

■ 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/インデックス型 | | | | |
| 信託期間 | 無期限(設定日:2005年9月30日) | | | | |
| 運用方針 | 各マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。 | | | | |
| 主要投資対象 | 各ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) 日本取引所に上場している株式 国内債券バッシブ・マザーファンド 日本の公社債および短期金融資産 外国株式インデックス・マザーファンド 日本を除く世界各国の株式 外国債券バッシブ・マザーファンド 日本を除く世界各国の債券 | | | | |
| 当ファンドの運用方法 | ■内外の株式・公社債に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。 ■各ファンドにつき、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への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。 | | | | |
| | 国内株式 | 国内債券 | 外国株式 | 外国債券 | 短期金融資産 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)*1 | 20% | 55% | 10% | 10% | 5% |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)*2 | 35% | 35% | 15% | 10% | 5% |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)*3 | 50% | 15% | 20% | 10% | 5% |
| 組入制限 | ■運用にあたっては、委託会社が独自に作成した合成指数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。 ■実質外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行わないことを基本とします。 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) ■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。 ■外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。 三井住友・DC年金バランス50(標準型) ■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の25%以上とします。 ■外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) ■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以上とします。 ■外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) ■株式への投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。 国内債券バッシブ・マザーファンド ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■外貨建資産への投資は行いません。 外国株式インデックス・マザーファンド ■株式への投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 外国債券バッシブ・マザーファンド ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 | | | | |
| 分配方針 | 年1回(毎年2月18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。 | | | | |

本書において、*1を「30(債券重点型)」、*2を「50(標準型)」、*3を「70(株式重点型)」とそれぞれ略称することがあります。

三井住友・DC年金バランス

30(債券重点型)

50(標準型)

70(株式重点型)

【愛称:マイパッケージ】

【運用報告書(全体版)】

(2021年2月19日から2022年2月18日まで)

第17期

決算日 2022年2月18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。

各ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。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年金バランス30（債券重点型）／50（標準型）／70（株式重点型）【愛称：マイパッケージ】

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年金バランス30（債券重点型）

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入率 比 | 株式先物 率 (買建-売建) | 公社債 組入比率 | 投資信託 証券組入 比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|-------------|------------------|-------------|--------|------------|----------------------|-------------|--------------------|-----------|
| | (分配落) | 税 分 配 | 込 金 騰 落 | 期 騰 落 | 中 率 | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 13期(2018年2月19日) | 14,611 | 0 | 5.2 | 153.58 | 5.5 | 29.4 | 0.7 | 64.5 | 0.2 | 8,363 |
| 14期(2019年2月18日) | 14,609 | 0 | △0.0 | 153.86 | 0.2 | 29.8 | 0.5 | 64.1 | 0.2 | 10,162 |
| 15期(2020年2月18日) | 15,268 | 0 | 4.5 | 161.21 | 4.8 | 29.0 | 0.7 | 64.7 | 0.3 | 12,218 |
| 16期(2021年2月18日) | 16,001 | 0 | 4.8 | 169.68 | 5.3 | 30.6 | 0.2 | 63.8 | 0.2 | 13,771 |
| 17期(2022年2月18日) | 16,223 | 0 | 1.4 | 172.72 | 1.8 | 29.3 | 0.5 | 64.5 | 0.2 | 15,215 |

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入率 比 | 株式先物 率 (買建-売建) | 公社債 組入比率 | 投資信託 証券組入 比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|-------------|------------------|-------------|--------|------------|----------------------|-------------|--------------------|-----------|
| | (分配落) | 税 分 配 | 込 金 騰 落 | 期 騰 落 | 中 率 | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 13期(2018年2月19日) | 15,652 | 0 | 8.1 | 166.46 | 8.5 | 49.1 | 1.1 | 44.4 | 0.3 | 23,340 |
| 14期(2019年2月18日) | 15,452 | 0 | △1.3 | 164.70 | △1.1 | 49.3 | 0.9 | 44.2 | 0.4 | 27,693 |
| 15期(2020年2月18日) | 16,411 | 0 | 6.2 | 175.48 | 6.5 | 48.2 | 1.1 | 45.0 | 0.4 | 32,984 |
| 16期(2021年2月18日) | 17,886 | 0 | 9.0 | 192.05 | 9.4 | 50.4 | 0.4 | 43.7 | 0.3 | 38,347 |
| 17期(2022年2月18日) | 18,381 | 0 | 2.8 | 198.27 | 3.2 | 48.9 | 0.8 | 44.7 | 0.3 | 40,992 |

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入率 比 | 株式先物 率 (買建-売建) | 公社債 組入比率 | 投資信託 証券組入 比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|-------------|------------------|-------------|--------|------------|----------------------|-------------|--------------------|-----------|
| | (分配落) | 税 分 配 | 込 金 騰 落 | 期 騰 落 | 中 率 | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 13期(2018年2月19日) | 16,422 | 0 | 11.0 | 176.17 | 11.4 | 68.9 | 1.5 | 24.3 | 0.4 | 12,058 |
| 14期(2019年2月18日) | 15,991 | 0 | △2.6 | 171.97 | △2.4 | 68.8 | 1.2 | 24.5 | 0.5 | 14,023 |
| 15期(2020年2月18日) | 17,255 | 0 | 7.9 | 186.19 | 8.3 | 67.7 | 1.5 | 25.0 | 0.5 | 16,535 |
| 16期(2021年2月18日) | 19,459 | 0 | 12.8 | 211.49 | 13.6 | 69.8 | 0.5 | 24.2 | 0.4 | 19,855 |
| 17期(2022年2月18日) | 20,265 | 0 | 4.1 | 221.24 | 4.6 | 68.5 | 1.1 | 24.9 | 0.5 | 21,789 |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※各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。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※各ファンドのベンチマークは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）、NOMURA-BPI（総合）、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）および有担保コール翌日物を各ファンドの基本資産配分で組み合わせた合成指数で、当報告書作成時に知りえ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、外国の指数については基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※各ファンドのベンチマークを構成する各指数の著作権、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、許諾者は各ファンドの運営に何ら関与するものではなく、各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

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ペ ン チ マ ー ク | | 株 式 組 入 率 比 | 株 式 先 物 率 比 (買建-売建) | 公 社 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 率 |
|---------------------|---------|-------|-------------|-------|----------------|---------------------------|--------------------|----------------------|
| | 円 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | |
| (期 首) 2021年2月18日 | 16,001 | — | 169.68 | — | 30.6 | 0.2 | 63.8 | 0.2 |
| 2月末 | 15,786 | △1.3 | 167.43 | △1.3 | 28.9 | 0.3 | 65.1 | 0.2 |
| 3月末 | 16,163 | 1.0 | 171.48 | 1.1 | 29.4 | 0.4 | 64.6 | 0.2 |
| 4月末 | 16,158 | 1.0 | 171.49 | 1.1 | 29.1 | 0.6 | 64.6 | 0.2 |
| 5月末 | 16,249 | 1.5 | 172.52 | 1.7 | 29.2 | 0.7 | 64.6 | 0.2 |
| 6月末 | 16,327 | 2.0 | 173.45 | 2.2 | 29.3 | 0.5 | 64.8 | 0.2 |
| 7月末 | 16,332 | 2.1 | 173.55 | 2.3 | 29.1 | 0.6 | 64.9 | 0.2 |
| 8月末 | 16,464 | 2.9 | 175.01 | 3.1 | 29.6 | 0.5 | 64.4 | 0.2 |
| 9月末 | 16,529 | 3.3 | 175.68 | 3.5 | 28.8 | 0.6 | 65.0 | 0.2 |
| 10月末 | 16,625 | 3.9 | 176.74 | 4.2 | 29.1 | 0.8 | 63.5 | 0.2 |
| 11月末 | 16,499 | 3.1 | 175.46 | 3.4 | 28.4 | 0.7 | 65.3 | 0.2 |
| 12月末 | 16,667 | 4.2 | 177.32 | 4.5 | 29.6 | 0.6 | 64.3 | 0.2 |
| 2022年1月末 | 16,292 | 1.8 | 173.38 | 2.2 | 28.7 | 0.4 | 65.1 | 0.2 |
| (期 末) 2022年2月18日 | 16,223 | 1.4 | 172.72 | 1.8 | 29.3 | 0.5 | 64.5 | 0.2 |

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ペ ン チ マ ー ク | | 株 式 組 入 率 比 | 株 式 先 物 率 比 (買建-売建) | 公 社 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 率 |
|---------------------|---------|-------|-------------|-------|----------------|---------------------------|--------------------|----------------------|
| | 円 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | |
| (期 首) 2021年2月18日 | 17,886 | — | 192.05 | — | 50.4 | 0.4 | 43.7 | 0.3 |
| 2月末 | 17,544 | △1.9 | 188.42 | △1.9 | 48.7 | 0.5 | 45.1 | 0.3 |
| 3月末 | 18,147 | 1.5 | 194.97 | 1.5 | 49.0 | 0.7 | 44.7 | 0.4 |
| 4月末 | 18,101 | 1.2 | 194.53 | 1.3 | 48.7 | 1.0 | 44.7 | 0.4 |
| 5月末 | 18,251 | 2.0 | 196.25 | 2.2 | 48.6 | 1.2 | 44.7 | 0.3 |
| 6月末 | 18,393 | 2.8 | 197.88 | 3.0 | 48.8 | 0.8 | 44.9 | 0.4 |
| 7月末 | 18,333 | 2.5 | 197.30 | 2.7 | 48.6 | 1.0 | 45.1 | 0.4 |
| 8月末 | 18,593 | 4.0 | 200.18 | 4.2 | 49.2 | 0.9 | 44.5 | 0.4 |
| 9月末 | 18,782 | 5.0 | 202.16 | 5.3 | 48.2 | 1.0 | 45.2 | 0.3 |
| 10月末 | 18,924 | 5.8 | 203.72 | 6.1 | 48.6 | 1.4 | 44.0 | 0.4 |
| 11月末 | 18,665 | 4.4 | 201.00 | 4.7 | 47.8 | 1.2 | 45.4 | 0.4 |
| 12月末 | 18,996 | 6.2 | 204.69 | 6.6 | 49.1 | 0.9 | 44.3 | 0.4 |
| 2022年1月末 | 18,387 | 2.8 | 198.24 | 3.2 | 48.4 | 0.8 | 45.1 | 0.4 |
| (期 末) 2022年2月18日 | 18,381 | 2.8 | 198.27 | 3.2 | 48.9 | 0.8 | 44.7 | 0.3 |

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

| 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | ペ ン チ マ ー ク | | 株 式 組 入 率 比 | 株 式 先 物 率 比 (買建-売建) | 公 社 債 率 組 入 比 率 | 投 資 信 託 組 入 率 証 券 組 入 率 |
|------------|--------|-------|--------|-------------|-------|----------------|---------------------------|--------------------|----------------------------|
| | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | |
| (期 首) | 円 | % | % | % | % | % | % | % | |
| 2021年2月18日 | 19,459 | — | 211.49 | — | 69.8 | 0.5 | 24.2 | 0.4 | |
| 2月末 | 18,977 | △2.5 | 206.29 | △2.5 | 68.3 | 0.7 | 25.4 | 0.5 | |
| 3月末 | 19,829 | 1.9 | 215.66 | 2.0 | 68.5 | 1.0 | 24.9 | 0.5 | |
| 4月末 | 19,735 | 1.4 | 214.65 | 1.5 | 68.1 | 1.4 | 24.9 | 0.5 | |
| 5月末 | 19,951 | 2.5 | 217.14 | 2.7 | 67.9 | 1.7 | 24.8 | 0.5 | |
| 6月末 | 20,164 | 3.6 | 219.57 | 3.8 | 68.4 | 1.2 | 25.0 | 0.5 | |
| 7月末 | 20,027 | 2.9 | 218.15 | 3.1 | 68.1 | 1.4 | 25.1 | 0.5 | |
| 8月末 | 20,434 | 5.0 | 222.68 | 5.3 | 68.7 | 1.2 | 24.7 | 0.5 | |
| 9月末 | 20,765 | 6.7 | 226.21 | 7.0 | 67.9 | 1.4 | 25.1 | 0.5 | |
| 10月末 | 20,956 | 7.7 | 228.32 | 8.0 | 67.8 | 1.9 | 24.6 | 0.5 | |
| 11月末 | 20,540 | 5.6 | 223.89 | 5.9 | 67.3 | 1.6 | 25.4 | 0.5 | |
| 12月末 | 21,065 | 8.3 | 229.71 | 8.6 | 68.6 | 1.3 | 24.5 | 0.5 | |
| 2022年1月末 | 20,194 | 3.8 | 220.36 | 4.2 | 67.9 | 1.1 | 25.3 | 0.5 | |
| (期 末) | | | | | | | | | |
| 2022年2月18日 | 20,265 | 4.1 | 221.24 | 4.6 | 68.5 | 1.1 | 24.9 | 0.5 | |

※騰落率は期首比です。

※各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。

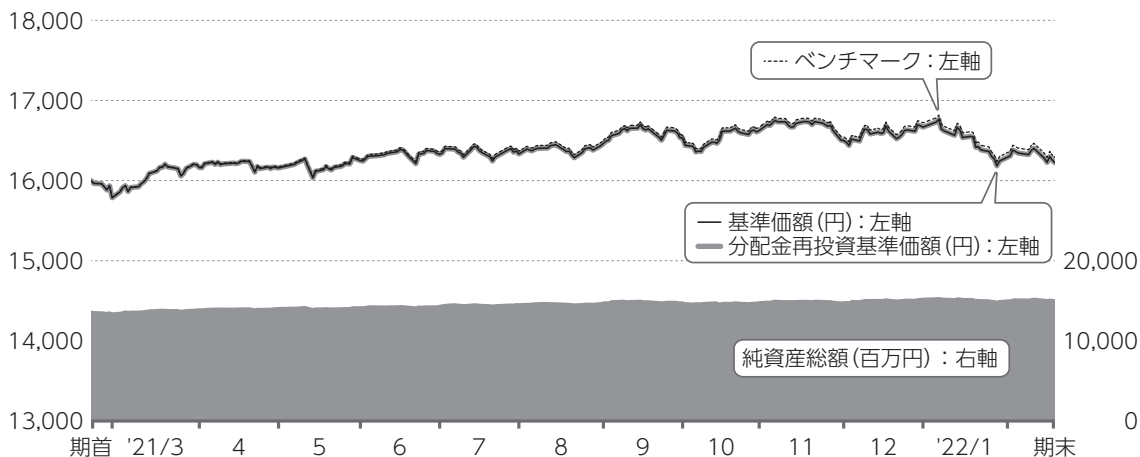
※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年2月19日から2022年2月18日まで)

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、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。

| | |
|-----|---------------------------|
| 期首 | 16,001円 |
| 期末 | 16,223円 (既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | +1.4% (分配金再投資ベース) |

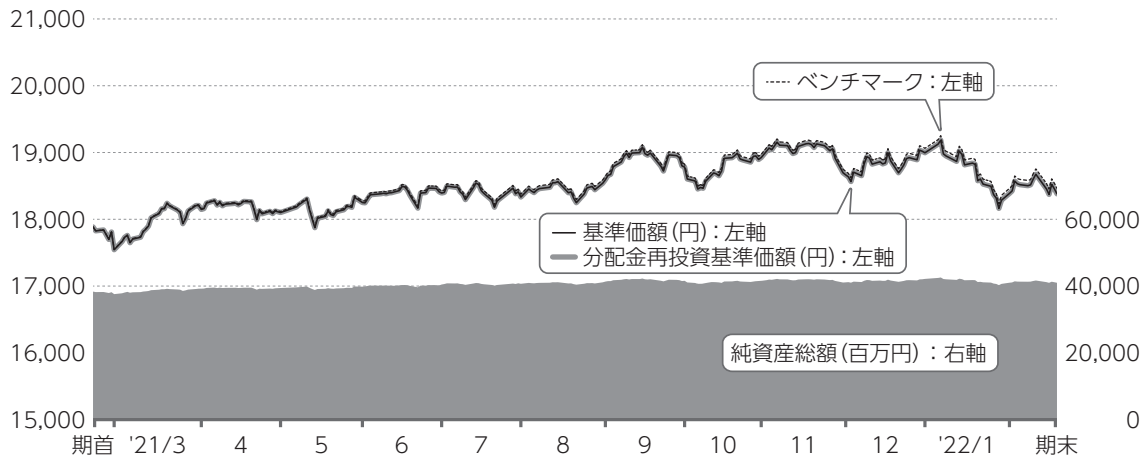
分配金再投資基準価額について

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

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

三井住友・DC年金バランス50(標準型)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、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。

| | |
|-----|---------------------------|
| 期首 | 17,886円 |
| 期末 | 18,381円 (既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | +2.8% (分配金再投資ベース) |

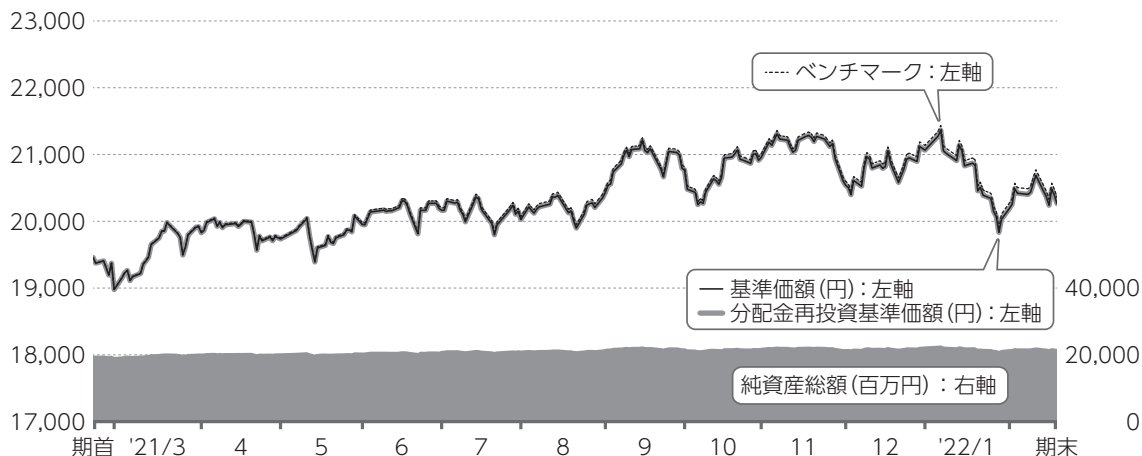
分配金再投資基準価額について

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

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

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、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。

| | |
|-----|---------------------------|
| 期首 | 19,459円 |
| 期末 | 20,265円 (既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | +4.1% (分配金再投資ベース) |

分配金再投資基準価額について

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

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

※各ファンドのベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)および有担保コール翌日物を各ファンドの基本資産配分で組み合わせた合成指数です。

※各ファンドのベンチマークを構成する各指数の著作権、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、許諾者は各ファンドの運営に何ら関与するものではなく、各ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）／50（標準型）／70（株式重点型）

各ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資を行いました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行っていません。

上昇要因

- 外国株式市場が上昇したこと
- 米ドル・ユーロ共に円に対して上昇したこと

組入れファンドの状況

| 組入れファンド | 投資資産 | 騰落率 | 基本資産配分 | | | 期末組入比率 | | |
|------------------------|--------|--------|---------------|-------------|---------------|---------------|-------------|---------------|
| | | | 30 (債券重点型) | 50 (標準型) | 70 (株式重点型) | 30 (債券重点型) | 50 (標準型) | 70 (株式重点型) |
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 国内株式 | +1.2% | 20% | 35% | 50% | 20.1% | 35.2% | 50.2% |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 国内債券 | -1.2% | 55% | 35% | 15% | 55.1% | 35.1% | 15.1% |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 外国株式 | +19.5% | 10% | 15% | 20% | 9.9% | 14.9% | 19.9% |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 外国債券 | +1.1% | 10% | 10% | 10% | 9.9% | 10.0% | 10.0% |
| — | 短期金融資産 | — | 5% | 5% | 5% | 5.0% | 4.9% | 4.9% |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

国内株式・外国株式は上昇しました。債券市場では、国内長期金利（10年国債利回り）・米国長期金利はともに上昇（債券価格は下落）しました。また欧州（ドイツ）長期金利も上昇しました。為替市場では、米ドル・ユーロ共に円に対して上昇しました。

国内株式

国内株式は小幅上昇しました。

期初は日本銀行の金融緩和スタンスが維持される中、米国を中心とした株価上昇等に連れる形で上昇しました。その後8月後半までは上値は重くもみ合いで推移しましたが、9月下旬にかけて自民党総裁選への期待感を背景に大きく上昇しました。

その後、1月上旬にかけては中国不動産大手のデフォルト（債務不履行）懸念や変異ウイルス感染拡大への警戒感、また米国長期金利の上昇等を背景に下落基調で推移しました。

期末にかけてはFOMC（米連邦公開市場委員会）を受けてタカ派（インフレ抑制を重視する立場）色の一段の強まりを警戒した売り優勢となった米国に連れる形で大きく下落しました。更に地政学リスクへの懸念も高まり、リスク・オフ（リスク回避）ムードが強まり下落基調で推移しました。

国内債券

日本の長期金利は上昇しました。

期初は、米金利の上昇や株価の上昇等を背景に国内でも長期金利は上昇しました。その後3月上旬から8月にかけて、日銀の金融緩和政策継続や米金利の低下等を背景に長期金利は低下しました。

10月下旬にかけては、FOMCで政策金利見通しが引き上げられたことによる米金利の上昇や、インフレ長期化懸念の強まり等を背景に国内長期金利は上昇しました。

1月にかけて、新たな変異ウイルス（オミクロン型）が検出され感染拡大懸念が高まったことから長期金利は再び低下しました。しかし、期末にかけてはコロナウイルス経口薬の承認が相次いだことで、変異ウイルスに対する警戒感が和らいだことや、米国金融政策への警戒感を背景に米金利が上昇したことに連れる形で、長期金利は大きく上昇しました。

外国株式

外国株式は、期を通して上昇しました。

米国市場は、期初から8月下旬にかけては、世界の主要国・中央銀行の景気支援的な政策の継続やワクチン接種の進展に伴う経済回復に対する期待等を背景に、株式市場は堅調に推移しました。その後、9月上旬から10月にかけては、軟調な雇用統計やFOMCで年内のテーパリング(量的緩和の段階的縮小)開始が示唆されたことを背景に下落しました。その後は企業業績が概ね予想を上回る決算となったことで、再び大きく上昇しました。しかし、11月中旬から1月にかけては変異ウイルス感染拡大への警戒感や米国長期金利の上昇等を背景に上値は重く、更に期末にかけては、米国金融政策への警戒感や地政学リスク等を背景に下落しました。

欧州市場も、米国市場に連れる形で推移し、ECB(欧州中央銀行)が金融緩和政策を当面維持するとの見方等が安心材料となり大きく上昇しました。しかし、期末は欧州を中心とした感染再拡大や地政学リスクへの警戒感の強まりを受けて下落しました。

外国債券

米国の長期金利は上昇しました。

期初から3月にかけて、経済活動の再開や株価の堅調な推移などから、米国の長期金利は上昇しました。4月上旬から7月にかけて

は、感染再拡大によるインフレ期待の低下などを背景に低下しました。その後10月下旬にかけては、FOMCにて政策金利予想が引き上げられたことやテーパリング開始が示唆されたことを受け、長期金利は上昇しました。しかし、1月にかけては、変異ウイルスの感染拡大懸念から低下基調となりました。期末にかけては、インフレへの警戒感が根強く、また金融政策正常化プロセスの見通しが前倒しされる中で長期金利は大きく上昇しました。

欧州(ドイツ)の長期金利は上昇しました。

欧州では、期初から6月下旬にかけて、米金利の上昇や欧州景気の改善期待等から、長期金利が大きく上昇しました。7月から8月下旬にかけては、感染再拡大や米金利の低下等を受けて、欧州でも長期金利は低下基調で推移しましたが、その後は米金利に連れる形で上昇しました。しかし、再度感染が再拡大し、変異ウイルスへの警戒感も強まる中で長期金利は大きく低下しましたが、その後は、インフレ懸念の高まりやECBの金融政策正常化の前倒し観測等を背景には大きく上昇しました。期末にかけては、地政学リスクへの懸念が高まり、長期金利は低下しました。

外国為替

●米ドル・円

期を通して見ると、米ドル・円は上昇しま

した。

期初から3月下旬にかけては、米金利の上昇などを背景に米ドルが底堅く推移しました。4月以降9月下旬にかけては、米金利の低下等を背景に米ドルは上値が重くなり、もみ合いで推移しました。その後期末にかけては、米国の利上げの織り込みが加速したことや、株価上昇などによるリスク選好度の改善を背景に、米ドルは上昇しました。

●ユーロ・円

期を通して見ると、ユーロ・円は上昇しました。

期初から5月下旬にかけては、米金利の上昇やユーロ圏の景気回復期待などを背景に、ユーロがじり高の展開となりました。10月上旬にかけては、感染再拡大を受けたリスク回避的な動きにより、ユーロは下落しました。その後、利上げの織り込みが進んだことでユーロは上昇しましたが、感染の再拡大を受けて下落で推移しました。

期末にかけては、ECB高官によるタカ派的な発言を受けてユーロは一時的に上昇する場面がありましたが、感染再拡大への懸念が強まり、下落基調で推移しました。

ポートフォリオについて（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

三井住友・DC年金バランス 30（債券重点型）／50（標準型）／70（株式重点型）

各マザーファンドへの投資を通じて、主として内外の株式および公社債に国際分散投資を行いました。時価変動等に伴う組入比率の変化については、追加設定や一部解約といった資金流出入に応じて各マザーファンドの売買を通じて資産配分の基準値からの乖離を調整しました。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

ベンチマークである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た運用を行いました。

具体的には、東証1部上場銘柄のうち流動性や信用リスクを考慮して投資し、また、連動性を高めつつ、ファンドの資金流出入に機動的に対応するため、株式先物の売買を行いました。

月次ベースの推定トラッキングエラー（ポートフォリオとベンチマークのリターン乖離）が拡大する場合には、現物株式のリバランス（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。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

国内債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるNOMUR A-BPI（総合）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。

具体的には、デュレーション（投資資金の平均回収期間）、満期・債券種別・格付け構成などをベンチマークに合わせつつ、個別銘柄については分散投資を図りました。また、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）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を行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

外国株式インデックス・マザーファンド

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

日々の追加設定・解約による資金変動に対しては、売買にかかるコストなどを勘案し、株式先物取引を利用した組入比率の調整を実施してトラッキングエラーを低く抑えめました。

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）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。

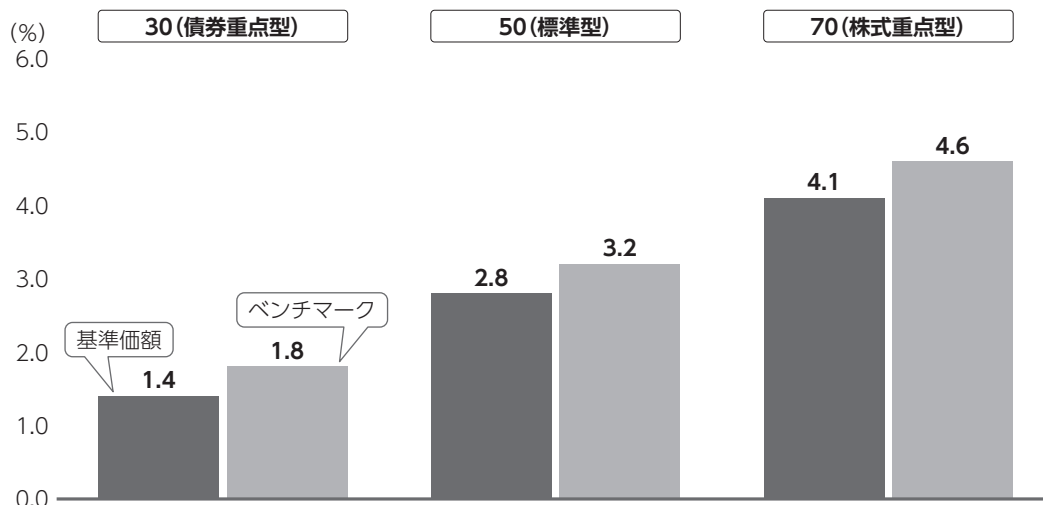
具体的には、通貨・国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りベンチマークに近似させるよう調整しました。

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（国別比率、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を行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

ベンチマークとの差異について（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

各ファンドのベンチマークは、国内株式…TOPIX（東証株価指数、配当込み）、国内債券…NOMURA-BPI（総合）、外国株式…MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）、外国債券…FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）、短期金融資産…有担保コール翌日物を、各ファンドの基本資産配分で組み合わせた合成指数です。

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

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 (分配金再投資ベース) | ベンチマークの騰落率 | 乖離幅 |
|------------|-------------------------|------------|-------|
| 30 (債券重点型) | +1.4% | +1.8% | -0.4% |
| 50 (標準型) | +2.8% | +3.2% | -0.4% |
| 70 (株式重点型) | +4.1% | +4.6% | -0.5% |

下方乖離要因

- 信託報酬等の支払い

分配金について（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

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

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

（単位：円、1万口当たり、税引前）

| 項目 | 第17期 | | |
|-----------|-----------|---------|-----------|
| | 30(債券重点型) | 50(標準型) | 70(株式重点型) |
| 当期分配金 | 0 | 0 | 0 |
| (対基準価額比率) | 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 | 7,094 | 10,170 | 13,019 |

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

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

2 今後の運用方針

三井住友・DC年金バランス

30(債券重点型)／50(標準型)／70(株式重点型)

引き続きマザーファンドへの投資を通じて、主として内外の株式および公社債に国際分散投資を行うことにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

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高位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)

引き続き、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

国内債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、NOMURA-BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を

行います。デュレーション、満期構成、流動性などを考慮して選択した債券に分散投資し、債券組入比率を高位に保つことを基本とします。

外国株式インデックス・マザーファンド

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

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

します。

外国債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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調整します。

また月次のベンチマーク更新時や、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。

債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

3 お知らせ

約款変更について

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）／50（標準型）／70（株式重点型）

該当事項はございません。

1万口当たりの費用明細（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-------------|------|---------|---|
| (a) 信託報酬 | 40円 | 0.242% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（経過日数／年日数） 期中の平均基準価額は16,383円です。 |
| （投信会社） | (16) | (0.099) | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 |
| （販売会社） | (18) | (0.110) | 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） | (5) | (0.033) | 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 | 0 | 0.001 | 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） | (0) | (0.000) | 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） | (0) | (0.001) | |
| （投資信託証券） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 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 |
| （株式） | (0) | (0.000) | 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） | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 2 | 0.014 | 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） | (1) | (0.007) | 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) | (0.005) | 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 | 42 | 0.257 | |

※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。

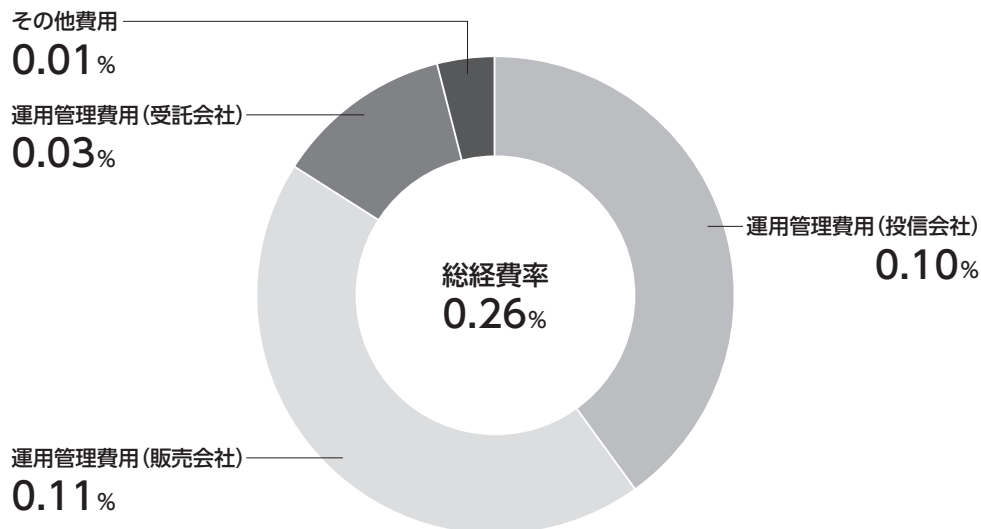
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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。



参考情報 総経費率（年率換算）



※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、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。

※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。

※上記の前提条件で算出しているため、「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。なお、これらの値はあくまでも参考であり、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総経費率(年率換算)は0.26%です。

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-------------|------|---------|---|
| (a) 信託報酬 | 47円 | 0.253% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は18,504円です。 |
| （投信会社） | (20) | (0.110) | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 |
| （販売会社） | (20) | (0.110) | 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| （受託会社） | (6) | (0.033) | 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 | 0 | 0.001 | 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） | (0) | (0.000) | 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） | (0) | (0.001) | |
| （投資信託証券） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 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 |
| （株式） | (0) | (0.000) | 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） | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 3 | 0.016 | 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） | (2) | (0.009) | 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) | (0.005) | 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 |
| （その他） | (0) | (0.002) | その他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 50 | 0.271 | |

※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。

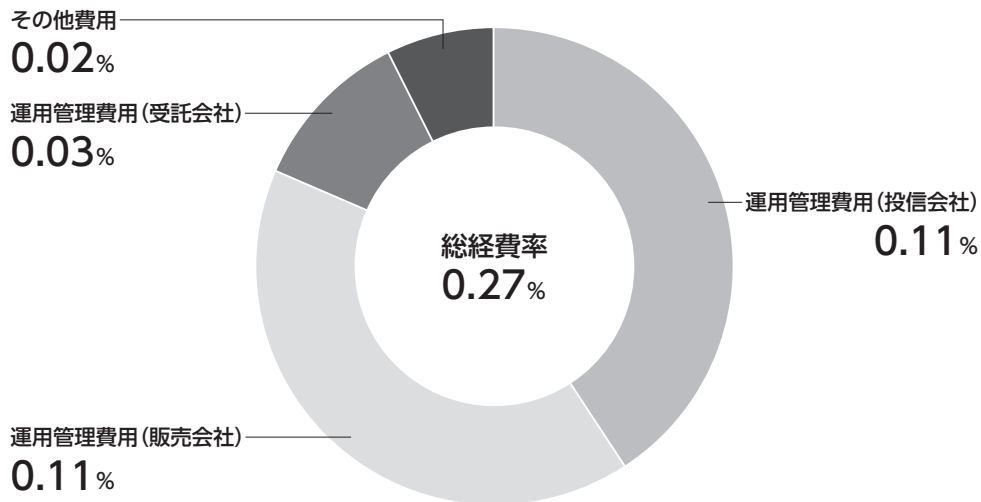
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



※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、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。

※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。

※上記の前提条件で算出しているため、「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。なお、これらの値はあくまでも参考であり、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総経費率(年率換算)は0.27%です。

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-------------|------|---------|---|
| (a) 信託報酬 | 54円 | 0.264% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（経過日数／年日数） 期中の平均基準価額は20,338円です。 |
| （投信会社） | (25) | (0.121) | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 |
| （販売会社） | (22) | (0.110) | 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) | (0.033) | 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 | 0 | 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 |
| （株式） | (0) | (0.001) | 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） | (0) | (0.001) | |
| （投資信託証券） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.001 | 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） | (0) | (0.001) | 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） | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 4 | 0.018 | 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） | (2) | (0.010) | 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) | (0.005) | 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 |
| （その他） | (0) | (0.002) | その他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 58 | 0.285 | |

※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。

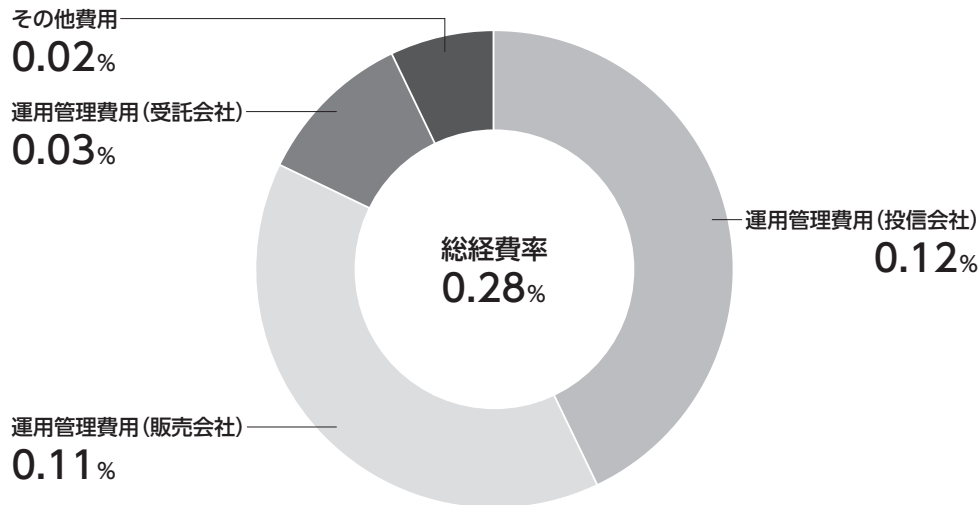
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



※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、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。

※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。

※上記の前提条件で算出しているため、「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。なお、これらの値はあくまでも参考であり、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総経費率(年率換算)は0.28%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

| | 設 定 | | 解 約 | |
|------------------------|-----------|-----------|---------|---------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 282,617 | 909,100 | 229,549 | 755,990 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 31,566 | 169,830 | 67,618 | 352,560 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 100,737 | 197,670 | 27,053 | 53,250 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 1,073,011 | 1,372,470 | 266,197 | 340,490 |

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

| | 設 定 | | 解 約 | |
|------------------------|-----------|-----------|---------|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 652,316 | 2,096,620 | 490,672 | 1,639,240 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 47,041 | 256,970 | 218,881 | 1,158,640 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 210,829 | 411,430 | 51,064 | 100,670 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 1,622,596 | 2,075,340 | 483,169 | 618,370 |

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

| | 設 定 | | 解 約 | |
|------------------------|---------|-----------|---------|---------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 531,207 | 1,710,860 | 297,549 | 995,320 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 64,427 | 346,220 | 151,646 | 807,930 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 161,923 | 316,280 | 39,833 | 78,430 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 553,962 | 708,520 | 224,197 | 286,610 |

■ 親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）／50（標準型）／70（株式重点型）

| 項 目 | 当 期 | |
|-------------------------------|------------------------|--------------------|
| | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 外国株式インデックス・マザーファンド |
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 35,926,123千円 | 38,250,818千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 192,794,498千円 | 310,066,553千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b) | 0.18 | 0.12 |

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

(1) 利害関係人との取引状況

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）／50（標準型）／70（株式重点型）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 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 22,710 | 百万円 6,507 | % 28.7 | 百万円 13,215 | 百万円 6,672 | % 50.5 |
| 株式先物取引 | 51,218 | 51,199 | 100.0 | 49,065 | 48,008 | 97.8 |

※三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） 平均保有割合 1.5%

※三井住友・DC年金バランス50（標準型） 平均保有割合 7.1%

※三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） 平均保有割合 5.4%

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|-----|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
| | | うち利害関係人 との取引状況B | B A | | うち利害関係人 との取引状況D | D C |
| 公社債 | 百万円 40,292 | 百万円 2,342 | % 5.8 | 百万円 36,419 | 百万円 625 | % 1.7 |

※三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） 平均保有割合 6.1%

※三井住友・DC年金バランス50（標準型） 平均保有割合 10.7%

※三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） 平均保有割合 2.4%

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

外国株式インデックス・マザーファンド

外国債券パッシブ・マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|-----------|--------------|
| 株式 | 百万円 172 | 百万円 74 | 百万円 2,207 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 期 末 保 有 額 |
|-----|----------|----------|------------|
| 公社債 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 101 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|--------------|
| 公社債 | 百万円 1,300 |

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------|
| (a) 売買委託手数料総額 | 131千円 |
| (b) うち利害関係人への支払額 | 73千円 |
| (c) (b) / (a) | 55.6% |

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------|
| (a) 売買委託手数料総額 | 604千円 |
| (b) うち利害関係人への支払額 | 353千円 |
| (c) (b) / (a) | 58.4% |

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------|
| (a) 売買委託手数料総額 | 445千円 |
| (b) うち利害関係人への支払額 | 266千円 |
| (c) (b) / (a) | 59.7% |

※売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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、株式会社三井住友銀行です。

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

（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）／50（標準型）／70（株式重点型）

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

■ 組入れ資産の明細（2022年2月18日現在）

親投資信託残高

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

| 種 類 | 期首(前期末) | | 期 末 | |
|------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 898,808 | 951,877 | 951,877 | 3,065,235 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 303,792 | 267,740 | 267,740 | 1,505,718 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 710,157 | 783,841 | 783,841 | 1,513,911 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 5,849,125 | 6,655,940 | 6,655,940 | 8,376,500 |

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

| 種 類 | 期首(前期末) | | 期 末 | |
|------------------------|------------|------------|------------|------------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 4,316,392 | 4,478,037 | 4,478,037 | 14,420,177 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 1,258,091 | 1,086,252 | 1,086,252 | 6,108,865 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 1,958,794 | 2,118,559 | 2,118,559 | 4,091,785 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 10,277,305 | 11,416,731 | 11,416,731 | 14,367,956 |

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

| 種 類 | 期首(前期末) | | 期 末 | |
|------------------------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 3,161,513 | 3,395,171 | 3,395,171 | 10,933,132 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 856,580 | 769,361 | 769,361 | 4,326,736 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 1,005,548 | 1,127,638 | 1,127,638 | 2,177,921 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 2,281,609 | 2,611,374 | 2,611,374 | 3,286,415 |

※各親投資信託の期末の受益権総口数は以下の通りです。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号） 62,902,449,020口
 外国債券パッシブ・マザーファンド 82,333,458,509口

外国株式インデックス・マザーファンド 61,407,657,975口
 国内債券パッシブ・マザーファンド 102,053,846,373口

■ 投資信託財産の構成

(2022年2月18日現在)

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

| 項 目 | 期 末 | |
|------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 3,065,235 | 20.1 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 8,376,500 | 54.9 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 1,505,718 | 9.9 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 1,513,911 | 9.9 |
| コール・ローン等、その他 | 783,233 | 5.1 |
| 投資信託財産総額 | 15,244,599 | 100.0 |

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

| 項 目 | 期 末 | |
|------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 14,420,177 | 35.1 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 14,367,956 | 35.0 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 6,108,865 | 14.9 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 4,091,785 | 10.0 |
| コール・ローン等、その他 | 2,096,422 | 5.1 |
| 投資信託財産総額 | 41,085,207 | 100.0 |

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

| 項 目 | 期 末 | |
|------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 10,933,132 | 50.1 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 3,286,415 | 15.1 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 4,326,736 | 19.8 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 2,177,921 | 10.0 |
| コール・ローン等、その他 | 1,106,402 | 5.1 |
| 投資信託財産総額 | 21,830,608 | 100.0 |

※外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（345,013,700千円）の投資信託財産総額（346,185,785千円）に対する比率は99.7%です。

※外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（158,502,441千円）の投資信託財産総額（159,096,109千円）に対する比率は99.6%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=114.95円、1カナダ・ドル=90.41円、1オーストラリア・ドル=82.48円、1香港・ドル=14.74円、1シンガポール・ドル=85.60円、1ニュージーランド・ドル=76.90円、1イギリス・ポンド=156.42円、1イスラエル・シケル=35.793円、1スイス・フラン=124.90円、1デンマーク・クローネ=17.55円、1ノルウェー・クローネ=12.89円、1スウェーデン・クローナ=12.30円、1メキシコ・ペソ=5.661円、1オフショア・人民元=18.15円、1マレーシア・リンギット=27.464円、1ポーランド・ズロチ=28.86円、1ユーロ=130.57円です。

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2022年2月18日現在）

| 項 目 | 期 末 |
|-------------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 15,244,599,383円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 783,233,947 |
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) (評価額) | 3,065,235,336 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 8,376,500,719 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド(評価額) | 1,505,718,017 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 1,513,911,364 |
| (B) 負 債 | 29,247,015 |
| 未 払 解 約 金 | 10,411,076 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 18,416,048 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 419,891 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 15,215,352,368 |
| 元 本 | 9,378,840,162 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 5,836,512,206 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 9,378,840,162口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 16,223円 |

※当期における期首元本額8,606,895,176円、期中追加設定元本額2,501,268,886円、期中一部解約元本額1,729,323,900円です。

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

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

■ 損益の状況

（自2021年2月19日 至2022年2月18日）

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|-------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △ 461,854円 |
| 受 取 利 息 | 34,443 |
| 支 払 利 息 | △ 496,297 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 156,714,183 |
| 売 買 益 | 326,092,505 |
| 売 買 損 | △ 169,378,322 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 36,437,933 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 119,814,396 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 1,517,599,470 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 4,199,098,340 |
| (配 当 等 相 当 額) | (4,981,351,418) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 782,253,078) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | 5,836,512,206 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | 5,836,512,206 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 4,199,098,340 |
| (配 当 等 相 当 額) | (4,983,786,207) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 784,687,867) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 1,669,920,939 |
| 繰 越 損 益 金 | △ 32,507,073 |

※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 | 152,321,469円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 4,983,786,207 |
| (d) 分配準備積立金 | 1,517,599,470 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 6,653,707,146 |
| 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 7,094.38 |
| (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 |

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2022年2月18日現在）

| 項 目 | 期 末 |
|-------------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 41,085,207,709円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 2,088,242,289 |
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額) | 14,420,177,481 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 14,367,956,926 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド(評価額) | 6,108,865,960 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 4,091,785,053 |
| 未 収 入 金 | 8,180,000 |
| (B) 負 債 | 92,840,963 |
| 未 払 解 約 金 | 38,720,004 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 52,965,870 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 1,155,089 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 40,992,366,746 |
| 元 本 | 22,301,330,040 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 18,691,036,706 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 22,301,330,040口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 18,381円 |

※当期における期首元本額21,439,931,171円、期中追加設定元本額3,694,800,844円、期中一部解約元本額2,833,401,975円です。

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

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

■ 損益の状況

（自2021年2月19日 至2022年2月18日）

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △ 1,303,811円 |
| 受 取 利 息 | 68,774 |
| 支 払 利 息 | △ 1,372,585 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 1,012,568,952 |
| 売 買 損 益 | 1,362,435,394 |
| 売 買 損 益 | △ 349,866,442 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 105,172,468 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 906,092,673 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 7,255,521,694 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 10,529,422,339 |
| (配 当 等 相 当 額) | (14,513,807,073) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 3,984,384,734) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | 18,691,036,706 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | 18,691,036,706 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 10,529,422,339 |
| (配 当 等 相 当 額) | (14,518,989,488) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 3,989,567,149) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 8,161,614,367 |

※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 | 541,472,862円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 364,619,811 |
| (c) 収益調整金 | 14,518,989,488 |
| (d) 分配準備積立金 | 7,255,521,694 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 22,680,603,855 |
| 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 10,170.07 |
| (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 |

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年2月18日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-------------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 21,830,608,929円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 1,106,402,889 |
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額) | 10,933,132,652 |
| 国内債券バッシブ・マザーファンド(評価額) | 3,286,415,085 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド(評価額) | 4,326,736,536 |
| 外国債券バッシブ・マザーファンド(評価額) | 2,177,921,767 |
| (B) 負 債 | 40,763,452 |
| 未 払 解 約 金 | 10,800,052 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 29,350,013 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 613,387 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 21,789,845,477 |
| 元 本 | 10,752,403,155 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 11,037,442,322 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 10,752,403,155口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 20,265円 |

※当期における期首元本額10,203,692,200円、期中追加設定元本額2,220,916,085円、期中一部解約元本額1,672,205,130円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2021年2月19日 至2022年2月18日)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △ 678,359円 |
| 受 取 利 息 | 41,496 |
| 支 払 利 息 | △ 719,855 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 759,575,548 |
| 売 買 益 | 936,915,825 |
| 売 買 損 | △ 177,340,277 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 57,693,456 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 701,203,733 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 4,234,408,353 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 6,101,830,236 |
| (配 当 等 相 当 額) | (9,059,895,581) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 2,958,065,345) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | 11,037,442,322 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | 11,037,442,322 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 6,101,830,236 |
| (配 当 等 相 当 額) | (9,063,687,585) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 2,961,857,349) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 4,935,612,086 |

※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 | 332,827,531円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 368,376,202 |
| (c) 収益調整金 | 9,063,687,585 |
| (d) 分配準備積立金 | 4,234,408,353 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 13,999,299,671 |
| 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 13,019.69 |
| (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 |

各ファンドとも上記のほか、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。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第19期（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

| | |
|------|---|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2003年2月17日） |
| 運用方針 | 主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 |

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

■ 最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | (ベンチマーク) TOPIX (東証株価指数、配当込み) | | 株式組入率 株比 | 株式先物率 (買建-売建) | 純資産額 |
|------------------|--------|-------|------------------------------------|-------|-------------|------------------|---------|
| | 円 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | |
| 15期（2017年11月30日） | 27,242 | 24.6% | 2,604.86 | 24.5% | 98.5% | 1.5% | 193,025 |
| 16期（2018年11月30日） | 25,937 | △4.8 | 2,475.92 | △4.9 | 97.1 | 2.8 | 173,547 |
| 17期（2019年12月2日） | 27,359 | 5.5 | 2,611.46 | 5.5 | 97.7 | 2.3 | 174,398 |
| 18期（2020年11月30日） | 28,704 | 4.9 | 2,738.72 | 4.9 | 97.7 | 2.0 | 180,486 |
| 19期（2021年11月30日） | 32,212 | 12.2 | 3,073.26 | 12.2 | 97.7 | 2.4 | 197,054 |

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

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

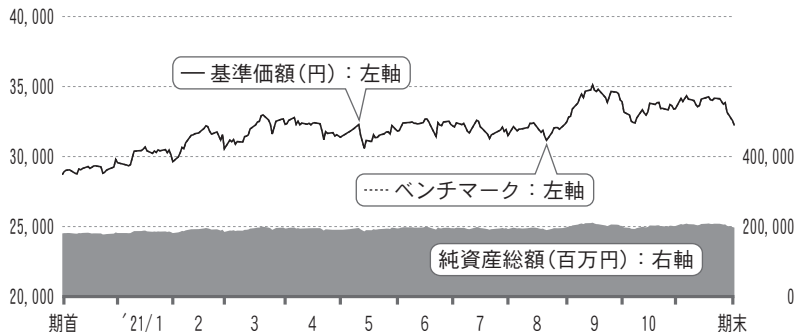
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 28,704円 |
| 期末 | 32,212円 |
| 騰落率 | +12.2% |

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

| | |
|------|--|
| 上昇要因 | <ul style="list-style-type: none"> ・米国の追加経済対策への期待と国内製造業の好業績により、国内株式市場が上昇したこと ・9月の菅総理の辞任表明により、新政権の政策期待から国内株式市場が上昇したこと |
| 下落要因 | <ul style="list-style-type: none"> ・期末にかけて、欧州を中心とした新型コロナウイルスの感染再拡大に加え、南アフリカでの新たな変異ウイルス（オミクロン型）の検出が嫌気され下落したこと |

▶ 投資環境について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

国内株式市場は上昇しました。

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

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

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

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

株式組入比率

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

ポートフォリオの特性

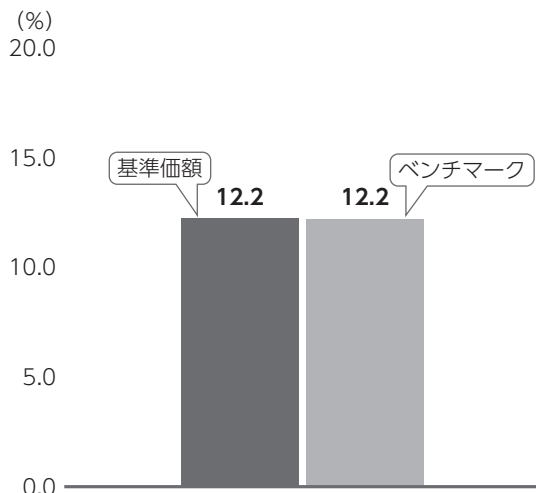
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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

推定トラッキングエラー（ポートフォリオとベンチマークのリターンの乖離）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（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+12.2%となり、ベンチマークの騰落率+12.2%を追随しました。

2 今後の運用方針

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

| 項 目 | 金 額 | 比 率 | 項 目 の 概 要 |
|---|------------------|------------------------------|--|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 1円 (0) (1) | 0.003% (0.000) (0.002) | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (b) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合 計 | 1 | 0.003 | |

期中の平均基準価額は31,986円です。

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|-----|------------------------|-------------------|-----------|------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 内 | 上 場 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 8,334.3 (3,590.575) | 19,219,723 () | 8,658.775 | 20,409,478 |

※金額は受渡し代金。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|-------------|---------------|---------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 内 | 株 式 先 物 取 引 | 百万円 49,971 | 百万円 48,975 | 百万円 - | 百万円 - |

※金額は受渡し代金。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

(1) 利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|-------------|--------------------|--------|---|--------------------|--------|---|
| | うち利害関係人 との取引状況B | B A | % | うち利害関係人 との取引状況D | D C | % |
| 株 式 | 百万円 6,507 | 33.9 | | 百万円 8,618 | 42.2 | |
| 株 式 先 物 取 引 | 49,971 | 94.6 | | 48,975 | 94.5 | |

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|-----------|--------------|
| 株 式 | 百万円 114 | 百万円 97 | 百万円 1,842 |

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額 | 5,504千円 |
| (b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 | 4,651千円 |
| (c) (b)／(a) | 84.5% |

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社、株式会社三井住友フィナンシャルグループです。

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

（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 組入れ資産の明細（2021年11月30日現在）

(1) 国内株式

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | |
|----------------------|---------|---------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| 日本通信 | 39.5 | — | — | |
| 日本電信電話 | 948.9 | 836.5 | 2,614,062 | |
| KDDI | 517.3 | 521.6 | 1,721,280 | |
| ソフトバンク | 645 | 1,083.9 | 1,693,593 | |
| 光通信 | 7.3 | 8.4 | 138,264 | |
| NTTドコモ | 144.7 | — | — | |
| エムティーアイ | 10.3 | 10.4 | 6,073 | |
| GMOインターネット | 26 | 25.7 | 73,450 | |
| ファイバーゲート | — | 3.4 | 3,668 | |
| KADOKAWA | 19.6 | 21 | 126,420 | |
| 学研ホールディングス | 9.9 | 11.1 | 10,855 | |
| ゼンリン | 15.1 | 13.6 | 12,716 | |
| アイネット | 5.2 | 5.8 | 7,540 | |
| 松竹 | 4.8 | 4.9 | 53,704 | |
| 東宝 | 41.9 | 42.2 | 213,110 | |
| 東映 | 2.6 | 2.3 | 42,780 | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 188.9 | 190 | 454,860 | |
| ピー・シー・エー | 1.6 | 4.9 | 7,168 | |
| ビジネスブレイン太田昭和 | — | 3.3 | 6,481 | |
| DTS | 15.5 | 13.1 | 31,007 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 30.5 | 33.3 | 197,469 | |
| シーイーシー | 8.2 | 8.8 | 10,929 | |
| カブコン | 33.7 | 67.4 | 190,674 | |
| アイ・エス・ビー | — | 4.7 | 4,761 | |
| ジャステック | 6.1 | 5.9 | 6,006 | |
| SCSK | 16.5 | 49.6 | 106,888 | |
| 日本システムウエア | 3.1 | 3.3 | 7,101 | |
| アイネス | 8.1 | 7.6 | 10,564 | |
| TKC | 5.9 | 11.9 | 39,151 | |
| 富士ソフト | 7.6 | 7.6 | 40,128 | |
| NSD | 23.2 | 22.8 | 48,267 | |
| コナミホールディングス | 25.9 | 26.1 | 151,641 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 3.3 | 3.7 | 14,134 | |
| JBCホールディングス | 6.2 | 5.9 | 10,401 | |
| ミロク情報サービス | 7 | 7.6 | 11,126 | |
| ソフトバンクグループ | 563.2 | 429.1 | 2,587,473 | |
| 卸売業（5.1%） | | | | |
| 伊藤忠食品 | 2.1 | 2 | 9,810 | |
| エレマテック | 8.6 | 7 | 7,063 | |
| JALUX | 3.5 | — | — | |
| あらた | 5.6 | 5.6 | 21,560 | |
| トーマンデバイス | — | 1.2 | 8,064 | |
| 東京エレクトロニクス デバイス | 3.4 | 2.1 | 14,217 | |
| フィールズ | 11.1 | 10 | 5,320 | |
| 双日 | 393.1 | 78.9 | 126,713 | |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | |
|---------------------------------|---------|-------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| コスモス薬品 | 6.3 | 7.2 | 126,792 | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 278.8 | 280.9 | 1,279,218 | |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 40.3 | 38.8 | 26,384 | |
| ツルハホールディングス | 15.5 | 15.6 | 199,680 | |
| サンマルクホールディングス | 6.3 | 7.7 | 10,841 | |
| トリドールホールディングス | 18.1 | 17.7 | 42,851 | |
| TOKYO BASE | 9.8 | 8.3 | 5,552 | |
| JMホールディングス | 5.7 | 5.6 | 9,643 | |
| アレンザホールディングス | — | 6.4 | 6,534 | |
| 串カツ田中ホールディングス | — | 2.5 | 4,832 | |
| パロックジャパンリミテッド | 8.4 | 7.7 | 6,344 | |
| クスリのアオキホールディングス | 6.4 | 7.2 | 51,768 | |
| 力の源ホールディングス | 4.5 | — | — | |
| FOOD & LIFE COMPANIES | 39.3 | 42 | 202,650 | |
| メディカルシステムネットワーク | 9.8 | 8.6 | 5,332 | |
| ノジマ | 12.8 | 11.5 | 25,587 | |
| カッパ・クリエイト | 10.8 | 11.3 | 14,995 | |
| 良品計画 | 95 | 82.7 | 151,754 | |
| アドヴァングループ | 11.5 | 9.4 | 8,300 | |
| アルビス | 3.6 | 3.3 | 6,976 | |
| コナカ | 18.7 | — | — | |
| G-7ホールディングス | 4.5 | 8.1 | 13,397 | |
| イオン北海道 | 12.1 | 13.2 | 17,608 | |
| コジマ | 14.6 | 13.4 | 7,450 | |
| コーナン商事 | 10.3 | 10.3 | 34,196 | |
| エコス | 3.2 | 3.3 | 5,768 | |
| ワタミ | 10.1 | 10.4 | 8,840 | |
| パン・パシフィック・インター ナショナルホールディングス | 156.8 | 143.5 | 277,816 | |
| 西松屋チェーン | 16.4 | 15.7 | 23,502 | |
| ゼンショーホールディングス | 34.3 | 35.4 | 91,367 | |
| 幸楽苑ホールディングス | 6.1 | 6.8 | 9,608 | |
| サイゼリヤ | 10.8 | 10.9 | 31,893 | |
| V Tホールディングス | 33.2 | 27.9 | 11,745 | |
| フジ・コーポレーション | 3 | 5.6 | 6,518 | |
| ユナイテッドアローズ | 8.2 | 7.8 | 14,843 | |
| ハイデイ日高 | 9.7 | 10.3 | 16,181 | |
| コロワイド | 22 | 30.2 | 45,964 | |
| ピーシーデポコーポレーション | 12.8 | — | — | |
| 壱番屋 | 5 | 5.2 | 23,062 | |
| スギホールディングス | 14.3 | 14.4 | 102,816 | |
| 薬王堂ホールディングス | 3.6 | 3.9 | 8,338 | |
| スクロール | 14.3 | 11.9 | 9,127 | |
| ヨンドシーホールディングス | 7.5 | 7.6 | 12,122 | |
| 木曽路 | 8.7 | 10 | 20,880 | |

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄 | 期首(前期末) 株数 | 期 | | 末 評価額 |
|--------------|---------------|----------|----------|-------------|
| | | 株数 | 評価額 | |
| 船井総研ホールディングス | 14.7 | 14.4 | 36,849 | |
| オオバ | 8.2 | 8.1 | 6,156 | |
| ベネッセホールディングス | 23.7 | 23.8 | 52,336 | |
| イオンディライト | 8.1 | 8.5 | 30,132 | |
| ナック | 6 | — | — | |
| ダイセキ | 11.8 | 12.8 | 66,048 | |
| 合計 | 千株 | 千株 | 千円 | |
| | 株数・金額 | 75,624.8 | 78,890.9 | 192,569,963 |
| | 銘柄数<比率> | 1,648銘柄 | 1,659銘柄 | <97.7%> |

※銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

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

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

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

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月30日現在)

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

※当期における期首元本額62,877,618,349円、期中追加設定元本額10,732,324,295円、期中一部解約元本額12,436,673,517円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2020年12月1日 至2021年11月30日)

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

※有価証券売買損益および先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

| | | | |
|---------------------------------|-----------------|---|----------------|
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,444,432,886円 | SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定> | 108,824,691円 |
| 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） | 893,111,379円 | SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 1,852,669,865円 |
| 三井住友・DC年金バランス50（標準型） | 4,314,610,252円 | SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 1,648,623,694円 |
| 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） | 3,302,572,824円 | SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 6,291,332,987円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 123,293,850円 | SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 41,040,556円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ） | 4,679,600円 | SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 166,358,728円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ） | 20,378,358円 | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 748,263,991円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ） | 62,968,056円 | SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 46,344,355円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ） | 145,617,764円 | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 259,277,705円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ） | 123,379,159円 | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 856,981,897円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ） | 223,865,395円 | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 603,670,244円 |
| 国内株式指数ファンド（TOPIX） | 1,383,108,545円 | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 1,898,722,676円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド | 18,142,394,620円 | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 374,931円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 277,082,196円 | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 42,261,700円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 326,588,940円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 47,434,130円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 215,307,143円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 34,163,089円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 14,508,106円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 16,669,461円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 29,487,863円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 115,063,306円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） | 154,290,540円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 248,882,682円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） | 142,287,008円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 61,933,489円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） | 489,286,600円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 39,574,438円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） | 261,074,601円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 7,375,595円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型） | 295,921,518円 | SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 45,508,490円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 33,623,909円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 613,464,436円 |
| 三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド | 440,586,720円 | SMAM・国内株式インデックスファンド・VA（適格機関投資家専用） | 180,359,966円 |
| 三井住友DS・年金バランス30（債券重点型） | 14,302,327円 | SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定> | 237,022,466円 |
| 三井住友DS・年金バランス50（標準型） | 71,078,321円 | SMAM・グローバルバランスファンド（債券重視型）VA<適格機関投資家限定> | 110,132,461円 |
| 三井住友DS・年金バランス70（株式重点型） | 69,299,615円 | SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 259,324,316円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 4,018,342円 | SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 64,476,018円 |
| 日興FWS・日本株インデックス | 300,009,523円 | SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 37,709,634円 |
| 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド | 1,878,586円 | SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 55,155,389円 |
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 2,839,797,359円 | SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 59,877,017円 |
| バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定> | 12,523,734円 | SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定> | 197,029,085円 |

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

第16期（2020年5月26日から2021年5月25日まで）

| | |
|------|--|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2005年6月10日） |
| 運用方針 | 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象として、NOMURA-BPI（総合）と連動する投資成果を目指して運用を行います。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | (ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合) | | 債券組入 比 | 純資産 総額 |
|------------------|-----------|------|-----------------------------|------|-----------|-----------|
| | 期中 騰落率 | 騰落率 | 期中 騰落率 | 騰落率 | | |
| 12期 (2017年5月25日) | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 12期 (2017年5月25日) | 12,530 | △1.9 | 379.26 | △1.9 | 99.0 | 229,268 |
| 13期 (2018年5月25日) | 12,628 | 0.8 | 382.10 | 0.8 | 99.4 | 206,843 |
| 14期 (2019年5月27日) | 12,860 | 1.8 | 388.97 | 1.8 | 98.7 | 165,548 |
| 15期 (2020年5月25日) | 12,846 | △0.1 | 388.47 | △0.1 | 99.7 | 137,939 |
| 16期 (2021年5月25日) | 12,790 | △0.4 | 386.73 | △0.4 | 99.4 | 130,401 |

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

■当期中の基準価額と市況等の推移

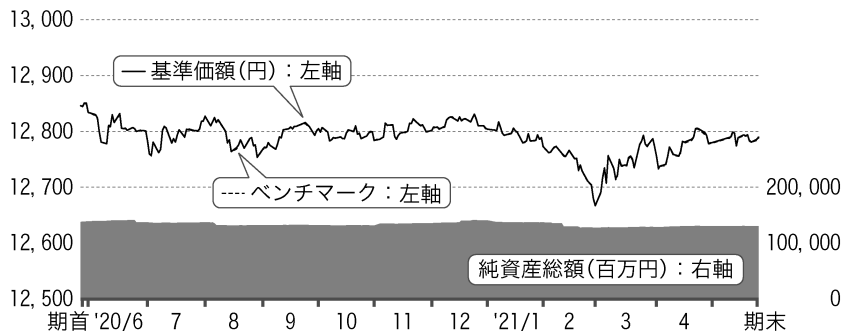
| 年月日 | 基準価額 | | (ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合) | | 債券組入 比 |
|--------------------|--------|------|-----------------------------|------|-----------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | |
| (期首) 2020年5月25日 | 円 | % | | % | % |
| 5月末 | 12,846 | — | 388.47 | — | 99.7 |
| 6月末 | 12,834 | △0.1 | 388.13 | △0.1 | 99.6 |
| 7月末 | 12,783 | △0.5 | 386.56 | △0.5 | 99.6 |
| 8月末 | 12,827 | △0.1 | 387.91 | △0.1 | 99.4 |
| 9月末 | 12,768 | △0.6 | 386.09 | △0.6 | 99.4 |
| 10月末 | 12,805 | △0.3 | 387.22 | △0.3 | 99.7 |
| 11月末 | 12,784 | △0.5 | 386.63 | △0.5 | 99.7 |
| 12月末 | 12,802 | △0.3 | 387.12 | △0.3 | 99.5 |
| 2021年1月末 | 12,804 | △0.3 | 387.20 | △0.3 | 97.4 |
| 2月末 | 12,773 | △0.6 | 386.25 | △0.6 | 99.5 |
| 3月末 | 12,667 | △1.4 | 383.06 | △1.4 | 99.4 |
| 4月末 | 12,756 | △0.7 | 385.72 | △0.7 | 99.5 |
| (期末) 2021年5月25日 | 12,780 | △0.5 | 386.44 | △0.5 | 99.5 |
| | 12,790 | △0.4 | 386.73 | △0.4 | 99.4 |

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について (2020年5月26日から2021年5月25日まで)

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 12,846円 |
| 期末 | 12,790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、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証券株式会社およびその許諾者は、NOMURA-BPI（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村証券株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因 (2020年5月26日から2021年5月25日まで)

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

下落要因

- ・新型コロナウイルス対策のための財政政策が大規模化したことに伴い、国債増発による需給悪化を警戒して超長期ゾーン中心に金利が上昇（債券価格は下落）したこと
- ・日銀が金融政策の点検において金利の変動幅拡大を検討しているとの観測報道を受けて、警戒感が強まる中で金利が上昇したこと

▶ 投資環境について (2020年5月26日から2021年5月25日まで)

日本の長期金利の代表である10年国債利回りは上昇しました。

新型コロナウイルス感染症の拡大が続く中、景気対策のための財政政策の拡大に伴う国債増発リスクが意識され、長期金利は期初からプラス圏で推移しました。日銀のイールドカーブコントロール（長短金利操作）により、長期金利の上昇は抑制される状況がしばらく続きましたが、12月に日銀は2%の物価目標を実現するためのより効果的で持続的な金融緩和の点検を行い、3月会合を目的に結果を公表することを決定しました。2021年1月から3月初めにかけては、大規模な経済対策への警戒感から米国長期金利が上昇基調で推移したことや、日銀が長期金利の許容変動幅の拡大を検討しているとの報道から、3月に発表される金融政策の点検結果への警戒感が強まり、長期金利は上昇しました。3月に日銀が政策点検の結果を発表すると、金利上昇を強く促す内容ではなかったことから、その後期末にかけては、長期金利は上昇幅を縮小する展開となりました。

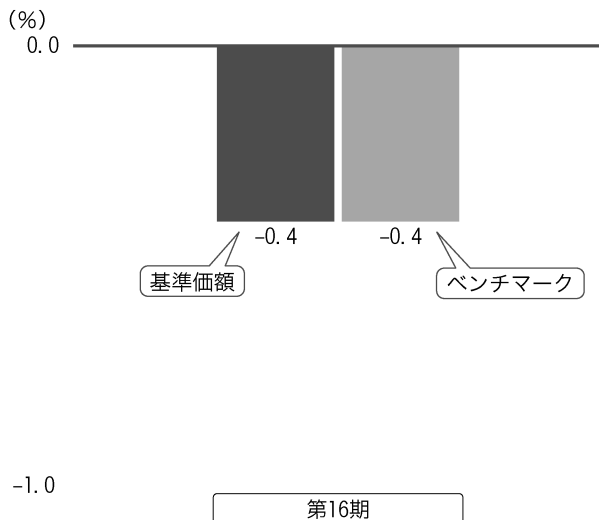
当期の市場の動きを10年国債利回りでみると、期首+0.002%から期末+0.078%へと上昇しました。

▶ ポートフォリオについて (2020年5月26日から2021年5月25日まで)

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

▶ ベンチマークとの差異について (2020年5月26日から2021年5月25日まで)

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



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

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は-0.4%となり、ベンチマークの騰落率-0.4%に連動した運用成果となりました。

2 今後の運用方針

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細(2020年5月26日から2021年5月25日まで)

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

期中の平均基準価額は12,781円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2020年5月26日から2021年5月25日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|---------------------|------------|--------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 38,643,903 | 41,878,430 |
| | 地方債証券 | 824,238 | 101,705 (603,500) |
| | 特殊債証券 | 2,455,335 | 2,012,483 (1,764,520) |
| | 社債証券 (投資法人債券を含む) | 2,400,006 | 2,934,628 (900,000) |

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

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

■ 利害関係人との取引状況等(2020年5月26日から2021年5月25日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 百万円 44,323 | 百万円 2,918 | % 6.6 | 百万円 46,927 | 百万円 597 | % 1.3 |

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種類 | 買付額 | 売付額 | 期末保有額 |
|-----|----------|----------|------------|
| 公社債 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 201 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額 |
|-------|--------------|
| 公 社 債 | 百万円 2,300 |

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社三井住友銀行、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年5月26日から2021年5月25日まで)

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

■ 組入れ資産の明細(2021年5月25日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

| 区 分 | 期 | | | | 末 | | |
|--------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------|--------------------|----------------|---------------|---------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組入比率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国 債 証 券 | 97,072,000 (13,635,000) | 105,560,274 (14,799,494) | 81.0 (11.3) | — (—) | 55.1 (6.9) | 20.3 (3.5) | 5.5 (1.0) |
| 地 方 債 証 券 | 7,997,000 (7,997,000) | 8,543,428 (8,543,428) | 6.6 (6.6) | — (—) | 2.6 (2.6) | 1.6 (1.6) | 2.4 (2.4) |
| 特 殊 債 券 (除 く 金 融 債) | 10,447,999 (10,447,999) | 11,257,155 (11,257,155) | 8.6 (8.6) | — (—) | 5.1 (5.1) | 1.7 (1.7) | 1.9 (1.9) |
| 金 融 債 券 | 300,000 (300,000) | 300,336 (300,336) | 0.2 (0.2) | — (—) | — (—) | — (—) | 0.2 (0.2) |
| 普 通 社 債 券 (含む投資法人債券) | 3,800,000 (3,600,000) | 3,948,489 (3,746,209) | 3.0 (2.9) | — (—) | 1.7 (1.6) | 1.2 (1.2) | 0.1 (0.1) |
| 合 計 | 119,616,999 (35,979,999) | 129,609,682 (38,646,622) | 99.4 (29.6) | — (—) | 64.5 (16.2) | 24.8 (7.9) | 10.1 (5.5) |

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

国内債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示
国内(邦貨建)公社債

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|---------|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 国 債 証 券 | 第419回 利付国債(2年) | 0.1 | 1,960,000 | 1,967,154 | 2022/12/1 |
| | 第420回 利付国債(2年) | 0.1 | 510,000 | 511,922 | 2023/1/1 |
| | 第421回 利付国債(2年) | 0.1 | 390,000 | 391,548 | 2023/2/1 |
| | 第422回 利付国債(2年) | 0.1 | 390,000 | 391,688 | 2023/3/1 |
| | 第423回 利付国債(2年) | 0.005 | 210,000 | 210,543 | 2023/4/1 |
| | 第424回 利付国債(2年) | 0.005 | 400,000 | 401,044 | 2023/5/1 |
| | 第133回 利付国債(5年) | 0.1 | 48,000 | 48,142 | 2022/9/20 |
| | 第134回 利付国債(5年) | 0.1 | 110,000 | 110,397 | 2022/12/20 |
| | 第135回 利付国債(5年) | 0.1 | 190,000 | 190,811 | 2023/3/20 |
| | 第136回 利付国債(5年) | 0.1 | 500,000 | 502,435 | 2023/6/20 |
| | 第137回 利付国債(5年) | 0.1 | 100,000 | 100,547 | 2023/9/20 |
| | 第138回 利付国債(5年) | 0.1 | 600,000 | 603,636 | 2023/12/20 |
| | 第139回 利付国債(5年) | 0.1 | 260,000 | 261,726 | 2024/3/20 |
| | 第140回 利付国債(5年) | 0.1 | 600,000 | 604,248 | 2024/6/20 |
| | 第141回 利付国債(5年) | 0.1 | 15,000 | 15,112 | 2024/9/20 |
| | 第142回 利付国債(5年) | 0.1 | 680,000 | 685,480 | 2024/12/20 |
| | 第143回 利付国債(5年) | 0.1 | 770,000 | 776,637 | 2025/3/20 |
| | 第144回 利付国債(5年) | 0.1 | 1,250,000 | 1,261,237 | 2025/6/20 |
| | 第145回 利付国債(5年) | 0.1 | 1,310,000 | 1,322,510 | 2025/9/20 |
| | 第146回 利付国債(5年) | 0.1 | 1,740,000 | 1,756,773 | 2025/12/20 |
| | 第147回 利付国債(5年) | 0.005 | 340,000 | 341,727 | 2026/3/20 |
| | 第1回 利付国債(40年) | 2.4 | 40,000 | 57,766 | 2048/3/20 |
| | 第2回 利付国債(40年) | 2.2 | 242,000 | 338,739 | 2049/3/20 |
| | 第3回 利付国債(40年) | 2.2 | 185,000 | 259,958 | 2050/3/20 |
| | 第4回 利付国債(40年) | 2.2 | 247,000 | 348,714 | 2051/3/20 |
| | 第5回 利付国債(40年) | 2.0 | 225,000 | 307,323 | 2052/3/20 |
| | 第6回 利付国債(40年) | 1.9 | 240,000 | 322,922 | 2053/3/20 |
| | 第7回 利付国債(40年) | 1.7 | 255,000 | 330,094 | 2054/3/20 |
| | 第8回 利付国債(40年) | 1.4 | 300,000 | 363,888 | 2055/3/20 |
| | 第9回 利付国債(40年) | 0.4 | 483,000 | 439,360 | 2056/3/20 |
| | 第10回 利付国債(40年) | 0.9 | 470,000 | 500,498 | 2057/3/20 |
| | 第11回 利付国債(40年) | 0.8 | 330,000 | 341,157 | 2058/3/20 |
| | 第12回 利付国債(40年) | 0.5 | 380,000 | 355,148 | 2059/3/20 |
| | 第13回 利付国債(40年) | 0.5 | 465,000 | 433,305 | 2060/3/20 |
| | 第326回 利付国債(10年) | 0.7 | 77,000 | 77,998 | 2022/12/20 |
| | 第327回 利付国債(10年) | 0.8 | 25,000 | 25,363 | 2022/12/20 |
| | 第328回 利付国債(10年) | 0.6 | 130,000 | 131,727 | 2023/3/20 |
| | 第329回 利付国債(10年) | 0.8 | 2,030,000 | 2,069,361 | 2023/6/20 |
| | 第330回 利付国債(10年) | 0.8 | 1,285,000 | 1,312,961 | 2023/9/20 |
| | 第332回 利付国債(10年) | 0.6 | 793,000 | 807,924 | 2023/12/20 |
| | 第333回 利付国債(10年) | 0.6 | 815,000 | 831,927 | 2024/3/20 |
| | 第334回 利付国債(10年) | 0.6 | 315,000 | 322,081 | 2024/6/20 |
| | 第335回 利付国債(10年) | 0.5 | 50,000 | 51,041 | 2024/9/20 |
| | 第336回 利付国債(10年) | 0.5 | 340,000 | 347,619 | 2024/12/20 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-----------------|-----|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第337回 利付国債(10年) | 0.3 | 120,000 | 121,827 | 2024/12/20 |
| | 第338回 利付国債(10年) | 0.4 | 805,000 | 821,204 | 2025/3/20 |
| | 第339回 利付国債(10年) | 0.4 | 785,000 | 801,681 | 2025/6/20 |
| | 第340回 利付国債(10年) | 0.4 | 770,000 | 787,386 | 2025/9/20 |
| | 第341回 利付国債(10年) | 0.3 | 557,000 | 567,616 | 2025/12/20 |
| | 第342回 利付国債(10年) | 0.1 | 350,000 | 353,384 | 2026/3/20 |
| | 第343回 利付国債(10年) | 0.1 | 310,000 | 313,078 | 2026/6/20 |
| | 第344回 利付国債(10年) | 0.1 | 811,000 | 819,231 | 2026/9/20 |
| | 第345回 利付国債(10年) | 0.1 | 818,000 | 826,466 | 2026/12/20 |
| | 第346回 利付国債(10年) | 0.1 | 710,000 | 717,462 | 2027/3/20 |
| | 第347回 利付国債(10年) | 0.1 | 540,000 | 545,756 | 2027/6/20 |
| | 第348回 利付国債(10年) | 0.1 | 345,000 | 348,722 | 2027/9/20 |
| | 第349回 利付国債(10年) | 0.1 | 250,000 | 252,720 | 2027/12/20 |
| | 第350回 利付国債(10年) | 0.1 | 590,000 | 596,460 | 2028/3/20 |
| | 第351回 利付国債(10年) | 0.1 | 290,000 | 293,085 | 2028/6/20 |
| | 第352回 利付国債(10年) | 0.1 | 790,000 | 798,113 | 2028/9/20 |
| | 第353回 利付国債(10年) | 0.1 | 640,000 | 646,310 | 2028/12/20 |
| | 第354回 利付国債(10年) | 0.1 | 845,000 | 852,934 | 2029/3/20 |
| | 第355回 利付国債(10年) | 0.1 | 870,000 | 877,725 | 2029/6/20 |
| | 第356回 利付国債(10年) | 0.1 | 850,000 | 857,072 | 2029/9/20 |
| | 第357回 利付国債(10年) | 0.1 | 390,000 | 393,003 | 2029/12/20 |
| | 第358回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,100,000 | 1,107,744 | 2030/3/20 |
| | 第359回 利付国債(10年) | 0.1 | 780,000 | 784,578 | 2030/6/20 |
| | 第360回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,700,000 | 1,708,670 | 2030/9/20 |
| | 第361回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,020,000 | 1,023,876 | 2030/12/20 |
| | 第362回 利付国債(10年) | 0.1 | 340,000 | 340,992 | 2031/3/20 |
| | 第2回 利付国債(30年) | 2.4 | 510,000 | 616,161 | 2030/2/20 |
| | 第4回 利付国債(30年) | 2.9 | 340,000 | 431,704 | 2030/11/20 |
| | 第5回 利付国債(30年) | 2.2 | 290,000 | 351,413 | 2031/5/20 |
| | 第7回 利付国債(30年) | 2.3 | 474,000 | 587,290 | 2032/5/20 |
| | 第9回 利付国債(30年) | 1.4 | 120,000 | 137,449 | 2032/12/20 |
| | 第10回 利付国債(30年) | 1.1 | 555,000 | 616,932 | 2033/3/20 |
| | 第11回 利付国債(30年) | 1.7 | 430,000 | 509,304 | 2033/6/20 |
| | 第12回 利付国債(30年) | 2.1 | 590,000 | 729,175 | 2033/9/20 |
| | 第14回 利付国債(30年) | 2.4 | 692,000 | 886,112 | 2034/3/20 |
| | 第16回 利付国債(30年) | 2.5 | 465,000 | 605,337 | 2034/9/20 |
| | 第18回 利付国債(30年) | 2.3 | 450,000 | 577,053 | 2035/3/20 |
| | 第19回 利付国債(30年) | 2.3 | 470,000 | 604,227 | 2035/6/20 |
| | 第21回 利付国債(30年) | 2.3 | 345,000 | 445,988 | 2035/12/20 |
| | 第22回 利付国債(30年) | 2.5 | 315,000 | 417,450 | 2036/3/20 |
| | 第23回 利付国債(30年) | 2.5 | 329,000 | 437,129 | 2036/6/20 |
| | 第24回 利付国債(30年) | 2.5 | 310,000 | 412,916 | 2036/9/20 |
| | 第25回 利付国債(30年) | 2.3 | 300,000 | 391,578 | 2036/12/20 |
| | 第26回 利付国債(30年) | 2.4 | 363,000 | 480,644 | 2037/3/20 |
| | 第27回 利付国債(30年) | 2.5 | 440,000 | 592,451 | 2037/9/20 |
| | 第28回 利付国債(30年) | 2.5 | 386,000 | 521,945 | 2038/3/20 |
| | 第29回 利付国債(30年) | 2.4 | 177,000 | 237,417 | 2038/9/20 |
| | 第30回 利付国債(30年) | 2.3 | 452,000 | 601,327 | 2039/3/20 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-----------------|-----|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償還年月日 |
| | 第31回 利付国債 (30年) | 2.2 | 315,000 | 414,971 | 2039/9/20 |
| | 第32回 利付国債 (30年) | 2.3 | 390,000 | 522,869 | 2040/3/20 |
| | 第33回 利付国債 (30年) | 2.0 | 378,000 | 488,217 | 2040/9/20 |
| | 第34回 利付国債 (30年) | 2.2 | 457,000 | 609,153 | 2041/3/20 |
| | 第35回 利付国債 (30年) | 2.0 | 350,000 | 454,811 | 2041/9/20 |
| | 第36回 利付国債 (30年) | 2.0 | 60,000 | 78,222 | 2042/3/20 |
| | 第37回 利付国債 (30年) | 1.9 | 355,000 | 457,364 | 2042/9/20 |
| | 第38回 利付国債 (30年) | 1.8 | 360,000 | 457,455 | 2043/3/20 |
| | 第39回 利付国債 (30年) | 1.9 | 190,000 | 245,799 | 2043/6/20 |
| | 第40回 利付国債 (30年) | 1.8 | 270,000 | 343,931 | 2043/9/20 |
| | 第41回 利付国債 (30年) | 1.7 | 270,000 | 338,801 | 2043/12/20 |
| | 第42回 利付国債 (30年) | 1.7 | 260,000 | 326,570 | 2044/3/20 |
| | 第43回 利付国債 (30年) | 1.7 | 305,000 | 383,473 | 2044/6/20 |
| | 第44回 利付国債 (30年) | 1.7 | 300,000 | 377,550 | 2044/9/20 |
| | 第45回 利付国債 (30年) | 1.5 | 345,000 | 419,509 | 2044/12/20 |
| | 第46回 利付国債 (30年) | 1.5 | 295,000 | 358,926 | 2045/3/20 |
| | 第47回 利付国債 (30年) | 1.6 | 280,000 | 347,286 | 2045/6/20 |
| | 第48回 利付国債 (30年) | 1.4 | 345,000 | 412,326 | 2045/9/20 |
| | 第49回 利付国債 (30年) | 1.4 | 345,000 | 412,488 | 2045/12/20 |
| | 第50回 利付国債 (30年) | 0.8 | 335,000 | 354,058 | 2046/3/20 |
| | 第51回 利付国債 (30年) | 0.3 | 345,000 | 324,210 | 2046/6/20 |
| | 第52回 利付国債 (30年) | 0.5 | 353,000 | 347,532 | 2046/9/20 |
| | 第53回 利付国債 (30年) | 0.6 | 247,000 | 248,652 | 2046/12/20 |
| | 第54回 利付国債 (30年) | 0.8 | 45,000 | 47,382 | 2047/3/20 |
| | 第55回 利付国債 (30年) | 0.8 | 335,000 | 352,487 | 2047/6/20 |
| | 第56回 利付国債 (30年) | 0.8 | 320,000 | 336,073 | 2047/9/20 |
| | 第57回 利付国債 (30年) | 0.8 | 355,000 | 372,551 | 2047/12/20 |
| | 第58回 利付国債 (30年) | 0.8 | 350,000 | 367,017 | 2048/3/20 |
| | 第59回 利付国債 (30年) | 0.7 | 400,000 | 409,312 | 2048/6/20 |
| | 第60回 利付国債 (30年) | 0.9 | 400,000 | 428,668 | 2048/9/20 |
| | 第61回 利付国債 (30年) | 0.7 | 345,000 | 351,910 | 2048/12/20 |
| | 第62回 利付国債 (30年) | 0.5 | 105,000 | 101,528 | 2049/3/20 |
| | 第63回 利付国債 (30年) | 0.4 | 380,000 | 357,025 | 2049/6/20 |
| | 第64回 利付国債 (30年) | 0.4 | 245,000 | 229,525 | 2049/9/20 |
| | 第65回 利付国債 (30年) | 0.4 | 355,000 | 332,013 | 2049/12/20 |
| | 第66回 利付国債 (30年) | 0.4 | 260,000 | 242,749 | 2050/3/20 |
| | 第67回 利付国債 (30年) | 0.6 | 310,000 | 305,089 | 2050/6/20 |
| | 第68回 利付国債 (30年) | 0.6 | 400,000 | 393,136 | 2050/9/20 |
| | 第69回 利付国債 (30年) | 0.7 | 350,000 | 353,024 | 2050/12/20 |
| | 第70回 利付国債 (30年) | 0.7 | 70,000 | 70,521 | 2051/3/20 |
| | 第59回 利付国債 (20年) | 1.7 | 1,455,000 | 1,496,758 | 2022/12/20 |
| | 第61回 利付国債 (20年) | 1.0 | 1,215,000 | 1,239,992 | 2023/3/20 |
| | 第64回 利付国債 (20年) | 1.9 | 1,025,000 | 1,073,421 | 2023/9/20 |
| | 第65回 利付国債 (20年) | 1.9 | 1,020,000 | 1,073,244 | 2023/12/20 |
| | 第69回 利付国債 (20年) | 2.1 | 1,020,000 | 1,084,137 | 2024/3/20 |
| | 第70回 利付国債 (20年) | 2.4 | 780,000 | 840,660 | 2024/6/20 |
| | 第72回 利付国債 (20年) | 2.1 | 753,000 | 808,729 | 2024/9/20 |
| | 第74回 利付国債 (20年) | 2.1 | 664,000 | 716,847 | 2024/12/20 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-----------------|-----|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第75回 利付国債(20年) | 2.1 | 490,000 | 531,703 | 2025/3/20 |
| | 第78回 利付国債(20年) | 1.9 | 590,000 | 638,592 | 2025/6/20 |
| | 第82回 利付国債(20年) | 2.1 | 620,000 | 679,625 | 2025/9/20 |
| | 第84回 利付国債(20年) | 2.0 | 850,000 | 932,373 | 2025/12/20 |
| | 第85回 利付国債(20年) | 2.1 | 645,000 | 713,499 | 2026/3/20 |
| | 第88回 利付国債(20年) | 2.3 | 742,000 | 832,501 | 2026/6/20 |
| | 第89回 利付国債(20年) | 2.2 | 20,000 | 22,337 | 2026/6/20 |
| | 第90回 利付国債(20年) | 2.2 | 580,000 | 651,003 | 2026/9/20 |
| | 第92回 利付国債(20年) | 2.1 | 734,000 | 823,753 | 2026/12/20 |
| | 第93回 利付国債(20年) | 2.0 | 632,000 | 708,813 | 2027/3/20 |
| | 第95回 利付国債(20年) | 2.3 | 305,000 | 349,157 | 2027/6/20 |
| | 第97回 利付国債(20年) | 2.2 | 677,000 | 774,562 | 2027/9/20 |
| | 第99回 利付国債(20年) | 2.1 | 693,000 | 791,988 | 2027/12/20 |
| | 第100回 利付国債(20年) | 2.2 | 207,000 | 239,018 | 2028/3/20 |
| | 第101回 利付国債(20年) | 2.4 | 355,000 | 414,771 | 2028/3/20 |
| | 第102回 利付国債(20年) | 2.4 | 457,000 | 536,422 | 2028/6/20 |
| | 第105回 利付国債(20年) | 2.1 | 390,000 | 451,272 | 2028/9/20 |
| | 第106回 利付国債(20年) | 2.2 | 370,000 | 430,850 | 2028/9/20 |
| | 第107回 利付国債(20年) | 2.1 | 378,000 | 439,084 | 2028/12/20 |
| | 第108回 利付国債(20年) | 1.9 | 390,000 | 447,107 | 2028/12/20 |
| | 第109回 利付国債(20年) | 1.9 | 340,000 | 391,105 | 2029/3/20 |
| | 第111回 利付国債(20年) | 2.2 | 386,000 | 454,881 | 2029/6/20 |
| | 第113回 利付国債(20年) | 2.1 | 427,000 | 501,609 | 2029/9/20 |
| | 第114回 利付国債(20年) | 2.1 | 363,000 | 427,958 | 2029/12/20 |
| | 第116回 利付国債(20年) | 2.2 | 200,000 | 238,372 | 2030/3/20 |
| | 第118回 利付国債(20年) | 2.0 | 200,000 | 235,632 | 2030/6/20 |
| | 第119回 利付国債(20年) | 1.8 | 295,000 | 342,220 | 2030/6/20 |
| | 第120回 利付国債(20年) | 1.6 | 200,000 | 228,396 | 2030/6/20 |
| | 第121回 利付国債(20年) | 1.9 | 255,000 | 299,041 | 2030/9/20 |
| | 第122回 利付国債(20年) | 1.8 | 330,000 | 383,931 | 2030/9/20 |
| | 第123回 利付国債(20年) | 2.1 | 80,000 | 95,573 | 2030/12/20 |
| | 第124回 利付国債(20年) | 2.0 | 190,000 | 225,178 | 2030/12/20 |
| | 第125回 利付国債(20年) | 2.2 | 205,000 | 247,691 | 2031/3/20 |
| | 第126回 利付国債(20年) | 2.0 | 180,000 | 213,973 | 2031/3/20 |
| | 第127回 利付国債(20年) | 1.9 | 145,000 | 170,952 | 2031/3/20 |
| | 第128回 利付国債(20年) | 1.9 | 215,000 | 254,209 | 2031/6/20 |
| | 第129回 利付国債(20年) | 1.8 | 190,000 | 222,750 | 2031/6/20 |
| | 第130回 利付国債(20年) | 1.8 | 155,000 | 182,194 | 2031/9/20 |
| | 第131回 利付国債(20年) | 1.7 | 380,000 | 442,783 | 2031/9/20 |
| | 第132回 利付国債(20年) | 1.7 | 450,000 | 525,856 | 2031/12/20 |
| | 第133回 利付国債(20年) | 1.8 | 190,000 | 224,017 | 2031/12/20 |
| | 第134回 利付国債(20年) | 1.8 | 200,000 | 236,382 | 2032/3/20 |
| | 第135回 利付国債(20年) | 1.7 | 155,000 | 181,537 | 2032/3/20 |
| | 第136回 利付国債(20年) | 1.6 | 120,000 | 139,261 | 2032/3/20 |
| | 第137回 利付国債(20年) | 1.7 | 25,000 | 29,346 | 2032/6/20 |
| | 第139回 利付国債(20年) | 1.6 | 20,000 | 23,258 | 2032/6/20 |
| | 第140回 利付国債(20年) | 1.7 | 500,000 | 588,560 | 2032/9/20 |
| | 第141回 利付国債(20年) | 1.7 | 230,000 | 271,312 | 2032/12/20 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-------|-----------------------|-------|------------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第142回 利付国債(20年) | 1.8 | 110,000 | 131,013 | 2032/12/20 |
| | 第143回 利付国債(20年) | 1.6 | 190,000 | 222,374 | 2033/3/20 |
| | 第144回 利付国債(20年) | 1.5 | 90,000 | 104,288 | 2033/3/20 |
| | 第145回 利付国債(20年) | 1.7 | 110,000 | 130,287 | 2033/6/20 |
| | 第146回 利付国債(20年) | 1.7 | 105,000 | 124,611 | 2033/9/20 |
| | 第147回 利付国債(20年) | 1.6 | 220,000 | 258,876 | 2033/12/20 |
| | 第148回 利付国債(20年) | 1.5 | 59,000 | 68,842 | 2034/3/20 |
| | 第149回 利付国債(20年) | 1.5 | 695,000 | 812,128 | 2034/6/20 |
| | 第150回 利付国債(20年) | 1.4 | 261,000 | 302,029 | 2034/9/20 |
| | 第151回 利付国債(20年) | 1.2 | 770,000 | 871,724 | 2034/12/20 |
| | 第152回 利付国債(20年) | 1.2 | 265,000 | 300,223 | 2035/3/20 |
| | 第153回 利付国債(20年) | 1.3 | 247,000 | 283,400 | 2035/6/20 |
| | 第154回 利付国債(20年) | 1.2 | 580,000 | 657,992 | 2035/9/20 |
| | 第155回 利付国債(20年) | 1.0 | 410,000 | 453,861 | 2035/12/20 |
| | 第156回 利付国債(20年) | 0.4 | 380,000 | 387,588 | 2036/3/20 |
| | 第157回 利付国債(20年) | 0.2 | 175,000 | 173,099 | 2036/6/20 |
| | 第158回 利付国債(20年) | 0.5 | 360,000 | 371,631 | 2036/9/20 |
| | 第159回 利付国債(20年) | 0.6 | 418,000 | 437,629 | 2036/12/20 |
| | 第160回 利付国債(20年) | 0.7 | 355,000 | 376,726 | 2037/3/20 |
| | 第161回 利付国債(20年) | 0.6 | 320,000 | 334,457 | 2037/6/20 |
| | 第162回 利付国債(20年) | 0.6 | 210,000 | 219,288 | 2037/9/20 |
| | 第163回 利付国債(20年) | 0.6 | 670,000 | 698,964 | 2037/12/20 |
| | 第164回 利付国債(20年) | 0.5 | 215,000 | 220,471 | 2038/3/20 |
| | 第165回 利付国債(20年) | 0.5 | 520,000 | 532,558 | 2038/6/20 |
| | 第166回 利付国債(20年) | 0.7 | 295,000 | 311,605 | 2038/9/20 |
| | 第167回 利付国債(20年) | 0.5 | 500,000 | 510,720 | 2038/12/20 |
| | 第168回 利付国債(20年) | 0.4 | 150,000 | 150,499 | 2039/3/20 |
| | 第169回 利付国債(20年) | 0.3 | 400,000 | 393,588 | 2039/6/20 |
| | 第170回 利付国債(20年) | 0.3 | 255,000 | 250,432 | 2039/9/20 |
| | 第171回 利付国債(20年) | 0.3 | 495,000 | 485,599 | 2039/12/20 |
| | 第172回 利付国債(20年) | 0.4 | 480,000 | 478,742 | 2040/3/20 |
| | 第173回 利付国債(20年) | 0.4 | 515,000 | 512,728 | 2040/6/20 |
| | 第174回 利付国債(20年) | 0.4 | 610,000 | 606,730 | 2040/9/20 |
| | 第175回 利付国債(20年) | 0.5 | 375,000 | 379,395 | 2040/12/20 |
| | 第176回 利付国債(20年) | 0.5 | 130,000 | 131,420 | 2041/3/20 |
| | 小 計 | - | 97,072,000 | 105,560,274 | - |
| 地方債証券 | 第1回 東京都公募公債(20年) | 1.54 | 100,000 | 103,169 | 2023/6/20 |
| | 第1回 東京都公募公債(30年) | 2.21 | 100,000 | 123,480 | 2033/6/20 |
| | 第6回 東京都公募公債(20年) | 2.0 | 100,000 | 107,597 | 2025/3/19 |
| | 第8回 東京都公募公債(30年) | 2.23 | 400,000 | 518,916 | 2038/9/17 |
| | 第13回 東京都公募公債(30年) | 1.93 | 500,000 | 637,170 | 2042/3/19 |
| | 第705回 東京都公募公債 | 1.06 | 100,000 | 100,854 | 2022/3/18 |
| | 第710回 東京都公募公債 | 0.81 | 100,000 | 100,856 | 2022/6/20 |
| | 平成24年度第1回 北海道公募公債 | 0.99 | 100,000 | 100,895 | 2022/4/27 |
| | 平成24年度第14回 北海道公募公債 | 0.8 | 100,000 | 101,375 | 2023/2/28 |
| | 平成26年度第15回 北海道公募公債 | 0.434 | 100,000 | 101,559 | 2025/2/27 |
| | 平成29年度第6回 北海道公募公債(5年) | 0.01 | 300,000 | 299,961 | 2022/7/28 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|--------------------|------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第1回 神奈川県公募公債(20年) | 2.55 | 100,000 | 107,800 | 2024/6/20 |
| | 第3回 神奈川県公募公債(20年) | 2.11 | 100,000 | 108,542 | 2025/6/20 |
| | 第7回 神奈川県公募公債(20年) | 2.22 | 100,000 | 112,583 | 2027/3/19 |
| | 第361回 大阪府公募公債(10年) | 0.92 | 200,000 | 201,966 | 2022/6/28 |
| | 第373回 大阪府公募公債(10年) | 0.904 | 100,000 | 101,847 | 2023/6/27 |
| | 第377回 大阪府公募公債(10年) | 0.729 | 100,000 | 101,723 | 2023/10/30 |
| | 平成27年度第4回 京都府公募公債 | 0.553 | 100,000 | 102,204 | 2025/6/19 |
| | 平成29年度第12回 京都府公募公債 | 0.04 | 300,000 | 300,162 | 2023/3/16 |
| | 第5回 兵庫県公募公債(15年) | 1.31 | 300,000 | 325,803 | 2028/5/26 |
| | 第7回 静岡県公募公債(30年) | 1.988 | 100,000 | 129,332 | 2043/6/19 |
| | 平成20年度第1回 静岡県公募公債 | 2.18 | 100,000 | 109,377 | 2025/9/19 |
| | 平成29年度第2回 埼玉県公募公債(5年) | 0.01 | 200,000 | 199,998 | 2022/4/19 |
| | 平成25年度第11回 福岡県公募公債 | 0.694 | 100,000 | 101,884 | 2024/2/26 |
| | 平成26年度第10回 福岡県公募公債 | 0.453 | 100,000 | 101,668 | 2025/2/26 |
| | 平成25年度第8回 千葉県公募公債 | 0.67 | 100,000 | 101,650 | 2023/11/24 |
| | 第9回 群馬県公募公債(10年) | 0.801 | 100,000 | 101,190 | 2022/11/25 |
| | 第111回 共同発行市場公募地方債 | 0.89 | 200,000 | 201,904 | 2022/6/24 |
| | 第112回 共同発行市場公募地方債 | 0.84 | 150,000 | 151,452 | 2022/7/25 |
| | 第113回 共同発行市場公募地方債 | 0.77 | 100,000 | 100,951 | 2022/8/25 |
| | 第114回 共同発行市場公募地方債 | 0.82 | 100,000 | 101,076 | 2022/9/22 |
| | 第115回 共同発行市場公募地方債 | 0.8 | 200,000 | 202,242 | 2022/10/25 |
| | 第118回 共同発行市場公募地方債 | 0.84 | 100,000 | 101,386 | 2023/1/25 |
| | 第137回 共同発行市場公募地方債 | 0.566 | 200,000 | 203,608 | 2024/8/23 |
| | 第172回 共同発行市場公募地方債 | 0.225 | 500,000 | 505,060 | 2027/7/23 |
| | 第183回 共同発行市場公募地方債 | 0.205 | 400,000 | 403,800 | 2028/6/23 |
| | 第1回 名古屋市長募公債(20年) | 1.99 | 200,000 | 210,186 | 2023/12/20 |
| | 第3回 名古屋市長募公債(20年) | 2.03 | 100,000 | 108,216 | 2025/6/20 |
| | 第5回 名古屋市長募公債(20年) | 2.3 | 100,000 | 112,021 | 2026/9/18 |
| | 第1回 京都市公募公債(30年) | 2.57 | 100,000 | 134,154 | 2037/9/18 |
| | 第7回 京都市公募公債(20年) | 2.38 | 100,000 | 116,834 | 2028/9/21 |
| | 平成29年度第5回 京都市公募公債 | 0.04 | 100,000 | 100,055 | 2023/3/28 |
| | 平成26年度第17回 神戸市長募公債 | 0.28 | 100,000 | 100,995 | 2025/1/27 |
| | 第4回 横浜市長募公債(20年) | 2.03 | 100,000 | 107,710 | 2025/3/19 |
| | 第9回 横浜市長募公債(20年) | 2.35 | 100,000 | 111,711 | 2026/6/19 |
| | 第14回 横浜市長募公債(20年) | 2.32 | 100,000 | 115,327 | 2028/3/17 |
| | 第47回 横浜市長募公債(5年) | 0.04 | 100,000 | 100,050 | 2023/1/27 |
| | 平成26年度第4回 札幌市長募公債(10年) | 0.54 | 100,000 | 101,627 | 2024/6/20 |
| | 平成24年度第2回 北九州市公募公債 | 0.715 | 100,000 | 101,104 | 2022/12/26 |
| | 平成23年度第9回 福岡市長募公債 | 1.01 | 147,000 | 148,236 | 2022/3/28 |
| | 平成29年度第11回 福岡市長募公債(5年) | 0.04 | 300,000 | 300,162 | 2023/3/16 |
| | 小 計 | - | 7,997,000 | 8,543,428 | - |
| 特 殊 債 券 (除く金融債) | 第3回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 1.82 | 10,038 | 10,089 | 2036/5/10 |
| | 第4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.29 | 12,037 | 12,328 | 2042/8/10 |
| | 第5回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 1.76 | 10,412 | 10,475 | 2036/11/10 |
| | 第7回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.0 | 13,538 | 14,063 | 2038/11/10 |
| | 第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.19 | 23,038 | 23,538 | 2037/5/10 |
| | 第9回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.24 | 13,737 | 14,378 | 2039/5/10 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-------|--------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 第10回 | 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.15 | 35,766 | 36,730 | 2037/5/10 |
| 第10回 | 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.09 | 13,492 | 13,991 | 2039/11/10 |
| 第11回 | 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.12 | 14,567 | 15,311 | 2040/5/10 |
| 第17回 | 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.71 | 22,378 | 22,599 | 2032/11/10 |
| 第19回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.15 | 17,571 | 18,623 | 2043/11/10 |
| 第24回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.34 | 36,158 | 38,528 | 2044/5/10 |
| 第26回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.14 | 55,116 | 58,344 | 2044/7/10 |
| 第27回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.05 | 20,138 | 21,363 | 2044/8/10 |
| 第28回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.98 | 21,975 | 23,391 | 2044/9/10 |
| 第29回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.81 | 10,963 | 11,110 | 2040/4/10 |
| 第29回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.95 | 24,772 | 26,536 | 2044/10/10 |
| 第30回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.97 | 24,025 | 25,731 | 2044/11/10 |
| 第32回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.69 | 12,317 | 12,603 | 2040/7/10 |
| 第32回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.82 | 47,998 | 50,984 | 2045/1/10 |
| 第35回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.79 | 13,128 | 13,563 | 2040/10/10 |
| 第35回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.87 | 24,749 | 26,305 | 2045/4/10 |
| 第36回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.81 | 24,116 | 25,505 | 2045/5/10 |
| 第39回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.84 | 11,871 | 12,119 | 2041/2/10 |
| 第41回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.09 | 12,738 | 13,162 | 2041/4/10 |
| 第43回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.28 | 24,468 | 25,248 | 2041/6/10 |
| 第43回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.6 | 30,861 | 32,702 | 2045/12/10 |
| 第46回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.85 | 25,463 | 27,039 | 2046/3/10 |
| 第48回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.89 | 49,140 | 52,032 | 2046/5/10 |
| 第49回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.76 | 25,053 | 26,450 | 2046/6/10 |
| 第51回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.21 | 11,799 | 12,159 | 2042/2/10 |
| 第51回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.64 | 56,668 | 59,828 | 2046/8/10 |
| 第52回 | 一般担保住宅金融支援機構債券 | 2.01 | 100,000 | 116,578 | 2030/7/16 |
| 第53回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.09 | 12,608 | 13,039 | 2042/4/10 |
| 第55回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.41 | 76,248 | 80,527 | 2046/12/10 |
| 第57回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 35,943 | 37,926 | 2047/2/10 |
| 第58回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.4 | 39,586 | 41,786 | 2047/3/10 |
| 第59回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 76,178 | 80,502 | 2047/4/10 |
| 第60回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.34 | 117,975 | 124,217 | 2047/5/10 |
| 第61回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.26 | 38,215 | 40,087 | 2047/6/10 |
| 第67回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.09 | 43,793 | 45,697 | 2047/12/10 |
| 第69回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.28 | 88,910 | 93,645 | 2048/2/10 |
| 第70回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.25 | 76,896 | 80,653 | 2048/3/10 |
| 第73回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.3 | 44,052 | 46,432 | 2048/6/10 |
| 第95回 | 一般担保住宅金融支援機構債券 | 1.065 | 100,000 | 100,859 | 2022/3/18 |
| 第99回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.88 | 65,496 | 67,847 | 2050/8/10 |
| 第123回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 83,619 | 84,662 | 2052/8/10 |
| 第124回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 83,142 | 83,955 | 2052/9/10 |
| 第125回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 83,565 | 84,378 | 2052/10/10 |
| 第127回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4 | 84,791 | 85,484 | 2052/12/10 |
| 第128回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 84,134 | 84,943 | 2053/1/10 |
| 第129回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 85,629 | 86,665 | 2053/2/10 |
| 第130回 | 一般担保住宅金融支援機構債券 | 1.763 | 200,000 | 234,170 | 2032/12/20 |
| 第137回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.47 | 88,538 | 89,719 | 2053/10/10 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-----------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償還年月日 |
| | 第167回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.41 | 99,813 | 100,692 | 2056/4/10 |
| | 第1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 23,228 | 23,777 | 2042/5/10 |
| | 第2回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.19 | 25,900 | 26,800 | 2042/6/10 |
| | 第3回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.09 | 12,436 | 12,793 | 2037/11/10 |
| | 第6回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 11,982 | 12,253 | 2042/10/10 |
| | 第5回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.96 | 26,232 | 27,090 | 2038/11/10 |
| | 第9回 道路債券 | 2.9 | 100,000 | 128,815 | 2032/5/20 |
| | 第18回 政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 0.001 | 800,000 | 800,120 | 2022/5/30 |
| | 第42回 地方公共団体金融機構債券 | 0.801 | 100,000 | 101,196 | 2022/11/28 |
| | 第45回 地方公共団体金融機構債券 | 0.791 | 200,000 | 202,754 | 2023/2/28 |
| | 第61回 地方公共団体金融機構債券 | 0.69 | 100,000 | 102,071 | 2024/6/28 |
| | 第63回 地方公共団体金融機構債券 | 0.581 | 100,000 | 101,827 | 2024/8/28 |
| | 第67回 政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.466 | 100,000 | 101,621 | 2024/12/13 |
| | 第51回 政府保証関西国際空港債券 | 2.1 | 100,000 | 102,682 | 2022/8/31 |
| | 第3回 政府保証日本政策投資銀行社債 | 2.1 | 200,000 | 210,758 | 2023/12/18 |
| | 第34回 政府保証日本政策投資銀行社債 | 0.001 | 300,000 | 300,051 | 2022/6/30 |
| | 第81回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.1 | 200,000 | 232,464 | 2022/5/31 |
| | 第88回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.3 | 100,000 | 132,336 | 2039/8/31 |
| | 第90回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.1 | 300,000 | 350,226 | 2029/9/28 |
| | 第99回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.2 | 100,000 | 118,185 | 2030/1/31 |
| | 第176回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.645 | 100,000 | 116,153 | 2032/10/29 |
| | 第196回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.779 | 100,000 | 118,498 | 2033/7/29 |
| | 第210回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.547 | 200,000 | 232,192 | 2034/1/31 |
| | 第227回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.544 | 200,000 | 203,578 | 2024/9/30 |
| | 第231回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.495 | 300,000 | 305,115 | 2024/11/29 |
| | 第288回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.01 | 189,000 | 188,948 | 2026/9/30 |
| | 第20回 西日本高速道路社債 | 0.759 | 100,000 | 101,691 | 2023/9/20 |
| | 第342回 東京交通債券 | 2.4 | 100,000 | 102,561 | 2022/6/21 |
| | 第36回 日本政策投資銀行債券 | 2.23 | 100,000 | 112,753 | 2027/5/28 |
| | 第18回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.87 | 100,000 | 149,812 | 2046/12/20 |
| | 第22回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.67 | 300,000 | 436,344 | 2047/3/20 |
| | 第27回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.34 | 100,000 | 114,255 | 2027/10/20 |
| | 第37回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.42 | 300,000 | 348,861 | 2028/6/20 |
| | 第47回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.41 | 200,000 | 235,768 | 2029/4/20 |
| | 第104回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.715 | 400,000 | 405,128 | 2023/3/20 |
| | 第2回 地方公営企業等金融機構債券(20年) | 2.29 | 100,000 | 116,986 | 2029/4/27 |
| | 第3回 公営企業債券(20年) | 1.03 | 100,000 | 101,861 | 2023/3/22 |
| | 第5回 公営企業債券(20年) | 2.11 | 100,000 | 104,852 | 2023/9/20 |
| | 第17回 公営企業債券(20年) | 2.39 | 100,000 | 111,438 | 2026/3/24 |
| | 第20回 公営企業債券(20年) | 2.25 | 100,000 | 112,558 | 2027/3/24 |
| | 第22回 公営企業債券(20年) | 2.32 | 100,000 | 113,451 | 2027/6/18 |
| | 第24回 公営企業債券(20年) | 2.29 | 200,000 | 230,086 | 2028/4/25 |
| | 第62回 地方公共団体金融機構債券 | 0.631 | 400,000 | 407,740 | 2024/7/26 |
| | 第101回 地方公共団体金融機構債券 | 0.235 | 100,000 | 100,894 | 2027/10/28 |
| | 第106回 地方公共団体金融機構債券 | 0.215 | 200,000 | 201,562 | 2028/3/28 |
| | 第226回 一般担保住宅金融支援機構債券 | 0.24 | 100,000 | 100,881 | 2027/12/20 |
| | 第12回 国際協力機構債券 | 0.901 | 100,000 | 100,953 | 2022/6/20 |
| | 第45回 中日本高速道路 | 0.904 | 100,000 | 101,169 | 2022/9/20 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | | |
|-------------------------|----------------------------------|-------|------------|-------------|-------------|---|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 | |
| | 第85回 中日本高速道路 | 0.07 | 300,000 | 300,204 | 2025/10/21 | |
| | 第23回 西日本高速道路 | 0.602 | 100,000 | 101,723 | 2024/6/20 | |
| | 小 計 | — | 10,447,999 | 11,257,155 | — | |
| 金 融 債 券 | い第810号 農林債 | 0.1 | 300,000 | 300,336 | 2022/11/25 | |
| 普 通 社 債 券 (含む投資法人債券) | 第472回 東北電力 | 0.954 | 100,000 | 102,453 | 2024/2/23 | |
| | 第508回 東北電力 | 0.465 | 200,000 | 203,264 | 2029/4/25 | |
| | 第13回 大和ハウス工業 | 0.285 | 100,000 | 100,101 | 2027/6/1 | |
| | 第30回 東レ | 0.375 | 100,000 | 100,452 | 2027/7/16 | |
| | 第56回 住友化学 | 0.38 | 200,000 | 200,952 | 2027/9/13 | |
| | 第24回 三菱ケミカルホールディングス | 0.37 | 100,000 | 100,710 | 2028/2/25 | |
| | 第13回 プリチストーン | 0.23 | 100,000 | 100,276 | 2026/4/17 | |
| | 第16回 日立製作所 | 0.813 | 100,000 | 101,828 | 2023/12/13 | |
| | 第22回 パナソニック | 0.29 | 100,000 | 100,402 | 2027/12/24 | |
| | 第63回 三井物産 | 2.37 | 100,000 | 112,777 | 2027/4/23 | |
| | 第8回 みずほコーポレート銀行 | 2.54 | 100,000 | 114,003 | 2027/7/27 | |
| | 第1回 三井住友フィナンシャル | 0.849 | 100,000 | 101,403 | 2024/9/12 | |
| | 第8回 住友信託銀行 | 2.49 | 100,000 | 112,177 | 2027/5/10 | |
| | 第1回 みずほフィナンシャルグループ | 0.95 | 100,000 | 101,429 | 2024/7/16 | |
| | 第24回 三井住友銀行 | 1.6 | 100,000 | 100,028 | 2021/6/1 | |
| | 第9回 みずほ銀行 | 2.52 | 100,000 | 110,995 | 2027/4/27 | |
| | 第17回 NTTファイナンス | 0.28 | 200,000 | 201,522 | 2027/12/20 | |
| | 第93回 トヨタファイナンス | 0.13 | 400,000 | 400,388 | 2025/6/10 | |
| | 第1回 野村ホールディングス | 0.3 | 100,000 | 100,048 | 2023/9/4 | |
| | 第58回 三菱地所 | 2.9 | 100,000 | 125,488 | 2032/5/20 | |
| | 第38回 京王電鉄 | 0.295 | 100,000 | 100,624 | 2027/11/29 | |
| | 第110回 東日本旅客鉄道 | 1.76 | 100,000 | 121,039 | 2045/7/28 | |
| | 第41回 東海旅客鉄道 | 2.166 | 100,000 | 115,089 | 2029/1/29 | |
| | 第42回 東海旅客鉄道 | 2.312 | 100,000 | 116,638 | 2029/4/24 | |
| | 第45回 東京地下鉄 | 0.215 | 100,000 | 100,136 | 2030/9/18 | |
| | 第27回 KDDI | 0.23 | 100,000 | 99,840 | 2026/4/24 | |
| | 第37回 東京電力パワーグリッド | 0.29 | 200,000 | 200,572 | 2023/6/9 | |
| | 第38回 東京電力パワーグリッド | 0.58 | 100,000 | 101,092 | 2025/7/16 | |
| | 第7回 ファーストリテイリング | 0.405 | 100,000 | 101,401 | 2028/6/6 | |
| | 第2回 ビー・ビー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20) | 0.645 | 200,000 | 201,362 | 2023/7/12 | |
| | | 小 計 | — | 3,800,000 | 3,948,489 | — |
| | | 合 計 | — | 119,616,999 | 129,609,682 | — |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 投資信託財産の構成

(2021年5月25日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 129,609,682 | 99.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 873,195 | 0.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 130,482,877 | 100.0 |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年5月25日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|--------------------------------|-------------------------|
| (A) 資 産 | 130,482,877,412円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 346,981,807 |
| 公 社 債 (評 価 額) | 129,609,682,442 |
| 未 収 入 金 | 171,343,600 |
| 未 収 利 息 | 351,485,559 |
| 前 払 費 用 | 3,384,004 |
| (B) 負 債 | 81,103,832 |
| 未 払 解 約 金 | 81,100,000 |
| 未 払 利 息 | 922 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 2,910 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 130,401,773,580 |
| 元 本 | 101,956,373,249 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 28,445,400,331 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 101,956,373,249口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,790円 |

※当期における期首元本額107,378,343,953円、期中追加設定元本額19,066,693,124円、期中一部解約元本額24,488,663,828円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2020年5月26日 至2021年5月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------------|------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 1,347,229,730円 |
| 受 取 利 息 | 1,347,822,751 |
| 支 払 利 息 | △ 593,021 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 1,985,583,902 |
| 売 買 益 | 59,305,652 |
| 売 買 損 | △ 2,044,889,554 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 89,983 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 638,444,155 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 30,561,050,080 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 5,341,176,396 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △ 6,818,381,990 |
| (H) 計 (D + E + F + G) | 28,445,400,331 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 28,445,400,331 |

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 期末における、元本の内訳は以下の通りです。

| | | | |
|----------------------------------|-----------------|---|-----------------|
| 三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型) | 6,107,406,137円 | SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 6,723,802,531円 |
| 三井住友・DC年金バランス50 (標準型) | 10,781,816,542円 | SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 16,849,038,912円 |
| 三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型) | 2,397,304,721円 | SMAM・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定> | 329,649,062円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型) | 641,931,738円 | SMAM・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定> | 596,483,349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) | 43,241,043円 | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 274,171,613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) | 184,044,133円 | SMAM・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定> | 117,615,876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) | 434,154,953円 | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 1,898,851,071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) | 583,046,424円 | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 2,193,869,711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) | 261,715,284円 | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 2,535,669,870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) | 412,399,004円 | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 9,205,091,355円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ (債券型) | 136,805,557円 | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 948,903円 |
| アセットアロケーション・ファンド (安定型) | 1,167,274,213円 | 三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用) | 1,259,749,712円 |
| アセットアロケーション・ファンド (安定成長型) | 336,338,695円 | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 468,541,289円 |
| アセットアロケーション・ファンド (成長型) | 13,590,257円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 595,459,501円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 34,209,543円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 182,525,240円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型) | 1,282,563,419円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 43,116,807円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型) | 409,872,922円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 1,610,117,052円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型) | 612,321,166円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 2,259,171,883円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型) | 123,710,024円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 786,132,548円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型) | 35,616,100円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 215,565,314円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 97,879,738円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 19,071,373円 |
| 三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型) | 77,545,541円 | SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 296,118,831円 |
| 三井住友DS・年金バランス50 (標準型) | 130,303,297円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 5,582,241,420円 |
| 三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型) | 36,291,637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> | 323,429,939円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 4,882,878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> | 817,827,093円 |
| SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 1,587,722,151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> | 996,614,616円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 14,242,266,453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> | 3,599,244,808円 |

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

外国株式インデックス・マザーファンド

第19期（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

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

■ 最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | (ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス | | 株式組入 比 | 株式先物 率 (買建-売建) | 投資信託 証券 組入比率 | 純資 産額 |
|------------------|--------|------|----------------------------|------|-----------|----------------------|--------------------|----------|
| | 円 | % | (配当込み、 円ベース) | % | | | | |
| 15期（2017年11月30日） | 33,807 | 22.7 | 350.45 | 23.0 | 95.2 | 2.5 | 2.3 | 196,182 |
| 16期（2018年11月30日） | 34,678 | 2.6 | 360.38 | 2.8 | 93.7 | 3.9 | 2.3 | 174,245 |
| 17期（2019年12月2日） | 38,813 | 11.9 | 404.43 | 12.2 | 95.2 | 2.1 | 2.7 | 232,418 |
| 18期（2020年11月30日） | 42,581 | 9.7 | 444.41 | 9.9 | 96.8 | 0.9 | 2.3 | 254,097 |
| 19期（2021年11月30日） | 58,337 | 37.0 | 609.64 | 37.2 | 95.5 | 2.2 | 2.4 | 353,818 |

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

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

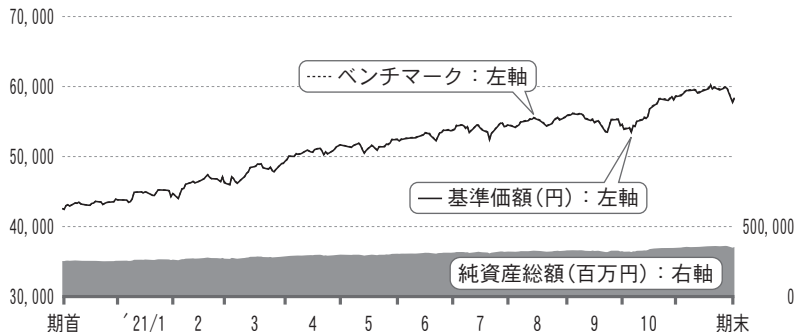
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 42,581円 |
| 期末 | 58,337円 |
| 騰落率 | +37.0% |

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

上昇要因

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

▶ 投資環境について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

株式市場

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

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

5月は、物価指数が予想以上に上昇して一進一退となりました。

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

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

期間を通じてみると、世界の株式市場は、大きく上昇しました。

為替市場

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

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

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

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

期間を通じてみると、為替市場では、米ドル、ユーロとも対円で上昇しました。

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

株式組入比率

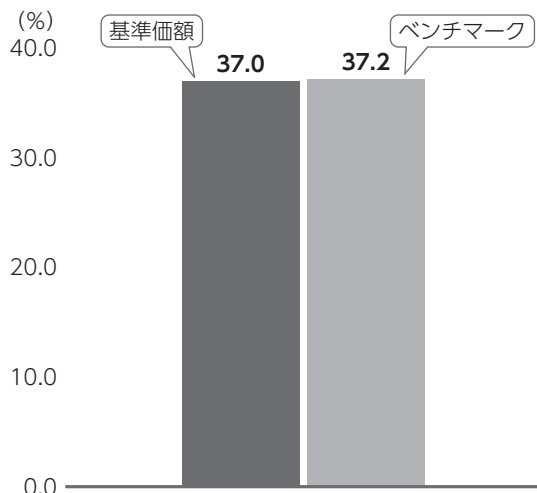
MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+37.0%となり、ベンチマークの騰落率+37.2%を0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

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

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

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

| 項 目 | 金 額 | 比 率 | 項 目 の 概 要 |
|---|--|--|--|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) (投 資 信 託 証 券) | 2円 (1) (0) (0) (0) | 0.004% (0.003) (0.000) (0.001) (0.000) | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券) | 2 (2) (0) | 0.003 (0.003) (0.000) | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 22 (18) (4) | 0.043 (0.034) (0.009) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合 計 | 25 | 0.049 | |

期中の平均基準価額は51,446円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引状況 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

(1) 株 式

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

※金額は受渡し代金。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 新株予約権証券

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

※金額は受渡し代金。

外国株式インデックス・マザーファンド

(3) 投資信託証券

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

外国株式インデックス・マザーファンド

| | | 買 付 | | 売 付 | | | | |
|---|--------|------------------------------|----------------------|----------------------------|----------------------|---------------------------|------------|-------------|
| | | 口 数 | 買 付 額 | 口 数 | 売 付 額 | | | |
| 外 | シンガポール | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | □ 40,800 (-) | 千シンガポール・ドル 124 (△ 4) | □ 29,300 (-) | 千シンガポール・ドル 86 (-) | | |
| | | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | - (21,128) | - (28) | - (-) | - (-) | | |
| | | SUNTEC REIT | - | - | 102,700 | 145 | | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | □ 70,000 (-) | 137 (△ 2) | - (-) | - (-) | | |
| | | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | □ 58,300 (-) | 118 (△ 0) | 50,800 (-) | 109 (-) | | |
| 国 | イギリス | SEGRO PLC | □ 8,749 | 千イギリス・ポンド 119 | □ - | 千イギリス・ポンド - | | |
| | | ユ ー ロ | フランス | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | □ - | 千ユーロ - | □ 1,606 | 千ユーロ 106 |
| | | | | ICADE | - | - | 2,061 | 127 |
| | | | | KLEPIERRE | □ 4,295 (-) | 89 (△ 9) | - (-) | - (-) |

※金額は受渡し代金。

※()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(4) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|-----------------|---------------|---------------|----------|----------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外 国 株 式 先 物 取 引 | 百万円 66,749 | 百万円 63,003 | 百万円 - | 百万円 - |

※金額は受渡し代金。

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

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 43,010,068千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 294,102,700千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)/(b) | 0.14 |

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2021年11月30日現在)

(1) 外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|-------------------------------|----------|----------|----------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION | 58.89 | 58.89 | 1,033 | 117,590 | ソフトウェア・サービス |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 98.95 | 110.28 | 1,817 | 206,779 | 保険 |
| ABBOTT LABORATORIES | 948.44 | 957.32 | 12,256 | 1,394,429 | ヘルスケア機器・サービス |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 30.92 | 35.59 | 1,488 | 169,388 | 素材 |
| CONCHO RESOURCES INC | 101.72 | — | — | — | エネルギー |
| VERISK ANALYTICS INC | 79.29 | 79.29 | 1,817 | 206,721 | 商業・専門サービス |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 20.6 | 23.71 | 1,023 | 116,499 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 176.34 | 176.34 | 657 | 74,751 | 消費者サービス |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | — | 22.43 | 1,265 | 144,006 | 半導体・半導体製造装置 |
| SVB FINANCIAL GROUP | 26.4 | 31.11 | 2,253 | 256,428 | 銀行 |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 333.93 | 339.4 | 3,576 | 406,948 | ソフトウェア・サービス |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 13.81 | 14.69 | 2,465 | 280,457 | 消費者サービス |
| AFLAC INC | 354.11 | 341.85 | 1,904 | 216,629 | 保険 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 74.25 | 76.06 | 1,078 | 122,661 | 消費者サービス |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 211.16 | 222.02 | 1,928 | 219,376 | 食品・飲料・タバコ |
| ADOBE INC | 258.16 | 257.02 | 17,669 | 2,010,300 | ソフトウェア・サービス |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 120.02 | 120.02 | 755 | 85,969 | 素材 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 64.81 | 64.81 | 3,002 | 341,581 | 耐久消費財・アパレル |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL | 202 | — | — | — | 銀行 |
| GARMIN LTD | 81.24 | 84.44 | 1,175 | 133,764 | 耐久消費財・アパレル |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 119.9 | 118.18 | 3,443 | 391,729 | 素材 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 377.29 | 375.49 | 7,797 | 887,113 | 資本財 |
| WR BERKLEY CORP | 74.28 | 74.28 | 590 | 67,158 | 保険 |
| AUTOZONE INC | 12.71 | 11.37 | 2,090 | 237,846 | 小売 |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 599.62 | 637.19 | 547 | 62,271 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DR HORTON INC | 193.85 | 181.62 | 1,793 | 204,066 | 耐久消費財・アパレル |
| DENTSPLY SIRONA INC | 118.64 | 118.64 | 577 | 65,720 | ヘルスケア機器・サービス |
| AUTODESK INC | 115.06 | 115.06 | 3,004 | 341,855 | ソフトウェア・サービス |
| ALLIANT ENERGY CORP | 121.01 | 121.01 | 693 | 78,859 | 公益事業 |
| CITIGROUP INC | 1,123.53 | 1,105.27 | 7,188 | 817,855 | 銀行 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 41.86 | 41.86 | 354 | 40,356 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 224.63 | 223.87 | 5,281 | 600,829 | ソフトウェア・サービス |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 257.27 | 257.27 | 2,143 | 243,845 | 公益事業 |
| HESS CORP | 153.62 | 143.44 | 1,091 | 124,139 | エネルギー |
| DAVITA INC | 41.38 | 41.38 | 401 | 45,623 | ヘルスケア機器・サービス |
| DOMINO'S PIZZA INC | 21.21 | 21.21 | 1,132 | 128,845 | 消費者サービス |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 289.13 | 307.81 | 4,060 | 461,907 | 各種金融 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 309.87 | 303.41 | 1,966 | 223,717 | 食品・飲料・タバコ |
| BUNGE LTD | 71.74 | 71.74 | 649 | 73,930 | 食品・飲料・タバコ |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|----------|---------|------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 174.25 | 174.25 | 2,777 | 315,981 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| APPLE INC | 9,240 | 8,929.29 | 143,082 | 16,278,546 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 164.25 | 164.25 | 1,861 | 211,757 | 各種金融 |
| BOEING CO/THE | 289.26 | 301.3 | 5,980 | 680,436 | 資本財 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 78.58 | 78.58 | 930 | 105,903 | 保険 |
| BECTON DICKINSON AND CO | 153.15 | 151.4 | 3,688 | 419,612 | ヘルスケア機器・サービス |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR | 133.96 | 179.45 | 181 | 20,661 | 消費者サービス |
| NISOURCE INC | 189.19 | 189.19 | 477 | 54,348 | 公益事業 |
| ABBVIE INC | 947.79 | 952.34 | 11,131 | 1,266,476 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 2,208.86 | 2,231.32 | 11,526 | 1,311,426 | 電気通信サービス |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 741.86 | 712.57 | 20,103 | 2,287,121 | 各種金融 |
| KINDER MORGAN INC | 1,059.4 | 1,059.4 | 1,696 | 192,965 | エネルギー |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 703.16 | 703.16 | 4,293 | 488,470 | 銀行 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 1,216.01 | 1,210.07 | 6,611 | 752,227 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 139.37 | 139.37 | 696 | 79,201 | 保険 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 56.61 | 56.61 | 734 | 83,533 | 各種金融 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 1,628.89 | 1,618.84 | 26,100 | 2,969,460 | 銀行 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 123.64 | 123.14 | 2,549 | 290,027 | 各種金融 |
| FAIR ISAAC CORP | 14.94 | 14.94 | 523 | 59,602 | ソフトウェア・サービス |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 21.07 | 21.07 | 382 | 43,560 | 資本財 |
| CIGNA CORP | 193.82 | 183.24 | 3,657 | 416,131 | ヘルスケア機器・サービス |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD | 30.52 | 30.52 | 473 | 53,854 | 保険 |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 161.3 | 161.3 | 1,196 | 136,146 | 食品・飲料・タバコ |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 142.5 | 154 | 2,875 | 327,091 | ソフトウェア・サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 64.12 | 65.01 | 1,909 | 217,233 | 各種金融 |
| MERCADOLIBRE INC | 23.64 | 24.57 | 3,032 | 344,971 | 小売 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 137.41 | 127.46 | 2,868 | 326,376 | 小売 |
| SERVICENOW INC | 103.03 | 106.96 | 7,196 | 818,743 | ソフトウェア・サービス |
| CATERPILLAR INC | 292.34 | 297.38 | 5,826 | 662,854 | 資本財 |
| BROWN & BROWN INC | 140.36 | 142.73 | 933 | 106,215 | 保険 |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | - | 25.77 | 967 | 110,035 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CENTENE CORP | 305.28 | 305.28 | 2,252 | 256,215 | ヘルスケア機器・サービス |
| CORNING INC | 397.09 | 456.88 | 1,757 | 199,912 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 44.11 | 44.11 | 863 | 98,295 | 運輸 |
| MOSAIC CO/THE | 185.84 | 185.84 | 669 | 76,178 | 素材 |
| CISCO SYSTEMS INC | 2,266.97 | 2,269.38 | 12,654 | 1,439,652 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MORGAN STANLEY | 734.12 | 755.61 | 7,346 | 835,844 | 各種金融 |
| BROADCOM INC | 214.87 | 220.01 | 12,416 | 1,412,573 | 半導体・半導体製造装置 |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 126.02 | 145.5 | 837 | 95,298 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DTE ENERGY COMPANY | 104.96 | 105.36 | 1,174 | 133,640 | 公益事業 |
| DOMINION ENERGY INC | 455.18 | 443.47 | 3,300 | 375,475 | 公益事業 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 56.13 | 68.1 | 1,230 | 140,032 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DEERE & CO | 161.07 | 157.22 | 5,472 | 622,625 | 資本財 |
| VMWARE INC-CLASS A | 41.94 | 106.05 | 1,276 | 145,242 | ソフトウェア・サービス |
| BLACKSTONE INC | 346.84 | 372.5 | 5,545 | 630,943 | 各種金融 |
| NASDAQ INC | 65.58 | 65.09 | 1,360 | 154,829 | 各種金融 |
| ZOETIS INC | 257.28 | 252.46 | 5,643 | 642,088 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 183.36 | 183.99 | 1,478 | 168,192 | 公益事業 |
| KKR & CO INC | 286.09 | 285.69 | 2,180 | 248,030 | 各種金融 |
| COGNEX CORP | 86.98 | 86.98 | 684 | 77,839 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ALPHABET INC-CL C | 161.54 | 156.03 | 45,596 | 5,187,495 | メディア・娯楽 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 441.81 | 430.41 | 3,344 | 380,528 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HCA HEALTHCARE INC | 143.52 | 143.12 | 3,290 | 374,373 | ヘルスケア機器・サービス |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 63.05 | 192.52 | 6,444 | 733,181 | ヘルスケア機器・サービス |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 139.31 | 139.31 | 1,242 | 141,328 | 素材 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 237.07 | 238.46 | 13,231 | 1,505,366 | 食品・生活必需品小売り |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|----------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| CUMMINS INC | 80 | 82.07 | 1,783 | 202,867 | 資本財 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 412.25 | 400.92 | 2,417 | 275,090 | メディア・娯楽 |
| DELTA AIR LINES INC | 82.99 | 82.99 | 300 | 34,216 | 運輸 |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 69.25 | 69.25 | 662 | 75,334 | 運輸 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN | 95.42 | 95.42 | 1,886 | 214,665 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| COTERRA ENERGY INC | 196.32 | 402.61 | 839 | 95,457 | エネルギー |
| TRANSDIGM GROUP INC | 26.81 | 26.81 | 1,566 | 178,197 | 資本財 |
| MASIMO CORP | 29.41 | 29.41 | 847 | 96,461 | ヘルスケア機器・サービス |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 38.33 | 36.41 | 2,345 | 266,830 | 小売 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 396.55 | 378.73 | 1,745 | 198,550 | 食品・生活必需品小売り |
| SEAGEN INC | 66.54 | 77.9 | 1,287 | 146,509 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COCA-COLA CO/THE | 2,186.12 | 2,206.53 | 12,043 | 1,370,159 | 食品・飲料・タバコ |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 86.89 | 86.89 | 1,101 | 125,308 | 運輸 |
| BURLINGTON STORES INC | 33.91 | 33.91 | 994 | 113,180 | 小売 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 142.98 | 142.98 | 482 | 54,900 | 各種金融 |
| CSX CORP | 415.38 | 1,218.27 | 4,339 | 493,702 | 運輸 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 49.95 | 49.95 | 1,458 | 165,892 | ヘルスケア機器・サービス |
| EXPEDIA GROUP INC | 68.94 | 80.61 | 1,342 | 152,697 | 消費者サービス |
| AMAZON.COM INC | 226.03 | 242.97 | 86,535 | 9,845,139 | 小売 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 323.36 | 340.18 | 3,766 | 428,472 | ヘルスケア機器・サービス |
| EXXON MOBIL CORP | 2,269.07 | 2,278.12 | 14,030 | 1,596,300 | エネルギー |
| EVEREST RE GROUP LTD | 20.65 | 20.65 | 545 | 62,109 | 保険 |
| EOG RESOURCES INC | 308.3 | 308.3 | 2,725 | 310,030 | エネルギー |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 83.21 | 83.21 | 950 | 108,167 | ソフトウェア・サービス |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 79.93 | 79.93 | 960 | 109,332 | ヘルスケア機器・サービス |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 171.3 | 168.73 | 2,588 | 294,511 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FORD MOTOR CO | 2,080.63 | 2,091.41 | 4,113 | 468,027 | 自動車・自動車部品 |
| HORMEL FOODS CORP | 149.39 | 149.39 | 634 | 72,216 | 食品・飲料・タバコ |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 84.32 | 84.32 | 233 | 26,515 | 電気通信サービス |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 380.96 | 384.38 | 1,336 | 152,096 | 食品・飲料・タバコ |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 91.54 | 102.41 | 1,774 | 201,938 | 公益事業 |
| EVERSOURCE ENERGY | 175.57 | 175.57 | 1,497 | 170,323 | 公益事業 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 597.93 | 601.25 | 11,257 | 1,280,800 | ソフトウェア・サービス |
| MSCI INC | 43.83 | 43.83 | 2,829 | 321,876 | 各種金融 |
| FORTINET INC | 73.6 | 73.6 | 2,526 | 287,461 | ソフトウェア・サービス |
| ALLY FINANCIAL INC | 201.39 | 201.39 | 960 | 109,313 | 各種金融 |
| ANTHEM INC | 136.42 | 133.09 | 5,539 | 630,225 | ヘルスケア機器・サービス |
| NEXTERA ENERGY INC | 1,051.98 | 1,059.66 | 9,394 | 1,068,862 | 公益事業 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 52.21 | 53.93 | 2,972 | 338,182 | ソフトウェア・サービス |
| T-MOBILE US INC | 290.19 | 333.35 | 3,780 | 430,072 | 電気通信サービス |
| ELECTRONIC ARTS INC | 153.52 | 153.52 | 1,917 | 218,115 | メディア・娯楽 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 754.31 | 808.28 | 3,069 | 349,256 | 素材 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 278.25 | 321.12 | 1,513 | 172,147 | 各種金融 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 339.33 | 339.33 | 2,096 | 238,505 | エネルギー |
| KEURIG DR PEPPER INC | 183.39 | 382.44 | 1,345 | 153,025 | 食品・飲料・タバコ |
| US BANCORP | 707.43 | 746.23 | 4,283 | 487,317 | 銀行 |
| AUTOLIV INC | 40.01 | 40.01 | 383 | 43,666 | 自動車・自動車部品 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 125.9 | - | - | - | 素材 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 638.81 | 638.81 | 933 | 106,181 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| F5 INC | 29.09 | 29.09 | 672 | 76,474 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 49.26 | 55.39 | 1,978 | 225,110 | 運輸 |
| FASTENAL CO | 298.92 | 298.92 | 1,821 | 207,245 | 資本財 |
| FISERV INC | 301.44 | 315.64 | 3,076 | 350,018 | ソフトウェア・サービス |
| GENERAL ELECTRIC CO | 4,736.99 | 589.47 | 5,800 | 659,909 | 資本財 |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 38.54 | 41.54 | 2,635 | 299,850 | ヘルスケア機器・サービス |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 25.22 | 25.22 | 1,128 | 128,380 | ソフトウェア・サービス |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期 末 | | 業 種 等 |
|-------------------------------|---------|--------|--------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC | — | 115.82 | 1,182 | 134,509 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 54.81 | 54.81 | 337 | 38,362 | 各種金融 |
| TRANSUNION | 94.97 | 94.97 | 1,083 | 123,314 | 商業・専門サービス |
| MATCH GROUP INC | 127.73 | 137.29 | 1,840 | 209,426 | メディア・娯楽 |
| GODADDY INC - CLASS A | 89.05 | 89.05 | 615 | 69,996 | ソフトウェア・サービス |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 37.79 | 37.79 | 1,690 | 192,345 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GENERAL MOTORS CO | 677.88 | 689.43 | 4,126 | 469,520 | 自動車・自動車部品 |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 79.33 | — | — | — | エネルギー |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 71.66 | 71.66 | 737 | 83,940 | 資本財 |
| HOLOGIC INC | 135.92 | 135.92 | 1,032 | 117,477 | ヘルスケア機器・サービス |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 126.42 | 126.42 | 2,458 | 279,659 | 資本財 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 177.23 | 181.67 | 7,022 | 798,923 | 各種金融 |
| ALPHABET INC-CL A | 160.21 | 161.11 | 46,892 | 5,334,998 | メディア・娯楽 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 42.03 | 42.03 | 509 | 57,988 | ヘルスケア機器・サービス |
| WABTEC CORP | 92.31 | 92.31 | 853 | 97,112 | 資本財 |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 27.37 | 27.37 | 1,661 | 189,075 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 88.97 | 88.97 | 1,907 | 217,068 | 銀行 |
| CELANESE CORP | 64.2 | 55.98 | 894 | 101,767 | 素材 |
| VAIL RESORTS INC | 20.38 | 20.38 | 679 | 77,314 | 消費者サービス |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 34.9 | 34.28 | 1,019 | 116,037 | ヘルスケア機器・サービス |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 78.09 | 70.02 | 4,678 | 532,291 | メディア・娯楽 |
| GENERAL MILLS INC | 314.89 | 314.89 | 2,000 | 227,560 | 食品・飲料・タバコ |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 108.56 | 108.56 | 1,340 | 152,533 | ヘルスケア機器・サービス |
| FIRSTENERGY CORP | 269.48 | 269.48 | 1,052 | 119,722 | 公益事業 |
| GENUINE PARTS CO | 74.06 | 74.06 | 984 | 111,987 | 小売 |
| FORTIVE CORP | 157.5 | 183.73 | 1,400 | 159,343 | 資本財 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 371.5 | 371.5 | 1,597 | 181,699 | 銀行 |
| XYLEM INC | 91.24 | 91.24 | 1,129 | 128,509 | 資本財 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 112.15 | 110.79 | 2,378 | 270,595 | 資本財 |
| LKQ CORP | 159.22 | 159.22 | 917 | 104,339 | 小売 |
| HALLIBURTON CO | 443.17 | 443.17 | 986 | 112,183 | エネルギー |
| TELADOC HEALTH INC | 61.22 | 74.96 | 797 | 90,748 | ヘルスケア機器・サービス |
| HOME DEPOT INC | 575.38 | 571.04 | 23,231 | 2,642,996 | 小売 |
| ALBEMARLE CORP | 55.48 | 65.6 | 1,809 | 205,905 | 素材 |
| CDW CORP/DE | 74.04 | 74.04 | 1,442 | 164,090 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ASSURANT INC | 31.14 | 31.14 | 485 | 55,281 | 保険 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 530.62 | 758.17 | 1,165 | 132,577 | 銀行 |
| HERSHEY CO/THE | 75.14 | 75.14 | 1,346 | 153,158 | 食品・飲料・タバコ |
| HUMANA INC | 68.99 | 67.44 | 2,886 | 328,443 | ヘルスケア機器・サービス |
| SQUARE INC - A | 197.41 | 207.89 | 4,425 | 503,472 | ソフトウェア・サービス |
| IQVIA HOLDINGS INC | 99.21 | 99.21 | 2,645 | 301,016 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SPLUNK INC | 82.52 | 82.52 | 1,031 | 117,353 | ソフトウェア・サービス |
| S&P GLOBAL INC | 130.4 | 127.67 | 5,935 | 675,311 | 各種金融 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 19.12 | 19.12 | 674 | 76,778 | 各種金融 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 207.99 | 207.99 | 1,014 | 115,428 | 銀行 |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 41.41 | 41.41 | 206 | 23,504 | メディア・娯楽 |
| HP INC | 731.61 | 653.88 | 2,349 | 267,290 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 39.15 | 39.15 | 596 | 67,840 | ソフトウェア・サービス |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 478.85 | 471.43 | 5,586 | 635,569 | ソフトウェア・サービス |
| EAST WEST BANCORP INC | 92.01 | — | — | — | 銀行 |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 30.22 | — | — | — | 保険 |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 70.05 | 76.75 | 2,257 | 256,794 | ヘルスケア機器・サービス |
| SNAP INC - A | 455.53 | 496.43 | 2,425 | 275,899 | メディア・娯楽 |
| XPO LOGISTICS INC | 47.16 | — | — | — | 運輸 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 57.07 | 57.07 | 967 | 110,118 | メディア・娯楽 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 69.47 | 69.47 | 629 | 71,567 | 商業・専門サービス |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期 | | 末 | | 業種等 |
|-------------------------------|----------|----------|--------|-----------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | 株数 | 株数 | | | |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 389.56 | 279.44 | 2,152 | 244,924 | 2,152 | 244,924 | 素材 |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C | 210.79 | 210.79 | 588 | 66,956 | 588 | 66,956 | 電気通信サービス |
| BLACK KNIGHT INC | 76.23 | 76.23 | 557 | 63,432 | 557 | 63,432 | ソフトウェア・サービス |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 79.4 | 79.4 | 459 | 52,239 | 459 | 52,239 | 運輸 |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A | 81.99 | 81.95 | 690 | 78,550 | 690 | 78,550 | 保険 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 174.6 | 174.6 | 555 | 63,247 | 555 | 63,247 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| JM SMUCKER CO/THE | 57.68 | 57.68 | 746 | 84,895 | 746 | 84,895 | 食品・飲料・タバコ |
| INGERSOLL-RAND INC | 205.03 | 210.13 | 1,256 | 142,960 | 1,256 | 142,960 | 資本財 |
| JOHNSON & JOHNSON | 1,407.94 | 1,413.74 | 22,584 | 2,569,438 | 22,584 | 2,569,438 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ON SEMICONDUCTOR CORP | 209.12 | 209.12 | 1,317 | 149,934 | 1,317 | 149,934 | 半導体・半導体製造装置 |
| SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC | — | 26.34 | 914 | 104,048 | 914 | 104,048 | 半導体・半導体製造装置 |
| HOWMET AEROSPACE INC | 190.24 | 190.24 | 542 | 61,684 | 542 | 61,684 | 資本財 |
| QORVO INC | 60.42 | 60.42 | 911 | 103,687 | 911 | 103,687 | 半導体・半導体製造装置 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 46.83 | 46.01 | 2,904 | 330,457 | 2,904 | 330,457 | ヘルスケア機器・サービス |
| ARISTA NETWORKS INC | 32.97 | 129.52 | 1,639 | 186,551 | 1,639 | 186,551 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| EXACT SCIENCES CORP | 84.28 | 84.28 | 729 | 83,007 | 729 | 83,007 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JONES LANG LASALLE INC | 26.18 | — | — | — | — | — | 不動産 |
| EVERGY INC | 112.73 | 112.73 | 735 | 83,697 | 735 | 83,697 | 公益事業 |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | 39.92 | 39.92 | 886 | 100,862 | 886 | 100,862 | ソフトウェア・サービス |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 87.57 | 87.57 | 1,356 | 154,344 | 1,356 | 154,344 | 半導体・半導体製造装置 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 178 | 178 | 2,403 | 273,470 | 2,403 | 273,470 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| INGREDION INC | 33.2 | — | — | — | — | — | 食品・飲料・タバコ |
| NORDSON CORP | 32.07 | 28.84 | 756 | 86,014 | 756 | 86,014 | 資本財 |
| KROGER CO | 408.43 | 389.55 | 1,649 | 187,691 | 1,649 | 187,691 | 食品・生活必需品小売り |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT INC | 75.12 | 87.7 | 945 | 107,608 | 945 | 107,608 | メディア・娯楽 |
| DISCOVERY INC-C | 182.83 | 174.17 | 418 | 47,655 | 418 | 47,655 | メディア・娯楽 |
| POOL CORP | — | 21.07 | 1,180 | 134,263 | 1,180 | 134,263 | 小売 |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | — | 106.9 | 999 | 113,690 | 999 | 113,690 | 消費者サービス |
| DOCUSIGN INC | 90.78 | 100.78 | 2,534 | 288,363 | 2,534 | 288,363 | ソフトウェア・サービス |
| FOX CORP - CLASS B | 87.73 | 87.73 | 302 | 34,424 | 302 | 34,424 | メディア・娯楽 |
| DOW INC | 386.54 | 415.16 | 2,360 | 268,565 | 2,360 | 268,565 | 素材 |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 52.2 | 52.2 | 507 | 57,784 | 507 | 57,784 | 各種金融 |
| CBRE GROUP INC - A | 182.44 | 182.44 | 1,787 | 203,327 | 1,787 | 203,327 | 不動産 |
| COUPA SOFTWARE INC | 34.9 | 34.9 | 707 | 80,467 | 707 | 80,467 | ソフトウェア・サービス |
| KLA CORP | 81.57 | 81.57 | 3,375 | 384,052 | 3,375 | 384,052 | 半導体・半導体製造装置 |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 83.07 | 110.98 | 2,430 | 276,488 | 2,430 | 276,488 | ソフトウェア・サービス |
| COPART INC | 109.77 | 109.77 | 1,624 | 184,842 | 1,624 | 184,842 | 商業・専門サービス |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 61.17 | 61.17 | 1,386 | 157,767 | 1,386 | 157,767 | 小売 |
| NRG ENERGY INC | 135.47 | 135.47 | 496 | 56,455 | 496 | 56,455 | 公益事業 |
| DISCOVERY INC - A | 70.75 | 70.75 | 173 | 19,793 | 173 | 19,793 | メディア・娯楽 |
| TWILIO INC - A | 65.43 | 89.93 | 2,637 | 300,013 | 2,637 | 300,013 | ソフトウェア・サービス |
| CORTEVA INC | 417.98 | 393.48 | 1,833 | 208,565 | 1,833 | 208,565 | 素材 |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 136.32 | 133.59 | 4,558 | 518,619 | 4,558 | 518,619 | 資本財 |
| IDEX CORP | 38.39 | 38.39 | 899 | 102,385 | 899 | 102,385 | 資本財 |
| SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A | 224.6 | — | — | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 12.88 | 12.88 | 262 | 29,921 | 262 | 29,921 | 保険 |
| EPAM SYSTEMS INC | 31.28 | 30.95 | 1,962 | 223,302 | 1,962 | 223,302 | ソフトウェア・サービス |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 20.56 | 15.27 | 491 | 55,960 | 491 | 55,960 | 資本財 |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 228.2 | 228.2 | 735 | 83,702 | 735 | 83,702 | 各種金融 |
| CERNER CORP | 155.37 | 155.37 | 1,132 | 128,790 | 1,132 | 128,790 | ヘルスケア機器・サービス |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 156.85 | 153.31 | 1,843 | 209,758 | 1,843 | 209,758 | ソフトウェア・サービス |
| RESMED INC | 80.36 | 75.95 | 1,951 | 222,000 | 1,951 | 222,000 | ヘルスケア機器・サービス |
| BATH & BODY WORKS INC | — | 154 | 1,168 | 132,928 | 1,168 | 132,928 | 小売 |
| DATADOG INC - CLASS A | 68.59 | 104.23 | 1,907 | 216,994 | 1,907 | 216,994 | ソフトウェア・サービス |
| VISTRA CORP | 257.77 | 257.77 | 517 | 58,916 | 517 | 58,916 | 公益事業 |
| GENERAC HOLDINGS INC | — | 33 | 1,401 | 159,404 | 1,401 | 159,404 | 資本財 |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|----------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価金額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| LOWE'S COS INC | 406.63 | 377.98 | 9,395 | 1,068,963 | 小売 |
| UNITED RENTALS INC | 35.96 | 41.13 | 1,468 | 167,062 | 資本財 |
| ELI LILLY & CO | 463.55 | 439.37 | 11,196 | 1,273,821 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZENDESK INC | — | 60.67 | 577 | 65,648 | ソフトウェア・サービス |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 80.29 | 80.29 | 691 | 78,630 | 商業・専門サービス |
| LAM RESEARCH CORP | 75.81 | 77.79 | 5,293 | 602,289 | 半導体・半導体製造装置 |
| OKTA INC | 59.12 | 63.06 | 1,410 | 160,425 | ソフトウェア・サービス |
| CARVANA CO | — | 38.03 | 1,110 | 126,325 | 小売 |
| LOEWS CORP | 139.14 | 127.27 | 701 | 79,796 | 保険 |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 12.2 | 12.2 | 914 | 104,038 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MARKEL CORP | 7.02 | 7.02 | 873 | 99,333 | 保険 |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 74.11 | 98.74 | 2,217 | 252,274 | ソフトウェア・サービス |
| NORTONLIFELOCK INC | 313.47 | 313.47 | 793 | 90,264 | ソフトウェア・サービス |
| ROLLINS INC | 76.62 | 114.93 | 406 | 46,196 | 商業・専門サービス |
| ETSY INC | — | 71.68 | 2,017 | 229,547 | 小売 |
| DYNATRACE INC | 111.94 | 95.87 | 618 | 70,318 | ソフトウェア・サービス |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 116.2 | 86.77 | 592 | 67,464 | 保険 |
| PLUG POWER INC | — | 285.84 | 1,189 | 135,348 | 資本財 |
| MCDONALD'S CORP | 398.83 | 402.64 | 10,078 | 1,146,583 | 消費者サービス |
| CABLE ONE INC | 2.46 | 2.46 | 449 | 51,104 | メディア・娯楽 |
| 3M CO | 310.51 | 306.04 | 5,393 | 613,600 | 資本財 |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 77.45 | 105.66 | 775 | 88,173 | 各種金融 |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 1,283.26 | 1,284.02 | 43,403 | 4,938,042 | メディア・娯楽 |
| ENPHASE ENERGY INC | — | 72.93 | 1,872 | 212,998 | 半導体・半導体製造装置 |
| ANSYS INC | 44.7 | 44.7 | 1,777 | 202,261 | ソフトウェア・サービス |
| COSTAR GROUP INC | 20.54 | 205.4 | 1,642 | 186,923 | 商業・専門サービス |
| IAC/INTERACTIVECORP | — | 39.74 | 519 | 59,142 | メディア・娯楽 |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 15.05 | 100.46 | 3,664 | 416,919 | ソフトウェア・サービス |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 115.46 | 115.46 | 906 | 103,090 | ソフトウェア・サービス |
| VIATRIS INC | 630.72 | 630.72 | 789 | 89,839 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOORDASH INC - A | — | 38.44 | 703 | 80,036 | 小売 |
| ZSCALER INC | 42.74 | 45.51 | 1,619 | 184,283 | ソフトウェア・サービス |
| AMETEK INC | 128.23 | 121.71 | 1,704 | 193,871 | 資本財 |
| MODERNA INC | 144.09 | 178.13 | 6,564 | 746,816 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOLLAR TREE INC | 120.47 | 120.47 | 1,702 | 193,732 | 小売 |
| PELTON INTERACTIVE INC-A | 102.16 | 125.99 | 559 | 63,628 | 耐久消費財・アパレル |
| FOX CORP - CLASS A | 169.62 | 169.62 | 626 | 71,246 | メディア・娯楽 |
| PHILLIPS 66 | 224.92 | 224.92 | 1,571 | 178,765 | エネルギー |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 258.78 | 221.98 | 913 | 103,872 | 消費者サービス |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 65.42 | 130.84 | 1,138 | 129,490 | 食品・飲料・タバコ |
| METLIFE INC | 415.34 | 397.03 | 2,377 | 270,523 | 保険 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 349.76 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 92.41 | 92.12 | 2,390 | 271,968 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 62.19 | 62.19 | 2,118 | 240,972 | 資本財 |
| MERCK & CO. INC. | 1,353.01 | 1,364.93 | 10,221 | 1,162,952 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MASCO CORP | 148.85 | 148.85 | 1,002 | 114,038 | 資本財 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 266.25 | 266.25 | 4,447 | 505,954 | 保険 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 422.07 | 445.47 | 2,539 | 288,933 | 各種金融 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 147.15 | 147.15 | 2,218 | 252,407 | 消費者サービス |
| WORKDAY INC-CLASS A | 90.8 | 98.64 | 2,777 | 316,007 | ソフトウェア・サービス |
| SUNRUN INC | 61.12 | 106.69 | 510 | 58,093 | 資本財 |
| BAKER HUGHES CO | 319.74 | 374.18 | 880 | 100,168 | エネルギー |
| AMERCO | 3.9 | 6.5 | 466 | 53,039 | 運輸 |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | — | 451.11 | 3,384 | 385,023 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHENIERE ENERGY INC | 117.47 | 137.63 | 1,467 | 166,916 | エネルギー |
| NETAPP INC | 109.19 | 109.19 | 999 | 113,691 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|----------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| NIKE INC -CL B | 665.94 | 687.23 | 11,673 | 1,328,148 | 耐久消費財・アパレル |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 139.42 | 137.09 | 3,684 | 419,146 | 運輸 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 127.45 | 287.04 | 2,422 | 275,621 | 半導体・半導体製造装置 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 82.95 | 82.15 | 2,927 | 333,089 | 資本財 |
| NEWMONT CORP | 418.82 | 418.82 | 2,320 | 263,976 | 素材 |
| MCKESSON CORP | 84.11 | 84.11 | 1,877 | 213,651 | ヘルスケア機器・サービス |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 138.14 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 838.74 | 843.16 | 7,365 | 837,916 | 食品・飲料・タバコ |
| NUCOR CORP | 154.55 | 154.55 | 1,732 | 197,054 | 素材 |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A | — | — | 1,018 | 115,922 | メディア・娯楽 |
| WESTERN UNION CO | 218.4 | 218.4 | 352 | 40,153 | ソフトウェア・サービス |
| NEWELL BRANDS INC | 251.06 | 175.87 | 393 | 44,719 | 耐久消費財・アパレル |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 442.07 | 485.8 | 1,460 | 166,140 | エネルギー |
| PAYCHEX INC | 177.34 | 177.29 | 2,193 | 249,566 | ソフトウェア・サービス |
| ALTRIA GROUP INC | 977.25 | 989.56 | 4,302 | 489,507 | 食品・飲料・タバコ |
| P G & E CORP | 635.37 | 765.38 | 947 | 107,801 | 公益事業 |
| PFIZER INC | 2,976.7 | 3,012.01 | 15,782 | 1,795,624 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| XCEL ENERGY INC | 269.59 | 292.37 | 1,917 | 218,171 | 公益事業 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 66.91 | 66.91 | 2,068 | 235,328 | 資本財 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 88.58 | 121.84 | 2,234 | 254,168 | エネルギー |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 1,319.2 | 1,315.39 | 19,601 | 2,230,112 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| EXELON CORP | 508.37 | 508.37 | 2,753 | 313,304 | 公益事業 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 115.19 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NVR INC | 1.73 | 1.73 | 913 | 103,956 | 耐久消費財・アパレル |
| CONOCOPHILLIPS | 557.97 | 734.21 | 5,297 | 602,676 | エネルギー |
| ABIOMED INC | 22.88 | 22.88 | 730 | 83,068 | ヘルスケア機器・サービス |
| PEPSICO INC | 743.95 | 744.41 | 12,218 | 1,390,126 | 食品・飲料・タバコ |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 207.28 | 207.28 | 2,177 | 247,684 | 保険 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 342.23 | 339.89 | 12,433 | 1,414,599 | ソフトウェア・サービス |
| PENTAIR INC | 82.2 | 82.2 | 631 | 71,822 | 資本財 |
| QUALCOMM INC | 604.16 | 608.94 | 11,188 | 1,272,934 | 半導体・半導体製造装置 |
| ADVANCE AUTO PARTS INC | 34.26 | 34.26 | 778 | 88,584 | 小売 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 141.24 | 141.24 | 1,001 | 113,960 | 保険 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 52.97 | 54.95 | 3,595 | 409,108 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REPUBLIC SERVICES INC | 114.15 | 114.15 | 1,577 | 179,517 | 商業・専門サービス |
| BOOKING HOLDINGS INC | 22.15 | 22.31 | 4,868 | 553,839 | 消費者サービス |
| ROSS STORES INC | 187.92 | 187.92 | 2,098 | 238,725 | 小売 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 46.82 | 46.82 | 625 | 71,218 | 素材 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 68.14 | 68.14 | 1,067 | 121,478 | ヘルスケア機器・サービス |
| ROBERT HALF INTL INC | 55.55 | 55.55 | 637 | 72,527 | 商業・専門サービス |
| RALPH LAUREN CORP | 19.71 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| RPM INTERNATIONAL INC | 76.21 | 76.96 | 715 | 81,445 | 素材 |
| PERKINELMER INC | 56.24 | 56.24 | 1,041 | 118,511 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HEICO CORP | 18.88 | 18.88 | 264 | 30,110 | 資本財 |
| HEICO CORP-CLASS A | 44.35 | 45.7 | 580 | 66,030 | 資本財 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 557.26 | 470.41 | 1,107 | 125,982 | 銀行 |
| CHEVRON CORP | 1,033.25 | 1,041.57 | 11,962 | 1,360,965 | エネルギー |
| EDISON INTERNATIONAL | 212.5 | 217.01 | 1,433 | 163,121 | 公益事業 |
| IPG PHOTONICS CORP | 17.76 | 17.76 | 289 | 32,971 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TESLA INC | 395.14 | 438.7 | 49,879 | 5,674,819 | 自動車・自動車部品 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 80.07 | 91.29 | 1,681 | 191,259 | 資本財 |
| SYNOPSIS INC | 78.69 | 78.69 | 2,800 | 318,594 | ソフトウェア・サービス |
| SOUTHERN CO/THE | 573.36 | 556.86 | 3,498 | 397,989 | 公益事業 |
| SYSCO CORP | 251.65 | 268.62 | 1,966 | 223,705 | 食品・生活必需品小売り |
| TRAVELERS COS INC/THE | 131.26 | 131.26 | 2,000 | 227,585 | 保険 |
| SIGNATURE BANK | 25.08 | — | — | — | 銀行 |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|----------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| SCHLUMBERGER LTD | 734.44 | 734.44 | 2,177 | 247,747 | エネルギー |
| AT&T INC | 3,819.17 | 3,854.89 | 9,209 | 1,047,745 | 電気通信サービス |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 96.2 | 70.76 | 315 | 35,856 | 運輸 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 43.3 | 136.16 | 4,551 | 517,830 | 素材 |
| SEMPRA ENERGY | 153.04 | 163.53 | 2,031 | 231,071 | 公益事業 |
| TIFFANY & CO | 55.41 | — | — | — | 小売 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 126.34 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 20.16 | 20.16 | 1,050 | 119,560 | ソフトウェア・サービス |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 493.45 | 498.76 | 9,694 | 1,102,988 | 半導体・半導体製造装置 |
| SALESFORCE.COM INC | 481.87 | 522.57 | 15,506 | 1,764,202 | ソフトウェア・サービス |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 386.44 | 388.03 | 3,040 | 345,929 | 資本財 |
| TERADYNE INC | 85.42 | 85.42 | 1,319 | 150,098 | 半導体・半導体製造装置 |
| UNION PACIFIC CORP | 364.9 | 359.04 | 8,597 | 978,145 | 運輸 |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 816.34 | 820.39 | 6,804 | 774,126 | 資本財 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 379.28 | 391.13 | 8,004 | 910,624 | 運輸 |
| DEXCOM INC | 47.65 | 50.47 | 2,881 | 327,872 | ヘルスケア機器・サービス |
| AMEREN CORPORATION | 124.54 | 147.6 | 1,255 | 142,886 | 公益事業 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 505.11 | 506.62 | 22,899 | 2,605,244 | ヘルスケア機器・サービス |
| VERISIGN INC | 52.27 | 52.27 | 1,277 | 145,374 | ソフトウェア・サービス |
| VALERO ENERGY CORP | 220.07 | 214.47 | 1,462 | 166,336 | エネルギー |
| ULTA BEAUTY INC | 27.65 | 27.65 | 1,109 | 126,276 | 小売 |
| WALT DISNEY CO/THE | 962.03 | 976.83 | 14,438 | 1,642,670 | メディア・娯楽 |
| WELLS FARGO & CO | 2,103.54 | 2,228.62 | 10,955 | 1,246,452 | 銀行 |
| INSULET CORP | 34 | 34 | 1,005 | 114,447 | ヘルスケア機器・サービス |
| WASTE MANAGEMENT INC | 220.23 | 220.23 | 3,674 | 418,002 | 商業・専門サービス |
| WHIRLPOOL CORP | 32.12 | 32.12 | 715 | 81,410 | 耐久消費財・アパレル |
| WALMART INC | 759.45 | 833.65 | 11,890 | 1,352,765 | 食品・生活必需品小売り |
| WYNN RESORTS LTD | 49.13 | 49.13 | 407 | 46,393 | 消費者サービス |
| TJX COMPANIES INC | 649.28 | 638.82 | 4,514 | 513,619 | 小売 |
| WATERS CORP | 35.27 | 34.25 | 1,168 | 132,960 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WASTE CONNECTIONS INC | 135.56 | 135.56 | 1,859 | 211,583 | 商業・専門サービス |
| WESTERN DIGITAL CORP | 148.57 | 148.57 | 876 | 99,709 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 164.38 | 164.38 | 1,487 | 169,229 | 公益事業 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 275.32 | 272.31 | 1,749 | 199,051 | 公益事業 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 901.86 | 908.92 | 17,841 | 2,029,792 | ソフトウェア・サービス |
| PPL CORP | 427.27 | 395.61 | 1,125 | 128,004 | 公益事業 |
| PULTEGROUP INC | 157.55 | 130.75 | 673 | 76,623 | 耐久消費財・アパレル |
| PPG INDUSTRIES INC | 122.56 | 122.56 | 1,928 | 219,417 | 素材 |
| NORTHERN TRUST CORP | 112.14 | 110.23 | 1,322 | 150,415 | 各種金融 |
| NVIDIA CORP | 328.93 | 1,335.64 | 44,578 | 5,071,675 | 半導体・半導体製造装置 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 225.26 | 231.68 | 4,653 | 529,484 | 銀行 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 149.49 | 149.49 | 1,224 | 139,257 | 食品・飲料・タバコ |
| NETFLIX INC | 235.71 | 238.52 | 15,833 | 1,801,424 | メディア・娯楽 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 211.85 | 211.63 | 13,729 | 1,562,052 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GLOBE LIFE INC | 60.4 | 43.33 | 383 | 43,612 | 保険 |
| TEXTRON INC | 118.03 | 118.03 | 859 | 97,744 | 資本財 |
| NEWS CORP - CLASS A | 166.62 | 231.02 | 504 | 57,349 | メディア・娯楽 |
| OMNICOM GROUP | 104.17 | 104.17 | 702 | 79,961 | メディア・娯楽 |
| ORACLE CORP | 1,104.15 | 1,012.06 | 9,406 | 1,070,130 | ソフトウェア・サービス |
| MASTERCARD INC - A | 478.11 | 475.6 | 15,362 | 1,747,775 | ソフトウェア・サービス |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC | — | 497.58 | 644 | 73,309 | 電気通信サービス |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 56.03 | 56.57 | 2,723 | 309,879 | 資本財 |
| YUM! BRANDS INC | 155.49 | 155.49 | 1,947 | 221,568 | 消費者サービス |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 96.29 | 96.29 | 436 | 49,658 | 食品・飲料・タバコ |
| BANK OF AMERICA CORP | 4,184.01 | 4,143.47 | 18,890 | 2,149,124 | 銀行 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 90.8 | 90.8 | 793 | 90,286 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|----------|---------|------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価金額 | 価額 | |
| | | | 外貨 | 邦貨 | 換算金額 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 370.48 | 370.2 | 5,843 | 664,869 | 各種金融 |
| ANALOG DEVICES INC | 192.98 | 292.73 | 5,362 | 610,127 | 半導体・半導体製造装置 |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 632.79 | 656.29 | 10,625 | 1,208,919 | 半導体・半導体製造装置 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 447.45 | 447.45 | 2,458 | 279,730 | 保険 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 90.36 | 118.9 | 830 | 94,541 | 消費者サービス |
| AVERY DENNISON CORP | 48.32 | 42.32 | 912 | 103,772 | 素材 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 287.37 | 293.48 | 2,339 | 266,145 | ソフトウェア・サービス |
| EMERSON ELECTRIC CO | 311.78 | 311.78 | 2,832 | 322,291 | 資本財 |
| AMGEN INC | 316.21 | 311.56 | 6,339 | 721,223 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EATON CORP PLC | 212.53 | 213.26 | 3,569 | 406,107 | 資本財 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 88.81 | 88.81 | 2,015 | 229,328 | 食品・飲料・タバコ |
| APPLIED MATERIALS INC | 482.6 | 496.83 | 7,513 | 854,761 | 半導体・半導体製造装置 |
| CME GROUP INC | 187.12 | 187.12 | 4,216 | 479,696 | 各種金融 |
| ECOLAB INC | 139.12 | 141.57 | 3,215 | 365,857 | 素材 |
| EQUIFAX INC | 61.27 | 68.41 | 1,943 | 221,084 | 商業・専門サービス |
| GILEAD SCIENCES INC | 661.68 | 656.73 | 4,639 | 527,869 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| STATE STREET CORP | 186.94 | 186.94 | 1,742 | 198,198 | 各種金融 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 828.87 | 773 | 6,191 | 704,433 | 各種金融 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 264.34 | 264.34 | 2,009 | 228,652 | ヘルスケア機器・サービス |
| CAMPBELL SOUP CO | 106.38 | 106.38 | 438 | 49,863 | 食品・飲料・タバコ |
| CROWN HOLDINGS INC | 68.63 | 68.63 | 743 | 84,639 | 素材 |
| CARDINAL HEALTH INC | 151.14 | 151.14 | 717 | 81,625 | ヘルスケア機器・サービス |
| FEDEX CORP | 134.81 | 130.83 | 3,147 | 358,077 | 運輸 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 236.54 | 236.54 | 3,477 | 395,647 | 各種金融 |
| FMC CORP | 66.76 | 66.76 | 691 | 78,641 | 素材 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 48.71 | 139.22 | 2,049 | 233,135 | 素材 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 64.9 | 64.9 | 534 | 60,819 | ソフトウェア・サービス |
| INTEL CORP | 2,270.51 | 2,177.38 | 10,886 | 1,238,602 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 196.26 | 196.26 | 667 | 75,961 | メディア・娯楽 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 183.31 | 183.31 | 1,257 | 143,087 | 保険 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 166.9 | 168.69 | 4,016 | 456,977 | 資本財 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 676.56 | 676.56 | 424 | 48,261 | メディア・娯楽 |
| ILLUMINA INC | 76.55 | 76.55 | 2,838 | 322,941 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 64.1 | 64 | 711 | 80,902 | ソフトウェア・サービス |
| SNAP-ON INC | 31.57 | 31.06 | 661 | 75,204 | 資本財 |
| CARMAX INC | 84.27 | 84.27 | 1,234 | 140,436 | 小売 |
| COMERICA INC | 76.91 | - | - | - | 銀行 |
| DANAHER CORP | 342.7 | 346.32 | 11,308 | 1,286,515 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DUKE ENERGY CORP | 398.62 | 420.41 | 4,213 | 479,352 | 公益事業 |
| TARGET CORP | 270.76 | 268.17 | 6,681 | 760,179 | 小売 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 69.27 | 69.27 | 1,011 | 115,131 | 商業・専門サービス |
| CINTAS CORP | 46.15 | 51.69 | 2,247 | 255,654 | 商業・専門サービス |
| CONAGRA BRANDS INC | 246.39 | 246.39 | 776 | 88,328 | 食品・飲料・タバコ |
| CLOROX COMPANY | 65.42 | 65.42 | 1,106 | 125,902 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| ENTERGY CORP | 108.66 | 108.66 | 1,141 | 129,890 | 公益事業 |
| MICROSOFT CORP | 3,840.36 | 3,828.65 | 128,883 | 14,663,115 | ソフトウェア・サービス |
| INCYTE CORP | 92.43 | 92.43 | 650 | 73,999 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CVS HEALTH CORP | 706.17 | 693.53 | 6,381 | 726,064 | ヘルスケア機器・サービス |
| MEDTRONIC PLC | 720.39 | 726.98 | 8,017 | 912,109 | ヘルスケア機器・サービス |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 595.08 | 612.23 | 5,273 | 599,994 | 半導体・半導体製造装置 |
| BLACKROCK INC | 82.25 | 82.52 | 7,657 | 871,234 | 各種金融 |
| HASBRO INC | 74.91 | 74.91 | 742 | 84,483 | 耐久消費財・アパレル |
| KEYCORP | 511.28 | 511.28 | 1,167 | 132,798 | 銀行 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 51 | 48.66 | 1,441 | 163,972 | 運輸 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 772.58 | 751.11 | 4,554 | 518,191 | 食品・飲料・タバコ |
| COOPER COS INC/THE | 27.71 | 27.71 | 1,056 | 120,172 | ヘルスケア機器・サービス |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|--------|-------|---------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| CHUBB LTD | 245.03 | 245.24 | 4,537 | 516,279 | 保険 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 41.3 | 41.3 | 513 | 58,461 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ALLSTATE CORP | 166.54 | 164.19 | 1,857 | 211,344 | 保険 |
| EBAY INC | 366.68 | 355.51 | 2,508 | 285,349 | 小売 |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 70.27 | 70.27 | 774 | 88,084 | 素材 |
| XILINX INC | 128.76 | 128.76 | 3,001 | 341,439 | 半導体・半導体製造装置 |
| DISH NETWORK CORP-A | 129.37 | 129.37 | 428 | 48,762 | メディア・娯楽 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 122.55 | 124 | 4,216 | 479,724 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| TRIMBLE INC | 127.59 | 127.59 | 1,104 | 125,606 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LENNAR CORP-A | 144.94 | 144.94 | 1,554 | 176,853 | 耐久消費財・アパレル |
| LEAR CORP | 27.49 | 37.36 | 631 | 71,832 | 自動車・自動車部品 |
| STRYKER CORP | 182.98 | 179.83 | 4,378 | 498,182 | ヘルスケア機器・サービス |
| AES CORP | 336.56 | 336.56 | 794 | 90,441 | 公益事業 |
| PROGRESSIVE CORP | 305.43 | 305.43 | 2,900 | 330,009 | 保険 |
| AIRBNB INC-CLASS A | — | 65.54 | 1,180 | 134,276 | 消費者サービス |
| ALLEGHANY CORP | 6.89 | 6.89 | 457 | 52,106 | 保険 |
| ALTICE USA INC- A | 180.72 | 96.67 | 154 | 17,586 | メディア・娯楽 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 35.39 | 35.39 | 488 | 55,619 | 保険 |
| AMPHENOL CORP-CL A | 156.98 | 313.96 | 2,603 | 296,219 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ARAMARK | 132.42 | 132.42 | 455 | 51,794 | 消費者サービス |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | — | 88.08 | 440 | 50,164 | ソフトウェア・サービス |
| ATMOS ENERGY CORP | 69.65 | 69.65 | 653 | 74,327 | 公益事業 |
| AVALARA INC | 43.19 | 43.19 | 616 | 70,118 | ソフトウェア・サービス |
| AVANTOR INC | 256.06 | 304.28 | 1,210 | 137,710 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PACCAR INC | 180.41 | 180.41 | 1,553 | 176,763 | 資本財 |
| BIO-TECHNE CORP | — | 19.91 | 955 | 108,657 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CDK GLOBAL INC | 58.08 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| CMS ENERGY CORP | 140.4 | 169.96 | 1,038 | 118,203 | 公益事業 |
| CARLYLE GROUP INC/THE | 93.41 | 100.94 | 573 | 65,228 | 各種金融 |
| CARRIER GLOBAL CORP | 456.84 | 432.53 | 2,421 | 275,471 | 資本財 |
| CATALENT INC | 89.35 | 89.35 | 1,196 | 136,175 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 254.64 | 320.03 | 850 | 96,813 | 公益事業 |
| CENTURYLINK INC | 497.58 | — | — | — | 電気通信サービス |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | — | 69.79 | 788 | 89,698 | ソフトウェア・サービス |
| CHEWY INC - CLASS A | — | 39.69 | 272 | 31,003 | 小売 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 124.85 | 124.85 | 1,170 | 133,164 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | — | 126.73 | 2,421 | 275,514 | ソフトウェア・サービス |
| DEVON ENERGY CORP | — | 361.96 | 1,589 | 180,863 | エネルギー |
| DOVER CORP | 82.53 | 82.25 | 1,413 | 160,763 | 資本財 |
| DRAFTKINGS INC - CL A | — | 167.42 | 589 | 67,046 | 消費者サービス |
| DROPBOX INC-CLASS A | 105.65 | 165.84 | 413 | 47,074 | ソフトウェア・サービス |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 208.11 | 208.11 | 628 | 71,479 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 138.81 | 139.09 | 673 | 76,652 | 公益事業 |
| FLIR SYSTEMS INC | 68.67 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 19.39 | 19.39 | 910 | 103,556 | 各種金融 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 43.71 | 43.71 | 930 | 105,912 | ソフトウェア・サービス |
| GARTNER INC | 45.68 | 45.68 | 1,484 | 168,902 | ソフトウェア・サービス |
| WW GRAINGER INC | 23.9 | 23.9 | 1,184 | 134,753 | 資本財 |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | 47.31 | 47.31 | 560 | 63,765 | ソフトウェア・サービス |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | 77.87 | — | — | — | 資本財 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 146.17 | 146.17 | 2,018 | 229,607 | 消費者サービス |
| HUBSPOT INC | — | 22.75 | 1,938 | 220,497 | ソフトウェア・サービス |
| IAC/INTERACTIVECORP | 39.74 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 191.4 | 191.4 | 903 | 102,824 | 素材 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | 67.6 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KELLOGG CO | 129.49 | 129.49 | 827 | 94,093 | 食品・飲料・タバコ |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期 | | 末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|--------|--------|-----------|------------------------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | 株数 | 株数 | | | |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 74.17 | 74.17 | | 395 | 44,967 | 食品・飲料・タバコ | |
| LIBERTY BROADBAND-A | 13.12 | 13.12 | | 205 | 23,336 | メディア・娯楽 | |
| LIBERTY BROADBAND-C | 54.18 | 81.96 | 1,310 | 149,137 | メディア・娯楽 | | |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 76.48 | 76.48 | | 380 | 43,270 | メディア・娯楽 | |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 102.88 | 102.88 | | 617 | 70,286 | メディア・娯楽 | |
| LYFT INC-A | - | 131.45 | | 549 | 62,542 | 運輸 | |
| M & T BANK CORP | 73.99 | 72.37 | 1,101 | 125,281 | 銀行 | | |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 12.58 | 12.58 | 1,932 | 219,867 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| MONGODB INC | 26.59 | 31.55 | 1,659 | 188,797 | ソフトウェア・サービス | | |
| MOODY'S CORP | 90.41 | 92.47 | 3,673 | 417,940 | 各種金融 | | |
| BIOGEN INC | 85.16 | 79.87 | 1,885 | 214,548 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| NATIONAL-OILWELL VARCO INC. | 258.92 | - | - | - | エネルギー | | |
| OGE ENERGY CORP | 118.7 | - | - | - | 公益事業 | | |
| NOVAVAX INC | - | 36.01 | 698 | 79,462 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| ONEOK INC | 255.89 | 247.25 | 1,544 | 175,697 | エネルギー | | |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 211.11 | 211.11 | 1,764 | 200,742 | 資本財 | | |
| OWENS CORNING | 52.05 | 52.05 | 453 | 51,596 | 資本財 | | |
| PPD INC | - | 64.13 | 302 | 34,437 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | - | 820.71 | 1,729 | 196,735 | ソフトウェア・サービス | | |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 59.96 | 59.96 | 397 | 45,220 | 公益事業 | | |
| PINTEREST INC- CLASS A | 210.89 | 285.63 | 1,157 | 131,739 | メディア・娯楽 | | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 64.26 | 96.39 | 969 | 110,287 | 各種金融 | | |
| ROKU INC | 56.2 | 60.12 | 1,390 | 158,192 | メディア・娯楽 | | |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC | 38.28 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| HENRY SCHEIN INC | 75.59 | 75.59 | 557 | 63,441 | ヘルスケア機器・サービス | | |
| SEALED AIR CORP | 78.95 | 78.95 | 506 | 57,665 | 素材 | | |
| SMITH (A. O.) CORP | 71.57 | 71.57 | 578 | 65,840 | 資本財 | | |
| STEEL DYNAMICS INC | 101.91 | 101.91 | 625 | 71,189 | 素材 | | |
| UNITY SOFTWARE INC | - | 28.53 | 485 | 55,286 | ソフトウェア・サービス | | |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A | - | 38.14 | 550 | 62,679 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| STARBUCKS CORP | 629.62 | 638.21 | 7,066 | 804,001 | 消費者サービス | | |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 21.4 | 241 | 2,580 | 293,543 | ソフトウェア・サービス | | |
| TWITTER INC | 407.95 | 407.95 | 1,867 | 212,476 | メディア・娯楽 | | |
| UGI CORP | 105.88 | 105.88 | 459 | 52,279 | 公益事業 | | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 496.19 | 671.87 | 2,667 | 303,461 | 運輸 | | |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 47.18 | - | - | - | ヘルスケア機器・サービス | | |
| VOYA FINANCIAL INC | 73.08 | 73.08 | 454 | 51,756 | 各種金融 | | |
| WAYFAIR INC- CLASS A | 32.66 | 37.56 | 1,004 | 114,312 | 小売 | | |
| WESTROCK CO | 130.34 | 130.34 | 601 | 68,390 | 素材 | | |
| PTC INC | 54.62 | 54.62 | 602 | 68,554 | ソフトウェア・サービス | | |
| WILLIAMS COS INC | 648.02 | 648.02 | 1,815 | 206,504 | エネルギー | | |
| PERRIGO CO PLC | 61.87 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| ZILLOW GROUP INC - A | - | 31.54 | 170 | 19,434 | 不動産 | | |
| ZILLOW GROUP INC - C | 79.06 | 79.06 | 428 | 48,805 | 不動産 | | |
| ZIONS BANCORP NA | 88.74 | - | - | - | 銀行 | | |
| BOSTON BEER COMPANY INC-A | - | 4.67 | 206 | 23,503 | 食品・飲料・タバコ | | |
| OAK STREET HEALTH INC | - | 62.12 | 190 | 21,675 | ヘルスケア機器・サービス | | |
| INTUIT INC | 140.94 | 147.65 | 10,256 | 1,166,899 | ソフトウェア・サービス | | |
| BORGWARNER INC | 120.75 | 120.75 | 541 | 61,558 | 自動車・自動車部品 | | |
| BEST BUY CO INC | 121.32 | 121.32 | 1,346 | 153,139 | 小売 | | |
| BALL CORP | 181.03 | 171.66 | 1,627 | 185,161 | 素材 | | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 745.56 | 745.56 | 2,877 | 327,329 | ヘルスケア機器・サービス | | |
| VULCAN MATERIALS CO | 66.98 | 75.55 | 1,506 | 171,347 | 素材 | | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 135.3 | 135.3 | 2,572 | 292,637 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| VF CORP | 171.17 | 171.17 | 1,262 | 143,581 | 耐久消費財・アパレル | | |
| VIAKOMCBS INC - CLASS B | 323.28 | 323.81 | 1,045 | 118,919 | メディア・娯楽 | | |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 株数 | 期 | | 末 | | 業種等 |
|------------------------------|-----------|------------|---------------------|---------------------|------------------------|------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | 価額 | |
| | | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 28.63 | 28.63 | 499 | 56,799 | 耐久消費財・アパレル | |
| CARNIVAL CORP | 222.89 | 481.56 | 874 | 99,493 | 消費者サービス | |
| COMCAST CORP-CLASS A | 2,440.57 | 2,468.63 | 12,720 | 1,447,251 | メディア・娯楽 | |
| APTIV PLC | 141.47 | 141.47 | 2,341 | 266,356 | 自動車・自動車部品 | |
| STERIS PLC | 42.87 | 52.82 | 1,197 | 136,225 | ヘルスケア機器・サービス | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 68.23 | 68.23 | 1,571 | 178,840 | 保険 | |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 126.11 | 122.53 | 634 | 72,238 | 食品・飲料・タバコ | |
| LINDE PLC | 282.34 | 280.91 | 9,009 | 1,025,057 | 素材 | |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A | — | 74.31 | 307 | 34,949 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 180.26 | — | — | — | 商業・専門サービス | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 76 | 76 | 440 | 50,063 | 資本財 | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 144.57 | 144.57 | 3,237 | 368,330 | 半導体・半導体製造装置 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 69.05 | — | — | — | 資本財 | |
| SEA LTD-ADR | — | 37.25 | 1,109 | 126,273 | メディア・娯楽 | |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 115 | 115 | 671 | 76,368 | 資本財 | |
| TELEFLEX INC | 23.4 | 23.4 | 722 | 82,249 | ヘルスケア機器・サービス | |
| WIX.COM LTD | 27.03 | 31.94 | 509 | 57,912 | ソフトウェア・サービス | |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 20.55 | 20.55 | 363 | 41,372 | ソフトウェア・サービス | |
| ALLEGION PLC | 47.64 | 47.64 | 613 | 69,744 | 資本財 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 204.76 | 204.76 | 854 | 97,212 | 保険 | |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 127.59 | 127.59 | 2,461 | 280,055 | 資本財 | |
| NOVOCURE LTD | — | 45.17 | 421 | 47,972 | ヘルスケア機器・サービス | |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | — | 118 | 1,227 | 139,699 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 26.04 | 26.04 | 318 | 36,264 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| BEIGENE LTD-ADR | 22.91 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| DAIRY FARM INTL HLDGS-900 | 135 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り | |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 523 | 523 | 290 | 33,082 | 不動産 | |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD | 106 | — | — | — | 資本財 | |
| AMCOR PLC | 823.02 | 823.02 | 953 | 108,429 | 素材 | |
| AON PLC-CLASS A | 120.05 | 120.05 | 3,561 | 405,221 | 保険 | |
| IHS MARKIT LTD | 195.84 | 195.84 | 2,548 | 289,938 | 商業・専門サービス | |
| INVESCO LTD | 183.28 | 183.28 | 425 | 48,459 | 各種金融 | |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR | — | 31.59 | 159 | 18,146 | 各種金融 | |
| CLARIVATE PLC | — | 199.39 | 455 | 51,788 | 商業・専門サービス | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 165,675.25 591銘柄 | 168,148.91 598銘柄 | 2,202,902 — | 250,624,236 <70.8%> |
| (カナダ) | | | | 千カナダ・ドル | | |
| IMPERIAL OIL LTD | 129.99 | 129.99 | 557 | 49,718 | エネルギー | |
| METRO INC/CN | 131.09 | 131.09 | 814 | 72,722 | 食品・生活必需品小売り | |
| HYDRO ONE LTD | 150.52 | 188.21 | 585 | 52,280 | 公益事業 | |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B | 248.14 | 248.14 | 840 | 75,062 | 素材 | |
| BALLARD POWER SYSTEMS INC | — | 170.08 | 332 | 29,709 | 資本財 | |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | — | 44.38 | 473 | 42,279 | 素材 | |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 10.26 | 10.26 | 2,262 | 201,964 | ソフトウェア・サービス | |
| WSP GLOBAL INC | 61.41 | 61.41 | 1,116 | 99,674 | 資本財 | |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD | 156.18 | 133.85 | 681 | 60,836 | 素材 | |
| ATCO LTD -CLASS I | 30.3 | 30.3 | 128 | 11,505 | 公益事業 | |
| AIR CANADA | 57.37 | 120.83 | 257 | 22,972 | 運輸 | |
| NUTRIEN LTD | 298.98 | 298.98 | 2,608 | 232,870 | 素材 | |
| QUEBECOR INC -CL B | 99.53 | 99.53 | 288 | 25,763 | メディア・娯楽 | |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 313.59 | 313.59 | 550 | 49,096 | 公益事業 | |
| LUNDIN MINING CORP | 282.09 | 464.46 | 483 | 43,198 | 素材 | |
| ALTAGAS LTD | 173.47 | 173.47 | 432 | 38,616 | 公益事業 | |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 241.17 | 243.35 | 1,312 | 117,187 | 素材 | |
| INTACT FINANCIAL CORP | 70.58 | 100.95 | 1,628 | 145,398 | 保険 | |
| BCE INC | 83.79 | 55.09 | 357 | 31,893 | 電気通信サービス | |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|----------|-------|---------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価金額 | 価額 | |
| | | | 外貨 | 邦貨 | 換算金額 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 101.65 | 101.65 | 1,829 | 163,282 | 素材 |
| SUNCOR ENERGY INC | 786.42 | 786.42 | 2,512 | 224,275 | エネルギー |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 169.93 | 169.93 | 1,731 | 154,515 | 銀行 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 633.07 | 633.07 | 5,155 | 460,143 | 銀行 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 235.13 | 235.13 | 3,423 | 305,559 | 銀行 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 966.93 | 984.88 | 9,217 | 822,753 | 銀行 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 767.31 | 770.35 | 9,993 | 892,042 | 銀行 |
| TC ENERGY CORP | 504.73 | 539.18 | 3,290 | 293,672 | エネルギー |
| BARRICK GOLD CORP | 930.98 | 930.98 | 2,274 | 203,011 | 素材 |
| THOMSON REUTERS CORP | 101.22 | 97.1 | 1,514 | 135,207 | 商業・専門サービス |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 91.48 | 91.48 | 339 | 30,302 | 食品・生活必需品小売り |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 201.36 | 182.36 | 1,052 | 93,953 | 電気通信サービス |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 138.08 | 134.47 | 868 | 77,538 | 素材 |
| KINROSS GOLD CORP | 635.01 | 635.01 | 488 | 43,644 | 素材 |
| BANK OF MONTREAL | 330.57 | 354.24 | 4,853 | 433,218 | 銀行 |
| CAMECO CORP | 266.96 | 188.9 | 601 | 53,669 | エネルギー |
| TELUS CORP | 152.22 | 152.22 | 448 | 40,068 | 電気通信サービス |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 35.7 | 30.01 | 522 | 46,622 | 小売 |
| IVANHOE MINES LTD-CL A | - | 326.98 | 337 | 30,149 | 素材 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 648.7 | 643.74 | 3,439 | 307,010 | エネルギー |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 13.93 | 13.93 | 789 | 70,467 | 保険 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 143.64 | 163.31 | 1,639 | 146,309 | 自動車・自動車部品 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 42.81 | 35.78 | 488 | 43,587 | 食品・生活必需品小売り |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 117.63 | 117.63 | 383 | 34,249 | 素材 |
| BLACKBERRY LTD | 259.93 | 259.93 | 326 | 29,140 | ソフトウェア・サービス |
| ENBRIDGE INC | 1,101.69 | 1,077.03 | 5,249 | 468,565 | エネルギー |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 998.1 | 998.1 | 2,387 | 213,104 | 保険 |
| BAUSCH HEALTH COS INC | 193.8 | 164.47 | 522 | 46,669 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 71.15 | 347.38 | 3,176 | 283,529 | 運輸 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 90.66 | 90.66 | 483 | 43,115 | 耐久消費財・アパレル |
| CGI INC | 128.82 | 114.93 | 1,234 | 110,208 | ソフトウェア・サービス |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 272.32 | 272.32 | 1,014 | 90,520 | メディア・娯楽 |
| IGM FINANCIAL INC | 64.33 | 49.49 | 241 | 21,588 | 各種金融 |
| CI FINANCIAL CORP | 110.41 | - | - | - | 各種金融 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 316.72 | 316.72 | 889 | 79,355 | 素材 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B | 459.24 | 442.7 | 2,103 | 187,737 | 食品・生活必需品小売り |
| YAMANA GOLD INC | 535.88 | 535.88 | 276 | 24,681 | 素材 |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS | 56.67 | 56.67 | 502 | 44,847 | 商業・専門サービス |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 730.84 | 694.48 | 5,130 | 457,914 | 各種金融 |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A | - | 63.36 | 302 | 26,988 | 公益事業 |
| B2GOLD CORP | 656.5 | 429.63 | 219 | 19,634 | 素材 |
| CAE INC | 128.91 | 128.91 | 406 | 36,291 | 資本財 |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 65.63 | 87.05 | 552 | 49,308 | 素材 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 378.75 | 386.87 | 6,335 | 565,496 | 運輸 |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A | 73.44 | 73.44 | 259 | 23,140 | 公益事業 |
| CANOPY GROWTH CORP | 112.51 | 112.51 | 158 | 14,150 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CENOVUS ENERGY INC | 540.18 | 750.6 | 1,190 | 106,259 | エネルギー |
| CRONOS GROUP INC | 80.26 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOLLARAMA INC | 170.25 | 170.25 | 960 | 85,723 | 小売 |
| EMERA INC | 142.79 | 142.79 | 847 | 75,644 | 公益事業 |
| FIRSTSERVICE CORP | - | 25.16 | 636 | 56,836 | 不動産 |
| FORTIS INC | 241.71 | 241.71 | 1,352 | 120,733 | 公益事業 |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | - | 99.13 | 507 | 45,285 | 商業・専門サービス |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 142 | 142 | 531 | 47,467 | 保険 |
| IA FINANCIAL CORP INC | 48.51 | 48.51 | 338 | 30,258 | 保険 |
| INTER PIPELINE LTD | 193.94 | - | - | - | エネルギー |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 評価額 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|-----------|----------|-----------|-------------|------------|-------------|
| | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| KEYERA CORP | 113.74 | — | 113.74 | 327 | — | 29,228 | エネルギー |
| LIGHTSPEED COMMERCE INC | — | — | 63.63 | 433 | — | 38,712 | ソフトウェア・サービス |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 86.83 | — | 86.83 | 841 | — | 75,070 | 食品・生活必需品小売り |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC | — | — | 30.84 | 378 | — | 33,812 | ソフトウェア・サービス |
| NORTHLAND POWER INC | — | — | 108.7 | 422 | — | 37,684 | 公益事業 |
| ONEX CORPORATION | 42.17 | — | 42.17 | 403 | — | 35,988 | 各種金融 |
| OPEN TEXT CORP | 136.65 | — | 136.65 | 847 | — | 75,672 | ソフトウェア・サービス |
| PARKLAND CORP | 76.66 | — | 76.66 | 261 | — | 23,381 | エネルギー |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 274.11 | — | 321.72 | 1,240 | — | 110,702 | エネルギー |
| POWER CORP OF CANADA | 332.78 | — | 317.68 | 1,328 | — | 118,613 | 保険 |
| RESTAURANT BRANDS INTERN | 145.1 | — | 145.1 | 1,058 | — | 94,495 | 消費者サービス |
| SSR MINING INC | 115.52 | — | — | — | — | — | 素材 |
| SAPUTO INC | 134.25 | — | 134.25 | 389 | — | 34,727 | 食品・飲料・タバコ |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 58.05 | — | 60.82 | 12,164 | — | 1,085,758 | ソフトウェア・サービス |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 324.94 | — | 305.5 | 2,097 | — | 187,255 | 保険 |
| TMX GROUP LTD | 31.42 | — | 31.42 | 404 | — | 36,069 | 各種金融 |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | — | — | 38.43 | 426 | — | 38,055 | 資本財 |
| 小計 | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 82銘柄 | 20,792.08 | 88銘柄 | 21,673.53 | 134,073 | 11,967,436 | |
| | 銘柄数 | <比率> | 銘柄数 | | — | <3.4%> | |
| (オーストラリア) | | | | | 千オーストラリア・ドル | | |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 944.4 | — | 944.4 | 322 | — | 26,178 | 運輸 |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 57.83 | — | 57.83 | 188 | — | 15,339 | 各種金融 |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 385.84 | — | 658.44 | 636 | — | 51,704 | 素材 |
| BHP GROUP LTD | 1,595.2 | — | 1,575.18 | 6,075 | — | 493,874 | 素材 |
| REA GROUP LTD | 28.33 | — | 28.33 | 456 | — | 37,077 | メディア・娯楽 |
| AUSNET SERVICES | 852.2 | — | 1,377.72 | 347 | — | 28,222 | 公益事業 |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | — | — | 37.94 | 493 | — | 40,146 | 消費者サービス |
| MEDIBANK PRIVATE LTD | 1,287.24 | — | 1,287.24 | 432 | — | 35,158 | 保険 |
| CIMIC GROUP LTD | 40.62 | — | — | — | — | — | 資本財 |
| SOUTH32 LTD | 3,006.71 | — | 2,763.48 | 986 | — | 80,197 | 素材 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 503.54 | — | 503.54 | 1,069 | — | 86,941 | エネルギー |
| WISETECH GLOBAL LTD | 79.09 | — | 79.09 | 409 | — | 33,309 | ソフトウェア・サービス |
| XERO LTD | — | — | 74.59 | 1,053 | — | 85,621 | ソフトウェア・サービス |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 52.94 | — | 140.25 | 436 | — | 35,468 | エネルギー |
| AFTERPAY LTD | 115.68 | — | 114.91 | 1,270 | — | 103,265 | ソフトウェア・サービス |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 921.05 | — | 884.48 | 1,556 | — | 126,542 | 素材 |
| COLES GROUP LTD | 664.43 | — | 735.52 | 1,326 | — | 107,802 | 食品・生活必需品小売り |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | — | — | 656.07 | 449 | — | 36,532 | 食品・生活必需品小売り |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 1,666.95 | — | 1,731.85 | 4,710 | — | 382,927 | 銀行 |
| WESTPAC BANKING CORP | 1,975.23 | — | 2,017.31 | 4,220 | — | 343,061 | 銀行 |
| SANTOS LTD | 845.86 | — | 1,003.76 | 641 | — | 52,139 | エネルギー |
| AUST AND NZ BANKING GROUP | 1,480.02 | — | 1,480.02 | 3,939 | — | 320,267 | 銀行 |
| RIO TINTO LTD | 193.36 | — | 193.36 | 1,844 | — | 149,936 | 素材 |
| ORIGIN ENERGY LTD | 1,094.48 | — | 880.6 | 433 | — | 35,219 | 公益事業 |
| EVOLUTION MINING LTD | 844.2 | — | 844.2 | 347 | — | 28,273 | 素材 |
| OIL SEARCH LTD | 1,056.18 | — | 1,056.18 | 412 | — | 33,570 | エネルギー |
| SEEK LTD | 181.86 | — | 172.66 | 592 | — | 48,141 | メディア・娯楽 |
| AGL ENERGY LTD | 324.92 | — | 324.92 | 173 | — | 14,077 | 公益事業 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 364.64 | — | 364.64 | 434 | — | 35,332 | 食品・飲料・タバコ |
| NEWCREST MINING LTD | 421.31 | — | 421.31 | 1,018 | — | 82,812 | 素材 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 949.46 | — | 960.41 | 9,006 | — | 732,156 | 銀行 |
| AMPOL LTD | 133.86 | — | 109.27 | 316 | — | 25,697 | エネルギー |
| ORICA LTD | 179.81 | — | 179.81 | 258 | — | 21,018 | 素材 |
| QBE INSURANCE GROUP LTD | 855.23 | — | 808.63 | 938 | — | 76,250 | 保険 |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 680.13 | — | 656.07 | 2,630 | — | 213,861 | 食品・生活必需品小売り |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 343.39 | — | — | — | — | — | 食品・飲料・タバコ |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 | |
|------------------------------|-----------|------------|-------------------|-------------------|------------------------|---------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| TABCORP HOLDINGS LTD | 1,308.04 | 1,128.17 | 562 | 45,762 | 消費者サービス | |
| CROWN RESORTS LTD | 218.63 | 218.63 | 242 | 19,727 | 消費者サービス | |
| QANTAS AIRWAYS LTD | 458.31 | 458.31 | 224 | 18,255 | 運輸 | |
| TELSTRA CORP LTD | 2,169.43 | 2,169.43 | 867 | 70,541 | 電気通信サービス | |
| AMP LTD | 2,235.04 | — | — | — | 各種金融 | |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | 247.13 | 261.08 | 1,434 | 116,579 | 素材 | |
| MACQUARIE GROUP LTD | 173.36 | 189.53 | 3,677 | 298,909 | 各種金融 | |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 307.49 | 307.49 | 1,371 | 111,456 | 消費者サービス | |
| CSL LTD | 241.83 | 247.47 | 7,597 | 617,586 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| WESFARMERS LTD | 596.74 | 606.28 | 3,529 | 286,885 | 小売 | |
| COCHLEAR LTD | 37.98 | 33.68 | 763 | 62,058 | ヘルスケア機器・サービス | |
| BLUESCOPE STEEL LTD | 230.89 | 254.62 | 517 | 42,079 | 素材 | |
| SUNCORP GROUP LTD | 639.33 | 639.33 | 680 | 55,349 | 保険 | |
| ASX LTD | 111.8 | 111.8 | 1,017 | 82,720 | 各種金融 | |
| COMPUTERSHARE LTD | 279.67 | 335.63 | 642 | 52,220 | ソフトウェア・サービス | |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 1,171.87 | 1,171.87 | 512 | 41,629 | 保険 | |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 210.81 | 242.58 | 1,035 | 84,201 | ヘルスケア機器・サービス | |
| BRAMBLES LTD | 837.26 | 746.38 | 753 | 61,279 | 商業・専門サービス | |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 94.46 | 94.46 | 625 | 50,832 | ヘルスケア機器・サービス | |
| TPG TELECOM LTD | 177.58 | — | — | — | 電気通信サービス | |
| REECE LTD | — | 193.09 | 452 | 36,823 | 資本財 | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 35,873.64 53銘柄 | 34,533.84 53銘柄 | 75,938 — | 6,173,027 <1.7%> |
| (香港) | | | 千香港・ドル | | | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 715 | 715 | 3,417 | 49,864 | 公益事業 | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 1,180 | 1,180 | 5,150 | 75,148 | 消費者サービス | |
| MTR CORP | 845 | 845 | 3,549 | 51,779 | 運輸 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 680 | 680 | 6,579 | 95,987 | 不動産 | |
| SINO LAND CO | 2,242 | 2,482 | 2,395 | 34,944 | 不動産 | |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A | 270 | 270 | 1,189 | 17,352 | 不動産 | |
| CLP HOLDINGS LTD | 851 | 851 | 6,535 | 95,355 | 公益事業 | |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 833.84 | 833.84 | 2,755 | 40,207 | 不動産 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 5,775.14 | 6,063.89 | 7,179 | 104,751 | 公益事業 | |
| HANG SENG BANK LTD | 388 | 388 | 5,466 | 79,762 | 銀行 | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 848.33 | 848.33 | 2,680 | 39,111 | 不動産 | |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 1,509.24 | 1,539.24 | 7,773 | 113,410 | 資本財 | |
| CK ASSET HOLDINGS LTD | 1,399.24 | 1,029.24 | 4,662 | 68,025 | 不動産 | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 629 | 629 | 27,990 | 408,381 | 各種金融 | |
| WH GROUP LTD | 5,345 | 5,815 | 2,965 | 43,268 | 食品・飲料・タバコ | |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 980 | 980 | 1,568 | 22,877 | 不動産 | |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 193 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| KERRY PROPERTIES LTD | 275 | — | — | — | 不動産 | |
| BANK OF EAST ASIA LTD | 872.2 | — | — | — | 銀行 | |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP | 460 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス | |
| XINYI GLASS HOLDINGS LTD | — | 940 | 1,821 | 26,578 | 資本財 | |
| SJM HOLDINGS LTD | 800 | 800 | 446 | 6,512 | 消費者サービス | |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 896 | 896 | 1,809 | 26,406 | 食品・飲料・タバコ | |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 1,020 | 910 | 3,662 | 53,439 | 不動産 | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 530 | 530 | 1,028 | 15,001 | 不動産 | |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 300 | 300 | 1,395 | 20,353 | 公益事業 | |
| PCCW LTD | 2,560 | — | — | — | 電気通信サービス | |
| AIA GROUP LTD | 6,482 | 6,540 | 54,870 | 800,562 | 保険 | |
| SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | — | 700 | 2,016 | 29,413 | 運輸 | |
| SANDS CHINA LTD | 1,160 | 1,160 | 2,166 | 31,614 | 消費者サービス | |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | — | 1,170 | 1,703 | 24,854 | 小売 | |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 705 | 705 | 11,611 | 169,409 | 資本財 | |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|-----------|-----------|---------------------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 1,875 | 1,875 | 4,500 | 65,655 | 銀行 |
| WYNN MACAU LTD | 708 | 708 | 509 | 7,427 | 消費者サービス |
| ESR CAYMAN LTD | — | 1,020 | 2,636 | 38,469 | 不動産 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 182,037 | 2,655,927 | |
| | 金額 比率 | 金額 比率 | — | < 0.8% > | |
| (シンガポール) | | | | | |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 645 | 647 | 千シンガポール・ドル 1,716 | 142,829 | 銀行 |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 663 | — | — | — | 資本財 |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 950 | 966 | 2,974 | 247,492 | 銀行 |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 779.66 | 779.66 | 382 | 31,853 | 運輸 |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | — | 1,366 | 460 | 38,305 | 不動産 |
| KEPPEL CORP LTD | 699 | 547 | 284 | 23,713 | 資本財 |
| UOL GROUP LTD | 217 | 172 | 118 | 9,832 | 不動産 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 258 | 258 | 180 | 15,027 | 不動産 |
| CAPITALAND LTD | 1,366 | — | — | — | 不動産 |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 51 | — | — | — | 小売 |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 1,834 | 1,812 | 2,054 | 170,980 | 銀行 |
| GENTING SINGAPORE LTD | 3,275 | 3,275 | 258 | 21,528 | 消費者サービス |
| VENTURE CORP LTD | 115 | 87 | 163 | 13,617 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 4,655.15 | 4,398.15 | 1,059 | 88,198 | 電気通信サービス |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING | 991 | 1,086 | 417 | 34,700 | 資本財 |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 428 | 428 | 395 | 32,871 | 各種金融 |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | 1,032 | 1,032 | 432 | 35,980 | 食品・飲料・タバコ |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 10,899 | 906,932 | |
| | 金額 比率 | 金額 比率 | — | < 0.3% > | |
| (ニュージーランド) | | | | | |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | 897.12 | 1,114.59 | 千ニュージーランド・ドル 485 | 37,633 | 電気通信サービス |
| MERIDIAN ENERGY LTD | 677.01 | 884.45 | 397 | 30,788 | 公益事業 |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 707.11 | 707.11 | 550 | 42,679 | 運輸 |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 286.78 | 312.5 | 1,031 | 79,952 | ヘルスケア機器・サービス |
| RYMAN HEALTHCARE LTD | 240.38 | 240.28 | 290 | 22,540 | ヘルスケア機器・サービス |
| A2 MILK CO LTD | 374.22 | 347.17 | 215 | 16,687 | 食品・飲料・タバコ |
| MERCURY NZ LTD | 467.71 | 269.13 | 157 | 12,206 | 公益事業 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 3,127 | 242,489 | |
| | 金額 比率 | 金額 比率 | — | < 0.1% > | |
| (イギリス) | | | | | |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 632.89 | 632.89 | 千イギリス・ポンド 169 | 25,630 | 保険 |
| BP PLC | 10,572.5 | 10,791.42 | 3,536 | 535,968 | エネルギー |
| ASHTED GROUP PLC | 236.86 | 236.86 | 1,451 | 220,057 | 資本財 |
| UNILEVER PLC | 1,399.23 | 1,418.43 | 5,561 | 842,925 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| NMC HEALTH PLC | 39.4 | 39.4 | 0 | 5 | ヘルスケア機器・サービス |
| JD SPORTS FASHION PLC | 288.6 | 288.6 | 329 | 49,929 | 小売 |
| BHP GROUP PLC | 1,101.6 | 1,164.84 | 2,351 | 356,440 | 素材 |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 439.54 | 439.54 | 321 | 48,790 | メディア・娯楽 |
| AVEVA GROUP PLC | 35.27 | 60.37 | 194 | 29,461 | ソフトウェア・サービス |
| BARCLAYS PLC | 9,047.41 | 9,047.41 | 1,657 | 251,208 | 銀行 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 4,951.88 | 4,941.44 | 605 | 91,743 | 資本財 |
| PRUDENTIAL PLC | 1,401.78 | 1,434.05 | 1,856 | 281,352 | 保険 |
| NATWEST GROUP PLC | 2,452.44 | 3,162.87 | 665 | 100,858 | 銀行 |
| EVRAZ PLC | 282.75 | 282.75 | 161 | 24,512 | 素材 |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 100.74 | 100.74 | 214 | 32,566 | 素材 |
| BAE SYSTEMS PLC | 1,781.01 | 1,657.53 | 911 | 138,118 | 資本財 |
| AVIVA PLC | 1,986.01 | 1,986.01 | 751 | 113,838 | 保険 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 2,708.24 | 2,665.28 | 4,064 | 616,023 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RELX PLC | 1,009.74 | 1,062.84 | 2,490 | 377,419 | 商業・専門サービス |
| DIAGEO PLC | 1,222.34 | 1,268.68 | 4,850 | 735,186 | 食品・飲料・タバコ |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|-----------|-----------|-------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| RIO TINTO PLC | 608.69 | 611.3 | 2,825 | 428,175 | 素材 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 1,465.61 | 1,465.61 | 607 | 92,005 | 銀行 |
| TESCO PLC | — | 3,999.3 | 1,115 | 169,111 | 食品・生活必需品小売り |
| PEARSON PLC | 396.23 | 396.23 | 243 | 36,908 | メディア・娯楽 |
| NEXT PLC | 68.6 | 68.6 | 546 | 82,781 | 小売 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 2,304.98 | 2,255.88 | 350 | 53,165 | 耐久消費財・アパレル |
| BUNZL PLC | 170.64 | 170.64 | 489 | 74,146 | 資本財 |
| VODAFONE GROUP PLC | 14,408.41 | 15,460.57 | 1,702 | 257,986 | 電気通信サービス |
| KINGFISHER PLC | 1,096.78 | 1,096.78 | 357 | 54,190 | 小売 |
| WPP PLC | 639.87 | 639.87 | 678 | 102,845 | メディア・娯楽 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 332.07 | 332.07 | 361 | 54,782 | 公益事業 |
| SEVERN TRENT PLC | 124.18 | 124.18 | 360 | 54,711 | 公益事業 |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 905.52 | 905.52 | 560 | 84,897 | 商業・専門サービス |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 386.01 | 373.85 | 2,304 | 349,256 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| SSE PLC | 558.79 | 558.79 | 870 | 131,947 | 公益事業 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 466.94 | 647.66 | 448 | 68,004 | 耐久消費財・アパレル |
| ASTRAZENECA PLC | 703.4 | 835.63 | 6,991 | 1,059,664 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 3,405.4 | 3,136.37 | 893 | 135,426 | 保険 |
| 3I GROUP PLC | 493.38 | 493.38 | 684 | 103,790 | 各種金融 |
| SAGE GROUP PLC/THE | 559.87 | 559.87 | 435 | 65,931 | ソフトウェア・サービス |
| NATIONAL GRID PLC | 1,925.47 | 1,918.51 | 1,920 | 291,118 | 公益事業 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 37,565.26 | 38,170.21 | 1,786 | 270,741 | 銀行 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 500.03 | 500.03 | 781 | 118,451 | 食品・飲料・タバコ |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 71.87 | 66.37 | 287 | 43,505 | 耐久消費財・アパレル |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 1,238.72 | 1,143.93 | 2,923 | 443,144 | 食品・飲料・タバコ |
| HSBC HOLDINGS PLC | 10,767.78 | 11,079.75 | 4,613 | 699,238 | 銀行 |
| ANGLO AMERICAN PLC | 669.08 | 669.35 | 1,796 | 272,232 | 素材 |
| COMPASS GROUP PLC | 930.18 | 930.18 | 1,415 | 214,568 | 消費者サービス |
| PERSIMMON PLC | 169.16 | 169.16 | 466 | 70,734 | 耐久消費財・アパレル |
| SAINSBURY (J) PLC | 1,128.14 | 1,134.8 | 328 | 49,825 | 食品・生活必需品小売り |
| BT GROUP PLC | 4,699.07 | 4,699.07 | 767 | 116,372 | 電気通信サービス |
| BURBERRY GROUP PLC | 230.66 | 190.12 | 341 | 51,722 | 耐久消費財・アパレル |
| SMITH & NEPHEW PLC | 443.55 | 443.55 | 550 | 83,358 | ヘルスケア機器・サービス |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 174.88 | 177.16 | 1,217 | 184,462 | 各種金融 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 2,204.08 | 2,192.98 | 3,497 | 530,060 | エネルギー |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 2,020.83 | 1,991.91 | 3,175 | 481,218 | エネルギー |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 75.81 | 75.81 | 169 | 25,622 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADMIRAL GROUP PLC | 115.35 | 115.35 | 347 | 52,674 | 保険 |
| ANTOFAGASTA PLC | 194.39 | 194.39 | 271 | 41,187 | 素材 |
| ABRDN PLC | 1,232.63 | 1,232.63 | 290 | 44,051 | 各種金融 |
| EXPERIAN PLC | 488.95 | 488.95 | 1,654 | 250,698 | 商業・専門サービス |
| TESCO PLC | 5,065.78 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| SCHRODERS PLC | 62.13 | 62.13 | 218 | 33,117 | 各種金融 |
| HALMA PLC | 198.39 | 198.39 | 600 | 91,075 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WM MORRISON SUPERMARKETS | 1,462.35 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 167.71 | 167.71 | 319 | 48,472 | 食品・飲料・タバコ |
| ST JAMES' S PLACE PLC | 261.57 | 261.57 | 408 | 61,943 | 各種金融 |
| INTERTEK GROUP PLC | 81.84 | 81.84 | 448 | 67,972 | 商業・専門サービス |
| MONDI PLC | 251.28 | 251.28 | 439 | 66,570 | 素材 |
| WHITBREAD PLC | 112.82 | 112.82 | 324 | 49,159 | 消費者サービス |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 195.72 | 195.72 | 262 | 39,793 | 各種金融 |
| SMITHS GROUP PLC | 241.68 | 243.69 | 354 | 53,775 | 資本財 |
| OCADO GROUP PLC | 221.77 | 273.79 | 502 | 76,102 | 食品・生活必需品小売り |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | — | 368.51 | 237 | 35,968 | 保険 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 103.34 | 95.87 | 441 | 66,838 | 消費者サービス |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 66.26 | 78.38 | 788 | 119,564 | 素材 |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 株数 | 期 | | 末 | | 業種等 | |
|------------------------------|-----------|------------|------------|------------|------------------------|------------|--------|
| | | 期首(前期末) | 期 | 価額 | | | |
| | | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| M&G PLC | 1,330.64 | 1,330.64 | 253 | 38,378 | 各種金融 | | |
| RSA INSURANCE GROUP LTD | 522.95 | — | — | — | 保険 | | |
| INFORMA PLC | 781.52 | 781.52 | 370 | 56,143 | メディア・娯楽 | | |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 36.85 | 36.85 | 583 | 88,466 | 資本財 | | |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 2,463.49 | 2,217.14 | 323 | 49,060 | 資本財 | | |
| GLENCORE PLC | 5,380.15 | 5,395.65 | 1,926 | 292,023 | 素材 | | |
| COCA-COLA HBC AG-DI | 87.04 | 87.04 | 204 | 31,040 | 食品・飲料・タバコ | | |
| DCC PLC | 59.54 | 59.54 | 335 | 50,840 | 資本財 | | |
| ENTAIN PLC | 288.65 | 288.65 | 503 | 76,383 | 消費者サービス | | |
| FERGUSON PLC | 125.13 | 120.17 | 1,388 | 210,450 | 資本財 | | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 157,200.09 | 157,107.16 | 94,813 | 14,369,899 | <4.1%> |
| (イスラエル) | | | 84銘柄 | 83銘柄 | — | — | |
| BANK HAPOLIM BM | 664.03 | 664.03 | 2,041 | 73,507 | 銀行 | | |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | 701.5 | 701.5 | 2,177 | 78,412 | 銀行 | | |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 546.74 | 546.74 | 1,079 | 38,885 | 銀行 | | |
| NICE LTD | 32.51 | 32.51 | 2,876 | 103,573 | ソフトウェア・サービス | | |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 92.49 | 92.49 | 1,083 | 39,002 | 銀行 | | |
| AZRIELI GROUP LTD | 21.4 | 21.4 | 622 | 22,417 | 不動産 | | |
| ICL GROUP LTD | 287.11 | 287.11 | 818 | 29,487 | 素材 | | |
| ELBIT SYSTEMS LTD | 13.89 | 13.89 | 654 | 23,559 | 資本財 | | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 2,359.67 | 2,359.67 | 11,353 | 408,845 | <0.1%> |
| (スイス) | | | 8銘柄 | 8銘柄 | — | — | |
| UBS GROUP AG-REG | 1,911.89 | 1,911.89 | 3,012 | 371,251 | 各種金融 | | |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 124 | 125.5 | 717 | 88,445 | 各種金融 | | |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 21.32 | 21.32 | 512 | 63,143 | 資本財 | | |
| HOLCIM LTD | 272.39 | 272.39 | 1,238 | 152,685 | 素材 | | |
| SWISS PRIME SITE-REG | 39.06 | 39.06 | 346 | 42,653 | 不動産 | | |
| VIFOR PHARMA AG | 26.38 | 26.38 | 277 | 34,204 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 0.59 | 0.59 | 668 | 82,388 | 食品・飲料・タバコ | | |
| ADECCO GROUP AG-REG | 87.86 | 91.18 | 398 | 49,154 | 商業・専門サービス | | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 0.05 | 0.05 | 561 | 69,204 | 食品・飲料・タバコ | | |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 9.73 | 12.03 | 1,894 | 233,524 | 各種金融 | | |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 9.41 | 9.41 | 220 | 27,138 | 資本財 | | |
| SIKA AG-REG | 73.99 | 78 | 2,836 | 349,642 | 素材 | | |
| ALCON INC | 265.85 | 265.85 | 1,942 | 239,454 | ヘルスケア機器・サービス | | |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 15.7 | 15.7 | 111 | 13,699 | 銀行 | | |
| ROCHE HOLDING AG-BR | — | 19.21 | 735 | 90,680 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG | 25.16 | 25.16 | 133 | 16,450 | 耐久消費財・アパレル | | |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 374.19 | 377.96 | 13,512 | 1,665,362 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| ABB LTD-REG | 981.55 | 908.36 | 2,901 | 357,585 | 資本財 | | |
| SWISS RE AG | 151.68 | 151.68 | 1,314 | 162,007 | 保険 | | |
| NESTLE SA-REG | 1,590.99 | 1,547.36 | 18,583 | 2,290,452 | 食品・飲料・タバコ | | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 1,267.13 | 1,454.88 | 1,289 | 158,979 | 各種金融 | | |
| SGS SA-REG | 3.08 | 3.08 | 876 | 108,037 | 商業・専門サービス | | |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR | 16.92 | 17.16 | 468 | 57,780 | 耐久消費財・アパレル | | |
| BALOISE HOLDING AG - REG | 24.75 | 24.75 | 342 | 42,187 | 保険 | | |
| CLARIANT AG-REG | 101.01 | 101.01 | 182 | 22,546 | 素材 | | |
| NOVARTIS AG-REG | 1,182.57 | 1,195.88 | 8,878 | 1,094,239 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 278.55 | 283.58 | 3,938 | 485,472 | 耐久消費財・アパレル | | |
| SWISSCOM AG-REG | 13.99 | 13.99 | 718 | 88,523 | 電気通信サービス | | |
| GIVAUDAN-REG | 4.84 | 4.84 | 2,189 | 269,870 | 素材 | | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 82.02 | 80.94 | 3,090 | 380,878 | 保険 | | |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG | 6.02 | 5.31 | 1,032 | 127,291 | ヘルスケア機器・サービス | | |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 26.6 | 26.6 | 915 | 112,844 | ヘルスケア機器・サービス | | |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 株数 | 期首(前期末) | 期末 | | 業種等 |
|----------------------------|-----------|------------------|---------------|--------------|------------------------|
| | | 株数 | 評価金額 | 価額 | |
| | | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 96.24 | 81.5 | 614 | 75,778 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LONZA GROUP AG-REG | 39.84 | 39.84 | 2,909 | 358,646 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEMENOS AG - REG | 31.31 | 37.43 | 454 | 55,958 | ソフトウェア・サービス |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 17.35 | 18.34 | 962 | 118,580 | 保険 |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG | 30.3 | 29.81 | 793 | 97,767 | 運輸 |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | 1.44 | 1.83 | 404 | 49,845 | 食品・飲料・タバコ |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 5.14 | 3.56 | 316 | 39,050 | 素材 |
| GEBERIT AG-REG | 19.86 | 19.86 | 1,386 | 170,852 | 資本財 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 9,230.75 39銘柄 | 9,343.27 — | 83,685 — | 10,314,264 < 2.9% > |
| (デンマーク) | | | | | |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-A | 1.68 | 1.68 | 3,111 | 53,733 | 運輸 |
| PANDORA A/S | 47.63 | 47.63 | 4,015 | 69,342 | 耐久消費財・アパレル |
| ORSTED A/S | 103.45 | 95.55 | 8,085 | 139,635 | 公益事業 |
| NOVO NORDISK A/S-B | 922.02 | 908.61 | 65,029 | 1,123,054 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHR HANSEN HOLDING A/S | 55.09 | 55.09 | 2,710 | 46,818 | 素材 |
| DANSKE BANK A/S | 401.89 | 391.03 | 4,289 | 74,081 | 銀行 |
| H LUNDBECK A/S | 28.96 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | — | 524.4 | 11,615 | 200,598 | 資本財 |
| GN STORE NORD A/S | 72.99 | 64.84 | 2,500 | 43,178 | ヘルスケア機器・サービス |
| CARLSBERG AS-B | 55.85 | 55.85 | 5,936 | 102,529 | 食品・飲料・タバコ |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES | 115.12 | 115.12 | 5,624 | 97,139 | 素材 |
| COLOPLAST-B | 66.38 | 63.99 | 6,875 | 118,743 | ヘルスケア機器・サービス |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 3.49 | 3.11 | 6,114 | 105,593 | 運輸 |
| TRYG A/S | 57.52 | 169.89 | 2,688 | 46,430 | 保険 |
| GENMAB A/S | 33.17 | 36.88 | 9,404 | 162,413 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ROCKWOOL INTL A/S-B SHS | — | 5.13 | 1,407 | 24,301 | 資本財 |
| DSV A/S | 108.73 | 109.5 | 15,631 | 269,949 | 運輸 |
| AMBU A/S-B | 83.56 | 83.56 | 1,595 | 27,562 | ヘルスケア機器・サービス |
| DEMANT A/S | 44.55 | 44.55 | 1,401 | 24,204 | ヘルスケア機器・サービス |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 104.88 | — | — | — | 資本財 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 2,306.96 18銘柄 | 2,776.41 — | 158,037 — | 2,729,313 < 0.8% > |
| (ノルウェー) | | | | | |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 135.96 | 114.12 | 2,365 | 29,831 | 保険 |
| NORSK HYDRO ASA | 643.44 | 832.94 | 5,039 | 63,545 | 素材 |
| DNB BANK ASA | — | 459.57 | 9,274 | 116,946 | 銀行 |
| DNB ASA | 490.48 | — | — | — | 銀行 |
| ORKLA ASA | 434.56 | 469.55 | 3,948 | 49,795 | 食品・飲料・タバコ |
| TELENOR ASA | 374.98 | 349.37 | 4,817 | 60,752 | 電気通信サービス |
| EQUINOR ASA | 518.71 | 518.71 | 11,782 | 148,577 | エネルギー |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 90.05 | 90.05 | 4,010 | 50,576 | 素材 |
| MOWI ASA | 222.42 | 233.18 | 4,906 | 61,866 | 食品・飲料・タバコ |
| SCHIBSTED ASA-CL A | — | 33.38 | 1,369 | 17,274 | メディア・娯楽 |
| ADEVINTA ASA | 141.86 | 155.4 | 2,050 | 25,856 | メディア・娯楽 |
| SCHIBSTED ASA-B SHS | 54.8 | 54.8 | 1,961 | 24,738 | メディア・娯楽 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 3,107.26 10銘柄 | 3,311.07 — | 51,527 — | 649,762 < 0.2% > |
| (スウェーデン) | | | | | |
| SWEDBANK AB - A SHARES | 459.21 | 459.21 | 8,429 | 105,618 | 銀行 |
| ERICSSON LM-B SHS | 1,615.17 | 1,596.85 | 14,981 | 187,720 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| VOLVO AB-B SHS | 800.3 | 803.38 | 15,932 | 199,635 | 資本財 |
| ICA GRUPPEN AB | 56.14 | 56.14 | 2,998 | 37,577 | 食品・生活必需品小売り |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 109.3 | 106.42 | 2,889 | 36,202 | 各種金融 |
| LUNDBERGS AB-B SHS | 33.68 | 33.68 | 1,710 | 21,429 | 各種金融 |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B | 327.01 | 299.42 | 8,755 | 109,700 | 家庭用品・パーソナル用品 |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期 末 | | 業 種 等 | |
|------------------------------|--------------|--------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| EPIROC AB-A | — | 342.3 | 7,468 | 93,586 | 資本財 | |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 49.51 | 82.23 | 2,811 | 35,227 | 資本財 | |
| KINNEVIK AB - B | — | 124.65 | 4,095 | 51,315 | 各種金融 | |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | — | 98.51 | 2,709 | 33,944 | 各種金融 | |
| SKF AB-B SHARES | 206.07 | 206.07 | 4,333 | 54,300 | 資本財 | |
| ELECTROLUX AB-B | 150.98 | 115.55 | 2,353 | 29,492 | 耐久消費財・アパレル | |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 428.37 | 401.48 | 6,528 | 81,806 | 小売 | |
| NORDEA BANK ABP | 1,679.42 | 1,679.42 | 18,010 | 225,666 | 銀行 | |
| SWEDISH MATCH AB | — | 846.4 | 5,669 | 71,034 | 食品・飲料・タバコ | |
| TELE2 AB-B SHS | 255.37 | 255.37 | 3,349 | 41,965 | 電気通信サービス | |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 883.17 | 883.17 | 11,613 | 145,519 | 銀行 | |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 776.68 | 776.68 | 7,482 | 93,756 | 銀行 | |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B | 343.7 | 343.7 | 5,179 | 64,899 | 素材 | |
| SKANSKA AB-B SHS | 208.21 | 171.83 | 3,613 | 45,278 | 資本財 | |
| SANDVIK AB | 610.7 | 610.7 | 14,009 | 175,538 | 資本財 | |
| INVESTOR AB-B SHS | — | 1,012.75 | 21,455 | 268,832 | 各種金融 | |
| ATLAS COPCO AB-A SHS | 344.34 | 373.42 | 20,821 | 260,898 | 資本財 | |
| SECURITAS AB-B SHS | 161.23 | 161.23 | 2,143 | 26,858 | 商業・専門サービス | |
| TELIA CO AB | 1,280.45 | 1,434.04 | 5,072 | 63,563 | 電気通信サービス | |
| ALFA LAVAL AB | 139.39 | 186.97 | 6,760 | 84,713 | 資本財 | |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 197.87 | 197.87 | 9,404 | 117,841 | 資本財 | |
| ASSA ABLOY AB-B | 521.19 | 521.19 | 13,498 | 169,140 | 資本財 | |
| BOLIDEN AB | — | 130.86 | 4,009 | 50,239 | 素材 | |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 185.93 | 185.93 | 2,444 | 30,623 | 資本財 | |
| HEXAGON AB-B SHS | — | 1,031.1 | 13,765 | 172,477 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| LUNDIN ENERGY AB | 85.81 | 85.81 | 2,906 | 36,417 | エネルギー | |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | — | 53.23 | 3,645 | 45,674 | 不動産 | |
| SWEDISH MATCH AB | 84.64 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ | |
| EPIROC AB-B | 251.32 | — | — | — | 資本財 | |
| EQT AB | 156.14 | 154.43 | 8,206 | 102,826 | 各種金融 | |
| EVOLUTION AB | 66.29 | 90.21 | 9,051 | 113,417 | 消費者サービス | |
| KINNEVIK AB-B SHS | 136.78 | — | — | — | 各種金融 | |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 184.41 | — | — | — | 資本財 | |
| INVESTOR AB-B SHS | 236.14 | — | — | — | 各種金融 | |
| VOLVO AB-A SHS | — | 132.83 | 2,683 | 33,620 | 資本財 | |
| HEXAGON AB-B SHS | 147.3 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| EPIROC AB-A | 393.07 | — | — | — | 資本財 | |
| BOLIDEN AB | 130.86 | — | — | — | 素材 | |
| EMBRACER GROUP AB | — | 300.12 | 2,853 | 35,754 | メディア・娯楽 | |
| EPIROC AB-B | — | 198.36 | 3,580 | 44,862 | 資本財 | |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | — | 737.64 | 9,375 | 117,473 | 資本財 | |
| SINCH AB | — | 276.9 | 3,421 | 42,866 | ソフトウェア・サービス | |
| 小 計 | 株 数 銘 柄 数 | 金 額 <比 率> | 13,696.15 36銘柄 | 17,558.05 41銘柄 | 300,025 — | 3,759,319 < 1.1% > |
| (ユーロ・・・アイルランド) | | | | 千ユーロ | | |
| KINGSPAN GROUP PLC | 80.21 | 80.84 | 808 | 103,785 | 資本財 | |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 129.21 | 129.21 | 592 | 76,106 | 素材 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 82.37 | 88.69 | 1,082 | 138,998 | 消費者サービス | |
| KERRY GROUP PLC-A | 85.06 | 81.93 | 887 | 113,991 | 食品・飲料・タバコ | |
| CRH PLC | 410.91 | 434.26 | 1,884 | 242,012 | 素材 | |
| 小 計 | 株 数 銘 柄 数 | 金 額 <比 率> | 787.76 5銘柄 | 814.93 5銘柄 | 5,255 — | 674,895 < 0.2% > |
| (ユーロ・・・オランダ) | | | | 千ユーロ | | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 480.02 | 477.6 | 1,516 | 194,687 | ヘルスケア機器・サービス | |
| AIRBUS SE | 314.64 | 320.94 | 3,199 | 410,841 | 資本財 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 61.68 | 61.68 | 476 | 61,224 | 食品・飲料・タバコ | |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 株数 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|-----------|------------|-------------------|-------------------|------------------------|---------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価金額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| NN GROUP NV | 159.22 | 140.69 | 617 | 79,291 | 保険 | |
| QIAGEN N. V. | 125.43 | 125.43 | 617 | 79,292 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 189.16 | 287.87 | 364 | 46,842 | 銀行 | |
| STELLANTIS NV | — | 1,055.16 | 1,642 | 210,935 | 自動車・自動車部品 | |
| VOPAK | 31.3 | 31.3 | 103 | 13,335 | エネルギー | |
| FERRARI NV | 64.52 | 69.49 | 1,638 | 210,409 | 自動車・自動車部品 | |
| ADYEN NV | 9.42 | 10.69 | 2,630 | 337,753 | ソフトウェア・サービス | |
| PROSUS NV | 264.14 | 510.18 | 3,605 | 463,040 | 小売 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 547.75 | 547.75 | 818 | 105,118 | 資本財 | |
| ASM INTERNATIONAL NV | — | 24.55 | 973 | 124,963 | 半導体・半導体製造装置 | |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | — | 384.96 | 962 | 123,631 | メディア・娯楽 | |
| HEINEKEN NV | 131.43 | 131.43 | 1,228 | 157,697 | 食品・飲料・タバコ | |
| AEGON NV | 916.09 | 916.09 | 360 | 46,336 | 保険 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 594.52 | 556.57 | 1,683 | 216,229 | 食品・生活必需品小売り | |
| AKZO NOBEL N. V. | 103.99 | 98.86 | 933 | 119,913 | 素材 | |
| KONINKLIJKE DSM NV | 89.94 | 94.22 | 1,807 | 232,054 | 素材 | |
| WOLTERS KLUWER | 145.78 | 145.78 | 1,462 | 187,757 | 商業・専門サービス | |
| ING GROEP NV | 2,052.37 | 2,052.37 | 2,495 | 320,417 | 銀行 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 1,736.03 | 1,736.03 | 454 | 58,383 | 電気通信サービス | |
| ASML HOLDING NV | 228.41 | 225.44 | 15,889 | 2,040,307 | 半導体・半導体製造装置 | |
| RANDSTAD NV | 72.79 | 62.41 | 350 | 44,958 | 商業・専門サービス | |
| JDE PEET'S NV | — | 21.66 | 54 | 6,967 | 食品・飲料・タバコ | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 280.21 | 280.21 | 366 | 47,082 | 食品・飲料・タバコ | |
| ARGENX SE | 23.3 | 26.44 | 663 | 85,184 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 642.8 | — | — | — | 自動車・自動車部品 | |
| JUST EAT TAKEAWAY | 63.55 | 93.07 | 541 | 69,495 | 小売 | |
| EXOR NV | 62.04 | 62.04 | 489 | 62,840 | 各種金融 | |
| STMICROELECTRONICS NV | 332.61 | 378.04 | 1,626 | 208,861 | 半導体・半導体製造装置 | |
| ALTICE EUROPE NV | 376.25 | — | — | — | 電気通信サービス | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 10,099.39 28銘柄 | 10,928.95 30銘柄 | 49,574 — | 6,365,856 <1.8%> |
| (ユーロ・・・ベルギー) | | | | | | |
| SOFINA | 8.04 | 8.04 | 千ユーロ 327 | 41,998 | 各種金融 | |
| UCB SA | 66.23 | 66.23 | 642 | 82,528 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| KBC GROUP NV | 144.07 | 130.92 | 950 | 122,017 | 銀行 | |
| COLRUYT SA | 28.7 | 21.64 | 89 | 11,490 | 食品・生活必需品小売り | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 59.14 | 59.14 | 572 | 73,526 | 各種金融 | |
| SOLVAY SA | 37.58 | 37.58 | 372 | 47,880 | 素材 | |
| UMICORE | 105.6 | 102.88 | 443 | 56,899 | 素材 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 398.98 | 409.43 | 2,081 | 267,290 | 食品・飲料・タバコ | |
| AGEAS | 87.65 | 112.47 | 520 | 66,882 | 保険 | |
| PROXIMUS | 96.97 | 46.17 | 74 | 9,503 | 電気通信サービス | |
| GALAPAGOS NV | 23.18 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ELIA GROUP SA/NV | 19.57 | 20.63 | 225 | 28,901 | 公益事業 | |
| TELENET GROUP HOLDINGS NV | 21.81 | — | — | — | メディア・娯楽 | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 1,097.52 13銘柄 | 1,015.13 11銘柄 | 6,299 — | 808,919 <0.2%> |
| (ユーロ・・・ルクセンブルグ) | | | | | | |
| ARCELORMITTAL | 366.89 | 366.89 | 896 | 115,142 | 素材 | |
| SES | 278.6 | — | — | — | メディア・娯楽 | |
| TENARIS SA | 259.63 | 259.63 | 231 | 29,745 | エネルギー | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 70.1 | 70.1 | 791 | 101,699 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| AROUNDTOWN SA | 521.14 | 525.6 | 290 | 37,255 | 不動産 | |
| INPOST SA | — | 109.02 | 112 | 14,436 | 運輸 | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 1,496.36 5銘柄 | 1,331.24 5銘柄 | 2,322 — | 298,278 <0.1%> |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|----------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価金額 | 価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ・・・フランス) | | | 千ユーロ | | |
| BUREAU VERITAS SA | 178.17 | 178.17 | 504 | 64,769 | 商業・専門サービス |
| ORANGE | 1,061.32 | 1,061.32 | 1,019 | 130,887 | 電気通信サービス |
| JCDECAUX SA | 28.28 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| GETLINK SE | 223.11 | 223.11 | 287 | 36,943 | 運輸 |
| SUEZ | 189.86 | 189.86 | 375 | 48,199 | 公益事業 |
| DASSAULT AVIATION SA | 1.72 | 17.2 | 145 | 18,652 | 資本財 |
| FAURECIA | 31.27 | 60.9 | 226 | 29,044 | 自動車・自動車部品 |
| TOTALENERGIES SE | 1,334.48 | 1,354.3 | 5,579 | 716,491 | エネルギー |
| TELEPERFORMANCE | 29.7 | 29.7 | 1,061 | 136,304 | 商業・専門サービス |
| WORLDBLINE SA | 127.74 | 127.74 | 606 | 77,865 | ソフトウェア・サービス |
| ESSILORLUXOTTICA | 153.58 | 157.04 | 2,832 | 363,745 | 耐久消費財・アパレル |
| AMUNDI SA | 39.55 | 39.55 | 296 | 38,115 | 各種金融 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 15.55 | 15.55 | 798 | 102,474 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICHELIN (CGDE) | 87.46 | 87.46 | 1,122 | 144,146 | 自動車・自動車部品 |
| AIR LIQUIDE SA | 256.34 | 251.83 | 3,710 | 476,525 | 素材 |
| KERING | 41.33 | 39.06 | 2,670 | 342,973 | 耐久消費財・アパレル |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 294.47 | 293.3 | 4,435 | 569,609 | 資本財 |
| BOUYGUES SA | 110.49 | 110.49 | 330 | 42,436 | 資本財 |
| BNP PARIBAS | 604.36 | 612.93 | 3,394 | 435,875 | 銀行 |
| PEUGEOT SA | 281.39 | — | — | — | 自動車・自動車部品 |
| THALES SA | 54.03 | 54.03 | 399 | 51,257 | 資本財 |
| DANONE | 320.81 | 343 | 1,863 | 239,294 | 食品・飲料・タバコ |
| CARREFOUR SA | 358.27 | 359.9 | 545 | 70,107 | 食品・生活必需品小売り |
| VIVENDI SE | 441.96 | 384.96 | 431 | 55,364 | メディア・娯楽 |
| L'OREAL | 135.48 | 136.29 | 5,476 | 703,190 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| LEGRAND SA | 149.97 | 133.23 | 1,276 | 163,861 | 資本財 |
| PERNOD RICARD SA | 111.12 | 111.08 | 2,294 | 294,689 | 食品・飲料・タバコ |
| SOCIETE GENERALE SA | 410.25 | 410.25 | 1,127 | 144,791 | 銀行 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 149.19 | 148.67 | 10,365 | 1,331,004 | 耐久消費財・アパレル |
| ACCOR SA | 104.51 | 104.51 | 278 | 35,791 | 消費者サービス |
| CAPGEMINI SE | 80.59 | 89.61 | 1,809 | 232,322 | ソフトウェア・サービス |
| VALEO | 140.48 | 144.44 | 354 | 45,571 | 自動車・自動車部品 |
| PUBLICIS GROUPE | 107.36 | 133.01 | 770 | 98,994 | メディア・娯楽 |
| SODEXO SA | 39 | 39 | 293 | 37,630 | 消費者サービス |
| SEB SA | 10.25 | 11.27 | 150 | 19,290 | 耐久消費財・アパレル |
| AXA SA | 1,063.04 | 1,004.73 | 2,434 | 312,673 | 保険 |
| EDENRED | 121.39 | 121.39 | 491 | 63,130 | ソフトウェア・サービス |
| RENAULT SA | 88.3 | 88.3 | 257 | 33,046 | 自動車・自動車部品 |
| HERMES INTERNATIONAL | 16.76 | 16.76 | 2,748 | 352,952 | 耐久消費財・アパレル |
| ATOS SE | 60.86 | 45.92 | 171 | 22,029 | ソフトウェア・サービス |
| DASSAULT SYSTEMES SE | 70.23 | 351.15 | 1,876 | 240,922 | ソフトウェア・サービス |
| ALSTOM | 96.68 | 176.65 | 571 | 73,426 | 資本財 |
| CNP ASSURANCES | 89.78 | 89.78 | 193 | 24,878 | 保険 |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 255.83 | 264.13 | 1,511 | 194,140 | 資本財 |
| SANOFI | 606.98 | 615.68 | 5,270 | 676,828 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VINCI SA | 276.68 | 293.09 | 2,466 | 316,741 | 資本財 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 285.61 | 361.22 | 1,020 | 130,989 | 公益事業 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 581.4 | 581.4 | 705 | 90,574 | 銀行 |
| ENGIE | 948.86 | 948.86 | 1,223 | 157,104 | 公益事業 |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 47.45 | 47.45 | 213 | 27,351 | メディア・娯楽 |
| EDF | 296.44 | 207.79 | 256 | 32,939 | 公益事業 |
| SAFRAN SA | 173.98 | 182.12 | 1,850 | 237,602 | 資本財 |
| ILIAD SA | 10.16 | — | — | — | 電気通信サービス |
| ARKEMA | 32.5 | 32.5 | 377 | 48,410 | 素材 |
| SCOR SE | 70.99 | 109.07 | 291 | 37,395 | 保険 |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 株数 | 期首(前期末) | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|-----------|-----------|--------|------------|------------------------|
| | | 株数 | 評価額 | 評価額 | |
| | | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| IPSEN | 14.98 | 14.98 | 129 | 16,692 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BOLLORE | 394.33 | 394.33 | 187 | 24,133 | メディア・娯楽 |
| REMY COINTREAU | 12.73 | 12.73 | 271 | 34,883 | 食品・飲料・タバコ |
| EURAZEO SE | 17.92 | 17.92 | 131 | 16,901 | 各種金融 |
| ORPEA | 26.95 | 26.95 | 225 | 28,931 | ヘルスケア機器・サービス |
| WENDEL | 10.82 | 10.82 | 111 | 14,380 | 各種金融 |
| EIFFAGE | 49.89 | 49.89 | 410 | 52,737 | 資本財 |
| ADP | 13.46 | 13.46 | 140 | 18,044 | 運輸 |
| NATIXIS | 453.62 | — | — | — | 各種金融 |
| BIOMERIEUX | 25.91 | 15.7 | 199 | 25,674 | ヘルスケア機器・サービス |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 57.85 | 57.85 | 241 | 31,073 | 消費者サービス |
| 小計 | 13,975.82 | 13,605.38 | 82,819 | 10,634,812 | |
| | 66銘柄 | 62銘柄 | — | < 3.0% > | |
| (ユーロ・・・ドイツ) | | | 千ユーロ | | |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT | 18.56 | — | — | — | 運輸 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 468.95 | 468.95 | 110 | 14,193 | 電気通信サービス |
| BAYER AG-REG | 532.63 | 517.33 | 2,344 | 301,062 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HENKEL AG & CO KGAA | 59.74 | 59.74 | 399 | 51,243 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 84.4 | 86.77 | 517 | 66,429 | 素材 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 133.12 | 109.52 | 292 | 37,549 | 素材 |
| VONOVIA SE | 280.71 | 395 | 1,942 | 249,399 | 不動産 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF | 77.65 | 77.65 | 582 | 74,782 | 自動車・自動車部品 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 25.08 | 25.64 | 180 | 23,211 | 自動車・自動車部品 |
| KION GROUP AG | 31.79 | 31.79 | 298 | 38,331 | 資本財 |
| ZALANDO SE | 79.11 | 123.67 | 1,007 | 129,425 | 小売 |
| BECHTLE AG | — | 43.05 | 272 | 34,959 | ソフトウェア・サービス |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 52.69 | 52.69 | 173 | 22,341 | 電気通信サービス |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED | 1,024.59 | 1,134.78 | 1,211 | 155,596 | 各種金融 |
| COVESTRO AG | 93.46 | 117.97 | 597 | 76,772 | 素材 |
| MTU AERO ENGINES AG | 29.57 | 29.57 | 495 | 63,658 | 資本財 |
| UNIPER SE | 104.56 | 46.97 | 181 | 23,329 | 公益事業 |
| COMMERZBANK AG | 466.44 | 466.44 | 290 | 37,344 | 銀行 |
| METRO AG | 93.68 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| VOLKSWAGEN AG | 19.84 | 19.6 | 500 | 64,279 | 自動車・自動車部品 |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 18.04 | 13.08 | 758 | 97,416 | ヘルスケア機器・サービス |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 98.69 | 97.76 | 1,608 | 206,527 | 自動車・自動車部品 |
| LEG IMMOBILIEN SE | 36.8 | 36.8 | 456 | 58,666 | 不動産 |
| DEUTSCHE WOHNEN SE | 181.44 | — | — | — | 不動産 |
| NEMETSCHKE SE | 30.11 | 30.11 | 323 | 41,583 | ソフトウェア・サービス |
| RATIONAL AG | — | 3.5 | 284 | 36,476 | 資本財 |
| SYMRISE AG | 65.24 | 65.24 | 821 | 105,472 | 素材 |
| DELIVERY HERO SE | 66.75 | 80.61 | 961 | 123,488 | 小売 |
| SIEMENS ENERGY AG | 198.55 | 198.55 | 478 | 61,419 | 資本財 |
| TEAMVIEWER AG | 95.85 | 90.59 | 111 | 14,366 | ソフトウェア・サービス |
| VONOVIA SE-RTS | — | 293.04 | 90 | 11,627 | 不動産 |
| SIEMENS AG-REG | 409.59 | 409.05 | 5,913 | 759,317 | 資本財 |
| E.ON SE | 1,166.81 | 1,269.98 | 1,395 | 179,255 | 公益事業 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 178.73 | 178.73 | 1,533 | 196,871 | 自動車・自動車部品 |
| GEA GROUP AG | 81.78 | 81.78 | 364 | 46,804 | 資本財 |
| CONTINENTAL AG | 55.78 | 55.78 | 520 | 66,792 | 自動車・自動車部品 |
| BASF SE | 499.52 | 494.39 | 2,866 | 368,083 | 素材 |
| ALLIANZ SE-REG | 225.21 | 217.83 | 4,184 | 537,277 | 保険 |
| THYSSENKRUPP AG | 193.67 | — | — | — | 素材 |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | 90.43 | 90.43 | 642 | 82,562 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| RWE AG | 347.39 | 346.73 | 1,214 | 155,921 | 公益事業 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 165.74 | 331.48 | 182 | 23,415 | 運輸 |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|----------------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| BRENTAG SE | 73.92 | 73.92 | 564 | 72,462 | 資本財 |
| FRESENIUS SE & CO KGA | 221.74 | 213.63 | 721 | 92,666 | ヘルスケア機器・サービス |
| SAP SE | 560.6 | 550.37 | 6,428 | 825,460 | ソフトウェア・サービス |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 75.72 | 73.64 | 1,760 | 226,095 | 保険 |
| BEIERSDORF AG | 51.38 | 51.38 | 458 | 58,891 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| MERCK KGA | 65.53 | 68.32 | 1,500 | 192,654 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADIDAS AG | 102.34 | 101.46 | 2,580 | 331,314 | 耐久消費財・アパレル |
| PUMA SE | 59.94 | 50.52 | 537 | 68,992 | 耐久消費財・アパレル |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 1,815.43 | 1,830.3 | 2,935 | 376,986 | 電気通信サービス |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & | 111.18 | 111.18 | 595 | 76,408 | ヘルスケア機器・サービス |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 444.02 | 466.8 | 3,865 | 496,318 | 自動車・自動車部品 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 650.83 | 715.33 | 2,877 | 369,442 | 半導体・半導体製造装置 |
| HANNOVER RUECK SE | 30.58 | 30.58 | 475 | 61,061 | 保険 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 513.45 | 544.53 | 2,917 | 374,647 | 運輸 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 100.31 | 107.01 | 1,521 | 195,399 | 各種金融 |
| LANXESS AG | 44.09 | 44.09 | 225 | 29,010 | 素材 |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF | 33.7 | 33.7 | 134 | 17,223 | 素材 |
| HOCHTIEF AG | 19.31 | - | - | - | 資本財 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 22.69 | 19.24 | 341 | 43,853 | ヘルスケア機器・サービス |
| KNORR-BREMSE AG | 38.81 | 38.81 | 350 | 45,071 | 資本財 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 141.82 | 164.26 | 1,058 | 135,963 | ヘルスケア機器・サービス |
| SCOUT24 SE | 56.1 | 46.71 | 279 | 35,844 | メディア・娯楽 |
| HELLOFRESH SE | - | 97.9 | 925 | 118,799 | 食品・生活必需品小売り |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 金額 <比率> | |
| | 13,116.18 61銘柄 | 13,626.27 60銘柄 | 69,167 -<2.5%> | 8,881,824 -<2.5%> | |
| (ユーロ・・・ポルトガル) | | | | 千ユーロ | |
| GALP ENERGIA SGPS SA | 304.82 | 296.87 | 249 | 31,983 | エネルギー |
| BANCO ESPIRITO SANTO-REG | 1,879.06 | 1,879.06 | 1 | 241 | 銀行 |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 1,359.64 | 1,459.1 | 709 | 91,170 | 公益事業 |
| JERONIMO MARTINS | 147.29 | 163.97 | 319 | 41,058 | 食品・生活必需品小売り |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 金額 <比率> | |
| | 3,690.81 4銘柄 | 3,799 4銘柄 | 1,280 -<0.0%> | 164,453 -<0.0%> | |
| (ユーロ・・・スペイン) | | | | 千ユーロ | |
| BANKINTER SA | 364.05 | - | - | - | 銀行 |
| TELEFONICA SA | 2,737 | 2,742.78 | 1,086 | 139,506 | 電気通信サービス |
| FERROVIAL SA | 275.2 | 246.93 | 619 | 79,587 | 資本財 |
| AENA SME SA | 35.56 | 43.77 | 566 | 72,701 | 運輸 |
| EDP RENOVAVEIS SA | - | 147.91 | 332 | 42,658 | 公益事業 |
| CAIXABANK SA | 1,819.81 | 2,181.03 | 498 | 64,051 | 銀行 |
| CELLNEX TELECOM SA | 163.78 | 270.81 | 1,441 | 185,140 | 電気通信サービス |
| ENDESA SA | 141.04 | 141.04 | 284 | 36,493 | 公益事業 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 3,528.89 | 3,528.89 | 1,694 | 217,600 | 銀行 |
| IBERDROLA SA | 3,189.22 | 3,127.16 | 3,100 | 398,185 | 公益事業 |
| REPSOL SA | 791.25 | 793.58 | 786 | 101,006 | エネルギー |
| GRIFOLS SA | 151.69 | 151.69 | 253 | 32,587 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BANCO SANTANDER SA | 8,933.41 | 9,272.2 | 2,580 | 331,356 | 銀行 |
| AMADEUS IT GROUP SA | 237.77 | 245.7 | 1,427 | 183,244 | ソフトウェア・サービス |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 154.39 | 154.39 | 380 | 48,829 | 公益事業 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 157.16 | 129.31 | 278 | 35,766 | 資本財 |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | 580.98 | 583.28 | 1,730 | 222,225 | 小売 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 114.82 | 114.82 | 269 | 34,618 | 資本財 |
| ENAGAS SA | 144.71 | 144.71 | 291 | 37,387 | 公益事業 |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 236.32 | 236.32 | 437 | 56,200 | 公益事業 |
| MAPFRE SA | 463.67 | - | - | - | 保険 |
| FERROVIAL SA RTS | 275.2 | - | - | - | 資本財 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 金額 <比率> | |
| | 24,495.92 21銘柄 | 24,256.32 19銘柄 | 18,060 -<0.7%> | 2,319,148 -<0.7%> | |

外国株式インデックス・マザーファンド

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

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

※< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

外国株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国新株予約権証券

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 期 | | 末 | |
|----------------------|---------|---------|--------|----------|--------|-------|--------|
| | | 証 券 数 | | 証 券 数 | | 評 価 額 | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (スイス) | | 証券 | 証券 | 千スイス・フラン | 千円 | | |
| CIE FINANCIERE RIC-W | | 55,710 | — | — | — | | |
| 小 計 | 証券数・金額 | 55,710 | — | — | — | | |
| | 銘柄数〈比率〉 | 1銘柄 | — | — | — | | 〈—〉 |
| 合 計 | 証券数・金額 | 55,710 | — | — | — | | |
| | 銘柄数〈比率〉 | 1銘柄 | — | — | — | | 〈—〉 |

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

※〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(3) 外国投資信託証券

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

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首 (前期末) | | 期 | | 末 | |
|------------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|---------|---------------------|-----|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 組入比率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 3,613 | — | — | — | — | |
| WELLTOWER INC | 22,737 | 23,388 | 1,918 | 218,296 | 0.1 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 28,756 | 28,756 | 979 | 111,429 | 0.0 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 8,664 | 8,664 | 734 | 83,607 | 0.0 | |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 85,417 | 64,936 | 542 | 61,687 | 0.0 | |
| PUBLIC STORAGE | 8,249 | 8,249 | 2,737 | 311,475 | 0.1 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 8,289 | 8,289 | 586 | 66,729 | 0.0 | |
| UDR INC | 16,633 | 16,633 | 955 | 108,752 | 0.0 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 14,362 | 10,364 | 287 | 32,732 | 0.0 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 14,002 | 15,126 | 2,553 | 290,468 | 0.1 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 7,483 | 7,376 | 1,497 | 170,392 | 0.0 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 31,750 | 31,858 | 684 | 77,890 | 0.0 | |
| WP CAREY INC | 8,640 | 8,640 | 680 | 77,409 | 0.0 | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数 <比率> | 731,049 39銘柄 | 672,476 36銘柄 | 60,354 | 6,866,548 <1.9%> | 1.9 |
| (カナダ) | | | 千カナダ・ドル | | | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 6,546 | — | — | — | — | |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 3,585 | — | — | — | — | |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 3,971 | 3,971 | 232 | 20,721 | 0.0 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 7,441 | 7,441 | 164 | 14,691 | 0.0 | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数 <比率> | 21,543 4銘柄 | 11,412 2銘柄 | 396 | 35,412 <0.0%> | 0.0 |
| (オーストラリア) | | | 千オーストラリア・ドル | | | |
| SCENTRE GROUP | 275,200 | 275,200 | 836 | 68,007 | 0.0 | |
| LENDLEASE GROUP | 36,263 | 36,263 | 384 | 31,246 | 0.0 | |
| DEXUS/AU | 54,256 | 54,256 | 588 | 47,853 | 0.0 | |
| TRANSURBAN GROUP | 145,680 | 161,485 | 2,210 | 179,710 | 0.1 | |
| SYDNEY AIRPORT | 73,899 | 62,186 | 512 | 41,654 | 0.0 | |
| APA GROUP | 68,344 | 55,644 | 539 | 43,876 | 0.0 | |
| GPT GROUP | 97,296 | 121,221 | 629 | 51,142 | 0.0 | |
| MIRVAC GROUP | 200,053 | 200,053 | 580 | 47,160 | 0.0 | |
| STOCKLAND | 127,393 | 127,393 | 554 | 45,047 | 0.0 | |
| GOODMAN GROUP | 86,301 | 86,301 | 2,118 | 172,228 | 0.0 | |
| VICINITY CENTRES | 250,037 | 241,241 | 408 | 33,239 | 0.0 | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数 <比率> | 1,414,722 11銘柄 | 1,421,243 11銘柄 | 9,363 | 761,167 <0.2%> | 0.2 |
| (香港) | | | 千香港・ドル | | | |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS | 197,000 | 197,000 | 2,092 | 30,524 | 0.0 | |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 125,000 | 193,500 | 1,480 | 21,597 | 0.0 | |
| LINK REIT | 110,100 | 110,100 | 7,563 | 110,356 | 0.0 | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数 <比率> | 432,100 3銘柄 | 500,600 3銘柄 | 11,136 | 162,478 <0.0%> | 0.0 |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘 | 柄 | 期首 (前期末) | | 期 | | 末 |
|------------------------------|--------------------------|-----------|-----------|-------------------|-----------|------|
| | | 口 | 数 | 口 | 数 | 組入比率 |
| | | | | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | | | | | | |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | | 159,000 | 170,500 | 千シンガポール・ドル 509 | 42,420 | 0.0 |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMER | | 238,488 | 259,616 | 555 | 46,229 | 0.0 |
| SUNTEC REIT | | 102,700 | — | — | — | — |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | 138,100 | 208,100 | 397 | 33,073 | 0.0 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | | 104,900 | 112,400 | 234 | 19,547 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 743,188 | 750,616 | 1,697 | 141,270 | 0.0 |
| | | 5銘柄 | 4銘柄 | | <0.0%> | |
| (イギリス) | | | | | | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 39,861 | 39,861 | 千イギリス・ポンド 299 | 45,370 | 0.0 |
| SEGRO PLC | | 59,874 | 68,623 | 972 | 147,427 | 0.0 |
| BRITISH LAND CO PLC | | 44,962 | 44,962 | 234 | 35,530 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 144,697 | 153,446 | 1,506 | 228,328 | 0.1 |
| | | 3銘柄 | 3銘柄 | | <0.1%> | |
| (ユーロ・・・フランス) | | | | | | |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | | 8,630 | 7,024 | 千ユーロ 421 | 54,117 | 0.0 |
| ICADE | | 2,061 | — | — | — | — |
| GECINA SA | | 2,189 | 2,189 | 261 | 33,548 | 0.0 |
| KLEPIERRE | | 9,305 | 13,600 | 259 | 33,277 | 0.0 |
| COVIVIO | | 2,388 | 2,388 | 175 | 22,495 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 24,573 | 25,201 | 1,117 | 143,437 | 0.0 |
| | | 5銘柄 | 4銘柄 | | <0.0%> | |
| ユーロ通貨計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 24,573 | 25,201 | 1,117 | 143,437 | 0.0 |
| | | 5銘柄 | 4銘柄 | | <0.0%> | |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 3,511,872 | 3,534,994 | — | 8,338,643 | 2.4 |
| | | 70銘柄 | 63銘柄 | | <2.4%> | |

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

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 | 柄 | 別 | 期 | | 末 |
|---|-------------------------|---|--------------|-------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 | |
| 外 | S & P 500 EMINI FUT | | 百万円 5,899 | | 百万円 — |
| | S P I 200 FUTURE S | | 249 | | — |
| 国 | F T S E 100 I D X F U T | | 323 | | — |
| | E U R O S T O X X 50 | | 1,138 | | — |

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

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

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

※期末における外貨建資産（352,603,331千円）の投資信託財産総額（353,968,499千円）に対する比率は99.6%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、1スイス・フラン=123.25円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローナ=12.53円、1ユーロ=128.41円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月30日現在)

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

※当期における期首元本額59,674,216,686円、期中追加設定元本額13,275,575,985円、期中一部解約元本額12,298,918,149円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2020年12月1日 至2021年11月30日)

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

※有価証券売買損益および先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

| | | | |
|----------------------------------|-----------------|---|----------------|
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS | 31,877,680,130円 | 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド | 12,792,410円 |
| 三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型) | 257,237,232円 | SMAM・外国株式バッシブ・ファンド (適格機関投資家専用) | 591,445,429円 |
| 三井住友・DC年金バランス50 (標準型) | 1,092,113,150円 | バランスファンドVA (安定運用型) <適格機関投資家限定> | 3,447,518円 |
| 三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型) | 759,876,748円 | SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定> | 32,980,346円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型) | 63,296,820円 | SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 704,179,317円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020 (4資産タイプ) | 1,131,648円 | SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 824,854,056円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025 (4資産タイプ) | 5,750,140円 | SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 3,604,698,411円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030 (4資産タイプ) | 17,334,902円 | SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 12,109,077円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035 (4資産タイプ) | 47,583,616円 | SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 64,600,386円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040 (4資産タイプ) | 49,206,031円 | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 508,707,107円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045 (4資産タイプ) | 93,432,630円 | SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 41,029,721円 |
| 外国株式指数ファンド | 762,591,588円 | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 102,099,408円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド | 12,154,970,474円 | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 495,008,013円 |
| アセットアロケーション・ファンド (安定型) | 136,154,453円 | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 350,695,262円 |
| アセットアロケーション・ファンド (安定成長型) | 161,478,755円 | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 829,398,471円 |
| アセットアロケーション・ファンド (成長型) | 106,177,098円 | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 218,848円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 26,039,960円 | 三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用) | 218,605,667円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 15,113,153円 | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 75,145,593円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型) | 110,598,046円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 8,737,379円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型) | 97,319,132円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 7,911,776円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型) | 330,128,909円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 4,096,558円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型) | 170,705,412円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 21,448,701円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型) | 195,254,066円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 60,189,060円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 38,559,109円 | SMAM・グローバルバランスファンド (標準型) VA<適格機関投資家限定> | 139,958,110円 |
| 三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド | 509,621,059円 | SMAM・グローバルバランスファンド (債券重視型) VA<適格機関投資家限定> | 63,429,174円 |
| 三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型) | 4,097,387円 | SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 817,767,596円 |
| 三井住友DS・年金バランス50 (標準型) | 17,354,910円 | SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 118,979,244円 |
| 三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型) | 15,630,593円 | SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定> | 1,028,620,924円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,093,613円 | SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 27,233,124円 |
| SMBC・DCインデックスファンド (MSC Iコクサイ) | 110,450,992円 | SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 37,994,675円 |
| 日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジあり) | 67,713,873円 | SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 41,244,635円 |
| 日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジなし) | 281,821,366円 | SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定> | 222,731,531円 |

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

第18期（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

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

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

■ 最近 5 期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | (ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース) | | 公 社 債 率 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|------------------|---------|------|---|------|--------------------|---------|
| | 期 騰 落 | 中 率 | 期 騰 落 | 中 率 | | |
| 14期（2017年12月18日） | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| | 17,897 | 4.6 | 181.01 | 4.9 | 98.9 | 196,212 |
| 15期（2018年12月17日） | 17,553 | △1.9 | 177.36 | △2.0 | 98.7 | 168,894 |
| 16期（2019年12月17日） | 18,248 | 4.0 | 184.64 | 4.1 | 98.6 | 171,892 |
| 17期（2020年12月17日） | 19,109 | 4.7 | 193.48 | 4.8 | 99.0 | 161,689 |
| 18期（2021年12月17日） | 19,947 | 4.4 | 201.87 | 4.3 | 99.1 | 162,393 |

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

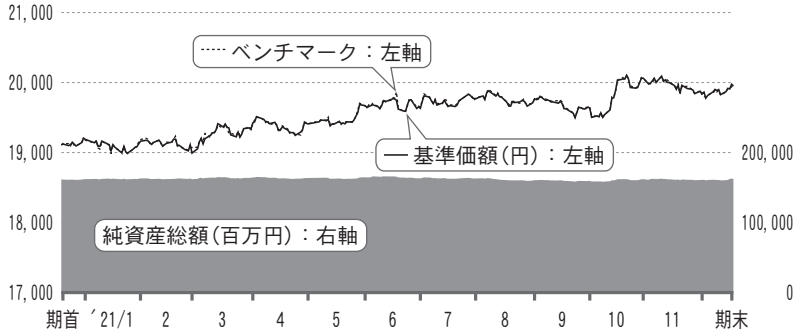
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | (ベ ン チ マ ー ク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円ベース) | | 公 社 債 組 入 比 率 |
|----------------------|-------------|--------|--|--------|------------------|
| | | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | |
| (期 首) 2020年12月17日 | 円 19,109 | % — | 193.48 | % — | % 99.0 |
| 12月末 | 19,189 | 0.4 | 194.18 | 0.4 | 98.6 |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

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

基準価額等の推移



※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、円ベース）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の国債に分散投資し、ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に対し、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション（投資資金の平均回収期間）等を可能な限り近似させることにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- ・グローバルに金利先高観が強まる中、米ドルを中心に対円で投資通貨が上昇したこと

下落要因

- ・グローバルに中央銀行の将来の金融緩和策の縮小が意識され、米欧金利が上昇（債券価格は下落）したこと

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

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

債券市場

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

為替市場

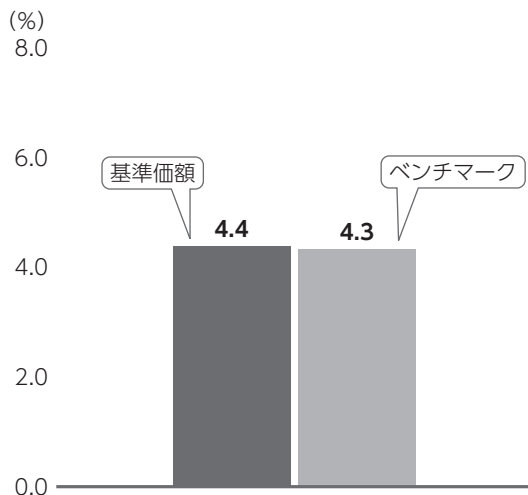
米欧を中心とした経済再開の本格化やインフレ率上昇懸念の高まりから、グローバルに中央銀行の金融緩和策の縮小が意識される中、米欧の金利先高観が強まり、米ドルを中心に対円で投資通貨が上昇しました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

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

上方乖離要因

・キャッシュフローに伴う売買のタイミング

2 今後の運用方針

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

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

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

■ 1万口当たりの費用明細 (2020年12月18日から2021年12月17日まで)

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

期中の平均基準価額は19,551円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年12月18日から2021年12月17日まで)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|---------|---------|-----------------------|-----------------------|
| 外 | ア メ リ カ | 国 債 証 券 | 千アメリカ・ドル 195,849 | 千アメリカ・ドル 163,553 |
| | カ ナ ダ | 国 債 証 券 | 千カナダ・ドル 12,407 | 千カナダ・ドル 14,579 |
| | オーストラリア | 国 債 証 券 | 千オーストラリア・ドル 1,902 | 千オーストラリア・ドル 23,215 |
| | シンガポール | 国 債 証 券 | 千シンガポール・ドル 1,174 | 千シンガポール・ドル 932 |
| | イギリス | 国 債 証 券 | 千イギリス・ポンド 7,602 | 千イギリス・ポンド 16,887 |
| | イスラエル | 国 債 証 券 | 千イスラエル・シェケル 9,140 | 千イスラエル・シェケル 8,450 |
| | デンマーク | 国 債 証 券 | 千デンマーク・クローネ 1,771 | 千デンマーク・クローネ 8,663 |
| | ノルウェー | 国 債 証 券 | 千ノルウェー・クローネ 1,555 | 千ノルウェー・クローネ 2,049 |
| | スウェーデン | 国 債 証 券 | 千スウェーデン・クローナ 2,614 | 千スウェーデン・クローナ 8,806 |
| | メキシコ | 国 債 証 券 | 千メキシコ・ペソ 20,788 | 千メキシコ・ペソ 52,993 |
| | 中 国 | 国 債 証 券 | 千オフショア・人民元 39,140 | 千オフショア・人民元 - |
| | マレーシア | 国 債 証 券 | 千マレーシア・リンギット 4,583 | 千マレーシア・リンギット 7,324 |
| | ポーランド | 国 債 証 券 | 千ポーランド・ズロチ 35,968 | 千ポーランド・ズロチ 40,616 |
| | 国 | ユ ー ロ | | 千ユーロ |
| アイルランド | | 国 債 証 券 | 1,270 | 1,111 |
| オランダ | | 国 債 証 券 | 4,395 | 5,272 |
| ベルギー | | 国 債 証 券 | 4,624 | 8,181 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|-------------|---------|--------|--------|
| 外 | フ ラ ン ス | 国 債 証 券 | 26,142 | 32,170 |
| | ド イ ツ | 国 債 証 券 | 22,150 | 24,196 |
| 国 | ス ペ イ ン | 国 債 証 券 | 7,855 | 8,933 |
| | イ タ リ ア | 国 債 証 券 | 15,196 | 23,507 |
| | フ ィ ン ラ ン ド | 国 債 証 券 | 1,451 | 3,116 |
| | オ ー ス ト リ ア | 国 債 証 券 | 2,517 | 4,650 |

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 （2020年12月18日から2021年12月17日まで）

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

■ 組入れ資産の明細（2021年12月17日現在）

公社債

A 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 区 分 | 期 | | | | 末 | | | |
|---------|-----------------------|-----------------------|------------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|----------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル 644,020 | 千アメリカ・ドル 672,251 | 千円 76,549,238 | % 47.1 | % — | % 21.6 | % 17.3 | % 8.3 |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 32,300 | 千カナダ・ドル 35,262 | 3,142,202 | 1.9 | — | 1.0 | 0.7 | 0.2 |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 29,350 | 千オーストラリア・ドル 32,046 | 2,618,502 | 1.6 | — | 1.2 | 0.4 | 0.1 |
| シンガポール | 千シンガポール・ドル 7,950 | 千シンガポール・ドル 8,624 | 720,460 | 0.4 | — | 0.3 | 0.0 | 0.1 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 区 分 | 期 | | | | 末 | | | |
|-------------|------------------------|------------------------|-------------|---------|---------------------|-------------------|---------|---------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組 入 比 率 | うちBBB格以下 組 入 比 率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| イ ギ リ ス | 千イギリス・ポンド 48,450 | 千イギリス・ポンド 64,546 | 9,793,053 | 6.0 | — | 4.8 | 0.7 | 0.6 |
| イ ス ラ エ ル | 千イスラエル・シェケル 18,400 | 千イスラエル・シェケル 20,818 | 763,243 | 0.5 | — | 0.2 | 0.1 | 0.2 |
| デ ン マ ー ク | 千デンマーク・クローネ 31,900 | 千デンマーク・クローネ 41,093 | 712,971 | 0.4 | — | 0.4 | 0.0 | 0.0 |
| ノ ル ウ ェ ー | 千ノルウェー・クローネ 29,700 | 千ノルウェー・クローネ 30,253 | 383,313 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | 0.0 |
| ス ウ ェ ー デ ン | 千スウェーデン・クローナ 33,000 | 千スウェーデン・クローナ 36,917 | 465,525 | 0.3 | — | 0.1 | 0.1 | 0.1 |
| メ キ シ コ | 千メキシコ・ペソ 201,000 | 千メキシコ・ペソ 208,282 | 1,139,138 | 0.7 | — | 0.4 | 0.2 | 0.1 |
| 中 国 | 千オフショア・人民元 39,000 | 千オフショア・人民元 39,234 | 700,385 | 0.4 | — | 0.2 | 0.2 | 0.1 |
| マ レ ー シ ア | 千マレーシア・リンギット 26,900 | 千マレーシア・リンギット 27,865 | 753,031 | 0.5 | — | 0.3 | 0.1 | — |
| ポ ー ラ ン ド | 千ポーランド・ズロチ 27,600 | 千ポーランド・ズロチ 27,894 | 776,753 | 0.5 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| アイルランド | 9,000 | 10,300 | 1,328,861 | 0.8 | — | 0.6 | 0.2 | 0.0 |
| オランダ | 19,500 | 23,835 | 3,074,959 | 1.9 | — | 1.3 | 0.4 | 0.2 |
| ベルギー | 22,750 | 27,521 | 3,550,490 | 2.2 | — | 1.6 | 0.5 | 0.1 |
| フランス | 105,370 | 123,265 | 15,902,433 | 9.8 | — | 6.3 | 2.9 | 0.6 |
| ドイツ | 78,500 | 91,073 | 11,749,439 | 7.2 | — | 4.5 | 2.0 | 0.7 |
| スペイン | 60,950 | 73,322 | 9,459,337 | 5.8 | — | 3.7 | 1.7 | 0.4 |
| イタリア | 93,470 | 109,645 | 14,145,323 | 8.7 | — | 5.5 | 2.3 | 0.9 |
| フィンランド | 6,300 | 7,279 | 939,103 | 0.6 | — | 0.4 | 0.1 | 0.1 |
| オーストリア | 14,500 | 17,402 | 2,245,153 | 1.4 | — | 0.9 | 0.3 | 0.2 |
| 合 計 | — | — | 160,912,922 | 99.1 | — | 55.6 | 30.4 | 13.1 |

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 外国（外貨建）公社債

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2021年12月17日現在)

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

※期末における外貨建資産（162,014,412千円）の投資信託財産総額（164,409,226千円）に対する比率は98.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.87円、1カナダ・ドル=89.11円、1オーストラリア・ドル=81.71円、1シンガポール・ドル=83.54円、1イギリス・ポンド=151.72円、1イスラエル・シェケル=36.661円、1デンマーク・クローネ=17.35円、1ノルウェー・クローネ=12.67円、1スウェーデン・クローナ=12.61円、1メキシコ・ペソ=5.469円、1オフショア・人民元=17.851円、1マレーシア・リンギット=27.023円、1ポーランド・ズロチ=27.846円、1ユーロ=129.01円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月17日現在)

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

※当期における期首元本額84,615,543,547円、期中追加設定元本額10,172,463,204円、期中一部解約元本額13,375,904,420円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2020年12月18日 至2021年12月17日)

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

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

| | | | |
|---------------------------------|-----------------|---|-----------------|
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS | 24,487,844,372円 | SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 4,563,065,943円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 760,198,503円 | SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 10,603,737,345円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 2,105,125,950円 | SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 35,392,217円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 1,119,007,643円 | SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 93,650,011円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 155,624,983円 | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 718,495,736円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 6,821,569円 | SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 117,631,749円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 29,780,404円 | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 1,068,564,548円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 100,943,914円 | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 1,438,731,860円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 215,809,603円 | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 1,547,910,459円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 146,490,369円 | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 4,874,996,538円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 247,645,688円 | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 627,347円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 25,113,488円 | SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定> | 8,237,337,020円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 75,454,990円 | 三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 331,971,594円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 112,630,498円 | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 150,359,802円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 63,013,857円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 81,175,759円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 117,794,452円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 33,971,193円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 16,988,179円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 11,926,289円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 66,333,551円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 96,352,849円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 49,304,278円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 426,754,581円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 119,676,115円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 104,874,447円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 34,468,587円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 40,181,590円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 16,515,743円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 5,252,180円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 117,826,123円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 1,046,403,883円 |
| 三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド | 227,846,301円 | SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定> | 648,746,322円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 12,061,797円 | SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定> | 960,695,213円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 35,271,630円 | SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 1,134,108,974円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 23,882,832円 | SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 404,802,053円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,248,709円 | SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド<適格機関投資家限定> | 51,663,081円 |
| 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし) | 163,477,935円 | SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 141,011,485円 |
| 三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド | 3,442,227円 | SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 295,647,332円 |
| SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 2,390,473,483円 | SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 321,381,894円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定> | 44,105,389円 | SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定> | 1,395,550,617円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 7,335,907,258円 | | |

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。