

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010  
 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020  
 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030  
 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040  
 第23期（2023年12月20日決算）運用報告書（全体版）

＜投資対象とするマザーファンドの運用報告書（全体版）の訂正のお知らせとお詫び＞

以下の投資対象とするマザーファンドの運用報告書（全体版）の財務諸表に関する注記事項におきまして、ファンド名称の相違がありました。

ここに深くお詫び申し上げますとともに、下記の通り訂正させていただきます（下線部が訂正箇所です）。

記

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

「資産、負債、元本及び基準価額の状況」に関する注記事項

第21期（2023年11月30日決算）運用報告書（全体版）P63

| 正   | 誤   |
|---|---|
| <p>■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。</p> <p>(中略)</p> <p>SMDAM・日米3資産バランスオープン&lt;適格機関投資家限定&gt; 15,940,785円</p> <p>SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド（リスク3%）&lt;適格機関投資家限定&gt; 29,029,528円</p> | <p>■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。</p> <p>(中略)</p> <p>SMDAM・日米3資産バランスオープン&lt;適格機関投資家限定&gt; 15,940,785円</p> <p><u>三井住友・ニュー・アジア・ファンド</u>（リスク3%）&lt;適格機関投資家限定&gt; 29,029,528円</p> |

外国株式インデックス・マザーファンド

「資産、負債、元本及び基準価額の状況」に関する注記事項

第21期（2023年11月30日決算）運用報告書（全体版）P129

| 正   | 誤   |
|---|---|
| <p>■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。</p> <p>(中略)</p> <p>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&lt;適格機関投資家限定&gt; 12,302,074円</p> <p>SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド（リスク3%）&lt;適格機関投資家限定&gt; 9,755,415円</p> | <p>■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。</p> <p>(中略)</p> <p>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&lt;適格機関投資家限定&gt; 12,302,074円</p> <p><u>三井住友・ニュー・アジア・ファンド</u>（リスク3%）&lt;適格機関投資家限定&gt; 9,755,415円</p> |

外国債券パッシブ・マザーファンド

「資産、負債、元本及び基準価額の状況」に関する注記事項

第 20 期（2023 年 12 月 18 日決算） 運用報告書（全体版） P 161

| 正   | 誤  |
|---|--|
| <p>■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。</p> <p style="text-align: center;">(中略)</p> <p>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&lt;適格機関投資家限定&gt;</p> <p style="text-align: right;">282,430,807 円</p> <p>SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド（リスク3%）&lt;適格機関投資家限定&gt;</p> <p style="text-align: right;">158,940,863 円</p> | <p>■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。</p> <p style="text-align: center;">(中略)</p> <p>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&lt;適格機関投資家限定&gt;</p> <p style="text-align: right;">282,430,807 円</p> <p>三井住友・ニュー・アジア・ファンド（リスク3%）&lt;適格機関投資家限定&gt;</p> <p style="text-align: right;">158,940,863 円</p> |

以 上

■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。<br>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。<br>SMAM・国内株式バシッブ・ファンド（適格機関投資家専用）<br>日本の株式<br>SMAM・年金国内債券バシッブファンド<適格機関投資家限定><br>日本の公社債および短期金融資産<br>SMAM・外国株式バシッブ・ファンド（適格機関投資家専用）<br>日本を除く世界各国の株式<br>SMAM・年金外国債券バシッブ・ファンド<適格機関投資家限定><br>日本を除く世界各国の債券<br>SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定><br>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 | ■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）。<br>■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。<br>※各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。<br><2010>・・・西暦2010年<br><2020>・・・西暦2020年<br><2030>・・・西暦2030年<br><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。<br>■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。<br>■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。<br>※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。<br><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。<br/>(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)】

(2022年12月21日から2023年12月20日まで)

第 **23** 期

決算日 2023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   |       |       | 投資信託証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|------------------|--------|-------|-------|----------------|-----------|
|                  | (分配落)  | 税込分配金 | 期中騰落率 |                |           |
|                  | 円      | 円     | %     | %              | 百万円       |
| 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       |
| 23期(2023年12月20日) | 13,154 | 0     | 2.5   | 99.1           | 349       |

#### 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   |       |       | 投資信託証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|------------------|--------|-------|-------|----------------|-----------|
|                  | (分配落)  | 税込分配金 | 期中騰落率 |                |           |
|                  | 円      | 円     | %     | %              | 百万円       |
| 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     |
| 23期(2023年12月20日) | 15,685 | 0     | 2.5   | 99.0           | 904       |

#### 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   |       |       | 投資信託証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|------------------|--------|-------|-------|----------------|-----------|
|                  | (分配落)  | 税込分配金 | 期中騰落率 |                |           |
|                  | 円      | 円     | %     | %              | 百万円       |
| 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     |
| 23期(2023年12月20日) | 18,986 | 0     | 7.0   | 97.0           | 2,070     |

#### 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   |       |       | 投資信託証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|------------------|--------|-------|-------|----------------|-----------|
|                  | (分配落)  | 税込分配金 | 期中騰落率 |                |           |
|                  | 円      | 円     | %     | %              | 百万円       |
| 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     |
| 23期(2023年12月20日) | 22,729 | 0     | 11.7  | 98.0           | 3,529     |

※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<br>組 入 比 率 |
|-------------|---------|-------|------------------------|
|             |         | 騰 落 率 |                        |
| (期 首)       | 円       | %     | %                      |
| 2022年12月20日 | 12,832  | —     | 99.4                   |
| 12月末        | 12,743  | △0.7  | 99.3                   |
| 2023年1月末    | 12,796  | △0.3  | 99.2                   |
| 2月末         | 12,846  | 0.1   | 99.5                   |
| 3月末         | 12,945  | 0.9   | 99.4                   |
| 4月末         | 12,953  | 0.9   | 99.3                   |
| 5月末         | 13,059  | 1.8   | 99.2                   |
| 6月末         | 13,197  | 2.8   | 99.2                   |
| 7月末         | 13,135  | 2.4   | 99.2                   |
| 8月末         | 13,103  | 2.1   | 99.0                   |
| 9月末         | 13,059  | 1.8   | 99.1                   |
| 10月末        | 12,936  | 0.8   | 99.0                   |
| 11月末        | 13,125  | 2.3   | 99.1                   |
| (期 末)       |         |       |                        |
| 2023年12月20日 | 13,154  | 2.5   | 99.1                   |

## 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<br>組 入 比 率 |
|-------------|---------|-------|------------------------|
|             |         | 騰 落 率 |                        |
| (期 首)       | 円       | %     | %                      |
| 2022年12月20日 | 15,298  | —     | 99.6                   |
| 12月末        | 15,190  | △0.7  | 99.7                   |
| 2023年1月末    | 15,254  | △0.3  | 99.7                   |
| 2月末         | 15,314  | 0.1   | 99.8                   |
| 3月末         | 15,432  | 0.9   | 99.7                   |
| 4月末         | 15,443  | 0.9   | 99.4                   |
| 5月末         | 15,568  | 1.8   | 99.5                   |
| 6月末         | 15,735  | 2.9   | 99.3                   |
| 7月末         | 15,661  | 2.4   | 99.3                   |
| 8月末         | 15,622  | 2.1   | 99.2                   |
| 9月末         | 15,570  | 1.8   | 99.3                   |
| 10月末        | 15,423  | 0.8   | 99.2                   |
| 11月末        | 15,651  | 2.3   | 99.2                   |
| (期 末)       |         |       |                        |
| 2023年12月20日 | 15,685  | 2.5   | 99.0                   |

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

| 年 月 日       | 基 準 価 額 |       | 投 資 信 託 証 券<br>組 入 比 率 |
|-------------|---------|-------|------------------------|
|             |         | 騰 落 率 |                        |
| (期 首)       | 円       | %     | %                      |
| 2022年12月20日 | 17,748  | —     | 99.7                   |
| 12月末        | 17,492  | △1.4  | 99.7                   |
| 2023年1月末    | 17,689  | △0.3  | 99.8                   |
| 2月末         | 17,836  | 0.5   | 99.8                   |
| 3月末         | 18,085  | 1.9   | 99.7                   |
| 4月末         | 18,151  | 2.3   | 99.7                   |
| 5月末         | 18,509  | 4.3   | 99.6                   |
| 6月末         | 18,982  | 7.0   | 99.5                   |
| 7月末         | 18,819  | 6.0   | 99.5                   |
| 8月末         | 18,795  | 5.9   | 99.3                   |
| 9月末         | 18,698  | 5.4   | 99.3                   |
| 10月末        | 18,342  | 3.3   | 99.4                   |
| 11月末        | 18,921  | 6.6   | 99.5                   |
| (期 末)       |         |       |                        |
| 2023年12月20日 | 18,986  | 7.0   | 97.0                   |

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

| 年 月 日       | 基 準 価 額 |       | 投 資 信 託 証 券<br>組 入 比 率 |
|-------------|---------|-------|------------------------|
|             |         | 騰 落 率 |                        |
| (期 首)       | 円       | %     | %                      |
| 2022年12月20日 | 20,342  | —     | 99.8                   |
| 12月末        | 20,044  | △ 1.5 | 99.8                   |
| 2023年1月末    | 20,440  | 0.5   | 99.3                   |
| 2月末         | 20,640  | 1.5   | 99.9                   |
| 3月末         | 20,873  | 2.6   | 99.6                   |
| 4月末         | 21,069  | 3.6   | 99.8                   |
| 5月末         | 21,701  | 6.7   | 99.6                   |
| 6月末         | 22,502  | 10.6  | 99.3                   |
| 7月末         | 22,370  | 10.0  | 99.3                   |
| 8月末         | 22,418  | 10.2  | 99.4                   |
| 9月末         | 22,380  | 10.0  | 99.4                   |
| 10月末        | 21,801  | 7.2   | 99.1                   |
| 11月末        | 22,675  | 11.5  | 99.2                   |
| (期 末)       |         |       |                        |
| 2023年12月20日 | 22,729  | 11.7  | 98.0                   |

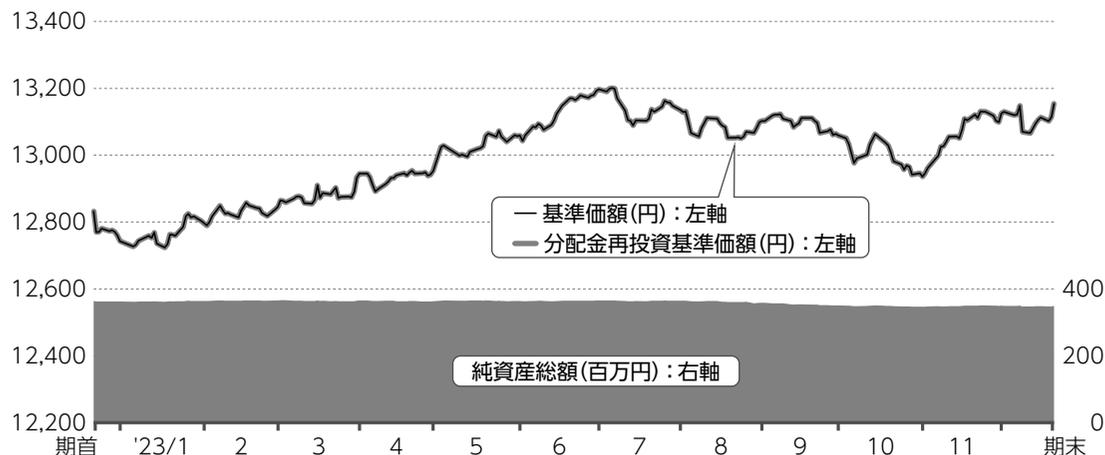
※騰落率は期首比です。

# 1 運用経過

基準価額等の推移について(2022年12月21日から2023年12月20日まで)

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

### 基準価額等の推移



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

|     |                           |
|-----|---------------------------|
| 期首  | 12,832円                   |
| 期末  | 13,154円<br>(既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | +2.5%<br>(分配金再投資ベース)      |

### 分配金再投資基準価額について

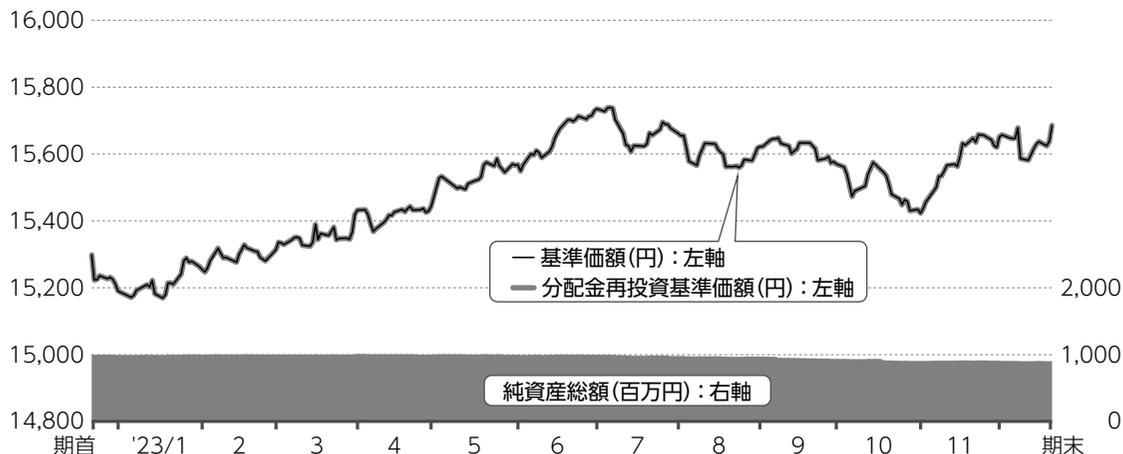
分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※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。

### 分配金再投資基準価額について

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

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

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

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

### 基準価額等の推移



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

|     |                           |
|-----|---------------------------|
| 期首  | 17,748円                   |
| 期末  | 18,986円<br>(既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | +7.0%<br>(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  | 20,342円                   |
| 期末  | 22,729円<br>(既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | +11.7%<br>(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(2022年12月21日から2023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))及び海外株式市場が上昇したこと
- 米ドルやユーロが円に対して上昇したこと

※各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。

<2010>……西暦2010年、<2020>……西暦2020年

<2030>……西暦2030年、<2040>……西暦2040年

## 組入れファンドの状況

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

| 組入れファンド                             | 投資資産   | 投資資産配分 | 期末組入比率 |
|-------------------------------------|--------|--------|--------|
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド<br>(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<br><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<br>(適格機関投資家専用)   | 外国株式   | 5%     | 5.2%   |
| SMAM・年金外国債券パッシブ・<br>ファンド<適格機関投資家限定> | 外国債券   | 5%     | 5.2%   |
| SMAM・マネーインカムファンド<br><適格機関投資家限定>     | 短期金融資産 | 50%    | 48.7%  |

## 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<br>(適格機関投資家専用)   | 国内株式   | 5%     | 5.0%   |
| SMAM・年金国内債券パッシブファンド<br><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<br>(適格機関投資家専用)   | 外国株式   | 5%     | 5.1%   |
| SMAM・年金外国債券パッシブ・<br>ファンド<適格機関投資家限定> | 外国債券   | 5%     | 5.0%   |
| SMAM・マネーインカムファンド<br><適格機関投資家限定>     | 短期金融資産 | 50%    | 48.8%  |

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

| 組入れファンド                             | 投資資産   | 投資資産配分 | 期末組入比率 |
|-------------------------------------|--------|--------|--------|
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド<br>(適格機関投資家専用)   | 国内株式   | 14%    | 13.2%  |
| SMAM・年金国内債券パッシブファンド<br><適格機関投資家限定>  | 国内債券   | 58%    | 57.7%  |
| SMAM・外国株式パッシブ・ファンド<br>(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・<br>ファンド<適格機関投資家限定> | 外国債券   | 14%    | 13.6%  |
| SMAM・マネーインカムファンド<br><適格機関投資家限定>     | 短期金融資産 | 4%     | 3.1%   |

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

| 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<br>(適格機関投資家専用)   | 国内株式   | 29%    | 27.0%  |
| SMAM・年金国内債券パッシブファンド<br><適格機関投資家限定>  | 国内債券   | 43%    | 43.5%  |
| SMAM・外国株式パッシブ・ファンド<br>(適格機関投資家専用)   | 外国株式   | 15%    | 15.3%  |
| SMAM・年金外国債券パッシブ・<br>ファンド<適格機関投資家限定> | 外国債券   | 11%    | 11.2%  |
| SMAM・マネーインカムファンド<br><適格機関投資家限定>     | 短期金融資産 | 2%     | 1.0%   |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

## 投資環境について(2022年12月21日から2023年12月20日まで)

期間における内外の株式市場は上昇しました。内外の債券市場では、長期金利(10年国債利回り)は日米でやや上昇(債券価格は下落)した一方、欧州では総じて低下しました。為替市場では、米ドルやユーロは円に対して上昇しました。

### 国内株式市場

国内株式市場は、期を通じて上昇しました。期初から2023年9月にかけて、上昇基調で推移しました。3月に欧米で金融不安が高まった局面では一時的に株価が下落する場面もありました。しかし、欧米株式市場が概ね上昇する中で、国内企業の業績の底堅さや、海外投資家による日本株買い、日銀の金融緩和方針維持による円安の進行などが株価の上昇要因となりました。

その後、欧米の長期金利の一段の上昇や中東情勢の悪化などを受けて、株価が軟調な動きとなる場面もありましたが、期末にかけては、米国の利上げ終了観測の高まりなどを好感し、欧米株式市場の上昇に連れて上昇しました。

### 国内債券市場

日本の長期金利は、期初の水準から小幅上昇となりました。

期初から7月にかけては、3月に欧米で金融不安が高まった局面で一時的に大きく金利低下する場面もありましたが、概ね日銀の許

容レンジ( $0 \pm 0.50\%$ )の上限付近で推移しました。

7月の日銀金融政策決定会合で従来の許容変動幅が形骸化されて事実上 $0 \pm 1.0\%$ に拡大されたことや、欧米金利の上昇の影響を受けて、金利は10月まで上昇を続けました。しかし、期末にかけては、米国の利上げ終了観測の高まりを背景に、欧米金利に連れて日本の長期金利も低下に転じ、期中の上昇幅を大きく縮小しました。

### 外国株式市場

先進国外国株式市場は、期を通じて上昇しました。

米国株式市場は、期初から7月にかけて、FRB(米連邦準備制度理事会)による金融引き締めの継続が相場の重石となる場面がありました。しかし、堅調な経済指標や企業業績を背景に、株価は上昇基調となりました。その後は、金融引き締めの長期化観測による一段の金利上昇や中東情勢の悪化が嫌気され、10月まで下落基調となりました。期末にかけては、FRBの利上げ終了観測や金利低下を好感し、株価は反転上昇となりました。

欧州株式市場は、期初から7月にかけて、概ね上昇基調で推移しました。米国景気の底堅さを背景としたグローバル景気への期待感などが相場のサポート材料となりました。その後、欧米長期金利の一段の上昇や中東情勢の悪化が嫌気され、10月まで下落基調となりました。期末にかけては、欧米金利の低下やインフレ鈍化によるECB(欧州中央銀行)の利上げ終了観測などを背景に、株価は反転上昇となりました。

## 外国債券市場

米国の長期金利は、期初の水準から上昇しました。堅調な景気を背景に、FRBのインフレ抑制に向けた姿勢が継続し、利上げなどの金融引き締めが進められたことから、金利は上昇基調で推移しました。しかし、11月以降、インフレの軟化などを受けてFRBの利上げ終了観測が強まったことや、12月のFOMC(米連邦公開市場委員会)の内容がハト派(景気を重視する立場)的と受け止められたことなどから、金利は低下に転じ、期末にかけては期中の上昇幅を大きく縮小しました。

欧州の長期金利(ドイツ10年国債利回り)は、上昇した後に低下し、期初の水準を下回

りました。ECBが利上げを継続したことや米金利上昇の影響などを受けて、10月まで金利は上昇基調となりました。しかし、11月以降、インフレの鈍化やECBの利上げ終了観測などを背景に金利は低下に転じ、期末にかけては期初の水準を割り込んで低下しました。

## 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。米国景気が底堅く推移する中、FRBが金融引き締めを進めた一方で、日銀はイールドカーブ・コントロール(長短金利操作)の柔軟化を行ったものの、金融緩和政策の大枠は維持したことから、米ドル高・円安が進行しました。しかし、11月以降、FRBの利上げ終了観測の高まりなどから、期末にかけて米ドル安・円高に転じました。

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。ECBが利上げを継続した一方、日銀は金融緩和政策の大枠を維持したことから、ユーロ高・円安が進行しました。しかし、11月以降、ECBの利上げ終了観測の高まりなどから、期末にかけてユーロ安・円高に転じました。

ポートフォリオについて(2022年12月21日から2023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。

|      | 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、円換算ベース)

外国債券：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

#### 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(2022年12月21日から2023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(2022年12月21日から2023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、見送りといたしました。  
なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

(単位：円、1万口当たり、税引前)

| 項目        | 2010    | 2020    | 2030    | 2040    |
|-----------|---------|---------|---------|---------|
| 当期分配金     | 0       | 0       | 0       | 0       |
| (対基準価額比率) | (0.00%) | (0.00%) | (0.00%) | (0.00%) |
| 当期の収益     | -       | -       | -       | -       |
| 当期の収益以外   | -       | -       | -       | -       |
| 翌期繰越分配対象額 | 3,153   | 6,473   | 10,680  | 14,633  |

※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、各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。

2023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 | 13%  | 60%  | 9%   | 13%  | 5%     |
| 2040 | 27%  | 45%  | 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(2022年12月21日から2023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)<br>期中の平均基準価額は12,999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         | 58   | 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。

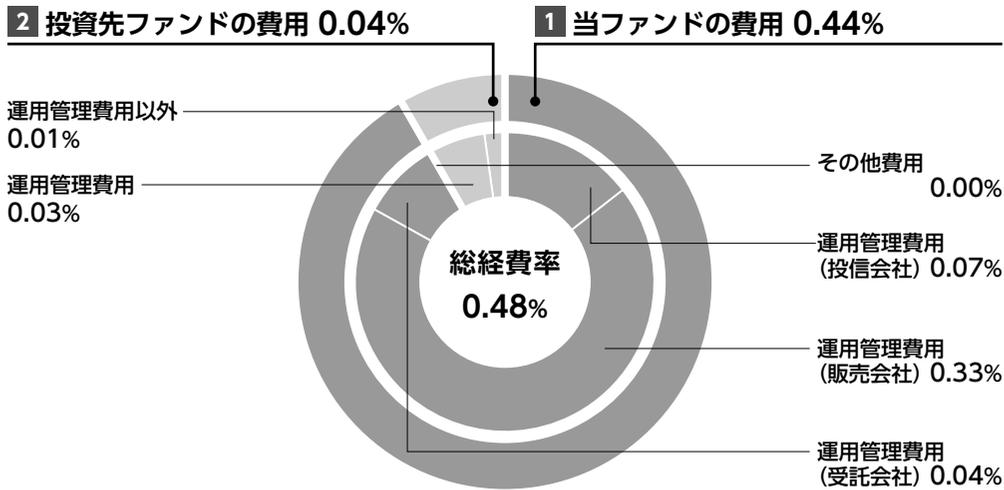
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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)



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

※ **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))の費用は、「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)<br>期中の平均基準価額は15,498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         | 69   | 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。

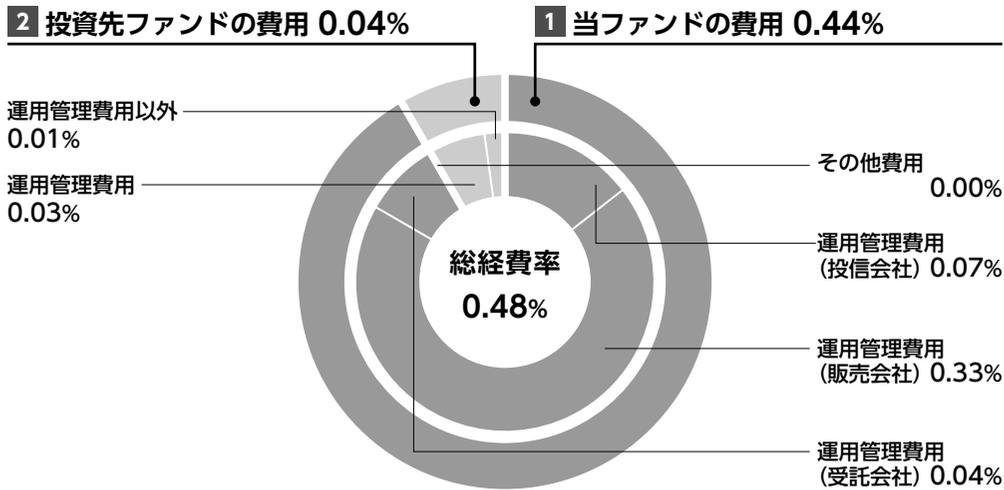
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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)



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

※ **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))の費用は、「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    | 99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)<br>[期中の平均基準価額は18,389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 ) | (61) | (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         | 100  | 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。

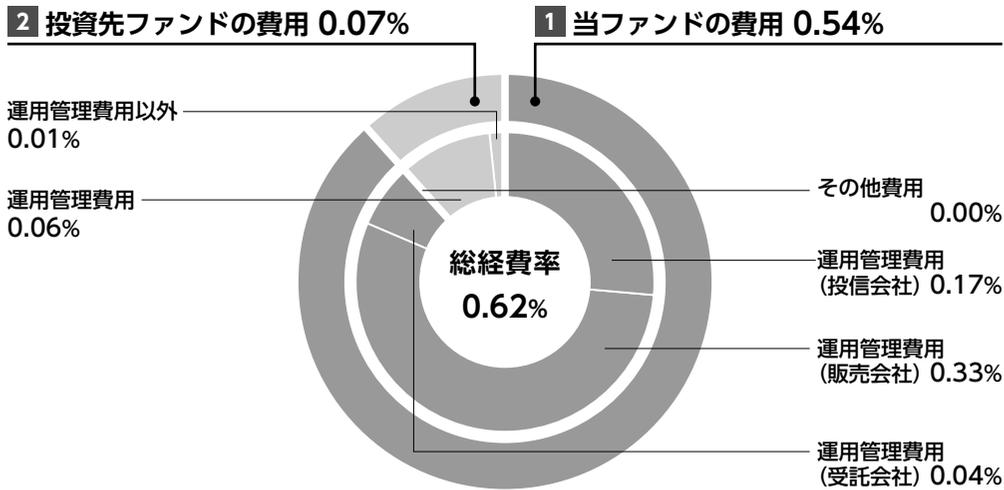
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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> |
| <b>2 投資先ファンドの運用管理費用の比率</b>   | <b>0.06%</b> |
| <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))の費用は、「1万口当たりの費用明細」をもとに、投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※ **1**と**2**の費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。また、計上された期間が異なる場合があります。

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

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は0.62%です。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

| 項目          | 金額   | 比率      | 項目の概要   |
|-------------|------|---------|---|
| (a) 信託報酬    | 117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)<br>[期中の平均基準価額は21,634円です。] |
| ( 投 信 会 社 ) | (36) | (0.165) | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価  |
| ( 販 売 会 社 ) | (71) | (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 ) | (10) | (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         | 117  | 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。

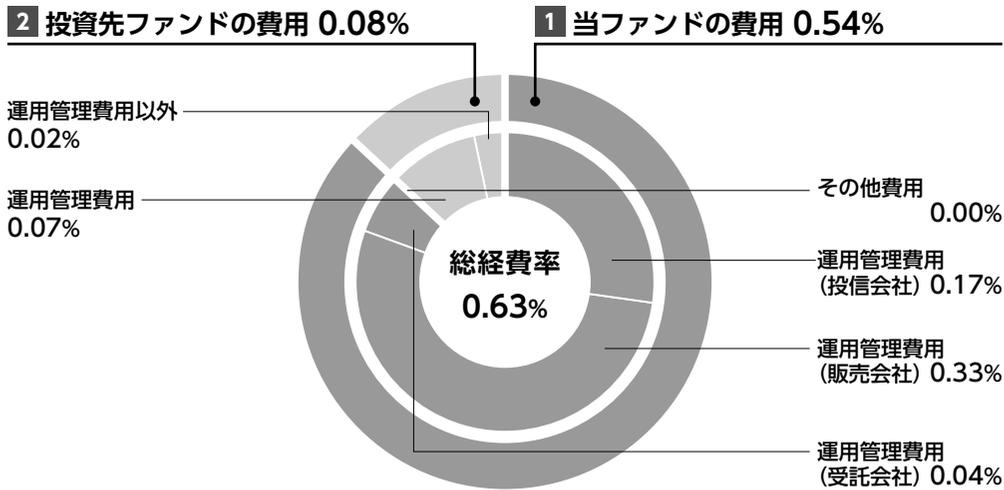
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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)



| 総経費率(1 + 2)                | 0.63%        |
|----------------------------|--------------|
| <b>1</b> 当ファンドの費用の比率       | <b>0.54%</b> |
| <b>2</b> 投資先ファンドの運用管理費用の比率 | <b>0.07%</b> |
| 投資先ファンドの運用管理費用以外の比率        | <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))の費用は、「1万口当たりの費用明細」をもとに、投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※ **1**と**2**の費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。また、計上された期間が異なる場合があります。

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

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は0.63%です。

## ■ 当期中の売買及び取引の状況(2022年12月21日から2023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)   | 280,131   | 670   | 1,904,934  | 4,850  |
|    | SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)   | 165,470   | 780   | 900,494    | 4,780  |
|    | SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 322,436   | 610   | 984,424    | 2,030  |
|    | SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>  | 2,535,972 | 3,150 | 6,006,960  | 7,490  |
|    | SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>     | 2,928,176 | 2,940 | 15,390,034 | 15,450 |

## 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)   | 401,851   | 890   | 5,783,623  | 14,820 |
|    | SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)   | 546,956   | 2,550 | 3,302,472  | 17,720 |
|    | SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 583,853   | 1,110 | 4,525,697  | 9,490  |
|    | SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>  | 2,868,869 | 3,550 | 28,970,769 | 36,080 |
|    | SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>     | 4,900,192 | 4,920 | 66,292,780 | 66,550 |

## 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)   | 2,163,825  | 4,730  | 30,536,580 | 76,160 |
|    | SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)   | 2,358,220  | 10,600 | 10,914,254 | 59,610 |
|    | SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 2,878,496  | 5,460  | 13,028,947 | 27,360 |
|    | SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>  | 62,669,055 | 78,100 | 11,306,416 | 14,110 |
|    | SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>     | 10,048,626 | 10,090 | 14,561,753 | 14,620 |

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)   | 16,235,813  | 36,610  | 85,200,678 | 212,660 |
|    | SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)   | 4,893,417   | 24,300  | 18,549,043 | 97,510  |
|    | SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 9,844,994   | 19,580  | 5,015,838  | 10,380  |
|    | SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 199,110,718 | 248,720 | 28,790,622 | 35,960  |
|    | SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>     | 468,081     | 470     | 29,813,879 | 29,930  |

※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(2022年12月21日から2023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  
(2022年12月21日から2023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(2023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)   | 8,072,761   | 6,447,958   | 17,282  | 4.9     |
| SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)   | 3,817,889   | 3,082,865   | 18,279  | 5.2     |
| SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 9,047,628   | 8,385,640   | 18,043  | 5.2     |
| SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 101,803,150 | 98,332,162  | 122,236 | 35.0    |
| SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>     | 181,976,034 | 169,514,176 | 170,192 | 48.7    |
| 合 計                             | 304,717,462 | 285,762,801 | 346,034 | 99.1    |

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)   | 22,425,256  | 17,043,484  | 45,681  | 5.0     |
| SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)   | 10,583,164  | 7,827,648   | 46,413  | 5.1     |
| SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 25,065,827  | 21,123,983  | 45,452  | 5.0     |
| SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 280,721,839 | 254,619,939 | 316,518 | 35.0    |
| SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>     | 501,419,833 | 440,027,245 | 441,787 | 48.8    |
| 合 計                             | 840,215,919 | 740,642,299 | 895,852 | 99.0    |

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

| 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)   | 130,467,040   | 102,094,285   | 273,643   | 13.2    |
| SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)   | 41,672,093    | 33,116,059    | 196,358   | 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> | 141,013,918   | 130,863,467   | 281,578   | 13.6    |
| SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 909,203,015   | 960,565,654   | 1,194,079 | 57.7    |
| SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>     | 68,045,937    | 63,532,810    | 63,786    | 3.1     |
| 合 計                             | 1,290,402,003 | 1,290,172,275 | 2,009,446 | 97.0    |

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

| 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)   | 424,317,500   | 355,352,635   | 952,451   | 27.0    |
| SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)   | 104,699,170   | 91,043,544    | 539,833   | 15.3    |
| SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 179,034,806   | 183,863,962   | 395,620   | 11.2    |
| SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 1,063,435,873 | 1,233,755,969 | 1,533,682 | 43.5    |
| SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>     | 64,964,749    | 35,618,951    | 35,761    | 1.0     |
| 合 計                             | 1,836,452,098 | 1,899,635,061 | 3,457,348 | 98.0    |

※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

(2023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         | 346,034 | 98.6  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 4,895   | 1.4   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 350,929 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年12月20日現在)

| 項 目                       | 期 末          |
|---------------------------|--------------|
| (A) 資 産                   | 350,929,691円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等           | 4,895,368    |
| 投資信託受益証券(評価額)             | 346,034,323  |
| (B) 負 債                   | 1,728,364    |
| 未 払 解 約 金                 | 937,698      |
| 未 払 信 託 報 酬               | 784,840      |
| そ の 他 未 払 費 用             | 5,826        |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B)     | 349,201,327  |
| 元 本                       | 265,478,304  |
| 次 期 繰 越 損 益 金             | 83,723,023   |
| (D) 受 益 権 総 口 数           | 265,478,304口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 13,154円      |

※当期における期首元本額283,825,717円、期中追加設定元本額7,841,713円、期中一部解約元本額26,189,126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2022年12月21日 至2023年12月20日)

| 項 目                       | 当 期           |
|---------------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | △ 1,211円      |
| 受 取 利 息                   | 109           |
| 支 払 利 息                   | △ 1,320       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | 10,002,674    |
| 売 買 益                     | 11,288,816    |
| 売 買 損                     | △ 1,286,142   |
| (C) 信 託 報 酬 等             | △ 1,595,782   |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 8,405,681     |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 25,127,625    |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 50,189,717    |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 47,567,963) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | ( 2,621,754)  |
| (G) 合 計 (D + E + F)       | 83,723,023    |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G)         | 83,723,023    |
| 追 加 信 託 差 損 益 金           | 50,189,717    |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 47,567,963) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | ( 2,621,754)  |
| 分 配 準 備 積 立 金             | 33,534,517    |
| 繰 越 損 益 金                 | △ 1,211       |

※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       | 1,690,170  |
| (c) 収益調整金                 | 50,189,717 |
| (d) 分配準備積立金               | 31,844,347 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d)      | 83,724,234 |
| 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 3,153.71   |
| (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

(2023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<br>895,852 | %<br>98.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 14,081        | 1.5       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 909,934       | 100.0     |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年12月20日現在)

| 項 目                       | 期 末          |
|---------------------------|--------------|
| (A) 資 産                   | 909,934,197円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等           | 11,201,418   |
| 投資信託受益証券(評価額)             | 895,852,779  |
| 未 収 入 金                   | 2,880,000    |
| (B) 負 債                   | 4,970,815    |
| 未 払 解 約 金                 | 2,864,771    |
| 未 払 信 託 報 酬               | 2,090,421    |
| そ の 他 未 払 費 用             | 15,623       |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B)     | 904,963,382  |
| 元 本                       | 576,971,615  |
| 次 期 繰 越 損 益 金             | 327,991,767  |
| (D) 受 益 権 総 口 数           | 576,971,615口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 15,685円      |

※当期における期首元本額655,178,910円、期中追加設定元本額14,557,083円、期中一部解約元本額92,764,378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2022年12月21日 至2023年12月20日)

| 項 目                       | 当 期            |
|---------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | △ 2,790円       |
| 受 取 利 息                   | 367            |
| 支 払 利 息                   | △ 3,157        |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | 26,390,267     |
| 売 買 損 益                   | 31,028,689     |
| 売 買 損 益                   | △ 4,638,422    |
| (C) 信 託 報 酬 等             | △ 4,320,637    |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 22,066,840     |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 113,635,356    |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 192,289,571    |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 237,789,561) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | (△ 45,499,990) |
| (G) 合 計 (D + E + F)       | 327,991,767    |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G)         | 327,991,767    |
| 追 加 信 託 差 損 益 金           | 192,289,571    |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 237,789,561) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | (△ 45,499,990) |
| 分 配 準 備 積 立 金             | 135,704,986    |
| 繰 越 損 益 金                 | △ 2,790        |

※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       | 4,439,297   |
| (c) 収益調整金                 | 237,789,561 |
| (d) 分配準備積立金               | 131,265,689 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d)      | 373,494,547 |
| 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 6,473.36    |
| (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

(2023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         | 2,009,446 | 96.8  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 67,287    | 3.2   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 2,076,734 | 100.0 |

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年12月20日現在)

| 項 目                       | 期 末            |
|---------------------------|----------------|
| (A) 資 産                   | 2,076,734,424円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等           | 21,117,726     |
| 投資信託受益証券(評価額)             | 2,009,446,698  |
| 未 収 入 金                   | 46,170,000     |
| (B) 負 債                   | 5,751,417      |
| 未 払 解 約 金                 | 159,135        |
| 未 払 信 託 報 酬               | 5,558,291      |
| そ の 他 未 払 費 用             | 33,991         |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B)     | 2,070,983,007  |
| 元 本                       | 1,090,821,924  |
| 次 期 繰 越 損 益 金             | 980,161,083    |
| (D) 受 益 権 総 口 数           | 1,090,821,924口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 18,986円        |

※当期における期首元本額1,099,191,787円、期中追加設定元本額68,799,876円、期中一部解約元本額77,169,739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2022年12月21日 至2023年12月20日)

| 項 目                       | 当 期            |
|---------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | △ 5,360円       |
| 受 取 利 息                   | 408            |
| 支 払 利 息                   | △ 5,768        |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | 141,294,800    |
| 売 買 益                     | 153,924,244    |
| 売 買 損                     | △ 12,629,444   |
| (C) 信 託 報 酬 等             | △ 10,943,283   |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 130,346,157    |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 276,708,627    |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 573,106,299    |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 757,971,995) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | (△184,865,696) |
| (G) 合 計 (D + E + F)       | 980,161,083    |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G)         | 980,161,083    |
| 追 加 信 託 差 損 益 金           | 573,106,299    |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 757,971,995) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | (△184,865,696) |
| 分 配 準 備 積 立 金             | 407,060,144    |
| 繰 越 損 益 金                 | △ 5,360        |

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

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

※分配金の計算過程は以下の通りです。

|                      | 当 期           |
|----------------------|---------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益      | 0円            |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 73,632,878    |
| (c) 収益調整金            | 757,971,995   |
| (d) 分配準備積立金          | 333,427,266   |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 1,165,032,139 |
| 1万口当たり当期分配対象額        | 10,680.31     |
| (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

(2023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     | 3,457,348 | 97.7  |
| コール・ローン等、その他 | 82,373    | 2.3   |
| 投資信託財産総額     | 3,539,722 | 100.0 |

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年12月20日現在)

| 項 目                       | 期 末            |
|---------------------------|----------------|
| (A) 資 産                   | 3,539,722,645円 |
| コール・ローン等                  | 37,143,831     |
| 投資信託受益証券(評価額)             | 3,457,348,814  |
| 未 収 入 金                   | 45,230,000     |
| (B) 負 債                   | 10,217,980     |
| 未 払 解 約 金                 | 762,732        |
| 未 払 信 託 報 酬               | 9,397,727      |
| そ の 他 未 払 費 用             | 57,521         |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B)     | 3,529,504,665  |
| 元 本                       | 1,552,849,280  |
| 次 期 繰 越 損 益 金             | 1,976,655,385  |
| (D) 受 益 権 総 口 数           | 1,552,849,280口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 22,729円        |

※当期における期首元本額1,539,915,161円、期中追加設定元本額186,034,924円、期中一部解約元本額173,100,805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2022年12月21日 至2023年12月20日)

| 項 目                       | 当 期               |
|---------------------------|-------------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | △ 10,438円         |
| 受 取 利 息                   | 899               |
| 支 払 利 息                   | △ 11,337          |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | 365,562,483       |
| 売 買 益                     | 396,971,216       |
| 売 買 損                     | △ 31,408,733      |
| (C) 信 託 報 酬 等             | △ 18,158,648      |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 347,393,397       |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 457,618,021       |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 1,171,643,967     |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 1,467,354,567 ) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | ( △ 295,710,600 ) |
| (G) 合 計 (D + E + F)       | 1,976,655,385     |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G)         | 1,976,655,385     |
| 追 加 信 託 差 損 益 金           | 1,171,643,967     |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 1,467,354,567 ) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | ( △ 295,710,600 ) |
| 分 配 準 備 積 立 金             | 805,021,856       |
| 繰 越 損 益 金                 | △ 10,438          |

※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  | 286,377,395   |
| (c) 収益調整金            | 1,467,354,567 |
| (d) 分配準備積立金          | 518,644,461   |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 2,272,376,423 |
| 1万口当たり当期分配対象額        | 14,633.59     |
| (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)

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

第 23 期

決算日 2023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。<br>国内株式インデックス・マザーファンド（B号）<br>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）と連動する投資成果を目指して運用を行います。<br>■株価指数先物取引等を含む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<br>■株式への実質投資割合には、制限を設けません。<br>■外貨建資産への投資は行いません。<br>国内株式インデックス・マザーファンド（B号）<br>■株式への投資割合には、制限を設けません。<br>■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。<br>■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。<br>■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(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

| 項目                                     | 金額                        | 比率                                      | 項目の概要   |
|--|---------------------------|---|---|
| (a) 信託報酬<br>(投信会社)<br>(販売会社)<br>(受託会社) | 20円<br>(7)<br>(3)<br>(11) | 0.082%<br>(0.027)<br>(0.011)<br>(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)<br>投信会社：ファンド運用の指図等の対価<br>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<br>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<br>(株式)<br>(先物・オプション)      | 1<br>(0)<br>(0)           | 0.002<br>(0.000)<br>(0.002)             | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数<br>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<br>(監査費用)<br>(その他)           | 2<br>(2)<br>(0)           | 0.007<br>(0.007)<br>(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<br>監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用<br>その他：信託事務の処理等に要するその他費用  |
| 合計                                     | 22                        | 0.092                                   |   |

期中の平均基準価額は24,404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(2022年12月1日から2023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<br>535,274 | 千円<br>2,031,781 | 千口<br>701,634 | 千円<br>2,511,040 |

### ■ 組入れ資産の明細(2023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<br>2,564,092 | 千口<br>2,397,731 | 千円<br>10,023,238 |

※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67,612,101,406口です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2023年11月30日現在）

| 項 目                         | 期 末             |
|-----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産                     | 10,025,195,931円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等             | 47,251          |
| 国内株式インテックス・マザーファンド(B号)(評価額) | 10,023,238,682  |
| 未 収 入 金                     | 1,909,998       |
| (B) 負 債                     | 6,197,837       |
| 未 払 解 約 金                   | 1,909,998       |
| 未 払 信 託 報 酬                 | 3,970,093       |
| そ の 他 未 払 費 用               | 317,746         |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B)       | 10,018,998,094  |
| 元 本                         | 3,673,318,215   |
| 次 期 繰 越 損 益 金               | 6,345,679,879   |
| (D) 受 益 権 総 口 数             | 3,673,318,215口  |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)   | 27,275円         |

※当期における期首元本額3,924,922,862円、期中追加設定元本額901,683,613円、期中一部解約元本額1,153,288,260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2022年12月1日 至2023年11月30日）

| 項 目                       | 当 期              |
|---------------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | △ 741円           |
| 受 取 利 息                   | 96               |
| 支 払 利 息                   | △ 837            |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | 1,640,376,461    |
| 売 買 損 益                   | 1,793,052,193    |
| 売 買 損 益                   | △ 152,675,732    |
| (C) 信 託 報 酬 等             | △ 8,058,389      |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 1,632,317,331    |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 2,574,430,983    |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 2,138,931,565    |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 4,021,329,614) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | (△1,882,398,049) |
| (G) 合 計 (D + E + F)       | 6,345,679,879    |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G)         | 6,345,679,879    |
| 追 加 信 託 差 損 益 金           | 2,138,931,565    |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 4,021,915,494) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | (△1,882,983,929) |
| 分 配 準 備 積 立 金             | 4,206,748,314    |

※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           | 216,720,283円  |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益       | 1,415,597,048 |
| (c) 収益調整金                 | 4,021,915,494 |
| (d) 分配準備積立金               | 2,574,430,983 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d)      | 8,228,663,808 |
| 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 22,401.17     |
| (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21期 (2022年12月1日から2023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)<br>T O P I X<br>(東証株価指数、配当込み) |      | 株式組入率<br>株比 | 株式先物率<br>(買建-売建) | 純資産額    |
|-------------------|--------|------|--|------|-------------|------------------|---------|
|                   | 期騰落率   | 中率   | 期騰落率                                   | 中率   |             |                  |         |
| 17期 (2019年12月2日)  | 円      | %    |  | %    | %           | %                | 百万円     |
| 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 |
| 21期 (2023年11月30日) | 41,803 | 22.7 | 3,986.65                               | 22.7 | 98.3        | 1.6              | 282,638 |

※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)<br>T O P I X<br>(東証株価指数、配当込み) |        | 株 式 組 入 率<br>比 | 株 式 先 物 率<br>比<br>(買建-売建) |
|----------------------|-------------|--------|---|--------|----------------|---------------------------|
|                      | 騰 落 率       | 騰 落 率  | 騰 落 率                                       | 騰 落 率  |                |                           |
| (期 首)<br>2022年11月30日 | 円<br>34,074 | %<br>- | 3,249.61                                    | %<br>- | %<br>97.9      | %<br>2.0                  |
| 12月末                 | 32,519      | △ 4.6  | 3,101.25                                    | △ 4.6  | 98.8           | 1.2                       |
| 2023年 1 月末           | 33,956      | △ 0.3  | 3,238.48                                    | △ 0.3  | 98.9           | 1.0                       |
| 2 月末                 | 34,276      | 0.6    | 3,269.12                                    | 0.6    | 99.0           | 1.0                       |
| 3 月末                 | 34,858      | 2.3    | 3,324.74                                    | 2.3    | 97.6           | 2.4                       |
| 4 月末                 | 35,797      | 5.1    | 3,414.45                                    | 5.1    | 97.8           | 2.2                       |
| 5 月末                 | 37,089      | 8.8    | 3,537.93                                    | 8.9    | 98.1           | 1.9                       |
| 6 月末                 | 39,894      | 17.1   | 3,805.00                                    | 17.1   | 98.4           | 1.6                       |
| 7 月末                 | 40,492      | 18.8   | 3,861.80                                    | 18.8   | 98.9           | 1.3                       |
| 8 月末                 | 40,665      | 19.3   | 3,878.51                                    | 19.4   | 98.9           | 1.2                       |
| 9 月末                 | 40,879      | 20.0   | 3,898.26                                    | 20.0   | 98.1           | 1.9                       |
| 10 月末                | 39,655      | 16.4   | 3,781.64                                    | 16.4   | 97.8           | 2.2                       |
| (期 末)<br>2023年11月30日 | 41,803      | 22.7   | 3,986.65                                    | 22.7   | 98.3           | 1.6                       |

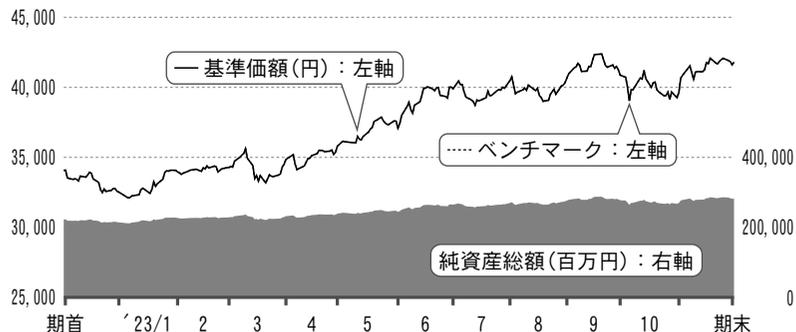
※騰落率は期首比です。

※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（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

### 基準価額等の推移



|     |         |
|-----|---------|
| 期首  | 34,074円 |
| 期末  | 41,803円 |
| 騰落率 | +22.7%  |

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、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（2022年12月1日から2023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

- ・日銀の金融緩和方針維持による円安進展や海外投資家による日本株買いが好感されたこと
- ・日銀による長短金利操作の運用柔軟化の決定が順調に消化され円安が進んだこと

### 下落要因

- ・FOMC（米連邦公開市場委員会）を契機に金融引き締めが長期化するとの見方から長期金利（10年国債利回り）が上昇したこと
- ・中東での地政学リスク台頭により原油価格急騰に対する警戒感が高まったこと

### ▶ 投資環境について（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期初はFRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利見通しの上方修正を受けた利上げ長期化懸念や、米経済指標悪化を受けた景気後退懸念などから軟調な展開となりました。

年が明けると、米国でのインフレと利上げペース鈍化への期待や、国内でのコロナ禍からの経済活動再開への期待が支えとなりじり高の展開となりました。しかし、3月に米国での銀行破綻に欧州大手金融機関の経営不安の報道が重なったことで金融不安が広がると、欧米でリスク回避の動きが強まり、急落しました。

新年度に入ると、日銀の金融緩和方針維持による円安進展や海外投資家による日本株買いが好感され、上値を追う動きとなりました。夏場に、日銀による長短金利操作の運用柔軟化が決定されると、米ドル高・円安の流れが一段進みTOPIXはバブル後の高値を更新しました。

期末には、FOMCを契機に金融引き締めが長期化するとの見方から長期金利が上昇したことや、中東での地政学リスク台頭により原油価格急騰に対する警戒感が高まったことなどを背景に、国内も軟調に推移しました。日銀が金融政策決定会合で長短金利操作の再修正を決定すると、値動きが荒くなる場面がありましたが、同内容を消化後は、堅調な展開に回帰しました。

### ▶ ポートフォリオについて（2022年12月1日から2023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

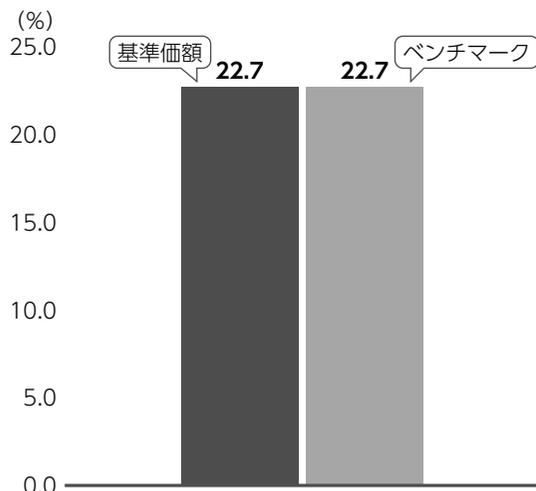
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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（2022年12月1日から2023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。記載のグラフは、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+22.7%となり、ベンチマークの騰落率+22.7%を追随しました。

## 2 今後の運用方針

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

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

### ■ 1万口当たりの費用明細（2022年12月1日から2023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<br>(株 式)<br>(先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 1円<br>(0)<br>(1) | 0.002%<br>(0.000)<br>(0.002) | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数<br>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<br>(そ の 他)                        | 0<br>(0)         | 0.000<br>(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<br>そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用             |
| 合 計   | 1                | 0.002                        |  |

期中の平均基準価額は37,388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（2022年12月1日から2023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                       | 千円                | 千株        | 千円         |
|     |     | 11,978.5<br>(30,542.116) | 26,323,582<br>( ) | 6,907.916 | 11,231,079 |

※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<br>49,745 | 百万円<br>50,698 | 百万円<br>-  | 百万円<br>- |

※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

（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

| 項 目                           | 当 期           |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額         | 37,554,661千円  |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 248,112,176千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b)          | 0.15          |

※(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（2022年12月1日から2023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<br>26,323   | 百万円<br>9,992 | %<br>38.0 | 百万円<br>11,231   | 百万円<br>2,481 | %<br>22.1 |
| 株 式 先 物 取 引 | 49,745          | 696          | 1.4       | 50,698          | 711          | 1.4       |

### (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<br>250 | 百万円<br>75 | 百万円<br>4,187 |

### (3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目                         | 当 期     |
|-----------------------------|---------|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額       | 5,440千円 |
| (b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 | 47千円    |
| (c) (b)／(a)                 | 0.9%    |

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

（2022年12月1日から2023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（2023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                   | 3.9     | 4.1   |    | 15,703  |
| ニッスイ                 | 106.9   | 115.6 |    | 85,243  |
| マルハニチロ               | 16.2    | 17.1  |    | 48,564  |
| 雪国まいたけ               | 10.6    | 11.4  |    | 10,830  |
| カネコ種苗                | 5.3     | 4.7   |    | 6,683   |
| サカタのタネ               | 13.5    | 13.2  |    | 52,602  |
| ホクト                  | 9.4     | 10.1  |    | 17,715  |
| <b>鉱業 (0.4%)</b>     |         |       |    |         |
| 住石ホールディングス           | 21.8    | 14.4  |    | 11,116  |
| 日鉄鉱業                 | 4.3     | 4.5   |    | 25,425  |
| 三井松島ホールディングス         | 5       | 5.5   |    | 15,499  |
| INPEX                | 394     | 427.2 |    | 892,848 |
| 石油資源開発               | 12.3    | 13.3  |    | 75,677  |
| K&Oエナジーグループ          | 4.9     | 5.5   |    | 12,039  |
| <b>建設業 (2.1%)</b>    |         |       |    |         |
| ショーボンドホールディングス       | 14.5    | 15.7  |    | 94,592  |
| ミライト・ワン              | 37.2    | 38.1  |    | 70,351  |
| タマホーム                | 7.6     | 7.3   |    | 25,404  |
| 日本アクア                | 5.9     | 5     |    | 4,675   |
| 安藤・間                 | 61.9    | 66.3  |    | 72,399  |
| 東急建設                 | 32.6    | 32.3  |    | 25,452  |
| コムシスホールディングス         | 35.9    | 37.5  |    | 120,262 |
| ピーアールホールディングス        | 22.2    | 21.6  |    | 7,754   |
| 高松コンストラクショングループ      | 7.2     | 7.2   |    | 18,986  |
| 東建コーポレーション           | 3.4     | 3.2   |    | 25,920  |
| ヤマウラ                 | 7.6     | 6.9   |    | 9,922   |
| オリエンタル白石             | 41.3    | 44    |    | 14,520  |
| 大成建設                 | 74.2    | 75.7  |    | 380,846 |
| 大林組                  | 265.9   | 288.9 |    | 360,402 |
| 清水建設                 | 223.6   | 233.6 |    | 226,965 |
| 飛島建設                 | 10.4    | 9.6   |    | 12,470  |
| 長谷工コーポレーション          | 76.9    | 83    |    | 150,935 |
| 松井建設                 | 2.7     | 8.2   |    | 6,355   |
| 銭高組                  | 2.1     | 1.5   |    | 5,775   |
| 鹿島建設                 | 164.9   | 179.1 |    | 418,467 |
| 不動テトラ                | 6       | 5.6   |    | 12,258  |
| 大末建設                 | 3.7     | —     |    | —       |
| 鉄建建設                 | 7       | 6.7   |    | 13,085  |
| 西松建設                 | 13.1    | 13.9  |    | 54,404  |
| 三井住友建設               | 63.2    | 65.6  |    | 26,108  |

| 銘柄            | 期首(前期末) |       | 期 | 末       |
|---------------|---------|-------|---|---------|
|               | 株数      | 株数    |   |         |
| 大豊建設          | 3.3     | 3.6   |   | 13,140  |
| 奥村組           | 12.3    | 12.9  |   | 58,243  |
| 東鉄工業          | 10.3    | 10.9  |   | 31,631  |
| 浅沼組           | 6.3     | 6.4   |   | 23,648  |
| 戸田建設          | 92.7    | 99.9  |   | 84,345  |
| 熊谷組           | 13      | 13.4  |   | 45,560  |
| 北野建設          | 3       | 1.9   |   | 5,890   |
| 矢作建設工業        | 11.3    | 11.5  |   | 14,789  |
| ピーエス三菱        | 11.1    | 10.9  |   | 10,256  |
| 日本ハウスホールディングス | 17.8    | 19.5  |   | 6,357   |
| 新日本建設         | 10.7    | 11.5  |   | 12,776  |
| 東亜道路工業        | 1.7     | 3.4   |   | 22,746  |
| 日本道路          | 1.7     | 8.5   |   | 16,124  |
| 東亜建設工業        | 6.8     | 7.1   |   | 25,382  |
| 日本国土開発        | 23.7    | 24.3  |   | 14,312  |
| 若築建設          | 3.8     | 3.9   |   | 11,489  |
| 東洋建設          | 24.8    | 26.3  |   | 34,979  |
| 五洋建設          | 106.9   | 114.6 |   | 92,871  |
| 世紀東急工業        | 11.2    | 10.8  |   | 17,971  |
| 福田組           | 2.9     | 3.1   |   | 16,182  |
| 住友林業          | 57.2    | 69.7  |   | 263,047 |
| 日本基礎技術        | —       | 7.5   |   | 3,375   |
| 巴コーポレーション     | 15.1    | 11.5  |   | 6,440   |
| 大和ハウス工業       | 208.4   | 223.5 |   | 938,476 |
| ライト工業         | 13.5    | 14.4  |   | 28,512  |
| 積水ハウス         | 233.7   | 244.9 |   | 741,802 |
| 日特建設          | 8       | 8.2   |   | 8,429   |
| ユアテック         | 16.6    | 17.8  |   | 17,853  |
| 日本リーテック       | 6.3     | 7.7   |   | 9,678   |
| 四電工           | 1.8     | 3.5   |   | 10,178  |
| 中電工           | 10.1    | 11.5  |   | 27,956  |
| 関電工           | 38.3    | 49    |   | 65,072  |
| きんでん          | 51.5    | 56.5  |   | 125,401 |
| 東京エネシス        | 8.5     | 8.7   |   | 8,395   |
| トーエネック        | 2.7     | 2.9   |   | 12,310  |
| 住友電設          | 6.9     | 7.4   |   | 18,921  |
| 日本電設工業        | 11.9    | 13.2  |   | 26,716  |
| エクシオグループ      | 36.4    | 36.8  |   | 114,742 |
| 新日本空調         | 4.4     | 5.3   |   | 11,845  |
| 九電工           | 18.3    | 19.7  |   | 91,861  |
| 三機工業          | 16.2    | 16.9  |   | 29,575  |
| 日揮ホールディングス    | 74.1    | 80    |   | 132,920 |

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 |
| 中外炉工業            | 2.6     |    | 3.3   |    | 7,388   |     |
| ヤマト              | 10.1    |    | 7     |    | 6,587   |     |
| 太平電業             | 4.8     |    | 5     |    | 19,375  |     |
| 高砂熱学工業           | 17.8    |    | 19.3  |    | 57,880  |     |
| 三晃金属工業           | —       |    | 1.3   |    | 6,110   |     |
| 朝日工業社            | 3.5     |    | 4     |    | 11,192  |     |
| 明星工業             | 14      |    | 16    |    | 17,920  |     |
| 大気社              | 8.9     |    | 9.2   |    | 38,916  |     |
| ダイダン             | 5.1     |    | 10.6  |    | 15,688  |     |
| 日比谷総合設備          | 6.8     |    | 6.9   |    | 16,270  |     |
| テスホールディングス       | 8.7     |    | 18.2  |    | 8,044   |     |
| インフロンア・ホールディングス  | 78.4    |    | 86.9  |    | 135,694 |     |
| 東洋エンジニアリング       | 11.2    |    | 11.3  |    | 7,977   |     |
| レイズネクスト          | 10.5    |    | 11.4  |    | 15,823  |     |
| <b>食料品（3.4%）</b> |         |    |       |    |         |     |
| ニッポン             | 19.4    |    | 21.4  |    | 48,663  |     |
| 日清製粉グループ本社       | 69.1    |    | 75    |    | 153,637 |     |
| 日東富士製粉           | 1.7     |    | 1.7   |    | 8,024   |     |
| 昭和産業             | 6.2     |    | 6.7   |    | 20,502  |     |
| 鳥越製粉             | —       |    | 10.7  |    | 7,650   |     |
| 中部飼料             | 10.8    |    | 11.3  |    | 12,260  |     |
| フィード・ワン          | 11.1    |    | 12.9  |    | 10,216  |     |
| 日本甜菜製糖           | 5.3     |    | 5.2   |    | 10,467  |     |
| DM三井製糖ホールディングス   | 7.4     |    | 7.9   |    | 23,858  |     |
| ウェルネオシュガー        | 4.1     |    | 4.7   |    | 9,700   |     |
| 森永製菓             | 15.6    |    | 15    |    | 79,155  |     |
| 中村屋              | 2.9     |    | 2.8   |    | 8,596   |     |
| 江崎グリコ            | 21.6    |    | 23.2  |    | 94,632  |     |
| 名糖産業             | 1.6     |    | —     |    | —       |     |
| 井村屋グループ          | 4.4     |    | 4.8   |    | 11,131  |     |
| 不二家              | 5       |    | 5.7   |    | 14,255  |     |
| 山崎製パン            | 50.5    |    | 54.6  |    | 176,631 |     |
| モロゾフ             | 2.7     |    | 2.8   |    | 10,878  |     |
| 亀田製菓             | 4.8     |    | 5.1   |    | 19,813  |     |
| 寿スピリッツ           | 8       |    | 43    |    | 100,964 |     |
| カルビー             | 34.5    |    | 37.3  |    | 103,283 |     |
| 森永乳業             | 13.8    |    | 29.6  |    | 81,696  |     |
| 六甲バター            | 5.9     |    | 6.3   |    | 8,719   |     |
| ヤクルト本社           | 53.5    |    | 116.2 |    | 383,808 |     |
| 明治ホールディングス       | 46.3    |    | 99.5  |    | 340,588 |     |
| 雪印メグミルク          | 18.6    |    | 19.5  |    | 42,178  |     |
| ブリマハム            | 9.9     |    | 10.6  |    | 23,850  |     |
| 日本ハム             | 29.3    |    | 31.7  |    | 139,289 |     |
| 丸大食品             | 8.6     |    | 8.4   |    | 13,582  |     |
| S F o o d s      | 8.4     |    | 8.9   |    | 28,524  |     |

| 銘柄                | 期首(前期末) |    | 期     |    | 末         |     |
|-------------------|---------|----|-------|----|-----------|-----|
|                   | 株数      | 株数 | 株数    | 株数 | 評価額       | 評価額 |
| 柿安本店              | 3.2     |    | 3.3   |    | 8,170     |     |
| 伊藤ハム米久ホールディングス    | 53.4    |    | 12.1  |    | 47,795    |     |
| サッポロホールディングス      | 24.8    |    | 26.7  |    | 153,952   |     |
| アサヒグループホールディングス   | 173.1   |    | 187.5 |    | 1,022,812 |     |
| キリンホールディングス       | 338.2   |    | 338.3 |    | 706,032   |     |
| 宝ホールディングス         | 51      |    | 54.8  |    | 66,582    |     |
| オエノンホールディングス      | 25.6    |    | 26.2  |    | 9,798     |     |
| コカ・コーラ ボトラーズ      | 58.9    |    | 63.6  |    | 128,821   |     |
| ジャパンホールディングス      | —       |    | 1.7   |    | 6,579     |     |
| ライフドリンク カンパニー     | —       |    | —     |    | —         |     |
| サントリー食品インターナショナル  | 52.5    |    | 57.1  |    | 265,400   |     |
| ダイドーグループホールディングス  | 4.2     |    | 4.5   |    | 26,910    |     |
| 伊藤園               | 27.9    |    | 27.5  |    | 123,612   |     |
| キーコーヒー            | 8.5     |    | 8.4   |    | 17,371    |     |
| 日清オイリオグループ        | 10.4    |    | 11.3  |    | 47,290    |     |
| 不二製油グループ本社        | 17.7    |    | 18.9  |    | 43,885    |     |
| かどや製油             | 2.9     |    | 1.8   |    | 6,408     |     |
| J-オイルミルズ          | 7.8     |    | 8.3   |    | 16,375    |     |
| キッコーマン            | 49.5    |    | 53.7  |    | 486,790   |     |
| 味の素               | 183.4   |    | 195.8 |    | 1,081,990 |     |
| ブルドックソース          | 3.5     |    | 4.7   |    | 9,832     |     |
| キユーピー             | 40.2    |    | 43.6  |    | 112,488   |     |
| ハウス食品グループ本社       | 22.9    |    | 24.8  |    | 80,079    |     |
| カゴメ               | 35      |    | 36.4  |    | 115,642   |     |
| 焼津水産化学工業          | 11.7    |    | —     |    | —         |     |
| アリアケジャパン          | 6.6     |    | 7.2   |    | 33,228    |     |
| エバラ食品工業           | —       |    | 2.8   |    | 7,935     |     |
| ニチレイ              | 34.6    |    | 37.3  |    | 120,255   |     |
| 東洋水産              | 37.8    |    | 41.1  |    | 323,457   |     |
| イトアンドホールディングス     | 3.9     |    | 4.1   |    | 8,384     |     |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | —       |    | 5.8   |    | 6,461     |     |
| 日清食品ホールディングス      | 26.6    |    | 28.6  |    | 419,419   |     |
| 永谷園ホールディングス       | 4.1     |    | 4.2   |    | 9,109     |     |
| フジッコ              | 7.8     |    | 7.6   |    | 14,713    |     |
| ロック・フィールド         | 9.6     |    | 9.1   |    | 14,478    |     |
| 日本たばこ産業           | 492.9   |    | 493.4 |    | 1,875,413 |     |
| ケンコーマヨネーズ         | 5.5     |    | 6.3   |    | 10,174    |     |
| わらべや日洋ホールディングス    | 6.1     |    | 6.2   |    | 21,607    |     |
| なとり               | 5.2     |    | 5.4   |    | 10,989    |     |
| ファーマフーズ           | 11.8    |    | 11.8  |    | 15,139    |     |
| ユーグレナ             | 49.3    |    | 51.5  |    | 38,419    |     |
| 紀文食品              | 6.9     |    | 7.1   |    | 8,179     |     |
| ピックルスホールディングス     | 1.5     |    | 5.2   |    | 6,276     |     |
| ミヨシ油脂             | 3.8     |    | 5.2   |    | 7,618     |     |
| 理研ビタミン            | 6.8     |    | 7.2   |    | 16,221    |     |

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>繊維製品 (0.4%)</b>  |         |       |         |     |
| 片倉工業                | 8.2     | 9     | 15,093  |     |
| グンゼ                 | 5.8     | 5.9   | 28,320  |     |
| 東洋紡                 | 34.3    | 36.1  | 37,977  |     |
| ユニチカ                | 27.8    | 30.5  | 5,581   |     |
| 富士紡ホールディングス         | 3.2     | 3.5   | 12,915  |     |
| 倉敷紡績                | 6.1     | 6.6   | 16,876  |     |
| シキボウ                | 7.9     | 6.1   | 6,667   |     |
| 日本毛織                | 22.2    | 21.8  | 28,231  |     |
| 帝国繊維                | 9       | 9.3   | 18,869  |     |
| 帝人                  | 73.5    | 79.7  | 107,236 |     |
| 東レ                  | 511.5   | 554.1 | 425,050 |     |
| アツギ                 | 3       | —     | —       |     |
| ダイニック               | 6.3     | 6.3   | 4,567   |     |
| セーレン                | 14.7    | 16    | 37,120  |     |
| 小松マターレ              | 12.3    | 13.3  | 10,374  |     |
| ワコールホールディングス        | 14.9    | 15.3  | 49,801  |     |
| ホギメディカル             | 10.3    | 11.2  | 38,360  |     |
| T S Iホールディングス       | 29.1    | 28.5  | 22,059  |     |
| ワールド                | 10.4    | 10.8  | 17,604  |     |
| 三陽商会                | 4       | 2.8   | 7,554   |     |
| オンワードホールディングス       | 52.1    | 54.6  | 27,354  |     |
| ルックホールディングス         | 3.4     | 2.6   | 6,455   |     |
| ゴールドウイン             | 13.4    | 14.7  | 169,564 |     |
| デサント                | 13.1    | 14.3  | 60,846  |     |
| <b>パルプ・紙 (0.2%)</b> |         |       |         |     |
| 特種東海製紙              | 4.3     | 4     | 14,860  |     |
| 王子ホールディングス          | 316.8   | 344.4 | 189,144 |     |
| 日本製紙                | 40.3    | 43.6  | 58,293  |     |
| 北越コーポレーション          | 48.3    | 51    | 71,859  |     |
| 大王製紙                | 34.2    | 37    | 38,757  |     |
| レンゴー                | 70.5    | 75.9  | 71,004  |     |
| トーモク                | 5.4     | 5.4   | 11,739  |     |
| ザ・バック               | 6       | 6.2   | 19,933  |     |
| <b>化学 (6.0%)</b>    |         |       |         |     |
| 北の達人コーポレーション        | 34.5    | 37.7  | 7,841   |     |
| クラレ                 | 121     | 122.3 | 184,000 |     |
| 旭化成                 | 475.3   | 531.9 | 545,995 |     |
| レゾナック・ホールディングス      | 73.7    | 79.7  | 219,972 |     |
| 住友化学                | 562.9   | 611.8 | 230,954 |     |
| 住友精化                | 3.3     | 3.5   | 17,675  |     |
| 日産化学                | 36.1    | 38.9  | 209,787 |     |
| ラサ工業                | 3.4     | 3.5   | 7,462   |     |
| クレハ                 | 6.5     | 6.8   | 58,820  |     |
| 多木化学                | 3       | 3.3   | 10,428  |     |

| 銘柄           | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|--------------|---------|-------|-----------|-----|
|              | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| テイカ          | 5.4     | 5.9   | 7,817     |     |
| 石原産業         | 14.3    | 14.8  | 20,320    |     |
| 日本曹達         | 8.2     | 8.8   | 46,992    |     |
| 東ソー          | 101.2   | 110   | 216,370   |     |
| トクヤマ         | 25      | 26.6  | 63,866    |     |
| セントラル硝子      | 12.3    | 13.3  | 36,162    |     |
| 東亜合成         | 38.8    | 41.1  | 55,896    |     |
| 大阪ソーダ        | 4.6     | 5.1   | 49,572    |     |
| 関東電化工業       | 15.3    | 16.4  | 13,612    |     |
| デンカ          | 27.7    | 30.1  | 79,614    |     |
| 信越化学工業       | 130.3   | 743.1 | 3,873,037 |     |
| 日本カーバイド工業    | 4.4     | —     | —         |     |
| 堺化学工業        | 6.2     | 6.3   | 11,875    |     |
| 第一稀元素化学工業    | 7.6     | 8     | 7,960     |     |
| エア・ウォーター     | 71.8    | 78    | 151,437   |     |
| 日本酸素ホールディングス | 73.3    | 80    | 310,640   |     |
| 日本化学工業       | 3.2     | 3     | 6,087     |     |
| 日本パーカライジング   | 36.6    | 39.8  | 45,929    |     |
| 高压ガス工業       | 12      | 12.8  | 10,355    |     |
| 四国化成ホールディングス | 9.2     | 11    | 19,217    |     |
| 戸田工業         | —       | 2.1   | 3,427     |     |
| ステラ ケミファ     | 4.8     | 5     | 16,225    |     |
| 保土谷化学工業      | 2.5     | 2.4   | 8,640     |     |
| 日本触媒         | 11.6    | 12.6  | 67,422    |     |
| 大日精化工業       | 5.7     | 5.8   | 12,858    |     |
| カネカ          | 17.2    | 21    | 77,973    |     |
| 三菱瓦斯化学       | 56.5    | 63    | 147,262   |     |
| 三井化学         | 63.7    | 69    | 298,632   |     |
| J S R        | 71.2    | 77.2  | 314,126   |     |
| 東京応化工業       | 13.3    | 13.3  | 121,867   |     |
| 大阪有機化学工業     | 5.9     | 6.8   | 18,149    |     |
| 三菱ケミカルグループ   | 515.3   | 582.5 | 564,151   |     |
| K Hネオケム      | 12.7    | 13.3  | 30,457    |     |
| ダイセル         | 112.2   | 117.4 | 166,825   |     |
| 住友ベークライト     | 11.2    | 12.2  | 86,144    |     |
| 積水化学工業       | 157.2   | 167   | 350,783   |     |
| 日本ゼオン        | 45.7    | 56    | 76,944    |     |
| アイカ工業        | 19.2    | 20.7  | 68,827    |     |
| U B E        | 39.3    | 42.3  | 98,284    |     |
| 積水樹脂         | 10.7    | 11.3  | 28,317    |     |
| タキロンシーアイ     | 16.8    | 18.9  | 11,132    |     |
| 旭有機材         | 5.2     | 5.5   | 23,320    |     |
| ニチバン         | 5.3     | 5.7   | 10,020    |     |
| リケンテクノス      | 17.4    | 18.2  | 15,797    |     |
| 大倉工業         | 4       | 4     | 11,272    |     |

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 |
| 群栄化学工業           | 2.2     | 2.1   | 6,478     |     |
| ミライアル            | 3.6     | 2.7   | 4,101     |     |
| ダイキョーニシカワ        | 17.4    | 18.6  | 14,322    |     |
| 森六ホールディングス       | 4.4     | 4.4   | 13,024    |     |
| 恵和               | 2.5     | 6.1   | 8,296     |     |
| 日本化薬             | 58.1    | 64    | 86,400    |     |
| カーリットホールディングス    | 8.5     | 8.7   | 8,221     |     |
| 日本精化             | 4.3     | 4.8   | 12,840    |     |
| 扶桑化学工業           | 6.9     | 7.5   | 32,887    |     |
| トリケミカル研究所        | 10.3    | 11    | 38,610    |     |
| ADEKA            | 26.2    | 30    | 86,085    |     |
| 日油               | 23.5    | 25.5  | 174,547   |     |
| 新日本理化            | 19.1    | 15.6  | 3,042     |     |
| ハリマ化成グループ        | 6.6     | 5.8   | 4,611     |     |
| 花王               | 185.7   | 186.9 | 1,064,582 |     |
| 第一工業製薬           | 3.4     | 3.3   | 6,184     |     |
| 石原ケミカル           | 4.1     | 4.2   | 8,320     |     |
| ニイタカ             | 2.1     | —     | —         |     |
| 三洋化成工業           | 4.5     | 4.8   | 20,568    |     |
| 大日本塗料            | 11.8    | 10.8  | 10,594    |     |
| 日本ペイントホールディングス   | 336.9   | 438.6 | 484,433   |     |
| 関西ペイント           | 70      | 81    | 182,412   |     |
| 中国塗料             | 14.9    | 13.8  | 21,265    |     |
| 日本特殊塗料           | 6.2     | 5.2   | 6,598     |     |
| 藤倉化成             | 4       | 12.9  | 5,753     |     |
| 太陽ホールディングス       | 11.5    | 12.3  | 36,777    |     |
| DIC              | 29.7    | 33    | 80,305    |     |
| サカタインクス          | 17      | 18.3  | 23,918    |     |
| 東洋インキSCホールディングス  | 14.3    | 17.2  | 45,872    |     |
| T&K TOKA         | 7.4     | —     | —         |     |
| 富士フィルムホールディングス   | 146.3   | 156.4 | 1,354,424 |     |
| 資生堂              | 159.4   | 172.7 | 684,928   |     |
| ライオン             | 92.1    | 108.6 | 140,528   |     |
| 高砂香料工業           | 5.2     | 5.6   | 19,684    |     |
| マンダム             | 17      | 17.9  | 22,804    |     |
| ミルボン             | 11.4    | 11.7  | 43,243    |     |
| ファンケル            | 33.4    | 36.3  | 82,655    |     |
| コーセー             | 15.5    | 16.8  | 175,812   |     |
| コタ               | 6.3     | 8     | 12,576    |     |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 39.3    | 42.6  | 66,392    |     |
| ノエビアホールディングス     | 6.8     | 7.3   | 38,106    |     |
| 新日本製薬            | 4.8     | 5     | 7,875     |     |
| l-ne             | —       | 1.1   | 2,842     |     |
| アクシージア           | —       | 4.8   | 4,881     |     |
| エステー             | 6.6     | 7.1   | 10,770    |     |

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                  | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| アグロ カネショウ        | —       | 3.9   | 5,257     |     |
| コニシ              | 12.6    | 13.7  | 35,373    |     |
| 長谷川香料            | 15.7    | 15.8  | 50,876    |     |
| 小林製薬             | 23.3    | 24.1  | 164,362   |     |
| 荒川化学工業           | 7.5     | 7.7   | 7,838     |     |
| メック              | 6.3     | 6.7   | 27,101    |     |
| 日本高純度化学          | 2.4     | 2.4   | 6,000     |     |
| タカラバイオ           | 20.5    | 22.2  | 27,128    |     |
| JCU              | 8.6     | 9.2   | 36,340    |     |
| 新田セラチン           | 5.9     | 6     | 4,704     |     |
| OATアグリオ          | 3.5     | 2.7   | 5,200     |     |
| デクセリアルズ          | 22.1    | 23    | 106,559   |     |
| アース製薬            | 6.9     | 7.4   | 35,372    |     |
| 北興化学工業           | 9.7     | 9.6   | 9,360     |     |
| 大成ラミック           | 3.9     | 3.5   | 10,269    |     |
| クミアイ化学工業         | 30.7    | 33.1  | 36,045    |     |
| 日本農薬             | 14.5    | 15.9  | 9,508     |     |
| アキレス             | 6       | 5.7   | 8,874     |     |
| 有沢製作所            | 13      | 14.4  | 15,768    |     |
| 日東電工             | 55.2    | 55.9  | 587,788   |     |
| レック              | 11.8    | 12.8  | 12,723    |     |
| 三光合成             | 12.5    | 11.7  | 6,318     |     |
| きもと              | 19.4    | 21.6  | 4,125     |     |
| 藤森工業             | 5.9     | 6.3   | 24,475    |     |
| 前澤化成工業           | 6.2     | 5.9   | 9,322     |     |
| 未来工業             | 3.2     | 3.2   | 10,064    |     |
| JSP              | 5.6     | 6     | 10,698    |     |
| エフピコ             | 14.6    | 15.9  | 44,376    |     |
| 天馬               | 6.4     | 6.4   | 14,950    |     |
| 信越ポリマー           | 13.8    | 14.8  | 21,149    |     |
| 東リ               | 9.1     | 20    | 6,760     |     |
| ニフコ              | 27.4    | 29.8  | 107,637   |     |
| バルカー             | 6.5     | 6.8   | 26,554    |     |
| ユニ・チャーム          | 159     | 172.4 | 821,141   |     |
| <b>医薬品（4.7%）</b> |         |       |           |     |
| 協和キリン            | 91.8    | 103   | 251,011   |     |
| 武田薬品工業           | 675     | 731.8 | 3,047,947 |     |
| アステラス製薬          | 730.9   | 736.4 | 1,323,679 |     |
| 住友ファーマ           | 56.9    | 61.9  | 28,969    |     |
| 塩野義製薬            | 97.6    | 104.5 | 729,201   |     |
| 日本新薬             | 18      | 23    | 122,613   |     |
| 中外製薬             | 238.5   | 258.8 | 1,350,418 |     |
| 科研製薬             | 13.3    | 16    | 54,048    |     |
| エーザイ             | 92.9    | 100.6 | 771,803   |     |
| ロート製薬            | 37      | 82    | 253,380   |     |

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 |
| 小野薬品工業                 | 147.3   | 177     | 481,617   |     |
| 久光製薬                   | 17.2    | 19.5    | 90,051    |     |
| 持田製薬                   | 8.9     | 11      | 36,905    |     |
| 参天製薬                   | 144     | 155     | 216,845   |     |
| 扶桑薬品工業                 | 3.2     | 4       | 7,628     |     |
| ツムラ                    | 24.1    | 28      | 78,260    |     |
| キッセイ薬品工業               | 11.8    | 15.5    | 47,352    |     |
| 生化学工業                  | 13.5    | 15.9    | 12,592    |     |
| 栄研化学                   | 11.9    | 17      | 27,999    |     |
| 鳥居薬品                   | 4       | 5       | 18,300    |     |
| JCRファーマ                | 26.2    | 28.5    | 37,734    |     |
| 東和薬品                   | 11.9    | 12.7    | 31,369    |     |
| 富士製薬工業                 | 6.6     | 7.9     | 12,324    |     |
| ゼリア新薬工業                | 10.5    | 11.3    | 22,893    |     |
| そーせいグループ               | —       | 26.9    | 37,364    |     |
| 第一三共                   | 664.4   | 720.4   | 2,881,600 |     |
| 杏林製薬                   | 16.6    | 17.4    | 31,807    |     |
| 大幸薬品                   | 15.9    | 18.1    | 5,448     |     |
| ダイト                    | 5.4     | 8       | 15,560    |     |
| 大塚ホールディングス             | 174.4   | 172.5   | 981,352   |     |
| 大正製薬ホールディングス           | 17.5    | —       | —         |     |
| ペプチドリーム                | 37.4    | 45      | 56,992    |     |
| あすか製薬ホールディングス          | 8.4     | 9.7     | 17,663    |     |
| サワイグループホールディングス        | 17.4    | 20      | 98,360    |     |
| <b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>  |         |         |           |     |
| 日本コークス工業               | 81.6    | 83.3    | 10,162    |     |
| ニチレキ                   | 9.4     | 9.6     | 21,945    |     |
| ユシロ化学工業                | 10.5    | 5.8     | 9,964     |     |
| 富士石油                   | 20      | 22.1    | 8,066     |     |
| 出光興産                   | 84.4    | 91.6    | 371,529   |     |
| ENEOSホールディングス          | 1,378.6 | 1,317.1 | 769,713   |     |
| コスモエネルギーホールディングス       | 29      | 25      | 140,875   |     |
| <b>ゴム製品 (0.7%)</b>     |         |         |           |     |
| 横浜ゴム                   | 43.3    | 42.2    | 138,795   |     |
| TOYO TIRE              | 44.1    | 47.4    | 116,343   |     |
| ブリヂストン                 | 243.5   | 241.6   | 1,473,276 |     |
| 住友ゴム工業                 | 75.2    | 81.1    | 138,640   |     |
| 藤倉コンポジット               | 6.6     | —       | —         |     |
| オカモト                   | 4.5     | 4.1     | 22,345    |     |
| フコク                    | —       | 5       | 7,010     |     |
| ニッタ                    | 7.6     | 8.2     | 30,709    |     |
| 住友理工                   | 15.6    | 13.8    | 14,269    |     |
| 三ツ星ベルト                 | 11.3    | 11.3    | 50,454    |     |
| バンドー化学                 | 12.7    | 12.7    | 19,812    |     |
| <b>ガラス・土石製品 (0.7%)</b> |         |         |           |     |
| 日東紡績                   | 9.4     | 10.5    | 47,197    |     |

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                  | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| AGC              | 77.4    | 74    | 397,380   |     |
| 日本山村硝子           | —       | 2.4   | 3,616     |     |
| 日本電気硝子           | 31.5    | 33.5  | 104,520   |     |
| オハラ              | 5       | 5.3   | 6,964     |     |
| 住友大阪セメント         | 11.3    | 11.8  | 42,574    |     |
| 太平洋セメント          | 49.1    | 52.6  | 146,096   |     |
| 日本ヒューム           | 9.5     | 11    | 10,439    |     |
| 日本コンクリート工業       | 22.5    | 21.5  | 6,944     |     |
| 三谷セキサン           | 3.6     | 4     | 17,560    |     |
| アジアパイルホールディングス   | 15.1    | 18.5  | 13,024    |     |
| 東海カーボン           | 64.8    | 76.3  | 83,472    |     |
| 日本カーボン           | 4.6     | 4.9   | 22,760    |     |
| 東洋炭素             | 4.9     | 6.1   | 27,999    |     |
| ノリタケカンパニーリミテド    | 4.2     | 4.8   | 33,312    |     |
| TOTO             | 50.2    | 54.5  | 206,936   |     |
| 日本碍子             | 89.7    | 95.9  | 173,003   |     |
| 日本特殊陶業           | 58.2    | 65.2  | 223,831   |     |
| ダントーホールディングス     | —       | 5     | 4,795     |     |
| MARUWA           | 3       | 3.2   | 95,264    |     |
| 品川リフラクトリーズ       | 2.3     | 13    | 22,165    |     |
| 黒崎播磨             | 1.8     | 2     | 22,460    |     |
| ヨータイ             | 5       | 6.2   | 9,027     |     |
| 東京窯業             | 22.5    | 13.6  | 5,725     |     |
| フジミンコーポレーテッド     | 6.5     | 22    | 64,438    |     |
| ニチアス             | 20      | 22    | 69,410    |     |
| ニチハ              | 9.9     | 10.5  | 29,148    |     |
| <b>鉄鋼 (1.0%)</b> |         |       |           |     |
| 日本製鉄             | 351.2   | 380.8 | 1,316,425 |     |
| 神戸製鋼所            | 173     | 171   | 296,086   |     |
| 中山製鋼所            | 17.3    | 18    | 15,174    |     |
| 合同製鐵             | 4.4     | 4     | 18,240    |     |
| JFEホールディングス      | 215     | 237   | 516,660   |     |
| 東京製鐵             | 21.9    | 24.1  | 43,235    |     |
| 共英製鋼             | 13      | 9.6   | 19,968    |     |
| 大和工業             | 14.8    | 15.5  | 115,661   |     |
| 東京製鋼             | 4.5     | 4.3   | 17,028    |     |
| 大阪製鐵             | 5.6     | 5.3   | 10,107    |     |
| 淀川製鋼所            | 8.4     | 9.3   | 36,316    |     |
| 中部鋼板             | —       | 7.3   | 14,337    |     |
| 丸一鋼管             | 27.2    | 25.7  | 98,199    |     |
| モリ工業             | 2.8     | 2     | 8,370     |     |
| 大同特殊鋼            | 12      | 10.7  | 73,048    |     |
| 日本冶金工業           | 5.9     | 6.2   | 25,916    |     |
| 山陽特殊製鋼           | 7.6     | 8.2   | 21,451    |     |
| 愛知製鋼             | 7       | 5.1   | 17,518    |     |

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 |
| 日本金属               | —       | 3.6   | 3,286   |     |
| 大平洋金属              | 8       | 6.3   | 7,774   |     |
| 新日本電工              | 52.1    | 50.9  | 15,422  |     |
| 栗本鐵工所              | 4.4     | 4.6   | 15,364  |     |
| 三菱製鋼               | 6.1     | 5.8   | 8,926   |     |
| 日本精線               | 2       | 1.3   | 6,116   |     |
| エンビプロ・ホールディングス     | 10      | —     | —       |     |
| 新家工業               | 3.1     | 2     | 5,786   |     |
| <b>非鉄金属 (0.7%)</b> |         |       |         |     |
| 大紀アルミニウム工業所        | 11.1    | 12.2  | 14,725  |     |
| 日本軽金属ホールディングス      | 21.7    | 23.9  | 40,367  |     |
| 三井金属鉱業             | 22.9    | 25.2  | 114,408 |     |
| 東邦亜鉛               | 5.1     | —     | —       |     |
| 三菱マテリアル            | 52.6    | 61.8  | 150,421 |     |
| 住友金属鉱山             | 91.1    | 98.8  | 424,049 |     |
| DOWAホールディングス       | 17.9    | 20.5  | 107,748 |     |
| 古河機械金属             | 11.1    | 12.9  | 24,148  |     |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ     | 11.7    | 14.4  | 41,788  |     |
| 東邦チタニウム            | 14.4    | 16.5  | 30,211  |     |
| UACJ               | 11.1    | 12    | 41,580  |     |
| CKサンエツ             | 2.2     | 2.4   | 8,868   |     |
| 古河電気工業             | 26.3    | 28.8  | 68,500  |     |
| 住友電気工業             | 270.6   | 319   | 585,046 |     |
| フジクラ               | 85.3    | 99.1  | 112,825 |     |
| SWCC               | 8.9     | 9.7   | 26,005  |     |
| タツタ電線              | 16.1    | —     | —       |     |
| 平河ヒューテック           | 5       | 5.5   | 7,502   |     |
| リョービ               | 8.9     | 9.3   | 27,109  |     |
| アーレスティ             | —       | 8.5   | 6,944   |     |
| AREホールディングス        | 31.7    | 34.6  | 66,051  |     |
| <b>金属製品 (0.5%)</b> |         |       |         |     |
| 稲葉製作所              | 8.9     | 6.2   | 9,213   |     |
| 宮地エンジニアリンググループ     | 2.5     | 4.8   | 15,288  |     |
| トーカロ               | 21.4    | 22.1  | 31,779  |     |
| アルファ               | 7.4     | 4.2   | 6,228   |     |
| SUMCO              | 149.4   | 151.1 | 334,913 |     |
| 川田テクノロジーズ          | 2.2     | 2.3   | 16,100  |     |
| RS Technologies    | 2.6     | 5.9   | 16,885  |     |
| ジェイテックコーポレーション     | —       | 1.2   | 2,448   |     |
| 信和                 | 11.2    | 9.9   | 7,326   |     |
| 東洋製罐グループホールディングス   | 52      | 50.9  | 116,790 |     |
| ホッカンホールディングス       | 5.8     | 5.5   | 8,662   |     |
| 横河ブリッジホールディングス     | 10.3    | 10.5  | 28,602  |     |
| 三和ホールディングス         | 72      | 80.4  | 170,528 |     |
| 文化シャッター            | 22.6    | 24    | 33,120  |     |

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                  | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 三協立山             | 12.5    | 10.7  | 8,752     |     |
| アルインコ            | 7.5     | 7.6   | 7,767     |     |
| LIXIL            | 114.2   | 130.3 | 235,256   |     |
| ノーリツ             | 11.7    | 13.8  | 20,672    |     |
| 長府製作所            | 7.9     | 8.4   | 17,656    |     |
| リンナイ             | 14.2    | 46.2  | 138,831   |     |
| 日東精工             | 12.5    | 13.7  | 7,726     |     |
| 岡部               | 14.2    | 16.5  | 11,599    |     |
| ジーテクト            | 8.6     | 9.3   | 16,219    |     |
| 東プレ              | 13.9    | 14.9  | 29,829    |     |
| 高周波熱錬            | 14.5    | 14    | 14,042    |     |
| 東京製網             | 5.8     | 5.7   | 7,866     |     |
| サンコール            | 8.4     | —     | —         |     |
| モリテックスチール        | 8.8     | —     | —         |     |
| パイオラックス          | 11.1    | 11.6  | 26,274    |     |
| エイチワン            | —       | 9.6   | 7,372     |     |
| 日本発条             | 69.5    | 75.1  | 84,487    |     |
| 中央発條             | —       | 4     | 2,888     |     |
| 立川ブラインド工業        | —       | 4.6   | 6,826     |     |
| 三益半導体工業          | 7       | 6.4   | 17,766    |     |
| <b>機械 (5.2%)</b> |         |       |           |     |
| 日本製鋼所            | 21.4    | 22.9  | 58,475    |     |
| 三浦工業             | 32.2    | 34.6  | 99,163    |     |
| タクマ              | 24      | 25.2  | 41,126    |     |
| ツガミ              | 17.4    | 18    | 22,140    |     |
| オークマ             | 7.7     | 8.1   | 50,171    |     |
| 芝浦機械             | 8.7     | 8.3   | 31,664    |     |
| アマダ              | 121.6   | 131.5 | 194,948   |     |
| アイダエンジニアリング      | 16.3    | 16.4  | 14,268    |     |
| FUJI             | 33.3    | 35.8  | 89,714    |     |
| 牧野フライス製作所        | 8.5     | 9.1   | 52,780    |     |
| オーエスジー           | 36.9    | 38.2  | 70,326    |     |
| 旭ダイヤモンド工業        | 23.1    | 23.1  | 21,228    |     |
| D MG 森精機         | 46.8    | 50.2  | 133,356   |     |
| ソディック            | 21      | 22.4  | 16,822    |     |
| ディスコ             | 12.3    | 40.1  | 1,286,809 |     |
| 日東工器             | 4.4     | 4.4   | 8,192     |     |
| 日進工具             | 6.7     | 7.1   | 7,313     |     |
| パンチ工業            | 3.3     | —     | —         |     |
| 豊和工業             | 6.5     | 5.5   | 4,262     |     |
| 石川製作所            | 3.5     | 3.1   | 3,729     |     |
| リケンNPR           | —       | 7     | 13,720    |     |
| 島精機製作所           | 12.3    | 13.5  | 20,709    |     |
| オプトラン            | 11.6    | 13.7  | 22,289    |     |
| NCホールディングス       | 2.5     | 2     | 3,804     |     |

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 |
| イワキ            | 5.7     | 6.3   | 12,959    |     |
| フリー            | 8.9     | 9.2   | 11,334    |     |
| ヤマシンフィルタ       | 20.4    | 21.8  | 7,521     |     |
| 日阪製作所          | 9.1     | 8.8   | 8,421     |     |
| やまびこ           | 13.1    | 13.3  | 19,763    |     |
| 野村マイクロ・サイエンス   | 2.6     | 2.8   | 32,004    |     |
| 平田機工           | 3.8     | 4     | 25,520    |     |
| P E G A S U S  | 9.6     | 11    | 5,258     |     |
| マルマエ           | 4.2     | 4.3   | 7,851     |     |
| タツモ            | 5       | 5.2   | 18,928    |     |
| ナブテスコ          | 48.4    | 52.1  | 144,186   |     |
| 三井海洋開発         | 9.9     | 10.6  | 20,214    |     |
| レオン自動機         | 8.7     | 9.1   | 14,214    |     |
| S M C          | 24.9    | 25.2  | 1,876,140 |     |
| ホソカワミクロン       | 6.1     | 5.7   | 24,225    |     |
| ユニオンツール        | 3.3     | 3.6   | 12,186    |     |
| 瑞光             | —       | 6.5   | 9,314     |     |
| オイルス工業         | 10.9    | 11.1  | 21,689    |     |
| 日精エー・エス・ビー機械   | 3.6     | 3.4   | 16,949    |     |
| サトーホールディングス    | 11.1    | 11.6  | 23,652    |     |
| 技研製作所          | 8.2     | 8.1   | 15,049    |     |
| 日本エアーテック       | 5.3     | 5.1   | 7,140     |     |
| 日精樹脂工業         | 7.2     | 6.9   | 7,479     |     |
| オカダアイオン        | 1.4     | —     | —         |     |
| ワイエイシイホールディングス | 4.1     | 2.7   | 6,831     |     |
| 小松製作所          | 360     | 390   | 1,471,080 |     |
| 住友重機械工業        | 45.3    | 48.9  | 172,568   |     |
| 日立建機           | 30.6    | 33    | 126,555   |     |
| 日工             | 13.7    | 12.8  | 8,614     |     |
| 巴工業            | 4       | 3.8   | 10,928    |     |
| 井関農機           | 8.5     | 8.4   | 9,290     |     |
| T O W A        | 8.1     | 8.4   | 59,304    |     |
| ローツェ           | 4       | 4.3   | 62,608    |     |
| クボタ            | 406.5   | 436.6 | 925,155   |     |
| 荏原実業           | 4       | 4.5   | 13,284    |     |
| 三菱化工機          | 3.1     | 2.9   | 9,526     |     |
| 月島ホールディングス     | 11.6    | 11.5  | 15,272    |     |
| 帝国電機製作所        | 6.1     | 5.9   | 17,788    |     |
| 新東工業           | 17.1    | 16.7  | 18,152    |     |
| 澁谷工業           | 7.2     | 8     | 20,296    |     |
| アイチ コーポレーション   | 11.5    | 11.8  | 11,009    |     |
| 小森コーポレーション     | 19.2    | 19.3  | 22,561    |     |
| 鶴見製作所          | 6.1     | 6.3   | 22,459    |     |
| 酒井重工業          | 1.8     | 1.4   | 8,218     |     |
| 荏原製作所          | 31.4    | 34    | 284,614   |     |

| 銘柄              | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|-----------------|---------|-------|-----------|-----|
|                 | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 西島製作所           | 7.7     | 7.6   | 16,697    |     |
| 北越工業            | 8.8     | 8.7   | 19,566    |     |
| ダイキン工業          | 91.7    | 99.2  | 2,197,776 |     |
| オルガノ            | 10.5    | 11.5  | 69,690    |     |
| トーヨーカネツ         | 3.7     | 3.4   | 12,631    |     |
| 栗田工業            | 42.9    | 46.5  | 243,567   |     |
| 椿本チエイン          | 10.6    | 11.5  | 43,412    |     |
| 大同工業            | 7.9     | 6.3   | 4,643     |     |
| 木村化工機           | 8.6     | 8.7   | 6,229     |     |
| アネスト岩田          | 13.9    | 14.1  | 15,425    |     |
| ダイフク            | 39.6    | 134.8 | 375,148   |     |
| サムコ             | 2.7     | 2.3   | 11,005    |     |
| 加藤製作所           | —       | 4.3   | 5,362     |     |
| タダノ             | 41.4    | 47.5  | 54,838    |     |
| フジテック           | 28.2    | 24.6  | 84,353    |     |
| C K D           | 21.3    | 23.9  | 57,575    |     |
| 平和              | 25.8    | 27.7  | 58,280    |     |
| 理想科学工業          | 7       | 7.2   | 19,879    |     |
| S A N K Y O     | 15.3    | 19.2  | 122,649   |     |
| 日本金銭機械          | 10.5    | 9.9   | 11,097    |     |
| マースグループホールディングス | 5.5     | 5.1   | 12,153    |     |
| フクシマガリレイ        | 5.7     | 6.1   | 29,890    |     |
| ダイコク電機          | 5.4     | 4.7   | 16,238    |     |
| 竹内製作所           | 14      | 15.1  | 65,307    |     |
| アマノ             | 22      | 23.6  | 74,269    |     |
| J U K I         | 13.8    | 13.7  | 6,918     |     |
| ジャノメ            | 9.8     | 9.4   | 6,739     |     |
| マックス            | 9.4     | 10.5  | 29,547    |     |
| グローリー           | 20.4    | 20.1  | 55,677    |     |
| 新晃工業            | 8.3     | 8.2   | 20,327    |     |
| 大和冷機工業          | 11.6    | 12.4  | 17,880    |     |
| セガサミーホールディングス   | 62      | 70.3  | 150,969   |     |
| 日本ピストンリング       | 1.2     | —     | —         |     |
| リケン             | 3.8     | —     | —         |     |
| T P R           | 9.8     | 9.3   | 16,079    |     |
| ツバキ・ナカシマ        | 18      | 19.1  | 14,172    |     |
| ホンザキ            | 49.5    | 49.7  | 234,037   |     |
| 大豊工業            | 8       | 8.3   | 7,245     |     |
| 日本精工            | 141.2   | 140   | 108,514   |     |
| N T N           | 155.1   | 163.4 | 45,245    |     |
| ジェイテクト          | 68      | 73.4  | 99,493    |     |
| 不二越             | 5.7     | 6.3   | 23,845    |     |
| 日本トムソン          | 20.4    | 20.6  | 12,154    |     |
| T H K           | 44.4    | 47.8  | 141,177   |     |
| ユースン精機          | —       | 7.7   | 5,174     |     |

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                  | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 前澤給装工業           | 6.8     | 6.3   | 8,133     |     |
| イーグル工業           | 9.2     | 9.3   | 15,410    |     |
| 前澤工業             | —       | 5.6   | 5,482     |     |
| 日本ビラー工業          | 7.3     | 7.8   | 35,880    |     |
| キッツ              | 29      | 30    | 34,290    |     |
| マキタ              | 95.9    | 97.9  | 384,159   |     |
| 三井E&S            | —       | 40.7  | 22,100    |     |
| 日立造船             | 63.5    | 68.1  | 61,358    |     |
| 三菱重工業            | 134.5   | 145.3 | 1,201,340 |     |
| IHI              | 48.5    | 60    | 171,360   |     |
| スター精密            | 14.6    | 15.1  | 28,342    |     |
| 電気機器 (17.3%)     |         |       |           |     |
| 日清紡ホールディングス      | 63.3    | 65.2  | 70,839    |     |
| イビデン             | 44      | 43.7  | 309,002   |     |
| ユニカミノルタ          | 173.4   | 186.2 | 87,122    |     |
| ブラザー工業           | 102.2   | 111.3 | 277,804   |     |
| ミネベアミツミ          | 133     | 144.4 | 406,197   |     |
| 日立製作所            | 385.5   | 400   | 4,114,000 |     |
| 東芝               | 147.9   | —     | —         |     |
| 三菱電機             | 793.7   | 916   | 1,840,244 |     |
| 富士電機             | 46.6    | 50.6  | 313,770   |     |
| 東洋電機製造           | —       | 5     | 4,680     |     |
| 安川電機             | 90.9    | 91.5  | 519,079   |     |
| シンフォニアテクノロジー     | 9.2     | 10    | 20,640    |     |
| 明電舎              | 12      | 12.5  | 30,587    |     |
| オリジン             | 3.7     | 3.5   | 4,256     |     |
| 山洋電気             | 3.5     | 3.6   | 21,924    |     |
| デンヨー             | 6.6     | 6.9   | 14,904    |     |
| PHCホールディングス      | 10.9    | 11.6  | 17,226    |     |
| KOKUSAI ELECTRIC | —       | 32    | 106,080   |     |
| ソシオネクスト          | 7.5     | 12    | 159,000   |     |
| 東芝テック            | 11.4    | 11.3  | 32,871    |     |
| 芝浦メカトロニクス        | 1.5     | 4.5   | 30,150    |     |
| マブチモーター          | 19      | 20.7  | 96,213    |     |
| ニデック             | 186.6   | 183.9 | 1,030,575 |     |
| トレックス・セミコンダクター   | 3.9     | 4.1   | 8,216     |     |
| 東光高岳             | 5.2     | 5.3   | 10,965    |     |
| ダブル・スコープ         | 19.5    | 24.1  | 22,172    |     |
| ダイヘン             | 7.1     | 7.4   | 43,142    |     |
| ヤーマン             | 15.7    | 15.2  | 16,127    |     |
| JVCケンウッド         | 75.6    | 67.7  | 51,925    |     |
| ミマキエンジニアリング      | 8.5     | 9     | 8,721     |     |
| IPEX             | 5.3     | 6.2   | 11,308    |     |
| 日新電機             | 18.1    | —     | —         |     |
| 大崎電気工業           | 21.4    | 21.5  | 14,125    |     |

| 銘柄                | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|-------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                   | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| オムロン              | 70.4    | 63.9  | 396,116   |     |
| 日東工業              | 10.5    | 11.2  | 40,208    |     |
| I D E C           | 11.5    | 12.3  | 34,747    |     |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 25.6    | 27.3  | 59,336    |     |
| メルコホールディングス       | 2.3     | 2.4   | 8,304     |     |
| 日本電気              | 108.6   | 110.1 | 907,224   |     |
| 富士通               | 76.5    | 76.6  | 1,617,792 |     |
| 沖電気工業             | 36.6    | 37.5  | 35,850    |     |
| 電気興業              | 4       | 3.7   | 8,946     |     |
| サンケン電気            | 7.2     | 7.7   | 58,173    |     |
| アイホン              | 5.1     | 4.9   | 13,563    |     |
| ルネサスエレクトロニクス      | 500.9   | 543   | 1,413,700 |     |
| セイコーエプソン          | 102.2   | 106.7 | 234,526   |     |
| ワコム               | 61.4    | 63.4  | 43,619    |     |
| アルバック             | 18.3    | 19.7  | 128,207   |     |
| アクセル              | 4       | 2.8   | 5,908     |     |
| E I Z O           | 5.8     | 6.1   | 29,737    |     |
| 日本信号              | 17.8    | 19    | 18,183    |     |
| 京三製作所             | 19.4    | 19.5  | 9,282     |     |
| 能美防災              | 10.4    | 11.2  | 21,112    |     |
| ホーチキ              | 6.4     | 6.7   | 11,075    |     |
| エレコム              | 18.5    | 19.9  | 32,317    |     |
| パナソニック ホールディングス   | 907.3   | 983.7 | 1,505,061 |     |
| シャープ              | 92.8    | 124.5 | 115,237   |     |
| アンリツ              | 54.6    | 59    | 75,726    |     |
| 富士通ゼネラル           | 21.9    | 23.8  | 64,498    |     |
| ソニーグループ           | 537.9   | 582.3 | 7,465,086 |     |
| T D K             | 121.6   | 131.7 | 904,779   |     |
| 帝国通信工業            | 4.3     | 4.1   | 8,052     |     |
| タムラ製作所            | 34.1    | 36.2  | 20,597    |     |
| アルプスアルパイン         | 69.6    | 74.6  | 96,644    |     |
| 日本電波工業            | 9.6     | 10.8  | 13,500    |     |
| 鈴木                | 3       | 5.5   | 6,787     |     |
| メイコー              | 8.6     | 9.1   | 39,630    |     |
| 日本トリム             | 2.4     | 2.2   | 6,831     |     |
| ローランド ディー. ジー.    | 4.5     | 4.6   | 16,629    |     |
| フォスター電機           | 9.1     | 8.7   | 9,674     |     |
| SMK               | 2.3     | 2.5   | 6,290     |     |
| ヨコオ               | 6.4     | 7.3   | 11,431    |     |
| ホシデン              | 18.7    | 19.3  | 34,894    |     |
| ヒロセ電機             | 12.7    | 12.7  | 210,185   |     |
| 日本航空電子工業          | 15.7    | 16.9  | 49,804    |     |
| T O A             | 10.3    | 10.1  | 10,605    |     |
| マクセル              | 17.4    | 17.4  | 28,849    |     |
| 古野電気              | 10.7    | 11.5  | 20,815    |     |

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 |
| スミダコーポレーション      | 8       | 11.3  | 13,356    |     |
| アイコム             | 3.2     | 3.6   | 11,736    |     |
| リオン              | 3.6     | 3.8   | 8,470     |     |
| 横河電機             | 84      | 91.1  | 255,171   |     |
| 新電元工業            | 3.2     | 3.4   | 10,387    |     |
| アズビル             | 53.1    | 57.6  | 274,867   |     |
| 東亜ディーケーケー        | 7.6     | 6     | 5,280     |     |
| 日本光電工業           | 35.3    | 36.7  | 136,230   |     |
| チノー              | 4.2     | 4     | 8,264     |     |
| 日本電子材料           | 6.4     | 6.2   | 9,746     |     |
| 堀場製作所            | 17      | 16.1  | 160,307   |     |
| アドバンテスト          | 59.8    | 236.3 | 1,106,120 |     |
| エスベック            | 6.6     | 7.1   | 16,770    |     |
| キーエンス            | 76.1    | 82.4  | 5,220,040 |     |
| 日置電機             | 4       | 4.1   | 26,896    |     |
| シスメックス           | 65.5    | 71    | 580,851   |     |
| 日本マイクロニクス        | 12.9    | 14.8  | 56,758    |     |
| メガチップス           | 6.5     | 6.8   | 28,764    |     |
| OBARA GROUP      | 4.4     | 4.9   | 18,130    |     |
| コーセル             | 11.5    | 10.6  | 13,398    |     |
| イリソ電子工業          | 7.1     | 7.6   | 30,210    |     |
| オプテックスグループ       | 14.3    | 15.1  | 25,851    |     |
| 千代田インテグレ         | 4.3     | 3.7   | 11,248    |     |
| レーザーテック          | 37.5    | 37.8  | 1,248,912 |     |
| スタンレー電気          | 54      | 56.5  | 154,584   |     |
| 岩崎電気             | 3.1     | —     | —         |     |
| ウシオ電機            | 40      | 41.8  | 79,629    |     |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 11.5    | 6.3   | 3,150     |     |
| エノモト             | 2.5     | —     | —         |     |
| 日本セラミック          | 8       | 8     | 23,472    |     |
| 古河電池             | 6.2     | 6.5   | 5,798     |     |
| 双信電機             | 2.8     | —     | —         |     |
| 山一電機             | 7.1     | 7.3   | 13,833    |     |
| 図研               | 6.7     | 7.2   | 30,528    |     |
| 日本電子             | 19      | 20.6  | 120,757   |     |
| カシオ計算機           | 57.1    | 61.3  | 76,563    |     |
| ファナック            | 74.6    | 402.1 | 1,654,239 |     |
| 日本シイエムケイ         | 18.6    | 19.8  | 14,869    |     |
| エンプラス            | 2.4     | 2.5   | 33,350    |     |
| 大真空              | 10.2    | 10.8  | 9,158     |     |
| ローム              | 35.1    | 152.4 | 430,606   |     |
| 浜松ホトニクス          | 60.8    | 66    | 386,496   |     |
| 三井ハイテック          | 7.9     | 7.4   | 54,752    |     |
| 新光電気工業           | 26.8    | 29.1  | 160,602   |     |
| 京セラ              | 118.1   | 128   | 1,048,320 |     |

| 銘柄             | 期首(前期末) |         | 期末         |     |
|----------------|---------|---------|------------|-----|
|                | 株数      | 株数      | 評価額        | 評価額 |
| 太陽誘電           | 37      | 40.1    | 153,743    |     |
| 村田製作所          | 230.5   | 749.7   | 2,161,759  |     |
| 双葉電子工業         | 17.6    | 17.4    | 9,622      |     |
| 北陸電気工業         | 1.6     | 3.2     | 4,486      |     |
| ニチコン           | 15.9    | 16.8    | 24,712     |     |
| 日本ケミコン         | 8.1     | —       | —          |     |
| K O A          | 11.8    | 12.6    | 20,399     |     |
| 市光工業           | 12.9    | 15.9    | 8,570      |     |
| 小糸製作所          | 91.1    | 92.2    | 206,205    |     |
| ミツバ            | 16.5    | 16.2    | 15,114     |     |
| SCREENホールディングス | 13      | 28.2    | 303,714    |     |
| キャノン電子         | 8.7     | 9.1     | 17,936     |     |
| キャノン           | 417.3   | 411.3   | 1,565,819  |     |
| リコー            | 190     | 206.9   | 249,728    |     |
| 象印マホービン        | 22.7    | 23.5    | 36,566     |     |
| 東京エレクトロン       | 53.6    | 174.3   | 4,187,557  |     |
| イノテック          | 6       | 6.1     | 10,546     |     |
| 輸送用機器 (8.7%)   |         |         |            |     |
| トヨタ紡織          | 32      | 34.5    | 87,975     |     |
| ユニプレス          | 15      | 15.1    | 14,949     |     |
| 豊田自動織機         | 55.3    | 68.4    | 869,706    |     |
| モリタホールディングス    | 14      | 14.6    | 22,279     |     |
| 三櫻工業           | 12.5    | 14      | 12,222     |     |
| デンソー           | 156.7   | 679.6   | 1,572,594  |     |
| 東海理化電機製作所      | 20.9    | 22.7    | 56,250     |     |
| 川崎重工業          | 57.6    | 64      | 215,232    |     |
| 名村造船所          | —       | 16      | 16,464     |     |
| 日本車輛製造         | 3.7     | 5       | 10,470     |     |
| 三菱ロジスネクスト      | 14      | 14      | 18,536     |     |
| 日産自動車          | 1,081.7 | 1,171.2 | 682,692    |     |
| いすゞ自動車         | 220.6   | 239.1   | 467,560    |     |
| トヨタ自動車         | 4,175.6 | 4,527   | 12,650,701 |     |
| 日野自動車          | 99      | 106.9   | 51,034     |     |
| 三菱自動車工業        | 297.8   | 322.3   | 155,155    |     |
| G M B          | —       | 2       | 2,650      |     |
| 武蔵精密工業         | 18.6    | 19.8    | 31,957     |     |
| 日産車体           | 13.7    | 16      | 14,336     |     |
| 新明和工業          | 24.7    | 25.9    | 30,665     |     |
| 極東開発工業         | 13.7    | 13.3    | 25,270     |     |
| トビー工業          | 6.9     | 7.1     | 19,617     |     |
| ティラド           | 2.5     | 3       | 9,495      |     |
| 曙ブレーキ工業        | 53.4    | —       | —          |     |
| タチエス           | 13.1    | 13.2    | 23,232     |     |
| N O K          | 30      | 32.2    | 60,697     |     |
| フタバ産業          | 24      | 24      | 20,544     |     |

# 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                 | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|--------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                    | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| カヤバ                | 7.4     | 7.8   | 37,089    |     |
| 大同メタル工業            | 19.6    | 19.5  | 11,290    |     |
| プレス工業              | 35.7    | 36.2  | 22,444    |     |
| ミクニ                | 13.5    | 10    | 4,560     |     |
| 太平洋工業              | 17.9    | 18.4  | 25,704    |     |
| アイシン               | 58.3    | 63.5  | 346,138   |     |
| マツダ                | 252     | 272.5 | 430,141   |     |
| 今仙電機製作所            | —       | 6.3   | 3,868     |     |
| 本田技研工業             | 618     | 2,010 | 3,033,090 |     |
| スズキ                | 139.8   | 151.4 | 911,579   |     |
| S U B A R U        | 241.1   | 260.9 | 683,818   |     |
| 安永                 | —       | 4.4   | 3,115     |     |
| ヤマハ発動機             | 119.2   | 118.5 | 447,574   |     |
| T B K              | 18.5    | —     | —         |     |
| エクセディ              | 12.7    | 13    | 33,124    |     |
| 豊田合成               | 22.2    | 23.8  | 70,400    |     |
| 愛三工業               | 13.8    | 14    | 18,368    |     |
| 日本プラスト             | 15.9    | 11    | 6,292     |     |
| ヨロズ                | 9       | 10    | 9,020     |     |
| エフ・シー・シー           | 13.4    | 14.2  | 25,957    |     |
| シマノ                | 31.1    | 33.5  | 762,292   |     |
| テイ・エス テック          | 34.9    | 37.5  | 68,475    |     |
| ジャムコ               | 2.4     | 4     | 5,952     |     |
| <b>精密機器 (2.3%)</b> |         |       |           |     |
| テルモ                | 237.5   | 232.8 | 1,098,350 |     |
| 日機装                | 19.5    | 19.1  | 19,214    |     |
| 日本エム・ディ・エム         | 5       | 5.4   | 3,796     |     |
| 島津製作所              | 92.3    | 102.2 | 391,937   |     |
| 長野計器               | 6.4     | 6.2   | 12,914    |     |
| ブイ・テクノロジー          | 4.1     | 4.4   | 11,690    |     |
| 東京計器               | 7       | 6.9   | 12,157    |     |
| 愛知時計電機             | 3.8     | 3.8   | 8,937     |     |
| インターアクション          | 5.1     | 4.5   | 4,572     |     |
| オーバル               | 8       | 7.3   | 3,547     |     |
| 東京精密               | 16.6    | 17.8  | 152,670   |     |
| マニー                | 33.6    | 33.2  | 72,807    |     |
| ニコン                | 118.4   | 119.2 | 169,800   |     |
| トプコン               | 40.3    | 43.5  | 65,989    |     |
| オリンパス              | 475.4   | 507.6 | 1,099,461 |     |
| 理研計器               | 4.8     | 5.1   | 33,813    |     |
| タムロン               | 5.7     | 5.4   | 23,841    |     |
| H O Y A            | 164.3   | 164   | 2,733,060 |     |
| ノーリツ鋼機             | 7.3     | 7.9   | 23,644    |     |
| A&Dホロンホールディングス     | 11.1    | 11.9  | 22,253    |     |
| 朝日インテック            | 100.5   | 92.1  | 264,004   |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|---------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                     | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| シチズン時計              | 83.7    | 78.1  | 67,712    |     |
| リズム                 | 3       | 1.7   | 4,234     |     |
| メニコン                | 26.2    | 28.4  | 61,173    |     |
| 松風                  | 3.7     | 4     | 10,692    |     |
| セイコーグループ            | 11.8    | 12.8  | 32,064    |     |
| ニプロ                 | 64.5    | 69    | 77,142    |     |
| <b>その他製品 (2.3%)</b> |         |       |           |     |
| スノーピーク              | 13.3    | 12.3  | 12,447    |     |
| パラマウントベッドホールディングス   | 17.3    | 18.9  | 52,220    |     |
| トランザクション            | 6.6     | 5.2   | 10,982    |     |
| ニホンフラッシュ            | 7.8     | 8.6   | 7,705     |     |
| 前田工織                | 8.4     | 7     | 20,713    |     |
| 永大産業                | 27.2    | 17.8  | 3,951     |     |
| アートネイチャー            | 8.9     | 9.8   | 7,742     |     |
| バンダイナムコホールディングス     | 69.4    | 225.4 | 663,352   |     |
| S H O E I           | 8       | 18.7  | 37,119    |     |
| フランスベッドホールディングス     | 10.6    | 10.5  | 13,135    |     |
| パイロットコーポレーション       | 11.9    | 12.4  | 55,415    |     |
| 萩原工業                | 6.5     | 6.3   | 10,023    |     |
| フジシールインターナショナル      | 15.5    | 16.7  | 27,972    |     |
| タカラトミー              | 35.3    | 37.5  | 77,943    |     |
| 広済堂ホールディングス         | 5.5     | 18    | 11,430    |     |
| プロネクサス              | 7.5     | 7.7   | 9,309     |     |
| ウッドワン               | 5       | —     | —         |     |
| 大建工業                | 5       | —     | —         |     |
| TOPPANホールディングス      | 98.9    | 101.2 | 350,556   |     |
| 大日本印刷               | 89.8    | 90.2  | 374,600   |     |
| 共同印刷                | 2.7     | 2.8   | 10,080    |     |
| N I S S H A         | 14.6    | 15.1  | 22,272    |     |
| TAKARA & COMPANY    | 5.8     | 5.7   | 14,022    |     |
| アシックス               | 70.3    | 70.2  | 371,358   |     |
| ツツミ                 | —       | 2     | 4,288     |     |
| ローランド               | 5.7     | 6.2   | 28,148    |     |
| 小松ウオール工業            | 3       | 3.3   | 9,659     |     |
| ヤマハ                 | 47.8    | 51.9  | 179,625   |     |
| 河合楽器製作所             | 2.2     | 2.4   | 7,572     |     |
| クリナップ               | 9.7     | 10.5  | 7,308     |     |
| ビジョン                | 49      | 53    | 87,927    |     |
| キングジム               | 7.9     | 9     | 7,830     |     |
| リンテック               | 15.2    | 16.3  | 40,652    |     |
| イトーキ                | 18.1    | 17.1  | 22,572    |     |
| 任天堂                 | 480.2   | 519.9 | 3,593,548 |     |
| 三菱鉛筆                | 10.9    | 11.8  | 22,278    |     |
| タカラスタンダード           | 14.2    | 15.2  | 27,010    |     |
| コクヨ                 | 36.5    | 36.5  | 84,041    |     |

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 |
| ナカバヤシ                | 3.3     | —     | —         | —   |
| グローブライド              | 6.2     | 6.8   | 13,763    |     |
| オカムラ                 | 22.5    | 24.9  | 53,061    |     |
| 美津濃                  | 7.6     | 8.3   | 33,573    |     |
| <b>電気・ガス業 (1.4%)</b> |         |       |           |     |
| 東京電力ホールディングス         | 686.3   | 744.2 | 469,515   |     |
| 中部電力                 | 278.9   | 303   | 553,581   |     |
| 関西電力                 | 292.3   | 318.1 | 626,975   |     |
| 中国電力                 | 121.9   | 143.2 | 139,820   |     |
| 北陸電力                 | 73.7    | 83.4  | 60,239    |     |
| 東北電力                 | 186.2   | 216.3 | 204,814   |     |
| 四国電力                 | 65.8    | 75.3  | 77,031    |     |
| 九州電力                 | 174.3   | 189.6 | 187,817   |     |
| 北海道電力                | 75.2    | 79.5  | 49,751    |     |
| 沖縄電力                 | 19.1    | 20.6  | 22,330    |     |
| 電源開発                 | 57.5    | 67.5  | 155,081   |     |
| エフオン                 | 6.8     | 8.6   | 4,093     |     |
| イーレックス               | 13.5    | 15.1  | 9,950     |     |
| レノバ                  | 20.3    | 22.2  | 23,421    |     |
| 東京瓦斯                 | 160.6   | 174.2 | 596,983   |     |
| 大阪瓦斯                 | 153.6   | 166.7 | 480,096   |     |
| 東邦瓦斯                 | 30      | 34.6  | 91,188    |     |
| 北海道瓦斯                | 5       | 5.1   | 11,531    |     |
| 広島ガス                 | 13.7    | 19.1  | 7,143     |     |
| 西部ガスホールディングス         | 7.1     | 7.8   | 14,609    |     |
| 静岡ガス                 | 17      | 18    | 18,360    |     |
| メタウォーター              | 9.4     | 9.8   | 20,080    |     |
| <b>陸運業 (2.8%)</b>    |         |       |           |     |
| SBSホールディングス          | 6.6     | 7.2   | 18,050    |     |
| 東武鉄道                 | 83.1    | 90.4  | 330,412   |     |
| 相鉄ホールディングス           | 25.4    | 27.3  | 73,232    |     |
| 東急                   | 212.2   | 230.7 | 400,379   |     |
| 京浜急行電鉄               | 86.6    | 93.4  | 117,870   |     |
| 小田急電鉄                | 115     | 126.1 | 262,224   |     |
| 京王電鉄                 | 40.2    | 43.6  | 185,866   |     |
| 京成電鉄                 | 48.9    | 53.1  | 316,476   |     |
| 富士急行                 | 9.4     | 10.2  | 44,166    |     |
| 東日本旅客鉄道              | 129.1   | 147.9 | 1,182,460 |     |
| 西日本旅客鉄道              | 97.5    | 102.3 | 598,148   |     |
| 東海旅客鉄道               | 58.7    | 317.5 | 1,127,125 |     |
| 西武ホールディングス           | 92.4    | 99.9  | 178,271   |     |
| 鴻池運輸                 | 13.1    | 14    | 27,566    |     |
| 西日本鉄道                | 20.2    | 21.6  | 51,138    |     |
| ハマキョウレックス            | 5.9     | 6.3   | 25,231    |     |
| サカイ引越センター            | 3.7     | 7.8   | 20,373    |     |

| 銘柄                     | 期首(前期末) |       | 期末      |     |
|------------------------|---------|-------|---------|-----|
|                        | 株数      | 株数    | 評価額     | 評価額 |
| 近鉄グループホールディングス         | 75.7    | 82.1  | 340,386 |     |
| 阪急阪神ホールディングス           | 100.7   | 109.5 | 489,574 |     |
| 南海電気鉄道                 | 36.4    | 39.3  | 110,138 |     |
| 京阪ホールディングス             | 31.4    | 45.4  | 167,616 |     |
| 神戸電鉄                   | 2.8     | 2.8   | 8,226   |     |
| 名古屋鉄道                  | 84      | 90.8  | 196,536 |     |
| 山陽電気鉄道                 | 6.3     | 6.7   | 14,224  |     |
| アルプス物流                 | 6       | 6.7   | 10,807  |     |
| ヤマトホールディングス            | 97.2    | 105.4 | 277,043 |     |
| 山九                     | 19.3    | 20.9  | 105,315 |     |
| 丸全昭和運輸                 | 4.7     | 5     | 18,700  |     |
| センコーグループホールディングス       | 39.8    | 42.9  | 45,345  |     |
| トナミホールディングス            | 1.8     | 1.9   | 8,797   |     |
| ニッコンホールディングス           | 24.3    | 26.1  | 83,963  |     |
| 福山通運                   | 6.3     | 6.2   | 22,723  |     |
| セイノーホールディングス           | 47      | 47.1  | 98,109  |     |
| 神奈川中央交通                | 2.5     | 2.6   | 7,917   |     |
| 日立物流                   | 16.7    | —     | —       |     |
| AZ-COM丸和ホールディングス       | 18.5    | 20    | 30,020  |     |
| C&Fロジホールディングス          | 7.8     | 8.3   | 12,541  |     |
| 九州旅客鉄道                 | 54.1    | 58.1  | 179,587 |     |
| SGホールディングス             | 145.4   | 145.5 | 311,006 |     |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 28.1    | 28.3  | 228,409 |     |
| <b>海運業 (0.8%)</b>      |         |       |         |     |
| 日本郵船                   | 202     | 233.4 | 927,531 |     |
| 商船三井                   | 133.3   | 178.5 | 724,888 |     |
| 川崎汽船                   | 64.7    | 69.4  | 360,116 |     |
| NSユナイテッド海運             | 4.2     | 4.6   | 22,379  |     |
| 明海グループ                 | 9.3     | 7.4   | 5,120   |     |
| 飯野海運                   | 29      | 30.6  | 37,423  |     |
| 乾汽船                    | 10.6    | 11.6  | 14,082  |     |
| <b>空運業 (0.5%)</b>      |         |       |         |     |
| 日本航空                   | 185.8   | 201.9 | 567,540 |     |
| ANAホールディングス            | 207.3   | 224.6 | 685,479 |     |
| パスコ                    | 3.2     | —     | —       |     |
| <b>倉庫・運輸関連業 (0.1%)</b> |         |       |         |     |
| トランコム                  | 2.2     | 2.4   | 18,144  |     |
| 日新                     | 6.3     | 6.5   | 16,315  |     |
| 三菱倉庫                   | 16.2    | 20    | 88,620  |     |
| 三井倉庫ホールディングス           | 7.1     | 7.5   | 36,262  |     |
| 住友倉庫                   | 20.4    | 21.5  | 52,438  |     |
| 滋澤倉庫                   | 3.5     | 3.3   | 9,348   |     |
| 東陽倉庫                   | 27.4    | 3.7   | 5,616   |     |
| 日本トランスシティ              | 16      | 16.8  | 10,449  |     |

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 |
| 川西倉庫                 | 5.2     |    | 5.2   |    | 5,642   |     |
| 安田倉庫                 | —       |    | 6.5   |    | 7,312   |     |
| 東洋埠頭                 | 0.9     |    | —     |    | —       |     |
| 上組                   | 37.4    |    | 39    |    | 126,321 |     |
| キムラユニティー             | —       |    | 4.3   |    | 6,118   |     |
| キューソー流通システム          | 6.6     |    | 6.3   |    | 5,682   |     |
| エーアイティー              | 5.4     |    | 5.4   |    | 8,985   |     |
| 内外トランスライン            | 3.2     |    | 3.5   |    | 8,816   |     |
| 日本コンセプト              | 2.9     |    | 3.3   |    | 5,553   |     |
| <b>情報・通信業 (7.7%)</b> |         |    |       |    |         |     |
| NECネットエスアイ           | 25.3    |    | 27.3  |    | 58,940  |     |
| クロスキャット              | 4.8     |    | 5.2   |    | 5,860   |     |
| システナ                 | 126.9   |    | 138.2 |    | 40,907  |     |
| デジタルアーツ              | 4.9     |    | 5.2   |    | 25,038  |     |
| 日鉄ソリューションズ           | 12.7    |    | 14    |    | 65,030  |     |
| キューブシステム             | 5.7     |    | 5.6   |    | 6,227   |     |
| コア                   | 3.9     |    | 4.4   |    | 7,827   |     |
| 手間いらず                | 1.3     |    | 1.5   |    | 3,744   |     |
| ラクーンホールディングス         | 8.5     |    | 8.1   |    | 5,516   |     |
| ソリトンシステムズ            | 5.1     |    | 4.8   |    | 6,124   |     |
| ソフトクリエイトホールディングス     | 3.4     |    | 7.1   |    | 12,034  |     |
| T I S                | 85.4    |    | 90.4  |    | 282,680 |     |
| グリー                  | 41.9    |    | 23.3  |    | 13,234  |     |
| コーエーテックモホールディングス     | 47.8    |    | 51.8  |    | 93,783  |     |
| 三菱総合研究所              | 3.7     |    | 3.9   |    | 18,739  |     |
| ファインデックス             | 8       |    | 8.2   |    | 7,806   |     |
| ブレインパッド              | 8.2     |    | 6.6   |    | 6,758   |     |
| K L a b              | 17.2    |    | 18.4  |    | 5,115   |     |
| ホールトゥウィンホールディングス     | 13.7    |    | 15    |    | 8,025   |     |
| ネクソン                 | 197.1   |    | 184.5 |    | 590,031 |     |
| アイスタイル               | 25.3    |    | 26.4  |    | 11,563  |     |
| エムアップホールディングス        | 9.6     |    | 10.8  |    | 10,994  |     |
| エイチーム                | 7       |    | 6.7   |    | 4,582   |     |
| エニグモ                 | 11.2    |    | 12.7  |    | 4,864   |     |
| コロブラ                 | 30      |    | 31.5  |    | 19,183  |     |
| ブロードリーフ              | 46.4    |    | 42.9  |    | 24,281  |     |
| クロス・マーケティンググループ      | 4.2     |    | 5     |    | 2,835   |     |
| デジタルハーツホールディングス      | 5.2     |    | 5.7   |    | 5,700   |     |
| システム情報               | 7.4     |    | —     |    | —       |     |
| メディアドゥ               | 3.5     |    | 3.7   |    | 5,609   |     |
| じげん                  | 25.2    |    | 24.9  |    | 13,396  |     |
| ブイキューブ               | 10.2    |    | —     |    | —       |     |
| サイバーリンクス             | 3.1     |    | —     |    | —       |     |
| ディー・エル・イー            | 8.6     |    | —     |    | —       |     |
| フィックスターズ             | 9.6     |    | 9.8   |    | 13,288  |     |

| 銘柄                    | 期首(前期末) |    | 期    |    | 末       |     |
|-----------------------|---------|----|------|----|---------|-----|
|                       | 株数      | 株数 | 株数   | 株数 | 評価額     | 評価額 |
| CARTA HOLDINGS        | 4.2     |    | 4.4  |    | 5,772   |     |
| オプティム                 | 7.3     |    | 7.2  |    | 6,091   |     |
| セレス                   | —       |    | 3.8  |    | 3,477   |     |
| S H I F T             | 5.6     |    | 5.5  |    | 189,420 |     |
| ティーガイア                | 8.1     |    | 9    |    | 16,515  |     |
| テクマトリックス              | 14.3    |    | 15.2 |    | 26,372  |     |
| プロシップ                 | 3.9     |    | 4.3  |    | 5,680   |     |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント  | 23.8    |    | 22   |    | 50,424  |     |
| GMOペイメントゲートウェイ        | 17.4    |    | 16.5 |    | 143,665 |     |
| システムリサーチ              | 2.7     |    | 2.8  |    | 10,052  |     |
| インターネットイニシアティブ        | 42.4    |    | 41.6 |    | 110,531 |     |
| さくらインターネット            | 11.1    |    | 9.6  |    | 17,193  |     |
| ヴィンクス                 | 1       |    | —    |    | —       |     |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス  | 2.5     |    | 2.7  |    | 6,725   |     |
| S R Aホールディングス         | 4.1     |    | 4.4  |    | 15,818  |     |
| 朝日ネット                 | 9.4     |    | 9.6  |    | 6,019   |     |
| e B A S E             | 12.1    |    | 12.2 |    | 9,833   |     |
| アバントグループ              | 9.8     |    | 10.7 |    | 15,921  |     |
| アドソル日進                | 4       |    | 3.8  |    | 6,102   |     |
| フリービット                | 5.7     |    | 5.1  |    | 6,063   |     |
| コムチュア                 | 10.3    |    | 11   |    | 22,165  |     |
| アステリア                 | 7.5     |    | —    |    | —       |     |
| アイル                   | 4.4     |    | 4    |    | 14,280  |     |
| マークライNZ               | 4.5     |    | 4.7  |    | 12,995  |     |
| メディカル・データ・ビジョン        | 12.2    |    | 12.6 |    | 8,744   |     |
| g u m i               | 13.3    |    | 13.1 |    | 5,449   |     |
| テラスカイ                 | 3.6     |    | 3.9  |    | 6,107   |     |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 4.5     |    | 5.2  |    | 8,507   |     |
| ネオジャパン                | 0.9     |    | —    |    | —       |     |
| P R T I M E S         | 2.2     |    | 2.7  |    | 4,633   |     |
| ラクス                   | 36.2    |    | 39   |    | 103,935 |     |
| ダブルスタンダード             | 3.4     |    | 3.7  |    | 5,564   |     |
| オープンドア                | 5.7     |    | 6.3  |    | 4,554   |     |
| アカツキ                  | 4.2     |    | 4.4  |    | 10,172  |     |
| Ubicomホールディングス        | 2.8     |    | 3.1  |    | 5,297   |     |
| カナミックネットワーク           | 12.8    |    | 12.6 |    | 4,888   |     |
| チェンジホールディングス          | 18.8    |    | 19.6 |    | 30,576  |     |
| シンクロ・フード              | 6.4     |    | —    |    | —       |     |
| オークネット                | 4.3     |    | 4.5  |    | 8,284   |     |
| マクロミル                 | 18      |    | 17   |    | 13,464  |     |
| オロ                    | 2.9     |    | 3.7  |    | 9,227   |     |
| ユーザーローカル              | 3.2     |    | 3.2  |    | 5,510   |     |
| マネーフォワード              | 17.2    |    | 18.5 |    | 84,027  |     |
| S U N A S T E R I S K | —       |    | 6.2  |    | 6,181   |     |
| ブラサルファ・コンサルティング       | —       |    | 4.9  |    | 13,323  |     |

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 |
| 電算システムホールディングス         | 4       | 4.2   | 11,671  |     |
| APPIER GROUP           | —       | 28.4  | 46,576  |     |
| プロトコーポレーション            | 10      | 10.5  | 14,070  |     |
| 野村総合研究所                | 156.3   | 177.3 | 736,149 |     |
| サイバネットシステム             | 8.4     | —     | —       |     |
| 日本システム技術               | 3.9     | 2.8   | 7,582   |     |
| インテージホールディングス          | 10.6    | 9.5   | 15,580  |     |
| ソースネクスト                | 41.1    | —     | —       |     |
| インフォコム                 | 9.9     | 10.6  | 25,991  |     |
| シンプレクス・ホールディングス        | 12.9    | 13.5  | 35,370  |     |
| HEROZ                  | 3.3     | 3     | 4,137   |     |
| ラクスル                   | 11      | 20.1  | 28,743  |     |
| メルカリ                   | 33.6    | 50.1  | 141,757 |     |
| I P S                  | 2.7     | 3     | 6,048   |     |
| F I G                  | 11.9    | —     | —       |     |
| システムサポート               | 3.9     | 3.4   | 6,409   |     |
| イーソル                   | 3.1     | 7.5   | 4,560   |     |
| アルテリア・ネットワークス          | 8.3     | —     | —       |     |
| ウイングアーク1st             | 8.1     | 8.7   | 28,579  |     |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | —       | 2.6   | 3,543   |     |
| サーバーワークス               | 1.8     | 1.9   | 6,754   |     |
| Sansan                 | 29      | 27.3  | 42,205  |     |
| ギフトィ                   | 8.5     | 7.6   | 14,432  |     |
| メドレー                   | —       | 11.1  | 49,117  |     |
| ベース                    | 2.6     | 3.1   | 10,323  |     |
| JMDC                   | 12.6    | 13.7  | 59,101  |     |
| フォーカスシステムズ             | 7       | 6.8   | 6,738   |     |
| クレスコ                   | 6.3     | 7     | 13,370  |     |
| フジ・メディア・ホールディングス       | 73.6    | 79.5  | 121,158 |     |
| オービック                  | 25.4    | 27.6  | 626,382 |     |
| ジャストシステム               | 11.2    | 11.9  | 39,627  |     |
| TDCソフト                 | 6.7     | 7.2   | 15,112  |     |
| L I N Eヤフー             | 1,087.2 | 1,160 | 499,496 |     |
| トレンドマイクロ               | 44.1    | 39.1  | 293,797 |     |
| IDホールディングス             | —       | 6.1   | 9,339   |     |
| 日本オラルク                 | 14.8    | 15.9  | 181,816 |     |
| アルファシステムズ              | 2.4     | 3     | 8,382   |     |
| フューチャー                 | 18.9    | 18.5  | 33,374  |     |
| CAC Holdings           | 4.9     | 5.3   | 9,476   |     |
| S Bテクノロジー              | 3.6     | 3.7   | 9,227   |     |
| オービックビジネスコンサルタント       | 15      | 12.3  | 83,135  |     |
| 伊藤忠テクノソリューションズ         | 40.8    | —     | —       |     |
| アイティフォー                | 11.3    | 11.5  | 13,386  |     |
| 東計電算                   | 1.4     | 1.4   | 9,870   |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |        | 期末        |     |
|---------------------|---------|--------|-----------|-----|
|                     | 株数      | 株数     | 評価額       | 評価額 |
| 大塚商会                | 43.3    | 40.8   | 246,228   |     |
| サイボウズ               | 10.8    | 11.6   | 24,151    |     |
| 電通国際情報サービス          | 9.1     | 10     | 49,200    |     |
| A C C E S S         | 10.3    | 10.4   | 7,602     |     |
| デジタルガレージ            | 13.6    | 14.7   | 45,496    |     |
| イーエムシステムズ           | 13.5    | 14.5   | 10,309    |     |
| ウェザーニューズ            | 2.8     | 2.5    | 14,675    |     |
| C I J               | 7.8     | 14.7   | 9,084     |     |
| ビジネスエンジニアリング        | 2       | 1.5    | 6,630     |     |
| WOWOW               | 5.8     | 7      | 7,623     |     |
| スカラ                 | 10      | 8.7    | 6,655     |     |
| インテリジェント ウェイブ       | 5.3     | —      | —         |     |
| ANYCOLOR            | —       | 3      | 11,550    |     |
| I M A G I C A GROUP | 7       | 8      | 5,016     |     |
| ネットワンシステムズ          | 28.6    | 30.9   | 63,530    |     |
| アルゴグラフィックス          | 7       | 7.5    | 28,012    |     |
| マーベラス               | 13.6    | 14.2   | 9,897     |     |
| エイベックス              | 13.5    | 14.2   | 19,766    |     |
| B I P R O G Y       | 28.2    | 27     | 115,371   |     |
| 兼松エレクトロニクス          | 4.8     | —      | —         |     |
| 都築電気                | 4.6     | 4.5    | 9,418     |     |
| T B Sホールディングス       | 39.1    | 42.3   | 116,176   |     |
| 日本テレビホールディングス       | 67.6    | 72.9   | 105,048   |     |
| 朝日放送グループホールディングス    | 2.6     | 9.6    | 6,172     |     |
| テレビ朝日ホールディングス       | 18.8    | 19.9   | 33,332    |     |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 68.6    | 73.7   | 49,968    |     |
| テレビ東京ホールディングス       | 6       | 6      | 17,940    |     |
| 日本BS放送              | —       | 6.5    | 5,765     |     |
| ビジョン                | 10.5    | 12.6   | 14,641    |     |
| USEN-NEXT HOLDINGS  | 7       | 9.3    | 35,107    |     |
| コネクシオ               | 5.3     | —      | —         |     |
| 日本通信                | 75.2    | 78.5   | 17,819    |     |
| 日本電信電話              | 977.2   | 24,550 | 4,249,605 |     |
| K D D I             | 589.4   | 637    | 2,946,125 |     |
| ソフトバンク              | 1,225.3 | 1,326  | 2,384,811 |     |
| 光通信                 | 9       | 8.9    | 204,611   |     |
| エムティーアイ             | 9.1     | 8.2    | 4,936     |     |
| GMOインターネットグループ      | 28.5    | 30.6   | 72,720    |     |
| ファイバーゲート            | 5.3     | 5      | 4,805     |     |
| K A D O K A W A     | 40.5    | 43.6   | 116,150   |     |
| 学研ホールディングス          | 13.8    | 14.4   | 14,068    |     |
| ゼンリン                | 13.6    | 14.5   | 12,963    |     |
| アイネット               | 5.8     | 5.7    | 10,830    |     |
| 松竹                  | 4.5     | 4.7    | 44,076    |     |
| 東宝                  | 47.6    | 46     | 236,026   |     |

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|----------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                      | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 東映                   | 2.1     | 2.3   | 40,756    |     |
| NTTデータグループ           | 238.5   | 222.5 | 399,832   |     |
| ビー・シー・エー             | 5.3     | 5.2   | 6,099     |     |
| ビジネスブレイン太田昭和         | 4       | 3.9   | 8,338     |     |
| D T S                | 16.3    | 17.2  | 60,458    |     |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 38.4    | 39.2  | 201,174   |     |
| シーイーシー               | 11.1    | 11.7  | 21,001    |     |
| カプコン                 | 75.7    | 74.5  | 371,233   |     |
| アイ・エス・ビー             | 4.5     | 4.6   | 6,913     |     |
| ジャステック               | 5.6     | 5.5   | 8,046     |     |
| S C S K              | 61.9    | 58    | 157,992   |     |
| NSW                  | 3.3     | 3.3   | 9,685     |     |
| アイネス                 | 6       | 6.3   | 10,495    |     |
| T K C                | 13.2    | 12.7  | 44,958    |     |
| 富士ソフト                | 8.5     | 17.2  | 103,028   |     |
| NSD                  | 26.7    | 29    | 81,200    |     |
| コナミグループ              | 32.7    | 32.1  | 234,811   |     |
| 福井コンピュータホールディングス     | 5.4     | 6.5   | 17,179    |     |
| J B C Cホールディングス      | 5.9     | 6.2   | 19,685    |     |
| ミロク情報サービス            | 7.6     | 7.9   | 13,722    |     |
| ソフトバンクグループ           | 441.1   | 406   | 2,444,120 |     |
| <b>卸売業 (7.0%)</b>    |         |       |           |     |
| 高千穂交易                | 3.3     | 2.7   | 9,180     |     |
| 伊藤忠食品                | 1.8     | 2     | 14,320    |     |
| エレマテック               | 7.4     | 8     | 14,136    |     |
| あらた                  | 6.2     | 6.6   | 41,250    |     |
| トーメンデバイス             | 1.3     | 1.4   | 7,420     |     |
| 東京エレクトロン デバイス        | 3       | 9.6   | 46,800    |     |
| 円谷フィールズホールディングス      | 7.2     | 15.1  | 17,002    |     |
| 双日                   | 85.3    | 96.4  | 317,445   |     |
| アルフレッサ ホールディングス      | 81.1    | 87.6  | 208,269   |     |
| 横浜冷凍                 | 24.1    | 24.3  | 26,948    |     |
| ラサ商事                 | 5.8     | 5     | 7,545     |     |
| アルコニックス              | 11.4    | 12    | 15,840    |     |
| 神戸物産                 | 62.2    | 67.5  | 263,520   |     |
| あい ホールディングス          | 12.8    | 13.8  | 34,113    |     |
| ダイワボウホールディングス        | 32.9    | 36.8  | 107,069   |     |
| マクニカホールディングス         | 19.5    | 20.6  | 150,647   |     |
| ラクト・ジャパン             | 3.6     | 3.8   | 7,413     |     |
| グリムス                 | 3.5     | 3.8   | 8,002     |     |
| バイタルケ-エスケ-ホールディングス   | 13.4    | 13.4  | 14,351    |     |
| 八洲電機                 | 7.8     | 7.7   | 9,786     |     |
| メディアスホールディングス        | 6.8     | 7     | 5,404     |     |
| レスターホールディングス         | 7.6     | 8     | 21,464    |     |
| ジオリーブグループ            | 4.7     | 3     | 3,735     |     |

| 銘柄                | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|-------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                   | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 大光                | —       | 8.9   | 5,678     |     |
| T O K A Iホールディングス | 39.5    | 42.3  | 39,804    |     |
| 三洋貿易              | 8.9     | 10.1  | 13,261    |     |
| ビューティガレージ         | 1.8     | 3     | 7,560     |     |
| ウイン・パートナーズ        | 5.6     | 6.8   | 8,105     |     |
| シップヘルスケアホールディングス  | 29.1    | 31.5  | 65,756    |     |
| コメダホールディングス       | 20.3    | 21.6  | 59,767    |     |
| フルサト・マルカホールディングス  | 8       | 8.3   | 22,410    |     |
| ヤマエグループホールディングス   | 5       | 5     | 17,325    |     |
| 小野建               | 8.2     | 8.7   | 14,676    |     |
| 南陽                | —       | 2.5   | 5,145     |     |
| 佐島電機              | 6.1     | 4.6   | 9,034     |     |
| 伯東                | 4.7     | 5     | 27,350    |     |
| コンドーテック           | 7.3     | 7.6   | 8,884     |     |
| ナガイレーベン           | 10.5    | 11    | 24,992    |     |
| 三菱食品              | 8.3     | 8.3   | 40,338    |     |
| 松田産業              | 6.2     | 6.8   | 17,387    |     |
| 第一興商              | 15.7    | 33.8  | 75,543    |     |
| メディカルホールディングス     | 83.6    | 88.1  | 206,154   |     |
| S P K             | 4.8     | 4.4   | 8,047     |     |
| 萩原電気ホールディングス      | 3.7     | 4.5   | 22,230    |     |
| アズワン              | 11.8    | 12.4  | 62,892    |     |
| スズデン              | 3.8     | 3.8   | 8,675     |     |
| 尾家産業              | 4.7     | 2.5   | 4,725     |     |
| シモジマ              | 6.2     | 6.7   | 8,455     |     |
| ドウシシャ             | 8.5     | 9     | 18,990    |     |
| 高速                | 4.4     | 6     | 12,234    |     |
| たけびし              | —       | 3.7   | 6,985     |     |
| リックス              | 2       | 2     | 6,560     |     |
| 丸文                | 8.6     | 8.3   | 12,516    |     |
| ハビネット             | 7.2     | 7.9   | 20,358    |     |
| 日本ライフライン          | 24.3    | 25.7  | 29,914    |     |
| タカショー             | 9.1     | 9.6   | 5,280     |     |
| I D O M           | 25.1    | 26.8  | 24,709    |     |
| 進和                | 5.8     | 5.8   | 14,494    |     |
| ダイトロン             | 3.6     | 3.6   | 10,670    |     |
| シークス              | 11.7    | 12.3  | 18,671    |     |
| オーハシテクニカ          | 4.9     | 4.7   | 8,215     |     |
| 白銅                | 3.2     | 3.4   | 7,816     |     |
| 伊藤忠商事             | 495.4   | 584   | 3,350,992 |     |
| 丸紅                | 633     | 721.9 | 1,665,423 |     |
| 高島                | 1       | —     | —         |     |
| 長瀬産業              | 37.2    | 39.5  | 91,778    |     |
| 蝶理                | 4.4     | 6     | 16,710    |     |
| 豊田通商              | 70      | 76.3  | 624,897   |     |

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 |
| 三共生興              | 17.3    | 14.6  | 10,833    |     |
| 兼松                | 30.7    | 33.7  | 69,219    |     |
| 三井物産              | 588.6   | 654.4 | 3,528,524 |     |
| 日本紙バルブ商事          | 4.3     | 4.6   | 22,977    |     |
| カメイ               | 8.9     | 9.5   | 16,197    |     |
| OUGホールディングス       | —       | 1     | 2,390     |     |
| スターゼン             | 6.4     | 6.6   | 16,255    |     |
| 山善                | 21.4    | 22.4  | 26,880    |     |
| 椿本興業              | 1.5     | 2.5   | 15,100    |     |
| 住友商事              | 497.6   | 527.7 | 1,635,870 |     |
| 内田洋行              | 3.7     | 3.5   | 25,200    |     |
| 三菱商事              | 502.5   | 574   | 3,952,564 |     |
| 第一実業              | 3.1     | 9.3   | 17,818    |     |
| キャンノマーケティングジャパン   | 18.6    | 20.2  | 75,366    |     |
| 西華産業              | 4.1     | 4     | 10,708    |     |
| 佐藤商事              | 6.1     | 6.3   | 9,601     |     |
| 菱洋エレクトロ           | 7.4     | 7.5   | 27,825    |     |
| 東京産業              | 8.4     | 8.9   | 7,734     |     |
| ユアサ商事             | 7.1     | 7.5   | 33,225    |     |
| 神鋼商事              | 2.2     | 2.3   | 13,133    |     |
| 阪和興業              | 14.3    | 15.5  | 70,680    |     |
| 正栄食品工業            | 5.5     | 5.8   | 26,187    |     |
| カナデン              | 7.3     | 6.7   | 9,869     |     |
| RYODEN            | 6.7     | 7.1   | 18,502    |     |
| 岩谷産業              | 18.4    | 19.9  | 141,409   |     |
| ナイス               | 3.4     | 2.6   | 4,209     |     |
| 極東貿易              | 6       | 5.9   | 11,139    |     |
| アステナホールディングス      | 17.8    | 18.3  | 9,095     |     |
| 三愛オブリ             | 22.3    | 22.9  | 37,029    |     |
| 稲畑産業              | 16.3    | 16.9  | 53,488    |     |
| G S Iクレオス         | 5.6     | 5.4   | 11,080    |     |
| 明和産業              | 11.6    | 12.5  | 8,237     |     |
| ワキタ               | 15.5    | 16.1  | 23,908    |     |
| 東邦ホールディングス        | 20.8    | 22.8  | 73,644    |     |
| サンゲツ              | 20.5    | 22    | 63,096    |     |
| ミツウロコグループホールディングス | 11.8    | 11.9  | 15,612    |     |
| シナネンホールディングス      | 2.7     | 3     | 12,195    |     |
| 伊藤忠エネクス           | 19.3    | 21.1  | 32,240    |     |
| サンリオ              | 23      | 24.8  | 150,511   |     |
| サンワテクノス           | 4.8     | 4.6   | 10,271    |     |
| リョーサン             | 8.8     | 9.3   | 45,988    |     |
| 新光商事              | 12.1    | 12.3  | 14,858    |     |
| トーホー              | 4.2     | 4     | 12,380    |     |
| 三信電気              | 3.7     | 3.9   | 8,954     |     |
| 東陽テクニカ            | 9.5     | 9.2   | 12,769    |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |       | 期末      |     |
|---------------------|---------|-------|---------|-----|
|                     | 株数      | 株数    | 評価額     | 評価額 |
| モスフードサービス           | 12      | 12.6  | 42,021  |     |
| 加賀電子                | 6.6     | 7     | 46,410  |     |
| ソーダニッカ              | —       | 8     | 8,272   |     |
| 立花エレテック             | 6       | 6.4   | 18,592  |     |
| PAL TAC             | 12.7    | 13.8  | 65,619  |     |
| 三谷産業                | 19.1    | 18.6  | 6,212   |     |
| 太平洋興発               | 9.5     | 6.4   | 5,088   |     |
| 西本Wismettacホールディングス | 2.2     | 2.3   | 14,237  |     |
| コア商事ホールディングス        | 6.6     | —     | —       |     |
| KPPグループホールディングス     | 19.3    | 25    | 17,725  |     |
| ヤマタネ                | 5       | 4.5   | 10,116  |     |
| 日鉄物産                | 5.2     | —     | —       |     |
| 泉州電業                | 3.8     | 4.8   | 16,296  |     |
| トラスコ中山              | 16.8    | 18.2  | 43,261  |     |
| オートボックスセブン          | 29      | 30.1  | 46,519  |     |
| モリト                 | 7.8     | 7.3   | 9,453   |     |
| 加藤産業                | 9.5     | 10.6  | 49,608  |     |
| イエローハット             | 14.1    | 15    | 26,670  |     |
| JKホールディングス          | 6.8     | 7.2   | 6,962   |     |
| 日伝                  | 5       | 6.5   | 17,231  |     |
| 杉本商事                | 3.8     | 5     | 11,230  |     |
| 因幡電機産業              | 20.2    | 21.9  | 71,832  |     |
| 東テク                 | 2.8     | 3     | 14,235  |     |
| ミスミグループ本社           | 121.3   | 131.5 | 315,600 |     |
| タキヒヨー               | 6.6     | 2.9   | 2,952   |     |
| スズケン                | 25      | 32.5  | 163,897 |     |
| ジェコス                | 2       | 6.1   | 6,466   |     |
| <b>小売業（4.3%）</b>    |         |       |         |     |
| ローソン                | 20.2    | 19.1  | 139,831 |     |
| サンエー                | 6       | 6.6   | 30,360  |     |
| カワチ薬品               | 6.6     | 7     | 17,857  |     |
| エービーシー・マート          | 11.7    | 37.8  | 92,250  |     |
| ハードオフコーポレーション       | 4.2     | 3.8   | 5,814   |     |
| アスクル                | 19.7    | 18.2  | 39,293  |     |
| ゲオホールディングス          | 8.8     | 9     | 21,123  |     |
| アダストリア              | 10      | 10.6  | 40,280  |     |
| くら寿司                | 9.6     | 10.3  | 37,852  |     |
| キャンドゥ               | 4.5     | 4.2   | 10,999  |     |
| バルグループホールディングス      | 8.2     | 17    | 39,712  |     |
| エディオン               | 31.5    | 34.7  | 51,529  |     |
| サーラコーポレーション         | 17.9    | 18.9  | 13,437  |     |
| ハローズ                | 3.7     | 4     | 16,580  |     |
| フジオフードグループ本社        | 7.5     | 10.6  | 15,306  |     |
| あみやき亭               | —       | 2.4   | 8,784   |     |
| ひらまつ                | 26.4    | —     | —       |     |

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 | 評         | 価 額 |
| 大黒天物産                     | 3       |   | 2.7   |   | 16,632    |     |
| ハニーズホールディングス              | 7.8     |   | 7.2   |   | 12,038    |     |
| アルベン                      | 6.8     |   | 7.3   |   | 14,235    |     |
| クオールホールディングス              | 11.7    |   | 12.2  |   | 20,813    |     |
| ジンズホールディングス               | 5       |   | 5.3   |   | 24,883    |     |
| ビックカメラ                    | 53.5    |   | 46.2  |   | 56,410    |     |
| DCMホールディングス               | 49.3    |   | 50    |   | 63,950    |     |
| MonotaRO                  | 113.9   |   | 123.7 |   | 184,684   |     |
| DDグループ                    | —       |   | 1.5   |   | 1,999     |     |
| アークランドサービスホールディングス        | 6.9     |   | —     |   | —         |     |
| J. フロント リテイリング            | 100.6   |   | 104.2 |   | 141,138   |     |
| ドトール・日レスホールディングス          | 14.3    |   | 15.4  |   | 33,803    |     |
| マツキヨココカラ&カンパニー            | 48.8    |   | 158.7 |   | 405,240   |     |
| ブロンコビリー                   | 5       |   | 5.2   |   | 16,432    |     |
| ZOZO                      | 53.3    |   | 57.7  |   | 180,312   |     |
| トレジャー・ファクトリー              | 2.6     |   | 4.2   |   | 5,304     |     |
| 物語コーポレーション                | 4.5     |   | 14.6  |   | 56,648    |     |
| 三越伊勢丹ホールディングス             | 135.7   |   | 147   |   | 245,637   |     |
| Hamee                     | 4.3     |   | —     |   | —         |     |
| ウエルシアホールディングス             | 41.8    |   | 45.4  |   | 117,313   |     |
| クリエイトSDホールディングス           | 13      |   | 14.1  |   | 43,146    |     |
| チムニー                      | 7.5     |   | 3.5   |   | 4,854     |     |
| シュッピン                     | 6.5     |   | 7.2   |   | 8,913     |     |
| オイシックス・ラ・大地               | 11      |   | 11.8  |   | 16,437    |     |
| ネクステージ                    | 18.4    |   | 20    |   | 45,780    |     |
| ジョイフル本田                   | 25.6    |   | 25    |   | 44,800    |     |
| 鳥貴族ホールディングス               | 3.7     |   | 3.7   |   | 10,500    |     |
| ホットランド                    | 7.4     |   | 7.1   |   | 14,001    |     |
| すかいらーくホールディングス            | 110.6   |   | 119.2 |   | 259,915   |     |
| SFPホールディングス               | 5       |   | 4.6   |   | 10,271    |     |
| 綿半ホールディングス                | 6.8     |   | 7.1   |   | 9,727     |     |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 27.8    |   | 29.3  |   | 29,622    |     |
| ゴルフダイジェスト・オンライン           | 4.2     |   | —     |   | —         |     |
| BEE NOS                   | 4.7     |   | 3.8   |   | 5,681     |     |
| あさひ                       | 6.8     |   | 7.6   |   | 10,009    |     |
| 日本調剤                      | 6.1     |   | 6.4   |   | 8,243     |     |
| コスモス薬品                    | 9.1     |   | 8.7   |   | 136,155   |     |
| セブン&アイ・ホールディングス           | 277.3   |   | 300.4 |   | 1,650,698 |     |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス     | 61.1    |   | 59.7  |   | 62,386    |     |
| ツルハホールディングス               | 19.8    |   | 18.3  |   | 227,652   |     |
| サンマルクホールディングス             | 7.3     |   | 7.3   |   | 14,585    |     |
| フェリシモ                     | 5       |   | 4     |   | 3,652     |     |
| トリドールホールディングス             | 20.1    |   | 21.6  |   | 89,661    |     |
| TOKYO BASE                | —       |   | 10.4  |   | 2,818     |     |

| 銘柄                          | 期首(前期末) |   | 期     |   | 末       |     |
|-----------------------------|---------|---|-------|---|---------|-----|
|                             | 株       | 数 | 株     | 数 | 評       | 価 額 |
| JMホールディングス                  | 7.2     |   | 6.9   |   | 14,331  |     |
| アレンザホールディングス                | 6.6     |   | 7.3   |   | 7,402   |     |
| 串カツ田中ホールディングス               | 3.6     |   | 3.8   |   | 6,175   |     |
| パロックジャパンリミテッド               | 1.4     |   | —     |   | —       |     |
| クスリのアオキホールディングス             | 8.1     |   | 23.4  |   | 80,074  |     |
| カシの源ホールディングス                | 6.2     |   | 3.8   |   | 5,958   |     |
| FOOD & LIFE COMPANIES       | 46.4    |   | 46.6  |   | 133,415 |     |
| メディカルシステムネットワーク             | 5.3     |   | —     |   | —       |     |
| ノジマ                         | 26.2    |   | 28.3  |   | 39,506  |     |
| カッパ・クリエイト                   | 13.5    |   | 13.7  |   | 22,659  |     |
| ライトオン                       | 9.2     |   | —     |   | —       |     |
| 良品計画                        | 104.1   |   | 95.4  |   | 222,902 |     |
| アドヴァングループ                   | 11      |   | 10.5  |   | 10,909  |     |
| アルビス                        | 3.1     |   | 3.1   |   | 8,001   |     |
| G-7ホールディングス                 | 9.9     |   | 9.6   |   | 11,548  |     |
| イオン北海道                      | 13.2    |   | 15.2  |   | 13,558  |     |
| コジマ                         | 16.2    |   | 15.6  |   | 11,278  |     |
| コーナン商事                      | 10.9    |   | 11.8  |   | 43,660  |     |
| エコス                         | 3.7     |   | 3.7   |   | 8,239   |     |
| ワタミ                         | 11      |   | 10.3  |   | 10,712  |     |
| 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 | 180.4   |   | 176.2 |   | 564,544 |     |
| 西松屋チェーン                     | 18.1    |   | 17.5  |   | 37,747  |     |
| ゼンショーホールディングス               | 43.9    |   | 43.2  |   | 354,844 |     |
| 幸楽苑ホールディングス                 | 6.8     |   | —     |   | —       |     |
| サイゼリヤ                       | 13.7    |   | 13    |   | 74,620  |     |
| V Tホールディングス                 | 31.1    |   | 34.5  |   | 18,078  |     |
| フジ・コーポレーション                 | 5.1     |   | 3.8   |   | 6,080   |     |
| ユナイテッドアローズ                  | 9       |   | 9.4   |   | 18,414  |     |
| ハイデイ日高                      | 12.1    |   | 13.1  |   | 36,011  |     |
| コロナイド                       | 37.7    |   | 39.7  |   | 88,689  |     |
| 壱番屋                         | 6.3     |   | 6.8   |   | 36,244  |     |
| スギホールディングス                  | 16.3    |   | 17.6  |   | 112,886 |     |
| 薬王堂ホールディングス                 | 4.6     |   | 4.6   |   | 12,470  |     |
| スクロール                       | 12.8    |   | 13.2  |   | 12,210  |     |
| ヨンドシーホールディングス               | 7.6     |   | 7.7   |   | 15,053  |     |
| 木曾路                         | 12.9    |   | 12.8  |   | 31,884  |     |
| SRSホールディングス                 | 16      |   | 15.7  |   | 16,280  |     |
| 千趣会                         | 17.1    |   | —     |   | —       |     |
| リテールパートナーズ                  | 12      |   | 12.9  |   | 22,936  |     |
| ケーヨー                        | 13.9    |   | —     |   | —       |     |
| 上新電機                        | 7.1     |   | 7.6   |   | 17,578  |     |
| 日本瓦斯                        | 43.3    |   | 46.5  |   | 104,020 |     |
| ロイヤルホールディングス                | 15.8    |   | 16.5  |   | 44,154  |     |
| いなげや                        | 8.1     |   | 8.6   |   | 12,908  |     |

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

| 銘柄                | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|-------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                   | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| チヨダ               | 10.2    | 9.5   | 8,008     |     |
| ライフコーポレーション       | 7.1     | 7.7   | 26,218    |     |
| リンガーハット           | 11.3    | 11.1  | 25,663    |     |
| MrMaxHD           | 12.2    | 13.2  | 8,289     |     |
| AOKIホールディングス      | 15.9    | 16.9  | 19,992    |     |
| オークワ              | 13.5    | 14.7  | 12,201    |     |
| コメリ               | 12.3    | 13.4  | 42,277    |     |
| 青山商事              | 18.2    | 18.9  | 29,880    |     |
| しまむら              | 9.4     | 10.2  | 168,861   |     |
| 高島屋               | 61.3    | 64.1  | 127,719   |     |
| 松屋                | 14.4    | 15.3  | 13,142    |     |
| イチ・ツー・オー リテイリング   | 39.5    | 41.6  | 68,473    |     |
| 近鉄百貨店             | 4       | 4.8   | 12,686    |     |
| 丸井グループ            | 59.3    | 60.4  | 142,815   |     |
| アクシアル リテイリング      | 5.4     | 5.9   | 22,980    |     |
| イオン               | 272.8   | 295.7 | 905,137   |     |
| イズミ               | 12.4    | 13.2  | 46,648    |     |
| 平和堂               | 13.2    | 14.8  | 34,365    |     |
| フジ                | 12.5    | 13.2  | 24,750    |     |
| ヤオコー              | 9.1     | 9.8   | 79,056    |     |
| ゼビオホールディングス       | 11.3    | 12.2  | 11,516    |     |
| ケーズホールディングス       | 64.3    | 61.5  | 77,459    |     |
| Olympicグループ       | 8       | 5.2   | 2,657     |     |
| シルバーライフ           | 2.5     | 2.5   | 2,585     |     |
| Genky DrugStores  | 4.1     | 3.7   | 18,870    |     |
| ブックオフグループホールディングス | 5.2     | 5.3   | 5,750     |     |
| ギフトホールディングス       | 1.9     | 3.9   | 7,924     |     |
| アインホールディングス       | 11.2    | 12.1  | 54,450    |     |
| 元気寿司              | 3.3     | 6     | 19,140    |     |
| ヤマダホールディングス       | 331     | 289.7 | 124,136   |     |
| アークランズ            | 12.3    | 27.1  | 44,660    |     |
| ニトリホールディングス       | 32.6    | 31.7  | 540,802   |     |
| グルメ軒屋             | 8.7     | 8.3   | 8,798     |     |
| ケユーホールディングス       | 3.3     | 5.9   | 6,643     |     |
| 吉野家ホールディングス       | 32      | 34    | 111,180   |     |
| 松屋フーズホールディングス     | 3.8     | 4.1   | 20,500    |     |
| サガミホールディングス       | 14.2    | 13.8  | 19,044    |     |
| 関西フードマーケット        | 8.1     | 7.7   | 10,895    |     |
| 玉将フードサービス         | 5.1     | 5.8   | 46,458    |     |
| ミニストップ            | 7       | 6.7   | 10,130    |     |
| アークス              | 14.2    | 16.1  | 43,759    |     |
| パローホールディングス       | 15.1    | 16.9  | 40,069    |     |
| ベルク               | 3.9     | 4.3   | 27,391    |     |
| 大庄                | 7.8     | 5     | 6,305     |     |
| ファーストリテイリング       | 12.1    | 39.2  | 1,469,608 |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|---------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                     | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| サンドラッグ              | 30.6    | 30.5    | 136,487   |     |
| サックスパー ホールディングス     | 9.4     | 7.7     | 6,891     |     |
| やまや                 | 3.5     | 2       | 6,080     |     |
| ベルーナ                | 19.7    | 21.2    | 13,271    |     |
| <b>銀行業 (7.2%)</b>   |         |         |           |     |
| いよぎんホールディングス        | 88.1    | 97.1    | 92,808    |     |
| しずおかフィナンシャルグループ     | 168     | 180.8   | 216,236   |     |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ    | 62.3    | 68.3    | 72,329    |     |
| 楽天銀行                | —       | 27.7    | 70,856    |     |
| 京都フィナンシャルグループ       | —       | 25.7    | 227,419   |     |
| 島根銀行                | —       | 4       | 2,056     |     |
| じもとホールディングス         | —       | 7       | 3,899     |     |
| めぶきフィナンシャルグループ      | 372     | 403.7   | 179,646   |     |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 9.7     | 10.5    | 45,150    |     |
| 九州フィナンシャルグループ       | 126.7   | 142.3   | 118,507   |     |
| ゆうちょ銀行              | 212.4   | 875     | 1,277,062 |     |
| 富山第一銀行              | 21.1    | 25      | 19,675    |     |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 410.5   | 436.2   | 302,679   |     |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | 47.6    | 50.6    | 82,629    |     |
| 三十三フィナンシャルグループ      | 7.4     | 7.5     | 14,010    |     |
| 第四北越フィナンシャルグループ     | 11.1    | 12.6    | 49,644    |     |
| ひろぎんホールディングス        | 97.8    | 105.7   | 97,983    |     |
| おきなわフィナンシャルグループ     | 7.6     | 6.9     | 16,546    |     |
| 十六フィナンシャルグループ       | 10      | 10.5    | 40,215    |     |
| 北國フィナンシャルホールディングス   | 6.4     | 8.5     | 38,505    |     |
| ブロックレアホールディングス      | 9.7     | 10.1    | 19,159    |     |
| あいちフィナンシャルグループ      | 10.4    | 11.4    | 26,733    |     |
| SBI新生銀行             | 22.7    | —       | —         |     |
| あおぞら銀行              | 46.7    | 50.9    | 154,736   |     |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 4,906.5 | 5,084.9 | 6,381,549 |     |
| りそなホールディングス         | 953.5   | 970.6   | 745,906   |     |
| 三井住友トラスト・ホールディングス   | 138.1   | 145.8   | 810,502   |     |
| 三井住友フィナンシャルグループ     | 546.5   | 577     | 4,187,866 |     |
| 千葉銀行                | 207.6   | 226.4   | 250,511   |     |
| 群馬銀行                | 144.5   | 157.7   | 117,928   |     |
| 武蔵野銀行               | 9.9     | 10.2    | 29,131    |     |
| 千葉興業銀行              | 22      | 13      | 10,790    |     |
| 筑波銀行                | 41.1    | 32      | 8,544     |     |
| 七十七銀行               | 24.1    | 26      | 89,180    |     |
| 秋田銀行                | 5.9     | 4.8     | 9,489     |     |
| 山形銀行                | 10      | 9       | 9,531     |     |
| 岩手銀行                | 6       | 5.8     | 14,355    |     |
| 東邦銀行                | 67.9    | 60      | 17,460    |     |
| 東北銀行                | —       | 3       | 3,489     |     |
| ふくおかフィナンシャルグループ     | 59.6    | 64.8    | 222,458   |     |

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 |
| スルガ銀行                    | 67.7    | 72.6    | 54,522    |     |
| 八十二銀行                    | 150.8   | 170.8   | 136,827   |     |
| 山梨中央銀行                   | 9.4     | 7.9     | 14,172    |     |
| 大垣共立銀行                   | 14.5    | 15.4    | 29,213    |     |
| 福井銀行                     | 8.1     | 7.5     | 11,655    |     |
| 清水銀行                     | 1.5     | 3.6     | 5,515     |     |
| 富山銀行                     | 3.4     | 1.5     | 2,560     |     |
| 滋賀銀行                     | 12.4    | 13.6    | 50,932    |     |
| 南都銀行                     | 11.5    | 12.3    | 30,577    |     |
| 百五銀行                     | 72.4    | 76      | 41,116    |     |
| 京都銀行                     | 23.5    | —       | —         |     |
| 紀陽銀行                     | 26.4    | 28.9    | 45,979    |     |
| ほくほくフィナンシャルグループ          | 48.6    | 51.4    | 80,595    |     |
| 山陰合同銀行                   | 47      | 50.5    | 48,379    |     |
| 鳥取銀行                     | —       | 2.5     | 3,312     |     |
| 百十四銀行                    | 8.1     | 7.6     | 19,737    |     |
| 四国銀行                     | 14.4    | 13.3    | 13,313    |     |
| 阿波銀行                     | 11.1    | 11.5    | 28,692    |     |
| 大分銀行                     | 5.8     | 5.1     | 13,474    |     |
| 宮崎銀行                     | 5.8     | 5.2     | 13,759    |     |
| 佐賀銀行                     | 5.4     | 5.1     | 9,562     |     |
| 琉球銀行                     | 21      | 19.2    | 21,484    |     |
| セブン銀行                    | 268.2   | 292.9   | 87,957    |     |
| みずほフィナンシャルグループ           | 1,081.3 | 1,105.3 | 2,776,513 |     |
| 高知銀行                     | —       | 2.5     | 2,410     |     |
| 山口フィナンシャルグループ            | 83.2    | 79      | 102,581   |     |
| 長野銀行                     | 3.3     | —       | —         |     |
| 名古屋銀行                    | 5.1     | 5.3     | 29,468    |     |
| 北洋銀行                     | 117.9   | 123     | 44,895    |     |
| 大光銀行                     | —       | 2.5     | 3,270     |     |
| 愛媛銀行                     | 12      | 11.6    | 11,692    |     |
| トマト銀行                    | —       | 2.5     | 2,862     |     |
| 京葉銀行                     | 38.4    | 37.4    | 26,217    |     |
| 栃木銀行                     | 38.2    | 39.2    | 12,465    |     |
| 北日本銀行                    | —       | 2.6     | 5,501     |     |
| 東和銀行                     | 16.6    | 15.2    | 9,454     |     |
| 大東銀行                     | —       | 3       | 2,298     |     |
| トモニホールディングス              | 64.9    | 65.7    | 32,193    |     |
| フィデアホールディングス             | 9.5     | 8.5     | 12,478    |     |
| 池田泉州ホールディングス             | 106.3   | 100     | 34,200    |     |
| <b>証券・商品先物取引業 (0.8%)</b> |         |         |           |     |
| F P G                    | 31.2    | 27.6    | 44,932    |     |
| ジャパンインベストメントアドバイザー       | 6.7     | 6.8     | 10,737    |     |
| マーキュリアホールディングス           | —       | 5.7     | 4,599     |     |
| S B Iホールディングス            | 107.9   | 117.4   | 376,501   |     |

| 銘柄                            | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|-------------------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                               | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| ジャフコグループ                      | 25.4    | 27.5    | 46,832    |     |
| 大和証券グループ本社                    | 529.9   | 597.2   | 570,564   |     |
| 野村ホールディングス                    | 1,374.4 | 1,395.5 | 847,487   |     |
| 岡三証券グループ                      | 66.1    | 72.6    | 51,836    |     |
| 丸三証券                          | 29.9    | 28      | 23,772    |     |
| 東洋証券                          | 29.1    | 29.4    | 8,790     |     |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス          | 81.2    | 87      | 48,111    |     |
| 水戸証券                          | 23.7    | 23.8    | 10,376    |     |
| いちよし証券                        | 17      | 14.8    | 10,833    |     |
| 松井証券                          | 44.7    | 47.9    | 35,541    |     |
| マネックスグループ                     | 84.3    | 83.5    | 55,193    |     |
| 極東証券                          | 12.9    | 10.9    | 11,259    |     |
| 岩井コスモホールディングス                 | 10      | 9.4     | 16,544    |     |
| アイザワ証券グループ                    | 11.9    | 12.2    | 14,615    |     |
| スパークス・グループ                    | 8.7     | 9.2     | 13,698    |     |
| <b>保険業 (2.4%)</b>             |         |         |           |     |
| かんぽ生命保険                       | 91.2    | 90.2    | 249,403   |     |
| F P パートナー                     | —       | 1.3     | 6,500     |     |
| S O M P Oホールディングス             | 128.3   | 132.3   | 893,951   |     |
| アニコムホールディングス                  | 29      | 28.5    | 17,185    |     |
| M S & A Dインシュアランスグループホールディングス | 168.4   | 176.7   | 977,681   |     |
| 第一生命ホールディングス                  | 381.2   | 396.7   | 1,222,232 |     |
| 東京海上ホールディングス                  | 753.5   | 802.4   | 2,927,155 |     |
| T & Dホールディングス                 | 201.2   | 226.7   | 495,679   |     |
| アドバンスクリエイト                    | 7.4     | 6.3     | 6,312     |     |
| <b>その他金融業 (1.2%)</b>          |         |         |           |     |
| 全国保証                          | 19.7    | 21.4    | 106,935   |     |
| あんしん保証                        | —       | 1.7     | 425       |     |
| ジェイリース                        | 2.8     | 2.4     | 4,480     |     |
| 日本モーゲージサービス                   | 7.6     | 7.5     | 3,952     |     |
| アルヒ                           | 16.2    | 11      | 9,207     |     |
| プレミアアグループ                     | 12.9    | 13.9    | 24,589    |     |
| ネットプロテクションズホールディングス           | 26      | 17.2    | 4,179     |     |
| クレディセゾン                       | 47.8    | 51.4    | 128,011   |     |
| 芙蓉総合リース                       | 6.8     | 7.4     | 88,800    |     |
| みずほリース                        | 10.9    | 11.9    | 59,024    |     |
| 東京センチュリー                      | 13.8    | 15.1    | 88,969    |     |
| 日本証券金融                        | 31.4    | 30.1    | 46,925    |     |
| アイフル                          | 126.3   | 135.4   | 51,316    |     |
| リコーリース                        | 7.3     | 7.6     | 35,264    |     |
| イオンフィナンシャルサービス                | 42.6    | 46.5    | 58,915    |     |
| アコム                           | 140.9   | 148.5   | 51,752    |     |
| ジャックス                         | 8       | 8.6     | 46,182    |     |
| オリエントコーポレーション                 | 19.8    | 21.3    | 23,046    |     |

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

| 銘柄                 | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|--------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                    | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| オリックス              | 499.8   | 501.5 | 1,353,297 |     |
| 三菱HCキャピタル          | 287.4   | 334   | 322,109   |     |
| 九州リースサービス          | —       | 5.6   | 5,264     |     |
| 日本取引所グループ          | 210.6   | 214.8 | 648,481   |     |
| イー・ギャランティ          | 12.5    | 13.7  | 26,605    |     |
| アサックス              | —       | 5.4   | 3,769     |     |
| NECキャピタルソリューション    | 4       | 3.9   | 13,123    |     |
| <b>不動産業 (2.0%)</b> |         |       |           |     |
| Robot Home         | 0.8     | 25.8  | 4,644     |     |
| 大東建託               | 27.5    | 29.7  | 484,110   |     |
| いちご                | 89      | 100.7 | 35,345    |     |
| 日本駐車場開発            | 95.8    | 94.3  | 19,237    |     |
| スター・マイカ・ホールディングス   | 9       | 11    | 6,677     |     |
| SREホールディングス        | 3.9     | 4.2   | 11,650    |     |
| ヒューリック             | 175     | 188.5 | 276,718   |     |
| 三栄建築設計             | 4.7     | —     | —         |     |
| 野村不動産ホールディングス      | 46.8    | 50.5  | 182,002   |     |
| 三重交通グループホールディングス   | 18.9    | 19.1  | 10,925    |     |
| サムティ               | 10.1    | 10.1  | 23,654    |     |
| ディア・ライフ            | 13.5    | 15    | 13,140    |     |
| 地主                 | 7.3     | 7.1   | 16,372    |     |
| プレサンスコーポレーション      | 11.4    | 13.9  | 20,905    |     |
| JPMC               | 5.8     | 5.6   | 6,288     |     |
| フージャースホールディングス     | 13.7    | 13.4  | 14,177    |     |
| オープンハウスグループ        | 27.4    | 29.7  | 122,601   |     |
| 東急不動産ホールディングス      | 225.5   | 243.3 | 222,376   |     |
| 飯田グループホールディングス     | 65.6    | 77    | 170,170   |     |
| And Doホールディングス     | 5.8     | —     | —         |     |
| シーアールイー            | 4.2     | 5.3   | 8,352     |     |
| ケイアイスター不動産         | 4.4     | 4.2   | 14,658    |     |
| グッドコムアセット          | 8.4     | 8.9   | 8,980     |     |
| ジェイ・エス・ビー          | 2.1     | 4.4   | 11,268    |     |
| ロードスターキャピタル        | 3.7     | 5.9   | 12,980    |     |
| パーク24              | 58.8    | 53.5  | 96,433    |     |
| バラカ                | 4.4     | 3.9   | 7,542     |     |
| 宮越ホールディングス         | 0.8     | 4.6   | 5,731     |     |
| 三井不動産              | 325.8   | 368   | 1,277,696 |     |
| 三菱地所               | 475.7   | 517.9 | 1,033,987 |     |
| 平和不動産              | 13      | 13.9  | 56,086    |     |
| 東京建物               | 71.6    | 72.7  | 152,779   |     |
| 京阪神ビルディング          | 11      | 15.7  | 22,262    |     |
| 住友不動産              | 135.8   | 123.7 | 516,323   |     |
| テーオーシー             | 16.8    | 17.7  | 10,620    |     |
| 東京楽天地              | 1.9     | 1.8   | 7,740     |     |
| レオパレス21            | —       | 92.5  | 43,660    |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |       | 期末      |     |
|---------------------|---------|-------|---------|-----|
|                     | 株数      | 株数    | 評価額     | 評価額 |
| スタートコーポレーション        | 11.4    | 12.6  | 35,141  |     |
| フジ住宅                | 13.7    | 12.7  | 9,080   |     |
| 空港施設                | 12.6    | 12    | 6,780   |     |
| 明和地所                | 9.3     | —     | —       |     |
| ゴールドクレスト            | 8.1     | 8.2   | 16,457  |     |
| エスリード               | 4.5     | 4.2   | 13,356  |     |
| 日神グループホールディングス      | 17.1    | 15.2  | 7,524   |     |
| 日本エスコン              | 19.5    | 19.6  | 17,934  |     |
| MIRARTHホールディングス     | 43      | 47.2  | 21,995  |     |
| イオンモール              | 39.5    | 41.9  | 72,047  |     |
| 毎日コムネット             | —       | 6.3   | 4,680   |     |
| カチタス                | 20.6    | 22.4  | 48,160  |     |
| トーセイ                | 13.5    | 14.6  | 26,294  |     |
| 穴吹興産                | —       | 2.9   | 5,863   |     |
| サンフロンティア不動産         | 13.5    | 15.5  | 24,180  |     |
| FJネクストホールディングス      | 9.2     | 9.6   | 11,001  |     |
| グランディアハウス           | 4.1     | —     | —       |     |
| 日本空港ビルデング           | 26.7    | 28.8  | 187,200 |     |
| <b>サービス業 (4.8%)</b> |         |       |         |     |
| 日本工営                | 5.8     | —     | —       |     |
| LIFULL              | 34.3    | 32.4  | 6,350   |     |
| MIXI                | 18      | 19.1  | 46,164  |     |
| ジェイエイシーリクルートメント     | 7.1     | 7.5   | 19,957  |     |
| 日本M&Aセンターホールディングス   | 134.6   | 136.3 | 93,392  |     |
| メンバーズ               | 2.6     | 3.1   | 3,410   |     |
| UTグループ              | 11.6    | 12.3  | 27,244  |     |
| アイティメディア            | 3.3     | 3.5   | 3,402   |     |
| E・Jホールディングス         | 5.7     | 5.4   | 8,667   |     |
| オープンアップグループ         | 28.6    | 25.2  | 54,406  |     |
| コシダカホールディングス        | 23.8    | 25.6  | 26,700  |     |
| アルトナー               | —       | 2     | 3,614   |     |
| パソナグループ             | 9.5     | 10.2  | 23,919  |     |
| リンクアンドモチベーション       | 23.2    | 26.1  | 15,294  |     |
| エス・エム・エス            | 30      | 30.7  | 86,267  |     |
| パーソルホールディングス        | 87.8    | 884.4 | 225,345 |     |
| リニカル                | 6.4     | 6.3   | 3,339   |     |
| クックパッド              | 36      | —     | —       |     |
| 学情                  | 4.1     | 4.5   | 9,094   |     |
| スタジオアリス             | 4.7     | 4.8   | 9,907   |     |
| シミックホールディングス        | 5.1     | —     | —       |     |
| NJS                 | —       | 1.5   | 4,240   |     |
| 総合警備保障              | 29.3    | 150.3 | 128,777 |     |
| カカコム                | 58.7    | 57.6  | 96,624  |     |
| アイロムグループ            | 3.1     | 3.5   | 7,108   |     |
| セントケア・ホールディング       | 5.8     | 5.6   | 5,241   |     |

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 |
| ルネサンス              | 7.1     | 6.6   | 5,709     |     |
| ディップ               | 13.8    | 13.5  | 42,795    |     |
| デジタルホールディングス       | 6.8     | 5.5   | 6,957     |     |
| 新日本科学              | 8.5     | 7.7   | 12,681    |     |
| キャリアデザインセンター       | —       | 1.4   | 2,821     |     |
| ベネフィット・ワン          | 36.6    | 31    | 46,965    |     |
| エムスリー              | 154.6   | 169   | 413,289   |     |
| アウトソーシング           | 47.2    | 54.4  | 65,280    |     |
| ウェルネット             | 9.6     | 5.5   | 3,107     |     |
| ワールドホールディングス       | 4       | 3.9   | 10,572    |     |
| ディー・エヌ・エー          | 33.8    | 33.8  | 50,835    |     |
| 博報堂DYホールディングス      | 100.5   | 107.8 | 120,250   |     |
| ぐるなび               | 15      | —     | —         |     |
| タカミヤ               | 14      | 14    | 6,384     |     |
| ジャパンベストレスキューシステム   | 5.9     | —     | —         |     |
| ファンコミュニケーションズ      | 18.4    | 15    | 6,255     |     |
| ライク                | 3.4     | 3.8   | 5,183     |     |
| エスプール              | 22.8    | 25.6  | 10,163    |     |
| WDBホールディングス        | 4.2     | 4.5   | 10,408    |     |
| アドウェイズ             | 11.5    | 12.2  | 6,722     |     |
| バリューコマース           | 6.3     | 7.9   | 10,949    |     |
| インフォマート            | 82.9    | 88.1  | 38,852    |     |
| J Pホールディングス        | 27.4    | 27.1  | 10,596    |     |
| プレステジ・インターナショナル    | 33.8    | 42    | 27,342    |     |
| アミューズ              | 4.9     | 5     | 7,545     |     |
| ドリームインキュベータ        | 2.8     | 2.8   | 9,044     |     |
| クイック               | 6.5     | 5.8   | 13,090    |     |
| 電通グループ             | 82.2    | 83.2  | 331,552   |     |
| びあ                 | 2.9     | 3.1   | 10,276    |     |
| イオンファンタジー          | 3.7     | 3.5   | 9,107     |     |
| シーティーエス            | 10.2    | 10.6  | 7,070     |     |
| H. U. グループホールディングス | 23.4    | 24.8  | 63,711    |     |
| アルプス技研             | 7.1     | 7.8   | 21,262    |     |
| 日本空調サービス           | 10.3    | 10.2  | 8,170     |     |
| オリエンタルランド          | 82.8    | 449   | 2,256,225 |     |
| ダスキン               | 17.7    | 21    | 68,418    |     |
| 明光ネットワークジャパン       | 14.3    | 13.8  | 9,894     |     |
| ファルコホールディングス       | 4.5     | 4.3   | 9,103     |     |
| ラウンドワン             | 66.3    | 78    | 46,020    |     |
| リゾートトラスト           | 31.3    | 39    | 87,769    |     |
| ビー・エム・エル           | 9.7     | 10.2  | 29,916    |     |
| りらいあコミュニケーションズ     | 13      | —     | —         |     |
| リゾー教育              | 39.9    | 41.9  | 10,097    |     |
| 早稲田アカデミー           | 5.6     | 5.5   | 8,712     |     |
| ユー・エス・エス           | 80.7    | 97    | 280,621   |     |

| 銘柄                     | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|------------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                        | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 東京個別指導学院               | 12.1    | 12.4  | 5,952     |     |
| サイバーエージェント             | 187.7   | 187.5 | 167,737   |     |
| 楽天グループ                 | 345.7   | 725.6 | 424,983   |     |
| クリーク・アンド・リバー社          | 4.9     | 5.1   | 10,674    |     |
| SBIグローバルアセットマネジメント     | 15.2    | 15.8  | 8,800     |     |
| テー・オー・ダブリュー            | 22      | 19.3  | 6,253     |     |
| 山田コンサルティンググループ         | 4.9     | 3.1   | 5,735     |     |
| セントラルスポーツ              | 3.6     | 3.7   | 9,079     |     |
| フルキャストホールディングス         | 7.5     | 8     | 15,336    |     |
| エン・ジャパン                | 14.3    | 15.2  | 39,337    |     |
| テクノプロ・ホールディングス         | 52.7    | 50.1  | 172,043   |     |
| アイ・アールジャパンホールディングス     | 4.4     | 4.7   | 7,355     |     |
| KeePer 技研              | 5.7     | 5     | 29,400    |     |
| Gunosy                 | 6.2     | 8.1   | 5,637     |     |
| イー・ガーディアン              | 3.3     | 3.7   | 5,694     |     |
| ジャパンマテリアル              | 24      | 26    | 67,522    |     |
| ベクトル                   | 13      | 11.7  | 12,788    |     |
| チャーム・ケア・コーポレーション       | 7.3     | 7.4   | 8,872     |     |
| キャリアリンク                | 3.3     | 3.2   | 7,001     |     |
| IBJ                    | 5.6     | 7.1   | 5,246     |     |
| アサンテ                   | 5.2     | 5.2   | 8,403     |     |
| バリューHR                 | 7.5     | 8     | 11,984    |     |
| M&Aキャピタルパートナーズ         | 7.4     | 6.9   | 15,642    |     |
| ライドオンエクスプレスホールディングス    | 4.2     | 4.2   | 4,271     |     |
| ERIホールディングス            | 3.8     | 1.9   | 3,273     |     |
| アビスト                   | —       | 0.5   | 1,520     |     |
| シグマクス・ホールディングス         | 12.3    | 11.3  | 14,983    |     |
| ウィルグループ                | 7       | 7     | 7,833     |     |
| メドピア                   | 6.5     | 7.7   | 5,913     |     |
| リクルートホールディングス          | 578.7   | 628   | 3,457,140 |     |
| エラン                    | 10.5    | 11.5  | 11,718    |     |
| 日本郵政                   | 1,025.7 | 999.8 | 1,304,239 |     |
| ベルシステム24ホールディングス       | 10.9    | 11.6  | 19,302    |     |
| 鎌倉新書                   | 9.7     | 7.4   | 4,314     |     |
| エアトリ                   | 5.4     | 6.5   | 10,211    |     |
| アトラエ                   | 6.6     | 5.9   | 4,230     |     |
| ストライク                  | 3.9     | 3.8   | 14,744    |     |
| ソラスト                   | 22.1    | 23.7  | 13,911    |     |
| セラク                    | 3.3     | 2.9   | 3,883     |     |
| インソース                  | 9.8     | 18.5  | 17,667    |     |
| ベイカレント・コンサルティング        | 58      | 62.2  | 309,507   |     |
| Orchestra Holdings     | 2       | —     | —         |     |
| アイモバイル                 | 5       | 14.1  | 6,471     |     |
| ジャパンエレベーターサービズホールディングス | 27.7    | 27.3  | 64,155    |     |

## 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 |
| グリーンズ              | —       | —  | 2.4  | —  | 4,658  | —   |
| ウェルビー              | 6.9     | —  | 5.4  | —  | 4,023  | —   |
| エル・ティール・エス         | 1.3     | —  | 1.3  | —  | 5,050  | —   |
| ミダックホールディングス       | 4.8     | —  | 5.3  | —  | 9,285  | —   |
| キュービーネットホールディングス   | 5.2     | —  | 4.7  | —  | 7,148  | —   |
| RPAホールディングス        | 13.6    | —  | 13.4 | —  | 4,046  | —   |
| マネジメントソリューションズ     | 4.6     | —  | 3.8  | —  | 11,092 | —   |
| フロンティア・マネジメント      | 3.4     | —  | 2.3  | —  | 3,599  | —   |
| アンビスホールディングス       | —       | —  | 8.6  | —  | 24,725 | —   |
| カーブスホールディングス       | 24.4    | —  | 23.2 | —  | 15,474 | —   |
| フォーラムエンジニアリング      | 0.7     | —  | 10.2 | —  | 8,109  | —   |
| FAST FITNESS JAPAN | 3.2     | —  | 3.4  | —  | 3,791  | —   |
| ダイレクトマーケティングミックス   | 9.3     | —  | 10.9 | —  | 5,024  | —   |
| LITALICO           | 6.2     | —  | 6.7  | —  | 14,344 | —   |
| リログループ             | 44      | —  | 45.7 | —  | 70,972 | —   |
| 東祥                 | 7       | —  | 6.9  | —  | 5,630  | —   |
| ID&Eホールディングス       | —       | —  | 5.1  | —  | 16,702 | —   |
| ビーウィズ              | 3.3     | —  | 2.4  | —  | 5,450  | —   |
| TREホールディングス        | 16.7    | —  | 17.9 | —  | 20,083 | —   |
| 人・夢・技術グループ         | 3.8     | —  | 3.6  | —  | 6,674  | —   |
| NISSOホールディングス      | —       | —  | 6.8  | —  | 5,344  | —   |
| 大栄環境               | —       | —  | 15.5 | —  | 35,975 | —   |
| 日本管財ホールディングス       | —       | —  | 8.4  | —  | 20,899 | —   |
| M&A総研ホールディングス      | —       | —  | 4    | —  | 15,200 | —   |
| エイチ・アイ・エス          | 20.8    | —  | 24.7 | —  | 42,533 | —   |
| ラックランド             | 3.3     | —  | 4.1  | —  | 11,213 | —   |
| 共立メンテナンス           | 13.4    | —  | 14.3 | —  | 82,067 | —   |
| イチネンホールディングス       | 8.9     | —  | 9.1  | —  | 14,041 | —   |
| 建設技術研究所            | 4.2     | —  | 4.4  | —  | 21,362 | —   |
| スペース               | 7.2     | —  | 7.1  | —  | 6,439  | —   |
| 燦ホールディングス          | 4.1     | —  | 7.6  | —  | 8,390  | —   |
| スバル興業              | —       | —  | 0.5  | —  | 6,615  | —   |
| 東京テアトル             | 9       | —  | 5    | —  | 5,460  | —   |
| タナベコンサルティンググループ    | —       | —  | 1.5  | —  | 1,560  | —   |
| ナガワ                | 2       | —  | 2.9  | —  | 19,401 | —   |

| 銘柄                | 期首(前期末) |          | 期       |           | 末       |             |
|-------------------|---------|----------|---------|-----------|---------|-------------|
|                   | 株数      | 株数       | 株数      | 株数        | 評価額     | 評価額         |
| 東京都競馬             | 6.8     | —        | 7.2     | —         | 31,752  | —           |
| カナモト              | 14.6    | —        | 14.4    | —         | 37,152  | —           |
| ニシオホールディングス       | 7.3     | —        | 7.6     | —         | 27,664  | —           |
| トランス・コスモス         | 9.7     | —        | 10.4    | —         | 32,240  | —           |
| 乃村工藝社             | 34.3    | —        | 36.6    | —         | 30,744  | —           |
| 藤田観光              | 4.1     | —        | 3.8     | —         | 15,086  | —           |
| KNT-CTホールディングス    | 5.7     | —        | 2       | —         | 2,490   | —           |
| 日本管財              | 7.9     | —        | —       | —         | —       | —           |
| トーカイ              | 7.2     | —        | 7.5     | —         | 14,362  | —           |
| セコム               | 79.6    | —        | 86.2    | —         | 887,429 | —           |
| セントラル警備保障         | 4.6     | —        | 4.7     | —         | 11,533  | —           |
| 丹青社               | 16.1    | —        | 17      | —         | 15,130  | —           |
| メイテックグループホールディングス | 31.6    | —        | 32.5    | —         | 93,193  | —           |
| 応用地質              | 7.7     | —        | 7.8     | —         | 16,309  | —           |
| 船井総研ホールディングス      | 16.5    | —        | 17.6    | —         | 44,369  | —           |
| いであ               | —       | —        | 2.5     | —         | 4,390   | —           |
| 学究社               | 4.9     | —        | 4.2     | —         | 8,122   | —           |
| ベネッセホールディングス      | 29.9    | —        | —       | —         | —       | —           |
| イオンディライト          | 8.6     | —        | 9.2     | —         | 32,338  | —           |
| ダイセキ              | 16      | —        | 17.3    | —         | 67,816  | —           |
| ステップ              | 3.6     | —        | 3.2     | —         | 6,000   | —           |
| 合計                | 株数・金額   | 88,126.6 | 千株      | 123,739.3 | 千円      | 277,901,462 |
|                   | 銘柄数<比率> | 1,724銘柄  | 1,733銘柄 |           |         | <98.3%>     |

※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 | 買建額 | 売建額 |
| 国内    | 百万円   | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| TOPIX | 4,633 | —   | —   | —   |

## ■ 投資信託財産の構成

(2023年11月30日現在)

| 項目           | 期           |       | 末           |       |
|--------------|-------------|-------|-------------|-------|
|              | 評価額         | 比率    | 評価額         | 比率    |
| 株式           | 千円          | %     | 千円          | %     |
| 株            | 277,901,462 | 97.8  | 277,901,462 | 97.8  |
| コール・ローン等、その他 | 6,396,437   | 2.2   | 6,396,437   | 2.2   |
| 投資信託財産総額     | 284,297,900 | 100.0 | 284,297,900 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2023年11月30日現在）

| 項 目                        | 期 末                 |
|----------------------------|---------------------|
| (A) 資 産                    | 284, 187, 277, 609円 |
| コール・ローン等                   | 3, 532, 670, 222    |
| 株 式(評価額)                   | 277, 901, 462, 330  |
| 未 収 入 金                    | 596, 010, 400       |
| 未 収 配 当 金                  | 2, 036, 482, 133    |
| 差 入 委 託 証 拠 金              | 120, 652, 524       |
| (B) 負 債                    | 1, 548, 319, 526    |
| 未 払 金                      | 395, 461, 400       |
| 未 払 解 約 金                  | 1, 152, 851, 240    |
| そ の 他 未 払 費 用              | 6, 886              |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B)       | 282, 638, 958, 083  |
| 元 本                        | 67, 612, 101, 406   |
| 次 期 繰 越 損 益 金              | 215, 026, 856, 677  |
| (D) 受 益 権 総 口 数            | 67, 612, 101, 406口  |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 41, 803円            |

※当期における期首元本額65,393,298,021円、期中追加設定元本額11,963,349,687円、期中一部解約元本額9,744,546,302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2022年12月1日 至2023年11月30日）

| 項 目                          | 当 期                 |
|------------------------------|---------------------|
| (A) 配 当 等 収 益                | 6, 233, 393, 018円   |
| 受 取 配 当 金                    | 6, 231, 921, 169    |
| 受 取 利 息                      | 43, 402             |
| そ の 他 収 益 金                  | 3, 192, 750         |
| 支 払 利 息                      | △ 1, 764, 303       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益          | 44, 665, 331, 709   |
| 売 買 益                        | 51, 596, 604, 918   |
| 売 買 損                        | △ 6, 931, 273, 209  |
| (C) 先 物 取 引 等 損 益            | 1, 029, 023, 200    |
| 取 引 益                        | 1, 399, 913, 500    |
| 取 引 損                        | △ 370, 890, 300     |
| (D) そ の 他 費 用 等              | △ 136, 879          |
| (E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D) | 51, 927, 611, 048   |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金            | 157, 426, 042, 586  |
| (G) 解 約 差 損 益 金              | △ 26, 859, 790, 389 |
| (H) 追 加 信 託 差 損 益 金          | 32, 532, 993, 432   |
| (I) 合 計(E + F + G + H)       | 215, 026, 856, 677  |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I)             | 215, 026, 856, 677  |

※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           | 9,698,799,980円  | 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）                        | 20,073,130円    |
| 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）          | 1,001,422,929円  | 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）                      | 8,796,845円     |
| 三井住友・DC年金バランス50（標準型）            | 4,466,421,362円  | SMAM・国内株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）                       | 2,397,731,905円 |
| 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）          | 3,671,641,660円  | バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞                        | 7,994,782円     |
| SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）    | 136,038,750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＞                     | 47,143,831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） | 3,406,393円      | SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞                        | 965,486,618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） | 15,296,763円     | SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞                      | 1,166,398,533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） | 54,752,270円     | SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞                        | 4,510,477,578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） | 159,640,709円    | SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞                        | 29,416,152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） | 149,414,525円    | SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞                        | 108,603,049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） | 271,748,343円    | SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞                        | 590,105,352円   |
| 国内株式指数ファンド（TOPIX）               | 1,365,075,520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＞                     | 35,412,893円    |
| 三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド   | 26,260,180,571円 | SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞                     | 195,641,630円   |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型）           | 115,624,640円    | SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞                     | 641,083,284円   |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）         | 168,156,238円    | SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞                        | 414,428,470円   |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型）           | 103,225,362円    | SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞                        | 1,267,607,584円 |
| イオン・バランス戦略ファンド                  | 37,149,436円     | SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞                          | 314,855円       |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050       | 50,643,471円     | SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞                       | 27,021,199円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）          | 208,010,508円    | SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞                   | 29,338,861円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）          | 197,543,121円    | SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞                   | 25,915,474円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）          | 777,703,738円    | SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞                   | 14,447,235円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）          | 448,368,315円    | SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞                   | 67,115,115円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）          | 525,557,954円    | SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞                   | 173,003,538円   |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド        | 55,602,276円     | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞                  | 37,568,256円    |
| 三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド         | 1,154,657,014円  | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞                  | 32,445,682円    |
| 三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）          | 39,519,295円     | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞                  | 6,832,341円     |
| 三井住友DS・年金バランス50（標準型）            | 236,791,813円    | SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞                  | 30,702,488円    |
| 三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）          | 240,914,837円    | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞                  | 411,103,933円   |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060       | 5,981,135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）                   | 156,608,259円   |
| 日興FWS・日本株インデックス                 | 1,902,897,918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＞                | 157,255,373円   |
| 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド         | 68,065,303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＞              | 65,272,266円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035       | 691,428円        | SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞                        | 50,839,821円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040       | 482,039円        | SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞                       | 29,597,543円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045       | 427,244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＞                    | 50,954,848円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055       | 135,914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＞            | 28,238,310円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065       | 230,889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＞                  | 45,469,182円    |
| 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）    | 554,713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＞ | 85,247,790円    |
| 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）    | 7,852,953円      | SMDAM・日米3資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞                      | 15,940,785円    |
| 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）  | 34,809,759円     | 三井住友・ニュー・アジア・ファンド（リスク3%）＜適格機関投資家限定＞                 | 29,029,528円    |

### ■ お知らせ

＜約款変更について＞

該当事項はございません。

# SMAM・年金国内債券パッシブファンド 〈適格機関投資家限定〉

(2022年6月21日から2023年6月20日まで)

第 19 期

決算日 2023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。<br>国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド<br>日本の公社債および短期金融資産  |
| 当ファンドの運用方法 | ■マザーファンドおよび日本の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI（総合）に連動する投資成果を目指します。<br>■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<br>■株式への投資は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限るものとし、かつ、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>■外貨建資産への投資は行いません。<br>国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド<br>■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。<br>■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。<br>■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 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 (2022 年 6 月 21 日 から 2023 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)<br>投信会社：ファンド運用の指図等の対価<br>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<br>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)    | (3) | (0.027) |   |
| (b) 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<br>監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用<br>そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用  |
| (監査費用)    | (0) | (0.002) |   |
| (その他)     | (0) | (0.000) |   |
| 合 計       | 7   | 0.057   |   |

期中の平均基準価額は12,580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 (2022 年 6 月 21 日 から 2023 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<br>4,311,968 | 千円<br>5,862,430 | 千口<br>5,935,194 | 千円<br>8,057,518 |

### ■ 組 入 れ 資 産 の 明 細 (2023 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<br>29,248,932 | 千口<br>27,625,707 | 千円<br>38,026,785 |

※国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンドの期末の受益権総口数は92,132,941,515口です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年6月20日現在)

| 項 目              | 期 末             |
|------------------|-----------------|
| (A) 資 産          | 38,026,796,123円 |
| コール・ローン等         | 10,346          |
| 国内債券(NOMURA-BPI) | 38,026,785,777  |
| マザーファンド(評価額)     |                 |
| (B) 負 債          | 11,134,586      |
| 未払信託報酬           | 10,639,586      |
| その他未払費用          | 495,000         |
| (C) 純資産総額(A-B)   | 38,015,661,537  |
| 元 本              | 29,904,280,390  |
| 次期繰越損益金          | 8,111,381,147   |
| (D) 受益権総口数       | 29,904,280,390口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)  | 12,712円         |

※当期における期首元本額31,644,206,150円、期中追加設定元本額5,012,121,816円、期中一部解約元本額6,752,047,576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2022年6月21日 至2023年6月20日)

| 項 目                 | 当 期              |
|---------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益       | △ 1,664円         |
| 受 取 利 息             | 251              |
| 支 払 利 息             | △ 1,915          |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 217,186,924      |
| 売 買 損 益             | 278,576,589      |
| 売 買 損 益             | △ 61,389,665     |
| (C) 信 託 報 酬 等       | △ 23,060,534     |
| (D) 当期損益金(A+B+C)    | 194,124,726      |
| (E) 前期繰越損益金         | 873,566,186      |
| (F) 追加信託差損益金        | 7,043,690,235    |
| (配当等相当額)            | (8,517,181,074)  |
| (売買損益相当額)           | (△1,473,490,839) |
| (G) 合 計(D+E+F)      | 8,111,381,147    |
| 次期繰越損益金(G)          | 8,111,381,147    |
| 追加信託差損益金            | 7,043,690,235    |
| (配当等相当額)            | (8,520,578,063)  |
| (売買損益相当額)           | (△1,476,887,828) |
| 分配準備積立金             | 3,121,031,475    |
| 繰越損益金               | △2,053,340,563   |

※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      | 261,583,960円   |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 0              |
| (c) 収益調整金            | 8,520,578,063  |
| (d) 分配準備積立金          | 2,859,447,515  |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 11,641,609,538 |
| 1万口当たり当期分配対象額        | 3,892.96       |
| (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23期 (2022年6月21日から2023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<br>組入比率 | 純資産<br>総額      |
|------------------|--------|-----------|--------------------|-----------|-------------|----------------|
|                  | 円      | 期中<br>騰落率 | (総合)               | 期中<br>騰落率 |             |                |
| 19期 (2019年6月20日) | 14,376 | 3.0%      | 393.94             | 3.0%      | 99.5%       | 115,199<br>百万円 |
| 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        |
| 23期 (2023年6月20日) | 13,765 | 0.4       | 376.86             | 0.3       | 98.9        | 126,823        |

※NOMURA-BPI (総合) は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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

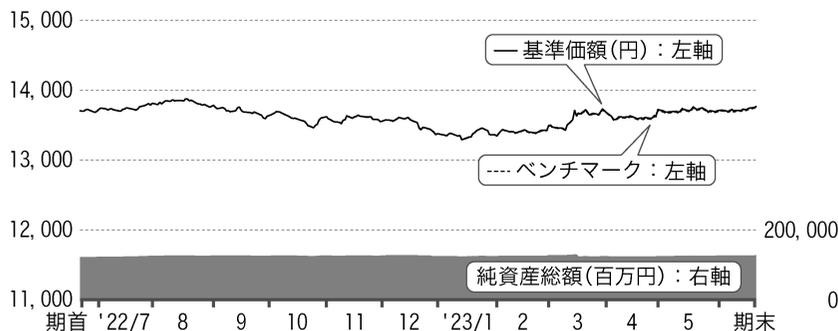
| 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | (ベンチマーク)NOMURA-BPI |       | 公 社 債<br>組入比率 |
|---------------------|---------|-------|--------------------|-------|---------------|
|                     | 円       | 騰 落 率 | (総 合)              | 騰 落 率 |               |
| (期 首)<br>2022年6月20日 | 円       | %     |                    | %     | %             |
|                     | 13,705  | —     | 375.58             | —     | 99.5          |
| 6月末                 | 13,720  | 0.1   | 376.08             | 0.1   | 99.5          |
| 7月末                 | 13,812  | 0.8   | 378.55             | 0.8   | 99.5          |
| 8月末                 | 13,782  | 0.6   | 377.67             | 0.6   | 99.4          |
| 9月末                 | 13,635  | △0.5  | 373.60             | △0.5  | 99.6          |
| 10月末                | 13,621  | △0.6  | 373.25             | △0.6  | 99.5          |
| 11月末                | 13,554  | △1.1  | 371.33             | △1.1  | 99.3          |
| 12月末                | 13,378  | △2.4  | 366.60             | △2.4  | 99.5          |
| 2023年1月末            | 13,343  | △2.6  | 365.59             | △2.7  | 99.5          |
| 2月末                 | 13,495  | △1.5  | 369.57             | △1.6  | 99.4          |
| 3月末                 | 13,683  | △0.2  | 374.74             | △0.2  | 99.5          |
| 4月末                 | 13,722  | 0.1   | 375.61             | 0.0   | 99.5          |
| 5月末                 | 13,709  | 0.0   | 375.27             | △0.1  | 99.5          |
| (期 末)<br>2023年6月20日 |         |       |                    |       |               |
|                     | 13,765  | 0.4   | 376.86             | 0.3   | 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 (2022年6月21日から2023年6月20日まで)

### 基準価額等の推移



|     |         |
|-----|---------|
| 期首  | 13,705円 |
| 期末  | 13,765円 |
| 騰落率 | +0.4%   |

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）です。

※NOMURA-BPI（総合）は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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 (2022年6月21日から2023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。

### 上昇要因

- ・日銀の金融政策修正後に金利が上昇（債券価格は下落）していた超長期ゾーンにおいて投資家需要が喚起され、2月から超長期金利が低下基調となったこと
- ・日銀が4月の新総裁の下で金融緩和策の継続姿勢を示し、金利が低下したこと

### 下落要因

- ・世界的にインフレへの警戒が高まる中で、海外中央銀行の金融引き締めを背景とした海外金利の上昇に追随し、国内金利が上昇したこと
- ・日銀が金融政策により制限していた長期金利（10年国債利回り）の許容変動幅を拡大したことを背景に、国内金利が上昇したこと

### ▶ 投資環境について (2022年6月21日から2023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しました。

期初は、インフレ懸念の高まりから欧米中央銀行がタカ派（インフレ抑制を重視する立場）姿勢を強める中、為替市場での円安進行も背景に、日本の金利に上昇圧力が加かったことに対し、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）の対象銘柄拡大などの対応を行うとともに、緩和政策維持の姿勢を強く示したことから、日本の金利は低下しました。しかし、8月以降、インフレ長期化への警戒から欧米中央銀行がタカ派姿勢を一段と強めたことで海外金利の上昇が加速したことや、日本の物価も上振れが続いたことから、日本の金利は上昇基調に転じました。

12月には、日銀が金融政策決定会合で市場の予想に反し長期金利の許容変動幅を拡大したことから、日本の金利は急上昇しました。その後は、日銀の国債買い入れ増額や1月の金融政策決定会合での政策据え置き等により金利が一時的に低下する局面もありましたが、物価指標の市場予想比上振れや日銀の一段の金融政策修正への根強い警戒から、長期金利は高めの水準での推移が続きました。

3月には、米国での銀行破綻を契機にリスク回避の動きが強まり、海外金利の低下に追随して日本の金利も急低下しました。その後、各国金融当局が金融不安の解消に向けた対応を迅速に打出したことからリスク回避の動きは和らぎましたが、欧米中央銀行の引き締めが終盤に入ってきたとの観測も広がる中で、金利の反発は限定的でした。期末にかけては、4月に植田新総裁の下で日銀が金融緩和政策の継続姿勢を示したこともあり、日本の長期金利は落ち着いた推移が続きました。

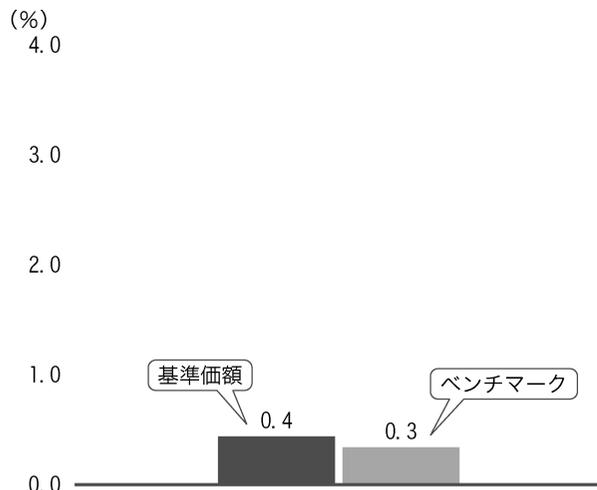
また、超長期ゾーンにおいては、12月の日銀による金融政策修正以降の金利上昇により投資家需要が喚起されたことから、2月以降、超長期金利は低下基調をたどりました。

### ▶ ポートフォリオについて (2022年6月21日から2023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：金利の変動による債券価格の感応度）、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 (2022年6月21日から2023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。記載のグラフは、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+0.4%となり、ベンチマークの騰落率+0.3%に概ね連動した運用結果となりました。

## 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(2022年6月21日から2023年6月20日まで)

| 項目                 | 金額        | 比率                | 項目の概要  |
|--------------------|-----------|-------------------|--|
| (a) その他費用<br>(その他) | 0円<br>(0) | 0.000%<br>(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<br>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13,618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(2022年6月21日から2023年6月20日まで)

公社債

|    |       | 買付額        | 売付額                  |
|----|-------|------------|----------------------|
| 国内 |       | 千円         | 千円                   |
|    | 国債証券  | 26,878,846 | 24,733,965           |
|    | 地方債証券 | 1,750,807  | 1,102,261            |
|    | 特殊債証券 | 1,712,342  | 703,138<br>(176,266) |
|    | 社債証券  | 1,096,273  | 300,737              |

※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。

### ■ 利害関係人との取引状況等(2022年6月21日から2023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<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
|     |               |                    |               |               |                    |               |
| 公社債 | 百万円<br>31,438 | 百万円<br>2,035       | %             | 百万円<br>26,840 | 百万円<br>1,905       | %             |
|     |               |                    | 6.5           |               |                    | 7.1           |

## 国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

### (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 |
|-------|-------|-------|-----------|
|       | 百万円   | 百万円   | 百万円       |
| 公 社 債 | —     | —     | 100       |

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 (2022年6月21日から2023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(2023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<br>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             | 94,322,000<br>(45,350,000)  | 96,200,264<br>(44,086,238)  | 75.9<br>(34.8) | —<br>(—)           | 55.3<br>(23.1) | 17.5<br>(9.8)  | 3.1<br>(1.9) |
| 地 方 債 証 券           | 12,150,000<br>(12,150,000)  | 12,380,473<br>(12,380,473)  | 9.8<br>(9.8)   | —<br>(—)           | 3.1<br>(3.1)   | 2.9<br>(2.9)   | 3.8<br>(3.8) |
| 特 殊 債 券<br>(除く金融債券) | 9,454,244<br>(9,454,244)    | 9,792,157<br>(9,792,157)    | 7.7<br>(7.7)   | —<br>(—)           | 4.0<br>(4.0)   | 2.1<br>(2.1)   | 1.6<br>(1.6) |
| 金 融 債 券             | 100,000<br>(100,000)        | 100,076<br>(100,076)        | 0.1<br>(0.1)   | —<br>(—)           | —<br>(—)       | —<br>(—)       | 0.1<br>(0.1) |
| 普 通 社 債 券           | 7,000,000<br>(7,000,000)    | 6,985,552<br>(6,985,552)    | 5.5<br>(5.5)   | —<br>(—)           | 1.6<br>(1.6)   | 3.3<br>(3.3)   | 0.6<br>(0.6) |
| 合 計                 | 123,026,244<br>(74,054,244) | 125,458,523<br>(73,344,497) | 98.9<br>(57.8) | —<br>(—)           | 64.0<br>(31.9) | 25.8<br>(18.1) | 9.1<br>(7.9) |

※( )内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

B 個別銘柄開示  
国内(邦貨建)公社債

| 種 類  | 銘 柄       | 期 末    |           |           |            |
|------|-----------|--------|-----------|-----------|------------|
|      |           | 利 率    | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
|      |           | %      | 千円        | 千円        |            |
| 国債証券 | 140 5年国債  | 0.1000 | 310,000   | 310,728   | 2024/06/20 |
|      | 141 5年国債  | 0.1000 | 1,090,000 | 1,092,997 | 2024/09/20 |
|      | 142 5年国債  | 0.1000 | 530,000   | 531,590   | 2024/12/20 |
|      | 336 10年国債 | 0.5000 | 115,000   | 116,035   | 2024/12/20 |
|      | 337 10年国債 | 0.3000 | 305,000   | 306,830   | 2024/12/20 |
|      | 445 2年国債  | 0.0050 | 40,000    | 40,064    | 2025/02/01 |
|      | 446 2年国債  | 0.0050 | 140,000   | 140,212   | 2025/03/01 |
|      | 143 5年国債  | 0.1000 | 440,000   | 441,421   | 2025/03/20 |
|      | 338 10年国債 | 0.4000 | 607,000   | 612,141   | 2025/03/20 |
|      | 75 20年国債  | 2.1000 | 230,000   | 238,781   | 2025/03/20 |
|      | 447 2年国債  | 0.0050 | 100,000   | 100,151   | 2025/04/01 |
|      | 144 5年国債  | 0.1000 | 1,220,000 | 1,224,392 | 2025/06/20 |
|      | 339 10年国債 | 0.4000 | 615,000   | 620,904   | 2025/06/20 |
|      | 78 20年国債  | 1.9000 | 340,000   | 353,464   | 2025/06/20 |
|      | 145 5年国債  | 0.1000 | 890,000   | 893,506   | 2025/09/20 |
|      | 340 10年国債 | 0.4000 | 883,000   | 892,448   | 2025/09/20 |
|      | 82 20年国債  | 2.1000 | 288,000   | 302,112   | 2025/09/20 |
|      | 146 5年国債  | 0.1000 | 1,280,000 | 1,285,440 | 2025/12/20 |
|      | 341 10年国債 | 0.3000 | 365,000   | 368,379   | 2025/12/20 |
|      | 84 20年国債  | 2.0000 | 424,000   | 445,967   | 2025/12/20 |
|      | 147 5年国債  | 0.0050 | 790,000   | 791,516   | 2026/03/20 |
|      | 342 10年国債 | 0.1000 | 900,000   | 904,077   | 2026/03/20 |
|      | 85 20年国債  | 2.1000 | 332,000   | 351,763   | 2026/03/20 |
|      | 148 5年国債  | 0.0050 | 620,000   | 621,116   | 2026/06/20 |
|      | 343 10年国債 | 0.1000 | 577,000   | 579,683   | 2026/06/20 |
|      | 88 20年国債  | 2.3000 | 329,000   | 352,260   | 2026/06/20 |
|      | 149 5年国債  | 0.0050 | 1,570,000 | 1,572,543 | 2026/09/20 |
|      | 344 10年国債 | 0.1000 | 1,100,000 | 1,105,181 | 2026/09/20 |
|      | 90 20年国債  | 2.2000 | 418,000   | 448,534   | 2026/09/20 |
|      | 150 5年国債  | 0.0050 | 920,000   | 921,122   | 2026/12/20 |
|      | 345 10年国債 | 0.1000 | 725,000   | 728,298   | 2026/12/20 |
|      | 92 20年国債  | 2.1000 | 295,000   | 317,004   | 2026/12/20 |
|      | 151 5年国債  | 0.0050 | 640,000   | 640,473   | 2027/03/20 |
|      | 152 5年国債  | 0.1000 | 250,000   | 251,075   | 2027/03/20 |
|      | 346 10年国債 | 0.1000 | 460,000   | 461,978   | 2027/03/20 |
|      | 93 20年国債  | 2.0000 | 242,000   | 260,271   | 2027/03/20 |
|      | 153 5年国債  | 0.0050 | 1,300,000 | 1,300,247 | 2027/06/20 |
|      | 347 10年国債 | 0.1000 | 105,000   | 105,418   | 2027/06/20 |
|      | 154 5年国債  | 0.1000 | 1,050,000 | 1,053,559 | 2027/09/20 |
|      | 348 10年国債 | 0.1000 | 105,000   | 105,355   | 2027/09/20 |
|      | 97 20年国債  | 2.2000 | 270,000   | 294,988   | 2027/09/20 |
|      | 156 5年国債  | 0.2000 | 1,140,000 | 1,147,923 | 2027/12/20 |
|      | 349 10年国債 | 0.1000 | 75,000    | 75,201    | 2027/12/20 |

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  |
|     | 99 20年国債  | 2.1000 | 177,000   | 193,372   | 2027/12/20 |
|     | 157 5年国債  | 0.2000 | 330,000   | 332,026   | 2028/03/20 |
|     | 158 5年国債  | 0.1000 | 430,000   | 430,507   | 2028/03/20 |
|     | 350 10年国債 | 0.1000 | 305,000   | 305,430   | 2028/03/20 |
|     | 100 20年国債 | 2.2000 | 130,000   | 143,128   | 2028/03/20 |
|     | 351 10年国債 | 0.1000 | 360,000   | 360,356   | 2028/06/20 |
|     | 102 20年国債 | 2.4000 | 255,000   | 284,516   | 2028/06/20 |
|     | 352 10年国債 | 0.1000 | 415,000   | 415,215   | 2028/09/20 |
|     | 105 20年国債 | 2.1000 | 237,000   | 261,956   | 2028/09/20 |
|     | 353 10年国債 | 0.1000 | 230,000   | 230,000   | 2028/12/20 |
|     | 107 20年国債 | 2.1000 | 248,000   | 275,198   | 2028/12/20 |
|     | 354 10年国債 | 0.1000 | 570,000   | 569,669   | 2029/03/20 |
|     | 109 20年国債 | 1.9000 | 315,000   | 347,287   | 2029/03/20 |
|     | 355 10年国債 | 0.1000 | 760,000   | 759,088   | 2029/06/20 |
|     | 111 20年国債 | 2.2000 | 393,000   | 441,802   | 2029/06/20 |
|     | 356 10年国債 | 0.1000 | 695,000   | 693,491   | 2029/09/20 |
|     | 113 20年国債 | 2.1000 | 395,000   | 443,371   | 2029/09/20 |
|     | 357 10年国債 | 0.1000 | 1,100,000 | 1,096,458 | 2029/12/20 |
|     | 114 20年国債 | 2.1000 | 223,000   | 251,147   | 2029/12/20 |
|     | 2 30年国債   | 2.4000 | 150,000   | 172,339   | 2030/02/20 |
|     | 358 10年国債 | 0.1000 | 1,050,000 | 1,045,443 | 2030/03/20 |
|     | 116 20年国債 | 2.2000 | 320,000   | 363,683   | 2030/03/20 |
|     | 359 10年国債 | 0.1000 | 1,060,000 | 1,054,138 | 2030/06/20 |
|     | 118 20年国債 | 2.0000 | 245,000   | 276,002   | 2030/06/20 |
|     | 119 20年国債 | 1.8000 | 160,000   | 178,033   | 2030/06/20 |
|     | 360 10年国債 | 0.1000 | 760,000   | 754,292   | 2030/09/20 |
|     | 121 20年国債 | 1.9000 | 200,000   | 224,374   | 2030/09/20 |
|     | 122 20年国債 | 1.8000 | 225,000   | 250,812   | 2030/09/20 |
|     | 4 30年国債   | 2.9000 | 160,000   | 191,499   | 2030/11/20 |
|     | 361 10年国債 | 0.1000 | 1,150,000 | 1,138,557 | 2030/12/20 |
|     | 123 20年国債 | 2.1000 | 205,000   | 233,429   | 2030/12/20 |
|     | 124 20年国債 | 2.0000 | 230,000   | 260,199   | 2030/12/20 |
|     | 362 10年国債 | 0.1000 | 1,220,000 | 1,205,628 | 2031/03/20 |
|     | 125 20年国債 | 2.2000 | 175,000   | 201,157   | 2031/03/20 |
|     | 126 20年国債 | 2.0000 | 185,000   | 209,756   | 2031/03/20 |
|     | 127 20年国債 | 1.9000 | 190,000   | 213,981   | 2031/03/20 |
|     | 5 30年国債   | 2.2000 | 100,000   | 115,129   | 2031/05/20 |
|     | 363 10年国債 | 0.1000 | 1,460,000 | 1,439,998 | 2031/06/20 |
|     | 129 20年国債 | 1.8000 | 40,000    | 44,825    | 2031/06/20 |
|     | 364 10年国債 | 0.1000 | 1,540,000 | 1,516,422 | 2031/09/20 |
|     | 130 20年国債 | 1.8000 | 300,000   | 336,903   | 2031/09/20 |
|     | 131 20年国債 | 1.7000 | 225,000   | 250,861   | 2031/09/20 |
|     | 365 10年国債 | 0.1000 | 1,150,000 | 1,130,461 | 2031/12/20 |
|     | 132 20年国債 | 1.7000 | 270,000   | 301,700   | 2031/12/20 |
|     | 133 20年国債 | 1.8000 | 235,000   | 264,539   | 2031/12/20 |
|     | 366 10年国債 | 0.2000 | 40,000    | 39,591    | 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  |
|     | 134 20年国債 | 1. 8000 | 163, 000    | 183, 834    | 2032/03/20 |
|     | 135 20年国債 | 1. 7000 | 285, 000    | 319, 000    | 2032/03/20 |
|     | 136 20年国債 | 1. 6000 | 205, 000    | 227, 709    | 2032/03/20 |
|     | 7 30年国債   | 2. 3000 | 180, 000    | 211, 248    | 2032/05/20 |
|     | 367 10年国債 | 0. 2000 | 790, 000    | 780, 678    | 2032/06/20 |
|     | 137 20年国債 | 1. 7000 | 190, 000    | 213, 022    | 2032/06/20 |
|     | 139 20年国債 | 1. 6000 | 200, 000    | 222, 484    | 2032/06/20 |
|     | 368 10年国債 | 0. 2000 | 600, 000    | 591, 936    | 2032/09/20 |
|     | 140 20年国債 | 1. 7000 | 560, 000    | 628, 857    | 2032/09/20 |
|     | 369 10年国債 | 0. 5000 | 170, 000    | 172, 184    | 2032/12/20 |
|     | 141 20年国債 | 1. 7000 | 1, 100, 000 | 1, 237, 082 | 2032/12/20 |
|     | 142 20年国債 | 1. 8000 | 730, 000    | 827, 681    | 2032/12/20 |
|     | 370 10年国債 | 0. 5000 | 1, 050, 000 | 1, 061, 340 | 2033/03/20 |
|     | 10 30年国債  | 1. 1000 | 230, 000    | 245, 676    | 2033/03/20 |
|     | 143 20年国債 | 1. 6000 | 240, 000    | 267, 765    | 2033/03/20 |
|     | 144 20年国債 | 1. 5000 | 285, 000    | 315, 289    | 2033/03/20 |
|     | 11 30年国債  | 1. 7000 | 150, 000    | 168, 988    | 2033/06/20 |
|     | 145 20年国債 | 1. 7000 | 392, 000    | 441, 623    | 2033/06/20 |
|     | 12 30年国債  | 2. 1000 | 230, 000    | 268, 628    | 2033/09/20 |
|     | 146 20年国債 | 1. 7000 | 350, 000    | 394, 796    | 2033/09/20 |
|     | 147 20年国債 | 1. 6000 | 360, 000    | 402, 714    | 2033/12/20 |
|     | 14 30年国債  | 2. 4000 | 220, 000    | 264, 783    | 2034/03/20 |
|     | 148 20年国債 | 1. 5000 | 262, 000    | 290, 641    | 2034/03/20 |
|     | 15 30年国債  | 2. 5000 | 220, 000    | 267, 819    | 2034/06/20 |
|     | 149 20年国債 | 1. 5000 | 287, 000    | 318, 575    | 2034/06/20 |
|     | 16 30年国債  | 2. 5000 | 175, 000    | 213, 526    | 2034/09/20 |
|     | 150 20年国債 | 1. 4000 | 595, 000    | 654, 470    | 2034/09/20 |
|     | 151 20年国債 | 1. 2000 | 530, 000    | 571, 271    | 2034/12/20 |
|     | 18 30年国債  | 2. 3000 | 170, 000    | 204, 513    | 2035/03/20 |
|     | 152 20年国債 | 1. 2000 | 590, 000    | 635, 813    | 2035/03/20 |
|     | 19 30年国債  | 2. 3000 | 125, 000    | 150, 721    | 2035/06/20 |
|     | 153 20年国債 | 1. 3000 | 572, 000    | 623, 085    | 2035/06/20 |
|     | 154 20年国債 | 1. 2000 | 565, 000    | 608, 538    | 2035/09/20 |
|     | 21 30年国債  | 2. 3000 | 122, 000    | 147, 484    | 2035/12/20 |
|     | 155 20年国債 | 1. 0000 | 470, 000    | 494, 444    | 2035/12/20 |
|     | 22 30年国債  | 2. 5000 | 149, 000    | 184, 043    | 2036/03/20 |
|     | 156 20年国債 | 0. 4000 | 460, 000    | 449, 636    | 2036/03/20 |
|     | 23 30年国債  | 2. 5000 | 151, 000    | 186, 829    | 2036/06/20 |
|     | 157 20年国債 | 0. 2000 | 523, 000    | 496, 876    | 2036/06/20 |
|     | 24 30年国債  | 2. 5000 | 135, 000    | 167, 302    | 2036/09/20 |
|     | 158 20年国債 | 0. 5000 | 455, 000    | 448, 311    | 2036/09/20 |
|     | 25 30年国債  | 2. 3000 | 175, 000    | 212, 812    | 2036/12/20 |
|     | 159 20年国債 | 0. 6000 | 558, 000    | 555, 913    | 2036/12/20 |
|     | 26 30年国債  | 2. 4000 | 219, 000    | 269, 567    | 2037/03/20 |
|     | 160 20年国債 | 0. 7000 | 540, 000    | 544, 093    | 2037/03/20 |
|     | 161 20年国債 | 0. 6000 | 515, 000    | 511, 039    | 2037/06/20 |

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  |
|     | 27 30年国債  | 2.5000 | 206,000 | 257,040 | 2037/09/20 |
|     | 162 20年国債 | 0.6000 | 615,000 | 608,604 | 2037/09/20 |
|     | 163 20年国債 | 0.6000 | 515,000 | 508,552 | 2037/12/20 |
|     | 28 30年国債  | 2.5000 | 201,000 | 251,372 | 2038/03/20 |
|     | 164 20年国債 | 0.5000 | 515,000 | 500,229 | 2038/03/20 |
|     | 165 20年国債 | 0.5000 | 515,000 | 498,648 | 2038/06/20 |
|     | 29 30年国債  | 2.4000 | 190,000 | 235,315 | 2038/09/20 |
|     | 166 20年国債 | 0.7000 | 500,000 | 496,915 | 2038/09/20 |
|     | 167 20年国債 | 0.5000 | 475,000 | 456,921 | 2038/12/20 |
|     | 30 30年国債  | 2.3000 | 270,000 | 330,795 | 2039/03/20 |
|     | 168 20年国債 | 0.4000 | 475,000 | 448,428 | 2039/03/20 |
|     | 169 20年国債 | 0.3000 | 395,000 | 365,691 | 2039/06/20 |
|     | 31 30年国債  | 2.2000 | 277,000 | 335,416 | 2039/09/20 |
|     | 170 20年国債 | 0.3000 | 420,000 | 387,294 | 2039/09/20 |
|     | 171 20年国債 | 0.3000 | 425,000 | 390,609 | 2039/12/20 |
|     | 32 30年国債  | 2.3000 | 377,000 | 462,899 | 2040/03/20 |
|     | 172 20年国債 | 0.4000 | 430,000 | 400,459 | 2040/03/20 |
|     | 173 20年国債 | 0.4000 | 500,000 | 464,170 | 2040/06/20 |
|     | 33 30年国債  | 2.0000 | 380,000 | 448,776 | 2040/09/20 |
|     | 174 20年国債 | 0.4000 | 515,000 | 476,550 | 2040/09/20 |
|     | 175 20年国債 | 0.5000 | 510,000 | 478,436 | 2040/12/20 |
|     | 34 30年国債  | 2.2000 | 394,000 | 478,225 | 2041/03/20 |
|     | 176 20年国債 | 0.5000 | 490,000 | 458,252 | 2041/03/20 |
|     | 177 20年国債 | 0.4000 | 510,000 | 467,246 | 2041/06/20 |
|     | 35 30年国債  | 2.0000 | 335,000 | 396,174 | 2041/09/20 |
|     | 178 20年国債 | 0.5000 | 530,000 | 493,286 | 2041/09/20 |
|     | 179 20年国債 | 0.5000 | 520,000 | 482,799 | 2041/12/20 |
|     | 36 30年国債  | 2.0000 | 315,000 | 372,966 | 2042/03/20 |
|     | 180 20年国債 | 0.8000 | 440,000 | 430,179 | 2042/03/20 |
|     | 181 20年国債 | 0.9000 | 335,000 | 332,571 | 2042/06/20 |
|     | 37 30年国債  | 1.9000 | 345,000 | 402,594 | 2042/09/20 |
|     | 182 20年国債 | 1.1000 | 500,000 | 513,035 | 2042/09/20 |
|     | 183 20年国債 | 1.4000 | 550,000 | 592,663 | 2042/12/20 |
|     | 38 30年国債  | 1.8000 | 335,000 | 384,580 | 2043/03/20 |
|     | 184 20年国債 | 1.1000 | 400,000 | 408,952 | 2043/03/20 |
|     | 39 30年国債  | 1.9000 | 240,000 | 279,960 | 2043/06/20 |
|     | 40 30年国債  | 1.8000 | 240,000 | 275,580 | 2043/09/20 |
|     | 41 30年国債  | 1.7000 | 250,000 | 282,410 | 2043/12/20 |
|     | 42 30年国債  | 1.7000 | 240,000 | 271,192 | 2044/03/20 |
|     | 43 30年国債  | 1.7000 | 280,000 | 316,484 | 2044/06/20 |
|     | 44 30年国債  | 1.7000 | 287,000 | 324,482 | 2044/09/20 |
|     | 45 30年国債  | 1.5000 | 302,000 | 329,883 | 2044/12/20 |
|     | 46 30年国債  | 1.5000 | 345,000 | 376,819 | 2045/03/20 |
|     | 47 30年国債  | 1.6000 | 315,000 | 350,024 | 2045/06/20 |
|     | 48 30年国債  | 1.4000 | 335,000 | 358,734 | 2045/09/20 |
|     | 49 30年国債  | 1.4000 | 375,000 | 401,441 | 2045/12/20 |

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      |
|       | 50 30年国債   | 0.8000 | 280,000    | 265,683    | 2046/03/20 |
|       | 51 30年国債   | 0.3000 | 317,000    | 267,747    | 2046/06/20 |
|       | 52 30年国債   | 0.5000 | 317,000    | 279,971    | 2046/09/20 |
|       | 53 30年国債   | 0.6000 | 342,000    | 308,340    | 2046/12/20 |
|       | 54 30年国債   | 0.8000 | 190,000    | 178,930    | 2047/03/20 |
|       | 55 30年国債   | 0.8000 | 350,000    | 328,814    | 2047/06/20 |
|       | 56 30年国債   | 0.8000 | 385,000    | 360,814    | 2047/09/20 |
|       | 57 30年国債   | 0.8000 | 405,000    | 378,626    | 2047/12/20 |
|       | 58 30年国債   | 0.8000 | 410,000    | 382,353    | 2048/03/20 |
|       | 59 30年国債   | 0.7000 | 350,000    | 317,569    | 2048/06/20 |
|       | 60 30年国債   | 0.9000 | 210,000    | 198,947    | 2048/09/20 |
|       | 61 30年国債   | 0.7000 | 350,000    | 314,909    | 2048/12/20 |
|       | 2 40年国債    | 2.2000 | 132,000    | 162,270    | 2049/03/20 |
|       | 62 30年国債   | 0.5000 | 265,000    | 225,628    | 2049/03/20 |
|       | 63 30年国債   | 0.4000 | 265,000    | 218,868    | 2049/06/20 |
|       | 64 30年国債   | 0.4000 | 255,000    | 209,877    | 2049/09/20 |
|       | 65 30年国債   | 0.4000 | 305,000    | 250,649    | 2049/12/20 |
|       | 3 40年国債    | 2.2000 | 150,000    | 184,287    | 2050/03/20 |
|       | 66 30年国債   | 0.4000 | 305,000    | 249,285    | 2050/03/20 |
|       | 67 30年国債   | 0.6000 | 350,000    | 301,339    | 2050/06/20 |
|       | 68 30年国債   | 0.6000 | 360,000    | 308,980    | 2050/09/20 |
|       | 69 30年国債   | 0.7000 | 350,000    | 308,084    | 2050/12/20 |
|       | 4 40年国債    | 2.2000 | 215,000    | 264,710    | 2051/03/20 |
|       | 70 30年国債   | 0.7000 | 350,000    | 307,492    | 2051/03/20 |
|       | 71 30年国債   | 0.7000 | 350,000    | 306,894    | 2051/06/20 |
|       | 72 30年国債   | 0.7000 | 360,000    | 315,043    | 2051/09/20 |
|       | 73 30年国債   | 0.7000 | 330,000    | 288,525    | 2051/12/20 |
|       | 5 40年国債    | 2.0000 | 222,000    | 263,904    | 2052/03/20 |
|       | 74 30年国債   | 1.0000 | 350,000    | 331,145    | 2052/03/20 |
|       | 75 30年国債   | 1.3000 | 350,000    | 356,377    | 2052/06/20 |
|       | 76 30年国債   | 1.4000 | 260,000    | 271,258    | 2052/09/20 |
|       | 77 30年国債   | 1.6000 | 340,000    | 371,650    | 2052/12/20 |
|       | 6 40年国債    | 1.9000 | 220,000    | 257,138    | 2053/03/20 |
|       | 78 30年国債   | 1.4000 | 350,000    | 365,344    | 2053/03/20 |
|       | 7 40年国債    | 1.7000 | 253,000    | 282,998    | 2054/03/20 |
|       | 8 40年国債    | 1.4000 | 295,000    | 307,148    | 2055/03/20 |
|       | 9 40年国債    | 0.4000 | 471,000    | 363,616    | 2056/03/20 |
|       | 10 40年国債   | 0.9000 | 438,000    | 395,049    | 2057/03/20 |
|       | 11 40年国債   | 0.8000 | 355,000    | 308,818    | 2058/03/20 |
|       | 12 40年国債   | 0.5000 | 360,000    | 280,472    | 2059/03/20 |
|       | 13 40年国債   | 0.5000 | 470,000    | 362,962    | 2060/03/20 |
|       | 14 40年国債   | 0.7000 | 470,000    | 386,838    | 2061/03/20 |
|       | 15 40年国債   | 1.0000 | 575,000    | 519,179    | 2062/03/20 |
|       | 16 40年国債   | 1.3000 | 100,000    | 98,452     | 2063/03/20 |
|       | 小 計        | -      | 94,322,000 | 96,200,264 | -          |
| 地方債証券 | 30-7 福岡県5年 | 0.0200 | 100,000    | 100,026    | 2024/01/22 |

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      |
|     | 25-11 福岡県公債 | 0.6940 | 100,000 | 100,494 | 2024/02/26 |
|     | 30-12 京都府5年 | 0.0200 | 300,000 | 300,076 | 2024/03/19 |
|     | 1-1 大阪市5年   | 0.0100 | 400,000 | 400,083 | 2024/05/21 |
|     | 1-2 千葉県5年   | 0.0100 | 100,000 | 100,021 | 2024/05/24 |
|     | 26-1 広島県公債  | 0.6700 | 100,000 | 100,639 | 2024/05/27 |
|     | 78 神奈川県5年   | 0.0050 | 100,000 | 100,005 | 2024/06/20 |
|     | 487 名古屋市債   | 0.6590 | 300,000 | 301,992 | 2024/06/20 |
|     | 26-4 埼玉県公債  | 0.6540 | 100,000 | 100,663 | 2024/06/26 |
|     | 26-3 千葉県公債  | 0.6110 | 300,000 | 301,985 | 2024/07/25 |
|     | 26-3 横浜市公債  | 0.5710 | 300,000 | 301,982 | 2024/08/19 |
|     | 137 共同発行地方  | 0.5660 | 100,000 | 100,661 | 2024/08/23 |
|     | 138 共同発行地方  | 0.5540 | 100,000 | 100,680 | 2024/09/25 |
|     | 1-2 北九州市5年  | 0.0010 | 100,000 | 99,981  | 2024/09/26 |
|     | 26-5 福岡県公債  | 0.5250 | 200,000 | 201,369 | 2024/10/28 |
|     | 26-5 福岡市公債  | 0.5390 | 200,000 | 201,410 | 2024/10/28 |
|     | 26-10 静岡県公債 | 0.5150 | 100,000 | 100,709 | 2024/11/25 |
|     | 11 群馬県公債    | 0.5050 | 100,000 | 100,689 | 2024/11/25 |
|     | 140 共同発行地方  | 0.5050 | 100,000 | 100,689 | 2024/11/25 |
|     | 26-14 愛知県公債 | 0.5350 | 100,000 | 100,739 | 2024/11/28 |
|     | 26-5 千葉県公債  | 0.4760 | 200,000 | 201,368 | 2024/12/25 |
|     | 26-13 北海道公債 | 0.4610 | 100,000 | 100,644 | 2024/12/26 |
|     | 6 東京都20年    | 2.0000 | 400,000 | 413,737 | 2025/03/19 |
|     | 26-18 愛知県公債 | 0.4400 | 100,000 | 100,698 | 2025/03/27 |
|     | 3 兵庫県公債12年  | 0.5600 | 100,000 | 100,916 | 2025/04/16 |
|     | 395 大阪府公債   | 0.4350 | 200,000 | 201,411 | 2025/04/28 |
|     | 170 大阪府5年   | 0.0010 | 300,000 | 299,687 | 2025/04/28 |
|     | 27-1 横浜市公債  | 0.5240 | 100,000 | 100,911 | 2025/05/26 |
|     | 397 大阪府公債   | 0.5660 | 100,000 | 101,019 | 2025/06/27 |
|     | 149 共同発行地方  | 0.5000 | 100,000 | 100,961 | 2025/08/25 |
|     | 7 東京都20年    | 2.1600 | 100,000 | 104,743 | 2025/09/19 |
|     | 1 静岡県20年    | 2.1800 | 100,000 | 104,764 | 2025/09/19 |
|     | 27-2 福井県公債  | 0.4760 | 100,000 | 100,972 | 2025/10/23 |
|     | 27-5 福岡市公債  | 0.4760 | 100,000 | 100,974 | 2025/10/28 |
|     | 27-11 京都府公債 | 0.4690 | 200,000 | 202,038 | 2025/12/18 |
|     | 494 名古屋市債   | 0.4640 | 200,000 | 202,020 | 2025/12/19 |
|     | 27-16 愛知県公債 | 0.4540 | 200,000 | 201,979 | 2025/12/25 |
|     | 27-6 千葉県公債  | 0.4690 | 100,000 | 101,020 | 2025/12/25 |
|     | 27-1 三重県公債  | 0.4640 | 100,000 | 101,009 | 2025/12/25 |
|     | 154 共同発行地方  | 0.4050 | 150,000 | 151,343 | 2026/01/23 |
|     | 407 大阪府公債   | 0.0900 | 100,000 | 100,045 | 2026/04/27 |
|     | 222 神奈川県公債  | 0.0600 | 100,000 | 99,967  | 2026/06/19 |
|     | 9 横浜市20年    | 2.3500 | 100,000 | 106,822 | 2026/06/19 |
|     | 1 兵庫県公債15年  | 1.6600 | 200,000 | 209,747 | 2026/07/29 |
|     | 11 東京都20年   | 2.2200 | 100,000 | 107,914 | 2027/03/19 |
|     | 7 神奈川県20年   | 2.2200 | 200,000 | 215,715 | 2027/03/19 |
|     | 29-5 北海道公債  | 0.1800 | 100,000 | 100,072 | 2027/06/30 |

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

| 種類               | 銘柄          | 期末     |            |            |            |
|------------------|-------------|--------|------------|------------|------------|
|                  |             | 利率     | 額面金額       | 評価額        | 償還年月日      |
|                  | 1 名古屋市15年   | 1.3290 | 200,000    | 209,718    | 2027/08/10 |
|                  | 175 共同発行地方  | 0.2150 | 200,000    | 200,405    | 2027/10/25 |
|                  | 425 大阪府公債   | 0.1950 | 200,000    | 200,043    | 2027/10/29 |
|                  | 176 共同発行地方  | 0.1850 | 100,000    | 100,043    | 2027/11/25 |
|                  | 29-16 愛知県公債 | 0.2600 | 100,000    | 100,281    | 2028/02/14 |
|                  | 179 共同発行地方  | 0.2400 | 100,000    | 100,171    | 2028/02/25 |
|                  | 233 神奈川県公債  | 0.1950 | 100,000    | 99,934     | 2028/03/17 |
|                  | 5 兵庫県公債15年  | 1.3100 | 100,000    | 105,287    | 2028/05/26 |
|                  | 183 共同発行地方  | 0.2050 | 600,000    | 599,815    | 2028/06/23 |
|                  | 30-4 埼玉県公債  | 0.2050 | 100,000    | 99,958     | 2028/06/26 |
|                  | 30-2 広島県公債  | 0.1800 | 200,000    | 199,606    | 2028/07/25 |
|                  | 185 共同発行地方  | 0.2450 | 200,000    | 200,208    | 2028/08/25 |
|                  | 91 川崎市公債    | 0.1850 | 100,000    | 99,756     | 2028/09/20 |
|                  | 6 埼玉県20年    | 2.2600 | 100,000    | 110,597    | 2028/09/21 |
|                  | 16 横浜市20年   | 2.3500 | 100,000    | 111,064    | 2028/09/21 |
|                  | 30-6 大阪市公債  | 0.2640 | 100,000    | 100,149    | 2028/11/13 |
|                  | 6 大阪市20年    | 2.2100 | 100,000    | 110,756    | 2028/12/20 |
|                  | 30-6 福岡県公債  | 0.2000 | 100,000    | 99,777     | 2028/12/21 |
|                  | 30-2 岡山県公債  | 0.1550 | 100,000    | 99,501     | 2029/01/31 |
|                  | 30-18 北海道公債 | 0.1460 | 200,000    | 198,498    | 2029/02/28 |
|                  | 792 東京都公債   | 0.0500 | 300,000    | 296,668    | 2029/03/19 |
|                  | 793 東京都公債   | 0.0500 | 200,000    | 197,507    | 2029/06/20 |
|                  | 9 兵庫県公債20年  | 2.2500 | 100,000    | 112,192    | 2029/11/19 |
|                  | 8 京都市20年    | 2.2300 | 100,000    | 112,292    | 2029/11/19 |
|                  | 2-7 千葉県公債   | 0.1500 | 100,000    | 98,380     | 2030/09/25 |
|                  | 1 京都市15年    | 0.7810 | 100,000    | 102,737    | 2030/12/20 |
|                  | 2-7 札幌市公債   | 0.1150 | 100,000    | 97,831     | 2030/12/20 |
|                  | 13 埼玉県20年   | 1.5990 | 100,000    | 109,273    | 2033/05/20 |
|                  | 14 埼玉県20年   | 1.5460 | 100,000    | 108,766    | 2034/05/08 |
|                  | 26-3 神戸市20年 | 1.4820 | 100,000    | 108,101    | 2034/07/14 |
|                  | 8 東京都30年    | 2.2300 | 100,000    | 118,393    | 2038/09/17 |
|                  | 13 東京都30年   | 1.9300 | 200,000    | 229,177    | 2042/03/19 |
|                  | 7 静岡県30年    | 1.9880 | 100,000    | 115,878    | 2043/06/19 |
|                  | 1-3 福岡県30年  | 0.4320 | 100,000    | 80,289     | 2049/06/18 |
|                  | 小計          | -      | 12,150,000 | 12,380,473 | -          |
| 特殊債券<br>(除く金融債券) | 207 政保道路機構  | 0.6930 | 200,000    | 200,790    | 2023/12/28 |
|                  | 209 政保道路機構  | 0.7470 | 100,000    | 100,504    | 2024/01/31 |
|                  | 122 道路機構    | 0.7040 | 200,000    | 201,029    | 2024/03/19 |
|                  | 27 道路債券     | 2.4200 | 100,000    | 101,799    | 2024/03/20 |
|                  | 59 地方公共団体   | 0.7240 | 100,000    | 100,598    | 2024/04/26 |
|                  | 220 政保道路機構  | 0.6440 | 300,000    | 302,136    | 2024/06/28 |
|                  | 61 地方公共団体   | 0.6900 | 100,000    | 100,673    | 2024/06/28 |
|                  | 62 地方公共団体   | 0.6310 | 300,000    | 301,956    | 2024/07/26 |
|                  | 32 道路債券     | 2.4400 | 100,000    | 102,994    | 2024/09/20 |
|                  | 227 政保道路機構  | 0.5440 | 300,000    | 302,246    | 2024/09/30 |
|                  | 6 福祉医療機構    | 2.1100 | 100,000    | 103,545    | 2025/03/19 |

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  |
|     | 42 道路債券     | 2.2200 | 100,000 | 103,744 | 2025/03/21 |
|     | 76政保地方公共団   | 0.4250 | 200,000 | 201,839 | 2025/09/12 |
|     | 85 中日本高速道   | 0.0700 | 100,000 | 99,894  | 2025/10/21 |
|     | 16 公営企業20年  | 2.1000 | 100,000 | 104,976 | 2025/12/19 |
|     | 66日本政策投資C0  | 0.0900 | 100,000 | 99,935  | 2026/04/17 |
|     | 18 公営企業20年  | 2.5800 | 100,000 | 107,350 | 2026/06/19 |
|     | 190 住宅支援機構  | 0.0800 | 100,000 | 99,877  | 2026/06/19 |
|     | 30 地方公共団5年  | 0.0010 | 300,000 | 298,583 | 2026/11/27 |
|     | 60 政保政策投資C  | 0.0010 | 100,000 | 99,851  | 2027/01/29 |
|     | 22 公営企業20年  | 2.3200 | 200,000 | 217,034 | 2027/06/18 |
|     | 117 住宅支援機構  | 1.4380 | 100,000 | 105,227 | 2027/09/17 |
|     | 27 道路機構     | 2.3400 | 100,000 | 109,195 | 2027/10/20 |
|     | 222 住宅支援機構  | 0.2100 | 200,000 | 199,964 | 2027/11/19 |
|     | 102 地方公共団体  | 0.2000 | 100,000 | 99,934  | 2027/11/26 |
|     | 42 政保政策投資C  | 0.1550 | 100,000 | 100,183 | 2027/12/15 |
|     | 226 住宅支援機構  | 0.2400 | 200,000 | 200,160 | 2027/12/20 |
|     | 333 政保道路機構  | 0.1550 | 100,000 | 100,161 | 2027/12/28 |
|     | 339 政保道路機構  | 0.1950 | 100,000 | 100,261 | 2028/02/29 |
|     | 106 地方公共団体  | 0.2150 | 300,000 | 299,473 | 2028/03/28 |
|     | 37 道路機構     | 2.4200 | 700,000 | 775,394 | 2028/06/20 |
|     | 354 政保道路機構  | 0.1300 | 200,000 | 199,743 | 2028/07/31 |
|     | 112 地方公共団体  | 0.2690 | 100,000 | 99,968  | 2028/09/28 |
|     | 79 政保道路機構   | 2.1000 | 100,000 | 111,093 | 2029/04/27 |
|     | 97 都市再生     | 1.0170 | 200,000 | 208,327 | 2029/09/20 |
|     | 92 政保道路機構   | 2.1000 | 100,000 | 111,822 | 2029/10/31 |
|     | 99 政保道路機構   | 2.2000 | 100,000 | 112,814 | 2030/01/31 |
|     | 124 日本政策投資  | 0.1550 | 200,000 | 196,960 | 2030/04/16 |
|     | 78 鉄道建設・運   | 0.8010 | 100,000 | 102,794 | 2030/05/28 |
|     | 117 都市再生    | 0.8040 | 100,000 | 102,593 | 2030/11/20 |
|     | 130 住宅支援機構  | 1.7630 | 100,000 | 110,761 | 2032/12/20 |
|     | 185 政保道路機構  | 1.7570 | 100,000 | 111,535 | 2033/02/28 |
|     | F281地方公共団体  | 0.9990 | 100,000 | 103,345 | 2033/09/21 |
|     | 210 政保道路機構  | 1.5470 | 400,000 | 438,770 | 2034/01/31 |
|     | 221 政保道路機構  | 1.4660 | 100,000 | 108,973 | 2034/06/30 |
|     | 246 政保道路機構  | 1.1780 | 100,000 | 106,100 | 2035/05/31 |
|     | 4 道路機構      | 2.5900 | 100,000 | 121,447 | 2035/12/20 |
|     | 48 地方公共団20  | 1.1210 | 100,000 | 103,907 | 2035/12/28 |
|     | S3 住宅機構RMBS | 2.0900 | 9,710   | 9,762   | 2037/11/10 |
|     | 35 住宅金融RMBS | 1.7900 | 10,317  | 10,361  | 2040/10/10 |
|     | 37 住宅金融RMBS | 1.8800 | 9,763   | 9,807   | 2040/12/10 |
|     | 40 住宅金融RMBS | 1.9300 | 10,646  | 10,778  | 2041/03/10 |
|     | 2 住宅機構RMBS  | 2.1900 | 10,249  | 10,308  | 2042/06/10 |
|     | 29 住宅機構RMBS | 1.9500 | 19,590  | 20,696  | 2044/10/10 |
|     | 32 住宅機構RMBS | 1.8200 | 18,906  | 19,841  | 2045/01/10 |
|     | 37 住宅機構RMBS | 1.7100 | 19,287  | 20,178  | 2045/06/10 |
|     | 49 住宅機構RMBS | 1.7600 | 17,823  | 18,617  | 2046/06/10 |

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      |
|           | 51 住宅機構RMBS    | 1.6400 | 19,394    | 20,251    | 2046/08/10 |
|           | 55 住宅機構RMBS    | 1.4100 | 25,991    | 27,087    | 2046/12/10 |
|           | 57 住宅機構RMBS    | 1.4400 | 24,882    | 25,941    | 2047/02/10 |
|           | 22 道路機構        | 2.6700 | 200,000   | 261,453   | 2047/03/20 |
|           | 59 住宅機構RMBS    | 1.4400 | 26,430    | 27,595    | 2047/04/10 |
|           | 67 住宅機構RMBS    | 1.0900 | 34,444    | 35,439    | 2047/12/10 |
|           | 69 住宅機構RMBS    | 1.2800 | 35,993    | 37,364    | 2048/02/10 |
|           | 70 住宅機構RMBS    | 1.2500 | 31,243    | 32,373    | 2048/03/10 |
|           | 73 住宅機構RMBS    | 1.3000 | 35,707    | 37,099    | 2048/06/10 |
|           | 88 住宅機構RMBS    | 0.9300 | 39,828    | 40,680    | 2049/09/10 |
|           | 113 住宅機構RMBS   | 0.3700 | 70,110    | 68,770    | 2051/10/10 |
|           | 123 住宅機構RMBS   | 0.4600 | 73,113    | 71,862    | 2052/08/10 |
|           | 124 住宅機構RMBS   | 0.4200 | 72,897    | 71,431    | 2052/09/10 |
|           | 125 住宅機構RMBS   | 0.4200 | 72,918    | 71,466    | 2052/10/10 |
|           | 132 住宅機構RMBS   | 0.4000 | 74,689    | 73,008    | 2053/05/10 |
|           | 138 住宅機構RMBS   | 0.5000 | 77,294    | 75,925    | 2053/11/10 |
|           | 146 住宅機構RMBS   | 0.2100 | 82,168    | 78,741    | 2054/07/10 |
|           | 151 住宅機構RMBS   | 0.2600 | 84,987    | 81,604    | 2054/12/10 |
|           | 157 住宅機構RMBS   | 0.3400 | 85,762    | 82,811    | 2055/06/10 |
|           | 160 住宅機構RMBS   | 0.3700 | 88,149    | 85,196    | 2055/09/10 |
|           | 166 住宅機構RMBS   | 0.4100 | 180,260   | 174,635   | 2056/03/10 |
|           | 183 住宅機構RMBS   | 0.5300 | 193,436   | 188,580   | 2057/08/10 |
|           | 188 住宅機構RMBS   | 1.0200 | 98,258    | 100,203   | 2058/01/10 |
|           | 小 計            | —      | 9,454,244 | 9,792,157 | —          |
| 金 融 債 券   | 350 信金中金       | 0.0800 | 100,000   | 100,076   | 2024/01/26 |
|           | 小 計            | —      | 100,000   | 100,076   | —          |
| 普 通 社 債 券 | 2 BPCE S.A.    | 0.6450 | 100,000   | 99,980    | 2023/07/12 |
|           | 1 野村ホールディングス   | 0.3000 | 100,000   | 99,960    | 2023/09/04 |
|           | 50 西日本高速道      | 0.0400 | 100,000   | 100,004   | 2024/06/20 |
|           | 1 みずほFG劣後      | 0.9500 | 100,000   | 100,273   | 2024/07/16 |
|           | 1 明治安田2019基    | 0.2900 | 200,000   | 199,967   | 2024/08/02 |
|           | 1 三井住友FG劣後     | 0.8490 | 100,000   | 100,260   | 2024/09/12 |
|           | 163東日本旅客鉄      | 0.0500 | 300,000   | 298,428   | 2026/04/15 |
|           | 61 西日本高速道      | 0.0400 | 200,000   | 199,450   | 2026/06/19 |
|           | 90 中日本高速道      | 0.0500 | 300,000   | 299,212   | 2026/07/27 |
|           | 64 阪急阪神HLDG    | 0.1000 | 100,000   | 99,487    | 2026/12/08 |
|           | 86 東日本高速道      | 0.0400 | 200,000   | 199,200   | 2026/12/18 |
|           | 73 ホンダファイナンス   | 0.1000 | 200,000   | 198,499   | 2026/12/18 |
|           | 13 西日本旅客鉄      | 2.3400 | 100,000   | 107,494   | 2027/02/19 |
|           | 553 中部電力       | 0.2500 | 100,000   | 99,927    | 2027/02/25 |
|           | 2 三菱HCキャピタル    | 0.1900 | 200,000   | 198,073   | 2027/03/01 |
|           | 11 プリチストン      | 0.2950 | 200,000   | 199,886   | 2027/04/21 |
|           | 550 関西電力       | 0.3900 | 300,000   | 300,698   | 2027/05/25 |
|           | 13 大和ハウス       | 0.2850 | 100,000   | 100,011   | 2027/06/01 |
|           | 17 アサヒグループHD   | 0.2900 | 100,000   | 100,011   | 2027/06/01 |
|           | 9 サントリーホールディング | 0.3000 | 100,000   | 100,050   | 2027/06/08 |

## 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  |
|     | 207 オリックス     | 0.3500 | 200,000     | 198,905     | 2027/06/15 |
|     | 30 東レ         | 0.3750 | 100,000     | 100,212     | 2027/07/16 |
|     | 32 東海旅客鉄道     | 2.3100 | 100,000     | 108,336     | 2027/09/17 |
|     | 56 東京電力PG     | 0.9800 | 200,000     | 202,584     | 2027/10/19 |
|     | 31 KDDI       | 0.4300 | 200,000     | 200,282     | 2027/10/27 |
|     | 38 京王電鉄       | 0.2950 | 100,000     | 99,912      | 2027/11/29 |
|     | 38 ソニーG       | 0.4500 | 100,000     | 100,140     | 2027/12/08 |
|     | 17 NTTファイナンス  | 0.2800 | 200,000     | 199,106     | 2027/12/20 |
|     | 126東日本旅客鉄     | 0.2750 | 200,000     | 199,203     | 2028/01/26 |
|     | 24三菱ケミカルホールデイ | 0.3700 | 100,000     | 99,423      | 2028/02/25 |
|     | 7 ジェイテクト      | 0.3450 | 100,000     | 99,400      | 2028/03/08 |
|     | 7 ファーストリテイリング | 0.4050 | 100,000     | 99,681      | 2028/06/06 |
|     | 9 TDK         | 0.2600 | 100,000     | 98,711      | 2028/12/01 |
|     | 51 住友商事       | 1.2410 | 100,000     | 103,728     | 2029/04/23 |
|     | 508 東北電力      | 0.4650 | 200,000     | 199,863     | 2029/04/25 |
|     | 547 東北電力      | 0.5000 | 100,000     | 100,050     | 2029/06/25 |
|     | 60 西日本旅客鉄     | 0.2550 | 100,000     | 97,716      | 2030/05/21 |
|     | 52 東海旅客鉄道     | 2.1110 | 100,000     | 110,347     | 2030/06/21 |
|     | 45 東京地下鉄      | 0.2150 | 200,000     | 194,032     | 2030/09/18 |
|     | 41 大阪瓦斯       | 0.2200 | 300,000     | 287,849     | 2031/06/03 |
|     | 135 三菱地所      | 0.2600 | 200,000     | 193,391     | 2031/06/20 |
|     | 546 中部電力      | 0.2800 | 200,000     | 192,686     | 2031/09/25 |
|     | 496 九州電力      | 0.3300 | 200,000     | 192,854     | 2031/10/24 |
|     | 11 東急         | 0.4790 | 100,000     | 97,571      | 2032/06/01 |
|     | 185 東日本旅客鉄    | 0.5490 | 100,000     | 97,386      | 2032/10/14 |
|     | 65 三菱地所       | 2.0400 | 100,000     | 111,292     | 2032/12/20 |
|     | 小 計           | -      | 7,000,000   | 6,985,552   | -          |
|     | 合 計           | -      | 123,026,244 | 125,458,523 | -          |

## ■ 投資信託財産の構成

(2023年6月20日現在)

| 項 目                     | 期 末         |       |
|-------------------------|-------------|-------|
|                         | 評 価 額       | 比 率   |
|                         | 千円          | %     |
| 公 社 債                   | 125,458,523 | 98.8  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,496,195   | 1.2   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 126,954,719 | 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

(2023年6月20日現在)

| 項 目                           | 期 末              |
|-------------------------------|------------------|
| (A) 資 産                       | 126,954,719,610円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等               | 735,326,385      |
| 公 社 債 ( 評 価 額 )               | 125,458,523,836  |
| 未 収 入 金                       | 592,542,600      |
| 未 収 利 息                       | 163,366,851      |
| 前 払 費 用                       | 4,959,938        |
| (B) 負 債                       | 130,964,821      |
| 未 払 解 約 金                     | 130,964,074      |
| そ の 他 未 払 費 用                 | 747              |
| (C) 純 資 産 総 額 ( A - B )       | 126,823,754,789  |
| 元 本                           | 92,132,941,515   |
| 次 期 繰 越 損 益 金                 | 34,690,813,274   |
| (D) 受 益 権 総 口 数               | 92,132,941,515口  |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D ) | 13,765円          |

※当期における期首元本額89,046,647,330円、期中追加設定元本額13,876,905,039円、期中一部解約元本額10,790,610,854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          | 53,739,183,996円 |
| 三井住友DS・国内債券インデックス年金ファンド       | 1,248,435,969円  |
| 日興FWS・日本債インデックス               | 7,486,997,154円  |
| SMAM・国内債券インデックス・ファンド          | 2,001,324,170円  |
| 国内債券インデックスファンドV A<適格機関投資家限定>  | 31,293,159円     |
| SMAM・年金国内債券バシプファンド<適格機関投資家限定> | 27,625,707,067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2022年6月21日 至2023年6月20日)

| 項 目                         | 当 期             |
|-----------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益               | 953,792,747円    |
| 受 取 利 息                     | 954,033,991     |
| 支 払 利 息                     | △ 241,244       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益         | △ 409,485,709   |
| 売 買 損 益                     | 383,041,847     |
| 売 買 損 益                     | △ 792,527,556   |
| (C) そ の 他 費 用 等             | △ 19,772        |
| (D) 当 期 損 益 金 ( A + B + C ) | 544,287,266     |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金           | 32,992,764,829  |
| (F) 解 約 差 損 益 金             | △ 3,877,288,949 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金         | 5,031,050,128   |
| (H) 合 計 ( D + E + F + G )   | 34,690,813,274  |
| 次 期 繰 越 損 益 金 ( H )         | 34,690,813,274  |

※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)

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

第 23 期

決算日 2023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、円換算ベース）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。<br>外国株式インデックス・マザーファンド<br>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、円換算ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。<br>■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。   |
| 組入制限       | 当ファンド<br>■株式への実質投資割合には、制限を設けません。<br>■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>外国株式インデックス・マザーファンド<br>■株式への投資割合には、制限を設けません。<br>■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。<br>■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。<br>■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(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

| 項目  | 金額                        | 比率                                      | 項目の概要   |
|---|---------------------------|---|---|
| (a) 信託報酬<br>(投信会社)<br>(販売会社)<br>(受託会社)        | 42円<br>(6)<br>(6)<br>(31) | 0.082%<br>(0.011)<br>(0.011)<br>(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)<br>投信会社：ファンド運用の指図等の対価<br>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<br>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<br>(株式)<br>(先物・オプション)<br>(投資信託証券) | 3<br>(2)<br>(1)<br>(0)    | 0.005<br>(0.004)<br>(0.001)<br>(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<br>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<br>(株式)<br>(投資信託証券)               | 4<br>(4)<br>(0)           | 0.007<br>(0.007)<br>(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<br>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<br>(保管費用)<br>(監査費用)<br>(その他)        | 30<br>(17)<br>(13)<br>(0) | 0.058<br>(0.032)<br>(0.026)<br>(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<br>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<br>監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用<br>その他：信託事務の処理等に要するその他費用              |
| 合計  | 78                        | 0.153                                   |   |

期中の平均基準価額は51,273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(2022年12月1日から2023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<br>18,958 | 千円<br>117,920 | 千口<br>133,894 | 千円<br>892,468 |

## ■ 組入れ資産の明細 (2023年11月30日現在)

親投資信託残高

| 種 類                | 期首(前期末)       |               | 期 末             |       |
|--------------------|---------------|---------------|-----------------|-------|
|                    | 口 数           | 口 数           | 口 数             | 評 価 額 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 千口<br>449,296 | 千口<br>334,360 | 千口<br>2,505,597 |       |

※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81,052,032,606口です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年11月30日現在)

| 項 目                       | 期 末            |
|---------------------------|----------------|
| (A) 資 産                   | 2,511,944,715円 |
| コール・ローン等                  | 3,776,773      |
| 外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)   | 2,505,597,953  |
| 未 収 入 金                   | 2,569,989      |
| (B) 負 債                   | 3,979,335      |
| 未 払 解 約 金                 | 2,569,989      |
| 未 払 信 託 報 酬               | 1,075,496      |
| そ の 他 未 払 費 用             | 333,850        |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B)     | 2,507,965,380  |
| 元 本                       | 434,409,048    |
| 次 期 繰 越 損 益 金             | 2,073,556,332  |
| (D) 受 益 権 総 口 数           | 434,409,048口   |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 57,733円        |

※当期における期首元本額582,920,969円、期中追加設定元本額31,050,971円、期中一部解約元本額179,562,892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7号および第11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2022年12月1日 至2023年11月30日)

| 項 目                       | 当 期             |
|---------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | △ 1,500円        |
| 受 取 利 息                   | 326             |
| 支 払 利 息                   | △ 1,826         |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | 453,919,079     |
| 売 買 益                     | 530,923,641     |
| 売 買 損                     | △ 77,004,562    |
| (C) 信 託 報 酬 等             | △ 2,815,214     |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 451,102,365     |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 1,126,110,693   |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 496,343,274     |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 729,133,573)  |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | (△ 232,790,299) |
| (G) 合 計 (D + E + F)       | 2,073,556,332   |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G)         | 2,073,556,332   |
| 追 加 信 託 差 損 益 金           | 496,343,274     |
| ( 配 当 等 相 当 額 )           | ( 729,278,584)  |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )         | (△ 232,935,310) |
| 分 配 準 備 積 立 金             | 1,577,213,058   |

※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           | 41,260,219円   |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益       | 409,842,146   |
| (c) 収益調整金                 | 729,278,584   |
| (d) 分配準備積立金               | 1,126,110,693 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d)      | 2,306,491,642 |
| 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 53,094.93     |
| (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21期（2022年12月1日から2023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、円換算ベース）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)<br>MSCIコクサイ・インデックス |            | 株 式 組 入 率<br>比 | 株 式 先 物 率<br>比<br>(買建-売建) | 投 資 信 託 証 券<br>組 入 比 率 | 純 資 産 額<br>総 |
|------------------|---------|------------|-----------------------------|------------|----------------|---------------------------|------------------------|--------------|
|                  | 円       | 騰 落 率<br>% | (配当込み、<br>円換算ベース)           | 騰 落 率<br>% |                |                           |                        |              |
| 17期（2019年12月2日）  | 38,813  | 11.9       | 404.43                      | 12.2       | 95.2           | 2.1                       | 2.7                    | 232,418      |
| 18期（2020年11月30日） | 42,581  | 9.7        | 444.41                      | 9.9        | 96.8           | 0.9                       | 2.3                    | 254,097      |
| 19期（2021年11月30日） | 58,337  | 37.0       | 609.64                      | 37.2       | 95.5           | 2.2                       | 2.4                    | 353,818      |
| 20期（2022年11月30日） | 61,258  | 5.0        | 641.79                      | 5.3        | 93.1           | 4.7                       | 2.3                    | 442,201      |
| 21期（2023年11月30日） | 74,937  | 22.3       | 786.53                      | 22.6       | 95.9           | 2.0                       | 2.0                    | 607,380      |

※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)<br>MSCIコクサイ・インデックス |        | 株 式 組 入 率<br>比 | 株 式 先 物 率<br>比<br>(買建-売建) | 投 資 信 託<br>証 券 組 入 率<br>比 |
|----------------------|-------------|-------------------|-----------------------------|--------|----------------|---------------------------|---------------------------|
|                      | 騰 落 率       | (配当込み、<br>円換算ベース) | 騰 落 率                       |        |                |                           |                           |
| (期 首)<br>2022年11月30日 | 円<br>61,258 | %<br>—            | 641.79                      | %<br>— | %<br>93.1      | %<br>4.7                  | %<br>2.3                  |
| 12月末                 | 57,507      | △ 6.1             | 602.34                      | △ 6.1  | 95.4           | 2.3                       | 2.3                       |
| 2023年 1月末            | 59,679      | △ 2.6             | 625.57                      | △ 2.5  | 93.7           | 4.0                       | 2.4                       |
| 2月末                  | 61,781      | 0.9               | 647.08                      | 0.8    | 95.5           | 2.3                       | 2.3                       |
| 3月末                  | 61,473      | 0.4               | 644.11                      | 0.4    | 95.7           | 2.1                       | 2.2                       |
| 4月末                  | 63,159      | 3.1               | 661.64                      | 3.1    | 95.5           | 2.5                       | 2.2                       |
| 5月末                  | 66,108      | 7.9               | 693.28                      | 8.0    | 95.8           | 2.0                       | 2.1                       |
| 6月末                  | 71,314      | 16.4              | 748.33                      | 16.6   | 95.3           | 2.6                       | 2.1                       |
| 7月末                  | 72,403      | 18.2              | 759.87                      | 18.4   | 96.7           | 1.3                       | 2.1                       |
| 8月末                  | 73,668      | 20.3              | 773.08                      | 20.5   | 95.6           | 2.4                       | 2.0                       |
| 9月末                  | 71,897      | 17.4              | 754.47                      | 17.6   | 96.3           | 1.8                       | 2.0                       |
| 10月末                 | 69,481      | 13.4              | 729.35                      | 13.6   | 96.1           | 1.9                       | 2.0                       |
| (期 末)<br>2023年11月30日 | 74,937      | 22.3              | 786.53                      | 22.6   | 95.9           | 2.0                       | 2.0                       |

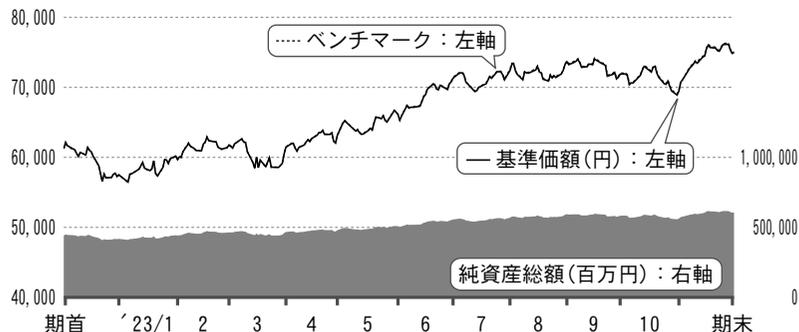
※騰落率は期首比です。

※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（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

### 基準価額等の推移



※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、円換算ベース）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（2022年12月1日から2023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、円換算ベース）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 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・ AI技術に関わる成長期待からテクノロジー関連銘柄への物色が継続したほか、底堅い景気を背景に業績の上方修正が続き、株価が上昇したこと</li> <li>・ 円が米ドル、ユーロに対し下落したこと</li> </ul> |
| 下落要因 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 米国の地方銀行の破綻をきっかけにグローバルでリスクオフ（リスク回避）の展開が強まったこと</li> </ul>  |

### ▶ 投資環境について（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

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

#### 株式市場

2022年末にかけては、世界の主要中央銀行が大幅利上げを実施したことで世界経済の先行き不透明感が高まり、株式市場は下落しました。

2023年に入り、インフレ圧力の継続や米国地方銀行の破綻を受けたグローバルの金融リスクの高まりを受け、株式市場では不安定な動きが続きしました。

その後、AI技術に関わる成長期待から、テクノロジー関連銘柄を中心に物色が進んだこと、消費者物価指数が鈍化する中、利上げは最終局面にあるとの見方が相場を下支えしました。

8月から10月にかけては、格付け会社による米国債の格下げや雇用統計など底堅い景気指標などをきっかけとした長期金利（10年国債利回り）の上昇が重石となりました。

期末はFRB（米連邦準備制度理事会）議長が追加利上げへ慎重な姿勢を見せ、長期金利が低下に転じたことから反発しました。

#### 為替市場

米ドル・円は米ドル高・円安となりました。総じて堅調な経済指標が続く中、FRBの利上げ継続観測が強まる一方、緩和姿勢を維持する日銀との金融政策の方向性の違いが意識されました。日銀の政策修正への警戒感が強まったことから一時米ドル安・円高となる局面もありました。

ユーロ・円はユーロ高・円安となりました。ECB（欧州中央銀行）高官による利上げ継続に前向きな姿勢が見られた一方、日銀は金融緩和姿勢を維持したことから、ユーロ高・円安が進行しました。

▶ ポートフォリオについて (2022年12月1日から2023年11月30日まで)

**株式組入比率**

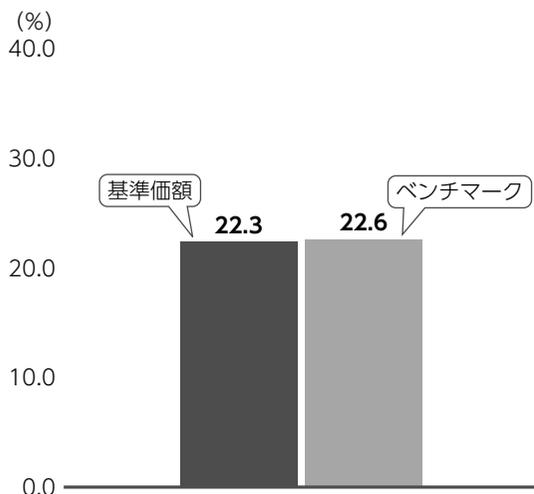
M S C I コクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース) の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100% (投資信託証券、先物含む) を維持しました。

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 (2022年12月1日から2023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、円換算ベース) をベンチマークとしています。

記載のグラフは、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+22.3%となり、ベンチマークの騰落率+22.6%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、円換算ベース）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（2022年12月1日から2023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<br>(株 式)<br>(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)<br>(投 資 信 託 証 券) | 3円<br>( 3)<br>( 1)<br>( 0) | 0.005%<br>(0.004)<br>(0.001)<br>(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<br>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<br>(株 式)<br>(投 資 信 託 証 券)                      | 5<br>( 4)<br>( 0)          | 0.007<br>(0.007)<br>(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<br>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<br>(保 管 費 用)<br>(そ の 他)                            | 22<br>(22)<br>( 0)         | 0.033<br>(0.033)<br>(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<br>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<br>そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合 計  | 30                         | 0.045                                   |  |

期中の平均基準価額は66,511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の状況 (2022年12月1日から2023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<br>44,254.7<br>( 738.63)    | 千アメリカ・ドル<br>441,317<br>(△ 8,847) | 百株<br>5,349.84 | 千アメリカ・ドル<br>17,233     |       |
|         | カ ナ ダ           | 百株<br>5,343.16<br>( 64.64)     | 千カナダ・ドル<br>29,602<br>(△ 1,345)   | 百株<br>637.87   | 千カナダ・ドル<br>730         |       |
|         | オーストラリア         | 百株<br>9,402.24<br>(△ 341.43)   | 千オーストラリア・ドル<br>19,975<br>( )     | 百株<br>1,420.54 | 千オーストラリア・ドル<br>2,190   |       |
|         | 香 港             | 百株<br>7,880                    | 千香港・ドル<br>32,417                 | 百株<br>1,170    | 千香港・ドル<br>1,592        |       |
|         | シンガポール          | 百株<br>19,717<br>( 18,016.27)   | 千シンガポール・ドル<br>3,879<br>( )       | 百株<br>217      | 千シンガポール・ドル<br>283      |       |
|         | ニュージーランド        | 百株<br>2,075.18                 | 千ニュージーランド・ドル<br>2,028            | 百株<br>1,322.1  | 千ニュージーランド・ドル<br>948    |       |
|         | イギリス            | 百株<br>32,720.28<br>(△ 1,077.8) | 千イギリス・ポンド<br>23,155<br>(△ 518)   | 百株<br>4,111.49 | 千イギリス・ポンド<br>2,543     |       |
|         | イスラエル           | 百株<br>722.64                   | 千イスラエル・シケル<br>3,176              | 百株<br>1,929.04 | 千イスラエル・シケル<br>2,483    |       |
|         | スイス             | 百株<br>2,255.98<br>( 419.28)    | 千スイス・フラン<br>15,669<br>(△ 196)    | 百株<br>4,187.68 | 千スイス・フラン<br>1,067      |       |
|         | デンマーク           | 百株<br>520.68<br>( 1,227.85)    | 千デンマーク・クローネ<br>32,928<br>( )     | 百株<br>64.84    | 千デンマーク・クローネ<br>1,095   |       |
|         | ノルウェー           | 百株<br>773.74<br>( )            | 千ノルウェー・クローネ<br>11,002<br>(△ 23)  | 百株<br>-        | 千ノルウェー・クローネ<br>-       |       |
|         | スウェーデン          | 百株<br>4,813.15<br>( 341.71)    | 千スウェーデン・クローナ<br>68,722<br>( )    | 百株<br>3,055.53 | 千スウェーデン・クローナ<br>28,325 |       |
|         | 国               | ユーロ                            | 百株                               | 千ユーロ           | 百株                     | 千ユーロ  |
|         |                 | アイルランド                         | 1,854.05                         | 2,149          | 551.74                 | 2,826 |
| オランダ    |                 | 1,846.75<br>( 969.05)          | 10,066<br>(△ 29)                 | 375.46         | 2,172                  |       |
| ベルギー    |                 | 214.35                         | 1,510                            | 114            | 190                    |       |
| ルクセンブルグ |                 | 152.38                         | 209                              | 769.56         | 152                    |       |
| フランス    | 2,803.04<br>( ) | 18,150<br>(△ 42)               | 752.28                           | 1,578          |                        |       |

## 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<br>国 | ド イ ツ       | 2,923.99<br>( - )     | 14,510<br>(△ 244) | 164.9  | 453 |
|        | ポ ル ト ガ ル   | 760.27                | 605               | 337.5  | 307 |
|        | ス ペ イ ン     | 4,691.49<br>(△ 133.3) | 3,788<br>(△ 7)    | 628.02 | 582 |
|        | イ タ リ ア     | 3,583.01<br>( - )     | 2,470<br>(△ 1)    | 491.49 | 927 |
|        | フ ィ ン ラ ン ド | 1,560.29<br>( 364.23) | 2,041<br>( - )    | 429.21 | 205 |
|        | オ ー ス ト リ ア | 207.98                | 796               | 115.25 | 506 |
|        | そ の 他       | 139.15<br>( - )       | 1,629<br>(△ 19)   | -      | -   |

※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<br>国 | ア メ リ カ                      |               | 千アメリカ・ドル   |                | 千アメリカ・ドル    |
|        | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 1,149         | 198        | -              | -           |
|        | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 3,695         | 434        | -              | -           |
|        | VORNADO REALTY TRUST         | -             | -          | 8,706          | 220         |
|        | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 1,035         | 229        | -              | -           |
|        | EQUITY RESIDENTIAL           | 3,519         | 220        | -              | -           |
|        | EQUINIX INC                  | 1,033         | 786        | -              | -           |
|        | AMERICAN TOWER CORP          | 6,119         | 1,280      | -              | -           |
|        | SUN COMMUNITIES INC          | 2,989         | 407        | -              | -           |
|        | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 13,088        | 240        | -              | -           |
|        | AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 6,197         | 212        | -              | -           |
|        | REALTY INCOME CORP           | 13,198        | 819        | -              | -           |
|        | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 1,701         | 247        | -              | -           |
|        | INVITATION HOMES INC         | 7,859         | 266        | -              | -           |
|        | VICI PROPERTIES INC          | 16,298        | 538        | -              | -           |
|        | KIMCO REALTY CORP            | 9,655         | 221        | -              | -           |
|        | NET LEASE OFFICE PROPERTY    | -<br>( 1,118) | -<br>( - ) | 1,118<br>( - ) | 12<br>( - ) |
|        | VENTAS INC                   | 4,979         | 231        | -              | -           |
|        | WEYERHAEUSER CO              | 6,906         | 215        | -              | -           |
|        | CROWN CASTLE INC             | 6,098         | 764        | -              | -           |
|        | IRON MOUNTAIN INC            | 4,115         | 261        | -              | -           |
|        | PROLOGIS INC                 | 10,103        | 1,265      | -              | -           |
|        | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 3,570         | 492        | -              | -           |
|        | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 1,852         | 212        | -              | -           |
|        | WELLTOWER INC                | 10,214        | 773        | -              | -           |
|        | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 3,070         | 193        | -              | -           |
|        | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 12,664        | 274        | -              | -           |

## 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                            |                           | PUBLIC STORAGE               | 1,572     | 476         | —         | —           |
|                              |                           | REGENCY CENTERS CORP         | 3,493     | 217         | —         | —           |
|                              |                           | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 4,339     | 527         | —         | —           |
|                              |                           | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 6,798     | 1,023       | —         | —           |
|                              |                           | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 16,934    | 218         | 48,792    | 402         |
|                              |                           | WP CAREY INC                 | 5,711     | 422         | —         | —           |
|                              | 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 |
|                              |                           | LENLEASE GROUP               | 27,389    | 216         | —         | —           |
|                              |                           | TRANSURBAN GROUP             | 45,857    | 649         | —         | —           |
|                              |                           | APA GROUP                    | 14,093    | 141         | —         | —           |
|                              |                           | MIRVAC GROUP                 | 75,244    | 175         | —         | —           |
|                              |                           | STOCKLAND                    | 66,431    | 252         | —         | —           |
|                              |                           | GOODMAN GROUP                | 27,697    | 616         | —         | —           |
|                              | 香 港                       |                              | □         | 千香港・ドル      | □         | 千香港・ドル      |
|                              |                           | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  | —         | —           | 193,500   | 967         |
|                              |                           | LINK REIT                    | 52,800    | 2,735       | —         | —           |
|                              |                           | LINK REIT-RIGHTS             | —         | —           | 27,320    | —           |
|                              |                           |                              | ( 27,320) | ( —)        | ( —)      | ( —)        |
|                              | 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     | 48,000    | 133         | —         | —           |
|                              |                           |                              | ( —)      | (△ 4)       | ( —)      | ( —)        |
|                              |                           | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 105,200   | 218         | —         | —           |
|                              |                           |                              | ( —)      | (△ 1)       | ( —)      | ( —)        |
|                              |                           | MAPLETREE LOGISTICS TRUST    | —         | —           | —         | —           |
|                              |                           |                              | ( —)      | (△ 8)       | ( —)      | ( —)        |
| KEPPEL REIT                  | —                         | —                            | 18,880    | 15          |           |             |
|                              | ( 18,880)                 | ( —)                         | ( —)      | ( —)        |           |             |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST      | —                         | —                            | 10,045    | 10          |           |             |
|                              | ( 10,045)                 | ( —)                         | ( —)      | ( —)        |           |             |
| MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST | —                         | —                            | —         | —           |           |             |
|                              | ( —)                      | (△ 1)                        | ( —)      | ( —)        |           |             |
| イ ギ リ ス                      |                           | □                            | 千イギリス・ポンド | □           | 千イギリス・ポンド |             |
|                              | LAND SECURITIES GROUP PLC | 19,996                       | 149       | —           | —         |             |
|                              | SEGR0 PLC                 | 10,423                       | 79        | —           | —         |             |
|                              | BRITISH LAND CO PLC       | —                            | —         | 49,008      | 158       |             |
| ユ<br>ー<br>ロ                  | ベルギー<br>フランス              |                              | □         | 千ユーロ        | □         | 千ユーロ        |
|                              |                           | WAREHOUSES DE PAUW SCA       | 7,674     | 199         | 4,169     | 120         |
|                              |                           | UNIBAIL-R0DAMCO-WESTFIELD    | 1,918     | 120         | —         | —           |
|                              |                           | KLEPIERRE                    | 4,572     | 109         | —         | —           |
|                              |                           | ( —)                         | (△ 11)    | ( —)        | ( —)      |             |

※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<br>128,458 | 百万円<br>139,916 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

※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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

| 項 目                           | 当 期           |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額         | 90,081,144千円  |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 498,612,728千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a) / (b)        | 0.18          |

※(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 (2022年12月1日から2023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

(2022年12月1日から2023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 (2023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<br>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 INC  | 72.44     | 89.63    | 1,708    | 251,299       | 商業・専門サービス              |
| FIRST SOLAR INC                     | —         | 68.59    | 1,066    | 156,790       | 半導体・半導体製造装置            |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO             | 130.3     | 165.77   | 4,061    | 597,353       | 保険                     |
| ABBOTT LABORATORIES                 | 1,108.13  | 1,314.77 | 13,624   | 2,003,823     | ヘルスケア機器・サービス           |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS           | 42.03     | 47.59    | 2,202    | 323,867       | 素材                     |
| VERISK ANALYTICS INC                | 96.74     | 113.54   | 2,705    | 397,854       | 商業・専門サービス              |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC           | 28.44     | 34.32    | 1,369    | 201,443       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| LAS VEGAS SANDS CORP                | 234.49    | 279.77   | 1,268    | 186,554       | 消費者サービス                |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC        | 28.87     | 33.99    | 1,877    | 276,169       | 半導体・半導体製造装置            |
| SVB FINANCIAL GROUP                 | 37.27     | —        | —        | —             | 銀行                     |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES INC | 382.49    | 427.49   | 2,487    | 365,783       | 金融サービス                 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC          | 17.45     | 21       | 4,597    | 676,100       | 消費者サービス                |
| AFLAC INC                           | 377.79    | 446.28   | 3,642    | 535,773       | 保険                     |
| DARDEN RESTAURANTS INC              | 76.06     | 93.23    | 1,451    | 213,526       | 消費者サービス                |
| MONSTER BEVERAGE CORP               | 260.21    | 600.52   | 3,285    | 483,190       | 食品・飲料・タバコ              |
| ADOBE INC                           | 302.05    | 340.76   | 21,038   | 3,094,085     | ソフトウェア・サービス            |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC          | 140.2     | 140.2    | 1,047    | 154,128       | 素材                     |
| LULULEMON ATHLETICA INC             | 72.14     | 83.57    | 3,663    | 538,760       | 耐久消費財・アパレル             |
| GARMIN LTD                          | 107.74    | 107.74   | 1,303    | 191,728       | 耐久消費財・アパレル             |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC        | 136.78    | 170.56   | 4,545    | 668,445       | 素材                     |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC         | 434.97    | 505.21   | 9,814    | 1,443,375     | 資本財                    |
| WR BERKLEY CORP                     | 144.86    | 144.86   | 1,022    | 150,346       | 保険                     |
| AUTOZONE INC                        | 12.12     | 13.15    | 3,414    | 502,157       | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR          | 738.73    | 822.14   | 796      | 117,163       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DR HORTON INC                       | 209.92    | 240.3    | 3,058    | 449,748       | 耐久消費財・アパレル             |
| DENTSPLY SIRONA INC                 | 118.64    | 177.15   | 555      | 81,625        | ヘルスケア機器・サービス           |
| AUTODESK INC                        | 133.58    | 161.46   | 3,452    | 507,806       | ソフトウェア・サービス            |
| ALLIANT ENERGY CORP                 | 166.41    | 212.04   | 1,058    | 155,736       | 公益事業                   |
| CITIGROUP INC                       | 1,207.48  | 1,438.67 | 6,581    | 968,002       | 銀行                     |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC          | 63.59     | 63.59    | 722      | 106,184       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING           | 269.47    | 305.87   | 7,009    | 1,030,860     | 商業・専門サービス              |
| AMERICAN ELECTRIC POWER             | 318.24    | 373.02   | 2,954    | 434,573       | 公益事業                   |
| HESS CORP                           | 179.13    | 211.98   | 2,958    | 435,090       | エネルギー                  |
| DAVITA INC                          | 41.38     | 41.38    | 412      | 60,620        | ヘルスケア機器・サービス           |
| DOMINO'S PIZZA INC                  | 21.21     | 28.75    | 1,117    | 164,420       | 消費者サービス                |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC       | 353.37    | 416.49   | 4,693    | 690,262       | 金融サービス                 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO           | 365.18    | 422.89   | 3,095    | 455,201       | 食品・飲料・タバコ              |
| BUNGE LTD                           | 102.63    | —        | —        | —             | 食品・飲料・タバコ              |
| TE CONNECTIVITY LTD                 | 198.05    | 231.94   | 3,025    | 444,915       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| APPLE INC                           | 10,249.49 | 11,787.3 | 223,216  | 32,828,391    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES         | 186.45    | 186.45   | 1,657    | 243,747       | 金融サービス                 |
| BOEING CO/THE                       | 353.54    | 433.59   | 9,731    | 1,431,147     | 資本財                    |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP           | 105.1     | 105.1    | 1,057    | 155,590       | 保険                     |
| BECTON DICKINSON AND CO             | 184.31    | 210.72   | 4,966    | 730,417       | ヘルスケア機器・サービス           |
| NISOURCE INC                        | 258.29    | 348.55   | 899      | 132,305       | 公益事業                   |
| ABBVIE INC                          | 1,124.3   | 1,330.33 | 18,425   | 2,709,775     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC          | 2,671.77  | 3,185.19 | 12,027   | 1,768,851     | 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  | 邦貨換算金額    |                        |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 814.17   | 971.22   | 34,836 | 5,123,432 | 金融サービス                 |
| KINDER MORGAN INC            | 1,273.94 | 1,561.97 | 2,705  | 397,873   | エネルギー                  |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 832.28   | 1,016.87 | 3,267  | 480,507   | 銀行                     |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 1,358.37 | 1,593.54 | 7,763  | 1,141,811 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL  | 190.58   | 190.58   | 845    | 124,418   | 保険                     |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 73.23    | 73.23    | 1,314  | 193,320   | 金融サービス                 |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 1,865.39 | 2,198.09 | 33,920 | 4,988,750 | 銀行                     |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 136.63   | 173.03   | 1,715  | 252,337   | 金融サービス                 |
| FAIR ISAAC CORP              | 14.94    | 18.71    | 2,011  | 295,833   | ソフトウェア・サービス            |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 28.88    | 28.88    | 675    | 99,282    | 資本財                    |
| THE CIGNA GROUP              | 203.47   | 223.35   | 5,871  | 863,477   | ヘルスケア機器・サービス           |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 189.5    | 226.43   | 1,318  | 193,912   | 食品・飲料・タバコ              |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | 174.92   | 203.18   | 5,591  | 822,373   | ソフトウェア・サービス            |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 71.31    | 79.78    | 2,779  | 408,727   | 金融サービス                 |
| MERCADOLIBRE INC             | 28.89    | 33.84    | 5,450  | 801,561   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 142.55   | 158      | 2,036  | 299,479   | 生活必需品流通・小売り            |
| SERVICENOW INC               | 129.25   | 154.73   | 10,505 | 1,544,982 | ソフトウェア・サービス            |
| CATERPILLAR INC              | 340.65   | 390.51   | 9,741  | 1,432,648 | 資本財                    |
| BROWN & BROWN INC            | 142.73   | 184.24   | 1,344  | 197,720   | 保険                     |
| CHARLES RIVER LABORATORIES   | 34.67    | 34.67    | 683    | 100,499   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CENTENE CORP                 | 366.96   | 403      | 2,840  | 417,729   | ヘルスケア機器・サービス           |
| CORNING INC                  | 517.62   | 584.7    | 1,650  | 242,668   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 55.3     | 63.08    | 1,148  | 168,890   | 運輸                     |
| MOSAIC CO/THE                | 213.06   | 254.89   | 928    | 136,526   | 素材                     |
| CISCO SYSTEMS INC            | 2,640.08 | 3,046.23 | 14,637 | 2,152,683 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MORGAN STANLEY               | 830.31   | 924.28   | 7,260  | 1,067,760 | 金融サービス                 |
| BROADCOM INC                 | 257.42   | 332.29   | 31,262 | 4,597,825 | 半導体・半導体製造装置            |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 187.97   | 187.97   | 1,410  | 207,501   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| DTE ENERGY COMPANY           | 120.57   | 162.77   | 1,695  | 249,296   | 公益事業                   |
| DOMINION ENERGY INC          | 526.1    | 605.34   | 2,828  | 416,024   | 公益事業                   |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 79.12    | 91.71    | 1,504  | 221,213   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DEERE & CO                   | 185.94   | 207.18   | 7,540  | 1,108,923 | 資本財                    |
| VMWARE INC-CLASS A           | 138.09   | —        | —      | —         | ソフトウェア・サービス            |
| BLACKSTONE INC               | 453.04   | 532.94   | 5,935  | 872,912   | 金融サービス                 |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    | —        | 44.06    | 563    | 82,910    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| NASDAQ INC                   | 229.24   | 279.99   | 1,559  | 229,362   | 金融サービス                 |
| ZOETIS INC                   | 294.34   | 342.74   | 6,025  | 886,100   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 221.6    | 252.3    | 2,269  | 333,729   | 公益事業                   |
| KKR & CO INC                 | 373.08   | 472.24   | 3,529  | 519,086   | 金融サービス                 |
| COGNEX CORP                  | 86.98    | 113.68   | 427    | 62,879    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ALPHABET INC-CL C            | 3,569.93 | 3,965.9  | 54,094 | 7,955,733 | メディア・娯楽                |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 500.68   | 589.56   | 4,591  | 675,270   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HCA HEALTHCARE INC           | 145.75   | 150.58   | 3,750  | 551,607   | ヘルスケア機器・サービス           |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 226.62   | 266.47   | 8,280  | 1,217,860 | ヘルスケア機器・サービス           |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 171.44   | 192.14   | 1,806  | 265,625   | 素材                     |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 281.36   | 334.32   | 19,653 | 2,890,416 | 生活必需品流通・小売り            |
| AECOM                        | —        | 102.61   | 900    | 132,497   | 資本財                    |
| CUMMINS INC                  | 91.44    | 101.59   | 2,275  | 334,600   | 資本財                    |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 506.81   | —        | —      | —         | メディア・娯楽                |
| DELTA AIR LINES INC          | 82.99    | 141.92   | 519    | 76,475    | 運輸                     |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 87.26    | 87.26    | 711    | 104,681   | 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     |                        |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN     | 118.11   | 133.2    | 1,836   | 270,103    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| COTERRA ENERGY INC           | 499.08   | 597.41   | 1,558   | 229,209    | エネルギー                  |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 33.74    | 41.65    | 3,968   | 583,646    | 資本財                    |
| MASIMO CORP                  | 29.41    | —        | —       | —          | ヘルスケア機器・サービス           |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 42.65    | 45.12    | 4,394   | 646,286    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 462.12   | 528.08   | 1,055   | 155,174    | 生活必需品流通・小売り            |
| SEAGEN INC                   | 89.54    | 103.28   | 2,205   | 324,323    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COCA-COLA CO/THE             | 2,620.91 | 3,098.73 | 18,043  | 2,653,717  | 食品・飲料・タバコ              |
| ENTEGRIS INC                 | 99.61    | 99.61    | 1,041   | 153,103    | 半導体・半導体製造装置            |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 104.36   | 104.36   | 1,247   | 183,441    | 運輸                     |
| BURLINGTON STORES INC        | 48.02    | 48.02    | 823     | 121,132    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 217.78   | 217.78   | 535     | 78,759     | 金融サービス                 |
| CSX CORP                     | 1,372.54 | 1,548.35 | 4,912   | 722,542    | 運輸                     |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 62.45    | 62.45    | 1,336   | 196,631    | ヘルスケア機器・サービス           |
| EXPEDIA GROUP INC            | 100.81   | 100.81   | 1,368   | 201,264    | 消費者サービス                |
| AMAZON.COM INC               | 5,804.71 | 6,920.35 | 101,258 | 14,892,096 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 390.84   | 440.49   | 2,970   | 436,830    | ヘルスケア機器・サービス           |
| EXXON MOBIL CORP             | 2,672.58 | 3,001.85 | 30,720  | 4,518,127  | エネルギー                  |
| EVEREST GROUP LTD            | 27.55    | 35.47    | 1,427   | 209,883    | 保険                     |
| EOG RESOURCES INC            | 370.69   | 438.3    | 5,401   | 794,414    | エネルギー                  |
| EQT CORP                     | 192.98   | 264.11   | 1,049   | 154,399    | エネルギー                  |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 103      | 103      | 1,191   | 175,264    | ソフトウェア・サービス            |
| CENCORA INC                  | 102.49   | 122.09   | 2,435   | 358,253    | ヘルスケア機器・サービス           |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 195.56   | 231.21   | 2,950   | 433,857    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FORD MOTOR CO                | 2,562.95 | 2,992    | 3,168   | 465,995    | 自動車・自動車部品              |
| HORMEL FOODS CORP            | 194.75   | 255.36   | 778     | 114,432    | 食品・飲料・タバコ              |
| LIBERTY GLOBAL HOLDINGS LTD/ | 84.32    | —        | —       | —          | 電気通信サービス               |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 441.24   | 622.28   | 2,182   | 321,047    | 食品・飲料・タバコ              |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 117.21   | 151.91   | 1,993   | 293,163    | 公益事業                   |
| EVERSOURCE ENERGY            | 221.16   | 253.75   | 1,515   | 222,831    | 公益事業                   |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 707.71   | 803.3    | 4,656   | 684,865    | 金融サービス                 |
| MSCI INC                     | 50.79    | 62.23    | 3,276   | 481,925    | 金融サービス                 |
| FORTINET INC                 | 433.92   | 476.04   | 2,551   | 375,260    | ソフトウェア・サービス            |
| ALLY FINANCIAL INC           | 201.39   | 201.39   | 576     | 84,827     | 金融サービス                 |
| ELEVANCE HEALTH INC          | 151.16   | 174.96   | 8,141   | 1,197,434  | ヘルスケア機器・サービス           |
| NEXTERA ENERGY INC           | 1,254.22 | 1,519.7  | 8,868   | 1,304,359  | 公益事業                   |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 186.42   | 228.21   | 6,593   | 969,664    | ソフトウェア・サービス            |
| T-MOBILE US INC              | 394.41   | 413.44   | 6,182   | 909,333    | 電気通信サービス               |
| ELECTRONIC ARTS INC          | 183.78   | 194.28   | 2,667   | 392,332    | メディア・娯楽                |
| FREEPORT-MCMORAN INC         | 941.69   | 1,067.89 | 3,969   | 583,771    | 素材                     |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 321.12   | 321.12   | 1,002   | 147,443    | 金融サービス                 |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 343.63   | 326.36   | 4,811   | 707,583    | エネルギー                  |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 469.03   | 681.47   | 2,162   | 318,010    | 食品・飲料・タバコ              |
| US BANCORP                   | 913.39   | 1,161.2  | 4,388   | 645,368    | 銀行                     |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 861.38   | 1,026.47 | 1,695   | 249,390    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| F5 INC                       | 39.21    | 39.21    | 666     | 98,061     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 62.92    | 76.77    | 2,947   | 433,456    | 運輸                     |
| FASTENAL CO                  | 370.51   | 415.51   | 2,478   | 364,454    | 資本財                    |
| FISERV INC                   | 379.74   | 469.55   | 6,074   | 893,317    | 金融サービス                 |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 707.21   | 826.51   | 9,823   | 1,444,800  | 資本財                    |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 49.14    | 57.03    | 1,234   | 181,570    | ヘルスケア機器・サービス           |

## 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           | 期首(前期末)  |          | 期 末    |           | 業 種 等                  |
|------------------------------|----------|----------|--------|-----------|------------------------|
|                              | 株 数      | 株 数      | 評 価 額  |           |                        |
|                              |          |          | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 30.07    | 37.78    | 684    | 100,730   | 商業・専門サービス              |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC     | 139.45   | —        | —      | —         | 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    | 75.5     | 436    | 64,268    | 金融サービス                 |
| TRANSUNION                   | 112.33   | 145.03   | 852    | 125,396   | 商業・専門サービス              |
| MATCH GROUP INC              | 177.99   | 177.99   | 578    | 85,022    | メディア・娯楽                |
| GODADDY INC - CLASS A        | 89.05    | 118.95   | 1,164  | 171,301   | ソフトウェア・サービス            |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 42.41    | 52.76    | 1,840  | 270,741   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GENERAL MOTORS CO            | 871.13   | 1,043.01 | 3,295  | 484,729   | 自動車・自動車部品              |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | 110.49   | 130.65   | 2,009  | 295,502   | エネルギー                  |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I | 71.66    | 106.48   | 724    | 106,550   | 資本財                    |
| HOLOGIC INC                  | 165.91   | 197.3    | 1,392  | 204,859   | ヘルスケア機器・サービス           |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 148.67   | 177.78   | 4,352  | 640,135   | 資本財                    |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 219.77   | 249.77   | 8,498  | 1,249,899 | 金融サービス                 |
| FIRST HORIZON CORP           | —        | 390.14   | 493    | 72,583    | 銀行                     |
| ALPHABET INC-CL A            | 3,806.93 | 4,452.27 | 60,101 | 8,839,082 | メディア・娯楽                |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 42.03    | 42.03    | 570    | 83,911    | ヘルスケア機器・サービス           |
| WABTEC CORP                  | 112.84   | 127.82   | 1,472  | 216,558   | 資本財                    |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 32.57    | 41.89    | 991    | 145,775   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 109.7    | —        | —      | —         | 銀行                     |
| CELANESE CORP                | 66.43    | 87.42    | 1,201  | 176,704   | 素材                     |
| VAIL RESORTS INC             | 28.6     | 28.6     | 615    | 90,525    | 消費者サービス                |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | 34.28    | 46.73    | 1,639  | 241,103   | ヘルスケア機器・サービス           |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 72.56    | 76.01    | 3,032  | 445,921   | メディア・娯楽                |
| GENERAL MILLS INC            | 373.27   | 422.68   | 2,645  | 389,081   | 食品・飲料・タバコ              |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 135.99   | 155.37   | 1,769  | 260,310   | ヘルスケア機器・サービス           |
| FIRSTENERGY CORP             | 319.66   | 379.7    | 1,404  | 206,505   | 公益事業                   |
| GENUINE PARTS CO             | 87.11    | 102.45   | 1,371  | 201,691   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| FORTIVE CORP                 | 219.81   | 250.83   | 1,698  | 249,779   | 資本財                    |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 424.45   | 495.41   | 1,407  | 206,995   | 銀行                     |
| XYLEM INC                    | 122.01   | 168.31   | 1,742  | 256,197   | 資本財                    |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 119.65   | 143.88   | 2,714  | 399,212   | 資本財                    |
| LKQ CORP                     | 159.22   | 189.82   | 842    | 123,922   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| HALLIBURTON CO               | 548.52   | 675.81   | 2,520  | 370,729   | エネルギー                  |
| TELADOC HEALTH INC           | 74.96    | —        | —      | —         | ヘルスケア機器・サービス           |
| HOME DEPOT INC               | 650.45   | 751.03   | 23,358 | 3,435,339 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| ALBEMARLE CORP               | 74.33    | 83.38    | 1,028  | 151,297   | 素材                     |
| CDW CORP/DE                  | 86.21    | 98.55    | 2,090  | 307,397   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ASSURANT INC                 | 31.14    | 31.14    | 510    | 75,016    | 保険                     |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 881.61   | 1,050.07 | 1,168  | 171,884   | 銀行                     |
| HERSHEY CO/THE               | 89.25    | 111.8    | 2,076  | 305,368   | 食品・飲料・タバコ              |
| HUMANA INC                   | 80.18    | 94.98    | 4,581  | 673,864   | ヘルスケア機器・サービス           |
| BLOCK INC                    | 314.99   | 384.43   | 2,449  | 360,317   | 金融サービス                 |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 124.01   | 144.39   | 3,087  | 454,034   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SPLUNK INC                   | 97.92    | 122.34   | 1,842  | 270,967   | ソフトウェア・サービス            |
| S&P GLOBAL INC               | 217.47   | 248.87   | 10,319 | 1,517,636 | 金融サービス                 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 26.53    | 26.53    | 628    | 92,506    | 金融サービス                 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 303.66   | 361.22   | 983    | 144,711   | 銀行                     |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 41.41    | —        | —      | —         | メディア・娯楽                |
| HP INC                       | 697.11   | 664.19   | 1,930  | 283,962   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC  | 49.71    | 49.71    | 775    | 114,056   | 金融サービス                 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 563.97   | 688.71   | 10,772 | 1,584,254 | 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    |           |                        |
|                               |          |          | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| HUBBELL INC                   | —        | 38.97    | 1,148  | 168,879   | 資本財                    |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A     | 83.42    | 103.15   | 1,788  | 262,991   | ヘルスケア機器・サービス           |
| SNAP INC - A                  | 640.99   | 706.89   | 917    | 134,943   | メディア・娯楽                |
| TARGA RESOURCES CORP          | 123.5    | 154.16   | 1,356  | 199,539   | エネルギー                  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 107.72   | 126.52   | 1,986  | 292,153   | メディア・娯楽                |
| LEIDOS HOLDINGS INC           | 88.63    | 88.63    | 941    | 138,455   | 商業・専門サービス              |
| DUPONT DE NEMOURS INC         | 304.9    | 342.01   | 2,443  | 359,338   | 素材                     |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C         | 210.79   | —        | —      | —         | 電気通信サービス               |
| BLACK KNIGHT INC              | 106.56   | —        | —      | —         | ソフトウェア・サービス            |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION   | 79.4     | 120.89   | 643    | 94,639    | 運輸                     |
| JUNIPER NETWORKS INC          | 174.6    | 211.51   | 593    | 87,223    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| JM SMUCKER CO/THE             | 66.47    | 81.72    | 887    | 130,497   | 食品・飲料・タバコ              |
| INGERSOLL-RAND INC            | 250.11   | 293.14   | 2,040  | 300,060   | 資本財                    |
| JOHNSON & JOHNSON             | 1,665.36 | 1,804.42 | 27,447 | 4,036,635 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ON SEMICONDUCTOR              | 278.91   | 312.06   | 2,234  | 328,697   | 半導体・半導体製造装置            |
| SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC    | 33.19    | 41.04    | 322    | 47,410    | 半導体・半導体製造装置            |
| HOWMET AEROSPACE INC          | 238.89   | 277.83   | 1,433  | 210,799   | 資本財                    |
| QORVO INC                     | 60.42    | 78.35    | 751    | 110,493   | 半導体・半導体製造装置            |
| IDEXX LABORATORIES INC        | 55.48    | 60.43    | 2,820  | 414,812   | ヘルスケア機器・サービス           |
| ARISTA NETWORKS INC           | 148.47   | 202.86   | 4,448  | 654,273   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| EXACT SCIENCES CORP           | 97.71    | 135.7    | 882    | 129,842   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EVERGY INC                    | 133.33   | 172.75   | 874    | 128,657   | 公益事業                   |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A       | 39.92    | —        | —      | —         | ソフトウェア・サービス            |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC        | 106.77   | 106.77   | 1,024  | 150,745   | 半導体・半導体製造装置            |
| KIMBERLY-CLARK CORP           | 213.36   | 253.78   | 3,090  | 454,487   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| NORDSON CORP                  | 28.84    | 39.27    | 913    | 134,336   | 資本財                    |
| PAYLOCITY HOLDING CORP        | —        | 27.18    | 421    | 61,971    | 商業・専門サービス              |
| KROGER CO                     | 419.15   | 498.9    | 2,177  | 320,200   | 生活必需品流通・小売り            |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN  | 110.8    | 110.8    | 926    | 136,229   | メディア・娯楽                |
| POOL CORP                     | 25.78    | 32.52    | 1,122  | 165,156   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC     | 133.36   | 158.81   | 715    | 105,172   | 消費者サービス                |
| DOCUSIGN INC                  | 120.31   | 171.64   | 748    | 110,110   | ソフトウェア・サービス            |
| FOX CORP - CLASS B            | 87.73    | 87.73    | 242    | 35,726    | メディア・娯楽                |
| DOW INC                       | 445.43   | 538.62   | 2,764  | 406,609   | 素材                     |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A  | 52.2     | 86.88    | 825    | 121,398   | 金融サービス                 |
| CBRE GROUP INC - A            | 207.93   | 235.02   | 1,865  | 274,372   | 不動産管理・開発               |
| COUPA SOFTWARE INC            | 34.9     | —        | —      | —         | ソフトウェア・サービス            |
| AXON ENTERPRISE INC           | —        | 46.72    | 1,055  | 155,190   | 資本財                    |
| KLA CORP                      | 94.74    | 100.49   | 5,467  | 804,084   | 半導体・半導体製造装置            |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A   | 139.27   | 183.07   | 1,243  | 182,949   | ソフトウェア・サービス            |
| COPART INC                    | 275.84   | 621.64   | 3,121  | 459,134   | 商業・専門サービス              |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY        | 70.72    | 80.71    | 1,615  | 237,625   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| NRG ENERGY INC                | 135.47   | 203.49   | 953    | 140,209   | 公益事業                   |
| TWILIO INC - A                | 109.05   | 109.05   | 721    | 106,059   | ソフトウェア・サービス            |
| CORTEVA INC                   | 444.4    | 539      | 2,452  | 360,681   | 素材                     |
| LOCKHEED MARTIN CORP          | 153.36   | 170.95   | 7,607  | 1,118,827 | 資本財                    |
| IDEX CORP                     | 47.88    | 60.48    | 1,199  | 176,383   | 資本財                    |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A   | 12.88    | 22.44    | 643    | 94,707    | 保険                     |
| EPAM SYSTEMS INC              | 37.33    | 48.15    | 1,261  | 185,519   | ソフトウェア・サービス            |
| LENNOX INTERNATIONAL INC      | 21.04    | 21.04    | 844    | 124,129   | 資本財                    |
| EQUITABLE HOLDINGS INC        | 228.2    | 228.2    | 683    | 100,549   | 金融サービス                 |

## 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           | 期首(前期末)  |          | 期末     |           | 業種等                    |
|------------------------------|----------|----------|--------|-----------|------------------------|
|                              | 株数       | 株数       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 181.57   | 205.94   | 2,396  | 352,426   | 金融サービス                 |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC   | 49.92    | 61.64    | 1,336  | 196,555   | 金融サービス                 |
| RESMED INC                   | 87.75    | 107.58   | 1,708  | 251,329   | ヘルスケア機器・サービス           |
| BATH & BODY WORKS INC        | 154      | 154      | 493    | 72,589    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| DATADOG INC - CLASS A        | 140.23   | 189.11   | 2,205  | 324,431   | ソフトウェア・サービス            |
| VISTRA CORP                  | 257.77   | 257.77   | 900    | 132,382   | 公益事業                   |
| GENERAC HOLDINGS INC         | 39.73    | 39.73    | 459    | 67,546    | 資本財                    |
| LOWE'S COS INC               | 400.32   | 438.14   | 8,759  | 1,288,229 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| UNITED RENTALS INC           | 47.98    | 53.83    | 2,563  | 377,012   | 資本財                    |
| ELI LILLY & CO               | 511.14   | 606.86   | 35,917 | 5,282,403 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 80.29    | 106.37   | 1,323  | 194,718   | 商業・専門サービス              |
| LAM RESEARCH CORP            | 85.5     | 102.43   | 7,313  | 1,075,581 | 半導体・半導体製造装置            |
| REPLIGEN CORP                | -        | 34.56    | 551    | 81,064    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| OKTA INC                     | 103.37   | 103.37   | 731    | 107,588   | ソフトウェア・サービス            |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP   | -        | 110.73   | 653    | 96,179    | 半導体・半導体製造装置            |
| LOEWS CORP                   | 127.27   | 127.27   | 871    | 128,234   | 保険                     |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       | 12.2     | 17.28    | 526    | 77,382    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MARKEL GROUP INC             | 8.37     | 9.57     | 1,354  | 199,178   | 保険                     |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 130.21   | 169.59   | 3,975  | 584,730   | ソフトウェア・サービス            |
| GEN DIGITAL INC              | 417.79   | 417.79   | 909    | 133,764   | ソフトウェア・サービス            |
| ROLLINS INC                  | 160.81   | 160.81   | 646    | 95,050    | 商業・専門サービス              |
| ETSY INC                     | 71.68    | 90.9     | 701    | 103,206   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| DYNATRACE INC                | 95.87    | 157.53   | 841    | 123,786   | ソフトウェア・サービス            |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 86.77    | -        | -      | -         | 保険                     |
| PLUG POWER INC               | 285.84   | -        | -      | -         | 資本財                    |
| MCDONALD'S CORP              | 468.04   | 542.94   | 15,222 | 2,238,839 | 消費者サービス                |
| BILL HOLDINGS INC            | 60.04    | 60.04    | 407    | 59,991    | ソフトウェア・サービス            |
| CABLE ONE INC                | 3.88     | -        | -      | -         | メディア・娯楽                |
| 3M CO                        | 351.01   | 424.82   | 4,183  | 615,223   | 資本財                    |
| META PLATFORMS INC-CLASS A   | 1,451.52 | 1,658.62 | 55,099 | 8,103,462 | メディア・娯楽                |
| ENPHASE ENERGY INC           | 83.02    | 103.81   | 1,048  | 154,139   | 半導体・半導体製造装置            |
| ANSYS INC                    | 59.08    | 67.63    | 2,021  | 297,256   | ソフトウェア・サービス            |
| COSTAR GROUP INC             | 251.16   | 308.36   | 2,588  | 380,672   | 不動産管理・開発               |
| IAC INC                      | 39.74    | -        | -      | -         | メディア・娯楽                |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A        | 147.43   | 203.23   | 3,563  | 524,014   | ソフトウェア・サービス            |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | 144.87   | 144.87   | 811    | 119,313   | 商業・専門サービス              |
| VIATRIS INC                  | 834.66   | 834.66   | 762    | 112,073   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOORDASH INC - A             | 116.27   | 201.42   | 1,912  | 281,298   | 消費者サービス                |
| ZSCALER INC                  | 45.51    | 62.71    | 1,253  | 184,307   | ソフトウェア・サービス            |
| AMETEK INC                   | 149.28   | 165.87   | 2,535  | 372,943   | 資本財                    |
| MODERNA INC                  | 219.41   | 237.9    | 1,879  | 276,439   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOLLAR TREE INC              | 139.92   | 159.23   | 1,928  | 283,638   | 生活必需品流通・小売り            |
| FOX CORP - CLASS A           | 169.62   | 238.86   | 706    | 103,911   | メディア・娯楽                |
| PHILLIPS 66                  | 312.8    | 338.14   | 4,132  | 607,803   | エネルギー                  |
| ROBLOX CORP -CLASS A         | 227.45   | 298.46   | 1,154  | 169,783   | メディア・娯楽                |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 221.98   | 221.98   | 875    | 128,725   | 消費者サービス                |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 151.62   | 184.25   | 1,184  | 174,183   | 食品・飲料・タバコ              |
| APA CORP                     | 197.59   | 197.59   | 717    | 105,515   | エネルギー                  |
| METLIFE INC                  | 437.46   | 475.92   | 3,005  | 442,079   | 保険                     |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 106.92   | 127.84   | 4,078  | 599,840   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 70.31    | 86.78    | 2,347  | 345,308   | 資本財                    |

## 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           | 期首(前期末)  |          | 期 末    |           | 業 種 等                  |
|------------------------------|----------|----------|--------|-----------|------------------------|
|                              | 株 数      | 株 数      | 評 価 額  |           |                        |
|                              |          |          | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| MERCK & CO. INC.             | 1,609.11 | 1,912.52 | 19,341 | 2,844,527 | 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   | 898    | 132,158   | 資本財                    |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 317.65   | 365.69   | 7,179  | 1,055,902 | 保険                     |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 496.81   | 611      | 2,905  | 427,283   | 金融サービス                 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 181.85   | 196.65   | 3,981  | 585,598   | 消費者サービス                |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 120.69   | 155.69   | 4,102  | 603,321   | ソフトウェア・サービス            |
| DARLING INGREDIENTS INC      | -        | 105.14   | 437    | 64,387    | 食品・飲料・タバコ              |
| BAKER HUGHES CO              | 609.81   | 780.82   | 2,603  | 382,860   | エネルギー                  |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 533.45   | 651.12   | 3,652  | 537,214   | 半導体・半導体製造装置            |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC     | -        | 98.01    | 1,322  | 194,434   | 資本財                    |
| CHENIERE ENERGY INC          | 149.77   | 177.54   | 3,203  | 471,143   | エネルギー                  |
| QUANTA SERVICES INC          | 88.91    | 104.16   | 1,933  | 284,332   | 資本財                    |
| NETAPP INC                   | 132.73   | 170.45   | 1,526  | 224,459   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NIKE INC -CL B               | 811.97   | 935.16   | 10,321 | 1,517,962 | 耐久消費財・アパレル             |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 150.62   | 170.33   | 3,663  | 538,784   | 運輸                     |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 364.42   | 401.24   | 3,329  | 489,668   | 半導体・半導体製造装置            |
| AFFIRM HOLDINGS INC          | 90.77    | -        | -      | -         | 金融サービス                 |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 72.52    | 136.34   | 1,742  | 256,298   | 金融サービス                 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 95.11    | 109.37   | 5,112  | 751,831   | 資本財                    |
| NEWMONT CORP                 | 508.98   | 863.38   | 3,486  | 512,734   | 素材                     |
| MCKESSON CORP                | 94.17    | 100.67   | 4,597  | 676,168   | ヘルスケア機器・サービス           |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 990.61   | 1,175.73 | 11,010 | 1,619,345 | 食品・飲料・タバコ              |
| NUCOR CORP                   | 174.84   | 189.97   | 3,111  | 457,583   | 素材                     |
| DECKERS OUTDOOR CORP         | -        | 18.72    | 1,226  | 180,328   | 耐久消費財・アパレル             |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A  | 276.58   | -        | -      | -         | メディア・娯楽                |
| WESTERN UNION CO             | 218.4    | -        | -      | -         | 金融サービス                 |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | 193.54   | 456.98   | 791    | 116,404   | 自動車・自動車部品              |
| NEWELL BRANDS INC            | 269.97   | -        | -      | -         | 耐久消費財・アパレル             |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 586.43   | 519.61   | 3,134  | 461,036   | エネルギー                  |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A    | -        | 319.65   | 285    | 41,933    | 金融サービス                 |
| LUCID GROUP INC              | 217.3    | 822.93   | 358    | 52,768    | 自動車・自動車部品              |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 242.07   | 311.81   | 2,877  | 423,130   | 金融サービス                 |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A   | 6.7      | 8.45     | 1,218  | 179,249   | 銀行                     |
| WEBSTER FINANCIAL CORP       | 96       | 139.18   | 619    | 91,169    | 銀行                     |
| CONSTELLATION ENERGY         | 202.34   | 250.08   | 3,015  | 443,484   | 公益事業                   |
| WARNER BROS DISCOVERY INC    | 1,361.45 | 1,659.16 | 1,788  | 263,045   | メディア・娯楽                |
| DRAFTKINGS INC-CL A          | -        | 322.65   | 1,234  | 181,599   | 消費者サービス                |
| APPROVIN CORP-CLASS A        | 89.26    | -        | -      | -         | ソフトウェア・サービス            |
| ALCOA CORP                   | 118.49   | -        | -      | -         | 素材                     |
| TOAST INC-CLASS A            | -        | 213.93   | 326    | 48,043    | 金融サービス                 |
| ARES MANAGEMENT CORP - A     | -        | 113.7    | 1,263  | 185,863   | 金融サービス                 |
| CARLISLE COS INC             | 34.99    | 34.99    | 962    | 141,571   | 資本財                    |
| PAYCHEX INC                  | 208.31   | 249.17   | 3,018  | 443,959   | 商業・専門サービス              |
| ALTRIA GROUP INC             | 1,164.8  | 1,345.04 | 5,616  | 826,075   | 食品・飲料・タバコ              |
| P G & E CORP                 | 918.94   | 1,492.97 | 2,563  | 377,003   | 公益事業                   |
| PFIZER INC                   | 3,564.55 | 4,199.49 | 12,632 | 1,857,797 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| XCEL ENERGY INC              | 335.65   | 407.56   | 2,445  | 359,639   | 公益事業                   |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 80.47    | 96.07    | 4,112  | 604,806   | 資本財                    |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 145.47   | 175.16   | 4,026  | 592,188   | エネルギー                  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 1,518.47 | 1,774.16 | 26,812 | 3,943,370 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EXELON CORP                  | 643.53   | 762.92   | 2,928  | 430,745   | 公益事業                   |

## 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    |                        |
| NVR INC                      | 1.73     | 2.5      | 1,526  | 224,543   | 耐久消費財・アパレル             |
| CONOCOPHILLIPS               | 825.11   | 917.05   | 10,451 | 1,537,119 | エネルギー                  |
| ABIOMED INC                  | 27.31    | —        | —      | —         | ヘルスケア機器・サービス           |
| PEPSICO INC                  | 879.89   | 1,038.27 | 17,355 | 2,552,505 | 食品・飲料・タバコ              |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 229.33   | 272.29   | 2,630  | 386,841   | 保険                     |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 404.16   | 476.44   | 15,881 | 2,335,714 | ソフトウェア・サービス            |
| PENTAIR PLC                  | 82.2     | 115.09   | 733    | 107,854   | 資本財                    |
| QUALCOMM INC                 | 716.9    | 832.12   | 10,643 | 1,565,361 | 半導体・半導体製造装置            |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 34.26    | —        | —      | —         | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 164.09   | 194.58   | 1,443  | 212,251   | 保険                     |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 68.37    | 80.98    | 6,547  | 963,008   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 142.32   | 160.65   | 2,569  | 377,863   | 商業・専門サービス              |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 26.17    | 27.88    | 8,716  | 1,281,876 | 消費者サービス                |
| ROSS STORES INC              | 222.58   | 247.02   | 3,191  | 469,373   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 55.5     | 71.11    | 1,150  | 169,265   | 素材                     |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 68.14    | 76.45    | 1,034  | 152,090   | ヘルスケア機器・サービス           |
| ROBERT HALF INC              | 81.49    | 81.49    | 655    | 96,477    | 商業・専門サービス              |
| RPM INTERNATIONAL INC        | 76.96    | 103.97   | 1,052  | 154,835   | 素材                     |
| REVVITY INC                  | 83.23    | 104.11   | 930    | 136,899   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HEICO CORP                   | 30.85    | 30.85    | 520    | 76,572    | 資本財                    |
| HEICO CORP-CLASS A           | 45.7     | 45.7     | 621    | 91,400    | 資本財                    |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 629.79   | 629.79   | 1,037  | 152,550   | 銀行                     |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP      | 4.17     | 4.17     | 688    | 101,318   | エネルギー                  |
| AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT  | 276.58   | —        | —      | —         | メディア・娯楽                |
| CHEVRON CORP                 | 1,181.31 | 1,364.57 | 19,637 | 2,888,091 | エネルギー                  |
| JACOBS SOLUTIONS INC         | 84.22    | 103.93   | 1,311  | 192,896   | 商業・専門サービス              |
| EDISON INTERNATIONAL         | 246.55   | 278.15   | 1,829  | 269,089   | 公益事業                   |
| TESLA INC                    | 1,671.95 | 2,142.41 | 52,304 | 7,692,466 | 自動車・自動車部品              |
| U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING | 58.5     | 58.5     | 313    | 46,158    | 運輸                     |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP       | —        | 76.95    | 613    | 90,270    | エネルギー                  |
| HF SINCLAIR CORP             | —        | 106.63   | 562    | 82,691    | エネルギー                  |
| ASPEN TECHNOLOGY INC         | —        | 19.01    | 354    | 52,164    | ソフトウェア・サービス            |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 91.29    | 108.69   | 994    | 146,199   | 資本財                    |
| OVINTIV INC                  | —        | 166.72   | 732    | 107,689   | エネルギー                  |
| SYNOPSYS INC                 | 93.83    | 116.69   | 6,446  | 948,109   | ソフトウェア・サービス            |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY     | —        | 311.6    | 2,109  | 310,294   | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | —        | 35.37    | 820    | 120,719   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GRACO INC                    | —        | 116.45   | 932    | 137,181   | 資本財                    |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM    | —        | 40.56    | 1,096  | 161,208   | 素材                     |
| TORO CO                      | —        | 80.97    | 668    | 98,255    | 資本財                    |
| LINDE PLC                    | —        | 369.66   | 15,207 | 2,236,558 | 素材                     |
| WATSCO INC                   | —        | 23.64    | 899    | 132,272   | 資本財                    |
| SOUTHERN CO/THE              | 685.72   | 809.27   | 5,683  | 835,872   | 公益事業                   |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW | —        | 123.83   | 333    | 49,062    | メディア・娯楽                |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C | —        | 134.38   | 851    | 125,259   | メディア・娯楽                |
| SYSCO CORP                   | 311.26   | 363.52   | 2,606  | 383,382   | 生活必需品流通・小売り            |
| KENVUE INC                   | —        | 1,126.11 | 2,261  | 332,558   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC     | —        | 46.48    | 1,039  | 152,855   | ソフトウェア・サービス            |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 150.31   | 167.19   | 2,966  | 436,300   | 保険                     |
| VERALTO CORP                 | —        | 176.4    | 1,309  | 192,550   | 商業・専門サービス              |
| SIGNATURE BANK               | 43.35    | —        | —      | —         | 銀行                     |

## 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                                | 期首(前期末)       |                  | 期 末            |                    | 業 種 等                  |
|-----------------------------------|---------------|------------------|----------------|--------------------|------------------------|
|                                   | 株 数           | 株 数              | 評 価 額          |                    |                        |
|                                   |               |                  | 外貨建金額          | 邦貨換算金額             |                        |
| SUPER MICRO COMPUTER INC          | —             | 35.4             | 1,018          | 149,748            | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SCHLUMBERGER LTD                  | 894.55        | 1,051.97         | 5,456          | 802,497            | エネルギー                  |
| AT&T INC                          | 4,577.81      | 5,345.92         | 8,713          | 1,281,545          | 電気通信サービス               |
| SOUTHWEST AIRLINES CO             | 70.76         | 140.57           | 356            | 52,366             | 運輸                     |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE<br>SEMPRA | 151.87<br>199 | 182.66<br>488.38 | 4,999<br>3,562 | 735,316<br>523,971 | 素材<br>公益事業             |
| TYLER TECHNOLOGIES INC            | 24.06         | 31.39            | 1,278          | 188,035            | ソフトウェア・サービス            |
| TEXAS INSTRUMENTS INC             | 588.9         | 687.25           | 10,528         | 1,548,451          | 半導体・半導体製造装置            |
| SALESFORCE INC                    | 635.19        | 735.6            | 16,944         | 2,492,034          | ソフトウェア・サービス            |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION      | 428.95        | 524.7            | 2,768          | 407,136            | 資本財                    |
| TERADYNE INC                      | 106.42        | 106.42           | 987            | 145,180            | 半導体・半導体製造装置            |
| UNION PACIFIC CORP                | 402.07        | 455.63           | 10,090         | 1,484,059          | 運輸                     |
| MARATHON OIL CORP                 | 423.8         | 423.8            | 1,072          | 157,690            | エネルギー                  |
| RTX CORP                          | 930.88        | 1,109.09         | 8,978          | 1,320,406          | 資本財                    |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B        | 470.01        | 540.32           | 8,228          | 1,210,170          | 運輸                     |
| DEXCOM INC                        | 248.41        | 302.45           | 3,513          | 516,783            | ヘルスケア機器・サービス           |
| AMEREN CORPORATION                | 169.37        | 199.79           | 1,538          | 226,220            | 公益事業                   |
| UNITEDHEALTH GROUP INC            | 593.75        | 700.17           | 37,457         | 5,508,903          | ヘルスケア機器・サービス           |
| VERISIGN INC                      | 64.25         | 64.25            | 1,360          | 200,040            | ソフトウェア・サービス            |
| VALERO ENERGY CORP                | 258.28        | 268.05           | 3,325          | 489,149            | エネルギー                  |
| ULTA BEAUTY INC                   | 32.87         | 37.34            | 1,568          | 230,652            | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| WALT DISNEY CO/THE                | 1,161.43      | 1,383.65         | 12,798         | 1,882,314          | メディア・娯楽                |
| WELLS FARGO & CO                  | 2,398.83      | 2,758.47         | 12,076         | 1,776,102          | 銀行                     |
| INSULET CORP                      | 42.63         | 50.82            | 960            | 141,200            | ヘルスケア機器・サービス           |
| WASTE MANAGEMENT INC              | 268.28        | 302.36           | 5,132          | 754,801            | 商業・専門サービス              |
| WHIRLPOOL CORP                    | 32.12         | 49.75            | 545            | 80,213             | 耐久消費財・アパレル             |
| WALMART INC                       | 964.31        | 1,117.44         | 17,441         | 2,565,048          | 生活必需品流通・小売り            |
| WYNN RESORTS LTD                  | 77.3          | 77.3             | 646            | 95,120             | 消費者サービス                |
| TJX COMPANIES INC                 | 734.17        | 850.65           | 7,494          | 1,102,175          | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| WATERS CORP                       | 40.95         | 40.95            | 1,145          | 168,473            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WASTE CONNECTIONS INC             | 161.22        | 201.67           | 2,674          | 393,405            | 商業・専門サービス              |
| WESTERN DIGITAL CORP              | 184.92        | 245.33           | 1,160          | 170,733            | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| WEC ENERGY GROUP INC              | 197.74        | 225.71           | 1,872          | 275,420            | 公益事業                   |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP      | 330.85        | 372.36           | 2,356          | 346,594            | 公益事業                   |
| VISA INC-CLASS A SHARES           | 1,041.54      | 1,217.62         | 30,955         | 4,552,633          | 金融サービス                 |
| PPL CORP                          | 471.99        | 555.23           | 1,445          | 212,554            | 公益事業                   |
| PULTEGROUP INC                    | 130.75        | 175.35           | 1,543          | 226,966            | 耐久消費財・アパレル             |
| PPG INDUSTRIES INC                | 151.81        | 167.35           | 2,335          | 343,462            | 素材                     |
| NORTHERN TRUST CORP               | 130.26        | 167.93           | 1,314          | 193,331            | 金融サービス                 |
| NVIDIA CORP                       | 1,588.98      | 1,851.05         | 89,109         | 13,105,341         | 半導体・半導体製造装置            |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP      | 262.02        | 303.37           | 4,016          | 590,634            | 銀行                     |
| TYSON FOODS INC-CL A              | 197.31        | 197.31           | 929            | 136,647            | 食品・飲料・タバコ              |
| NETFLIX INC                       | 284.48        | 331.45           | 15,816         | 2,326,127          | メディア・娯楽                |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC      | 247.75        | 286.88           | 14,140         | 2,079,700          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GLOBE LIFE INC                    | 63.73         | 63.73            | 766            | 112,716            | 保険                     |
| TEXTRON INC                       | 148.7         | 148.7            | 1,112          | 163,648            | 資本財                    |
| NEWS CORP - CLASS A               | 231.02        | 231.02           | 516            | 75,902             | メディア・娯楽                |
| OMNICOM GROUP                     | 125.45        | 151.06           | 1,205          | 177,264            | メディア・娯楽                |
| ORACLE CORP                       | 1,003.64      | 1,229.99         | 14,293         | 2,102,176          | ソフトウェア・サービス            |
| MASTERCARD INC - A                | 549.61        | 630.63           | 25,844         | 3,800,947          | 金融サービス                 |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC            | 497.58        | —                | —              | —                  | 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   | 邦貨換算金額     |                        |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 66.85    | 80.88    | 4,252   | 625,475    | ソフトウェア・サービス            |
| YUM! BRANDS INC              | 180.46   | 201.79   | 2,532   | 372,508    | 消費者サービス                |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 96.29    | 124.77   | 749     | 110,283    | 食品・飲料・タバコ              |
| BANK OF AMERICA CORP         | 4,589.12 | 5,412.47 | 16,405  | 2,412,712  | 銀行                     |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 115.57   | 138.32   | 1,241   | 182,555    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 405.11   | 473.98   | 7,935   | 1,167,125  | 金融サービス                 |
| ANALOG DEVICES INC           | 334.95   | 373.27   | 6,820   | 1,003,019  | 半導体・半導体製造装置            |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 1,013.83 | 1,218.18 | 15,087  | 2,218,868  | 半導体・半導体製造装置            |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 505.66   | 552.64   | 3,582   | 526,917    | 保険                     |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 160.97   | 160.97   | 1,704   | 250,729    | 消費者サービス                |
| AVERY DENNISON CORP          | 54.54    | 54.54    | 1,049   | 154,295    | 素材                     |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 327.59   | 367.63   | 2,577   | 379,120    | ソフトウェア・サービス            |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 366.97   | 417.63   | 3,688   | 542,407    | 資本財                    |
| AMGEN INC                    | 334.61   | 405.06   | 10,798  | 1,588,194  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EATON CORP PLC               | 250.62   | 294.68   | 6,653   | 978,585    | 資本財                    |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 104.39   | 127.01   | 3,022   | 444,475    | 食品・飲料・タバコ              |
| APPLIED MATERIALS INC        | 539.08   | 621.67   | 9,285   | 1,365,583  | 半導体・半導体製造装置            |
| CME GROUP INC                | 232.52   | 267.55   | 5,748   | 845,364    | 金融サービス                 |
| ECOLAB INC                   | 164.6    | 195.74   | 3,692   | 543,018    | 素材                     |
| EQUIFAX INC                  | 79.22    | 91.33    | 1,978   | 290,935    | 商業・専門サービス              |
| GILEAD SCIENCES INC          | 791.25   | 921.89   | 6,935   | 1,019,986  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| STATE STREET CORP            | 240.45   | 254.74   | 1,827   | 268,771    | 金融サービス                 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 912.82   | 1,111.07 | 6,623   | 974,057    | 金融サービス                 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 307.26   | 392.41   | 1,428   | 210,070    | ヘルスケア機器・サービス           |
| CAMPBELL SOUP CO             | 129.45   | 129.45   | 514     | 75,695     | 食品・飲料・タバコ              |
| CROWN HOLDINGS INC           | 68.63    | 94.13    | 791     | 116,383    | 素材                     |
| CARDINAL HEALTH INC          | 180      | 180      | 1,895   | 278,756    | ヘルスケア機器・サービス           |
| FEDEX CORP                   | 154.88   | 180.74   | 4,589   | 674,982    | 運輸                     |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 248.92   | 297.75   | 3,279   | 482,260    | 金融サービス                 |
| FMC CORP                     | 85.48    | 85.48    | 450     | 66,226     | 素材                     |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 156.29   | 176.59   | 1,328   | 195,380    | 素材                     |
| INTEL CORP                   | 2,618.39 | 3,160.85 | 14,204  | 2,089,108  | 半導体・半導体製造装置            |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 260.27   | 260.27   | 797     | 117,283    | メディア・娯楽                |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 217.67   | 217.67   | 1,675   | 246,433    | 保険                     |
| WOLFSPEED INC                | -        | 84.61    | 306     | 45,108     | 半導体・半導体製造装置            |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 196.22   | 232.64   | 5,602   | 823,984    | 資本財                    |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 565.5    | 565.5    | 265     | 39,088     | メディア・娯楽                |
| ILLUMINA INC                 | 103.27   | 115.73   | 1,175   | 172,876    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 67.76    | 75.61    | 1,105   | 162,540    | ソフトウェア・サービス            |
| SNAP-ON INC                  | 31.06    | 40.41    | 1,098   | 161,557    | 資本財                    |
| CARMAX INC                   | 103.66   | 103.66   | 654     | 96,289     | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| DANAHER CORP                 | 437.14   | 529.21   | 11,775  | 1,731,893  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DUKE ENERGY CORP             | 496.46   | 572.37   | 5,191   | 763,582    | 公益事業                   |
| TARGET CORP                  | 293.11   | 343.31   | 4,508   | 663,042    | 生活必需品流通・小売り            |
| JABIL INC                    | -        | 98.08    | 1,130   | 166,229    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CINTAS CORP                  | 57.07    | 69.98    | 3,842   | 565,110    | 商業・専門サービス              |
| CONAGRA BRANDS INC           | 308.96   | 397.22   | 1,113   | 163,690    | 食品・飲料・タバコ              |
| CLOROX COMPANY               | 73.84    | 91.04    | 1,295   | 190,582    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| ENTERGY CORP                 | 126.77   | 148      | 1,488   | 218,947    | 公益事業                   |
| MICROSOFT CORP               | 4,500.54 | 5,297.31 | 200,688 | 29,515,270 | ソフトウェア・サービス            |
| INCYTE CORP                  | 118.42   | 158.99   | 848     | 124,840    | 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    |                        |
| CVS HEALTH CORP              | 821.13  | 960.86   | 6,428 | 945,388   | ヘルスケア機器・サービス           |
| MEDTRONIC PLC                | 842.2   | 1,011.68 | 7,978 | 1,173,340 | ヘルスケア機器・サービス           |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 722.06  | 812.66   | 6,232 | 916,582   | 半導体・半導体製造装置            |
| BLACKROCK INC                | 95.88   | 110.45   | 8,253 | 1,213,905 | 金融サービス                 |
| HASBRO INC                   | 74.91   | 114.07   | 529   | 77,892    | 耐久消費財・アパレル             |
| KEYCORP                      | 627.41  | 627.41   | 780   | 114,787   | 銀行                     |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 889.48  | 1,006.07 | 7,086 | 1,042,249 | 食品・飲料・タバコ              |
| COOPER COS INC/THE           | 27.71   | 33.84    | 1,122 | 165,027   | ヘルスケア機器・サービス           |
| CHUBB LTD                    | 269.75  | 311.61   | 7,013 | 1,031,507 | 保険                     |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 41.3    | 41.3     | 493   | 72,632    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ALLSTATE CORP                | 180.7   | 205.03   | 2,777 | 408,553   | 保険                     |
| EBAY INC                     | 355.51  | 405.34   | 1,647 | 242,268   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 70.27   | 95.17    | 791   | 116,438   | 素材                     |
| DISH NETWORK CORP-A          | 129.37  | -        | -     | -         | メディア・娯楽                |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 142.45  | 170.09   | 2,136 | 314,190   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| TRIMBLE INC                  | 155.66  | 207.83   | 954   | 140,357   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| LENNAR CORP-A                | 171.26  | 193.31   | 2,451 | 360,607   | 耐久消費財・アパレル             |
| LEAR CORP                    | 37.36   | 37.36    | 503   | 74,071    | 自動車・自動車部品              |
| STRYKER CORP                 | 215.14  | 251.67   | 7,408 | 1,089,554 | ヘルスケア機器・サービス           |
| AES CORP                     | 418.93  | 540.86   | 931   | 136,975   | 公益事業                   |
| PROGRESSIVE CORP             | 366.19  | 434.69   | 7,085 | 1,042,056 | 保険                     |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 232.6   | 313.1    | 3,960 | 582,410   | 消費者サービス                |
| ALBERTSONS COS INC - CLASS A | -       | 203.78   | 434   | 63,835    | 生活必需品流通・小売り            |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 48.66   | 48.66    | 539   | 79,343    | 保険                     |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 378.96  | 453.11   | 4,086 | 600,949   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ARAMARK                      | 132.42  | 192.32   | 534   | 78,574    | 消費者サービス                |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B  | 116.82  | 181.66   | 956   | 140,610   | ソフトウェア・サービス            |
| ATMOS ENERGY CORP            | 87.26   | 108.02   | 1,210 | 178,008   | 公益事業                   |
| AVANTOR INC                  | 373.82  | 560.39   | 1,168 | 171,920   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PACCAR INC                   | 218.97  | 399.8    | 3,650 | 536,889   | 資本財                    |
| BIO-TECHNE CORP              | 25.51   | 132.96   | 839   | 123,427   | 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  | 205.78   | 1,167 | 171,748   | 公益事業                   |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 100.94  | 167.3    | 577   | 84,935    | 金融サービス                 |
| CARRIER GLOBAL CORP          | 558.22  | 613.24   | 3,201 | 470,877   | 資本財                    |
| CATALENT INC                 | 107.97  | 160.25   | 634   | 93,258    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 370.91  | 443.29   | 1,236 | 181,827   | 公益事業                   |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC     | 69.79   | 104.85   | 724   | 106,600   | 商業・専門サービス              |
| CHEWY INC - CLASS A          | 39.69   | 131.19   | 232   | 34,208    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 143.3   | 171.13   | 1,619 | 238,241   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | 141.79  | 192.1    | 1,504 | 221,242   | ソフトウェア・サービス            |
| DEVON ENERGY CORP            | 401.69  | 498.97   | 2,239 | 329,345   | エネルギー                  |
| DOVER CORP                   | 89.29   | 104.36   | 1,469 | 216,056   | 資本財                    |
| DROPBOX INC-CLASS A          | 165.84  | 165.84   | 465   | 68,487    | ソフトウェア・サービス            |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 208.11  | -        | -     | -         | 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  | 163.29   | 577   | 84,941    | 公益事業                   |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 23.77   | 29.46    | 1,338 | 196,872   | 金融サービス                 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 43.71   | 50.89    | 1,207 | 177,552   | 金融サービス                 |
| GARTNER INC                  | 53.57   | 61.79    | 2,657 | 390,869   | ソフトウェア・サービス            |
| WW GRAINGER INC              | 27.97   | 35.04    | 2,718 | 399,738   | 資本財                    |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC       | 47.31   | -        | -     | -         | ソフトウェア・サービス            |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 174.62  | 193.8    | 3,229 | 475,017   | 消費者サービス                |

## 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           | 期首(前期末) |          | 期末     |           | 業種等                    |
|------------------------------|---------|----------|--------|-----------|------------------------|
|                              | 株数      | 株数       | 評価額    | 評価額       |                        |
|                              |         |          | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| HUBSPOT INC                  | 25.61   | 33.18    | 1,647  | 242,290   | ソフトウェア・サービス            |
| HYATT HOTELS CORP - CL A     | —       | 33.71    | 383    | 56,423    | 消費者サービス                |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 234.72  | 234.72   | 840    | 123,548   | 素材                     |
| KELLANOVA                    | 158.43  | 195.03   | 1,007  | 148,176   | 食品・飲料・タバコ              |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | —       | 105.34   | 1,027  | 151,096   | 食品・飲料・タバコ              |
| LIBERTY BROADBAND-C          | 81.96   | 81.96    | 675    | 99,335    | メディア・娯楽                |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 123.83  | —        | —      | —         | メディア・娯楽                |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 134.38  | —        | —      | —         | メディア・娯楽                |
| LYFT INC-A                   | 187.51  | —        | —      | —         | 運輸                     |
| M & T BANK CORP              | 110.46  | 126.29   | 1,613  | 237,238   | 銀行                     |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 13.69   | 16.91    | 1,847  | 271,682   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MONGODB INC                  | 41.5    | 52.36    | 2,201  | 323,817   | ソフトウェア・サービス            |
| MOODY'S CORP                 | 105.11  | 125.18   | 4,530  | 666,247   | 金融サービス                 |
| BIOGEN INC                   | 95.74   | 111.14   | 2,579  | 379,310   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ONEOK INC                    | 282.26  | 436.15   | 2,939  | 432,270   | エネルギー                  |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 253.48  | 318.38   | 2,684  | 394,868   | 資本財                    |
| OWENS CORNING                | 52.05   | 75.97    | 1,019  | 149,873   | 資本財                    |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A  | 987.35  | 1,287.42 | 2,554  | 375,652   | ソフトウェア・サービス            |
| PINTEREST INC- CLASS A       | 383     | 481.15   | 1,601  | 235,498   | メディア・娯楽                |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 115.2   | 145.29   | 1,507  | 221,690   | 金融サービス                 |
| ROKU INC                     | 60.12   | 99.45    | 1,061  | 156,133   | メディア・娯楽                |
| UIPATH INC - CLASS A         | —       | 252.98   | 502    | 73,927    | ソフトウェア・サービス            |
| HENRY SCHEIN INC             | 75.59   | 104.57   | 697    | 102,517   | ヘルスケア機器・サービス           |
| SEALED AIR CORP              | 78.95   | 133.26   | 441    | 64,988    | 素材                     |
| SMITH (A. O.) CORP           | 71.57   | 106.52   | 799    | 117,650   | 資本財                    |
| STEEL DYNAMICS INC           | 127.13  | 127.13   | 1,468  | 215,931   | 素材                     |
| UNITY SOFTWARE INC           | 190.66  | 190.66   | 578    | 85,130    | ソフトウェア・サービス            |
| CONFLUENT INC-CLASS A        | —       | 159.54   | 338    | 49,789    | ソフトウェア・サービス            |
| STARBUCKS CORP               | 734.09  | 871.25   | 8,699  | 1,279,425 | 消費者サービス                |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A  | 289.06  | 326.08   | 2,294  | 337,470   | メディア・娯楽                |
| UGI CORP                     | 152.56  | —        | —      | —         | 公益事業                   |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 962.42  | 1,381.31 | 7,790  | 1,145,761 | 運輸                     |
| WAYFAIR INC- CLASS A         | 37.56   | —        | —      | —         | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| WESTLAKE CORP                | 21.89   | 21.89    | 281    | 41,455    | 素材                     |
| WESTROCK CO                  | 167.66  | 167.66   | 672    | 98,877    | 素材                     |
| PTC INC                      | 72.95   | 92.46    | 1,437  | 211,436   | ソフトウェア・サービス            |
| WILLIAMS COS INC             | 755.29  | 920.48   | 3,354  | 493,306   | エネルギー                  |
| ZILLOW GROUP INC - C         | 106.72  | 106.72   | 451    | 66,375    | 不動産管理・開発               |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC    | 153.82  | 246.29   | 350    | 51,507    | メディア・娯楽                |
| INTUIT INC                   | 171.98  | 212.12   | 12,244 | 1,800,754 | ソフトウェア・サービス            |
| BORGWARNER INC               | 174.33  | 174.33   | 595    | 87,581    | 自動車・自動車部品              |
| BEST BUY CO INC              | 121.32  | 149.54   | 1,058  | 155,665   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| BALL CORP                    | 194.1   | 234.69   | 1,286  | 189,215   | 素材                     |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 896.31  | 1,065.96 | 5,909  | 869,136   | ヘルスケア機器・サービス           |
| VULCAN MATERIALS CO          | 87.62   | 98.92    | 2,103  | 309,410   | 素材                     |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 161.59  | 193.46   | 6,790  | 998,670   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VF CORP                      | 205.83  | 205.83   | 352    | 51,854    | 耐久消費財・アパレル             |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B     | 409.64  | 409.64   | 590    | 86,814    | メディア・娯楽                |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 28.63   | 28.63    | 251    | 36,969    | 耐久消費財・アパレル             |
| CARNIVAL CORP                | 697.45  | 697.45   | 1,039  | 152,937   | 消費者サービス                |
| CLEVELAND-CLIFFS INC         | 334.03  | 334.03   | 564    | 83,022    | 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     | 邦貨換算金額     |                        |             |   |         |  |
| COMCAST CORP-CLASS A         | 2,796.7      | 3,131.5      | 13,036    | 1,917,268  | メディア・娯楽                |             |   |         |  |
| APTIV PLC                    | 174.16       | 211.17       | 1,737     | 255,504    | 自動車・自動車部品              |             |   |         |  |
| STERIS PLC                   | 62.71        | 75.25        | 1,485     | 218,507    | ヘルスケア機器・サービス           |             |   |         |  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 68.23        | 78.97        | 1,901     | 279,633    | 保険                     |             |   |         |  |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 132.6        | 158.03       | 943       | 138,751    | 食品・飲料・タバコ              |             |   |         |  |
| ATLASSIAN CORP-CL A          | —            | 109.41       | 2,139     | 314,658    | ソフトウェア・サービス            |             |   |         |  |
| LINDE PLC/OLD                | 320.85       | —            | —         | —          | 素材                     |             |   |         |  |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 207.85       | 271.62       | 730       | 107,457    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |   |         |  |
| FERGUSON PLC                 | —            | 160.77       | 2,711     | 398,834    | 資本財                    |             |   |         |  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 76           | 125.38       | 405       | 59,689     | 資本財                    |             |   |         |  |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 165.94       | 197.15       | 4,028     | 592,451    | 半導体・半導体製造装置            |             |   |         |  |
| AERCAP HOLDINGS NV           | 87.8         | 135.05       | 897       | 132,041    | 資本財                    |             |   |         |  |
| BUNGE GLOBAL SA              | —            | 123.43       | 1,334     | 196,232    | 食品・飲料・タバコ              |             |   |         |  |
| SEA LTD-ADR                  | 247.19       | 281.49       | 1,034     | 152,098    | メディア・娯楽                |             |   |         |  |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A     | 966.61       | 1,594.85     | 491       | 72,242     | 運輸                     |             |   |         |  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 116          | 116          | 457       | 67,319     | 資本財                    |             |   |         |  |
| TELEFLEX INC                 | 30.67        | 30.67        | 678       | 99,797     | ヘルスケア機器・サービス           |             |   |         |  |
| WIX.COM LTD                  | 31.94        | 41.19        | 420       | 61,856     | ソフトウェア・サービス            |             |   |         |  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 23           | 31.73        | 632       | 92,985     | ソフトウェア・サービス            |             |   |         |  |
| ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV | 62.49        | —            | —         | —          | 運輸                     |             |   |         |  |
| MONDAY.COM LTD               | —            | 18.79        | 328       | 48,360     | ソフトウェア・サービス            |             |   |         |  |
| GLOBAL-E ONLINE LTD          | —            | 88.96        | 305       | 44,967     | 一般消費財・サービス流通・小売り       |             |   |         |  |
| ALLEGION PLC                 | 47.64        | 68.43        | 715       | 105,259    | 資本財                    |             |   |         |  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 253.2        | 290.61       | 2,394     | 352,092    | 保険                     |             |   |         |  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       | 143.63       | 172.25       | 3,834     | 563,984    | 資本財                    |             |   |         |  |
| NOVOCURE LTD                 | 69.29        | —            | —         | —          | ヘルスケア機器・サービス           |             |   |         |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS  | 118          | 137.15       | 1,076     | 158,299    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |   |         |  |
| LIBERTY GLOBAL LTD-C         | —            | 210.79       | 356       | 52,360     | 電気通信サービス               |             |   |         |  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 40.89        | 40.89        | 467       | 68,712     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |   |         |  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 791          | 791          | 252       | 37,110     | 不動産管理・開発               |             |   |         |  |
| AMCOR PLC                    | 976.1        | 976.1        | 926       | 136,233    | 素材                     |             |   |         |  |
| AON PLC-CLASS A              | 131.51       | 148.65       | 4,788     | 704,173    | 保険                     |             |   |         |  |
| INVESCO LTD                  | 183.28       | 183.28       | 261       | 38,491     | 金融サービス                 |             |   |         |  |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR        | 53.75        | 65.33        | 356       | 52,402     | 金融サービス                 |             |   |         |  |
| CLARIVATE PLC                | 199.39       | 199.39       | 153       | 22,579     | 商業・専門サービス              |             |   |         |  |
| 小 計                          | 株 数<br>銘 柄 数 | 金 額<br><比 率> | 215,606.3 | 255,249.79 | 2,954,075              | 434,455,948 | — | <71.5%> |  |
| (カナダ)                        | 百株           | 百株           | 千カナダ・ドル   | 千円         |                        |             |   |         |  |
| IMPERIAL OIL LTD             | 162.67       | 162.67       | 1,272     | 137,704    | エネルギー                  |             |   |         |  |
| METRO INC/CN                 | 147.65       | 189.29       | 1,309     | 141,701    | 生活必需品流通・小売り            |             |   |         |  |
| HYDRO ONE LTD                | 188.21       | 247.47       | 929       | 100,527    | 公益事業                   |             |   |         |  |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 298.36       | 349.47       | 1,761     | 190,593    | 素材                     |             |   |         |  |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 44.38        | 44.38        | 449       | 48,619     | 素材                     |             |   |         |  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 13.38        | 14.8         | 4,759     | 515,000    | ソフトウェア・サービス            |             |   |         |  |
| WSP GLOBAL INC               | 76.68        | 92.6         | 1,726     | 186,807    | 資本財                    |             |   |         |  |
| AIR CANADA                   | 120.83       | 120.83       | 210       | 22,815     | 運輸                     |             |   |         |  |
| NUTRIEN LTD                  | 340.81       | 367.92       | 2,776     | 300,465    | 素材                     |             |   |         |  |
| QUEBECOR INC -CL B           | 145.78       | 145.78       | 433       | 46,898     | 電気通信サービス               |             |   |         |  |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | 441.54       | 441.54       | 364       | 39,465     | 公益事業                   |             |   |         |  |
| LUNDIN MINING CORP           | 464.46       | 464.46       | 432       | 46,791     | 素材                     |             |   |         |  |
| ALTAGAS LTD                  | 173.47       | 273.09       | 738       | 79,906     | 公益事業                   |             |   |         |  |

# 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    |                  |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | —        | 326.74   | 702    | 76,016    | 金融サービス           |
| STANTEC INC                  | —        | 99.39    | 964    | 104,334   | 資本財              |
| TFI INTERNATIONAL INC        | 50.97    | 50.97    | 808    | 87,535    | 運輸               |
| TOURMALINE OIL CORP          | 204.01   | 261.07   | 1,705  | 184,559   | エネルギー            |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 529.06   | 579.69   | 4,418  | 478,177   | 生活必需品流通・小売り      |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 310.91   | 342.21   | 2,281  | 246,919   | 素材               |
| ARC RESOURCES LTD            | 449.23   | 449.23   | 973    | 105,389   | エネルギー            |
| BRP INC/CA- SUB VOTING       | 30.82    | 30.82    | 292    | 31,682    | 耐久消費財・アパレル       |
| DESCARTES SYSTEMS GRP/THE    | —        | 64.24    | 705    | 76,382    | ソフトウェア・サービス      |
| BROOKFIELD ASSET MGMT-A      | —        | 235.55   | 1,142  | 123,671   | 金融サービス           |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 114.16   | 124.46   | 2,599  | 281,329   | 保険               |
| BCE INC                      | 55.09    | 55.09    | 292    | 31,666    | 電気通信サービス         |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 127.89   | 147.24   | 2,282  | 246,943   | 素材               |
| SUNCOR ENERGY INC            | 932.93   | 1,007.85 | 4,518  | 488,913   | エネルギー            |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 225.33   | 259.56   | 2,323  | 251,434   | 銀行               |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 742.87   | 889      | 5,308  | 574,402   | 銀行               |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 589.41   | 647.92   | 3,457  | 374,114   | 銀行               |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 1,164.32 | 1,397.36 | 11,640 | 1,259,565 | 銀行               |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 905.61   | 1,051.93 | 12,497 | 1,352,406 | 銀行               |
| TC ENERGY CORP               | 618.97   | 736.52   | 3,712  | 401,761   | エネルギー            |
| BARRICK GOLD CORP            | 1,147.92 | 1,255.29 | 2,967  | 321,113   | 素材               |
| THOMSON REUTERS CORP         | 113.7    | 126.39   | 2,389  | 258,598   | 商業・専門サービス        |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 91.48    | 91.48    | 335    | 36,349    | 生活必需品流通・小売り      |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 225.95   | 284.51   | 1,633  | 176,777   | 電気通信サービス         |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 272.43   | 364.83   | 2,648  | 286,612   | 素材               |
| KINROSS GOLD CORP            | 635.01   | 1,101.56 | 873    | 94,525    | 素材               |
| BANK OF MONTREAL             | 425.03   | 536.93   | 5,911  | 639,694   | 銀行               |
| CAMECO CORP                  | 266.27   | 335.86   | 2,017  | 218,351   | エネルギー            |
| TELUS CORP                   | 152.22   | 152.22   | 363    | 39,301    | 電気通信サービス         |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 30.01    | 47.37    | 665    | 72,024    | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| IVANHOE MINES LTD-CL A       | 326.98   | 564.32   | 621    | 67,293    | 素材               |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 723.31   | 825.06   | 7,440  | 805,124   | エネルギー            |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 13.93    | 17.45    | 2,145  | 232,133   | 保険               |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 189.21   | 224.36   | 1,654  | 179,001   | 自動車・自動車部品        |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 49.84    | 49.84    | 808    | 87,461    | 生活必需品流通・小売り      |
| PAN AMERICAN SILVER CORP     | 117.63   | 251.57   | 535    | 57,929    | 素材               |
| BLACKBERRY LTD               | 486.54   | —        | —      | —         | ソフトウェア・サービス      |
| ENBRIDGE INC                 | 1,275.5  | 1,551.65 | 7,280  | 787,805   | エネルギー            |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 1,214.16 | 1,349.95 | 3,542  | 383,308   | 保険               |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY | 581.52   | 685.55   | 6,646  | 719,207   | 運輸               |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 113.02   | 113.02   | 549    | 59,461    | 耐久消費財・アパレル       |
| CGI INC                      | 134.76   | 157.2    | 2,154  | 233,130   | ソフトウェア・サービス      |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 311.75   | —        | —      | —         | メディア・娯楽          |
| IGM FINANCIAL INC            | 49.49    | 49.49    | 165    | 17,940    | 金融サービス           |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 414.52   | 414.52   | 470    | 50,955    | 素材               |
| RB GLOBAL INC                | 79.3     | 125.2    | 1,075  | 116,349   | 商業・専門サービス        |
| BROOKFIELD CORP              | 881.4    | 1,031.4  | 4,987  | 539,735   | 金融サービス           |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A   | 63.36    | 112      | 404    | 43,775    | 公益事業             |
| CAE INC                      | 179.63   | 274.74   | 726    | 78,634    | 資本財              |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 87.05    | 132.68   | 745    | 80,702    | 素材               |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 364.38   | 429.42   | 6,678  | 722,709   | 運輸               |

## 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           | 期首(前期末)    |                   | 期 末               |              | 業 種 等                  |  |
|------------------------------|------------|-------------------|-------------------|--------------|------------------------|--|
|                              | 株 数        | 株 数               | 評 価 額             |              |                        |  |
|                              |            |                   | 外貨建金額             | 邦貨換算金額       |                        |  |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 73.44      | 73.44             | 221               | 23,999       | 公益事業                   |  |
| CENOVUS ENERGY INC           | 856.69     | 998.24            | 2,396             | 259,354      | エネルギー                  |  |
| DOLLARAMA INC                | 170.25     | 204.68            | 1,993             | 215,725      | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| EMERA INC                    | 180        | 225.91            | 1,073             | 116,117      | 公益事業                   |  |
| FIRSTSERVICE CORP            | 25.16      | 36.69             | 778               | 84,275       | 不動産管理・開発               |  |
| FORTIS INC                   | 301.71     | 350.86            | 1,907             | 206,386      | 公益事業                   |  |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 99.13      | 156.3             | 583               | 63,137       | 商業・専門サービス              |  |
| GREAT-WEST LIFE CO INC       | 142        | 229.64            | 988               | 106,976      | 保険                     |  |
| IA FINANCIAL CORP INC        | 82.68      | 82.68             | 736               | 79,716       | 保険                     |  |
| KEYERA CORP                  | 113.74     | 198.02            | 653               | 70,690       | エネルギー                  |  |
| LIGHTSPEED COMMERCE INC      | 63.63      | —                 | —                 | —            | ソフトウェア・サービス            |  |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 115.73     | 115.73            | 1,394             | 150,853      | 生活必需品流通・小売り            |  |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC   | 50.42      | 50.42             | 141               | 15,331       | 金融サービス                 |  |
| NORTHLAND POWER INC          | 157.41     | 157.41            | 344               | 37,268       | 公益事業                   |  |
| ONEX CORPORATION             | 42.17      | 42.17             | 392               | 42,520       | 金融サービス                 |  |
| OPEN TEXT CORP               | 153.37     | 215.07            | 1,189             | 128,767      | ソフトウェア・サービス            |  |
| PARKLAND CORP                | 76.66      | 76.66             | 335               | 36,267       | エネルギー                  |  |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 373.48     | 373.48            | 1,682             | 182,025      | エネルギー                  |  |
| POWER CORP OF CANADA         | 317.68     | 414.36            | 1,546             | 167,379      | 保険                     |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 192.7      | 210.66            | 1,994             | 215,850      | 消費者サービス                |  |
| SAPUTO INC                   | 134.25     | 182.7             | 475               | 51,500       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| SHOPIFY INC - CLASS A        | 709.5      | 889.05            | 8,865             | 959,347      | ソフトウェア・サービス            |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 370.83     | 419.57            | 2,869             | 310,456      | 保険                     |  |
| TMX GROUP LTD                | 31.42      | 260.34            | 747               | 80,851       | 金融サービス                 |  |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD      | 60.27      | 60.27             | 666               | 72,098       | 資本財                    |  |
| 小 計                          | 株 数<br>銘柄数 | 25,581.42<br>85銘柄 | 30,351.35<br>86銘柄 | 182,214<br>— | 19,717,414<br>< 3.2% > |  |
| (オーストラリア)                    |            | 百株                | 百株                | 千オーストラリア・ドル  | 千円                     |  |
| AURIZON HOLDINGS LTD         | 1,302.51   | 1,302.51          | 462               | 45,060       | 運輸                     |  |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD  | 658.44     | 929.6             | 1,177             | 114,776      | 素材                     |  |
| BHP GROUP LTD                | 3,236.91   | 3,768.28          | 17,405            | 1,696,184    | 素材                     |  |
| REA GROUP LTD                | 28.33      | 38.13             | 604               | 58,872       | メディア・娯楽                |  |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 37.94      | —                 | —                 | —            | 消費者サービス                |  |
| MEDIBANK PRIVATE LTD         | 1,287.24   | 1,937.02          | 662               | 64,556       | 保険                     |  |
| SOUTH32 LTD                  | 2,763.48   | 3,366.39          | 1,030             | 100,384      | 素材                     |  |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD    | 1,194.9    | 1,413.15          | 4,380             | 426,905      | エネルギー                  |  |
| IDP EDUCATION LTD            | 109.4      | 158.55            | 362               | 35,366       | 消費者サービス                |  |
| WISETECH GLOBAL LTD          | 106.21     | 106.21            | 700               | 68,311       | ソフトウェア・サービス            |  |
| XERO LTD                     | 86.83      | 111.73            | 1,140             | 111,145      | ソフトウェア・サービス            |  |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 127.22     | 227.86            | 763               | 74,386       | 金融サービス                 |  |
| PILBARA MINERALS LTD         | —          | 1,971.6           | 701               | 68,399       | 素材                     |  |
| FORTESCUE LTD                | 1,052      | 1,218.17          | 3,018             | 294,165      | 素材                     |  |
| COLES GROUP LTD              | 847.99     | 999.72            | 1,519             | 148,082      | 生活必需品流通・小売り            |  |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | 893.18     | 1,387.38          | 678               | 66,112       | 生活必需品流通・小売り            |  |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 2,073.67   | 2,374.26          | 6,671             | 650,154      | 銀行                     |  |
| LOTTERY CORP LTD/THE         | 1,397.85   | 1,732.68          | 790               | 76,995       | 消費者サービス                |  |
| WESTPAC BANKING CORP         | 2,273.53   | 2,547.56          | 5,388             | 525,069      | 銀行                     |  |
| TELSTRA GROUP LTD            | 2,733.43   | 2,733.43          | 1,033             | 100,688      | 電気通信サービス               |  |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD       | —          | 2,245.17          | 5,428             | 529,038      | 銀行                     |  |
| SANTOS LTD                   | 2,138.11   | 2,396.85          | 1,663             | 162,099      | エネルギー                  |  |
| AUST AND NZ BANKING GROUP    | —          | 1,832.88          | —                 | —            | 銀行                     |  |

## 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           | 株数        | 期首(前期末)    |                   | 期末                |                        | 業種等                  |
|------------------------------|-----------|------------|-------------------|-------------------|------------------------|----------------------|
|                              |           | 株数         | 株数                | 評価額               |                        |                      |
|                              |           |            |                   | 外貨建金額             | 邦貨換算金額                 |                      |
| RIO TINTO LTD                | 227.51    | 293.68     | 3,658             | 356,536           | 素材                     |                      |
| ORIGIN ENERGY LTD            | 1,109.98  | 1,348.65   | 1,132             | 110,397           | 公益事業                   |                      |
| EVOLUTION MINING LTD         | 844.2     | —          | —                 | —                 | 素材                     |                      |
| SEEK LTD                     | 219.57    | 298.33     | 697               | 67,970            | メディア・娯楽                |                      |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    | 456.84    | 456.84     | 485               | 47,279            | 食品・飲料・タバコ              |                      |
| NEWCREST MINING LTD          | 540.82    | —          | —                 | —                 | 素材                     |                      |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 1,070.36  | 1,242.66   | 12,840            | 1,251,297         | 銀行                     |                      |
| AMPOL LTD                    | 144.28    | 190.16     | 649               | 63,283            | エネルギー                  |                      |
| ORICA LTD                    | 362.12    | 362.12     | 560               | 54,591            | 素材                     |                      |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      | 1,018.6   | 1,244.5    | 1,887             | 183,976           | 保険                     |                      |
| WOOLWORTHS GROUP LTD         | 747.6     | 882.46     | 3,025             | 294,793           | 生活必需品流通・小売り            |                      |
| QANTAS AIRWAYS LTD           | 782.26    | 782.26     | 406               | 39,640            | 運輸                     |                      |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 261.08    | 337.23     | 1,603             | 156,263           | 素材                     |                      |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 226.04    | 280.15     | 4,638             | 452,043           | 金融サービス                 |                      |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 377.19    | 452.43     | 1,823             | 177,679           | 消費者サービス                |                      |
| CSL LTD                      | 304.42    | 355.57     | 9,323             | 908,530           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |                      |
| WESFARMERS LTD               | 732.5     | 830        | 4,375             | 426,417           | 一般消費財・サービス流通・小売り       |                      |
| COCHLEAR LTD                 | 40.95     | 54.04      | 1,442             | 140,607           | ヘルスケア機器・サービス           |                      |
| BLUESCOPE STEEL LTD          | 372.14    | 372.14     | 755               | 73,654            | 素材                     |                      |
| SUNCORP GROUP LTD            | 882.34    | 882.34     | 1,202             | 117,196           | 保険                     |                      |
| ASX LTD                      | 111.8     | 153.85     | 893               | 87,077            | 金融サービス                 |                      |
| COMPUTERSHARE LTD            | 287.38    | 384.85     | 895               | 87,308            | 商業・専門サービス              |                      |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 1,737.55  | 1,737.55   | 1,000             | 97,530            | 保険                     |                      |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 311.26    | 311.26     | 899               | 87,690            | ヘルスケア機器・サービス           |                      |
| BRAMBLES LTD                 | 860.89    | 1,051.61   | 1,373             | 133,838           | 商業・専門サービス              |                      |
| IGO LTD                      | —         | 543.23     | 463               | 45,155            | 素材                     |                      |
| MINERAL RESOURCES LTD        | 116.62    | 116.62     | 714               | 69,585            | 素材                     |                      |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 107.81    | 145.65     | 713               | 69,548            | ヘルスケア機器・サービス           |                      |
| REECE LTD                    | 130.59    | 130.59     | 246               | 23,975            | 資本財                    |                      |
| 小計                           | 株数<br>銘柄数 | 金額<br><比率> | 40,566.75<br>49銘柄 | 48,207.02<br>48銘柄 | 113,295<br>—           | 11,040,629<br><1.8%> |
| (香港)                         | 百株        | 百株         | 千香港・ドル            | 千円                |                        |                      |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 915       | 915        | 3,646             | 68,695            | 公益事業                   |                      |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 1,490     | 1,760      | 7,084             | 133,462           | 消費者サービス                |                      |
| MTR CORP                     | 845       | 1,185      | 3,329             | 62,734            | 運輸                     |                      |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 890       | 1,080      | 8,251             | 155,452           | 不動産管理・開発               |                      |
| SINO LAND CO                 | 2,482     | 2,482      | 1,928             | 36,333            | 不動産管理・開発               |                      |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 270       | 270        | 1,377             | 25,942            | 不動産管理・開発               |                      |
| CLP HOLDINGS LTD             | 941       | 1,196      | 7,223             | 136,097           | 公益事業                   |                      |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 833.84    | 833.84     | 1,771             | 33,382            | 不動産管理・開発               |                      |
| HONG KONG & CHINA GAS        | 7,223.89  | 8,613.89   | 4,565             | 86,011            | 公益事業                   |                      |
| HANG SENG BANK LTD           | 482       | 634        | 5,547             | 104,514           | 銀行                     |                      |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        | 848.33    | 848.33     | 994               | 18,731            | 不動産管理・開発               |                      |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 1,734.24  | 1,969.24   | 7,709             | 145,248           | 資本財                    |                      |
| CK ASSET HOLDINGS LTD        | 1,269.24  | 1,609.24   | 6,139             | 115,663           | 不動産管理・開発               |                      |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 738       | 880        | 24,604            | 463,554           | 金融サービス                 |                      |
| WH GROUP LTD                 | 5,610     | 5,610      | 2,754             | 51,894            | 食品・飲料・タバコ              |                      |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 980       | 1,900      | 2,014             | 37,943            | 不動産管理・開発               |                      |
| XINYI GLASS HOLDINGS LTD     | 940       | 940        | 835               | 15,743            | 資本財                    |                      |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 896       | 1,470      | 2,002             | 37,720            | 食品・飲料・タバコ              |                      |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 1,250     | 1,250      | 3,118             | 58,757            | 不動産管理・開発               |                      |

## 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                   |                    |
|                              | 株 数                                | 株 数                           | 外貨建金額        | 邦貨換算金額              |                    |
| SWIRE PROPERTIES LTD         | 530                                | 1,168                         | 1,775        | 33,447              | 不動産管理・開発           |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 410                                | 410                           | 1,562        | 29,429              | 公益事業               |
| AIA GROUP LTD                | 7,632                              | 8,682                         | 60,079       | 1,131,896           | 保険                 |
| SITC INTERNATIONAL HOLDINGS  | 700                                | 1,600                         | 1,958        | 36,896              | 運輸                 |
| SANDS CHINA LTD              | 1,424                              | 1,728                         | 3,290        | 61,985              | 消費者サービス            |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 1,170                              | —                             | —            | —                   | 一般消費財・サービス流通・小売り   |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 830                                | 1,010                         | 8,074        | 152,132             | 資本財                |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 2,470                              | 2,470                         | 5,199        | 97,955              | 銀行                 |
| ESR GROUP LTD                | 1,570                              | 1,570                         | 1,570        | 29,578              | 不動産管理・開発           |
| 小 計                          | 株 数 : 47,374.54<br>銘柄数 <比率> : 28銘柄 | 株 数 : 54,084.54<br>銘柄数 : 27銘柄 | 178,408<br>— | 3,361,208<br><0.6%> |                    |
| (シンガポール)                     | 百株                                 | 百株                            | 千シンガポール・ドル   | 千円                  |                    |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 756                                | 935                           | 2,554        | 281,956             | 銀行                 |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 1,098                              | 1,309                         | 4,157        | 458,892             | 銀行                 |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       | 779.66                             | 1,135.66                      | 723          | 79,850              | 運輸                 |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 1,762                              | 2,201                         | 673          | 74,341              | 不動産管理・開発           |
| KEPPEL CORP LTD              | 944                                | 944                           | 606          | 66,999              | 資本財                |
| UOL GROUP LTD                | 309                                | 309                           | 183          | 20,259              | 不動産管理・開発           |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        | 258                                | 490                           | 305          | 33,695              | 不動産管理・開発           |
| SEATRUM LTD                  | —                                  | 32,317.27                     | 345          | 38,168              | 資本財                |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | —                                  | 108                           | 313          | 34,571              | 資本財                |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 2,114                              | 2,584                         | 3,279        | 361,946             | 銀行                 |
| GENTING SINGAPORE LTD        | 3,275                              | 4,525                         | 411          | 45,451              | 消費者サービス            |
| VENTURE CORP LTD             | 217                                | —                             | —            | —                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 4,807.15                           | 5,790.15                      | 1,325        | 146,357             | 電気通信サービス           |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 1,086                              | 1,086                         | 403          | 44,592              | 資本財                |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD      | —                                  | 892                           | 460          | 50,804              | 公益事業               |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 652                                | 652                           | 623          | 68,801              | 金融サービス             |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 1,300                              | 1,596                         | 587          | 64,829              | 食品・飲料・タバコ          |
| 小 計                          | 株 数 : 19,357.81<br>銘柄数 <比率> : 14銘柄 | 株 数 : 56,874.08<br>銘柄数 : 16銘柄 | 16,955<br>—  | 1,871,520<br><0.3%> |                    |
| (ニュージーランド)                   | 百株                                 | 百株                            | 千ニュージーランド・ドル | 千円                  |                    |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        | 990.68                             | 1,320.27                      | 669          | 60,712              | 電気通信サービス           |
| MERIDIAN ENERGY LTD          | 664.54                             | 913.27                        | 468          | 42,493              | 公益事業               |
| EBOS GROUP LTD               | —                                  | 129.72                        | 479          | 43,520              | ヘルスケア機器・サービス       |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 788.08                             | 909.13                        | 718          | 65,141              | 運輸                 |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 390.17                             | 457.32                        | 1,088        | 98,719              | ヘルスケア機器・サービス       |
| MERCURY NZ LTD               | 625.22                             | 482.06                        | 293          | 26,583              | 公益事業               |
| 小 計                          | 株 数 : 3,458.69<br>銘柄数 <比率> : 5銘柄   | 株 数 : 4,211.77<br>銘柄数 : 6銘柄   | 3,717<br>—   | 337,172<br><0.1%>   |                    |
| (イギリス)                       | 百株                                 | 百株                            | 千イギリス・ポンド    | 千円                  |                    |
| BP PLC                       | 12,227.97                          | 12,846.25                     | 6,062        | 1,132,651           | エネルギー              |
| ASHTREAD GROUP PLC           | 261.31                             | 304.39                        | 1,440        | 269,233             | 資本財                |
| UNILEVER PLC                 | 1,633.79                           | 1,908.22                      | 7,162        | 1,338,242           | 家庭用品・パーソナル用品       |
| NMC HEALTH PLC               | 39.4                               | 39.4                          | 0            | 7                   | ヘルスケア機器・サービス       |
| JD SPORTS FASHION PLC        | 1,443                              | 2,514.82                      | 395          | 73,910              | 一般消費財・サービス流通・小売り   |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 513.19                             | 779.01                        | 559          | 104,534             | メディア・娯楽            |
| AVEVA GROUP LTD              | 60.37                              | —                             | —            | —                   | ソフトウェア・サービス        |
| BARCLAYS PLC                 | 10,831.54                          | 12,087.42                     | 1,695        | 316,855             | 銀行                 |
| SHELL PLC                    | 4,729.35                           | 5,080.42                      | 12,972       | 2,423,847           | エネルギー              |
| WISE PLC - A                 | —                                  | 436.61                        | 341          | 63,727              | 金融サービス             |

## 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  | 邦貨換算金額    |                        |
| HALEON PLC                   | 2,935.73  | 4,152.31  | 1,374  | 256,873   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| ENDEAVOUR MINING PLC         | —         | 175.07    | 321    | 59,990    | 素材                     |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 4,941.44  | 6,491.46  | 1,709  | 319,468   | 資本財                    |
| PRUDENTIAL PLC               | 1,780.81  | 2,119.66  | 1,810  | 338,295   | 保険                     |
| NATWEST GROUP PLC            | 3,474.2   | 4,072.38  | 840    | 157,046   | 銀行                     |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 100.74    | 196.37    | 315    | 58,942    | 素材                     |
| BAE SYSTEMS PLC              | 2,092.6   | 2,315.22  | 2,396  | 447,715   | 資本財                    |
| AVIVA PLC                    | 1,740.6   | 2,178.35  | 905    | 169,150   | 保険                     |
| GSK PLC                      | 2,574.03  | 3,111.33  | 4,358  | 814,430   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RELX PLC                     | 1,214.21  | 1,440.62  | 4,388  | 819,877   | 商業・専門サービス              |
| DIAGEO PLC                   | 1,457.4   | 1,691.99  | 4,636  | 866,200   | 食品・飲料・タバコ              |
| RIO TINTO PLC                | 726.7     | 830.83    | 4,486  | 838,254   | 素材                     |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 1,518.95  | 1,823.97  | 1,168  | 218,242   | 銀行                     |
| TESCO PLC                    | 4,959.19  | 5,515.71  | 1,568  | 293,089   | 生活必需品流通・小売り            |
| PEARSON PLC                  | 396.23    | 469.42    | 435    | 81,338    | 消費者サービス                |
| NEXT PLC                     | 90.3      | 90.3      | 716    | 133,792   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 2,255.88  | 2,255.88  | 291    | 54,414    | 耐久消費財・アパレル             |
| BUNZL PLC                    | 226.58    | 226.58    | 666    | 124,589   | 資本財                    |
| VODAFONE GROUP PLC           | 16,395.44 | 16,293.76 | 1,153  | 215,538   | 電気通信サービス               |
| KINGFISHER PLC               | 1,096.78  | 1,795.93  | 395    | 73,854    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| WPP PLC                      | 785.03    | 785.03    | 551    | 103,112   | メディア・娯楽                |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 420.35    | 512.08    | 576    | 107,636   | 公益事業                   |
| SEVERN TRENT PLC             | 149.04    | 201.17    | 546    | 102,085   | 公益事業                   |
| RENTOKIL INITIAL PLC         | 1,568.48  | 1,904.67  | 827    | 154,660   | 商業・専門サービス              |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 449.2     | 535.59    | 2,886  | 539,375   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| SSE PLC                      | 705.32    | 788.38    | 1,443  | 269,634   | 公益事業                   |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 647.66    | 647.66    | 329    | 61,496    | 耐久消費財・アパレル             |
| ASTRAZENECA PLC              | 980.93    | 1,150.98  | 11,546 | 2,157,372 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 3,863.91  | 4,570.83  | 1,044  | 195,142   | 保険                     |
| 3I GROUP PLC                 | 608.07    | 705.72    | 1,574  | 294,172   | 金融サービス                 |
| SAGE GROUP PLC/THE           | 750.45    | 750.45    | 848    | 158,441   | ソフトウェア・サービス            |
| NATIONAL GRID PLC            | 2,243.29  | 2,806.06  | 2,877  | 537,653   | 公益事業                   |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 43,247.26 | 48,018.58 | 2,084  | 389,375   | 銀行                     |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 594.22    | 594.22    | 1,090  | 203,673   | 食品・飲料・タバコ              |
| CENTRICA PLC                 | —         | 4,038.1   | 595    | 111,210   | 公益事業                   |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 66.37     | 66.37     | 308    | 57,613    | 耐久消費財・アパレル             |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 1,385.71  | 1,577.93  | 3,967  | 741,325   | 食品・飲料・タバコ              |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 12,552.33 | 14,650.67 | 8,714  | 1,628,164 | 銀行                     |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 803.77    | 954.36    | 2,040  | 381,321   | 素材                     |
| COMPASS GROUP PLC            | 1,100.16  | 1,275.18  | 2,572  | 480,559   | 消費者サービス                |
| PERSIMMON PLC                | 169.16    | 276.65    | 348    | 65,076    | 耐久消費財・アパレル             |
| SAINSBURY (J) PLC            | 1,134.8   | 1,134.8   | 321    | 60,109    | 生活必需品流通・小売り            |
| BT GROUP PLC                 | 4,039.57  | 5,406.23  | 662    | 123,737   | 電気通信サービス               |
| BURBERRY GROUP PLC           | 262.33    | 262.33    | 380    | 71,069    | 耐久消費財・アパレル             |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 572.78    | 572.78    | 585    | 109,319   | ヘルスケア機器・サービス           |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 213.45    | 304.87    | 2,716  | 507,530   | 金融サービス                 |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 145.9     | 145.9     | 251    | 46,955    | 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    | 198.08    | 535    | 100,036   | 保険                     |
| ANTOFAGASTA PLC              | 194.39    | 309.83    | 439    | 82,115    | 素材                     |
| ABRDN PLC                    | 1,380.15  | 1,380.15  | 230    | 43,115    | 金融サービス                 |
| EXPERIAN PLC                 | 547.49    | 697.5     | 2,035  | 380,276   | 商業・専門サービス              |

## 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           | 株数               | 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               |     |
| SCHRODERS PLC                | 617.11           | 617.11             | 247                | 46,235       | 金融サービス               |     |
| HALMA PLC                    | 243.75           | 322.77             | 685                | 128,090      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器   |     |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 242.58           | 242.58             | 579                | 108,232      | 食品・飲料・タバコ            |     |
| ST JAMES' S PLACE PLC        | 338.23           | 338.23             | 218                | 40,912       | 金融サービス               |     |
| INTERTEK GROUP PLC           | 118.84           | 118.84             | 473                | 88,460       | 商業・専門サービス            |     |
| MONDI PLC                    | 339.05           | 339.05             | 474                | 88,687       | 素材                   |     |
| WHITBREAD PLC                | 112.82           | 165.22             | 513                | 96,004       | 消費者サービス              |     |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 310.08           | 310.08             | 220                | 41,157       | 金融サービス               |     |
| SMITHS GROUP PLC             | 243.69           | 243.69             | 398                | 74,511       | 資本財                  |     |
| OCADO GROUP PLC              | 273.79           | 426.97             | 253                | 47,354       | 生活必需品流通・小売り          |     |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC   | 592.86           | 592.86             | 274                | 51,364       | 保険                   |     |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 118.2            | 118.2              | 722                | 135,068      | 消費者サービス              |     |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 78.38            | 102.96             | 458                | 85,604       | 素材                   |     |
| M&G PLC                      | 1,197.33         | 1,197.33           | 251                | 47,068       | 金融サービス               |     |
| INFORMA PLC                  | 1,027.55         | 1,027.55           | 758                | 141,686      | メディア・娯楽              |     |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 44.59            | 59.04              | 541                | 101,220      | 資本財                  |     |
| MELROSE INDUSTRIES PLC       | 3,052.27         | 1,194.56           | 624                | 116,729      | 資本財                  |     |
| GLENCORE PLC                 | 6,227.41         | 7,736.48           | 3,434              | 641,650      | 素材                   |     |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 87.04            | 178.66             | 389                | 72,736       | 食品・飲料・タバコ            |     |
| CRH PLC                      | —                | 545.81             | 2,687              | 502,043      | 素材                   |     |
| DCC PLC                      | 59.54            | 59.54              | 319                | 59,649       | 資本財                  |     |
| ENTAIN PLC                   | 421.58           | 421.58             | 337                | 63,030       | 消費者サービス              |     |
| FERGUSON PLC                 | 133.61           | —                  | —                  | —            | 資本財                  |     |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 179,294.95<br>80銘柄 | 206,825.94<br>82銘柄 | 134,366<br>— | 25,104,983<br><4.1%> |     |
| (イスラエル)                      | 百株               | 百株                 | 千イスラエル・シェケル        | 千円           |                      |     |
| TOWER SEMICONDUCTOR LTD      | 74.38            | —                  | —                  | —            | 半導体・半導体製造装置          |     |
| BANK HAPOLIM BM              | 846.82           | 983.27             | 3,146              | 125,586      | 銀行                   |     |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 926.39           | 1,159.37           | 3,338              | 133,270      | 銀行                   |     |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A       | 853.39           | 853.39             | 1,581              | 63,116       | 銀行                   |     |
| NICE LTD                     | 39.19            | 39.19              | 2,813              | 112,278      | ソフトウェア・サービス          |     |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 92.49            | 119.16             | 1,625              | 64,872       | 銀行                   |     |
| AZRIELI GROUP LTD            | 21.4             | 35.27              | 781                | 31,209       | 不動産管理・開発             |     |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 1,795.69         | —                  | —                  | —            | 電気通信サービス             |     |
| ICL GROUP LTD                | 417.73           | 671.43             | 1,304              | 52,070       | 素材                   |     |
| ELBIT SYSTEMS LTD            | 13.89            | 13.89              | 1,054              | 42,084       | 資本財                  |     |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 5,081.37<br>10銘柄   | 3,874.97<br>8銘柄    | 15,646<br>—  | 624,488<br><0.1%>    |     |
| (スイス)                        | 百株               | 百株                 | 千スイス・フラン           | 千円           |                      |     |
| AVOLTA AG                    | —                | 86.56              | 267                | 45,041       | 一般消費財・サービス流通・小売り     |     |
| UBS GROUP AG-REG             | 2,212.55         | 2,482.48           | 5,933              | 1,000,087    | 金融サービス               |     |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 151.68           | 151.68             | 658                | 110,961      | 金融サービス               |     |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 30.3             | 30.3               | 594                | 100,181      | 資本財                  |     |
| HOLCIM LTD                   | 352.46           | 394.59             | 2,521              | 425,012      | 素材                   |     |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 55.72            | 55.72              | 486                | 81,993       | 不動産管理・開発             |     |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 0.72             | 0.72               | 783                | 132,043      | 食品・飲料・タバコ            |     |
| ADECCO GROUP AG-REG          | 91.18            | 148.1              | 622                | 104,897      | 商業・専門サービス            |     |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 0.06             | 0.08               | 859                | 144,826      | 食品・飲料・タバコ            |     |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 13.72            | 15.85              | 1,813              | 305,639      | 金融サービス               |     |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 17.66            | 17.66              | 329                | 55,546       | 資本財                  |     |
| SIKA AG-REG                  | 92.91            | 110.05             | 2,605              | 439,264      | 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               |                        |
| ALCON INC                    | 311.65          | 359.56          | 2,352           | 396,493              | ヘルスケア機器・サービス           |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | —               | 30.06           | 318             | 53,759               | 銀行                     |
| ROCHE HOLDING AG-BR          | 17.4            | 25.84           | 643             | 108,541              | 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      | 52.25           | 52.25           | 229             | 38,619               | 耐久消費財・アパレル             |
| BACHEM HOLDING AG            | 17.56           | 17.56           | 115             | 19,476               | 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           | 21.64           | 841             | 141,893              | 資本財                    |
| SIG GROUP AG                 | 222.69          | 222.69          | 451             | 76,049               | 素材                     |
| BKW AG                       | —               | 13.85           | 208             | 35,228               | 公益事業                   |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-RTS   | 1,681.96        | —               | —               | —                    | 金融サービス                 |
| HELVETIA HOLDING AG-REG      | —               | 22.21           | 262             | 44,213               | 保険                     |
| SANDOZ GROUP AG              | —               | 309.36          | 803             | 135,474              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 445.08          | 522.44          | 12,350          | 2,081,797            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ABB LTD-REG                  | 1,037.2         | 1,194.21        | 4,071           | 686,218              | 資本財                    |
| SWISS RE AG                  | 192.28          | 227.81          | 2,340           | 394,556              | 保険                     |
| NESTLE SA-REG                | 1,789.46        | 2,000.93        | 19,835          | 3,343,424            | 食品・飲料・タバコ              |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 1,681.96        | —               | —               | —                    | 金融サービス                 |
| SGS SA-REG                   | 3.74            | 114.5           | 852             | 143,747              | 商業・専門サービス              |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 17.16           | 17.16           | 394             | 66,469               | 耐久消費財・アパレル             |
| BALOISE HOLDING AG - REG     | 24.75           | 39.09           | 507             | 85,525               | 保険                     |
| CLARIANT AG-REG              | 101.01          | 101.01          | 132             | 22,253               | 素材                     |
| NOVARTIS AG-REG              | 1,379.72        | 1,546.81        | 13,123          | 2,212,035            | 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 | 327.7           | 391.72          | 4,289           | 723,010              | 耐久消費財・アパレル             |
| SWISSCOM AG-REG              | 17.09           | 19.94           | 1,019           | 171,885              | 電気通信サービス               |
| GIVAUDAN-REG                 | 5.68            | 6.8             | 2,206           | 371,944              | 素材                     |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 97.13           | 111.72          | 4,865           | 820,112              | 保険                     |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 70.44           | 88.23           | 1,076           | 181,438              | ヘルスケア機器・サービス           |
| SONOVA HOLDING AG-REG        | 32.69           | 41.73           | 1,050           | 177,116              | ヘルスケア機器・サービス           |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 104.26          | 135.55          | 1,017           | 171,499              | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| LONZA GROUP AG-REG           | 47.15           | 58.01           | 1,982           | 334,217              | 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           | 272             | 46,006               | ソフトウェア・サービス            |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 18.34           | 22.72           | 1,274           | 214,845              | 保険                     |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   | 35.7            | 41.94           | 1,074           | 181,118              | 運輸                     |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 2.16            | 2.16            | 313             | 52,902               | 食品・飲料・タバコ              |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 3.56            | 5.38            | 330             | 55,726               | 素材                     |
| GEBERIT AG-REG               | 23.22           | 23.22           | 1,129           | 190,375              | 資本財                    |
| 小計                           | 株数<br>12,831.74 | 株数<br>11,319.32 | 外貨建金額<br>99,213 | 邦貨換算金額<br>16,723,472 |                        |
|                              | 銘柄数<br>42銘柄     | 銘柄数<br>45銘柄     | —               | < 2.8% >             |                        |
| (デンマーク)                      | 百株              | 百株              | 千円              | 千円                   |                        |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-A       | 2.06            | 2.06            | 2,206           | 47,787               | 運輸                     |
| PANDORA A/S                  | 58.88           | 58.88           | 5,366           | 116,234              | 耐久消費財・アパレル             |
| ORSTED A/S                   | 120.9           | 149.88          | 4,736           | 102,586              | 公益事業                   |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 1,048.8         | 2,455.7         | 169,295         | 3,666,950            | 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       | 72.11           | 72.11           | 3,855           | 83,499               | 素材                     |
| DANSKE BANK A/S              | 391.03          | 500             | 8,792           | 190,445              | 銀行                     |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 654.33          | 784.24          | 14,315          | 310,074              | 資本財                    |
| GN STORE NORD A/S            | 64.84           | —               | —               | —                    | 耐久消費財・アパレル             |
| CARLSBERG AS-B               | 55.85           | 80.8            | 6,685           | 144,805              | 食品・飲料・タバコ              |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 140.03          | 157.85          | 5,516           | 119,495              | 素材                     |
| COLOPLAST-B                  | 83.16           | 83.16           | 6,679           | 144,676              | ヘルスケア機器・サービス           |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 3.11            | 4.12            | 4,478           | 97,003               | 運輸                     |
| TRYG A/S                     | 249.75          | 249.75          | 3,645           | 78,952               | 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       |                        |
|                              | 株数       | 株数       | 外貨建金額        | 邦貨換算金額    |                        |
| GENMAB A/S                   | 39.34    | 46.34    | 9,926        | 214,997   | 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     | 936          | 20,278    | 資本財                    |
| DSV A/S                      | 114.17   | 137.16   | 14,449       | 312,982   | 運輸                     |
| DEMANT A/S                   | 81.78    | 81.78    | 2,377        | 51,493    | ヘルスケア機器・サービス           |
| 小計                           | 3,185.27 | 4,868.96 | 263,262      | 5,702,262 |                        |
|                              | 17銘柄     | 16銘柄     | —            | < 0.9% >  |                        |
| (ノルウェー)                      | 百株       | 百株       | 千ノルウェー・クローネ  | 千円        |                        |
| SALMAR ASA                   | 41.88    | 41.88    | 2,448        | 33,811    | 食品・飲料・タバコ              |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    | 114.12   | 186.91   | 3,401        | 46,978    | 保険                     |
| NORSK HYDRO ASA              | 877.53   | 1,081.09 | 6,817        | 94,147    | 素材                     |
| AKER BP ASA                  | 212.04   | 212.04   | 6,458        | 89,195    | エネルギー                  |
| DNB BANK ASA                 | 616.91   | 668.1    | 13,682       | 188,957   | 銀行                     |
| KONGSBERG GRUPPEN ASA        | 65.26    | 65.26    | 3,031        | 41,871    | 資本財                    |
| ORKLA ASA                    | 469.55   | 631.95   | 5,050        | 69,748    | 食品・飲料・タバコ              |
| TELENOR ASA                  | 406.94   | 484.35   | 5,601        | 77,356    | 電気通信サービス               |
| EQUINOR ASA                  | 608.49   | 722.37   | 24,723       | 341,426   | エネルギー                  |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 108.72   | 127.18   | 4,602        | 63,562    | 素材                     |
| MOWI ASA                     | 233.18   | 307.23   | 5,906        | 81,568    | 食品・飲料・タバコ              |
| ADEVINTA ASA                 | 155.4    | 155.4    | 1,731        | 23,907    | メディア・娯楽                |
| 小計                           | 3,910.02 | 4,683.76 | 83,456       | 1,152,531 |                        |
|                              | 12銘柄     | 12銘柄     | —            | < 0.2% >  |                        |
| (スウェーデン)                     | 百株       | 百株       | 千スウェーデン・クローナ | 千円        |                        |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 576.03   | 635.38   | 12,278       | 174,480   | 銀行                     |
| ERICSSON LM-B SHS            | 1,833.18 | 2,210.4  | 11,622       | 165,152   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| VOLVO AB-B SHS               | 908.83   | 1,114.79 | 27,000       | 383,673   | 資本財                    |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 106.42   | 106.42   | 3,349        | 47,589    | 金融サービス                 |
| LUNDBERGS AB-B SHS           | 60.81    | 60.81    | 3,028        | 43,041    | 金融サービス                 |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 360.76   | 454.27   | 11,965       | 170,029   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EPIROC AB-A                  | 447.46   | 447.46   | 8,680        | 123,353   | 資本財                    |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   | 82.23    | 82.23    | 1,915        | 27,214    | 資本財                    |
| KINNEVIK AB - B              | 124.65   | —        | —            | —         | 金融サービス                 |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS      | 72.11    | 72.11    | 2,270        | 32,267    | 金融サービス                 |
| INVESTOR AB-A SHS            | 274.15   | —        | —            | —         | 金融サービス                 |
| SAGAX AB-B                   | 147.21   | 147.21   | 3,522        | 50,058    | 不動産管理・開発               |
| LIFCO AB-B SHS               | 151.49   | 151.49   | 3,472        | 49,339    | 資本財                    |
| HOLMEN AB-B SHARES           | 70.24    | 70.24    | 3,094        | 43,976    | 素材                     |
| INDUTRADE AB                 | 179.13   | 179.13   | 4,125        | 58,621    | 資本財                    |
| VOLVO CAR AB-B               | 386.28   | 386.28   | 1,328        | 18,871    | 自動車・自動車部品              |
| SAAB AB-B                    | —        | 69.53    | 3,807        | 54,104    | 資本財                    |
| BEIJER REF AB                | —        | 239.18   | 2,800        | 39,799    | 資本財                    |
| SKF AB-B SHARES              | 206.07   | 317.15   | 6,200        | 88,106    | 資本財                    |
| ELECTROLUX AB-B              | 115.55   | —        | —            | —         | 耐久消費財・アパレル             |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 522.1    | 522.1    | 9,138        | 129,862   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| NORDEA BANK ABP              | 2,100.76 | 2,481.87 | 29,013       | 412,275   | 銀行                     |
| SWEDISH MATCH AB             | 1,030.37 | —        | —            | —         | 食品・飲料・タバコ              |
| TELE2 AB-B SHS               | 384.24   | 384.24   | 3,146        | 44,717    | 電気通信サービス               |
| GETINGE AB-B SHS             | 131.51   | 131.51   | 2,970        | 42,215    | ヘルスケア機器・サービス           |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 1,083.74 | 1,293.15 | 16,397       | 233,003   | 銀行                     |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 976.03   | 1,135.33 | 11,267       | 160,104   | 銀行                     |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   | 343.7    | 522.03   | 8,321        | 118,243   | 素材                     |
| SKANSKA AB-B SHS             | 269.15   | 269.15   | 4,527        | 64,330    | 資本財                    |

## 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                          | 期首(前期末)          |                   | 期 末               |              | 業 種 等                  |    |
|-----------------------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------|------------------------|----|
|                             | 株 数              | 株 数               | 評 価 額             |              |                        |    |
|                             |                  |                   | 外貨建金額             | 邦貨換算金額       |                        |    |
| SANDVIK AB                  | 701.08           | 768.66            | 15,711            | 223,259      | 資本財                    |    |
| INVESTOR AB-B SHS           | 1,117.44         | 1,315.35          | 28,345            | 402,793      | 金融サービス                 |    |
| ATLAS COPCO AB-A SHS        | 1,697.3          | 2,001.21          | 32,369            | 459,971      | 資本財                    |    |
| SECURITAS AB-B SHS          | 410.1            | 410.1             | 3,807             | 54,102       | 商業・専門サービス              |    |
| TELIA CO AB                 | 1,876.75         | 1,876.75          | 4,676             | 66,458       | 電気通信サービス               |    |
| ALFA LAVAL AB               | 186.97           | 230.93            | 9,001             | 127,913      | 資本財                    |    |
| ATLAS COPCO AB-B SHS        | 1,074.24         | 1,250.66          | 17,340            | 246,407      | 資本財                    |    |
| ASSA ABLOY AB-B             | 624.54           | 725.39            | 19,556            | 277,898      | 資本財                    |    |
| BOLIDEN AB                  | 152.97           | 206.58            | 5,874             | 83,470       | 素材                     |    |
| HUSQVARNA AB-B SHS          | 185.93           | 348.97            | 2,802             | 39,819       | 資本財                    |    |
| SWEDISH ORPHAN BIVITRUM AB  | 135.13           | 135.13            | 3,410             | 48,465       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |    |
| HEXAGON AB-B SHS            | 1,170.1          | 1,571.05          | 16,417            | 233,292      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |    |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 319.38           | 319.38            | 2,006             | 28,510       | 不動産管理・開発               |    |
| EQT AB                      | 231.94           | 231.94            | 5,770             | 82,001       | 金融サービス                 |    |
| EVOLUTION AB                | 112.54           | 131.01            | 14,434            | 205,116      | 消費者サービス                |    |
| VOLVO AB-A SHS              | 132.83           | 132.83            | 3,259             | 46,319       | 資本財                    |    |
| EMBRACER GROUP AB           | 300.12           | —                 | —                 | —            | メディア・娯楽                |    |
| EPIROC AB-B                 | 198.36           | 331.82            | 5,471             | 77,753       | 資本財                    |    |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS    | 892.71           | 1,092.74          | 6,838             | 97,173       | 資本財                    |    |
| 小 計                         | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 24,464.63<br>46銘柄 | 26,563.96<br>43銘柄 | 392,340<br>— | 5,575,157<br><0.9%>    |    |
| <b>(ユーロ・・・アイルランド)</b>       |                  |                   |                   |              |                        |    |
| KINGSPAN GROUP PLC          | 百株               | 百株                | 千ユーロ              | 千円           | 資本財                    |    |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 95.97            | 112.62            | 802               | 129,689      | 資本財                    |    |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC   | 171.89           | 208.28            | 690               | 111,514      | 素材                     |    |
| AIB GROUP PLC               | —                | 752.42            | 645               | 104,194      | 銀行                     |    |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC   | —                | 909.21            | 377               | 60,911       | 銀行                     |    |
| KERRY GROUP PLC-A           | 110.19           | 132.39            | 1,903             | 307,370      | 消費者サービス                |    |
| CRH PLC                     | 98.94            | 124.02            | 915               | 147,784      | 食品・飲料・タバコ              |    |
| 小 計                         | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 459.64<br>5銘柄     | —<br>6銘柄          | —<br>—       | 861,465<br><0.1%>      | 素材 |
| <b>(ユーロ・・・オランダ)</b>         |                  |                   |                   |              |                        |    |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV      | 百株               | 百株                | 千ユーロ              | 千円           | ヘルスケア機器・サービス           |    |
| AIRBUS SE                   | 527.27           | 680.92            | 1,282             | 207,061      | ヘルスケア機器・サービス           |    |
| HEINEKEN HOLDING NV         | 381.7            | 438.24            | 5,940             | 959,495      | 資本財                    |    |
| NN GROUP NV                 | 61.68            | 79.62             | 561               | 90,723       | 食品・飲料・タバコ              |    |
| QIAGEN N.V.                 | 169.17           | 169.17            | 537               | 86,749       | 保険                     |    |
| ABN AMRO BANK NV-CVA        | 156.65           | 156.65            | 589               | 95,205       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |    |
| STELLANTIS NV               | 287.87           | 287.87            | 360               | 58,233       | 銀行                     |    |
| FERRARI NV                  | 1,392.38         | 1,717.48          | 3,385             | 546,847      | 自動車・自動車部品              |    |
| ADYEN NV                    | 79.86            | 89.92             | 3,015             | 487,100      | 自動車・自動車部品              |    |
| PROSUS NV                   | 13.94            | 15.53             | 1,689             | 272,847      | 金融サービス                 |    |
| CNH INDUSTRIAL NV           | 510.27           | 1,145.57          | 3,445             | 556,450      | 一般消費財・サービス流通・小売り       |    |
| ASM INTERNATIONAL NV        | 687.66           | 820.28            | 794               | 128,376      | 資本財                    |    |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV    | 31.7             | 31.7              | 1,487             | 240,326      | 半導体・半導体製造装置            |    |
| OCI NV                      | 444.22           | 661.7             | 1,600             | 258,521      | メディア・娯楽                |    |
| EXOR NV                     | 60               | 60                | 125               | 20,301       | 素材                     |    |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES | 62.04            | 86.69             | 766               | 123,771      | 金融サービス                 |    |
| FERROVIAL SE                | —                | 62.86             | 808               | 130,510      | 半導体・半導体製造装置            |    |
| ASR NEDERLAND NV            | —                | 388.69            | 1,225             | 197,999      | 資本財                    |    |
| HEINEKEN NV                 | 160.91           | 228.05            | 546               | 88,195       | 保険                     |    |
|                             |                  |                   | 1,886             | 304,677      | 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            |                        |  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N      | 646.61    | 710.69     | 1,871            | 302,339           | 生活必需品流通・小売り            |  |
| AKZO NOBEL N. V.                  | 124.75    | 124.75     | 875              | 141,401           | 素材                     |  |
| DSM BV                            | 104.33    | —          | —                | —                 | 素材                     |  |
| WOLTERS KLUWER                    | 163.6     | 188.02     | 2,368            | 382,473           | 商業・専門サービス              |  |
| ING GROEP NV                      | 2,541.05  | 2,706.46   | 3,455            | 558,115           | 銀行                     |  |
| KONINKLIJKE KPN NV                | 2,221.79  | 2,221.79   | 704              | 113,752           | 電気通信サービス               |  |
| ASML HOLDING NV                   | 257.52    | 302.12     | 19,009           | 3,070,206         | 半導体・半導体製造装置            |  |
| RANDSTAD NV                       | 89.46     | 89.46      | 490              | 79,294            | 商業・専門サービス              |  |
| JDE PEET'S NV                     | 66.6      | 133.17     | 325              | 52,523            | 食品・飲料・タバコ              |  |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV          | 354.07    | 354.07     | 351              | 56,819            | 食品・飲料・タバコ              |  |
| EURONEXT NV                       | 55.02     | 55.02      | 418              | 67,624            | 金融サービス                 |  |
| IMCD NV                           | 32.14     | 43.4       | 596              | 96,310            | 資本財                    |  |
| ARGENX SE                         | 35.03     | 41.59      | 1,672            | 270,165           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| JUST EAT TAKEAWAY                 | 129.03    | —          | —                | —                 | 消費者サービス                |  |
| STMICROELECTRONICS NV             | 435.38    | 486.63     | 2,094            | 338,236           | 半導体・半導体製造装置            |  |
| 小計                                | 株数<br>銘柄数 | 金額<br><比率> | 12,283.7<br>31銘柄 | 14,724.04<br>32銘柄 | 64,284<br>—<br><1.7%>  |  |
| <b>(ユーロ・・・ベルギー)</b>               |           |            |                  |                   |                        |  |
| SOFINA                            | 8.04      | 8.04       | 162              | 26,308            | 金融サービス                 |  |
| LOTUS BAKERIES                    | —         | 0.31       | 247              | 39,954            | 食品・飲料・タバコ              |  |
| UCB SA                            | 77.82     | 102.3      | 688              | 111,196           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| KBC GROUP NV                      | 149.1     | 176.43     | 925              | 149,542           | 銀行                     |  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV       | 59.14     | 79.33      | 573              | 92,635            | 金融サービス                 |  |
| SOLVAY SA                         | 48.02     | 48.02      | 506              | 81,783            | 素材                     |  |
| UMICORE                           | 131.6     | 169.12     | 413              | 66,729            | 素材                     |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV        | 566.32    | 661.43     | 3,782            | 610,839           | 食品・飲料・タバコ              |  |
| ACEAS                             | 112.47    | 112.47     | 443              | 71,588            | 保険                     |  |
| D'IETEREN GROUP                   | 14.49     | 18.85      | 295              | 47,798            | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| PROXIMUS                          | 108.95    | —          | —                | —                 | 電気通信サービス               |  |
| ELIA GROUP SA/NV                  | 21.11     | 21.11      | 207              | 33,583            | 公益事業                   |  |
| 小計                                | 株数<br>銘柄数 | 金額<br><比率> | 1,297.06<br>11銘柄 | 1,397.41<br>11銘柄  | 8,246<br>—<br><0.2%>   |  |
| <b>(ユーロ・・・ルクセンブルグ)</b>            |           |            |                  |                   |                        |  |
| ARCELORMITTAL                     | 370.54    | 336.06     | 767              | 123,914           | 素材                     |  |
| TENARIS SA                        | 259.63    | 412.01     | 631              | 102,044           | エネルギー                  |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC AROUNDTOWN SA | 92.7      | 92.7       | 489              | 79,081            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| AROUNDTOWN SA                     | 735.08    | —          | —                | —                 | 不動産管理・開発               |  |
| 小計                                | 株数<br>銘柄数 | 金額<br><比率> | 1,457.95<br>4銘柄  | 840.77<br>3銘柄     | 1,888<br>—<br><0.1%>   |  |
| <b>(ユーロ・・・フランス)</b>               |           |            |                  |                   |                        |  |
| BUREAU VERITAS SA                 | 178.17    | 178.17     | 400              | 64,660            | 商業・専門サービス              |  |
| ORANGE                            | 1,277.98  | 1,327.22   | 1,494            | 241,325           | 電気通信サービス               |  |
| GETLINK SE                        | 304.28    | 304.28     | 509              | 82,292            | 運輸                     |  |
| DASSAULT AVIATION SA              | 17.2      | 17.2       | 318              | 51,392            | 資本財                    |  |
| TOTALENERGIES SE                  | 1,581.13  | 1,694.57   | 10,452           | 1,688,119         | エネルギー                  |  |
| TELEPERFORMANCE                   | 34.2      | 42.99      | 560              | 90,471            | 商業・専門サービス              |  |
| WORLDLINE SA                      | 166.77    | 166.77     | 232              | 37,574            | 金融サービス                 |  |
| ESSILORLUXOTTICA                  | 178.07    | 219.58     | 3,891            | 628,570           | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| AMUNDI SA                         | 39.55     | 39.55      | 221              | 35,835            | 金融サービス                 |  |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH          | 15.55     | 22.07      | 457              | 73,963            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| MICHELIN (CGDE)                   | 456.59    | 518.44     | 1,598            | 258,233           | 自動車・自動車部品              |  |

# 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           | 株数               | 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                 |     |
| AIR LIQUIDE SA               | 334.12           | 399.11           | 6,934             | 1,120,061    | 素材                     |     |
| KERING                       | 47.59            | 58.01            | 2,268             | 366,335      | 耐久消費財・アパレル             |     |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 348.68           | 414.72           | 6,934             | 1,119,929    | 資本財                    |     |
| BOUYGUES SA                  | 171.23           | 171.23           | 601               | 97,180       | 資本財                    |     |
| BNP PARIBAS                  | 720.2            | 804.74           | 4,580             | 739,809      | 銀行                     |     |
| THALES SA                    | 70.74            | 70.74            | 980               | 158,410      | 資本財                    |     |
| DANONE                       | 407.11           | 503.15           | 2,976             | 480,675      | 食品・飲料・タバコ              |     |
| CARREFOUR SA                 | 359.9            | 499.14           | 866               | 139,909      | 生活必需品流通・小売り            |     |
| VIVENDI SE                   | 384.96           | 571.61           | 500               | 80,817       | メディア・娯楽                |     |
| L'OREAL                      | 151.95           | 177.38           | 7,660             | 1,237,191    | 家庭用品・パーソナル用品           |     |
| LEGRAND SA                   | 168.52           | 195.39           | 1,722             | 278,210      | 資本財                    |     |
| PERNOD RICARD SA             | 137.33           | 147.36           | 2,295             | 370,686      | 食品・飲料・タバコ              |     |
| SOCIETE GENERALE SA          | 485.58           | 551.96           | 1,255             | 202,720      | 銀行                     |     |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 177              | 205.1            | 14,162            | 2,287,329    | 耐久消費財・アパレル             |     |
| ACCOR SA                     | 104.51           | 164.69           | 520               | 84,132       | 消費者サービス                |     |
| CAPGEMINI SE                 | 104.53           | 127.5            | 2,404             | 388,272      | ソフトウェア・サービス            |     |
| VALEO                        | 144.44           | 144.44           | 195               | 31,575       | 自動車・自動車部品              |     |
| PUBLICIS GROUPE              | 133.01           | 155.58           | 1,202             | 194,187      | メディア・娯楽                |     |
| SODEXO SA                    | 47.6             | 69.6             | 691               | 111,669      | 消費者サービス                |     |
| SEB SA                       | 11.27            | 11.27            | 117               | 19,039       | 耐久消費財・アパレル             |     |
| AXA SA                       | 1,195.47         | 1,325.35         | 3,769             | 608,778      | 保険                     |     |
| EDENRED                      | 146.5            | 202.97           | 1,015             | 163,973      | 金融サービス                 |     |
| RENAULT SA                   | 147.64           | 147.64           | 528               | 85,425       | 自動車・自動車部品              |     |
| HERMES INTERNATIONAL         | 19.73            | 24.02            | 4,556             | 735,935      | 耐久消費財・アパレル             |     |
| DASSAULT SYSTEMES SE         | 400.49           | 507.81           | 2,189             | 353,695      | ソフトウェア・サービス            |     |
| ALSTOM                       | 176.65           | 255.74           | 293               | 47,479       | 資本財                    |     |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    | 294.71           | 344.54           | 2,047             | 330,652      | 資本財                    |     |
| SANOFI                       | 730.53           | 862.55           | 7,320             | 1,182,327    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |
| VINCI SA                     | 340.5            | 387.5            | 4,344             | 701,704      | 資本財                    |     |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 421.62           | 487.32           | 1,397             | 225,731      | 公益事業                   |     |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 731.02           | 908.99           | 1,072             | 173,236      | 銀行                     |     |
| ENGIE                        | 1,178.99         | 1,422.33         | 2,257             | 364,612      | 公益事業                   |     |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        | 47.45            | —                | —                 | —            | メディア・娯楽                |     |
| EDF                          | 326.58           | —                | —                 | —            | 公益事業                   |     |
| SAFRAN SA                    | 217.82           | 259.61           | 4,157             | 671,460      | 資本財                    |     |
| ARKEMA                       | 32.5             | 51.45            | 481               | 77,712       | 素材                     |     |
| IPSEN                        | 14.98            | 33.8             | 347               | 56,173       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |
| BOLLORE SE                   | 692.88           | 692.88           | 369               | 59,758       | メディア・娯楽                |     |
| REMY COINTREAU               | 12.73            | 20.08            | 217               | 35,204       | 食品・飲料・タバコ              |     |
| EURAZEO SE                   | 17.92            | 17.92            | 112               | 18,161       | 金融サービス                 |     |
| WENDEL                       | 10.82            | 25.47            | 199               | 32,292       | 金融サービス                 |     |
| EIFFAGE                      | 49.89            | 66.41            | 616               | 99,493       | 資本財                    |     |
| ADP                          | 13.46            | 13.46            | 152               | 24,565       | 運輸                     |     |
| BIOMERIEUX                   | 27.91            | 27.91            | 275               | 44,554       | ヘルスケア機器・サービス           |     |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM   | 57.85            | 57.85            | 191               | 30,945       | 消費者サービス                |     |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 16,066.4<br>56銘柄 | 18,117.16<br>54銘柄 | 116,924<br>— | 18,884,459<br><3.1%>   |     |
| (ユーロ・・・ドイツ)                  |                  | 百株               | 百株                | 千ユーロ         | 千円                     |     |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 796.54           | 796.54           | 187               | 30,232       | 電気通信サービス               |     |
| BAYER AG-REG                 | 637.81           | 758.08           | 2,325             | 375,515      | 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            | 87.14            | 546               | 88,243       | 家庭用品・パーソナル用品           |     |

# 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           | 期首(前期末)  |          | 期末     |           | 業種等                    |
|------------------------------|----------|----------|--------|-----------|------------------------|
|                              | 株数       | 株数       | 評価額    |           |                        |
|                              |          |          | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| HEIDELBERG MATERIALS AG      | 86.77    | 100.08   | 741    | 119,774   | 素材                     |
| EVONIK INDUSTRIES AG         | 176.69   | 176.69   | 307    | 49,683    | 素材                     |
| VONOVIA SE                   | 463.39   | 523.13   | 1,357  | 219,253   | 不動産管理・開発               |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   | 100.89   | 100.89   | 456    | 73,668    | 自動車・自動車部品              |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 36.79    | 36.79    | 320    | 51,843    | 自動車・自動車部品              |
| KION GROUP AG                | 31.79    | —        | —      | —         | 資本財                    |
| ZALANDO SE                   | 123.67   | 174.18   | 384    | 62,115    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| BECHTLE AG                   | 43.05    | 43.05    | 197    | 31,823    | ソフトウェア・サービス            |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 52.69    | —        | —      | —         | 電気通信サービス               |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 1,272.33 | 1,460.2  | 1,645  | 265,835   | 金融サービス                 |
| COVESTRO AG                  | 117.97   | 160.49   | 779    | 125,974   | 素材                     |
| MTU AERO ENGINES AG          | 38.54    | 38.54    | 723    | 116,929   | 資本財                    |
| UNIPER SE                    | 46.97    | —        | —      | —         | 公益事業                   |
| COMMERZBANK AG               | 606.4    | 735.61   | 831    | 134,312   | 銀行                     |
| VOLKSWAGEN AG                | 19.6     | 19.6     | 234    | 37,813    | 自動車・自動車部品              |
| SARTORIUS AG-VORZUG          | 16.82    | 21.64    | 637    | 102,929   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 118.44   | 152.75   | 1,632  | 263,679   | 自動車・自動車部品              |
| LEG IMMOBILIEN SE            | 45.38    | 65.05    | 467    | 75,539    | 不動産管理・開発               |
| NEMETSCHKE SE                | 30.11    | 59.41    | 481    | 77,760    | ソフトウェア・サービス            |
| RATIONAL AG                  | 3.5      | 3.5      | 206    | 33,351    | 資本財                    |
| SYMRISE AG                   | 84.04    | 97.21    | 985    | 159,201   | 素材                     |
| DELIVERY HERO SE             | 85.3     | 132.93   | 404    | 65,321    | 消費者サービス                |
| SIEMENS ENERGY AG            | 318.78   | 409.28   | 440    | 71,159    | 資本財                    |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG     | 293.58   | 350.66   | 1,046  | 168,942   | 資本財                    |
| RHEINMETALL AG               | 28.99    | 28.99    | 797    | 128,853   | 資本財                    |
| DR ING HC F PORSCHE AG       | 70       | 84.98    | 721    | 116,498   | 自動車・自動車部品              |
| TALANX AG                    | —        | 53.45    | 351    | 56,716    | 保険                     |
| SIEMENS AG-REG               | 488.9    | 568.06   | 8,684  | 1,402,633 | 資本財                    |
| E.ON SE                      | 1,473.18 | 1,643.22 | 1,967  | 317,812   | 公益事業                   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 203.47   | 233.1    | 2,239  | 361,684   | 自動車・自動車部品              |
| GEA GROUP AG                 | 81.78    | 104.67   | 352    | 56,970    | 資本財                    |
| CONTINENTAL AG               | 80.78    | 80.78    | 578    | 93,414    | 自動車・自動車部品              |
| BASF SE                      | 590.53   | 643.23   | 2,764  | 446,459   | 素材                     |
| ALLIANZ SE-REG               | 263.07   | 295.98   | 6,837  | 1,104,266 | 保険                     |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | 103.98   | 130.09   | 928    | 149,975   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| RWE AG                       | 386.04   | 482.89   | 1,895  | 306,194   | 公益事業                   |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 331.48   | 508.85   | 408    | 65,911    | 運輸                     |
| BRENTAG SE                   | 99.2     | 121.53   | 938    | 151,648   | 資本財                    |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 232.54   | 312.27   | 892    | 144,092   | ヘルスケア機器・サービス           |
| SAP SE                       | 669.88   | 788.9    | 11,402 | 1,841,659 | ソフトウェア・サービス            |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 90.23    | 106.09   | 4,110  | 663,965   | 保険                     |
| BEIERSDORF AG                | 68.13    | 68.13    | 879    | 142,112   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| MERCK KGAA                   | 77.77    | 89.96    | 1,442  | 233,052   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADIDAS AG                    | 103.95   | 120.9    | 2,329  | 376,315   | 耐久消費財・アパレル             |
| PUMA SE                      | 64.59    | 96.01    | 561    | 90,682    | 耐久消費財・アパレル             |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      | 2,082.85 | 2,456.84 | 5,389  | 870,390   | 電気通信サービス               |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  | 136.13   | 171.25   | 638    | 103,111   | ヘルスケア機器・サービス           |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG       | 522.42   | 617.62   | 3,661  | 591,428   | 自動車・自動車部品              |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 796.41   | 971.2    | 3,467  | 559,984   | 半導体・半導体製造装置            |
| HANNOVER RUECK SE            | 35.98    | 42.98    | 934    | 150,981   | 保険                     |
| DHL GROUP                    | 621.78   | 730.67   | 3,135  | 506,383   | 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        |                        |
|                               | 株数        | 株数        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |                        |
| DEUTSCHE BOERSE AG            | 119.16    | 144.32    | 2,511  | 405,695    | 金融サービス                 |
| WACKER CHEMIE AG              | —         | 14.14     | 159    | 25,783     | 素材                     |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR    | 21.61     | 35.83     | 300    | 48,598     | ヘルスケア機器・サービス           |
| KNORR-BREMSE AG               | 38.81     | 72.17     | 417    | 67,442     | 資本財                    |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG       | 164.26    | 192.03    | 1,006  | 162,579    | ヘルスケア機器・サービス           |
| SCOUT24 SE                    | 46.71     | 46.71     | 295    | 47,769     | メディア・娯楽                |
| HELLOFRESH SE                 | 97.9      | 97.9      | 141    | 22,800     | 生活必需品流通・小売り            |
| 小計                            | 株数<br>銘柄数 | 株数<br>銘柄数 | 90,488 | 14,614,776 |                        |
|                               |           |           | —      | < 2.4% >   |                        |
| (ユーロ・・・ポルトガル)                 | 百株        | 百株        | 千ユーロ   | 千円         |                        |
| GALP ENERGIA SGPS SA          | 259.2     | 316.7     | 431    | 69,666     | エネルギー                  |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA   | 1,952.32  | 2,270.46  | 999    | 161,495    | 公益事業                   |
| JERONIMO MARTINS              | 173.93    | 221.06    | 497    | 80,404     | 生活必需品流通・小売り            |
| 小計                            | 株数<br>銘柄数 | 株数<br>銘柄数 | 1,929  | 311,566    |                        |
|                               |           |           | —      | < 0.1% >   |                        |
| (ユーロ・・・スペイン)                  | 百株        | 百株        | 千ユーロ   | 千円         |                        |
| TELEFONICA SA                 | 3,359.1   | 4,122.02  | 1,602  | 258,842    | 電気通信サービス               |
| FERROVIAL SA                  | 321.77    | —         | —      | —          | 資本財                    |
| AENA SME SA                   | 43.77     | 56.4      | 882    | 142,558    | 運輸                     |
| EDP RENOVAVEIS SA             | 177.64    | 272.94    | 446    | 72,052     | 公益事業                   |
| CAIXABANK SA                  | 2,907.77  | 3,080.48  | 1,292  | 208,812    | 銀行                     |
| CELLNEX TELECOM SA            | 328.3     | 411.67    | 1,444  | 233,375    | 電気通信サービス               |
| ENDESA SA                     | 141.04    | 255.35    | 487    | 78,771     | 公益事業                   |
| CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA  | —         | 68.49     | 183    | 29,579     | 公益事業                   |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA | 4,202.32  | 4,525.95  | 3,935  | 635,665    | 銀行                     |
| IBERDROLA SA                  | 3,768.63  | 4,498.51  | 5,085  | 821,369    | 公益事業                   |
| REPSOL SA                     | 964.57    | 964.57    | 1,352  | 218,492    | エネルギー                  |
| GRIFOLS SA                    | 151.69    | 151.69    | 192    | 31,016     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BANCO SANTANDER SA            | 10,464.74 | 12,299.19 | 4,671  | 754,450    | 銀行                     |
| AMADEUS IT GROUP SA           | 299.28    | 329.15    | 2,100  | 339,273    | 消費者サービス                |
| NATURGY ENERGY GROUP SA       | 106.03    | 106.03    | 288    | 46,579     | 公益事業                   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV   | 131.89    | 140.86    | 517    | 83,630     | 資本財                    |
| ACCIONA SA                    | 18.1      | 18.1      | 233    | 37,652     | 公益事業                   |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL    | 713.41    | 817.48    | 3,068  | 495,645    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE  | 197.73    | —         | —      | —          | 資本財                    |
| ENAGAS SA                     | 144.71    | 144.71    | 242    | 39,136     | 公益事業                   |
| REDEIA CORP SA                | 236.32    | 345.39    | 529    | 85,516     | 公益事業                   |
| 小計                            | 株数<br>銘柄数 | 株数<br>銘柄数 | 28,558 | 4,612,422  |                        |
|                               |           |           | —      | < 0.8% >   |                        |
| (ユーロ・・・イタリア)                  | 百株        | 百株        | 千ユーロ   | 千円         |                        |
| MONCLER SPA                   | 122.09    | 157.1     | 801    | 129,454    | 耐久消費財・アパレル             |
| PRYSMIAN SPA                  | 171.86    | 196.81    | 694    | 112,111    | 資本財                    |
| DIASORIN SPA                  | 13.13     | 13.13     | 113    | 18,271     | ヘルスケア機器・サービス           |
| POSTE ITALIANE SPA            | 347.2     | 347.2     | 340    | 55,033     | 保険                     |
| FINECOBANK SPA                | 430.93    | 430.93    | 527    | 85,154     | 銀行                     |
| ASSICURAZIONI GENERALI        | 723.82    | 723.82    | 1,373  | 221,767    | 保険                     |
| MEDIOBANCA SPA                | 477.08    | 477.08    | 511    | 82,678     | 銀行                     |
| UNICREDIT SPA                 | 1,279.61  | 1,415.13  | 3,583  | 578,822    | 銀行                     |
| INTESA SANPAOLO               | 10,118.86 | 11,630    | 3,077  | 497,014    | 銀行                     |
| MUNDYS SPA                    | 265.01    | —         | —      | —          | 運輸                     |
| ENI SPA                       | 1,601.58  | 1,671.2   | 2,524  | 407,788    | 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        |                        |
| ENEL SPA                       | 5,010.6   | 6,179.4   | 3,975   | 642,035       | 公益事業                   |
| SNAM SPA                       | 1,338.67  | 1,338.67  | 610     | 98,569        | 公益事業                   |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE | 1,016.86  | 1,016.86  | 753     | 121,663       | 公益事業                   |
| TELECOM ITALIA SPA             | 6,963.55  | 6,963.55  | 183     | 29,579        | 電気通信サービス               |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA    | 80.68     | 80.68     | 357     | 57,751        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMPLIFON SPA                   | 75.67     | 101.23    | 285     | 46,171        | ヘルスケア機器・サービス           |
| NEXI SPA                       | 308.53    | 570.6     | 405     | 65,450        | 金融サービス                 |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL   | 158.04    | 281.9     | 318     | 51,448        | 電気通信サービス               |
| 小計                             | 株数<br>銘柄数 | 株数<br>銘柄数 | 金額<br>— | 金額<br><0.5%>  |                        |
| (ユーロ・・・フィンランド)                 | 百株        | 百株        | 千ユーロ    | 千円            |                        |
| WARTSILA OYJ ABP               | 267.53    | 382.6     | 485     | 78,478        | 資本財                    |
| NESTE OYJ                      | 265.63    | 315.09    | 1,077   | 174,044       | エネルギー                  |
| UPM-KYMMENE OYJ                | 328.18    | 384.47    | 1,230   | 198,706       | 素材                     |
| NOKIA OYJ                      | 3,486.1   | 4,049.25  | 1,314   | 212,351       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| STORA ENSO OYJ-R SHS           | 392.28    | 392.28    | 470     | 75,933        | 素材                     |
| ELISA OYJ                      | 101.6     | 101.6     | 418     | 67,672        | 電気通信サービス               |
| SAMPO OYJ-A SHS                | 298.43    | 364.23    | 1,431   | 231,277       | 保険                     |
| FORTUM OYJ                     | 243.12    | 305       | 395     | 63,841        | 公益事業                   |
| KESKO OYJ-B SHS                | 202.5     | 202.5     | 354     | 57,186        | 生活必需品流通・小売り            |
| KONE OYJ-B                     | 206.23    | 242.25    | 987     | 159,476       | 資本財                    |
| ORION OYJ-CLASS B              | 62.61     | 105.42    | 384     | 62,146        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| METSO CORP                     | —         | 504.83    | 459     | 74,213        | 資本財                    |
| 小計                             | 株数<br>銘柄数 | 株数<br>銘柄数 | 金額<br>— | 金額<br><0.2%>  |                        |
| (ユーロ・・・オーストリア)                 | 百株        | 百株        | 千ユーロ    | 千円            |                        |
| OMV AG                         | 83.89     | 100.43    | 395     | 63,859        | エネルギー                  |
| ERSTE GROUP BANK AG            | 205.06    | 251.05    | 922     | 148,929       | 銀行                     |
| VOESTALPINE AG                 | 73.82     | 104.1     | 271     | 43,781        | 素材                     |
| VERBUND AG                     | 53.46     | 53.38     | 452     | 73,023        | 公益事業                   |
| 小計                             | 株数<br>銘柄数 | 株数<br>銘柄数 | 金額<br>— | 金額<br><0.1%>  |                        |
| (ユーロ・・・その他)                    | 百株        | 百株        | 千ユーロ    | 千円            |                        |
| AEGON LTD                      | 1,277.48  | 1,277.48  | 631     | 101,966       | 保険                     |
| DSM-FIRMENICH AG               | —         | 139.15    | 1,212   | 195,906       | 素材                     |
| 小計                             | 株数<br>銘柄数 | 株数<br>銘柄数 | 金額<br>— | 金額<br><0.0%>  |                        |
| ユーロ通貨計                         | 株数<br>銘柄数 | 株数<br>銘柄数 | 金額<br>— | 金額<br><9.3%>  |                        |
| 合計                             | 株数<br>銘柄数 | 株数<br>銘柄数 | 金額<br>— | 金額<br><95.9%> |                        |

※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      | 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          | %       |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    |   | 9,096    | 10,245 | 1,750     | 257,395     | 0.0     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     |   | 20,565   | 24,260 | 2,978     | 437,997     | 0.1     |
| BOSTON PROPERTIES INC        |   | 9,604    | 9,604  | 547       | 80,510      | 0.0     |
| VORNADO REALTY TRUST         |   | 8,706    | —      | —         | —           | —       |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  |   | 22,843   | 22,843 | 345       | 50,829      | 0.0     |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      |   | 7,141    | 8,176  | 2,004     | 294,839     | 0.0     |
| EQUITY RESIDENTIAL           |   | 22,609   | 26,128 | 1,478     | 217,416     | 0.0     |
| EQUINIX INC                  |   | 5,902    | 6,935  | 5,605     | 824,419     | 0.1     |
| AMERICAN TOWER CORP          |   | 28,877   | 34,996 | 7,215     | 1,061,179   | 0.2     |
| SUN COMMUNITIES INC          |   | 7,129    | 10,118 | 1,295     | 190,470     | 0.0     |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE |   | 17,613   | 17,613 | 808       | 118,844     | 0.0     |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    |   | 46,189   | 59,277 | 1,033     | 152,039     | 0.0     |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A     |   | 20,093   | 26,290 | 940       | 138,380     | 0.0     |
| REALTY INCOME CORP           |   | 36,686   | 49,884 | 2,677     | 393,746     | 0.1     |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   |   | 7,866    | 9,567  | 1,184     | 174,273     | 0.0     |
| INVITATION HOMES INC         |   | 36,871   | 44,730 | 1,474     | 216,825     | 0.0     |
| VICI PROPERTIES INC          |   | 60,354   | 76,652 | 2,270     | 333,912     | 0.1     |
| KIMCO REALTY CORP            |   | 35,169   | 44,824 | 852       | 125,384     | 0.0     |
| VENTAS INC                   |   | 23,363   | 28,342 | 1,287     | 189,280     | 0.0     |
| WEYERHAEUSER CO              |   | 47,220   | 54,126 | 1,715     | 252,341     | 0.0     |
| CROWN CASTLE INC             |   | 27,033   | 33,131 | 3,842     | 565,121     | 0.1     |
| IRON MOUNTAIN INC            |   | 19,659   | 23,774 | 1,504     | 221,254     | 0.0     |
| PROLOGIS INC                 |   | 59,103   | 69,206 | 7,823     | 1,150,535   | 0.2     |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT |   | 9,773    | 13,343 | 1,454     | 213,916     | 0.0     |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        |   | 6,009    | 7,861  | 705       | 103,761     | 0.0     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     |   | 4,379    | 4,379  | 929       | 136,680     | 0.0     |
| WELLTOWER INC                |   | 27,308   | 37,522 | 3,309     | 486,719     | 0.1     |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    |   | 36,377   | 36,377 | 623       | 91,698      | 0.0     |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  |   | 11,186   | 14,256 | 999       | 146,952     | 0.0     |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN |   | 22,502   | 35,166 | 636       | 93,610      | 0.0     |
| PUBLIC STORAGE               |   | 10,308   | 11,880 | 3,063     | 450,600     | 0.1     |
| REGENCY CENTERS CORP         |   | 9,608    | 13,101 | 805       | 118,438     | 0.0     |
| UDR INC                      |   | 20,610   | 20,610 | 686       | 100,905     | 0.0     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     |   | 18,137   | 22,476 | 3,106     | 456,826     | 0.1     |

## 外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘                            | 柄           | 期首 (前期末)  |           | 期           |            | 組入比率 |
|------------------------------|-------------|-----------|-----------|-------------|------------|------|
|                              |             | 口         | 数         | 評 価 額       |            |      |
|                              |             |           |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |      |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      |             | 8,530     | 15,328    | 1,985       | 291,998    | 0.0  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC |             | 31,858    | —         | —           | —          | —    |
| WP CAREY INC                 |             | 11,067    | 16,778    | 1,043       | 153,456    | 0.0  |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額   | 807,343   | 939,798   | 69,984      | 10,292,566 | 1.7  |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 37銘柄      | 35銘柄      |             | <1.7%>     |      |
| (カナダ)                        |             | 口         | 口         | 千カナダ・ドル     | 千円         |      |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA |             | 8,170     | 8,170     | 374         | 40,508     | 0.0  |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  |             | 7,441     | 7,441     | 129         | 14,034     | 0.0  |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額   | 15,611    | 15,611    | 504         | 54,542     | 0.0  |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 2銘柄       | 2銘柄       |             | <0.0%>     |      |
| (オーストラリア)                    |             | 口         | 口         | 千オーストラリア・ドル | 千円         |      |
| SCENTRE GROUP                |             | 350,311   | 350,311   | 921         | 89,782     | 0.0  |
| LENLEASE GROUP               |             | 36,263    | 63,652    | 424         | 41,373     | 0.0  |
| DEXUS/AU                     |             | 79,604    | 79,604    | 557         | 54,301     | 0.0  |
| TRANSURBAN GROUP             |             | 190,071   | 235,928   | 3,026       | 294,976    | 0.0  |
| APA GROUP                    |             | 75,718    | 89,811    | 756         | 73,692     | 0.0  |
| GPT GROUP                    |             | 121,221   | 121,221   | 494         | 48,196     | 0.0  |
| MIRVAC GROUP                 |             | 251,619   | 326,863   | 643         | 62,750     | 0.0  |
| STOCKLAND                    |             | 127,393   | 193,824   | 788         | 76,874     | 0.0  |
| GOODMAN GROUP                |             | 106,251   | 133,948   | 3,123       | 304,401    | 0.1  |
| VICINITY CENTRES             |             | 241,241   | 241,241   | 437         | 42,668     | 0.0  |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額   | 1,579,692 | 1,836,403 | 11,175      | 1,089,018  | 0.2  |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 10銘柄      | 10銘柄      |             | <0.2%>     |      |
| (香港)                         |             | 口         | 口         | 千香港・ドル      | 千円         |      |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     |             | 276,000   | 276,000   | 2,318       | 43,678     | 0.0  |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  |             | 193,500   | —         | —           | —          | —    |
| LINK REIT                    |             | 136,600   | 189,400   | 7,367       | 138,806    | 0.0  |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額   | 606,100   | 465,400   | 9,686       | 182,485    | 0.0  |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 3銘柄       | 2銘柄       |             | <0.0%>     |      |
| (シンガポール)                     |             | 口         | 口         | 千シンガポール・ドル  | 千円         |      |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT     |             | 219,000   | 267,000   | 758         | 83,698     | 0.0  |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMER |             | 303,516   | 408,716   | 756         | 83,461     | 0.0  |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST    |             | 208,100   | 208,100   | 337         | 37,211     | 0.0  |
| MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST |             | 112,400   | 112,400   | 153         | 16,997     | 0.0  |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額   | 843,016   | 996,216   | 2,005       | 221,368    | 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         | 評 価 額     |             | 組 入 比 率 |
|              |                           |           |           | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |         |
| (イギリス)       |                           | 口         | 口         | 千イギリス・ポンド | 千円          |         |
|              | LAND SECURITIES GROUP PLC | 39,861    | 59,857    | 376       | 70,300      | 0.0     |
|              | SEGRO PLC                 | 78,831    | 89,254    | 732       | 136,811     | 0.0     |
|              | BRITISH LAND CO PLC       | 49,008    | —         | —         | —           | —       |
| 小 計          | 口 数 ・ 金 額                 | 167,700   | 149,111   | 1,108     | 207,112     | 0.0     |
|              | 銘 柄 数 <比 率>               | 3銘柄       | 2銘柄       |           | <0.0%>      |         |
| (ユーロ・・・ベルギー) |                           | 口         | 口         | 千ユーロ      | 千円          |         |
|              | WAREHOUSES DE PAUW SCA    | 9,913     | 13,418    | 342       | 55,305      | 0.0     |
| 小 計          | 口 数 ・ 金 額                 | 9,913     | 13,418    | 342       | 55,305      | 0.0     |
|              | 銘 柄 数 <比 率>               | 1銘柄       | 1銘柄       |           | <0.0%>      |         |
| (ユーロ・・・フランス) |                           | 口         | 口         | 千ユーロ      | 千円          |         |
|              | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 7,024     | 8,942     | 512       | 82,696      | 0.0     |
|              | GECINA SA                 | 3,082     | 3,082     | 311       | 50,374      | 0.0     |
|              | KLEPIERRE                 | 13,600    | 18,172    | 419       | 67,797      | 0.0     |
|              | COVIVIO                   | 2,388     | 2,388     | 105       | 17,109      | 0.0     |
| 小 計          | 口 数 ・ 金 額                 | 26,094    | 32,584    | 1,349     | 217,977     | 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                 | 36,007    | 46,002    | 1,692     | 273,282     | 0.0     |
|              | 銘 柄 数 <比 率>               | 5銘柄       | 5銘柄       |           | <0.0%>      |         |
| 合 計          | 口 数 ・ 金 額                 | 4,055,469 | 4,448,541 | —         | 12,320,377  | 2.0     |
|              | 銘 柄 数 <比 率>               | 64銘柄      | 60銘柄      |           | <2.0%>      |         |

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

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※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 | S & P 500 EMINI FUT     |   | 百万円   | 百万円   |   |
|   |                         |   | 9,521 | —     |   |
| 国 | S P I 200 FUTURE S      |   | 378   | —     |   |
|   | F T S E 100 I D X F U T |   | 528   | —     |   |
|   | E U R O S T O X X 50    |   | 1,803 | —     |   |

※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

(2023年11月30日現在)

| 項 目                     | 期 末         |       |
|-------------------------|-------------|-------|
|                         | 評 価 額       | 比 率   |
|                         | 千円          | %     |
| 株 式                     | 582,354,704 | 95.7  |
| 投 資 証 券                 | 12,320,377  | 2.0   |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 14,153,283  | 2.3   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 608,828,365 | 100.0 |

※期末における外貨建資産（606,073,278千円）の投資信託財産総額（608,828,365千円）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=147.07円、1カナダ・ドル=108.21円、1オーストラリア・ドル=97.45円、1香港・ドル=18.84円、1シンガポール・ドル=110.38円、1ニュージーランド・ドル=90.70円、1イギリス・ポンド=186.84円、1イスラエル・シケル=39.913円、1スイス・フラン=168.56円、1デンマーク・クローネ=21.66円、1ノルウェー・クローネ=13.81円、1スウェーデン・クローナ=14.21円、1ユーロ=161.51円です。

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年11月30日現在)

| 項 目                | 期 末              |
|--------------------|------------------|
| (A) 資 産            | 610,174,345,116円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等    | 9,492,589,278    |
| 株 式(評価額)           | 582,354,704,334  |
| 投 資 証 券(評価額)       | 12,320,377,867   |
| 未 収 入 金            | 1,875,388,867    |
| 未 収 配 当 金          | 803,404,260      |
| 差 入 委 託 証 拠 金      | 3,327,880,510    |
| (B) 負 債            | 2,793,778,064    |
| 未 払 金              | 1,674,961,354    |
| 未 払 解 約 金          | 1,118,815,080    |
| そ の 他 未 払 費 用      | 1,630            |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 607,380,567,052  |
| 元 本                | 81,052,032,606   |
| 次 期 繰 越 損 益 金      | 526,328,534,446  |
| (D) 受 益 権 総 口 数    | 81,052,032,606口  |
| 1万口当たり基準価額(C/D)    | 74,937円          |

※当期における期首元本額72,186,242,919円、期中追加設定元本額18,357,964,761円、期中一部解約元本額9,492,175,074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2022年12月1日 至2023年11月30日)

| 項 目                    | 当 期              |
|------------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益          | 10,150,906,831円  |
| 受 取 配 当 金              | 10,013,863,956   |
| 受 取 利 息                | 69,313,021       |
| そ の 他 収 益 金            | 68,251,024       |
| 支 払 利 息                | △ 521,170        |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益    | 94,389,927,144   |
| 売 買 損 益                | 126,809,356,624  |
| 売 買 損 益                | △ 32,419,429,480 |
| (C) 先 物 取 引 等 損 益      | 2,548,514,080    |
| 取 引 損 益                | 3,602,791,451    |
| 取 引 損 益                | △ 1,054,277,371  |
| (D) そ の 他 費 用 等        | △ 170,689,072    |
| (E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D) | 106,918,658,983  |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金      | 370,015,318,533  |
| (G) 解 約 差 損 益 金        | △ 53,055,617,435 |
| (H) 追 加 信 託 差 損 益 金    | 102,450,174,365  |
| (I) 合 計(E+F+G+H)       | 526,328,534,446  |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I)       | 526,328,534,446  |

※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           | 40,993,532,445円 | 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)                       | 141,347円       |
| 三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型)          | 284,367,476円    | 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)                       | 2,079,027円     |
| 三井住友・DC年金バランス50 (標準型)            | 1,101,912,635円  | 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3 (安定成長型)                     | 9,297,239円     |
| 三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)          | 824,925,641円    | 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)                       | 5,432,744円     |
| SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)    | 31,803,096円     | 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)                     | 2,398,858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) | 809,182円        | SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)                      | 334,360,590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) | 4,287,286円      | バランスファンドVA (安定運用型) <適格機関投資家限定>                      | 2,083,168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) | 13,864,389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>                     | 12,733,609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) | 44,327,375円     | SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>                        | 352,745,446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) | 53,201,554円     | SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>                      | 563,666,379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) | 112,627,999円    | SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>                        | 2,492,534,646円 |
| 外国株式指数ファンド                       | 1,023,969,577円  | SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>                        | 8,325,935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   | 21,741,516,631円 | SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>                        | 40,662,080円    |
| アセットアロケーション・ファンド (安定型)           | 31,711,655円     | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>                        | 372,277,079円   |
| アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)         | 78,665,753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>                     | 29,673,252円    |
| アセットアロケーション・ファンド (成長型)           | 47,802,122円     | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>                     | 72,529,431円    |
| イオン・バランス戦略ファンド                   | 16,682,579円     | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>                     | 356,314,546円   |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050        | 25,577,368円     | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>                        | 228,424,293円   |
| 三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)         | 144,439,096円    | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>                        | 523,702,536円   |
| 三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)         | 132,408,735円    | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>                          | 179,149円       |
| 三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型)         | 516,674,455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)                 | 183,290,958円   |
| 三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型)         | 304,111,742円    | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>                       | 45,029,147円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型)         | 415,113,239円    | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>                   | 5,291,801円     |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド         | 62,415,696円     | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>                   | 5,839,402円     |
| 三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド          | 2,365,310,413円  | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>                   | 3,468,121円     |
| 三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)          | 10,909,978円     | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>                   | 12,153,717円    |
| 三井住友DS・年金バランス50 (標準型)            | 55,882,152円     | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>                   | 41,025,891円    |
| 三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)          | 52,967,585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>              | 88,244,496円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060        | 3,054,592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>            | 35,686,410円    |
| SMBC・DCインデックスファンド (MSCI コクサイ)    | 1,040,268,126円  | SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>                        | 148,918,344円   |
| 日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジあり)       | 216,434,937円    | SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>                       | 52,597,055円    |
| 日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジなし)       | 2,404,003,330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>                    | 667,223,190円   |
| 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド          | 110,398,522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>                    | 24,515,733円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035        | 309,886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>            | 15,507,627円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040        | 227,339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>                  | 24,710,830円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045        | 209,701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> | 12,302,074円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055        | 69,177円         | 三井住友・ニュー・アジア・ファンド (リスク3%)<適格機関投資家限定>                | 9,755,415円     |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065        | 117,577円        |   |                |

### ■ お知らせ

#### <約款変更について>

・信託金限度額を5,000億円から1兆円へ引き上げる信託約款の変更を行いました。

(適用日：2023年3月3日)

# SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド 〈適格機関投資家限定〉

(2022年12月20日から2023年12月18日まで)

## 第 20 期

決算日 2023年12月18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、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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。<br>外国債券パッシブ・マザーファンド<br>外国の国債  |
| 当ファンドの運用方法 | ■ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。<br>■ 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。<br>■ 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。<br>■ 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<br>■ 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。<br>■ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>外国債券パッシブ・マザーファンド<br>■ 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。<br>■ 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、以下の方針に基づき分配を行います。<br>■ 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。<br>■ 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 (2022年12月20日から2023年12月18日まで)

| 項 目       | 金 額 | 比 率     | 項 目 の 概 要   |
|-----------|-----|---------|---|
| (a) 信託報酬  | 13円 | 0.066%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数)<br>投信会社：ファンド運用の指図等の対価<br>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<br>受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (投信会社)    | (2) | (0.009) |   |
| (販売会社)    | (3) | (0.013) |   |
| (受託会社)    | (9) | (0.044) |   |
| (b) その他費用 | 9   | 0.043   | その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数<br>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<br>監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用<br>そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用            |
| (保管費用)    | (7) | (0.037) |   |
| (監査費用)    | (1) | (0.005) |   |
| (その他)     | (0) | (0.000) |   |
| 合 計       | 22  | 0.109   |   |

期中の平均基準価額は20,117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 (2022年12月20日から2023年12月18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<br>993,716 | 千円<br>2,048,450 | 千口<br>300,171 | 千円<br>637,721 |

### ■ 組 入 れ 資 産 の 明 細 (2023年12月18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<br>4,137,465 | 千口<br>4,831,010 | 千円<br>10,363,483 |

※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78,931,509,804口です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年12月18日現在)

| 項 目                   | 期 末             |
|-----------------------|-----------------|
| (A) 資 産               | 10,557,504,195円 |
| コール・ローン等              | 10,311          |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 10,363,483,971  |
| 未 収 入 金               | 194,009,913     |
| (B) 負 債               | 197,535,014     |
| 未 払 解 約 金             | 194,009,913     |
| 未 払 信 託 報 酬           | 3,253,988       |
| その他未払費用               | 271,113         |
| (C) 純資産総額(A-B)        | 10,359,969,181  |
| 元 本                   | 4,894,108,568   |
| 次期繰越損益金               | 5,465,860,613   |
| (D) 受益権総口数            | 4,894,108,568口  |
| 1万口当たり基準価額(C/D)       | 21,168円         |

※当期における期首元本額4,188,647,204円、期中追加設定元本額1,008,519,037円、期中一部解約元本額303,057,673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2022年12月20日 至2023年12月18日)

| 項 目                 | 当 期              |
|---------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益       | △ 1円             |
| 受 取 利 息             | 2                |
| 支 払 利 息             | △ 3              |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 703,071,083      |
| 売 買 損 益             | 744,711,098      |
| 売 買 損 益             | △ 41,640,015     |
| (C) 信 託 報 酬 等       | △ 6,517,448      |
| (D) 当期損益金(A+B+C)    | 696,553,634      |
| (E) 前期繰越損益金         | 338,580,890      |
| (F) 追加信託差損益金        | 4,430,726,089    |
| ( 配当等相当額 )          | ( 5,937,180,321) |
| ( 売買損益相当額 )         | (△1,506,454,232) |
| (G) 合 計 (D+E+F)     | 5,465,860,613    |
| 次期繰越損益金(G)          | 5,465,860,613    |
| 追加信託差損益金            | 4,430,726,089    |
| ( 配当等相当額 )          | ( 5,939,210,878) |
| ( 売買損益相当額 )         | (△1,508,484,789) |
| 分配準備積立金             | 1,035,134,524    |

※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      | 214,675,338円  |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 300,290,267   |
| (c) 収益調整金            | 5,939,210,878 |
| (d) 分配準備積立金          | 520,168,919   |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 6,974,345,402 |
| 1万口当たり当期分配対象額        | 14,250.49     |
| (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20期（2022年12月20日から2023年12月18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、円換算ベース）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)<br>F T S E 世界国債インデックス<br>(除く日本、<br>円換算ベース) |      | 公 社 債 率<br>組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|------------------|---------|------|---|------|--------------------|---------|
|                  | 期 騰 落   | 中 率  | 期 騰 落   | 中 率  |                    |         |
| 16期（2019年12月17日） | 円       | %    |   |      | %                  | 百万円     |
| 17期（2020年12月17日） | 18,248  | 4.0  | 184.64  | 4.1  | 98.6               | 171,892 |
| 18期（2021年12月17日） | 19,109  | 4.7  | 193.48  | 4.8  | 99.0               | 161,689 |
| 19期（2022年12月19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 |
| 20期（2023年12月18日） | 21,452  | 8.1  | 217.73  | 8.3  | 99.1               | 169,321 |

※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

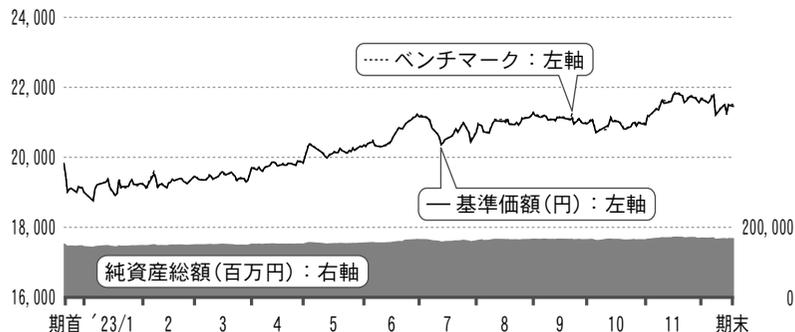
| 年 月 日                | 基 準 価 額     |        | (ベ ン チ マ ー ク)<br>F T S E 世界国債インデックス<br>(除く日本、<br>円換算ベース) |        | 公 社 債<br>組 入 比 率 |
|----------------------|-------------|--------|--|--------|------------------|
|                      |             | 騰 落 率  |  | 騰 落 率  |                  |
| (期 首)<br>2022年12月19日 | 円<br>19,845 | %<br>— | 200.98   | %<br>— | %<br>98.9        |
| 12月末                 | 19,003      | △4.2   | 192.47   | △4.2   | 99.7             |
| 2023年1月末             | 19,227      | △3.1   | 194.97   | △3.0   | 97.9             |
| 2月末                  | 19,458      | △2.0   | 197.06   | △2.0   | 99.0             |
| 3月末                  | 19,703      | △0.7   | 199.59   | △0.7   | 98.6             |
| 4月末                  | 19,845      | 0.0    | 200.89   | △0.0   | 98.7             |
| 5月末                  | 20,355      | 2.6    | 206.26   | 2.6    | 98.6             |
| 6月末                  | 21,163      | 6.6    | 214.73   | 6.8    | 98.7             |
| 7月末                  | 20,708      | 4.3    | 209.99   | 4.5    | 98.4             |
| 8月末                  | 21,270      | 7.2    | 215.66   | 7.3    | 98.8             |
| 9月末                  | 20,957      | 5.6    | 212.44   | 5.7    | 98.6             |
| 10月末                 | 20,931      | 5.5    | 212.31   | 5.6    | 98.6             |
| 11月末                 | 21,659      | 9.1    | 219.71   | 9.3    | 98.4             |
| (期 末)<br>2023年12月18日 | 21,452      | 8.1    | 217.73   | 8.3    | 99.1             |

※騰落率は期首比です。

# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について（2022年12月20日から2023年12月18日まで）

### 基準価額等の推移



|     |         |
|-----|---------|
| 期首  | 19,845円 |
| 期末  | 21,452円 |
| 騰落率 | +8.1%   |

※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、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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（2022年12月20日から2023年12月18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F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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：金利の変動による債券価格の感応度）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

- ・対円で投資通貨が上昇したこと
- ・保有する債券から得られるインカム収益

### ▶ 投資環境について (2022年12月20日から2023年12月18日まで)

債券市場は、米欧の長期金利はまちまちな動きとなりましたが、債券の利息収益などにより、トータルリターンはプラスとなりました。為替市場は投資通貨が対円で総じて上昇しました。

#### 債券市場

シリコンバレー銀行の破綻を受けて、米欧金利の急低下が見られた場面はありましたが、その後の底堅い経済指標などを背景に、先進国中銀の金融引き締め長期化などが警戒され、米欧金利は大きく上昇しました。

期末にかけては、米国などで景気減速の兆候が確認され、米欧金利は期中の上昇幅を縮小しました。

#### 為替市場

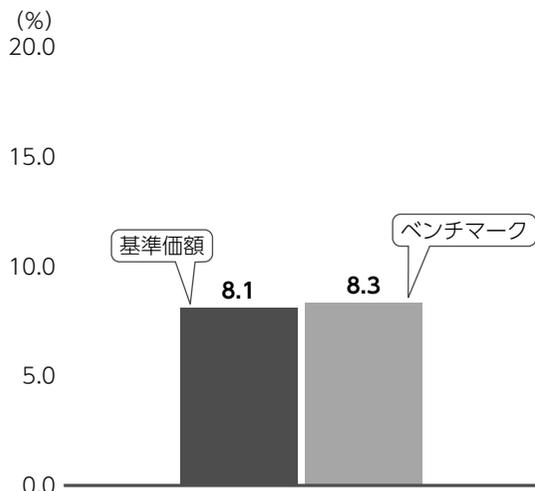
グローバルに長期金利が上昇するなか、対円で投資通貨は総じて上昇しました。日本銀行は段階的に金融政策の正常化を進めたものの、金融緩和的な姿勢を維持したことも円売り圧力となり、投資通貨の対円での上昇要因となりました。

### ▶ ポートフォリオについて (2022年12月20日から2023年12月18日まで)

F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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（2022年12月20日から2023年12月18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、円換算ベース）をベンチマークとしています。

記載のグラフは、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+8.1%となり、ベンチマークの騰落率+8.3%を0.2%下方乖離しました。

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

債券市場は、これまでの利上げに伴う景気減速が見込まれる中、F R B（米連邦準備制度理事会）など、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、金利の緩やかな低下を予想します。為替市場は、日本の貿易赤字拡大などの構造的な円安圧力が残るとみられるものの、グローバルに中銀のタカ派姿勢が緩むことも見込まれるなか、来年にかけては、海外通貨高・円安圧力が後退に向かう展開を予想します。

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（2022年12月20日から2023年12月18日まで）

| 項 目           | 金 額 | 比 率     | 項 目 の 概 要  |
|---------------|-----|---------|--|
| (a) そ の 他 費 用 | 8円  | 0.037%  | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数<br>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<br>そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| （保 管 費 用）     | (7) | (0.037) |  |
| （そ の 他）       | (0) | (0.000) |  |
| 合 計           | 8   | 0.037   |  |

期中の平均基準価額は20,380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 (2022年12月20日から2023年12月18日まで)

公社債

|   |                                      |         | 買 付 額                 | 売 付 額                 |
|---|--------------------------------------|---------|-----------------------|-----------------------|
| 外 | ア<br>メ<br>リ<br>カ                     | 国 債 証 券 | 千アメリカ・ドル<br>166,414   | 千アメリカ・ドル<br>175,494   |
|   | カ<br>ナ<br>ダ                          | 国 債 証 券 | 千カナダ・ドル<br>13,968     | 千カナダ・ドル<br>13,496     |
|   | オ<br>ー<br>ス<br>ト<br>ラ<br>リ<br>ア      | 国 債 証 券 | 千オーストラリア・ドル<br>4,961  | 千オーストラリア・ドル<br>6,172  |
|   | シ<br>ン<br>ガ<br>ポ<br>ー<br>ル           | 国 債 証 券 | 千シンガポール・ドル<br>652     | 千シンガポール・ドル<br>1,091   |
|   | ニ<br>ュ<br>ー<br>ジ<br>ー<br>ラ<br>ン<br>ド | 国 債 証 券 | 千ニュージーランド・ドル<br>1,220 | 千ニュージーランド・ドル<br>614   |
|   | イ<br>ギ<br>リ<br>ス                     | 国 債 証 券 | 千イギリス・ポンド<br>13,030   | 千イギリス・ポンド<br>6,630    |
|   | イ<br>ス<br>ラ<br>エ<br>ル                | 国 債 証 券 | 千イスラエル・シェケル<br>5,031  | 千イスラエル・シェケル<br>5,601  |
|   | デ<br>ン<br>マ<br>ー<br>ク                | 国 債 証 券 | 千デンマーク・クローネ<br>2,265  | 千デンマーク・クローネ<br>6,692  |
|   | ノ<br>ル<br>ウ<br>ェ<br>ー                | 国 債 証 券 | 千ノルウェー・クローネ<br>3,842  | 千ノルウェー・クローネ<br>5,381  |
|   | ス<br>ウ<br>ェ<br>ー<br>デ<br>ン           | 国 債 証 券 | 千スウェーデン・クローナ<br>1,648 | 千スウェーデン・クローナ<br>-     |
| 国 | メ<br>キ<br>シ<br>コ                     | 国 債 証 券 | 千メキシコ・ペソ<br>46,326    | 千メキシコ・ペソ<br>45,107    |
|   | 中<br>国                               | 国 債 証 券 | 千オフショア・人民元<br>390,413 | 千オフショア・人民元<br>42,117  |
|   | マ<br>レ<br>ー<br>シ<br>ア                | 国 債 証 券 | 千マレーシア・リンギット<br>4,963 | 千マレーシア・リンギット<br>4,212 |
|   | ポ<br>ー<br>ラ<br>ン<br>ド                | 国 債 証 券 | 千ポーランド・ズロチ<br>7,738   | 千ポーランド・ズロチ<br>7,749   |
|   | ユ<br>ー<br>ロ                          |         | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  |
|   | ア<br>イ<br>ル<br>ラ<br>ン<br>ド           | 国 債 証 券 | 165                   | 753                   |
|   | オ<br>ラ<br>ン<br>ダ                     | 国 債 証 券 | 4,106                 | 4,795                 |

## 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 | 3,419  | 4,448  |
|   | フランス   | 国債証券 | 17,460 | 18,347 |
|   | ドイツ    | 国債証券 | 19,721 | 20,478 |
|   | スペイン   | 国債証券 | 14,572 | 15,450 |
|   | イタリア   | 国債証券 | 16,695 | 17,408 |
| 国 | フィンランド | 国債証券 | 2,004  | 1,815  |
|   | オーストリア | 国債証券 | 2,481  | 2,030  |

※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 (2022年12月20日から2023年12月18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 (2022年12月20日から2023年12月18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 (2023年12月18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<br>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<br>618,370   | 千アメリカ・ドル<br>557,146   | 千円<br>79,226,218 | %<br>46.8 | %<br>-              | %<br>20.3         | %<br>18.1 | %<br>8.4 |
| カ ナ ダ   | 千カナダ・ドル<br>32,880     | 千カナダ・ドル<br>31,746     | 3,374,302        | 2.0       | -                   | 1.1               | 0.4       | 0.4      |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>27,550 | 千オーストラリア・ドル<br>24,820 | 2,367,160        | 1.4       | -                   | 1.0               | 0.3       | 0.1      |
| シンガポール  | 千シンガポール・ドル<br>6,900   | 千シンガポール・ドル<br>6,731   | 718,689          | 0.4       | -                   | 0.3               | 0.2       | 0.0      |

## 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<br>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・<br>ドル<br>5,090 | 千ニュージーランド・<br>ドル<br>4,419 | 391,136     | 0.2     | —                  | 0.1               | 0.1     | 0.0     |
| イギリス     | 千イギリス・ポンド<br>56,700       | 千イギリス・ポンド<br>48,955       | 8,829,074   | 5.2     | —                  | 3.7               | 1.1     | 0.5     |
| イスラエル    | 千イスラエル・シケル<br>13,700      | 千イスラエル・シケル<br>13,001      | 502,544     | 0.3     | —                  | 0.1               | 0.1     | 0.1     |
| デンマーク    | 千デンマーク・クローネ<br>22,100     | 千デンマーク・クローネ<br>22,378     | 465,241     | 0.3     | —                  | 0.2               | 0.1     | 0.0     |
| ノルウェー    | 千ノルウェー・クローネ<br>22,900     | 千ノルウェー・クローネ<br>21,430     | 290,591     | 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<br>24,900    | 千スウェーデン・クローナ<br>24,916    | 344,849     | 0.2     | —                  | 0.1               | 0.1     | 0.0     |
| メキシコ     | 千メキシコ・ペソ<br>194,000       | 千メキシコ・ペソ<br>182,768       | 1,508,916   | 0.9     | —                  | 0.6               | 0.2     | 0.1     |
| 中国       | 千オフショア・人民元<br>625,900     | 千オフショア・人民元<br>635,185     | 12,668,272  | 7.5     | —                  | 3.2               | 3.2     | 1.0     |
| マレーシア    | 千マレーシア・リンギット<br>27,100    | 千マレーシア・リンギット<br>27,761    | 845,469     | 0.5     | —                  | 0.3               | 0.1     | 0.1     |
| ポーランド    | 千ポーランド・ズロチ<br>27,200      | 千ポーランド・ズロチ<br>24,162      | 863,842     | 0.5     | —                  | 0.2               | 0.2     | 0.1     |
| ユ ー ロ    | 千ユーロ                      | 千ユーロ                      |             |         |                    |                   |         |         |
| アイルランド   | 6,600                     | 6,095                     | 944,746     | 0.6     | —                  | 0.4               | 0.1     | 0.1     |
| オランダ     | 17,300                    | 16,539                    | 2,563,695   | 1.5     | —                  | 0.9               | 0.5     | 0.1     |
| ベルギー     | 21,050                    | 19,378                    | 3,003,708   | 1.8     | —                  | 1.2               | 0.5     | 0.1     |
| フランス     | 97,470                    | 91,058                    | 14,114,093  | 8.3     | —                  | 4.9               | 2.5     | 0.9     |
| ドイツ      | 74,750                    | 71,256                    | 11,044,707  | 6.5     | —                  | 3.6               | 2.1     | 0.9     |
| スペイン     | 54,700                    | 53,007                    | 8,216,216   | 4.9     | —                  | 2.9               | 1.4     | 0.6     |
| イタリア     | 84,520                    | 81,451                    | 12,624,939  | 7.5     | —                  | 4.2               | 2.2     | 1.1     |
| フィンランド   | 6,100                     | 5,467                     | 847,436     | 0.5     | —                  | 0.3               | 0.2     | 0.0     |
| オーストリア   | 14,000                    | 12,872                    | 1,995,293   | 1.2     | —                  | 0.7               | 0.3     | 0.1     |
| 合 計      | —                         | —                         | 167,751,148 | 99.1    | —                  | 50.4              | 33.9    | 14.8    |

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

※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         |            |  |
| ア メ リ カ         | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.1250 | 2,300    | 1,967    | 279,793    | 2043/02/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.8750 | 1,200    | 985      | 140,134    | 2043/05/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.6250 | 500      | 459      | 65,370     | 2043/08/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.7500 | 700      | 654      | 93,119     | 2043/11/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.3750 | 500      | 441      | 62,741     | 2044/05/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.6250 | 300      | 275      | 39,135     | 2044/02/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.1250 | 1,300    | 1,101    | 156,685    | 2044/08/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.0000 | 2,500    | 2,419    | 344,095    | 2025/02/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.0000 | 1,000    | 828      | 117,842    | 2044/11/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.5000 | 1,400    | 1,061    | 151,004    | 2045/02/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.1250 | 600      | 579      | 82,344     | 2025/05/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.0000 | 900      | 743      | 105,775    | 2045/05/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.0000 | 3,300    | 3,166    | 450,231    | 2025/08/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.8750 | 800      | 646      | 91,875     | 2045/08/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.2500 | 4,000    | 3,839    | 545,991    | 2025/11/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.0000 | 800      | 659      | 93,740     | 2045/11/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 1.6250 | 2,900    | 2,737    | 389,311    | 2026/02/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.5000 | 1,000    | 751      | 106,863    | 2046/02/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 1.6250 | 11,450   | 10,764   | 1,530,742  | 2026/05/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.5000 | 1,000    | 750      | 106,650    | 2046/05/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.2500 | 1,950    | 1,389    | 197,594    | 2046/08/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.0000 | 1,000    | 941      | 133,904    | 2026/11/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.8750 | 3,000    | 2,407    | 342,312    | 2046/11/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.2500 | 4,400    | 4,162    | 591,887    | 2027/02/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.0000 | 2,500    | 2,049    | 291,374    | 2047/02/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.3750 | 3,000    | 2,839    | 403,828    | 2027/05/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 3.0000 | 1,800    | 1,474    | 209,636    | 2047/05/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.2500 | 4,200    | 3,947    | 561,345    | 2027/08/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.7500 | 1,800    | 1,406    | 199,981    | 2047/08/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.7500 | 1,500    | 1,171    | 166,619    | 2047/11/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.2500 | 4,400    | 4,121    | 586,118    | 2027/11/15 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.1250 | 2,600    | 2,531    | 359,970    | 2024/11/30 |  |
|                 | US TREASURY N/B | 国債証券   | 2.2500 | 3,900    | 3,797    | 540,005    | 2024/12/31 |  |
| US TREASURY N/B | 国債証券            | 2.5000 | 3,400  | 3,314    | 471,325  | 2025/01/31 |            |  |
| US TREASURY N/B | 国債証券            | 2.7500 | 5,300  | 5,047    | 717,785  | 2028/02/15 |            |  |
| US TREASURY N/B | 国債証券            | 3.0000 | 2,400  | 1,962    | 279,088  | 2048/02/15 |            |  |
| US TREASURY N/B | 国債証券            | 2.7500 | 2,000  | 1,952    | 277,688  | 2025/02/28 |            |  |
| US TREASURY N/B | 国債証券            | 2.6250 | 1,000  | 973      | 138,433  | 2025/03/31 |            |  |

## 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 | 2.8750 | 400     | 390       | 55,493      | 2025/04/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.8750 | 3,500   | 3,342     | 475,358     | 2028/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.1250 | 2,400   | 2,007     | 285,398     | 2048/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.8750 | 3,100   | 3,022     | 429,821     | 2025/05/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.7500 | 900     | 875       | 124,492     | 2025/06/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.8750 | 4,500   | 4,291     | 610,202     | 2028/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.0000 | 2,000   | 1,634     | 232,394     | 2048/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.7500 | 3,400   | 3,300     | 469,352     | 2025/08/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.0000 | 1,000   | 974       | 138,561     | 2025/09/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.0000 | 2,600   | 2,532     | 360,085     | 2025/10/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.1250 | 2,900   | 2,792     | 397,076     | 2028/11/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.3750 | 3,100   | 2,712     | 385,655     | 2048/11/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.8750 | 2,500   | 2,428     | 345,265     | 2025/11/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.6250 | 1,400   | 1,352     | 192,281     | 2025/12/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.6250 | 2,200   | 2,123     | 301,899     | 2026/01/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.6250 | 1,800   | 1,688     | 240,046     | 2029/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.0000 | 3,300   | 2,696     | 383,422     | 2049/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.5000 | 2,100   | 2,019     | 287,185     | 2026/02/28 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.2500 | 8,200   | 7,838     | 1,114,605   | 2026/03/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.3750 | 2,400   | 2,216     | 315,250     | 2029/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.8750 | 1,400   | 1,117     | 158,925     | 2049/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.8750 | 2,500   | 2,356     | 335,062     | 2026/07/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.6250 | 3,750   | 3,322     | 472,464     | 2029/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.2500 | 3,500   | 2,455     | 349,216     | 2049/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.3750 | 600     | 557       | 79,246      | 2026/08/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.6250 | 900     | 840       | 119,546     | 2026/09/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.7500 | 1,300   | 1,155     | 164,347     | 2029/11/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.3750 | 1,900   | 1,369     | 194,764     | 2049/11/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.6250 | 200     | 186       | 26,470      | 2026/11/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.5000 | 800     | 774       | 110,120     | 2024/11/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.5000 | 2,100   | 1,822     | 259,169     | 2030/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.0000 | 2,800   | 1,853     | 263,530     | 2050/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.1250 | 2,000   | 1,824     | 259,475     | 2027/02/28 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.5000 | 1,600   | 1,515     | 215,472     | 2025/03/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.6250 | 2,400   | 2,147     | 305,363     | 2027/03/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.7500 | 2,500   | 2,333     | 331,805     | 2026/12/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.5000 | 4,400   | 4,068     | 578,484     | 2027/01/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.1250 | 1,500   | 1,436     | 204,296     | 2025/02/28 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.3750 | 1,900   | 1,829     | 260,104     | 2025/01/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.7500 | 4,000   | 3,874     | 550,894     | 2024/12/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.6250 | 5,000   | 4,068     | 578,547     | 2030/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.2500 | 5,100   | 2,765     | 393,301     | 2050/05/15 |

## 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 | 0.2500 | 4,400   | 4,128     | 587,106     | 2025/05/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.1250 | 3,800   | 2,436     | 346,441     | 2040/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.5000 | 2,500   | 2,216     | 315,211     | 2027/05/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.3750 | 3,000   | 2,829     | 402,300     | 2025/04/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.5000 | 1,200   | 1,066     | 151,681     | 2027/04/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.2500 | 2,900   | 2,713     | 385,880     | 2025/06/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.5000 | 4,000   | 3,536     | 502,830     | 2027/06/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.2500 | 300     | 279       | 39,797      | 2025/07/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.3750 | 2,500   | 2,194     | 311,997     | 2027/07/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.6250 | 4,800   | 3,876     | 551,296     | 2030/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.3750 | 4,500   | 2,523     | 358,779     | 2050/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.1250 | 3,100   | 1,969     | 280,123     | 2040/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.2500 | 2,000   | 1,855     | 263,817     | 2025/09/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.3750 | 4,800   | 4,191     | 596,100     | 2027/09/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.8750 | 4,900   | 4,009     | 570,209     | 2030/11/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.6250 | 3,200   | 1,918     | 272,773     | 2050/11/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.1250 | 5,700   | 4,737     | 673,680     | 2031/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.8750 | 5,800   | 3,703     | 526,568     | 2051/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.7500 | 5,900   | 5,179     | 736,515     | 2028/01/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.3750 | 2,000   | 1,849     | 262,996     | 2025/11/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.3750 | 3,000   | 2,768     | 393,645     | 2025/12/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.6250 | 3,400   | 2,984     | 424,374     | 2027/11/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.6250 | 7,200   | 6,304     | 896,494     | 2027/12/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.3750 | 3,500   | 2,311     | 328,750     | 2040/11/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.8750 | 3,300   | 2,365     | 336,323     | 2041/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.5000 | 1,000   | 875       | 124,460     | 2027/10/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.2500 | 1,000   | 925       | 131,539     | 2025/10/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.6250 | 5,500   | 4,700     | 668,476     | 2031/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.7500 | 1,500   | 1,381     | 196,517     | 2026/04/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.3750 | 3,900   | 2,801     | 398,354     | 2051/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.2500 | 5,000   | 3,800     | 540,438     | 2041/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.7500 | 2,000   | 1,838     | 261,429     | 2026/05/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.8750 | 2,000   | 1,841     | 261,923     | 2026/06/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.2500 | 3,000   | 2,663     | 378,773     | 2028/06/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.2500 | 3,000   | 2,668     | 379,473     | 2028/05/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.2500 | 5,200   | 4,288     | 609,890     | 2031/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.1250 | 3,500   | 3,077     | 437,582     | 2028/08/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.0000 | 2,900   | 1,907     | 271,185     | 2051/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.7500 | 4,400   | 3,054     | 434,328     | 2041/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.6250 | 800     | 729       | 103,765     | 2026/07/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.0000 | 2,900   | 2,539     | 361,170     | 2028/07/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.7500 | 1,500   | 1,369     | 194,742     | 2026/08/31 |

## 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 | 1.2500 | 3,000   | 2,648     | 376,589     | 2028/09/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.8750 | 2,500   | 2,286     | 325,190     | 2026/09/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.8750 | 3,300   | 2,102     | 298,956     | 2051/11/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.3750 | 4,900   | 4,056     | 576,787     | 2031/11/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.1250 | 3,700   | 3,400     | 483,522     | 2026/10/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.2500 | 4,200   | 3,866     | 549,759     | 2026/11/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.3750 | 3,000   | 2,659     | 378,189     | 2028/10/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.0000 | 3,800   | 2,744     | 390,215     | 2041/11/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.0000 | 4,500   | 4,331     | 615,878     | 2024/12/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.5000 | 4,500   | 4,006     | 569,792     | 2028/11/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.1250 | 2,000   | 1,922     | 273,439     | 2025/01/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.2500 | 2,300   | 2,115     | 300,757     | 2026/12/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.3750 | 2,500   | 2,208     | 313,984     | 2028/12/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.8750 | 5,300   | 4,544     | 646,203     | 2032/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.5000 | 3,000   | 2,888     | 410,683     | 2025/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.7500 | 4,300   | 3,864     | 549,592     | 2029/01/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.3750 | 2,800   | 2,145     | 305,074     | 2042/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.2500 | 1,700   | 1,187     | 168,862     | 2052/02/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.8750 | 2,800   | 2,528     | 359,538     | 2029/02/28 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.8750 | 3,400   | 3,175     | 451,521     | 2027/02/28 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.7500 | 1,500   | 1,445     | 205,574     | 2025/03/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.3750 | 5,000   | 4,625     | 657,738     | 2029/03/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.6250 | 4,500   | 4,378     | 622,648     | 2025/04/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.5000 | 3,000   | 2,857     | 406,285     | 2027/03/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.8750 | 3,500   | 3,317     | 471,799     | 2029/04/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.8750 | 5,700   | 5,269     | 749,303     | 2032/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.7500 | 3,000   | 2,920     | 415,333     | 2025/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.7500 | 1,600   | 1,534     | 218,150     | 2027/04/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.2500 | 2,200   | 1,928     | 274,198     | 2042/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.8750 | 3,200   | 2,565     | 364,837     | 2052/05/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.8750 | 2,000   | 1,948     | 277,133     | 2025/06/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.6250 | 4,800   | 4,579     | 651,148     | 2027/05/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.7500 | 1,400   | 1,317     | 187,352     | 2029/05/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.0000 | 2,000   | 1,951     | 277,483     | 2025/07/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.2500 | 3,000   | 2,895     | 411,681     | 2029/06/30 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.7500 | 4,200   | 3,836     | 545,501     | 2032/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.1250 | 3,000   | 2,931     | 416,882     | 2025/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 2.6250 | 1,100   | 1,026     | 145,994     | 2029/07/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.3750 | 3,000   | 2,672     | 380,045     | 2042/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.0000 | 3,000   | 2,468     | 351,066     | 2052/08/15 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.1250 | 2,700   | 2,585     | 367,664     | 2029/08/31 |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.2500 | 2,000   | 1,991     | 283,171     | 2025/10/15 |

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

| 区 分 | 銘 柄             | 種 類  | 期      |         |           |             | 末          |  |
|-----|-----------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|--|
|     |                 |      | 利 率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |             | 償 還 年 月 日  |  |
|     |                 |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.8750 | 2,300   | 2,289     | 325,539     | 2029/09/30 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.1250 | 5,600   | 5,679     | 807,603     | 2032/11/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.5000 | 3,800   | 3,803     | 540,808     | 2025/11/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.1250 | 3,500   | 3,512     | 499,456     | 2027/10/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.0000 | 1,600   | 1,602     | 227,936     | 2029/10/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.0000 | 2,000   | 1,944     | 276,487     | 2042/11/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.0000 | 2,600   | 2,580     | 366,972     | 2052/11/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.2500 | 1,500   | 1,490     | 211,960     | 2024/12/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.1250 | 3,500   | 3,474     | 494,051     | 2025/01/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.8750 | 5,300   | 5,246     | 746,002     | 2026/01/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.8750 | 4,400   | 4,379     | 622,826     | 2027/12/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.8750 | 1,500   | 1,493     | 212,316     | 2029/12/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.5000 | 6,100   | 5,900     | 839,020     | 2033/02/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.5000 | 1,000   | 981       | 139,508     | 2028/01/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.6250 | 3,800   | 3,792     | 539,257     | 2025/02/28 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.0000 | 2,000   | 1,985     | 282,309     | 2026/02/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.5000 | 2,500   | 2,437     | 346,665     | 2030/01/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.8750 | 2,600   | 2,480     | 352,668     | 2043/02/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.6250 | 1,700   | 1,579     | 224,561     | 2053/02/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.0000 | 1,500   | 1,503     | 213,790     | 2030/02/28 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.0000 | 5,000   | 5,001     | 711,191     | 2028/02/29 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.6250 | 2,500   | 2,515     | 357,693     | 2026/03/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.7500 | 3,300   | 3,260     | 463,657     | 2026/04/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.6250 | 3,000   | 2,957     | 420,572     | 2028/03/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.6250 | 1,200   | 1,177     | 167,500     | 2030/03/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.3750 | 5,500   | 5,265     | 748,735     | 2033/05/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.8750 | 1,000   | 988       | 140,583     | 2025/04/30 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.6250 | 2,500   | 2,463     | 350,373     | 2026/05/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.6250 | 2,000   | 1,972     | 280,549     | 2028/05/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.5000 | 2,500   | 2,436     | 346,452     | 2030/04/30 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.8750 | 1,500   | 1,430     | 203,417     | 2043/05/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.6250 | 2,100   | 1,953     | 277,809     | 2053/05/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.1250 | 2,000   | 1,994     | 283,603     | 2026/06/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.7500 | 3,000   | 2,965     | 421,664     | 2030/05/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.0000 | 3,000   | 3,005     | 427,346     | 2028/06/30 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.5000 | 3,900   | 3,926     | 558,345     | 2026/07/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.1250 | 1,000   | 1,007     | 143,232     | 2028/07/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.7500 | 4,400   | 4,348     | 618,378     | 2030/06/30 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 3.8750 | 5,000   | 4,981     | 708,333     | 2033/08/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.3750 | 4,000   | 4,016     | 571,120     | 2026/08/15 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.0000 | 2,200   | 2,206     | 313,712     | 2030/07/31 |  |
|     | US TREASURY N/B | 国債証券 | 4.3750 | 500     | 510       | 72,582      | 2043/08/15 |  |

## 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 | 4.1250 | 1,000          | 1,016          | 144,587     | 2053/08/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.1250 | 500            | 505            | 71,813      | 2030/08/31 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.6250 | 4,000          | 4,045          | 575,216     | 2026/09/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.3750 | 1,000          | 1,018          | 144,815     | 2028/08/31 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.6250 | 1,000          | 1,012          | 143,910     | 2026/10/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.6250 | 1,500          | 1,560          | 221,863     | 2030/09/30 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.5000 | 2,400          | 2,514          | 357,569     | 2033/11/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.6250 | 2,800          | 2,835          | 403,228     | 2026/11/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 6.0000 | 1,000          | 1,033          | 146,987     | 2026/02/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 6.1250 | 1,000          | 1,075          | 152,924     | 2027/11/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 5.2500 | 500            | 528            | 75,185      | 2028/11/15 |
|     | US TREASURY BOND    | 国債証券 | 5.3750 | 320            | 350            | 49,782      | 2031/02/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.5000 | 2,000          | 2,118          | 301,190     | 2038/05/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 3.5000 | 200            | 188            | 26,811      | 2039/02/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.2500 | 100            | 102            | 14,585      | 2039/05/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.5000 | 300            | 316            | 44,950      | 2039/08/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.3750 | 300            | 311            | 44,250      | 2039/11/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.6250 | 1,000          | 1,066          | 151,697     | 2040/02/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.3750 | 900            | 930            | 132,328     | 2040/05/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 3.8750 | 500            | 485            | 69,056      | 2040/08/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.2500 | 600            | 609            | 86,633      | 2040/11/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.7500 | 900            | 969            | 137,857     | 2041/02/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 4.3750 | 300            | 308            | 43,901      | 2041/05/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 3.7500 | 1,100          | 1,044          | 148,552     | 2041/08/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 3.1250 | 1,000          | 867            | 123,416     | 2041/11/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 3.1250 | 1,000          | 865            | 123,062     | 2042/02/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 3.0000 | 800            | 676            | 96,223      | 2042/05/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 2.7500 | 2,000          | 1,621          | 230,634     | 2042/08/15 |
|     | US TREASURY N/B     | 国債証券 | 2.7500 | 300            | 242            | 34,481      | 2042/11/15 |
|     | 小 計                 |      | —      | 618,370        | 557,146        | 79,226,218  | —          |
| カナダ | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 5.7500 | 千カナダ・ドル<br>250 | 千カナダ・ドル<br>282 | 29,994      | 2029/06/01 |
|     | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 5.7500 | 300            | 363            | 38,671      | 2033/06/01 |
|     | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 5.0000 | 400            | 481            | 51,212      | 2037/06/01 |
|     | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0000 | 1,300          | 1,474          | 156,681     | 2041/06/01 |
|     | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5000 | 1,200          | 1,301          | 138,356     | 2045/12/01 |
|     | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.2500 | 500            | 487            | 51,768      | 2025/06/01 |
|     | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 1,300          | 1,257          | 133,635     | 2048/12/01 |
|     | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 1.5000 | 2,600          | 2,470          | 262,602     | 2026/06/01 |
|     | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 1.0000 | 800            | 740            | 78,654      | 2027/06/01 |
|     | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.0000 | 700            | 665            | 70,737      | 2028/06/01 |
|     | CANADIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.2500 | 1,100          | 1,051          | 111,786     | 2029/06/01 |

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

| 区 分     | 銘 柄                   | 種 類  | 期 末    |                    |                    |             |            |
|---------|-----------------------|------|--------|--------------------|--------------------|-------------|------------|
|         |                       |      | 利 率    | 額 面 金 額            | 評 価 額              |             | 償 還 年 月 日  |
|         |                       |      |        |                    | 外 貨 建 金 額          | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 1.2500 | 500                | 444                | 47,262      | 2030/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 0.5000 | 2,700              | 2,547              | 270,742     | 2025/09/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 1.7500 | 1,100              | 845                | 89,858      | 2053/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 1.2500 | 400                | 373                | 39,718      | 2027/03/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 1.5000 | 2,300              | 2,036              | 216,490     | 2031/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 1.5000 | 300                | 289                | 30,781      | 2025/04/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.2500 | 1,000              | 953                | 101,320     | 2029/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.0000 | 2,000              | 1,832              | 194,787     | 2032/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.7500 | 2,300              | 2,250              | 239,171     | 2027/09/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 3.0000 | 900                | 884                | 94,048      | 2025/10/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.5000 | 2,930              | 2,786              | 296,194     | 2032/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 3.0000 | 200                | 196                | 20,907      | 2026/04/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.7500 | 1,800              | 1,746              | 185,614     | 2033/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.7500 | 200                | 192                | 20,479      | 2055/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 3.5000 | 1,000              | 990                | 105,288     | 2025/08/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 3.2500 | 300                | 303                | 32,256      | 2033/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 4.5000 | 1,800              | 1,817              | 193,216     | 2025/11/01 |
|         | CANADA GOVERNMENT     | 国債証券 | 2.7500 | 700                | 677                | 72,063      | 2064/12/01 |
|         | 小 計                   |      | -      | 32,880             | 31,746             | 3,374,302   | -          |
| オーストラリア | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.2500 | 千オーストラリア・ドル<br>800 | 千オーストラリア・ドル<br>776 | 74,090      | 2029/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.5000 | 1,500              | 1,543              | 147,217     | 2033/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.2500 | 2,150              | 2,170              | 207,030     | 2026/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7500 | 900                | 853                | 81,407      | 2037/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 800                | 695                | 66,332      | 2035/06/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 2,600              | 2,502              | 238,683     | 2027/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.2500 | 2,000              | 1,752              | 167,170     | 2039/06/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.2500 | 1,300              | 1,218              | 116,222     | 2028/05/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.0000 | 1,200              | 941                | 89,766      | 2047/03/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 200                | 190                | 18,165      | 2028/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 1,800              | 1,691              | 161,360     | 2029/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.5000 | 2,200              | 2,022              | 192,928     | 2030/05/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 600                | 478                | 45,669      | 2041/05/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 1.5000 | 4,400              | 3,688              | 351,727     | 2031/06/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 1.2500 | 800                | 639                | 61,016      | 2032/05/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 1.7500 | 500                | 284                | 27,151      | 2051/06/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 0.2500 | 1,300              | 1,213              | 115,727     | 2025/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 0.5000 | 100                | 91                 | 8,724       | 2026/09/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 1.7500 | 1,400              | 1,155              | 110,160     | 2032/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.0000 | 1,000              | 908                | 86,606      | 2033/11/21 |
|         | 小 計                   |      | -      | 27,550             | 24,820             | 2,367,160   | -          |

## 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 |            |
| シンガポール   | SINGAPORE GOVERNMENT   | 国債証券 | 3.5000 | 千シンガポール・ドル<br>1,000   | 千シンガポール・ドル<br>1,017   | 108,660     | 2027/03/01 |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.8750 | 200                   | 201                   | 21,501      | 2030/09/01 |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.7500 | 700                   | 690                   | 73,696      | 2042/04/01 |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 国債証券 | 3.3750 | 400                   | 421                   | 44,962      | 2033/09/01 |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.7500 | 1,000                 | 974                   | 103,984     | 2046/03/01 |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.2500 | 1,000                 | 946                   | 100,994     | 2036/08/01 |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 国債証券 | 2.6250 | 800                   | 796                   | 85,040      | 2028/05/01 |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 国債証券 | 0.5000 | 200                   | 189                   | 20,283      | 2025/11/01 |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 国債証券 | 1.6250 | 1,000                 | 923                   | 98,539      | 2031/07/01 |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 国債証券 | 1.2500 | 600                   | 571                   | 61,026      | 2026/11/01 |
| 小 計      |                        |      | -      | 6,900                 | 6,731                 | 718,689     | -          |
| 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<br>1,100 | 千ニュージーランド・ドル<br>1,100 | 97,423      | 2027/04/15 |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 550                   | 534                   | 47,288      | 2025/04/15 |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 国債証券 | 3.0000 | 1,000                 | 933                   | 82,593      | 2029/04/20 |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 国債証券 | 1.7500 | 700                   | 446                   | 39,540      | 2041/05/15 |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 500                   | 343                   | 30,431      | 2051/05/15 |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 国債証券 | 0.5000 | 100                   | 90                    | 8,034       | 2026/05/15 |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 国債証券 | 2.0000 | 970                   | 799                   | 70,749      | 2032/05/15 |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 国債証券 | 4.5000 | 170                   | 170                   | 15,075      | 2030/05/15 |
| 小 計      |                        |      | -      | 5,090                 | 4,419                 | 391,136     | -          |
| イギリス     | UK GILT                | 国債証券 | 6.0000 | 千イギリス・ポンド<br>650      | 千イギリス・ポンド<br>718      | 129,631     | 2028/12/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.2500 | 500                   | 522                   | 94,260      | 2032/06/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 5.0000 | 1,300                 | 1,307                 | 235,744     | 2025/03/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.2500 | 700                   | 725                   | 130,780     | 2036/03/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.7500 | 1,000                 | 1,080                 | 194,888     | 2038/12/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.2500 | 1,700                 | 1,726                 | 311,433     | 2055/12/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.2500 | 1,500                 | 1,513                 | 272,932     | 2046/12/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.2500 | 900                   | 917                   | 165,504     | 2027/12/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.5000 | 1,050                 | 1,098                 | 198,135     | 2042/12/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.7500 | 1,150                 | 1,231                 | 222,078     | 2030/12/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.2500 | 900                   | 908                   | 163,897     | 2049/12/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.2500 | 600                   | 612                   | 110,508     | 2039/09/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.5000 | 400                   | 424                   | 76,556      | 2034/09/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.0000 | 1,300                 | 1,275                 | 230,082     | 2060/01/22 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 4.2500 | 600                   | 611                   | 110,201     | 2040/12/07 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 3.7500 | 1,200                 | 1,116                 | 201,342     | 2052/07/22 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 3.2500 | 1,600                 | 1,399                 | 252,400     | 2044/01/22 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 3.5000 | 1,300                 | 1,158                 | 208,875     | 2068/07/22 |
|          | UK GILT                | 国債証券 | 3.5000 | 1,250                 | 1,130                 | 203,876     | 2045/01/22 |

## 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 | 2.0000 | 1,100                | 1,059                | 191,139     | 2025/09/07 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 2.5000 | 1,600                | 1,107                | 199,816     | 2065/07/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.5000 | 1,100                | 1,036                | 186,882     | 2026/07/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.5000 | 2,000                | 1,202                | 216,896     | 2047/07/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.7500 | 100                  | 76                   | 13,815      | 2037/09/07 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.2500 | 900                  | 826                  | 148,997     | 2027/07/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.6250 | 900                  | 821                  | 148,247     | 2028/10/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.7500 | 1,950                | 1,222                | 220,469     | 2049/01/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.6250 | 500                  | 282                  | 50,975      | 2054/10/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.8750 | 500                  | 429                  | 77,496      | 2029/10/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.6250 | 900                  | 853                  | 153,882     | 2025/06/07 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.3750 | 600                  | 484                  | 87,379      | 2030/10/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.2500 | 2,700                | 1,732                | 312,472     | 2041/10/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.5000 | 900                  | 300                  | 54,115      | 2061/10/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.1250 | 1,300                | 1,199                | 216,345     | 2026/01/30 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.1250 | 1,400                | 1,213                | 218,800     | 2028/01/31 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.6250 | 1,900                | 1,328                | 239,625     | 2035/07/31 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.2500 | 1,300                | 1,010                | 182,314     | 2031/07/31 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.3750 | 1,800                | 1,632                | 294,429     | 2026/10/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.2500 | 1,200                | 632                  | 114,053     | 2051/07/31 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.8750 | 1,300                | 1,002                | 180,790     | 2033/07/31 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.2500 | 700                  | 667                  | 120,331     | 2025/01/31 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 0.5000 | 2,050                | 1,752                | 316,071     | 2029/01/31 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.0000 | 2,100                | 1,711                | 308,669     | 2032/01/31 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 1.1250 | 300                  | 122                  | 22,165      | 2073/10/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 4.1250 | 1,700                | 1,710                | 308,572     | 2027/01/29 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 3.7500 | 1,100                | 1,067                | 192,611     | 2038/01/29 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 3.5000 | 700                  | 690                  | 124,509     | 2025/10/22 |
|       | UK GILT            | 国債証券 | 3.2500 | 2,100                | 2,027                | 365,645     | 2033/01/31 |
|       | UK TSY GILT        | 国債証券 | 1.1250 | 400                  | 268                  | 48,420      | 2039/01/31 |
|       | 小 計                |      | —      | 56,700               | 48,955               | 8,829,074   | —          |
| イスラエル | ISRAEL FIXED BOND  | 国債証券 | 3.7500 | 千イスラエル・シケル<br>3,600  | 千イスラエル・シケル<br>3,250  | 125,653     | 2047/03/31 |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 国債証券 | 6.2500 | 3,200                | 3,430                | 132,604     | 2026/10/30 |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 国債証券 | 2.2500 | 1,700                | 1,599                | 61,807      | 2028/09/28 |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 国債証券 | 1.0000 | 700                  | 594                  | 22,985      | 2030/03/31 |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 国債証券 | 1.5000 | 900                  | 656                  | 25,378      | 2037/05/31 |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 3,100                | 2,966                | 114,658     | 2025/04/30 |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 国債証券 | 3.7500 | 500                  | 503                  | 19,456      | 2029/02/28 |
|       | 小 計                |      | —      | 13,700               | 13,001               | 502,544     | —          |
| デンマーク | KINGDOM OF DENMARK | 国債証券 | 4.5000 | 千デンマーク・クローネ<br>7,000 | 千デンマーク・クローネ<br>8,972 | 186,533     | 2039/11/15 |

## 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 | 1.7500  | 100     | 98        | 2,047       | 2025/11/15 |
|        | KINGDOM OF DENMARK       | 国債証券 | 0.5000  | 6,100   | 5,725     | 119,038     | 2027/11/15 |
|        | KINGDOM OF DENMARK       | 国債証券 | 0.5000  | 5,400   | 4,925     | 102,395     | 2029/11/15 |
|        | KINGDOM OF DENMARK       | 国債証券 | 0.2500  | 1,800   | 1,033     | 21,492      | 2052/11/15 |
|        | KINGDOM OF DENMARK       | 国債証券 | 0.0000  | 500     | 422       | 8,790       | 2031/11/15 |
|        | KINGDOM OF DENMARK       | 国債証券 | 2.2500  | 1,200   | 1,199     | 24,943      | 2033/11/15 |
|        | 小 計                      |      | -       | 22,100  | 22,378    | 465,241     | -          |
| ノルウェー  | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 1.7500  | 1,200   | 1,170     | 15,866      | 2025/03/13 |
|        | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 1.5000  | 2,300   | 2,204     | 29,890      | 2026/02/19 |
|        | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 1.7500  | 200     | 190       | 2,586       | 2027/02/17 |
|        | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 2.0000  | 5,900   | 5,624     | 76,265      | 2028/04/26 |
|        | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 1.7500  | 5,000   | 4,633     | 62,823      | 2029/09/06 |
|        | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 1.3750  | 6,800   | 6,077     | 82,409      | 2030/08/19 |
|        | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3.0000  | 800     | 785       | 10,653      | 2033/08/15 |
|        | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3.5000  | 700     | 744       | 10,095      | 2042/10/06 |
|        | 小 計                      |      | -       | 22,900  | 21,430    | 290,591     | -          |
| スウェーデン | SWEDISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.5000  | 5,300   | 6,155     | 85,191      | 2039/03/30 |
|        | SWEDISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.5000  | 5,000   | 4,968     | 68,761      | 2025/05/12 |
|        | SWEDISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.0000  | 6,200   | 5,965     | 82,562      | 2026/11/12 |
|        | SWEDISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.7500  | 3,700   | 3,490     | 48,313      | 2028/05/12 |
|        | SWEDISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.7500  | 4,200   | 3,901     | 53,998      | 2029/11/12 |
|        | SWEDISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.1250  | 500     | 435       | 6,022       | 2031/05/12 |
|        | 小 計                      |      | -       | 24,900  | 24,916    | 344,849     | -          |
| メキシコ   | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 国債証券 | 10.0000 | 11,000  | 10,931    | 90,251      | 2024/12/05 |
|        | MEX BONOS DE DESARROLLO  | 国債証券 | 7.5000  | 22,000  | 20,859    | 172,212     | 2027/06/03 |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 国債証券 | 8.5000  | 25,000  | 24,475    | 202,065     | 2029/05/31 |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 国債証券 | 8.5000  | 40,000  | 38,078    | 314,374     | 2038/11/18 |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 国債証券 | 7.7500  | 29,000  | 26,982    | 222,762     | 2031/05/29 |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 国債証券 | 7.7500  | 18,000  | 16,406    | 135,451     | 2034/11/23 |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 国債証券 | 5.7500  | 19,000  | 17,561    | 144,987     | 2026/03/05 |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 国債証券 | 8.0000  | 9,000   | 8,019     | 66,210      | 2047/11/07 |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 国債証券 | 5.5000  | 3,000   | 2,691     | 22,220      | 2027/03/04 |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 国債証券 | 5.0000  | 12,000  | 11,349    | 93,696      | 2025/03/06 |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 国債証券 | 7.5000  | 6,000   | 5,412     | 44,682      | 2033/05/26 |
|        | 小 計                      |      | -       | 194,000 | 182,768   | 1,508,916   | -          |
| 中 国    | CHINA GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 2.6900  | 50,000  | 50,359    | 1,004,379   | 2026/08/12 |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 2.9100  | 21,000  | 21,405    | 426,919     | 2028/10/14 |
|        | CHINA GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 3.7200  | 38,700  | 44,171    | 880,955     | 2051/04/12 |

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

| 区 分   | 銘 柄                    | 種 類  | 期      |         |           |             | 末          |  |
|-------|------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|--|
|       |                        |      | 利 率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |             | 償 還 年 月 日  |  |
|       |                        |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.0200 | 43,000  | 44,242    | 882,376     | 2031/05/27 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.2600 | 18,000  | 17,972    | 358,439     | 2025/02/24 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.8000 | 26,000  | 26,341    | 525,362     | 2029/03/24 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.4800 | 9,000   | 9,004     | 179,585     | 2027/04/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.2400 | 31,000  | 30,923    | 616,743     | 2025/05/25 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.5000 | 16,000  | 16,025    | 319,617     | 2027/07/25 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.1800 | 39,000  | 38,851    | 774,860     | 2025/08/25 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.6200 | 19,000  | 19,051    | 379,966     | 2029/09/25 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.8000 | 21,000  | 21,268    | 424,185     | 2032/11/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.1200 | 12,000  | 12,348    | 246,282     | 2052/10/25 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.6400 | 31,500  | 31,699    | 632,219     | 2028/01/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.4600 | 29,000  | 29,027    | 578,931     | 2026/02/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.8000 | 15,000  | 15,163    | 302,426     | 2030/03/25 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.8800 | 10,900  | 11,120    | 221,796     | 2033/02/25 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.6200 | 27,000  | 27,189    | 542,273     | 2028/04/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.3000 | 17,000  | 16,971    | 338,478     | 2026/05/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.6700 | 5,000   | 5,007     | 99,877      | 2033/05/25 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.1900 | 8,000   | 8,412     | 167,770     | 2053/04/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.6200 | 17,000  | 17,019    | 339,434     | 2030/06/25 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.4000 | 41,000  | 40,861    | 814,940     | 2028/07/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.1800 | 9,800   | 9,746     | 194,391     | 2026/08/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.5200 | 13,000  | 12,887    | 257,029     | 2033/08/25 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.6000 | 32,000  | 32,012    | 638,463     | 2030/09/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.5500 | 9,000   | 9,032     | 180,154     | 2028/10/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.3900 | 14,000  | 14,002    | 279,269     | 2026/11/15 |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.0000 | 3,000   | 3,065     | 61,140      | 2053/10/15 |  |
|       | 小 計                    |      | -      | 625,900 | 635,185   | 12,668,272  | -          |  |
| マレーシア | MALAYSIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 3.5020 | 5,100   | 5,077     | 154,623     | 2027/05/31 |  |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT   | 国債証券 | 4.4980 | 4,000   | 4,170     | 127,005     | 2030/04/15 |  |
|       | MALAYSIA GOVERNMENT    | 国債証券 | 3.9550 | 3,200   | 3,223     | 98,161      | 2025/09/15 |  |
|       | MALAYSIA GOVERNMENT    | 国債証券 | 4.7360 | 6,700   | 7,146     | 217,629     | 2046/03/15 |  |
|       | MALAYSIA GOVERNMENT    | 国債証券 | 3.5820 | 2,500   | 2,436     | 74,192      | 2032/07/15 |  |
|       | MALAYSIA GOVERNMENT    | 国債証券 | 4.6960 | 1,700   | 1,834     | 55,860      | 2042/10/15 |  |
|       | MALAYSIA GOVERNMENT    | 国債証券 | 4.5040 | 700     | 724       | 22,060      | 2029/04/30 |  |
|       | MALAYSIA GOVERNMENT    | 国債証券 | 3.8820 | 500     | 503       | 15,319      | 2025/03/14 |  |
|       | MALAYSIA GOVERNMENT    | 国債証券 | 3.9000 | 1,300   | 1,311     | 39,939      | 2026/11/30 |  |
|       | MALAYSIA GOVERNMENT    | 国債証券 | 3.7570 | 1,400   | 1,335     | 40,676      | 2040/05/22 |  |
|       | 小 計                    |      | -      | 27,100  | 27,761    | 845,469     | -          |  |
| ポーランド | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,500   | 2,309     | 82,559      | 2028/04/25 |  |
|       | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 700     | 633       | 22,647      | 2029/10/25 |  |

## 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 |            |  |
|       | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 1,800   | 1,702     | 60,854      | 2025/04/25 |  |
|       | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 7,800   | 6,241     | 223,146     | 2030/10/25 |  |
|       | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 7,400   | 6,532     | 233,555     | 2026/10/25 |  |
|       | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 5,000   | 4,593     | 164,223     | 2025/10/25 |  |
|       | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 2,000   | 2,149     | 76,856      | 2033/10/25 |  |
|       | 小 計                    |      | —      | 27,200  | 24,162    | 863,842     | —          |  |
| ユ     |                        |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |            |  |
| アイランド | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 5.4000 | 800     | 824       | 127,726     | 2025/03/13 |  |
|       | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 2.4000 | 600     | 605       | 93,818      | 2030/05/15 |  |
|       | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 2.0000 | 1,100   | 955       | 148,159     | 2045/02/18 |  |
|       | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 1.0000 | 800     | 773       | 119,916     | 2026/05/15 |  |
|       | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 1.7000 | 300     | 268       | 41,637      | 2037/05/15 |  |
|       | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 0.9000 | 500     | 472       | 73,242      | 2028/05/15 |  |
|       | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 1.3000 | 500     | 455       | 70,535      | 2033/05/15 |  |
|       | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 1.3500 | 500     | 469       | 72,761      | 2031/03/18 |  |
|       | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 1.1000 | 500     | 471       | 73,014      | 2029/05/15 |  |
|       | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 1.5000 | 500     | 380       | 59,017      | 2050/05/15 |  |
|       | IRISH GOVT TREASURY    | 国債証券 | 0.0000 | 500     | 418       | 64,917      | 2031/10/18 |  |
| オランダ  | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 5.5000 | 700     | 787       | 122,108     | 2028/01/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0000 | 300     | 350       | 54,383      | 2037/01/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7500 | 1,300   | 1,537     | 238,285     | 2042/01/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 2.5000 | 600     | 610       | 94,558      | 2033/01/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 2,200   | 2,316     | 359,130     | 2047/01/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 0.2500 | 1,300   | 1,252     | 194,072     | 2025/07/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 0.5000 | 1,300   | 1,240     | 192,293     | 2026/07/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 0.7500 | 400     | 379       | 58,883      | 2027/07/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 0.7500 | 1,500   | 1,405     | 217,926     | 2028/07/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 0.2500 | 500     | 449       | 69,696      | 2029/07/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 0.5000 | 1,500   | 1,113     | 172,542     | 2040/01/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 0.0000 | 2,200   | 1,907     | 295,589     | 2030/07/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 0.0000 | 1,300   | 1,213     | 188,033     | 2027/01/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 0.5000 | 1,700   | 1,468     | 227,548     | 2032/07/15 |  |
|       | NETHERLANDS GOVERNMENT | 国債証券 | 2.5000 | 500     | 507       | 78,640      | 2033/07/15 |  |
| ベルギー  | BELGIUM KINGDOM        | 国債証券 | 5.5000 | 1,000   | 1,129     | 175,035     | 2028/03/28 |  |
|       | BELGIUM KINGDOM        | 国債証券 | 5.0000 | 1,000   | 1,219     | 188,974     | 2035/03/28 |  |
|       | BELGIUM KINGDOM        | 国債証券 | 4.2500 | 900     | 1,056     | 163,773     | 2041/03/28 |  |
|       | BELGIUM KINGDOM        | 国債証券 | 4.5000 | 1,100   | 1,147     | 177,925     | 2026/03/28 |  |
|       | BELGIUM KINGDOM        | 国債証券 | 4.0000 | 300     | 333       | 51,699      | 2032/03/28 |  |
|       | BELGIUM KINGDOM        | 国債証券 | 3.7500 | 600     | 667       | 103,406     | 2045/06/22 |  |
|       | BELGIUM KINGDOM        | 国債証券 | 3.0000 | 200     | 206       | 31,933      | 2034/06/22 |  |
|       | BELGIUM KINGDOM        | 国債証券 | 0.8000 | 700     | 679       | 105,345     | 2025/06/22 |  |
|       | BELGIUM KINGDOM        | 国債証券 | 1.0000 | 1,300   | 1,171     | 181,634     | 2031/06/22 |  |

## 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 |            |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 1.9000 | 1,000   | 885       | 137,232     | 2038/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 1.0000 | 700     | 675       | 104,740     | 2026/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 1.6000 | 650     | 492       | 76,390      | 2047/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 2.1500 | 500     | 403       | 62,475      | 2066/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 0.8000 | 800     | 759       | 117,653     | 2027/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 2.2500 | 500     | 416       | 64,514      | 2057/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 1.4500 | 1,200   | 1,015     | 157,476     | 2037/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 0.8000 | 1,000   | 937       | 145,258     | 2028/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 1.2500 | 900     | 804       | 124,767     | 2033/04/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 0.9000 | 900     | 835       | 129,444     | 2029/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 1.7000 | 1,100   | 827       | 128,337     | 2050/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 0.1000 | 700     | 605       | 93,790      | 2030/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 0.4000 | 800     | 535       | 82,990      | 2040/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 0.0000 | 800     | 732       | 113,582     | 2027/10/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 0.6500 | 400     | 185       | 28,680      | 2071/06/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 0.0000 | 1,500   | 1,238     | 191,952     | 2031/10/22 |  |
|      | BELGIUM KINGDOM | 国債証券 | 0.3500 | 500     | 417       | 64,692      | 2032/06/22 |  |
| フランス | FRANCE O. A. T. | 国債証券 | 6.0000 | 2,100   | 2,226     | 345,062     | 2025/10/25 |  |
|      | FRANCE O. A. T. | 国債証券 | 5.5000 | 1,650   | 1,909     | 295,928     | 2029/04/25 |  |
|      | FRANCE O. A. T. | 国債証券 | 5.7500 | 400     | 503       | 77,986      | 2032/10/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 4.7500 | 800     | 964       | 149,503     | 2035/04/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 4.0000 | 1,370   | 1,634     | 253,314     | 2055/04/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 4.0000 | 2,000   | 2,292     | 355,297     | 2038/10/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 4.5000 | 1,900   | 2,322     | 360,043     | 2041/04/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 4.0000 | 1,400   | 1,693     | 262,526     | 2060/04/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 3.5000 | 1,800   | 1,840     | 285,330     | 2026/04/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 2.7500 | 2,650   | 2,690     | 416,989     | 2027/10/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 3.2500 | 900     | 944       | 146,335     | 2045/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 2.5000 | 2,600   | 2,627     | 407,203     | 2030/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 0.5000 | 1,300   | 1,257     | 194,969     | 2025/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 1.0000 | 1,500   | 1,455     | 225,548     | 2025/11/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 1.5000 | 3,050   | 2,872     | 445,235     | 2031/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 0.5000 | 3,300   | 3,148     | 488,063     | 2026/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 1.2500 | 2,750   | 2,328     | 360,991     | 2036/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 1.7500 | 800     | 580       | 90,041      | 2066/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 0.2500 | 2,900   | 2,725     | 422,489     | 2026/11/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 1.7500 | 2,700   | 2,352     | 364,659     | 2039/06/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 1.0000 | 2,200   | 2,103     | 326,019     | 2027/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 2.0000 | 2,000   | 1,666     | 258,347     | 2048/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 0.7500 | 3,100   | 2,898     | 449,344     | 2028/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 1.2500 | 1,200   | 1,054     | 163,499     | 2034/05/25 |  |
|      | FRANCE OAT.     | 国債証券 | 0.7500 | 3,100   | 2,878     | 446,230     | 2028/11/25 |  |

## 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 | 1.5000 | 2,400   | 1,758     | 272,490     | 2050/05/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.5000 | 3,000   | 2,726     | 422,601     | 2029/05/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.0000 | 1,900   | 1,830     | 283,730     | 2025/03/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.0000 | 3,500   | 3,056     | 473,765     | 2029/11/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.7500 | 3,000   | 1,737     | 269,318     | 2052/05/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.0000 | 2,000   | 1,894     | 293,669     | 2026/02/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.0000 | 3,900   | 3,319     | 514,568     | 2030/11/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.5000 | 1,300   | 901       | 139,770     | 2040/05/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.5000 | 100     | 42        | 6,647       | 2072/05/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.5000 | 1,200   | 755       | 117,081     | 2044/06/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.0000 | 3,000   | 2,485     | 385,224     | 2031/11/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.0000 | 1,100   | 1,021     | 158,292     | 2027/02/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.0000 | 3,000   | 2,896     | 448,934     | 2025/02/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.0000 | 2,900   | 2,368     | 367,165     | 2032/05/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 1.2500 | 900     | 734       | 113,815     | 2038/05/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 0.7500 | 4,200   | 3,941     | 610,859     | 2028/02/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 2.0000 | 3,000   | 2,888     | 447,790     | 2032/11/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 2.5000 | 1,300   | 1,214     | 188,263     | 2043/05/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 2.5000 | 2,200   | 2,203     | 341,501     | 2026/09/24 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 3.0000 | 1,500   | 1,561     | 242,006     | 2033/05/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 2.7500 | 1,100   | 1,122     | 173,959     | 2029/02/25 |
|       | FRANCE OAT.              | 国債証券 | 3.5000 | 1,500   | 1,623     | 251,676     | 2033/11/25 |
| ド イ ツ | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 6.5000 | 1,000   | 1,148     | 177,969     | 2027/07/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 5.6250 | 1,000   | 1,138     | 176,399     | 2028/01/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 4.7500 | 1,600   | 1,790     | 277,519     | 2028/07/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 6.2500 | 800     | 994       | 154,191     | 2030/01/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 5.5000 | 900     | 1,108     | 171,762     | 2031/01/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 4.7500 | 600     | 751       | 116,500     | 2034/07/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 4.0000 | 1,300   | 1,568     | 243,051     | 2037/01/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 4.2500 | 700     | 883       | 136,966     | 2039/07/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 4.7500 | 1,450   | 1,947     | 301,884     | 2040/07/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 3.2500 | 1,000   | 1,147     | 177,924     | 2042/07/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 2.5000 | 1,600   | 1,662     | 257,627     | 2044/07/04 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 2.5000 | 2,700   | 2,820     | 437,219     | 2046/08/15 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.5000 | 2,350   | 2,284     | 354,163     | 2025/02/15 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 1.0000 | 1,900   | 1,850     | 286,789     | 2025/08/15 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.5000 | 3,200   | 3,074     | 476,551     | 2026/02/15 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.2500 | 500     | 471       | 73,131      | 2027/02/15 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.5000 | 2,100   | 1,986     | 307,958     | 2027/08/15 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 1.2500 | 1,650   | 1,351     | 209,510     | 2048/08/15 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.5000 | 1,600   | 1,505     | 233,390     | 2028/02/15 |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.2500 | 1,500   | 1,387     | 215,043     | 2028/08/15 |

# 外国債券パッシブ・マザーファンド

| 区 分  | 銘 柄                      | 種 類  | 期 末    |         |           |             |            |
|------|--------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
|      |                          |      | 利 率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |             | 償 還 年 月 日  |
|      |                          |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.2500 | 1,400   | 1,285     | 199,197     | 2029/02/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 2,500   | 2,243     | 347,808     | 2029/08/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 3,000   | 1,689     | 261,795     | 2050/08/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 1,500   | 1,334     | 206,838     | 2030/02/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 2,000   | 1,575     | 244,214     | 2035/05/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 1,800   | 1,586     | 245,849     | 2030/08/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 1,300   | 1,201     | 186,258     | 2027/11/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 800     | 614       | 95,174      | 2036/05/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 900     | 509       | 78,959      | 2050/08/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 400     | 363       | 56,379      | 2028/11/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 600     | 518       | 80,334      | 2031/08/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 2,300   | 1,987     | 308,058     | 2031/08/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 0.0000 | 3,200   | 2,733     | 423,643     | 2032/02/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 1.0000 | 1,400   | 1,193     | 184,925     | 2038/05/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 1.7000 | 2,800   | 2,740     | 424,725     | 2032/08/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 2.1000 | 1,400   | 1,410     | 218,644     | 2029/11/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 1.8000 | 200     | 182       | 28,210      | 2053/08/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 2.3000 | 1,600   | 1,640     | 254,321     | 2033/02/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 2.3000 | 800     | 820       | 127,238     | 2033/02/15 |
|      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 国債証券 | 1.8000 | 900     | 820       | 127,224     | 2053/08/15 |
|      | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 国債証券 | 3.1000 | 300     | 302       | 46,872      | 2025/09/18 |
|      | BUNDES OBLIGATION        | 国債証券 | 0.0000 | 2,800   | 2,699     | 418,362     | 2025/04/11 |
|      | BUNDES OBLIGATION        | 国債証券 | 0.0000 | 2,600   | 2,485     | 385,235     | 2025/10/10 |
|      | BUNDES OBLIGATION        | 国債証券 | 0.0000 | 2,100   | 1,991     | 308,759     | 2026/04/10 |
|      | BUNDES OBLIGATION        | 国債証券 | 0.0000 | 1,000   | 940       | 145,779     | 2026/10/09 |
|      | BUNDES OBLIGATION        | 国債証券 | 0.0000 | 3,200   | 2,986     | 462,961     | 2027/04/16 |
|      | BUNDES OBLIGATION        | 国債証券 | 1.3000 | 300     | 291       | 45,258      | 2027/10/15 |
|      | BUNDES OBLIGATION        | 国債証券 | 2.2000 | 600     | 604       | 93,646      | 2028/04/13 |
|      | BUNDES OBLIGATION        | 国債証券 | 2.4000 | 1,600   | 1,628     | 252,471     | 2028/10/19 |
| スペイン | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 6.0000 | 1,900   | 2,205     | 341,802     | 2029/01/31 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.2000 | 1,400   | 1,004     | 155,717     | 2040/10/31 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 5.7500 | 1,000   | 1,220     | 189,126     | 2032/07/30 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 4.2000 | 1,050   | 1,160     | 179,933     | 2037/01/31 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 4.9000 | 1,400   | 1,660     | 257,444     | 2040/07/30 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 4.7000 | 1,500   | 1,755     | 272,101     | 2041/07/30 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 4.6500 | 800     | 821       | 127,396     | 2025/07/30 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 5.9000 | 500     | 539       | 83,656      | 2026/07/30 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 5.1500 | 1,500   | 1,672     | 259,290     | 2028/10/31 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 5.1500 | 1,400   | 1,745     | 270,536     | 2044/10/31 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.6000 | 1,400   | 1,373     | 212,957     | 2025/04/30 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 2.1500 | 1,600   | 1,582     | 245,356     | 2025/10/31 |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.9500 | 700     | 667       | 103,538     | 2030/07/30 |

## 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 |            |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.9500 | 2,400   | 2,358     | 365,594     | 2026/04/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 2.9000 | 1,700   | 1,539     | 238,683     | 2046/10/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 3.4500 | 1,300   | 1,225     | 189,903     | 2066/07/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.3000 | 1,400   | 1,348     | 209,088     | 2026/10/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.5000 | 1,500   | 1,446     | 224,211     | 2027/04/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 2.3500 | 700     | 664       | 103,059     | 2033/07/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.4500 | 1,800   | 1,724     | 267,335     | 2027/10/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.4000 | 2,000   | 1,902     | 294,834     | 2028/04/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 2.7000 | 750     | 647       | 100,352     | 2048/10/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.4000 | 1,200   | 1,138     | 176,434     | 2028/07/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.4500 | 2,100   | 1,977     | 306,542     | 2029/04/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.8500 | 1,000   | 877       | 136,001     | 2035/07/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 0.5000 | 1,600   | 1,397     | 216,551     | 2030/04/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 0.8000 | 1,700   | 1,594     | 247,205     | 2027/07/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.0000 | 800     | 454       | 70,377      | 2050/10/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 0.0000 | 500     | 483       | 74,870      | 2025/01/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.2500 | 2,100   | 1,906     | 295,449     | 2030/10/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 1.4500 | 400     | 203       | 31,520      | 2071/10/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 0.8500 | 800     | 588       | 91,242      | 2037/07/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 0.5000 | 1,400   | 1,174     | 182,030     | 2031/10/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 0.7000 | 2,200   | 1,852     | 287,125     | 2032/04/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 0.0000 | 2,600   | 2,491     | 386,206     | 2025/05/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 0.8000 | 700     | 632       | 98,060      | 2029/07/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 2.5500 | 1,600   | 1,557     | 241,425     | 2032/10/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 2.8000 | 1,100   | 1,102     | 170,825     | 2026/05/31 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 3.1500 | 1,500   | 1,524     | 236,243     | 2033/04/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 3.9000 | 200     | 212       | 32,868      | 2039/07/30 |  |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 国債証券 | 3.5500 | 1,500   | 1,569     | 243,313     | 2033/10/31 |  |
| イタリア | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 7.2500 | 400     | 447       | 69,316      | 2026/11/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 6.5000 | 1,700   | 1,917     | 297,206     | 2027/11/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 4.7500 | 1,800   | 1,930     | 299,297     | 2028/09/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 1.6500 | 1,100   | 984       | 152,650     | 2030/12/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.9500 | 700     | 489       | 75,932      | 2037/03/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 6.0000 | 2,200   | 2,582     | 400,258     | 2031/05/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 5.7500 | 1,700   | 1,983     | 307,517     | 2033/02/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 5.0000 | 1,570   | 1,743     | 270,247     | 2034/08/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 4.0000 | 2,000   | 2,025     | 313,992     | 2037/02/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 5.0000 | 1,800   | 1,991     | 308,682     | 2039/08/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 5.0000 | 1,000   | 1,020     | 158,115     | 2025/03/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 5.0000 | 1,700   | 1,885     | 292,266     | 2040/09/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 4.5000 | 1,300   | 1,341     | 207,986     | 2026/03/01 |  |
|      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 4.7500 | 1,200   | 1,297     | 201,183     | 2044/09/01 |  |

## 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 | 1,000   | 1,014     | 157,304     | 2030/03/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.5000 | 1,300   | 1,289     | 199,908     | 2024/12/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 3.2500 | 1,600   | 1,395     | 216,228     | 2046/09/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 1.5000 | 1,900   | 1,856     | 287,729     | 2025/06/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.0000 | 1,300   | 1,276     | 197,782     | 2025/12/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 1.6000 | 1,200   | 1,162     | 180,230     | 2026/06/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.7000 | 1,250   | 991       | 153,653     | 2047/03/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.2500 | 500     | 419       | 64,962      | 2036/09/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 1.2500 | 800     | 762       | 118,242     | 2026/12/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.8000 | 700     | 517       | 80,210      | 2067/03/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.4500 | 600     | 543       | 84,295      | 2033/09/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.2000 | 900     | 878       | 136,211     | 2027/06/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 3.4500 | 1,000   | 899       | 139,377     | 2048/03/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.0500 | 1,500   | 1,454     | 225,452     | 2027/08/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.9500 | 1,000   | 886       | 137,410     | 2038/09/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.0000 | 2,500   | 2,405     | 372,809     | 2028/02/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 1.4500 | 700     | 684       | 106,042     | 2025/05/15 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.8000 | 1,300   | 1,284     | 199,077     | 2028/12/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.5000 | 1,200   | 1,189     | 184,383     | 2025/11/15 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 3.3500 | 700     | 671       | 104,105     | 2035/03/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 3.8500 | 1,500   | 1,427     | 221,316     | 2049/09/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 3.0000 | 2,600   | 2,578     | 399,643     | 2029/08/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.1000 | 1,000   | 979       | 151,881     | 2026/07/15 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 3.1000 | 700     | 621       | 96,276      | 2040/03/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.3500 | 2,400   | 2,323     | 360,203     | 2025/02/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.8500 | 1,500   | 1,409     | 218,457     | 2027/01/15 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.9500 | 700     | 602       | 93,375      | 2030/08/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 1.4500 | 400     | 307       | 47,591      | 2036/03/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.4500 | 900     | 662       | 102,685     | 2050/09/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 1.8500 | 1,000   | 981       | 152,075     | 2025/07/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.9500 | 800     | 743       | 115,289     | 2027/09/15 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.5000 | 1,000   | 949       | 147,160     | 2026/02/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 1.7000 | 1,500   | 929       | 144,073     | 2051/09/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.9000 | 2,000   | 1,684     | 261,063     | 2031/04/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.9500 | 2,600   | 2,154     | 333,958     | 2031/12/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.0000 | 1,000   | 926       | 143,677     | 2026/08/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.4500 | 2,400   | 2,096     | 324,919     | 2029/02/15 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.9500 | 3,500   | 2,857     | 442,972     | 2032/06/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 0.0000 | 1,300   | 1,259     | 195,172     | 2024/12/15 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 1.1000 | 2,300   | 2,169     | 336,290     | 2027/04/01 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.8000 | 1,000   | 980       | 152,019     | 2029/06/15 |
|     | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 2.6500 | 400     | 395       | 61,246      | 2027/12/01 |

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

| 区 分    | 銘 柄                      | 種 類  | 期 末    |         |           |             |            |
|--------|--------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
|        |                          |      | 利 率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |             | 償 還 年 月 日  |
|        |                          |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
|        | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 4.0000 | 1,100   | 1,122     | 173,983     | 2035/04/30 |
|        | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 3.8500 | 1,300   | 1,341     | 208,002     | 2029/12/15 |
|        | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 4.4000 | 1,700   | 1,809     | 280,516     | 2033/05/01 |
|        | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 3.7000 | 1,900   | 1,941     | 301,002     | 2030/06/15 |
|        | BUONI POLIENNALI DEL TES | 国債証券 | 3.8500 | 2,900   | 2,967     | 460,009     | 2026/09/15 |
| フィンランド | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 4.0000 | 300     | 305       | 47,356      | 2025/07/04 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 200     | 203       | 31,585      | 2028/07/04 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.6250 | 800     | 779       | 120,860     | 2042/07/04 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.7500 | 800     | 710       | 110,157     | 2031/04/15 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.5000 | 700     | 668       | 103,641     | 2026/04/15 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.3750 | 500     | 382       | 59,340      | 2047/04/15 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.5000 | 500     | 467       | 72,452      | 2027/09/15 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.5000 | 300     | 275       | 42,644      | 2028/09/15 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.5000 | 800     | 720       | 111,738     | 2029/09/15 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.2500 | 500     | 331       | 51,364      | 2040/09/15 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.0000 | 400     | 340       | 52,806      | 2030/09/15 |
|        | FINNISH GOVERNMENT       | 国債証券 | 0.0000 | 300     | 280       | 43,487      | 2026/09/15 |
| オーストリア | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 6.2500 | 1,000   | 1,130     | 175,295     | 2027/07/15 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 4.1500 | 300     | 344       | 53,471      | 2037/03/15 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 4.8500 | 800     | 839       | 130,093     | 2026/03/15 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 3.8000 | 700     | 847       | 131,394     | 2062/01/26 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 3.1500 | 500     | 524       | 81,277      | 2044/06/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 2.4000 | 1,000   | 980       | 152,008     | 2034/05/23 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 1.2000 | 1,000   | 974       | 151,121     | 2025/10/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 0.7500 | 600     | 572       | 88,748      | 2026/10/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 1.5000 | 700     | 542       | 84,054      | 2047/02/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 0.5000 | 700     | 658       | 102,031     | 2027/04/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 0.7500 | 600     | 561       | 87,088      | 2028/02/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 0.5000 | 550     | 500       | 77,533      | 2029/02/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 0.0000 | 1,300   | 1,121     | 173,803     | 2030/02/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 0.7500 | 900     | 553       | 85,743      | 2051/03/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 1.5000 | 400     | 255       | 39,637      | 2086/11/02 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 0.8500 | 250     | 120       | 18,655      | 2120/06/30 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 0.0000 | 1,400   | 1,173     | 181,956     | 2031/02/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 0.0000 | 300     | 288       | 44,794      | 2025/04/20 |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 国債証券 | 0.9000 | 1,000   | 881       | 136,581     | 2032/02/20 |
|        | 小 計                      |      | —      | 376,490 | 357,127   | 55,354,836  | —          |
|        | 合 計                      |      | —      | —       | —         | 167,751,148 | —          |

※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

(2023年12月18日現在)

| 項 目                     | 期 末         |       |
|-------------------------|-------------|-------|
|                         | 評 価 額       | 比 率   |
|                         | 千円          | %     |
| 公 社 債                   | 167,751,148 | 98.9  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,890,403   | 1.1   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 169,641,551 | 100.0 |

※期末における外貨建資産（169,248,477千円）の投資信託財産総額（169,641,551千円）に対する比率は99.8%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=142.20円、1カナダ・ドル=106.29円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1シンガポール・ドル=106.76円、1ニュージーランド・ドル=88.51円、1イギリス・ポンド=180.35円、1イスラエル・シケル=38.653円、1デンマーク・クローネ=20.79円、1ノルウェー・クローネ=13.56円、1スウェーデン・クローナ=13.84円、1メキシコ・ペソ=8.255円、1オフショア・人民元=19.944円、1マレーシア・リンギット=30.454円、1ポーランド・ズロチ=35.751円、1ユーロ=155.00円です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年12月18日現在)

| 項 目                | 期 末              |
|--------------------|------------------|
| (A) 資 産            | 169,641,551,799円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等    | 671,374,841      |
| 公 社 債(評価額)         | 167,751,148,322  |
| 未 収 利 息            | 1,128,403,094    |
| 前 払 費 用            | 90,625,542       |
| (B) 負 債            | 320,373,497      |
| 未 払 解 約 金          | 320,372,665      |
| そ の 他 未 払 費 用      | 832              |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 169,321,178,302  |
| 元 本                | 78,931,509,804   |
| 次 期 繰 越 損 益 金      | 90,389,668,498   |
| (D) 受 益 権 総 口 数    | 78,931,509,804口  |
| 1万口当たり基準価額(C/D)    | 21,452円          |

※当期における期首元本額77,954,604,200円、期中追加設定元本額13,718,817,238円、期中一部解約元本額12,741,911,634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2022年12月20日 至2023年12月18日)

| 項 目                  | 当 期             |
|----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益        | 3,826,907,112円  |
| 受 取 利 息              | 3,827,275,726   |
| そ の 他 収 益 金          | 1,937           |
| 支 払 利 息              | △ 370,551       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益  | 8,785,937,714   |
| 売 買 益                | 11,332,436,647  |
| 売 買 損                | △ 2,546,498,933 |
| (C) そ の 他 費 用 等      | △ 59,239,844    |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 12,553,604,982  |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金    | 76,746,905,619  |
| (F) 解 約 差 損 益 金      | △13,190,385,331 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金  | 14,279,543,228  |
| (H) 合 計(D+E+F+G)     | 90,389,668,498  |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)     | 90,389,668,498  |

※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           | 26,888,589,360円 | 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)                       | 11,725,777円    |
| 三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型)          | 964,663,501円    | 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)                     | 4,596,004円     |
| 三井住友・DC年金バランス50 (標準型)            | 2,399,078,160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>                     | 4,831,010,615円 |
| 三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)          | 1,439,747,460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>                     | 22,646,222円    |
| SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)    | 164,716,444円    | SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>                        | 4,326,213,814円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020 (4資産タイプ) | 5,708,133円      | SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>                      | 3,634,307,384円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025 (4資産タイプ) | 25,193,200円     | SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>                        | 8,651,594,539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) | 95,498,475円     | SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>                        | 28,565,773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) | 290,467,200円    | SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>                        | 68,538,172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) | 215,136,777円    | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>                        | 648,783,265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) | 347,064,911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>                     | 103,087,222円   |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ (債券型)            | 21,141,090円     | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>                     | 877,986,063円   |
| アセットアロケーション・ファンド (安定型)           | 43,377,211円     | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>                     | 1,228,213,127円 |
| アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)         | 66,220,051円     | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>                        | 1,193,960,782円 |
| アセットアロケーション・ファンド (成長型)           | 41,498,716円     | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>                        | 3,630,935,406円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050        | 35,264,167円     | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>                          | 604,716円       |
| 三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)          | 354,339,094円    | SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>                      | 6,250,771,023円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型)          | 233,462,601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)                 | 291,829,347円   |
| 三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型)          | 649,008,193円    | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>                       | 101,932,994円   |
| 三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型)          | 198,655,965円    | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>                   | 56,153,532円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型)          | 101,696,493円    | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>                   | 29,749,375円    |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド         | 218,970,977円    | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>                   | 11,741,981円    |
| 三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド          | 997,087,996円    | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>                   | 64,344,790円    |
| 三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)          | 38,798,410円     | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>                   | 332,102,114円   |
| 三井住友DS・年金バランス50 (標準型)            | 132,136,326円    | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>                  | 72,005,110円    |
| 三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)          | 94,021,737円     | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>                  | 37,643,421円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060        | 4,212,067円      | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>                  | 5,511,845円     |
| 日興FWS・先進国債インデックス (為替ヘッジなし)       | 2,941,292,811円  | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>                  | 784,921,718円   |
| 三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド           | 278,259,720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>               | 480,319,360円   |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035        | 433,191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>             | 646,166,262円   |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040        | 311,836円        | SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>                        | 251,747,031円   |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045        | 285,927円        | SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>                       | 213,172,000円   |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055        | 140,211円        | SMAM・年金Wリスクリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>                 | 122,573,223円   |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065        | 169,690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>            | 58,871,718円    |
| 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)    | 617,466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>                  | 94,549,143円    |
| 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)    | 7,552,267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> | 282,430,807円   |
| 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3 (安定成長型)  | 26,445,432円     | 三井住友・ニュー・アジア・ファンド (リスク3%)<適格機関投資家限定>                | 158,940,863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)】

(2022年4月14日から2023年4月13日まで)

第 **15** 期  
決算日 2023年4月13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。

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。

### ■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。<br><b>マネーインカム・マザーファンド</b><br>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。<br>■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<br>■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。<br>■外貨建資産への投資は行いません。<br><b>マネーインカム・マザーファンド</b><br>■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。<br>■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。<br>■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。<br>■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。 |

 **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)        |          | 公社債<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|------------------|--------|----------|----------|---------------|----------|-------------|-----------|
|                  | (分配)   | 税分<br>込金 | 期騰<br>落率 | 無担保コ<br>ール翌日物 | 騰落<br>中率 |             |           |
|                  | 円      | 円        | %        |               | %        | %           | 百万円       |
| 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       |
| 15期 (2023年4月13日) | 10,041 | 0        | △0.0     | 100.69        | △0.0     | 76.0        | 803       |

※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)        |      | 公社債<br>組入比率 |
|------------|--------|------|---------------|------|-------------|
|            | 騰落率    | 騰落率  | 無担保コ<br>ール翌日物 | 騰落率  |             |
| (期首)       | 円      | %    |               | %    | %           |
| 2022年4月13日 | 10,044 | —    | 100.73        | —    | 76.7        |
| 4月末        | 10,044 | 0.0  | 100.73        | △0.0 | 76.9        |
| 5月末        | 10,044 | 0.0  | 100.72        | △0.0 | 74.3        |
| 6月末        | 10,044 | 0.0  | 100.72        | △0.0 | 71.7        |
| 7月末        | 10,045 | 0.0  | 100.72        | △0.0 | 72.7        |
| 8月末        | 10,044 | 0.0  | 100.72        | △0.0 | 74.6        |
| 9月末        | 10,043 | △0.0 | 100.71        | △0.0 | 76.8        |
| 10月末       | 10,043 | △0.0 | 100.71        | △0.0 | 72.6        |
| 11月末       | 10,041 | △0.0 | 100.70        | △0.0 | 72.5        |
| 12月末       | 10,039 | △0.0 | 100.70        | △0.0 | 75.3        |
| 2023年1月末   | 10,041 | △0.0 | 100.70        | △0.0 | 74.4        |
| 2月末        | 10,040 | △0.0 | 100.69        | △0.0 | 74.7        |
| 3月末        | 10,041 | △0.0 | 100.69        | △0.0 | 74.4        |
| (期末)       |        |      |               |      |             |
| 2023年4月13日 | 10,041 | △0.0 | 100.69        | △0.0 | 76.0        |

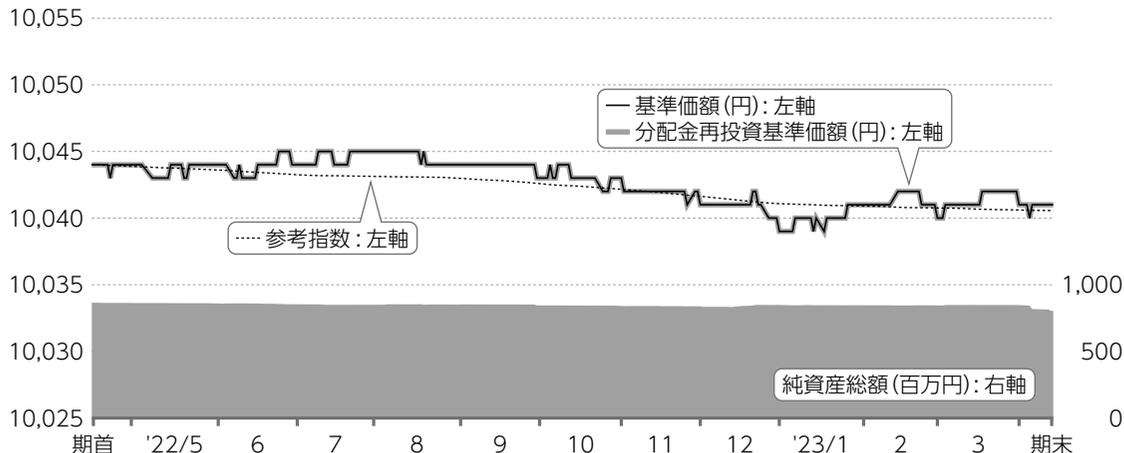
※騰落率は期首比です。

※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(2022年4月14日から2023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  | 10,044円                   |
| 期末  | 10,041円<br>(既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | -0.0%<br>(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(2022年4月14日から2023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(2022年4月14日から2023年4月13日まで)

**短期金利は低下しました。**

世界的にインフレが高止まりを続けたことや、欧米中央銀行による大幅な利上げの継続を背景に円安が進行したことから、国内でも物価上昇率が拡大し、CPIコア(生鮮食品除く消費者物価指数)は一時、前年比+4%台まで上昇しました。しかし、日銀はコストプッシュ型の物価上昇は持続的でないとの見方から、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、年末越え運用ニーズが高まった10月や、欧米での金融不安の影響でリスク回避の動きが強まった3月に、一時的に大きく低下する局面もありました。しかし、日銀が需給動向を勘案し、短期国債の買入れ額を調整したことから、利回りは期を通じて概ねレンジ推移となりました。

## ポートフォリオについて(2022年4月14日から2023年4月13日まで)

**当ファンド**

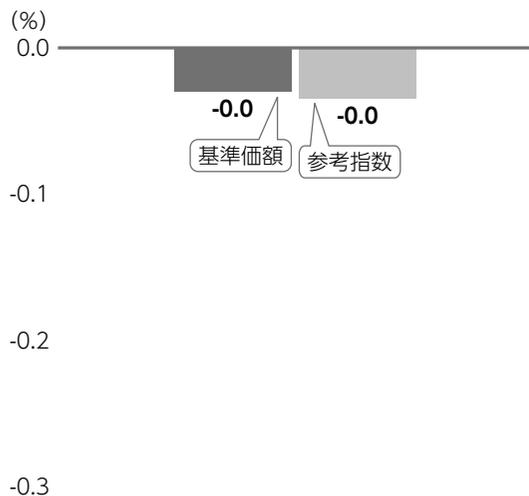
期を通じて、「マネーインカム・マザーファンド」を高位に組み入れました。

**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(2022年4月14日から2023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。

記載のグラフは、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(2022年4月14日から2023年4月13日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

| 項目        | 第15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 | 1,454   |

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

CPIコアの前年比伸び率は、政策効果によって+3%台に低下しており、先行きは原油高などのコストプッシュ要因の緩和によって減速基調となる見通しです。日銀はコストプッシュ型の物価上昇は継続的でないとの見方を維持し、マイナス金利政策を継続する見込みです。従って、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(2022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：110名、平均運用経験年数：15年(兼務者含む)

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

1万口当たりの費用明細(2022年4月14日から2023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)<br>期中の平均基準価額は10,043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<br>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<br>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   | 0.001   | 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) | (0.001) | その他:信託事務の処理等に要するその他費用  |
| 合計          | 0   | 0.001   |  |

※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 (2022年4月14日から2023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<br>35,043 | 千円<br>35,317 | 千口<br>95,853 | 千円<br>96,579 |

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2022年4月14日から2023年4月13日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2022年4月14日から2023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 (2023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<br>858,040 | 千円<br>858,040 | 千口<br>797,231 | 千円<br>803,290 |

※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1,989,263,317口です。

## ■ 投資信託財産の構成

(2023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<br>803,290 | %<br>98.6 |
| コール・ローン等、その他    | 11,230        | 1.4       |
| 投資信託財産総額        | 814,521       | 100.0     |

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年4月13日現在)

| 項 目                  | 期 末          |
|----------------------|--------------|
| (A) 資 産              | 814,521,236円 |
| コール・ローン等             | 950          |
| マネーインカム・マザーファンド(評価額) | 803,290,286  |
| 未 収 入 金              | 11,230,000   |
| (B) 負 債              | 11,230,000   |
| 未 払 解 約 金            | 11,230,000   |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B)   | 803,291,236  |
| 元 本                  | 799,972,585  |
| 次 期 繰 越 損 益 金        | 3,318,651    |
| (D) 受 益 権 総 口 数      | 799,972,585口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)      | 10,041円      |

※当期における期首元本額860,990,940円、期中追加設定元本額37,111,413円、期中一部解約元本額98,129,768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2022年4月14日 至2023年4月13日)

| 項 目                 | 当 期           |
|---------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益       | △ 4円          |
| 支 払 利 息             | △ 4           |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 240,478     |
| 売 買 益               | 21,578        |
| 売 買 損               | △ 262,056     |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B)  | △ 240,482     |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金   | △ 1,708,473   |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 5,267,606     |
| (配 当 等 相 当 額)       | ( 75,931,946) |
| (売 買 損 益 相 当 額)     | (△70,664,340) |
| (F) 合 計(C+D+E)      | 3,318,651     |
| 次 期 繰 越 損 益 金(F)    | 3,318,651     |
| 追 加 信 託 差 損 益 金     | 5,267,606     |
| (配 当 等 相 当 額)       | ( 75,944,549) |
| (売 買 損 益 相 当 額)     | (△70,676,943) |
| 分 配 準 備 積 立 金       | 40,393,475    |
| 繰 越 損 益 金           | △42,342,430   |

※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      | 3,691,441円  |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 0           |
| (c) 収益調整金            | 75,944,549  |
| (d) 分配準備積立金          | 36,702,034  |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 116,338,024 |
| 1万口当たり当期分配対象額        | 1,454.28    |
| (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15期（2022年4月14日から2023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)<br>無担保コール翌日物 |      | 公社債比率 | 純資産額  |
|-----------------|--------|------|---------------------|------|-------|-------|
|                 | 騰落率    | 中率   | 騰落率                 | 中率   |       |       |
|                 | 円      | %    |                     | %    | %     | 百万円   |
| 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 |
| 15期（2023年4月13日） | 10,076 | △0.0 | 100.69              | △0.0 | 76.0  | 2,004 |

※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

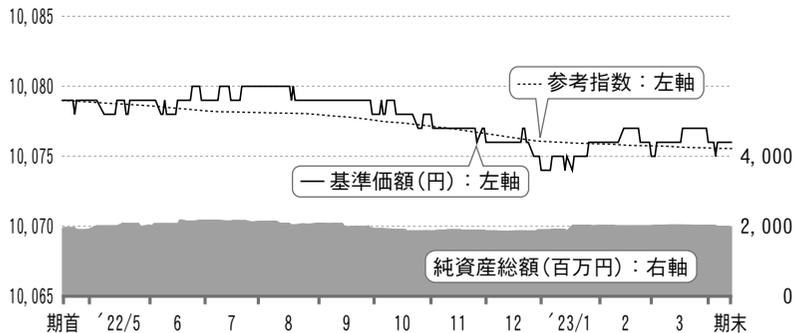
| 年月日                | 基準価額   |      | (参考指数)<br>無担保コール翌日物 |      | 公社債比率 |
|--------------------|--------|------|---------------------|------|-------|
|                    | 騰落率    | 騰落率  | 騰落率                 | 騰落率  |       |
| (期首)<br>2022年4月13日 | 円      | %    |                     | %    | %     |
| 4月末                | 10,079 | —    | 100.73              | —    | 76.7  |
| 5月末                | 10,079 | 0.0  | 100.73              | △0.0 | 76.9  |
| 6月末                | 10,079 | 0.0  | 100.72              | △0.0 | 74.3  |
| 7月末                | 10,079 | 0.0  | 100.72              | △0.0 | 71.7  |
| 8月末                | 10,080 | 0.0  | 100.72              | △0.0 | 72.7  |
| 9月末                | 10,079 | 0.0  | 100.72              | △0.0 | 74.6  |
| 10月末               | 10,078 | △0.0 | 100.71              | △0.0 | 76.8  |
| 11月末               | 10,078 | △0.0 | 100.71              | △0.0 | 72.6  |
| 12月末               | 10,076 | △0.0 | 100.70              | △0.0 | 72.5  |
| 2023年1月末           | 10,074 | △0.0 | 100.70              | △0.0 | 75.2  |
| 2月末                | 10,076 | △0.0 | 100.70              | △0.0 | 74.4  |
| 3月末                | 10,075 | △0.0 | 100.69              | △0.0 | 74.7  |
| (期末)<br>2023年4月13日 | 10,076 | △0.0 | 100.69              | △0.0 | 74.4  |
|                    |        |      |                     |      | 76.0  |

※騰落率は期首比です。

# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について（2022年4月14日から2023年4月13日まで）

### 基準価額等の推移



|     |         |
|-----|---------|
| 期首  | 10,079円 |
| 期末  | 10,076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（2022年4月14日から2023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 (2022年4月14日から2023年4月13日まで)

短期金利は低下しました。

世界的にインフレが高止まりを続けたことや、欧米中央銀行による大幅な利上げの継続を背景に円安が進行したこと、国内でも物価上昇率が拡大し、CPIコア（生鮮食品除く消費者物価指数）は一時、前年比+4%台まで上昇しました。しかし、日銀はコストプッシュ型の物価上昇は持続的でないとの見方から、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。

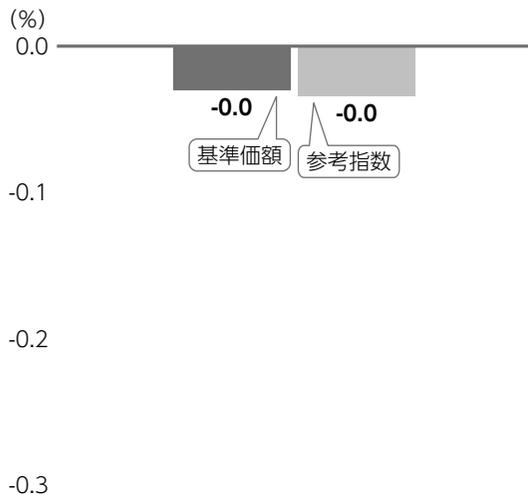
国庫短期証券3ヵ月物利回りは、年末越え運用ニーズが高まった10月や、欧米での金融不安の影響でリスク回避の動きが強まった3月に、一時的に大きく低下する局面もありました。しかし、日銀が需給動向を勘案し、短期国債の買入れ額を調整したことから、利回りは期を通じて概ねレンジ推移となりました。

▶ ポートフォリオについて (2022年4月14日から2023年4月13日まで)

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、残存0年から1年3ヵ月までの円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを維持しました。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 (2022年4月14日から2023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。

記載のグラフは、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

CPIコアの前年比伸び率は、政策効果によって+3%台に低下しており、先行きは原油高などのコストプッシュ要因の緩和によって減速基調となる見通しです。日銀はコストプッシュ型の物価上昇は継続的でないとの見方を維持し、マイナス金利政策を継続する見込みです。従って、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。

### ■ 1万口当たりの費用明細 (2022年4月14日から2023年4月13日まで)

| 項目                 | 金額        | 比率                | 項目の概要  |
|--------------------|-----------|-------------------|--|
| (a) その他費用<br>(その他) | 0円<br>(0) | 0.001%<br>(0.001) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数<br>その他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計                 | 0         | 0.001             |  |

期中の平均基準価額は10,078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 (2022年4月14日から2023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  | 375,039   | (400,000)              |
|    | 特殊債証券 | 1,982,926 | 100,658<br>(1,821,000) |

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※（ ）内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2022年4月14日から2023年4月13日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況  
(2022年4月14日から2023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 (2023年4月13日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

| 区 分          | 期                        |                          |                |                 | 末          |            |                |
|--------------|--------------------------|--------------------------|----------------|-----------------|------------|------------|----------------|
|              | 額面金額                     | 評価額                      | 組入比率           | うちBB格以下<br>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         | 273,000<br>( - )         | 274,025<br>( - )         | 13.7<br>( - )  | -<br>( - )      | -<br>( - ) | -<br>( - ) | 13.7<br>( - )  |
| 特殊債券(除く金融債券) | 1,245,000<br>(1,245,000) | 1,248,494<br>(1,248,494) | 62.3<br>(62.3) | -<br>( - )      | -<br>( - ) | -<br>( - ) | 62.3<br>(62.3) |
| 合 計          | 1,518,000<br>(1,245,000) | 1,522,520<br>(1,248,494) | 76.0<br>(62.3) | -<br>( - )      | -<br>( - ) | -<br>( - ) | 76.0<br>(62.3) |

※( )内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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         | 329 | 10年国債   | 0.8000 | 100,000   | 100,173   | 2023/06/20 |
|              | 332 | 10年国債   | 0.6000 | 173,000   | 173,852   | 2023/12/20 |
| 小            |     | 計       | -      | 273,000   | 274,025   | -          |
| 特殊債券(除く金融債券) | 189 | 政保道路機構  | 0.5410 | 200,000   | 200,039   | 2023/04/28 |
|              | 190 | 政保道路機構  | 0.6050 | 127,000   | 127,115   | 2023/05/31 |
|              | 2   | 政保新関西空港 | 0.8820 | 118,000   | 118,225   | 2023/06/27 |
|              | 50  | 政保地方公共団 | 0.9110 | 300,000   | 300,753   | 2023/07/14 |
|              | 195 | 政保道路機構  | 0.9110 | 100,000   | 100,290   | 2023/07/31 |
|              | 200 | 政保道路機構  | 0.8010 | 100,000   | 100,387   | 2023/09/29 |
|              | 202 | 政保道路機構  | 0.6990 | 100,000   | 100,408   | 2023/10/31 |
|              | 23  | 政保政策投資C | 0.6450 | 200,000   | 201,274   | 2024/03/18 |
| 小            |     | 計       | -      | 1,245,000 | 1,248,494 | -          |
| 合            |     | 計       | -      | 1,518,000 | 1,522,520 | -          |

# マネーインカム・マザーファンド

## ■ 投資信託財産の構成

(2023年4月13日現在)

| 項 目                     | 期 末       |       |
|-------------------------|-----------|-------|
|                         | 評 価 額     | 比 率   |
| 公 社 債                   | 1,522,520 | 75.5  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 493,039   | 24.5  |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 2,015,559 | 100.0 |

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年4月13日現在)

| 項 目                   | 期 末            |
|-----------------------|----------------|
| (A) 資 産               | 2,015,559,930円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等       | 491,077,982    |
| 公 社 債 (評価額)           | 1,522,520,077  |
| 未 収 利 息               | 1,796,508      |
| 前 払 費 用               | 165,363        |
| (B) 負 債               | 11,231,970     |
| 未 払 解 約 金             | 11,230,000     |
| そ の 他 未 払 費 用         | 1,970          |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 2,004,327,960  |
| 元 本                   | 1,989,263,317  |
| 次 期 繰 越 損 益 金         | 15,064,643     |
| (D) 受 益 権 総 口 数       | 1,989,263,317口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)       | 10,076円        |

※当期における期首元本額1,935,317,393円、期中追加設定元本額938,745,932円、期中一部解約元本額884,800,008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)    | 171,629,556円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 94,363,204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) | 212,524,739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) | 137,225,742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) | 49,707,035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) | 36,162,259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) | 57,429,415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>     | 797,231,328円 |
| SMAM・FGマネーファンドV A<適格機関投資家限定>    | 432,593,527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2022年4月14日 至2023年4月13日)

| 項 目                       | 当 期         |
|---------------------------|-------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | 9,277,791円  |
| 受 取 利 息                   | 9,496,194   |
| 支 払 利 息                   | △ 218,403   |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | △10,095,159 |
| 売 買 損 益                   | △10,095,159 |
| (C) そ の 他 費 用 等           | △ 20,240    |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 837,608   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 15,339,844  |
| (F) 解 約 差 損 益 金           | △ 6,844,924 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 7,407,331   |
| (H) 合 計 (D + E + F + G)   | 15,064,643  |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H)         | 15,064,643  |

※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。