080			食品・生活必需品小売り
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	368.51	592.86	353	58,736			保険
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	95.87	118.2	560	93,231			消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	78.38	78.38	526	87,451			素材
M&G PLC	1,330.64	1,197.33	230	38,253			各種金融
INFORMA PLC	781.52	1,027.55	627	104,262			メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	36.85	44.59	499	83,090			資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,217.14	3,052.27	401	66,669			資本財
GLENCORE PLC	5,395.65	6,227.41	3,430	570,178			素材
COCA-COLA HBC AG-DI	87.04	87.04	175	29,197			食品・飲料・タバコ
DCC PLC	59.54	59.54	266	44,290			資本財
ENTAIN PLC	288.65	421.58	589	97,935			消費者サービス
FERGUSON PLC	120.17	133.61	1,267	210,772			資本財
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	157,107.16 83銘柄	179,294.95 80銘柄	116,283 —	19,329,750 <4.4%>	
(イスラエル)					イスラエル・シェケル		
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	—	74.38	1,126	45,450			半導体・半導体製造装置
BANK HAPUALIM BM	664.03	846.82	2,793	112,679			銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	701.5	926.39	2,916	117,625			銀行
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	546.74	853.39	1,745	70,390			銀行
NICE LTD	32.51	39.19	2,550	102,887			ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	92.49	92.49	1,173	47,339			銀行
AZRIELI GROUP LTD	21.4	21.4	520	20,974			不動産
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	—	1,795.69	1,123	45,303			電気通信サービス
ICL GROUP LTD	287.11	417.73	1,193	48,153			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	
ELBIT SYSTEMS LTD	13.89	13.89	803	32,404			資本財
小計	2,359.67 8銘柄	5,081.37 10銘柄	15,947 -	643,208 <0.1%>			
(スイス)			千スイス・フラン				
UBS GROUP AG-REG	1,911.89	2,212.55	3,838	559,194			各種金融
JULIUS BAER GROUP LTD	125.5	151.68	818	119,181			各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	21.32	30.3	543	79,139			資本財
HOLCIM LTD	272.39	352.46	1,724	251,220			素材
SWISS PRIME SITE-REG	39.06	55.72	436	63,554			不動産
VIFOR PHARMA AG	26.38	-	-	-			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	0.72	702	102,365			食品・飲料・タバコ
ADECCO GROUP AG-REG	91.18	91.18	295	43,074			商業・専門サービス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.05	0.06	584	85,129			食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	12.03	13.72	1,246	181,552			各種金融
SCHINDLER HOLDING AG-REG	9.41	17.66	301	43,938			資本財
SIKA AG-REG	78	92.91	2,162	315,076			素材
ALCON INC	265.85	311.65	1,999	291,273			ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	15.7	-	-	-			銀行
ROCHE HOLDING AG-BR	19.21	17.4	648	94,492			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	52.25	238	34,813			耐久消費財・アパレル
BACHEM HOLDING AG	-	17.56	154	22,433			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VAT GROUP AG	-	14.36	370	53,927			資本財
SIG GROUP AG	-	222.69	446	65,073			素材
CREDIT SUISSE GROUP AG-RTS	-	1,681.96	16	2,425			各種金融
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	377.96	445.08	13,764	2,005,016			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD-REG	908.36	1,037.2	3,052	444,654			資本財
SWISS RE AG	151.68	192.28	1,625	236,735			保険
NESTLE SA-REG	1,547.36	1,789.46	19,909	2,900,221			食品・飲料・タバコ
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,454.88	1,681.96	488	71,102			各種金融
SGS SA-REG	3.08	3.74	817	119,040			商業・専門サービス
SWATCH GROUP AG/THE-BR	17.16	17.16	421	61,367			耐久消費財・アパレル
BALOISE HOLDING AG - REG	24.75	24.75	352	51,303			保険
CLARIANT AG-REG	101.01	101.01	157	22,939			素材
NOVARTIS AG-REG	1,195.88	1,379.72	11,493	1,674,195			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	283.58	327.7	3,930	572,594			耐久消費財・アパレル
SWISSCOM AG-REG	13.99	17.09	862	125,669			電気通信サービス
GIVAUDAN-REG	4.84	5.68	1,775	258,646			素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	80.94	97.13	4,390	639,531			保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG	5.31	70.44	743	108,253			ヘルスケア機器・サービス
SONOVA HOLDING AG-REG	26.6	32.69	790	115,144			ヘルスケア機器・サービス
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	81.5	104.26	578	84,260			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG-REG	39.84	47.15	2,292	334,007			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEMENOS AG - REG	37.43	37.43	214	31,242			ソフトウェア・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	18.34	18.34	922	134,380			保険
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	29.81	35.7	803	117,113			運輸
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.83	2.16	414	60,412			食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3.56	3.56	229	33,474			素材
GEBERIT AG-REG	19.86	23.22	1,034	150,722			資本財
小計	9,343.27 40銘柄	12,831.74 42銘柄	87,594 -	12,759,895 <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	2.06	3,026	58,434			運輸
PANDORA A/S	47.63	58.88	2,966	57,280			耐久消費財・アパレル
ORSTED A/S	95.55	120.9	7,304	141,055			公益事業
NOVO NORDISK A/S-B	908.61	1,048.8	92,283	1,782,002			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	72.11	3,142	60,682			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	外貨建金額	邦貨換算金額		
DANSKE BANK A/S	391.03	391.03	4,971	96,008	銀行	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	524.4	654.33	11,521	222,479	資本財	
GN STORE NORD A/S	64.84	64.84	1,091	21,072	ヘルスケア機器・サービス	
CARLSBERG AS-B	55.85	55.85	5,047	97,471	食品・飲料・タバコ	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	115.12	140.03	5,739	110,836	素材	
COLOPLAST-B	63.99	83.16	7,180	138,646	ヘルスケア機器・サービス	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	3.11	3.11	4,691	90,591	運輸	
TRYG A/S	169.89	249.75	4,109	79,357	保険	
GENMAB A/S	36.88	39.34	12,510	241,570	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROCKWOOL A/S-B SHS	5.13	5.13	807	15,601	資本財	
DSV A/S	109.5	114.17	12,632	243,941	運輸	
AMBU A/S-B	83.56	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
DEMANT A/S	44.55	81.78	1,640	31,678	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	2,776.41 18銘柄	3,185.27 17銘柄	180,668 —	3,488,710 <0.8%>
<b>(ノルウェー)</b>						
SALMAR ASA	—	41.88	1,393	19,373	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	114.12	114.12	2,140	29,758	保険	
NORSK HYDRO ASA	832.94	877.53	6,412	89,140	素材	
AKER BP ASA	—	212.04	7,200	100,092	エネルギー	
DNB BANK ASA	459.57	616.91	11,770	163,611	銀行	
KONGSBERG GRUPPEN ASA	—	65.26	2,610	36,284	資本財	
ORKLA ASA	469.55	469.55	3,257	45,282	食品・飲料・タバコ	
TELENOR ASA	349.37	406.94	3,984	55,388	電気通信サービス	
EQUINOR ASA	518.71	608.49	22,940	318,867	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	90.05	108.72	5,058	70,316	素材	
MOWI ASA	233.18	233.18	3,582	49,801	食品・飲料・タバコ	
SCHIBSTED ASA-CL A	33.38	—	—	—	メディア・娯楽	
ADEVINTA ASA	155.4	155.4	1,185	16,481	メディア・娯楽	
SCHIBSTED ASA-B SHS	54.8	—	—	—	メディア・娯楽	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	3,311.07 11銘柄	3,910.02 12銘柄	71,539 —	994,397 <0.2%>
<b>(スウェーデン)</b>						
SWEDBANK AB - A SHARES	459.21	576.03	9,645	126,743	銀行	
ERICSSON LM-B SHS	1,596.85	1,833.18	11,820	155,319	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
VOLVO AB-B SHS	803.38	908.83	17,329	227,710	資本財	
ICA GRUPPEN AB	56.14	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	106.42	106.42	2,806	36,874	各種金融	
LUNDBERGS AB-B SHS	33.68	60.81	2,845	37,395	各種金融	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	299.42	360.76	9,213	121,069	家庭用品・パーソナル用品	
EPIROC AB-A	342.3	447.46	8,835	116,093	資本財	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	82.23	82.23	1,687	22,171	資本財	
KINNEVIK AB - B	124.65	124.65	1,977	25,985	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	98.51	72.11	1,910	25,109	各種金融	
INVESTOR AB-A SHS	—	274.15	5,443	71,524	各種金融	
SAGAX AB-B	—	147.21	3,281	43,116	不動産	
LIFCO AB-B SHS	—	151.49	2,678	35,193	資本財	
HOLMEN AB-B SHARES	—	70.24	3,022	39,714	素材	
INDUTRADE AB	—	179.13	3,937	51,735	資本財	
VOLVO CAR AB-B	—	386.28	1,921	25,244	自動車・自動車部品	
SKF AB-B SHARES	206.07	206.07	3,567	46,871	資本財	
ELECTROLUX AB-B	115.55	115.55	1,682	22,103	耐久消費財・アパレル	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	401.48	522.1	6,140	80,691	小売	
NORDEA BANK ABP	1,679.42	2,100.76	23,078	303,257	銀行	
SWEDISH MATCH AB	846.4	1,030.37	11,869	155,969	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	255.37	384.24	3,583	47,086	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 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
GETINGE AB-B SHS	—	131.51	3,136	41,213	ヘルスケア機器・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	883.17	1,083.74	12,956	170,243	銀行
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	776.68	976.03	10,179	133,765	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	343.7	343.7	4,866	63,949	素材
SKANSKA AB-B SHS	171.83	269.15	4,597	60,405	資本財
SANDVIK AB	610.7	701.08	13,460	176,874	資本財
INVESTOR AB-B SHS	1,012.75	1,117.44	21,390	281,065	各種金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	373.42	1,697.3	21,888	287,613	資本財
SECURITAS AB-B SHS	161.23	410.1	3,620	47,571	商業・専門サービス
TELIA CO AB	1,434.04	1,876.75	5,414	71,145	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	186.97	186.97	5,524	72,598	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	197.87	1,074.24	12,504	164,304	資本財
ASSA ABLOY AB-B	521.19	624.54	14,889	195,641	資本財
BOLIDEN AB	130.86	152.97	5,820	76,481	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	185.93	185.93	1,493	19,623	資本財
SWEDISH ORPHAN BIVITRUM AB	—	135.13	2,960	38,903	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEXAGON AB-B SHS	1,031.1	1,170.1	13,795	181,272	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ORROR ENERGY AB	85.81	—	—	—	公益事業
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	53.23	319.38	1,497	19,678	不動産
EQT AB	154.43	231.94	5,473	71,925	各種金融
EVOLUTION AB	90.21	112.54	11,742	154,295	消費者サービス
VOLVO AB-A SHS	132.83	132.83	2,675	35,152	資本財
EMBRACER GROUP AB	300.12	300.12	1,348	17,716	メディア・娯楽
EPIROC AB-B	198.36	198.36	3,372	44,309	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	737.64	892.71	8,736	114,791	資本財
SINCH AB	276.9	—	—	—	ソフトウェア・サービス
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 銘柄数	金額 銘柄数	
	17,558.05 41銘柄	24,464.63 46銘柄	331,622 —	4,357,523 <1.0%>	
<b>(ユーロ・・・アイルランド)</b>					
KINGSPAN GROUP PLC	80.84	95.97	千ユーロ	74,463	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	129.21	171.89	596	85,713	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	88.69	110.19	1,527	219,359	消費者サービス
KERRY GROUP PLC-A	81.93	98.94	898	129,073	食品・飲料・タバコ
CRH PLC	434.26	459.64	1,763	253,223	素材
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 銘柄数	金額 銘柄数	
	814.93 5銘柄	936.63 5銘柄	5,305 —	761,833 <0.2%>	
<b>(ユーロ・・・オランダ)</b>					
KONINKLIJKE PHILIPS NV	477.6	527.27	742	106,593	ヘルスケア機器・サービス
AIRBUS SE	320.94	381.7	4,167	598,355	資本財
HEINEKEN HOLDING NV	61.68	61.68	447	64,206	食品・飲料・タバコ
NN GROUP NV	140.69	169.17	682	97,959	保険
QIAGEN N.V.	125.43	156.65	739	106,116	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	287.87	287.87	353	50,756	銀行
STELLANTIS NV	1,055.16	1,392.38	2,048	294,079	自動車・自動車部品
VOPAK	31.3	—	—	—	エネルギー
FERRARI NV	69.49	79.86	1,665	239,072	自動車・自動車部品
ADYEN NV	10.69	13.94	1,989	285,614	ソフトウェア・サービス
PROSUS NV	510.18	510.27	3,075	441,565	小売
CNH INDUSTRIAL NV	547.75	687.66	1,045	150,076	資本財
ASM INTERNATIONAL NV	24.55	31.7	811	116,586	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	384.96	444.22	988	141,912	メディア・娯楽
OCI NV	—	60	239	34,407	素材
EXOR NV	—	62.04	458	65,827	各種金融
HEINEKEN NV	131.43	160.91	1,427	204,927	食品・飲料・タバコ
AEGON NV	916.09	1,277.48	596	85,657	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	556.57	646.61	1,806	259,395	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	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
AKZO NOBEL N. V.	98.86	124.75	851	122,300	素材
KONINKLIJKE DSM NV	94.22	104.33	1,251	179,681	素材
WOLTERS KLUWER	145.78	163.6	1,706	244,997	商業・専門サービス
ING GROEP NV	2,052.37	2,541.05	2,963	425,481	銀行
KONINKLIJKE KPN NV	1,736.03	2,221.79	646	92,862	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	225.44	257.52	14,415	2,069,844	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	62.41	89.46	498	71,596	商業・専門サービス
JDE PEET'S NV	21.66	66.6	194	27,922	食品・飲料・タバコ
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	280.21	354.07	355	51,015	食品・飲料・タバコ
EURONEXT NV	—	55.02	394	56,704	各種金融
IMCD NV	—	32.14	447	64,213	資本財
ARGENX SE	26.44	35.03	1,276	183,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUST EAT TAKEAWAY	93.07	129.03	270	38,793	小売
EXOR NV	62.04	—	—	—	各種金融
STMICROELECTRONICS NV	378.04	435.38	1,556	223,479	半導体・半導体製造装置
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	評価額 —	評価額 —	
	10,928.95 30銘柄	13,561.18 32銘柄	50,113	7,195,231	
	金額 <比率>		—	<1.6%>	
<b>(ユーロ・・・ベルギー)</b>					
SOFINA	8.04	8.04	千ユーロ 169	24,357	各種金融
UCB SA	66.23	77.82	600	86,191	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KBC GROUP NV	130.92	149.1	783	112,433	銀行
COLRUYT SA	21.64	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	59.14	59.14	455	65,434	各種金融
SOLVAY SA	37.58	48.02	452	64,906	素材
UMICORE	102.88	131.6	450	64,659	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	409.43	566.32	3,182	456,974	食品・飲料・タバコ
AGEAS	112.47	112.47	425	61,057	保険
D'IETTEREN GROUP	—	14.49	257	37,032	小売
PROXIMUS	46.17	108.95	110	15,885	電気通信サービス
ELIA GROUP SA/NV	20.63	21.11	283	40,675	公益事業
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	7,170	1,029,608	
	1,015.13 11銘柄	1,297.06 11銘柄	—	<0.2%>	
	金額 <比率>		—		
<b>(ユーロ・・・ルクセンブルグ)</b>					
ARCELORMITTAL	366.89	370.54	千ユーロ 961	138,006	素材
TENARIS SA	259.63	259.63	425	61,060	エネルギー
EUROFINS SCIENTIFIC	70.1	92.7	621	89,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AROUNDTOWN SA	525.6	735.08	171	24,654	不動産
INPOST SA	109.02	—	—	—	運輸
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	2,179	312,951	
	1,331.24 5銘柄	1,457.95 4銘柄	—	<0.1%>	
	金額 <比率>		—		
<b>(ユーロ・・・フランス)</b>					
BUREAU VERITAS SA	178.17	178.17	千ユーロ 448	64,389	商業・専門サービス
ORANGE	1,061.32	1,277.98	1,258	180,629	電気通信サービス
GETLINK SE	223.11	304.28	483	69,486	運輸
SUEZ	189.86	—	—	—	公益事業
DASSAULT AVIATION SA	17.2	17.2	260	37,339	資本財
FAURECIA	60.9	—	—	—	自動車・自動車部品
TOTALENERGIES SE	1,354.3	1,581.13	9,319	1,338,047	エネルギー
TELEPERFORMANCE	29.7	34.2	731	105,083	商業・専門サービス
WORLDLINE SA	127.74	166.77	747	107,296	ソフトウェア・サービス
ESSILORLUXOTTICA	157.04	178.07	3,125	448,705	ヘルスケア機器・サービス
AMUNDI SA	39.55	39.55	208	29,869	各種金融
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	15.55	15.55	490	70,485	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICHELIN (CGDE)	87.46	456.59	1,207	173,333	自動車・自動車部品
AIR LIQUIDE SA	251.83	334.12	4,636	665,672	素材
KERING	39.06	47.59	2,629	377,590	耐久消費財・アパレル

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	293.3	348.68	4,842	695,281	資本財
BOUYGUES SA	110.49	171.23	508	73,067	資本財
BNP PARIBAS	612.93	720.2	3,858	553,947	銀行
THALES SA	54.03	70.74	861	123,761	資本財
DANONE	343	407.11	2,047	294,017	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	359.9	359.9	594	85,314	食品・生活必需品小売り
VIVENDI SE	384.96	384.96	329	47,258	メディア・娯楽
L'OREAL	136.29	151.95	5,280	758,140	家庭用品・パーソナル用品
LEGRAND SA	133.23	168.52	1,315	188,874	資本財
PERNOD RICARD SA	111.08	137.33	2,567	368,625	食品・飲料・タバコ
SOCIETE GENERALE SA	410.25	485.58	1,169	167,849	銀行
LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUI	148.67	177	12,425	1,784,038	耐久消費財・アパレル
ACCOR SA	104.51	104.51	260	37,333	消費者サービス
CAPGEMINI SE	89.61	104.53	1,805	259,270	ソフトウェア・サービス
VALEO	144.44	144.44	254	36,562	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	133.01	133.01	837	120,314	メディア・娯楽
SODEXO SA	39	47.6	433	62,220	消費者サービス
SEB SA	11.27	11.27	86	12,427	耐久消費財・アパレル
AXA SA	1,004.73	1,195.47	3,270	469,536	保険
EDENRED	121.39	146.5	770	110,683	ソフトウェア・サービス
RENAULT SA	88.3	147.64	498	71,607	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	16.76	19.73	2,927	420,392	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	45.92	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DASSAULT SYSTEMES SE	351.15	400.49	1,391	199,849	ソフトウェア・サービス
ALSTOM	176.65	176.65	433	62,292	資本財
CNP ASSURANCES	89.78	—	—	—	保険
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	264.13	294.71	1,302	186,945	資本財
SANOFI	615.68	730.53	6,442	925,020	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VINCI SA	293.09	340.5	3,288	472,218	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	361.22	421.62	1,025	147,224	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	581.4	731.02	702	100,824	銀行
ENGIE	948.86	1,178.99	1,693	243,085	公益事業
UBISOFT ENTERTAINMENT	47.45	47.45	124	17,849	メディア・娯楽
EDF	207.79	326.58	391	56,268	公益事業
SAFRAN SA	182.12	217.82	2,537	364,349	資本財
ARKEMA	32.5	32.5	272	39,169	素材
SCOR SE	109.07	—	—	—	保険
IPSEN	14.98	14.98	162	23,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOLLORRE SE	394.33	692.88	362	52,079	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	12.73	12.73	205	29,573	食品・飲料・タバコ
EURAZEO SE	17.92	17.92	108	15,566	各種金融
ORPEA	26.95	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WENDEL	10.82	10.82	94	13,523	各種金融
EIFFAGE	49.89	49.89	471	67,649	資本財
ADP	13.46	13.46	196	28,157	運輸
BIOMERIEUX	15.7	27.91	268	38,494	ヘルスケア機器・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	57.85	57.85	216	31,073	消費者サービス
小 計	株数 13,605.38	株数 16,066.4	金額 94,184	金額 13,523,070	
	銘柄数 62銘柄	銘柄数 56銘柄	比率 —	比率 <3.1%>	
<b>(ユーロ・・・ドイツ)</b>					
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	468.95	796.54	180	25,938	電気通信サービス
BAYER AG-REG	517.33	637.81	3,569	512,463	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	385	55,324	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	86.77	86.77	455	65,381	素材
EVONIK INDUSTRIES AG	109.52	176.69	327	47,021	素材
VONOVIA SE	395	463.39	1,102	158,349	不動産

## 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	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	77.65	100.89	585	84,017	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	25.64	36.79	294	42,337	自動車・自動車部品
KION GROUP AG	31.79	31.79	86	12,374	資本財
ZALANDO SE	123.67	123.67	361	51,937	小売
BECHTLE AG	43.05	43.05	146	21,021	ソフトウェア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	52.69	52.69	100	14,479	電気通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,134.78	1,272.33	1,299	186,517	各種金融
COVESTRO AG	117.97	117.97	450	64,754	素材
MTU AERO ENGINES AG	29.57	38.54	760	109,232	資本財
UNIPER SE	46.97	46.97	22	3,229	公益事業
COMMERZBANK AG	466.44	606.4	485	69,758	銀行
VOLKSWAGEN AG	19.6	19.6	356	51,133	自動車・自動車部品
SARTORIUS AG-VORZUG	13.08	16.82	594	85,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	97.76	118.44	1,632	234,405	自動車・自動車部品
LEG IMMOBILIEN SE	36.8	45.38	279	40,110	不動産
NEMETSCHKE SE	30.11	30.11	137	19,735	ソフトウェア・サービス
RATIONAL AG	3.5	3.5	203	29,272	資本財
SYMRISE AG	65.24	84.04	904	129,895	素材
DELIVERY HERO SE	80.61	85.3	335	48,230	小売
SIEMENS ENERGY AG	198.55	318.78	499	71,722	資本財
TEAMVIEWER AG	90.59	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VONOVIA SE-RTS	293.04	—	—	—	不動産
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	293.58	908	130,503	資本財
RHEINMETALL AG	—	28.99	560	80,521	資本財
DR ING HC F PORSCHE AG	—	70	745	106,988	自動車・自動車部品
SIEMENS AG-REG	409.05	488.9	6,506	934,171	資本財
E.ON SE	1,269.98	1,473.18	1,338	192,186	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	178.73	203.47	1,724	247,590	自動車・自動車部品
GEA GROUP AG	81.78	81.78	318	45,676	資本財
CONTINENTAL AG	55.78	80.78	467	67,131	自動車・自動車部品
BASF SE	494.39	590.53	2,897	415,971	素材
ALLIANZ SE-REG	217.83	263.07	5,408	776,583	保険
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	90.43	103.98	711	102,087	家庭用品・パーソナル用品
RWE AG	346.73	386.04	1,611	231,354	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	331.48	331.48	251	36,133	運輸
BRENTAG SE	73.92	99.2	600	86,284	資本財
FRESENIUS SE & CO KGAA	213.63	232.54	610	87,710	ヘルスケア機器・サービス
SAP SE	550.37	669.88	6,905	991,437	ソフトウェア・サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	73.64	90.23	2,720	390,599	保険
BEIERSDORF AG	51.38	68.13	701	100,706	家庭用品・パーソナル用品
MERCK KGAA	68.32	77.77	1,338	192,170	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADIDAS AG	101.46	103.95	1,257	180,504	耐久消費財・アパレル
PUMA SE	50.52	64.59	309	44,375	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,830.3	2,082.85	4,054	582,081	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	111.18	136.13	403	57,972	ヘルスケア機器・サービス
MERCEDES-BENZ GROUP AG	466.8	522.42	3,267	469,106	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	715.33	796.41	2,437	349,906	半導体・半導体製造装置
HANNOVER RUECK SE	30.58	35.98	651	93,608	保険
DEUTSCHE POST AG-REG	544.53	621.78	2,352	337,817	運輸
DEUTSCHE BOERSE AG	107.01	119.16	2,055	295,130	各種金融
LANXESS AG	44.09	—	—	—	素材
FUCHS PETROLUB SE-PREF	33.7	—	—	—	素材
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	19.24	21.61	274	39,374	ヘルスケア機器・サービス
KNORR-BREMSE AG	38.81	38.81	209	30,090	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	164.26	164.26	828	118,959	ヘルスケア機器・サービス
SCOUT24 SE	46.71	46.71	238	34,270	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	株数	期		末		業種等
		期首(前期末)	株数	評価額	金額	
		株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
HELLOFRESH SE		97.9	97.9	221	31,851	食品・生活必需品小売り
小計	株数 銘柄数	13,626.27 60銘柄	15,900.09 59銘柄	70,447 -	10,114,853 -<2.3%>	
(ユーロ・・・ポルトガル)				千ユーロ		
GALP ENERGIA SGPS SA		296.87	259.2	300	43,133	エネルギー
BANCO ESPIRITO SANTO-REG		1,879.06	-	-	-	銀行
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,459.1	1,952.32	862	123,898	公益事業
JERONIMO MARTINS		163.97	173.93	371	53,292	食品・生活必需品小売り
小計	株数 銘柄数	3,799 4銘柄	2,385.45 3銘柄	1,534 -	220,324 -<0.0%>	
(ユーロ・・・スペイン)				千ユーロ		
TELEFONICA SA		2,742.78	3,359.1	1,205	173,145	電気通信サービス
FERROVIAL SA		246.93	321.77	821	117,947	資本財
AENA SME SA		43.77	43.77	531	76,262	運輸
EDP RENOVAVEIS SA		147.91	177.64	386	55,423	公益事業
CAIXABANK SA		2,181.03	2,907.77	1,031	148,128	銀行
CELLNEX TELECOM SA		270.81	328.3	1,070	153,714	電気通信サービス
ENDESA SA		141.04	141.04	247	35,529	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA		3,528.89	4,202.32	2,363	339,334	銀行
IBERDROLA SA		3,127.16	3,768.63	4,015	576,541	公益事業
REPSOL SA		793.58	964.57	1,411	202,684	エネルギー
GRIFOLS SA		151.69	151.69	150	21,657	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANCO SANTANDER SA		9,272.2	10,464.74	2,966	425,966	銀行
AMADEUS IT GROUP SA		245.7	299.28	1,522	218,548	ソフトウェア・サービス
NATURGY ENERGY GROUP SA		154.39	106.03	278	39,916	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		129.31	131.89	353	50,807	資本財
ACCIONA SA		-	18.1	328	47,116	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		583.28	713.41	1,777	255,259	小売
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		114.82	197.73	356	51,130	資本財
ENAGAS SA		144.71	144.71	250	35,945	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		236.32	236.32	401	57,631	公益事業
小計	株数 銘柄数	24,256.32 19銘柄	28,678.81 20銘柄	21,470 -	3,082,692 -<0.7%>	
(ユーロ・・・イタリア)				千ユーロ		
MONCLER SPA		122.09	122.09	586	84,142	耐久消費財・アパレル
PRYSMIAN SPA		125.26	171.86	579	83,206	資本財
DIASORIN SPA		13.13	13.13	169	24,300	ヘルスケア機器・サービス
TELECOM ITALIA-RSP		3,783.08	-	-	-	電気通信サービス
POSTE ITALIANE SPA		265.62	347.2	327	46,969	保険
FINECOBANK SPA		320.34	430.93	651	93,551	銀行
ASSICURAZIONI GENERALI		573.03	723.82	1,226	176,050	保険
MEDIOBANCA SPA		313.03	477.08	441	63,402	銀行
UNICREDIT SPA		1,128.45	1,279.61	1,658	238,109	銀行
INTESA SANPAOLO		9,050.32	10,118.86	2,159	310,041	銀行
ATLANTIA SPA		265.01	265.01	607	87,248	運輸
ENI SPA		1,369.72	1,601.58	2,273	326,443	エネルギー
ENEL SPA		4,316.52	5,010.6	2,558	367,336	公益事業
SNAM SPA		1,067.07	1,338.67	642	92,201	公益事業
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE		871.42	1,016.86	731	105,091	公益事業
TELECOM ITALIA SPA		3,905.36	6,963.55	151	21,696	電気通信サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		45.78	80.68	322	46,347	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPLIFON SPA		75.67	75.67	205	29,454	ヘルスケア機器・サービス
NEXI SPA		206.12	308.53	257	36,945	ソフトウェア・サービス
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		158.04	158.04	148	21,298	電気通信サービス
小計	株数 銘柄数	27,975.06 20銘柄	30,503.77 19銘柄	15,697 -	2,253,838 -<0.5%>	

## 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	
<b>(ユーロ・・・フィンランド)</b>					
WARTSILA OYJ ABP	267.53	267.53	千ユーロ 218	31,382	資本財
NESTE OYJ	214.27	265.63	1,240	178,071	エネルギー
UPM-KYMMENE OYJ	280.55	328.18	1,137	163,318	素材
NOKIA OYJ	2,801.61	3,486.1	1,593	228,794	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	302.34	392.28	550	79,078	素材
ELISA OYJ	86.81	101.6	503	72,296	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS	284.54	298.43	1,442	207,087	保険
FORTUM OYJ	243.12	243.12	365	52,430	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	134.02	202.5	415	59,690	食品・生活必需品小売り
KONE OYJ-B	176.18	206.23	1,000	143,610	資本財
ORION OYJ-CLASS B	62.61	62.61	315	45,325	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数 11銘柄	株数 11銘柄	8,783	1,261,086	
	金額 <比率>		—	<0.3%>	
<b>(ユーロ・・・オーストリア)</b>					
OMV AG	83.89	83.89	千ユーロ 415	59,718	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	193.83	205.06	603	86,619	銀行
VOESTALPINE AG	60.56	73.82	193	27,769	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	70.66	—	—	—	銀行
VERBUND AG	31.9	53.46	458	65,781	公益事業
小計	株数 5銘柄	株数 4銘柄	1,670	239,889	
	金額 <比率>		—	<0.1%>	
ユーロ通貨計	株数 232銘柄	株数 224銘柄	278,558	39,995,380	
	金額 <比率>		—	<9.0%>	
合計	株数 1,223銘柄	株数 1,209銘柄	—	411,677,365	
	金額 <比率>		—	<93.1%>	

※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。

※〈 〉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。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### (2) 外国投資信託証券

銘	柄	期首 (前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額		組 入 比 率
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		口	口	千アメリカ・ドル	千円		%	
AGNC INVESTMENT CORP		25,432	—	—	—	—	—	
AVALONBAY COMMUNITIES INC		7,344	9,096	1,553	215,735	0.0	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC		17,345	20,565	2,415	335,449	0.1	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC		7,835	9,604	678	94,279	0.0	0.0	
VORNADO REALTY TRUST		8,706	8,706	220	30,599	0.0	0.0	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		—	22,843	455	63,222	0.0	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP		5,916	7,141	2,103	292,096	0.1	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL		18,773	22,609	1,437	199,622	0.0	0.0	
EQUINIX INC		4,908	5,902	3,960	549,926	0.1	0.1	
AMERICAN TOWER CORP		24,648	28,877	6,272	871,084	0.2	0.2	
SUN COMMUNITIES INC		6,088	7,129	1,032	143,362	0.0	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		—	17,613	908	126,135	0.0	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC		37,569	46,189	861	119,690	0.0	0.0	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A		—	20,093	653	90,713	0.0	0.0	
REALTY INCOME CORP		28,298	36,686	2,285	317,392	0.1	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM		5,780	7,866	1,273	176,873	0.0	0.0	
INVITATION HOMES INC		32,632	36,871	1,176	163,439	0.0	0.0	
VICI PROPERTIES INC		36,025	60,354	2,032	282,200	0.1	0.1	
KIMCO REALTY CORP		—	35,169	799	110,962	0.0	0.0	
VENTAS INC		19,379	23,363	1,060	147,296	0.0	0.0	
WEYERHAEUSER CO		38,940	47,220	1,499	208,264	0.0	0.0	
CROWN CASTLE INC		22,634	27,033	3,760	522,229	0.1	0.1	
IRON MOUNTAIN INC		14,204	19,659	1,058	147,040	0.0	0.0	
PROLOGIS INC		40,178	59,103	6,726	934,110	0.2	0.2	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		7,662	9,773	1,490	206,996	0.0	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST		4,902	6,009	707	98,258	0.0	0.0	
DUKE REALTY CORP		21,667	—	—	—	—	—	
ESSEX PROPERTY TRUST INC		3,332	4,379	939	130,433	0.0	0.0	
WELLTOWER INC		23,388	27,308	1,889	262,424	0.1	0.1	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		28,756	36,377	932	129,524	0.0	0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		8,664	11,186	731	101,638	0.0	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		64,936	22,502	477	66,278	0.0	0.0	
PUBLIC STORAGE		8,249	10,308	2,995	415,985	0.1	0.1	
REGENCY CENTERS CORP		8,289	9,608	632	87,821	0.0	0.0	
UDR INC		16,633	20,610	839	116,631	0.0	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		10,364	—	—	—	—	—	

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄		期首 (前期末)		期末		
		口数	口数	評価額		組入比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
DIGITAL REALTY TRUST INC		15,126	18,137	1,972	273,907	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC		7,376	8,530	1,309	181,853	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		31,858	31,858	413	57,425	0.0
WP CAREY INC		8,640	11,067	865	120,214	0.0
小計	口数・金額	672,476	807,343	60,424	8,391,121	1.9
	銘柄数 <比率>	36銘柄	37銘柄		<1.9%>	
<b>(カナダ)</b>				千カナダ・ドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		3,971	8,170	353	36,140	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		7,441	7,441	158	16,168	0.0
小計	口数・金額	11,412	15,611	512	52,309	0.0
	銘柄数 <比率>	2銘柄	2銘柄		<0.0%>	
<b>(オーストラリア)</b>				千オーストラリア・ドル		
SCENTRE GROUP		275,200	350,311	1,029	95,565	0.0
LENDLEASE GROUP		36,263	36,263	276	25,640	0.0
DEXUS/AU		54,256	79,604	625	58,057	0.0
TRANSURBAN GROUP		161,485	190,071	2,697	250,264	0.1
SYDNEY AIRPORT		62,186	—	—	—	—
APA GROUP		55,644	75,718	850	78,900	0.0
GPT GROUP		121,221	121,221	529	49,154	0.0
MIRVAC GROUP		200,053	251,619	558	51,831	0.0
STOCKLAND		127,393	127,393	484	44,919	0.0
GOODMAN GROUP		86,301	106,251	1,985	184,265	0.0
VICINITY CENTRES		241,241	241,241	489	45,441	0.0
小計	口数・金額	1,421,243	1,579,692	9,527	884,040	0.2
	銘柄数 <比率>	11銘柄	10銘柄		<0.2%>	
<b>(香港)</b>				千香港・ドル		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		197,000	276,000	2,586	45,981	0.0
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		193,500	193,500	1,075	19,128	0.0
LINK REIT		110,100	136,600	7,185	127,752	0.0
小計	口数・金額	500,600	606,100	10,847	192,862	0.0
	銘柄数 <比率>	3銘柄	3銘柄		<0.0%>	
<b>(シンガポール)</b>				千シンガポール・ドル		
CAPITALAND ASCENDAS REIT		170,500	219,000	604	61,072	0.0
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		259,616	303,516	631	63,787	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		208,100	208,100	335	33,852	0.0
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST		112,400	112,400	194	19,647	0.0
小計	口数・金額	750,616	843,016	1,765	178,360	0.0
	銘柄数 <比率>	4銘柄	4銘柄		<0.0%>	

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄		期首 (前期末)		期末		
		口数	口数	評価額		組入比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(イギリス)</b>				千イギリス・ポンド		
LAND SECURITIES GROUP PLC		39,861	39,861	247	41,121	0.0
SEGR0 PLC		68,623	78,831	637	105,933	0.0
BRITISH LAND CO PLC		44,962	49,008	198	32,969	0.0
小計	口数・金額	153,446	167,700	1,082	180,024	0.0
	銘柄数 <比率>	3銘柄	3銘柄		<0.0%>	
<b>(ユーロ・・・ベルギー)</b>				千ユーロ		
WAREHOUSES DE PAUW SCA		—	9,913	254	36,607	0.0
小計	口数・金額	—	9,913	254	36,607	0.0
	銘柄数 <比率>	—	1銘柄		<0.0%>	
<b>(ユーロ・・・フランス)</b>				千ユーロ		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		7,024	7,024	365	52,422	0.0
GECINA SA		2,189	3,082	292	41,928	0.0
KLEPIERRE		13,600	13,600	303	43,505	0.0
COVIVIO		2,388	2,388	134	19,320	0.0
小計	口数・金額	25,201	26,094	1,094	157,176	0.0
	銘柄数 <比率>	4銘柄	4銘柄		<0.0%>	
ユーロ通貨計	口数・金額	25,201	36,007	1,349	193,784	0.0
	銘柄数 <比率>	4銘柄	5銘柄		<0.0%>	
合計	口数・金額	3,534,994	4,055,469	—	10,072,502	2.3
	銘柄数 <比率>	63銘柄	64銘柄		<2.3%>	

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

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※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。

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			期末	
			買建額	売建額
外国			百万円	百万円
	S & P	500 EMINI FUT	15,983	—
	S P I	200 FUTURES	757	—
	F T S E	100 I D X FUT	963	—
	E U R O	S T O X X 50	3,089	—

※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

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	411,677,365	93.1
投 資 証 券	10,072,502	2.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	20,646,824	4.7
投 資 信 託 財 産 総 額	442,396,692	100.0

※期末における外貨建資産(440,169,581千円)の投資信託財産総額(442,396,692千円)に対する比率は99.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=138.87円、1カナダ・ドル=102.16円、1オーストラリア・ドル=92.79円、1香港・ドル=17.78円、1シンガポール・ドル=101.04円、1ニュージーランド・ドル=86.13円、1イギリス・ポンド=166.23円、1イスラエル・シェケル=40.334円、1スイス・フラン=145.67円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.90円、1スウェーデン・クローナ=13.14円、1ユーロ=143.58円です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	445,475,559,094円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	14,541,913,780
株 式(評価額)	411,677,365,126
投 資 証 券(評価額)	10,072,502,218
未 収 入 金	3,568,262,597
未 収 配 当 金	582,453,884
差 入 委 託 証 拠 金	5,033,061,489
(B) 負 債	3,273,997,642
未 払 金	3,112,990,857
未 払 解 約 金	161,000,409
そ の 他 未 払 費 用	6,376
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	442,201,561,452
元 本	72,186,242,919
次 期 繰 越 損 益 金	370,015,318,533
(D) 受 益 権 総 口 数	72,186,242,919口
1万口当たり基準価額(C/D)	61,258円

※当期における期首元本額60,650,874,522円、期中追加設定元本額22,050,143,482円、期中一部解約元本額10,514,775,085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2021年12月1日 至2022年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	7,287,501,862円
受 取 配 当 金	7,253,557,434
受 取 利 息	8,351,669
そ の 他 収 益 金	26,025,121
支 払 利 息	△ 432,362
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	11,547,232,777
売 買 損 益	99,265,619,371
売 買 損 益	△ 87,718,386,594
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 84,643,124
取 引 損 益	2,643,294,548
取 引 損 益	△ 2,727,937,672
(D) そ の 他 費 用 等	△ 145,059,032
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	18,605,032,483
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	293,167,362,270
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 50,863,192,984
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	109,106,116,764
(I) 合 計(E+F+G+H)	370,015,318,533
次 期 繰 越 損 益 金(I)	370,015,318,533

※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	36,369,253,618円	三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	50,536,075円
三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型)	284,736,068円	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	449,296,410円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	1,090,013,037円	バランスファンドVA (安定運用型) <適格機関投資家限定>	3,279,377円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	785,999,194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>	20,004,315円
SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	33,400,233円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	536,704,870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)	1,017,107円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	702,957,041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)	5,342,658円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	3,074,190,088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)	16,884,192円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	9,972,101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)	49,323,143円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	49,989,232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)	54,445,231円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	423,311,736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)	105,113,958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>	36,093,954円
外国株式指数ファンド	936,693,371円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	90,939,599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	17,542,779,547円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	427,001,205円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	90,349,697円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	293,567,068円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	117,821,294円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	687,726,675円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	75,689,448円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	200,225円
イオン・バランス戦略ファンド	20,982,589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)	194,459,687円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	21,006,539円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	59,953,329円
三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)	130,889,105円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,255,976円
三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型)	118,201,443円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	6,951,628円
三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型)	437,684,453円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,833,026円
三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型)	238,781,337円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	17,103,227円
三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型)	274,840,665円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	51,782,752円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	54,612,889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>	110,286,434円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,637,991,448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>	46,890,632円
三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)	10,892,390円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	281,352,925円
三井住友DS・年金バランス50 (標準型)	47,697,547円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	80,381,144円
三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)	42,074,552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>	1,662,845,853円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,714,893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>	17,217,947円
SMBC・DCインデックスファンド (MSCIコクサイ)	397,450,005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>	1,803,118円
日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジあり)	250,037,372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>	2,321,567円
日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジなし)	1,466,576,467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>	74,738,213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〉

(2021年12月18日から2022年12月19日まで)

第 19 期

決算日 2022年12月19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	マザーファンドへの投資を通じて、あるいは、直接、ベンチマーク採用国の国債等に投資することにより、FTSE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。
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	■主として日本を除く世界各国の債券に投資し、FTSE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た運用を行います。 ■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 (2021年12月18日から2022年12月19日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 信託報酬	13円	0.067%	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)	(0.045)	
(b) その他費用	9	0.044	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)	(8)	(0.038)	
(監査費用)	(1)	(0.006)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合 計	22	0.111	

期中の平均基準価額は19,713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 (2021年12月18日から2022年12月19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 2,006,119	千円 3,995,619	千口 259,127	千円 521,610

### ■ 組 入 れ 資 産 の 明 細 (2022年12月19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 2,390,473	千口 4,137,465	千円 8,210,799

※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77,954,604,200口です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年12月19日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	8, 210, 809, 979円
コール・ローン等	10, 314
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	8, 210, 799, 665
(B) 負 債	2, 772, 735
未払信託報酬	2, 559, 496
その他未払費用	213, 239
(C) 純資産総額(A-B)	8, 208, 037, 244
元 本	4, 188, 647, 204
次期繰越損益金	4, 019, 390, 040
(D) 受益権総口数	4, 188, 647, 204口
1万口当たり基準価額(C/D)	19, 596円

※当期における期首元本額2,418,278,214円、期中追加設定元本額2,049,855,201円、期中一部解約元本額279,486,211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2021年12月18日 至2022年12月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 123円
受 取 利 息	1
支 払 利 息	△ 124
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 36, 721, 045
売 買 損 益	6, 111, 255
売 買 損 益	△ 42, 832, 300
(C) 信 託 報 酬 等	△ 5, 328, 487
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 42, 049, 655
(E) 前期繰越損益金	402, 152, 532
(F) 追加信託差損益金	3, 659, 287, 163
( 配 当 等 相 当 額 )	( 4, 968, 202, 243)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△1, 308, 915, 080)
(G) 合 計 (D+E+F)	4, 019, 390, 040
次期繰越損益金(G)	4, 019, 390, 040
追加信託差損益金	3, 659, 287, 163
( 配 当 等 相 当 額 )	( 4, 971, 701, 094)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△1, 312, 413, 931)
分配準備積立金	553, 399, 350
繰越損益金	△ 193, 296, 473

※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。

※株式投資の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投資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	151, 246, 818円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	4, 971, 701, 094
(d) 分配準備積立金	402, 152, 532
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	5, 525, 100, 444
1万口当たり当期分配対象額	13, 190.66
(f) 分配金	0
1万口当たり分配金	0

# 外国債券パッシブ・マザーファンド

第19期（2021年12月18日から2022年12月19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"> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> </ul>

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
	円	%	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率		
15期（2018年12月17日）	17,553	△1.9	177.36	△2.0	98.7	百万円 168,894
16期（2019年12月17日）	18,248	4.0	184.64	4.1	98.6	171,892
17期（2020年12月17日）	19,109	4.7	193.48	4.8	99.0	161,689
18期（2021年12月17日）	19,947	4.4	201.87	4.3	99.1	162,393
19期（2022年12月19日）	19,845	△0.5	200.98	△0.4	98.9	154,701

※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

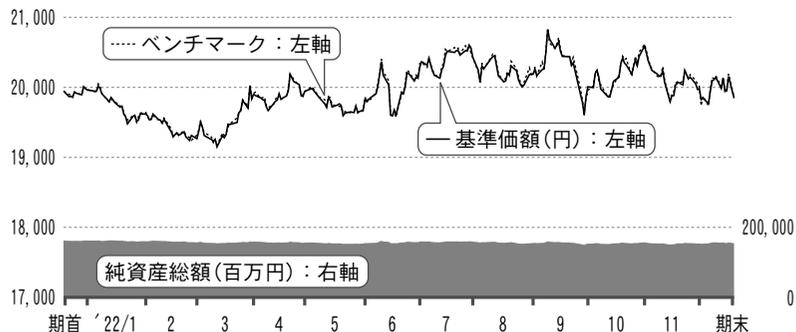
年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		公 社 債 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2021年12月17日	円 19,947	% —	201.87	% —	% 99.1
12月末	19,962	0.1	202.11	0.1	98.8
2022年1月末	19,620	△1.6	198.79	△1.5	99.2
2月末	19,267	△3.4	195.51	△3.1	99.2
3月末	19,901	△0.2	201.52	△0.2	98.9
4月末	19,943	△0.0	201.80	△0.0	98.8
5月末	19,824	△0.6	201.02	△0.4	98.5
6月末	20,294	1.7	205.87	2.0	98.7
7月末	20,430	2.4	206.71	2.4	99.0
8月末	20,188	1.2	204.09	1.1	98.4
9月末	20,008	0.3	201.99	0.1	98.5
10月末	20,591	3.2	208.63	3.3	98.5
11月末	19,980	0.2	202.57	0.3	98.4
(期 末) 2022年12月19日	19,845	△0.5	200.98	△0.4	98.9

※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（2021年12月18日から2022年12月19日まで）

### 基準価額等の推移



期首	19,947円
期末	19,845円
騰落率	-0.5%

※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（2021年12月18日から2022年12月19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	・米ドルを中心に投資通貨が対円で上昇したこと
下落要因	・欧米金利が上昇（債券価格は下落）したこと

### ▶ 投資環境について（2021年12月18日から2022年12月19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

インフレ率上昇への懸念から、グローバルに中央銀行の急速な金融緩和策の縮小が警戒され、欧米の金利は上昇しました。

#### 為替市場

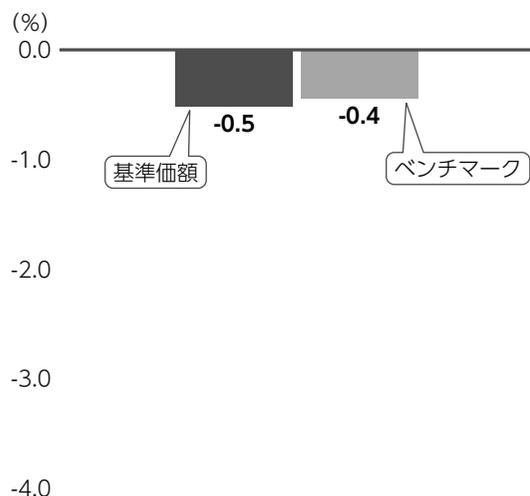
グローバルに中央銀行の金融緩和策の縮小が意識される中、欧米での金利先高観から米ドルを中心に投資通貨が対円で上昇しました。

### ▶ ポートフォリオについて（2021年12月18日から2022年12月19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 (2021年12月18日から2022年12月19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-0.5%となり、ベンチマークの騰落率-0.4%から0.1%の下方乖離となりました。

下方乖離要因 ・ 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

先進国では依然として粘着的なインフレ圧力が残るとみられるものの、米国等ではインフレのピークアウトの兆しも見え始めています。また、これまでの利上げに伴う景気減速が見込まれる中、FRB（米連邦準備制度理事会）の利上げペース鈍化などを受け、グローバルに中銀のタカ派（インフレ抑制を重視する立場）姿勢が緩むことで、先進国金利の上昇圧力は後退していくと予想します。

為替市場は、先進国金利の上昇圧力後退や日本銀行の政策調整観測などが円高要因になるとみられ、投資通貨は円に対して軟調な推移になりやすいと予想します。

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（2021年12月18日から2022年12月19日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用	8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）	(8)	(0.038)	
（その他）	(0)	(0.001)	
合計	8	0.038	

期中の平均基準価額は19,956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 (2021年12月18日から2022年12月19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 195,896	千アメリカ・ドル 212,347
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 9,186	千カナダ・ドル 9,482
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 5,492	千オーストラリア・ドル 6,819
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 2,968	千シンガポール・ドル 3,782
	ニュージーランド	国 債 証 券	千ニュージーランド・ドル 3,849	千ニュージーランド・ドル -
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 11,753	千イギリス・ポンド 14,882
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シェケル 4,973	千イスラエル・シェケル 9,620
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 2,244	千デンマーク・クローネ 8,498
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 3,232	千ノルウェー・クローネ 8,941
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 1,560	千スウェーデン・クローナ 11,104
国	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 14,892	千メキシコ・ペソ 26,213
	中国	国 債 証 券	千オフショア・人民元 256,265	千オフショア・人民元 14,165
	マレーシア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 6,025	千マレーシア・リンギット 6,684
	ポーランド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 23,663	千ポーランド・ズロチ 27,193
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	アイルランド	国 債 証 券	619	2,491
	オランダ	国 債 証 券	2,618	4,749

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

			買 付 額	売 付 額
外	ベルギー	国債証券	3,273	4,661
	フランス	国債証券	17,541	27,291
	ドイツ	国債証券	15,329	19,965
	スペイン	国債証券	10,693	17,735
	イタリア	国債証券	15,543	25,918
国	フィンランド	国債証券	1,130	1,860
	オーストリア	国債証券	3,250	4,562

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2021年12月18日から2022年12月19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 (2021年12月18日から2022年12月19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 (2022年12月19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BBB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 631,120	千アメリカ・ドル 571,823	千円 77,893,780	% 50.4	% -	% 22.3	% 18.1	% 9.9
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 32,550	千カナダ・ドル 31,410	3,129,436	2.0	-	1.2	0.5	0.3
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 28,550	千オーストラリア・ドル 26,906	2,455,718	1.6	-	1.1	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,300	千シンガポール・ドル 7,150	718,177	0.5	-	0.3	0.1	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
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 4,300	千ニュージーランド・ドル 3,819	332,288	0.2	—	0.1	0.1	—
イギリス	千イギリス・ポンド 47,550	千イギリス・ポンド 43,694	7,245,490	4.7	—	3.4	1.1	0.2
イスラエル	千イスラエル・シケル 14,100	千イスラエル・シケル 14,034	552,495	0.4	—	0.1	0.2	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 26,100	千デンマーク・クローネ 26,786	519,663	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 24,100	千ノルウェー・クローネ 22,792	314,312	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 23,200	千スウェーデン・クローナ 23,359	306,480	0.2	—	0.1	0.1	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 190,000	千メキシコ・ペソ 182,214	1,254,820	0.8	—	0.4	0.1	0.2
中国	千オフショア・人民元 278,000	千オフショア・人民元 280,516	5,476,180	3.5	—	1.7	1.5	0.3
マレーシア	千マレーシア・リンギット 26,300	千マレーシア・リンギット 26,653	820,533	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 26,800	千ポーランド・ズロチ 21,531	663,275	0.4	—	0.1	0.1	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	7,200	6,601	952,855	0.6	—	0.4	0.2	0.0
オランダ	17,800	17,092	2,467,283	1.6	—	1.1	0.4	0.1
ベルギー	21,550	20,136	2,906,640	1.9	—	1.4	0.3	0.2
フランス	97,520	90,586	13,076,191	8.5	—	5.1	2.5	0.9
ドイツ	75,200	71,219	10,280,487	6.6	—	3.7	2.1	0.9
スペイン	55,200	53,060	7,659,238	5.0	—	3.0	1.3	0.7
イタリア	84,770	79,202	11,432,812	7.4	—	4.2	2.2	1.0
フィンランド	5,700	5,191	749,419	0.5	—	0.3	0.1	0.1
オーストリア	13,200	12,298	1,775,312	1.1	—	0.7	0.4	0.1
合 計	—	—	152,982,896	98.9	—	51.3	32.3	15.3

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

## 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	
				千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
					外貨建金額	邦貨換算金額		
ア メ リ カ	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,300	2,088	284,519	2043/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,400	2,089	284,616	2043/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	2,400	2,348	319,902	2043/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	700	697	95,010	2043/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	5,700	5,546	755,582	2024/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	5,100	4,996	680,660	2024/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	500	469	63,996	2044/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	5,600	5,421	738,512	2024/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	600	586	79,921	2044/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,300	2,074	282,586	2044/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	5,100	4,919	670,080	2024/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,500	3,347	455,944	2025/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,500	3,091	421,083	2044/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,600	2,911	396,565	2045/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	600	573	78,098	2025/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,000	2,648	360,830	2045/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,300	3,134	427,013	2025/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,300	2,847	387,819	2045/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,000	3,817	520,060	2025/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,700	2,382	324,578	2045/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	2,900	2,710	369,281	2026/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	2,900	2,334	318,033	2046/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	14,950	13,896	1,892,977	2026/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,600	2,895	394,378	2046/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,450	1,872	255,046	2046/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	5,000	4,681	637,652	2026/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	3,100	3,029	412,713	2023/11/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,300	1,983	270,201	2046/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,000	2,929	399,113	2023/12/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,149	565,299	2027/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,200	2,145	292,212	2024/01/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,500	2,201	299,949	2047/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	6,500	6,307	859,141	2024/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,000	1,933	263,392	2024/04/30		
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,000	1,944	264,830	2024/02/29		
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	3,000	2,836	386,371	2027/05/15		
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,800	1,585	215,963	2047/05/15		
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,300	3,186	434,017	2024/05/31		
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	4,100	3,952	538,384	2024/06/30		

## 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	2.1250	3,500	3,376	460,006	2024/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,200	3,946	537,550	2027/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,300	2,781	378,900	2047/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,800	3,648	496,930	2024/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	4,000	3,853	524,910	2024/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	800	771	105,131	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,500	1,265	172,370	2047/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,121	561,457	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,600	2,500	340,681	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,900	3,756	511,707	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,400	3,287	447,803	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,800	4,596	626,067	2028/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,400	2,123	289,252	2048/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	1,943	264,798	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,000	969	132,047	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	400	389	53,082	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	9,000	8,654	1,178,951	2028/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,400	2,172	295,997	2048/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,100	3,015	410,800	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	900	873	118,976	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	4,500	4,321	588,684	2028/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	900	797	108,690	2048/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,400	3,291	448,308	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,000	975	132,814	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,600	2,533	345,080	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,900	2,818	383,909	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,100	2,949	401,826	2048/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,000	1,969	268,266	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,900	1,862	253,750	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,500	2,426	330,517	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,400	1,350	183,995	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,700	2,603	354,590	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,800	1,700	231,670	2029/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,300	2,941	400,640	2049/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	3,700	3,607	491,448	2024/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	2,100	2,013	274,316	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	13,300	12,658	1,724,310	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,800	3,686	502,122	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,400	2,231	304,003	2029/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,400	1,220	166,228	2049/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	6,200	5,957	811,566	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	850	814	111,018	2024/07/31

## 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	1.6250	450	399	54,440	2029/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,500	2,679	365,024	2049/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	7,100	6,516	887,670	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,000	2,859	389,518	2024/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,900	3,610	491,764	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	5,500	5,235	713,210	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,300	1,163	158,435	2029/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,900	1,494	203,596	2049/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	200	184	25,153	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	800	760	103,560	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	2,100	1,836	250,169	2030/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,800	2,020	275,271	2050/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,802	245,482	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,600	1,478	201,333	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,400	2,107	287,042	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	3,500	3,244	441,980	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	4,400	4,027	548,607	2027/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,500	1,407	191,765	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,900	1,794	244,440	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	4,000	3,815	519,717	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,500	6,107	832,001	2030/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	5,100	3,020	411,456	2050/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	4,400	4,016	547,157	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,332	181,513	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	2,500	2,174	296,264	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,754	375,231	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,200	1,047	142,622	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,900	2,644	360,175	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	4,000	3,472	473,043	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	300	272	37,117	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,500	2,154	293,441	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,000	5,671	772,586	2030/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	4,500	2,753	375,021	2050/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,200	2,117	288,511	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,000	1,810	246,599	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	4,800	4,113	560,374	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	7,000	5,762	785,030	2030/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,200	2,093	285,142	2050/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	8,500	7,136	972,066	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	5,800	4,041	550,580	2051/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	5,900	5,113	696,540	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,000	1,804	245,759	2025/11/30

## 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	0.3750	3,000	2,704	368,398	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,100	1,814	247,174	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,200	6,209	845,886	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,000	1,383	188,471	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	2,800	2,103	286,565	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,000	860	117,222	2027/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,000	901	122,852	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	7,700	7,320	997,225	2024/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	5,500	4,767	649,407	2031/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,400	1,097	149,436	2051/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,000	2,392	325,873	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	3,000	2,644	360,176	2028/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	5,200	4,345	591,906	2031/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,500	3,050	415,605	2028/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,900	2,080	283,439	2051/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	2,900	2,109	287,417	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	3,600	3,216	438,170	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	5,900	5,115	696,830	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,804	382,048	2024/09/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,500	3,943	537,248	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	4,400	4,124	561,811	2024/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,300	903	123,046	2051/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	4,900	4,117	560,888	2031/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	5,200	4,871	663,654	2024/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,200	3,816	519,917	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	6,000	5,292	720,933	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,800	2,880	392,430	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	4,500	4,230	576,210	2024/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	2,300	2,040	277,958	2028/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	2,000	1,920	261,667	2024/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,880	256,178	2025/01/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,300	2,087	284,347	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,500	2,201	299,936	2028/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	5,300	4,636	631,546	2032/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,000	2,838	386,612	2025/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	4,300	3,860	525,865	2029/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,800	2,263	308,290	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,700	1,293	176,202	2052/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	2,800	2,533	345,120	2029/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,400	3,157	430,111	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,500	1,425	194,232	2025/03/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	5,000	4,651	633,634	2029/03/31

## 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	2.6250	4,500	4,358	593,686	2025/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,000	2,857	389,215	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,500	3,352	456,636	2029/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	5,700	5,422	738,718	2032/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,000	2,912	396,796	2025/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,700	2,596	353,725	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	1,000	929	126,662	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,700	1,483	202,120	2052/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,000	1,946	265,212	2025/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,800	4,593	625,733	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,400	1,330	181,298	2029/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,000	1,951	265,808	2025/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	3,000	2,936	400,020	2029/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,200	3,950	538,082	2032/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	3,000	2,935	399,910	2025/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,100	1,037	141,312	2029/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,000	2,840	386,866	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	2,000	2,015	274,545	2025/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	3,500	3,558	484,755	2029/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	2,900	3,055	416,208	2032/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	3,800	3,857	525,519	2025/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	3,500	3,572	486,677	2027/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,000	1,025	139,625	2029/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,200	1,303	177,523	2052/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.0000	1,000	1,062	144,775	2026/02/15
	US TREASURY BOND	国債証券	6.1250	1,000	1,109	151,129	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.2500	500	541	73,701	2028/11/15
	US TREASURY BOND	国債証券	5.3750	320	361	49,219	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	200	198	27,052	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	100	108	14,800	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	300	335	45,715	2039/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	300	330	45,019	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	200	226	30,887	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	900	989	134,732	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	500	515	70,211	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	600	648	88,314	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	900	1,034	140,882	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	300	329	44,821	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	1,500	1,509	205,607	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,000	915	124,736	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	800	715	97,498	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	1,711	233,167	2042/08/15

## 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	2.7500	300	256	34,924	2042/11/15
小 計			-	631,120	571,823	77,893,780	-
カ ナ ダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	千カナダ・ドル 250	千カナダ・ドル 294	29,291	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	400	504	50,244	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	600	743	74,052	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,900	2,179	217,163	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	1,200	1,315	131,030	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	2,100	2,062	205,492	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	500	486	48,517	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,300	1,267	126,235	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	3,200	3,035	302,441	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	1,100	1,016	101,293	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	700	674	67,157	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,400	1,361	135,605	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,000	980	97,697	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,200	2,122	211,457	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	5,700	5,123	510,488	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	2,700	2,500	249,143	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,000	773	77,017	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,300	2,065	205,784	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	700	669	66,676	2025/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,600	1,553	154,812	2029/12/01
CANADA GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	680	67,830	2064/12/01	
小 計			-	32,550	31,410	3,129,436	-
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	千オーストラリア・ドル 2,500	千オーストラリア・ドル 2,486	226,967	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	800	797	72,775	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5000	900	981	89,545	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	1,300	1,303	119,010	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	2,150	2,222	202,888	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	1,200	1,207	110,246	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	800	731	66,784	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,300	1,271	116,083	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	2,000	1,874	171,094	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,600	1,520	138,782	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,200	1,042	95,163	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	194	17,736	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,800	1,734	158,315	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	2,600	2,452	223,835	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	4,700	4,037	368,544	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	323	29,536	2051/06/21

## 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	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	800	736	67,181	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,200	1,029	93,960	2032/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,000	956	87,264	2033/11/21
	小 計		-	28,550	26,906	2,455,718	-
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 1,100	千シンガポール・ドル 1,128	113,378	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,000	997	100,205	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	200	198	19,957	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	698	70,149	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	300	311	31,322	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	800	818	82,200	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	800	737	74,122	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	788	79,178	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	1,000	904	90,875	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	600	565	56,786	2026/11/01
	小 計		-	7,300	7,150	718,177	-
ニュージーランド	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	4.5000	千ニュージーランド・ドル 1,100	千ニュージーランド・ドル 1,101	95,865	2027/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,100	1,050	91,355	2025/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	3.0000	600	556	48,410	2029/04/20
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	329	28,649	2041/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	500	368	32,051	2051/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.0000	500	413	35,956	2032/05/15
	小 計		-	4,300	3,819	332,288	-
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 741	122,873	2028/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	500	536	88,984	2032/06/07
	UK GILT	国債証券	5.0000	1,300	1,343	222,852	2025/03/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	962	159,589	2036/03/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,000	1,125	186,565	2038/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,700	1,895	314,354	2055/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,500	1,608	266,690	2046/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	937	155,417	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,050	1,156	191,809	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,150	1,268	210,267	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	973	161,429	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	600	636	105,578	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,100	1,204	199,662	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	1,300	1,415	234,738	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	4.2500	600	636	105,625	2040/12/07
	UK GILT	国債証券	3.7500	1,200	1,209	200,510	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	1,600	1,475	244,644	2044/01/22

## 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	3.5000	1,300	1,301	215,889	2068/07/22
	UK GILT	国債証券	2.7500	900	887	147,191	2024/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,250	1,195	198,246	2045/01/22
	UK GILT	国債証券	2.0000	1,100	1,061	176,014	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	1,600	1,255	208,230	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	1,100	1,032	171,140	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	2,000	1,280	212,359	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	100	78	12,977	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.2500	200	182	30,273	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	300	274	45,510	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.0000	800	774	128,399	2024/04/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	1,250	840	139,386	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	500	311	51,570	2054/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	500	427	70,874	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	2,900	2,716	450,476	2025/06/07
	UK GILT	国債証券	0.3750	1,800	1,439	238,646	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	0.5000	100	38	6,306	2061/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	1,300	1,181	195,919	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.1250	500	425	70,593	2028/01/31
	UK GILT	国債証券	0.6250	2,200	1,540	255,516	2035/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	1,300	998	165,640	2031/07/31
	UK GILT	国債証券	0.3750	1,200	1,072	177,849	2026/10/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	500	285	47,363	2051/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	700	651	108,100	2025/01/31
	UK GILT	国債証券	0.5000	1,800	1,517	251,701	2029/01/31
	UK GILT	国債証券	1.0000	1,700	1,381	228,999	2032/01/31
	UK GILT	国債証券	1.1250	300	139	23,094	2073/10/22
	UK TSY GILT	国債証券	1.1250	400	275	45,623	2039/01/31
	小 計		—	47,550	43,694	7,245,490	—
イ ス ラ エ ル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	千イスラエル・シケル 3,500	千イスラエル・シケル 3,645	143,529	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	2,200	2,162	85,129	2023/11/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	2,600	2,863	112,727	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	500	471	18,566	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.0000	700	597	23,518	2030/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.5000	4,600	4,293	169,023	2025/04/30
	小 計		—	14,100	14,034	552,495	—
デ ン マ ー ク	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 8,700	千デンマーク・クローネ 11,404	221,250	2039/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.7500	2,800	2,744	53,250	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	8,000	7,304	141,700	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	4,800	4,229	82,051	2029/11/15

## 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		
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.2500	1,800	1,103	21,410	2052/11/15	
小 計			—	26,100	26,786	519,663	—	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	千ノルウェー・クローネ 2,800	千ノルウェー・クローネ 2,795	38,547	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	3,000	2,916	40,221	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	3,000	2,865	39,522	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	5,900	5,629	77,634	2028/04/26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	5,200	4,831	66,629	2029/09/06	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.3750	4,200	3,753	51,756	2030/08/19	
小 計			—	24,100	22,792	314,312	—	
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 5,650	74,132	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.5000	5,000	4,991	65,493	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.0000	6,200	5,894	77,329	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	3,700	3,436	45,083	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	3,700	3,387	44,440	2029/11/12	
小 計			—	23,200	23,359	306,480	—	
メキシコ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	8.0000	千メキシコ・ペソ 21,000	千メキシコ・ペソ 20,481	141,047	2023/12/07	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	10.0000	32,000	32,203	221,771	2024/12/05	
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	16,000	15,296	105,340	2027/06/03	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	18,000	17,778	122,431	2029/05/31	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	40,000	38,348	264,089	2038/11/18	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	21,000	19,727	135,852	2031/05/29	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	18,000	16,447	113,265	2034/11/23	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	19,000	17,388	119,745	2026/03/05	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	5,000	4,541	31,276	2047/11/07	
小 計			—	190,000	182,214	1,254,820	—	
中 国	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	千オフショア・人民元 51,000	千オフショア・人民元 51,035	996,298	2026/08/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	26,000	26,011	507,800	2024/09/02	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	23,000	23,164	452,220	2028/10/14	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7200	31,000	33,493	653,850	2051/04/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0200	43,000	43,492	849,048	2031/05/27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2600	22,000	21,869	426,924	2025/02/24	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	26,000	25,942	506,445	2029/03/24	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	9,000	8,911	173,965	2027/04/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2400	31,000	30,762	600,540	2025/05/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,000	6,940	135,499	2027/07/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	3,000	2,970	57,995	2025/08/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	6,000	5,921	115,591	2029/09/25	
	小 計			—	278,000	280,516	5,476,180	—

## 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	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	5,100	5,045	155,333	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	6,400	6,620	203,818	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	3,200	3,228	99,384	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	6,700	6,941	213,684	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.4780	700	699	21,539	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.8820	1,500	1,506	46,384	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.9000	1,300	1,308	40,282	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.7570	1,400	1,302	40,105	2040/05/22
小 計			-	26,300	26,653	820,533	-
ポーランド	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	1,818	56,008	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	8,000	7,382	227,415	2024/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,800	1,568	48,320	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	7,800	5,301	163,316	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	7,000	5,460	168,215	2026/10/25
小 計			-	26,800	21,531	663,275	-
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	850	122,778	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.4000	500	506	73,130	2024/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	600	594	85,813	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.0000	900	772	111,447	2045/02/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	800	765	110,560	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	300	259	37,525	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	500	460	66,499	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3000	800	697	100,623	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	500	456	65,882	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	500	458	66,212	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	500	380	54,962	2050/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.0000	500	397	57,418	2031/10/18
オランダ	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	5.5000	700	802	115,846	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,400	1,646	237,688	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	1,300	1,566	226,174	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	200	200	28,895	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.0000	700	695	100,404	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,700	1,848	266,852	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	1,100	1,041	150,374	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,593	229,949	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	400	372	53,774	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	500	487	70,360	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	1,500	1,375	198,546	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	1,000	870	125,718	2029/07/15

## 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	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,250	180,544	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	2,600	2,174	313,849	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	1,100	999	144,240	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	200	166	24,063	2032/07/15
ベルギー	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	1,100	1,266	182,759	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0000	1,000	1,210	174,765	2035/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.2500	1,000	1,168	168,709	2041/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	700	746	107,810	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	500	548	79,210	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6000	400	400	57,838	2024/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	800	901	130,140	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	200	201	29,143	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	300	288	41,653	2025/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,300	1,135	163,967	2031/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	1,000	866	125,070	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,800	1,717	247,857	2026/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	650	501	72,342	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.1500	500	432	62,396	2066/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	800	743	107,339	2027/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.5000	1,300	1,255	181,190	2024/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	500	437	63,083	2057/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	400	329	47,513	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	1,600	1,465	211,603	2028/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	1,100	952	137,439	2033/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	900	812	117,337	2029/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	500	385	55,577	2050/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	200	166	23,978	2030/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	300	194	28,063	2040/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	400	193	27,937	2071/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	2,000	1,575	227,371	2031/10/22
BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.3500	300	239	34,537	2032/06/22	
フランス	FRANCE O. A. T.	国債証券	6.0000	2,100	2,301	332,181	2025/10/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.5000	1,650	1,938	279,856	2029/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.7500	400	505	73,024	2032/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.7500	800	955	137,886	2035/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	1,370	1,690	244,060	2055/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	2,000	2,273	328,208	2038/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.5000	2,100	2,569	370,870	2041/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	1,400	1,785	257,703	2060/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.5000	2,100	2,168	313,008	2026/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	3,850	3,898	562,783	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.2500	900	953	137,668	2045/05/25

## 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	2.2500	1,700	1,694	244,531	2024/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	2,600	2,561	369,800	2024/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	3,500	3,501	505,437	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,300	1,240	179,017	2025/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	1,300	1,247	180,088	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	2,550	2,356	340,157	2031/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	3,500	3,276	473,021	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	3,700	3,032	437,744	2036/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	800	617	89,114	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.2500	3,200	2,939	424,352	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	3,200	2,749	396,881	2039/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	1,800	1,691	244,198	2027/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	2,000	1,692	244,274	2048/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,300	3,009	434,435	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	1,200	1,016	146,686	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,500	3,170	457,713	2028/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	4,800	4,651	671,497	2024/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	2,400	1,797	259,441	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	2,300	2,029	293,014	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,900	1,795	259,216	2025/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	4,500	3,790	547,163	2029/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,000	1,791	258,587	2052/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,800	3,515	507,467	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,900	3,196	461,417	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	400	388	56,125	2024/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	100	44	6,379	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,200	754	108,958	2044/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,000	2,386	344,525	2031/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,000	2,839	409,903	2025/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,900	1,484	214,338	2032/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	500	457	66,052	2028/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	3,000	2,822	407,396	2032/11/25
ド イ ツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	1,200	1,250	180,450	2024/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.5000	1,000	1,184	170,934	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.6250	1,000	1,161	167,635	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,600	1,810	261,291	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	500	631	91,217	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.5000	900	1,115	161,080	2031/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	600	756	109,215	2034/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.0000	1,800	2,189	316,101	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.2500	700	897	129,594	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,450	1,987	286,872	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	826	119,296	2042/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	1,900	2,043	294,985	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	2,200	2,176	314,241	2024/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7500	2,200	2,188	315,858	2024/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	2,700	2,948	425,566	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,500	2,406	347,316	2025/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,300	1,273	183,776	2024/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,300	1,257	181,516	2025/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	3,100	2,939	424,269	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	2,300	2,124	306,623	2027/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,300	2,130	307,466	2027/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.2500	1,450	1,245	179,717	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,100	1,928	278,417	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	1,500	1,348	194,653	2028/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	1,800	1,604	231,674	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,500	2,168	313,051	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,000	1,775	256,356	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	800	687	99,226	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,600	2,739	395,497	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	5,800	4,936	712,599	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,300	1,168	168,675	2027/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,500	1,249	180,352	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,200	2,633	380,197	2032/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,000	843	121,698	2038/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.8000	200	191	27,669	2053/08/15
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,300	1,263	182,319	2024/04/05
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,000	958	138,388	2024/10/18
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	2,800	2,656	383,522	2025/04/11
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,800	1,690	244,037	2025/10/10
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,100	1,011	145,964	2026/10/09
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	4,200	3,818	551,153	2027/04/16
スペイン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	2,200	2,580	372,458	2029/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	1,700	1,177	169,967	2040/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	1,000	1,219	175,968	2032/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	1,250	1,364	196,980	2037/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.9000	1,200	1,432	206,777	2040/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.8000	2,200	2,254	325,480	2024/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	1,500	1,756	253,483	2041/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.6500	800	839	121,241	2025/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.9000	500	554	80,026	2026/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,500	1,675	241,871	2028/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,000	1,262	182,215	2044/10/31

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期		評 価 額		末
			利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.8000	1,400	1,422	205,289	2024/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7500	2,100	2,103	303,592	2024/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.6000	1,400	1,367	197,385	2025/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.1500	1,600	1,578	227,853	2025/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	1,700	1,577	227,687	2030/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	2,000	1,949	281,367	2026/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.9000	1,700	1,564	225,895	2046/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	1,300	1,266	182,854	2066/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.3000	3,100	2,939	424,269	2026/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.5000	1,500	1,421	205,200	2027/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.3500	700	643	92,844	2033/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	1,100	1,030	148,775	2027/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	1,600	1,481	213,912	2028/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7000	750	656	94,698	2048/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	2,200	2,030	293,075	2028/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	1,600	1,464	211,358	2029/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.8500	2,000	1,691	244,173	2035/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.2500	1,400	1,347	194,446	2024/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	1,000	837	120,836	2030/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	1,700	1,551	223,967	2027/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	300	171	24,707	2050/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	500	472	68,264	2025/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2500	3,000	2,629	379,520	2030/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	400	207	29,979	2071/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	1,400	1,117	161,358	2031/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.7000	2,200	1,762	254,344	2032/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.5500	700	658	95,104	2032/10/31
イタリア	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	7.2500	400	456	65,833	2026/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.5000	1,700	1,920	277,244	2027/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	2,000	2,100	303,160	2028/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	2,200	1,843	266,133	2030/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.0000	2,200	2,510	362,356	2031/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.7500	1,700	1,898	274,103	2033/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	2,070	2,174	313,959	2034/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	2,600	2,514	362,984	2037/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,800	1,921	277,368	2039/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,000	1,039	150,024	2025/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,700	1,825	263,505	2040/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,800	1,858	268,316	2026/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,000	1,016	146,669	2024/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	1,100	1,155	166,783	2044/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.7500	2,300	2,326	335,759	2024/09/01

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期		評 価 額		末
			利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	2,000	1,950	281,514	2030/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	1,300	1,286	185,665	2024/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	1,600	1,357	195,969	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	1,900	1,824	263,335	2025/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	1,300	1,252	180,749	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6000	1,200	1,128	162,894	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.7000	1,550	1,194	172,411	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2500	500	395	57,096	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.2500	800	735	106,114	2026/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	600	435	62,911	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	1,100	922	133,179	2033/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2000	900	851	122,907	2027/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	700	688	99,428	2024/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	1,000	874	126,177	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0500	1,500	1,402	202,442	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	1,800	1,747	252,185	2024/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	600	503	72,703	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	3,200	2,952	426,208	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	700	673	97,186	2025/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	1,600	1,519	219,303	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	1,200	1,174	169,549	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.3500	850	763	110,208	2035/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	1,100	1,024	147,870	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0000	3,100	2,944	425,074	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1000	1,000	954	137,812	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	500	422	60,926	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.3500	2,400	2,263	326,758	2025/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.8500	1,700	1,531	221,039	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	1,800	1,439	207,723	2030/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	400	286	41,309	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	900	644	93,015	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	1,000	965	139,364	2025/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	800	708	102,217	2027/09/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	1,000	914	131,958	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.7000	1,500	902	130,252	2051/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9000	2,000	1,559	225,099	2031/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	2,600	1,985	286,673	2031/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	2,100	1,581	228,239	2032/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	1,300	1,224	176,694	2024/12/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.1000	2,700	2,437	351,846	2027/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	1,000	935	135,030	2029/06/15
	BTPS	国債証券	0.0000	2,400	2,283	329,557	2024/08/15

## 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	
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	4.0000	300	311	45,016	2025/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	403	58,244	2028/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	788	113,847	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.0000	900	895	129,251	2024/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	500	427	61,742	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	700	657	94,876	2026/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	500	396	57,293	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	400	355	51,307	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	800	695	100,392	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	400	259	37,449	2040/09/15
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	1,000	1,165	168,309	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	300	346	50,081	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	500	537	77,653	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	700	880	127,061	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	500	531	76,745	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.4000	900	866	125,109	2034/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.6500	800	788	113,863	2024/10/21
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.2000	1,000	967	139,693	2025/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	1,300	1,223	176,603	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	700	557	80,448	2047/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	700	643	92,939	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	700	640	92,456	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	550	484	69,907	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	900	743	107,385	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	900	566	81,742	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	200	135	19,574	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.8500	150	69	10,086	2120/06/30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	900	722	104,354	2031/02/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.9000	500	424	61,297	2032/02/20	
小 計			—	378,140	355,387	51,300,242	—
合 計			—	—	—	152,982,896	—

※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。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 投資信託財産の構成

(2022年12月19日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	152,982,896	98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,745,720	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	154,728,616	100.0

※期末における外貨建資産（154,175,700千円）の投資信託財産総額（154,728,616千円）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=136.22円、1カナダ・ドル=99.63円、1オーストラリア・ドル=91.27円、1シンガポール・ドル=100.44円、1ニュージーランド・ドル=87.00円、1イギリス・ポンド=165.82円、1イスラエル・シケル=39.366円、1デンマーク・クローネ=19.40円、1ノルウェー・クローネ=13.79円、1スウェーデン・クローナ=13.12円、1メキシコ・ペソ=6.886円、1オフショア・人民元=19.521円、1マレーシア・リンギット=30.785円、1ポーランド・ズロチ=30.804円、1ユーロ=144.35円です。

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年12月19日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	154,728,616,682円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	749,201,414
公 社 債(評価額)	152,982,896,578
未 収 利 息	942,268,098
前 払 費 用	54,250,592
(B) 負 債	27,106,863
未 払 解 約 金	27,102,311
そ の 他 未 払 費 用	4,552
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	154,701,509,819
元 本	77,954,604,200
次 期 繰 越 損 益 金	76,746,905,619
(D) 受 益 権 総 口 数	77,954,604,200口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,845円

※当期における期首元本額81,412,102,331円、期中追加設定元本額11,717,059,759円、期中一部解約元本額15,174,557,890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2021年12月18日 至2022年12月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,388,011,459円
受 取 利 息	3,388,241,031
そ の 他 収 益 金	87,605
支 払 利 息	△ 317,177
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 4,218,802,521
売 買 益	24,469,390,677
売 買 損	△28,688,193,198
(C) そ の 他 費 用 等	△ 60,550,279
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 891,341,341
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	80,981,208,508
(F) 解 約 差 損 益 金	△14,987,799,996
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,644,838,448
(H) 合 計(D+E+F+G)	76,746,905,619
次 期 繰 越 損 益 金(H)	76,746,905,619

※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	25,699,219,523円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	5,723,489,507円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	864,451,522円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,976,908,206円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,193,210,727円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,301,306,578円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,215,238,768円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	30,338,011円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	153,997,157円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	75,478,804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)	6,115,153円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	631,815,767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)	28,041,920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>	109,386,082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)	96,060,756円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	949,869,564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)	253,631,582円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,268,921,919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)	182,685,179円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,332,150,475円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	294,968,200円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,139,989,648円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,146,332円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	176,453,310円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,092,729,430円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	196,065,249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)	314,642,256円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	127,100,213円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	120,661,407円
イオン・バランス戦略ファンド	337,501,691円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,375,516円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	24,330,578円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	30,968,221円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	82,010,179円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,592,229円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	61,886,719円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	78,931,659円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	163,669,831円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	363,615,745円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	49,154,614円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,450,602円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	24,004,429円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,410,392円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	171,579,317円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,460,174円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	643,974,752円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	897,907,179円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	34,145,102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>	547,164,260円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	100,150,368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>	740,186,895円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	66,880,818円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	424,473,864円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,130,696円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	278,652,069円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	817,097,768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>	101,287,305円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	43,737,304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>	85,173,393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>	4,137,465,188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>	109,719,316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>	30,152,077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>	717,685,989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)】

(2021年4月14日から2022年4月13日まで)

第 **14** 期

決算日 2022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。 <b>マネーインカム・マザーファンド</b> 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。 <b>マネーインカム・マザーファンド</b> ■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)

## SMAM・マネーインカムファンド<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。

### ■ 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		公 社 債 率 組 入 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配	込 金 騰 落 率	期 騰 落 率	中 率		
	円	円	%		%	%	百万円
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
14期 (2022年 4月13日)	10,044	0	△0.0	100.73	△0.0	76.7	864

※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。

※参考指数は市場の動きを示す目的で記載しており、当ファンドが当該参考指数を意識して運用しているわけではありません。

### ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(参 考 指 数) 無 担 保 コ ー ル 翌 日 物		公 社 債 率 組 入 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期 首)	円	%		%	%
2021年 4月13日	10,049	—	100.76	—	76.3
4月末	10,049	0.0	100.76	△0.0	73.4
5月末	10,048	△0.0	100.76	△0.0	72.6
6月末	10,047	△0.0	100.76	△0.0	74.7
7月末	10,047	△0.0	100.75	△0.0	76.6
8月末	10,046	△0.0	100.75	△0.0	74.4
9月末	10,046	△0.0	100.75	△0.0	76.0
10月末	10,046	△0.0	100.74	△0.0	76.6
11月末	10,045	△0.0	100.74	△0.0	77.2
12月末	10,045	△0.0	100.74	△0.0	73.0
2022年 1月末	10,044	△0.0	100.73	△0.0	71.2
2月末	10,044	△0.0	100.73	△0.0	71.2
3月末	10,043	△0.1	100.73	△0.0	75.9
(期 末)					
2022年 4月13日	10,044	△0.0	100.73	△0.0	76.7

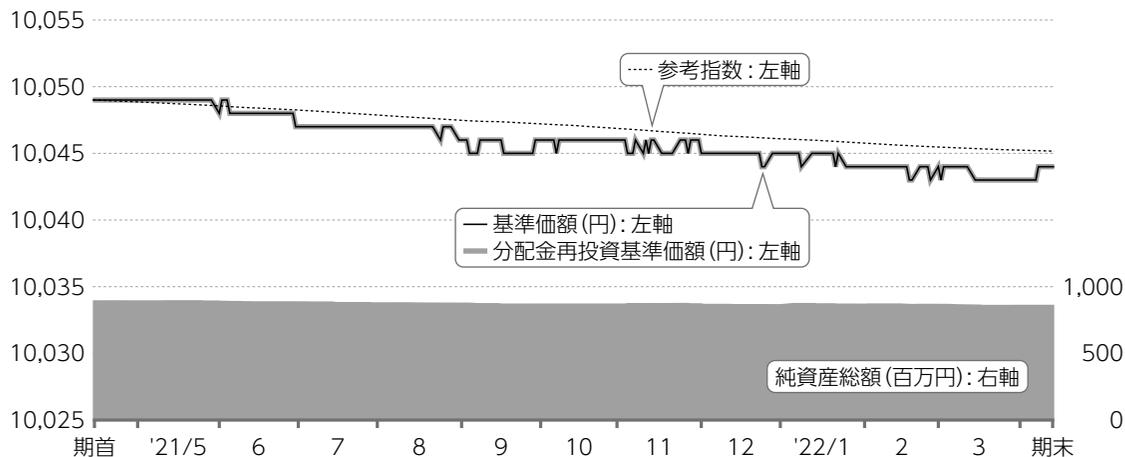
※騰落率は期首比です。

※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(2021年4月14日から2022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	10,049円
期末	10,044円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-0.0% (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(2021年4月14日から2022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

投資環境について(2021年4月14日から2022年4月13日まで)

**短期金利は低下しました。**

物価の上昇率が低水準にとどまったことや、新型コロナウイルスの感染拡大が繰り返されたことから、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。

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、発行額の増減などにより上下に振れる局面もありましたが、日銀が需給動向を勘案して短期国債の買入れ額を調整したことから、期を通じて概ねレンジ内での推移となりました。

ポートフォリオについて(2021年4月14日から2022年4月13日まで)

---

## 当ファンド

期を通じて「マネーインカム・マザーファンド」を高位に組み入れました。

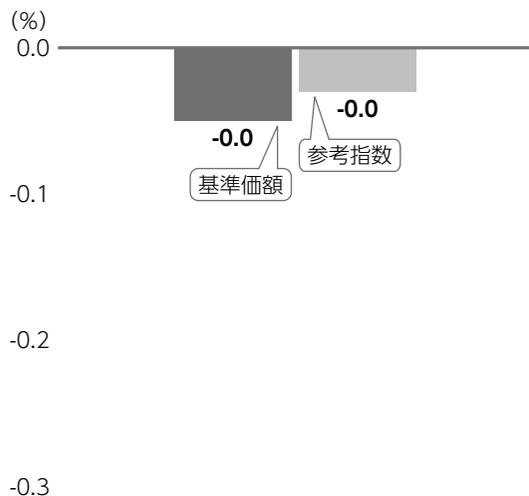
---

## マネーインカム・マザーファンド

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、残存0年から1年3ヵ月までの円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを維持しました。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(2021年4月14日から2022年4月13日まで)

基準価額と参考指数の騰落率対比



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(2021年4月14日から2022年4月13日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第14期
当期分配金	0
(対基準価額比率)	(0.00%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,407

期間の1万口当たりの分配金(税引前)は、分配可能額および基準価額水準等を勘案し、左記の通りといたしました。

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

商品市況の高騰や為替の円安を背景に物価上昇率はプラス幅を拡大するものの、日銀の定義する物価安定目標を達成する状況へは到達しない見通しです。従って、日銀によるマイナス金利政策が継続される公算は高く、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。

以上の見通しの下、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(2021年10月1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：120名、平均運用経験年数：16年(兼務者含む)

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

1万口当たりの費用明細(2021年4月14日から2022年4月13日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	－円	－%	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10,046円です。
(投信会社)	(－)	(－)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(－)	(－)	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)	(－)	(－)	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 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)	(－)	(－)	
(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 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)	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) その他費用	0	0.002	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回金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(－)	(－)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.002)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	0	0.002	

※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。

## SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

### ■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年4月14日から2022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 18,589	千円 18,740	千口 51,443	千円 51,856

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2021年4月14日から2022年4月13日まで)

利害関係人との取引状況

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

当期中における利害関係人との取引等はありません。

マネーインカム・マザーファンド

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
公 社 債	百万円 1,982	百万円 200	% 10.1	百万円 -	百万円 -	% -

※平均保有割合 41.5%

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

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMBC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

(2021年4月14日から2022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 (2022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 890,895	千円 890,895	千口 858,040	千円 864,819

※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1,935,317,393口です。

### ■ 投資信託財産の構成

(2022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 864,819	% 100.0
コール・ローン等、その他	0	0.0
投資信託財産総額	864,820	100.0

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年4月13日現在)

項目	期	末
(A) 資産		864,820,470円
コール・ローン等		954
マネーインカム・マザーファンド(評価額)		864,819,516
(B) 純資産総額(A)		864,820,470
元本		860,990,940
次期繰越損益金		3,829,530
(C) 受益権総口数		860,990,940口
1万口当たり基準価額(B/C)		10,044円

※当期における期首元本額893,961,565円、期中追加設定元本額24,289,522円、期中一部解約元本額57,260,147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2021年4月14日 至2022年4月13日)

項目	当	期
(A) 配当等収益	△	14円
支払利息	△	14
(B) 有価証券売買損益	△	422,299
売買益		6,807
売買損	△	429,106
(C) 当期損益金(A+B)	△	422,313
(D) 前期繰越損益金	△	1,509,833
(E) 追加信託差損益金		5,761,676
(配当等相当額)	(	79,934,765)
(売買損益相当額)	(△)	74,173,089)
(F) 合計(C+D+E)		3,829,530
次期繰越損益金(F)		3,829,530
追加信託差損益金		5,761,676
(配当等相当額)	(	79,942,931)
(売買損益相当額)	(△)	74,181,255)
分配準備積立金		41,271,656
繰越損益金	△	43,203,802

※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。

※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		5,061,037円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		0
(c) 収益調整金		79,942,931
(d) 分配準備積立金		36,210,619
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)		121,214,587
1万口当たり当期分配対象額		1,407.85
(f) 分配金		0
1万口当たり分配金		0

## ■ 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。

# マネーインカム・マザーファンド

第14期（2021年4月14日から2022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。

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		(参考指数) 無担保コール翌日物		公社債比率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
	円	%		%	%	百万円
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
14期（2022年4月13日）	10,079	△0.0	100.73	△0.0	76.7	1,950

※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。

※参考指数は市場の動きを示す目的で記載しており、当ファンドが当該参考指数を意識して運用しているわけではありません。

## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

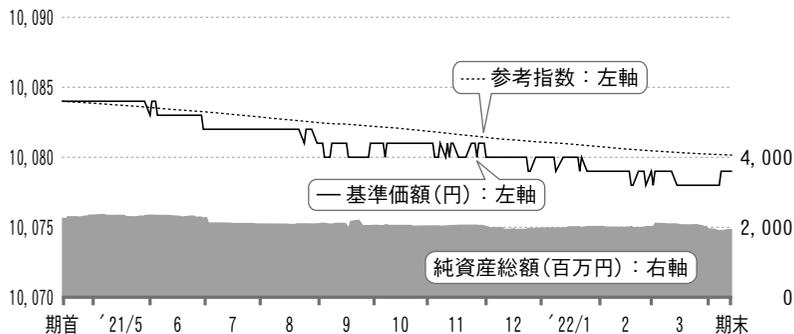
年月日	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		公社債比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2021年4月13日	円	%		%	%
4月末	10,084	—	100.76	—	76.3
5月末	10,084	0.0	100.76	△0.0	73.4
6月末	10,083	△0.0	100.76	△0.0	72.5
7月末	10,082	△0.0	100.76	△0.0	74.7
8月末	10,082	△0.0	100.75	△0.0	76.6
9月末	10,081	△0.0	100.75	△0.0	74.4
10月末	10,081	△0.0	100.75	△0.0	76.0
11月末	10,081	△0.0	100.74	△0.0	76.6
12月末	10,080	△0.0	100.74	△0.0	77.2
2022年1月末	10,080	△0.0	100.74	△0.0	73.0
2月末	10,079	△0.0	100.73	△0.0	71.2
3月末	10,079	△0.0	100.73	△0.0	71.2
(期末) 2022年4月13日	10,078	△0.1	100.73	△0.0	75.9
	10,079	△0.0	100.73	△0.0	76.7

※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（2021年4月14日から2022年4月13日まで）

### 基準価額等の推移



期首	10,084円
期末	10,079円
騰落率	-0.0%

※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、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（2021年4月14日から2022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 (2021年4月14日から2022年4月13日まで)

短期金利は低下しました。

物価の上昇率が低水準にとどまったことや、新型コロナウイルスの感染拡大が繰り返されたことから、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。

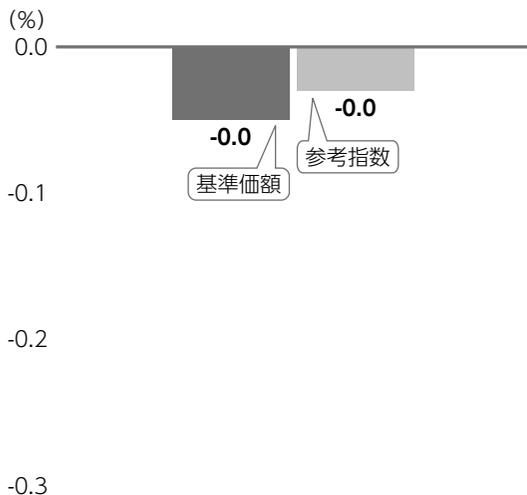
国庫短期証券3ヵ月物利回りは、発行額の増減などにより上下に振れる局面もありましたが、日銀が需給動向を勘案して短期国債の買入れ額を調整したことから、期を通じて概ねレンジ内での推移となりました。

▶ ポートフォリオについて (2021年4月14日から2022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 (2021年4月14日から2022年4月13日まで)

基準価額と参考指数の騰落率対比



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

商品市況の高騰や為替の円安を背景に物価上昇率はプラス幅を拡大するものの、日銀の定義する物価安定目標を達成する状況へは到達しない見通しです。従って、日銀によるマイナス金利政策が継続される公算は高く、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続きマイナス圏での推移を想定します。

以上の見通しの下、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 (2021年4月14日から2022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)	0円 (0)	0.003% (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 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	0	0.003	

期中の平均基準価額は10,081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 (2021年4月14日から2022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	480,119	( 400,000)
	特 殊 債 券	1,502,052	(1,809,600)

※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。

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2021年4月14日から2022年4月13日まで)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況 B	B A		うち利害関係人 との取引状況 D	D C	
公 社 債	百万円 1,982	百万円 200	% 10.1	百万円 -	百万円 -	% -

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況  
(2021年4月14日から2022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 (2022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BBB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	300,000 ( 300,000)	300,054 ( 300,054)	15.4 (15.4)	— (—)	— (—)	— (—)	15.4 (15.4)
特殊債券(除く金融債券)	1,192,000 (1,192,000)	1,196,252 (1,196,252)	61.3 (61.3)	— (—)	— (—)	— (—)	61.3 (61.3)
合 計	1,492,000 (1,492,000)	1,496,306 (1,496,306)	76.7 (76.7)	— (—)	— (—)	— (—)	76.7 (76.7)

※( )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。

※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。

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	1055国庫短期証券		—	100,000	100,008	2022/05/09
	1062国庫短期証券		—	100,000	100,018	2022/06/06
	1067国庫短期証券		—	100,000	100,026	2022/06/27
小		計	—	300,000	300,054	—
特殊債券(除く金融債券)	163 政保道路機構		0.9010	100,000	100,127	2022/05/31
	166 政保道路機構		0.8950	100,000	100,197	2022/06/30
	229 政保預金保険		0.1000	100,000	100,038	2022/07/29
	170 政保道路機構		0.8010	100,000	100,326	2022/08/31
	40政保地方公共団		0.8190	69,000	69,252	2022/09/16
	42 政保日本政策		0.0010	200,000	200,054	2022/09/26
	177 政保道路機構		0.8050	100,000	100,546	2022/11/30
	180 政保道路機構		0.7340	100,000	100,557	2022/12/28
	182 政保道路機構		0.8340	123,000	123,870	2023/01/31
	19 政保政策投資C		0.6680	100,000	100,667	2023/03/15
189 政保道路機構		0.5410	100,000	100,615	2023/04/28	
小		計	—	1,192,000	1,196,252	—
合		計	—	1,492,000	1,496,306	—

※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。

■ 投資信託財産の構成

(2022年4月13日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	1,496,306	76.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	459,036	23.5
投 資 信 託 財 産 総 額	1,955,343	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年4月13日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,955,343,081円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	457,659,728
公 社 債(評価額)	1,496,306,766
未 収 利 息	1,138,662
前 払 費 用	237,925
(B) 負 債	4,685,844
未 払 解 約 金	4,684,078
そ の 他 未 払 費 用	1,766
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,950,657,237
元 本	1,935,317,393
次 期 繰 越 損 益 金	15,339,844
(D) 受 益 権 総 口 数	1,935,317,393口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,079円

※当期における期首元本額2,257,314,469円、期中追加設定元本額955,084,096円、期中一部解約元本額1,277,081,172円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	21,805,906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)	102,779,034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)	162,087,175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)	89,556,632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)	42,692,099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)	29,057,907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)	49,084,616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>	858,040,993円
SMAM・FGマネーファンドVA<適格機関投資家限定>	579,816,519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2021年4月14日 至2022年4月13日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	12,462,791円
受 取 利 息	12,786,775
支 払 利 息	△ 323,984
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△13,661,988
売 買 益 損	6,300
売 買 損 益	△13,668,288
(C) そ の 他 費 用 等	△ 55,501
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 1,254,698
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	19,069,253
(F) 解 約 差 損 益 金	△10,237,902
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,763,191
(H) 合 計(D+E+F+G)	15,339,844
次 期 繰 越 損 益 金(H)	15,339,844

※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。