

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	無期限（設定日：2008年3月31日）
運用方針	内外の株式、公社債および短期金融資産を主要投資対象とする5つのマザーファンドへの投資を通じて、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	当ファンドは以下の各マザーファンドを主要投資対象とします。 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） 日本の取引所に上場している株式 国内債券パッシブ・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 外国債券パッシブ・マザーファンド FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）採用国の国債 マネーインカム・マザーファンド 円貨建の短期公社債および短期金融商品
当ファンドの運用方法	<ul style="list-style-type: none"> ■日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産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。 ■委託会社が独自に作成する基本資産配分に對し、一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。 ■運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。 国内株式：TOPIX（東証株価指数、配当込み） 国内債券：NOMURA-BPI（総合） 外国株式：MSCIコカサインデックス（配当込み、円ベース） 外国債権：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：無担保コール翌日物
組入制限	当ファンド <ul style="list-style-type: none"> ■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。 ■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70%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） <ul style="list-style-type: none"> ■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。 国内債券パッシブ・マザーファンド <ul style="list-style-type: none"> ■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 <ul style="list-style-type: none"> ■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。 外国債券パッシブ・マザーファンド <ul style="list-style-type: none"> ■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。 マネーインカム・マザーファンド <ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	年1回（原則として毎年4月13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。

SMAM・グローバル バランスファンド （機動的資産配分型）

【愛称：資産配分おまかせくん】

【運用報告書（全体版）】

（2019年4月16日から2020年4月13日まで）

第 12 期

決算日 2020年4月13日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドは内外の株式、公社債および短期金融資産を主要投資対象とする5つのマザーファンドへの投資を通じて、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。



〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1

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

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式比率	株式先比率 (<small>健</small> - <small>健</small>)	債券組比率	投資信託証券組比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
8期(2016年4月13日)	12,610	0	△5.9	134.65	△1.9	29.0	0.7	66.7	0.2	796
9期(2017年4月13日)	12,972	0	2.9	138.62	2.9	36.5	0.8	60.5	0.4	977
10期(2018年4月13日)	13,760	0	6.1	148.17	6.9	40.5	1.1	56.1	0.5	1,320
11期(2019年4月15日)	13,725	0	△0.3	150.81	1.8	36.7	0.9	61.0	0.4	1,552
12期(2020年4月13日)	13,151	0	△4.2	147.72	△2.0	29.9	0.4	68.0	0.5	1,600

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

※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、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）および無担保コール翌日物を基本資産配分で組み合わせた合成指数で、設定時を100として2020年4月13日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

なお、基本資産配分は、以下の通りです。

国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
20%	50%	10%	15%	5%

基本資産配分は、5年に一度程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

※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		株式組入 比 率	株式先物 比 率 (買建-売建)	債券組入 比 率	投資信託 証券組入 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率				
(期 首) 2019年4月15日	円 13,725	% -		% -	% 36.7	% 0.9	% 61.0	% 0.4
4月末	13,697	△0.2	150.50	△0.2	36.6	0.5	60.7	0.4
5月末	13,420	△2.2	147.80	△2.0	28.3	0.6	69.3	0.3
6月末	13,575	△1.1	149.91	△0.6	32.9	0.5	61.6	0.5
7月末	13,670	△0.4	150.75	△0.0	32.9	0.4	64.4	0.5
8月末	13,564	△1.2	150.22	△0.4	28.8	0.8	67.8	0.5
9月末	13,659	△0.5	151.79	0.7	32.6	0.8	65.2	0.5
10月末	13,849	0.9	153.74	1.9	40.4	1.2	57.2	0.5
11月末	13,985	1.9	154.72	2.6	48.2	1.1	49.4	0.6
12月末	14,101	2.7	155.49	3.1	47.9	0.8	49.7	0.5
2020年1月末	14,072	2.5	155.42	3.1	40.1	0.9	58.0	0.4
2月末	13,586	△1.0	151.77	0.6	34.8	0.8	61.8	0.5
3月末	13,029	△5.1	147.04	△2.5	29.2	0.6	68.7	0.4
(期 末) 2020年4月13日	円 13,151	% △4.2		% △2.0	% 29.9	% 0.4	% 68.0	% 0.5

※騰落率は期首比です。

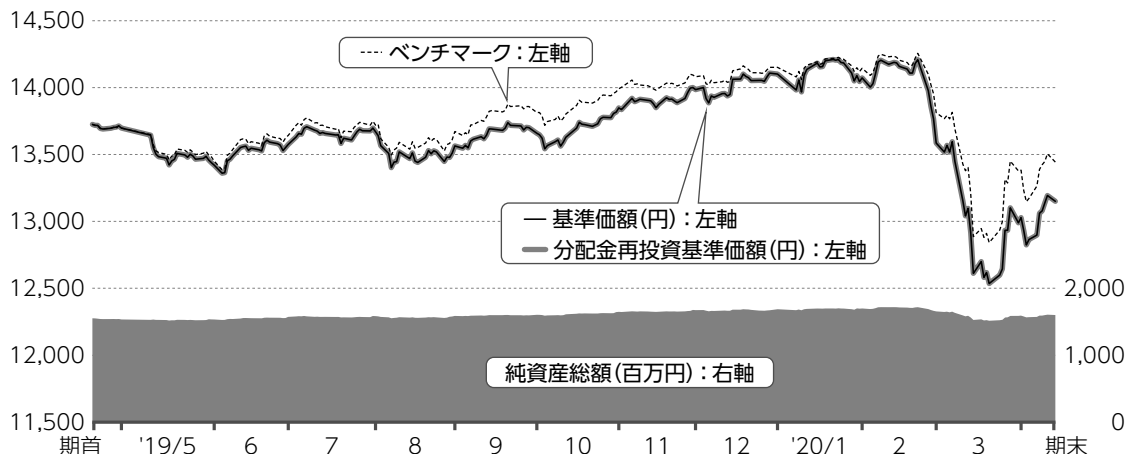
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

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

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、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	13,725円
期末	13,151円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	-4.2% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

※当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)および無担保コール翌日物を基本資産配分で組み合わせた合成指数です。

※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、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

内外の株式、公社債および短期金融資産を主要投資対象とする5つのマザーファンドへの投資を行いました。実質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

- 外国債券の利回りが低下(価格は上昇)したこと

下落要因

- 内外の株式市場が下落したこと
- 米ドルやユーロが円に対して下落したこと

組入れファンドの状況

組入れファンド	投資資産	騰落率	期末組入比率
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	国内株式	-11.3%	12.0%
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	+0.2%	61.0%
外国株式インデックス・マザーファンド	外国株式	-9.9%	18.9%
外国債券パッシブ・マザーファンド	外国債券	+3.7%	6.9%
マネーインカム・マザーファンド	短期金融資産	-0.1%	0.9%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について（2019年4月16日から2020年4月13日まで）

内外の株式市場は下落し、内外の債券市場は上昇しました。為替市場では、米ドルやユーロが円に対して下落する展開となりました。

国内株式

国内株式は、先行きの企業業績に対する慎重な見方などを背景に期初から上値が重い相場が続きました。6月から7月下旬にかけては、米国の利下げ期待の高まりなどを背景とした海外株式の上昇に連れて上昇基調で推移しましたが、円の上昇に伴う企業業績への懸念等が上値の抑制要因となりました。F R B（米連邦準備制度理事会）は7月末に約10年半ぶりとなる利下げを実施しました。8月に入り、米国が対中関税第4弾の導入を表明したことで、再び米中貿易摩擦の激化が懸念され、国内株式は下落しました。9月から2020年1月中旬にかけて、米中の貿易交渉に対する進展等（12月には貿易協議の第一段階の合意が発表されました）を背景に、株価は上昇傾向で推移しました。その後、期末にかけては新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念等から、株価は大幅に下落する展開となりました。

当期の市場の動きを代表的な指数であるT O P I X（東証株価指数、配当込み）で見ると、期首に比べて11.3%下落しました。

国内債券

日銀の金融緩和政策が続く中、米欧の債券利回りの低下に連れて、日本の長期債利回り（10年国債利回り）も期首から8月後半にかけては低下基調で推移しました。その後は、2020年1月中旬まで、米中貿易協議の進展を受けた米欧債券利回りの上昇に押される形で、国内債券利回りも上昇基調で推移しました。その後は、新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念等から債券利回りが低下しましたが、3月には世界的な金融市場の混乱を受け、現金化目的の売りが債券市場にも波及し、利回りが急上昇するなど、非常に値動きの荒い相場展開となりました。

当期の市場の動きを代表的な指数であるN O M U R A - B P I（総合）で見ると、期首に比べて0.2%の上昇となりました。

外国株式

先進国外国株式は、期首から概ねもみあいでも推移しました。5月には、米国が中国に対する追加関税の引上げを発表し、米中貿易摩擦に対する警戒感等から株価が大幅に調整しました。6月から7月下旬にかけては、米国

での金融緩和期待の高まり等から、米国を中心に先進国外国株式は底堅く推移しました。FRBは7月末に約10年半ぶりとなる利下げを実施しました。8月には、米国が中国に対する新たな制裁関税の賦課を公表したことで米中貿易摩擦に再度焦点が当たり、株価が大きく調整しました。8月下旬から2020年1月中旬頃にかけては、米中貿易協議の進展などを背景に、株価が持ち直す動きになりました。その後、期末にかけて新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念等を背景に、株価は大幅に下落する展開となりました。

当期の市場の動きを代表的な指数であるMSCIコクサイインデックス(配当込み、米ドルベース)で見ると、期首に比べて6.6%下落しました。

外国債券

米国国債利回りは、期を通してみれば低下しました。米中貿易摩擦に対する警戒感等から米国国債利回りは期初から8月後半にかけて低下基調で推移しました。その後、1月中旬には、米中貿易協議の進展を受け、リスク回避姿勢が後退し、債券利回りは小幅に上昇する展開となりました。その後は、新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念や3月に入ってからFRBの緊急利下げ等を受け、債券利回りは低下する動きとなりました。

欧州では、英国のEU離脱を巡る迷走やイタリアの政治情勢を巡る混乱など欧州政治の不透明感などを背景に、ドイツの債券利回り

は、期初から8月後半にかけて低下基調で推移しました。その後は、2020年1月中旬にかけて米中貿易協議の進展や、英のEU離脱にめどがついたことなどで利回りが上昇(価格は下落)する動きとなりました。その後、期末にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念や米FRBによる緊急利下げ等を背景に債券利回りが低下しました。3月に入り、現金化目的の債券売りが強まり、利回りが急上昇するなど値動きの荒い展開となりました。

当期の市場の動きを米国10年国債利回りで見ると、期首2.57%から期末0.72%へと低下し、ドイツ10年国債利回りで見ると、期首0.06%から期末-0.35%へと低下しました。

外国為替

米ドル・円は、期初以降、米中貿易摩擦に対する懸念や、FRBによる金融緩和観測の高まりなどが米ドルの上値抑制要因となり、8月後半にかけて、米ドルはじり安の展開となりました。その後は2月中旬まで、米国株価の上昇等も背景に、米ドルはじり高の展開となりました。その後は新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念やFRBによる緊急利下げの動きなどを背景に、米ドル・円相場は大幅に下落しました。3月には米ドル資金需要の高まりを背景に、米ドルが急上昇するなど非常に値動きの荒い展開となりました。

当期の米ドル・円は、期首112円01銭か

ら期末108円23銭と3円78銭の米ドル安・円高となりました。

ユーロ・円は、期初から、英国のEU離脱を巡る迷走やイタリアの政治情勢を巡る混乱など欧州政治の不透明感や欧州債券利回りの低下等がユーロの下押し材料となりました。10月以降は米中貿易協議の進展などを背景

にユーロが上昇する展開になりました。2月以降から期末にかけては新型コロナウイルスの感染拡大を受け、再びユーロが下落しました。

当期のユーロ・円は、期首126円60銭から期末118円27銭と8円33銭のユーロ安・円高となりました。

ポートフォリオについて(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

当ファンド

当期の各資産の組入れは以下の通りです。

資産	期首	期末	当期の動き	配分理由
国内株式	中立	UW	↓	期前半、国内株式は米中通商交渉の影響を受けやすいと判断し、UWを構築しました。その後、米中交渉の進展や相対的な割安感を評価し、10月以降段階的にOWまで引き上げました。期末には、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、ウイルスの流行前から国内景気が脆弱であることを考慮し、UWへ引き下げました。
国内債券	中立	OW	↑	期前半、米中通商交渉の対立が激化する局面で、OWを構築しました。その後、米中交渉の進展を受けて、株式優位の展開を想定し、UWへ引き下げました。期末には、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、リスクオフを警戒し、再びOWへ引き上げました。
外国株式	OW	OW	→	当期は、相対的に底堅い企業業績や、欧米中銀の金融緩和スタンスを評価し、OWを継続しました。その中で、期前半に米中通商交渉の対立が激化した局面や、期後半に新型コロナウイルスの感染拡大を受けて市場の変動性が高まった局面では、OW幅を抑制し、機動的にウェイトを調整しました。
外国債券	UW	UW	→	期初から9月にかけて、主にリスクオフによる円高進行を警戒し、UWとしました。10月には、米中通商交渉の進展を背景に、リスクオフの展開を見込み、中立へと引き上げました。その後、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、再びUWへ引き下げ、期末まで同方針を維持しました。
短期金融資産	UW	UW	→	内外の株式・債券の投資方針に合わせて機動的に方針を変更しました。

OW(オーバーウェイト)：投資対象資産への配分比率が、ベンチマークの配分比率より高いこと

UW(アンダーウェイト)：投資対象資産への配分比率が、ベンチマークの配分比率より低いこと

中立：投資対象資産への配分比率が、ベンチマークの配分比率とほぼ同じであること

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

また、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。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

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）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（投資資金の平均回収期間）、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。

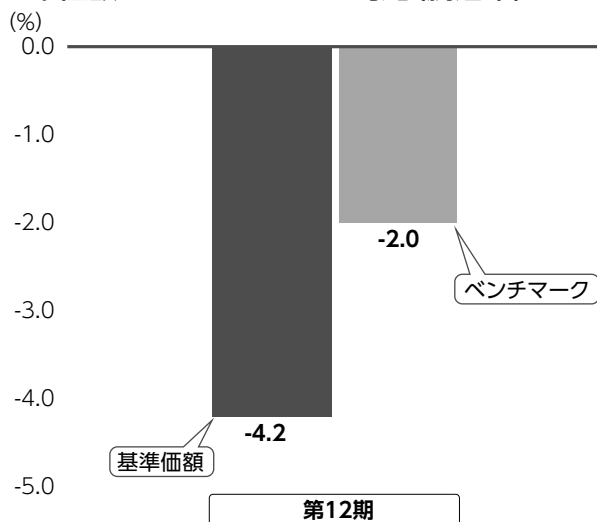
インデックス構成銘柄の変更が実施される毎月末において、ファンドの特性値（国別比率、デュレーション等）をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資配分比率の調整）を行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

マネーインカム・マザーファンド

主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

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

基準価額とベンチマークの対比(騰落率)



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは、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：無担保コール翌日物を、基本資産配分(国内株式20%、国内債券50%、外国株式10%、外国債券15%、短期金融資産5%)で組み合わせた合成指数をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

ベンチマークとの差異の状況および要因

当期における基準価額の騰落率は-4.2%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率-2.0%を2.2%下回りました。

マイナス要因

- 2020年2月の内外株式のオーバーウェイトが、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に株式市場が急落したことでマイナス寄与となったこと

分配金について(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第12期
当期分配金	—
(対基準価額比率)	(—%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	5,318

※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。

当期の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りといたしました。

なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、短期金融資産を主要投資対象とするマザーファンドを通じて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。基本資産配分に対し一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。運用にあたっては、基本資産配分に基づいて各資産の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

引き続き、T O P I X (東証株価指数、配当込み)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T O P I X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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、N O M U R A - B P I (総合)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）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（先物含む）を高位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）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、日々の資金流出入に対応し、迅速なリ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。

マネーインカム・マザーファンド

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

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

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

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	88円 (31) (52) (4)	0.645% (0.230) (0.383) (0.033)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料 (株式) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0)	0.002 (0.001) (0.000) (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 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	0 (0) (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
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	2 (2) (1) (0)	0.018 (0.011) (0.005) (0.001)	その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	90	0.668	

期中の平均基準価額は13,683円です。

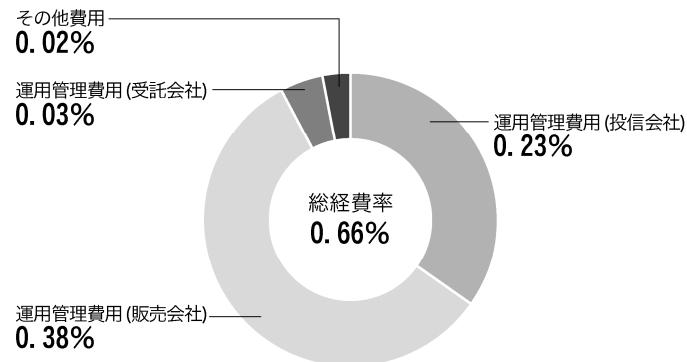
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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0.66%です。

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

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	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）	244,921	641,140	281,719	710,180
外国株式インデックス・マザーファンド	138,472	495,730	123,499	458,910
外国債券パッシブ・マザーファンド	148,827	269,430	185,246	334,886
国内債券パッシブ・マザーファンド	935,823	1,211,300	776,744	1,006,540
マネーインカム・マザーファンド	217,582	219,750	218,589	220,760

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 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

(2019年4月16日から2020年4月13日まで)

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	35,597,356千円	97,456,153千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	162,857,099千円	194,864,419千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.21	0.50

※単位未満は切捨て。

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

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

(1)利害関係人との取引状況

S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

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	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株 式	15,935	3,038	19.1	19,661	9,746	49.6
株 式 先 物 取 引	48,082	31,772	66.1	48,757	28,056	57.5

※平均保有割合 0.2%

※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	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 37,794	百万円 2,857	% 7.6	百万円 75,636	百万円 5,835	% 7.7

※平均保有割合 0.6%

※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

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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。

マネーインカム・マザーファンド

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 1,863	百万円 100	% 5.4	百万円 -	百万円 -	% -

※平均保有割合 2.0%

※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。

(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 124	百万円 171	百万円 1,437

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 201

(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
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

種 類	買 付 額
株 式	百万円 1

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 400

(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
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	31千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	7千円
(c) (b) / (a)	23.7%

※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、株式会社三井住友銀行、株式会社関西みらいフィナンシャルグループ、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、SMB C日興証券株式会社です。

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

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

■ 組入れ資産の明細(2020年4月13日現在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	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）	121,085	84,286	191,887
外国株式インデックス・マザーファンド	76,136	91,109	302,637
外国債券パッシブ・マザーファンド	95,754	59,334	109,698
国内債券パッシブ・マザーファンド	601,656	760,735	977,012
マネーインカム・マザーファンド	14,875	13,868	13,997

※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）	66,999,567千口	外国株式インデックス・マザーファンド	58,474,870千口
外国債券パッシブ・マザーファンド	84,556,952千口	国内債券パッシブ・マザーファンド	102,757,947千口
マネーインカム・マザーファンド	2,617,198千口		

※単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2020年4月13日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	191,887	11.9
外国株式インデックス・マザーファンド	302,637	18.8
外国債券パッシブ・マザーファンド	109,698	6.8
国内債券パッシブ・マザーファンド	977,012	60.8
マネーインカム・マザーファンド	13,997	0.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,114	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	1,606,345	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。

※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(195,996,890千円)の投資信託財産総額(196,338,963千円)に対する比率は99.8%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(155,667,088千円)の投資信託財産総額(156,679,949千円)に対する比率は99.4%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=108.23円、1カナダドル=77.55円、1メキシコペソ=4.62円、1ユーロ=118.27円、1英ポンド=134.80円、1スイスフラン=112.02円、1スウェーデンクローナ=10.88円、1ノルウェークローネ=10.56円、1デンマーククローネ=15.84円、1ポーランドズロチ=25.99円、1オーストラリアドル=68.57円、1ニュージーランドドル=65.75円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=76.41円、1マレーシアリンギット=25.06円、1イスラエルシェケル=30.27円、1南アフリカランド=6.00円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年4月13日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,606,345,405円
コール・ローン等	10,882,083
国内株式インテックス・マザーファンド(8号)(評価額)	191,887,276
外国株式インテックス・マザーファンド(評価額)	302,637,967
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	109,698,052
国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	977,012,801
マネーインカム・マザーファンド(評価額)	13,997,226
未 収 入 金	230,000
(B) 負 債	5,671,166
未 払 解 約 金	325,113
未 払 信 託 報 酬	5,300,001
未 払 利 息	12
そ の 他 未 払 費 用	46,040
(C) 純資産総額(A-B)	1,600,674,239
元 本	1,217,129,568
次 期 繰 越 損 益 金	383,544,671
(D) 受 益 権 総 口 数	1,217,129,568口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,151円

※当期における期首元本額1,130,847,594円、期中追加設定元本額242,872,998円、期中一部解約元本額156,591,024円です。

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

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

■ 分配金のお知らせ

	当 期
1万口当たり分配金(税引前)	－円

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

■ 損益の状況

(自2019年4月16日 至2020年4月13日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 4,659円
支 払 利 息	△ 4,659
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 58,046,743
売 買 益	43,310,577
売 買 損	△101,357,320
(C) 信 託 報 酬 等	△ 10,381,568
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 68,432,970
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	104,301,383
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	347,676,258
(配 当 等 相 当 額)	(513,658,534)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△165,982,276)
(G) 計 (D+E+F)	383,544,671
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	383,544,671
追 加 信 託 差 損 益 金	347,676,258
(配 当 等 相 当 額)	(513,932,575)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△166,256,317)
分 配 準 備 積 立 金	133,372,444
繰 越 損 益 金	△ 97,504,031

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

※期末における、費用控除後の配当等収益(14,466,039円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(513,932,575円)および分配準備積立金(118,906,405円)より分配可能額は647,305,019円(1万口当たり5,318円)ですが、分配は行っておりません。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第17期 (2018年12月1日から2019年12月2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、T O P I X (東証株価指数、配当込み) の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株比	株式先物率 比 (買建-売建)	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
13期 (2015年11月30日)	円 23,013	% 13.3	2,200.15	% 13.3	% 98.0	% 1.9	百万円 224,719
14期 (2016年11月30日)	21,863	△ 5.0	2,091.95	△ 4.9	97.9	2.1	204,698
15期 (2017年11月30日)	27,242	24.6	2,604.86	24.5	98.5	1.5	193,025
16期 (2018年11月30日)	25,937	△ 4.8	2,475.92	△ 4.9	97.1	2.8	173,547
17期 (2019年12月2日)	27,359	5.5	2,611.46	5.5	97.7	2.3	174,398

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※T O P I X (東証株価指数) 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) 2018年11月30日	円 25,937	% -	2,475.92	% -	% 97.1	% 2.8
12月末	23,280	△10.2	2,223.11	△10.2	98.3	1.8
2019年1月末	24,425	△ 5.8	2,332.52	△ 5.8	99.1	0.9
2月末	25,062	△ 3.4	2,393.08	△ 3.3	99.0	0.9
3月末	25,084	△ 3.3	2,395.21	△ 3.3	97.1	2.8
4月末	25,502	△ 1.7	2,434.82	△ 1.7	98.2	1.8
5月末	23,846	△ 8.1	2,275.96	△ 8.1	97.8	2.2
6月末	24,496	△ 5.6	2,338.89	△ 5.5	97.8	2.3
7月末	24,720	△ 4.7	2,360.18	△ 4.7	98.6	1.3
8月末	23,885	△ 7.9	2,280.58	△ 7.9	97.9	2.0
9月末	25,328	△ 2.3	2,418.29	△ 2.3	97.6	2.3
10月末	26,600	2.6	2,539.02	2.5	97.0	2.8
11月末	27,116	4.5	2,588.40	4.5	97.6	2.3
(期末) 2019年12月2日	27,359	5.5	2,611.46	5.5	97.7	2.3

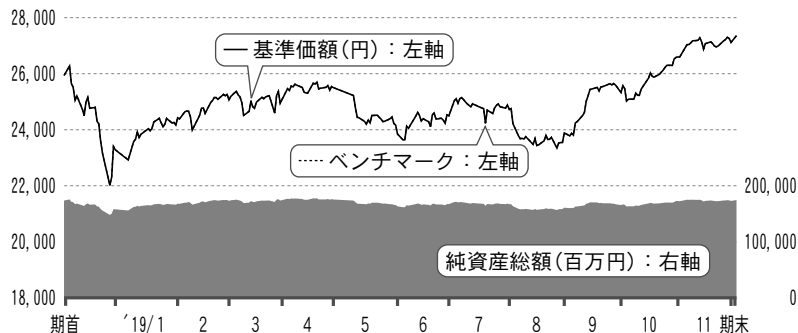
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

基準価額等の推移



期首	25,937円
期末	27,359円
騰落率	+5.5%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）です。

※TOPIX（東証株価指数）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（2018年12月1日から2019年12月2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

- ・ 2018年12月下旬から2019年4月下旬にかけて、米中貿易摩擦問題に対する懸念の後退や中国の景気対策期待が高まったこと
- ・ 8月下旬から期末にかけて、トランプ米大統領が中国との貿易協議継続に前向きな姿勢を示したことや、世界景気や企業業績の底打ち回復期待が高まったこと

下落要因

- ・ 期首から12月下旬にかけて、低調な国内企業決算に加え、米国で金利上昇への警戒感の高まりなどから株式市場が急落し、世界的にリスク回避の動きが広がったこと
- ・ 4月下旬から8月下旬にかけて、再び米中貿易摩擦問題が激化したこと

▶ 投資環境について（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期首から2018年12月下旬にかけては、低調な国内企業決算に加え、米国で金利上昇への警戒感の高まりなどから株式市場が急落し、世界的にリスク回避の動きが広がったことから、国内株式市場も大幅に下落しました。

12月下旬から2019年4月下旬にかけては、米中貿易摩擦問題に対する懸念の後退や中国の景気対策に対する期待が高まったことから、上昇しました。

4月下旬から8月下旬にかけては、5月の追加関税の相互引上げや8月の米国による新たな対中追加関税の導入発表など、米中貿易摩擦問題が激化したことなどが重石となり、軟調な推移となりました。

8月下旬から期末にかけては、トランプ米大統領が中国との貿易協議継続に前向きな姿勢を示したことなどから反発し、世界景気・企業業績の底打ち回復期待を背景に、上昇する展開となりました。

当期の市場の動きをベンチマークであるTOPIX（東証株価指数、配当込み）でみると、期首に比べて5.5%上昇しました。

▶ ポートフォリオについて（2018年12月1日から2019年12月2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

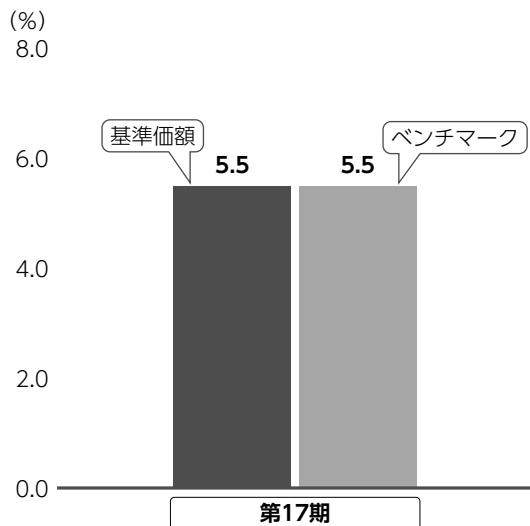
TOPIX（東証株価指数、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+5.5%となり、ベンチマークの騰落率+5.5%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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	1円 (0) (1)	0.005% (0.001) (0.003)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.001 (0.001)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	1	0.006	

期中の平均基準価額は25,021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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 8,251 (1,286)	千円 14,919,624 ()	千株 8,990	千円 18,015,919

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類	別	買 建		売 建		
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	
国 内	株式先物取引	T O P I X	百万円 43,587	百万円 44,780	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	32,935,543千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	164,850,191千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.19

※単位未満は切捨て。

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 利害関係人との取引状況等（2018年12月1日から2019年12月2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	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株 式	14,919	464	3.1	18,015	7,954	44.2
株 式 先 物 取 引	43,587	10,428	23.9	44,780	6,674	14.9

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株 式	110	162	1,955

(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	7,657千円
(b) うち利害関係人への支払額	1,075千円
(c) (b) / (a)	14.0%

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社関西みらいフィナンシャルグループ、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、NECキャピタルソリューション株式会社、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

（2018年12月1日から2019年12月2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（2019年12月2日現在）

(1) 国内株式

銘 柄	期首(前期末)		期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	3.5	3.6		10,458
日本水産	96.8	95.8		63,802
マルハニチロ	14	13.8		40,544
カネコ種苗	4	4.3		6,544
サカタのタネ	11.5	10.9		38,531
ホクト	7.9	7.2		14,407
鉱業 (0.3%)				
日鉄鉱業	2.4	2.5		11,425
三井松島ホールディングス	4.9	3.3		3,969
国際石油開発帝石	389.5	384.9		408,571
石油資源開発	13.7	12.4		35,203
K&Oエナジーグループ	5.1	5.3		8,358

銘 柄	期首(前期末)		期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
建設業 (2.8%)				
ヒノキヤグループ	2.6	3.2		7,145
ショーボンドホールディングス	7.5	13.5		57,510
ミライト・ホールディングス	24.1	27.6		45,208
タマホーム	7.2	5.5		10,131
TATERU	12.5	-		-
スペースバリューホールディングス	12.8	13.8		7,107
安藤・間	61.7	57.3		51,856
東急建設	28.4	28		21,952
コムシスホールディングス	34.3	33.8		107,822
ミサワホーム	9.3	8.5		10,183
ビーアールホールディングス	10.5	13		6,292
高松コンストラクショングループ	6	6		16,398
東建コーポレーション	2.9	2.8		20,440

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
大成建設	79.5	73.4	318,923	
大林組	239	220.7	260,426	
清水建設	243.6	223.8	238,347	
飛鳥建設	7.5	8	11,760	
長谷工コーポレーション	99.8	84.4	120,523	
松井建設	10.8	11.2	8,758	
銭高組	1.3	1.3	5,206	
鹿島建設	187	172.2	251,412	
不動テトラ	7	7	10,801	
大末建設	5.4	5.4	5,205	
鉄建建設	5.1	5.1	14,514	
西松建設	17.8	17.7	43,081	
三井住友建設	59.3	56	34,160	
大豊建設	5.5	5.1	15,294	
前田建設工業	57.8	56.7	56,359	
奥村組	13.6	12.6	38,997	
東鉄工業	9.4	9	29,475	
浅沼組	3.2	3	13,125	
戸田建設	93.4	92.7	63,221	
熊谷組	11.4	10.3	33,732	
北野建設	2.2	2	5,212	
矢作建設工業	13.1	12.1	9,244	
ピーエス三菱	11.1	10.6	7,409	
日本ハウスホールディングス	18.3	20	9,640	
大東建託	28.6	26.5	353,907	
新日本建設	10.2	10.4	9,651	
N I P P O	20.6	17.7	39,931	
東亜道路工業	2.2	1.8	6,219	
前田道路	25.2	23.2	60,366	
日本道路	2.3	2.3	16,123	
東亜建設工業	7.5	8.3	13,089	
日本国土開発	—	15	9,390	
若築建設	5.8	5.3	9,015	
東洋建設	32.3	26.1	13,154	
五洋建設	96.4	89.3	56,884	
世紀東急工業	14.8	13.3	11,757	
福田組	2.8	2.8	13,510	
住友林業	56.5	55.3	88,148	
日本基礎技術	—	12.2	4,916	
巴コーポレーション	16	14.4	5,745	
大和ハウス工業	221.4	218.4	741,468	
ライト工業	15.6	12.6	19,996	
積水ハウス	245.5	241.5	578,271	
日特建設	8.7	—	—	
ユアテック	13.3	13.8	9,342	
中電工	9.6	8.2	21,172	
関電工	35	29.2	30,776	
きんでん	52.8	51.8	85,936	
東京エネクス	9.1	9.4	8,817	
トーエネック	2.8	2.9	10,556	
住友電設	6.2	6.3	15,554	
日本電設工業	13.2	11.2	25,401	
協和エクシオ	31.3	33.3	95,804	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
新日本空調	7.5	6.1	13,676	
九電工	15.8	15.5	54,947	
三機工業	18.2	15.7	23,236	
日揮ホールディングス	69	68.6	111,269	
中外炉工業	3.1	3.2	5,465	
ヤマト	10	9.4	6,786	
太平電業	5.5	5.7	13,298	
高砂熱学工業	19.7	18.6	35,358	
朝日工業社	2.3	2.1	7,287	
明星工業	14.8	14.7	13,671	
大気社	10.9	10.7	39,643	
ダイダン	5.6	5.5	14,476	
日比谷総合設備	7.9	7.4	14,422	
東芝プラントシステム	17	17	45,288	
OSJBホールディングス	40.7	41.7	11,300	
レイズネクスト	15.1	12.6	15,649	
食料品（3.9%）				
日本製粉	22.6	20.2	34,663	
日清製粉グループ本社	79.9	79.4	163,405	
日東富士製粉	0.6	—	—	
昭和産業	6.3	6.1	19,703	
鳥越製粉	9.1	8.5	8,032	
中部飼料	9.2	8.9	12,371	
フィード・ワン	52.4	53.4	9,078	
日本甜菜製糖	5.3	4.7	9,588	
三井製糖	5.5	5.9	13,688	
日新製糖	3.8	3.4	6,864	
森永製菓	18.1	16.5	92,565	
中村屋	2.5	2.5	11,175	
江崎グリコ	21.5	21	106,890	
名糖産業	5.4	4.9	6,443	
井村屋グループ	3.5	3.8	7,820	
不二家	4.5	4.3	9,520	
山崎製パン	58.5	53.3	108,518	
モロゾフ	1.6	1.7	8,449	
亀田製菓	4.5	4	20,120	
寿スピリッツ	7.5	6.7	51,322	
カルビー	32.7	32.2	114,632	
森永乳業	14.5	13.3	61,645	
六甲バター	5.5	5.3	9,582	
ヤクルト本社	53	48.5	316,705	
明治ホールディングス	50.5	46.5	350,145	
雪印メグミルク	17.3	17.1	45,588	
ブリマハム	9.9	10.7	27,327	
日本ハム	30.7	26.9	125,085	
丸大食品	8	7	16,387	
S Foods	6.4	5.4	16,227	
伊藤ハム米久ホールディングス	40.6	45.3	32,525	
サッポロホールディングス	26.3	24.4	65,367	
アサヒグループホールディングス	150.1	148	779,368	
キリンホールディングス	324.1	299.6	731,473	
宝ホールディングス	53.9	53.7	57,673	
オエノンホールディングス	24.8	22.2	8,991	

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	
養命酒製造	3.2	3.5	7,000
コカ・コーラ ボトラスジャパンホールデ	54.7	49.8	131,770
サントリー食品インターナショナル	47.5	47	223,485
ダイドーグループホールディングス	3.9	3.5	16,222
伊藤園	23.7	21.3	118,002
キーコーヒー	6.9	6.7	16,073
日清オイリオグループ	9	8.8	34,496
不二製油グループ本社	17.5	17.3	53,197
かどや製油	1	1.3	4,959
J-オイルミルズ	3.6	3.6	15,714
キッコーマン	47.1	50.6	283,360
味の素	158.3	157.2	288,619
キュービー	39.9	39.4	96,766
ハウス食品グループ本社	27.1	26.3	100,992
カゴメ	28.6	27.1	72,844
焼津水産化学工業	7.7	5.7	5,996
アリアケジャパン	6.4	6.4	50,432
ニチレイ	37.1	33.6	86,721
東洋水産	36.6	36.1	171,294
イトアンド	3.6	3.7	6,604
ヨシムラ・フード・ホールディングス	—	4.4	5,310
日清食品ホールディングス	30.2	29.9	246,077
永谷園ホールディングス	4.6	4.2	9,038
一正蒲鉾	3.3	4.3	4,570
フジッコ	7.8	7.6	15,283
ロック・フィールド	7.6	7.8	11,544
日本たばこ産業	413.6	407.7	1,025,977
ケンコーマヨネーズ	4.5	4.4	11,448
わらべや日洋ホールディングス	5.1	5.1	9,276
なとり	5.5	5.4	9,180
ビックルスコオペレーション	2.3	2	5,570
北の達人コーオペレーション	28.9	23.6	16,614
ユーグレナ	29.4	29.1	24,327
ミヨシ油脂	3.5	4.3	5,551
理研ビタミン	3.6	3	12,195
繊維製品 (0.6%)			
片倉工業	10	11.1	15,295
グンゼ	5.1	5.1	26,520
東洋紡	30.3	28.2	45,740
ユニチカ	21.3	23.7	8,911
富士紡ホールディングス	3.9	3.9	13,572
倉敷紡績	6.7	7.1	18,332
シキボウ	6.3	—	—
日本毛織	23	22.5	24,187
ダイドーリミテッド	23	15	4,200
帝国繊維	8	8.3	16,948
帝人	56.7	55.3	115,908
東レ	543.1	500.4	369,295
住江織物	2.4	2.6	7,415
アuzzi	8.1	9.6	7,958
ダイニック	6.2	6.4	4,915
セーレン	17.1	16.9	26,364
小松マテーレ	12.5	12.8	10,624

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
ワコールホールディングス	20.5	18.2	56,147
ホギメディカル	8.8	8	28,880
レナウン	—	35	4,025
T S Iホールディングス	25.8	24.5	13,548
マツオカコーポレーション	2.5	2.8	6,151
ワールド	8	10	27,660
三陽商会	4.9	5.1	7,175
オンワードホールディングス	45.4	41.7	26,813
ゴールドウイン	6.3	12.6	100,044
デサント	17	13.9	25,159
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	4.5	4.4	17,842
王子ホールディングス	311.9	285.3	180,309
日本製紙	33.3	30.7	59,404
三菱製紙	14.8	11.7	5,943
北越コーポレーション	45.8	45.7	26,003
中越パルプ工業	4	4.3	7,077
巴川製紙所	3.1	—	—
大玉製紙	33.1	29.4	43,923
レンゴー	72.1	65.3	53,937
トーモク	5.2	5.1	9,078
ザ・バック	5.4	5	19,550
化学 (7.2%)			
クラレ	117	108	145,584
旭化成	497.5	459.4	562,535
昭和電工	46.5	48.7	144,395
住友化学	546.5	507.3	255,171
住友精化	3.4	3.3	11,517
日産化学	42.8	38.5	170,940
ラサ工業	3.4	3.3	5,029
クレハ	6.3	5.8	37,990
多木化学	1.1	2.3	10,465
テイカ	5.9	5.2	10,160
石原産業	13.9	12.9	15,273
日本曹達	10.9	10.2	30,151
東ソー	107.7	105.2	174,526
トクヤマ	20.4	19.9	59,222
セントラル硝子	15.8	14.5	39,106
東亞合成	44.3	43.6	55,590
大阪ソーダ	7.5	6.9	21,045
関東電化工業	16.9	16.8	17,690
デンカ	27.4	24.9	82,045
信越化学工業	123.2	118.4	1,409,552
日本カーバイド工業	3.2	3.2	4,758
堺化学工業	4.8	4.6	11,564
第一稀元素化学工業	6.7	9.4	8,206
エア・ウォーター	56.5	55.7	97,586
大陽日酸	57.6	66.2	162,190
日本化学工業	2.6	2.4	7,656
日本パーカライジング	38.9	35.4	41,311
高圧ガス工業	12.8	12.4	9,957
チタン工業	—	1.8	4,820
四国化成工業	11.8	10.4	13,457

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	
戸田工業	2.1		2.5		5,535
ステラ ケミファ	4.3		4		12,940
保土谷化学工業	2.9		2.8		10,920
日本触媒	11.7		10.8		74,196
大日精化学工業	5.7		6.2		20,026
カネカ	18.4		17.7		63,100
三菱瓦斯化学	71.8		64.5		111,198
三井化学	63		62.6		165,890
J S R	70.2		64.3		124,099
東京応化工業	12.2		12		48,900
大阪有機化学工業	7.2		7.2		10,072
三菱ケミカルホールディングス	467		461		377,328
K H ネオケム	10.8		12.3		30,922
ダイセル	108.4		94		102,460
住友ベークライト	12.2		10.9		47,415
積水化学工業	151.5		148.2		284,544
日本ゼオン	63.2		62.3		87,531
アイカ工業	21.1		20.7		72,864
宇部興産	35.2		34.2		82,216
積水樹脂	11.5		12.3		28,117
タキロンシーアイ	16.9		16.1		10,883
旭有機材	5.3		4.5		7,740
日立化成	32.2		31.9		128,078
ニチバン	4.1		4.1		7,978
リケンテクノス	21.8		19.2		9,792
大倉工業	4.4		3.9		7,585
積水化成成品工業	11.3		10.2		8,160
群栄化学工業	2.4		2.4		5,997
ミライアル	-		3.3		4,544
ダイキョーニシカワ	14.6		14.4		12,441
森六ホールディングス	4.1		4.1		9,753
日本化薬	44.4		43.1		59,822
カーリットホールディングス	9.1		9.5		5,985
日本精化	7.3		6.7		8,361
扶桑化学工業	7.1		6.9		21,217
トリケミカル研究所	1.7		1.6		12,480
A D E K A	34.6		31.9		53,273
日油	27		25.9		96,607
ハリマ化成グループ	7.3		6.2		7,712
花王	173.3		168.5		1,467,298
第一工業製薬	3		2.9		10,802
石原ケミカル	2.8		-		-
三洋化成工業	4.6		4		21,960
大日本塗料	9.3		9.1		10,610
日本ペイントホールディングス	57.6		56.8		333,984
関西ペイント	78.6		77.6		217,047
中国塗料	23.2		20.3		20,990
日本特殊塗料	5.6		5.9		8,118
藤倉化成	12.6		13.2		7,550
太陽ホールディングス	5.7		5		20,875
D I C	31.6		28.7		86,042
サカタインクス	15.2		15.1		18,074
東洋インキS Cホールディングス	14.1		13.9		37,265

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
T & K T O K A	6.4		7.1		7,114
富士フイルムホールディングス	148.2		134.8		698,533
資生堂	141.9		139.8		1,121,056
ライオン	99.5		91.3		201,225
高砂香料工業	5		4.6		11,877
マンダム	15.8		15.8		47,953
ミルボン	8.9		9.4		59,314
ファンケル	31.6		28.6		83,912
コーセー	12.1		13.2		232,716
コタ	4.4		5.1		7,073
シーズ・ホールディングス	8.7		-		-
ポーラ・オルビスホールディングス	30.5		30		81,660
ノエビアホールディングス	4.4		6.6		41,448
エステー	5.6		5.4		9,374
アグロ カネショウ	3.3		3.3		4,735
コニシ	12.5		11.8		17,546
長谷川香料	8.7		9.7		19,225
星光P M C	6		-		-
小林製薬	20		19.7		178,088
荒川化学工業	7.1		7		11,067
メック	5.6		5.4		8,775
日本高純度化学	3.2		-		-
タカラバイオ	18.6		18.7		40,279
J C U	9.4		8.7		25,682
デクセリアルズ	18.8		19		20,805
アース製薬	5.3		5.3		30,210
北興化学工業	10.5		9.1		5,350
大成ラミック	3.6		3.3		9,405
クミアイ化学工業	29.7		29.5		30,296
日本農薬	18.6		14.6		8,584
アキレス	5.8		5.6		10,225
有沢製作所	12.8		11.7		11,676
日東電工	54		48.2		299,322
レック	7.8		8.1		10,530
三光合成	-		11.6		5,011
藤森工業	6.2		6.1		21,533
前澤化成工業	7.7		6.6		7,900
未来工業	-		4.5		10,093
J S P	4.5		4.6		8,763
エフピコ	5.8		7.8		51,870
天馬	5.4		5.3		10,663
信越ポリマー	13.7		12.6		12,196
東リ	23.5		23.1		7,299
ニフコ	28.6		25.5		77,775
バルカー	6.1		5.9		15,481
ユニ・チャーム	151.6		136.1		494,587
医薬品 (6.0%)					
協和キリン	88.7		70.2		164,338
武田薬品工業	281.9		586		2,631,726
アステラス製薬	658		619.5		1,175,811
大日本住友製薬	52.9		52.5		111,457
塩野義製薬	93.4		89.9		585,878
田辺三菱製薬	73.9		85.2		170,655

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
あすか製薬	9.4	9	11,898	
日本新薬	18.7	18.4	183,264	
中外製薬	74.1	73.4	720,274	
科研製薬	13	12.2	72,834	
エーザイ	85.5	84.3	680,469	
ロート製薬	36.7	35.9	125,829	
小野薬品工業	168.9	162	398,115	
久光製薬	21.1	20.7	111,987	
持田製薬	5.5	10	44,750	
参天製薬	135.2	130.9	270,177	
扶桑薬品工業	3.8	3.6	7,570	
日本ケミファ	1.6	1.5	4,458	
ツムラ	22.3	22.1	70,609	
日医工	17.1	20.1	27,135	
キッセイ薬品工業	12.8	12.8	39,040	
生化学工業	14	14.2	18,048	
栄研化学	12.6	12.8	25,446	
鳥居薬品	4.1	4.5	12,829	
JCRファーマ	5.1	5	46,750	
東和薬品	3.4	9	25,551	
富士製薬工業	5.3	5.6	7,896	
沢井製薬	14.8	14.7	95,991	
ゼリア新薬工業	14.2	13	28,314	
第一三共	204.3	201.4	1,412,216	
キョーリン製薬ホールディングス	18.3	14.7	27,621	
大幸薬品	4.1	3.3	11,121	
ダイト	4.3	4.4	13,970	
大塚ホールディングス	136	134.1	648,909	
大正製薬ホールディングス	15.9	14.8	121,064	
ペプチドリーム	33.1	35.7	182,427	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	75	81.7	6,617	
昭和シェル石油	66.9	—	—	
ニチレキ	10.1	9.5	12,350	
ユシロ化学工業	5.1	5.9	8,112	
富士石油	19.7	25.2	5,997	
MORESCO	3.8	—	—	
出光興産	55.2	79.1	234,610	
JXTGホールディングス	1,215.3	1,090.7	531,825	
コスエネルギーホールディングス	20.2	20.7	49,555	
ゴム製品 (0.8%)				
横浜ゴム	41.6	40.7	93,732	
TOYO TIRE	37.3	41.2	65,096	
ブリヂストン	219.5	216.7	958,030	
住友ゴム工業	64.3	63.4	89,520	
オカモト	5.1	4.5	18,810	
ニッタ	8	7.9	25,240	
住友理工	14.1	13.7	14,015	
三ツ星ベルト	9.6	9.6	20,265	
バンドー化学	14.2	13.5	12,501	
ガラス・土石製品 (0.9%)				
日東紡績	10.6	10.6	43,460	
AGC	71.5	69.5	283,212	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本板硝子	33.5	21.5	13,953	
日本山村硝子	4.2	5.4	6,928	
日本電気硝子	30.9	28.5	67,830	
オハラ	3.1	3.6	5,259	
住友大阪セメント	14.6	13.7	64,253	
太平洋セメント	45	44.5	144,180	
日本ヒューム	8.9	9.3	7,635	
日本コンクリート工業	20.5	20.5	5,576	
三谷セキサン	3.7	3.5	12,565	
アジアパイルホールディングス	11.7	13.3	7,315	
東海カーボン	64.7	73.8	80,368	
日本カーボン	3.5	3.7	15,854	
東洋炭素	4.4	4.6	11,164	
ノリタケカンパニーリミテド	4.3	4	19,040	
TOYO	54.7	50.3	240,685	
日本碍子	86.5	85.4	158,587	
日本特殊陶業	60	54.6	121,648	
MARUWA	2.6	2.8	21,140	
品川リフラクトリーズ	2.2	2.4	7,728	
黒崎播磨	1.5	1.5	8,730	
ヨータイ	7.8	8.2	5,690	
東京窯業	12.6	16.5	5,626	
ニッカトー	4.3	—	—	
フジミインコーポレーテッド	6.4	6.4	18,489	
ニチアス	19.3	19.3	50,392	
ニチハ	9.9	9.7	26,936	
鉄鋼 (0.8%)				
日本製鉄	316	311.5	507,277	
神戸製鋼所	129.4	129.3	73,571	
中山製鋼所	11.9	13	6,461	
合同製鐵	4.1	4.1	10,799	
ジェイエフイーホールディングス	190.7	187.9	265,314	
日新製鋼	17.2	—	—	
東京製鐵	37.7	34.2	28,591	
共英製鋼	8	8	16,800	
大和工業	15.2	15.1	41,600	
東京鐵鋼	4.1	4	6,128	
大阪製鐵	5.1	4.5	6,520	
淀川製鋼所	9.2	9.1	19,373	
丸一鋼管	25.1	22.9	72,822	
モリ工業	2.7	2.7	6,760	
大同特殊鋼	11.8	11.4	56,601	
日本冶金工業	61.4	5.9	13,747	
山陽特殊製鋼	8.9	5.4	8,083	
愛知製鋼	3.9	3.9	14,196	
日立金属	77.7	74.9	115,121	
大平洋金属	5	4.9	11,848	
新日本電工	46.4	50.2	9,086	
栗本鐵工所	4.6	4.3	8,518	
三菱製鋼	6	6.7	7,638	
シンニッタン	14.7	14.7	6,556	
非鉄金属 (0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	13.1	11.2	8,769	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本軽金属ホールディングス	196.2	178	40,406	
三井金属鉱業	19.4	18.9	52,182	
東邦亜鉛	4	4	8,540	
三菱マテリアル	46.6	45.7	134,906	
住友金属鉱山	97	89.2	294,449	
DOWAホールディングス	16.6	17.6	69,520	
古河機械金属	11.8	12.5	18,950	
大阪チタニウムテクノロジーズ	8.6	7.8	12,269	
東邦チタニウム	13.2	13.7	13,289	
UACJ	10.5	10.7	26,610	
CKサンエツ	1.7	1.8	5,409	
古河電気工業	20.6	21.5	65,145	
住友電気工業	264.2	260	435,370	
フジクラ	87.2	85.9	39,428	
昭和電線ホールディングス	—	9.6	9,744	
タツタ電線	16.3	15.3	8,981	
平河ヒューテック	3.6	—	—	
リョービ	8.8	8.5	17,875	
アーレスティ	10.2	11.5	6,141	
アサヒホールディングス	13.4	12.5	32,587	
金属製品 (0.6%)				
稲葉製作所	5.7	5.5	7,870	
宮地エンジニアリンググループ	2.7	3.3	6,880	
トーカロ	19.6	19.4	21,572	
アルファC o	4	4.3	5,637	
SUMCO	78.5	83.5	141,198	
川田テクノロジーズ	1.7	1.7	11,645	
RS Technologies	1.6	2.2	8,173	
東洋製罐グループホールディングス	44.9	44.6	86,613	
ホッカンホールディングス	4.8	4.8	9,408	
コロナ	5.6	5.9	7,021	
横河ブリッジホールディングス	13.3	13	24,583	
三和ホールディングス	73.2	66.8	81,496	
文化シャッター	21.5	21.2	20,585	
三協立山	10.2	10.5	13,104	
アルインコ	8.9	7	8,379	
LIXILグループ	104.2	103	194,155	
ノーリツ	15.7	14.9	20,979	
長府製作所	7	7.2	17,719	
リンナイ	12.6	13.6	114,648	
日東精工	12.5	13	8,502	
岡部	15.2	14.6	13,519	
ジーテクト	8.3	8.7	15,103	
東ブレ	12.8	12.9	22,304	
高周波熱錬	14.4	14.2	12,595	
東京製綱	5.9	6.7	7,745	
パイオラックス	11.2	10.2	22,603	
エイチワン	8	9.3	7,858	
日本発條	71	75	73,650	
三益半導体工業	6.1	6.2	12,474	
機械 (5.1%)				
日本製鋼所	21.8	21.5	48,697	
三浦工業	30.7	30.1	111,219	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
タクマ	25.7	23.7	30,288	
ツガミ	16.1	14.8	16,738	
オークマ	9	8	49,200	
東芝機械	8	7.9	22,127	
アマダホールディングス	107.8	87.3	108,863	
アイダエンジニアリング	19.5	18.2	18,236	
FUJI	20.6	28.7	55,878	
牧野フライス製作所	8.1	8	43,280	
オーエスジー	35	32.4	73,126	
旭ダイヤモンド工業	19.2	19.1	12,529	
DMG森精機	44.9	43.9	76,956	
ソディック	15.6	16.7	17,067	
ディスコ	9.6	9.4	221,370	
日東工器	4.4	4.3	9,576	
日進工具	2.4	2.1	4,882	
パンチ工業	—	9.2	5,280	
豊和工業	5	5.7	4,263	
津田駒工業	2.2	—	—	
島精機製作所	9.8	11.3	31,402	
オプトラン	7.1	8	23,464	
イワキポンプ	—	4.5	5,157	
フリー	7.6	8.6	9,030	
ヤマシンフィルタ	12.9	15.2	13,315	
日阪製作所	10.1	10.3	10,300	
やまびこ	13.7	13.8	15,745	
平田機工	3.4	3.3	26,301	
ベガサスミシン製造	8.6	10.7	5,489	
マルマエ	—	3.5	3,650	
タツモ	—	3.6	4,312	
ナブテスコ	39	40.9	139,469	
三井海洋開発	7.5	7.6	18,977	
レオン自動機	7.1	6.9	11,433	
S M C	20.9	22.1	1,103,453	
ホソカワミクロン	2.6	2.7	12,190	
ユニオンツール	3.2	2.6	8,554	
オイレス工業	9.8	9.3	15,735	
日精エー・エス・ビー機械	2.3	2.6	12,727	
サトーホールディングス	8.6	10.1	34,037	
技研製作所	4.9	6.4	28,416	
日精樹脂工業	7.3	7.3	7,489	
オカダアイオン	3.2	—	—	
ワイエイシイホールディングス	—	4.1	2,931	
小松製作所	323.3	318.7	824,476	
住友重機械工業	40.5	39.8	125,967	
日立建機	28.5	27.5	81,152	
日工	2.7	12.4	9,312	
巴工業	3.7	3.9	8,899	
井関農機	7.5	7.9	13,090	
TOWA	7.3	7.8	8,970	
北川鉄工所	3.7	3.6	8,164	
ローツェ	3.6	3.2	12,560	
クボタ	382.8	373.2	643,956	
荏原実業	3.5	2.6	5,891	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
三菱化工機	3.9		3.7		7,052
月島機械	14.2		13.4		22,860
帝国電機製作所	5.8		7.1		9,386
新東工業	17		16.7		17,334
澁谷工業	6.3		6.3		19,908
アイチ コーポレーション	14.2		13.7		9,905
小森コーポレーション	19.1		17.6		20,433
鶴見製作所	6		6.1		12,541
住友精密工業	1.8		1.8		6,210
酒井重工業	1.8		1.9		5,823
荏原製作所	31.8		29.3		98,008
西島製作所	9.8		8.9		8,561
北越工業	8.1		8.5		10,863
ダイキン工業	97.4		89.7		1,414,569
オルガノ	3.1		2.6		17,004
トーヨーカネツ	3.1		3.9		8,907
栗田工業	38.5		37.8		118,503
椿本チエイン	9.1		9.6		36,672
大同工業	5.7		6.2		5,189
アネスト岩田	11.8		11.9		12,090
ダイフク	39.3		35.6		234,604
加藤製作所	3.9		4.5		8,284
タダノ	35		34.8		37,966
フジテック	25.5		25.1		43,799
CKD	19.9		19.7		36,543
キトー	6.1		6		9,906
平和	19.7		19.7		44,699
理想科学工業	6.2		6.6		12,493
SANKYO	17.9		16.1		59,892
日本金銭機械	9		9.4		8,732
マースグループホールディングス	5.1		5.5		11,198
福島工業	4.3		4.4		15,400
ダイコク電機	4.3		4.5		7,569
竹内製作所	11.9		11.6		19,627
アマノ	20.7		18.5		60,772
JUKI	10.2		10.6		9,688
サンデンホールディングス	9.3		—		—
蛇の目マシン工業	9.9		—		—
マックス	10.9		10.7		22,534
グローリー	19.9		19.7		65,601
新晃工業	7.4		6.9		13,047
大和冷機工業	10.3		10.7		13,824
セガサミーホールディングス	71		70.4		111,584
日本ピストンリング	3.5		4.4		6,340
リケン	3.3		3.4		14,603
TPR	9.4		9		18,819
ツバキ・ナカシマ	11		14.6		25,053
ホシザキ	20.8		20.6		197,966
大豊工業	6.9		7.4		6,467
日本精工	145		130.7		140,763
NTN	152.2		161.9		56,017
ジェイテクト	67.6		65.9		91,205
不二越	6.8		6.6		33,924

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
日本トムソン	22.3		22.9		11,427
THK	44.7		40.8		127,296
ユーシン精機	6.3		6.7		7,095
前澤給装工業	4.1		3.7		7,943
イーグル工業	9.3		8.9		9,665
日本ピラー工業	8.3		7.8		11,793
キッツ	28.9		29		22,098
マキタ	86.6		91.5		339,007
日立造船	54.2		56		24,360
三菱重工業	119.7		117.7		499,518
IHI	54.8		50.9		131,525
スター精密	12.5		11.2		17,348
電気機器 (14.2%)					
日清紡ホールディングス	39.6		47.8		48,708
イビデン	44.1		43.5		112,186
コニカミノルタ	156.2		155.1		112,602
ブラザー工業	92.7		85.5		188,185
ミネベアミツミ	132.3		130.1		280,885
日立製作所	321.1		338.3		1,457,734
三菱電機	713.2		704		1,080,288
富士電機	46.3		42.2		144,535
東洋電機製造	4		3.8		5,947
安川電機	82.8		75.6		307,314
シンフォニアテクノロジー	10.3		9.4		12,943
明電舎	14.2		13.1		28,138
オリジン	3.2		3.4		5,157
山洋電気	3.6		3.5		19,110
デンヨー	7.5		6.5		13,585
東芝テック	8.8		8.8		39,248
芝浦メカトロニクス	1.7		1.6		6,352
マブチモーター	19.6		19.3		81,542
日本電産	85.9		84.7		1,382,727
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4.2		—		—
トレックス・セミコンダクター	3.2		4.9		7,198
東光高岳	4.4		5.5		6,583
ダブル・スコープ	10.9		—		—
宮越ホールディングス	—		3.9		4,009
ダイヘン	7.9		7.7		28,451
ヤーマン	10.6		11.2		7,862
JVCケンウッド	53.2		60		16,500
ミマキエンジニアリング	7.3		9.3		4,910
第一精工	3.9		3		7,935
日新電機	17		16.7		19,238
大崎電気工業	15.9		16.2		12,069
オムロン	75.7		65.3		427,062
日東工業	11.6		10.7		26,792
IDEC	9.9		10.5		24,832
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26		24.1		55,526
サクサホールディングス	2.7		3		5,934
メルコホールディングス	3		2.8		8,680
日本電気	92		85.4		379,176
富士通	68.9		67.9		682,395
沖電気工業	31.4		29.9		45,747

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
電気興業	4.3	3.7	11,525	
サンケン電気	8.6	8	25,360	
アイホン	5.4	5.1	9,720	
ルネサスエレクトロニクス	73	336.3	241,799	
セイコーエプソン	88.4	86.9	144,427	
ワコム	53	47.8	21,414	
アルバック	16.6	14.1	60,630	
EIZO	6.6	5.5	22,990	
ジャパンディスプレイ	93	—	—	
日本信号	18.3	18.5	24,124	
京三製作所	18.5	19	9,804	
能美防災	9.5	9.6	22,876	
ホーチキ	5.3	6	10,002	
エレコム	6.5	7.7	31,916	
パナソニック	815.1	805.2	830,966	
シャープ	71.1	81.6	135,129	
アンリツ	45.8	45.7	94,690	
富士通ゼネラル	22.3	19.8	41,718	
ソニー	478.4	444.9	3,113,410	
TDK	37.3	33.8	395,122	
帝国通信工業	5.4	5.8	6,989	
タムラ製作所	28.1	24.2	15,972	
アルプスアルパイン	65.3	62.2	154,691	
日本トリム	1.6	1.3	6,448	
ローランド ディー. ジー.	4.3	4.8	10,440	
フォスター電機	8.8	7.7	15,577	
クラリオン	6.2	—	—	
SMK	2.6	2.4	7,149	
ヨコオ	5.7	4.6	14,973	
ホシデン	21.3	19.3	25,437	
ヒロセ電機	10.3	10.9	149,439	
日本航空電子工業	16.4	16	33,664	
TOA	8.6	8.9	9,790	
マクセルホールディングス	15.3	15.4	23,007	
古野電気	9.7	10.1	12,756	
ユニデンホールディングス	2.8	2.8	5,143	
アルパイン	12.9	—	—	
スミダコーポレーション	7	6.4	8,480	
アイコム	4.4	4.6	11,904	
リオン	3.8	3.5	10,374	
本多通信工業	7.6	—	—	
船井電機	10.7	9.5	7,030	
横河電機	71.4	64.7	130,305	
新電元工業	2.7	2.8	10,318	
アズビル	46.2	44.1	140,458	
東亜ディーケーケー	4.6	5.5	4,730	
日本光電工業	31.6	29.6	87,882	
チノー	4.5	4.2	5,972	
共和電業	11.7	15.2	6,733	
堀場製作所	14.3	14	102,900	
アドバンテスト	49.1	52.4	278,768	
エスベック	6.9	6.5	13,858	
キーエンス	35	63.8	2,422,486	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日置電機	3.9	3.9	14,586	
シスメックス	55.6	50.5	391,930	
日本マイクロニクス	12.9	11.5	13,271	
メガチップス	6	7	17,234	
OBARA GROUP	4.2	3.8	14,763	
コーセル	10.9	9.9	12,384	
イリソ電子工業	6.5	6	31,800	
オプテックスグループ	12.8	11.9	19,301	
千代田インテグレ	3.6	3.8	9,101	
アイ・オー・データ機器	4.1	—	—	
レーザーテック	14.7	14.4	137,952	
スタンレー電気	50.5	49.3	153,076	
岩崎電気	4.7	4.6	6,555	
ウシオ電機	43.7	41.4	68,020	
ヘリオス テクノ ホールディング	7.6	9.2	4,600	
日本セラミック	7.4	7.4	21,171	
古河電池	6.8	—	—	
山一電機	5.8	5.7	9,091	
図研	5.4	5.1	12,801	
日本電子	14.3	14	43,260	
カシオ計算機	63.2	62.6	130,208	
ファナック	67.8	66.9	1,420,956	
日本シイエムケイ	19.4	17.8	11,712	
エンプラス	3.6	3.6	13,140	
ローム	34.5	31.2	286,104	
浜松ホトニクス	51.1	50.4	224,532	
三井ハイテック	8.5	8	16,408	
新光電気工業	23.7	23.6	25,865	
京セラ	108.8	99.1	737,799	
太陽誘電	32.1	31.3	93,117	
村田製作所	74.9	206.8	1,350,197	
ユージン	13.9	—	—	
双葉電子工業	11.6	11.5	15,973	
北陸電気工業	—	4.2	4,720	
ニチコン	22.9	24.2	29,887	
日本ケミコン	5.4	5.9	12,277	
KOA	11.2	11	15,840	
市光工業	11.3	11.2	9,721	
小糸製作所	42.5	42.1	239,970	
ミツバ	14	14	10,374	
SCREENホールディングス	12.5	12.3	93,480	
キャノン電子	6.5	7.5	15,562	
キヤノン	384.4	378.8	1,153,824	
リコー	214.3	179.1	201,308	
象印マホービン	13.6	21.1	37,937	
東京エレクトロン	47.6	46.9	1,058,533	
輸送用機器 (7.8%)				
トヨタ紡織	24.9	20.2	34,865	
ユニプレス	14.5	13.8	23,294	
豊田自動織機	57.5	56.9	368,143	
モリタホールディングス	12.5	12.5	21,950	
三櫻工業	11.2	8.5	11,390	
デンソー	158.2	155	767,715	

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
東海理化電機製作所	19	18.4	39,799	
三井E&Sホールディングス	26.4	14.9	13,737	
川崎重工業	55.5	54.7	135,710	
名村造船所	23.5	27.4	7,863	
日本車輛製造	3.1	3.3	10,477	
三菱ロジスネクスト	9.2	9.2	11,279	
日産自動車	841.4	830.6	571,701	
いすゞ自動車	226.2	204.9	264,423	
トヨタ自動車	795.5	784.8	6,072,782	
日野自動車	88.9	87.7	96,645	
三菱自動車工業	263.9	261.1	129,505	
エフテック	6.7	7.6	5,738	
武蔵精密工業	16.8	15.9	24,215	
日産車体	14.8	14.2	16,159	
新明和工業	33	19.2	28,032	
極東開発工業	14.4	12.7	20,713	
日信工業	12.8	14.3	31,803	
トビー工業	6	6	12,504	
ティラド	3.3	3.5	7,122	
タチエス	12.3	12	17,304	
NOK	38.5	38.1	65,874	
フタバ産業	20.3	20.1	16,602	
KYB	7.6	8	26,520	
大同メタル工業	13.3	16.8	12,230	
プレス工業	35.9	35.7	15,850	
ミクニ	11.2	—	—	
太平洋工業	14.9	15	22,695	
ケーヒン	16.1	16	41,152	
河西工業	9.9	11	9,603	
アイシン精機	58.5	57.7	244,936	
マツダ	224.9	206.8	202,043	
今仙電機製作所	8.8	9.5	8,939	
本田技研工業	602	554.3	1,720,547	
スズキ	130.7	139.7	664,273	
SUBARU	221.6	218.9	629,009	
安永	3.9	4.1	5,301	
ヤマハ発動機	100.5	92	212,244	
ショーワ	16.9	16.6	37,798	
TBK	16.5	15.3	6,594	
エクセディ	9.2	9.4	23,575	
豊田合成	23.2	22.7	59,110	
愛三工業	12.9	12.3	10,651	
日本ブラスト	7.4	8.4	6,031	
ヨロズ	7.4	7.7	11,134	
エフ・シー・シー	12.7	11.3	27,255	
シマノ	28.7	26.3	471,296	
テイ・エス テック	16.8	16.4	56,006	
ジャムコ	3.9	4.8	7,248	
精密機器 (2.3%)				
テルモ	100.7	199.3	779,263	
日機装	23.2	21.6	29,116	
日本エム・ディ・エム	—	4.6	10,704	
島津製作所	91.4	84.3	279,454	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
JMS	12	9.6	7,132	
長野計器	7.4	7.8	6,107	
パイ・テクノロジ	1.7	3.3	19,833	
東京計器	6	6.4	6,496	
インターアクション	4.3	4.2	10,508	
東京精密	12.7	12.8	50,368	
マニー	8.8	28.3	83,060	
ニコン	123.9	113.6	171,081	
トプコン	38.6	36.1	53,103	
オリンパス	105.9	390	637,260	
理研計器	6.4	6.1	14,182	
タムロン	6.4	5.9	14,921	
HOYA	143.7	141.8	1,421,545	
シード	3.5	—	—	
ノーリツ鋼機	5.8	5.2	9,859	
エー・アンド・ディ	7.9	7.9	6,343	
朝日インテック	25.6	59.7	190,741	
シチズン時計	78.4	82.7	50,447	
リズム時計工業	3.5	—	—	
大研医器	8.5	—	—	
メニコン	9.9	9.6	41,760	
松風	3.2	4.3	7,310	
セイコーホールディングス	11.1	9.8	27,596	
ニプロ	49.9	49.9	66,217	
その他製品 (2.3%)				
スノーピーク	3.2	4.5	4,932	
パラマウントベッドホールディングス	8.1	7.3	31,463	
トランザクション	5.1	5.3	5,300	
ニホンフラッシュ	3.6	3.7	10,430	
前田工織	8.1	8.1	15,795	
永大産業	16.8	14.7	5,012	
アートネイチャー	10.7	8.2	6,338	
バンダイナムコホールディングス	73.7	73	488,224	
SHOEI	3.5	3.4	17,204	
フランスベッドホールディングス	12.8	11.8	12,059	
パイロットコーポレーション	12.6	12.5	53,375	
萩原工業	4.7	4.4	7,114	
トッパン・フォームズ	15.1	14.9	17,313	
フジシールインターナショナル	15.9	15.9	39,543	
タカラトミー	30.1	31.8	42,771	
廣済堂	12	7.6	6,688	
プロネクス	7.9	7.2	8,683	
大建工業	5.8	5	9,870	
凸版印刷	99.6	99.2	216,057	
大日本印刷	100	91.7	269,598	
図書印刷	8.1	—	—	
共同印刷	3.3	2	5,900	
NISSHA	14.9	14.8	16,768	
TAKARA & COMPANY	5.1	3.7	6,297	
アシックス	71	58.9	105,195	
小松ウオール工業	—	2.6	6,260	
ヤマハ	42.4	41.7	255,621	
河合楽器製作所	2.5	2.5	9,187	

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	
クリナップ	9.5		9		6,345
ビジョン	43.3		42.6		215,982
キングジム	8.8		6.8		6,065
リンテック	17.2		17		41,871
イトーキ	15.8		18.5		9,564
任天堂	44		43.2		1,867,968
三菱鉛筆	11.7		11.5		19,975
タカラスタンダード	14.3		14.1		28,298
コクヨ	34.4		34		55,590
ナカバヤシ	7.8		7.4		4,395
グロープライド	3.9		3.6		9,730
オカムラ	24.6		24.3		26,244
美津濃	7.1		6.5		18,232
電気・ガス業 (1.5%)					
東京電力ホールディングス	568.1		558.3		269,658
中部電力	218.2		215.4		330,746
関西電力	291.2		267.2		334,267
中国電力	97.5		96.8		140,940
北陸電力	70.1		66		52,140
東北電力	166.5		176		194,480
四国電力	64.3		63.8		67,564
九州電力	145.8		143.7		139,532
北海道電力	67.5		68.1		36,229
沖縄電力	13.1		13		26,039
電源開発	56.5		55.7		149,164
エフオン	5.2		—		—
イーレックス	12.9		10.4		18,168
レノバ	7.7		11.5		13,340
東京瓦斯	140.2		136		360,808
大阪瓦斯	139.1		136.7		283,925
東邦瓦斯	35.2		34.9		145,533
北海道瓦斯	5		4.6		7,295
広島ガス	20.5		17		6,103
西部瓦斯	8.1		7.8		19,656
静岡ガス	21.7		20.4		18,931
メタウォーター	3.8		3.2		13,024
陸運業 (4.5%)					
SBSホールディングス	7.8		6.6		12,982
東武鉄道	74.8		73.9		299,664
相鉄ホールディングス	24.5		22.8		69,312
東急	193.5		177.4		386,199
京浜急行電鉄	97.9		90.4		202,676
小田急電鉄	113.6		104		281,632
京王電鉄	39.6		36.5		257,690
京成電鉄	53.3		48.8		221,308
富士急行	9.8		9.8		41,797
新京成電鉄	3.4		2.8		6,448
東日本旅客鉄道	126.9		124		1,250,540
西日本旅客鉄道	64.2		62.8		607,590
東海旅客鉄道	63.9		58.5		1,301,332
西武ホールディングス	91		94.6		182,578
鴻池運輸	11.2		10.6		17,627
西日本鉄道	20		20		52,580

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
ハマキョウレックス	5.5		5.5		20,157
サカイ引越センター	3.8		3.7		25,789
近鉄グループホールディングス	67.2		66.6		409,590
阪急阪神ホールディングス	90		88.9		421,830
南海電気鉄道	30.4		32.1		97,584
京阪ホールディングス	29.9		29.6		161,320
神戸電鉄	2.7		1.7		6,783
名古屋鉄道	53.7		54.5		190,477
山陽電気鉄道	5.6		5.9		13,263
日本通運	26.4		23.5		164,735
ヤマトホールディングス	118.8		117.1		222,607
山九	18.8		18.5		105,265
丸全昭和運輸	5.5		5.7		17,727
センコーグループホールディングス	37.2		35.9		32,920
トナミホールディングス	1.8		1.8		9,216
ニッコンホールディングス	25.9		23.8		64,974
福山通運	8.6		8.4		35,154
セイノーホールディングス	50.8		49.7		73,506
神奈川中央交通	2.5		2.3		9,234
日立物流	14.3		11.8		36,698
丸和運輸機関	3.6		6.9		17,733
C&Fロジホールディングス	8.6		7.6		10,700
九州旅客鉄道	56.8		59.6		225,288
S Gホールディングス	63.9		70		184,310
海運業 (0.2%)					
日本郵船	56		55.4		106,645
商船三井	39.9		41.9		123,269
川崎汽船	21.2		19.8		37,204
N Sユナイテッド海運	4.1		4.4		10,203
飯野海運	33.8		38.2		13,752
乾汽船	8		5.8		6,658
空運業 (0.5%)					
日本航空	124.1		122.3		414,719
A N Aホールディングス	124.1		122.2		459,227
倉庫・運輸関連業 (0.2%)					
トランコム	1.9		2		15,600
日新	6		6.3		10,980
三菱倉庫	23.4		21.3		60,385
三井倉庫ホールディングス	8.6		8.1		16,191
住友倉庫	26.1		24		36,240
澁澤倉庫	5.5		4.6		9,885
東陽倉庫	25.3		20.9		7,022
日本トランスシティ	19.5		17.3		9,480
川西倉庫	2.6		3.2		3,372
安田倉庫	8.7		7.5		7,462
東洋埠頭	2.4		4.9		6,918
上組	42.2		38.6		94,338
キューソー流通システム	2.3		—		—
近鉄エクスプレス	12.6		14		27,216
エアティイー	5.4		6.4		6,195
日本コンセプト	—		3.6		5,148
情報・通信業 (8.5%)					
N E C ネットエスアイ	7.6		6.5		22,392

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
システナ	25.3	24.4	42,846	
デジタルアーツ	3.9	3.5	22,120	
日鉄ソリューションズ	10.4	10.2	38,862	
キューブシステム	6.1	6.8	5,426	
コア	4.4	3.9	5,635	
ソリトンシステムズ	5.3	4.7	5,165	
ソフトクリエイトホールディングス	4.4	4	7,136	
T I S	23.4	23	152,030	
ネオス	2.9	—	—	
電算システム	3.9	3.3	9,850	
グリー	38	49.7	25,993	
コーエーテックモホールディングス	14.4	14.1	37,844	
三菱総合研究所	3	3.3	13,827	
ファインデックス	8.1	7.6	9,074	
ブレインパッド	1.6	1.5	8,625	
K L a b	13	14	11,900	
ホールトゥウィン・ビットクルーホールディ	4.9	9.5	10,203	
イーブックイニシアティブジャパン	1.5	—	—	
ネクソン	178.6	196.8	295,396	
アイスタイル	18.4	18.7	15,128	
エムアップ	2.7	2.5	6,462	
エイチーム	4.9	6.7	7,624	
エジモ	—	6.5	6,870	
テクノスジャパン	6.9	—	—	
コロブラ	20.8	23.2	29,533	
ブロードリーフ	36.3	36.1	25,594	
デジタルハーツホールディングス	4.3	5.4	5,518	
システム情報	—	4.3	4,790	
メディアドゥホールディングス	2.4	2.5	9,400	
じげん	9.3	19.6	10,858	
フィックスターズ	7.3	8	13,024	
CARTA HOLDINGS	4.8	4.5	6,129	
オブティム	1.8	2.4	8,364	
セレス	2.8	3.2	3,900	
S H I F T	—	1.8	14,364	
ティーガイア	6.9	6.1	15,975	
セック	1.4	1.5	5,827	
豆蔵ホールディングス	7.1	5.4	7,792	
テクマトリックス	5.4	5	11,625	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	174.5	17.3	41,468	
GMOペイメントゲートウェイ	11.6	11.5	90,965	
システムリサーチ	1.2	2.6	4,755	
インターネットイニシアティブ	11.6	10.6	27,061	
さくらインターネット	10.5	8.4	5,577	
ヴィンクス	2.7	—	—	
GMOクラウド	2	1.8	5,250	
S R Aホールディングス	4.1	4.4	11,202	
e B A S E	2.9	4.8	5,745	
アバント	—	5.8	6,008	
アドソル日進	2.9	2.8	6,678	
フリービット	5.8	5.5	5,131	
コムチュア	4.2	7.9	18,975	
アステリア	4.4	5.7	3,687	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
マークライnz	3.3	4.3	8,987	
メディカル・データ・ビジョン	6.6	6.1	6,002	
g u m i	9.1	10.2	7,354	
モバイルファクトリー	2.5	2.3	3,210	
テラスカイ	—	3	8,553	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	3.6	3.9	6,606	
P C Iホールディングス	1.7	—	—	
ダブルスタンダード	—	1.1	6,050	
オープンドア	3.8	4	7,136	
アカツキ	2.6	2.6	16,692	
Ubicomホールディングス	—	2.3	2,895	
L I N E	21.6	16.1	82,754	
チェンジ	—	1.8	4,528	
オークネット	5.2	5.8	7,801	
A O I T Y O Holdings	8.3	8.7	6,011	
マクロミル	9.2	13.6	13,940	
オロ	0.9	2.2	9,449	
サインポスト	—	1.5	2,749	
ソルクシーズ	—	4.4	4,184	
フェイス	4.5	—	—	
プロトコーポレーション	—	7.5	7,807	
野村総合研究所	44.5	115.1	265,765	
サイバネットシステム	7.6	6.5	5,096	
インテージホールディングス	10.7	10.7	10,314	
ソースネクスト	28.2	34.8	17,086	
インフォコム	—	7.7	19,003	
ラクスル	—	3.9	14,293	
アルテリア・ネットワークス	—	8.5	13,829	
フォーカスシステムズ	6	6.2	5,592	
クレスコ	2.4	2.5	8,950	
フジ・メディア・ホールディングス	73	67.1	100,448	
オービック	24.3	23.9	349,179	
ジャストシステム	10.1	11.2	63,392	
T D Cソフト	7.1	7.2	6,472	
Zホールディングス	457.5	949.7	363,735	
トレンドマイクロ	37.4	30.9	185,400	
I Dホールディングス	—	3.9	5,616	
日本オラクル	11.4	13.9	139,417	
アルファシステムズ	2.9	2.7	7,570	
フューチャー	10.1	8.7	16,051	
C A C Holdings	7.7	5.9	9,274	
S Bテクノロジ	3.2	3	5,973	
オービックビジネスコンサルティング	3.6	7	34,230	
伊藤忠テクノソリューションズ	32	31.4	92,661	
アイティフォー	9.9	10.3	9,053	
大塚商会	37.9	37.2	164,424	
サイボウズ	10.2	9.7	11,620	
ソフトブレーン	—	5.5	3,118	
電通国際情報サービス	4.5	4.3	18,081	
デジタルガレージ	13.9	12.7	52,514	
E Mシステムズ	7.2	5.3	10,907	
ウェザーニューズ	3	3	10,320	
C I J	9	8.2	8,241	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
WOWOW	3.6	3.5	9,453	
スカラ	7.4	6.4	5,036	
IMAGICA GROUP	7.4	7.8	5,023	
ネットワンシステムズ	24.9	26.5	83,475	
アルゴグラフィックス	3.1	6	20,010	
マーベラス	12.2	13.1	9,929	
エイベックス	12.3	12.6	16,808	
日本ユニシス	21.8	21.7	78,011	
兼松エレクトロニクス	3.9	3.8	13,015	
東京放送ホールディングス	46.7	42.3	74,025	
日本テレビホールディングス	64.4	58.3	84,651	
朝日放送グループホールディングス	10.5	10.8	8,089	
テレビ朝日ホールディングス	19.6	19.7	34,849	
スカパーJ SATホールディングス	53.4	47	21,808	
テレビ東京ホールディングス	5.8	6	13,818	
ビジョン	2.3	6.7	12,013	
コネクシオ	5.5	4.8	7,320	
日本電信電話	479.1	461.8	2,585,156	
KDDI	617.2	514.8	1,621,620	
ソフトバンク	—	627.4	930,747	
光通信	8.3	7.1	183,748	
NTTドコモ	503	510.1	1,533,870	
エムティーアイ	10.2	9.1	6,297	
GMOインターネット	25.9	27.5	62,397	
KADOKAWA	20.6	19.1	33,921	
学研ホールディングス	2.5	2.5	18,725	
ゼンリン	14.1	14	26,698	
アイネット	5.2	4.7	7,167	
松竹	4.8	4.6	74,658	
東宝	46.1	41.5	185,297	
東映	2.9	2.6	44,642	
エヌ・ティ・ティ・データ	186.5	182.8	277,490	
ビブ・シー・エー	—	1.3	5,824	
DTS	7.7	14.9	35,044	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32.7	29.7	162,459	
シーイーシー	7.7	7.7	17,409	
カブコン	30.5	33.1	86,821	
アイ・エス・ピー	1.7	—	—	
ジャストテック	5.8	6.4	7,168	
S C S K	18.6	16	92,320	
日本システムウエア	2.8	2.6	6,692	
アイネス	10.1	8.3	11,329	
T K C	5.9	5.7	29,241	
富士ソフト	10.4	9	38,475	
NSD	11.2	11.4	40,926	
コナミホールディングス	28.7	25.2	122,472	
福井コンピュータホールディングス	3	3	11,625	
J B C Cホールディングス	6.6	5.6	10,432	
ミロク情報サービス	7.3	6.3	21,325	
ソフトバンクグループ	292.8	548.1	2,321,751	
卸売業 (5.0%)				
伊藤忠食品	1.9	1.9	9,918	
エレマテック	3.8	8.1	8,561	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
J A L U X	2.4	2.7	6,806	
あらた	4	5.6	24,164	
東京エレクトロン デバイス	3.8	3.6	8,118	
フィールズ	7.8	8.5	4,241	
双日	387.2	378.2	132,748	
アルフレッサ ホールディングス	77.8	76.5	176,179	
横浜冷凍	19.1	20.7	22,356	
アルコニックス	8.7	8.3	12,010	
神戸物産	10.6	23.8	80,682	
あい ホールディングス	11.5	10.5	20,968	
ダイワボウホールディングス	6.4	5.9	32,922	
マクニカ・富士エレホールディングス	19	16.9	31,670	
ラクト・ジャパン	1.6	2.8	9,744	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13.3	13.5	14,958	
八洲電機	9	8.4	7,408	
レスターホールディングス	5.2	7.4	15,066	
ジュテックホールディングス	2.5	2.4	2,608	
T O K A Iホールディングス	36.7	36.2	40,109	
三洋貿易	4.4	4.1	9,643	
ウイン・パートナーズ	5.3	5.6	8,321	
シップヘルスケアホールディングス	14.5	11.2	51,296	
コメダホールディングス	16.6	15.9	33,787	
小野建	7.1	7.5	10,110	
佐鳥電機	6.6	7.3	6,679	
伯東	5.7	5.3	6,948	
コンドーテック	8	5.8	6,391	
ナガイレーベン	10.4	10.6	27,146	
三菱食品	7.5	7	20,524	
松田産業	6.2	5.8	9,088	
第一興商	10.7	10.6	57,452	
メディバルホールディングス	75.6	74.3	176,239	
S P K	2	2.6	7,410	
萩原電気ホールディングス	3.2	3.2	9,056	
アズワン	5	4.6	43,976	
尾家産業	4.1	3.6	4,849	
シモジマ	4.1	6.1	7,564	
ドウシシャ	6.5	6.8	12,308	
高速	6.5	5.5	6,512	
丸文	9	—	—	
ハビネット	6.3	6.7	9,594	
日本ライフライン	22.1	20.4	31,497	
エクセル	3.2	—	—	
マルカ	3.1	3.3	7,583	
I D O M	25.4	21	11,130	
日本エム・ディ・エム	4.8	—	—	
進和	4.8	4.7	11,054	
ダイトロン	3.9	3.9	6,618	
シークス	9.2	9.2	14,296	
オーハシテクニカ	5.7	5.7	8,333	
白銅	3.5	—	—	
伊藤忠商事	491.8	484.9	1,182,186	
丸紅	693.9	722.3	596,041	
長瀬産業	39.7	39	63,492	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
蝶理	5.4	4.9	9,672	
豊田通商	77.8	77.4	300,699	
三共生興	16.8	15	9,015	
兼松	27.4	24.9	35,158	
三井物産	579.1	609.2	1,198,601	
日本紙パルプ商事	4.1	4.1	16,646	
日立ハイテクノロジーズ	21.4	24.1	172,797	
カメイ	9.9	9.6	11,779	
スターゼン	2.7	2.7	11,893	
山善	26.6	26.1	27,274	
椿本興業	2.2	1.6	6,432	
住友商事	415.9	437.8	725,215	
内田洋行	3.9	3.2	16,768	
三菱商事	493.2	486.7	1,415,080	
第一実業	3.5	3.8	14,117	
キャノンマーケティングジャパン	20.4	20.3	50,953	
西華産業	4.8	5.4	7,608	
佐藤商事	8	7.7	7,022	
菱洋エレクトロ	7.8	7.2	14,731	
東京産業	9.4	9.1	5,105	
ユアサ商事	7	6.2	21,700	
神鋼商事	2	2.2	5,838	
阪和興業	12.4	13.1	37,204	
正栄食品工業	3.8	4.7	15,909	
カナデン	8.2	7	9,275	
菱電商事	6.9	6.1	10,095	
フルサト工業	5.2	5.2	8,559	
岩谷産業	15.8	15.6	57,330	
極東貿易	3	3.2	7,020	
イワキ	10.8	12.3	5,854	
三愛石油	18.6	17.2	18,214	
稲畑産業	16.3	14.3	22,679	
明和産業	—	8.4	5,208	
ワキタ	15.7	15.7	17,191	
東邦ホールディングス	20.9	22.6	57,336	
サンゲツ	21.9	19	40,565	
ミツウロコグループホールディングス	11.9	10.7	15,194	
シナネンホールディングス	3.6	3.9	7,534	
伊藤忠エネクス	14.8	14.8	13,246	
サンリオ	22.5	19.5	43,563	
サンワテクノス	5.7	6.6	7,913	
リョーサン	8.2	7.7	22,691	
新光商事	7.4	11.7	10,530	
トーホー	4.1	4.3	8,053	
三信電気	6.2	4.4	7,480	
東陽テクニカ	11	10	11,400	
モスフードサービス	8.9	9.3	28,551	
加賀電子	7	7.1	17,522	
ソータニッカ	9.9	10.5	6,415	
立花エレクトック	6.1	5.8	10,196	
PALTAC	12.5	11	59,400	
太平洋興発	5.4	6.6	5,332	
西本Wisemittacホールディングス	1.7	1.7	6,655	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
国際紙パルプ商事	—	—	20.5	6,170
ヤマタネ	4.8	4.8	7,219	
日鉄物産	4.7	4.6	23,322	
泉州電業	3	2.8	8,173	
トラスコ中山	14.3	14.2	39,745	
オートボックスセブン	28.5	26.1	47,006	
モリト	7.4	7.7	6,160	
加藤産業	10.6	10.6	38,849	
イノテック	5.8	5.8	6,101	
イエローハット	6.7	13.1	26,252	
JKホールディングス	10	9.3	6,017	
日伝	6.6	6.6	13,833	
杉本商事	4.8	4.7	9,423	
因幡電機産業	9.6	19.4	51,817	
バイテックホールディングス	3	—	—	
東テク	2.8	2.8	6,792	
ミスミグループ本社	88	86.7	237,384	
タキヒヨー	3.4	2.8	5,426	
スズケン	32	29.4	143,766	
ジェコス	6.5	7.2	6,876	
小売業 (4.7%)				
ローソン	17.8	17.7	107,616	
サンエー	5.2	5.6	28,280	
カワチ薬品	6	5.5	12,677	
エービーシー・マート	11	10.8	80,568	
アスクル	6.1	7.5	22,537	
ゲオホールディングス	10.8	12.7	16,738	
アダストリア	10	9.8	24,852	
くら寿司	4.2	3.7	18,074	
キャンドゥ	5.1	5	8,175	
バルグループホールディングス	3.9	3.7	13,227	
エディオン	29.3	31.1	36,915	
サーラコーポレーション	16.6	16.3	10,154	
ハローズ	3.1	2.9	7,482	
フジオフードシステム	—	3.4	12,138	
あみやき亭	1.9	2.2	8,019	
ひらまつ	19.6	20.5	6,252	
大黒天物産	2	2.1	6,741	
ハニーズホールディングス	8.8	7.1	9,869	
アルベン	6	5.9	10,856	
クオールホールディングス	10.5	10.6	16,790	
ジンスホールディングス	4.9	3.8	25,536	
ビックカメラ	37.1	40.3	48,883	
DCMホールディングス	37	36.4	38,911	
ペッパーフードサービス	5.7	—	—	
Monotaro	44.8	49.4	152,399	
DDホールディングス	2	3.3	5,171	
アークランドサービスホールディングス	5.5	5.6	10,477	
J. フロント リテイリング	90.1	82.7	121,817	
ドトール・日レスホールディングス	12.1	10.5	23,446	
マツモトキヨシホールディングス	29.1	28.4	119,280	
ブロンコビリー	3.9	3.9	10,689	
ZOZO	76.3	48	105,888	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
物語コーポレーション	2.1	1.8			15,534
ココカラファイン	7.8	7.2			46,368
三越伊勢丹ホールディングス	131.3	121.4			120,186
Ham e e	2.2	2.8			3,914
ウエルシアホールディングス	18.5	20.6			139,874
クリエイトSDホールディングス	10.1	9.5			25,422
テムニー	2.8	3			6,924
シュッピン	5.3	5.9			6,885
ネクステージ	11	10.3			12,308
ジョイフル本田	20.3	20.4			29,845
鳥貴族	2.9	3			5,691
キリン堂ホールディングス	3.4	3.2			6,588
ホットランド	5.1	6.3			8,523
すかいらーくホールディングス	65.8	77.9			172,704
S F Pホールディングス	—	3.7			8,140
綿半ホールディングス	3.1	3.1			6,246
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	19	18.5			18,148
B E E N O S	—	3.4			5,232
あさひ	6.7	6.2			7,830
日本調剤	2.7	2.3			8,694
コスモス薬品	3.6	3.1			68,975
セブン&アイ・ホールディングス	294.5	271.5			1,116,679
薬王堂	3.1	—			—
クリエイト・レストランツ・ホールディング	18.8	18.6			34,242
ツルハホールディングス	15.3	15			196,050
サンマルクホールディングス	5.4	5.4			12,592
トリドールホールディングス	8.9	8.7			25,047
T O K Y O B A S E	7.3	7.3			5,234
ジャパンミート	3.1	3.9			8,443
アレンザホールディングス	5	—			—
パロックジャパンリミテッド	6.9	6.7			6,338
クスリのアオキホールディングス	5.5	6.9			57,201
力の源ホールディングス	—	4.1			3,575
スシローグローバルホールディングス	7.8	7.6			65,056
L I X I L ビバ	6.2	7			13,419
メディカルシステムネットワーク	9.6	9.2			5,299
ノジマ	12.4	11.6			26,459
カップ・クリエイト	11.2	10.2			14,943
ライトオン	7.6	—			—
良品計画	10	92			229,816
三城ホールディングス	14.5	—			—
アドヴァン	12.3	11.3			14,780
アルビス	3.1	3.3			7,566
コナカ	13.8	15.2			6,171
G-7ホールディングス	2.6	2.1			9,450
イオン北海道	10.1	8.4			6,711
コジマ	12.8	14.1			6,471
コーナン商事	9.2	9.4			23,951
エコス	3.1	3.3			5,553
ワタミ	10.3	9			11,808
パン・パシフィック・インターナショナルホ	45.6	166			298,468
西松屋チェーン	15.6	15.4			15,477
ゼンショーホールディングス	33.6	33.5			84,219

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
幸楽苑ホールディングス	6.2	5.2			11,008
サイゼリヤ	11.5	11.4			29,993
V Tホールディングス	26	30.1			14,237
フジ・コーポレーション	—	2.5			5,810
ユナイテッドアローズ	8.1	7.5			25,050
ハイデイ日高	9.1	9.6			20,995
コロワイド	23.2	23.9			52,962
ピーシーデポコーポレーション	10.8	11.8			5,640
壱番屋	4.9	4.9			25,872
スギホールディングス	15.5	13.9			85,763
薬王堂ホールディングス	—	3.2			8,102
ヴィア・ホールディングス	11.8	13.3			8,871
スクロール	12.7	15.8			5,530
ヨンドシーホールディングス	7.9	7.3			19,074
ファミリーマート	19.6	55.5			144,355
木曽路	8.5	9.1			26,208
S R Sホールディングス	10.4	11.2			11,692
千趣会	—	17.8			7,689
ケーヨー	17	18.8			10,133
上新電機	8.3	8			19,720
日本瓦斯	12.9	11.2			38,528
ロイヤルホールディングス	12.2	11.8			29,995
いなげや	7.7	8.9			13,172
島忠	16.1	13.2			39,666
チヨダ	7.3	7.6			12,289
ライフコーポレーション	5.2	5.4			13,521
リンガーハット	8.9	8.8			21,859
M r M a x H D	11.8	12.5			6,237
A O K Iホールディングス	13.8	13.6			15,422
オークワ	11	11			15,873
コメリ	11.3	10.5			24,811
青山商事	13.7	14.6			24,484
しまむら	8.2	8			71,760
高島屋	55.4	51.6			67,286
松屋	14.9	14.9			12,724
エイチ・ツー・オー リテイリング	36.3	33			40,689
近鉄百貨店	2	2.8			10,108
バルコ	7.7	7.2			9,820
丸井グループ	59.6	63.6			168,603
アクシアル リテイリング	5.7	5.6			21,672
イオン	270.5	266.4			603,396
イズミ	14.3	14.2			60,634
平和堂	13.8	13.6			28,764
フジ	8.6	8.5			16,753
ヤオコー	7.7	7.6			38,836
ゼビオホールディングス	8.1	8.8			11,686
ケーズホールディングス	73.2	67.1			91,658
O l y m p i c グループ	5.8	6.3			4,101
日産東京販売ホールディングス	17.8	17.8			4,948
Genky DrugStores	2.9	3.7			9,394
総合メディカルホールディングス	6.1	6.3			13,009
ブックオフグループホールディングス	—	4.9			5,223
アインホールディングス	9.5	9.5			65,360

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
元気寿司	2.1	2.4	7,185	
ヤマダ電機	215.5	210.5	117,248	
アークランドサカモト	11.9	10.9	13,962	
ニトリホールディングス	30.5	30	517,800	
グルメ軒屋	8.2	6.2	7,409	
吉野家ホールディングス	25.5	23.5	64,766	
松屋フーズホールディングス	3.3	3.3	14,883	
サガミホールディングス	10.4	9.8	13,484	
関西スーパーマーケット	6.9	6.6	7,167	
王将フードサービス	5.1	5	33,100	
ブレナス	7.7	7.8	15,100	
ミニストップ	5.6	5.8	8,537	
アークス	12.8	13.4	30,605	
パローホールディングス	15.5	14.8	30,547	
ベルク	3.4	3.2	16,736	
大庄	5.5	5.2	8,346	
ファーストリテイリング	9.4	9.3	630,540	
サンドラッグ	26.4	26	100,620	
サクスパーホールディングス	7.3	8.3	7,511	
ペルーナ	17.3	15.3	10,893	
銀行業 (5.8%)				
じもとホールディングス	60.3	59.1	6,323	
めぶきフィナンシャルグループ	365.5	361.1	102,552	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10	10	15,320	
九州フィナンシャルグループ	113.5	112.6	55,511	
ゆうちょ銀行	198.4	196.3	210,041	
富山第一銀行	21.6	19.6	6,781	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	446.2	409.1	182,867	
西日本フィナンシャルホールディングス	45.9	47.3	40,488	
関西みらいフィナンシャルグループ	33.3	41.1	30,085	
三十三フィナンシャルグループ	7	6.5	11,102	
第四北越フィナンシャルグループ	12.2	12.1	36,360	
新生銀行	50.8	50.8	87,223	
あおぞら銀行	38.7	41.1	115,819	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,902	4,780.6	2,782,787	
リソナホールディングス	768.8	760.7	355,094	
三井住友トラスト・ホールディングス	137.6	131.1	549,964	
三井住友フィナンシャルグループ	495.8	480.3	1,925,042	
千葉銀行	247	238.2	148,636	
群馬銀行	138.4	135.4	52,806	
武蔵野銀行	10.6	10.6	20,786	
千葉興業銀行	23.6	20.6	7,086	
筑波銀行	36.8	30.8	7,484	
七十七銀行	21.9	23.7	42,517	
青森銀行	6.1	5.4	15,287	
秋田銀行	5.3	5.2	11,746	
山形銀行	8.2	8.7	14,433	
岩手銀行	5.1	5	14,825	
東邦銀行	63.4	60	16,680	
東北銀行	5.5	4	4,136	
みちのく銀行	5.5	5	7,835	
ふくおかフィナンシャルグループ	56.7	58.3	121,963	
静岡銀行	175.7	171.2	143,636	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
十六銀行	9.4	9	23,958	
スルガ銀行	69.8	72.7	39,621	
八十二銀行	122.9	166.8	79,230	
山梨中央銀行	9.3	9.2	10,616	
大垣共立銀行	11	13.7	34,935	
福井銀行	6.9	5.9	10,230	
北國銀行	7.8	7.6	26,676	
清水銀行	3.9	2.9	6,322	
富山銀行	1.7	1.6	4,225	
滋賀銀行	13.9	13.7	37,579	
南都銀行	8.6	11.9	32,879	
百五銀行	62.9	64.7	22,903	
京都銀行	25	24.7	113,126	
紀陽銀行	24.8	24.5	42,238	
ほくほくフィナンシャルグループ	46.3	46.8	53,071	
広島銀行	101.8	101.2	55,154	
山陰合同銀行	42	42	28,854	
中国銀行	45	60	65,820	
伊予銀行	91.4	97.6	59,340	
百十四銀行	7.8	7.6	17,160	
四国銀行	11.1	10.4	10,868	
阿波銀行	11.1	11.4	30,848	
大分銀行	4.6	4.2	11,986	
宮崎銀行	5.2	4.5	11,947	
佐賀銀行	4.7	4.7	8,178	
十八銀行	4.6	—	—	
沖縄銀行	6.6	6.5	23,887	
琉球銀行	17	15.7	19,750	
セブン銀行	237.5	235.6	80,339	
みずほフィナンシャルグループ	9,556	9,433.6	1,600,881	
山口フィナンシャルグループ	86.6	87.8	66,464	
名古屋銀行	6	6	20,340	
北洋銀行	107.2	108.3	26,100	
愛知銀行	2.8	2.9	11,150	
中京銀行	3.7	3	6,771	
大光銀行	3.5	2.5	4,377	
愛媛銀行	11	10.2	12,484	
京葉銀行	31	30.8	19,373	
栃木銀行	39.2	39.6	9,147	
北日本銀行	3	—	—	
東和銀行	13.8	12.3	10,922	
福島銀行	10	—	—	
トモニホールディングス	57	57.6	24,134	
フィデアホールディングス	83	73	9,782	
池田泉州ホールディングス	77.8	78.2	15,874	
証券・商品先物取引業 (0.8%)				
F P G	23.2	22.8	24,373	
S B Iホールディングス	83.8	77.7	175,446	
ジャフコ	11.7	10.6	44,838	
大和証券グループ本社	563.5	557.3	309,914	
野村ホールディングス	1,291	1,223.1	687,749	
岡三証券グループ	61.4	62.6	25,415	
丸三証券	23	22.5	12,307	

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		
東洋証券	32	—	—	—
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	84.3	82.4	27,851	—
水戸証券	24	26.5	7,499	—
いちよし証券	16	13.6	9,275	—
松井証券	34.5	40.9	36,319	—
マネックスグループ	66.5	56.1	15,764	—
カブドットコム証券	55.2	—	—	—
極東証券	10	11.1	8,713	—
岩井コスモホールディングス	8	8	10,256	—
藍澤證券	15.4	12.5	9,225	—
スパークス・グループ	—	30	7,470	—
保険業（2.3%）				
かんぽ生命保険	26.6	24.9	46,712	—
SOMPOホールディングス	137.9	130.6	570,852	—
アニコムホールディングス	5.9	5.8	20,793	—
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	183.8	181.7	646,852	—
ソニーフィナンシャルホールディングス	57.7	56.9	146,403	—
第一生命ホールディングス	398	393.1	692,445	—
東京海上ホールディングス	255	248.3	1,494,766	—
T&Dホールディングス	216.9	214.5	277,777	—
アドバンスクリエイト	4	1.5	2,796	—
その他金融業（1.2%）				
全国保証	20.2	19.6	86,436	—
C a s a	—	3	3,789	—
アルヒ	7	11.2	28,168	—
プレミアグループ	—	4	9,344	—
クレディセゾン	49.4	48.9	88,509	—
芙蓉総合リース	8.1	7.3	52,779	—
みずほリース	13.7	10.9	35,752	—
東京センチュリー	14.1	14	83,860	—
日本証券金融	34.2	32.2	17,484	—
アイフル	113.3	111.7	28,148	—
リコーリース	5.8	5.8	22,678	—
イオンフィナンシャルサービス	44.7	42.5	71,612	—
アコム	142.3	138.8	63,570	—
ジャックス	8.7	7.8	21,028	—
オリエントコーポレーション	194	195.6	31,687	—
日立キャピタル	16.7	16.2	43,659	—
アブラスフィナンシャル	—	44.1	4,101	—
オリックス	469.5	434.3	780,654	—
三菱UFJリース	158.2	176.2	124,221	—
日本取引所グループ	190.2	199.5	373,863	—
イー・ギャランティ	8	7.1	10,053	—
NECキャピタルソリューション	3.3	3.3	8,127	—
不動産業（2.4%）				
いちご	90.3	90.2	39,597	—
日本駐車場開発	90.4	85.3	14,159	—
スター・マイカ・ホールディングス	—	4.5	7,992	—
ヒューリック	147	149	186,846	—
三栄建築設計	3.6	4	6,500	—
スター・マイカ	4	—	—	—
野村不動産ホールディングス	46.8	42.2	111,956	—
三重交通グループホールディングス	16.4	18	10,872	—

銘柄	期首(前期末)		期	末
	株数	株数		
サムティ	10.2	9.9	20,077	—
ディア・ライフ	10.1	10.3	5,757	—
日本商業開発	5.1	6.1	9,796	—
プレサンスコーポレーション	11.4	11.1	19,491	—
ユニゾホールディングス	11	10.8	52,920	—
日本管理センター	5.8	5.8	7,650	—
フージャースホールディングス	17.4	16.6	11,736	—
オープンハウス	11.5	20.1	58,692	—
東急不動産ホールディングス	189.1	188.2	140,020	—
飯田グループホールディングス	58.7	56.6	110,539	—
ムゲンエステート	6.5	8.2	6,560	—
ヒーロット	—	2.5	5,077	—
ハウスドゥ	2.9	4.8	7,771	—
ジェイ・エス・ビー	—	1.2	5,544	—
パーク24	41.3	37.7	97,077	—
バラカ	2.8	3.1	6,302	—
三井不動産	373.5	347.3	948,649	—
三菱地所	493.4	487	978,870	—
平和不動産	13.5	13	33,982	—
東京建物	77.5	77	127,281	—
ダイビル	20.7	18.4	21,564	—
京阪神ビルディング	15	12.1	17,387	—
住友不動産	158.4	156.5	600,803	—
大京	10.8	—	—	—
テーオーシー	16.7	15	13,425	—
東京楽天地	1.8	1.7	10,438	—
レオパレス21	91.4	—	—	—
スターツコーポレーション	9.3	9.2	24,757	—
フジ住宅	11.8	11.8	8,389	—
空港施設	13.3	13.3	7,182	—
ゴールドクレスト	6.2	5.9	12,755	—
エスリード	4.2	3.8	8,249	—
日神不動産	13.5	14.1	6,993	—
日本エスコン	14.1	14.1	13,944	—
タカラレーベン	35.8	33.5	16,381	—
サンヨーハウジング名古屋	7	7	6,965	—
イオンモール	35.4	35.7	63,367	—
ファースト住建	—	5.2	6,858	—
カチタス	8	8.8	43,296	—
トーセイ	10.8	9.9	13,196	—
エヌ・ティ・ティ都市開発	44	—	—	—
サンフロンティア不動産	10.5	10.2	12,994	—
エフ・ジェー・ネクスト	8.2	7.8	8,330	—
ランドビジネス	—	7.4	5,631	—
日本空港ビルデング	22.6	22.4	130,592	—
サービス業（5.1%）				
日本工営	5	4.6	15,548	—
L I F U L L	24.4	24.8	13,764	—
ジェイエイシーリクルートメント	5.9	5	10,460	—
日本M&Aセンター	51.3	50.9	190,875	—
メンバーズ	—	2.3	5,423	—
タケエイ	9.9	8.1	10,392	—
トラスト・テック	3.4	8.1	10,959	—

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
コシダカホールディングス	18.5	16.6	26,709		
パソナグループ	7	8.4	14,338		
リンクアンドモチベーション	12.9	16.3	11,833		
GCA	8.5	9.8	9,339		
エス・エム・エス	25.3	21.3	64,006		
パーソルホールディングス	68.3	67.3	136,888		
リニカル	4.4	4.7	5,546		
クックパッド	23.9	28.3	10,527		
学情	3.6	3.4	5,402		
スタジオアリス	3.8	4.3	8,380		
シミックホールディングス	4.4	4.7	8,544		
総合警備保障	27.1	26.7	155,127		
カカコム	51.9	50.8	134,823		
アイロムグループ	3.1	3.3	4,804		
ルネサンス	4.3	4.9	8,555		
ディップ	10.9	9.5	29,592		
オプトホールディング	4.5	4.2	7,488		
新日本科学	11.6	9.3	7,309		
ツクイ	16.6	18.4	10,451		
ベネフィット・ワン	—	18.1	43,892		
エムスリー	143.9	148.3	453,056		
アウトソーシング	36	38.3	46,036		
ウェルネット	8.4	9.1	7,471		
ワールドホールディングス	2.2	2.7	5,316		
ディー・エヌ・エー	37.1	33.7	59,986		
博報堂DYホールディングス	94.3	93	166,284		
ぐるなび	10.7	13.5	14,107		
タカミヤ	9.4	9.4	6,796		
ジャパンベストレスキューシステム	6.3	5.6	6,053		
ファンコミュニケーションズ	20.2	21	10,605		
ライク	3.3	3.2	5,430		
エスプール	—	14.2	10,096		
WD Bホールディングス	3.4	3.3	8,362		
バリューコマース	5	4.3	8,604		
インフォマート	38	37.5	72,750		
J Pホールディングス	25.4	27.2	7,996		
E P Sホールディングス	10.4	10.7	15,375		
プレステージ・インターナショナル	13.4	26	24,024		
アミューズ	4.3	4.1	12,792		
ドリームインキュベータ	2.9	3.1	5,177		
クイック	4.7	4.9	8,246		
ケネディクス	64.9	65.4	38,324		
電通	83	69.2	279,914		
テイクアンドギヴ・ニーズ	3	3.4	4,522		
びあ	2.1	2.1	10,122		
イオンファンタジー	2.3	2.8	8,848		
シーティーエス	9.2	9	6,777		
ネクシィーズグループ	2.4	2.8	5,269		
みらかホールディングス	19.5	19.4	53,369		
アルプス技研	6.1	6.3	11,497		
日本空調サービス	9.6	9.6	7,516		
オリエンタルランド	80.6	71.5	1,085,370		
ダスキン	18.6	17.4	53,070		

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
明光ネットワークジャパン	10.2	10.1	10,413		
ファルコホールディングス	5.2	5.1	8,991		
ラウンドワン	21.4	19.3	21,365		
リゾートトラスト	29.5	31.7	58,518		
ビー・エム・エル	8.8	8.6	27,563		
りらいあコミュニケーションズ	12.1	12.2	17,287		
リソー教育	36.3	32.3	13,339		
ユー・エス・エス	83.4	75.4	160,677		
サイバーエージェント	42.2	39	149,370		
楽天	319.7	313.9	295,693		
クリーク・アンド・リバー社	4.9	4.5	5,062		
テー・オー・ダブリュー	8.3	8.3	6,972		
山田コンサルティンクグループ	—	3.8	6,938		
セントラルスポーツ	2.9	2.9	9,483		
フルキャストホールディングス	6.8	6.6	16,401		
エン・ジャパン	7.6	11.9	60,928		
テクノプロ・ホールディングス	13	13.5	100,980		
アイ・アールジャパンホールディングス	—	3.1	13,051		
Gunosy	4.4	5.3	8,787		
イー・ガーディアン	3.6	3.6	8,078		
ジャパンマテリアル	18.9	20.6	31,106		
ベクトル	8.6	9.3	10,592		
チャーム・ケア・コーポレーション	—	2.5	4,882		
I B J	—	5.6	6,025		
アサンテ	3.5	3.7	7,499		
N・フィールド	5	7	4,921		
バリューHR	2.2	1.7	5,958		
M&Aキャピタルパートナーズ	1.8	4.8	20,640		
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.7	3.7	7,185		
アビスト	1.4	—	—		
シグマクシス	4.4	5	11,255		
ウィルグループ	5.4	5.1	5,900		
エスクロー・エージェント・ジャパン	11.5	—	—		
リクルートホールディングス	488.7	481.7	1,916,202		
エラン	2.6	4.4	7,524		
日本郵政	556.7	551.6	571,733		
ベルシステム24ホールディングス	11.6	11.6	19,940		
鎌倉新書	5.4	5.4	10,411		
L I T A L I C O	2	2.9	7,777		
エポラブルアジア	2.4	3.5	7,710		
アトラエ	—	2	7,670		
ストライク	1.9	2.6	11,388		
ソラスト	17	18.9	24,702		
インソース	2.5	3.5	12,022		
ベイカレント・コンサルティング	—	4.2	25,032		
キャリアインデックス	2.8	—	—		
MS - J a p a n	3.2	—	—		
グレイステクノロジー	2	3.3	9,771		
ジャパンエレベーターサービスホールディング	4.5	7.3	21,410		
グリーンズ	—	4.3	5,254		
日総工産	2	5.2	5,631		
キュービーネットホールディングス	4	4.7	11,740		
R P Aホールディングス	—	4.4	5,513		

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
スプリックス	2.2	3.1	3,906	
アドバンテッジリスクマネジメント	—	4.7	4,653	
リログループ	37.4	36.8	109,884	
東祥	4.3	4.8	11,779	
エイチ・アイ・エス	12	10.6	32,542	
共立メンテナンス	10.4	11	57,200	
イチネンホールディングス	8.5	8.3	11,744	
建設技術研究所	5.7	5.6	11,368	
スペース	5.3	—	—	
燦ホールディングス	2.3	4.4	5,931	
東京テアトル	4.9	4.7	6,547	
ナガワ	2	2.1	15,813	
よみうりランド	2.3	2.1	9,534	
東京都競馬	4.6	4.6	15,985	
常盤興産	5.3	4.9	8,168	
カナモト	9.7	11.1	35,131	
東京ドーム	25.8	28.2	28,566	
西尾レントオール	7	6.8	20,978	
トランス・コスモス	7.5	6.4	18,393	
乃村工務社	15.9	28.8	40,608	
藤田観光	3.3	3.7	10,611	
KNT-CTホールディングス	4.3	4.8	7,252	
日本管財	7	6.4	12,486	
トーカイ	6.6	6.6	18,935	
セコム	72.4	71.3	676,351	
セントラル警備保障	3.4	3.3	21,318	
丹青社	13.2	13.1	16,139	
メイテック	8.9	8.5	49,555	
応用地質	8.3	7.9	11,060	
船井総研ホールディングス	14.1	13.7	34,880	
オオバ	7.8	8.2	6,543	
学究社	4.2	—	—	
ベネッセホールディングス	25.1	22.7	66,011	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
イオンディライト	8.2	8.1	31,347	
ナック	6	6	6,336	
ニチイ学館	10.5	9.9	16,047	
ダイセキ	11.4	11.3	36,838	
合計	株数・金額	81,162	81,710	170,406,746
	銘柄数<比率>	1,659	1,661	<97.7%>

※銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※評価額の単位未満は切捨て。ただし、評価額が単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	期末	
	買建額	売建額
国内 株式先物取引 TOPIX	百万円 3,999	百万円 —

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

■ 投資信託財産の構成

(2019年12月2日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円	%
株	170,406,746	97.5
コール・ローン等、その他	4,281,756	2.5
投資信託財産総額	174,688,502	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年12月2日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	176,445,102,542円
コール・ローン等	3,379,265,534
株式(評価額)	170,406,746,760
未 収 入 金	72,899,200
未 収 配 当 金	857,351,048
差入委託証拠金	1,728,840,000
(B) 負 債	2,046,808,561
未 払 解 約 金	290,138,959
未 払 利 息	6,480
差入委託証拠金代用有価証券	1,756,600,000
その他未払費用	63,122
(C) 純資産総額(A-B)	174,398,293,981
元 本	63,743,430,458
次期繰越損益金	110,654,863,523
(D) 受益権総口数	63,743,430,458口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,359円

※当期における期首元本額66,912,228,971円、期中追加設定元本額13,207,087,179円、期中一部解約元本額16,375,885,692円です。

※代用として、担保に供している資産は、株式3,095,200,000円です。（受渡しベース）

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

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

■ 損益の状況

（自2018年12月1日 至2019年12月2日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,180,864,487円
受 取 配 当 金	4,179,624,536
そ の 他 収 益 金	2,800,929
支 払 利 息	△ 1,560,978
(B) 有価証券売買損益	4,923,794,035
売 買 益	16,144,533,878
売 買 損	△ 11,220,739,843
(C) 先物取引等取引損益	321,575,500
取 引 益	860,998,660
取 引 損	△ 539,423,160
(D) 信 託 報 酬 等	△ 1,078,963
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	9,425,155,059
(F) 前期繰越損益金	106,635,545,407
(G) 追加信託差損益金	19,374,291,115
(H) 解約差損益金	△ 24,780,128,058
(I) 計 (E+F+G+H)	110,654,863,523
次期繰越損益金(I)	110,654,863,523

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

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,093,895,533円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,366,581,213円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	871,994,826円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	55,996,005円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,134,711,529円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	212,637,976円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,984,021,207円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	794,882円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	171,270,930円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	882,312,334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）	6,770,604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>	55,058,558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）	24,018,495円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	363,346,655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）	65,633,993円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,058,492,761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）	108,427,212円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	861,659,534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）	71,148,493円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,778,991,517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）	157,127,838円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,137,750円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,522,887,951円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	58,214,802円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	11,405,867,081円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	71,457,145円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	750,808,584円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	44,386,681円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	754,464,975円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	21,663,542円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	588,252,205円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	179,161,011円
イオン・バランス戦略ファンド	102,533,812円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	345,072,882円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	11,657,198円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	11,140,518円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	55,140,191円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	111,594,783円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	50,085,566円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	58,092,653円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	139,661,373円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,215,706円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	75,363,090円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	70,883,973円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	94,884,854円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	848,254,810円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	12,899,750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）	194,795,060円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	407,382円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,380,760円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	77,860円	SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	1,164,508,623円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	137,846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>	193,275,461円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	198,857円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,504,949,363円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,810,058,037円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	111,253,748円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	22,375,907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>	14,465,450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>	218,475,561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>	81,986,207円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	3,018,643,305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>	51,058,228円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	2,309,967,382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>	307,740,440円

■ お知らせ

<約款変更について>

・委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
（適用日：2019年4月1日）

国内債券パッシブ・マザーファンド

第14期（2018年5月26日から2019年5月27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 比率	純資産 総額
	期中 騰落率	騰落率	期中 騰落率	騰落率		
	円	%		%	%	百万円
10期(2015年5月25日)	11,956	2.3	362.06	2.3	99.4	296,491
11期(2016年5月25日)	12,773	6.8	386.72	6.8	99.4	243,829
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

※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

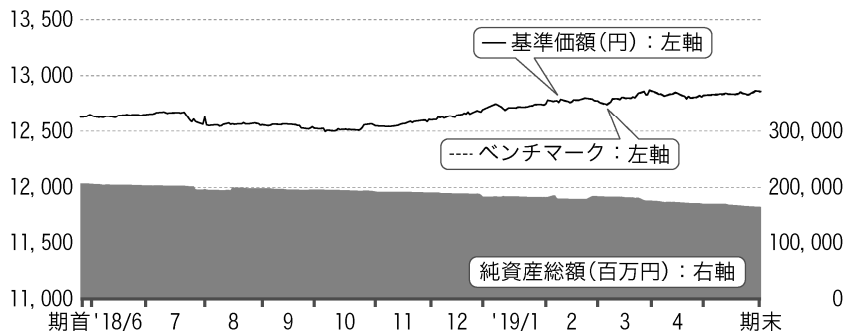
年月日	基準価額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合)		債券組入 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2018年5月25日	円	%		%	%
5月末	12,628	—	382.10	—	99.4
6月末	12,642	0.1	382.50	0.1	99.4
7月末	12,648	0.2	382.67	0.1	99.5
8月末	12,626	△0.0	381.98	△0.0	99.5
9月末	12,558	△0.6	379.89	△0.6	99.5
10月末	12,527	△0.8	378.99	△0.8	99.6
11月末	12,549	△0.6	379.64	△0.6	99.3
12月末	12,602	△0.2	381.24	△0.2	99.4
2019年1月末	12,694	0.5	384.13	0.5	99.4
2月末	12,747	0.9	385.58	0.9	99.4
3月末	12,774	1.2	386.43	1.1	99.3
4月末	12,865	1.9	389.14	1.8	99.5
(期末) 2019年5月27日	12,824	1.6	387.94	1.5	99.3
	12,860	1.8	388.97	1.8	98.7

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について (2018年5月26日から2019年5月27日まで)

基準価額等の推移



項目	期首	期末
基準価額(円)	12,628円	12,860円
騰落率		+1.8%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因 (2018年5月26日から2019年5月27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。

上昇要因

- ・10月以降、米中貿易摩擦問題への警戒や世界的な景気減速懸念を背景に、国内金利が低下（価格は上昇）したこと

下落要因

- ・7月、日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の許容変動幅を従来の倍程度としたことから国内金利が上昇（価格は下落）したこと

▶ 投資環境について (2018年5月26日から2019年5月27日まで)

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

長期金利は、期首からしばらくは0.0%台の狭い範囲で推移しましたが、7月末に日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の許容変動幅を従来の倍程度とすると、8月上旬には0.1%台前半へと上昇しました。しかし、急速な金利上昇に対して日銀が臨時的国債買入れオペを実施し金利上昇をけん制したため、長期金利は低下に転じました。

10月には、米国での利上げ観測を背景に海外金利が上昇していたこともあり、長期金利は再度0.1%台半ばへ上昇する場面がありました。しかしその後は、米中貿易摩擦問題や英国のEU（欧州連合）離脱問題を巡る混乱が警戒されるなか、世界的な株価の下落とともに、国内長期金利は年末まで低下基調で推移しました。

年明け以降は、世界的に景気減速への警戒感が高まるなかで欧米中央銀行が利上げ先送りのスタンスを示すと、海外金利の低下とともに、3月下旬には国内長期金利は一時-0.10%となるなど低下が進みました。期末にかけても、米中貿易摩擦問題への警戒が高まるなか、金利は低水準での推移が続きました。

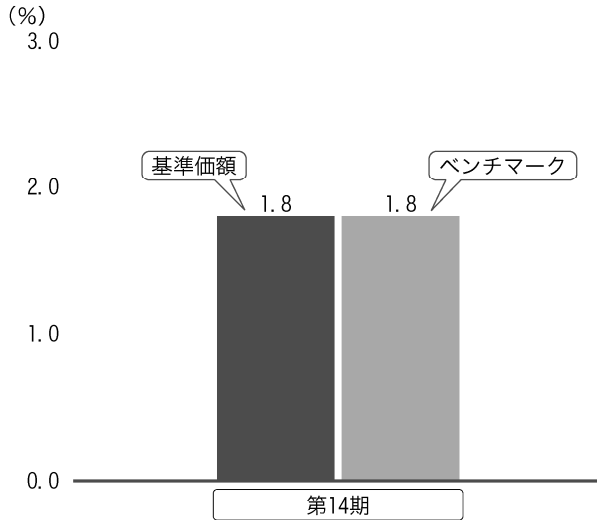
当期の市場の動きを10年国債利回りでみると、期首の0.04%から期末には-0.07%へ低下しました。

▶ ポートフォリオについて (2018年5月26日から2019年5月27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 (2018年5月26日から2019年5月27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】

基準価額の騰落率は+1.8%となり、ベンチマークの騰落率+1.8%に概ね連動した運用成果となりました。

2 今後の運用方針

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細(2018年5月26日から2019年5月27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12,671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(2018年5月26日から2019年5月27日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	31,576,321	65,587,604
	地方債証券	1,214,805	7,044,159 (250,600)
	特殊債証券	1,438,016	3,723,710 (1,413,736)
	社債証券 (投資法人債券を含む)	1,500,000	302,928 (700,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

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

■ 利害関係人との取引状況等(2018年5月26日から2019年5月27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 35,729	百万円 6,876	% 19.2	百万円 76,658	百万円 5,622	% 7.3

(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 405

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 1,300

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 (2018年5月26日から2019年5月27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(2019年5月27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	107,476,000 (17,585,000)	120,966,594 (19,622,403)	73.1 (11.9)	— (—)	54.1 (9.0)	18.2 (2.9)	0.8 (—)
地 方 債 証 券	12,000,500 (12,000,500)	12,772,620 (12,772,620)	7.7 (7.7)	— (—)	3.1 (3.1)	3.1 (3.1)	1.5 (1.5)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	19,345,994 (19,345,994)	20,442,309 (20,442,309)	12.3 (12.3)	— (—)	4.8 (4.8)	3.4 (3.4)	4.2 (4.2)
金 融 債 券	1,000,000 (1,000,000)	1,000,977 (1,000,977)	0.6 (0.6)	— (—)	— (—)	0.2 (0.2)	0.4 (0.4)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	8,000,000 (7,800,000)	8,288,373 (8,084,434)	5.0 (4.9)	— (—)	2.1 (2.0)	1.7 (1.7)	1.2 (1.2)
合 計	147,822,494 (57,731,494)	163,470,874 (61,922,744)	98.7 (37.4)	— (—)	64.1 (18.9)	26.5 (11.1)	8.2 (7.4)

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

国内債券パッシブ・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396回	利付国債(2年)	0.1	40,000	40,166	2021/1/1
	第397回	利付国債(2年)	0.1	90,000	90,394	2021/2/1
	第400回	利付国債(2年)	0.1	100,000	100,502	2021/5/1
	第128回	利付国債(5年)	0.1	565,000	568,039	2021/6/20
	第129回	利付国債(5年)	0.1	950,000	955,842	2021/9/20
	第130回	利付国債(5年)	0.1	830,000	835,768	2021/12/20
	第131回	利付国債(5年)	0.1	140,000	141,066	2022/3/20
	第132回	利付国債(5年)	0.1	145,000	146,204	2022/6/20
	第133回	利付国債(5年)	0.1	108,000	108,989	2022/9/20
	第134回	利付国債(5年)	0.1	110,000	111,084	2022/12/20
	第135回	利付国債(5年)	0.1	190,000	192,004	2023/3/20
	第136回	利付国債(5年)	0.1	950,000	960,687	2023/6/20
	第137回	利付国債(5年)	0.1	700,000	708,365	2023/9/20
	第138回	利付国債(5年)	0.1	500,000	506,325	2023/12/20
	第1回	利付国債(40年)	2.4	40,000	60,432	2048/3/20
	第2回	利付国債(40年)	2.2	242,000	355,183	2049/3/20
	第3回	利付国債(40年)	2.2	225,000	332,896	2050/3/20
	第4回	利付国債(40年)	2.2	302,000	450,949	2051/3/20
	第5回	利付国債(40年)	2.0	295,000	426,334	2052/3/20
	第6回	利付国債(40年)	1.9	300,000	427,653	2053/3/20
	第7回	利付国債(40年)	1.7	345,000	473,364	2054/3/20
	第8回	利付国債(40年)	1.4	390,000	499,640	2055/3/20
	第9回	利付国債(40年)	0.4	551,000	524,893	2056/3/20
	第10回	利付国債(40年)	0.9	565,000	632,839	2057/3/20
	第11回	利付国債(40年)	0.8	460,000	499,173	2058/3/20
	第313回	利付国債(10年)	1.3	95,000	97,518	2021/3/20
	第315回	利付国債(10年)	1.2	1,800,000	1,850,652	2021/6/20
	第317回	利付国債(10年)	1.1	1,005,000	1,034,416	2021/9/20
	第318回	利付国債(10年)	1.0	895,000	919,120	2021/9/20
	第319回	利付国債(10年)	1.1	980,000	1,011,918	2021/12/20
	第320回	利付国債(10年)	1.0	960,000	988,800	2021/12/20
	第321回	利付国債(10年)	1.0	960,000	991,718	2022/3/20
	第322回	利付国債(10年)	0.9	1,065,000	1,097,184	2022/3/20
	第323回	利付国債(10年)	0.9	310,000	320,211	2022/6/20
	第324回	利付国債(10年)	0.8	390,000	401,645	2022/6/20
	第325回	利付国債(10年)	0.8	1,365,000	1,409,376	2022/9/20
	第326回	利付国債(10年)	0.7	77,000	79,416	2022/12/20
	第327回	利付国債(10年)	0.8	375,000	388,113	2022/12/20
	第328回	利付国債(10年)	0.6	380,000	391,297	2023/3/20
	第329回	利付国債(10年)	0.8	2,030,000	2,110,976	2023/6/20
	第330回	利付国債(10年)	0.8	1,285,000	1,339,471	2023/9/20
	第332回	利付国債(10年)	0.6	793,000	821,270	2023/12/20
	第333回	利付国債(10年)	0.6	815,000	845,644	2024/3/20
	第334回	利付国債(10年)	0.6	315,000	327,467	2024/6/20
	第335回	利付国債(10年)	0.5	50,000	51,810	2024/9/20
	第336回	利付国債(10年)	0.5	470,000	487,822	2024/12/20
	第337回	利付国債(10年)	0.3	120,000	123,202	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338回 利付国債(10年)	0.4	805,000	831,927	2025/3/20
	第339回 利付国債(10年)	0.4	905,000	936,593	2025/6/20
	第340回 利付国債(10年)	0.4	770,000	798,012	2025/9/20
	第341回 利付国債(10年)	0.3	1,107,000	1,141,538	2025/12/20
	第342回 利付国債(10年)	0.1	950,000	967,670	2026/3/20
	第343回 利付国債(10年)	0.1	1,110,000	1,131,012	2026/6/20
	第344回 利付国債(10年)	0.1	1,021,000	1,040,644	2026/9/20
	第345回 利付国債(10年)	0.1	1,398,000	1,425,274	2026/12/20
	第346回 利付国債(10年)	0.1	990,000	1,009,552	2027/3/20
	第347回 利付国債(10年)	0.1	990,000	1,009,374	2027/6/20
	第348回 利付国債(10年)	0.1	665,000	677,854	2027/9/20
	第349回 利付国債(10年)	0.1	1,300,000	1,324,739	2027/12/20
	第350回 利付国債(10年)	0.1	1,330,000	1,354,844	2028/3/20
	第351回 利付国債(10年)	0.1	1,220,000	1,242,313	2028/6/20
	第352回 利付国債(10年)	0.1	1,200,000	1,221,408	2028/9/20
	第353回 利付国債(10年)	0.1	1,070,000	1,088,553	2028/12/20
	第354回 利付国債(10年)	0.1	135,000	137,266	2029/3/20
	第2回 利付国債(30年)	2.4	510,000	643,456	2030/2/20
	第4回 利付国債(30年)	2.9	300,000	399,894	2030/11/20
	第5回 利付国債(30年)	2.2	290,000	365,542	2031/5/20
	第7回 利付国債(30年)	2.3	474,000	611,123	2032/5/20
	第9回 利付国債(30年)	1.4	100,000	117,712	2032/12/20
	第10回 利付国債(30年)	1.1	585,000	665,595	2033/3/20
	第11回 利付国債(30年)	1.7	430,000	525,408	2033/6/20
	第12回 利付国債(30年)	2.1	590,000	755,465	2033/9/20
	第14回 利付国債(30年)	2.4	742,000	987,468	2034/3/20
	第16回 利付国債(30年)	2.5	465,000	629,535	2034/9/20
	第18回 利付国債(30年)	2.3	450,000	598,500	2035/3/20
	第19回 利付国債(30年)	2.3	490,000	653,189	2035/6/20
	第21回 利付国債(30年)	2.3	345,000	462,272	2035/12/20
	第22回 利付国債(30年)	2.5	315,000	433,184	2036/3/20
	第23回 利付国債(30年)	2.5	329,000	453,480	2036/6/20
	第24回 利付国債(30年)	2.5	310,000	428,606	2036/9/20
	第25回 利付国債(30年)	2.3	300,000	405,522	2036/12/20
	第26回 利付国債(30年)	2.4	363,000	498,202	2037/3/20
	第27回 利付国債(30年)	2.5	440,000	614,455	2037/9/20
	第28回 利付国債(30年)	2.5	386,000	541,546	2038/3/20
	第29回 利付国債(30年)	2.4	177,000	246,208	2038/9/20
	第30回 利付国債(30年)	2.3	472,000	650,345	2039/3/20
	第31回 利付国債(30年)	2.2	395,000	538,704	2039/9/20
	第32回 利付国債(30年)	2.3	420,000	583,963	2040/3/20
	第33回 利付国債(30年)	2.0	613,000	818,489	2040/9/20
	第34回 利付国債(30年)	2.2	477,000	659,156	2041/3/20
	第35回 利付国債(30年)	2.0	465,000	625,750	2041/9/20
	第36回 利付国債(30年)	2.0	240,000	324,336	2042/3/20
	第37回 利付国債(30年)	1.9	640,000	853,830	2042/9/20
	第38回 利付国債(30年)	1.8	375,000	493,425	2043/3/20
	第39回 利付国債(30年)	1.9	260,000	348,665	2043/6/20
	第40回 利付国債(30年)	1.8	295,000	389,538	2043/9/20
	第41回 利付国債(30年)	1.7	335,000	435,325	2043/12/20

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42回 利付国債(30年)	1.7	345,000	448,762	2044/3/20
	第43回 利付国債(30年)	1.7	315,000	410,148	2044/6/20
	第44回 利付国債(30年)	1.7	415,000	541,504	2044/9/20
	第45回 利付国債(30年)	1.5	415,000	522,082	2044/12/20
	第46回 利付国債(30年)	1.5	435,000	547,586	2045/3/20
	第47回 利付国債(30年)	1.6	360,000	462,506	2045/6/20
	第48回 利付国債(30年)	1.4	425,000	525,559	2045/9/20
	第49回 利付国債(30年)	1.4	395,000	488,674	2045/12/20
	第50回 利付国債(30年)	0.8	505,000	548,596	2046/3/20
	第51回 利付国債(30年)	0.3	520,000	498,175	2046/6/20
	第52回 利付国債(30年)	0.5	503,000	507,265	2046/9/20
	第53回 利付国債(30年)	0.6	197,000	203,497	2046/12/20
	第54回 利付国債(30年)	0.8	160,000	173,412	2047/3/20
	第55回 利付国債(30年)	0.8	425,000	460,912	2047/6/20
	第56回 利付国債(30年)	0.8	430,000	466,038	2047/9/20
	第57回 利付国債(30年)	0.8	590,000	639,029	2047/12/20
	第58回 利付国債(30年)	0.8	590,000	638,592	2048/3/20
	第59回 利付国債(30年)	0.7	400,000	422,444	2048/6/20
	第60回 利付国債(30年)	0.9	420,000	465,931	2048/9/20
	第61回 利付国債(30年)	0.7	355,000	374,248	2048/12/20
	第62回 利付国債(30年)	0.5	70,000	69,909	2049/3/20
	第50回 利付国債(20年)	1.9	918,000	952,443	2021/3/22
	第52回 利付国債(20年)	2.1	720,000	757,936	2021/9/21
	第54回 利付国債(20年)	2.2	965,000	1,023,768	2021/12/20
	第56回 利付国債(20年)	2.0	818,000	872,650	2022/6/20
	第59回 利付国債(20年)	1.7	1,455,000	1,552,848	2022/12/20
	第61回 利付国債(20年)	1.0	1,215,000	1,269,760	2023/3/20
	第64回 利付国債(20年)	1.9	1,025,000	1,117,229	2023/9/20
	第65回 利付国債(20年)	1.9	1,020,000	1,117,124	2023/12/20
	第69回 利付国債(20年)	2.1	1,020,000	1,132,302	2024/3/20
	第70回 利付国債(20年)	2.4	780,000	882,367	2024/6/20
	第72回 利付国債(20年)	2.1	753,000	844,677	2024/9/20
	第74回 利付国債(20年)	2.1	664,000	748,666	2024/12/20
	第75回 利付国債(20年)	2.1	490,000	555,116	2025/3/20
	第78回 利付国債(20年)	1.9	590,000	664,611	2025/6/20
	第82回 利付国債(20年)	2.1	620,000	709,614	2025/9/20
	第84回 利付国債(20年)	2.0	850,000	972,119	2025/12/20
	第85回 利付国債(20年)	2.1	645,000	745,374	2026/3/20
	第88回 利付国債(20年)	2.3	742,000	872,080	2026/6/20
	第89回 利付国債(20年)	2.2	20,000	23,363	2026/6/20
	第90回 利付国債(20年)	2.2	580,000	680,809	2026/9/20
	第92回 利付国債(20年)	2.1	734,000	860,027	2026/12/20
	第93回 利付国債(20年)	2.0	632,000	738,808	2027/3/20
	第95回 利付国債(20年)	2.3	305,000	365,390	2027/6/20
	第97回 利付国債(20年)	2.2	677,000	808,913	2027/9/20
	第99回 利付国債(20年)	2.1	693,000	825,411	2027/12/20
	第100回 利付国債(20年)	2.2	207,000	249,321	2028/3/20
	第101回 利付国債(20年)	2.4	355,000	433,891	2028/3/20
	第102回 利付国債(20年)	2.4	457,000	561,232	2028/6/20
	第105回 利付国債(20年)	2.1	390,000	470,008	2028/9/20

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106回 利付国債(20年)	2.2	370,000	449,379	2028/9/20
	第107回 利付国債(20年)	2.1	378,000	457,198	2028/12/20
	第108回 利付国債(20年)	1.9	390,000	464,201	2028/12/20
	第109回 利付国債(20年)	1.9	340,000	405,966	2029/3/20
	第111回 利付国債(20年)	2.2	386,000	474,077	2029/6/20
	第113回 利付国債(20年)	2.1	427,000	521,917	2029/9/20
	第114回 利付国債(20年)	2.1	383,000	469,703	2029/12/20
	第116回 利付国債(20年)	2.2	380,000	471,652	2030/3/20
	第118回 利付国債(20年)	2.0	200,000	244,658	2030/6/20
	第119回 利付国債(20年)	1.8	365,000	438,408	2030/6/20
	第120回 利付国債(20年)	1.6	280,000	330,108	2030/6/20
	第121回 利付国債(20年)	1.9	255,000	309,995	2030/9/20
	第122回 利付国債(20年)	1.8	380,000	457,653	2030/9/20
	第123回 利付国債(20年)	2.1	230,000	285,689	2030/12/20
	第124回 利付国債(20年)	2.0	330,000	406,088	2030/12/20
	第125回 利付国債(20年)	2.2	275,000	345,842	2031/3/20
	第126回 利付国債(20年)	2.0	180,000	222,125	2031/3/20
	第127回 利付国債(20年)	1.9	145,000	177,224	2031/3/20
	第128回 利付国債(20年)	1.9	265,000	324,757	2031/6/20
	第129回 利付国債(20年)	1.8	230,000	279,098	2031/6/20
	第130回 利付国債(20年)	1.8	135,000	164,216	2031/9/20
	第131回 利付国債(20年)	1.7	640,000	770,662	2031/9/20
	第132回 利付国債(20年)	1.7	680,000	820,603	2031/12/20
	第133回 利付国債(20年)	1.8	160,000	195,081	2031/12/20
	第134回 利付国債(20年)	1.8	50,000	61,099	2032/3/20
	第135回 利付国債(20年)	1.7	205,000	247,898	2032/3/20
	第136回 利付国債(20年)	1.6	100,000	119,654	2032/3/20
	第137回 利付国債(20年)	1.7	245,000	297,077	2032/6/20
	第138回 利付国債(20年)	1.5	25,000	29,666	2032/6/20
	第139回 利付国債(20年)	1.6	80,000	95,968	2032/6/20
	第140回 利付国債(20年)	1.7	600,000	729,018	2032/9/20
	第141回 利付国債(20年)	1.7	460,000	559,994	2032/12/20
	第142回 利付国債(20年)	1.8	230,000	283,084	2032/12/20
	第143回 利付国債(20年)	1.6	290,000	349,734	2033/3/20
	第144回 利付国債(20年)	1.5	180,000	214,621	2033/3/20
	第145回 利付国債(20年)	1.7	445,000	543,736	2033/6/20
	第146回 利付国債(20年)	1.7	275,000	336,622	2033/9/20
	第147回 利付国債(20年)	1.6	590,000	714,991	2033/12/20
	第148回 利付国債(20年)	1.5	284,000	340,535	2034/3/20
	第149回 利付国債(20年)	1.5	715,000	858,443	2034/6/20
	第150回 利付国債(20年)	1.4	541,000	642,237	2034/9/20
	第151回 利付国債(20年)	1.2	790,000	914,764	2034/12/20
	第152回 利付国債(20年)	1.2	570,000	660,396	2035/3/20
	第153回 利付国債(20年)	1.3	457,000	536,906	2035/6/20
	第154回 利付国債(20年)	1.2	560,000	649,499	2035/9/20
	第155回 利付国債(20年)	1.0	570,000	643,108	2035/12/20
	第156回 利付国債(20年)	0.4	630,000	648,383	2036/3/20
	第157回 利付国債(20年)	0.2	565,000	561,751	2036/6/20
	第158回 利付国債(20年)	0.5	545,000	568,554	2036/9/20
	第159回 利付国債(20年)	0.6	553,000	586,058	2036/12/20

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160回 利付国債(20年)	0.7	480,000	516,830	2037/3/20
	第161回 利付国債(20年)	0.6	540,000	571,671	2037/6/20
	第162回 利付国債(20年)	0.6	455,000	481,203	2037/9/20
	第163回 利付国債(20年)	0.6	710,000	750,093	2037/12/20
	第164回 利付国債(20年)	0.5	555,000	575,784	2038/3/20
	第165回 利付国債(20年)	0.5	610,000	631,996	2038/6/20
	第166回 利付国債(20年)	0.7	485,000	519,939	2038/9/20
	第167回 利付国債(20年)	0.5	660,000	681,872	2038/12/20
	小 計	-	107,476,000	120,966,594	-
地方債証券	第1回 東京都公募公債(20年)	1.54	100,000	106,219	2023/6/20
	第1回 東京都公募公債(30年)	2.21	100,000	126,898	2033/6/20
	第6回 東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	111,462	2025/3/19
	第7回 東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	113,463	2025/9/19
	第8回 東京都公募公債(20年)	2.36	100,000	115,800	2026/3/19
	第8回 東京都公募公債(30年)	2.23	400,000	528,368	2038/9/17
	第13回 東京都公募公債(30年)	1.93	500,000	646,445	2042/3/19
	第684回 東京都公募公債	1.26	100,000	101,322	2020/6/19
	第685回 東京都公募公債	1.13	100,000	101,185	2020/6/19
	第688回 東京都公募公債	0.94	193,500	195,847	2020/9/18
	第689回 東京都公募公債	1.08	200,000	202,794	2020/9/18
	第703回 東京都公募公債	0.99	100,000	102,514	2021/12/20
	第705回 東京都公募公債	1.06	100,000	102,950	2022/3/18
	第710回 東京都公募公債	0.81	100,000	102,452	2022/6/20
	平成21年度第14回 北海道公募公債	1.52	100,000	101,118	2020/2/26
	平成24年度第1回 北海道公募公債	0.99	100,000	102,799	2022/4/27
	平成24年度第14回 北海道公募公債	0.8	100,000	102,891	2023/2/28
	平成25年度第15回 北海道公募公債	0.67	100,000	103,041	2024/2/28
	平成26年度第10回 北海道公募公債(5年)	0.147	200,000	200,112	2019/11/28
	平成26年度第15回 北海道公募公債	0.434	100,000	102,299	2025/2/27
	平成29年度第6回 北海道公募公債(5年)	0.01	300,000	299,808	2022/7/28
	第1回 神奈川県公募公債(20年)	2.55	100,000	112,798	2024/6/20
	第3回 神奈川県公募公債(20年)	2.11	100,000	112,630	2025/6/20
	第7回 神奈川県公募公債(20年)	2.22	100,000	117,023	2027/3/19
	第342回 大阪府公募公債(10年)	1.2	200,000	203,126	2020/9/29
	第361回 大阪府公募公債(10年)	0.92	200,000	205,490	2022/6/28
	第373回 大阪府公募公債(10年)	0.904	100,000	103,565	2023/6/27
	第377回 大阪府公募公債(10年)	0.729	100,000	103,090	2023/10/30
	平成22年度第5回 京都府公募公債	1.26	110,000	112,158	2020/12/21
	平成26年度第13回 京都府公募公債	0.484	100,000	102,664	2025/3/19
	平成27年度第4回 京都府公募公債	0.553	100,000	103,196	2025/6/19
	平成29年度第12回 京都府公募公債	0.04	300,000	300,339	2023/3/16
	第5回 兵庫県公募公債(15年)	1.31	300,000	332,820	2028/5/26
	平成22年度第1回 兵庫県公募公債	1.46	100,000	101,268	2020/4/16
	第7回 静岡県公募公債(30年)	1.988	100,000	131,520	2043/6/19
	平成20年度第1回 静岡県公募公債	2.18	200,000	227,180	2025/9/19
	平成21年度第10回 愛知県公募公債(10年)	1.38	100,000	100,583	2019/10/30
	平成22年度第12回 愛知県公募公債(10年)	1.085	100,000	101,624	2020/11/30
	平成29年度第2回 埼玉県公募公債(5年)	0.01	200,000	200,000	2022/4/19
	平成29年度第7回 埼玉県公募公債(5年)	0.02	400,000	400,136	2022/10/27
	平成21年度第8回 福岡県公募公債	1.34	100,000	100,770	2019/12/25

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
	平成25年度第11回 福岡県公募公債	0.694	100,000	103,250	2024/2/26
	平成26年度第10回 福岡県公募公債	0.453	100,000	102,466	2025/2/26
	第9回 群馬県公募公債(10年)	0.801	100,000	102,766	2022/11/25
	第81回 共同発行市場公募地方債	1.32	100,000	100,758	2019/12/25
	第82回 共同発行市場公募地方債	1.42	100,000	100,932	2020/1/24
	第91回 共同発行市場公募地方債	0.9	300,000	303,744	2020/10/23
	第110回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	102,634	2022/5/25
	第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	300,000	308,118	2022/6/24
	第112回 共同発行市場公募地方債	0.84	150,000	153,934	2022/7/25
	第113回 共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	102,466	2022/8/25
	第114回 共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	102,691	2022/9/22
	第115回 共同発行市場公募地方債	0.8	600,000	616,176	2022/10/25
	第118回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	103,041	2023/1/25
	第137回 共同発行市場公募地方債	0.566	200,000	205,714	2024/8/23
	第149回 共同発行市場公募地方債	0.5	400,000	411,848	2025/8/25
	第172回 共同発行市場公募地方債	0.225	500,000	507,520	2027/7/23
	第1回 名古屋市公募公債(20年)	1.99	200,000	218,080	2023/12/20
	第3回 名古屋市公募公債(20年)	2.03	100,000	112,145	2025/6/20
	第1回 京都市公募公債(7年)	0.365	300,000	300,591	2019/12/18
	第1回 京都市公募公債(30年)	2.57	100,000	137,377	2037/9/18
	第7回 京都市公募公債(20年)	2.38	100,000	121,339	2028/9/21
	平成29年度第5回 京都市公募公債	0.04	100,000	100,114	2023/3/28
	平成26年度第17回 神戸市公募公債	0.28	100,000	101,460	2025/1/27
	第4回 横浜市公募公債(20年)	2.03	100,000	111,636	2025/3/19
	第9回 横浜市公募公債(20年)	2.35	100,000	116,313	2026/6/19
	第14回 横浜市公募公債(20年)	2.32	100,000	119,852	2028/3/17
	第47回 横浜市公募公債(5年)	0.04	100,000	100,110	2023/1/27
	平成26年度第4回 札幌市公募公債(10年)	0.54	100,000	102,626	2024/6/20
	第2回 川崎市15年公募公債	1.63	100,000	101,729	2020/6/22
	第4回 川崎市15年公募公債	2.11	100,000	105,390	2021/12/20
	平成24年度第2回 北九州市公募公債	0.715	100,000	102,525	2022/12/26
	平成23年度第9回 福岡市公募公債	1.01	147,000	151,168	2022/3/28
	平成29年度第11回 福岡市公募公債(5年)	0.04	300,000	300,339	2023/3/16
	小 計	-	12,000,500	12,772,620	-
特 殊 債 券 (除く金融債)	第340回 政府保証道路債券	1.7	100,000	101,591	2020/4/28
	第14回 政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.199	200,000	200,472	2020/6/18
	第16回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	301,000	305,015	2020/9/14
	第3回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	12,876	13,253	2036/5/10
	第4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	15,482	16,308	2042/8/10
	第5回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	13,424	13,822	2036/11/10
	第6回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.94	20,510	20,620	2037/6/10
	第7回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.0	17,022	17,991	2038/11/10
	第8回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	10,313	10,358	2037/10/10
	第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	29,074	30,487	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	17,123	18,255	2039/5/10
	第10回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	44,967	47,183	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	16,736	17,695	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	17,992	19,158	2040/5/10
	第12回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	11,611	11,818	2038/9/10
	第14回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7	15,977	16,322	2032/5/10

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17回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	37,218	38,302	2032/11/10
第19回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.15	21,971	23,501	2043/11/10
第24回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	45,428	49,014	2044/5/10
第26回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	71,601	77,009	2044/7/10
第27回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.05	25,852	27,817	2044/8/10
第28回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	28,514	30,657	2044/9/10
第29回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	14,159	14,638	2040/4/10
第29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	30,921	33,384	2044/10/10
第30回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	30,415	32,820	2044/11/10
第32回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	15,892	16,514	2040/7/10
第32回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	59,896	64,145	2045/1/10
第35回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	16,663	17,437	2040/10/10
第35回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	33,133	35,483	2045/4/10
第36回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	33,307	35,525	2045/5/10
第39回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	14,914	15,519	2041/2/10
第41回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	16,291	17,207	2041/4/10
第43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.28	30,814	32,564	2041/6/10
第43回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	43,613	46,564	2045/12/10
第46回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	36,051	38,658	2046/3/10
第48回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	67,566	72,373	2046/5/10
第49回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	33,471	35,700	2046/6/10
第51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	14,619	15,385	2042/2/10
第51回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	73,514	78,337	2046/8/10
第52回	一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	120,116	2030/7/16
第53回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	15,365	16,147	2042/4/10
第55回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	96,054	101,981	2046/12/10
第57回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	45,757	48,597	2047/2/10
第58回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4	48,302	51,275	2047/3/10
第59回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	93,734	99,628	2047/4/10
第60回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	146,409	155,091	2047/5/10
第61回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	47,217	49,824	2047/6/10
第67回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	52,957	55,490	2047/12/10
第69回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	108,036	114,218	2048/2/10
第70回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	95,450	100,507	2048/3/10
第73回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	53,575	56,760	2048/6/10
第95回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.065	100,000	102,934	2022/3/18
第99回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	77,377	80,477	2050/8/10
第123回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	93,010	94,390	2052/8/10
第124回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	93,137	94,282	2052/9/10
第125回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	93,337	94,517	2052/10/10
第127回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	94,425	95,465	2052/12/10
第128回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	94,339	95,555	2053/1/10
第129回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	95,061	96,547	2053/2/10
第130回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	200,000	239,716	2032/12/20
第137回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	97,784	99,393	2053/10/10
第1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	29,628	30,937	2042/5/10
第2回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	32,174	33,848	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	15,832	16,676	2037/11/10
第6回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	15,230	15,974	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	32,874	34,696	2038/11/10

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7回	道路債券	2.7	100,000	108,145	2022/6/20
第9回	道路債券	2.9	100,000	133,572	2032/5/20
第42回	道路債券	2.22	100,000	112,456	2025/3/21
第11回	地方公共団体金融機構債券	1.465	100,000	101,319	2020/4/28
第15回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	200,000	202,492	2020/8/14
第18回	政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	500,000	506,855	2020/11/17
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	800,744	2022/5/30
第26回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	300,000	307,248	2021/7/16
第27回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	200,000	204,562	2021/8/13
第42回	地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	102,737	2022/11/28
第45回	地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	205,792	2023/2/28
第61回	地方公共団体金融機構債券	0.69	100,000	103,243	2024/6/28
第63回	地方公共団体金融機構債券	0.581	100,000	102,781	2024/8/28
第65回	地方公共団体金融機構債券	0.535	100,000	102,622	2024/10/28
第67回	政府保証地方公共団体金融機構債券	0.466	100,000	102,670	2024/12/13
第51回	政府保証関西国際空港債券	2.1	100,000	106,956	2022/8/31
第3回	政府保証日本政策投資銀行社債	2.1	200,000	219,458	2023/12/18
第9回	政府保証日本政策投資銀行社債	1.0	100,000	101,334	2020/9/14
第15回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	105,224	2021/12/22
第20回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	107,243	2022/12/19
第27回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.11	100,000	100,240	2021/2/12
第34回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.001	300,000	300,285	2022/6/30
第2回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	300,000	308,712	2020/12/27
第9回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	103,534	2021/3/26
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	240,970	2029/5/31
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	135,363	2039/8/31
第89回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	751,000	754,424	2019/9/30
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	362,901	2029/9/28
第98回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	159,000	160,437	2020/1/31
第99回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	122,457	2030/1/31
第103回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	1,500,000	1,516,155	2020/3/19
第104回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	300,000	303,966	2020/4/30
第120回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	101,323	2020/10/30
第137回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	1,000,000	1,025,750	2021/6/30
第147回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	102,498	2021/10/29
第152回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	300,000	308,778	2021/12/28
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	205,980	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	308,433	2024/11/29
第8回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	129,000	130,113	2020/1/20
第203回	政府保証預金保険機構債	0.1	300,000	300,240	2020/1/17
第208回	政府保証預金保険機構債	0.1	600,000	601,026	2020/10/6
第209回	政府保証預金保険機構債	0.1	600,000	601,194	2020/12/11
第20回	西日本高速道路社債	0.759	100,000	103,054	2023/9/20
第332回	東京交通債券	2.65	100,000	101,335	2019/11/29
第342回	東京交通債券	2.4	100,000	107,298	2022/6/21
第36回	日本政策投資銀行債券	2.23	100,000	117,239	2027/5/28
第8回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	100,000	116,017	2026/3/19
第18回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.87	100,000	155,186	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	451,305	2047/3/20
第47回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	200,000	244,694	2029/4/20

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107回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.935	300,000	311,151	2023/6/20
	第120回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.751	100,000	103,335	2023/12/20
	第2回 地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.29	100,000	121,332	2029/4/27
	第3回 公営企業債券(20年)	1.03	100,000	103,854	2023/3/22
	第5回 公営企業債券(20年)	2.11	100,000	109,017	2023/9/20
	第11回 公営企業債券(20年)	2.11	100,000	111,965	2025/3/24
	第16回 公営企業債券(20年)	2.1	100,000	113,415	2025/12/19
	第17回 公営企業債券(20年)	2.39	100,000	115,642	2026/3/24
	第18回 公営企業債券(20年)	2.58	100,000	117,602	2026/6/19
	第22回 公営企業債券(20年)	2.32	100,000	118,084	2027/6/18
	第24回 公営企業債券(20年)	2.29	200,000	239,016	2028/4/25
	第44回 地方公共団体金融機構債券	0.791	300,000	308,484	2023/1/27
	第62回 地方公共団体金融機構債券	0.631	400,000	411,956	2024/7/26
	第15回 首都高速道路	0.21	100,000	100,196	2020/9/18
	第7回 本州四国連絡橋債券	2.26	100,000	113,161	2025/6/20
	第12回 国際協力機構債券	0.901	100,000	102,699	2022/6/20
	第28回 東日本高速道路	0.248	100,000	100,124	2019/12/20
	第35回 東日本高速道路	0.1	200,000	200,182	2021/3/19
	第45回 中日本高速道路	0.904	100,000	102,828	2022/9/20
	第22回 西日本高速道路	0.744	100,000	103,330	2024/3/19
	第23回 西日本高速道路	0.602	100,000	102,602	2024/6/20
	小 計	-	19,345,994	20,442,309	-
金 融 債 券	い第810号 農林債	0.1	300,000	300,522	2022/11/25
	第297回 信金中金債(5年)	0.2	200,000	200,088	2019/8/27
	第301回 信金中金債(5年)	0.225	300,000	300,369	2019/12/27
	第197号 商工債(3年)	0.02	200,000	199,998	2019/6/27
	小 計	-	1,000,000	1,000,977	-
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第528回 東京電力	1.905	100,000	100,085	2019/6/13
	第537回 東京電力	1.814	100,000	101,215	2020/2/28
	第547回 東京電力	1.948	100,000	101,944	2020/7/24
	第507回 中部電力	0.605	100,000	102,058	2026/1/23
	第518回 中部電力	0.19	100,000	100,091	2023/1/25
	第512回 関西電力	0.32	100,000	100,293	2024/10/25
	第527回 関西電力	0.28	100,000	100,167	2024/4/25
	第308回 北陸電力	0.769	100,000	102,703	2024/9/25
	第471回 東北電力	1.168	100,000	104,322	2023/12/25
	第472回 東北電力	0.954	100,000	103,422	2024/2/23
	第476回 東北電力	0.57	100,000	101,492	2025/1/24
	第508回 東北電力	0.465	200,000	201,332	2029/4/25
	第253回 四国電力	1.0	100,000	103,274	2023/6/23
	第328回 北海道電力	0.42	100,000	100,635	2023/1/25
	第13回 大和ハウス工業	0.285	100,000	100,598	2027/6/1
	第10回 アサヒグループホールディングス	0.17	100,000	100,087	2022/6/13
	第9回 セブン&アイ・ホールディングス	0.671	100,000	102,023	2023/3/20
	第30回 東レ	0.375	100,000	100,875	2027/7/16
	第7回 クラレ	0.19	100,000	100,188	2025/4/25
	第56回 住友化学	0.38	200,000	200,982	2027/9/13
	第47回 三井化学	0.26	100,000	100,072	2025/6/19
	第24回 三菱ケミカルホールディングス	0.37	100,000	100,602	2028/2/25
	第13回 プリチストン	0.23	100,000	99,974	2026/4/17

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3回 新日鐵住金	0.22	100,000	100,163	2024/5/20
	第8回 ジェイテクト	0.25	100,000	100,070	2025/3/7
	第16回 日立製作所	0.813	100,000	103,064	2023/12/13
	第12回 パナソニック	0.387	200,000	200,504	2020/3/19
	第13回 パナソニック	0.568	200,000	202,388	2022/3/18
	第1回 明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	0.51	100,000	100,047	2019/8/7
	第1回 ユニー・ファミリーマートホールディングス	0.14	100,000	100,133	2022/2/22
	第63回 三井物産	2.37	100,000	116,984	2027/4/23
	第47回 住友商事	0.858	100,000	102,999	2023/10/23
	第69回 クレディセゾン	0.18	100,000	99,847	2023/6/19
	第8回 みずほコーポレート銀行	2.54	100,000	118,576	2027/7/27
	第25回 三菱東京UFJ銀行	1.31	300,000	305,292	2020/11/12
	第110回 三菱東京UFJ銀行	1.485	100,000	100,568	2019/10/16
	第1回 三井住友フィナンシャル	0.849	100,000	102,158	2024/9/12
	第4回 りそな銀行	2.766	100,000	100,173	2019/6/20
	第9回 三菱UFJ信託銀行	1.68	100,000	102,967	2021/4/28
	第8回 住友信託銀行	2.49	100,000	115,807	2027/5/10
	第1回 みずほフィナンシャルグループ	0.95	100,000	102,294	2024/7/16
	第20回 三井住友銀行	2.21	200,000	200,668	2019/7/24
	第24回 三井住友銀行	1.6	100,000	102,939	2021/6/1
	第9回 みずほ銀行	2.52	100,000	115,969	2027/4/27
	第50回 日産フィナンシャルサービス	0.1	100,000	99,690	2021/12/20
	第17回 トヨタファイナンス	1.91	100,000	102,426	2020/9/18
	第54回 トヨタファイナンス	0.508	100,000	100,480	2020/6/19
	第83回 トヨタファイナンス	0.08	100,000	100,019	2023/4/24
	第70回 日立キャピタル	0.2	100,000	100,080	2022/12/20
	第1回 野村ホールディングス	0.3	100,000	100,009	2023/9/4
	第21回 野村ホールディングス	1.86	100,000	101,432	2020/3/17
	第58回 三井不動産	0.1	100,000	99,934	2023/2/24
	第58回 三菱地所	2.9	100,000	131,177	2032/5/20
	第38回 京王電鉄	0.295	100,000	100,800	2027/11/29
	第15回 東日本旅客鉄道	2.65	100,000	103,271	2020/8/25
	第34回 東日本旅客鉄道	2.53	100,000	112,355	2024/6/20
	第110回 東日本旅客鉄道	1.76	100,000	125,647	2045/7/28
	第41回 東海旅客鉄道	2.166	100,000	118,666	2029/1/29
	第42回 東海旅客鉄道	2.312	200,000	240,936	2029/4/24
	第27回 KDDI	0.23	100,000	100,178	2026/4/24
	第11回 電源開発	2.05	100,000	109,978	2025/3/19
	第24回 東京電力パワーグリッド	0.61	200,000	200,650	2024/4/24
	第18回 大阪瓦斯	1.47	200,000	210,224	2022/12/20
	第27回 東邦瓦斯	1.12	100,000	104,112	2023/3/20
	第4回 ファーストリテイリング	0.749	100,000	103,132	2025/12/18
	第7回 ファーストリテイリング	0.405	100,000	100,573	2028/6/6
	第2回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20)	0.645	200,000	200,168	2023/7/12
	第11回 ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	200,000	200,392	2021/1/22
	小 計	—	8,000,000	8,288,373	—
	合 計	—	147,822,494	163,470,874	—

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2019年5月27日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	163,470,874	98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,817,662	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	166,288,536	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

(2019年5月27日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	166,288,536,967円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	886,480,851
公 社 債 (評 価 額)	163,470,874,889
未 収 入 金	1,433,502,650
未 収 利 息	493,145,413
前 払 費 用	4,533,164
(B) 負 債	739,539,609
未 払 解 約 金	739,497,801
未 払 利 息	901
そ の 他 未 払 費 用	40,907
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	165,548,997,358
元 本	128,728,886,975
次 期 繰 越 損 益 金	36,820,110,383
(D) 受 益 権 総 口 数	128,728,886,975口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12,860円

※当期における期首元本額163,796,330,040円、期中追加設定元本額18,991,205,023円、期中一部解約元本額54,058,648,088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2018年5月26日 至2019年5月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,031,762,455円
受 取 利 息	2,032,287,838
支 払 利 息	△ 525,383
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,218,113,376
売 買 損 益	2,203,039,987
売 買 損 益	△ 984,926,611
(C) 信 託 報 酬 等	△ 607,593
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	3,249,268,238
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	43,046,958,058
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,112,264,943
(G) 解 約 差 損 益 金	△14,588,380,856
(H) 計 (D + E + F + G)	36,820,110,383
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	36,820,110,383

※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)	4,544,382,925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>	112,648,590円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	7,764,734,486円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,014,357,930円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	1,670,199,620円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,167,297,178円
SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	690,559,127円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,802,135,470円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2020 (4資産タイプ)	49,679,212円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,589,912,942円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2025 (4資産タイプ)	168,403,515円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	3,063,620円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2030 (4資産タイプ)	310,024,681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)	2,148,625,775円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2035 (4資産タイプ)	271,423,917円	三井住友・5資産バランスファンド・VAS (適格機関投資家専用)	9,593,375,639円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2040 (4資産タイプ)	103,009,207円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	510,755,318円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2045 (4資産タイプ)	209,045,221円	SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	224,809,413円
三井住友・DC年金バランスゼロ (債券型)	90,014,140円	三井住友・7資産バランスファンド・VAS (適格機関投資家専用)	7,679,220,975円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	2,427,872,977円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	919,958,791円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	643,158,344円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	186,847,552円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	33,591,719円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	44,401,846円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2050	10,423,988円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,996,661,678円
三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)	36,601,395円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,502,256,041円
三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)	13,811,555円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,365,436,017円
三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型)	7,776,181円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,012,950,975円
三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型)	3,623,027円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	244,033,609円
三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型)	4,896,557円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,430,319円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	26,417,100円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	354,495,506円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,800,435,855円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	6,233,010,024円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	18,018,659,061円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	301,457,933円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,267,490,683円	SMAM・年金Wリス্কコントロールファンド<適格機関投資家限定>	142,628,061円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	17,716,923,693円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,365,633,107円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	351,415,849円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	654,311,594円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	578,749,942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>	1,624,886,083円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,668,525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>	1,846,803,949円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	252,488,538円		

■ お知らせ

<約款変更について>

委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(適用日：2019年4月1日)

外国株式インデックス・マザーファンド

第17期（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	投資信託 証券 組入比率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率				
13期 (2015年11月30日)	円	%		%	%	%	%	百万円
13期 (2015年11月30日)	29,051	2.5	299.80	2.6	93.7	3.9	2.3	174,039
14期 (2016年11月30日)	27,558	△ 5.1	284.85	△ 5.0	95.6	2.0	2.4	165,583
15期 (2017年11月30日)	33,807	22.7	350.45	23.0	95.2	2.5	2.3	196,182
16期 (2018年11月30日)	34,678	2.6	360.38	2.8	93.7	3.9	2.3	174,245
17期 (2019年12月2日)	38,813	11.9	404.43	12.2	95.2	2.1	2.7	232,418

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）は、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したもので、設定時を100として2019年12月2日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	投資信託 証券 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2018年11月30日	円	%		%	%	%	%
2018年11月30日	34,678	—	360.38	—	93.7	3.9	2.3
12月末	31,058	△10.4	322.64	△10.5	93.8	4.3	2.4
2019年1月末	33,076	△ 4.6	343.47	△ 4.7	94.9	2.7	2.4
2月末	35,061	1.1	364.78	1.2	96.3	1.3	2.4
3月末	35,307	1.8	367.43	2.0	94.8	2.7	2.4
4月末	36,886	6.4	384.07	6.6	96.5	1.0	2.4
5月末	34,561	△ 0.3	359.86	△ 0.1	95.6	1.9	2.5
6月末	35,808	3.3	372.93	3.5	96.5	1.1	2.5
7月末	36,786	6.1	383.06	6.3	96.2	1.2	2.5
8月末	34,963	0.8	364.33	1.1	94.4	3.0	2.6
9月末	36,096	4.1	376.07	4.4	94.7	2.6	2.7
10月末	37,532	8.2	390.60	8.4	94.2	3.1	2.6
11月末	38,931	12.3	405.57	12.5	95.2	2.2	2.6
(期末) 2019年12月2日	38,813	11.9	404.43	12.2	95.2	2.1	2.7

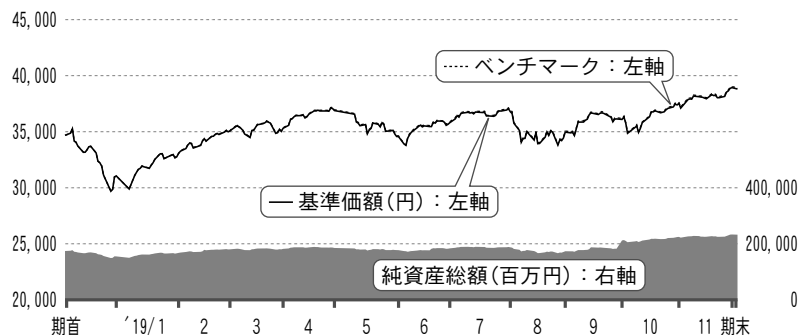
※騰落率は期首比です。

※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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

基準価額等の推移



期首	34,678円
期末	38,813円
騰落率	+11.9%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2018年12月1日から2019年12月2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

・米中貿易交渉の進展期待や先進国の緩和的な金融政策を背景に、株式市場が上昇したこと

下落要因

・米ドル、ユーロが対円で下落したこと

▶ 投資環境について（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

当期の世界の株式市場は上昇しました。為替市場では、米ドル、ユーロともに対円で下落しました。

株式市場

世界の株式市場は、期初から2018年12月下旬まで下落しました。米中貿易摩擦問題がくすぶる中、12月上旬に行われた米中首脳会談の後に二国間の問題解決への期待が後退したことが下押し材料になりました。また、中国景気の減速や関税率引上げの影響で、堅調だった米国の企業業績についても懸念が高まりました。また、フランスにおける反政府デモ、英国のEU（欧州連合）離脱問題など、EU域内の不安定な政治動向も嫌気されました。年明けから4月にかけては、株式市場の下落に呼応して米国や中国で政策対応への期待が高まったことや、FRB（米連邦準備制度理事会）が利上げを停止し、景気動向や市場動向に配慮する姿勢に転換したことを好感し、上昇しました。5月は、トランプ米大統領が対中輸入関税率の追加引上げを指示したことから再び米中貿易摩擦問題の深刻化に対する懸念が高まり、株価が下落しました。6月から7月後半にかけては、堅調な企業決算発表を受けて企業業績に対する悲観的な見方が後退したことなどから、株価が再度上昇に転じました。8月には米国が中国に対する新たな追加関税の導入を発表し、株価が下落しましたが、9月以降は米中貿易交渉の再開を受け、貿易摩擦問題の進展期待が高まり、あわせて欧米主要国の中銀による緩和的な金融政策を受け期末にかけて値を戻す展開となりました。

FRBは7月以降3回の利下げを実施しました。またECB（欧州中央銀行）は9月に再び金融緩和に舵を切りました。米中貿易交渉については、10月に第一段階の合意の大枠が発表され、その後の株価の下支えになりました。

当期のMSCIコクサイインデックス（配当込み、米ドルベース）は、期首に比べて16.1%上昇しました。

為替市場

米ドル・円相場は、期初から2019年1月初にかけて、株価の下落などを受け、急激な米ドル安・円高となりました。1月上旬から4月末にかけては、緩やかな米ドル高・円安基調での推移となりました。FRBが利上げを停止したことや、堅調な景気指標が発表されたことなどが要因

です。5月から8月にかけては、中国に対する関税の引上げや新たな追加関税の導入が発表されるなど再び米中の貿易摩擦への懸念が高まったことや、米国の金融緩和期待が高まったことなどを受け、安全資産とされる円が上昇しました。9月から期末にかけては、米中通商協議に対する期待などから円は米ドルに対し下落しました。

ユーロは、対円で下落しました。概ね米ドル・円相場と同様の動きとなりましたが、欧州域内の景気減速懸念の高まりや、英国のEUからの強硬離脱懸念といった域内情勢の不安定化など、通貨ユーロを取り巻く不安材料が払拭されず、戻りは限定的でした。

当期の米ドル・円は期首113円47銭から期末109円68銭へと3円79銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首129円19銭から期末120円86銭へと8円33銭のユーロ安・円高となりました。

▶ ポートフォリオについて (2018年12月1日から2019年12月2日まで)

株式組入比率

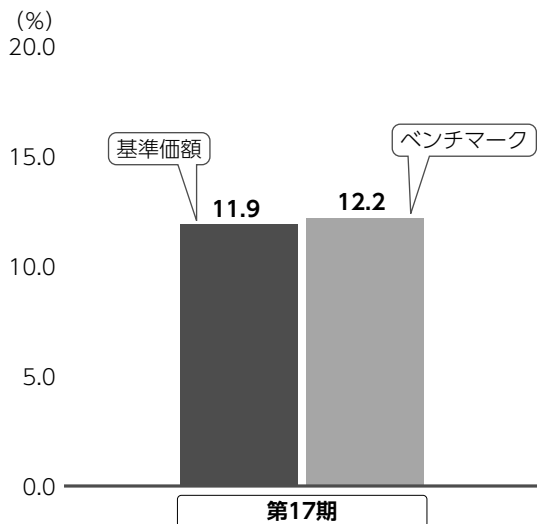
MSCICockサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

また2、5、8、11月末のMSCICock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 (2018年12月1日から2019年12月2日まで)

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は+11.9%となり、ベンチマークの騰落率+12.2%から0.3%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

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

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

■ 1万口当たりの費用明細（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	2円 (1) (0) (1)	0.006% (0.004) (0.000) (0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	5 (5) (0)	0.015 (0.015) (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)	16 (15) (1)	0.046 (0.042) (0.004)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	23	0.067	

期中の平均基準価額は35,441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 (2018年12月1日から2019年12月2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 45,643 (1,208)	千米ドル 377,391 (5,899)	百株 17,140 (1,164)	千米ドル 124,023 (11,300)
	カ ナ ダ	6,052 184)	千カナダドル 30,353 (433)	2,734 (-)	千カナダドル 9,391 (5)
	ユ ー ロ		千ユーロ		千ユーロ
	ド イ ツ	3,258 (34)	16,084 (△ 217)	1,303	5,596
	イ タ リ ア	7,416	3,212	3,812	1,203
	フ ラ ン ス	3,391 (41)	18,431 (△ 6)	940	4,920
	オ ラ ン ダ	3,705 (△ 12)	10,184 (-)	861 (-)	2,264 (84)
	ス ペ イ ン	7,730 (6,571)	5,668 (111)	2,379 (6,065)	1,870 (112)
	ベ ル ギ ー	277	2,082	77	482
	オ ー ス ト リ ア	157 (-)	581 (△ 18)	56	200
	ル ク セ ン ブ ル ク	931	1,072	278	405
	フ ィ ン ラ ン ド	1,169 (131)	1,926 (-)	323	578
	ア イ ル ラ ン ド	411	1,301	110	475
ポ ル ト ガ ル	820	441	403	252	
国	イ ギ リ ス	43,416 (92,311)	千英ポンド 27,325 (-)	98,313 (38)	千英ポンド 10,077 (410)
	ス イ ス	2,319 (189)	千スイスフラン 17,868 (△ 242)	548	千スイスフラン 5,409
	ス ウ ェ ー デ ン	3,471 (228)	千スウェーデンクローナ 48,476 (-)	1,133 (-)	千スウェーデンクローナ 12,677 (607)
	ノ ル ウ ェ ー	735 (54)	千ノルウェークローネ 10,987 (-)	277	千ノルウェークローネ 4,486
	デ ン マ ー ク	579 (9)	千デンマーククローネ 24,806 (-)	185	千デンマーククローネ 7,535
	オ ー ス ト ラ リ ア	9,157 (△ 7)	千オーストラリアドル 19,167 (△ 10)	3,256 (-)	千オーストラリアドル 6,611 (25)

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	ニュージーランド	1,830	千ニュージーランドドル 1,236	827	千ニュージーランドドル 517
	香 港	11,965 (454)	千香港ドル 53,075 (-)	7,037	千香港ドル 18,743
	シンガポール	5,676	千シンガポールドル 3,093	4,622	千シンガポールドル 829
	イスラエル	1,035	千イスラエルシェケル 2,253	1,090	千イスラエルシェケル 375

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

(2) 投資信託証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国	アメリカ		口 千米ドル	口	千米ドル
	AGNC INVESTMENT CORPORATION	7,956	141	-	-
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	1,401	204	-	-
	AMERICAN TOWER CORP	7,328	1,521	2,345	477
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	28,984	281	-	-
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,498	299	-	-
	BOSTON PROPERTIES INC	1,678	209	-	-
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	-	-	11,010	215
	CAMDEN PROPERTY TRUST	660	73	-	-
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,603	437	1,574	183
	DUKE REALTY CORP	9,969	317	3,461	114
	EQUINIX INC	4,426	1,855	-	-
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	6,163	757	1,831	231
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC-NEW	-	-	-	-
		(4,332)	(-)	-	-
	EQUITY RESIDENTIAL	3,961	311	-	-
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,247	376	628	177
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,058	124	-	-
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST HCP, INC.	1,003	136	-	-
		4,075	144	(24,237)	(724)
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC(NEW)	-	-	-	-
		(24,237)	(724)	-	-
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	5,501	92	-	-
	INVITATION HOMES INC	15,335	448	-	-
	IRON MOUNTAIN INC	4,230	134	-	-
	KIMCO REALTY CORPORATION	11,493	223	6,069	115
	LIBERTY PROPERTY TRUST	2,317	117	-	-
MACERICH COMPANY/THE	1,923	62	5,729	153	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29,675	615	-	-	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	1,021	133	-	-	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,833	103	-	-	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	12,872	541	-	-	

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		PROLOGIS INC	8,952	732	1,504	122
		PUBLIC STORAGE	1,449	341	—	—
		REALTY INCOME CORPORATION	4,333	321	—	—
		REGENCY CENTERS CORP	3,371	226	—	—
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,582	564	—	—
		SUN COMMUNITIES INC	6,358	833	1,760	237
		UDR INC	8,738	407	5,100	236
		VENTAS INC	9,317	618	3,678	249
		VEREIT INC	9,533	92	—	—
		VICI PROPERTIES INC	26,533	652	—	—
		VORNADO REALTY TRUST	1,103	70	—	—
		WP CAREY INC	4,757	414	2,811	240
		WELLTOWER INC	6,907	581	1,354	114
		WEYERHAEUSER CO	16,679	444	9,301	230
小	計	282,822 (28,569)	15,968 (724)	58,155 (24,237)	3,100 (724)	
カ ナ ダ		口	千カナダドル	口	千カナダドル	
	CAN APARTMENT PROP	4,697	257	—	—	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,566	152	—	—	
小	計	11,263	410	—	—	
ユ ー ロ	フ ラ ン ス	口	千ユーロ	口	千ユーロ	
		GECINA SA	951	137	—	—
		COVIVIO	838	71	—	—
	小	計	1,772	233	398	48
ユ ー ロ	計	3,561	441	398	48	
イ ギ リ ス	計	3,561	441	398	48	
イ ギ リ ス		口	千英ポンド	口	千英ポンド	
	BRITISH LAND CO PLC	10,190	60	—	—	
	HAMMERSON PLC	—	—	34,414	95	
	SEGRO PLC	20,438	165	—	—	
小	計	30,628	225	34,414	95	
オーストラリア		口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル	
	MIRVAC GROUP	137,742	430	52,367	170	
	TRANSURBAN GROUP	42,076	573	5,396	72	
	APA GROUP	42,240	471	23,467	247	
	GPT GROUP	49,328	298	21,745	127	
	DEXUS	30,104	362	5,770	78	
	GOODMAN GROUP	22,036	278	—	—	
SCENTRE GROUP	56,705	222	—	—		
小	計	380,231	2,637	108,745	695	
香 港		口	千香港ドル	口	千香港ドル	
	LINK REIT	20,000	1,715	—	—	
	HKT TRUST AND HKT LTD	34,000	426	—	—	
小	計	54,000	2,142	—	—	
シンガポール		口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル	
	CAPITALAND MALL TRUST	58,000	154	—	—	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,100	95	—	—	
	(—)	(△ 1)	(—)	(7)		
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	34,700	65	34,300	59	

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 国	SUNTEC REIT	112,400 (-)	210 (△ 1)	113,400	209
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	104,900	255	-	-
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT RIGHT	-	-	18,928	4
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT RIGHT-N	-	-	-	-
		(18,928)	(5)		
小	計	342,100 (18,928)	780 (3)	166,628 (-)	273 (7)

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建		
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	
外 国	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円	
		S P M I N I	39,655	41,330	-	-
		S P I 2 0 0	2,642	2,755	-	-
		F T S E	3,289	3,491	-	-
	D J E U R O	9,422	9,887	-	-	

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	79,649,627千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	179,517,456千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.44

※単位未満は切捨て。

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等 (2018年12月1日から2019年12月2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

(2018年12月1日から2019年12月2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 (2019年12月2日現在)

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC	321	378	2,073	227,367	保険
AGCO CORP	22	—	—	—	資本財
AES CORPORATION	271	336	636	69,804	公益事業
AT&T INC	3,017	3,819	14,278	1,566,056	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	728	919	7,861	862,210	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	630	768	6,739	739,150	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	18	22	448	49,230	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	296	410	2,252	247,099	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	18	18	246	27,024	資本財
ADOBE INC	204	253	7,832	859,085	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	33	40	637	69,896	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	394	552	2,163	237,267	半導体・半導体製造装置
AFFILIATED MANAGERS GROUP	22	—	—	—	各種金融
AGILENT TECHNOLOGIES INC	128	160	1,294	141,945	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	89	114	2,710	297,310	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	73	83	724	79,509	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORPORATION	46	63	412	45,291	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	90	113	1,295	142,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	31	38	1,068	117,233	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORPORATION	6	8	627	68,871	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	22	22	237	26,054	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	91	132	703	77,214	公益事業
ALLSTATE CORP	142	168	1,880	206,287	保険
ALLY FINANCIAL INC	177	201	641	70,329	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	39	56	657	72,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	130	163	21,296	2,335,849	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	123	156	20,394	2,236,886	メディア・娯楽
ALTICE USA INC-A	—	63	161	17,675	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	786	975	4,849	531,874	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	171	219	39,475	4,329,654	小売
AMERCO	3	3	141	15,494	運輸
AMEREN CORPORATION	103	124	925	101,531	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	56	56	163	17,891	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER	204	263	2,409	264,278	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	303	370	4,445	487,532	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	35	35	388	42,584	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	373	464	2,445	268,214	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	70	91	1,107	121,515	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	70	79	702	77,068	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	62	67	1,112	122,038	各種金融
AMETEK INC	96	121	1,206	132,376	資本財
AMGEN INC	273	314	7,383	809,806	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORPORATION -CL A	125	151	1,575	172,788	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	214	—	—	—	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	154	187	2,117	232,281	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	36	42	1,083	118,888	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	92	—	—	—	エネルギー
ANTHEM INC	106	135	3,904	428,267	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORPORATION	163	190	424	46,581	エネルギー
APPLE INC	2,041	2,354	62,929	6,902,062	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	418	474	2,748	301,437	半導体・半導体製造装置
AQUA AMERICA INC	—	126	560	61,437	公益事業
ARAMARK	107	132	577	63,381	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	226	284	1,219	133,742	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	
ARCONIC INC	190	190	588	64,599	資本財
ARISTA NETWORKS INC	22	27	530	58,213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	41	41	328	36,075	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	21	31	413	45,380	保険
ATMOS ENERGY CORP	46	64	688	75,503	公益事業
AUTODESK INC	91	111	2,019	221,506	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	40	40	326	35,861	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	183	229	3,912	429,093	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	10	12	1,470	161,234	小売
AVERY DENNISON CORP	39	48	633	69,478	素材
AVNET INC	45	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	—	228	564	61,921	各種金融
BB & T CORPORATION	317	388	2,125	233,093	銀行
BAKER HUGHES COMPANY	163	319	716	78,624	エネルギー
BALL CORPORATION	136	161	1,065	116,833	素材
BANK OF AMERICA CORP	4,002	4,621	15,398	1,688,951	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	419	436	2,139	234,703	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	211	245	2,014	220,949	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	111	141	3,645	399,880	ヘルスケア機器・サービス
BEIGENE LTD-ADR	—	19	401	44,080	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
W. R. BERKLEY CORPORATION	38	74	505	55,399	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	529	688	15,164	1,663,250	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	105	130	1,054	115,704	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	13	490	53,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	75	90	732	80,378	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	86	98	2,947	323,307	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	—	87	553	60,760	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	49	61	3,049	334,484	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	356	1,931	211,886	各種金融
H&R BLOCK INC	78	—	—	—	消費者サービス
BOEING CO	229	279	10,250	1,124,232	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	20	22	4,295	471,129	小売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	81	593	65,143	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	85	120	507	55,690	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	573	718	3,108	340,983	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	42	—	—	—	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	679	1,221	6,952	762,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	49	58	728	79,904	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	170	205	6,501	713,060	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	—	140	531	58,260	保険
BROWN-FORMAN CORPORATION	113	156	1,059	116,189	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	—	37	843	92,517	小売
CBS CORP-CL B	136	182	738	80,999	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	49	56	673	73,824	各種金融
CBRE GROUP INC-A	131	161	923	101,307	不動産
CDK GLOBAL INC	50	74	400	43,979	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	63	74	999	109,670	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	101	120	554	60,829	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE, INC.	60	69	532	58,370	運輸
CIGNA CORP	101	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CIGNA CORPORATION	—	199	3,990	437,689	ヘルスケア機器・サービス
CIT GROUP INC	47	—	—	—	銀行
CME GROUP INC.	139	186	3,788	415,491	各種金融
CMS ENERGY CORPORATION	114	150	921	101,106	公益事業
CSX CORPORATION	345	389	2,788	305,849	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	535	677	5,097	559,045	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORPORATION	196	196	312	34,322	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC	117	142	1,001	109,796	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	78	78	366	40,244	食品・飲料・タバコ

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	202	251	2,511	275,444	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	128	151	831	91,223	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	74	84	819	89,894	小売
CARNIVAL CORP	177	213	963	105,671	消費者サービス
CATERPILLAR INC	248	295	4,275	468,901	資本財
CELANESE CORPORATION	56	64	806	88,419	素材
CELGENE CORP	301	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	83	209	1,267	139,020	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	193	254	625	68,593	公益事業
CENTURYLINK INC	406	497	720	79,078	電気通信サービス
CERNER CORP	124	165	1,181	129,565	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	69	79	3,753	411,632	メディア・娯楽
CHEMOURS CO	80	—	—	—	素材
CHENIERE ENERGY INC	81	117	711	78,000	エネルギー
CHEVRON CORPORATION	791	984	11,534	1,265,051	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	11	14	1,143	125,425	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	99	124	876	96,183	家庭用品・パーソナル用品
CIMAREX ENERGY CO	40	—	—	—	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	63	78	841	92,262	保険
CISCO SYSTEMS INC	1,947	2,241	10,158	1,114,169	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	36	45	1,158	127,071	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	1,055	1,184	8,895	975,623	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	201	232	893	98,041	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	56	66	753	82,602	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	55	64	957	104,993	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO/THE	1,673	2,126	11,353	1,245,249	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	71	86	436	47,871	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATI	239	288	1,850	202,980	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	344	433	2,940	322,481	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CLASS A	1,899	2,374	10,483	1,149,879	メディア・娯楽
COMERICA INC	71	88	620	68,004	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	88	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONAGRA BRANDS INC	171	246	711	78,018	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	83	101	738	80,952	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	486	584	3,500	383,973	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	129	180	1,564	171,589	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	68	90	1,683	184,602	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	45	45	140	15,359	エネルギー
COOPER COMPANIES INC (THE)	20	25	785	86,158	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	85	104	930	102,066	商業・専門サービス
CORNING INC	335	397	1,155	126,744	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	—	381	991	108,763	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	182	228	6,840	750,262	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	15	18	1,135	124,555	商業・専門サービス
COTY INC-CL A	225	169	196	21,498	家庭用品・パーソナル用品
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	172	218	2,916	319,848	不動産
CROWN HOLDINGS INC	52	68	520	57,132	素材
CUMMINS INC	62	79	1,452	159,325	資本財
D. R. HORTON INC	156	190	1,055	115,794	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	73	92	1,160	127,304	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	118	158	590	64,789	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	261	335	4,899	537,412	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	53	67	796	87,322	消費者サービス
DAVITA INC	58	51	367	40,263	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	126	152	2,566	281,452	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	82	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-C	—	79	383	42,015	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	72	82	475	52,165	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	99	118	670	73,572	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	
DEVON ENERGY CORPORATION	220	210	460	50,548	エネルギー
DEXCOM INC	—	46	1,049	115,108	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	38	79	613	67,292	エネルギー
THE WALT DISNEY CO.	615	941	14,276	1,565,803	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	144	164	1,393	152,799	各種金融
DISCOVERY INC-A	70	70	233	25,560	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	127	182	557	61,201	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP.	97	122	419	45,996	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-RIGHTS	—	6	0.45152	49	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	—	54	384	42,183	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	108	130	2,061	226,078	小売
DOLLAR TREE INC	102	120	1,101	120,847	小売
DOMINION ENERGY INC	271	435	3,617	396,743	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	16	22	653	71,626	消費者サービス
DOVER CORP	66	79	886	97,193	資本財
DOW INC	—	379	2,026	222,267	素材
DOWDUPONT INC	962	—	—	—	素材
DROPBOX INC-CLASS A	—	105	195	21,425	ソフトウェア・サービス
DUKE ENERGY CORP	291	375	3,307	362,817	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	—	381	2,469	270,906	素材
EOG RESOURCES INC	240	310	2,201	241,485	エネルギー
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	109	124	549	60,283	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	62	88	404	44,350	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	59	70	550	60,401	素材
EATON VANCE CORP	55	55	260	28,610	各種金融
EBAY INC	392	419	1,491	163,558	小売
ECOLAB INC	105	138	2,579	282,909	素材
EDISON INTERNATIONAL	135	179	1,239	135,972	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	85	105	2,589	284,043	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	179	497	54,596	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	127	150	1,522	166,990	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO	261	328	2,426	266,157	資本財
ENTERGY CORP	71	107	1,245	136,630	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	—	30	653	71,658	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	47	61	855	93,839	商業・専門サービス
EQUINIX INC	32	—	—	—	不動産
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	12	218	23,916	保険
EVERGY INC	118	123	783	85,896	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	137	175	1,454	159,480	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	—	84	680	74,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	401	492	2,185	239,759	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	51	75	766	84,049	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	68	95	711	78,003	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	233	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORPORATION	1,755	2,208	15,044	1,650,114	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	52	68	367	40,339	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FMC CORPORATION	56	66	653	71,728	素材
FACEBOOK INC-A	994	1,252	25,249	2,769,416	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	19	503	55,219	各種金融
FASTENAL COMPANY	119	290	1,030	113,060	資本財
FEDEX CORP	105	129	2,071	227,222	運輸
F5 NETWORKS INC	26	35	510	55,999	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	137	320	4,420	484,888	ソフトウェア・サービス
FINF GROUP	108	139	663	72,807	保険
FIFTH THIRD BANCORP	284	372	1,124	123,307	銀行
FIRST DATA CORP-CLASS A	209	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	67	91	1,009	110,702	銀行
FISERV INC	166	306	3,558	390,304	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP	202	269	1,285	140,955	公益事業

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	38	43	1,341	147,140			ソフトウェア・サービス
FLUOR CORP	56	—	—	—			資本財
FLOWSERVE CORPORATION	48	66	323	35,520			資本財
FORD MOTOR COMPANY	1,545	1,987	1,800	197,454			自動車・自動車部品
FORTINET INC	59	73	773	84,849			ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	124	161	1,165	127,781			資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	64	64	408	44,752			資本財
FOX CORPORATION-CLASS A	—	197	706	77,537			メディア・娯楽
FOX CORPORATION-CLASS B	—	87	306	33,658			メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	134	178	489	53,723			各種金融
FREEMONT-MCMORAN INC	602	807	919	100,826			素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	75	93	876	96,099			保険
GAP INC/THE	92	92	153	16,793			小売
GARTNER INC	40	45	732	80,393			ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	104	131	2,383	261,464			資本財
GENERAL ELECTRIC CO	3,609	4,551	5,129	562,558			資本財
GENERAL MILLS INC	250	325	1,737	190,555			食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	527	662	2,386	261,721			自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	60	74	772	84,778			小売
GILEAD SCIENCES INC	540	662	4,457	488,910			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	66	159	2,890	317,073			ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	—	59	606	66,497			保険
GODADDY INC - CLASS A	66	89	591	64,833			ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	149	169	3,756	411,992			各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	103	—	—	—			自動車・自動車部品
WW GRAINGER INC	19	23	757	83,083			資本財
GRUBHUB INC	—	44	189	20,823			小売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	47	583	64,032			ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	116	138	1,925	211,181			ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	77	77	310	34,009			資本財
HP INC	682	763	1,533	168,217			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	364	443	930	102,025			エネルギー
HANESBRANDS INC	131	222	334	36,700			耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	73	73	267	29,315			自動車・自動車部品
HARRIS CORP	49	—	—	—			資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	152	183	1,133	124,372			保険
HASBRO INC	51	73	746	81,851			耐久消費財・アパレル
HEICO CORP	—	18	245	26,897			資本財
HEICO CORP-CLASS A	—	44	445	48,857			資本財
HELMERICH & PAYNE INC	40	—	—	—			エネルギー
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	32	39	594	65,242			ソフトウェア・サービス
THE HERSHEY COMPANY	56	75	1,113	122,103			食品・飲料・タバコ
HESS CORPORATION	110	145	900	98,786			エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	615	679	1,074	117,898			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	114	140	1,472	161,471			消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	73	94	485	53,249			エネルギー
HOLOGIC INC	121	135	697	76,506			ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	477	572	12,632	1,385,541			小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	310	377	6,746	739,976			資本財
HORMEL FOODS CORPORATION	124	149	665	72,962			食品・飲料・タバコ
HUMANA INC.	57	72	2,461	269,991			ヘルスケア機器・サービス
J. B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	35	44	509	55,936			運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	458	530	790	86,657			銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	18	21	530	58,159			資本財
IAC/INTERACTIVECORP	32	39	885	97,067			メディア・娯楽
IPG PHOTONICS CORP	17	17	252	27,677			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEX CORP	30	38	624	68,523			資本財
IDEXX LABORATORIES INC	36	43	1,097	120,334			ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	126	171	2,997	328,739			資本財

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株	数	株	数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ILLUMINA INC	61	74			2,390	262,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	75	92			870	95,456	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGREDION INC	33	33			276	30,285	食品・飲料・タバコ
INSULET CORP	—	34			647	71,001	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	1,929	2,313			13,430	1,473,057	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	240	285			2,692	295,314	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	381	460			6,186	678,485	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	39	48			687	75,452	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	171	191			886	97,280	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	155	196			439	48,217	メディア・娯楽
INTUIT INC	101	137			3,566	391,141	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	47	61			3,621	397,198	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	67			432	47,422	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQVIA HOLDINGS INC	68	85			1,240	136,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	1,414	1,669			21,991	2,412,060	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	49	69			637	69,965	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	128	128			269	29,536	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	1,112	1,378			18,949	2,078,342	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	20	26			435	47,760	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	150	174			437	47,990	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KLA CORPORATION	64	81			1,342	147,281	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC -A	—	248			732	80,292	各種金融
KANSAS CITY SOUTHERN	46	51			777	85,258	運輸
KELLOGG CO	112	129			843	92,486	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	456	511			991	108,733	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	75	95			1,021	112,014	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	145	183			2,505	274,835	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	808	1,091			2,140	234,749	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	51	83			307	33,775	運輸
KOHL'S CORP	69	82			388	42,661	小売
KRAFT HEINZ COMPANY	247	340			1,037	113,768	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	326	409			1,118	122,659	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	106	—			—	—	小売
LKQ CORPORATION	139	159			561	61,610	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	33	—			—	—	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	118			2,385	261,622	資本財
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	44	49			860	94,389	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	68	76			2,028	222,479	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	74			622	68,317	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	158	176			1,106	121,364	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	90	118			2,313	253,710	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	25	35			424	46,514	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	50	66			348	38,195	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	60	69			631	69,215	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	112	156			934	102,480	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	15	20			519	56,965	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	40	54			647	71,006	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	41	41			201	22,118	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	76	76			371	40,691	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	85	102			463	50,879	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	405	454			5,336	585,254	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	91	112			662	72,648	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	60	75			524	57,517	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	106	133			5,234	574,143	資本財
LOEWS CORPORATION	106	139			708	77,677	保険
LOWE'S COMPANIES INC	341	409			4,799	526,435	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	42	56			1,267	138,991	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	55	65			1,084	118,910	銀行
MGM MIRAGE	224	258			826	90,683	消費者サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
MSCI INC-A	38	42	1,112	122,069	各種金融
MACY'S INC	135	—	—	—	小売
MANPOWERGROUP	32	32	302	33,164	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	368	470	547	60,093	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	287	335	2,037	223,466	エネルギー
MARKEL CORP	5	7	797	87,432	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	19	772	84,684	各種金融
MARSH & MCLENNAN COS	210	259	2,802	307,339	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	124	143	2,014	220,944	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	25	33	907	99,530	素材
MASCO CORP	119	148	692	75,996	資本財
MASTERCARD INC-CL A	383	469	13,721	1,504,927	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	—	37	263	28,849	メディア・娯楽
MATTEL INC	140	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	116	138	782	85,861	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	50	62	1,050	115,259	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORPORATION	326	395	7,692	843,666	消費者サービス
MCKESSON CORP	83	96	1,393	152,803	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	111	115	245	26,899	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	18	22	1,306	143,339	小売
MERCK & CO. INC.	1,113	1,328	11,580	1,270,155	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	359	409	2,044	224,231	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	11	12	905	99,262	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	3,030	3,779	57,218	6,275,737	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	101	120	1,140	125,103	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	474	588	2,793	306,405	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	23	28	326	35,842	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	28	28	399	43,764	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING COMPANY	78	96	486	53,312	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	612	751	3,949	433,156	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	—	18	281	30,824	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	181	206	1,236	135,630	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	71	86	1,961	215,123	各種金融
MORGAN STANLEY	551	639	3,165	347,195	各種金融
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	135	135	78	8,661	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE	155	185	354	38,829	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	67	83	1,397	153,328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	—	135	538	59,032	公益事業
NVR INC	1	1	655	71,949	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC	53	65	688	75,472	各種金融
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	168	221	499	54,798	エネルギー
NEKTAR THERAPEUTICS	70	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	111	125	758	83,221	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	179	226	7,140	783,144	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	50	590	64,818	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	523	523	287	31,549	不動産
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	94	115	646	70,911	資本財
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	91	131	415	45,618	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	219	—	—	—	銀行
NEWELL BRANDS INC	184	184	355	38,950	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	82	—	—	—	エネルギー
NEWMONT GOLD CORP CORPORATION	212	415	1,595	175,042	素材
NEWS CORP-CLASS A	166	166	214	23,538	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	195	249	5,831	639,544	公益事業
NIKE INC -CL B	533	652	6,100	669,082	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	157	189	500	54,884	公益事業
NOBLE ENERGY INC	209	267	555	60,924	エネルギー
NORDSTROM INC	47	47	181	19,910	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	117	134	2,609	286,214	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	
NORTHERN TRUST CORP	85	104	104	123,337	1,124	123,337	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	68	85	85	3,005	329,645	329,645	資本財
NORTONLIFELOCK INC	—	313	313	780	85,609	85,609	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	132	154	154	871	95,536	95,536	素材
NVIDIA CORP	239	300	300	6,513	714,421	714,421	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	90	116	116	491	53,881	53,881	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	33	39	39	1,755	192,533	192,533	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	318	453	453	1,749	191,897	191,897	エネルギー
OKTA INC	—	52	52	683	75,014	75,014	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	26	32	32	629	69,008	69,008	運輸
OMNICOM GROUP	94	118	118	945	103,719	103,719	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP	174	209	209	448	49,244	49,244	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	170	209	209	1,487	163,102	163,102	エネルギー
ORACLE CORPORATION	1,265	1,226	1,226	6,885	755,147	755,147	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	48	65	65	437	47,940	47,940	資本財
P G & E CORPORATION	208	—	—	—	—	—	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	195	236	236	3,620	397,097	397,097	銀行
PPG INDUSTRIES INC	100	119	119	1,542	169,178	169,178	素材
PPL CORPORATION	290	365	365	1,245	136,595	136,595	公益事業
PVH CORP	33	33	33	320	35,125	35,125	耐久消費財・アパレル
PTC INC	—	54	54	418	45,888	45,888	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	141	175	175	1,429	156,779	156,779	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	40	53	53	597	65,526	65,526	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	39	48	48	1,105	121,292	121,292	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORPORATION	53	65	65	1,293	141,830	141,830	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	92	—	—	—	—	—	エネルギー
PAYCHEX INC	134	164	164	1,412	154,917	154,917	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	25	25	698	76,569	76,569	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	468	579	579	6,261	686,755	686,755	ソフトウェア・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	140	202	202	333	36,556	36,556	銀行
PEPSICO INC	586	725	725	9,850	1,080,450	1,080,450	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	—	56	56	522	57,304	57,304	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	2,423	2,871	2,871	11,060	1,213,087	1,213,087	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	645	807	807	6,697	734,601	734,601	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	184	230	230	2,640	289,661	289,661	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	51	59	59	523	57,471	57,471	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	—	109	109	213	23,391	23,391	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	70	85	85	1,091	119,743	119,743	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	78	—	—	—	—	—	エネルギー
POLARIS INC	24	24	24	241	26,435	26,435	耐久消費財・アパレル
T ROWE PRICE GROUP INC	100	119	119	1,481	162,502	162,502	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	119	141	141	778	85,356	85,356	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,041	1,307	1,307	15,963	1,750,822	1,750,822	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	237	296	296	2,163	237,255	237,255	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	171	205	205	1,927	211,392	211,392	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	209	256	256	1,520	166,719	166,719	公益事業
PULTE GROUP INC	129	130	130	518	56,817	56,817	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	48	60	60	629	69,058	69,058	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	579	632	632	5,286	579,855	579,855	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	59	68	68	726	79,631	79,631	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC	189	—	—	—	—	—	小売
RPM INTERNATIONAL INC	—	76	76	560	61,483	61,483	素材
RALPH LAUREN CORPORATION	20	33	33	355	39,027	39,027	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	54	64	64	577	63,305	63,305	各種金融
RAYTHEON COMPANY	119	147	147	3,214	352,524	352,524	資本財
RED HAT INC	73	—	—	—	—	—	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	33	40	40	1,511	165,813	165,813	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	473	558	558	929	101,976	101,976	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	29	30	30	500	54,842	54,842	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
REPUBLIC SERVICES INC	97	114	1,011	110,989	商業・専門サービス
RESMED INC	59	72	1,087	119,303	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	41	707	77,576	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC	46	70	410	45,053	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	50	60	1,175	128,921	資本財
ROKU INC	—	46	741	81,333	メディア・娯楽
ROLLINS INC	43	64	231	25,365	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	42	52	1,897	208,101	資本財
ROSS STORES INC	157	186	2,164	237,359	小売
S&P GLOBAL INC	103	128	3,412	374,271	各種金融
SBA COMMUNICATIONS CORP	47	57	1,358	148,950	不動産
SEI INVESTMENTS COMPANY	58	76	493	54,179	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	90	115	693	76,045	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	23	26	611	67,098	銀行
SABRE CORP	98	139	312	34,269	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM, INC.	292	431	7,028	770,854	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	44	504	55,286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCANA CORP	64	—	—	—	公益事業
HENRY SCHEIN INC	60	75	520	57,123	ヘルスケア機器・サービス
SCHLUMBERGER LTD	575	736	2,666	292,516	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	504	609	3,015	330,771	各種金融
SEALED AIR CORP	58	78	297	32,671	素材
SEATTLE GENETICS INC	42	57	689	75,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY	104	139	2,048	224,730	公益事業
SERVICENOW INC	73	99	2,824	309,755	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	34	44	2,582	283,268	素材
SIGNATURE BANK	25	25	309	33,933	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	682	817	570	62,598	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	79	87	860	94,413	半導体・半導体製造装置
SMITH(A. O.) CORP	59	71	346	37,993	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	49	57	606	66,483	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	24	32	516	56,687	資本財
SNAP INC-A	—	351	535	58,712	メディア・娯楽
SOUTHERN CO	420	544	3,376	370,344	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES	55	63	364	39,929	運輸
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	51	51	446	49,012	資本財
SPLUNK INC	62	76	1,136	124,614	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	367	367	217	23,855	電気通信サービス
SQUARE INC-A	123	170	1,178	129,265	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	67	76	1,212	132,940	資本財
STARBUCKS CORP	573	629	5,379	590,026	消費者サービス
STATE STREET CORP	148	189	1,421	155,859	各種金融
STEEL DYNAMICS, INC.	101	101	343	37,701	素材
STERICYCLE, INC.	42	—	—	—	商業・専門サービス
STRYKER CORP	139	175	3,600	394,915	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	193	225	1,594	174,857	銀行
SYMANTEC CORPORATION	272	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	61	76	1,072	117,581	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	306	314	1,176	129,076	各種金融
SYSCO CORP	201	261	2,106	231,089	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	117	140	727	79,745	各種金融
TJX COMPANIES INC	521	625	3,822	419,240	小売
T-MOBILE US INC	140	173	1,361	149,287	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	48	57	692	75,958	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	119	147	395	43,390	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	210	270	3,385	371,310	小売
TARGA RESOURCES CORP	86	117	430	47,229	エネルギー
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	20	707	77,644	資本財
TELEFLEX INC	19	23	826	90,685	ヘルスケア機器・サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
TERADYNE INC	—	98	616	67,564	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	54	71	2,366	259,575	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	387	569	593	65,107	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	406	486	5,853	642,052	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	106	118	545	59,860	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	167	207	6,522	715,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M COMPANY	246	300	5,093	558,704	資本財
TIFFANY & CO	46	55	741	81,315	小売
TOLL BROTHERS INC	70	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORPORATION	46	—	—	—	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	71	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	52	61	577	63,360	小売
TRANSNIGM GROUP INC	20	24	1,376	150,958	資本財
TRANSUNION	75	94	819	89,903	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC(THE)	112	132	1,815	199,154	保険
TRIMBLE INC	103	127	517	56,717	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC-W/I	40	40	115	12,618	メディア・娯楽
TWENTY-FIRST CE CL-A	437	—	—	—	メディア・娯楽
TWENTY-FIRST CE CL-B	175	—	—	—	メディア・娯楽
TWILIO INC-A	—	56	583	63,990	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	295	370	1,144	125,525	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	22	645	70,748	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	126	149	1,343	147,384	食品・飲料・タバコ
UGI CORPORATION	74	105	461	50,574	公益事業
US BANCORP	648	788	4,734	519,333	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	—	93	277	30,468	運輸
ULTA BEAUTY INC	23	30	715	78,513	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	86	86	163	17,888	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	82	82	143	15,731	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	322	367	6,469	709,620	運輸
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	28	28	267	29,313	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	286	363	4,355	477,702	運輸
UNITED RENTALS INC	36	42	647	71,057	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	341	425	6,313	692,464	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	18	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	398	491	13,747	1,507,825	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	37	42	586	64,302	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	97	97	300	32,936	保険
VF CORP	135	171	1,515	166,224	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	16	20	494	54,243	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	179	211	2,020	221,584	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	41	51	694	76,197	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	50	64	966	106,042	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	43	54	1,037	113,785	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,711	2,163	13,031	1,429,259	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	62	78	1,162	127,528	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	105	131	2,926	320,947	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC-CLASS B	146	202	488	53,525	メディア・娯楽
VISA INC	740	902	16,649	1,826,111	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	138	183	486	53,406	公益事業
VMWARE INC	30	41	652	71,584	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	75	73	425	46,713	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	54	66	950	104,222	素材
WABCO HOLDINGS INC	21	25	350	38,396	資本財
WEC ENERGY GROUP INC	131	159	1,417	155,521	公益事業
WABTEC CORP	34	92	725	79,548	資本財
WALMART INC	613	742	8,838	969,406	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	350	394	2,348	257,600	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	109	133	1,210	132,794	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	
WASTE MANAGEMENT INC	176	226	2,556	280,360	商業・専門サービス
WATERS CORP	34	35	782	85,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC-CLASS A	—	28	245	26,889	小売
WELLCARE HEALTH PLANS INC	—	25	821	90,113	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & COMPANY	1,923	2,190	11,927	1,308,226	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	42	626	68,697	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	129	148	747	82,013	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION COMPANY	190	218	587	64,388	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	14	14	101	11,110	素材
WESTROCK CO	113	130	525	57,654	素材
WHIRLPOOL CORP	26	32	459	50,413	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	502	614	1,396	153,116	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	60	88	1,593	174,730	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CL A	123	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WYNN RESORTS LTD	42	49	593	65,120	消費者サービス
XPO LOGISTICS INC	49	47	389	42,771	運輸
XCEL ENERGY INC	205	260	1,604	176,010	公益事業
XILINX INC	110	128	1,194	131,027	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	96	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XYLEM INC	79	91	707	77,565	資本財
XEROX HOLDINGS CORP	—	96	377	41,404	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUM! BRANDS INC	134	155	1,561	171,308	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	92	119	409	44,862	電気通信サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	27	686	75,330	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC-C	53	53	208	22,843	メディア・娯楽
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	82	103	1,508	165,477	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORPORATION	88	88	441	48,450	銀行
ZOETIS INC	201	253	3,057	335,396	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALKERMES PLC	64	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGION PLC	39	47	571	62,717	資本財
ALLERGAN PLC	140	174	3,219	353,168	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC	—	823	844	92,615	素材
AON PLC	101	121	2,483	272,360	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	178	204	859	94,256	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	60	81	369	40,484	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	39	—	—	—	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	107	125	358	39,313	素材
ACCENTURE PLC-CL A	267	331	6,661	730,667	ソフトウェア・サービス
BUNGE LIMITED	59	71	382	42,001	食品・飲料・タバコ
CAPRI HOLDINGS LTD	—	62	231	25,373	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	93	125	634	69,595	食品・飲料・タバコ
EATON CORP PLC	181	214	1,984	217,659	資本財
EVEREST RE GROUP LTD	16	20	560	61,437	保険
IHS MARKIT LTD	162	192	1,399	153,444	商業・専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC	103	122	1,603	175,840	資本財
INVESCO LIMITED	183	183	321	35,299	各種金融
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	26	26	393	43,160	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	395	403	1,728	189,585	資本財
LIBERTY GLOBAL PLC-A	84	84	190	20,854	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	235	210	453	49,706	メディア・娯楽
LINDE PLC	225	279	5,755	631,311	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	268	317	837	91,829	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	562	703	7,841	860,021	ヘルスケア機器・サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	62	—	—	—	耐久消費財・アパレル
APTIV PLC	105	130	1,227	134,619	自動車・自動車部品
NIELSEN HOLDINGS PLC	151	180	352	38,652	商業・専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	91	109	585	64,256	消費者サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	15	22	421	46,248	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	113	126	753	82,698	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PENTAIR PLC-REGISTERED	70	99	441	48,414	資本財
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	71	95	489	53,684	資本財
STERIS PLC	—	42	647	71,065	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC	181	215	406	44,600	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	54	65	1,287	141,187	保険
PERRIGO CO PLC	55	77	396	43,473	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHUBB LTD	191	239	3,624	397,514	保険
GARMIN LTD	49	67	658	72,205	耐久消費財・アパレル
TE CONNECTIVITY LTD	145	170	1,583	173,697	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	52	65	777	85,306	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	23	283	31,062	ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD	—	24	292	32,074	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	48	70	438	48,065	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	135	142	1,317	144,532	素材
MYLAN NV	225	261	490	53,838	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	142	149	1,732	190,063	半導体・半導体製造装置
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	67	90	1,084	118,948	消費者サービス
FLEX LTD	232	232	275	30,209	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数 595	株数 614	外貨建金額 1,396,454	邦貨換算金額 153,163,129	<65.9%>
(カナダ)			千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD	170	—	—	—	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	96	119	939	77,625	素材
AIR CANADA	—	57	287	23,723	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	302	563	46,596	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	183	462	2,009	166,010	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	97	173	341	28,234	公益事業
ATCO LTD-CLASS I	30	30	152	12,614	公益事業
AURORA CANNABIS INC	285	285	94	7,834	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	69	83	535	44,263	電気通信サービス
BANK OF MONTREAL	262	336	3,440	284,247	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	492	629	4,719	389,961	銀行
BARRICK GOLD CORP	502	932	2,068	170,918	素材
BAUSCH HEALTH COS INC	118	190	714	59,050	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKBERRY LIMITED	180	259	190	15,741	ソフトウェア・サービス
BOMBARDIER INC 'B'	758	758	149	12,345	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	343	464	3,567	294,749	各種金融
CAE INC	139	128	460	38,011	資本財
CCL INDUSTRIES INC-CL B	53	91	521	43,078	素材
CGI INC-CL A	—	124	1,369	113,110	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	110	110	230	19,083	各種金融
CAMECO CORP	163	163	198	16,379	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	191	225	2,603	215,082	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	302	372	4,489	370,919	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES	499	628	2,332	192,751	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	59	70	2,230	184,267	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	24	35	547	45,263	小売
CANADIAN UTILITIES LIMITED	39	73	286	23,700	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	83	112	275	22,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENOVUS ENERGY INC	414	540	634	52,395	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE	8	11	1,570	129,757	ソフトウェア・サービス
CRESCENT POINT ENERGY CORP	225	—	—	—	エネルギー
CRONOS GROUP INC	—	80	72	5,987	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	119	145	706	58,378	小売
EMERA INC	24	134	732	60,483	公益事業
EMPIRE CO LTD A	72	72	257	21,262	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	418	663	345	28,571	エネルギー
ENBRIDGE INC	701	1,042	5,243	433,228	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	11	13	835	69,054	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
FINNING INTERNATIONAL INC	61	—	—	—	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	65	65	141	11,671	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	316	316	384	31,793	素材
FORTIS INC	179	219	1,139	94,181	公益事業
FRANCO-NEVADA CORPORATION	80	94	1,240	102,486	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	90	90	353	29,212	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	333	—	—	—	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	142	142	474	39,243	保険
CGI GROUP INC - CL A	101	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	145	145	140	11,626	エネルギー
HYDRO ONE LTD	150	150	376	31,114	公益事業
IGM FINANCIAL INC	30	64	245	20,303	各種金融
IA FINANCIAL CORP INC	—	48	329	27,253	保険
IMPERIAL OIL LTD	129	129	432	35,720	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	48	—	—	—	保険
INTACT FINANCIAL CORPORATION	62	70	966	79,871	保険
INTER PIPELINE LTD	180	252	555	45,891	エネルギー
KEYERA CORP	84	113	368	30,456	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	570	635	364	30,114	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	113	632	52,219	素材
LINAMAR CORP	22	—	—	—	自動車・自動車部品
LOBLAW COMPANIES LTD	85	85	611	50,513	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	282	282	202	16,757	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	146	166	1,216	100,492	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	804	998	2,608	215,478	保険
METHANEX CORPORATION	24	24	121	10,013	素材
METRO INC	91	142	829	68,492	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	147	169	1,209	99,891	銀行
NUTRIEN LTD	262	300	1,883	155,625	素材
ONEX CORPORATION	42	42	333	27,559	各種金融
OPEN TEXT CORPORATION	116	136	790	65,290	ソフトウェア・サービス
PARKLAND FUEL CORP	—	76	361	29,907	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	217	274	1,271	105,036	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	145	145	470	38,876	保険
POWER FINANCIAL CORP	110	162	526	43,475	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	90	90	123	10,230	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	—	99	327	27,087	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	91	130	1,137	93,985	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	145	183	1,180	97,521	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	595	753	8,197	677,248	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	82	—	—	—	資本財
SAPUTO INC	98	134	539	44,533	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	85	—	—	—	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	193	265	728	60,172	メディア・娯楽
SHOPIFY INC-CLASS A	38	51	2,306	190,529	ソフトウェア・サービス
STARS GROUP INC/THE	—	145	463	38,329	消費者サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	258	300	1,823	150,673	保険
SUNCOR ENERGY INC	678	814	3,375	278,901	エネルギー
TC ENERGY CORP	—	481	3,233	267,143	エネルギー
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	198	248	516	42,642	素材
TELUS CORPORATION	76	76	381	31,535	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	—	110	1,021	84,426	商業・専門サービス
THOMSON REUTERS CORP-NEW	78	—	—	—	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	761	950	7,278	601,362	銀行
TOURMALINE OIL CORP	128	—	—	—	エネルギー
TRANSCANADA CORP	363	—	—	—	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	451	—	—	—	素材
VERMILION ENERGY INC	55	—	—	—	エネルギー
WSP GLOBAL INC	45	63	548	45,281	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	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	28	28	165	13,712	素材
WESTON (GEORGE) LTD	31	42	462	38,213	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	195	246	901	74,470	素材
小計	17,304	20,806	101,017	8,346,043	
	株数	株数	評価額	評価額	
(ユーロ・・・ドイツ)	89	86	—	< 3.6% >	
ADIDAS AG	76	94	千ユーロ	323,380	耐久消費財・アパレル
FRESENIUS SE & CO KGAA	168	211	1,050	126,961	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	59	68	210	25,498	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE-PREF	33	33	132	15,966	素材
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	23	30	515	62,275	保険
GEA GROUP AG	81	81	238	28,831	資本財
CONTINENTAL AG	46	55	661	79,955	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	413	519	1,756	212,343	運輸
AXEL SPRINGER SE	16	—	—	—	メディア・娯楽
MERCK KGAA	57	65	694	83,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	228	296	796	96,298	公益事業
SAP SE	405	509	6,295	760,934	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	883	1,158	1,100	133,018	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	46	57	504	60,931	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	2	38	261	31,569	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	384	480	3,303	399,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA	71	90	867	104,790	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	380	481	3,285	397,082	素材
BEIERSDORF AG	40	56	592	71,640	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	8	8	91	11,117	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	65	83	560	67,716	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	91	109	727	87,909	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	181	220	4,795	579,544	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	92	92	159	19,271	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	60	76	2,004	242,299	保険
VOLKSWAGEN AG	12	19	343	41,518	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	75	94	1,651	199,572	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	372	484	2,478	299,544	自動車・自動車部品
THYSSENKRUPP AG	193	193	220	26,637	素材
SIEMENS AG-REG	315	402	4,719	570,423	資本財
1&1 DRILLISCH AG	21	—	—	—	電気通信サービス
DEUTSCHE BANK AG -REG	789	995	651	78,742	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	140	167	1,230	148,734	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE (BMW) AG-PFD	25	25	140	16,974	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,366	1,734	2,643	319,470	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	13	18	345	41,709	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	484	655	1,271	153,629	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	22	251	30,439	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	82	96	1,341	162,137	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	66	77	521	63,046	自動車・自動車部品
FRAPORT AG	18	18	143	17,344	運輸
WIRECARD AG	48	59	713	86,179	ソフトウェア・サービス
LANXESS	31	44	266	32,238	素材
MTU AERO ENGINES AG	20	28	702	84,878	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	142	181	643	77,737	不動産
SYMRISE AG	49	65	574	69,418	素材
BRENNTAG AG	66	91	444	53,663	資本財
K+S AG	96	—	—	—	素材
EVONIK INDUSTRIES AG	64	118	311	37,679	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	403	403	111	13,528	電気通信サービス
HUGO BOSS AG	22	—	—	—	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	466	466	245	29,658	銀行
OSRAM LICHT AG	45	—	—	—	資本財

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
KION GROUP AG	31	31	191	23,137	資本財
VONOVIA SE	200	275	1,303	157,546	不動産
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	108	—	—	—	メディア・娯楽
KNORR-BREMSE AG	—	21	188	22,811	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	65	87	383	46,344	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG	83	83	122	14,748	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE	58	—	—	—	公益事業
AXEL SPRINGER SE-TEND	—	23	146	17,698	メディア・娯楽
ZALANDO SE	53	82	323	39,147	小売
COVESTRO AG	80	80	342	41,364	素材
SCHAEFFLER AG	95	—	—	—	自動車・自動車部品
UNIPER SE	89	123	362	43,762	公益事業
DELIVERY HERO SE	34	53	256	30,944	小売
小計	10,261	12,251	58,869	7,114,915	
	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	63	58	—	<3.1%>	
(ユーロ・・・イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	469	586	1,086	131,312	保険
INTESA SANPAOLO	6,179	7,792	1,792	216,664	銀行
MEDIOBANCA SPA	267	267	271	32,854	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	72	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ENEL SPA	3,320	4,202	2,880	348,196	公益事業
ENI SPA	1,057	1,304	1,789	216,265	エネルギー
SNAM SPA	999	896	404	48,873	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	4,940	4,919	279	33,785	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	2,513	2,513	140	16,983	電気通信サービス
ATLANTIA SPA	198	265	533	64,442	運輸
TERNA SPA	663	804	469	56,708	公益事業
RECORDATI SPA	45	45	174	21,064	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEONARDO SPA	183	183	194	23,490	資本財
PRYSMIAN SPA	93	119	246	29,822	資本財
MONCLER SPA	77	77	306	37,063	耐久消費財・アパレル
FINECOBANK SPA	—	320	360	43,594	銀行
UNICREDIT SPA	812	1,068	1,342	162,277	銀行
POSTE ITALIANE SPA	265	265	281	33,996	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	229	361	299	36,195	食品・飲料・タバコ
PIRELLI & C SPA	174	174	90	10,882	自動車・自動車部品
小計	22,565	26,169	12,944	1,564,475	
	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	19	19	—	<0.7%>	
(ユーロ・・・フランス)					
BOUYGUES SA	83	110	409	49,515	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	215	290	675	81,682	公益事業
L'OREAL	103	129	3,351	405,119	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	114	146	5,951	719,245	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA	0.89	1	212	25,673	資本財
THALES SA	45	54	480	58,065	資本財
CAPGEMINI SA	65	80	865	104,560	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	18	18	73	8,848	食品・生活必需品小売り
INGENICO S.A.	26	26	260	31,502	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PUBLICIS GROUPE	91	107	428	51,824	メディア・娯楽
FAURECIA	31	31	150	18,193	自動車・自動車部品
BOLLORE	394	394	153	18,491	運輸
MICHELIN (CGDE)-B	68	87	952	115,111	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD SA	86	110	1,848	223,454	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	76	88	383	46,374	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	12	12	148	17,985	食品・飲料・タバコ
SEB SA	10	10	145	17,586	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE	233	285	2,502	302,427	資本財
VIVENDI SA	454	475	1,184	143,161	メディア・娯楽
ORANGE S.A.	829	1,048	1,572	190,107	電気通信サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
HERMES INTERNATIONAL	13	16	1,149	138,892	耐久消費財・アパレル
BIC	13	—	—	—	商業・専門サービス
DASSAULT SYSTEMES SA	55	66	953	115,208	ソフトウェア・サービス
KERING	30	39	2,179	263,437	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	89	89	160	19,444	保険
CARREFOUR SA	263	351	526	63,598	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	36	45	350	42,359	ソフトウェア・サービス
SANOFI	464	593	5,013	605,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA	75	106	414	50,121	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	311	410	1,171	141,608	銀行
TELEPERFORMANCE	24	29	638	77,175	商業・専門サービス
EURAZEO	21	17	110	13,395	各種金融
SODEXO	39	39	412	49,869	消費者サービス
AXA SA	794	1,028	2,538	306,829	保険
PSA PEUGEOT CITROEN	261	321	704	85,165	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA	28	28	73	8,886	メディア・娯楽
ESSILORLUXOTTICA	88	147	2,083	251,869	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA	495	581	721	87,237	銀行
BNP PARIBAS	461	577	2,942	355,673	銀行
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	212	255	940	113,629	資本財
WENDEL	10	10	132	15,993	各種金融
ILIAD SA	10	10	117	14,188	電気通信サービス
IMERYS SA	13	—	—	—	素材
SAFRAN SA	136	171	2,552	308,524	資本財
ENGIE	736	962	1,381	167,017	公益事業
ALSTOM RGPT	64	96	382	46,248	資本財
EUTELSAT COMMUNICATIONS	87	87	129	15,703	メディア・娯楽
ELECTRICITE DE FRANCE (EDF)	238	286	267	32,272	公益事業
IPSEN	14	14	153	18,557	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARKEMA	32	32	305	36,946	素材
LEGRAND SA	106	143	1,028	124,317	資本財
EIFFAGE SA	35	46	459	55,586	資本財
TOTAL SA	989	1,260	6,005	725,847	エネルギー
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	13	13	238	28,875	運輸
NATIXIS	453	453	172	20,794	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	35	52	287	34,728	メディア・娯楽
SCOR SE	71	95	373	45,148	保険
REXEL SA	128	—	—	—	資本財
VINCI S. A.	209	264	2,614	315,995	資本財
DANONE	251	319	2,389	288,764	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE SA	175	244	3,003	362,976	素材
BUREAU VERITAS SA	126	172	409	49,492	商業・専門サービス
GETLINK	169	223	341	41,283	運輸
SUEZ	177	145	195	23,602	公益事業
EDENRED	94	121	546	66,093	商業・専門サービス
VALEO SA	99	140	502	60,714	自動車・自動車部品
BIOMERIEUX	17	17	145	17,641	ヘルスケア機器・サービス
WORLDLINE SA	—	62	365	44,222	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	—	15	224	27,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	23	39	271	32,838	各種金融
小 計	株 数	金 額	株 数	金 額	
	11,269	13,762	69,838	8,440,680	
	銘柄数	<比率>	—	<3.6%>	
(ユーロ・・・オランダ)					
AIRBUS SE	239	300	4,005	484,084	資本財
RANDSTAD NV	46	46	248	29,988	商業・専門サービス
AKZO NOBEL	108	—	—	—	素材
WOLTERS KLUWER-CVA	128	149	972	117,530	商業・専門サービス
VOPAK	31	31	151	18,305	エネルギー
AEGON NV	745	916	374	45,306	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
KONINKLIJKE KPN NV	1,415	1,996	558	67,450	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	280	376	839	101,411	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV	390	469	1,979	239,223	ヘルスケア機器・サービス
HEINEKEN NV	104	131	1,235	149,379	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	52	65	567	68,556	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	73	92	1,069	129,315	素材
UNILEVER NV-CVA	635	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
UNILEVER NV	—	763	4,109	496,682	家庭用品・パーソナル用品
ASML HOLDING NV	168	218	5,407	653,499	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	504	600	1,403	169,643	食品・生活必需品小売り
FERRARI NV	48	65	1,009	121,974	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV	431	570	554	67,055	資本財
AKZO NOBEL	—	122	1,060	128,162	素材
PROSUS NV	—	254	1,576	190,574	小売
NN GROUP NV	129	159	554	67,043	保険
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	431	594	798	96,490	自動車・自動車部品
ABN AMRO BANK NV-CVA	189	189	293	35,413	銀行
EXOR NV	46	63	442	53,460	各種金融
ALTICE NV -A W/I	—	376	203	24,564	メディア・娯楽
QIAGEN N.V.	100	138	536	64,827	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADYEN NV	—	6	433	52,336	ソフトウェア・サービス
ING GROEP NV-CVA	1,592	2,031	2,121	256,401	銀行
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	7,897	10,729	32,506	3,928,681	
	株 数	株 数	金 額	金 額	
	23	26	—	<1.7%>	
(ユーロ・・・スペイン)					
ENDESA S.A.	129	183	452	54,693	公益事業
BANKINTER, S.A.	269	364	231	27,930	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA	2,770	3,430	1,640	198,218	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	161	154	364	44,036	公益事業
REPSOL SA	565	736	1,052	127,255	エネルギー
BANCO SANTANDER SA	6,728	8,522	3,014	364,321	銀行
TELEFONICA S.A.	1,912	2,406	1,672	202,189	電気通信サービス
ENAGAS	104	104	236	28,613	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	114	114	166	20,101	資本財
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	115	145	514	62,235	資本財
FERROVIAL SA	187	231	622	75,286	資本財
MAPPFRE SA	463	463	118	14,340	保険
BANCO DE SABADELL SA	2,350	3,280	330	39,922	銀行
CAIXABANK	1,491	1,819	487	58,922	銀行
IBERDROLA SA	2,448	3,198	2,855	345,141	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA	182	222	1,608	194,433	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROU	232	—	—	—	運輸
FERROVIAL SA-RIGHTS	187	—	—	—	資本財
RED ELECTRICA CORPORATION SA	183	207	367	44,422	公益事業
FERROVIAL SA-RIGHTS	—	231	9	1,174	資本財
INDITEX	450	556	1,573	190,223	小売
AENA SME SA	28	37	623	75,371	運輸
CELLNEX TELECOM SA	—	137	535	64,679	電気通信サービス
GRIFOLS S.A.	119	170	529	63,983	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANKIA SA	483	820	144	17,432	銀行
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	21,683	27,539	19,153	2,314,925	
	株 数	株 数	金 額	金 額	
	23	23	—	<1.0%>	
(ユーロ・・・ベルギー)					
KBC GROUPE SA	108	129	856	103,486	銀行
SOLVAY SA	28	37	390	47,235	素材
UCB SA	52	72	530	64,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT NV	31	24	116	14,041	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	33	47	435	52,628	各種金融
PROXIMUS SA	63	63	172	20,890	電気通信サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
GALAPAGOS NV	—	23	414	50,105	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELENET GROUP HOLDINGS NV	21	21	89	10,796	メディア・娯楽
AGEAS	72	87	477	57,712	保険
UMICORE	87	113	442	53,471	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	313	392	2,818	340,690	食品・飲料・タバコ
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 金額	金額 金額	
	812 10	1,012 11	6,744 —	815,151 < 0.4% >	
(ユーロ・・・オーストリア)					
OMV AG	63	77	402	48,656	エネルギー
VERBUND AG	—	36	174	21,052	公益事業
VOESTALPINE AG	50	50	122	14,763	素材
ERSTE GROUP BANK AG	120	169	551	66,669	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	66	55	117	14,178	銀行
ANDRITZ AG	25	37	131	15,950	資本財
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 金額	金額 金額	
	326 5	427 6	1,499 —	181,269 < 0.1% >	
(ユーロ・・・ルクセンブルク)					
EUROFINS SCIENTIFIC	4	7	334	40,378	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS S.A.	184	259	250	30,286	エネルギー
SES	138	176	213	25,748	メディア・娯楽
RTL GROUP	16	—	—	—	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA	—	458	361	43,708	不動産
ARCELORMITTAL	265	359	558	67,541	素材
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 金額	金額 金額	
	609 5	1,262 5	1,718 —	207,663 < 0.1% >	
(ユーロ・・・フィンランド)					
WARTSILA OYJ-B SHARES	189	189	172	20,872	資本財
UPM-KYMMENE OYJ	213	290	882	106,606	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	247	247	301	36,433	素材
SAMPO OYJ-A SHS	177	236	867	104,901	保険
FORTUM OYJ	170	244	522	63,192	公益事業
ELISA OYJ	59	83	404	48,855	電気通信サービス
METSO OYJ	39	58	204	24,730	資本財
NOKIA OYJ	2,340	2,857	917	110,924	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	56	227	698	84,386	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	55	55	135	16,346	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	146	182	1,037	125,396	資本財
ORION OYJ	42	42	168	20,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 金額	金額 金額	
	3,737 12	4,715 12	6,312 —	762,978 < 0.3% >	
(ユーロ・・・アイルランド)					
CRH PLC	349	406	1,412	170,773	素材
KERRY GROUP PLC-A	68	83	972	117,496	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC	—	76	373	45,123	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	101	114	368	44,524	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC	376	521	237	28,745	銀行
AIB GROUP PLC	369	369	109	13,251	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	34	45	477	57,769	消費者サービス
RYANAIR HOLDINGS PLC	16	—	—	—	運輸
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 金額	金額 金額	
	1,316 7	1,617 7	3,952 —	477,686 < 0.2% >	
(ユーロ・・・ポルトガル)					
BANCO ESPERITO SANTO, S.A(BES)	1,879	1,879	1	227	銀行
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	979	1,363	500	60,475	公益事業
GALP ENERGIA SGPS S.A	209	241	356	43,133	エネルギー

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
JERONIMO MARTINS SGPS S. A.	122	123	179	21,682	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 3,190	株 数 3,607	1,038	125,519	
	株 銘 柄 数 <比 率> 4	株 銘 柄 数 <比 率> 4	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	株 銘 柄 数 <比 率> 83,670	株 銘 柄 数 <比 率> 103,095	214,578	25,933,947	
	株 銘 柄 数 <比 率> 239	株 銘 柄 数 <比 率> 238	—	<1.2%>	
(イギリス)			千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC	194	194	168	23,890	素材
ASHTAD GROUP PLC	192	236	556	78,811	資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	397	587	391	55,453	耐久消費財・アパレル
AVIVA PLC	1,608	1,986	801	113,548	保険
DIAGEO PLC	1,022	1,219	3,858	546,282	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	62	62	204	29,021	各種金融
DCC PLC	37	47	312	44,292	資本財
BAE SYSTEMS PLC	1,285	1,706	978	138,512	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	946	1,178	3,607	510,802	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC	—	211	445	63,114	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC	1,224	1,415	987	139,800	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	389	496	845	119,755	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	8,294	10,485	6,042	855,569	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,492	3,022	849	120,217	保険
MEGGITT PLC	369	369	237	33,649	資本財
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	1,008	1,462	289	41,058	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	167	167	430	61,003	食品・飲料・タバコ
PEARSON PLC	296	396	256	36,275	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	139	169	432	61,267	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	1,062	1,330	1,831	259,339	保険
RIO TINTO PLC	487	586	2,465	349,087	素材
ST JAMES'S PLACE PLC	218	319	347	49,266	各種金融
TRAVIS PERKINS PLC	92	—	—	—	資本財
SSE PLC	445	548	713	100,964	公益事業
BP PLC	8,272	10,558	5,070	717,887	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	29,961	36,841	2,252	318,982	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	1,296	1,476	257	36,440	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	4,269	5,160	1,183	167,629	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	354	443	767	108,710	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,045	2,589	4,542	643,106	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	92	167	233	33,017	資本財
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	114	—	—	—	商業・専門サービス
ASTRAZENECA PLC	522	681	5,080	719,406	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	3,652	4,542	870	123,205	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	80	80	263	37,266	消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	713	1,247	242	34,328	小売
BARCLAYS PLC	6,968	9,260	1,588	224,932	銀行
INTERTEK GROUP PLC	67	81	451	63,917	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	174	230	485	68,714	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	54	76	518	73,381	小売
KINGFISHER PLC	799	1,096	230	32,596	小売
ITV PLC	1,510	2,150	312	44,183	メディア・娯楽
SAINSBURY (J) PLC	641	1,128	241	34,230	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	38	—	—	—	素材
G4S PLC	742	742	155	21,994	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	78	121	259	36,690	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	53	53	244	34,648	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	2,549	2,549	204	28,954	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,901	2,237	4,946	700,395	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,547	1,944	4,257	602,835	エネルギー
BUNZL PLC	134	170	362	51,293	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	—	905	402	57,041	商業・専門サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	129	159	1,096	155,223	各種金融

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
UNILEVER PLC	501	588	2,693	381,316	家庭用品・パーソナル用品	
TUI AG-DI	176	176	187	26,556	消費者サービス	
INVESTEC PLC	330	—	—	—	各種金融	
EXPERIAN PLC	381	479	1,229	174,146	商業・専門サービス	
MONDI PLC	140	251	421	59,612	素材	
SEVERN TRENT PLC	98	144	324	45,942	公益事業	
WHITBREAD PLC	77	68	312	44,305	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	110	144	267	37,902	各種金融	
SMITHS GROUP PLC	187	235	390	55,338	資本財	
ANGLO AMERICAN PLC	447	559	1,133	160,547	素材	
3I GROUP PLC	377	493	528	74,817	各種金融	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	274	366	2,221	314,523	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	806	1,029	1,928	273,111	商業・専門サービス	
SHIRE PLC	386	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FRESNILLO PLC	85	—	—	—	素材	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	250	332	283	40,124	公益事業	
OCADO GROUP PLC	—	221	293	41,605	小売	
GLENCORE PLC	4,722	5,567	1,357	192,250	素材	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	326	—	—	—	エネルギー	
GVC HOLDINGS PLC	238	238	203	28,748	消費者サービス	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	716	869	618	87,573	資本財	
EVRAZ PLC	—	282	104	14,828	素材	
NMC HEALTH PLC	37	68	171	24,274	ヘルスケア機器・サービス	
EASYJET PLC	76	76	102	14,454	運輸	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,091	2,452	554	78,545	銀行	
SAGE GROUP PLC/THE	409	620	467	66,213	ソフトウェア・サービス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	198	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
WPP PLC	545	639	640	90,644	メディア・娯楽	
COCA-COLA HBC AG-CDI	87	87	224	31,783	食品・飲料・タバコ	
AVEVA GROUP PLC	—	35	160	22,762	ソフトウェア・サービス	
CONVATEC GROUP PLC	612	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
COMPASS GROUP PLC	652	826	1,566	221,817	消費者サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	76	—	—	—	消費者サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	182	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
NATIONAL GRID PLC	1,366	1,783	1,586	224,702	公益事業	
ROYAL MAIL PLC	360	—	—	—	運輸	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	325	—	—	—	消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,024	1,232	390	55,307	各種金融	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	32,972	—	—	—	資本財	
FERGUSON PLC	99	—	—	—	資本財	
BHP GROUP PLC	899	1,070	1,831	259,302	素材	
VODAFONE GROUP PLC	10,933	13,673	2,097	296,920	電気通信サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	—	97	485	68,795	消費者サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	—	151	171	24,237	ソフトウェア・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	—	74	372	52,756	素材	
FERGUSON PLC	—	122	822	116,467	資本財	
M&G PLC	—	1,330	314	44,463	各種金融	
RSA INSURANCE GROUP PLC	405	522	288	40,828	保険	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENTITLEMENT	—	39,981	3	566	資本財	
INFORMA PLC	546	690	546	77,428	メディア・娯楽	
AUTO TRADER GROUP PLC	420	420	236	33,463	メディア・娯楽	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	36	328	46,567	資本財	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	632	632	193	27,367	保険	
JD SPORTS FASHION PLC	—	288	219	31,080	小売	
CRODA INTERNATIONAL PLC	62	—	—	—	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,125	2,463	565	80,085	資本財	
JOHNSON MATTHEY PLC	72	100	289	40,994	素材	
小 計	株 数 銘柄 数	金 額 比 率	159,056 97	196,431 94	92,711 —	13,127,085 < 5.6% >

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	
(スイス)			千スイスフラン		
SGS SA	2	2	666	72,999	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	377	41,411	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM AG-REG	10	14	740	81,171	電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG	0.45	0.49	373	40,945	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	0.04	0.05	426	46,740	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	3	4	1,387	152,024	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	64	77	3,047	333,963	保険
NOVARTIS AG-REG SHS	900	1,124	10,347	1,133,997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	751	964	2,108	231,119	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	290	363	11,197	1,227,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	70	70	433	47,552	商業・専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD	206	257	1,329	145,742	素材
CLARIANT AG-REG	101	101	208	22,869	素材
NESTLE SA-REGISTERED	1,290	1,551	16,125	1,767,145	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG	19	24	430	47,140	保険
TEMENOS GROUP AG-REG	24	36	553	60,680	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG	26	26	603	66,126	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4	5	576	63,149	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,039	1,296	1,698	186,140	各種金融
THE SWATCH GROUP AG-B	13	13	372	40,811	耐久消費財・アパレル
THE SWATCH GROUP AG-REG	25	25	134	14,696	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	31	37	1,282	140,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG	14	17	860	94,270	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3	5	325	35,700	素材
SWISS PRIME SITE-REG	32	39	412	45,202	不動産
PARGESA HOLDING SA-BR	18	18	147	16,143	各種金融
DUFREY AG-REG	11	22	220	24,189	小売
PARTNERS GROUP HOLDING AG	6	9	820	89,911	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	17	23	578	63,438	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	7	12	310	34,051	資本財
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	23	23	384	42,089	運輸
GEBERIT AG-REG	15	19	1,073	117,596	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD	95	126	596	65,350	各種金融
SWISS RE AG	132	154	1,673	183,405	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	212	272	2,076	227,522	耐久消費財・アパレル
SIKA AG	52	64	1,126	123,409	素材
ALCON INC	—	210	1,162	127,440	ヘルスケア機器・サービス
UBS GROUP AG	1,584	2,037	2,469	270,616	各種金融
VIFOR PHARMA AG	17	26	470	51,546	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数	株数	評価額	評価額	
	7,124	9,085	69,129	7,575,947	
	銘柄数	銘柄数	—	< 3.3% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS	31	31	1,189	13,633	各種金融
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	647	887	7,292	83,567	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	390	459	5,726	65,623	銀行
SWEDISH MATCH AB	75	101	4,655	53,350	食品・飲料・タバコ
SECURITAS AB-B SHS	122	199	3,163	36,249	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	198	242	12,297	140,930	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	362	437	8,081	92,614	小売
ERICSSON LM-B SHS	1,265	1,594	13,756	157,647	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELI A CO AB	1,269	1,269	5,262	60,309	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	157	157	3,324	38,098	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	68	113	3,359	38,498	エネルギー
ALFA LAVAL AB	120	139	3,284	37,634	資本財
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	26	26	1,154	13,226	電気通信サービス
ICA GRUPPEN AB	35	35	1,483	17,005	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	185	185	1,390	15,933	耐久消費財・アパレル
ELECTROLUX AB-SER B	110	91	2,255	25,848	耐久消費財・アパレル

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SKF AB-B SHARES	166	206	3,769	43,192	資本財
VOLVO AB-B SHS	645	795	11,772	134,909	資本財
SANDVIK AB	450	609	10,622	121,739	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	62	62	1,391	15,948	各種金融
HEXAGON AB-B SHS	110	132	7,148	81,917	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS	131	291	4,120	47,217	電気通信サービス
KINNEVIK AB-B SHS	112	—	—	—	各種金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	267	359	12,600	144,401	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	161	197	6,126	70,204	資本財
BOLIDEN AB	102	—	—	—	素材
EPIROC AB-A	302	302	3,381	38,755	資本財
EPIROC AB-B	161	161	1,733	19,870	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	239	327	9,850	112,883	家庭用品・パーソナル用品
BOLIDEN AB	—	162	4,012	45,986	素材
KINNEVIK AB-B SHS	—	112	2,468	28,290	各種金融
KINNEVIK AB-REDEMPTION SHARE	—	112	655	7,508	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	608	776	7,300	83,667	銀行
ASSA ABLOY AB-B	434	534	12,153	139,283	資本財
NORDEA BANK ABP	1,231	1,704	11,563	132,514	銀行
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	10,255 32	12,822 33	188,347 —	2,158,463 <0.9%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	406	510	7,906	94,091	銀行
TELENOR ASA	311	396	6,661	79,266	電気通信サービス
EQUINOR ASA	498	507	8,623	102,623	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	74	90	3,129	37,237	素材
MOWI ASA	169	222	5,084	60,505	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA	604	790	2,576	30,665	素材
AKER BP ASA	36	53	1,425	16,958	エネルギー
ORKLA ASA	339	339	3,027	36,024	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	69	110	1,919	22,840	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	37	39	933	11,111	メディア・娯楽
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	2,548 10	3,060 10	41,287 —	491,326 <0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B	46	58	5,675	91,765	食品・飲料・タバコ
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	2	3	3,506	56,705	運輸
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	1	1	1,479	23,919	運輸
DANSKE BANK A/S	297	327	3,002	48,544	銀行
GENMAB A/S	27	32	5,204	84,157	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	76	95	6,183	99,988	資本財
H LUNDBECK A/S	28	28	752	12,165	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DSV PANALPINA A S	75	116	8,620	139,398	運輸
PANDORA A/S	47	47	1,300	21,025	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	40	60	3,104	50,206	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES	85	102	3,307	53,475	素材
COLOPLAST-B	49	60	4,848	78,406	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B	751	928	35,388	572,235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S	64	85	1,326	21,451	商業・専門サービス
TRYG A/S	50	82	1,601	25,903	保険
ORSTED A/S	77	95	5,995	96,939	公益事業
DEMANT A/S	44	44	924	14,947	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	1,769 17	2,172 17	92,222 —	1,491,236 <0.6%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	61	95	694	51,548	ヘルスケア機器・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,202	1,466	3,643	270,493	銀行
AMCOR PLC-CDI	503	—	—	—	素材
WESTPAC BANKING CORPORATION	1,406	1,853	4,545	337,493	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	
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	178	—	—	—	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	728	701	682	50,644	素材
TELSTRA CORPORATION LIMITED	1,697	2,169	837	62,176	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	198	198	199	14,776	銀行
COCA-COLA AMATIL LIMITED	168	234	266	19,807	食品・飲料・タバコ
ASX LTD	92	92	758	56,343	各種金融
BHP GROUP LTD	1,334	1,516	5,799	430,580	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	99	133	462	34,349	エネルギー
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	205	205	88	6,558	小売
COMPUTERSHARE LIMITED	194	300	532	39,544	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	185	234	6,650	493,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	17	28	299	22,246	メディア・娯楽
COCHLEAR LIMITED	21	29	684	50,852	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	745	893	776	57,689	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	724	920	7,438	552,345	銀行
BORAL LIMITED	422	753	387	28,774	素材
RIO TINTO LIMITED	165	197	1,914	142,126	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	260	291	988	73,393	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	1,010	1,171	924	68,651	保険
TPG TELECOM LTD	177	177	124	9,216	電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	26	26	116	8,663	消費者サービス
ORICA LIMITED	179	179	427	31,748	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	230	230	335	24,943	素材
WORLEY LIMITED	—	133	200	14,906	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	523	639	855	63,515	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,114	1,532	3,966	294,524	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	313	412	1,270	94,310	素材
OIL SEARCH LTD	608	705	525	38,985	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD	613	613	198	14,714	素材
AMP LIMITED	1,297	2,235	436	32,443	各種金融
QANTAS AIRWAYS LIMITED	—	458	334	24,841	運輸
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	582	670	849	63,083	保険
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	230	230	187	13,914	各種金融
SANTOS LTD	715	916	747	55,465	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	178	210	634	47,145	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATINSON	—	76	170	12,692	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LIMITED	743	1,040	498	37,002	消費者サービス
WESFARMERS LIMITED	464	585	2,481	184,262	小売
ALUMINA LTD	1,069	1,069	247	18,348	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	381	501	1,729	128,428	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	556	677	2,694	200,039	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	80	424	31,545	各種金融
SEEK LIMITED	125	181	421	31,313	商業・専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	21	—	—	—	消費者サービス
BRAMBLES LIMITED	724	883	1,109	82,364	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	130	169	2,333	173,269	各種金融
CROWN RESORTS LTD	165	218	282	20,957	消費者サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	186	258	749	55,616	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	319	364	681	50,629	食品・飲料・タバコ
AURIZON HOLDINGS LTD	868	868	502	37,287	運輸
HEALTHSCOPE LTD	760	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AUSNET SERVICES	852	852	148	11,009	公益事業
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287	1,287	419	31,158	保険
AGL ENERGY LIMITED	250	341	696	51,732	公益事業
SOUTH32 LTD	2,234	2,946	795	59,073	素材
CIMIC GROUP LTD	40	40	136	10,145	資本財
COLES GROUP LIMITED	464	574	934	69,412	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	金額	株数	金額	
WISETECH GLOBAL LTD	—	—	79	215	ソフトウェア・サービス
小計	株数 30,067	金額 —	株数 35,962	金額 67,460	—
	銘柄数 57	<比率>	58	<2.2%>	
(ニュージーランド)					千ニュージーランドドル
RYMAN HEALTHCARE LIMITED	198	—	211	318	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	319	—	349	541	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	219	—	306	677	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	310	—	406	212	素材
SPARK NEW ZEALAND LIMITED	798	—	878	399	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	—	—	302	145	公益事業
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	342	—	552	499	運輸
MERIDIAN ENERGY LTD	633	—	818	385	公益事業
小計	株数 2,822	金額 —	株数 3,825	金額 3,179	—
	銘柄数 7	<比率>	8	<0.1%>	
(香港)					千香港ドル
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	123	—	123	1,257	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	980	—	980	1,571	不動産
BANK OF EAST ASIA	528	—	872	1,540	銀行
CLP HOLDINGS LTD	661	—	851	6,867	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	478	—	606	14,980	各種金融
LI & FUNG LTD	2,372	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MTR CORPORATION	670	—	670	2,941	運輸
HANG LUNG GROUP LTD	420	—	—	—	不動産
HANG SENG BANK LTD	331	—	388	6,192	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	486	—	633	2,386	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	600	—	715	3,893	公益事業
WHARF HOLDINGS LTD	590	—	—	—	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	3,872	—	5,450	8,131	公益事業
HYSAN DEVELOPMENT CO	290	—	—	—	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	930	—	1,180	6,041	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	275	—	275	694	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,570	—	1,875	4,987	銀行
NWS HOLDINGS LTD	695	—	695	729	資本財
PCCW LIMITED	1,940	—	2,690	1,269	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDC	270	—	270	625	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,613	—	3,563	3,641	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD.	640	—	—	—	消費者サービス
SINO LAND CO	1,242	—	1,242	1,458	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	640	—	850	9,681	不動産
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	180	—	270	1,902	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	—	—	420	1,264	食品・飲料・タバコ
WHEELLOCK&COMPANY LTD	330	—	520	2,529	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	560	—	780	4,590	資本財
MINTH GROUP LTD	320	—	—	—	自動車・自動車部品
SJM HOLDINGS LIMITED	800	—	800	638	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	708	—	708	1,219	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	440	—	—	—	消費者サービス
AIA GROUP LTD	4,980	—	6,326	49,595	保険
SANDS CHINA LTD	936	—	1,356	5,017	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LIMITED	530	—	530	1,290	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	480	—	720	3,128	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	1,110	—	1,110	851	公益事業
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	—	650	1,813	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LIMITED	3,975	—	5,170	4,156	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,094	—	1,434	10,197	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	300	—	300	1,590	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,074	—	1,394	7,257	不動産
小計	株数 41,035	金額 —	株数 46,417	金額 175,933	—
	銘柄数 40	<比率>	35	<1.1%>	

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	外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	683	991	409	32,828	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	3,536	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP HOLDINGS LTD	769	942	2,378	190,783	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	161	258	266	21,397	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	47	47	144	11,550	小売
SATS LTD	268	268	133	10,705	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	356	356	315	25,270	各種金融
CAPITALAND LTD	1,045	1,366	502	40,320	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	711	1,167	274	21,997	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD	250	250	230	18,476	運輸
UNITED OVERSEAS BANK LTD	546	639	1,649	132,338	銀行
UOL GROUP LIMITED	217	217	168	13,506	不動産
VENTURE CORP LTD	119	119	188	15,147	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	563	690	151	12,184	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,349	4,391	1,484	119,048	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	437	437	95	7,679	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,268	1,762	1,899	152,353	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	699	1,170	478	38,382	食品・飲料・タバコ
KEPPEL CORP LTD	586	699	469	37,676	資本財
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	900	900	92	7,435	資本財
GENTING SINGAPORE LTD	2,807	3,702	342	27,466	消費者サービス
小計	株数 19,318	株数 20,372	外貨建金額 11,676	邦貨換算金額 936,553	
	銘柄数 21	銘柄数 20		<比率> <0.4%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
BANK HAPOLIM BM	440	650	1,797	56,738	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	655	839	2,091	66,005	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	1,001	—	—	—	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	8	13	784	24,772	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	—	546	869	27,435	銀行
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	287	287	458	14,461	素材
NICE LTD	27	27	1,439	45,426	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	54	54	495	15,629	銀行
AZRIELI GROUP	21	21	583	18,417	不動産
小計	株数 2,496	株数 2,441	外貨建金額 8,519	邦貨換算金額 268,887	
	銘柄数 8	銘柄数 8		<比率> <0.1%>	
合計	株数 505,064	株数 612,636	外貨建金額 —	邦貨換算金額 221,190,960	
	銘柄数 1,250	銘柄数 1,260		<比率> <95.2%>	

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

※<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※-印は組入れなし。

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

※一部の銘柄において、資産区分を変更しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首 (前期末)		期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		組 入 比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORPORATION	17,476	25,432	440	48,312	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,326	5,727	930	102,084	0.0
AMERICAN TOWER CORP	18,353	23,336	4,994	547,808	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	51,312	80,296	749	82,168	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,571	7,069	1,515	166,238	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	6,157	7,835	1,085	119,053	0.1
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	11,010	—	—	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	4,902	546	59,975	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	8,532	10,561	1,277	140,100	0.1
DUKE REALTY CORP	13,732	20,240	712	78,096	0.0
EQUINIX INC	—	4,426	2,508	275,173	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	—	8,664	641	70,395	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	14,828	18,789	1,598	175,372	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,713	3,332	1,040	114,087	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	6,463	685	75,174	0.0
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	4,227	558	61,229	0.0
HCP, INC.	20,162	—	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	24,237	845	92,721	0.0
HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	37,569	657	72,068	0.0
INVITATION HOMES INC	14,734	30,069	918	100,686	0.0
IRON MOUNTAIN INC	12,165	16,395	526	57,758	0.0
KIMCO REALTY CORPORATION	15,666	21,090	455	50,010	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	9,193	566	62,130	0.0
MACERICH COMPANY/THE	3,806	—	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	29,675	616	67,568	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	5,780	786	86,286	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	8,249	459	50,430	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	—	12,872	541	59,337	0.0
PROLOGIS INC	25,652	33,100	3,030	332,363	0.1
PUBLIC STORAGE	6,516	7,965	1,678	184,050	0.1
REALTY INCOME CORPORATION	11,714	16,047	1,229	134,871	0.1
REGENCY CENTERS CORP	6,080	9,451	614	67,419	0.0
SL GREEN REALTY CORP	3,945	3,945	336	36,921	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	12,869	16,451	2,487	272,835	0.1
SUN COMMUNITIES INC	—	4,598	757	83,064	0.0
UDR INC	10,651	14,289	686	75,304	0.0
VENTAS INC	14,830	20,469	1,193	130,908	0.1

外国株式インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首 (前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額		組 入 比 率
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
VEREIT INC		44,740		54,273		529	58,097	0.0
VICI PROPERTIES INC		—		26,533		656	71,967	0.0
VORNADO REALTY TRUST		7,603		8,706		562	61,656	0.0
WP CAREY INC		6,694		8,640		720	79,051	0.0
WELLTOWER INC		14,980		20,533		1,736	190,456	0.1
WEYERHAEUSER CO		30,388		37,766		1,114	122,235	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	480,195		709,194		42,993	4,715,477	
	銘 柄 数 <比 率>	36		40		—	<2.0%>	
(カナダ)						千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP		—		4,697		260	21,514	0.0
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		3,825		10,391		224	18,526	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		7,441		7,441		201	16,685	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS		3,585		3,585		114	9,487	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	14,851		26,114		801	66,212	
	銘 柄 数 <比 率>	3		4		—	<0.0%>	
(ユーロ・・・フランス)						千ユーロ		
ICADE		1,265		1,265		114	13,889	0.0
KLEPIERRE		9,305		9,305		303	36,628	0.0
GECINA SA		1,738		2,689		421	50,958	0.0
COVIVIO		1,550		2,388		239	28,976	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED		5,937		7,311		1,037	125,383	0.1
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	19,795		22,958		2,116	255,837	
	銘 柄 数 <比 率>	5		5		—	<0.1%>	
(イギリス)						千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		34,772		44,962		258	36,643	0.0
HAMMERSON PLC		34,414		—		—	—	—
SEGRO PLC		40,873		61,311		548	77,608	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		32,703		32,703		313	44,377	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	142,762		138,976		1,120	158,629	
	銘 柄 数 <比 率>	4		3		—	<0.1%>	
(オーストラリア)						千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP		140,993		226,368		762	56,642	0.0
TRANSURBAN GROUP		104,775		141,455		2,171	161,221	0.1
APA GROUP		48,387		67,160		738	54,852	0.0
GPT GROUP		69,713		97,296		598	44,429	0.0
LENDLEASE GROUP		25,262		25,262		487	36,219	0.0
STOCKLAND		103,417		103,417		522	38,777	0.0
DEXUS		38,051		62,385		762	56,650	0.0
GOODMAN GROUP		64,265		86,301		1,278	94,964	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	
	SYDNEY AIRPORT	49,760	49,760			456	33,917	0.0
	SCENTRE GROUP	234,290	290,995			1,146	85,129	0.0
	VICINITY CENTRES	146,656	146,656			393	29,183	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,025,569	1,297,055			9,319	691,987	
	銘 柄 数 <比 率>	11	11			—	<0.3%>	
(香港)						千香港ドル		
	LINK REIT	92,500	112,500			9,000	126,090	0.1
	HKT TRUST AND HKT LTD	136,000	170,000			1,951	27,341	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	228,500	282,500			10,951	153,431	
	銘 柄 数 <比 率>	2	2			—	<0.1%>	
(シンガポール)						千シンガポールドル		
	CAPITALAND MALL TRUST	102,800	160,800			405	32,502	0.0
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	118,300	150,400			448	35,949	0.0
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,000	130,400			262	21,023	0.0
	SUNTEC REIT	65,600	64,600			118	9,534	0.0
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	104,900			247	19,857	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	416,700	611,100			1,481	118,866	
	銘 柄 数 <比 率>	4	5			—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	2,328,372	3,087,897			—	6,160,443	
	銘 柄 数 <比 率>	65	70			—	<2.7%>	

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

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	期		末	
			買	建 額	売	建 額
外 国	株 式 先 物 取 引			百万円		百万円
		S P I 2 0 0		216		—
		D J E U R 0		827		—
		F T S E		281		—
		S P M I N I		3,534		—

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

※—印は組入れなし。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2019年12月2日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	221,190,960	95.1
投 資 証 券	6,160,443	2.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,346,121	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	232,697,524	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※期末における外貨建資産（232,363,571千円）の投資信託財産総額（232,697,524千円）に対する比率は99.9%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.68円、1カナダドル=82.62円、1ユーロ=120.86円、1英ポンド=141.59円、1スイスフラン=109.59円、1スウェーデンクローナ=11.46円、1ノルウェークローネ=11.90円、1デンマーククローネ=16.17円、1オーストラリアドル=74.25円、1ニュージーランドドル=70.63円、1香港ドル=14.01円、1シンガポールドル=80.21円、1イスラエルシェケル=31.56円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月2日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	232,939,548,805円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,229,184,929
株 式(評価額)	221,190,960,865
投 資 証 券(評価額)	6,160,443,382
未 収 入 金	318,051,486
未 収 配 当 金	388,775,579
差 入 委 託 証 拠 金	1,652,132,564
(B) 負 債	520,629,054
未 払 金	331,083,940
未 払 解 約 金	189,530,582
未 払 利 息	469
そ の 他 未 払 費 用	14,063
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	232,418,919,751
元 本	59,882,488,969
次 期 繰 越 損 益 金	172,536,430,782
(D) 受 益 権 総 口 数	59,882,488,969口
1万口当たり基準価額(C/D)	38,813円

※当期における期首元本額50,246,578,230円、期中追加設定元本額25,475,610,485円、期中一部解約元本額15,839,699,746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2018年12月1日 至2019年12月2日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,142,999,222円
受 取 配 当 金	4,118,511,245
受 取 利 息	7,980,013
そ の 他 収 益 金	16,811,889
支 払 利 息	△ 303,925
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	18,409,509,351
売 買 益 損	29,830,623,457
売 買 損	△ 11,421,114,106
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	689,302,248
取 引 益 損	1,248,893,389
取 引 損	△ 559,591,141
(D) 信 託 報 酬 等	△ 86,588,797
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	23,155,222,024
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	123,998,809,377
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	65,355,675,104
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 39,973,275,723
(I) 計 (E+F+G+H)	172,536,430,782
次 期 繰 越 損 益 金(I)	172,536,430,782

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

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

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

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	24,341,482,029円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,425,257,649円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	309,208,928円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,437,712,637円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,259,261,163円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,008,822,640円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	846,574,484円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	20,208,409円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	95,225,173円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	101,561,964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)	2,203,478円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	419,448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)	8,569,298円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	719,013,252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)	23,404,360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>	59,112,177円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	49,150,528円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	171,173,908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)	35,973,195円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	746,604,437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)	84,418,147円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	610,403,231円
外国株式指数ファンド	519,424,273円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,481,526,688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	4,651,861,582円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	807,485円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	467,864,523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)	298,971,151円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	467,950,368円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	124,994,236円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	363,716,897円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	17,270,683円
イオン・バランス戦略ファンド	12,835,702円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	12,728,159円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,924,395円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,672,335円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	38,804,550円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	41,560,678円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,331,600円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	104,386,931円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	98,630,259円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	7,900,647円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	53,111,115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>	824,759,297円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	67,295,491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>	136,799,749円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	18,283,485円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,661,668,736円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	280,003円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	253,114,771円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	27,790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>	3,894,611,777円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	41,770円	SMAM・年金ワリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	8,907,868円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	56,291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>	45,206,401円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,410,498,405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>	27,976,493円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	7,831,278円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	282,124,598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>	73,969,974円		

■ お知らせ

<約款変更について>

・委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(適用日：2019年4月1日)

外国債券パッシブ・マザーファンド

第16期（2018年12月18日から2019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。

■ 最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		(ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
12期 (2015年12月17日)	円 18,044	△1.6%	182.96	△1.4%	98.5%	百万円 198,255
13期 (2016年12月19日)	17,116	△5.1	172.59	△5.7	98.4	180,203
14期 (2017年12月18日)	17,897	4.6	181.01	4.9	98.9	196,212
15期 (2018年12月17日)	17,553	△1.9	177.36	△2.0	98.7	168,894
16期 (2019年12月17日)	18,248	4.0	184.64	4.1	98.6	171,892

※ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したもので、設定時を100として2019年12月17日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

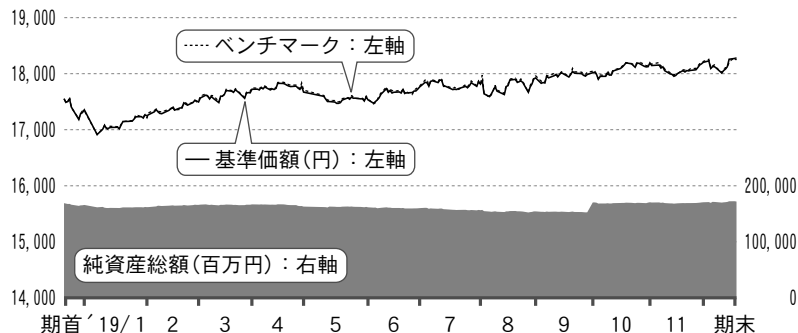
年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 率 比
	騰 落	率	騰 落	率	
(期 首) 2018年12月17日	円 17,553	—	177.36	—	98.7%
12月末	17,355	△1.1	175.20	△1.2	98.7
2019年 1月末	17,249	△1.7	173.91	△1.9	98.8
2月末	17,495	△0.3	176.93	△0.2	98.2
3月末	17,722	1.0	179.31	1.1	98.8
4月末	17,671	0.7	178.91	0.9	98.4
5月末	17,533	△0.1	177.32	△0.0	98.9
6月末	17,763	1.2	179.64	1.3	99.1
7月末	17,814	1.5	180.05	1.5	98.8
8月末	17,925	2.1	181.49	2.3	98.8
9月末	18,017	2.6	182.32	2.8	98.5
10月末	18,192	3.6	183.72	3.6	98.1
11月末	18,202	3.7	184.08	3.8	98.5
(期 末) 2019年12月17日	18,248	4.0	184.64	4.1	98.6

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

基準価額等の推移



期首	17,553円
期末	18,248円
騰落率	+4.0%

※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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

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

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- ・FRB（米連邦準備制度理事会）が保険的な利下げを実施するなど、ハト派（景気を重視する立場）的な金融政策に転換したことにより、米国金利が低下したこと

下落要因

- ・景気見通しに対する不透明感や投資家のリスク回避的な姿勢などから、円が対ドルや対ユーロで上昇したこと

▶ 投資環境について（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

長期金利は米国、欧州（ドイツ）ともに低下（債券価格は上昇）しました。為替市場では、米ドルやユーロは対円で下落しました。

債券市場

米国では、期初からもみ合い推移が続いた後、2019年3月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利の見通しが大幅に引き下げられると、年内の利下げを織り込む形で金利が低下しました。その後、5月にトランプ大統領が中国に対する関税上げを実施し、8月にも中国に対する追加関税が発表されるなど、米中通商摩擦に対する不透明感から金利は大きく低下しました。7月末にグローバルな景気見通しの悪化を受けてFRBが保険的な利下げを実施したことも、金利低下要因になりました。その後、米中協議の再開を受けて、米中間の対立先鋭化に対する警戒感が後退し、10月に金利は上昇に転じ、期末まで上昇基調で推移しました。

欧州では、域内の経済指標の低迷や、ECB（欧州中央銀行）が金利据え置き期間を長期化するなどハト派的な姿勢を示したことから、期首から8月にかけて金利低下が進行しました。ECBは9月に政策金利の引下げと量的緩和を含む金融緩和策を発表しました。ドイツの財政支出拡大観測や米中通商協議の進展に対する期待から、9月以降、金利は上昇に転じ、期末にかけて上昇傾向が続きました。

当期の市場の動きを米国10年国債利回りで見ると、期首2.89%から期末1.87%へと低下し、ドイツ10年国債利回りで見ると、期首0.25%から期末-0.28%へと低下しました。

為替市場

米ドル・円は、期初は株式市場の下落を受けてリスク回避の動きが強まるなか、円高が進行しましたが、2019年1月中旬以降は、米国の利上げ停止観測などを受けたリスク選好度の改善とともに、米ドルが反発しました。5月以降は、米中通商協議に対する警戒感が高まると、円が強含みで推移しました。10月から期末にかけては、米国金利の上昇に連れて米ドル高・円安基調となりました。

ユーロ・円は、期初から8月にかけて、投資家のリスク回避姿勢の強まりと欧州景気の低迷から、円高傾向となりました。その後は英国のEU（欧州連合）からの離脱交渉が進展するなどリスク選好度の改善とともにユーロが反発に転じ、期末までユーロ高・円安となりました。

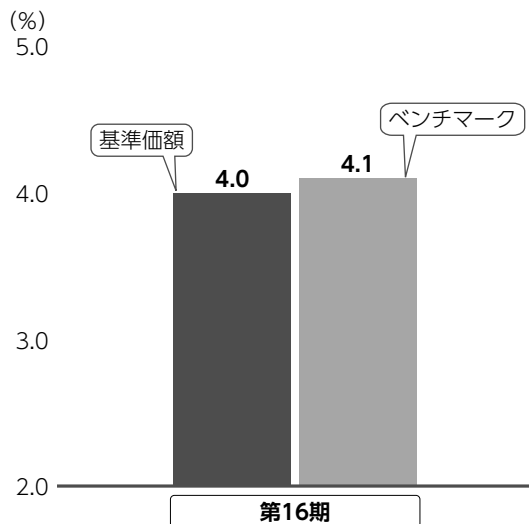
当期の米ドル・円は、期首113円47銭から期末109円56銭と3円91銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首128円28銭から期末122円01銭と6円27銭のユーロ安・円高となりました。

▶ポートフォリオについて（2018年12月18日から2019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（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は+4.0%となり、ベンチマークの騰落率+4.1%を0.1%下方乖離しました。

下方乖離要因

・カストディフィーやポートフォリオの維持のための売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

米国では、景気に底入れの兆候が見られるものの、F R Bは慎重なスタンスを継続する見通しです。インフレ環境が抑制されていることから、長期金利は低位での推移を予想します。ユーロ圏でも、景気の底入れが見込まれる一方で、低インフレ環境やE C Bの緩和政策が続くことから、金利は低位での推移を予想します。

為替相場は、米ドル・円では、日米金利差は米ドルの支援材料ですが、F R Bの慎重な姿勢を背景にレンジ相場を予想します。ユーロ・米ドルに関しても、米国、ユーロ圏ともに慎重な金融政策が継続することから、レンジ相場を予想します。

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

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

期中の平均基準価額は17,744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 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 237,118	千米ドル 211,041
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 14,012	千カナダドル 15,881
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 89,136	千メキシコペソ 89,554
	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	20,446	30,435
	イ タ リ ア	国 債 証 券	30,062	31,992
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	41,083	35,251
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	4,653	6,453
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	16,882	22,494
	ベルギー	国 債 証 券	6,308	5,023
	オーストリア	国 債 証 券	4,238	3,509
	フィンランド	国 債 証 券	2,223	725
アイルランド	国 債 証 券	1,637	2,094	
国	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 17,673	千英ポンド 22,451
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 7,478	千スウェーデンクローナ 7,012

外国債券パッシブ・マザーファンド

			買 付 額	売 付 額
外	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 4,912	千ノルウェークローネ 3,486
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 7,725	千デンマーククローネ 8,503
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 6,066	千ポーランドズロチ 6,826
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 6,849	千オーストラリアドル 8,893
国	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 2,281	千シンガポールドル 1,898
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリングgit 10,439	千マレーシアリングgit 10,746
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 24,197	千南アフリカランド 17,148

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等 (2018年12月18日から2019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 (2018年12月18日から2019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 (2019年12月17日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル 711,170	千米ドル 741,288	千円 81,215,588	% 47.2	% -	% 20.2	% 17.2	% 9.8
カ ナ ダ	千カナダドル 35,500	千カナダドル 38,573	3,209,295	1.9	-	0.9	0.7	0.3

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
メ キ シ コ	千メキシコペソ 241,000	千メキシコペソ 257,176	1,486,478	0.9	—	0.5	0.4	—
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	63,000	78,385	9,563,778	5.6	—	3.9	1.2	0.5
イ タ リ ア	109,120	125,910	15,362,296	8.9	—	5.1	2.7	1.1
フ ラ ン ス	117,270	140,636	17,159,073	10.0	—	6.6	2.4	1.0
オ ラ ン ダ	21,400	25,565	3,119,239	1.8	—	1.1	0.6	0.1
ス ペ イ ン	61,550	75,673	9,232,969	5.4	—	3.5	1.4	0.4
ベ ル ギ ー	27,450	34,658	4,228,633	2.5	—	1.7	0.4	0.3
オーストリア	17,750	21,765	2,655,644	1.5	—	1.1	0.4	0.1
フィンランド	9,000	10,106	1,233,111	0.7	—	0.4	0.3	0.1
アイルランド	9,200	10,745	1,311,063	0.8	—	0.6	0.2	—
イ ギ リ ス	千英ポンド 58,020	千英ポンド 75,864	11,035,227	6.4	—	5.1	1.1	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 43,800	千スウェーデンクローナ 49,622	580,091	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 31,200	千ノルウェークローネ 32,213	391,397	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 41,100	千デンマーククローネ 53,848	879,343	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 31,900	千ポーランドズロチ 34,087	976,939	0.6	—	0.3	0.1	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 38,250	千オーストラリアドル 43,919	3,307,106	1.9	—	1.3	0.5	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 8,050	千シンガポールドル 8,775	709,066	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 28,200	千マレーシアリンギット 29,136	770,358	0.4	—	0.3	0.1	—
南アフリカ	千南アフリカランド 162,500	千南アフリカランド 132,294	1,006,764	0.6	—	0.5	—	0.1
合 計	—	—	169,433,468	98.6	—	53.8	30.1	14.6

※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。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 外国（外貨建）公社債

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千 米 ド ル	千 米 ド ル	千 円		
(アメリカ)	国債証券	US TREASURY N/B 1.125		1.125	3,800	3,774	413,530	2021/2/28
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	3,000	2,974	325,906	2021/6/30
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	4,500	4,458	488,474	2021/7/31
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	2,700	2,673	292,946	2021/8/31
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	2,100	2,079	227,775	2021/9/30
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	3,600	3,579	392,197	2021/3/31
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	4,500	4,463	489,014	2021/10/31
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	3,000	2,952	323,493	2023/7/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,989	327,550	2021/1/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,400	2,389	261,814	2021/4/30
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	4,000	3,981	436,219	2021/5/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	4,000	3,966	434,610	2022/10/15
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,500	3,460	379,176	2023/6/30
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,500	2,470	270,626	2023/8/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,962	324,622	2023/9/30
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,600	2,526	276,777	2026/8/31
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	2,989	327,575	2022/1/31
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	5,800	5,774	632,618	2022/9/15
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	2,982	326,754	2023/2/28
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	2,982	326,754	2023/3/31
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	1,500	1,469	161,001	2026/8/15
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,500	3,498	383,250	2020/11/30
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	2,000	1,997	218,897	2022/8/15
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,400	3,395	372,038	2022/8/31
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,500	3,494	382,830	2022/11/15
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,000	2,993	327,961	2023/4/30
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,000	2,992	327,858	2023/5/31
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,000	2,990	327,652	2023/10/31
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	2,400	2,374	260,129	2026/2/15
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	6,050	5,980	655,225	2026/5/15
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	5,500	5,429	594,812	2026/9/30
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	9,650	9,420	1,032,144	2029/8/15
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	2,000	2,001	219,274	2020/12/31
US TREASURY N/B 1.75		1.75	10,500	10,507	1,151,188	2021/7/31		
US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,004	329,142	2021/11/30		
US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,005	329,296	2022/2/28		
US TREASURY N/B 1.75		1.75	1,800	1,803	197,577	2022/3/31		
US TREASURY N/B 1.75		1.75	2,400	2,404	263,457	2022/4/30		
US TREASURY N/B 1.75		1.75	4,100	4,108	450,108	2022/5/15		
US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,006	329,347	2022/5/31		
US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,006	329,373	2022/6/30		

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末							
				利	率	額	面		額	償	還	年	月	日
							額	金						
				外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額
		US TREASURY	N/B	1.75	3,000	3,005	329,296	2022/ 9 /30						
		US TREASURY	N/B	1.75	3,000	3,006	329,347	2023/ 1 /31						
		US TREASURY	N/B	1.75	5,700	5,709	625,516	2023/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B	1.75	11,800	11,809	1,293,818	2024/ 6 /30						
		US TREASURY	N/B	1.75	850	850	93,184	2024/ 7 /31						
		US TREASURY	N/B	1.875	2,400	2,409	264,012	2022/ 1 /31						
		US TREASURY	N/B	1.875	2,000	2,008	220,095	2022/ 3 /31						
		US TREASURY	N/B	1.875	3,000	3,014	330,220	2022/ 4 /30						
		US TREASURY	N/B	1.875	3,000	3,015	330,349	2022/ 5 /31						
		US TREASURY	N/B	1.875	1,700	1,708	187,183	2022/ 7 /31						
		US TREASURY	N/B	1.875	4,800	4,825	528,640	2022/ 8 /31						
		US TREASURY	N/B	1.875	3,000	3,016	330,451	2022/10/31						
		US TREASURY	N/B	1.875	1,800	1,810	198,409	2024/ 8 /31						
		US TREASURY	N/B	1.875	3,500	3,512	384,778	2026/ 6 /30						
		US TREASURY	N/B	1.875	3,200	3,210	351,769	2026/ 7 /31						
		US TREASURY	N/B	2.0	5,300	5,315	582,391	2020/11/30						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,000	3,010	329,784	2021/ 1 /15						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,000	3,011	329,886	2021/ 2 /28						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,000	3,013	330,143	2021/ 5 /31						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,000	3,015	330,400	2021/ 8 /31						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,000	3,017	330,554	2021/10/31						
		US TREASURY	N/B	2.0	4,300	4,327	474,089	2021/11/15						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,500	3,521	385,856	2021/12/31						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,100	3,121	341,997	2022/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,000	3,024	331,401	2022/ 7 /31						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,500	3,531	386,905	2022/10/31						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,000	3,027	331,658	2022/11/30						
		US TREASURY	N/B	2.0	5,500	5,552	608,370	2023/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B	2.0	2,000	2,022	221,602	2024/ 4 /30						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,300	3,338	365,756	2024/ 5 /31						
		US TREASURY	N/B	2.0	2,500	2,528	277,024	2024/ 6 /30						
		US TREASURY	N/B	2.0	3,500	3,541	387,983	2025/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B	2.0	4,300	4,349	476,555	2025/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B	2.0	7,000	7,077	775,428	2026/11/15						
		US TREASURY	N/B	2.125	2,700	2,712	297,198	2021/ 1 /31						
		US TREASURY	N/B	2.125	1,700	1,711	187,474	2021/ 6 /30						
		US TREASURY	N/B	2.125	4,000	4,028	441,355	2021/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B	2.125	3,000	3,022	331,145	2021/ 9 /30						
		US TREASURY	N/B	2.125	3,000	3,026	331,581	2021/12/31						
		US TREASURY	N/B	2.125	4,500	4,547	498,219	2022/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B	2.125	3,000	3,034	332,429	2022/ 6 /30						
		US TREASURY	N/B	2.125	4,000	4,052	443,991	2022/12/31						
		US TREASURY	N/B	2.125	3,100	3,147	344,863	2023/11/30						
		US TREASURY	N/B	2.125	2,000	2,031	222,612	2024/ 2 /29						

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末							
				利	率	額	面		額	償	還	年	月	日
							額	金						
				外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額
		US TREASURY	N/B 2.125	2.125	6,500	6,606	723,767	2024/ 3 /31						
		US TREASURY	N/B 2.125	2.125	3,500	3,559	389,990	2024/ 7 /31						
		US TREASURY	N/B 2.125	2.125	4,000	4,069	445,874	2024/ 9 /30						
		US TREASURY	N/B 2.125	2.125	1,800	1,831	200,705	2024/11/30						
		US TREASURY	N/B 2.125	2.125	4,900	4,989	546,616	2025/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 2.125	2.125	5,700	5,806	636,152	2026/ 5 /31						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	4,000	4,025	441,047	2021/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	3,000	3,021	330,991	2021/ 3 /31						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	4,500	4,533	496,640	2021/ 4 /30						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	2,800	2,824	309,404	2021/ 7 /31						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	4,300	4,356	477,254	2022/ 4 /15						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	3,000	3,061	335,459	2023/12/31						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	5,200	5,308	581,551	2024/ 1 /31						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	4,800	4,904	537,309	2024/ 4 /30						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	1,500	1,535	168,230	2024/10/31						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	6,300	6,448	706,459	2024/11/15						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	3,100	3,174	347,808	2024/12/31						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	4,000	4,100	449,298	2025/11/15						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	7,200	7,387	809,415	2026/ 3 /31						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	4,400	4,525	495,772	2027/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	5,200	5,351	586,358	2027/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	5,600	5,764	631,558	2027/11/15						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	2,850	2,813	308,196	2046/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.25	2.25	4,500	4,440	486,472	2049/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	2,000	2,014	220,694	2020/12/31						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	5,000	5,042	552,507	2021/ 3 /15						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	2,000	2,017	221,071	2021/ 4 /15						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	3,600	3,656	400,609	2022/ 3 /15						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	1,200	1,224	134,204	2023/ 1 /31						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	3,700	3,797	416,013	2024/ 2 /29						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	5,600	5,756	630,695	2024/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	4,900	5,084	557,101	2027/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	6,200	6,458	707,557	2029/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	700	709	77,782	2049/11/15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	8,900	8,986	984,530	2021/ 2 /28						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	1,900	1,931	211,611	2022/ 1 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	3,500	3,560	390,140	2022/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	5,000	5,139	563,078	2023/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	5,700	5,883	644,641	2024/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	4,600	4,768	522,481	2025/ 1 /31						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	1,400	1,456	159,603	2026/ 2 /28						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	4,100	4,248	465,514	2045/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	2,900	3,006	329,365	2046/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	4,100	4,252	465,900	2046/ 5 /15						

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	1,500	1,513	165,765	2020/11/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	500	506	55,494	2021/5/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	4,000	4,055	444,300	2021/6/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	4,000	4,057	444,573	2021/7/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	3,000	3,056	334,842	2021/12/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	4,000	4,116	450,976	2023/2/28
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	4,300	4,487	491,608	2025/3/31
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	5,800	6,072	665,333	2025/12/31
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	6,300	6,691	733,097	2029/2/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	4,000	4,068	445,772	2021/8/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	1,400	1,425	156,152	2021/9/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	4,900	5,068	555,339	2023/4/30
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	2,000	2,072	227,097	2023/7/31
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	5,000	5,185	568,171	2023/8/31
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	6,200	6,439	705,540	2023/11/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	5,100	5,308	581,586	2024/2/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	2,000	2,098	229,921	2025/2/28
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	5,000	5,256	575,874	2025/6/30
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	600	631	69,171	2025/8/31
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	4,800	5,124	561,385	2028/2/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	2,000	2,164	237,163	2042/8/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	2,800	3,028	331,764	2042/11/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	3,800	4,138	453,439	2047/8/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	1,500	1,634	179,079	2047/11/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	4,000	4,089	447,997	2021/11/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	5,000	5,216	571,509	2023/10/31
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	2,000	2,088	228,792	2023/11/30
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	2,200	2,324	254,721	2025/4/30
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	1,100	1,162	127,417	2025/5/31
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	2,500	2,651	290,526	2025/11/30
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	4,500	4,853	531,768	2028/5/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	7,000	7,560	828,273	2028/8/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	3,000	3,314	363,088	2043/5/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	4,000	4,438	486,275	2045/8/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	3,600	4,008	439,219	2046/11/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	900	1,008	110,444	2049/5/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	4,000	4,266	467,444	2025/9/30
		US TREASURY N/B 3		3.0	3,100	3,307	362,402	2025/10/31
		US TREASURY N/B 3		3.0	1,800	2,026	222,074	2042/5/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	4,000	4,525	495,861	2044/11/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	4,000	4,534	496,786	2045/5/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	4,200	4,768	522,488	2045/11/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	2,500	2,851	312,374	2047/2/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	2,200	2,508	274,795	2047/5/15

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末		
				利	率	額	評 価 額		償 還 年 月 日
							面	金	
				額	額	外貨建金額	邦貨換算金額		
		US TREASURY N/B 3		3.0	3,100		3,542	388,113	2048/2/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	7,400		8,466	927,605	2048/8/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	3,800		4,353	477,020	2049/2/15
		US TREASURY N/B 3.125		3.125	3,000		3,060	335,253	2021/5/15
		US TREASURY N/B 3.125		3.125	6,700		7,383	808,948	2028/11/15
		US TREASURY N/B 3.125		3.125	1,100		1,263	138,405	2041/11/15
		US TREASURY N/B 3.125		3.125	2,000		2,297	251,679	2042/2/15
		US TREASURY N/B 3.125		3.125	2,300		2,643	289,589	2043/2/15
		US TREASURY N/B 3.125		3.125	3,800		4,385	480,468	2044/8/15
		US TREASURY N/B 3.125		3.125	2,400		2,805	307,315	2048/5/15
		US TREASURY N/B 3.375		3.375	4,000		4,803	526,298	2044/5/15
		US TREASURY N/B 3.375		3.375	3,100		3,797	416,080	2048/11/15
		US TREASURY N/B 3.5		3.5	800		968	106,156	2039/2/15
		US TREASURY N/B 3.625		3.625	5,000		5,110	559,911	2021/2/15
		US TREASURY N/B 3.625		3.625	3,400		4,225	462,923	2043/8/15
		US TREASURY N/B 3.625		3.625	3,600		4,483	491,201	2044/2/15
		US TREASURY N/B 3.75		3.75	1,500		1,884	206,477	2041/8/15
		US TREASURY N/B 3.75		3.75	4,000		5,067	555,229	2043/11/15
		US TREASURY N/B 3.875		3.875	1,500		1,912	209,494	2040/8/15
		US TREASURY N/B 4.25		4.25	1,000		1,330	145,757	2039/5/15
		US TREASURY N/B 4.25		4.25	600		803	87,978	2040/11/15
		US TREASURY N/B 4.375		4.375	500		671	73,572	2038/2/15
		US TREASURY N/B 4.375		4.375	700		947	103,809	2039/11/15
		US TREASURY N/B 4.375		4.375	1,400		1,901	208,374	2040/5/15
		US TREASURY N/B 4.375		4.375	1,800		2,453	268,834	2041/5/15
		US TREASURY N/B 4.5		4.5	750		1,002	109,806	2036/2/15
		US TREASURY N/B 4.5		4.5	200		272	29,896	2038/5/15
		US TREASURY N/B 4.5		4.5	1,000		1,372	150,396	2039/8/15
		US TREASURY N/B 4.625		4.625	4,200		5,871	643,278	2040/2/15
		US TREASURY N/B 4.75		4.75	1,500		2,139	234,377	2041/2/15
		US TREASURY N/B 5		5.0	500		714	78,258	2037/5/15
		US TREASURY N/B 5.25		5.25	500		638	69,964	2028/11/15
		US TREASURY N/B 5.375		5.375	320		431	47,253	2031/2/15
		US TREASURY N/B 5.5		5.5	500		645	70,691	2028/8/15
		US TREASURY N/B 6		6.0	1,000		1,245	136,462	2026/2/15
		US TREASURY N/B 6.125		6.125	1,000		1,316	144,225	2027/11/15
		US TREASURY N/B 6.25		6.25	800		929	101,794	2023/8/15
		US TREASURY N/B 6.5		6.5	500		652	71,505	2026/11/15
		US TREASURY N/B 8		8.0	1,300		1,453	159,274	2021/11/15
	小	計		—	—		—	81,215,588	—
(カナダ)	国債証券	CANADA-GOV'T 0.5		0.5	2,000	千カナダドル	1,948	162,136	2022/3/1
		CANADA-GOV'T 0.75		0.75	1,800	千カナダドル	1,785	148,540	2020/9/1
		CANADA-GOV'T 0.75		0.75	2,000	千カナダドル	1,976	164,428	2021/3/1

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		CANADA-GOV T 0.75	0.75	2,000	1,965	163,556	2021/9/1	
		CANADA-GOV T 1	1.0	3,000	2,946	245,137	2022/9/1	
		CANADA-GOV T 1	1.0	1,600	1,526	126,983	2027/6/1	
		CANADA-GOV T 1.25	1.25	600	576	47,985	2030/6/1	
		CANADA-GOV T 1.5	1.5	2,000	1,989	165,519	2023/6/1	
		CANADA-GOV T 1.5	1.5	1,000	993	82,667	2024/9/1	
		CANADA-GOV T 1.5	1.5	1,000	991	82,501	2026/6/1	
		CANADA-GOV T 1.75	1.75	1,100	1,102	91,743	2023/3/1	
		CANADA-GOV T 2	2.0	900	924	76,885	2028/6/1	
		CANADA-GOV T 2.25	2.25	1,000	1,024	85,201	2024/3/1	
		CANADA-GOV T 2.25	2.25	1,400	1,444	120,173	2025/6/1	
		CANADA-GOV T 2.25	2.25	1,400	1,474	122,676	2029/6/1	
		CANADA-GOV T 2.5	2.5	2,100	2,176	181,118	2024/6/1	
		CANADA-GOV T 2.75	2.75	1,800	1,846	153,593	2022/6/1	
		CANADA-GOV T 2.75	2.75	1,100	1,354	112,661	2048/12/1	
		CANADA-GOV T 2.75	2.75	500	661	55,021	2064/12/1	
		CANADA-GOV T 3.25	3.25	1,000	1,021	85,005	2021/6/1	
		CANADA-GOV T 3.5	3.5	1,500	2,047	170,354	2045/12/1	
		CANADA-GOV T 4	4.0	1,500	2,100	174,759	2041/6/1	
		CANADA-GOV T 5	5.0	1,750	2,605	216,807	2037/6/1	
		CANADA-GOV T 5.75	5.75	250	338	28,153	2029/6/1	
		CANADA-GOV T 5.75	5.75	500	742	61,783	2033/6/1	
		CANADA-GOV T 8	8.0	700	1,008	83,898	2027/6/1	
	小	計	-	-	-	3,209,295	-	
(メキシコ)	国債証券	MEXICAN BONOS 10	10.0	千メキシコペソ 32,000	千メキシコペソ 36,514	211,052	2024/12/5	
		MEXICAN BONOS 5.75	5.75	20,000	19,058	110,157	2026/3/5	
		MEXICAN BONOS 6.5	6.5	52,000	51,819	299,514	2022/6/9	
		MEXICAN BONOS 7.5	7.5	25,000	26,059	150,625	2027/6/3	
		MEXICAN BONOS 7.75	7.75	6,000	6,436	37,201	2031/5/29	
		MEXICAN BONOS 7.75	7.75	11,000	11,859	68,545	2034/11/23	
		MEXICAN BONOS 8	8.0	27,000	28,240	163,229	2023/12/7	
		MEXICAN BONOS 8.5	8.5	28,000	31,311	180,980	2029/5/31	
		MEXICAN BONOS 8.5	8.5	40,000	45,877	265,172	2038/11/18	
	小	計	-	-	-	1,486,478	-	
(ユ - ロ)				千ユーロ	千ユーロ			
(ドイツ)	国債証券	BUNDESUBL-173 0	-	2,500	2,521	307,669	2021/4/9	
		BUNDESUBL-174 0	-	3,000	3,035	370,327	2021/10/8	
		BUNDESUBL-176 0	-	1,000	1,018	124,226	2022/10/7	
		DEUTSCHLAND REP 0	-	3,400	3,507	427,996	2026/8/15	
		DEUTSCHLAND REP 0	-	500	513	62,667	2029/8/15	
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	1,800	1,890	230,673	2027/2/15	
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	2,900	3,055	372,751	2028/8/15	
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	2,400	2,526	308,317	2029/2/15	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5	2,500	2,636	321,633	2025/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5	1,400	1,487	181,450	2026/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5	1,500	1,607	196,093	2027/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5	2,000	2,147	262,023	2028/2/15
		DEUTSCHLAND REP 1		1.0	1,300	1,396	170,342	2024/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1		1.0	2,050	2,228	271,946	2025/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1.25		1.25	1,450	1,867	227,910	2048/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1.5		1.5	500	534	65,166	2023/2/15
		DEUTSCHLAND REP 1.5		1.5	1,300	1,395	170,228	2023/5/15
		DEUTSCHLAND REP 1.5		1.5	2,000	2,185	266,679	2024/5/15
		DEUTSCHLAND REP 1.75		1.75	2,200	2,334	284,878	2022/7/4
		DEUTSCHLAND REP 1.75		1.75	4,000	4,393	536,048	2024/2/15
		DEUTSCHLAND REP 2		2.0	1,500	1,645	200,772	2023/8/15
		DEUTSCHLAND REP 2.25		2.25	1,400	1,469	179,334	2021/9/4
		DEUTSCHLAND REP 2.5		2.5	500	517	63,104	2021/1/4
		DEUTSCHLAND REP 2.5		2.5	2,200	3,451	421,172	2044/7/4
		DEUTSCHLAND REP 2.5		2.5	2,100	3,367	410,809	2046/8/15
		DEUTSCHLAND REP 3.25		3.25	1,200	2,045	249,611	2042/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4		4.0	1,800	3,042	371,207	2037/1/4
		DEUTSCHLAND REP 4.25		4.25	950	1,734	211,657	2039/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4.75		4.75	1,600	2,309	281,813	2028/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4.75		4.75	4,300	7,380	900,502	2034/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4.75		4.75	1,150	2,260	275,787	2040/7/4
		DEUTSCHLAND REP 5.5		5.5	900	1,480	180,665	2031/1/4
		DEUTSCHLAND REP 5.625		5.625	1,000	1,492	182,138	2028/1/4
		DEUTSCHLAND REP 6.25		6.25	1,200	1,536	187,524	2024/1/4
		DEUTSCHLAND REP 6.25		6.25	500	834	101,809	2030/1/4
		DEUTSCHLAND REP 6.5		6.5	1,000	1,531	186,832	2027/7/4
(イタリア)	国債証券	BTPS 0.05		0.05	1,000	1,003	122,417	2021/4/15
		BTPS 0.35		0.35	1,500	1,512	184,515	2021/11/1
		BTPS 0.45		0.45	1,500	1,513	184,678	2021/6/1
		BTPS 0.65		0.65	2,000	2,028	247,511	2023/10/15
		BTPS 0.9		0.9	2,250	2,298	280,471	2022/8/1
		BTPS 0.95		0.95	3,000	3,071	374,741	2023/3/1
		BTPS 0.95		0.95	2,000	2,048	249,922	2023/3/15
		BTPS 1		1.0	2,300	2,355	287,414	2022/7/15
		BTPS 1.2		1.2	1,000	1,027	125,317	2022/4/1
		BTPS 1.25		1.25	1,600	1,643	200,469	2026/12/1
		BTPS 1.35		1.35	2,000	2,060	251,440	2022/4/15
		BTPS 1.45		1.45	2,000	2,074	253,092	2022/9/15
		BTPS 1.45		1.45	1,800	1,880	229,386	2024/11/15
		BTPS 1.45		1.45	1,000	1,041	127,084	2025/5/15
		BTPS 1.5		1.5	2,700	2,818	343,895	2025/6/1
		BTPS 1.6		1.6	1,200	1,261	153,905	2026/6/1

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期				末									
				利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
			BTPS 1.65	1.65		2,400			2,458	299,980	2032/3/1						
			BTPS 1.85	1.85		1,000			1,061	129,500	2024/5/15						
			BTPS 2	2.0		2,300			2,469	301,310	2025/12/1						
			BTPS 2	2.0		1,600			1,724	210,384	2028/2/1						
			BTPS 2.05	2.05		1,500			1,617	197,319	2027/8/1						
			BTPS 2.1	2.1		1,000			1,079	131,713	2026/7/15						
			BTPS 2.15	2.15		500			522	63,689	2021/12/15						
			BTPS 2.2	2.2		1,000			1,088	132,867	2027/6/1						
			BTPS 2.25	2.25		1,200			1,277	155,896	2036/9/1						
			BTPS 2.3	2.3		600			625	76,375	2021/10/15						
			BTPS 2.45	2.45		1,100			1,213	148,011	2033/9/1						
			BTPS 2.5	2.5		600			656	80,083	2024/12/1						
			BTPS 2.5	2.5		1,100			1,211	147,782	2025/11/15						
			BTPS 2.7	2.7		2,050			2,254	275,057	2047/3/1						
			BTPS 2.8	2.8		300			343	41,867	2028/12/1						
			BTPS 2.8	2.8		900			960	117,244	2067/3/1						
			BTPS 2.95	2.95		1,000			1,150	140,366	2038/9/1						
			BTPS 3	3.0		3,500			4,075	497,265	2029/8/1						
			BTPS 3.1	3.1		1,700			1,979	241,474	2040/3/1						
			BTPS 3.25	3.25		1,500			1,807	220,503	2046/9/1						
			BTPS 3.35	3.35		850			1,029	125,582	2035/3/1						
			BTPS 3.45	3.45		1,600			1,987	242,526	2048/3/1						
			BTPS 3.5	3.5		1,900			2,304	281,187	2030/3/1						
			BTPS 3.75	3.75		2,500			2,621	319,852	2021/3/1						
			BTPS 3.75	3.75		2,000			2,108	257,255	2021/5/1						
			BTPS 3.75	3.75		3,200			3,401	415,001	2021/8/1						
			BTPS 3.75	3.75		2,000			2,298	280,427	2024/9/1						
			BTPS 3.85	3.85		400			528	64,439	2049/9/1						
			BTPS 4	4.0		2,100			2,739	334,263	2037/2/1						
			BTPS 4.5	4.5		2,300			2,627	320,617	2023/5/1						
			BTPS 4.5	4.5		3,000			3,508	428,020	2024/3/1						
			BTPS 4.5	4.5		1,800			2,207	269,306	2026/3/1						
			BTPS 4.75	4.75		2,600			2,815	343,501	2021/9/1						
			BTPS 4.75	4.75		2,500			2,901	354,066	2023/8/1						
			BTPS 4.75	4.75		2,500			3,259	397,630	2028/9/1						
			BTPS 4.75	4.75		1,600			2,359	287,873	2044/9/1						
			BTPS 5	5.0		2,000			2,221	271,013	2022/3/1						
			BTPS 5	5.0		1,000			1,224	149,437	2025/3/1						
			BTPS 5	5.0		2,070			2,946	359,547	2034/8/1						
			BTPS 5	5.0		1,800			2,658	324,320	2039/8/1						
			BTPS 5	5.0		1,700			2,512	306,533	2040/9/1						
			BTPS 5.5	5.5		1,200			1,375	167,865	2022/9/1						
			BTPS 5.5	5.5		2,000			2,307	281,572	2022/11/1						
			BTPS 5.75	5.75		1,700			2,536	309,505	2033/2/1						

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		BTPS 6		6.0	2,700	4,008	489,113	2031/5/1
		BTPS 6.5		6.5	3,700	5,233	638,553	2027/11/1
		BTPS 7.25		7.25	400	569	69,502	2026/11/1
		BTPS 9		9.0	300	400	48,814	2023/11/1
	(フランス)	国債証券		—	3,000	3,021	368,712	2021/2/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	4,200	4,237	517,012	2021/5/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,000	2,027	247,375	2022/2/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,200	2,233	272,534	2022/5/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,000	2,038	248,722	2023/3/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	5,000	5,105	622,873	2024/3/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,200	2,243	273,688	2025/3/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	4,000	3,993	487,278	2029/11/25
		FRANCE O. A. T. 0.25		0.25	2,400	2,481	302,785	2026/11/25
		FRANCE O. A. T. 0.5		0.5	2,900	3,038	370,763	2025/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.5		0.5	3,500	3,676	448,604	2026/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.5		0.5	3,300	3,464	422,668	2029/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.75		0.75	3,300	3,542	432,218	2028/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.75		0.75	1,700	1,825	222,682	2028/11/25
		FRANCE O. A. T. 1		1.0	2,050	2,212	269,945	2025/11/25
		FRANCE O. A. T. 1		1.0	2,500	2,723	332,333	2027/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.25		1.25	1,700	1,932	235,843	2034/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.25		1.25	2,400	2,727	332,809	2036/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.5		1.5	3,650	4,229	516,047	2031/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	4,000	4,322	527,405	2023/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	2,300	2,549	311,036	2024/11/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	2,900	3,578	436,639	2039/6/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	800	1,038	126,730	2066/5/25
		FRANCE O. A. T. 2		2.0	3,000	3,960	483,163	2048/5/25
		FRANCE O. A. T. 2.25		2.25	1,900	2,056	250,923	2022/10/25
		FRANCE O. A. T. 2.25		2.25	3,400	3,816	465,676	2024/5/25
		FRANCE O. A. T. 2.5		2.5	3,500	4,399	536,829	2030/5/25
		FRANCE O. A. T. 2.75		2.75	4,050	4,992	609,097	2027/10/25
		FRANCE O. A. T. 3		3.0	5,000	5,431	662,666	2022/4/25
		FRANCE O. A. T. 3.25		3.25	2,500	2,681	327,212	2021/10/25
		FRANCE O. A. T. 3.25		3.25	2,200	3,529	430,615	2045/5/25
		FRANCE O. A. T. 3.5		3.5	2,500	3,110	379,457	2026/4/25
		FRANCE O. A. T. 3.75		3.75	3,400	3,602	439,566	2021/4/25
		FRANCE O. A. T. 4		4.0	2,000	3,288	401,195	2038/10/25
		FRANCE O. A. T. 4		4.0	1,170	2,294	279,993	2055/4/25
		FRANCE O. A. T. 4		4.0	1,400	2,873	350,635	2060/4/25
		FRANCE O. A. T. 4.25		4.25	3,000	3,560	434,448	2023/10/25
		FRANCE O. A. T. 4.5		4.5	2,900	5,223	637,277	2041/4/25
		FRANCE O. A. T. 4.75		4.75	2,200	3,670	447,870	2035/4/25
		FRANCE O. A. T. 5.5		5.5	2,750	4,189	511,179	2029/4/25

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			FRANCE O. A. T. 5. 75	5. 75	2, 800	4, 800	585, 676	2032/10/25
			FRANCE O. A. T. 6	6. 0	3, 000	4, 123	503, 082	2025/10/25
			FRANCE O. A. T. 8. 5	8. 5	600	785	95, 794	2023/ 4 /25
(オランダ)	国債証券		NETHERLANDS GOVT 0	—	1, 800	1, 823	222, 435	2022/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 0	—	2, 000	2, 043	249, 320	2024/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 25	0. 25	1, 700	1, 764	215, 228	2025/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 25	0. 25	300	311	38, 024	2029/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 5	0. 5	1, 500	1, 586	193, 553	2026/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 5	0. 5	600	634	77, 439	2040/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 75	0. 75	1, 400	1, 511	184, 385	2027/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 75	0. 75	1, 200	1, 301	158, 843	2028/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 1. 75	1. 75	1, 600	1, 735	211, 739	2023/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 2	2. 0	1, 000	1, 115	136, 127	2024/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 2. 25	2. 25	1, 500	1, 612	196, 746	2022/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 2. 5	2. 5	1, 000	1, 329	162, 161	2033/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 2. 75	2. 75	1, 200	1, 987	242, 436	2047/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 3. 25	3. 25	800	849	103, 624	2021/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 3. 75	3. 75	700	795	97, 029	2023/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 3. 75	3. 75	1, 300	2, 308	281, 607	2042/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 4	4. 0	1, 100	1, 827	223, 015	2037/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 5. 5	5. 5	700	1, 028	125, 521	2028/ 1 /15
(スペイン)	国債証券		SPANISH GOV' T 0. 05	0. 05	1, 100	1, 105	134, 931	2021/ 1 /31
			SPANISH GOV' T 0. 25	0. 25	3, 000	3, 049	372, 069	2024/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 0. 4	0. 4	2, 000	2, 036	248, 461	2022/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 0. 45	0. 45	500	511	62, 375	2022/10/31
			SPANISH GOV' T 0. 75	0. 75	2, 000	2, 038	248, 724	2021/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 1. 3	1. 3	2, 700	2, 916	355, 899	2026/10/31
			SPANISH GOV' T 1. 4	1. 4	2, 000	2, 185	266, 613	2028/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 1. 4	1. 4	1, 600	1, 748	213, 310	2028/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 1. 45	1. 45	600	656	80, 143	2027/10/31
			SPANISH GOV' T 1. 45	1. 45	2, 900	3, 185	388, 610	2029/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 1. 5	1. 5	1, 200	1, 315	160, 510	2027/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 1. 6	1. 6	2, 200	2, 392	291, 898	2025/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 1. 85	1. 85	400	459	56, 119	2035/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 1. 95	1. 95	400	447	54, 610	2026/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 1. 95	1. 95	1, 700	1, 956	238, 766	2030/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 2. 15	2. 15	2, 000	2, 248	274, 341	2025/10/31
			SPANISH GOV' T 2. 35	2. 35	2, 200	2, 674	326, 283	2033/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 2. 7	2. 7	1, 750	2, 342	285, 816	2048/10/31
			SPANISH GOV' T 2. 75	2. 75	2, 100	2, 391	291, 787	2024/10/31
			SPANISH GOV' T 2. 9	2. 9	1, 400	1, 926	235, 084	2046/10/31
			SPANISH GOV' T 3. 45	3. 45	1, 100	1, 759	214, 646	2066/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 3. 8	3. 8	1, 900	2, 226	271, 701	2024/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 4. 2	4. 2	1, 650	2, 531	308, 924	2037/ 1 /31

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末		
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
				SPANISH GOV T 4.4	4.4	2,000	2,356	287,511	2023/10/31
				SPANISH GOV T 4.65	4.65	1,800	2,268	276,780	2025/7/30
				SPANISH GOV T 4.7	4.7	1,800	3,067	374,251	2041/7/30
				SPANISH GOV T 4.8	4.8	2,000	2,409	293,944	2024/1/31
				SPANISH GOV T 4.9	4.9	1,500	2,587	315,688	2040/7/30
				SPANISH GOV T 5.15	5.15	1,500	2,131	260,024	2028/10/31
				SPANISH GOV T 5.15	5.15	1,200	2,231	272,217	2044/10/31
				SPANISH GOV T 5.4	5.4	2,250	2,650	323,382	2023/1/31
				SPANISH GOV T 5.5	5.5	2,700	2,919	356,248	2021/4/30
				SPANISH GOV T 5.75	5.75	1,500	2,444	298,211	2032/7/30
				SPANISH GOV T 5.85	5.85	2,200	2,492	304,068	2022/1/31
				SPANISH GOV T 5.9	5.9	500	690	84,250	2026/7/30
				SPANISH GOV T 6	6.0	2,200	3,317	404,761	2029/1/31
(ベルギー)	国債証券			BELGIAN 0326 4	4.0	700	1,028	125,503	2032/3/28
				BELGIAN 0.8	0.8	1,300	1,382	168,645	2025/6/22
				BELGIAN 0.8	0.8	700	751	91,634	2027/6/22
				BELGIAN 0.8	0.8	500	537	65,619	2028/6/22
				BELGIAN 0291 5.5	5.5	2,000	2,941	358,911	2028/3/28
				BELGIAN 0304 5	5.0	1,600	2,710	330,695	2035/3/28
				BELGIAN 0308 4	4.0	700	774	94,473	2022/3/28
				BELGIAN 0320 4.25	4.25	1,500	2,596	316,782	2041/3/28
				BELGIAN 0321 4.25	4.25	4,300	4,677	570,706	2021/9/28
				BELGIAN 0324 4.5	4.5	1,000	1,302	158,965	2026/3/28
				BELGIAN 0325 4.25	4.25	1,700	1,931	235,673	2022/9/28
				BELGIAN 0328 2.25	2.25	1,500	1,649	201,226	2023/6/22
				BELGIAN 0332 2.6	2.6	500	569	69,448	2024/6/22
				BELGIAN 0333 3	3.0	1,500	2,080	253,821	2034/6/22
				BELGIAN 0338 0.5	0.5	1,000	1,043	127,325	2024/10/22
				BELGIAN 0338 2.25	2.25	500	707	86,380	2057/6/22
				BELGIAN 0344 1.45	1.45	400	465	56,831	2037/6/22
				BELGIAN 1	1.0	1,400	1,515	184,936	2026/6/22
				BELGIAN 1	1.0	1,300	1,430	174,477	2031/6/22
				BELGIAN 1.25	1.25	400	453	55,363	2033/4/22
		BELGIAN 1.6	1.6	1,150	1,397	170,528	2047/6/22		
		BELGIAN 1.9	1.9	500	623	76,081	2038/6/22		
		BELGIAN 2.15	2.15	500	711	86,828	2066/6/22		
		BELGIAN 3.75	3.75	800	1,375	167,768	2045/6/22		
(オーストリア)	国債証券			REP OF AUSTRIA 0	—	1,100	1,121	136,778	2023/7/15
				REP OF AUSTRIA 0.5	0.5	1,300	1,368	167,002	2027/4/20
				REP OF AUSTRIA 0.5	0.5	850	894	109,083	2029/2/20
				REP OF AUSTRIA 0.75	0.75	900	963	117,512	2026/10/20
				REP OF AUSTRIA 0.75	0.75	200	214	26,195	2028/2/20
				REP OF AUSTRIA 1.2	1.2	2,000	2,182	266,279	2025/10/20
		REP OF AUSTRIA 1.5	1.5	1,000	1,248	152,297	2047/2/20		

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		REP OF AUSTRIA 1.5	1.5	200	262	32,009	2086/11/2	
		REP OF AUSTRIA 1.65	1.65	1,100	1,211	147,830	2024/10/21	
		REP OF AUSTRIA 1.75	1.75	1,000	1,087	132,744	2023/10/20	
		REP OF AUSTRIA 2.4	2.4	600	787	96,126	2034/5/23	
		REP OF AUSTRIA 3.15	3.15	600	979	119,485	2044/6/20	
		REP OF AUSTRIA 3.4	3.4	1,100	1,229	149,978	2022/11/22	
		REP OF AUSTRIA 3.5	3.5	1,000	1,072	130,809	2021/9/15	
		REP OF AUSTRIA 3.65	3.65	1,000	1,100	134,265	2022/4/20	
		REP OF AUSTRIA 3.8	3.8	500	1,074	131,047	2062/1/26	
		REP OF AUSTRIA 4.15	4.15	1,300	2,149	262,249	2037/3/15	
		REP OF AUSTRIA 4.85	4.85	1,000	1,325	161,758	2026/3/15	
		REP OF AUSTRIA 6.25	6.25	1,000	1,493	182,191	2027/7/15	
(フィンランド)	国債証券	FINNISH GOV'T 0	—	400	405	49,489	2022/4/15	
		FINNISH GOV'T 0.5	0.5	400	421	51,444	2028/9/15	
		FINNISH GOV'T 0.5	0.5	1,400	1,476	180,087	2029/9/15	
		FINNISH GOV'T 0.75	0.75	500	539	65,863	2031/4/15	
		FINNISH GOV'T 1.125	1.125	200	226	27,610	2034/4/15	
		FINNISH GOV'T 1.5	1.5	1,000	1,069	130,437	2023/4/15	
		FINNISH GOV'T 1.625	1.625	1,000	1,061	129,483	2022/9/15	
		FINNISH GOV'T 2	2.0	1,000	1,107	135,184	2024/4/15	
		FINNISH GOV'T 2.625	2.625	500	748	91,314	2042/7/4	
		FINNISH GOV'T 2.75	2.75	600	748	91,345	2028/7/4	
		FINNISH GOV'T 3.5	3.5	1,000	1,055	128,737	2021/4/15	
		FINNISH GOV'T 4	4.0	1,000	1,246	152,113	2025/7/4	
(アイルランド)	国債証券	IRISH GOVT 0	—	400	405	49,477	2022/10/18	
		IRISH GOVT 0.8	0.8	700	720	87,894	2022/3/15	
		IRISH GOVT 0.9	0.9	700	757	92,384	2028/5/15	
		IRISH GOVT 1	1.0	1,000	1,077	131,517	2026/5/15	
		IRISH GOVT 1.1	1.1	1,100	1,212	147,985	2029/5/15	
		IRISH GOVT 1.5	1.5	400	472	57,606	2050/5/15	
		IRISH GOVT 1.7	1.7	300	361	44,056	2037/5/15	
		IRISH GOVT 2	2.0	1,000	1,307	159,519	2045/2/18	
		IRISH GOVT 2.4	2.4	600	744	90,777	2030/5/15	
		IRISH GOVT 3.4	3.4	1,000	1,163	141,902	2024/3/18	
		IRISH GOVT 3.9	3.9	500	571	69,783	2023/3/20	
		IRISH GOVT 5.4	5.4	1,500	1,951	238,159	2025/3/13	
		小 計			—	—	—	63,865,811
(イギリス)	国債証券	UK TSY GILT 0.5	0.5	1,800	1,796	261,306	2022/7/22	
		UK TSY GILT 0.625	0.625	1,000	998	145,185	2025/6/7	
		UK TSY GILT 0.75	0.75	750	753	109,625	2023/7/22	
		UK TSY GILT 0.875	0.875	700	703	102,353	2029/10/22	
		UK TSY GILT 1	1.0	1,000	1,015	147,761	2024/4/22	
		UK TSY GILT 1.25	1.25	1,500	1,563	227,408	2027/7/22	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末										
				利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
		UK TSY GILT 1.5		1.5		1,000				1,055		153,573					2026/7/22
		UK TSY GILT 1.5		1.5		1,700				1,773		257,949					2047/7/22
		UK TSY GILT 1.625		1.625		2,000				2,152		313,029					2028/10/22
		UK TSY GILT 1.625		1.625		100				110		16,074					2054/10/22
		UK TSY GILT 1.625		1.625		450				531		77,276					2071/10/22
		UK TSY GILT 1.75		1.75		3,000				3,094		450,099					2022/9/7
		UK TSY GILT 1.75		1.75		2,600				2,821		410,437					2037/9/7
		UK TSY GILT 1.75		1.75		1,650				1,823		265,200					2049/1/22
		UK TSY GILT 2		2.0		1,100				1,186		172,579					2025/9/7
		UK TSY GILT 2.25		2.25		2,700				2,863		416,495					2023/9/7
		UK TSY GILT 2.5		2.5		1,600				2,335		339,748					2065/7/22
		UK TSY GILT 2.75		2.75		1,700				1,867		271,673					2024/9/7
		UK TSY GILT 3.25		3.25		1,600				2,239		325,821					2044/1/22
		UK TSY GILT 3.5		3.5		2,550				3,740		544,099					2045/1/22
		UK TSY GILT 3.5		3.5		1,450				2,682		390,131					2068/7/22
		UK TSY GILT 3.75		3.75		1,500				1,581		229,998					2021/9/7
		UK TSY GILT 3.75		3.75		1,600				2,664		387,612					2052/7/22
		UK TSY GILT 4		4.0		1,500				1,613		234,663					2022/3/7
		UK TSY GILT 4		4.0		1,700				3,216		467,820					2060/1/22
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,100				1,405		204,404					2027/12/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,400				1,939		282,089					2032/6/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,050				1,534		223,220					2036/3/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,350				2,064		300,331					2039/9/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,300				2,015		293,149					2040/12/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,500				2,501		363,799					2046/12/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,400				2,423		352,583					2049/12/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,700				3,194		464,630					2055/12/7
		UK TSY GILT 4.5		4.5		1,100				1,614		234,815					2034/9/7
		UK TSY GILT 4.5		4.5		1,350				2,213		321,934					2042/12/7
		UK TSY GILT 4.75		4.75		1,450				2,042		297,150					2030/12/7
		UK TSY GILT 4.75		4.75		1,200				1,925		280,110					2038/12/7
		UK TSY GILT 5		5.0		1,600				1,958		284,880					2025/3/7
		UK TSY GILT 6		6.0		950				1,384		201,410					2028/12/7
		UK TSY GILT 8		8.0		1,320				1,462		212,791					2021/6/7
	小	計		—		—				—		11,035,227					—
(スウェーデン)	国債証券	SWEDISH GOVRNMNT 0.75		0.75		4,000			千スウェーデンクローナ	4,271		49,934					2028/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 1		1.0		7,400				7,982		93,316					2026/11/12
		SWEDISH GOVRNMNT 1.5		1.5		7,000				7,488		87,540					2023/11/13
		SWEDISH GOVRNMNT 2.5		2.5		5,000				5,740		67,109					2025/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 3.5		3.5		8,000				8,754		102,337					2022/6/1
		SWEDISH GOVRNMNT 3.5		3.5		4,600				7,191		84,065					2039/3/30
		SWEDISH GOVRNMNT 5		5.0		7,800				8,193		95,786					2020/12/1
	小	計		—		—			千スウェーデンクローナ	—		580,091					—

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ノルウェー)	国債証券	NORWEGIAN GOV T 1.5	1.5	千ノルウェークロネ 3,500	千ノルウェークロネ 3,533	42,937	2026/2/19	
		NORWEGIAN GOV T 1.75	1.75	5,000	5,110	62,092	2025/3/13	
		NORWEGIAN GOV T 1.75	1.75	2,700	2,766	33,615	2029/9/6	
		NORWEGIAN GOV T 2	2.0	6,000	6,136	74,553	2023/5/24	
		NORWEGIAN GOV T 2	2.0	4,000	4,178	50,767	2028/4/26	
		NORWEGIAN GOV T 3	3.0	4,000	4,280	52,006	2024/3/14	
		NORWEGIAN GOV T 3.75	3.75	6,000	6,207	75,424	2021/5/25	
小 計			—	—	—	391,397	—	
(デンマーク)	国債証券	DENMARK - BULLET 0.25	0.25	千デンマーククロネ 3,500	千デンマーククロネ 3,531	57,675	2020/11/15	
		DENMARK - BULLET 0.5	0.5	8,100	8,673	141,637	2027/11/15	
		DENMARK - BULLET 1.5	1.5	5,000	5,413	88,402	2023/11/15	
		DENMARK - BULLET 1.75	1.75	6,000	6,805	111,128	2025/11/15	
		DENMARK - BULLET 3	3.0	7,000	7,498	122,448	2021/11/15	
		DENMARK - BULLET 4.5	4.5	11,500	11,925	358,049	2039/11/15	
小 計			—	—	—	879,343	—	
(ポーランド)	国債証券	POLAND GOVT BOND 1.75	1.75	千ポーランドズロチ 3,000	千ポーランドズロチ 3,015	86,427	2021/7/25	
		POLAND GOVT BOND 2	2.0	2,000	2,013	57,692	2021/4/25	
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	4,500	4,659	133,535	2026/7/25	
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	3,000	3,099	88,817	2027/7/25	
		POLAND GOVT BOND 3.25	3.25	8,900	9,523	272,929	2025/7/25	
		POLAND GOVT BOND 4	4.0	2,700	2,943	84,346	2023/10/25	
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	4,000	4,306	123,409	2021/10/25	
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	2,400	2,670	76,537	2022/9/23	
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	1,400	1,857	53,244	2029/4/25	
小 計			—	—	—	976,939	—	
(オーストラリア)	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	1.5	千オーストラリアドル 1,400	千オーストラリアドル 1,438	108,297	2031/6/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 1.75	1.75	300	302	22,770	2020/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2	2.0	1,000	1,021	76,952	2021/12/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	2,000	2,084	156,992	2022/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	3,000	3,264	245,801	2028/5/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.5	2.5	1,350	1,519	114,392	2030/5/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	2,500	2,707	203,901	2024/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	2,200	2,472	186,152	2027/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	1,800	2,047	154,143	2028/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	1,300	1,487	112,005	2029/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	800	943	71,041	2035/6/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3	3.0	1,100	1,394	104,993	2047/3/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	1,900	2,130	160,453	2025/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	2,100	2,480	186,783	2029/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	1,150	1,459	109,915	2039/6/21	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.75	3.75	1,200	1,615	121,654	2037/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 4.25	4.25	2,150	2,578	194,144	2026/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 4.5	4.5	1,400	1,946	146,533	2033/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 4.75	4.75	2,300	2,905	218,790	2027/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 5.5	5.5	2,000	2,309	173,920	2023/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 5.75	5.75	2,800	2,993	225,373	2021/5/15	
		AUSTRALIAN GOVT. 5.75	5.75	2,500	2,816	212,091	2022/7/15	
	小	計	—	—	—	3,307,106	—	
(シンガポール)	国債証券	SINGAPORE GOV'T 2.25	2.25	1,100	1,111	89,785	2021/6/1	
		SINGAPORE GOV'T 2.75	2.75	1,200	1,248	100,878	2023/7/1	
		SINGAPORE GOV'T 2.75	2.75	400	454	36,703	2042/4/1	
		SINGAPORE GOV'T 2.75	2.75	700	793	64,124	2046/3/1	
		SINGAPORE GOV'T 2.875	2.875	400	443	35,841	2030/9/1	
		SINGAPORE GOV'T 3	3.0	700	745	60,201	2024/9/1	
		SINGAPORE GOV'T 3.125	3.125	800	833	67,363	2022/9/1	
		SINGAPORE GOV'T 3.375	3.375	950	1,122	90,669	2033/9/1	
		SINGAPORE GOV'T 3.5	3.5	1,800	2,023	163,499	2027/3/1	
	小	計	—	—	—	709,066	—	
(マレーシア)	国債証券	MALAYSIA GOVT 3.418	3.418	7,000	7,059	186,660	2022/8/15	
		MALAYSIA GOVT 3.502	3.502	7,900	7,937	209,866	2027/5/31	
		MALAYSIA GOVT 3.955	3.955	5,300	5,485	145,035	2025/9/15	
		MALAYSIA GOVT 4.498	4.498	5,000	5,382	142,301	2030/4/15	
		MALAYSIA GOVT 4.736	4.736	3,000	3,271	86,494	2046/3/15	
	小	計	—	—	—	770,358	—	
(南アフリカ)	国債証券	REP SOUTH AFRICA 6.5	6.5	60,000	41,310	314,369	2041/2/28	
		REP SOUTH AFRICA 6.75	6.75	16,000	15,986	121,655	2021/3/31	
		REP SOUTH AFRICA 7	7.0	59,000	49,536	376,972	2031/2/28	
		REP SOUTH AFRICA 8	8.0	27,500	25,462	193,767	2030/1/31	
	小	計	—	—	—	1,006,764	—	
	合	計	—	—	—	169,433,468	—	

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

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2019年12月17日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 169,433,469	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,747,300	98.4
投 資 信 託 財 産 総 額	172,180,769	1.6
		100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※期末における外貨建資産（171,602,207千円）の投資信託財産総額（172,180,769千円）に対する比率は99.7%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.56円、1カナダドル=83.20円、1メキシコペソ=5.78円、1ユーロ=122.01円、1英ポンド=145.46円、1スウェーデンクローナ=11.69円、1ノルウェークローネ=12.15円、1デンマーククローネ=16.33円、1ポーランドズロチ=28.66円、1オーストラリアドル=75.30円、1シンガポールドル=80.80円、1マレーシアリンギット=26.44円、1南アフリカランド=7.61円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	173,190,376,657円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,588,753,970
公 社 債(評価額)	169,433,469,191
未 収 入 金	1,009,996,247
未 収 利 息	1,093,891,665
前 払 費 用	64,265,584
(B) 負 債	1,297,746,532
未 払 金	1,009,610,339
未 払 解 約 金	288,134,468
未 払 利 息	1,725
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	171,892,630,125
元 本	94,197,787,250
次 期 繰 越 損 益 金	77,694,842,875
(D) 受 益 権 総 口 数	94,197,787,250口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	18,248円

※当期における期首元本額96,220,120,290円、期中追加設定元本額19,281,670,482円、期中一部解約元本額21,304,003,522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2018年12月18日 至2019年12月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,862,550,604円
受 取 利 息	3,862,909,631
支 払 利 息	△ 359,027
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,383,483,514
売 買 益	9,490,306,434
売 買 損	△ 7,106,822,920
(C) 信 託 報 酬 等	△ 61,607,846
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	6,184,426,272
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	72,674,184,817
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	15,131,895,633
(G) 解 約 差 損 益 金	△16,295,663,847
(H) 計 (D + E + F + G)	77,694,842,875
次 期 繰 越 損 益 金(H)	77,694,842,875

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	21,416,234,918円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	105,090,890円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	653,338,604円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	558,555円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,771,536,835円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	748,096,890円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	890,673,798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>	123,648,852円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	136,965,014円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,233,947,890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)	8,807,362円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,543,643,762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)	31,937,213円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,892,409,294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)	90,257,895円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,151,843,262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)	129,206,353円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,620,816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)	71,166,457円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	10,187,665,851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)	151,244,659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)	413,794,737円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	21,944,188円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	171,764,970円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	209,755,424円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	104,353,401円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	228,446,383円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	39,453,718円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	178,930,457円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,885,160円
イオン・バランス戦略ファンド	53,824,408円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	130,916,754円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,018,684円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	511,180,891円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,085,507円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	886,798円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	53,273,704円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	164,457,715円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	102,132,606円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,439,144円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	39,851,024円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,536,577円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	18,271,008円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,260,435,983円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	40,500,450円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	21,829,928円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	563,635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>	2,731,528,169円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	56,364円	SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	1,403,654,156円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	56,364円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,798,596,392円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	57,463円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	610,297,468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>	2,659,394,714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>	76,064,013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>	68,956,145円	SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	49,676,039円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,485,338,822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>	193,332,563円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,453,787,775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>	124,745,649円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,406,346,106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>	862,645,245円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,825,379円		

■ お知らせ

<約款変更について>

- ・委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。(適用日：2019年4月1日)

マネーインカム・マザーファンド

第12期（2019年4月16日から2020年4月13日まで）

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

■ 最近5期の運用実績

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

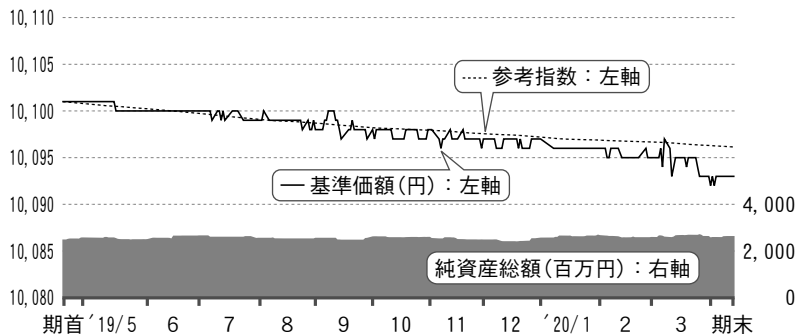
年月日	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比
	騰落率	率	騰落率	率	
(期首) 2019年4月15日	円 10,101	% -	100.85	% -	% 72.5
4月末	10,101	0.0	100.85	△0.0	70.1
5月末	10,100	△0.0	100.85	△0.0	71.9
6月末	10,100	△0.0	100.84	△0.0	70.2
7月末	10,099	△0.0	100.83	△0.0	73.0
8月末	10,098	△0.0	100.83	△0.0	70.8
9月末	10,098	△0.0	100.83	△0.0	65.3
10月末	10,098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

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

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

基準価額等の推移



期首	10,101円
期末	10,093円
騰落率	-0.1%

※参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドの参考指数は、無担保コール翌日物です。

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

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

当ファンドは、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

下落要因

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

▶ 投資環境について (2019年4月16日から2020年4月13日まで)

当期の短期金利は小幅に上昇しました。

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

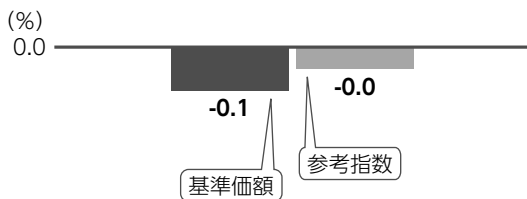
国庫短期証券3ヵ月物利回りは、日銀当座預金付利金利である-0.10%程度を上限に、マイナス圏で推移しました。国庫短期証券3ヵ月物利回りは期首-0.190%に対し、期末は-0.152%と小幅に上昇しました。

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

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

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

基準価額と参考指数の対比 (騰落率)



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

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

2 今後の運用方針

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

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

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

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

期中の平均基準価額は10,097円です。

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

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

公社債

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

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

利害関係人との取引状況

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

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

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

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

マネーインカム・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2020年4月13日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

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

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

B 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債

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

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 投資信託財産の構成

(2020年4月13日現在)

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

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年4月13日現在)

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

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

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

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

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

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2019年4月16日 至2020年4月13日)

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

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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