

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド
第12期（2023年11月30日決算）運用報告書（全体版）

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

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

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

記

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

「資産、負債、元本及び基準価額の状況」に関する注記事項

第21期（2023年11月30日決算） 運用報告書（全体版） P42

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

以 上

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2011年12月9日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） 日本の取引所に上場している株式
当ファンドの運用方法	■マザーファンドへの投資を通じて、主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ■株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） ■株式への投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	■年1回（原則として毎年11月30日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みません。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 （ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。））

三井住友・ DCつみたてNISA・日本株 インデックスファンド 【運用報告書(全体版)】

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

第 **12** 期
決算日 2023年11月30日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

 **三井住友DSアセットマネジメント**
〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1
<https://www.smd-am.co.jp>

- 口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ

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

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	純資産額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
8期 (2019年12月2日)	円 26,719	円 0	% 5.3	2,611.46	% 5.5	% 97.8	% 2.3	百万円 31,181
9期 (2020年11月30日)	27,977	0	4.7	2,738.72	4.9	97.8	2.0	42,720
10期 (2021年11月30日)	31,333	0	12.0	3,073.26	12.2	97.8	2.4	58,388
11期 (2022年11月30日)	33,080	0	5.6	3,249.61	5.7	98.0	2.0	74,957
12期 (2023年11月30日)	40,507	0	22.5	3,986.65	22.7	98.4	1.6	109,683

※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。

※T O P I Xに関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）に帰属します。J P Xは、T O P I Xの算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの算出もしくは公表の停止またはT O P I Xにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、J P Xは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2022年11月30日	円 33,080	% -	3,249.61	% -	% 98.0	% 2.0
12月末	31,565	△ 4.6	3,101.25	△ 4.6	98.8	1.2
2023年1月末	32,954	△ 0.4	3,238.48	△ 0.3	99.0	1.0
2月末	33,260	0.5	3,269.12	0.6	99.1	1.0
3月末	33,819	2.2	3,324.74	2.3	97.7	2.4
4月末	34,726	5.0	3,414.45	5.1	97.9	2.2
5月末	35,974	8.7	3,537.93	8.9	98.2	1.9
6月末	38,688	17.0	3,805.00	17.1	98.4	1.6
7月末	39,262	18.7	3,861.80	18.8	98.9	1.3
8月末	39,423	19.2	3,878.51	19.4	98.9	1.2
9月末	39,624	19.8	3,898.26	20.0	98.1	1.9
10月末	38,430	16.2	3,781.64	16.4	97.9	2.2
(期末) 2023年11月30日	40,507	22.5	3,986.65	22.7	98.4	1.6

※騰落率は期首比です。

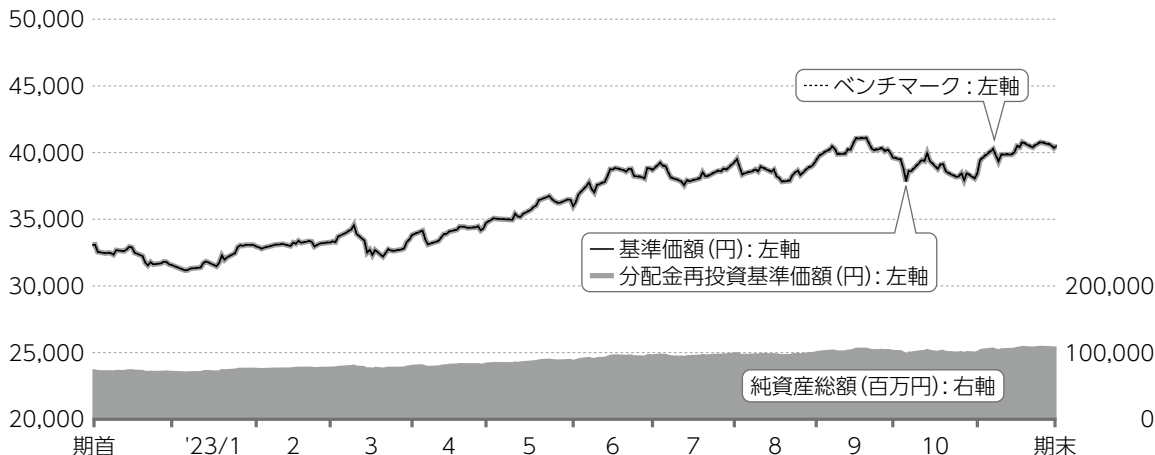
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※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(2022年12月1日から2023年11月30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	33,080円
期末	40,507円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+22.5% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)です。

※TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)に帰属します。JPXは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、JPXは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

基準価額の主な変動要因(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

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

上昇要因

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

下落要因

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

投資環境について(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

国内株式市場は上昇しました。

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

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

新年度に入ると、日銀の金融緩和方針維持による円安進展や海外投資家による日本

株買いが好感され、上値を追う動きとなりました。夏場に、日銀による長短金利操作の運用柔軟化が決定されると、米ドル高・円安の流れが一段進みTOPIXはバブル後の高値を更新しました。

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

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

当ファンド

期を通じて「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」を高位に組み入れました。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

●株式組入比率

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

●ポートフォリオの特性

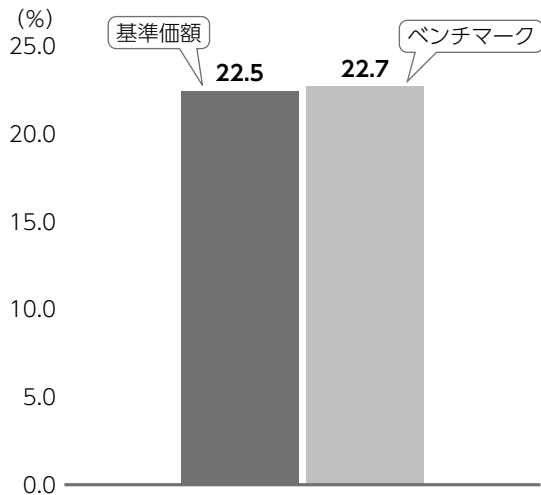
TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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

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

ベンチマークとの差異について(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

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

記載のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は+22.5%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+22.7%を0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 信託報酬等のコスト負担が日々生じたこと

分配金について(2022年12月1日から2023年11月30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	0
(対基準価額比率)	(0.00%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	30,507

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りとしたしました。
 なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

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

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

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」を高位に組み入れて運用を行います。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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。

3 お知らせ

約款変更について

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

(適用日：2023年8月29日)

1万口当たりの費用明細(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	64円	0.176%	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数) 期中の平均基準価額は36,261円です。
(投信会社)	(28)	(0.077)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(28)	(0.077)	販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(8)	(0.022)	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	1	0.002	売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(1)	(0.002)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数
(株式)	(-)	(-)	有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	2	0.006	その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数
(保管費用)	(-)	(-)	保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(2)	(0.005)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	67	0.184	

※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。

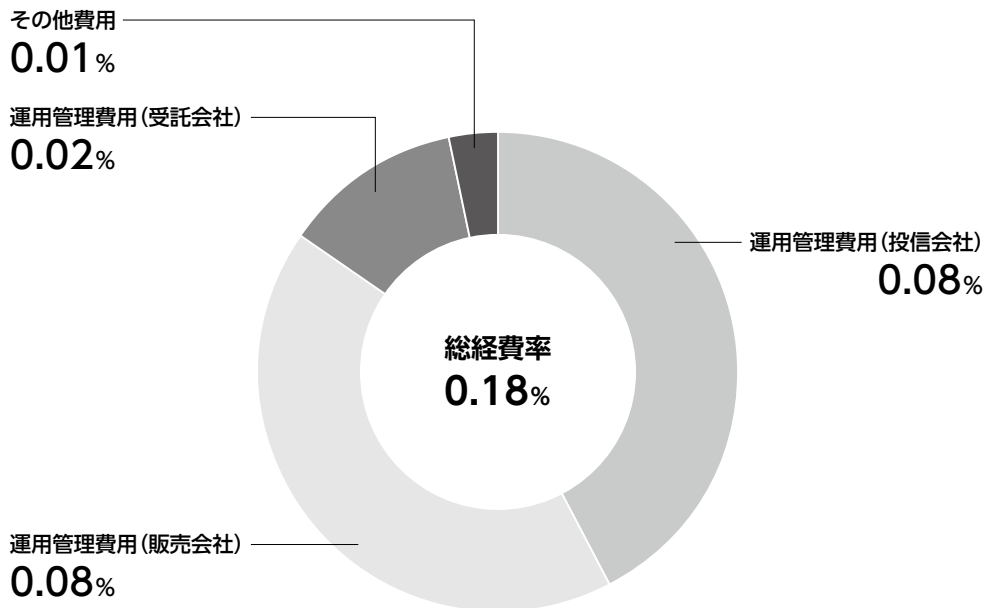
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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0.18%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2022年12月1日から2023年11月30日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	千口 4,506,545	千円 16,813,697	千口 263,173	千円 968,164

■ 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

(2022年12月1日から2023年11月30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)
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	37,554,661千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	248,112,176千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	0.15

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年12月1日から2023年11月30日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	B/A		うち利害関係人との取引状況 D	D/C	
株 式	百万円 26,323	百万円 9,992	% 38.0	百万円 11,231	百万円 2,481	% 22.1
株 式 先 物 取 引	49,745	696	1.4	50,698	711	1.4

※平均保有割合 36.3%

※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 250	百万円 75	百万円 4,187

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	1,969千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	17千円
(c) (b) / (a)	0.9%

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

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2023年11月30日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首(前期末)	期	末
	口 数	口 数	評 価 額
国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	千口 22,016,808	千口 26,260,180	千円 109,775,432

※国内株式インデックス・マザーファンド (B号) の期末の受益権総口数は67,612,101,406口です。

■ 投資信託財産の構成

(2023年11月30日現在)

項 目	期	末
	評 価 額	比 率
国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	千円 109,775,432	% 99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	176,289	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	109,951,722	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	109,951,722,477円
コール・ローン等	145,522,065
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	109,775,432,840
未 収 入 金	30,767,572
(B) 負 債	268,275,545
未 払 解 約 金	176,241,258
未 払 信 託 報 酬	89,245,170
そ の 他 未 払 費 用	2,789,117
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	109,683,446,932
元 本	27,077,492,077
次 期 繰 越 損 益 金	82,605,954,855
(D) 受 益 権 総 口 数	27,077,492,077口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	40,507円

※当期における期首元本額22,659,528,886円、期中追加設定元本額6,987,903,321円、期中一部解約元本額2,569,940,130円です。
 ※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。
 ※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2022年12月1日 至2023年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 48,400円
受 取 利 息	3,856
支 払 利 息	△ 52,256
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	18,047,517,288
売 買 益	18,938,295,400
売 買 損	△ 890,778,112
(C) 信 託 報 酬 等	△ 163,952,952
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	17,883,515,936
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	10,747,053,515
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	53,975,385,404
(配 当 等 相 当 額)	(40,430,273,179)
(売 買 損 益 相 当 額)	(13,545,112,225)
(G) 合 計(D + E + F)	82,605,954,855
次 期 繰 越 損 益 金(G)	82,605,954,855
追 加 信 託 差 損 益 金	53,975,385,404
(配 当 等 相 当 額)	(40,458,771,489)
(売 買 損 益 相 当 額)	(13,516,613,915)
分 配 準 備 積 立 金	28,630,569,451

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 ※株式投資の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投資には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。
 ※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 ※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	2,241,149,017円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	15,642,366,919
(c) 収益調整金	53,975,385,404
(d) 分配準備積立金	10,747,053,515
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	82,605,954,855
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	30,507.24
(f) 分配金	0
1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当 期
	0円

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

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第21期（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年2月17日）
運用方針	主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) TOPIX (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株比	株式先物率 (買建-売建)	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
17期（2019年12月2日）	円	%		%	%	%	百万円
17期（2019年12月2日）	27,359	5.5	2,611.46	5.5	97.7	2.3	174,398
18期（2020年11月30日）	28,704	4.9	2,738.72	4.9	97.7	2.0	180,486
19期（2021年11月30日）	32,212	12.2	3,073.26	12.2	97.7	2.4	197,054
20期（2022年11月30日）	34,074	5.8	3,249.61	5.7	97.9	2.0	222,819
21期（2023年11月30日）	41,803	22.7	3,986.65	22.7	98.3	1.6	282,638

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

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

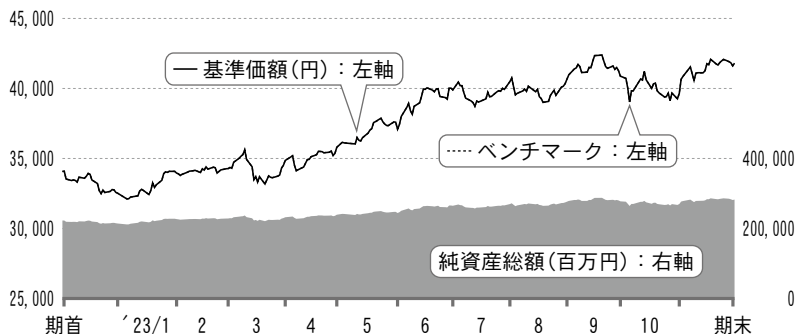
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	34,074円
期末	41,803円
騰落率	+22.7%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

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

上昇要因

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

下落要因

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

▶ 投資環境について（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

国内株式市場は上昇しました。

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

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

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

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

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

株式組入比率

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、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

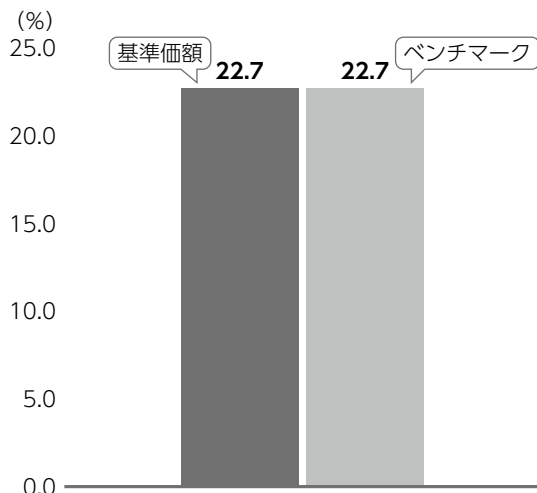
T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドはTOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとしています。記載のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+22.7%となり、ベンチマークの騰落率+22.7%を追随しました。

2 今後の運用方針

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 1万口当たりの費用明細（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

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

期中の平均基準価額は37,388円です。

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 11,978.5 (30,542.116)	千円 26,323,582 (-)	千株 6,907.916	千円 11,231,079

※金額は受渡し代金。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 49,745	百万円 50,698	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

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

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

(1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B A	%	うち利害関係人 との取引状況D	D C	%
株 式	百万円 9,992	百万円 26,323	38.0	百万円 2,481	百万円 11,231	22.1
株 式 先 物 取 引	696	49,745	1.4	711	50,698	1.4

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	百万円 250	百万円 75	百万円 4,187

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

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

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

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

（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 組入れ資産の明細（2023年11月30日現在）

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
	千株		千円	
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	3.9	4.1	15,703	
ニッスイ	106.9	115.6	85,243	
マルハニチロ	16.2	17.1	48,564	
雪国まいたけ	10.6	11.4	10,830	
カネコ種苗	5.3	4.7	6,683	
サカタのタネ	13.5	13.2	52,602	
ホクト	9.4	10.1	17,715	
鉱業 (0.4%)				
住石ホールディングス	21.8	14.4	11,116	
日鉄鉱業	4.3	4.5	25,425	
三井鉱山ホールディングス	5	5.5	15,499	
I N P E X	394	427.2	892,848	
石油資源開発	12.3	13.3	75,677	
K & O エナジーグループ	4.9	5.5	12,039	
建設業 (2.1%)				
ショーボンドホールディングス	14.5	15.7	94,592	
ミライト・ワン	37.2	38.1	70,351	
タマホーム	7.6	7.3	25,404	
日本アクア	5.9	5	4,675	
安藤・間	61.9	66.3	72,399	
東急建設	32.6	32.3	25,452	
コムシスホールディングス	35.9	37.5	120,262	
ビーアールホールディングス	22.2	21.6	7,754	
高松コンストラクショングループ	7.2	7.2	18,986	
東建コーポレーション	3.4	3.2	25,920	
ヤマウラ	7.6	6.9	9,922	
オリエンタル白石	41.3	44	14,520	
大成建設	74.2	75.7	380,846	
大林組	265.9	288.9	360,402	
清水建設	223.6	233.6	226,965	
飛島建設	10.4	9.6	12,470	
長谷工コーポレーション	76.9	83	150,935	
松井建設	2.7	8.2	6,355	
銭高組	2.1	1.5	5,775	
鹿島建設	164.9	179.1	418,467	
不動テトラ	6	5.6	12,258	
大末建設	3.7	—	—	
鉄建建設	7	6.7	13,085	
西松建設	13.1	13.9	54,404	
三井住友建設	63.2	65.6	26,108	

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
小野薬品工業	147.3	177	481,617	
久光製薬	17.2	19.5	90,051	
持田製薬	8.9	11	36,905	
参天製薬	1.44	155	216,845	
扶桑薬品工業	3.2	4	7,628	
ツムラ	24.1	28	78,260	
キッセイ薬品工業	11.8	15.5	47,352	
生化学工業	13.5	15.9	12,592	
栄研化学	11.9	17	27,999	
鳥居薬品	4	5	18,300	
JCRファーマ	26.2	28.5	37,734	
東和薬品	11.9	12.7	31,369	
富士製薬工業	6.6	7.9	12,324	
ゼリア新薬工業	10.5	11.3	22,893	
モーせいグループ	—	26.9	37,364	
第一三共	664.4	720.4	2,881,600	
杏林製薬	16.6	17.4	31,807	
大幸薬品	15.9	18.1	5,448	
ダイト	5.4	8	15,560	
大塚ホールディングス	174.4	172.5	981,352	
大正製薬ホールディングス	17.5	—	—	
ペプチドリーム	37.4	45	56,992	
あすか製薬ホールディングス	8.4	9.7	17,663	
サワイグループホールディングス	17.4	20	98,360	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	81.6	83.3	10,162	
ニチレキ	9.4	9.6	21,945	
ユシロ化学工業	10.5	5.8	9,964	
富士石油	20	22.1	8,066	
出光興産	84.4	91.6	371,529	
ENEOSホールディングス	1,378.6	1,317.1	769,713	
コスモエネルギーホールディングス	29	25	140,875	
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	43.3	42.2	138,795	
TOYO TIRE	44.1	47.4	116,343	
ブリヂストン	243.5	241.6	1,473,276	
住友ゴム工業	75.2	81.1	138,640	
藤倉コンポジット	6.6	—	—	
オカモト	4.5	4.1	22,345	
フコク	—	5	7,010	
ニッタ	7.6	8.2	30,709	
住友理工	15.6	13.8	14,269	
三ツ星ベルト	11.3	11.3	50,454	
バンドー化学	12.7	12.7	19,812	
ガラス・土石製品 (0.7%)				
日東紡績	9.4	10.5	47,197	

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

※銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	期		末	
	買	建額	売	建額
国内	百万円		百万円	
TOPIX	4,633		—	

■ 投資信託財産の構成

(2023年11月30日現在)

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	284,187,277,609円
コール・ローン等	3,532,670,222
株 式(評価額)	277,901,462,330
未 収 入 金	596,010,400
未 収 配 当 金	2,036,482,133
差 入 委 託 証 拠 金	120,652,524
(B) 負 債	1,548,319,526
未 払 金	395,461,400
未 払 解 約 金	1,152,851,240
そ の 他 未 払 費 用	6,886
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	282,638,958,083
元 本	67,612,101,406
次 期 繰 越 損 益 金	215,026,856,677
(D) 受 益 権 総 口 数	67,612,101,406口
1万口当たり基準価額(C/D)	41,803円

※当期における期首元本額65,393,298,021円、期中追加設定元本額11,963,349,687円、期中一部解約元本額9,744,546,302円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2022年12月1日 至2023年11月30日)

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

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

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,698,799,980円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	20,073,130円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	1,001,422,322円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）	8,796,845円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,466,421,362円	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,397,731,905円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,671,641,660円	バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	7,994,782円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	136,038,750円	SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	47,143,831円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	3,406,393円	SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	965,486,618円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	15,296,763円	SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	1,166,398,533円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	54,752,270円	SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	4,510,477,578円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	159,640,709円	SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	29,416,152円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	149,414,525円	SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	108,603,049円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	271,748,343円	SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	590,105,352円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,365,075,520円	SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	35,412,893円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	26,260,180,571円	SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	195,641,630円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	115,624,640円	SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	641,083,284円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	168,156,238円	SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	414,428,470円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	103,225,362円	SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	1,267,607,584円
イオン・バランス戦略ファンド	37,149,436円	SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	314,855円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	50,643,471円	SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	27,021,199円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	208,010,508円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	29,338,861円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	197,543,121円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	25,915,474円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	777,703,738円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	14,447,235円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	448,368,315円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	67,115,115円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	525,557,954円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	173,003,538円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	55,602,276円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	37,568,256円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	1,154,657,014円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	32,445,682円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	39,519,295円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	6,832,341円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	236,791,813円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	30,702,488円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	240,914,837円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	411,103,933円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,981,135円	SMAM・国内株式インデックスファンド・VA（適格機関投資家専用）	156,608,259円
日興FWS・日本株インデックス	1,902,897,918円	SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA＜適格機関投資家限定＞	157,255,373円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	68,065,303円	SMAM・グローバルバランスファンド（債券重視型）VA＜適格機関投資家限定＞	65,272,266円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	691,428円	SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	50,839,821円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	482,039円	SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	29,597,543円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	427,244円	SMAM・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	50,954,848円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	135,914円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞	28,238,310円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	230,889円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	45,469,182円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	554,713円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII＜適格機関投資家限定＞	85,247,790円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	7,852,953円	SMDAM・日米3資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	15,940,785円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	34,809,759円	三井住友・ニュー・アジア・ファンド（リスク3%）＜適格機関投資家限定＞	29,029,528円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。