

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/資産複合/インデックス型			
信託期間	無期限（設定日：2017年10月3日）			
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。			
主要投資対象	マザーファンド	対象指数	基本資産 配分比率	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	NOMURA-BPI（総合）	15%	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・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）	5%	
	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）	20%	
	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）	10%	
	外国株式インデックス・マザーファンド	MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）	20%	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）	10%	
	リート・インデックス・マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）	5%	
当ファンドの運用方法	外国リート・インデックス・マザーファンド	S&P先遣国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）	15%	
	<ul style="list-style-type: none"> ■マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。 ■各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ■実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対価の為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として為替ヘッジは行いません。 			
	組入制限	<p>当ファンド</p> <ul style="list-style-type: none"> ■株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 <p>国内債券パッシブ・マザーファンド</p> <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。 <p>ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド</p> <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。 <p>外国債券パッシブ・マザーファンド</p> <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。 <p>国内株式インデックス・マザーファンド（B号）</p> <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。 <p>外国株式インデックス・マザーファンド</p> <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。 <p>エマージング株式インデックス・マザーファンド</p> <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。 <p>リート・インデックス・マザーファンド</p> <ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資は行いません。 ■外貨建資産への投資は行いません。 <p>外国リート・インデックス・マザーファンド</p> <ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資は行いません。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 		
	分配方針	<ul style="list-style-type: none"> ■年1回（原則として毎年9月10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、経費控除後の剰子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 <p>※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。</p>		
	<p>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、市況動向によっては変更する場合があります。）</p>			

三井住友・ DCつみたてNISA・ 世界分散ファンド

【運用報告書(全体版)】

(2020年9月11日から2021年9月10日まで)

第 4 期

決算日 2021年9月10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、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。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)

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。

■ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) 合成指数		株式組入比率	株式先物比率 (買建-売建)	債券組入比率	投資信託組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率					
(設定日) 2017年10月3日	円 10,000	円 -	% -	100.00	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 0.1
1期 (2018年9月10日)	10,051	0	0.5	101.75	1.8	33.2	5.4	39.6	20.3	115
2期 (2019年9月10日)	10,442	0	3.9	106.37	4.5	33.6	5.5	38.8	20.7	295
3期 (2020年9月10日)	10,720	0	2.7	110.12	3.5	34.8	3.6	39.3	20.9	544
4期 (2021年9月10日)	12,869	0	20.0	133.41	21.1	35.9	2.5	39.1	21.2	1,014

※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、NOMURA-BPI (総合) 15%、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジベース) 5%、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) 20%、TOPIX (東証株価指数、配当込み) 10%、MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース) 20%、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) 10%、東証REIT指数 (配当込み) 5%およびS&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース) 15%の割合で組み合わせた合成指数で、当報告書作成時に知れた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、外国の指数については基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※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) 合成指数		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 率 比 (買建-売建)	債 券 組 入 率 比	投 資 信 託 証 券 組 入 率 比
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %				
(期 首) 2020年9月10日	10,720	—	110.12	—	34.8	3.6	39.3	20.9
9月末	10,614	△ 1.0	109.10	△ 0.9	34.4	3.9	39.5	20.7
10月末	10,450	△ 2.5	107.46	△ 2.4	34.0	3.2	40.3	19.5
11月末	11,123	3.8	114.54	4.0	35.3	3.5	39.0	20.8
12月末	11,314	5.5	116.62	5.9	36.2	2.9	38.6	21.1
2021年1月末	11,500	7.3	118.59	7.7	35.3	2.8	39.1	21.3
2月末	11,717	9.3	121.00	9.9	35.3	3.1	38.3	21.6
3月末	12,156	13.4	125.56	14.0	35.6	2.6	38.7	21.5
4月末	12,357	15.3	127.70	16.0	35.2	3.0	38.8	21.4
5月末	12,495	16.6	129.21	17.3	35.9	2.6	39.0	21.3
6月末	12,676	18.2	131.22	19.2	36.0	2.3	39.2	21.0
7月末	12,685	18.3	131.41	19.3	35.2	2.8	39.3	21.2
8月末	12,817	19.6	132.87	20.7	35.5	2.7	38.9	21.4
(期 末) 2021年9月10日	12,869	20.0	133.41	21.1	35.9	2.5	39.1	21.2

※騰落率は期首比です。

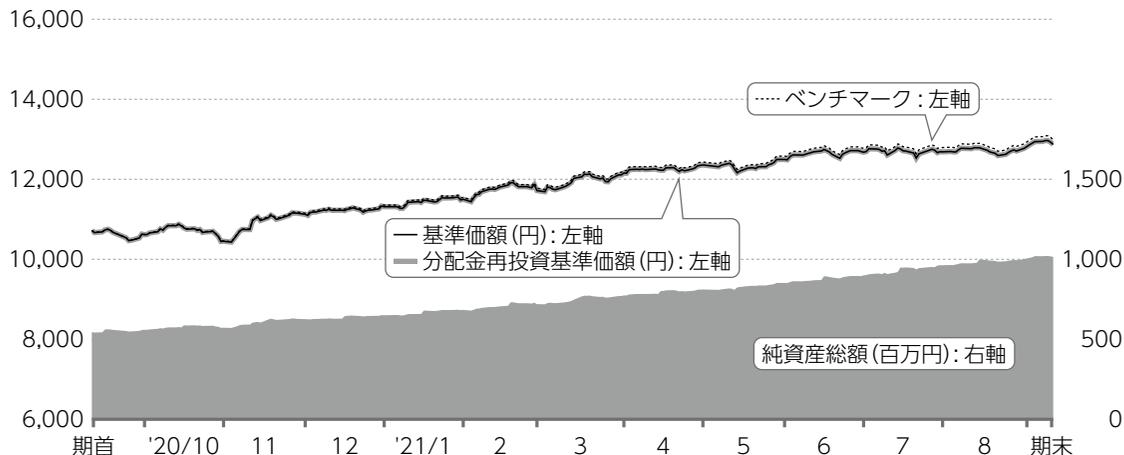
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※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(2020年9月11日から2021年9月10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	10,720円
期末	12,869円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+20.0% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI(総合)15%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)5%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)20%、TOPIX(東証株価指数、配当込み)10%、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)20%、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)10%、東証REIT指数(配当込み)5%およびS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)15%の割合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(2020年9月11日から2021年9月10日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資し、各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指しました。実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、為替ヘッジは行いませんでした。

上昇要因

- 国内株式、主要先進国・新興国の株式市場が上昇したこと
- 国内リート、グローバルリート市場が上昇したこと
- 米ドルやユーロ、新興国通貨に対して円安が進行したこと

下落要因

- 日本や米国、欧州の債券利回りが上昇(価格は下落)したこと

投資環境について(2020年9月11日から2021年9月10日まで)

期を通してみると、国内株式、先進国株式市場、新興国株式市場はそれぞれ上昇しました。債券市場では、先進国債券市場は米国や欧州、日本で利回りが上昇しました。グローバルリート市場、国内リート市場は上昇しました。外国為替市場では、米ドルやユーロなど主要通貨に対して円が下落しました。新興国通貨は、概ね円に対して上昇しました。

株式市場

●先進国外国株式

世界の主要国・中央銀行の景気支援的な政策対応の継続や、ワクチン接種の進展に伴う経済回復に対する期待等を背景に、期を通じて堅調に推移しました。

●国内株式

日本銀行の金融緩和スタンスが維持される中、米国を中心とした株価上昇等に連れる形で、株価は期を通してみれば、大幅に上昇しました。

●新興国株式

世界各国の中央銀行による金融緩和策の実施等を背景としたリスクセンチメント(投資家心理)の改善などを受け、新興国株式市場に投資資金が流入し、期を通してみれば、上昇しました。しかし、新型コロナウイルス変異型の感染拡大による新興国景気への懸念等を背景に、期の後半は上値の重い展開が続きました。

債券市場

●先進国外国債券

米回国債利回りは、経済活動の再開や堅調な企業業績などを背景に、株価が堅調に推移したこともあり、期の前半は上昇基調で推移しました。4月から期末にかけては、感染再拡大に伴うインフレ期待の低下などを受け、債券利回りは低下基調で推移しました。期間を通じて見ると上昇しました。

欧州では、感染拡大への懸念や、英国のEU(欧州連合)離脱に伴う通商協定交渉の行方等の不透明要因(12月下旬に合意されました)等も背景に年末まで低下基調で推移しました。しかし年明け以降は、米国債券利回りの上昇や欧州景気の回復期待等から、欧州の債券利回りが大きく上昇する相場となりました。5月中旬以降、期末にかけては、感染再拡大に伴うロックダウン(都市封鎖)の実施や、ECB(欧州中央銀行)の金融緩和の継続などを背景に、債券利回りは低下に転じる動きとなりました。期を通してみれば、欧州債券利回りは上昇しました。

●国内債券市場

長期債利回り(10年国債利回り)は世界的に株価が上昇傾向で推移したことや、米債券利回り上昇の影響等があった一方で、日本銀行による金融緩和が続く中で、新型コロナウイルスの感染拡大懸念等もくすぶり、期初は方向感に乏しいもみ合い相場となりました。年明け以降は、海外債券利回りの上昇や株価の上昇等も背景に、債券利回りは2月まで上昇基調で推移したものの、3月から期末にかけては日銀の金融緩和策継続の動きや米国債利回りの低下等も背景に、利回りは低下基調で推移しました。期間を通して見ると小幅上昇となりました。

リート市場

●グローバルリート

新型コロナワクチン接種の進展により経済回復期待が強まったことや、世界的な株価上昇に伴うリスクセンチメント改善の動き、主要先進国中央銀行の金融緩和スタンスの継続等を背景に、期間を通じて大幅に上昇しました。

●国内リート

ワクチン接種の進展による経済回復期待が強まったこと、世界的な株価上昇に伴うリスクセンチメントの改善、日銀の金融緩和スタンスの継続、国内債券利回りの落ち着き等を背景に、期を通じて大きく上昇する展開となりました。

為替市場

●米ドル・円

期初から2020年12月下旬まではFRB(米連邦準備制度理事会)による金融緩和スタンス継続等を背景に、米ドルが緩やかに下落する展開となりました。その後、年末以降は、米金利の上昇などを受け、総じて米ドルは底堅く推移しました。4月以降は、米国債利回りの低下等を背景に、米ドルの上値が重い相場展開となりました。

期間を通してみれば、米ドル高・円安となりました。

●ユーロ・円

期初から年末にかけてはもみ合いで推移しました。年明け以降から5月下旬にかけては、世界的な株高を受けたリスク選好姿勢の高まりなどを背景に、ユーロが上昇する展開となりました。しかし、その後は新型コロナウイルスの感染拡大を受け、リスク回避的な動きが強まり、ユーロが下落しました。

期間を通してみれば、ユーロ高・円安となりました。

●新興国通貨

世界各国の中央銀行による金融緩和や、ワクチン接種の進展から背景としたリスクセンチメントの改善等ら、メキシコペソや南アランドなどの通貨が円に対して、期を通じて大幅上昇する展開となりました。ま

た、期中に政策金利を引き上げたブラジルレアルは円に対して、期を通じて上昇する展開となりました。一方、中央銀行総裁の

解任等政治リスクの高まりなどを背景に、トルコリラが円に対して期を通してみれば下落しました。

ポートフォリオについて(2020年9月11日から2021年9月10日まで)

当ファンド

主としてマザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資を行い、各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

マザーファンドへの投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとしました。

なお、実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、対円での為替ヘッジを行っていません。

投資対象マザーファンド	投資対象資産	基本資産配分
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	15%
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	先進国債券 (除く日本、 為替ヘッジあり)	5%
外国債券パッシブ・マザーファンド	先進国債券 (除く日本)	20%
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	国内株式	10%
外国株式インデックス・マザーファンド	先進国株式 (除く日本)	20%
エマージング株式インデックス・マザーファンド	新興国株式	10%
Jリート・インデックス・マザーファンド	国内リート	5%
外国リート・インデックス・マザーファンド	外国リート	15%

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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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(日本除く、円ヘッジベース)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、ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラー(ポートフォリオとベンチマークのリターン乖離)を最小化するよう努めました。

ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行いました。

保有する外貨建資産については、為替のフルヘッジを原則としました。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、満期構成等を可能な限りベンチマークに近似させるよう調整しました。

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

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が拡大する場合には、現物株式のリバランスを実施しトラッキングエラーを低く抑えました。組入比率は期を通じて高位を保ちま

した。

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。

エマーシング株式インデックス・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIエマーシング・マーケット・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、ベンチマークに連動する先物取引を利用した組入比率の調整を実施しました。また先物取引に加えて余裕資金部分については、米ドル建て短期公社債などを組み入れました。

組入比率は期を通じて高位を保ちました。

Jリート・インデックス・マザーファンド

ベンチマークである東証REIT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、原則として指数採用銘柄への時価構成比に応じた投資を行いました。

組入比率は期を通じて高位を保ちました。

外国リート・インデックス・マザーファンド

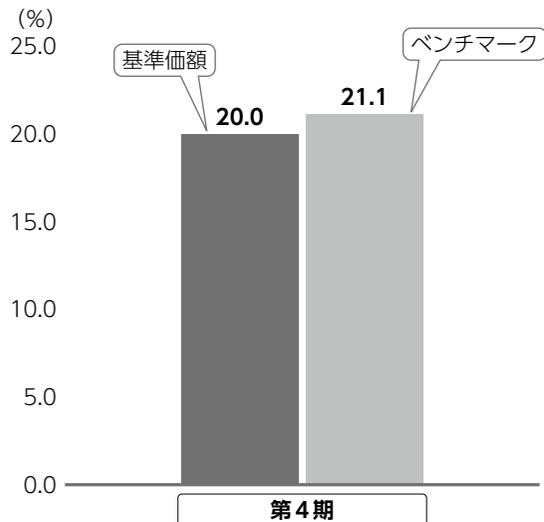
S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

日々の追加設定・解約による資金移動に応じてリートの売買を行い、トラッキングエラーの抑制に努めました。

また、3、6、9、12月のベンチマークの定期銘柄見直しに応じて、ポートフォリオの修正を行いました。

ベンチマークとの差異について(2020年9月11日から2021年9月10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

当ファンドは各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとしております。

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+20.0%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+21.1を1.1%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 信託報酬等の費用がかかったこと

分配金について(2020年9月11日から2021年9月10日まで)

(単位:円、1万口当たり、税引前)

項目	第4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	2,869

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、マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資を行い、各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行う方針です。

マザーファンドへの投資を通じて行う各資産への投資は基本資産配分に基づき実施します。

実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対円での為替ヘッジを行って

る場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行わない方針です。

国内債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、NOMURA-BPI(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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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。

通貨に関してはフルヘッジを継続します。債券組入比率は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。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

引き続き、TOPIX(東証株価指数、配当込み)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高位に保つことを基本とします。

外国株式インデックス・マザーファンド

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

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

エマージング株式インデックス・マザーファンド

引き続き、MSCIエマージング・マーケット・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。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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

引き続き、東証REIT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。

採用銘柄への時価構成比に応じた投資を行うことにより、ベンチマークとの連動を目指した運用を行います。組入比率は高位に保つことを基本とします。

外国リート・インデックス・マザーファンド

引き続き、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。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、リート組入比率を高位に保つことを基本とします。

3 お知らせ

約款変更等のお知らせ

該当事項はございません。

1万口当たりの費用明細(2020年9月11日から2021年9月10日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	27円	0.231%	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11,825円です。
(投信会社)	(12)	(0.099)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(13)	(0.110)	販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(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	3	0.027	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(1)	(0.009)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(2)	(0.015)	
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	1	0.006	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.003)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.003)	
(d) その他費用	7	0.056	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)	(5)	(0.039)	保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.007)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(1)	(0.010)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	38	0.320	

※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。

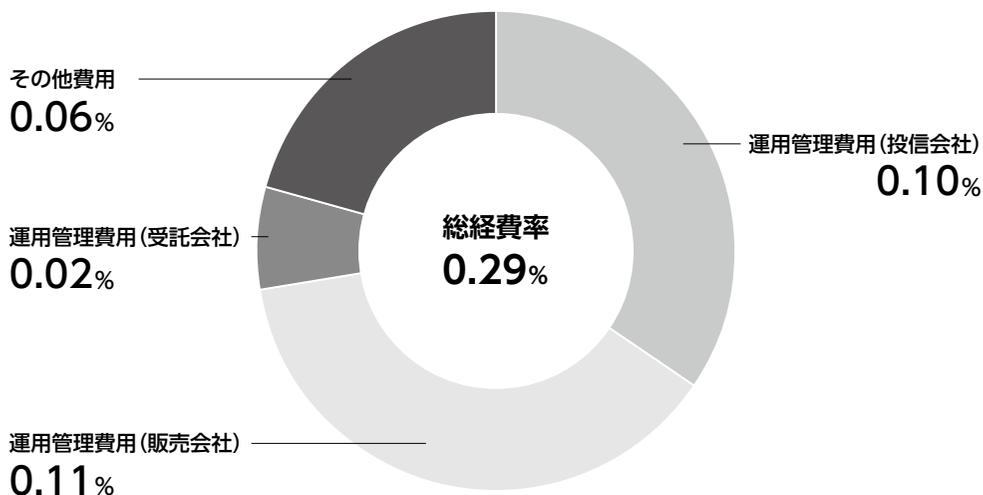
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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0.29%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年9月11日から2021年9月10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)	11,593	36,040	1,811	5,465
外国株式インデックス・マザーファンド	10,737	51,171	1,667	7,435
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	15,471	23,456	256	391
外国債券パッシブ・マザーファンド	46,211	89,718	1,221	2,338
国内債券パッシブ・マザーファンド	55,704	71,310	2,367	3,036
Jリート・インデックス・マザーファンド	5,715	14,243	203	510
外国リート・インデックス・マザーファンド	16,875	37,181	3,298	7,453
エマージング株式インデックス・マザーファンド	23,683	39,973	4,249	6,822

■ 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

(2020年9月11日から2021年9月10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	外国リート・ インデックス・ マザーファンド	エマージング株式 インデックス・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	31,504,633千円	56,394,047千円	7,831千円	4,905,230千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	182,851,036千円	269,934,740千円	3,083千円	8,825,153千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.17	0.20	2.53	0.55

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年9月11日から2021年9月10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・世界分散ファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 49,455	百万円 2,907	% 5.9	百万円 40,753	百万円 658	% 1.6

※平均保有割合 0.1%

※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。

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
株 式	百万円 10,624	百万円 5,066	% 47.7	百万円 20,880	百万円 7,539	% 36.1
株 式 先 物 取 引	48,559	42,197	86.9	49,791	43,452	87.3

※平均保有割合 0.0%

※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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
投 資 信 託 証 券	百万円 3,789	百万円 417	% 11.0	百万円 4,636	百万円 1,045	% 22.5

※平均保有割合 0.5%

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

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

外国債券パッシブ・マザーファンド

外国株式インデックス・マザーファンド

エマージング株式インデックス・マザーファンド

外国リート・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。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
公 社 債	百万円 -	百万円 -	百万円 101

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 66	百万円 118	百万円 1,972

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 2,100

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 20

Jリート・インデックス・マザーファンド

種 類	買 付 額
投 資 信 託 証 券	百万円 270

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	203千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	2千円
(c) (b) / (a)	1.4%

※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 (2020年9月11日から2021年9月10日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2021年9月10日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首(前期末)		期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
		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)	20,691	30,472	105,625	
外国株式インデックス・マザーファンド	26,928	35,998	199,429	
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	16,988	32,203	48,900	
外国債券パッシブ・マザーファンド	56,728	101,717	200,618	
国内債券パッシブ・マザーファンド	63,782	117,119	150,240	
Jリート・インデックス・マザーファンド	12,315	17,827	49,588	
外国リート・インデックス・マザーファンド	43,237	56,813	150,402	
エマージング株式インデックス・マザーファンド	38,808	58,243	100,265	

※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)	60,456,249千口	外国株式インデックス・マザーファンド	59,015,956千口
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	17,348,369千口	外国債券パッシブ・マザーファンド	81,240,238千口
国内債券パッシブ・マザーファンド	106,912,762千口	Jリート・インデックス・マザーファンド	2,675,035千口
外国リート・インデックス・マザーファンド	5,775,124千口	エマージング株式インデックス・マザーファンド	8,888,051千口

■ 投資信託財産の構成

(2021年9月10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）	105,625	10.4
外国株式インデックス・マザーファンド	199,429	19.6
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	48,900	4.8
外国債券パッシブ・マザーファンド	200,618	19.7
国内債券パッシブ・マザーファンド	150,240	14.8
Jリート・インデックス・マザーファンド	49,588	4.9
外国リート・インデックス・マザーファンド	150,402	14.8
エマージング株式インデックス・マザーファンド	100,265	9.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,085	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	1,016,152	100.0

※外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（326,614,836千円）の投資信託財産総額（326,992,159千円）に対する比率は99.9%です。

※ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（26,144,554千円）の投資信託財産総額（26,356,311千円）に対する比率は99.2%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（159,812,611千円）の投資信託財産総額（160,272,085千円）に対する比率は99.7%です。

※外国リート・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（15,277,330千円）の投資信託財産総額（15,345,580千円）に対する比率は99.6%です。

※エマージング株式インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（13,283,438千円）の投資信託財産総額（15,433,437千円）に対する比率は86.1%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=109.78円、1カナダドル=86.69円、1メキシコペソ=5.5078円、1ブラジルレアル=21.0894円、100チリペソ=13.8189円、100コロンビアペソ=2.8646円、1ユーロ=129.81円、1英ポンド=151.95円、1スイスフラン=119.76円、1スウェーデンクローナ=12.76円、1ノルウェークローネ=12.66円、1デンマーククローネ=17.46円、1トルコリラ=13.0029円、1チェココルナ=5.1037円、100ハンガリーフォリント=37.0232円、1ポーランドズロチ=28.558円、1オーストラリアドル=80.91円、1ニュージーランドドル=77.95円、1香港ドル=14.12円、1シンガポールドル=81.75円、1マレーシアリングギット=26.4686円、1タイバーツ=3.36円、1フィリピンペソ=2.1982円、100インドネシアルピア=0.77円、100韓国ウォン=9.39円、1新台幣ドル=3.9656円、1インドルピー=1.50円、1イスラエルシェケル=34.2502円、1エジプトポンド=6.9715円、1南アフリカランド=7.74円、1中国元（オフショア）=17.0104円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年9月10日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,016,152,998円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	11,080,240
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	105,625,800
外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	199,429,962
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	48,900,946
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	200,618,003
国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	150,240,988
Jリート・インデックス・マザーファンド(評価額)	49,588,470
外国リート・インデックス・マザーファンド(評価額)	150,402,788
エマージング株式インデックス・マザーファンド(評価額)	100,265,801
(B) 負 債	1,746,641
未 払 解 約 金	697,032
未 払 信 託 報 酬	1,020,255
未 払 利 息	16
そ の 他 未 払 費 用	29,338
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,014,406,357
元 本	788,236,116
次 期 繰 越 損 益 金	226,170,241
(D) 受 益 権 総 口 数	788,236,116口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,869円

※当期における期首元本額508,204,609円、期中追加設定元本額357,578,274円、期中一部解約元本額77,546,767円です。

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

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

■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当	期

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2020年9月11日 至2021年9月10日)

項 目	当	期
(A) 配 当 等 収 益	△	6,693円
支 払 利 息	△	6,693
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		128,700,120
売 買 益		135,707,507
売 買 損	△	7,007,387
(C) 信 託 報 酬 等	△	1,796,908
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)		126,896,519
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		20,144,868
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金		79,128,854
(配 当 等 相 当 額)	(36,540,016)
(売 買 損 益 相 当 額)	(42,588,838)
(G) 計 (D+E+F)		226,170,241
(H) 収 益 分 配 金		0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)		226,170,241
追 加 信 託 差 損 益 金		79,128,854
(配 当 等 相 当 額)	(37,032,667)
(売 買 損 益 相 当 額)	(42,096,187)
分 配 準 備 積 立 金		147,041,387

※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(14,720,294円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(112,176,225円)、信託約款に規定される収益調整金(79,128,854円)および分配準備積立金(20,144,868円)より分配可能額は226,170,241円(1万口当たり2,869円)ですが、分配は行っておりません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

第16期（2020年5月26日から2021年5月25日まで）

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

■最近5期の運用実績

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

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

■当期中の基準価額と市況等の推移

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

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

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

基準価額等の推移



期首	12,846円
期末	12,790円
騰落率	-0.4%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）です。

※NOMURA-BPI（総合）は、野村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 (2020年5月26日から2021年5月25日まで)

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

下落要因

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

▶ 投資環境について (2020年5月26日から2021年5月25日まで)

日本の長期金利の代表である10年国債利回りは上昇しました。

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

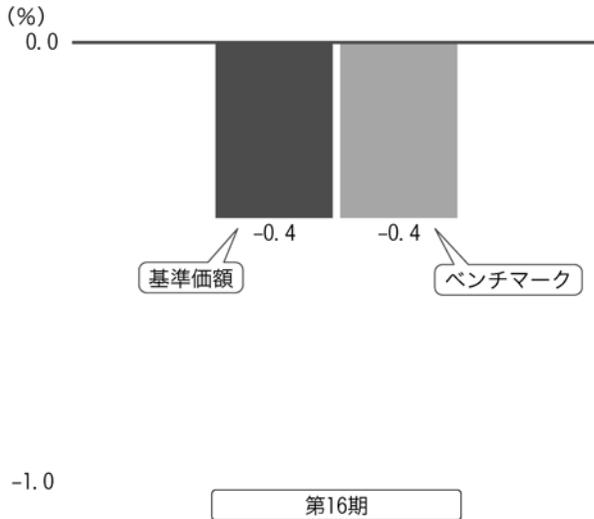
当期の市場の動きを10年国債利回りでみると、期首+0.002%から期末+0.078%へと上昇しました。

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

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

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

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



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

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

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

2 今後の運用方針

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

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

期中の平均基準価額は12,781円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

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

公社債

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

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

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

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

(1) 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	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 44,323	百万円 2,918	% 6.6	百万円 46,927	百万円 597	% 1.3

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 2,300

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

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

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

■ 組入れ資産の明細(2021年5月25日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

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

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

国内債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 国内(邦貨建)公社債

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2021年5月25日現在)

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

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年5月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	130,482,877,412円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	346,981,807
公 社 債 (評 価 額)	129,609,682,442
未 収 入 金	171,343,600
未 収 利 息	351,485,559
前 払 費 用	3,384,004
(B) 負 債	81,103,832
未 払 解 約 金	81,100,000
未 払 利 息	922
そ の 他 未 払 費 用	2,910
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	130,401,773,580
元 本	101,956,373,249
次 期 繰 越 損 益 金	28,445,400,331
(D) 受 益 権 総 口 数	101,956,373,249口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12,790円

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

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

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

■ 損益の状況

(自2020年5月26日 至2021年5月25日)

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

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 期末における、元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	6,107,406,137円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,723,802,531円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	10,781,816,542円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,849,038,912円
三井住友・DC年金バランス70(株主重点型)	2,397,304,721円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	329,649,062円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	641,931,738円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	596,483,349円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	43,241,043円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	274,171,613円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	184,044,133円	SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	117,615,876円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	434,154,953円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,898,851,071円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	583,046,424円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,193,869,711円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	261,715,284円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,535,669,870円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	412,399,004円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,205,091,355円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	136,805,557円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	948,903円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,167,274,213円	三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,259,749,712円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	336,338,695円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	468,541,289円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,590,257円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	595,459,501円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	34,209,543円	SMAM・アセットバランスファンドVL35A<適格機関投資家専用>	182,525,240円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,282,563,419円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,116,807円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	409,872,922円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,610,117,052円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	612,321,166円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,259,171,883円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	123,710,024円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	786,132,548円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	35,616,100円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	215,565,314円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	97,879,738円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	19,071,373円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	77,545,541円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	296,118,831円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	130,303,297円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,582,241,420円
三井住友DS・年金バランス70(株主重点型)	36,291,637円	SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	323,429,939円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,882,878円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	817,827,093円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,587,722,151円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	996,614,616円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,242,266,453円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	3,599,244,808円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

第18期（2020年8月26日から2021年8月25日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年10月3日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。 ・ 保有する外貨建資産については、為替のフルヘッジを原則とします。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		（ベンチマーク） FTSE世界国債 インデックス （除く日本、円 ヘッジベース）		債券組入率 債比	純資産額
	騰落	中率	騰落	中率		
	円	%		%	%	百万円
14期(2017年8月25日)	13,940	△3.2	386.65	△3.3	97.8	61,516
15期(2018年8月27日)	13,764	△1.3	382.07	△1.2	97.5	46,117
16期(2019年8月26日)	14,894	8.2	414.04	8.4	94.6	27,583
17期(2020年8月25日)	15,423	3.6	428.86	3.6	98.4	23,201
18期(2021年8月25日)	15,251	△1.1	423.79	△1.2	98.4	26,330

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

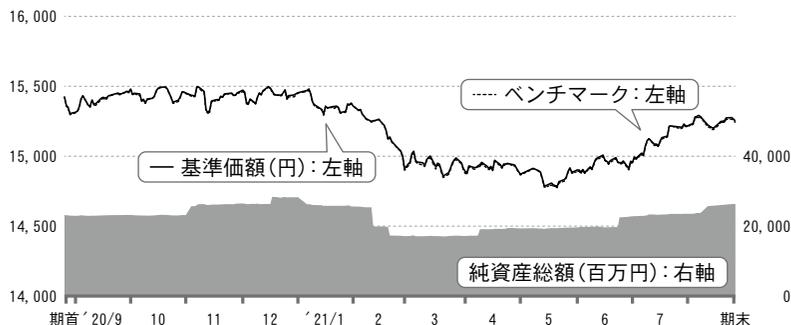
年月日	基準価額		（ベンチマーク） FTSE世界国債 インデックス （除く日本、円 ヘッジベース）		債券組入率 債比
	騰落	率	騰落	率	
(期首) 2020年8月25日	円 15,423	% -	428.86	% -	98.4
8月末	15,314	△0.7	425.73	△0.7	98.8
9月末	15,480	0.4	430.39	0.4	96.8
10月末	15,452	0.2	429.55	0.2	96.8
11月末	15,472	0.3	429.92	0.2	98.6
12月末	15,454	0.2	429.65	0.2	98.4
2021年1月末	15,359	△0.4	427.12	△0.4	99.4
2月末	14,911	△3.3	414.29	△3.4	98.7
3月末	14,892	△3.4	413.65	△3.5	99.9
4月末	14,871	△3.6	413.35	△3.6	98.3
5月末	14,902	△3.4	414.03	△3.5	99.4
6月末	14,956	△3.0	415.77	△3.1	98.0
7月末	15,217	△1.3	423.02	△1.4	97.1
(期末) 2021年8月25日	15,251	△1.1	423.79	△1.2	98.4

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年8月26日から2021年8月25日まで）

基準価額等の推移



期首	15,423円
期末	15,251円
騰落率	-1.1%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2020年8月26日から2021年8月25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、円ヘッジベース）の動きに連動する投資成果を目指しました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

下落要因

- ・景気の回復期待から、米国や英国など多くの国で金利が上昇（価格は下落）したこと

▶ 投資環境について（2020年8月26日から2021年8月25日まで）

米国や英国など多くの国で金利が上昇した一方、ドイツなどのユーロ諸国の金利は総じて横ばいとなりました

先進国債券市場では、多くの国で長期金利は上昇しました。期初保ち合いの後、11月から2021年3月末にかけては、新型コロナウイルスワクチンの開発・接種の進展や拡張的な財政政策による景気の先行き期待を背景に、米国長期金利が大きく上昇したことに伴い、グローバルに長期金利は上昇しました。

4月以降は、多くの国で金利上昇要因の織り込みが進展したことに伴い、長期金利の上昇に歯止めがかかりましたが、ドイツなどユーロ諸国の長期金利は5月中旬まで上昇基調が続きました。期末にかけては、新型コロナウイルス（デルタ型）の感染が拡大したことを受けて、米国など多くの国で長期金利は緩やかに低下し、期間中の上昇幅を縮めました。ドイツなどのユーロ諸国の長期金利は、期末にかけて大きく低下し、期を通してみると、総じて「往って来い」（上昇、下落を繰り返した結果、ほぼ元の水準で落ち着くこと）の動きとなりました。

▶ ポートフォリオについて（2020年8月26日から2021年8月25日まで）

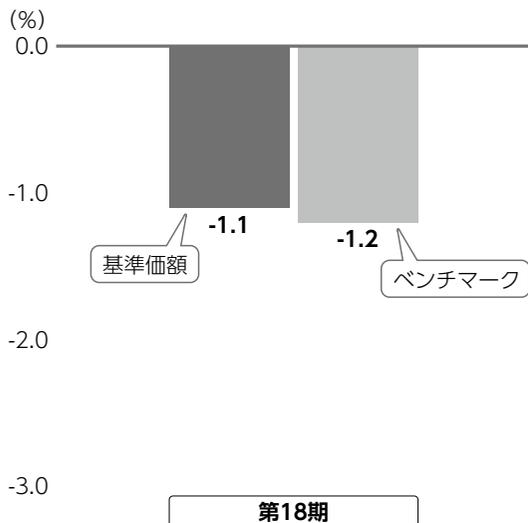
債券組入比率

F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）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（投資資金の平均回収期間）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。

また、組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

▶ ベンチマークとの差異について（2020年8月26日から2021年8月25日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドはF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）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-1.1%となり、ベンチマークの騰落率-1.2%にほぼ連動する結果となりました。

2 今後の運用方針

先進国債券市場では、米国は景気の回復とともに金融緩和の縮小が意識されることで、金利は緩やかに水準を切り上げていくと予想します。但し、当面は新型コロナウイルス（デルタ型）の収束時期について不透明感が高いことなどから、金利の上昇は抑制される見通しです。ユーロ圏でも、中期的には景気の回復が金利上昇要因となっていく見通しですが、当面はE C B（欧州中央銀行）の大規模な金融緩和が継続される中で、ドイツやフランスなどのユーロ諸国の金利上昇は抑制される見通しです。

今後も引き続き、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します。また、組入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活用し、為替変動リスクの低減を図ります。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細 (2020年8月26日から2021年8月25日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用	8円	0.051%	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）	(8)	(0.050)	
（その他）	(0)	(0.001)	
合計	8	0.051	

期中の平均基準価額は15,190円です。

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。
 ※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。
 ※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年8月26日から2021年8月25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 79,064	千米ドル 63,680
	カナダ国債証券	千カナダドル 4,757	千カナダドル 3,944
	メキシコ国債証券	千メキシコペソ 23,905	千メキシコペソ 23,813
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ国債証券	11,010	9,514
	イタリア国債証券	12,229	10,756
	フランス国債証券	13,779	11,821
	オランダ国債証券	2,860	2,444
	スペイン国債証券	7,654	6,756
	ベルギー国債証券	3,754	3,326
国	オーストリア国債証券	1,868	1,950
	フィンランド国債証券	648	574
	アイルランド国債証券	948	794
	イギリス国債証券	千英ポンド 7,281	千英ポンド 6,556
	スウェーデン国債証券	千スウェーデンクローナ 4,848	千スウェーデンクローナ 4,202
	ノルウェー国債証券	千ノルウェークローネ 2,582	千ノルウェークローネ 2,010
	デンマーク国債証券	千デンマーククローネ 5,571	千デンマーククローネ 4,885
	ポーランド国債証券	千ポーランドズロチ 7,944	千ポーランドズロチ 7,338
	オーストラリア国債証券	千オーストラリアドル 5,326	千オーストラリアドル 5,922
	シンガポール国債証券	千シンガポールドル 1,911	千シンガポールドル 1,587
イスラエル国債証券	千イスラエルシェケル 2,489	千イスラエルシェケル 1,737	

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 利害関係人との取引状況等（2020年8月26日から2021年8月25日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 （2020年8月26日から2021年8月25日まで）

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

■ 組入れ資産の明細（2021年8月25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				残存期間別組入比率			
	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 102,280	千米ドル 106,770	千円 11,729,825	44.5	% —	% 19.8	% 16.4	% 8.3
カナダ	千カナダドル 5,650	千カナダドル 5,980	521,234	2.0	—	0.9	0.8	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 32,490	千メキシコペソ 34,162	185,691	0.7	—	0.4	0.3	0.0
ユーロ	千ユーロ 12,790	千ユーロ 15,079	1,945,230	7.4	—	4.4	2.0	1.0
ドイツ	16,550	19,257	2,484,208	9.4	—	5.7	2.6	1.1
イタリア	17,450	20,659	2,665,027	10.1	—	6.5	2.7	0.9
フランス	3,100	3,771	486,491	1.8	—	1.3	0.4	0.1
オランダ	10,130	12,002	1,548,339	5.9	—	3.8	1.7	0.4
スペイン	4,015	4,882	629,840	2.4	—	1.8	0.5	0.1
ベルギー	2,520	3,007	387,969	1.5	—	1.1	0.2	0.2
オーストリア	1,180	1,294	166,972	0.6	—	0.4	0.2	0.1
フィンランド	1,470	1,666	214,951	0.8	—	0.6	0.2	0.0
アイルランド								
イギリス	千英ポンド 9,010	千英ポンド 11,014	1,660,358	6.3	—	4.8	1.0	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 5,570	千スウェーデンクローナ 6,134	77,484	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 4,800	千ノルウェークローネ 4,973	61,816	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 6,430	千デンマーククローネ 7,676	133,179	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 4,890	千ポーランドズロチ 5,268	148,533	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 5,690	千オーストラリアドル 6,188	492,751	1.9	—	1.3	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 2,690	千シンガポールドル 2,940	238,448	0.9	—	0.5	0.2	0.2
イスラエル	千イスラエルシェケル 3,180	千イスラエルシェケル 3,512	119,946	0.5	—	0.3	0.2	0.0
合 計	—	—	25,898,301	98.4	—	54.5	30.4	13.5

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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		
(アメリカ)	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	%	千米ドル	千米ドル	千円	2022/9/30
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	770	770	84,612	2022/11/30
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	930	929	102,145	2023/1/31
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	1,650	1,649	181,176	2023/2/28
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	1,200	1,199	131,734	2023/4/30
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	940	939	103,163	2023/5/15
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	1,600	1,598	175,576	2023/7/15
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	320	319	35,089	2023/8/15
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	750	748	82,211	2023/9/15
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	1,100	1,097	120,529	2023/10/15
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	460	458	50,379	2024/2/15
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	1,300	1,293	142,076	2023/4/15
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	500	500	54,985	2023/11/15
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	910	909	99,863	2024/3/15
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	1,460	1,456	159,957	2024/5/15
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	890	886	97,382	2024/6/15
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	620	617	67,815	2025/5/31
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	100	98	10,834	2025/6/30
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	650	640	70,399	2025/9/30
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	630	619	68,035	2025/10/31
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	720	706	77,656	2024/4/15
		US TREASURY N/B 0.375	0.375	980	979	107,650	2024/7/15
		US TREASURY N/B 0.375	0.375	820	818	89,947	2025/4/30
		US TREASURY N/B 0.375	0.375	1,010	1,002	110,096	2025/11/30
		US TREASURY N/B 0.375	0.375	650	641	70,443	2025/12/31
		US TREASURY N/B 0.375	0.375	620	611	67,126	2026/1/31
		US TREASURY N/B 0.375	0.375	530	521	57,316	2025/3/31
		US TREASURY N/B 0.5	0.5	1,570	1,566	172,102	2026/2/28
		US TREASURY N/B 0.5	0.5	500	494	54,342	2027/4/30
		US TREASURY N/B 0.5	0.5	560	547	60,151	2027/5/31
		US TREASURY N/B 0.5	0.5	330	322	35,416	2027/6/30
		US TREASURY N/B 0.5	0.5	1,340	1,307	143,652	2027/8/31
US TREASURY N/B 0.5	0.5	500	486	53,494	2027/10/31		
US TREASURY N/B 0.5	0.5	1,030	1,000	109,937	2027/3/31		
US TREASURY N/B 0.625	0.625	440	433	47,645	2027/11/30		
US TREASURY N/B 0.625	0.625	580	567	62,332	2027/12/31		
US TREASURY N/B 0.625	0.625	570	556	61,174	2030/5/15		
US TREASURY N/B 0.625	0.625	920	874	96,096	2030/8/15		
US TREASURY N/B 0.625	0.625	1,190	1,128	123,951	2026/3/31		
US TREASURY N/B 0.75	0.75	1,020	1,019	112,044	2028/1/31		
US TREASURY N/B 0.75	0.75	430	422	46,462			

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期		末		償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
	US TREASURY N/B 0.875	0.875	1,000	1,004	110,323	2026/6/30
	US TREASURY N/B 0.875	0.875	1,300	1,258	138,271	2030/11/15
	US TREASURY N/B 1.125	1.125	1,100	1,107	121,667	2028/2/29
	US TREASURY N/B 1.125	1.125	1,120	1,106	121,591	2031/2/15
	US TREASURY N/B 1.125	1.125	80	71	7,861	2040/5/15
	US TREASURY N/B 1.125	1.125	700	623	68,535	2040/8/15
	US TREASURY N/B 1.25	1.25	1,150	1,177	129,383	2024/8/31
	US TREASURY N/B 1.25	1.25	660	669	73,518	2028/3/31
	US TREASURY N/B 1.25	1.25	320	324	35,634	2028/4/30
	US TREASURY N/B 1.25	1.25	690	698	76,780	2028/5/31
	US TREASURY N/B 1.25	1.25	1,080	1,093	120,080	2028/6/30
	US TREASURY N/B 1.25	1.25	380	323	35,533	2050/5/15
	US TREASURY N/B 1.375	1.375	950	970	106,609	2023/6/30
	US TREASURY N/B 1.375	1.375	300	306	33,707	2023/8/31
	US TREASURY N/B 1.375	1.375	470	483	53,080	2026/8/31
	US TREASURY N/B 1.375	1.375	580	539	59,246	2040/11/15
	US TREASURY N/B 1.375	1.375	870	763	83,899	2050/8/15
	US TREASURY N/B 1.5	1.5	600	608	66,809	2022/8/15
	US TREASURY N/B 1.5	1.5	1,150	1,174	128,994	2023/3/31
	US TREASURY N/B 1.5	1.5	450	464	51,051	2024/11/30
	US TREASURY N/B 1.5	1.5	550	568	62,464	2026/8/15
	US TREASURY N/B 1.5	1.5	450	465	51,120	2027/1/31
	US TREASURY N/B 1.5	1.5	900	922	101,291	2030/2/15
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	250	253	27,874	2022/8/15
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	200	203	22,371	2022/11/15
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	800	815	89,594	2022/12/15
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	880	901	99,006	2023/4/30
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	520	533	58,555	2023/5/31
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	800	823	90,469	2023/10/31
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	600	623	68,511	2026/2/15
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	860	894	98,266	2026/5/15
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	900	936	102,898	2026/9/30
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	500	520	57,180	2026/11/30
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	440	455	50,075	2029/8/15
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	1,220	1,259	138,369	2031/5/15
	US TREASURY N/B 1.625	1.625	840	783	86,125	2050/11/15
	US TREASURY N/B 1.75	1.75	350	356	39,132	2022/9/30
	US TREASURY N/B 1.75	1.75	700	718	78,971	2023/5/15
	US TREASURY N/B 1.75	1.75	500	522	57,446	2029/11/15
	US TREASURY N/B 1.875	1.875	1,000	1,017	111,816	2022/8/31
	US TREASURY N/B 1.875	1.875	900	917	100,766	2022/9/30
	US TREASURY N/B 1.875	1.875	300	312	34,353	2024/8/31
	US TREASURY N/B 1.875	1.875	750	789	86,688	2026/6/30
	US TREASURY N/B 1.875	1.875	1,110	1,122	123,359	2041/2/15

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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 1.875	1.875	720	713	78,339	2051/2/15	
	US TREASURY N/B 2	2.0	100	102	11,227	2022/10/31	
	US TREASURY N/B 2	2.0	1,000	1,027	112,842	2023/2/15	
	US TREASURY N/B 2	2.0	200	208	22,932	2024/4/30	
	US TREASURY N/B 2	2.0	500	522	57,365	2024/5/31	
	US TREASURY N/B 2	2.0	600	626	68,874	2024/6/30	
	US TREASURY N/B 2	2.0	600	631	69,404	2025/8/15	
	US TREASURY N/B 2	2.0	600	611	67,190	2050/2/15	
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	430	441	48,492	2022/12/31	
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	280	292	32,169	2024/3/31	
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	410	430	47,285	2024/7/31	
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	320	340	37,389	2026/5/31	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	550	575	63,175	2023/12/31	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	460	481	52,910	2024/1/31	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	770	808	88,788	2024/4/30	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	580	612	67,307	2024/10/31	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	500	528	58,043	2024/11/15	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	500	529	58,116	2024/12/31	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	420	448	49,270	2026/3/31	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	450	483	53,117	2027/2/15	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	570	613	67,399	2027/8/15	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	700	754	82,873	2027/11/15	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	570	611	67,204	2041/5/15	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	400	428	47,049	2046/8/15	
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	460	494	54,296	2049/8/15	
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	600	634	69,713	2024/8/15	
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	400	429	47,212	2026/4/30	
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	480	523	57,563	2029/5/15	
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	520	573	63,056	2049/11/15	
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	760	841	92,478	2051/5/15	
	US TREASURY N/B 2.5	2.5	300	313	34,416	2023/8/15	
	US TREASURY N/B 2.5	2.5	700	746	82,035	2025/1/31	
	US TREASURY N/B 2.5	2.5	390	436	47,901	2045/2/15	
	US TREASURY N/B 2.5	2.5	500	560	61,543	2046/2/15	
	US TREASURY N/B 2.5	2.5	360	403	44,346	2046/5/15	
	US TREASURY N/B 2.625	2.625	500	536	58,961	2025/3/31	
	US TREASURY N/B 2.625	2.625	430	465	51,151	2026/1/31	
	US TREASURY N/B 2.625	2.625	720	797	87,645	2029/2/15	
	US TREASURY N/B 2.75	2.75	900	943	103,667	2023/7/31	
	US TREASURY N/B 2.75	2.75	900	949	104,257	2023/11/15	
	US TREASURY N/B 2.75	2.75	500	538	59,150	2025/2/28	
	US TREASURY N/B 2.75	2.75	600	648	71,263	2025/6/30	
	US TREASURY N/B 2.75	2.75	600	649	71,377	2025/8/31	
	US TREASURY N/B 2.75	2.75	300	332	36,575	2028/2/15	

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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 2.75	2.75	400	464	51,047	2042/11/15	
		US TREASURY N/B 2.75	2.75	300	353	38,797	2047/8/15	
		US TREASURY N/B 2.75	2.75	250	294	32,338	2047/11/15	
		US TREASURY N/B 2.875	2.875	900	951	104,586	2023/11/30	
		US TREASURY N/B 2.875	2.875	200	216	23,803	2025/4/30	
		US TREASURY N/B 2.875	2.875	600	650	71,449	2025/5/31	
		US TREASURY N/B 2.875	2.875	720	786	86,369	2025/11/30	
		US TREASURY N/B 2.875	2.875	500	559	61,508	2028/5/15	
		US TREASURY N/B 2.875	2.875	660	740	81,358	2028/8/15	
		US TREASURY N/B 2.875	2.875	200	237	26,042	2043/5/15	
		US TREASURY N/B 2.875	2.875	110	131	14,419	2045/8/15	
		US TREASURY N/B 2.875	2.875	370	443	48,776	2046/11/15	
		US TREASURY N/B 2.875	2.875	630	763	83,846	2049/5/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	620	678	74,525	2025/9/30	
		US TREASURY N/B 3	3.0	290	349	38,422	2042/5/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	400	485	53,342	2044/11/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	290	352	38,772	2045/5/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	300	366	40,229	2045/11/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	250	306	33,707	2047/2/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	300	368	40,507	2047/5/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	400	492	54,142	2048/2/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	480	592	65,096	2048/8/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	550	681	74,863	2049/2/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	380	433	47,676	2028/11/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	210	257	28,302	2041/11/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	150	184	20,247	2042/2/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	400	492	54,063	2043/2/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	110	136	14,952	2044/8/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	470	592	65,095	2048/5/15	
		US TREASURY N/B 3.375	3.375	450	578	63,503	2044/5/15	
		US TREASURY N/B 3.375	3.375	230	303	33,335	2048/11/15	
		US TREASURY N/B 3.5	3.5	100	128	14,113	2039/2/15	
		US TREASURY N/B 3.625	3.625	230	304	33,467	2043/8/15	
		US TREASURY N/B 3.625	3.625	400	531	58,436	2044/2/15	
		US TREASURY N/B 3.875	3.875	120	162	17,804	2040/8/15	
		US TREASURY N/B 4.25	4.25	170	238	26,226	2039/5/15	
		US TREASURY N/B 4.25	4.25	140	198	21,780	2040/11/15	
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	40	56	6,196	2038/2/15	
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	300	428	47,050	2039/11/15	
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	430	616	67,718	2040/5/15	
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	120	173	19,012	2041/5/15	
		US TREASURY N/B 4.5	4.5	100	140	15,407	2036/2/15	
		US TREASURY N/B 4.625	4.625	100	147	16,168	2040/2/15	
		US TREASURY N/B 5.25	5.25	200	258	28,386	2028/11/15	

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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 5.375	5.375	80	109	12,073	2031/2/15
		US TREASURY N/B 5.5	5.5	120	156	17,154	2028/8/15
小	計		-	-	-	11,729,825	-
(カナダ)	国債証券			千カナダドル	千カナダドル		
		CANADA-GOV T 0.25	0.25	90	89	7,838	2022/11/1
		CANADA-GOV T 0.25	0.25	300	298	26,047	2023/8/1
		CANADA-GOV T 0.25	0.25	430	426	37,175	2024/4/1
		CANADA-GOV T 0.25	0.25	170	165	14,426	2026/3/1
		CANADA-GOV T 0.5	0.5	210	207	18,105	2025/9/1
		CANADA-GOV T 0.5	0.5	300	281	24,573	2030/12/1
		CANADA-GOV T 1	1.0	150	150	13,137	2027/6/1
		CANADA-GOV T 1.25	1.25	440	444	38,742	2030/6/1
		CANADA-GOV T 1.5	1.5	130	132	11,551	2023/6/1
		CANADA-GOV T 1.5	1.5	320	328	28,622	2024/9/1
		CANADA-GOV T 1.5	1.5	170	175	15,267	2026/6/1
		CANADA-GOV T 1.5	1.5	80	81	7,140	2031/6/1
		CANADA-GOV T 1.75	1.75	490	500	43,620	2023/3/1
		CANADA-GOV T 2	2.0	300	309	26,955	2023/9/1
		CANADA-GOV T 2	2.0	170	181	15,794	2028/6/1
		CANADA-GOV T 2	2.0	330	347	30,301	2051/12/1
		CANADA-GOV T 2.25	2.25	250	260	22,723	2024/3/1
		CANADA-GOV T 2.25	2.25	130	137	11,980	2025/6/1
		CANADA-GOV T 2.25	2.25	190	207	18,055	2029/6/1
		CANADA-GOV T 2.5	2.5	290	305	26,610	2024/6/1
		CANADA-GOV T 2.75	2.75	230	280	24,437	2048/12/1
		CANADA-GOV T 2.75	2.75	50	63	5,508	2064/12/1
		CANADA-GOV T 3.5	3.5	120	162	14,177	2045/12/1
		CANADA-GOV T 4	4.0	90	126	11,018	2041/6/1
		CANADA-GOV T 5	5.0	70	104	9,118	2037/6/1
		CANADA-GOV T 5.75	5.75	90	121	10,587	2029/6/1
		CANADA-GOV T 5.75	5.75	60	88	7,714	2033/6/1
小	計		-	-	-	521,234	-
(メキシコ)	国債証券			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
		MEXICAN BONOS 10	10.0	2,700	3,005	16,335	2024/12/5
		MEXICAN BONOS 5.75	5.75	3,180	3,091	16,805	2026/3/5
		MEXICAN BONOS 6.75	6.75	850	865	4,704	2023/3/9
		MEXICAN BONOS 7.5	7.5	3,300	3,433	18,660	2027/6/3
		MEXICAN BONOS 7.75	7.75	2,080	2,194	11,930	2031/5/29
		MEXICAN BONOS 7.75	7.75	1,960	2,054	11,169	2034/11/23
		MEXICAN BONOS 7.75	7.75	2,500	2,551	13,867	2042/11/13
		MEXICAN BONOS 8	8.0	5,180	5,419	29,460	2023/12/7
		MEXICAN BONOS 8	8.0	3,000	3,155	17,152	2024/9/5
		MEXICAN BONOS 8	8.0	1,800	1,872	10,180	2047/11/7
MEXICAN BONOS 8.5	8.5	3,640	3,999	21,736	2029/5/31		

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
	MEXICAN BONOS 8.5	8.5	2,300	2,518	13,688	2038/11/18	
小	計	—	—	—	185,691	—	
(ユーロ)			千ユーロ	千ユーロ			
(ドイツ)	国債証券	BUNDESUBL-120 0	—	340	349	45,135	2025/4/11
		BUNDESUBL-120 0	—	250	258	33,381	2025/10/10
		BUNDESUBL-176 0	—	250	252	32,521	2022/10/7
		BUNDESUBL-177 0	—	380	384	49,648	2023/4/14
		BUNDESUBL-178 0	—	350	355	45,919	2023/10/13
		BUNDESUBL-179 0	—	490	500	64,538	2024/4/5
		BUNDESUBL-180 0	—	700	717	92,597	2024/10/18
		BUNDESUBL-183 0	—	60	62	8,022	2026/4/10
		BUNDESSCHATZANW 0	—	320	323	41,765	2023/3/10
		DEUTSCHLAND REP 0	—	300	311	40,203	2026/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	190	198	25,610	2027/11/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	100	104	13,517	2028/11/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	250	262	33,893	2029/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	150	157	20,352	2030/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	680	715	92,250	2030/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	380	399	51,507	2031/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	40	41	5,412	2031/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	260	271	34,977	2035/5/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	180	186	24,085	2036/5/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	240	242	31,235	2050/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0	—	130	132	17,115	2050/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	330	348	44,936	2027/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	170	181	23,392	2028/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	190	203	26,214	2029/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5	330	345	44,529	2025/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5	410	434	55,994	2026/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5	380	408	52,690	2027/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5	220	237	30,645	2028/2/15
		DEUTSCHLAND REP 1	1.0	100	105	13,601	2024/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1	1.0	230	246	31,821	2025/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1.25	1.25	280	380	49,097	2048/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5	450	460	59,406	2022/9/4
		DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5	250	259	33,520	2023/5/15
		DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5	240	255	32,923	2024/5/15
		DEUTSCHLAND REP 1.75	1.75	200	212	27,450	2024/2/15
		DEUTSCHLAND REP 2	2.0	250	263	34,046	2023/8/15
		DEUTSCHLAND REP 2.5	2.5	390	634	81,879	2044/7/4
		DEUTSCHLAND REP 2.5	2.5	280	467	60,249	2046/8/15
		DEUTSCHLAND REP 3.25	3.25	210	366	47,264	2042/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4	4.0	350	590	76,126	2037/1/4
		DEUTSCHLAND REP 4.25	4.25	200	367	47,359	2039/7/4

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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 4.75	4.75	170	235	30,389	2028/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4.75	4.75	180	304	39,260	2034/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4.75	4.75	250	493	63,702	2040/7/4
		DEUTSCHLAND REP 5.5	5.5	80	127	16,414	2031/1/4
		DEUTSCHLAND REP 5.625	5.625	160	226	29,235	2028/1/4
		DEUTSCHLAND REP 6.25	6.25	290	462	59,717	2030/1/4
		DEUTSCHLAND REP 6.5	6.5	160	229	29,669	2027/7/4
(イタリア)	国債証券	BTPS 0	—	250	252	32,543	2024/4/15
		BTPS 0	—	100	100	13,016	2024/8/15
		BTPS 0.3	0.3	100	101	13,089	2023/8/15
		BTPS 0.35	0.35	300	306	39,532	2025/2/1
		BTPS 0.5	0.5	50	51	6,630	2026/2/1
		BTPS 0.5	0.5	270	275	35,526	2028/7/15
		BTPS 0.6	0.6	360	361	46,583	2031/8/1
		BTPS 0.65	0.65	300	307	39,621	2023/10/15
		BTPS 0.85	0.85	280	292	37,770	2027/1/15
		BTPS 0.9	0.9	500	506	65,363	2022/8/1
		BTPS 0.9	0.9	240	248	32,069	2031/4/1
		BTPS 0.95	0.95	720	736	94,989	2023/3/15
		BTPS 0.95	0.95	130	136	17,648	2027/9/15
		BTPS 0.95	0.95	210	219	28,282	2030/8/1
		BTPS 0.95	0.95	180	186	23,994	2031/12/1
		BTPS 0.95	0.95	100	98	12,706	2037/3/1
		BTPS 1.25	1.25	200	213	27,545	2026/12/1
		BTPS 1.35	1.35	560	605	78,105	2030/4/1
		BTPS 1.45	1.45	200	204	26,342	2022/9/15
		BTPS 1.45	1.45	250	264	34,078	2024/11/15
		BTPS 1.45	1.45	240	255	32,913	2025/5/15
		BTPS 1.45	1.45	100	106	13,746	2036/3/1
		BTPS 1.5	1.5	420	447	57,752	2025/6/1
		BTPS 1.5	1.5	80	81	10,539	2045/4/30
		BTPS 1.6	1.6	380	410	52,999	2026/6/1
		BTPS 1.65	1.65	230	254	32,805	2030/12/1
		BTPS 1.65	1.65	370	408	52,743	2032/3/1
		BTPS 1.7	1.7	140	144	18,607	2051/9/1
		BTPS 1.8	1.8	220	239	30,884	2041/3/1
		BTPS 1.85	1.85	300	318	41,049	2024/5/15
		BTPS 2	2.0	220	240	31,025	2025/12/1
		BTPS 2	2.0	320	358	46,245	2028/2/1
		BTPS 2.05	2.05	320	357	46,142	2027/8/1
		BTPS 2.1	2.1	280	309	39,978	2026/7/15
		BTPS 2.15	2.15	50	52	6,727	2072/3/1
		BTPS 2.2	2.2	290	326	42,094	2027/6/1
		BTPS 2.25	2.25	310	364	47,009	2036/9/1

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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 2.45	2.45	420	445	57,495	2023/10/1	
		BTPS 2.45	2.45	130	154	19,993	2033/9/1	
		BTPS 2.45	2.45	180	217	28,044	2050/9/1	
		BTPS 2.5	2.5	260	283	36,621	2024/12/1	
		BTPS 2.5	2.5	210	233	30,172	2025/11/15	
		BTPS 2.7	2.7	260	326	42,166	2047/3/1	
		BTPS 2.8	2.8	240	284	36,706	2028/12/1	
		BTPS 2.8	2.8	60	74	9,665	2067/3/1	
		BTPS 2.95	2.95	150	192	24,773	2038/9/1	
		BTPS 3	3.0	170	205	26,566	2029/8/1	
		BTPS 3.1	3.1	100	131	16,909	2040/3/1	
		BTPS 3.25	3.25	160	219	28,347	2046/9/1	
		BTPS 3.35	3.35	210	275	35,499	2035/3/1	
		BTPS 3.45	3.45	80	114	14,708	2048/3/1	
		BTPS 3.75	3.75	100	112	14,495	2024/9/1	
		BTPS 3.85	3.85	180	274	35,453	2049/9/1	
		BTPS 4	4.0	250	354	45,762	2037/2/1	
		BTPS 4.5	4.5	70	78	10,148	2024/3/1	
		BTPS 4.5	4.5	300	363	46,857	2026/3/1	
		BTPS 4.75	4.75	300	330	42,640	2023/8/1	
		BTPS 4.75	4.75	270	355	45,821	2028/9/1	
		BTPS 4.75	4.75	270	448	57,906	2044/9/1	
		BTPS 5	5.0	300	356	45,928	2025/3/1	
		BTPS 5	5.0	310	467	60,331	2034/8/1	
		BTPS 5	5.0	250	404	52,210	2039/8/1	
		BTPS 5	5.0	180	294	38,029	2040/9/1	
		BTPS 5.25	5.25	410	574	74,049	2029/11/1	
		BTPS 5.5	5.5	350	374	48,363	2022/11/1	
		BTPS 5.75	5.75	200	311	40,131	2033/2/1	
		BTPS 6	6.0	250	380	49,067	2031/5/1	
		BTPS 6.5	6.5	190	264	34,168	2027/11/1	
		BTPS 9	9.0	170	205	26,463	2023/11/1	
(フランス)	国債証券	FRANCE O. A. T. 0	—	300	303	39,128	2023/2/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	430	434	56,112	2023/3/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	340	345	44,632	2024/2/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	450	458	59,124	2024/3/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	340	348	44,925	2025/3/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	380	390	50,389	2026/2/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	270	277	35,848	2027/2/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	480	492	63,544	2029/11/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	430	439	56,633	2030/11/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	230	233	30,072	2031/11/25	
		FRANCE O. A. T. 0.25	0.25	410	428	55,215	2026/11/25	
		FRANCE O. A. T. 0.5	0.5	440	459	59,275	2025/5/25	

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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. 0.5	0.5	470	495	63,878	2026/5/25
		FRANCE	O. A. T. 0.5	0.5	420	448	57,851	2029/5/25
		FRANCE	O. A. T. 0.5	0.5	240	247	31,889	2040/5/25
		FRANCE	O. A. T. 0.5	0.5	70	70	9,156	2044/6/25
		FRANCE	O. A. T. 0.5	0.5	110	95	12,342	2072/5/25
		FRANCE	O. A. T. 0.75	0.75	640	693	89,406	2028/5/25
		FRANCE	O. A. T. 0.75	0.75	580	629	81,219	2028/11/25
		FRANCE	O. A. T. 0.75	0.75	350	361	46,604	2052/5/25
		FRANCE	O. A. T. 0.75	0.75	120	122	15,837	2053/5/25
		FRANCE	O. A. T. 1	1.0	350	374	48,359	2025/11/25
		FRANCE	O. A. T. 1	1.0	280	305	39,364	2027/5/25
		FRANCE	O. A. T. 1.25	1.25	380	438	56,583	2034/5/25
		FRANCE	O. A. T. 1.25	1.25	490	569	73,432	2036/5/25
		FRANCE	O. A. T. 1.5	1.5	540	630	81,338	2031/5/25
		FRANCE	O. A. T. 1.5	1.5	350	435	56,133	2050/5/25
		FRANCE	O. A. T. 1.75	1.75	640	667	86,154	2023/5/25
		FRANCE	O. A. T. 1.75	1.75	570	615	79,455	2024/11/25
		FRANCE	O. A. T. 1.75	1.75	410	519	67,037	2039/6/25
		FRANCE	O. A. T. 1.75	1.75	150	206	26,606	2066/5/25
		FRANCE	O. A. T. 2	2.0	290	396	51,175	2048/5/25
		FRANCE	O. A. T. 2.25	2.25	120	124	16,019	2022/10/25
		FRANCE	O. A. T. 2.25	2.25	430	465	60,052	2024/5/25
		FRANCE	O. A. T. 2.5	2.5	640	799	103,086	2030/5/25
		FRANCE	O. A. T. 2.75	2.75	420	506	65,327	2027/10/25
		FRANCE	O. A. T. 3.25	3.25	280	458	59,141	2045/5/25
		FRANCE	O. A. T. 3.5	3.5	490	585	75,568	2026/4/25
		FRANCE	O. A. T. 4	4.0	230	377	48,758	2038/10/25
		FRANCE	O. A. T. 4	4.0	170	342	44,231	2055/4/25
		FRANCE	O. A. T. 4	4.0	170	360	46,484	2060/4/25
		FRANCE	O. A. T. 4.25	4.25	480	532	68,668	2023/10/25
		FRANCE	O. A. T. 4.5	4.5	470	846	109,255	2041/4/25
		FRANCE	O. A. T. 4.75	4.75	270	444	57,309	2035/4/25
		FRANCE	O. A. T. 5.5	5.5	390	569	73,494	2029/4/25
		FRANCE	O. A. T. 5.75	5.75	340	565	72,936	2032/10/25
		FRANCE	O. A. T. 6	6.0	400	512	66,165	2025/10/25
		FRANCE	O. A. T. 8.5	8.5	200	230	29,796	2023/4/25
(オランダ)	国債証券	NETHERLANDS	GOVT 0	—	170	173	22,348	2024/1/15
		NETHERLANDS	GOVT 0	—	120	124	16,036	2027/1/15
		NETHERLANDS	GOVT 0	—	180	187	24,128	2030/7/15
		NETHERLANDS	GOVT 0	—	100	103	13,361	2031/7/15
		NETHERLANDS	GOVT 0	—	50	50	6,551	2038/1/15
		NETHERLANDS	GOVT 0	—	80	78	10,147	2052/1/15
		NETHERLANDS	GOVT 0.25	0.25	200	207	26,822	2025/7/15
		NETHERLANDS	GOVT 0.25	0.25	130	137	17,781	2029/7/15

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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		
		NETHERLANDS GOVT 0.5	0.5	230	243	31,462	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVT 0.5	0.5	200	222	28,684	2040/1/15
		NETHERLANDS GOVT 0.75	0.75	170	184	23,776	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVT 0.75	0.75	100	109	14,105	2028/7/15
		NETHERLANDS GOVT 1.75	1.75	160	167	21,640	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVT 2	2.0	200	216	27,903	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVT 2.5	2.5	140	185	23,966	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVT 2.75	2.75	170	291	37,564	2047/1/15
		NETHERLANDS GOVT 3.75	3.75	100	106	13,717	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVT 3.75	3.75	190	340	43,946	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVT 4	4.0	260	430	55,483	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVT 5.5	5.5	150	209	27,060	2028/1/15
(スペイン)	国債証券	SPANISH GOV T 0	—	180	181	23,464	2023/4/30
		SPANISH GOV T 0	—	350	355	45,823	2024/5/31
		SPANISH GOV T 0	—	290	295	38,086	2025/1/31
		SPANISH GOV T 0	—	210	213	27,587	2026/1/31
		SPANISH GOV T 0.1	0.1	280	278	35,898	2031/4/30
		SPANISH GOV T 0.25	0.25	390	399	51,497	2024/7/30
		SPANISH GOV T 0.35	0.35	300	305	39,424	2023/7/30
		SPANISH GOV T 0.45	0.45	300	303	39,213	2022/10/31
		SPANISH GOV T 0.5	0.5	440	457	59,061	2030/4/30
		SPANISH GOV T 0.5	0.5	170	174	22,515	2031/10/31
		SPANISH GOV T 0.6	0.6	220	231	29,837	2029/10/31
		SPANISH GOV T 0.8	0.8	100	106	13,723	2027/7/30
		SPANISH GOV T 0.85	0.85	210	215	27,789	2037/7/30
		SPANISH GOV T 1	1.0	180	174	22,542	2050/10/31
		SPANISH GOV T 1.2	1.2	60	63	8,248	2040/10/31
		SPANISH GOV T 1.25	1.25	240	265	34,234	2030/10/31
		SPANISH GOV T 1.3	1.3	250	272	35,109	2026/10/31
		SPANISH GOV T 1.4	1.4	250	276	35,693	2028/4/30
		SPANISH GOV T 1.4	1.4	290	321	41,514	2028/7/30
		SPANISH GOV T 1.45	1.45	350	387	49,948	2027/10/31
		SPANISH GOV T 1.45	1.45	230	257	33,186	2029/4/30
		SPANISH GOV T 1.45	1.45	20	19	2,471	2071/10/31
		SPANISH GOV T 1.5	1.5	290	320	41,349	2027/4/30
		SPANISH GOV T 1.85	1.85	160	189	24,389	2035/7/30
		SPANISH GOV T 1.95	1.95	220	244	31,555	2026/4/30
		SPANISH GOV T 1.95	1.95	200	233	30,170	2030/7/30
		SPANISH GOV T 2.15	2.15	250	277	35,845	2025/10/31
		SPANISH GOV T 2.35	2.35	300	370	47,792	2033/7/30
		SPANISH GOV T 2.7	2.7	270	376	48,508	2048/10/31
		SPANISH GOV T 2.75	2.75	150	165	21,408	2024/10/31
		SPANISH GOV T 2.9	2.9	190	271	35,025	2046/10/31
		SPANISH GOV T 3.45	3.45	160	261	33,778	2066/7/30

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期		末		償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		SPANISH GOV T 4.2	4.2	100	154	19,892	2037/1/31
		SPANISH GOV T 4.4	4.4	300	333	42,974	2023/10/31
		SPANISH GOV T 4.65	4.65	590	711	91,738	2025/7/30
		SPANISH GOV T 4.7	4.7	270	464	59,983	2041/7/30
		SPANISH GOV T 4.8	4.8	100	113	14,610	2024/1/31
		SPANISH GOV T 4.9	4.9	230	401	51,731	2040/7/30
		SPANISH GOV T 5.15	5.15	200	276	35,700	2028/10/31
		SPANISH GOV T 5.15	5.15	130	246	31,746	2044/10/31
		SPANISH GOV T 5.75	5.75	260	415	53,571	2032/7/30
		SPANISH GOV T 5.9	5.9	270	354	45,786	2026/7/30
		SPANISH GOV T 6	6.0	180	262	33,908	2029/1/31
(ベルギー)	国債証券	BELGIAN 0326 4	4.0	50	72	9,348	2032/3/28
		BELGIAN 0	—	205	211	27,327	2027/10/22
		BELGIAN 0.1	0.1	130	134	17,377	2030/6/22
		BELGIAN 0.2	0.2	80	81	10,532	2023/10/22
		BELGIAN 0.4	0.4	50	50	6,518	2040/6/22
		BELGIAN 0.8	0.8	240	253	32,765	2025/6/22
		BELGIAN 0.8	0.8	380	410	52,999	2027/6/22
		BELGIAN 0.8	0.8	130	141	18,267	2028/6/22
		BELGIAN 0291 5.5	5.5	170	239	30,906	2028/3/28
		BELGIAN 0304 5	5.0	160	268	34,692	2035/3/28
		BELGIAN 0320 4.25	4.25	170	296	38,238	2041/3/28
		BELGIAN 0324 4.5	4.5	80	99	12,825	2026/3/28
		BELGIAN 0325 4.25	4.25	70	73	9,523	2022/9/28
		BELGIAN 0328 2.25	2.25	100	105	13,608	2023/6/22
		BELGIAN 0332 2.6	2.6	240	262	33,923	2024/6/22
		BELGIAN 0333 3	3.0	120	166	21,478	2034/6/22
		BELGIAN 0338 0.5	0.5	100	103	13,410	2024/10/22
		BELGIAN 0344 1.45	1.45	110	131	17,020	2037/6/22
		BELGIAN 0347 0.9	0.9	170	187	24,171	2029/6/22
		BELGIAN 0348 1.7	1.7	100	129	16,659	2050/6/22
		BELGIAN 0352 0	—	90	91	11,793	2031/10/22
		BELGIAN 0353 0.65	0.65	30	28	3,618	2071/6/22
		BELGIAN 1	1.0	200	216	27,867	2026/6/22
		BELGIAN 1	1.0	160	179	23,140	2031/6/22
		BELGIAN 1.25	1.25	130	150	19,453	2033/4/22
		BELGIAN 1.6	1.6	120	150	19,417	2047/6/22
		BELGIAN 1.9	1.9	170	217	28,022	2038/6/22
		BELGIAN 2.15	2.15	130	199	25,688	2066/6/22
		BELGIAN 3.75	3.75	130	226	29,242	2045/6/22
(オーストリア)	国債証券	REP OF AUSTRIA 0	—	180	182	23,562	2023/7/15
		REP OF AUSTRIA 0	—	90	91	11,862	2024/7/15
		REP OF AUSTRIA 0	—	120	123	15,931	2030/2/20
		REP OF AUSTRIA 0	—	290	296	38,302	2031/2/20

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期		末		償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		REP OF AUSTRIA 0	—	120	115	14,914	2040/10/20
		REP OF AUSTRIA 0.5	0.5	310	329	42,545	2027/4/20
		REP OF AUSTRIA 0.5	0.5	30	32	4,139	2029/2/20
		REP OF AUSTRIA 0.75	0.75	200	214	27,672	2026/10/20
		REP OF AUSTRIA 0.75	0.75	130	140	18,176	2028/2/20
		REP OF AUSTRIA 0.75	0.75	80	89	11,509	2051/3/20
		REP OF AUSTRIA 1.2	1.2	40	43	5,576	2025/10/20
		REP OF AUSTRIA 1.5	1.5	70	91	11,771	2047/2/20
		REP OF AUSTRIA 1.5	1.5	70	102	13,236	2086/11/2
		REP OF AUSTRIA 1.75	1.75	80	84	10,887	2023/10/20
		REP OF AUSTRIA 2.4	2.4	100	131	17,012	2034/5/23
		REP OF AUSTRIA 3.15	3.15	40	66	8,591	2044/6/20
		REP OF AUSTRIA 3.4	3.4	200	210	27,134	2022/11/22
		REP OF AUSTRIA 3.8	3.8	150	336	43,420	2062/1/26
		REP OF AUSTRIA 4.15	4.15	120	197	25,500	2037/3/15
		REP OF AUSTRIA 4.85	4.85	100	125	16,221	2026/3/15
(フィンランド)	国債証券	FINNISH GOV'T 0	—	120	121	15,721	2023/9/15
		FINNISH GOV'T 0	—	70	72	9,303	2030/9/15
		FINNISH GOV'T 0.125	0.125	40	41	5,355	2031/9/15
		FINNISH GOV'T 0.125	0.125	20	19	2,491	2052/4/15
		FINNISH GOV'T 0.25	0.25	70	72	9,292	2040/9/15
		FINNISH GOV'T 0.5	0.5	100	105	13,617	2026/4/15
		FINNISH GOV'T 0.5	0.5	40	42	5,504	2027/9/15
		FINNISH GOV'T 0.5	0.5	100	107	13,869	2029/9/15
		FINNISH GOV'T 0.75	0.75	30	33	4,274	2031/4/15
		FINNISH GOV'T 0.875	0.875	100	106	13,732	2025/9/15
		FINNISH GOV'T 1.125	1.125	100	115	14,960	2034/4/15
		FINNISH GOV'T 1.375	1.375	50	65	8,440	2047/4/15
		FINNISH GOV'T 1.5	1.5	100	103	13,383	2023/4/15
		FINNISH GOV'T 1.625	1.625	100	102	13,224	2022/9/15
		FINNISH GOV'T 2.625	2.625	40	61	7,914	2042/7/4
		FINNISH GOV'T 2.75	2.75	100	123	15,886	2028/7/4
(アイルランド)	国債証券	IRISH GOVT 0.2	0.2	120	124	16,117	2027/5/15
		IRISH GOVT 0.2	0.2	150	155	20,067	2030/10/18
		IRISH GOVT 0.9	0.9	120	130	16,885	2028/5/15
		IRISH GOVT 1	1.0	220	236	30,548	2026/5/15
		IRISH GOVT 1.1	1.1	130	144	18,654	2029/5/15
		IRISH GOVT 1.3	1.3	150	173	22,353	2033/5/15
		IRISH GOVT 1.35	1.35	60	69	8,901	2031/3/18
		IRISH GOVT 1.5	1.5	70	86	11,158	2050/5/15
		IRISH GOVT 1.7	1.7	100	123	15,923	2037/5/15
		IRISH GOVT 2	2.0	70	94	12,200	2045/2/18
		IRISH GOVT 2.4	2.4	100	123	15,961	2030/5/15
		IRISH GOVT 3.4	3.4	80	88	11,407	2024/3/18

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期				末			
				利	率	額	面	評		額	償
								外	貨		
			IRISH GOVT 3.9	3.9		50		53		6,918	2023/3/20
			IRISH GOVT 5.4	5.4		50		60		7,853	2025/3/13
小		計		—		—		—		10,529,031	—
						千英	千英				
(イギリス)	国債証券	UK TSY GILT 0.125	0.125	260	260	39,195	2023/1/31				
		UK TSY GILT 0.125	0.125	260	259	39,127	2024/1/31				
		UK TSY GILT 0.125	0.125	360	357	53,926	2026/1/30				
		UK TSY GILT 0.125	0.125	140	137	20,747	2028/1/31				
		UK TSY GILT 0.25	0.25	220	212	31,958	2031/7/31				
		UK TSY GILT 0.375	0.375	100	100	15,105	2026/10/22				
		UK TSY GILT 0.375	0.375	180	177	26,687	2030/10/22				
		UK TSY GILT 0.5	0.5	140	123	18,685	2061/10/22				
		UK TSY GILT 0.625	0.625	250	254	38,292	2025/6/7				
		UK TSY GILT 0.625	0.625	220	214	32,288	2035/7/31				
		UK TSY GILT 0.625	0.625	230	211	31,841	2050/10/22				
		UK TSY GILT 0.75	0.75	280	283	42,723	2023/7/22				
		UK TSY GILT 0.875	0.875	170	175	26,429	2029/10/22				
		UK TSY GILT 0.875	0.875	170	166	25,050	2046/1/31				
		UK TSY GILT 1	1.0	150	153	23,117	2024/4/22				
		UK TSY GILT 1.125	1.125	300	309	46,650	2039/1/31				
		UK TSY GILT 1.25	1.25	150	158	23,826	2027/7/22				
		UK TSY GILT 1.25	1.25	150	158	23,880	2041/10/22				
		UK TSY GILT 1.25	1.25	250	268	40,535	2051/7/31				
		UK TSY GILT 1.5	1.5	80	84	12,788	2026/7/22				
		UK TSY GILT 1.5	1.5	310	348	52,552	2047/7/22				
		UK TSY GILT 1.625	1.625	220	239	36,043	2028/10/22				
		UK TSY GILT 1.625	1.625	80	95	14,444	2054/10/22				
		UK TSY GILT 1.625	1.625	80	108	16,425	2071/10/22				
		UK TSY GILT 1.75	1.75	310	315	47,535	2022/9/7				
		UK TSY GILT 1.75	1.75	220	249	37,537	2037/9/7				
		UK TSY GILT 1.75	1.75	90	107	16,183	2049/1/22				
		UK TSY GILT 1.75	1.75	220	278	41,906	2057/7/22				
		UK TSY GILT 2	2.0	130	139	21,006	2025/9/7				
		UK TSY GILT 2.25	2.25	250	260	39,317	2023/9/7				
		UK TSY GILT 2.5	2.5	140	225	34,022	2065/7/22				
		UK TSY GILT 2.75	2.75	90	97	14,622	2024/9/7				
		UK TSY GILT 3.25	3.25	180	263	39,704	2044/1/22				
		UK TSY GILT 3.5	3.5	250	383	57,824	2045/1/22				
		UK TSY GILT 3.5	3.5	170	347	52,401	2068/7/22				
		UK TSY GILT 4	4.0	140	283	42,785	2060/1/22				
		UK TSY GILT 4.25	4.25	200	248	37,455	2027/12/7				
		UK TSY GILT 4.25	4.25	140	192	29,030	2032/6/7				
		UK TSY GILT 4.25	4.25	180	265	40,011	2036/3/7				
		UK TSY GILT 4.25	4.25	140	218	32,969	2039/9/7				

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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		
		UK TSY GILT 4.25	4.25	190	302	45,582	2040/12/7
		UK TSY GILT 4.25	4.25	90	156	23,588	2046/12/7
		UK TSY GILT 4.25	4.25	90	164	24,730	2049/12/7
		UK TSY GILT 4.25	4.25	200	397	59,899	2055/12/7
		UK TSY GILT 4.5	4.5	210	308	46,446	2034/9/7
		UK TSY GILT 4.5	4.5	260	439	66,239	2042/12/7
		UK TSY GILT 4.75	4.75	160	220	33,308	2030/12/7
		UK TSY GILT 4.75	4.75	70	113	17,158	2038/12/7
		UK TSY GILT 5	5.0	80	93	14,102	2025/3/7
		UK TSY GILT 6	6.0	60	83	12,660	2028/12/7
小	計		-	-	-	1,660,358	-
(スウェーデン)	国債証券	SWEDISH GOVRNMNT 0.125	0.125	500	502	6,340	2031/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 0.75	0.75	1,080	1,139	14,388	2028/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 0.75	0.75	810	858	10,843	2029/11/12
		SWEDISH GOVRNMNT 1	1.0	640	678	8,575	2026/11/12
		SWEDISH GOVRNMNT 1.5	1.5	1,010	1,050	13,270	2023/11/13
		SWEDISH GOVRNMNT 2.25	2.25	300	367	4,644	2032/6/1
		SWEDISH GOVRNMNT 2.5	2.5	800	882	11,141	2025/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 3.5	3.5	430	655	8,279	2039/3/30
小	計		-	-	-	77,484	-
(ノルウェー)	国債証券	NORWEGIAN GOV'T 1.25	1.25	410	413	5,144	2031/9/17
		NORWEGIAN GOV'T 1.375	1.375	330	336	4,180	2030/8/19
		NORWEGIAN GOV'T 1.5	1.5	650	664	8,265	2026/2/19
		NORWEGIAN GOV'T 1.75	1.75	250	257	3,198	2025/3/13
		NORWEGIAN GOV'T 1.75	1.75	680	706	8,778	2027/2/17
		NORWEGIAN GOV'T 1.75	1.75	460	482	5,992	2029/9/6
		NORWEGIAN GOV'T 2	2.0	700	717	8,916	2023/5/24
		NORWEGIAN GOV'T 2	2.0	400	423	5,268	2028/4/26
		NORWEGIAN GOV'T 3	3.0	920	971	12,070	2024/3/14
小	計		-	-	-	61,816	-
(デンマーク)	国債証券	DENMARK - BULLET 0	-	390	396	6,883	2024/11/15
		DENMARK - BULLET 0	-	550	559	9,699	2031/11/15
		DENMARK - BULLET 0.25	0.25	220	222	3,854	2022/11/15
		DENMARK - BULLET 0.25	0.25	450	452	7,858	2052/11/15
		DENMARK - BULLET 0.5	0.5	660	697	12,108	2027/11/15
		DENMARK - BULLET 0.5	0.5	1,090	1,163	20,182	2029/11/15
		DENMARK - BULLET 1.5	1.5	1,100	1,149	19,947	2023/11/15
		DENMARK - BULLET 1.75	1.75	690	756	13,126	2025/11/15
		DENMARK - BULLET 4.5	4.5	1,190	2,165	37,570	2039/11/15
		DENMARK - BULLET 7	7.0	90	112	1,947	2024/11/10
小	計		-	-	-	133,179	-

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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		
(ポーランド)	国債証券	POLAND GOVT BOND	—	千ポーランドズロチ 260	千ポーランドズロチ 258	7,283	2023/4/25
		POLAND GOVT BOND 0.25	0.25	140	133	3,755	2026/10/25
		POLAND GOVT BOND 0.75	0.75	850	851	24,009	2025/4/25
		POLAND GOVT BOND 1.25	1.25	200	194	5,479	2030/10/25
		POLAND GOVT BOND 2.25	2.25	560	588	16,596	2024/10/25
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	70	74	2,106	2026/7/25
		POLAND GOVT BOND 2.75	2.75	510	558	15,734	2028/4/25
		POLAND GOVT BOND 2.75	2.75	520	571	16,104	2029/10/25
		POLAND GOVT BOND 3.25	3.25	470	513	14,467	2025/7/25
		POLAND GOVT BOND 4	4.0	260	280	7,901	2023/10/25
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	540	573	16,163	2022/9/23
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	510	671	18,932	2029/4/25
		小 計	—	—	—	148,533	—
(オーストラリア)	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	0.25	千オーストラリアドル 200	千オーストラリアドル 200	15,940	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 0.25	0.25	320	317	25,283	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 0.5	0.5	320	318	25,393	2026/9/21
		AUSTRALIAN GOVT. 1	1.0	310	307	24,504	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVT. 1	1.0	220	216	17,262	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 1.25	1.25	190	191	15,228	2032/5/21
		AUSTRALIAN GOVT. 1.5	1.5	250	258	20,607	2031/6/21
		AUSTRALIAN GOVT. 1.75	1.75	220	232	18,503	2032/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 1.75	1.75	180	168	13,455	2051/6/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	140	143	11,454	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	320	350	27,897	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.5	2.5	380	427	34,007	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	330	353	28,185	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	270	303	24,140	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	130	147	11,740	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	250	285	22,717	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	150	174	13,913	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	130	149	11,880	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVT. 3	3.0	120	144	11,520	2047/3/21
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	230	254	20,253	2025/4/21
AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	250	293	23,364	2029/4/21		
AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	80	98	7,849	2039/6/21		
AUSTRALIAN GOVT. 3.75	3.75	150	195	15,558	2037/4/21		
AUSTRALIAN GOVT. 4.25	4.25	210	246	19,611	2026/4/21		
AUSTRALIAN GOVT. 4.5	4.5	140	189	15,112	2033/4/21		
AUSTRALIAN GOVT. 5.5	5.5	200	218	17,364	2023/4/21		
小 計	—	—	—	492,751	—		
(シンガポール)	国債証券	SINGAPORE GOV T 1.875	1.875	千シンガポールドル 90	千シンガポールドル 90	7,375	2050/3/1
		SINGAPORE GOV T 2	2.0	120	124	10,105	2024/2/1

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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	
	SINGAPORE GOV T 2.125	2.125	340	361	29,309	2026/6/1
	SINGAPORE GOV T 2.25	2.25	120	129	10,492	2036/8/1
	SINGAPORE GOV T 2.375	2.375	90	98	8,004	2039/7/1
	SINGAPORE GOV T 2.625	2.625	210	230	18,708	2028/5/1
	SINGAPORE GOV T 2.75	2.75	330	344	27,943	2023/7/1
	SINGAPORE GOV T 2.75	2.75	100	115	9,350	2042/4/1
	SINGAPORE GOV T 2.75	2.75	150	174	14,184	2046/3/1
	SINGAPORE GOV T 2.875	2.875	210	236	19,151	2029/7/1
	SINGAPORE GOV T 2.875	2.875	200	226	18,341	2030/9/1
	SINGAPORE GOV T 3	3.0	300	322	26,176	2024/9/1
	SINGAPORE GOV T 3.125	3.125	180	185	15,014	2022/9/1
	SINGAPORE GOV T 3.375	3.375	250	299	24,289	2033/9/1
小	計	—	—	—	238,448	—
(イスラエル)	国債証券		千イスラエルシケル	千イスラエルシケル		
	ISRAEL FIXED 0.75	0.75	170	171	5,842	2022/7/31
	ISRAEL FIXED 1.5	1.5	990	1,021	34,863	2023/11/30
	ISRAEL FIXED 1.5	1.5	360	346	11,816	2037/5/31
	ISRAEL FIXED 1.75	1.75	330	349	11,938	2025/8/31
	ISRAEL FIXED 2.25	2.25	540	596	20,379	2028/9/28
	ISRAEL FIXED 3.75	3.75	370	481	16,448	2047/3/31
	ISRAEL FIXED 6.25	6.25	420	546	18,658	2026/10/30
小	計	—	—	—	119,946	—
合	計	—	—	—	25,898,301	—

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

■ 投資信託財産の構成

(2021年8月25日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
	25,898,301	97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	697,956	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	26,596,257	100.0

※期末における外貨建資産（26,078,825千円）の投資信託財産総額（26,596,257千円）に対する比率は98.1%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=109.86円、1カナダドル=87.16円、1メキシコペソ=5.4355円、1ユーロ=129.00円、1英ポンド=150.74円、1スウェーデンクローナ=12.63円、1ノルウェークローネ=12.43円、1デンマーククローネ=17.35円、1ポーランドズロチ=28.1936円、1オーストラリアドル=79.62円、1シンガポールドル=81.10円、1イスラエルシケル=34.1453円です。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年8月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	52,620,155,357円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	449,644,922
公 社 債 (評 価 額)	25,898,301,965
未 収 入 金 息	26,149,184,272
未 収 利 息	105,261,519
前 払 費 用	17,762,679
(B) 負 債	26,289,619,535
未 払 金	26,289,614,673
未 払 利 息	392
そ の 他 未 払 費 用	4,470
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	26,330,535,822
元 本	17,264,503,118
次 期 繰 越 損 益 金	9,066,032,704
(D) 受 益 権 総 口 数	17,264,503,118口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	15,251円

※当期における期首元本額15,043,454,758円、期中追加設定元本額11,178,300,254円、期中一部解約元本額8,957,251,894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。

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,211,662,342円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,013,712,465円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	842,192,518円
イオン・バランス戦略ファンド	877,233,480円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,431,753,445円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	527,705,333円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	885,889,436円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	201,371,411円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	53,375,010円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	32,056,062円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	655,738円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,339,079,645円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	820,208円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンドII<適格機関投資家限定>	5,107,293,377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>	157,763,895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>	278,825,116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>	303,113,637円

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

■ 損益の状況

(自2020年8月26日 至2021年8月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	419,212,031円
受 取 利 息	419,482,387
支 払 利 息	△ 270,356
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 639,990,880
売 買 益	2,572,860,981
売 買 損	△3,212,851,861
(C) 信 託 報 酬 等	△ 11,408,582
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 232,187,431
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	8,158,341,812
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,840,892,755
(G) 解 約 差 損 益 金	△4,701,014,432
(H) 計 (D + E + F + G)	9,066,032,704
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	9,066,032,704

※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。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

第17期（2019年12月18日から2020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 率	中 率	期 騰 落 率	中 率		
13期 (2016年12月19日)	円 17,116	% △5.1	172.59	% △5.7	% 98.4	百万円 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
17期 (2020年12月17日)	19,109	4.7	193.48	4.8	99.0	161,689

※ 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2020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	率	騰 落 率	率	
(期 首) 2019年12月17日	円 18,248	% —	184.64	% —	% 98.6
12月末	18,289	0.2	184.76	0.1	98.0
2020年 1 月末	18,430	1.0	186.45	1.0	98.4
2 月末	18,646	2.2	188.52	2.1	98.6
3 月末	18,646	2.2	189.13	2.4	97.9
4 月末	18,321	0.4	185.30	0.4	97.8
5 月末	18,576	1.8	187.85	1.7	97.8
6 月末	18,865	3.4	191.10	3.5	98.2
7 月末	19,053	4.4	192.35	4.2	98.6
8 月末	19,034	4.3	192.65	4.3	98.2
9 月末	19,120	4.8	193.62	4.9	99.0
10 月末	18,839	3.2	190.58	3.2	99.0
11 月末	19,036	4.3	192.55	4.3	98.9
(期 末) 2020年12月17日	19,109	4.7	193.48	4.8	99.0

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2019年12月18日から2020年12月17日まで）

基準価額等の推移



期首	18,248円
期末	19,109円
騰落率	+4.7%

※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、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（2019年12月18日から2020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	<ul style="list-style-type: none"> 新型コロナウイルスの感染拡大による景気の悪化や各国の中央銀行が大規模な金融緩和政策を行ったことなどを受けて、欧米の長期金利（10年国債利回り）が低下（債券価格は上昇）したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> 米金利の低下や米中関係悪化懸念に伴うリスクセンチメント（リスクに対する投資家心理）の悪化を背景に、米ドルが対円で下落したこと

▶ 投資環境について（2019年12月18日から2020年12月17日まで）

長期金利は米国、欧州ともに低下しました。為替市場では、米ドルが対円で下落した一方で、ユーロは対円で上昇しました。

債券市場

米国では、1月から3月にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大を受けたリスクセンチメントの悪化や、F R B（米連邦準備制度理事会）による緊急利下げなど大規模な金融緩和政策を受けて、金利が大幅に低下しました。その後は、経済活動再開の動きの一方で感染拡大が引き続き警戒されたことなどから、金利は一進一退の推移となりました。11月に行われた米大統領選挙の結果について、ねじれ議会（民主党バイデン氏が新大統領、上院は共和党、下院は民主党が過半数）となる可能性が高いとの見方から、大規模な財政拡大への期待は後退しました。しかし、新型コロナウイルスのワクチン開発が進展したことなどから、期末にかけて金利は緩やかに上昇傾向となりました。

欧州でも、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、3月上旬にかけて金利は一時急低下しました。その後、投資家による保有資産売却の動きや大規模な財政支援策への思惑から3月中旬にかけて金利は急上昇しましたが、E C B（欧州中央銀行）が資産購入策の拡大など大規模な金融緩和政策を発表したことで再び低下する展開となりました。その後は、E U（欧州連合）復興基金設立で合意（7月）したことや経済再開の動きを背景としたリスクセンチメント回復の一方で、大規模な金融緩和政策が継続されたことから、金利は期末まで一進一退の推移となりました。

当期の市場の動きを米国10年国債利回りで見ると、期首1.87%から期末0.92%へと低下し、ドイツ10年国債利回りで見ると、期首-0.28%から期末-0.57%へと低下しました。

為替市場

米ドル・円相場は、新型コロナウイルスの感染拡大によるリスク回避的な動きやF R Bの緊急利下げを背景に、3月上旬にかけて米ドル安・円高が進行したものの、その後、米ドル確保の動きが強まり、3月中旬にかけて一転して米ドルが上昇する展開となりました。その後は、F R Bなど各国中央銀行による米ドル供給策を受けて米ドル安・円高となりました。4月以降も、経済活動再開の動きの一方で、米中関係悪化への懸念や感染拡大への懸念などを背景に期末まで、米ドル安・円高傾向での推移となりました。

ユーロ・円は、期初から5月上旬にかけて、欧州各国での新型コロナウイルス感染拡大への懸念などリスクセンチメントの悪化から、円高傾向となりました。その後は、欧州復興基金設立への合意や経済活動再開に伴うリスク選好度の改善などを背景に、期末までユーロ高・円安基調となりました。

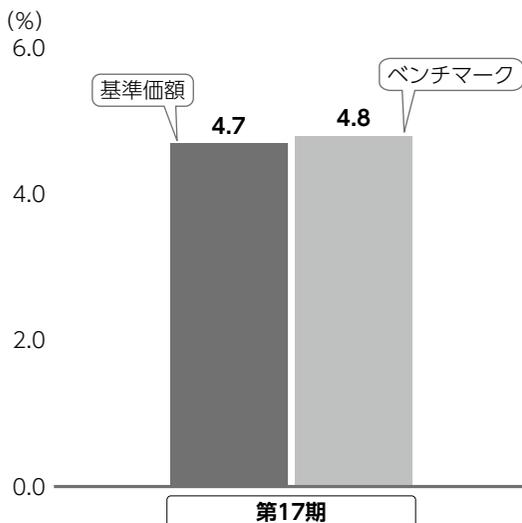
当期の米ドル・円は、期首109円56銭から期末103円44銭と6円12銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首122円01銭から期末126円06銭と4円05銭のユーロ高・円安となりました。

▶ **ポートフォリオについて（2019年12月18日から2020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（2019年12月18日から2020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+4.7%となり、ベンチマークの騰落率+4.8%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、新型コロナウイルスのワクチン開発進展や財政支出の拡大が金利上昇要因となる一方で、感染拡大による悪影響が懸念されることやF R Bの金融緩和政策の継続を背景に金利の上昇が抑制されることから、長期金利は低位のレンジ内での推移を予想します。ユーロ圏でも、財政支出の拡大が見込まれる一方で、低インフレ環境やE C Bの金融緩和政策が続くことから、長期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、米景気の底堅さは米ドルの支援材料ですが、F R Bの金融緩和政策が続くことから、レンジ相場を予想します。ユーロ・米ドルに関しては、ワクチン開発の進展に伴うリスクセンチメントの改善や復興基金による投資拡大への期待がユーロの支援材料となり、ユーロの底堅い推移を予想します。

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、日々の資金流入出に対応し、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 (2019年12月18日から2020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）	(7)	(0.037)	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）	(0)	(0.001)	そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	7	0.038	

期中の平均基準価額は18,737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12月18日から2020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 131,070	千米ドル 251,100
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 7,968	千カナダドル 9,155
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 16,220	千メキシコペソ 22,178
	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	33,962	17,657
	イ タ リ ア	国 債 証 券	18,897	27,462
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	21,406	29,633
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	4,428	4,857
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	14,085	13,692
	ベルギー	国 債 証 券	7,380	10,110
	オーストリア	国 債 証 券	2,962	4,611
	フィンランド	国 債 証 券	711	1,675
アイルランド	国 債 証 券	1,653	2,034	
国	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 11,651	千英ポンド 15,037
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 6,482	千スウェーデンクローナ 11,425

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 7,676	千ノルウェークローネ 8,337
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 8,942	千デンマーククローネ 12,811
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 17,027	千ポーランドズロチ 16,130
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 18,153	千オーストラリアドル 5,821
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 1,610	千シンガポールドル 1,824
国	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリングット 1,718	千マレーシアリングット -
	イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 21,180	千イスラエルシェケル -
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド -	千南アフリカランド 117,912

※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 (2019年12月18日から2020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 (2019年12月18日から2020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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2020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			組入比率	うちBB格以下 組入比率	末		
	額 面 金 額	評 価 額				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
	千 米 ド ル	千 米 ド ル	千 円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	605,970	664,300	68,715,242	42.5	—	18.8	16.3	7.4
カ ナ ダ	千カナダドル 34,300	千カナダドル 39,185	3,179,505	2.0	—	1.1	0.5	0.3
メ キ シ コ	千メキシコペソ 233,000	千メキシコペソ 264,976	1,380,527	0.9	—	0.5	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	79,100	95,520	12,041,282	7.4	—	4.8	2.1	0.6
イ タ リ ア	101,320	122,959	15,500,287	9.6	—	5.8	2.7	1.1
フ ラ ン ス	109,170	134,841	16,998,179	10.5	—	7.0	2.6	0.9
オ ラ ン ダ	20,700	25,529	3,218,304	2.0	—	1.3	0.4	0.3
ス ペ イ ン	61,850	77,684	9,792,846	6.1	—	4.2	1.5	0.4
ベルギー	25,450	32,558	4,104,348	2.5	—	1.9	0.5	0.2
オーストリア	16,150	20,562	2,592,066	1.6	—	1.1	0.3	0.2
フィンランド	8,000	9,187	1,158,207	0.7	—	0.3	0.3	0.1
アイルランド	9,000	10,592	1,335,248	0.8	—	0.6	0.2	0.1
イ ギ リ ス	千英ポンド 56,100	千英ポンド 76,679	10,706,720	6.6	—	5.1	1.2	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 39,000	千スウェーデンクローナ 44,152	546,166	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 30,200	千ノルウェークローネ 32,218	384,049	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 37,900	千デンマーククローネ 49,672	841,446	0.5	—	0.4	0.1	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 32,500	千ポーランドズロチ 36,035	1,024,121	0.6	—	0.3	0.2	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 48,150	千オーストラリアドル 56,066	4,392,805	2.7	—	2.1	0.4	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 7,750	千シンガポールドル 8,975	698,679	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 29,700	千マレーシアリンギット 32,108	820,039	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 17,800	千イスラエルシェケル 20,650	657,084	0.4	—	0.2	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド —	千南アフリカランド —	—	—	—	—	—	—
合 計	—	—	160,087,159	99.0	—	56.2	29.8	12.9

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

※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 0.125	0.125	4,300	4,295	444,340	2023/7/15	
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	8,000	7,993	826,808	2023/8/15	
		US TREASURY N/B 0.125	0.125	5,700	5,692	588,824	2023/10/15	
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	5,000	5,011	518,412	2023/4/15	
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	7,700	7,717	798,292	2023/6/15	
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	2,400	2,391	247,344	2025/6/30	
		US TREASURY N/B 0.25	0.25	3,300	3,286	339,911	2025/7/31	
		US TREASURY N/B 0.375	0.375	1,500	1,504	155,656	2022/3/31	
		US TREASURY N/B 0.375	0.375	3,000	3,008	311,217	2025/4/30	
		US TREASURY N/B 0.375	0.375	9,100	8,947	925,566	2027/9/30	
		US TREASURY N/B 0.5	0.5	1,500	1,512	156,444	2025/3/31	
		US TREASURY N/B 0.5	0.5	3,000	2,987	309,035	2027/4/30	
		US TREASURY N/B 0.5	0.5	3,000	2,985	308,792	2027/5/31	
		US TREASURY N/B 0.625	0.625	1,500	1,506	155,826	2027/3/31	
		US TREASURY N/B 0.625	0.625	7,500	7,325	757,799	2030/5/15	
		US TREASURY N/B 0.625	0.625	5,800	5,649	584,390	2030/8/15	
		US TREASURY N/B 1.125	1.125	4,000	4,048	418,802	2022/2/28	
		US TREASURY N/B 1.125	1.125	1,500	1,552	160,542	2025/2/28	
		US TREASURY N/B 1.125	1.125	3,000	3,106	321,326	2027/2/28	
		US TREASURY N/B 1.25	1.25	3,000	3,086	319,265	2023/7/31	
		US TREASURY N/B 1.25	1.25	5,100	4,601	476,026	2050/5/15	
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	4,000	4,090	423,166	2022/10/15	
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	3,000	3,080	318,635	2023/2/15	
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	500	515	53,320	2023/6/30	
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	2,500	2,582	267,125	2023/8/31	
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	3,000	3,102	320,890	2023/9/30	
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	1,000	1,044	108,062	2025/1/31	
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	2,600	2,732	282,622	2026/8/31	
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	2,500	2,327	240,720	2050/8/15	
		US TREASURY N/B 1.5	1.5	3,000	3,045	315,071	2022/1/31	
		US TREASURY N/B 1.5	1.5	3,500	3,583	370,695	2022/9/15	
		US TREASURY N/B 1.5	1.5	3,000	3,089	319,605	2023/2/28	
		US TREASURY N/B 1.5	1.5	3,000	3,092	319,872	2023/3/31	
		US TREASURY N/B 1.5	1.5	2,000	2,097	216,949	2024/11/30	
		US TREASURY N/B 1.5	1.5	1,500	1,586	164,093	2026/8/15	
		US TREASURY N/B 1.5	1.5	1,000	1,058	109,500	2027/1/31	
US TREASURY N/B 1.5	1.5	4,500	4,754	491,772	2030/2/15			
US TREASURY N/B 1.625	1.625	2,000	2,050	212,068	2022/8/15			
US TREASURY N/B 1.625	1.625	3,400	3,486	360,625	2022/8/31			
US TREASURY N/B 1.625	1.625	3,500	3,599	372,363	2022/11/15			
US TREASURY N/B 1.625	1.625	4,000	4,119	426,075	2022/12/15			

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		債 還 年 月 日
							面	金	
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,000	3,104	321,108	2023/ 4 /30	
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,000	3,107	321,447	2023/ 5 /31	
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,000	3,126	323,363	2023/10/31	
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	2,400	2,550	263,772	2026/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	6,050	6,438	666,000	2026/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,900	4,154	429,732	2026/ 9 /30	
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,000	3,196	330,684	2026/11/30	
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	5,450	5,823	602,373	2029/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,046	315,120	2021/11/30	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,059	316,429	2022/ 2 /28	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	1,800	1,837	190,090	2022/ 3 /31	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	2,400	2,453	253,783	2022/ 4 /30	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	1,600	1,636	169,318	2022/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,070	317,617	2022/ 5 /31	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,074	318,053	2022/ 6 /30	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,087	319,411	2022/ 9 /30	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,103	320,987	2023/ 1 /31	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	2,700	2,803	290,023	2023/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	11,800	12,435	1,286,294	2024/ 6 /30	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	850	896	92,752	2024/ 7 /31	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	2,400	2,577	266,584	2026/12/31	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	4,000	4,318	446,666	2029/11/15	
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	2,400	2,446	253,104	2022/ 1 /31	
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	2,000	2,045	211,534	2022/ 3 /31	
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	3,000	3,071	317,738	2022/ 4 /30	
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	3,000	3,076	318,199	2022/ 5 /31	
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	1,700	1,748	180,821	2022/ 7 /31	
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	4,800	4,942	511,252	2022/ 8 /31	
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	3,000	3,097	320,429	2022/10/31	
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	1,800	1,908	197,407	2024/ 8 /31	
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	3,500	3,775	390,494	2026/ 6 /30	
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	3,200	3,452	357,074	2026/ 7 /31	
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,500	3,567	369,054	2021/12/31	
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,100	3,168	327,703	2022/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,000	3,090	319,678	2022/ 7 /31	
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,500	3,622	374,683	2022/10/31	
		US TREASURY N/B 2		2.0	5,000	5,182	536,029	2022/11/30	
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,800	3,952	408,887	2023/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 2		2.0	2,000	2,121	219,454	2024/ 4 /30	
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,300	3,503	362,366	2024/ 5 /31	
		US TREASURY N/B 2		2.0	2,500	2,657	274,843	2024/ 6 /30	
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,500	3,746	387,524	2025/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 2		2.0	4,300	4,631	479,054	2025/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 2		2.0	5,000	5,436	562,333	2026/11/15	

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		2.0	2,800	3,026	313,074	2050/2/15
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,000	3,062	316,744	2021/12/31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	2,500	2,570	265,893	2022/5/15
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,000	3,092	319,847	2022/6/30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	4,000	4,161	430,504	2022/12/31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,100	3,279	339,227	2023/11/30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	2,000	2,123	219,680	2024/2/29
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	6,500	6,910	714,855	2024/3/31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,500	3,739	386,788	2024/7/31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	4,000	4,282	442,981	2024/9/30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	1,800	1,931	199,807	2024/11/30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	4,900	5,288	547,048	2025/5/15
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	900	982	101,620	2026/5/31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	4,300	4,421	457,336	2022/4/15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	3,000	3,188	329,860	2023/12/31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	2,200	2,341	242,253	2024/1/31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	3,800	4,062	420,187	2024/4/30
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	1,500	1,615	167,075	2024/10/31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	6,300	6,789	702,278	2024/11/15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	3,100	3,345	346,091	2024/12/31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	4,000	4,366	451,644	2025/11/15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	2,700	2,961	306,322	2026/3/31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	4,400	4,858	502,569	2027/2/15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	4,200	4,653	481,320	2027/8/15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	4,400	4,881	504,987	2027/11/15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	2,850	3,243	335,477	2046/8/15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	3,500	3,988	412,584	2049/8/15
		US TREASURY N/B 2.375		2.375	3,600	3,700	382,799	2022/3/15
		US TREASURY N/B 2.375		2.375	1,200	1,256	130,014	2023/1/31
		US TREASURY N/B 2.375		2.375	3,700	3,958	409,429	2024/2/29
		US TREASURY N/B 2.375		2.375	5,600	6,037	624,519	2024/8/15
		US TREASURY N/B 2.375		2.375	4,900	5,461	564,986	2027/5/15
		US TREASURY N/B 2.375		2.375	5,200	5,869	607,141	2029/5/15
		US TREASURY N/B 2.375		2.375	1,900	2,222	229,916	2049/11/15
		US TREASURY N/B 2.5		2.5	1,900	1,948	201,556	2022/1/15
		US TREASURY N/B 2.5		2.5	3,500	3,596	372,024	2022/2/15
		US TREASURY N/B 2.5		2.5	5,000	5,313	549,605	2023/8/15
		US TREASURY N/B 2.5		2.5	5,700	6,145	635,671	2024/5/15
		US TREASURY N/B 2.5		2.5	3,400	3,709	383,733	2025/1/31
		US TREASURY N/B 2.5		2.5	1,400	1,551	160,462	2026/2/28
		US TREASURY N/B 2.5		2.5	4,100	4,875	504,302	2045/2/15
		US TREASURY N/B 2.5		2.5	2,900	3,453	357,264	2046/2/15
		US TREASURY N/B 2.5		2.5	4,100	4,884	505,230	2046/5/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	3,000	3,074	317,981	2021/12/15

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		債 還 年 月 日
							面	金	
		US TREASURY N/B 2. 625		2. 625	4, 000	4, 218	436, 322	2023/ 2 /28	
		US TREASURY N/B 2. 625		2. 625	2, 300	2, 527	261, 480	2025/ 3 /31	
		US TREASURY N/B 2. 625		2. 625	4, 400	4, 892	506, 125	2025/12/31	
		US TREASURY N/B 2. 625		2. 625	4, 700	5, 389	557, 497	2029/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	2, 900	3, 078	318, 466	2023/ 4 /30	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	1, 000	1, 063	110, 010	2023/ 5 /31	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	2, 000	2, 135	220, 925	2023/ 7 /31	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	3, 800	4, 066	420, 587	2023/ 8 /31	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	4, 200	4, 515	467, 133	2023/11/15	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	5, 100	5, 513	570, 283	2024/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	2, 000	2, 205	228, 133	2025/ 2 /28	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	4, 600	5, 102	527, 755	2025/ 6 /30	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	2, 100	2, 334	241, 508	2025/ 8 /31	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	4, 800	5, 502	569, 204	2028/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	2, 000	2, 473	255, 836	2042/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	300	370	38, 343	2042/11/15	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	3, 800	4, 749	491, 309	2047/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 2. 75		2. 75	1, 500	1, 876	194, 071	2047/11/15	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	1, 000	1, 077	111, 472	2023/10/31	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	2, 000	2, 159	223, 381	2023/11/30	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	2, 200	2, 445	252, 956	2025/ 4 /30	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	1, 100	1, 224	126, 700	2025/ 5 /31	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	2, 500	2, 807	290, 399	2025/11/30	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	5, 000	5, 792	599, 143	2028/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	5, 500	6, 386	660, 658	2028/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	3, 000	3, 786	391, 633	2043/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	4, 000	5, 075	524, 974	2045/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	3, 600	4, 585	474, 295	2046/11/15	
		US TREASURY N/B 2. 875		2. 875	1, 400	1, 800	186, 280	2049/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	4, 000	4, 502	465, 706	2025/ 9 /30	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	3, 100	3, 494	361, 473	2025/10/31	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	800	1, 026	106, 194	2042/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	3, 500	4, 519	467, 470	2044/11/15	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	3, 000	3, 881	401, 464	2045/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	2, 700	3, 502	362, 277	2045/11/15	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	2, 500	3, 258	337, 109	2047/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	2, 200	2, 871	296, 994	2047/ 5 /15	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	3, 100	4, 053	419, 268	2048/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	5, 400	7, 076	731, 996	2048/ 8 /15	
		US TREASURY N/B 3		3. 0	3, 800	4, 993	516, 490	2049/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 3. 125		3. 125	4, 200	4, 969	514, 074	2028/11/15	
		US TREASURY N/B 3. 125		3. 125	1, 100	1, 435	148, 505	2041/11/15	
		US TREASURY N/B 3. 125		3. 125	1, 000	1, 308	135, 320	2042/ 2 /15	
		US TREASURY N/B 3. 125		3. 125	2, 300	3, 010	311, 423	2043/ 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	評 価 額		債 還 年 月 日
							面	金	
		US TREASURY N/B 3.125		3.125	3,300	4,342	449,211	2044/8/15	
		US TREASURY N/B 3.125		3.125	2,400	3,211	332,236	2048/5/15	
		US TREASURY N/B 3.375		3.375	3,000	4,094	423,538	2044/5/15	
		US TREASURY N/B 3.375		3.375	3,100	4,338	448,729	2048/11/15	
		US TREASURY N/B 3.5		3.5	800	1,085	112,290	2039/2/15	
		US TREASURY N/B 3.625		3.625	2,400	3,384	350,050	2043/8/15	
		US TREASURY N/B 3.625		3.625	3,600	5,087	526,239	2044/2/15	
		US TREASURY N/B 3.75		3.75	1,500	2,128	220,145	2041/8/15	
		US TREASURY N/B 3.75		3.75	700	1,005	104,044	2043/11/15	
		US TREASURY N/B 3.875		3.875	500	715	74,032	2040/8/15	
		US TREASURY N/B 4.25		4.25	1,000	1,483	153,442	2039/5/15	
		US TREASURY N/B 4.25		4.25	600	900	93,188	2040/11/15	
		US TREASURY N/B 4.375		4.375	500	743	76,856	2038/2/15	
		US TREASURY N/B 4.375		4.375	700	1,058	109,452	2039/11/15	
		US TREASURY N/B 4.375		4.375	1,400	2,125	219,814	2040/5/15	
		US TREASURY N/B 4.375		4.375	300	459	47,517	2041/5/15	
		US TREASURY N/B 4.5		4.5	750	1,101	113,915	2036/2/15	
		US TREASURY N/B 4.5		4.5	200	301	31,235	2038/5/15	
		US TREASURY N/B 4.5		4.5	1,000	1,529	158,202	2039/8/15	
		US TREASURY N/B 4.625		4.625	600	935	96,744	2040/2/15	
		US TREASURY N/B 4.75		4.75	1,500	2,394	247,710	2041/2/15	
		US TREASURY N/B 5		5.0	500	783	81,038	2037/5/15	
		US TREASURY N/B 5.25		5.25	500	674	69,807	2028/11/15	
		US TREASURY N/B 5.375		5.375	320	460	47,608	2031/2/15	
		US TREASURY N/B 5.5		5.5	500	679	70,314	2028/8/15	
		US TREASURY N/B 6		6.0	1,000	1,286	133,049	2026/2/15	
		US TREASURY N/B 6.125		6.125	1,000	1,373	142,116	2027/11/15	
		US TREASURY N/B 6.25		6.25	800	929	96,192	2023/8/15	
	小	計		—	—	—	68,715,242	—	
(カナダ)	国債証券	CANADA-GOV' T 0.5		0.5	2,000	2,007	162,847	2022/3/1	
		CANADA-GOV' T 0.5		0.5	600	601	48,800	2025/9/1	
		CANADA-GOV' T 1		1.0	3,000	3,040	246,691	2022/9/1	
		CANADA-GOV' T 1		1.0	1,300	1,339	108,708	2027/6/1	
		CANADA-GOV' T 1.25		1.25	3,400	3,560	288,924	2030/6/1	
		CANADA-GOV' T 1.5		1.5	2,000	2,060	167,180	2023/6/1	
		CANADA-GOV' T 1.5		1.5	1,000	1,042	84,558	2024/9/1	
		CANADA-GOV' T 1.5		1.5	3,100	3,271	265,468	2026/6/1	
		CANADA-GOV' T 1.75		1.75	1,100	1,135	92,138	2023/3/1	
		CANADA-GOV' T 2		2.0	1,200	1,254	101,814	2023/9/1	
		CANADA-GOV' T 2		2.0	900	993	80,583	2028/6/1	
		CANADA-GOV' T 2.25		2.25	1,000	1,061	86,144	2024/3/1	
		CANADA-GOV' T 2.25		2.25	1,400	1,514	122,918	2025/6/1	
		CANADA-GOV' T 2.25		2.25	1,100	1,244	101,011	2029/6/1	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末		
				利	率	額	評 価 額		債 還 年 月 日
							面	金	
		CANADA-GOV' T 2.5	2.5	2,100	2,256	183,108	2024/6/1		
		CANADA-GOV' T 2.75	2.75	1,800	1,866	151,485	2022/6/1		
		CANADA-GOV' T 2.75	2.75	1,100	1,478	119,997	2048/12/1		
		CANADA-GOV' T 2.75	2.75	500	744	60,389	2064/12/1		
		CANADA-GOV' T 3.5	3.5	1,300	1,931	156,732	2045/12/1		
		CANADA-GOV' T 4	4.0	1,500	2,280	185,075	2041/6/1		
		CANADA-GOV' T 5	5.0	1,450	2,324	188,595	2037/6/1		
		CANADA-GOV' T 5.75	5.75	250	354	28,757	2029/6/1		
		CANADA-GOV' T 5.75	5.75	500	787	63,899	2033/6/1		
		CANADA-GOV' T 8	8.0	700	1,031	83,669	2027/6/1		
	小	計	-	-	-	3,179,505	-		
(メキシコ)	国債証券	MEXICAN BONOS 10	10.0	32,000	38,208	199,063	2024/12/5		
		MEXICAN BONOS 5.75	5.75	20,000	20,806	108,399	2026/3/5		
		MEXICAN BONOS 6.5	6.5	42,000	43,290	225,543	2022/6/9		
		MEXICAN BONOS 7.5	7.5	25,000	28,264	147,258	2027/6/3		
		MEXICAN BONOS 7.75	7.75	6,000	6,988	36,408	2031/5/29		
		MEXICAN BONOS 7.75	7.75	18,000	20,985	109,335	2034/11/23		
		MEXICAN BONOS 8	8.0	27,000	29,622	154,333	2023/12/7		
		MEXICAN BONOS 8.5	8.5	23,000	27,860	145,152	2029/5/31		
		MEXICAN BONOS 8.5	8.5	40,000	48,950	255,033	2038/11/18		
	小	計	-	-	-	1,380,527	-		
(ユーロ)				千ユーロ	千ユーロ				
(ドイツ)	国債証券	BUNDESUBL-120 0	-	3,500	3,616	455,950	2025/4/11		
		BUNDESUBL-176 0	-	2,000	2,027	255,586	2022/10/7		
		BUNDESUBL-177 0	-	1,900	1,934	243,861	2023/4/14		
		BUNDESUBL-178 0	-	1,600	1,635	206,207	2023/10/13		
		BUNDESUBL-179 0	-	1,300	1,333	168,114	2024/4/5		
		BUNDESSCHATZANW 0	-	3,400	3,430	432,448	2022/3/11		
		DEUTSCHLAND REP 0	-	2,400	2,503	315,619	2026/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 0	-	3,500	3,695	465,794	2029/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 0	-	1,300	1,373	173,138	2030/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 0	-	2,300	2,415	304,463	2050/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	3,800	4,036	508,799	2027/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	2,900	3,111	392,217	2028/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	1,900	2,044	257,673	2029/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5	2,500	2,634	332,130	2025/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5	1,900	2,025	255,384	2026/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5	3,400	3,682	464,242	2027/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5	4,100	4,460	562,318	2028/2/15		
		DEUTSCHLAND REP 1	1.0	1,300	1,385	174,705	2024/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 1	1.0	2,050	2,221	280,068	2025/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 1.25	1.25	1,650	2,326	293,222	2048/8/15		
		DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5	2,100	2,204	277,885	2023/2/15		

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	評 価 額		償 還 年 月 日
								外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5	1,300	1,372	172,976	2023/5/15		
			DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5	2,000	2,157	271,944	2024/5/15		
			DEUTSCHLAND REP 1.75	1.75	2,200	2,285	288,125	2022/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 1.75	1.75	2,200	2,378	299,826	2024/2/15		
			DEUTSCHLAND REP 2	2.0	2,000	2,149	270,991	2023/8/15		
			DEUTSCHLAND REP 2.5	2.5	2,200	3,693	465,573	2044/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 2.5	2.5	2,600	4,485	565,424	2046/8/15		
			DEUTSCHLAND REP 3.25	3.25	1,200	2,159	272,285	2042/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 4	4.0	1,800	3,121	393,556	2037/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 4.25	4.25	950	1,794	226,199	2039/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 4.75	4.75	1,600	2,280	287,493	2028/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 4.75	4.75	2,000	3,475	438,159	2034/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 4.75	4.75	1,650	3,362	423,906	2040/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 5.5	5.5	900	1,470	185,346	2031/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 5.625	5.625	1,000	1,461	184,245	2028/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 6.25	6.25	1,200	1,460	184,157	2024/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 6.25	6.25	500	822	103,697	2030/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 6.5	6.5	1,000	1,487	187,539	2027/7/4		
(イタリア)	国債証券		BTPS 0.35	0.35	2,700	2,762	348,203	2025/2/1		
			BTPS 0.65	0.65	2,000	2,058	259,524	2023/10/15		
			BTPS 0.85	0.85	1,700	1,778	224,151	2027/1/15		
			BTPS 0.9	0.9	2,250	2,300	290,016	2022/8/1		
			BTPS 0.95	0.95	2,000	2,061	259,827	2023/3/1		
			BTPS 0.95	0.95	2,000	2,062	259,973	2023/3/15		
			BTPS 0.95	0.95	1,800	1,884	237,563	2030/8/1		
			BTPS 1	1.0	1,000	1,023	129,046	2022/7/15		
			BTPS 1.2	1.2	1,000	1,021	128,796	2022/4/1		
			BTPS 1.25	1.25	1,600	1,714	216,131	2026/12/1		
			BTPS 1.35	1.35	2,000	2,048	258,178	2022/4/15		
			BTPS 1.45	1.45	2,000	2,068	260,692	2022/9/15		
			BTPS 1.45	1.45	1,800	1,919	241,913	2024/11/15		
			BTPS 1.45	1.45	1,000	1,070	134,971	2025/5/15		
			BTPS 1.45	1.45	600	646	81,538	2036/3/1		
			BTPS 1.5	1.5	2,700	2,899	365,562	2025/6/1		
			BTPS 1.6	1.6	1,200	1,305	164,617	2026/6/1		
			BTPS 1.65	1.65	1,200	1,334	168,191	2030/12/1		
			BTPS 1.65	1.65	1,800	2,002	252,387	2032/3/1		
			BTPS 1.85	1.85	1,000	1,072	135,256	2024/5/15		
			BTPS 1.85	1.85	1,000	1,090	137,418	2025/7/1		
			BTPS 2	2.0	1,300	1,435	180,926	2025/12/1		
			BTPS 2	2.0	1,600	1,801	227,113	2028/2/1		
			BTPS 2.05	2.05	1,500	1,686	212,635	2027/8/1		
			BTPS 2.1	2.1	1,000	1,116	140,796	2026/7/15		
			BTPS 2.15	2.15	500	513	64,722	2021/12/15		

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		
		BTPS 2.2	2.2	1,000	1,132	142,824	2027/6/1	
		BTPS 2.25	2.25	1,200	1,433	180,708	2036/9/1	
		BTPS 2.45	2.45	1,100	1,327	167,367	2033/9/1	
		BTPS 2.45	2.45	900	1,129	142,350	2050/9/1	
		BTPS 2.5	2.5	600	664	83,768	2024/12/1	
		BTPS 2.5	2.5	2,100	2,368	298,571	2025/11/15	
		BTPS 2.7	2.7	1,550	2,017	254,325	2047/3/1	
		BTPS 2.8	2.8	300	358	45,247	2028/12/1	
		BTPS 2.8	2.8	900	1,212	152,824	2067/3/1	
		BTPS 2.95	2.95	1,300	1,701	214,444	2038/9/1	
		BTPS 3	3.0	3,500	4,282	539,846	2029/8/1	
		BTPS 3.1	3.1	700	938	118,258	2040/3/1	
		BTPS 3.25	3.25	1,500	2,132	268,791	2046/9/1	
		BTPS 3.35	3.35	850	1,134	143,061	2035/3/1	
		BTPS 3.45	3.45	1,400	2,068	260,732	2048/3/1	
		BTPS 3.5	3.5	4,900	6,262	789,449	2030/3/1	
		BTPS 3.75	3.75	2,000	2,296	289,547	2024/9/1	
		BTPS 3.85	3.85	900	1,428	180,044	2049/9/1	
		BTPS 4	4.0	2,600	3,767	474,967	2037/2/1	
		BTPS 4.5	4.5	2,300	2,570	324,086	2023/5/1	
		BTPS 4.5	4.5	3,000	3,465	436,847	2024/3/1	
		BTPS 4.5	4.5	1,800	2,225	280,555	2026/3/1	
		BTPS 4.75	4.75	2,500	2,842	358,335	2023/8/1	
		BTPS 4.75	4.75	2,500	3,347	421,954	2028/9/1	
		BTPS 4.75	4.75	1,600	2,740	345,422	2044/9/1	
		BTPS 5	5.0	2,000	2,132	268,835	2022/3/1	
		BTPS 5	5.0	1,000	1,219	153,694	2025/3/1	
		BTPS 5	5.0	2,070	3,192	402,420	2034/8/1	
		BTPS 5	5.0	1,800	2,996	377,681	2039/8/1	
		BTPS 5	5.0	1,700	2,857	360,265	2040/9/1	
		BTPS 5.5	5.5	1,200	1,322	166,707	2022/9/1	
		BTPS 5.5	5.5	2,000	2,222	280,173	2022/11/1	
		BTPS 5.75	5.75	1,700	2,699	340,328	2033/2/1	
		BTPS 6	6.0	2,200	3,408	429,639	2031/5/1	
		BTPS 6.5	6.5	1,700	2,429	306,235	2027/11/1	
		BTPS 7.25	7.25	400	569	71,750	2026/11/1	
		BTPS 9	9.0	300	381	48,063	2023/11/1	
(フランス)	国債証券	FRANCE O. A. T. 0	—	2,000	2,017	254,263	2022/2/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	2,200	2,222	280,216	2022/5/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	2,000	2,032	256,186	2023/3/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	4,000	4,093	516,008	2024/3/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	1,200	1,234	155,590	2025/3/25	
		FRANCE O. A. T. 0	—	4,500	4,663	587,918	2029/11/25	
		FRANCE O. A. T. 0.25	0.25	4,900	5,149	649,153	2026/11/25	

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	債	還	年	月	日
		FRANCE	O. A. T.	0.5	0.5	2,900		3,052	384,821	2025/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	0.5	0.5	4,500		4,778	602,389	2026/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	0.5	0.5	2,800		3,027	381,625	2029/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	0.75	0.75	2,500		2,738	345,209	2028/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	0.75	0.75	3,200		3,518	443,585	2028/11/25							
		FRANCE	O. A. T.	0.75	0.75	1,000		1,111	140,150	2052/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	1	1.0	2,050		2,219	279,773	2025/11/25							
		FRANCE	O. A. T.	1	1.0	2,500		2,757	347,578	2027/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	1.25	1.25	2,700		3,214	405,207	2034/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	1.25	1.25	2,400		2,885	363,772	2036/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	1.5	1.5	3,850		4,592	578,980	2031/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	1.5	1.5	2,400		3,192	402,456	2050/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	1.75	1.75	4,200		4,453	561,409	2023/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	1.75	1.75	2,600		2,854	359,790	2024/11/25							
		FRANCE	O. A. T.	1.75	1.75	2,400		3,168	399,358	2039/6/25							
		FRANCE	O. A. T.	1.75	1.75	800		1,220	153,904	2066/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	2	2.0	2,200		3,201	403,531	2048/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	2.25	2.25	1,900		2,005	252,864	2022/10/25							
		FRANCE	O. A. T.	2.25	2.25	3,400		3,750	472,818	2024/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	2.5	2.5	3,500		4,472	563,800	2030/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	2.75	2.75	2,550		3,140	395,866	2027/10/25							
		FRANCE	O. A. T.	3	3.0	5,000		5,250	661,928	2022/4/25							
		FRANCE	O. A. T.	3.25	3.25	2,200		3,796	478,616	2045/5/25							
		FRANCE	O. A. T.	3.5	3.5	2,500		3,063	386,134	2026/4/25							
		FRANCE	O. A. T.	4	4.0	2,000		3,441	433,860	2038/10/25							
		FRANCE	O. A. T.	4	4.0	1,370		2,967	374,040	2055/4/25							
		FRANCE	O. A. T.	4	4.0	1,400		3,214	405,249	2060/4/25							
		FRANCE	O. A. T.	4.25	4.25	4,000		4,575	576,805	2023/10/25							
		FRANCE	O. A. T.	4.5	4.5	2,900		5,490	692,075	2041/4/25							
		FRANCE	O. A. T.	4.75	4.75	2,200		3,770	475,299	2035/4/25							
		FRANCE	O. A. T.	5.5	5.5	2,750		4,152	523,453	2029/4/25							
		FRANCE	O. A. T.	5.75	5.75	2,100		3,628	457,351	2032/10/25							
		FRANCE	O. A. T.	6	6.0	3,000		3,989	502,952	2025/10/25							
		FRANCE	O. A. T.	8.5	8.5	600		731	92,176	2023/4/25							
(オランダ)	国債証券	NETHERLANDS	GOVT	0	—	1,800		1,813	228,641	2022/1/15							
		NETHERLANDS	GOVT	0	—	1,000		1,022	128,934	2024/1/15							
		NETHERLANDS	GOVT	0	—	1,900		1,991	251,070	2030/7/15							
		NETHERLANDS	GOVT	0.25	0.25	1,000		1,045	131,778	2025/7/15							
		NETHERLANDS	GOVT	0.25	0.25	500		535	67,498	2029/7/15							
		NETHERLANDS	GOVT	0.5	0.5	1,200		1,280	161,429	2026/7/15							
		NETHERLANDS	GOVT	0.5	0.5	800		917	115,683	2040/1/15							
		NETHERLANDS	GOVT	0.75	0.75	900		984	124,094	2027/7/15							
		NETHERLANDS	GOVT	0.75	0.75	1,000		1,104	139,281	2028/7/15							
		NETHERLANDS	GOVT	1.75	1.75	1,600		1,704	214,814	2023/7/15							

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	債	還	年	月	日
				2.0		1,000				1,099		138,560		2024/	7/	15	
				2.25		1,500			1,570		198,028		2022/	7/	15		
				2.5		1,000			1,361		171,681		2033/	1/	15		
				2.75		1,200			2,145		270,490		2047/	1/	15		
				3.75		700			765		96,537		2023/	1/	15		
				3.75		1,300			2,429		306,219		2042/	1/	15		
				4.0		1,600			2,746		346,160		2037/	1/	15		
				5.5		700			1,010		127,399		2028/	1/	15		
(スペイン)	国債証券			—		500			510		64,350		2025/	1/	31		
				0.25		1,000			1,029		129,786		2024/	7/	30		
				0.4		2,000			2,028		255,677		2022/	4/	30		
				0.45		500			509		64,255		2022/	10/	31		
				0.5		1,000			1,050		132,408		2030/	4/	30		
				1.25		2,000			2,242		282,644		2030/	10/	31		
				1.3		2,700			2,972		374,718		2026/	10/	31		
				1.4		2,000			2,240		282,490		2028/	4/	30		
				1.4		1,600			1,797		226,619		2028/	7/	30		
				1.45		2,600			2,908		366,677		2027/	10/	31		
				1.45		2,900			3,285		414,155		2029/	4/	30		
				1.5		1,200			1,342		169,214		2027/	4/	30		
				1.6		2,200			2,404		303,146		2025/	4/	30		
				1.85		2,400			2,918		367,950		2035/	7/	30		
				1.95		2,600			2,935		370,098		2026/	4/	30		
				1.95		1,700			2,022		254,997		2030/	7/	30		
				2.15		2,400			2,710		341,720		2025/	10/	31		
				2.35		1,700			2,153		271,520		2033/	7/	30		
				2.7		1,550			2,292		288,933		2048/	10/	31		
				2.75		2,100			2,370		298,825		2024/	10/	31		
				2.9		1,400			2,111		266,136		2046/	10/	31		
				3.45		1,100			2,018		254,443		2066/	7/	30		
				3.8		1,400			1,608		202,718		2024/	4/	30		
				4.2		1,650			2,638		332,569		2037/	1/	31		
				4.4		2,000			2,288		288,463		2023/	10/	31		
				4.65		1,800			2,233		281,527		2025/	7/	30		
				4.7		1,500			2,701		340,537		2041/	7/	30		
				4.8		1,500			1,754		221,123		2024/	1/	31		
				4.9		1,500			2,726		343,703		2040/	7/	30		
				5.15		1,500			2,133		268,954		2028/	10/	31		
				5.15		1,200			2,382		300,315		2044/	10/	31		
				5.4		2,250			2,537		319,928		2023/	1/	31		
				5.75		1,500			2,476		312,142		2032/	7/	30		
				5.85		2,200			2,360		297,505		2022/	1/	31		
				5.9		500			679		85,635		2026/	7/	30		
				6.0		2,200			3,307		416,952		2029/	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	評 価 額		債 還 年 月 日
							面	金	
(ベルギー)	国債証券	BELGIAN 0326 4		4.0		700	1,044	131,679	2032/3/28
		BELGIAN 0.1		0.1	1,300	1,360	171,465	2030/6/22	
		BELGIAN 0.8		0.8	800	854	107,707	2025/6/22	
		BELGIAN 0.8		0.8	1,000	1,092	137,702	2027/6/22	
		BELGIAN 0.8		0.8	500	550	69,441	2028/6/22	
		BELGIAN 0291 5.5		5.5	1,100	1,594	200,997	2028/3/28	
		BELGIAN 0304 5		5.0	1,600	2,790	351,820	2035/3/28	
		BELGIAN 0308 4		4.0	700	742	93,596	2022/3/28	
		BELGIAN 0320 4.25		4.25	1,200	2,185	275,464	2041/3/28	
		BELGIAN 0324 4.5		4.5	700	893	112,668	2026/3/28	
		BELGIAN 0325 4.25		4.25	1,700	1,852	233,486	2022/9/28	
		BELGIAN 0328 2.25		2.25	1,500	1,613	203,426	2023/6/22	
		BELGIAN 0332 2.6		2.6	2,300	2,571	324,226	2024/6/22	
		BELGIAN 0333 3		3.0	700	1,002	126,341	2034/6/22	
		BELGIAN 0338 0.5		0.5	1,000	1,047	132,001	2024/10/22	
		BELGIAN 0338 2.25		2.25	500	812	102,367	2057/6/22	
		BELGIAN 0344 1.45		1.45	400	496	62,576	2037/6/22	
		BELGIAN 0347 0.9		0.9	1,300	1,452	183,084	2029/6/22	
		BELGIAN 0348 1.7		1.7	500	690	87,057	2050/6/22	
		BELGIAN 1		1.0	1,400	1,528	192,708	2026/6/22	
		BELGIAN 1		1.0	1,000	1,140	143,772	2031/6/22	
		BELGIAN 1.25		1.25	400	474	59,800	2033/4/22	
		BELGIAN 1.6		1.6	850	1,130	142,533	2047/6/22	
		BELGIAN 1.9		1.9	1,000	1,327	167,301	2038/6/22	
		BELGIAN 2.15		2.15	500	841	106,117	2066/6/22	
		BELGIAN 3.75		3.75	800	1,467	185,002	2045/6/22	
(オーストリア)	国債証券	REP OF AUSTRIA 0		—	1,100	1,120	141,228	2023/7/15	
		REP OF AUSTRIA 0.5		0.5	800	857	108,080	2027/4/20	
		REP OF AUSTRIA 0.5		0.5	850	920	116,043	2029/2/20	
		REP OF AUSTRIA 0.75		0.75	900	974	122,845	2026/10/20	
		REP OF AUSTRIA 0.75		0.75	700	766	96,667	2028/2/20	
		REP OF AUSTRIA 0.75		0.75	1,000	1,195	150,687	2051/3/20	
		REP OF AUSTRIA 1.2		1.2	1,000	1,093	137,813	2025/10/20	
		REP OF AUSTRIA 1.5		1.5	700	967	121,996	2047/2/20	
		REP OF AUSTRIA 1.5		1.5	200	337	42,565	2086/11/2	
		REP OF AUSTRIA 1.65		1.65	1,100	1,201	151,452	2024/10/21	
		REP OF AUSTRIA 1.75		1.75	1,000	1,070	134,977	2023/10/20	
		REP OF AUSTRIA 2.4		2.4	900	1,226	154,551	2034/5/23	
		REP OF AUSTRIA 3.15		3.15	600	1,052	132,704	2044/6/20	
		REP OF AUSTRIA 3.4		3.4	1,100	1,187	149,726	2022/11/22	
		REP OF AUSTRIA 3.65		3.65	1,000	1,058	133,401	2022/4/20	
		REP OF AUSTRIA 3.8		3.8	700	1,708	215,396	2062/1/26	
		REP OF AUSTRIA 4.15		4.15	1,000	1,712	215,902	2037/3/15	
		REP OF AUSTRIA 4.85		4.85	500	647	81,685	2026/3/15	

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	
		REP OF AUSTRIA	6.25	1,000	1,462	184,338	2027/7/15	
(フィンランド)	国債証券	FINNISH GOV'T 0	—	400	403	50,910	2022/4/15	
		FINNISH GOV'T 0.25	0.25	300	318	40,203	2040/9/15	
		FINNISH GOV'T 0.5	0.5	400	432	54,547	2028/9/15	
		FINNISH GOV'T 0.5	0.5	800	869	109,578	2029/9/15	
		FINNISH GOV'T 0.75	0.75	500	559	70,574	2031/4/15	
		FINNISH GOV'T 1.125	1.125	200	236	29,872	2034/4/15	
		FINNISH GOV'T 1.375	1.375	300	411	51,853	2047/4/15	
		FINNISH GOV'T 1.5	1.5	1,000	1,052	132,707	2023/4/15	
		FINNISH GOV'T 1.625	1.625	1,000	1,041	131,324	2022/9/15	
		FINNISH GOV'T 2	2.0	1,000	1,092	137,696	2024/4/15	
		FINNISH GOV'T 2.625	2.625	500	796	100,409	2042/7/4	
		FINNISH GOV'T 2.75	2.75	600	753	94,959	2028/7/4	
		FINNISH GOV'T 4	4.0	1,000	1,218	153,570	2025/7/4	
(アイルランド)	国債証券	IRISH GOVT 0	—	400	405	51,077	2022/10/18	
		IRISH GOVT 0.8	0.8	700	713	89,889	2022/3/15	
		IRISH GOVT 0.9	0.9	700	771	97,238	2028/5/15	
		IRISH GOVT 1	1.0	1,000	1,086	136,989	2026/5/15	
		IRISH GOVT 1.1	1.1	1,600	1,804	227,420	2029/5/15	
		IRISH GOVT 1.35	1.35	500	585	73,746	2031/3/18	
		IRISH GOVT 1.5	1.5	400	531	67,025	2050/5/15	
		IRISH GOVT 1.7	1.7	300	383	48,372	2037/5/15	
		IRISH GOVT 2	2.0	1,000	1,427	179,975	2045/2/18	
		IRISH GOVT 2.4	2.4	600	757	95,494	2030/5/15	
		IRISH GOVT 3.4	3.4	500	566	71,434	2024/3/18	
		IRISH GOVT 3.9	3.9	500	552	69,610	2023/3/20	
		IRISH GOVT 5.4	5.4	800	1,007	126,972	2025/3/13	
	小	計	—	—	—	66,740,770	—	
(イギリス)	国債証券	UK TSY GILT 0.125	0.125	千英ポンド 1,500	千英ポンド 1,507	210,508	2026/1/30	
		UK TSY GILT 0.375	0.375	1,000	1,008	140,786	2030/10/22	
		UK TSY GILT 0.5	0.5	1,800	1,816	253,633	2022/7/22	
		UK TSY GILT 0.625	0.625	2,000	2,058	287,495	2025/6/7	
		UK TSY GILT 0.75	0.75	2,650	2,706	377,904	2023/7/22	
		UK TSY GILT 0.875	0.875	1,000	1,057	147,621	2029/10/22	
		UK TSY GILT 1	1.0	1,600	1,656	231,327	2024/4/22	
		UK TSY GILT 1.25	1.25	1,000	1,076	150,370	2027/7/22	
		UK TSY GILT 1.5	1.5	1,000	1,084	151,384	2026/7/22	
		UK TSY GILT 1.5	1.5	1,700	1,972	275,357	2047/7/22	
		UK TSY GILT 1.625	1.625	2,000	2,233	311,810	2028/10/22	
		UK TSY GILT 1.625	1.625	500	619	86,497	2054/10/22	
		UK TSY GILT 1.625	1.625	550	775	108,223	2071/10/22	
		UK TSY GILT 1.75	1.75	1,200	1,237	172,849	2022/9/7	
		UK TSY GILT 1.75	1.75	2,700	3,165	442,056	2037/9/7	

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	
		UK TSY GILT 1. 75	1. 75	750	924	129, 098	2049/ 1/ 22	
		UK TSY GILT 2	2. 0	1, 100	1, 205	168, 354	2025/ 9/ 7	
		UK TSY GILT 2. 25	2. 25	2, 700	2, 870	400, 759	2023/ 9/ 7	
		UK TSY GILT 2. 5	2. 5	1, 600	2, 653	370, 499	2065/ 7/ 22	
		UK TSY GILT 2. 75	2. 75	1, 300	1, 435	200, 413	2024/ 9/ 7	
		UK TSY GILT 3. 25	3. 25	1, 600	2, 424	338, 536	2044/ 1/ 22	
		UK TSY GILT 3. 5	3. 5	1, 650	2, 619	365, 741	2045/ 1/ 22	
		UK TSY GILT 3. 5	3. 5	1, 450	3, 049	425, 762	2068/ 7/ 22	
		UK TSY GILT 3. 75	3. 75	1, 600	2, 910	406, 457	2052/ 7/ 22	
		UK TSY GILT 4	4. 0	1, 500	1, 574	219, 866	2022/ 3/ 7	
		UK TSY GILT 4	4. 0	1, 700	3, 550	495, 706	2060/ 1/ 22	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 100	1, 419	198, 134	2027/ 12/ 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	900	1, 291	180, 290	2032/ 6/ 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 050	1, 613	225, 245	2036/ 3/ 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 750	2, 845	397, 385	2039/ 9/ 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 300	2, 151	300, 435	2040/ 12/ 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 500	2, 702	377, 357	2046/ 12/ 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	900	1, 697	236, 994	2049/ 12/ 7	
		UK TSY GILT 4. 25	4. 25	1, 700	3, 489	487, 180	2055/ 12/ 7	
		UK TSY GILT 4. 5	4. 5	1, 100	1, 685	235, 290	2034/ 9/ 7	
		UK TSY GILT 4. 5	4. 5	1, 350	2, 368	330, 720	2042/ 12/ 7	
		UK TSY GILT 4. 75	4. 75	1, 150	1, 656	231, 289	2030/ 12/ 7	
		UK TSY GILT 4. 75	4. 75	1, 200	2, 036	284, 404	2038/ 12/ 7	
		UK TSY GILT 5	5. 0	1, 300	1, 577	220, 307	2025/ 3/ 7	
		UK TSY GILT 6	6. 0	650	950	132, 659	2028/ 12/ 7	
	小	計	—	—	—	10, 706, 720	—	
(スウェーデン)	国債証券	SWEDISH GOVRNMNT 0. 75	0. 75	4, 000	4, 277	52, 910	2028/ 5/ 12	
		SWEDISH GOVRNMNT 0. 75	0. 75	4, 000	4, 304	53, 246	2029/ 11/ 12	
		SWEDISH GOVRNMNT 1	1. 0	6, 400	6, 885	85, 175	2026/ 11/ 12	
		SWEDISH GOVRNMNT 1. 5	1. 5	7, 000	7, 392	91, 442	2023/ 11/ 13	
		SWEDISH GOVRNMNT 2. 5	2. 5	5, 000	5, 631	69, 665	2025/ 5/ 12	
		SWEDISH GOVRNMNT 3. 5	3. 5	8, 000	8, 456	104, 608	2022/ 6/ 1	
		SWEDISH GOVRNMNT 3. 5	3. 5	4, 600	7, 204	89, 117	2039/ 3/ 30	
	小	計	—	—	—	546, 166	—	
(ノルウェー)	国債証券	NORWEGIAN GOV' T 1. 375	1. 375	2, 000	2, 091	24, 925	2030/ 8/ 19	
		NORWEGIAN GOV' T 1. 5	1. 5	3, 500	3, 665	43, 688	2026/ 2/ 19	
		NORWEGIAN GOV' T 1. 75	1. 75	3, 000	3, 160	37, 675	2025/ 3/ 13	
		NORWEGIAN GOV' T 1. 75	1. 75	2, 700	2, 907	34, 657	2029/ 9/ 6	
		NORWEGIAN GOV' T 2	2. 0	6, 000	6, 251	74, 523	2023/ 5/ 24	
		NORWEGIAN GOV' T 2	2. 0	9, 000	9, 802	116, 844	2028/ 4/ 26	
		NORWEGIAN GOV' T 3	3. 0	4, 000	4, 340	51, 735	2024/ 3/ 14	
	小	計	—	—	—	384, 049	—	

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	
(デンマーク)	国債証券	DENMARK - BULLET 0.25	0.25	1,300	1,420	24,063	2052/11/15	
		DENMARK - BULLET 0.5	0.5	11,100	11,884	201,328	2027/11/15	
		DENMARK - BULLET 0.5	0.5	4,000	4,340	73,526	2029/11/15	
		DENMARK - BULLET 1.5	1.5	5,000	5,305	89,875	2023/11/15	
		DENMARK - BULLET 1.75	1.75	6,000	6,691	113,348	2025/11/15	
		DENMARK - BULLET 4.5	4.5	10,500	20,029	339,304	2039/11/15	
小 計			—	—	—	841,446	—	
(ポーランド)	国債証券	POLAND GOVT BOND	—	6,000	5,998	170,482	2022/ 7 /25	
		POLAND GOVT BOND 2.25	2.25	3,000	3,091	87,869	2022/ 4 /25	
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	1,000	1,078	30,655	2024/ 4 /25	
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	3,000	3,297	93,705	2026/ 7 /25	
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	3,000	3,311	94,124	2027/ 7 /25	
		POLAND GOVT BOND 2.75	2.75	4,500	5,098	144,887	2029/10/25	
		POLAND GOVT BOND 3.25	3.25	6,900	7,777	221,035	2025/ 7 /25	
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	2,400	2,643	75,129	2022/ 9 /23	
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	2,700	3,737	106,231	2029/ 4 /25	
小 計			—	—	—	1,024,121	—	
(オーストラリア)	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	0.25	900	896	70,204	2025/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 1.5	1.5	3,300	3,455	270,732	2031/ 6 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2	2.0	1,000	1,018	79,791	2021/12/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	1,500	1,561	122,358	2022/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	3,000	3,338	261,563	2028/ 5 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.5	2.5	1,350	1,541	120,771	2030/ 5 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	2,500	2,720	213,141	2024/ 4 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	3,600	4,121	322,930	2027/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	1,800	2,079	162,942	2028/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	4,300	4,990	391,011	2029/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	800	947	74,200	2035/ 6 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3	3.0	1,400	1,727	135,316	2047/ 3 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	1,900	2,142	167,875	2025/ 4 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	2,100	2,513	196,915	2029/ 4 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	2,550	3,210	251,578	2039/ 6 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.75	3.75	1,200	1,604	125,689	2037/ 4 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 4.25	4.25	2,650	3,189	249,879	2026/ 4 /21	
		AUSTRALIAN GOVT. 4.5	4.5	1,400	1,941	152,107	2033/ 4 /21	
AUSTRALIAN GOVT. 4.75	4.75	6,400	8,092	634,020	2027/ 4 /21			
AUSTRALIAN GOVT. 5.5	5.5	2,000	2,251	176,365	2023/ 4 /21			
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	5.75	2,500	2,723	213,405	2022/ 7 /15			
小 計			—	—	—	4,392,805	—	
(シンガポール)	国債証券	SINGAPORE GOV'T 2.25	2.25	1,000	1,157	90,114	2036/ 8 / 1	
		SINGAPORE GOV'T 2.625	2.625	400	452	35,208	2028/ 5 / 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	評		額	償	還	年	月	日
							外	貨						
		SINGAPORE GOV T 2.75		2.75		1,200		1,271		98,984		2023/7/1		
		SINGAPORE GOV T 2.75		2.75		400		512		39,858		2042/4/1		
		SINGAPORE GOV T 2.75		2.75		700		924		71,992		2046/3/1		
		SINGAPORE GOV T 2.875		2.875		400		472		36,806		2030/9/1		
		SINGAPORE GOV T 3		3.0		700		766		59,676		2024/9/1		
		SINGAPORE GOV T 3.125		3.125		800		837		65,224		2022/9/1		
		SINGAPORE GOV T 3.375		3.375		650		825		64,238		2033/9/1		
		SINGAPORE GOV T 3.5		3.5		1,500		1,754		136,575		2027/3/1		
	小		計			—		—		698,679		—		
(マレーシア)	国債証券	MALAYSIA GOVT 3.418		3.418		7,000	千マレーシアリンギット	7,184	千マレーシアリンギット	183,495		2022/8/15		
		MALAYSIA GOVT 3.502		3.502		7,900		8,393		214,363		2027/5/31		
		MALAYSIA GOVT 3.955		3.955		5,300		5,731		146,383		2025/9/15		
		MALAYSIA GOVT 4.498		4.498		5,000		5,682		145,130		2030/4/15		
		MALAYSIA GOVT 4.736		4.736		4,500		5,116		130,666		2046/3/15		
	小		計			—		—		820,039		—		
(イスラエル)	国債証券	ISRAEL FIXED 0.75		0.75		6,200	千イスラエルシェケル	6,259	千イスラエルシェケル	199,175		2022/7/31		
		ISRAEL FIXED 1.5		1.5		2,900		3,005		95,626		2023/11/30		
		ISRAEL FIXED 2.25		2.25		1,500		1,675		53,310		2028/9/28		
		ISRAEL FIXED 3.75		3.75		3,700		5,044		160,505		2047/3/31		
		ISRAEL FIXED 6.25		6.25		3,500		4,665		148,465		2026/10/30		
	小		計			—		—		657,084		—		
	合		計			—		—		160,087,159		—		

※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

(2020年12月17日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 160,087,159	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,304,343	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	163,391,502	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。

※期末における外貨建資産（162,833,597千円）の投資信託財産総額（163,391,502千円）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=103.44円、1カナダドル=81.14円、1メキシコペソ=5.21円、1ユーロ=126.06円、1英ポンド=139.63円、1スウェーデンクローナ=12.37円、1ノルウェークローネ=11.92円、1デンマーククローネ=16.94円、1ポーランドズロチ=28.42円、1オーストラリアドル=78.35円、1シンガポールドル=77.84円、1マレーシアリンギット=25.54円、1イスラエルシェケル=31.82円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	164,890,831,324円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	826,983,271
公 社 債(評価額)	160,087,159,769
未 収 入 金	2,994,182,294
未 収 利 息	968,033,713
前 払 費 用	14,472,277
(B) 負 債	3,200,974,995
未 払 金	1,500,123,866
未 払 解 約 金	1,700,849,039
未 払 利 息	1,355
そ の 他 未 払 費 用	735
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	161,689,856,329
元 本	84,615,543,547
次 期 繰 越 損 益 金	77,074,312,782
(D) 受 益 権 総 口 数	84,615,543,547口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,109円

※当期における期首元本額94,197,787,250円、期中追加設定元本額11,551,425,788円、期中一部解約元本額21,133,669,491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条の第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条の第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2019年12月18日 至2020年12月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,438,949,861円
受 取 利 息	3,439,491,274
そ の 他 収 益 金	10,905
支 払 利 息	△ 552,318
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,044,298,920
売 買 益	10,325,791,900
売 買 損	△ 6,281,492,980
(C) 信 託 報 酬 等	△ 62,095,645
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	7,421,153,136
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	77,694,842,875
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,050,970,303
(G) 解 約 差 損 益 金	△18,092,653,532
(H) 計 (D + E + F + G)	77,074,312,782
次 期 繰 越 損 益 金(H)	77,074,312,782

※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	23,035,739,593円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	34,927,566円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	687,913,532円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	95,799,532円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,907,870,886円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	364,139円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	965,102,548円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	709,890,350円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	139,031,137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>	120,185,798円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2020(4資産タイプ)	7,181,893円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,129,253,665円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2025(4資産タイプ)	30,332,931円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,453,491,138円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2030(4資産タイプ)	97,121,134円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,690,913,511円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2035(4資産タイプ)	160,110,998円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,368,971,214円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2040(4資産タイプ)	101,490,751円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	734,643円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2045(4資産タイプ)	185,719,883円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,851,000,802円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,968,025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)	358,285,851円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	28,443,819円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	156,538,305円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	37,277,320円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	92,185,533円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	33,762,121円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,742,152円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2050	10,669,316円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	12,770,670円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	59,577,040円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	111,149,382円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	36,427,917円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	454,669,380円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	86,705,063円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	126,544,227円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	26,365,618円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	41,682,415円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	17,204,362円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,588,209円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	67,013,290円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,130,964,529円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	87,821,681円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	597,174円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	5,295,145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>	1,046,909,175円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	15,009,222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>	1,125,954,317円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	9,114,469円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,627,594,689円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2060	1,469,262円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	500,283,384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>	2,017,936,053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>	38,447,253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>	57,240,371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>	49,486,543円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	8,701,123,426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>	156,964,760円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,915,662,739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>	148,871,868円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	11,232,661,455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>	149,418,373円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第18期 (2019年12月3日から2020年11月30日まで)

信託期間	無期限 (設定日: 2003年2月17日)
運用方針	主として東京証券取引所第一部に上場している株式に投資を行い、TOPIX (東証株価指数、配当込み) の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) TOPIX (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株比	株式先物率 (買建-売建)	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
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
18期 (2020年11月30日)	28,704	4.9	2,738.72	4.9	97.7	2.0	180,486

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※TOPIX (東証株価指数、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) 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)
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2019年12月2日	27,359	—	2,611.46	—	97.7	2.3
12月末	27,507	0.5	2,625.91	0.6	98.3	1.6
2020年1月末	26,915	△ 1.6	2,569.77	△ 1.6	97.9	2.1
2月末	24,151	△ 11.7	2,305.76	△ 11.7	97.6	2.4
3月末	22,719	△ 17.0	2,167.60	△ 17.0	97.5	1.9
4月末	23,700	△ 13.4	2,261.88	△ 13.4	97.8	2.1
5月末	25,313	△ 7.5	2,416.04	△ 7.5	97.8	1.6
6月末	25,270	△ 7.6	2,411.45	△ 7.7	97.7	2.2
7月末	24,252	△ 11.4	2,314.39	△ 11.4	97.9	2.1
8月末	26,234	△ 4.1	2,503.59	△ 4.1	98.2	1.8
9月末	26,571	△ 2.9	2,536.14	△ 2.9	98.1	1.5
10月末	25,821	△ 5.6	2,464.21	△ 5.6	97.9	1.5
(期末) 2020年11月30日	28,704	4.9	2,738.72	4.9	97.7	2.0

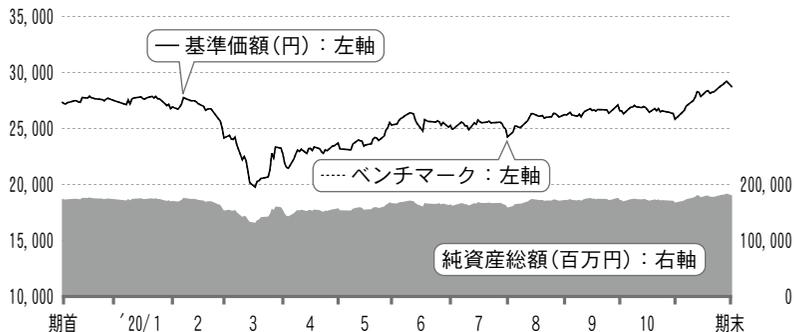
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	27,359円
期末	28,704円
騰落率	+4.9%

※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、TOPIX（東証株価指数、配当込み）です。

※TOPIX（東証株価指数、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（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

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

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ 3月下旬から6月上旬にかけて、各国中央銀行による金融緩和の強化が発表されたことや大規模な経済対策への期待が高まったこと ・ 期末にかけて、米大統領選挙の結果を受け、大幅な増税やハイテク企業への規制強化懸念が和らいだことや国内企業業績の回復期待が高まったこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ 2月下旬から3月中旬にかけて、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大が嫌気されたこと

▶ 投資環境について（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期初から2020年2月中旬までは、米国とイランの対立や中国での新型コロナウイルスの感染拡大といった懸念材料があった一方、12月の米中貿易協議での部分合意や国内企業業績の改善期待など株価の下支え要因もあり、保ち合いで推移しました。2月下旬から3月中旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大が嫌気され、大幅に下落しました。

3月下旬から6月上旬にかけては、各国中央銀行による金融緩和策の強化が発表されたことや政府による大規模な経済対策への期待が高まったことから、国内株式市場は上昇しました。その後は、米国での追加経済対策への期待が高まる一方、新型コロナウイルスの感染再拡大への警戒から10月まで一進一退の展開になりました。

期末にかけては、米国大統領選挙の結果を受け、大幅な増税やハイテク企業への規制強化懸念が和らいだことや、企業業績の回復期待から上昇しました。

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）で見ると、期首に比べて4.9%上昇しました。

▶ ポートフォリオについて（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

株式組入比率

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

ポートフォリオの特性

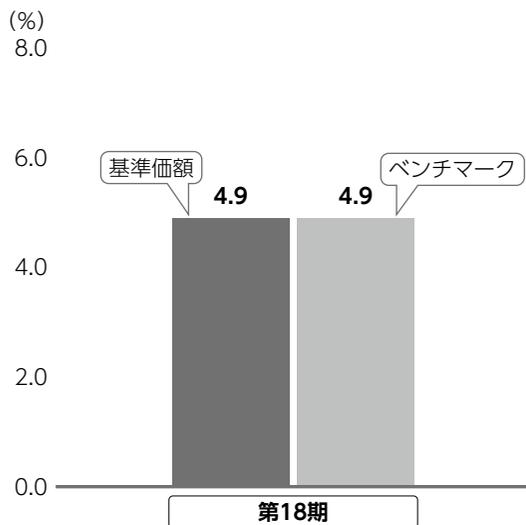
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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（2019年12月3日から2020年11月30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】

当期における基準価額の騰落率は+4.9%となり、ベンチマークの騰落率+4.9%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（2019年12月3日から2020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)	0.005% (0.001) (0.004)	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25,313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12月3日から2020年11月30日まで）

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株	千円	千株	千円
		10,503 (△ 7,692)	17,255,229 ()	8,898	17,919,319

※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) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国 内		証券	千円	証券	千円
		— (27,200)	— (—)	— (27,200)	— (—)

※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。

※（ ）内は権利付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

(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
国内 株式先物取引	T O P I X 百万円 49,002	百万円 49,274	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

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	35,174,549千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	162,591,890千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.21

※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12月3日から2020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	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	百万円 17,255	百万円 6,800	% 39.4	百万円 17,919	百万円 9,595	% 53.5
株 式 先 物 取 引	49,002	45,359	92.6	49,274	45,650	92.6

(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 164	百万円 135	百万円 1,517

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

(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
株 式	百万円 7

(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

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	7,733千円
(b) うち利害関係人への支払額	6,072千円
(c) (b) / (a)	78.5%

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、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12月3日から2020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 (2020年11月30日現在)

(1) 国内株式

銘 柄	期首(前期末)		期 末
	株 数	株 数	
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	3.6	3.8	10,621
日本水産	95.8	97.5	39,097
マルハニチロ	13.8	14.1	29,948
雪国まいたけ	-	5.7	10,607
カネコ種苗	4.3	4.6	7,097
サカタのタネ	10.9	11.6	39,034
ホクト	7.2	7.1	14,626
鉱業 (0.1%)			
日鉄鉱業	2.5	2.4	12,696
三井松島ホールディングス	3.3	5.6	4,132
国際石油開発帝石	384.9	361.1	210,882
石油資源開発	12.4	12.4	21,799
K&Oエナジーグループ	5.3	5.6	8,176
建設業 (2.4%)			
ヒノキヤグループ	3.2	3.4	7,395
ショーボンドホールディングス	13.5	15.1	78,520
ミライト・ホールディングス	27.6	27.3	42,724
タマホーム	5.5	6.5	9,353
スペースバリューホールディングス	13.8	15.4	9,409
安藤・間	57.3	59.5	40,936
東急建設	28	30.2	14,163
コムシスホールディングス	33.8	34.7	107,223
ミサワホーム	8.5	-	-
ピーアールホールディングス	13	13.4	9,514

銘 柄	期首(前期末)		期 末
	株 数	株 数	
高松コンストラクショングループ	6	6.2	12,629
東建コーポレーション	2.8	3	24,270
大成建設	73.4	75.4	278,226
大林組	220.7	224.9	206,908
清水建設	223.8	228.5	181,200
飛鳥建設	8	8.7	9,369
長谷工コーポレーション	84.4	86.7	97,884
松井建設	11.2	11.8	8,649
銭高組	1.3	1.6	7,352
鹿島建設	172.2	177	243,021
不動テトラ	7	7.4	12,417
大末建設	5.4	6.3	5,625
鉄建建設	5.1	6.1	10,998
西松建設	17.7	18	34,920
三井住友建設	56	55.8	23,938
大豊建設	5.1	5.6	19,432
前田建設工業	56.7	58.8	48,098
奥村組	12.6	10.4	25,386
東鉄工業	9	9.2	25,760
浅沼組	3	3	11,925
戸田建設	92.7	94.9	58,173
熊谷組	10.3	10.5	24,801
北野建設	2	2.2	5,995
矢作建設工業	12.1	12.1	10,914
ピーエス三菱	10.6	10.6	6,020
日本ハウスホールディングス	20	26.1	6,211

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	
大東建託	26.5	24.9	254,976
新日本建設	10.4	10.5	8,925
N I P P O	17.7	18.1	49,358
東亜道路工業	1.8	2	7,390
前田道路	23.2	21	35,217
日本道路	2.3	2.3	16,997
東亜建設工業	8.3	8.3	16,517
日本国土開発	15	22.9	12,480
若築建設	5.3	6	6,906
東洋建設	26.1	29.9	11,870
五洋建設	89.3	91.5	71,095
世紀東急工業	13.3	13.6	10,975
福田組	2.8	2.8	14,812
住友林業	55.3	58	110,258
日本基礎技術	12.2	11.7	5,756
バコーボレーション	14.4	15.7	6,656
大和ハウス工業	218.4	225	720,000
ライト工業	12.6	12.6	21,105
積水ハウス	241.5	246.6	463,114
ユアテック	13.8	14.8	9,842
日本リーテック	—	5.5	13,689
中電工	8.2	7.2	15,350
関電工	29.2	27.9	22,264
きんでん	51.8	52.8	88,334
東京エネシス	9.4	9.8	8,722
トーエネック	2.9	2.9	10,759
住友電設	6.3	6.2	16,082
日本電設工業	11.2	11.2	24,158
協和エクシオ	33.3	33.8	90,820
新日本空調	6.1	6.7	15,001
九電工	15.5	16.1	48,058
三機工業	15.7	16	18,384
日揮ホールディングス	68.6	70.5	65,917
中外炉工業	3.2	4.1	6,609
ヤマト	9.4	9.4	6,965
太平電業	5.7	6.1	14,707
高砂熱学工業	18.6	16	22,928
朝日工業社	2.1	2.2	7,084
明星工業	14.7	15.6	12,121
大気社	10.7	10.7	29,713
ダイダン	5.5	5.4	15,022
日比谷総合設備	7.4	7.8	14,297
東芝プラントシステム	17	—	—
O S J Bホールディングス	41.7	43.1	10,171
レイズネクスト	12.6	13	14,443
食料品 (3.5%)			
日本製粉	20.2	19.3	31,401
日清製粉グループ本社	79.4	81.9	138,984
昭和産業	6.1	6.4	20,224
鳥越製粉	8.5	8.2	8,618
中部飼料	8.9	8.9	12,433
フィード・ワン	53.4	11.1	9,823
日本甜菜製糖	4.7	4.7	7,501
三井製糖	5.9	5.7	10,197

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
日新製糖	3.4	3.6	6,660
森永製菓	16.5	17.2	65,532
中村屋	2.5	1.9	7,685
江崎グリコ	21	20	86,900
名糖産業	4.9	3.7	5,439
井村屋グループ	3.8	4.8	12,326
不二家	4.3	4.8	11,347
山崎製パン	53.3	54.7	94,740
モロゾフ	1.7	1.3	8,073
亀田製菓	4	4.2	20,643
寿スブリッツ	6.7	6.9	36,846
カルビー	32.2	33	101,805
森永乳業	13.3	13.6	68,952
六甲バター	5.3	5.9	11,133
ヤクルト本社	48.5	50.1	249,247
明治ホールディングス	46.5	47.9	353,502
雪印メグミルク	17.1	17.2	38,476
プリマハム	10.7	10.9	31,468
日本ハム	26.9	27.7	123,403
丸大食品	7	7.7	12,758
S F o o d s	5.4	5.8	18,212
柿安本店	—	3.2	8,032
伊藤ハム米久ホールディングス	45.3	42.4	27,729
サッポロホールディングス	24.4	25.2	49,140
アサヒグループホールディングス	148	158.5	639,864
キリンホールディングス	299.6	307.9	700,010
宝ホールディングス	53.7	54.8	65,705
オエノンホールディングス	22.2	24.1	9,905
養命酒製造	3.5	3.5	6,576
コカ・コーラ ホトラーズジャパンホールデ	49.8	56.3	90,417
サントリー食品インターナショナル	47	48.6	185,409
ダイドールグループホールディングス	3.5	3.8	21,204
伊藤園	21.3	22	177,320
キーコーヒー	6.7	6.4	13,491
日清オイリオグループ	8.8	8.9	25,863
不二製油グループ本社	17.3	17.8	49,768
かどや製油	1.3	1.3	5,044
J - オイルミルズ	3.6	3.8	13,528
キッコーマン	50.6	52.2	338,778
味の素	157.2	160.9	350,842
キュービー	39.4	40.4	87,829
ハウス食品グループ本社	26.3	26.9	96,840
カゴメ	27.1	29.5	112,395
焼津水産化学工業	5.7	4.1	4,063
アリアケジャパン	6.4	6.8	46,988
ニチレイ	33.6	34.8	98,623
東洋水産	36.1	37.5	192,375
イトアンドホールディングス	3.7	2.6	4,732
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4.4	5.1	4,426
日清食品ホールディングス	29.9	31	267,220
永谷園ホールディングス	4.2	4.2	9,450
一正蒲鉾	4.3	2.9	3,343
フジッコ	7.6	7.7	15,084
ロック・フィールド	7.8	8.2	11,947

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
日本たばこ産業	407.7	389	824,680	
ケンコーマヨネーズ	4.4	4.8	8,572	
わらべや日洋ホールディングス	5.1	6	8,352	
なとり	5.4	4.6	9,154	
ビックルスコーポレーション	2	2.1	6,140	
北の達人コーポレーション	23.6	26.4	13,437	
ユーグレナ	29.1	31	25,451	
ミヨシ油脂	4.3	4.5	5,548	
理研ビタミン	3	7.1	9,457	
繊維製品 (0.5%)				
片倉工業	11.1	11.4	15,595	
グンゼ	5.1	5.1	18,360	
東洋紡	28.2	29.2	38,106	
ユニチカ	23.7	25.2	9,525	
富士紡ホールディングス	3.9	4	14,420	
倉敷紡績	7.1	7.6	13,999	
日本毛織	22.5	22.9	24,182	
ダイドーリミテッド	15	—	—	
帝国繊維	8.3	8.3	21,355	
帝人	55.3	57.7	102,936	
東レ	500.4	514.8	291,428	
住江織物	2.6	2.6	5,662	
アツギ	9.6	11.3	5,932	
ダイニック	6.4	6	5,226	
セーレン	16.9	17.8	27,162	
小松マテーレ	12.8	13.5	12,865	
ワコールホールディングス	18.2	18.3	36,618	
ホギメディカル	8	8.3	26,228	
レナウン	35	—	—	
T S I ホールディングス	24.5	26.4	5,306	
マツオカコーポレーション	2.8	3	7,596	
ワールド	10	10.7	13,717	
三陽商会	5.1	—	—	
オンワードホールディングス	41.7	45.9	8,491	
ゴールドウイン	12.6	13.1	91,962	
デサント	13.9	14.4	24,825	
パルプ・紙 (0.2%)				
特種東海製紙	4.4	4.4	23,540	
王子ホールディングス	285.3	293.3	139,024	
日本製紙	30.7	31.4	35,325	
三菱製紙	11.7	12.5	4,012	
北越コーポレーション	45.7	42.2	14,812	
中越パルプ工業	4.3	4.8	6,465	
大王製紙	29.4	32	57,792	
レンゴー	65.3	68.9	54,775	
トーモク	5.1	5.3	9,169	
ザ・バック	5	5.8	16,773	
化学 (7.6%)				
クラレ	108	110.5	114,478	
旭化成	459.4	469.2	449,071	
昭和電工	48.7	53.6	103,823	
住友化学	507.3	515.3	190,661	
住友精化	3.3	3.2	13,280	
日産化学	38.5	39.1	243,984	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ラサ工業	3.3	3.3	6,596	
クレハ	5.8	5.9	31,270	
多木化学	2.3	2.8	18,620	
テイカ	5.2	5.8	8,485	
石原産業	12.9	14.3	8,236	
日本曹達	10.2	10.5	28,843	
東ソー	105.2	109	179,414	
トクヤマ	19.9	20.5	45,448	
セントラル硝子	14.5	14.5	32,248	
東亜合成	43.6	43.3	54,125	
大阪ソーダ	6.9	6.7	16,394	
関東電化工業	16.8	16.6	11,653	
デンカ	24.9	25.9	83,657	
信越化学工業	118.4	121.6	2,083,616	
日本カーバイド工業	3.2	4.7	6,152	
堺化学工業	4.6	5	9,715	
第一稀元素化学工業	9.4	9.8	6,830	
エア・ウォーター	55.7	66.1	113,758	
日本酸素ホールディングス	66.2	68.3	119,115	
日本化学工業	2.4	2.9	7,406	
日本パーカライジング	35.4	36.1	39,529	
高圧ガス工業	12.4	13	9,841	
チタン工業	1.8	2.1	4,088	
四国化成工業	10.4	10.3	12,277	
戸田工業	2.5	—	—	
ステラ ケミファ	4	3.7	12,395	
保土谷化学工業	2.8	2.6	11,973	
日本触媒	10.8	11	57,420	
大日精化工業	6.2	5.9	14,089	
カネカ	17.7	18.1	56,834	
三菱瓦斯化学	64.5	65.8	145,681	
三井化学	62.6	65.4	191,818	
J S R	64.3	66.3	191,275	
東京応化工業	12	12.3	80,934	
大阪有機化学工業	7.2	6.4	18,553	
三菱ケミカルホールディングス	461	472.6	272,926	
K H ネオケム	12.3	11.6	32,329	
ダイセル	94	88.2	64,738	
住友ベークライト	10.9	11.5	37,030	
積水化学工業	148.2	148	266,844	
日本ゼオン	62.3	64.4	83,269	
アイカ工業	20.7	21.1	77,859	
宇部興産	34.2	35.1	62,302	
積水樹脂	12.3	12.6	27,594	
タキロンシーアイ	16.1	16	11,328	
旭有機材	4.5	5.1	7,430	
日立化成	31.9	—	—	
ニチバン	4.1	4.8	7,780	
リケンテクノス	19.2	20.9	9,321	
大倉工業	3.9	3.8	7,132	
積水化成成品工業	10.2	10.9	5,864	
群栄化学工業	2.4	2.4	6,079	
ミライアル	3.3	3.8	4,601	
ダイキョーニシカワ	14.4	15.9	10,891	

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	
森六ホールディングス	4.1	4.9	9,746
日本化薬	43.1	44.9	41,173
カーリットホールディングス	9.5	11.5	6,900
日本精化	6.7	6.7	9,735
扶桑化学工業	6.9	7	24,185
トリケミカル研究所	1.6	1.6	22,576
ADEKA	31.9	32.4	53,719
日油	25.9	26.4	122,232
ハリマ化成グループ	6.2	7	7,154
花王	168.5	173.2	1,352,345
第一工業製薬	2.9	2.6	11,726
ニイタカ	—	2	6,220
三洋化成工業	4	4	17,920
大日本塗料	9.1	9.1	8,399
日本ペイントホールディングス	56.8	58.4	780,808
関西ペイント	77.6	79.6	251,934
中国塗料	20.3	20.8	20,675
日本特殊塗料	5.9	6.5	7,442
藤倉化成	13.2	12.6	6,388
太陽ホールディングス	5	5.2	33,332
DIC	28.7	29.7	76,239
サカタインクス	15.1	15.2	17,601
東洋インキSCホールディングス	13.9	14	27,454
T&K TOKA	7.1	7.6	6,536
富士フイルムホールディングス	134.8	138.6	779,625
資生堂	139.8	143.7	1,057,632
ライオン	91.3	94.3	232,732
高砂香料工業	4.6	5	12,600
マンダム	15.8	16.6	27,174
ミルボン	9.4	9.9	59,004
ファンケル	28.6	29.4	124,509
コーセー	13.2	13.6	216,784
コタ	5.1	5.9	8,018
ポーラ・オルビスホールディングス	30	31.2	65,052
ノエビアホールディングス	6.6	6	25,770
エステー	5.4	5.6	11,407
アグロ カネショウ	3.3	3.9	6,805
コニシ	11.8	11.4	18,148
長谷川香料	9.7	12.4	24,948
小林製薬	19.7	20.2	253,510
荒川化学工業	7	7	7,840
メック	5.4	5.8	13,218
タカラバイオ	18.7	19.1	56,784
JCU	8.7	8.6	31,691
デクセリアルズ	19	19	24,225
アース製薬	5.3	5.3	32,595
北興化学工業	9.1	8.1	9,104
大成ラミック	3.3	3.5	10,164
クミアイ化学工業	29.5	30.5	31,140
日本農薬	14.6	16.1	8,549
アキレス	5.6	5.9	8,401
有沢製作所	11.7	12.6	11,554
日東電工	48.2	49.8	430,272
レック	8.1	7.5	11,610

銘柄	期首(前期末)		期末 評価額
	株数	株数	
三光合成	11.6	15.3	4,467
藤森工業	6.1	6.1	28,822
前澤化成工業	6.6	7.1	6,972
未来工業	4.5	4.9	9,212
JSP	4.6	5	7,535
エフピコ	7.8	15	62,775
天馬	5.3	5.4	10,297
信越ポリマー	12.6	12.7	11,938
東リ	23.1	23.1	5,913
ニフコ	25.5	26.5	97,387
バルカー	5.9	6.6	12,342
ユニ・チャーム	136.1	153.3	776,157
医薬品 (6.1%)			
協和キリン	70.2	72.6	205,821
武田薬品工業	586	601.8	2,253,741
アステラス製薬	619.5	627.6	931,044
大日本住友製薬	52.5	54.3	71,838
塩野義製薬	89.9	90.9	508,403
田辺三菱製薬	85.2	—	—
あすか製薬	9	8	13,632
日本新薬	18.4	19	141,740
中外製薬	73.4	226.2	1,140,952
科研製薬	12.2	12.2	46,482
エーザイ	84.3	86.7	683,802
ロート製薬	35.9	37	126,725
小野薬品工業	162	166.3	549,288
久光製薬	20.7	19.1	116,892
持田製薬	10	10.1	40,501
参天製薬	130.9	135.1	234,398
扶桑薬品工業	3.6	3.7	10,482
日本ケミファ	1.5	2.2	5,434
ツムラ	22.1	22.5	68,512
日医工	20.1	20	20,000
キッセイ薬品工業	12.8	12.5	26,125
生化学工業	14.2	14.4	14,299
栄研化学	12.8	12.4	24,018
鳥居薬品	4.5	4.5	14,242
JCRファーマ	5	20.8	56,576
東和薬品	9	9.2	17,489
富士製薬工業	5.6	6.8	8,486
沢井製薬	14.7	14.8	69,782
ゼリア新薬工業	13	13	24,284
第一三共	201.4	621.1	2,294,343
キョーリン製薬ホールディングス	14.7	16.1	30,219
大幸薬品	3.3	9.2	15,502
ダイト	4.4	4.6	16,652
大塚ホールディングス	134.1	150.2	637,148
大正製薬ホールディングス	14.8	15	99,600
ペプチドリーム	35.7	36.7	195,244
石油・石炭製品 (0.4%)			
日本コークス工業	81.7	99.6	7,071
ニチレキ	9.5	9.1	14,887
シンロ化学工業	5.9	6.4	7,449
富士石油	25.2	—	—

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	
出光興産	79.1	80.8	175,659
E N E O Sホールディングス	1,090.7	1,088	390,048
コスモエネルギーホールディングス	20.7	21.7	38,495
ゴム製品 (0.5%)			
横浜ゴム	40.7	41.5	63,204
T O Y O T I R E	41.2	39	64,233
ブリヂストン	216.7	192.6	701,834
住友ゴム工業	63.4	64	59,072
オカモト	4.5	4.6	18,745
ニッタ	7.9	7.8	17,206
住友理工	13.7	16.1	8,259
三ツ星ベルト	9.6	10	16,310
バンドー化学	13.5	14.4	8,294
ガラス・土石製品 (0.8%)			
日東紡績	10.6	11.1	47,175
A G C	69.5	66.2	230,045
日本板硝子	21.5	15.4	6,175
日本山村硝子	5.4	5.4	4,660
日本電気硝子	28.5	27.1	61,842
オハラ	3.6	4	6,032
住友大阪セメント	13.7	14	43,260
太平洋セメント	44.5	45.9	128,795
日本ヒューム	9.3	10.6	8,268
日本コンクリート工業	20.5	22.2	7,059
三谷セキサン	3.5	3.4	14,195
アジアパイルホールディングス	13.3	15	6,825
東海カーボン	73.8	71	81,366
日本カーボン	3.7	4.2	15,687
東洋炭素	4.6	4.9	8,741
ノリタケカンパニーリミテド	4	4	11,724
T O T O	50.3	51.7	305,547
日本碍子	85.4	86.5	143,503
日本特殊陶業	54.6	54.9	103,815
M A R U W A	2.8	2.8	31,024
品川リフラクトリーズ	2.4	2.4	5,901
黒崎播磨	1.5	1.8	6,471
ヨータイ	8.2	8.2	6,765
東京窯業	16.5	16.5	5,692
フジインコーポレーテッド	6.4	6.7	24,388
ニチアス	19.3	19	46,303
ニチハ	9.7	10	32,600
鉄鋼 (0.6%)			
日本製鉄	311.5	319.8	408,224
神戸製鋼所	129.3	130.3	65,801
中山製鋼所	13	13	4,888
合同製鐵	4.1	4.7	8,718
ジェイ エフ イー ホールディングス	187.9	191	182,596
東京製鐵	34.2	34	22,304
共英製鋼	8	9.2	13,744
大和工業	15.1	15.5	41,013
東京製鋼	4	4	8,828
大阪製鐵	4.5	4.5	5,346
淀川製鋼所	9.1	8.9	17,559
丸一鋼管	22.9	22.8	50,068

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
モリ工業	2.7	2.7	6,590
大同特殊鋼	11.4	11.7	50,778
日本冶金工業	5.9	6.9	11,385
山陽特殊製鋼	5.4	6	7,500
愛知製鋼	3.9	4.4	11,220
日立金属	74.9	77	118,041
大平洋金属	4.9	5.6	10,360
新日本電工	50.2	49.6	11,308
栗本鐵工所	4.3	4.4	7,528
三菱製鋼	6.7	8.9	4,930
シンニッタン	14.7	19.9	3,641
非鉄金属 (0.7%)			
大紀アルミニウム工業所	11.2	12.7	8,648
日本軽金属ホールディングス	178	18.1	32,435
三井金属鉱業	18.9	19.5	57,681
東邦亜鉛	4	-	-
三菱マテリアル	45.7	47.5	94,145
住友金属鉱山	89.2	91.5	355,660
D O W Aホールディングス	17.6	18.3	63,135
古河機械金属	12.5	12.7	14,427
大阪チタニウムテクノロジーズ	7.8	9.7	8,148
東邦チタニウム	13.7	15.2	10,472
U A C J	10.7	11	19,701
C Kサンエツ	1.8	2.1	8,095
古河電気工業	21.5	22.6	59,754
住友電気工業	260	267.1	318,917
フジクラ	85.9	89.6	36,467
昭和電線ホールディングス	9.6	8	12,896
タツタ電線	15.3	16.3	10,106
リョービ	8.5	9.7	11,795
アレスティ	11.5	15.7	5,055
アサヒホールディングス	12.5	13.2	40,986
金属製品 (0.6%)			
稲葉製作所	5.5	5.4	7,354
宮地エンジニアリンググループ	3.3	3.3	7,128
トーカロ	19.4	20.8	25,896
アルファC o	4.3	4.3	4,171
S U M C O	83.5	92	194,488
川田テクノロジーズ	1.7	1.8	7,587
R S Technologies	2.2	2.8	12,502
東洋製罐グループホールディングス	44.6	46.3	46,624
ホクサンホールディングス	4.8	4.8	6,624
コロナ	5.9	5.9	5,327
横河ブリッジホールディングス	13	13.5	26,757
三和ホールディングス	66.8	68	86,360
文化シャッター	21.2	21.4	19,516
三協立山	10.5	11.1	8,491
アルインコ	7	7.9	7,173
L I X I Lグループ	103	105.9	265,279
ノーリツ	14.9	15	24,165
長府製作所	7.2	7.2	14,688
リンナイ	13.6	14	170,520
日東精工	13	12.4	5,332
岡部	14.6	14.7	11,848

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
ジーテクト	8.7	9.3	12,927	
東ブレ	12.9	13.9	18,125	
高周波熱錬	14.2	16.2	7,225	
東京製綱	6.7	8.2	6,125	
バイオラックス	10.2	10.6	16,546	
エイチワン	9.3	9.3	6,510	
日本発條	75	77.1	48,804	
三益半導体工業	6.2	5.7	15,960	
機械 (5.7%)				
日本製鋼所	21.5	21.5	54,825	
三浦工業	30.1	31	170,190	
タクマ	23.7	23.9	42,852	
ツガミ	14.8	14.7	24,255	
オークマ	8	8.2	49,364	
芝浦機械	7.9	8.2	18,868	
アマダ	87.3	88	88,528	
アイダエンジニアリング	18.2	18.4	16,265	
F U J I	28.7	29.9	75,617	
牧野フライス製作所	8	8.2	34,440	
オーエスジー	32.4	35.2	66,422	
旭ダイヤモンド工業	19.1	20.3	8,607	
D M G森精機	43.9	45.5	70,161	
ソディック	16.7	15.8	13,161	
ディスコ	9.4	9.7	322,525	
日東工器	4.3	4.5	7,488	
日進工具	2.1	3.4	9,965	
パンチ工業	9.2	11.3	4,972	
豊和工業	5.7	5.7	4,617	
島精機製作所	11.3	11	19,151	
オプトラン	8	9	19,656	
イワキポンプ	4.5	5.9	4,725	
フリュー	8.6	8.9	10,510	
ヤマシンフィルタ	15.2	15	15,990	
日阪製作所	10.3	10.6	8,882	
やまびこ	13.8	13.9	19,654	
平田機工	3.3	3.3	27,522	
ベガスミシン製造	10.7	15.3	4,482	
マルマエ	3.5	4.2	4,502	
タツモ	3.6	3.9	5,873	
ナブテスコ	40.9	42.1	181,451	
三井海洋開発	7.6	7.2	12,744	
レオン自動機	6.9	7.9	8,745	
S M C	22.1	22.7	1,505,464	
ホソカワミクロン	2.7	2.4	15,192	
ユニオンツール	2.6	2.7	8,275	
オイレス工業	9.3	8.6	13,708	
日精エー・エス・ビー機械	2.6	2.4	13,680	
サトーホールディングス	10.1	10.2	20,634	
技研製作所	6.4	6.2	25,420	
日精樹脂工業	7.3	7.7	6,637	
ワイエシイホールディングス	4.1	—	—	
小松製作所	318.7	327.4	831,596	
住友重機械工業	39.8	40.9	92,147	
日立建機	27.5	29.1	84,128	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
日工	12.4	13.1	8,685	
巴工業	3.9	4	7,676	
井関農機	7.9	8.1	11,088	
T O W A	7.8	7	12,698	
北川鉄工所	3.6	4.1	5,243	
ローツェ	3.2	3.1	16,802	
クボタ	373.2	378.6	783,891	
荏原実業	2.6	2.3	8,441	
三菱化工機	3.7	3.6	8,082	
月島機械	13.4	13.6	16,333	
帝国電機製作所	7.1	7.3	9,088	
新東工業	16.7	16.6	11,802	
澁谷工業	6.3	6.3	22,995	
アイチ コーポレーション	13.7	12	11,136	
小森コーポレーション	17.6	17.9	12,762	
鶴見製作所	6.1	6.1	10,437	
住友精密工業	1.8	2.2	4,406	
酒井重工業	1.9	1.9	4,721	
荏原製作所	29.3	30.1	100,534	
西島製作所	8.9	10.9	9,156	
北越工業	8.5	9.3	9,681	
ダイキン工業	89.7	92.2	2,181,913	
オルガノ	2.6	2.6	15,418	
トーヨーカネツ	3.9	4.2	8,950	
栗田工業	37.8	38.9	149,765	
椿本チエイン	9.6	9.4	23,772	
大同工業	6.2	7	4,732	
アネスト岩田	11.9	12.6	12,436	
ダイフク	35.6	36.7	444,070	
サムコ	—	2.3	8,199	
加藤製作所	4.5	6	6,096	
タダノ	34.8	35	28,805	
フジテック	25.1	26.2	55,858	
C K D	19.7	20	44,500	
キトー	6	6.9	10,943	
平和	19.7	19.8	28,135	
理想科学工業	6.6	7.4	9,553	
S A N K Y O	16.1	16	41,088	
日本金銭機械	9.4	10.7	5,788	
マースグループホールディングス	5.5	5.7	9,108	
フジマガリレイ	4.4	4.5	19,777	
ダイコク電機	4.5	5.8	5,109	
竹内製作所	11.6	12.1	29,729	
アマノ	18.5	19	46,626	
J U K I	10.6	13.2	7,154	
マックス	10.7	11	15,400	
グローリー	19.7	18.7	39,270	
新晃工業	6.9	7.5	12,885	
大和冷機工業	10.7	11.5	11,799	
セガサミーホールディングス	70.4	71.9	105,477	
日本ビストンリング	4.4	4.4	4,114	
リケン	3.4	3.9	8,638	
T P R	9	9.8	12,818	
ツバキ・ナカシマ	14.6	13.5	11,893	

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	
ホシザキ	20.6	22.8	235,524
大豊工業	7.4	8.2	4,985
日本精工	130.7	133.9	113,145
NTN	161.9	170.5	37,169
ジェイテクト	65.9	68.2	55,310
不二越	6.6	6.5	28,015
日本トムソン	22.9	25.8	8,462
THK	40.8	45	145,125
ユーシン精機	6.7	8	6,296
前澤給装工業	3.7	3.6	8,316
イーグル工業	8.9	9.6	8,668
日本ピラー工業	7.8	7.9	12,805
キッツ	29	28.2	15,876
マキタ	91.5	94.1	508,140
日立造船	56	56	22,512
三菱重工業	117.7	121	284,531
IHI	50.9	52.6	81,582
スター精密	11.2	11.3	16,622
電気機器 (17.0%)			
日清紡ホールディングス	47.8	45.1	33,374
イビデン	43.5	44.4	217,116
コニカミノルタ	155.1	160	53,440
ブラザー工業	85.5	88	176,000
ミネベアミツミ	130.1	133.9	291,098
日立製作所	338.3	347.7	1,378,978
三菱電機	704	722.9	1,108,567
富士電機	42.2	43.6	161,756
東洋電機製造	3.8	4.2	4,641
安川電機	75.6	77.7	390,831
シンフォニアテクノロジー	9.4	10.2	13,443
明電舎	13.1	13.9	25,270
オリジン	3.4	3.6	4,935
山洋電気	3.5	3.5	18,060
デンヨー	6.5	6.5	13,578
東芝テック	8.8	9.1	34,125
芝浦メカトロニクス	1.6	1.8	6,993
マブチモーター	19.3	19.9	92,734
日本電産	84.7	174.1	2,316,400
トレックス・セミコンダクター	4.9	5.9	7,699
東光高岳	5.5	5.8	7,725
宮越ホールディングス	3.9	5.2	3,562
ダイヘン	7.7	7.8	35,412
ヤーマン	11.2	12.4	28,817
JVCケンウッド	60	—	—
ミマキエンジニアリング	9.3	11.9	6,069
IPEX	3	4.2	8,253
日新電機	16.7	16.8	19,572
大崎電気工業	16.2	18	9,936
オムロン	65.3	64.6	609,178
日東工業	10.7	10.5	19,488
IDEC	10.5	11.2	20,664
ジーエス・ユアサ コーポレーション	24.1	24.7	62,342
サクサホールディングス	3	—	—
メルコホールディングス	2.8	3	9,180

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
日本電気	85.4	87.8	494,314
富士通	67.9	69.7	1,010,998
沖電気工業	29.9	29	26,274
電気興業	3.7	4	11,600
サンケン電気	8	8	30,520
アイホン	5.1	5.1	7,848
ルネサスエレクトロニクス	336.3	311.1	288,700
セイコーエプソン	86.9	90.1	140,285
ワコム	47.8	48.6	46,899
アルバック	14.1	13.6	57,392
EIZO	5.5	5.8	21,054
日本信号	18.5	18.9	17,595
京三製作所	19	19.7	8,293
能美防災	9.6	9.6	21,724
ホーチキ	6	6.2	7,725
エレコム	7.7	8.4	40,110
パナソニック	805.2	826.1	919,036
シャープ	81.6	84.4	118,160
アンリツ	45.7	47	111,813
富士通ゼネラル	19.8	19.9	62,983
ソニー	444.9	453.1	4,396,882
TDK	33.8	34.9	513,728
帝国通信工業	5.8	5.5	6,424
タムラ製作所	24.2	26.3	14,070
アルプスアルパイン	62.2	64	83,712
日本トリム	1.3	1.6	6,504
ローランド ディー・ジー	4.8	5.8	9,900
フォスター電機	7.7	9.1	10,173
SMK	2.4	2.5	7,612
ヨコオ	4.6	5	12,140
ホシデン	19.3	20.2	17,695
ヒロセ電機	10.9	11.1	163,836
日本航空電子工業	16	17.1	23,940
TOA	8.9	9.6	8,352
マクセルホールディングス	15.4	16.4	19,680
古野電気	10.1	10.5	12,474
ユニデンホールディングス	2.8	3	7,167
スミダコーポレーション	6.4	8	8,416
アイコム	4.6	4.2	11,163
リオン	3.5	3.8	12,179
船井電機	9.5	12.9	5,418
横河電機	64.7	66.7	122,994
新電元工業	2.8	3.3	7,741
アズビル	44.1	45.5	213,167
東亜ディーケーケー	5.5	5.5	4,680
日本光電工業	29.6	30.3	99,990
チノー	4.2	4.2	5,980
共和電業	15.2	15.2	6,110
堀場製作所	14	14.5	81,200
アドバンテスト	52.4	53.7	389,862
エスベック	6.5	6.9	13,386
キーエンス	63.8	65.5	3,490,495
日置電機	3.9	3.5	13,737
シスメックス	50.5	51.7	565,081

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	
日本マイクロニクス	11.5	12.1	11,918
メガチップス	7	7	19,999
OBARA GROUP	3.8	4.4	14,916
コーセル	9.9	11.7	12,928
イリソ電子工業	6	6.1	25,772
オブテックスグループ	11.9	12.6	23,776
千代田インテグレ	3.8	4.5	6,871
レーザーテック	14.4	31.7	348,700
スタンレー電気	49.3	50.9	156,263
岩崎電気	4.6	4.1	5,682
ウシオ電機	41.4	40.9	53,783
ヘリオス テクノ ホールディング	9.2	13.3	4,016
日本セラミック	7.4	7.7	22,075
古河電池	—	6.2	10,515
山一電機	5.7	6.3	9,531
図研	5.1	5.1	13,474
日本電子	14	14.6	59,787
カシオ計算機	62.6	64.5	120,937
ファナック	66.9	68	1,724,820
日本シイエムケイ	17.8	20.8	8,340
エンプラス	3.6	4.6	13,013
ローム	31.2	30	261,300
浜松ホトニクス	50.4	51.7	303,479
三井ハイテック	8	8.5	24,471
新光電気工業	23.6	24.7	57,081
京セラ	99.1	101.9	607,629
太陽誘電	31.3	32.3	152,940
村田製作所	206.8	212.5	1,939,912
双葉電子工業	11.5	12.9	11,158
北陸電気工業	4.2	5.7	5,215
ニチコン	24.2	25.3	27,678
日本ケミコン	5.9	—	—
KOA	11	11.6	16,599
市光工業	11.2	12.8	6,758
小糸製作所	42.1	43.1	270,668
ミツバ	14	—	—
SCREENホールディングス	12.3	12.6	87,696
キャノン電子	7.5	7.6	11,042
キャノン	378.8	359	665,406
リコー	179.1	184.7	128,735
象印マホービン	21.1	19.9	37,531
東京エレクトロン	46.9	45.9	1,628,073
輸送用機器 (7.0%)			
トヨタ紡織	20.2	21.3	29,181
ユニプレス	13.8	14.6	13,067
豊田自動織機	56.9	58.1	438,074
モリタホールディングス	12.5	12.7	22,656
三櫻工業	8.5	11.1	7,337
デンソー	155	159.2	784,696
東海理化電機製作所	18.4	19	30,343
三井E&Sホールディングス	14.9	—	—
川崎重工業	54.7	56.5	85,597
名村造船所	27.4	29.6	4,469
日本車輛製造	3.3	3.4	8,438

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
三菱ロジスネクスト	9.2	10.7	11,855
日産自動車	830.6	851.4	419,314
いすゞ自動車	204.9	209.5	213,271
トヨタ自動車	784.8	807.1	5,648,892
日野自動車	87.7	90	81,450
三菱自動車工業	261.1	270.9	50,929
エフテック	7.6	8.8	4,998
武蔵精密工業	15.9	16	24,624
日産車体	14.2	14.4	12,988
新明和工業	19.2	19	15,694
極東開発工業	12.7	13.5	18,643
日信工業	14.3	—	—
トビー工業	6	7.2	7,761
ティラド	3.5	4.1	5,243
タチエス	12	11.9	13,387
NOK	38.1	39	44,928
フタバ産業	20.1	21.3	10,756
KYB	8	8.2	20,647
大同メタル工業	16.8	18.3	8,546
プレス工業	35.7	40.5	12,271
太平洋工業	15	15.3	16,416
ケーヒン	16	—	—
河西工業	11	13.4	4,649
アイシン精機	57.7	59.3	183,533
マツダ	206.8	213.5	131,729
今仙電機製作所	9.5	8.9	7,760
本田技研工業	554.3	569.4	1,635,032
スズキ	139.7	143.4	803,613
SUBARU	218.9	224.4	465,181
安永	4.1	4.5	5,175
ヤマハ発動機	92	102.1	205,221
ショーワ	16.6	—	—
TBK	15.3	13.1	5,921
エクセディ	9.4	10.2	12,586
豊田合成	22.7	23.4	66,268
愛三工業	12.3	14.6	6,467
日本プラス	8.4	8.8	3,960
ロイズ	7.7	8.9	10,057
エフ・シー・シー	11.3	12	23,904
シマノ	26.3	27.1	670,454
テイ・エス テック	16.4	16.6	50,630
ジャムコ	4.8	6.7	4,160
精密機器 (2.8%)			
テルモ	199.3	204.5	848,061
日機装	21.6	23.8	23,681
日本エム・ディ・エム	4.6	5	11,725
島津製作所	84.3	86.1	323,305
JMS	9.6	8.3	7,793
長野計器	7.8	7.4	5,809
ブイ・テクノロジ	3.3	3.5	18,445
東京計器	6.4	6.4	5,715
インターアクション	4.2	4.6	8,648
東京精密	12.8	13.2	60,786
マニー	28.3	28.9	73,926

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
ニコン	113.6	110.8	71,909	
トプコン	36.1	37.2	49,364	
オリンパス	390	400.4	903,502	
理研計器	6.1	6.2	17,347	
タムロン	5.9	6.4	10,233	
H O Y A	141.8	143.6	1,997,476	
ノーリツ鋼機	5.2	5.6	12,476	
エー・アンド・デイ	7.9	9.1	8,281	
朝日インテック	59.7	82	313,650	
シチズン時計	82.7	80	22,000	
メニコン	9.6	10.1	65,448	
松風	4.3	4.3	7,838	
セイコーホールディングス	9.8	9.6	12,902	
ニプロ	49.9	51.4	57,568	
その他製品（2.7%）				
スノーピーク	4.5	5.8	9,077	
パラマウントベッドホールディングス	7.3	7.5	31,987	
トランザクション	5.3	6	5,628	
ニホンフラッシュ	3.7	7.6	10,366	
前田工織	8.1	7.7	19,996	
永大産業	14.7	15.6	4,524	
アートネイチャー	8.2	10.6	7,091	
パンダイナムコホールディングス	73	74.6	710,938	
S H O E I	3.4	6.2	22,351	
フランスベッドホールディングス	11.8	12.5	10,637	
パイロットコーポレーション	12.5	12.6	37,283	
萩原工業	4.4	5.2	7,971	
トッパン・フォームズ	14.9	14.8	14,770	
フジシールインターナショナル	15.9	15.9	30,798	
タカラトミー	31.8	32.1	29,949	
廣済堂	7.6	8.8	5,552	
プロネクサス	7.2	7.6	8,170	
大建工業	5	5.5	10,862	
凸版印刷	99.2	100.6	143,355	
大日本印刷	91.7	94.3	184,450	
共同印刷	2	2.9	8,462	
N I S S H A	14.8	14.6	20,089	
TAKARA & COMPANY	3.7	4.5	8,721	
アシックス	58.9	63.5	119,380	
小松ウオール工業	2.6	3.1	5,400	
ヤマハ	41.7	42.9	255,684	
河合楽器製作所	2.5	2.8	7,560	
クリナップ	9	9.3	4,296	
ビジョン	42.6	46.4	216,224	
オリバー	—	2	4,722	
キングジム	6.8	8.2	7,339	
リンテック	17	17	36,635	
イトーキ	18.5	20	6,760	
任天堂	43.2	44.4	2,631,144	
三菱鉛筆	11.5	11.5	16,583	
タカラスタンダード	14.1	13.2	18,216	
コクヨ	34	34.1	45,762	
ナカバヤシ	7.4	9.9	6,009	
グローブライド	3.6	3.1	12,539	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
オカムラ	24.3	24.5	22,956	
美津濃	6.5	6.3	11,415	
電気・ガス業（1.3%）				
東京電力ホールディングス	558.3	572.3	155,665	
中部電力	215.4	221.4	278,410	
関西電力	267.2	273.6	261,370	
中国電力	96.8	104.5	138,671	
北陸電力	66	66	48,510	
東北電力	176	179.1	156,712	
四国電力	63.8	66.2	47,002	
九州電力	143.7	147.7	130,123	
北海道電力	68.1	68.7	26,930	
沖縄電力	13	14.5	21,039	
電源開発	55.7	57.4	80,589	
イーレックス	10.4	10	19,640	
レノバ	11.5	12.6	32,634	
東京瓦斯	136	139.1	326,119	
大阪瓦斯	136.7	139.9	280,359	
東邦瓦斯	34.9	35.5	242,465	
北海道瓦斯	4.6	5.8	8,816	
広島ガス	17	22.7	8,421	
西部瓦斯	7.8	8.4	29,820	
静岡ガス	20.4	20.3	20,076	
メタウォーター	3.2	7.4	17,486	
陸運業（3.5%）				
S B Sホールディングス	6.6	5.4	13,597	
東武鉄道	73.9	74.7	233,811	
相鉄ホールディングス	22.8	23.3	59,391	
東急	177.4	180.7	228,946	
京浜急行電鉄	90.4	92.1	164,582	
小田急電鉄	104	106.9	338,338	
京王電鉄	36.5	37.3	276,393	
京成電鉄	48.8	50.1	175,600	
富士急行	9.8	10	48,250	
新京成電鉄	2.8	3.3	7,095	
東日本旅客鉄道	124	127.6	827,868	
西日本旅客鉄道	62.8	64.7	308,203	
東海旅客鉄道	58.5	60.2	800,660	
西武ホールディングス	94.6	94.5	97,807	
鴻池運輸	10.6	11.6	12,029	
西日本鉄道	20	19.9	58,884	
ハマキョウレックス	5.5	5.8	16,941	
サカイ引越センター	3.7	3.9	20,163	
近鉄グループホールディングス	66.6	68.1	315,303	
阪急阪神ホールディングス	88.9	90.9	309,969	
南海電気鉄道	32.1	33	86,526	
京阪ホールディングス	29.6	30.3	148,924	
神戸電鉄	1.7	2.3	8,268	
名古屋鉄道	54.5	55.7	159,970	
山陽電気鉄道	5.9	6	12,198	
日本通運	23.5	23.6	164,728	
ヤマトホールディングス	117.1	113	297,981	
山九	18.5	19.1	73,439	
丸全昭和運輸	5.7	5.9	19,735	

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	
セコグループホールディングス	35.9	37.8	36,666
トナミホールディングス	1.8	1.9	11,115
ニッコンホールディングス	23.8	24.7	50,190
福山通運	8.4	8.8	40,744
セイノーホールディングス	49.7	51	74,562
神奈川中央交通	2.3	2.3	8,878
日立物流	11.8	12.8	39,808
丸和運輸機関	6.9	7.3	33,762
C&Fロジホールディングス	7.6	7.5	13,935
九州旅客鉄道	59.6	60.2	132,319
S Gホールディングス	70	143.8	448,656
海運業 (0.2%)			
日本郵船	55.4	58.2	132,463
商船三井	41.9	44.3	120,850
川崎汽船	19.8	14.3	24,152
N Sユナイテッド海運	4.4	5.5	7,287
飯野海運	38.2	39.1	15,131
乾汽船	5.8	8.1	7,597
空運業 (0.3%)			
日本航空	122.3	152.2	300,899
A N Aホールディングス	122.2	125.8	316,701
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	2	2	16,760
日新	6.3	6.7	8,120
三菱倉庫	21.3	22	65,780
三井倉庫ホールディングス	8.1	8.4	18,874
住友倉庫	24	22.8	30,780
澁澤倉庫	4.6	4.5	10,107
東陽倉庫	20.9	20.9	6,353
日本トランスシティ	17.3	18	10,188
川西倉庫	3.2	4	4,564
安田倉庫	7.5	7.6	7,508
東洋埠頭	4.9	4.9	7,075
上組	38.6	36.9	66,604
近鉄エクスプレス	14	14.5	31,465
エーアイテイー	6.4	8	7,952
日本コンセプト	3.6	4.3	7,494
情報・通信業 (9.4%)			
N E C ネットエスアイ	6.5	20.3	37,291
システナ	24.4	25.5	54,825
デジタルアーツ	3.5	3.6	32,148
日鉄ソリューションズ	10.2	10.6	32,701
キューブシステム	6.8	5.4	7,808
コア	3.9	4.1	5,719
ソリトンシステムズ	4.7	4.5	9,688
ソフトクリエイトホールディングス	4	3.4	10,829
T I S	23	71.5	148,577
電算システム	3.3	3.3	10,972
グリー	49.7	45.6	26,676
ユーエテックモホールディングス	14.1	14.7	81,585
三菱総合研究所	3.3	3.2	13,312
ファインデックス	7.6	8	10,896
ブレインパッド	1.5	2.1	8,977
K L a b	14	14.8	15,066

銘柄	期首(前期末)		期末 評価額
	株数	株数	
ポルトクウイン・ビットクルーホールディ	9.5	10.6	10,176
ネクソン	196.8	179.5	566,322
アイスタイル	18.7	—	—
エムアップホールディングス	2.5	2.5	6,572
エイチーム	6.7	7.8	7,620
エニグモ	6.5	7.7	10,202
コロブラ	23.2	24.9	22,758
ブロードリーフ	36.1	36.7	23,781
デジタルハーツホールディングス	5.4	6.1	7,228
システム情報	4.3	6.3	7,371
メディアアドゥ	2.5	2.5	18,750
じげん	19.6	23.9	7,815
ブイキューブ	—	4.7	15,839
フィックスターズ	8	9.3	9,662
CART A HOLDINGS	4.5	4.8	6,115
オブティム	2.4	4.3	13,244
セレス	3.2	3.5	9,859
S H I F T	1.8	3	46,410
ティーガイア	6.1	6.1	11,217
セック	1.5	1.6	4,848
豆蔵ホールディングス	5.4	—	—
テクマトリックス	5	10.6	24,337
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17.3	17.8	47,223
GMOペイメントゲートウェイ	11.5	15.1	221,064
システムリサーチ	2.6	2.9	4,738
インターネットイニシアティブ	10.6	10.9	54,227
ざくらインターネット	8.4	10.9	8,022
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1.8	1.7	17,544
S R Aホールディングス	4.4	4.8	11,904
e B A S E	4.8	9.8	10,378
アバント	5.8	7.8	8,619
アドソル日進	2.8	3.4	10,057
フリービット	5.5	6.2	5,704
コムチュア	7.9	8.3	26,809
アステリア	5.7	6.4	7,008
アイル	—	4.6	6,568
マークラインズ	4.3	4.1	11,139
メディカル・データ・ビジョン	6.1	8.7	27,144
g u m i	10.2	10.9	9,461
モバイルファクトリー	2.3	2.8	2,780
テラスカイ	3	2.9	14,181
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	3.9	4.6	6,941
ダブルスタンダード	1.1	1.3	5,752
オーブントア	4	5.3	6,683
アカツキ	2.6	2.8	12,558
U b i c o mホールディングス	2.3	2.3	8,234
L I N E	16.1	14.8	79,624
カナミックネットワーク	—	8.1	6,593
チェンジ	1.8	5.1	41,310
オークネット	5.8	5.8	7,940
A O I T Y O Holdings	8.7	11.2	4,670
マクロミル	13.6	17.1	11,115
オロ	2.2	2.8	10,892
サインポスト	1.5	—	—

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
ソルクシーズ	4.4	4.7	4,963	
プロトコーポレーション	7.5	8.4	8,845	
野村総合研究所	115.1	100.7	354,967	
サイバネットシステム	6.5	8	7,744	
インテジホールディングス	10.7	11.1	11,488	
ソースネクスト	34.8	39.3	12,300	
インフォコム	7.7	7.9	28,914	
HEROZ	—	1.2	3,489	
ラクスル	3.9	6.1	30,927	
アルテリア・ネットワークス	8.5	9	14,319	
フォーカスシステムズ	6.2	6.9	6,230	
クレスコ	2.5	5.9	7,552	
フジ・メディア・ホールディングス	67.1	67.5	73,372	
オービック	23.9	24.6	577,362	
ジャストシステム	11.2	11.6	81,548	
TDCソフト	7.2	7.4	7,725	
Zホールディングス	949.7	976.3	641,429	
トレンドマイクロ	30.9	38.2	216,594	
IDホールディングス	3.9	3.9	4,773	
日本オラクル	13.9	14.5	167,765	
アルファシステムズ	2.7	2.7	9,504	
フューチャー	8.7	9	15,993	
CAC Holdings	5.9	6.1	8,967	
S Bテクノロジー	3	3	10,860	
オービックビジネスコンサルタント	7	7.3	54,020	
伊藤忠テクノソリューションズ	31.4	32.4	119,394	
アイティフォー	10.3	10.9	10,038	
大塚商会	37.2	38.4	194,304	
サイボウズ	9.7	8.9	25,543	
ソフトブレイン	5.5	—	—	
電通国際情報サービス	4.3	4.5	31,455	
ACCESS	—	9	7,380	
デジタルガレージ	12.7	13	54,925	
EMシステムズ	5.3	12.2	10,004	
ウェザーニューズ	3	2.6	14,560	
CIJ	8.2	7.1	6,908	
WOWOW	3.5	3.8	10,780	
スカラ	6.4	7.7	6,660	
IMAGICA GROUP	7.8	10.1	4,070	
ネットワンシステムズ	26.5	27.4	101,928	
アルゴグラフィックス	6	6.2	19,840	
マーベラス	13.1	14.1	12,788	
エイベックス	12.6	13.5	12,717	
日本ユニシス	21.7	22.5	86,850	
兼松エレクトロニクス	3.8	3.9	15,756	
TBSホールディングス	42.3	43.1	80,553	
日本テレビホールディングス	58.3	58.4	66,400	
朝日放送グループホールディングス	10.8	10.6	7,345	
テレビ朝日ホールディングス	19.7	19.5	32,838	
スカパーJ S A Tホールディングス	—	47	23,271	
テレビ東京ホールディングス	6	5.9	13,859	
ビジョン	6.7	10.8	12,484	
USEN-NEXT HOLDINGS	—	3.8	5,145	
コネクシオ	4.8	5	6,135	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
日本通信	—	39.5	8,018	
日本電信電話	461.8	948.9	2,339,038	
KDDI	514.8	517.3	1,542,847	
ソフトバンク	627.4	645	828,502	
光通信	7.1	7.3	183,011	
NTTドコモ	510.1	144.7	560,423	
エムティーアイ	9.1	10.3	8,672	
GMOインターネット	27.5	26	76,336	
KADOKAWA	19.1	19.6	64,876	
学研ホールディングス	2.5	9.9	16,176	
ゼンリン	14	15.1	19,569	
アイネット	4.7	5.2	7,737	
松竹	4.6	4.8	62,448	
東宝	41.5	41.9	185,198	
東映	2.6	2.6	43,524	
エヌ・ティ・ティ・データ	182.8	188.9	262,193	
ビー・シー・エー	1.3	1.6	7,256	
DTS	14.9	15.5	34,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29.7	30.5	195,505	
シーイーシー	7.7	8.2	12,439	
カプコン	33.1	33.7	198,156	
ジャストテック	6.4	6.1	8,326	
SCSK	16	16.5	102,795	
日本システムウエア	2.6	3.1	6,519	
アイネス	8.3	8.1	11,534	
TKC	5.7	5.9	40,946	
富士ソフト	9	7.6	38,456	
NSD	11.4	23.2	46,284	
コナミホールディングス	25.2	25.9	141,673	
福井コンピュータホールディングス	3	3.3	11,071	
JBCホールディングス	5.6	6.2	9,182	
ミロク情報サービス	6.3	7	14,273	
ソフトバンクグループ	548.1	563.2	4,095,590	
卸売業（4.5%）				
伊藤忠食品	1.9	2.1	11,802	
エレマテック	8.1	8.6	8,238	
JALUX	2.7	3.5	4,707	
あらた	5.6	5.6	27,776	
東京エレクトロン デバイス	3.6	3.4	10,642	
フィールズ	8.5	11.1	4,129	
双日	378.2	393.1	90,019	
アルフレッサ ホールディングス	76.5	79.2	165,528	
横浜冷凍	20.7	18.8	15,980	
アルコニックス	8.3	8	11,032	
神戸物産	23.8	49	178,360	
あい ホールディングス	10.5	10.2	19,859	
ダイワボウホールディングス	5.9	6	39,120	
マクニカ・富士エレホールディングス	16.9	17.4	35,965	
ラクト・ジャパン	2.8	3.2	9,417	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13.5	14	12,054	
八洲電機	8.4	8.8	8,289	
レスターホールディングス	7.4	7.8	17,487	
ジュテックホールディングス	2.4	3.2	3,244	
TOKAIホールディングス	36.2	37.2	36,865	

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	
三洋貿易	4.1	8.9	9,069
ウイン・パートナーズ	5.6	6.5	7,442
シップヘルスケアホールディングス	11.2	11.4	59,280
コメダホールディングス	15.9	15.5	28,830
小野建	7.5	7.5	9,112
佐鳥電機	7.3	7.6	5,874
伯東	5.3	5.7	6,019
コンドーテック	5.8	7.7	7,823
ナガイレーベン	10.6	9.3	25,128
三菱食品	7	6.9	19,030
松田産業	5.8	6.5	11,186
第一興商	10.6	10.5	35,385
メディバルホールディングス	74.3	76.4	149,973
S P K	2.6	5.4	6,739
萩原電気ホールディングス	3.2	3.5	8,456
アズワン	4.6	4.7	75,388
尾家産業	3.6	3.6	5,313
シモジマ	6.1	6	7,974
ドウシシャ	6.8	6.9	13,862
高速	5.5	5.6	8,825
ハビネット	6.7	7.3	10,409
日本ライフライン	20.4	21.6	31,060
マルカ	3.3	3.8	7,524
I D O M	21	19.1	10,925
進和	4.7	5.4	11,647
ダイترون	3.9	4.3	6,342
シークス	9.2	9.5	14,877
オーハシテクニカ	5.7	5.6	7,560
伊藤忠商事	484.9	498.4	1,374,836
丸紅	722.3	742.5	451,811
長瀬産業	39	39.4	56,539
蝶理	4.9	5.4	8,316
豊田通商	77.4	79.1	285,551
三共生興	15	16.4	7,166
兼松	24.9	26.5	31,932
三井物産	609.2	616.9	1,098,082
日本紙バルブ商事	4.1	3.9	13,435
日立ハイテク	24.1	—	—
カメイ	9.6	9.9	11,612
スターゼン	2.7	2.6	11,037
山善	26.1	26.7	26,539
椿本興業	1.6	1.9	6,925
住友商事	437.8	449.3	578,024
内田洋行	3.2	2.8	14,364
三菱商事	486.7	467.2	1,136,697
第一実業	3.8	3.5	14,087
キャノンマーケティングジャパン	20.3	17.9	39,075
西華産業	5.4	6.2	7,812
佐藤商事	7.7	7.7	7,915
菱洋エレクトロ	7.2	7.2	19,814
東京産業	9.1	10.5	5,848
ユアサ商事	6.2	6.6	21,615
神鋼商事	2.2	2.7	5,022
阪和興業	13.1	13.3	33,250

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
正栄食品工業	4.7	4.8	18,096
カナデン	7	7.4	9,538
菱電商事	6.1	6.5	9,802
フルサト工業	5.2	5	6,265
岩谷産業	15.6	18.7	106,216
極東貿易	3.2	3.3	4,544
イワキ	12.3	12.9	6,785
三菱石油	17.2	17.4	20,079
稲畑産業	14.3	14.9	20,532
明和産業	8.4	10	4,070
ヤマエ久野	—	6.8	8,098
ワキタ	15.7	15.4	17,633
東邦ホールディングス	22.6	23	43,769
サンゲツ	19	20.1	29,446
ミツロコグループホールディングス	10.7	10.8	13,953
シナネンホールディングス	3.9	3.8	11,240
伊藤忠エネクス	14.8	15.1	15,100
サンリオ	19.5	20	31,500
サンワテクノス	6.6	7	6,587
リョーサン	7.7	7.9	14,654
新光商事	11.7	13.8	10,598
トーホー	4.3	4.7	9,559
三信電気	4.4	5.1	10,944
東陽テクニカ	10	9.6	10,156
モスフードサービス	9.3	9.6	25,948
加賀電子	7.1	6.7	14,505
ソダグニッカ	10.5	12	6,480
立花エレテック	5.8	6	9,882
P A L T A C	11	11.4	68,172
太平洋興発	6.6	7.5	4,635
西本Wismettacホールディングス	1.7	2.8	6,314
国際紙バルブ商事	20.5	24.7	6,298
ヤマタネ	4.8	6.5	8,911
日鉄物産	4.6	4.5	15,975
泉州電業	2.8	3	8,625
トラスコ中山	14.2	16.3	42,477
オートボックスセブン	26.1	27	34,992
モリト	7.7	9.7	5,936
加藤産業	10.6	9.6	33,168
イノテック	5.8	6	5,436
イエローハット	13.1	13.9	22,379
J Kホールディングス	9.3	8.5	6,885
日伝	6.6	6.8	16,034
杉本商事	4.7	4.7	11,209
因幡電機産業	19.4	19.6	46,981
東テク	2.8	3.1	7,812
ミスミグループ本社	86.7	89.2	292,130
タキヒヨー	2.8	3.8	7,121
スズケン	29.4	30.4	121,296
ジェコス	7.2	7	6,699
小売業（4.8%）			
ローソン	17.7	18.3	86,559
サンエー	5.6	5.4	21,789
カワチ薬品	5.5	5.6	16,788

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	
エービーシー・マート	10.8	11	59,840
アスクル	7.5	7.4	30,895
ゲオホールディングス	12.7	13.2	16,750
アダストリア	9.8	10.4	17,680
くら寿司	3.7	4.3	24,295
キャンドウ	5	5	9,210
バルグループホールディングス	3.7	8.7	9,918
エディオン	31.1	30.8	30,030
サーコーポレーション	16.3	16.4	9,249
ハローズ	2.9	2.8	9,688
フジオフードグループ本社	3.4	7.5	10,665
あみやき亭	2.2	2.3	6,559
ひらまつ	20.5	26.9	4,949
大黒天物産	2.1	2.1	12,054
ハニースホールディングス	7.1	7.5	7,162
アルペン	5.9	5.9	12,891
クオールホールディングス	10.6	10.2	10,628
ジーンズホールディングス	3.8	3.8	27,018
ビックカメラ	40.3	42.1	47,194
DCMホールディングス	36.4	41.7	49,456
MonotaRO	49.4	50.8	323,596
DDホールディングス	3.3	—	—
アークランドサービスホールディングス	5.6	6.5	13,396
J. フロント リテイリング	82.7	85.8	71,814
ドトール・日レスホールディングス	10.5	9.5	13,708
マツモトキヨシホールディングス	28.4	29.2	142,642
ブロンコビルー	3.9	4.3	9,894
ZOZO	48	49.7	129,418
物語コーポレーション	1.8	1.9	21,907
ココカラファイン	7.2	7.3	55,407
三越伊勢丹ホールディングス	121.4	123.9	69,507
Hamee	2.8	3.6	6,346
ウエルシアホールディングス	20.6	42.3	177,448
クリエイトSDホールディングス	9.5	11.7	43,407
チムニー	3	3.5	4,308
シュッピン	5.9	7.6	6,330
オイシックス・ラ・大地	—	7.1	22,897
ネクステージ	10.3	12.8	17,766
ジョイフル本田	20.4	20.2	29,350
鳥貴族	3	3.4	4,664
キリン堂ホールディングス	3.2	—	—
ホットランド	6.3	7.5	9,390
すかいらーくホールディングス	77.9	80.6	127,428
SFPホールディングス	3.7	5.4	6,879
綿半ホールディングス	3.1	6.8	9,350
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	18.5	20	21,620
B E E N O S	3.4	4.3	10,900
あざひ	6.2	5.8	9,042
日本調剤	2.3	5.4	8,181
コスモス薬品	3.1	6.3	113,400
セブン&アイ・ホールディングス	271.5	278.8	923,664
クワイエット・レストランズ・ホールディング	18.6	40.3	22,205
ツルハホールディングス	15	15.5	236,840
サンマルクホールディングス	5.4	6.3	9,053

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
トリドールホールディングス	8.7	18.1	25,376
TOKYO BASE	7.3	9.8	4,772
JMホールディングス	3.9	5.7	13,879
パロックジャパンリミテッド	6.7	8.4	5,653
クスリのアオキホールディングス	6.9	6.4	55,680
力の源ホールディングス	4.1	4.5	2,646
スシローグローバルホールディングス	7.6	39.3	130,476
LIXILビバ	7	—	—
メディカルシステムネットワーク	9.2	9.8	6,134
ノジマ	11.6	12.8	34,944
カップバ・クリエイト	10.2	10.8	15,195
良品計画	92	95	203,965
アドヴァン	11.3	11.5	14,961
アルビス	3.3	3.6	9,201
コナカ	15.2	18.7	4,824
G-7ホールディングス	2.1	4.5	10,962
イオン北海道	8.4	12.1	11,567
コジマ	14.1	14.6	11,023
コーナン商事	9.4	10.3	33,269
エコス	3.3	3.2	7,372
ワタミ	9	10.1	8,958
バン・パシフィック・インターナショナルホ	166	156.8	386,825
西松屋チェーン	15.4	16.4	25,780
ゼンショーホールディングス	33.5	34.3	89,523
幸楽苑ホールディングス	5.2	6.1	10,821
サイゼリヤ	11.4	10.8	19,332
VTホールディングス	30.1	33.2	12,450
フジ・コーポレーション	2.5	3	6,993
ユナイテッドアローズ	7.5	8.2	11,996
ハイデイ日高	9.6	9.7	16,422
コロワイド	23.9	22	33,924
ピーシーデポコーポレーション	11.8	12.8	7,641
壱番屋	4.9	5	25,600
スギホールディングス	13.9	14.3	99,099
薬王堂ホールディングス	3.2	3.6	8,643
ヴィア・ホールディングス	13.3	—	—
スクロール	15.8	14.3	11,053
ヨンドシーホールディングス	7.3	7.5	13,980
ファミリーマート	55.5	—	—
木曾路	9.1	8.7	20,523
SRSホールディングス	11.2	12	10,416
千趣会	17.8	17.8	5,909
リテールパートナーズ	—	10.2	15,106
ケーヨー	18.8	14.8	10,981
上新電機	8	7.9	21,661
日本瓦斯	11.2	11.3	59,664
ロイヤルホールディングス	11.8	12.4	22,096
いなげや	8.9	8.7	17,739
島忠	13.2	13.2	72,336
チヨダ	7.6	9.6	8,572
ライフコーポレーション	5.4	5.7	21,004
リンガーハット	8.8	9.3	20,571
M r M a x H D	12.5	12.5	10,675
AOKIホールディングス	13.6	17.2	7,034

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	
オークワ	11	11.5	15,398
コメリ	10.5	11.2	31,752
青山商事	14.6	18.9	8,429
しまむら	8	8.2	88,560
高島屋	51.6	52.4	42,077
松屋	14.9	15.7	11,288
エイチ・ツー・オー リテイリング	33	32.2	20,704
近鉄百貨店	2.8	3	9,885
バルコ	7.2	—	—
丸井グループ	63.6	65.7	125,224
アクシアル リテイリング	5.6	5.8	27,521
イオン	266.4	274.2	851,391
イズミ	14.2	14.8	53,280
平和堂	13.6	13.2	28,036
フジ	8.5	8.2	15,752
ヤオコー	7.6	7.9	56,406
ゼビオホールディングス	8.8	9.8	7,448
ケーズホールディングス	67.1	68	86,224
Olympicグループ	6.3	5.8	5,800
日産東京販売ホールディングス	17.8	18.4	4,600
Genky DrugStores	3.7	3.3	13,695
総合メディカルホールディングス	6.3	—	—
ブックオフグループホールディングス	4.9	5.9	4,950
アインホールディングス	9.5	8.9	63,279
元気寿司	2.4	2.6	6,045
ヤマダホールディングス	210.5	215.4	106,838
アークランドサカモト	10.9	11.8	21,110
ニトリホールディングス	30	30.8	684,684
グルメ杵屋	6.2	8.4	8,240
吉野家ホールディングス	23.5	24.4	46,506
松屋フーズホールディングス	3.3	3.1	10,633
サガミホールディングス	9.8	10.1	12,554
関西スーパーマーケット	6.6	6.9	8,638
王将フードサービス	5	5	30,000
ブレナス	7.8	7.5	13,027
ミニストップ	5.8	6.5	8,775
アークス	13.4	14.2	30,984
パローホールディングス	14.8	15.2	39,398
ベルク	3.2	3.6	21,996
大庄	5.2	5.4	5,184
ファーストリテイリング	9.3	9.5	816,430
サンドラッグ	26	26.7	116,946
サックスパー ホールディングス	8.3	9.2	4,885
ペルーナ	15.3	16.6	15,869
銀行業 (4.6%)			
じもとホールディングス	59.1	5.5	4,933
めぶきフィナンシャルグループ	361.1	370.2	79,222
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10	10.6	12,084
九州フィナンシャルグループ	112.6	155.3	79,203
ゆうちょ銀行	196.3	202	166,044
富山第一銀行	19.6	18.1	5,285
コンコルディア・フィナンシャルグループ	409.1	407.2	151,071
西日本フィナンシャルホールディングス	47.3	47	33,981
関西みらいフィナンシャルグループ	41.1	42.5	22,185

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
三十三フィナンシャルグループ	6.5	6.7	8,582
第四北越フィナンシャルグループ	12.1	12.9	30,495
ひろぎんホールディングス	—	106.6	61,934
新生銀行	50.8	52.8	65,577
あおぞら銀行	41.1	42.4	80,348
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,780.6	4,879.9	2,188,635
りそなホールディングス	760.7	774.1	283,088
三井住友トラスト・ホールディングス	131.1	134.5	410,359
三井住友フィナンシャルグループ	480.3	493.2	1,495,382
千葉銀行	238.2	237.8	140,777
群馬銀行	135.4	138.6	45,045
武蔵野銀行	10.6	11.2	17,785
千葉興業銀行	20.6	20.2	5,312
筑波銀行	30.8	30.1	5,899
七十七銀行	23.7	24.2	35,477
青森銀行	5.4	5.6	13,624
秋田銀行	5.2	4.8	6,686
山形銀行	8.7	8.7	10,274
岩手銀行	5	5	11,080
東邦銀行	60	63.6	14,437
東北銀行	4	4	4,304
みちのく銀行	5	5.5	6,506
ふくおかフィナンシャルグループ	58.3	60.2	112,152
静岡銀行	171.2	170.4	126,436
十六銀行	9	9.1	18,045
スルガ銀行	72.7	74.4	25,072
八十二銀行	166.8	166.6	61,808
山梨中央銀行	9.2	9.2	6,798
大垣共立銀行	13.7	14.2	33,341
福井銀行	5.9	6	11,970
北國銀行	7.6	7.3	21,053
清水銀行	2.9	3	5,670
富山銀行	1.6	1.5	5,190
滋賀銀行	13.7	14.1	33,459
南都銀行	11.9	12	22,452
百五銀行	64.7	66.3	21,017
京都銀行	24.7	25.4	132,334
紀陽銀行	24.5	25.6	40,704
ほくほくフィナンシャルグループ	46.8	47.4	49,153
広島銀行	101.2	—	—
山陰合同銀行	42	44.2	24,089
中国銀行	60	61	56,181
伊予銀行	97.6	100.7	69,684
百十四銀行	7.6	7.9	12,782
四国銀行	10.4	11.5	8,142
阿波銀行	11.4	11.6	29,788
大分銀行	4.2	4.2	9,765
宮崎銀行	4.5	5	11,500
佐賀銀行	4.7	4.7	6,439
沖縄銀行	6.5	6.5	19,194
琉球銀行	15.7	17.1	14,928
セブン銀行	235.6	240.4	55,051
みずほフィナンシャルグループ	9,433.6	969.1	1,286,480
山口フィナンシャルグループ	87.8	89.2	58,158

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	
名古屋銀行	6	5.5	14,883
北洋銀行	108.3	110.4	25,723
愛知銀行	2.9	2.5	7,700
中京銀行	3	3	6,417
大光銀行	2.5	2.5	3,132
愛媛銀行	10.2	10.3	11,072
京葉銀行	30.8	31.9	14,578
栃木銀行	39.6	40.1	7,338
北日本銀行	—	2.7	5,510
東和銀行	12.3	14.2	9,116
トモニホールディングス	57.6	58.5	19,539
フィデアホールディングス	73	75	8,175
池田泉州ホールディングス	78.2	88.8	13,497
証券・商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	22.8	22	10,934
S B I ホールディングス	77.7	81.8	231,494
ジャフコ グループ	10.6	11.2	50,176
大和証券グループ本社	557.3	572.1	259,790
野村ホールディングス	1,223.1	1,254.4	657,305
岡三証券グループ	62.6	62.6	23,099
丸三証券	22.5	22.1	10,475
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82.4	82.5	25,410
水戸証券	26.5	26.5	6,254
いちよし証券	13.6	16.3	7,661
松井証券	40.9	41.9	35,196
マネックスグループ	56.1	56.3	19,648
極東証券	11.1	10.9	7,869
岩井コスモホールディングス	8	7	9,324
藍澤證券	12.5	14.5	10,498
スパークス・グループ	30	35.8	8,413
保険業 (1.9%)			
かんぽ生命保険	24.9	25.5	44,370
S O M P O ホールディングス	130.6	134.1	537,741
アニコム ホールディングス	5.8	24.5	26,778
M S & A D インシュアランスグループホール	181.7	186.4	565,724
ソニーフィナンシャルホールディングス	56.9	—	—
第一生命ホールディングス	393.1	403.2	663,062
東京海上ホールディングス	248.3	252.2	1,308,918
T & D ホールディングス	214.5	213.2	259,890
アドバンスクリエイト	1.5	1.8	3,456
その他金融業 (1.1%)			
全国保証	19.6	20.4	97,410
日本モーゲージサービス	—	3.5	3,986
C a s a	3	3	3,840
アルヒ	11.2	11.8	22,667
プレミアグループ	4	4	8,980
クレディセゾン	48.9	50.1	59,869
芙蓉総合リース	7.3	7.4	47,212
みずほリース	10.9	11.2	31,102
東京センチュリー	14	14.3	98,813
日本証券金融	32.2	34.7	17,350
アイフル	111.7	110.9	29,610
リコーリース	5.8	6	17,406
イオンフィナンシャルサービス	42.5	44.2	50,299

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
アコム	138.8	143.6	71,943
ジャックス	7.8	8.5	15,436
オリエントコーポレーション	195.6	203.5	23,402
日立キャピタル	16.2	17.4	41,655
アプラスフィナンシャル	44.1	—	—
オリックス	434.3	441.2	685,183
三菱UFJリース	176.2	175.5	84,064
日本取引所グループ	199.5	204.6	528,584
イー・ギャランティ	7.1	8.8	18,189
NECキャピタルソリューション	3.3	3.3	5,982
不動産業 (2.0%)			
いちご	90.2	89	29,370
日本駐車場開発	85.3	99.2	12,598
スター・マイカ・ホールディングス	4.5	4.8	6,624
ヒューリック	149	152	160,664
三栄建築設計	4	3.8	6,593
野村不動産ホールディングス	42.2	43.2	97,632
三重交通グループホールディングス	18	18.8	8,779
サムティ	9.9	10.3	17,036
ディア・ライフ	10.3	14.3	5,977
日本商業開発	6.1	6.1	10,443
プレサンスコーポレーション	11.1	11.3	19,820
ユニゾホールディングス	10.8	—	—
日本管理センター	5.8	6	7,806
フージャースホールディングス	16.6	17.3	11,660
オープンハウス	20.1	22.6	93,451
東急不動産ホールディングス	188.2	194.4	98,366
飯田グループホールディングス	56.6	59	123,782
ムゲンエステート	8.2	10.2	5,212
ビーロッド	2.5	5.7	4,731
ハウスドゥ	4.8	4.7	5,560
エイ・エス・ビー	1.2	2.1	6,856
パーク24	37.7	39	60,684
バラカ	3.1	3.1	5,090
三井不動産	347.3	346.5	755,889
三菱地所	487	500	902,000
平和不動産	13	13.1	44,802
東京建物	77	71.1	101,886
ダイビル	18.4	18.8	25,248
京阪神ビルディング	12.1	11.1	21,289
住友不動産	156.5	160.2	545,481
テーオーシー	15	16.9	10,799
東京楽天地	1.7	1.7	7,403
スターツコーポレーション	9.2	8.9	25,089
フジ住宅	11.8	11.8	7,257
空港施設	13.3	11.4	5,289
ゴールドクレスト	5.9	6.9	9,694
エスリード	3.8	4	5,268
日神グループホールディングス	14.1	14.5	5,466
日本エスコ	14.1	13.5	12,447
タカラレーベン	33.5	36.4	10,774
A V A N T I A	7	7	5,635
イオンモール	35.7	36.1	60,467
ファースト住建	5.2	4.8	5,131

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	
カチタス	8.8	18	55,800
トーセイ	9.9	11.6	13,490
サンフロンティア不動産	10.2	12.4	11,420
エフ・ジェー・ネクスト	7.8	7.6	7,486
ランドビジネス	7.4	11.6	3,897
日本空港ビルデング	22.4	22.8	138,624
サービス業 (6.1%)			
日本工営	4.6	4.9	13,891
L I F U L L	24.8	28.5	11,143
ミクシィ	—	13.4	38,203
ジェイエイシーリクルートメント	5	5.8	10,753
日本M&Aセンター	50.9	53	386,900
メンバーズ	2.3	2.8	6,412
UTグループ	—	11	36,245
アイティメディア	—	3.3	8,448
タケエイ	8.1	8.6	11,205
ビーネックスグループ	8.1	10.5	11,970
コシダカホールディングス	16.6	19.8	7,860
パソナグループ	8.4	8	14,432
リンクアンドモチベーション	16.3	16.8	9,374
G C A	9.8	12.1	8,603
エス・エム・エス	21.3	22	83,270
パーソルホールディングス	67.3	69.6	133,075
リニカル	4.7	5.9	4,165
クックパッド	28.3	30	9,600
学情	3.4	4.1	4,460
スタジオアリス	4.3	4.6	8,661
シミックホールディングス	4.7	5.1	6,992
総合警備保障	26.7	27.3	152,607
カカココム	50.8	51.5	150,843
アイロムグループ	3.3	3.3	5,989
ルネサンス	4.9	6.2	5,363
ディップ	9.5	9.7	23,609
デジタルホールディングス	4.2	5.8	10,828
新日本科学	9.3	10.2	6,905
ツクイホールディングス	18.4	19.6	11,328
ベネフィット・ワン	18.1	25.4	85,598
エムスリー	148.3	152.4	1,466,392
アウトソーシング	38.3	40.3	57,790
ウェルネット	9.1	11.7	5,744
ワールドホールディングス	2.7	3	6,102
ディー・エヌ・エー	33.7	30.1	55,083
博報堂DYホールディングス	93	95.4	144,054
ぐるなび	13.5	15.2	7,858
タカミヤ	9.4	12.5	6,837
ジャパンベストレスキューシステム	5.6	7.1	6,816
ファンコミュニケーションズ	21	22.8	9,530
ライク	3.2	3.2	6,697
エスプール	14.2	18	13,698
WDBホールディングス	3.3	3.6	10,224
バリューコマース	4.3	4.9	17,052
インフォマート	37.5	71.1	76,148
J Pホールディングス	27.2	28.8	8,092
E P Sホールディングス	10.7	10.8	10,357

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
プレステージ・インターナショナル	26	26.8	25,781
アミューズ	4.1	4.5	11,587
ドリームインキュベータ	3.1	4	5,804
ケイック	4.9	5.4	6,075
ケネディクス	65.4	58	44,022
電通グループ	69.2	77.9	264,860
テイクアンドギヴ・ニーズ	3.4	—	—
びあ	2.1	1	2,715
イオンファンタジー	2.8	3.4	7,480
シーティーエス	9	9.3	8,742
ネクシィーズグループ	2.8	4.8	4,118
H. U. グループホールディングス	19.4	19.6	55,389
アルプス技研	6.3	6.4	13,408
日本空調サービス	9.6	10	7,620
オリエンタルランド	71.5	73.5	1,305,727
ダスキン	17.4	16.6	46,048
明光ネットワークジャパン	10.1	12.4	6,547
ファルコホールディングス	5.1	5.1	8,093
ラウンドワン	19.3	20.4	17,523
リゾートトラスト	31.7	32.3	52,584
ビー・エム・エル	8.6	8.7	28,536
りらいあコミュニケーションズ	12.2	12.6	15,548
リソー教育	32.3	37.9	11,938
ユー・エス・エス	75.4	76.8	167,731
サイバーエージェント	39	42.8	306,020
楽天	313.9	323.1	377,703
クリーク・アンド・リバー社	4.5	5	5,170
テー・オー・ダブリュー	8.3	17.7	4,956
山田コンサルティンググループ	3.8	5.6	5,432
セントラルスポーツ	2.9	3.4	7,310
フルキャストホールディングス	6.6	7.1	12,020
エン・ジャパン	11.9	12.3	39,975
テクノプロ・ホールディングス	13.5	13.9	122,320
アイ・アールジャパンホールディングス	3.1	2.8	46,620
K e e P e r 技研	—	6.2	13,051
G u n o s y	5.3	5.8	4,355
イー・ガーディアン	3.6	3.5	11,095
ジャパンマテリアル	20.6	21.5	31,196
ベクトル	9.3	10.3	9,476
チャーム・ケア・コーポレーション	2.5	6.9	9,308
I B J	5.6	7.6	5,829
アサンテ	3.7	4.7	6,612
N ・ フィールド	7	7.2	5,652
バリューHR	1.7	4.2	7,795
M&Aキャピタルパートナーズ	4.8	5.6	35,280
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.7	3.8	7,679
シグマクス	5	5.5	9,020
ウィルグループ	5.1	6.3	6,167
メドピア	—	3.3	21,813
リクルートホールディングス	481.7	495.3	2,179,320
エラン	4.4	4.9	15,631
日本郵政	551.6	564	435,802
ベルシステム24ホールディングス	11.6	12	19,236
鎌倉新書	5.4	6.4	6,860

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
LITALICO	2.9	3	10,650	
エアトリ	3.5	—	—	
アトラエ	2	2.4	7,368	
ストライク	2.6	2.7	17,064	
ソラスト	18.9	19.3	29,278	
インソース	3.5	3.4	12,546	
ペイカレント・コンサルティング	4.2	4.2	72,996	
グレイステクノロジー	3.3	3.3	27,489	
ジャパンエレベーターサービスホールディング	7.3	8.1	39,406	
グリーンズ	4.3	—	—	
日総工産	5.2	6.7	5,038	
キュービーネットホールディングス	4.7	4	6,348	
RPAホールディングス	4.4	6.6	4,441	
スプリックス	3.1	4.1	3,452	
マネジメントソリューションズ	—	4.5	6,786	
プロレド・パートナーズ	—	1.1	5,357	
カーブスホールディングス	—	20	14,440	
アドバンテッジリスクマネジメント	4.7	5.9	4,082	
リログループ	36.8	38.3	111,567	
東祥	4.8	5.7	7,581	
エイチ・アイ・エス	10.6	11.1	17,871	
共立メンテナンス	11	11.7	42,529	
イチネンホールディングス	8.3	8.8	11,545	
建設技術研究所	5.6	5.4	11,421	
スペース	—	6	4,842	
燦ホールディングス	4.4	4.5	5,490	
東京テアトル	4.7	4.4	5,667	
ナガワ	2.1	2.3	21,022	
よみうりランド	2.1	1	6,040	
東京都競馬	4.6	4.4	22,748	
常磐興産	4.9	—	—	
カナモト	11.1	12.5	27,162	
東京ドーム	28.2	28.8	38,793	
西尾レントオール	6.8	6.3	12,807	
トランス・コスモス	6.4	6.9	18,630	
乃村工藝社	28.8	30.2	23,556	
藤田観光	3.7	—	—	
KNT-CTホールディングス	4.8	—	—	
日本管財	6.4	6.3	13,066	
トーカイ	6.6	6.5	13,214	
セコム	71.3	73.3	761,953	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
セントラル警備保障	3.3	3.4	11,815	
丹青社	13.1	15.8	12,039	
メイテック	8.5	8.5	40,842	
応用地質	7.9	8.3	10,084	
船井総研ホールディングス	13.7	14.7	36,985	
オオバ	8.2	8.2	6,174	
ベネッセホールディングス	22.7	23.7	51,950	
イオンディライト	8.1	8.1	21,335	
ナック	6	6	5,490	
ニチイ学館	9.9	—	—	
ダイセキ	11.3	11.8	34,939	
合計	株数・金額	81,710	75,624	176,346,813
	銘柄数<比率>	1,661	1,648	<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。

※-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	百万円 3,616	百万円 —
T O P I X		

※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。

■ 投資信託財産の構成

(2020年11月30日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 176,346,813	%
コール・ローン等、その他	4,629,863	2.6
投資信託財産総額	180,976,676	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。

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

(2020年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	182,707,781,463円
コール・ローン等 株 式(評価額)	2,068,196,828
未 収 入 金	176,346,813,610
未 収 配 当 金	1,490,479,706
差入委託証拠金	1,157,091,319
(B) 負 債	2,221,773,203
未 払 金	1,645,200,000
未 払 解 約 金	74,697,472
未 払 利 息	390,456,554
差入委託証拠金代用有価証券	5,163
その他未払費用	1,756,600,000
(C) 純資産総額(A-B)	180,486,008,260
元 本	62,877,618,349
次期繰越損益金	117,608,389,911
(D) 受益権総口数	62,877,618,349口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,704円

※当期における期首元本額63,743,430,458円、期中追加設定元本額16,414,885,649円、期中一部解約元本額17,280,697,758円です。

※代用として、担保に供している資産は、株式2,799,600,000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2019年12月3日 至2020年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,977,494,527円
受 取 配 当 金	3,977,638,105
受 取 利 息	13
そ の 他 収 益 金	1,507,242
支 払 利 息	△ 1,650,833
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,604,156,195
売 買 益	25,626,270,617
売 買 損	△ 19,022,114,422
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 110,849,500
取 引 益	1,230,195,000
取 引 損	△ 1,341,044,500
(D) 信 託 報 酬 等	△ 923,029
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	10,469,878,193
(F) 前期繰越損益金	110,654,863,523
(G) 追加信託差損益金	23,133,127,061
(H) 解約差損益金	△ 26,649,478,866
(I) 計 (E+F+G+H)	117,608,389,911
次期繰越損益金(I)	117,608,389,911

※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	9,593,112,435円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	2,066,309,075円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	924,099,772円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	7,670,534,834円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,437,512,099円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	47,626,634円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,182,148,801円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	197,754,086円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	171,397,205円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	533,150円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2020（4資産タイプ）	5,673,022円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	845,219,384円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2025（4資産タイプ）	23,413,868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>	54,367,762円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2030（4資産タイプ）	66,326,513円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	341,176,214円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2035（4資産タイプ）	127,855,299円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,003,227,262円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2040（4資産タイプ）	95,770,146円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	773,646,515円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2045（4資産タイプ）	191,642,664円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,435,179,848円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,182,656,821円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	777,157円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	14,894,965,209円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	53,935,752円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	373,453,945円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	61,624,654円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	408,583,033円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,563,364円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	266,224,089円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	20,614,021円
イオン・バランス戦略ファンド	24,685,046円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	151,409,094円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2050	18,780,552円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	304,450,841円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	119,160,393円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	86,690,924円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	94,968,523円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	48,801,662円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	312,450,363円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,014,718円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	154,728,514円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	60,239,936円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	169,643,016円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	785,065,293円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	21,524,925円	SMAM・国内株式インデックスファンド・VA（適格機関投資家専用）	180,416,835円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	126,244,586円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	1,078,473円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	6,314,117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>	440,633,490円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	31,885,382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>	155,973,301円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	27,185,537円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,261,312,360円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2060	3,079,650円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	94,325,682円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,506,055,801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>	20,538,793円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	19,074,070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>	59,665,207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>	162,193,127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>	82,302,624円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	2,502,207,801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>	277,593,080円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

外国株式インデックス・マザーファンド

第18期（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

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

■ 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 証券組入率	純資産額
	騰落率	中率	騰落率	中率				
14期 (2016年11月30日)	円	%		%	%	%	%	百万円
15期 (2017年11月30日)	27,558	△ 5.1	284.85	△ 5.0	95.6	2.0	2.4	165,583
16期 (2018年11月30日)	33,807	22.7	350.45	23.0	95.2	2.5	2.3	196,182
17期 (2019年12月2日)	34,678	2.6	360.38	2.8	93.7	3.9	2.3	174,245
18期 (2020年11月30日)	38,813	11.9	404.43	12.2	95.2	2.1	2.7	232,418
	42,581	9.7	444.41	9.9	96.8	0.9	2.3	254,097

※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2020年11月30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 証券組入率
	騰落率	中率	騰落率	中率			
(期首) 2019年12月2日	円	%		%	%	%	%
12月末	38,813	—	404.43	—	95.2	2.1	2.7
2020年1月末	40,115	3.4	417.79	3.3	96.0	1.6	2.6
2月末	40,168	3.5	418.52	3.5	95.2	2.2	2.6
3月末	37,016	△ 4.6	385.76	△ 4.6	95.6	1.8	2.7
4月末	31,452	△ 19.0	328.34	△ 18.8	95.4	2.2	2.5
5月末	34,540	△ 11.0	360.09	△ 11.0	96.4	1.5	2.4
6月末	36,029	△ 7.2	375.64	△ 7.1	94.4	3.2	2.3
7月末	36,725	△ 5.4	383.02	△ 5.3	95.0	2.7	2.4
8月末	37,947	△ 2.2	395.29	△ 2.3	95.4	2.2	2.4
9月末	40,868	5.3	426.30	5.4	95.9	1.7	2.3
10月末	39,268	1.2	409.61	1.3	94.9	3.0	2.3
(期末) 2020年11月30日	38,175	△ 1.6	398.22	△ 1.5	95.8	1.4	2.3
	42,581	9.7	444.41	9.9	96.8	0.9	2.3

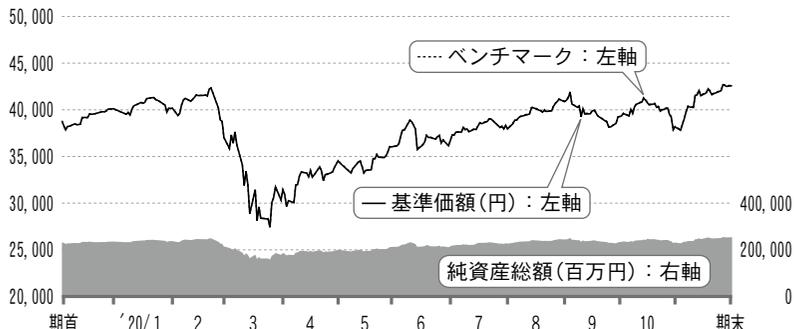
※騰落率は期首比です。

※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（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	38,813円
期末	42,581円
騰落率	+9.7%

※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、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（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

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

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ 期初から2020年2月中旬にかけて、米中貿易摩擦問題の緩和期待などから株式市場が上昇したこと ・ 3月下旬から期末にかけて、新型コロナウイルス感染拡大ペースの減速とそれに伴う世界景気の急回復期待で株式市場が上昇したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ 2月下旬から3月中旬にかけて、新型コロナウイルスのパンデミック（世界的大流行）による世界経済の急激な落ち込みを受け、株式市場が急落したこと ・ 3月下旬以降、米国の金融政策の緩和強化が当面維持されるとの見方から米ドルが対円で下落したこと

▶ 投資環境について（2019年12月3日から2020年11月30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、米ドルが対円で下落、ユーロは対円で上昇しました。

株式市場

期初から2020年2月中旬にかけては、米中貿易交渉が進展し、12月には第一段階の合意に達したことや中国景気の先行き不透明感が後退したこともあって、世界の株式市場は堅調に推移しました。2月下旬から3月中旬にかけては中国の武漢が発生源とされる新型コロナウイルスの感染が拡大するとともに、世界の株式市場は急落しました。

その後は、8月まで、欧米の感染者数・死者数の増加ペースが鈍化し始めたことから欧米の経済活動再開への期待が高まり、世界的に株式に対する買い安心感が広がりました。世界各国の政府・中央銀行から景気刺激策の発表が相次いだことや、情報技術セクターを中心に企業の業績見通しが概ね良好な内容となったことも、株式市場の押し上げ要因となりました。

9月以降、米国や中国の追加景気対策に対する期待が後退し、世界の株式市場は軟調に推移しました。11月以降は、新型コロナウイルスに対するワクチンの開発進展期待や、米国大統領選においてバイデン候補の勝利が確実視されたことなどもあって、世界的に株式市場は期末にかけて上昇しました。

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16.0%上昇しました。

為替市場

米ドル・円相場は、期初から2月中旬まで概ねもみあい推移しました。その後、市場の混乱を受け、3月中旬にかけ、乱高下する展開となりましたが、3月下旬以降は、期末まで米ドル安・円高の展開となりました。新型コロナウイルスの感染拡大に伴い世界景気が急速な落ち込みをみせたことを受け、3月にFRB（米連邦準備制度理事会）ゼロ金利政策を選択したことで、米ドル・円レートは月間で102円台～111円台と大きく変動しました。3月下旬以降は、未曾有の世界景気の落ち込みに対して、金融緩和策は長期化するとの観測から、米ドルは対円で軟調に推移しました。

ユーロ・円相場は、期初から1月中旬までは世界景気の回復期待や日本の消費増税後の景気停

滞観測からユーロ高で推移しました。その後、イタリアで新型コロナウイルスの感染が急速に拡大するなどしたことから、ユーロは弱含む動きとなりました。5月以降は欧州復興基金設立に向けた政治的な取り組み（7月に設立が合意されました）や経済活動再開の動きなどが好感され、ユーロ高・円安の動きが強まりました。

当期の米ドル・円は期首109円68銭から期末103円89銭へと5円79銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首120円86銭から期末124円38銭へと3円52銭のユーロ高・円安となりました。

▶ ポートフォリオについて（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

株式組入比率

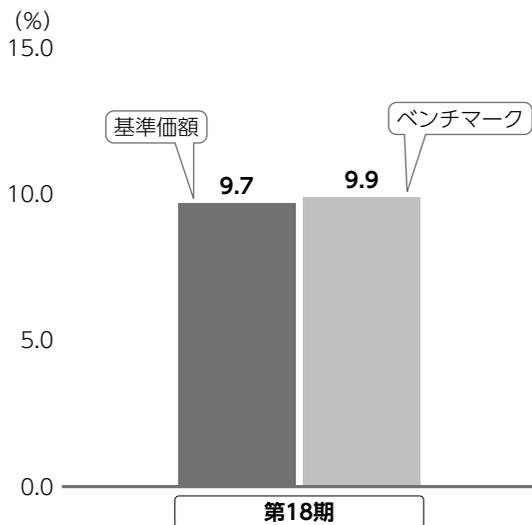
M S C I コクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について (2019年12月3日から2020年11月30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+9.7%となり、ベンチマークの騰落率+9.9%から0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

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

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

■ 1万口当たりの費用明細（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	3円 (3) (0) (0) (1)	0.009% (0.007) (0.000) (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) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券)	3 (3) (0) (0)	0.009 (0.009) (0.000) (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)	20 (15) (5)	0.053 (0.040) (0.013)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	26	0.071	

期中の平均基準価額は37,482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 (2019年12月3日から2020年11月30日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 30,330 (9,716)	千米ドル 272,978 (1,449)	百株 30,120 (334)	千米ドル 249,128 (7,318)
	カ ナ ダ	4,943 (△ 209)	千カナダドル 19,237 (-)	4,177 (569)	千カナダドル 16,472 (415)
	ユ ー ロ		千ユーロ		千ユーロ
	ド イ ツ	3,349 (397)	12,095 (199)	2,683 (198)	9,204 (395)
	イ タ リ ア	4,927	2,840	2,986	1,719
	フ ラ ン ス	2,583 (96)	12,157 (△ 1)	2,466	11,160
	オ ラ ン ダ	1,275 (9)	6,636 (-)	2,195 (-)	9,275 (2)
	ス ペ イ ン	4,677 (17,021)	2,944 (126)	22,727 (2,014)	3,152 (127)
	ベ ル ギ ー	263	1,394	178	837
	オ ー ス ト リ ア	154	367	131	377
	ル ク セ ン ブ ル ク	349 (63)	269 (-)	178	113
	フ ィ ン ラ ン ド	927 (252)	1,153 (144)	1,031 (-)	1,337 (144)
	ア イ ル ラ ン ド	195 (0.7)	1,209 (-)	1,026	816
	ポ ル ト ガ ル	529 (1,359)	328 (-)	1,806	260
国	イ ギ リ ス	28,996 (3,015)	千英ポンド 18,327 (235)	71,243	千英ポンド 14,613
	ス イ ス	1,838 (0.17)	千スイスフラン 13,309 (△ 188)	1,693 (-)	千スイスフラン 11,269 (11)
	ス ウ ェ ー デ ン	3,125 (154)	千スウェーデンクローナ 47,880 (-)	2,405 (-)	千スウェーデンクローナ 32,359 (51)

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	ノ ル ウ ェ ー	614	千ノルウェークローネ 9,084	567	千ノルウェークローネ 7,138
	デ ン マ ー ク	626	千デンマーククローネ 22,934	491	千デンマーククローネ 18,751
	オ ー ス ト ラ リ ア	8,988 (360)	千オーストラリアドル 12,866 (124)	9,260 (177)	千オーストラリアドル 10,822 (124)
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	1,583	千ニューージーランドドル 892	1,758	千ニューージーランドドル 944
	香 港	11,230 (△ 2,078)	千香港ドル 32,116 (-)	10,992	千香港ドル 32,715
	シ ン ガ ポ ー ル	4,555 (1,115)	千シンガポールドル 1,710 (65)	7,344 (739)	千シンガポールドル 1,981 (65)
国	イ ス ラ エ ル	183 (25)	千イスラエルシェケル 830 (-)	290	千イスラエルシェケル 687

※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) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外	ア メ リ カ	証券 — (5,525)	千米ドル — (77)	証券 5,525	千米ドル 28
	国	ス イ ス	— (55,710)	千スイスフラン — (11)	— —

※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。

※（ ）内は権利付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

外国株式インデックス・マザーファンド

(3) 投資信託証券

		買 付		売 付			
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額		
外	アメリカ	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	1,520	228	751	111	
		AMERICAN TOWER CORP	5,068	1,170	4,790	1,115	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	18,628	137	13,507	132	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,785	443	2,510	421	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2,785	468	2,118	348	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	(21,967)	(2,949)			
		DUKE REALTY CORP	6,359	868	2,918	394	
		EQUINIX INC	12,085	403	11,323	386	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,424	986	1,039	686	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,593	158	1,711	128	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	1,020	117	—	—	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	—	614	71	
		INVITATION HOMES INC	9,243	251	4,724	133	
		IRON MOUNTAIN INC	4,560	96	6,894	196	
		KIMCO REALTY CORPORATION	2,200	60	4,391	133	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	—	—	21,090	234	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	(Δ 9,193)	(Δ 566)	—	—	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	9,511	175	7,436	159	
		PROLOGIS INC	3,908	120	2,418	99	
		PUBLIC STORAGE	10,334	929	9,599	897	
	REALTY INCOME CORPORATION	(6,205)	(566)				
	REGENCY CENTERS CORP	727	122	443	92		
	REGENT COMMUNITIES INC	1,751	93	—	—		
	SL GREEN REALTY CORP	1,197	62	2,359	135		
	SIMON PROPERTY GROUP INC	—	—	3,945	166		
	SUN COMMUNITIES INC	2,397	164	3,142	354		
	UDR INC	1,052	156	—	—		
	VENTAS INC	2,344	88	—	—		
	VICI PROPERTIES INC	6,565	212	5,717	270		
	WELLTOWER INC	—	—	3,035	77		
WEYERHAEUSER CO	6,593	327	4,389	280			
小 計	9,778	292	8,604	236			
小 計	126,427	8,138	129,467	7,263			
	(18,979)	(2,949)					
国	カナダ	CAN APARTMENT PROP	—	—	726	40	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,546	141	—	—	
	小 計	—	—	10,391	136		
	小 計	6,546	141	11,117	177		
	ユ ーロ	フランス	ICADE	796	55	—	—
			KLEPIERRE	—	—	—	—
			GECINA SA	(—)	(Δ 7)	—	—
			UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	—	—	500	80
	小 計	3,334	165	2,015	152		
	小 計	4,130	220	2,515	232		
ユ ーロ 小 計	(—)	(Δ 7)					
ユ ーロ 小 計	4,130	220	2,515	232			
	(—)	(Δ 7)					

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	イギリス	SEGRO PLC	□ 19,544	千英ポンド 160	□ 20,981	千英ポンド 180
		LAND SECURITIES GROUP PLC	7,158	41	—	—
		計	26,702	202	20,981	180
	オーストラリア	MIRVAC GROUP	□ 29,561	千オーストラリアドル 53	□ 55,876	千オーストラリアドル 169
		TRANSURBAN GROUP	20,397	252	16,172	240
		APA GROUP	24,828	249	23,644	269
		LENDLEASE GROUP	51,032	630	40,031	463
		STOCKLAND	23,976	97	—	—
		DEXUS	8,552	99	16,681	202
		SYDNEY AIRPORT	24,139	133	—	—
					(—)	(11)
		SCENTRE GROUP	—	—	15,795	56
		SYDNEY AIRPORT-RIGHTS	—	—	9,662	7
		SYDNEY AIRPORT-RIGHTS NEW	—	—	—	—
	VICINITY CENTRES	(9,662)	(11)	—	—	
	計	285,866 (9,662)	1,658 (11)	177,861 (—)	1,409 (11)	
	香港	LINK REIT	□ 9,800	千香港ドル 631	□ 12,200	千香港ドル 879
		HKT TRUST AND HKT LTD	27,000	282	—	—
		計	36,800	914	12,200	879
シンガポール	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	□ 23,900	千シンガポールドル 47	□ 40,100	千シンガポールドル 90	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST N	—	—	—	—	
		(93,888)	(262)	(—)	(33)	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,500	203	53,900	174	
		(—)	(△ 4)	—	—	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—	
		(△130,400)	(△ 262)	—	—	
SUNTEC REIT	38,100	44	—	—		
	(—)	(△0.14922)	—	—		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	138,100	277	—	—		
	(—)	(△ 1)	—	—		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—		
	(—)	(△0.60842)	—	—		
計	262,600 (△ 36,512)	572 (△ 6)	94,000 (—)	265 (33)		

※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。

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建		
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	
外 国	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円	
		S P M I N I	53,232	55,014	—	—
		S P I 2 0 0	3,173	3,281	—	—
		F T S E	3,553	3,649	—	—
	D J E U R O	11,711	12,040	—	—	

※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

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	80,451,964千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	214,309,702千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.37

※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12月3日から2020年11月30日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

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

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2020年11月30日現在)

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC	378	354	1,603	166,578	保険
AES CORPORATION	336	336	708	73,566	公益事業
AT&T INC	3,819	3,819	11,087	1,151,833	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	919	948	10,207	1,060,416	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	768	947	9,941	1,032,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	22	22	622	64,630	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	410	412	3,221	334,663	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	18	—	—	—	資本財
ADOBE INC	253	258	12,315	1,279,406	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	40	34	513	53,364	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	552	632	5,517	573,191	半導体・半導体製造装置
AGILENT TECHNOLOGIES INC	160	171	1,954	203,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	114	119	3,331	346,076	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	83	83	868	90,181	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORPORATION	63	55	763	79,344	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	113	115	1,426	148,188	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	38	38	1,832	190,386	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORPORATION	8	6	406	42,223	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	22	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	132	121	638	66,328	公益事業
ALLSTATE CORP	168	166	1,734	180,181	保険
ALLY FINANCIAL INC	201	201	617	64,169	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	56	56	728	75,725	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	163	161	28,967	3,009,401	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	156	160	28,629	2,974,354	メディア・娯楽
ALTICE USA INC-A	63	180	620	64,454	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	975	977	3,945	409,862	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	219	226	72,224	7,503,379	小売
AMERCO	3	3	158	16,508	運輸
AMEREN CORPORATION	124	124	983	102,200	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	56	—	—	—	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER	263	257	2,184	226,972	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	370	370	4,467	464,140	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	35	35	329	34,240	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	464	447	1,776	184,594	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	91	91	1,407	146,198	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	79	79	824	85,696	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	67	64	1,223	127,066	各種金融
AMETEK INC	121	128	1,535	159,555	資本財
AMGEN INC	314	316	7,108	738,524	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORPORATION -CL A	151	156	2,071	215,192	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES INC	187	192	2,658	276,170	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	42	44	1,476	153,438	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	135	136	4,267	443,321	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORPORATION	190	—	—	—	エネルギー
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	77	339	35,299	各種金融
APPLE INC	2,354	9,240	107,729	11,191,982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	474	482	3,989	414,435	半導体・半導体製造装置
AQUA AMERICA INC	126	—	—	—	公益事業
ARAMARK	132	132	479	49,773	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	284	309	1,563	162,410	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	190	—	—	—	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	
ARISTA NETWORKS INC	27	32	898	93,358	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	41	41	384	39,907	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	31	31	416	43,282	保険
ATMOS ENERGY CORP	64	69	674	70,058	公益事業
AUTODESK INC	111	115	3,138	326,105	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	40	40	365	37,970	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	229	224	3,936	408,977	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	12	12	1,422	147,789	小売
AVALARA INC	—	43	730	75,843	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	—	256	674	70,096	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVERY DENNISON CORP	48	48	726	75,450	素材
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	228	—	—	—	各種金融
BB & T CORPORATION	388	—	—	—	銀行
BAKER HUGHES COMPANY	319	319	632	65,704	エネルギー
BALL CORPORATION	161	181	1,744	181,226	素材
BANK OF AMERICA CORP	4,621	4,184	12,129	1,260,128	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP (THE)	436	422	1,686	175,176	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	245	264	2,008	208,630	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	141	153	3,506	364,292	ヘルスケア機器・サービス
BEIGENE LTD-ADR	19	22	654	68,045	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
W. R. BERKLEY CORPORATION	74	74	478	49,704	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	688	741	17,177	1,784,598	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	130	121	1,366	141,958	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	13	12	652	67,817	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	90	90	730	75,843	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	98	85	2,076	215,678	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	76	690	71,695	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	61	82	5,881	611,058	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	356	346	2,099	218,109	各種金融
BOEING CO	279	289	6,262	650,608	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	22	22	4,546	472,352	小売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	81	80	707	73,512	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	120	120	476	49,551	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	718	745	2,505	260,252	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,221	1,216	7,666	796,518	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	58	58	868	90,180	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	205	214	8,486	881,640	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	140	140	640	66,523	保険
BROWN-FORMAN CORPORATION	156	161	1,308	135,902	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	37	33	751	78,060	小売
CBS CORP-CL B	182	—	—	—	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	56	56	519	53,936	各種金融
CBRE GROUP INC-A	161	182	1,115	115,863	不動産
CDK GLOBAL INC	74	58	271	28,202	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	74	74	979	101,711	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	120	120	465	48,341	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE, INC.	69	69	642	66,706	運輸
CIGNA CORPORATION	199	193	4,118	427,889	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC.	186	187	3,270	339,751	各種金融
CMS ENERGY CORPORATION	150	140	870	90,404	公益事業
CSX CORPORATION	389	415	3,792	393,951	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	677	706	4,792	497,921	ヘルスケア機器・サービス
CABLE ONE INC	—	2	482	50,144	メディア・娯楽
CABOT OIL & GAS CORPORATION	196	196	348	36,243	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC	142	142	1,661	172,588	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	78	106	521	54,131	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	251	236	2,075	215,662	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	
CARDINAL HEALTH INC	151	151	812	84,445	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	84	84	803	83,494	小売
CARLYLE GROUP INC/THE	—	93	267	27,783	各種金融
CARNIVAL CORP	213	222	480	49,970	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	—	456	1,727	179,450	資本財
CATALENT INC	—	89	870	90,412	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	295	292	5,118	531,739	資本財
CELANESE CORPORATION	64	64	858	89,161	素材
CENTENE CORP	209	305	1,928	200,347	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	254	254	612	63,676	公益事業
CENTURYLINK INC	497	497	520	54,071	電気通信サービス
CERNER CORP	165	155	1,151	119,607	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	79	78	5,019	521,488	メディア・娯楽
CHENIERE ENERGY INC	117	117	690	71,734	エネルギー
CHEVRON CORPORATION	984	1,033	9,434	980,161	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	14	13	1,792	186,193	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	124	124	1,077	111,897	家庭用品・パーソナル用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	78	78	611	63,521	保険
CISCO SYSTEMS INC	2,241	2,266	9,679	1,005,651	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	45	46	1,666	173,125	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	1,184	1,123	6,367	661,472	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	232	207	710	73,769	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	66	64	794	82,554	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	64	65	1,328	138,029	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO/THE	2,126	2,186	11,520	1,196,901	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	86	86	648	67,320	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATI	288	287	2,253	234,092	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	433	441	3,750	389,687	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CLASS A	2,374	2,440	12,629	1,312,125	メディア・娯楽
COMERICA INC	88	76	396	41,141	銀行
CONAGRA BRANDS INC	246	246	885	91,997	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	101	101	630	65,540	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	584	557	2,386	247,984	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	180	183	1,425	148,146	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	90	88	1,818	188,967	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	45	—	—	—	エネルギー
COOPER COMPANIES INC (THE)	25	27	944	98,083	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	104	109	1,264	131,385	商業・専門サービス
CORNING INC	397	397	1,472	153,009	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	381	417	1,605	166,791	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	228	237	9,207	956,573	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	18	20	1,816	188,717	商業・専門サービス
COTY INC-CL A	169	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
COUPA SOFTWARE INC	—	34	1,141	118,540	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	74	1,117	116,128	ソフトウェア・サービス
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	218	—	—	—	不動産
CROWN HOLDINGS INC	68	68	655	68,134	素材
CUMMINS INC	79	80	1,832	190,351	資本財
D. R. HORTON INC	190	193	1,472	153,016	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	92	104	1,349	140,152	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	158	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	335	342	7,429	771,804	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	67	74	816	84,813	消費者サービス
DATADOG INC - CLASS A	—	68	661	68,707	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	51	41	454	47,237	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	152	161	4,219	438,335	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-C	79	126	879	91,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
DELTA AIR LINES INC	82	82	340	35,401	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	118	118	612	63,673	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	210	—	—	—	エネルギー
DEXCOM INC	46	47	1,516	157,525	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	79	79	345	35,867	エネルギー
THE WALT DISNEY CO.	941	962	14,154	1,470,495	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	164	164	1,295	134,583	各種金融
DISCOVERY INC-A	70	70	194	20,198	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	182	182	448	46,630	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP.	122	129	464	48,263	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-RIGHTS	6	—	—	—	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	54	90	2,059	213,964	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	130	137	2,995	311,220	小売
DOLLAR TREE INC	120	120	1,323	137,546	小売
DOMINION ENERGY INC	435	455	3,597	373,769	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	22	21	828	86,040	消費者サービス
DOVER CORP	79	82	1,022	106,215	資本財
DOW INC	379	386	2,141	222,473	素材
DROPBOX INC-CLASS A	105	105	206	21,447	ソフトウェア・サービス
DUKE ENERGY CORP	375	398	3,770	391,763	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	381	389	2,514	261,202	素材
DYNATRACE INC	—	111	430	44,680	ソフトウェア・サービス
EOG RESOURCES INC	310	308	1,585	164,726	エネルギー
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	124	—	—	—	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	88	92	402	41,810	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	70	70	701	72,930	素材
EATON VANCE CORP	55	—	—	—	各種金融
EBAY INC	419	366	1,882	195,576	小売
ECOLAB INC	138	139	3,127	324,921	素材
EDISON INTERNATIONAL	179	212	1,334	138,619	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	105	323	2,756	286,421	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	179	208	651	67,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	150	153	1,906	198,041	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO	328	311	2,436	253,166	資本財
ENERGY CORP	107	108	1,211	125,880	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	30	31	1,019	105,923	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	61	61	1,009	104,862	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	—	228	593	61,640	各種金融
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12	12	291	30,318	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	138	635	66,033	公益事業
EVERGY INC	123	112	628	65,315	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	175	175	1,543	160,384	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	84	84	996	103,485	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	492	508	2,121	220,447	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	75	68	852	88,617	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	95	86	772	80,304	運輸
EXXON MOBIL CORPORATION	2,208	2,269	9,119	947,413	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	68	68	268	27,915	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FMC CORPORATION	66	66	772	80,225	素材
FACEBOOK INC-A	1,252	1,283	35,650	3,703,704	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	19	19	625	65,015	各種金融
FAIR ISAAC CORP	—	14	707	73,495	ソフトウェア・サービス
FASTENAL COMPANY	290	298	1,452	150,864	資本財
FEDEX CORP	129	134	3,874	402,529	運輸
F5 NETWORKS INC	35	29	478	49,729	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	320	333	4,951	514,412	ソフトウェア・サービス
FNF GROUP	139	139	509	52,935	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
FIFTH THIRD BANCORP	372	371	976	101,428	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	91	88	1,159	120,474	銀行
FISERV INC	306	301	3,482	361,800	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP	269	269	720	74,806	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	43	43	1,169	121,518	ソフトウェア・サービス
FLOWSERVE CORPORATION	66	—	—	—	資本財
FORD MOTOR COMPANY	1,987	2,080	1,891	196,486	自動車・自動車部品
FORTINET INC	73	73	911	94,653	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	161	157	1,125	116,878	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	64	71	609	63,287	資本財
FOX CORPORATION-CLASS A	197	169	494	51,385	メディア・娯楽
FOX CORPORATION-CLASS B	87	87	252	26,185	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	178	142	318	33,080	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	807	754	1,774	184,315	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	93	98	1,146	119,103	保険
GAP INC/THE	92	—	—	—	小売
GARTNER INC	45	45	696	72,395	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	131	126	1,922	199,712	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	4,551	4,736	4,926	511,810	資本財
GENERAL MILLS INC	325	314	1,893	196,708	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	662	677	3,054	317,334	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	74	74	728	75,679	小売
GILEAD SCIENCES INC	662	661	3,972	412,657	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	159	156	3,090	321,063	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	59	60	579	60,252	保険
GODADDY INC - CLASS A	89	89	707	73,548	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	169	177	4,171	433,428	各種金融
VW GRANGER INC	23	23	990	102,939	資本財
GRUBHUB INC	44	—	—	—	小売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	47	47	580	60,312	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	138	143	2,196	228,202	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	77	77	434	45,149	資本財
HP INC	763	731	1,629	169,267	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	443	443	778	80,847	エネルギー
HANESBRANDS INC	222	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	73	—	—	—	自動車・自動車部品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	183	183	840	87,278	保険
HASBRO INC	73	74	691	71,847	耐久消費財・アパレル
HEICO CORP	18	18	239	24,922	資本財
HEICO CORP-CLASS A	44	44	504	52,396	資本財
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	39	39	617	64,181	ソフトウェア・サービス
THE HERSHEY COMPANY	75	75	1,112	115,572	食品・飲料・タバコ
HESS CORPORATION	145	153	779	81,026	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	679	638	716	74,462	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	140	146	1,526	158,552	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	94	—	—	—	エネルギー
HOLOGIC INC	135	135	944	98,153	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	572	575	15,879	1,649,764	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	377	377	7,900	820,817	資本財
HORMEL FOODS CORPORATION	149	149	705	73,254	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	—	190	467	48,619	資本財
HUMANA INC.	72	68	2,804	291,346	ヘルスケア機器・サービス
J. B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	44	44	596	61,997	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	530	530	661	68,687	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	21	21	346	36,014	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	—	39	566	58,824	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	39	—	—	—	メディア・娯楽

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
IPG PHOTONICS CORP	17	17	361	37,551	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEX CORP	38	38	738	76,719	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	43	46	2,127	220,990	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	171	166	3,542	367,990	資本財
ILLUMINA INC	74	76	2,426	252,126	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	92	92	769	79,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	—	205	918	95,426	資本財
INGREDION INC	33	33	265	27,575	食品・飲料・タバコ
INSULET CORP	34	34	855	88,829	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	2,313	2,270	10,773	1,119,266	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	285	289	3,035	315,365	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	460	478	5,954	618,612	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	48	48	549	57,117	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	191	191	970	100,794	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	196	196	447	46,487	メディア・娯楽
INTUIT INC	137	140	4,992	518,687	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	61	63	4,601	478,051	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	67	67	345	35,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQVIA HOLDINGS INC	85	99	1,674	173,991	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	1,669	1,628	19,745	2,051,350	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	69	69	733	76,181	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	128	—	—	—	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	1,378	1,407	20,274	2,106,300	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	26	26	350	36,434	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	174	174	387	40,287	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KLA CORPORATION	81	81	2,072	215,357	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC	248	286	1,107	115,053	各種金融
KANSAS CITY SOUTHERN	51	51	966	100,404	運輸
KELLOGG CO	129	129	822	85,397	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	—	183	564	58,605	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	511	511	834	86,739	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	95	95	1,136	118,036	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	183	178	2,516	261,427	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	1,091	1,059	1,562	162,340	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	83	79	327	34,010	運輸
KOHL'S CORP	82	—	—	—	小売
KRAFT HEINZ COMPANY	340	380	1,251	129,973	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	409	408	1,324	137,606	食品・生活必需品小売り
LKQ CORPORATION	159	159	572	59,515	小売
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	118	112	2,180	226,582	資本財
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	49	49	999	103,786	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	76	75	3,461	359,566	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	74	74	542	56,396	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	176	176	997	103,672	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	118	122	3,013	313,123	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	35	27	403	41,868	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	66	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	69	69	710	73,817	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	156	144	1,126	117,014	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	20	20	596	61,934	資本財
LIBERTY BROADBAND-A	—	13	206	21,418	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	54	54	855	88,917	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	41	41	174	18,094	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	76	76	322	33,553	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	102	102	438	45,521	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	454	463	6,834	710,044	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	112	116	571	59,346	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	評価金額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	75	75	505	52,467	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	133	136	5,103	530,150	資本財
LOEWS CORPORATION	139	139	604	62,750	保険
LOWE'S COMPANIES INC	409	406	6,289	653,400	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	56	64	2,368	246,021	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	65	73	895	92,995	銀行
MGM MIRAGE	258	258	740	76,943	消費者サービス
MSCI INC-A	42	43	1,763	183,164	各種金融
MANPOWERGROUP	32	—	—	—	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	470	—	—	—	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	335	339	1,405	146,017	エネルギー
MARKEL CORP	7	7	705	73,243	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	19	19	1,020	106,050	各種金融
MARSH & MCLENNAN COS	259	266	3,044	316,327	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	143	147	1,888	196,213	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	33	30	837	87,055	素材
MASCO CORP	148	148	807	83,876	資本財
MASIMO CORPORATION	—	29	748	77,732	ヘルスケア機器・サービス
MASTERCARD INC-CL A	469	478	16,211	1,684,189	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	37	—	—	—	メディア・娯楽
MATCH GROUP INC	—	127	1,783	185,287	メディア・娯楽
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	138	138	1,138	118,269	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	62	65	1,219	126,740	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORPORATION	395	398	8,707	904,638	消費者サービス
MCKESSON CORP	96	84	1,513	157,287	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	115	133	247	25,732	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	22	23	3,577	371,692	小売
MERCK & CO. INC.	1,328	1,353	10,805	1,122,545	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	409	415	1,970	204,745	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	12	12	1,417	147,249	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	3,779	3,840	82,656	8,587,138	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	120	127	1,695	176,115	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	588	595	3,822	397,088	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	28	—	—	—	資本財
MODERNA INC	—	144	1,830	190,157	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC	28	28	373	38,830	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	—	34	722	75,060	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	96	96	450	46,816	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	751	772	4,439	461,193	食品・飲料・タバコ
MONGOOD INC	18	26	717	74,591	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	206	211	1,776	184,603	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	86	90	2,506	260,384	各種金融
MORGAN STANLEY	639	734	4,686	486,893	各種金融
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	135	135	55	5,736	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE	185	185	421	43,788	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	83	92	1,602	166,529	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	135	135	440	45,754	公益事業
NVR INC	1	1	712	74,052	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC	65	65	833	86,608	各種金融
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	221	258	340	35,372	エネルギー
NETAPP INC	125	109	581	60,416	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	226	235	11,581	1,203,238	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	50	41	400	41,557	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	220	22,929	不動産
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	115	115	608	63,201	資本財
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	131	106	253	26,319	資本財
NEWELL BRANDS INC	184	251	528	54,956	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	評価金額	評価金額	
NEWMONT CORPORATION	415	418	2,449	254,453	素材
NEWS CORP-CLASS A	166	166	295	30,656	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	249	1,051	7,903	821,097	公益事業
NIKE INC -CL B	652	665	8,940	928,802	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	189	189	463	48,174	公益事業
NOBLE ENERGY INC	267	—	—	—	エネルギー
NORDSON CORP	—	32	655	68,091	資本財
NORDSTROM INC	47	—	—	—	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	134	139	3,384	351,563	運輸
NORTHERN TRUST CORP	104	112	1,078	112,005	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	85	82	2,538	263,726	資本財
NORTONLIFELOCK INC	313	313	567	58,977	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	154	154	851	88,421	素材
NVIDIA CORP	300	328	17,448	1,812,682	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	116	118	399	41,496	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	39	38	1,698	176,466	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	453	442	732	76,054	エネルギー
OKTA INC	52	59	1,395	144,975	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	32	49	995	103,370	運輸
OMNICOM GROUP	118	104	656	68,179	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP	209	209	599	62,243	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	209	255	952	98,973	エネルギー
ORACLE CORPORATION	1,226	1,104	6,377	662,565	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	—	211	1,421	147,691	資本財
OWENS CORNING	65	52	386	40,177	資本財
P G & E CORPORATION	—	635	808	84,028	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	236	225	3,148	327,140	銀行
PPG INDUSTRIES INC	119	122	1,811	188,164	素材
PPL CORPORATION	365	427	1,243	129,216	公益事業
PVH CORP	33	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PTC INC	54	54	593	61,630	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	175	180	1,582	164,449	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	53	46	621	64,581	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	48	52	1,541	160,179	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORPORATION	65	66	1,825	189,665	資本財
PAYCHEX INC	164	177	1,655	172,023	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	25	25	1,051	109,198	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	579	597	12,639	1,313,132	ソフトウェア・サービス
PELOTON INTERACTIVE INC-A	—	102	1,113	115,664	耐久消費財・アパレル
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	202	202	259	26,987	銀行
PEPSICO INC	725	743	10,757	1,117,598	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	56	56	726	75,523	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	2,871	2,976	11,082	1,151,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	807	838	6,366	661,367	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	230	224	1,467	152,422	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	59	59	503	52,288	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	109	210	1,470	152,752	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	85	88	975	101,292	エネルギー
POLARIS INC	24	—	—	—	耐久消費財・アパレル
T ROWE PRICE GROUP INC	119	123	1,800	187,061	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	141	141	725	75,421	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,307	1,319	18,285	1,899,673	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	296	305	2,700	280,598	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	205	207	1,618	168,161	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	256	275	1,634	169,758	公益事業
PULTE GROUP INC	130	157	698	72,607	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	60	60	906	94,224	半導体・半導体製造装置

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
QUALCOMM INC	632	604	8,689	902,766	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	68	68	850	88,346	ヘルスケア機器・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	76	76	668	69,412	素材
RALPH LAUREN CORPORATION	33	19	173	18,015	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	64	64	595	61,892	各種金融
RAYTHEON COMPANY	147	—	—	—	資本財
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	816	6,033	626,827	資本財
REGENERON PHARMACEUTICALS	40	52	2,722	282,884	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	558	557	870	90,430	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	30	30	363	37,743	保険
REPUBLIC SERVICES INC	114	114	1,107	115,080	商業・専門サービス
RESMED INC	72	80	1,684	175,020	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	41	39	1,168	121,407	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC	70	55	363	37,806	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	60	62	1,591	165,354	資本財
ROKU INC	46	56	1,547	160,760	メディア・娯楽
ROLLINS INC	64	76	436	45,396	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	52	56	2,346	243,781	資本財
ROSS STORES INC	186	187	2,058	213,855	小売
S&P GLOBAL INC	128	130	4,454	462,733	各種金融
SBA COMMUNICATIONS CORP	57	59	1,690	175,613	不動産
SEI INVESTMENTS COMPANY	76	54	304	31,665	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	115	115	803	83,510	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	26	26	934	97,033	銀行
SABRE CORP	139	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM, INC.	431	481	11,932	1,239,672	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	44	38	532	55,338	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENRY SCHEIN INC	75	75	481	50,008	ヘルスケア機器・サービス
SCHLUMBERGER LTD	736	734	1,606	166,946	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	609	828	4,119	427,973	各種金融
SEAGEN INC	—	66	1,125	116,909	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEALED AIR CORP	78	78	351	36,524	素材
SEATTLE GENETICS INC	57	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY	139	153	1,996	207,422	公益事業
SERVICENOW INC	99	103	5,434	564,603	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	44	43	3,186	330,999	素材
SIGNATURE BANK	25	25	288	30,016	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	817	676	443	46,038	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	87	87	1,192	123,873	半導体・半導体製造装置
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	—	224	913	94,898	ソフトウェア・サービス
SMITH (A.O.) CORP	71	71	408	42,441	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	57	57	671	69,811	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	32	31	558	58,052	資本財
SNAP INC-A	351	455	2,096	217,837	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	15	494	51,407	ソフトウェア・サービス
SOUTHERN CO	544	573	3,477	361,270	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES	63	96	459	47,702	運輸
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	51	—	—	—	資本財
SPLUNK INC	76	82	1,683	174,914	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	367	—	—	—	電気通信サービス
SQUARE INC-A	170	197	4,195	435,855	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	76	80	1,502	156,146	資本財
STARBUCKS CORP	629	629	6,211	645,347	消費者サービス
STATE STREET CORP	189	186	1,338	139,036	各種金融
STEEL DYNAMICS, INC.	101	101	383	39,861	素材
STRYKER CORP	175	182	4,259	442,566	ヘルスケア機器・サービス
SUNRUN INC	—	61	407	42,384	資本財

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価金額	価額	
SUNTRUST BANKS INC	225	—	—	—	銀行
SYNOPLYS INC	76	78	1,773	184,283	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	314	278	865	89,873	各種金融
SYSCO CORP	261	251	1,792	186,249	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	140	—	—	—	各種金融
TJX COMPANIES INC	625	649	4,104	426,442	小売
T-MOBILE US INC	173	290	3,827	397,649	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	57	57	1,006	104,593	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	147	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	270	270	4,867	505,679	小売
TARGA RESOURCES CORP	117	—	—	—	エネルギー
TELADOC HEALTH INC	—	61	1,202	124,945	ヘルスケア機器・サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	20	20	795	82,660	資本財
TELEFLEX INC	23	23	868	90,203	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	98	85	934	97,084	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	71	395	23,145	2,404,608	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	569	599	588	61,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	486	493	7,845	815,054	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	118	118	553	57,472	資本財
TRADE DESK INC/THE- CLASS A	—	21	1,868	194,111	ソフトウェア・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	207	211	9,605	997,892	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M COMPANY	300	310	5,492	570,627	資本財
TIFFANY & CO	55	55	729	75,825	小売
TRACTOR SUPPLY COMPANY	61	61	852	88,568	小売
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	52	312	32,435	各種金融
TRANSDIGM GROUP INC	24	26	1,585	164,761	資本財
TRANSUNION	94	94	881	91,609	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC (THE)	132	131	1,764	183,330	保険
TRIMBLE INC	127	127	771	80,128	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC-W/I	40	—	—	—	メディア・娯楽
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	—	703	3,410	354,298	銀行
TWILIO INC-A	56	65	2,087	216,874	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	370	407	1,900	197,457	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	22	20	859	89,245	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	149	149	971	100,948	食品・飲料・タバコ
UGI CORPORATION	105	105	393	40,875	公益事業
US BANCORP	788	707	3,127	324,920	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	93	496	2,516	261,457	運輸
ULTA BEAUTY INC	30	27	777	80,802	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	86	—	—	—	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	82	—	—	—	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	367	364	7,503	779,570	運輸
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	28	—	—	—	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	363	379	6,405	665,484	運輸
UNITED RENTALS INC	42	35	837	87,012	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	425	—	—	—	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	491	505	17,069	1,773,369	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	42	42	555	57,685	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	97	—	—	—	保険
VF CORP	171	171	1,467	152,434	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	20	20	576	59,849	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	211	220	1,246	129,450	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	51	47	820	85,237	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	64	70	1,936	201,186	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	54	52	1,048	108,888	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,163	2,208	13,381	1,390,180	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	78	79	1,571	163,290	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	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	131	135	3,067	318,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC-CLASS B	202	—	—	—	メディア・娯楽
VIACOMCBS INC	—	323	1,133	117,767	メディア・娯楽
VIATRIS INC	—	630	1,075	111,720	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC	902	901	19,029	1,976,948	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	183	257	504	52,461	公益事業
VMWARE INC	41	41	595	61,906	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	73	73	433	45,045	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	66	66	953	99,041	素材
WABCO HOLDINGS INC	25	—	—	—	資本財
WEC ENERGY GROUP INC	159	164	1,573	163,499	公益事業
WABTEC CORP	92	92	681	70,794	資本財
WALMART INC	742	759	11,513	1,196,112	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	394	396	1,546	160,670	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	133	135	1,414	147,001	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	226	220	2,624	272,703	商業・専門サービス
WATERS CORP	35	35	805	83,642	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	32	851	88,449	小売
WELLCARE HEALTH PLANS INC	25	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & COMPANY	2,190	2,103	5,986	621,955	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	42	37	1,050	109,127	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	148	148	681	70,769	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION COMPANY	218	218	491	51,096	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	14	—	—	—	素材
WESTROCK CO	130	130	574	59,661	素材
WHIRLPOOL CORP	32	32	645	67,059	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	614	648	1,390	144,474	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	88	90	2,032	211,171	ソフトウェア・サービス
WYNN RESORTS LTD	49	49	497	51,663	消費者サービス
XPO LOGISTICS INC	47	47	499	51,846	運輸
XCEL ENERGY INC	260	269	1,822	189,388	公益事業
XILINX INC	128	128	1,770	183,918	半導体・半導体製造装置
XYLEM INC	91	91	886	92,078	資本財
XEROX HOLDINGS CORP	96	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUM! BRANDS INC	155	155	1,666	173,137	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	119	—	—	—	電気通信サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	27	27	1,031	107,198	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC-C	53	79	854	88,747	メディア・娯楽
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	103	108	1,628	169,197	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORPORATION	88	88	350	36,378	銀行
ZOETIS INC	253	257	4,154	431,590	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZSCALER INC	—	42	639	66,488	ソフトウェア・サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	83	3,917	407,006	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	47	47	544	56,560	資本財
ALLERGAN PLC	174	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC	823	823	944	98,158	素材
AON PLC	—	120	2,479	257,646	保険
AON PLC	121	—	—	—	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	204	204	676	70,263	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	81	81	376	39,114	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	125	125	363	37,813	素材
ACCENTURE PLC-CL A	331	342	8,559	889,283	ソフトウェア・サービス
BUNGE LIMITED	71	71	436	45,344	食品・飲料・タバコ
CAPRI HOLDINGS LTD	62	—	—	—	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	125	126	554	57,594	食品・飲料・タバコ
EATON CORP PLC	214	212	2,590	269,152	資本財
EVEREST RE GROUP LTD	20	20	482	50,082	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	
IHS MARKIT LTD	192	195	1,813	188,361	商業・専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC	122	—	—	—	資本財
INVESCO LIMITED	183	183	311	32,388	各種金融
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	26	26	373	38,761	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	403	386	1,776	184,556	資本財
LIBERTY GLOBAL PLC-A	84	84	191	19,867	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	210	210	459	47,783	電気通信サービス
LINDE PLC	279	282	7,268	755,101	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	317	349	1,577	163,914	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	703	720	8,254	857,606	ヘルスケア機器・サービス
APTIV PLC	130	141	1,723	179,101	自動車・自動車部品
NIELSEN HOLDINGS PLC	180	180	292	30,412	商業・専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	109	—	—	—	消費者サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	22	30	523	54,343	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	126	126	738	76,757	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PENTAIR PLC-REGISTERED	99	82	436	45,346	資本財
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	95	76	384	39,912	資本財
STERIS PLC	42	42	821	85,374	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC	215	—	—	—	エネルギー
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	127	1,830	190,213	資本財
WILLIS TOWERS WATSON PLC	65	68	1,429	148,537	保険
PERRIGO CO PLC	77	61	297	30,872	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHUBB LTD	239	245	3,710	385,457	保険
GARMIN LTD	67	81	950	98,790	耐久消費財・アパレル
TE CONNECTIVITY LTD	170	174	2,009	208,743	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	65	64	767	79,725	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	23	20	232	24,167	ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD	24	27	699	72,624	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	70	69	266	27,733	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	142	139	1,223	127,159	素材
MYLAN NV	261	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	149	144	2,297	238,717	半導体・半導体製造装置
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	90	90	736	76,489	消費者サービス
FLEX LTD	232	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数 156,142	株数 165,734	評価額 1,696,694	評価額 176,269,641	
	銘柄数 614	銘柄数 592		<69.4%>	
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	119	138	1,162	92,941	素材
AIR CANADA	57	57	142	11,402	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	302	313	640	51,246	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	462	459	1,974	157,879	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	173	173	330	26,448	公益事業
ATCO LTD-CLASS I	30	30	120	9,609	公益事業
AURORA CANNABIS INC	285	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	83	83	477	38,204	電気通信サービス
BANK OF MONTREAL	336	330	3,198	255,754	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	629	633	4,107	328,433	銀行
BARRICK GOLD CORP	932	930	2,741	219,201	素材
BAUSCH HEALTH COS INC	190	193	490	39,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKBERRY LIMITED	259	259	207	16,604	ソフトウェア・サービス
BOMBARDIER INC 'B'	758	—	—	—	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	464	730	3,894	311,376	各種金融
B2GOLD CORP	—	656	461	36,898	素材
CAE INC	128	128	431	34,495	資本財
CCL INDUSTRIES INC-CL B	91	65	393	31,477	素材
CGI INC-CL A	124	128	1,258	100,602	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	110	110	192	15,403	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	評価金額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
CAMECO CORP	163	266	353	28,237	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	225	235	2,613	208,928	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	372	378	5,362	428,719	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES	628	648	2,034	162,696	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	70	71	3,001	239,938	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	35	35	593	47,454	小売
CANADIAN UTILITIES LIMITED	73	73	240	19,264	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	112	112	421	33,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENOVUS ENERGY INC	540	540	375	30,058	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE	11	10	1,662	132,912	ソフトウェア・サービス
CRONOS GROUP INC	80	80	87	6,955	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	145	170	897	71,773	小売
EMERA INC	134	142	777	62,137	公益事業
EMPIRE CO LTD A	72	91	326	26,081	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	663	-	-	-	エネルギー
ENBRIDGE INC	1,042	1,101	4,592	367,206	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	13	13	620	49,582	保険
FIRST CAPITAL REALTY INC	65	-	-	-	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	316	316	571	45,680	素材
FORTIS INC	219	241	1,279	102,305	公益事業
FRANCO-NEVADA CORPORATION	94	101	1,722	137,710	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	90	90	316	25,318	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC	142	142	433	34,637	保険
HUSKY ENERGY INC	145	-	-	-	エネルギー
HYDRO ONE LTD	150	150	446	35,705	公益事業
IGM FINANCIAL INC	64	64	224	17,954	各種金融
IA FINANCIAL CORP INC	48	48	283	22,676	保険
IMPERIAL OIL LTD	129	129	314	25,181	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORPORATION	70	70	1,014	81,088	保険
INTER PIPELINE LTD	252	193	262	20,947	エネルギー
KEYERA CORP	113	113	266	21,333	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	635	635	592	47,367	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	113	156	812	64,955	素材
LOBLAW COMPANIES LTD	85	86	558	44,637	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	282	282	291	23,274	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	166	143	1,149	91,906	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	998	998	2,237	178,907	保険
METHANEX CORPORATION	24	-	-	-	素材
METRO INC	142	131	787	62,946	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	169	169	1,248	99,829	銀行
NUTRIEN LTD	300	298	1,922	153,699	素材
ONEX CORPORATION	42	42	300	24,038	各種金融
OPEN TEXT CORPORATION	136	136	795	63,573	ソフトウェア・サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	-	117	448	35,887	素材
PARKLAND FUEL CORP	76	-	-	-	エネルギー
PARKLAND CORP	-	76	303	24,264	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	274	274	933	74,664	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	145	332	988	78,992	保険
POWER FINANCIAL CORP	162	-	-	-	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	90	-	-	-	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	99	99	327	26,219	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	130	145	1,101	88,084	消費者サービス
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	-	56	502	40,183	商業・専門サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	183	201	1,226	98,041	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	753	767	8,299	663,523	銀行
SSR MINING INC	-	115	265	21,233	素材
SAPUTO INC	134	134	483	38,650	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	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	265	272	617	49,378	メディア・娯楽
SHOPIFY INC-CLASS A	51	58	7,796	623,299	ソフトウェア・サービス
STARS GROUP INC/THE	145	—	—	—	消費者サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	300	324	1,922	153,743	保険
SUNCOR ENERGY INC	814	786	1,762	140,901	エネルギー
TMX GROUP LTD	—	31	396	31,734	各種金融
TC ENERGY CORP	481	504	2,993	239,334	エネルギー
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	248	248	517	41,403	素材
TELUS CORPORATION	76	152	384	30,717	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	110	101	1,049	83,919	商業・専門サービス
TORONTO-DOMINION BANK	950	966	6,855	548,099	銀行
WSP GLOBAL INC	63	61	587	46,956	資本財
WEST FRASER TIMBER CO LTD	28	—	—	—	素材
WESTON (GEORGE) LTD	42	42	417	33,370	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	246	241	1,230	98,355	素材
YAMANA GOLD INC	—	535	356	28,533	素材
小計	20,806	20,792	105,791	8,458,059	
	株数	株数	金額	金額	
	銘柄	銘柄	<比率>	<比率>	
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	94	102	2,775	345,211	耐久消費財・アパレル
FRESENIUS SE & CO KGAA	211	221	844	104,997	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	68	52	176	21,967	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE-PREF	33	33	162	20,228	素材
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	30	30	425	52,907	保険
GEA GROUP AG	81	81	235	29,294	資本財
CONTINENTAL AG	55	55	652	81,138	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	519	513	2,083	259,155	運輸
MERCK KGAA	65	65	874	108,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	296	347	1,211	150,667	公益事業
SAP SE	509	560	5,613	698,250	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	1,158	1,166	1,066	132,646	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	57	59	478	59,555	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	38	59	492	61,223	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	480	532	2,637	327,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA	90	90	812	101,071	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	481	499	3,043	378,497	素材
BEIERSDORF AG	56	51	487	60,647	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	8	19	156	19,418	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	83	84	510	63,510	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	109	111	787	97,933	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	220	225	4,462	555,022	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	92	165	166	20,759	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	76	75	1,785	222,077	保険
VOLKSWAGEN AG	19	19	319	39,705	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	94	98	1,440	179,117	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	484	444	2,512	312,530	自動車・自動車部品
NEMETSCHKE SE	—	30	195	24,361	ソフトウェア・サービス
THYSSENKRUPP AG	193	193	107	13,402	素材
SIEMENS AG-REG	402	409	4,615	574,046	資本財
DEUTSCHE BANK AG -REG	995	1,024	971	120,862	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	167	178	1,306	162,482	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE (BMW) AG-PFD	25	25	139	17,312	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,734	1,815	2,751	342,204	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	18	18	656	81,674	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	655	650	1,926	239,653	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	22	22	252	31,467	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	96	100	1,374	170,991	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	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	77	77	427	53,119	自動車・自動車部品
FRAPORT AG	18	18	87	10,836	運輸
WIRECARD AG	59	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LANXESS	44	44	262	32,618	素材
MTU AERO ENGINES AG	28	29	604	75,176	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	181	181	743	92,526	不動産
SYMRISE AG	65	65	687	85,486	素材
BRENTAG AG	91	73	472	58,713	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	118	133	334	41,625	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	403	468	112	13,963	電気通信サービス
COMMERZBANK AG	466	466	251	31,282	銀行
LEG IMMOBILIEN AG	—	36	434	54,010	不動産
KION GROUP AG	31	31	222	27,717	資本財
VONOVIA SE	275	280	1,587	197,477	不動産
KNORR-BREMSE AG	21	38	417	51,979	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	87	141	543	67,630	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG	83	93	73	9,158	食品・生活必需品小売り
TEAMVIEWER AG	—	95	379	47,162	ソフトウェア・サービス
AXEL SPRINGER SE-TEND	23	—	—	—	メディア・娯楽
SIEMENS ENERGY AG	—	198	494	61,541	資本財
ZALANDO SE	82	79	636	79,170	小売
SCOUT24 AG	—	56	353	43,994	メディア・娯楽
COVESTRO AG	80	93	443	55,158	素材
UNIPER SE	123	104	295	36,752	公益事業
DELIVERY HERO SE	53	66	660	82,193	小売
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	12,251 58	13,116 61	61,038 —	7,592,020 <3.0%>	
(ユーロ・・・イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	586	573	829	103,132	保険
INTESA SANPAOLO	7,792	8,785	1,708	212,499	銀行
MEDIOBANCA SPA	267	352	272	33,902	銀行
ENEL SPA	4,202	4,327	3,679	457,640	公益事業
ENI SPA	1,304	1,331	1,143	142,177	エネルギー
SNAM SPA	896	1,067	501	62,392	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	4,919	4,919	197	24,550	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	2,513	2,513	107	13,403	電気通信サービス
ATLANTIA SPA	265	265	404	50,332	運輸
TERNA SPA	804	789	500	62,202	公益事業
RECORDATI SPA	45	45	207	25,800	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEONARDO SPA	183	291	174	21,679	資本財
PRYSMIAN SPA	119	119	320	39,902	資本財
DIASORIN SPA	—	13	226	28,220	ヘルスケア機器・サービス
MONCLER SPA	77	104	428	53,237	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA	—	206	327	40,737	ソフトウェア・サービス
FINECOBANK SPA	320	320	420	52,255	銀行
UNICREDIT SPA	1,068	1,205	1,095	136,301	銀行
POSTE ITALIANE SPA	265	265	233	29,073	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	—	158	169	21,111	電気通信サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	361	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PIRELLI & C SPA	174	174	75	9,448	自動車・自動車部品
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	26,169 19	27,830 21	13,024 —	1,620,002 <0.6%>	
(ユーロ・・・フランス)					
BOUYGUES SA	110	110	373	46,422	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	290	285	565	70,320	公益事業
L'OREAL	129	135	4,190	521,201	家庭用品・パーソナル用品
LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	146	149	7,399	920,390	耐久消費財・アパレル

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
DASSAULT AVIATION SA	1	1	153	19,147	資本財
THALES SA	54	54	431	53,667	資本財
CAPGEMINI SA	80	80	965	120,034	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	18	—	—	—	食品・生活必需品小売り
INGENICO S.A.	26	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PUBLICIS GROUPE	107	107	412	51,357	メディア・娯楽
FAURECIA	31	31	133	16,615	自動車・自動車部品
BOLLORE	394	394	128	15,969	メディア・娯楽
MICHELIN (CGDE) -B	87	87	946	117,757	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD SA	110	111	1,774	220,723	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	88	88	301	37,467	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	12	12	190	23,655	食品・飲料・タバコ
SEB SA	10	10	153	19,059	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE	285	294	3,458	430,174	資本財
VIVENDI SA	475	441	1,122	139,571	メディア・娯楽
ORANGE S.A.	1,048	1,061	1,134	141,115	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	16	16	1,380	171,646	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	66	70	1,090	135,657	ソフトウェア・サービス
KERING	39	41	2,505	311,624	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	89	89	121	15,052	保険
CARREFOUR SA	351	358	492	61,272	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	45	60	464	57,802	ソフトウェア・サービス
SANOFI	593	606	5,172	643,302	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA	106	104	316	39,308	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	410	410	710	88,419	銀行
TELEPERFORMANCE	29	29	816	101,587	商業・専門サービス
EURAZEO	17	17	93	11,590	各種金融
SODEXO	39	39	285	35,508	消費者サービス
AXA SA	1,028	1,063	2,097	260,898	保険
PSA PEUGEOT CITROEN	321	281	562	69,963	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA	28	28	50	6,292	メディア・娯楽
ESSILORLUXOTTICA	147	153	1,857	231,042	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA	581	581	573	71,331	銀行
BNP PARIBAS	577	604	2,648	329,433	銀行
ORPEA	—	26	282	35,146	ヘルスケア機器・サービス
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	255	255	1,030	128,235	資本財
WENDEL	10	10	101	12,623	各種金融
ILIAD SA	10	10	176	21,937	電気通信サービス
SAFRAN SA	171	173	2,139	266,167	資本財
ENGIE	962	948	1,187	147,760	公益事業
ALSTOM RGPT	96	96	436	54,341	資本財
EUTELSAT COMMUNICATIONS	87	—	—	—	メディア・娯楽
ELECTRICITE DE FRANCE (EDF)	286	296	385	47,895	公益事業
IPSEN	14	14	119	14,905	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARKEMA	32	32	316	39,404	素材
LEGRAND SA	143	149	1,071	133,221	資本財
EIFFAGE SA	46	49	419	52,236	資本財
TOTAL SE	1,260	1,334	5,030	625,754	エネルギー
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	13	13	146	18,164	運輸
NATIXIS	453	453	120	14,991	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	52	47	374	46,565	メディア・娯楽
SCOR SE	95	70	206	25,623	保険
VINCI S.A.	264	276	2,434	302,769	資本財
DANONE	319	320	1,693	210,604	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE SA	244	256	3,540	440,312	素材
BUREAU VERITAS SA	172	178	383	47,734	商業・専門サービス
GETLINK	223	223	317	39,488	運輸

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期		末		業種等	
		期首(前期末)	期	評価額	額		
		株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
SUEZ	145	189	307	38,196		公益事業	
EDENRED	121	121	590	73,484		ソフトウェア・サービス	
VALEO SA	140	140	470	58,569		自動車・自動車部品	
BIOMERIEUX	17	25	309	38,446		ヘルスケア機器・サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	57	203	25,298		消費者サービス	
WORLDLINE SA	62	127	999	124,341		ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	15	15	456	56,785		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	39	39	268	33,376		各種金融	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	13,762	13,975	70,596	8,780,771	
			67	66	—	<3.5%>	
(ユーロ・・・オランダ)							
AIRBUS SE	300	314	2,831	352,214		資本財	
RANDSTAD NV	46	72	374	46,553		商業・専門サービス	
WOLTERS KLUWER-CVA	149	145	1,016	126,489		商業・専門サービス	
VOPAK	31	31	143	17,807		エネルギー	
AEGON NV	916	916	280	34,843		保険	
KONINKLIJKE KPN NV	1,996	1,736	440	54,802		電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	376	332	1,104	137,389		半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	469	480	2,075	258,104		ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	131	131	1,172	145,882		食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	65	61	482	60,069		食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	92	89	1,232	153,258		素材	
UNILEVER NV	763	—	—	—		家庭用品・パーソナル用品	
ASML HOLDING NV	218	228	8,367	1,040,787		半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	600	594	1,415	176,066		食品・生活必需品小売り	
FERRARI NV	65	64	1,152	143,286		自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	570	547	503	62,637		資本財	
AKZO NOBEL	122	103	932	115,942		素材	
PROSUS NV	254	264	2,462	306,328		小売	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	—	280	267	33,298		食品・飲料・タバコ	
NN GROUP NV	159	159	548	68,164		保険	
ARGENX SE	—	23	547	68,104		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	594	642	850	105,743		自動車・自動車部品	
JUST EAT TAKEAWAY	—	63	560	69,700		小売	
ABN AMRO BANK NV-CVA	189	189	179	22,346		銀行	
EXOR NV	63	62	364	45,311		各種金融	
ALTICE NV -A W/I	376	376	169	21,059		電気通信サービス	
QIAGEN N.V.	138	125	510	63,449		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADYEN NV	6	9	1,522	189,340		ソフトウェア・サービス	
ING GROEP NV-CVA	2,031	2,052	1,727	214,838		銀行	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	10,729	10,099	33,235	4,133,821	
			26	28	—	<1.6%>	
(ユーロ・・・スペイン)							
ENDESA S. A.	183	141	342	42,610		公益事業	
BANKINTER, S. A.	364	364	151	18,900		銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,430	3,528	1,396	173,725		銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	154	154	307	38,233		公益事業	
REPSOL SA	736	791	671	83,515		エネルギー	
BANCO SANTANDER SA	8,522	8,933	2,202	273,895		銀行	
TELEFONICA S. A.	2,406	2,737	1,022	127,183		電気通信サービス	
ENAGAS	104	144	300	37,401		公益事業	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	114	114	331	41,215		資本財	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	145	157	421	52,426		資本財	
FERROVIAL SA	231	275	649	80,815		資本財	
MAPFRE SA	463	463	73	9,106		保険	
BANCO DE SABADELL SA	3,280	—	—	—		銀行	
CAIXABANK	1,819	1,819	400	49,864		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	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
IBERDROLA SA	3,198	3,189	3,658	454,986	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA	222	237	1,434	178,448	ソフトウェア・サービス
RED ELECTRICA CORPORATION SA	207	236	404	50,351	公益事業
FERROVIAL SA-RIGHTS	231	—	—	—	資本財
FERROVIAL SA RTS	—	275	6	817	資本財
INDITEX	556	580	1,643	204,357	小売
AENA SME SA	37	35	511	63,602	運輸
CELLNEX TELECOM SA	137	163	842	104,788	電気通信サービス
GRIFOLS S. A.	170	151	370	46,092	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANKIA SA	820	—	—	—	銀行
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	27,539 23	24,495 21	17,143 —	2,132,339 <0.8%>	
(ユーロ・・・ベルギー)					
KBC GROUPE SA	129	144	859	106,943	銀行
SOFINA	—	8	211	26,300	各種金融
SOLVAY SA	37	37	362	45,106	素材
UCB SA	72	66	599	74,584	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT NV	24	28	141	17,555	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	47	59	490	60,994	各種金融
PROXIMUS SA	63	96	174	21,704	電気通信サービス
GALAPAGOS NV	23	23	243	30,301	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELIA GROUP SA/NV	—	19	186	23,245	公益事業
TELENET GROUP HOLDINGS NV	21	21	76	9,510	メディア・娯楽
AGEAS	87	87	366	45,624	保険
UMICORE	113	105	404	50,318	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	392	398	2,284	284,103	食品・飲料・タバコ
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	1,012 11	1,097 13	6,402 —	796,293 <0.3%>	
(ユーロ・・・オーストリア)					
OMV AG	77	81	239	29,762	エネルギー
VERBUND AG	36	38	228	28,458	公益事業
VOESTALPINE AG	50	60	163	20,284	素材
ERSTE GROUP BANK AG	169	149	373	46,505	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	55	93	156	19,453	銀行
ANDRITZ AG	37	26	92	11,559	資本財
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	427 6	450 6	1,254 —	156,025 <0.1%>	
(ユーロ・・・ルクセンブルク)					
EUROFINS SCIENTIFIC	7	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS S. A.	259	259	174	21,649	エネルギー
SES	176	278	220	27,375	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA	458	521	312	38,891	不動産
EUROFINS SCIENTIFIC	—	70	473	58,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL	359	366	561	69,792	素材
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	1,262 5	1,496 5	1,741 —	216,570 <0.1%>	
(ユーロ・・・フィンランド)					
WARTSILA OYJ-B SHARES	189	267	215	26,793	資本財
UPM-KYMMENE OYJ	290	306	867	107,897	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	247	302	438	54,546	素材
SAMPO OYJ-A SHS	236	245	885	110,076	保険
FORTUM OYJ	244	243	468	58,316	公益事業
ELISA OYJ	83	69	317	39,477	電気通信サービス
METSO OYJ	58	—	—	—	資本財
NOKIA OYJ	2,857	2,968	1,014	126,195	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	227	221	1,273	158,434	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	55	—	—	—	自動車・自動車部品

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期		末		業種等
		期首(前期末)	期	評 価	額	
		株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
KONE OYJ-B	182	176	1,226	152,560	資本財	
ORION OYJ	42	63	255	31,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	4,715	4,864	6,962	866,027		
	株数 <比率>	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
	12	10	—	<0.3%>		
(ユーロ・・・アイルランド)						
CRH PLC	406	410	1,403	174,537	素材	
KERRY GROUP PLC-A	83	85	990	123,148	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC	76	80	577	71,830	資本財	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	114	129	459	57,181	素材	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	521	—	—	—	銀行	
AIB GROUP PLC	369	—	—	—	銀行	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	45	82	1,268	157,775	消費者サービス	
小計	1,617	787	4,699	584,473		
	株数 <比率>	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
	7	5	—	<0.2%>		
(ユーロ・・・ポルトガル)						
BANCO ESPIRITO SANTO, S.A (BES)	1,879	1,879	1	233	銀行	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,363	1,359	625	77,791	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS S.A	241	304	291	36,237	エネルギー	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	123	147	208	25,959	食品・生活必需品小売り	
小計	3,607	3,690	1,127	140,222		
	株数 <比率>	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
	4	4	—	<0.1%>		
ユーロ計	103,095	101,904	217,225	27,018,567		
	株数 <比率>	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
	238	240	—	<10.6%>		
(イギリス)						
ANTOFAGASTA PLC	194	194	240	33,315	素材	
ASHTAD GROUP PLC	236	236	746	103,373	資本財	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	587	466	293	40,692	耐久消費財・アパレル	
AVIVA PLC	1,986	1,986	643	89,179	保険	
DIAGEO PLC	1,219	1,222	3,585	496,718	食品・飲料・タバコ	
SCHRODERS PLC	62	62	200	27,838	各種金融	
DCC PLC	47	59	338	46,905	資本財	
BAE SYSTEMS PLC	1,706	1,781	897	124,415	資本財	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,178	1,238	3,316	459,439	食品・飲料・タバコ	
HALMA PLC	211	198	440	61,020	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STANDARD CHARTERED PLC	1,415	1,465	679	94,159	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	496	500	706	97,891	食品・飲料・タバコ	
HSBC HOLDINGS PLC	10,485	10,767	4,359	603,985	銀行	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,022	3,405	872	120,926	保険	
MEGGITT PLC	369	—	—	—	資本財	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	1,462	1,462	268	37,198	食品・生活必需品小売り	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	167	167	356	49,400	食品・飲料・タバコ	
PEARSON PLC	396	396	257	35,683	メディア・娯楽	
PERSIMMON PLC	169	169	456	63,186	耐久消費財・アパレル	
PRUDENTIAL PLC	1,330	1,401	1,698	235,390	保険	
RIO TINTO PLC	586	608	2,996	415,134	素材	
ST JAMES'S PLACE PLC	319	261	266	36,947	各種金融	
SSE PLC	548	558	771	106,840	公益事業	
BP PLC	10,558	10,572	2,779	385,101	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	36,841	37,565	1,400	194,108	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	1,476	2,304	362	50,202	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	5,160	5,065	1,153	159,884	食品・生活必需品小売り	
SMITH & NEPHEW PLC	443	443	644	89,261	ヘルスケア機器・サービス	
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,589	2,708	3,747	519,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEIR GROUP PLC/THE	167	—	—	—	資本財	
ASTRAZENECA PLC	681	703	5,465	757,233	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BT GROUP PLC	4,542	4,699	569	78,973	電気通信サービス	
CARNIVAL PLC	80	—	—	—	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	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,247	—	—	—	小売
BARCLAYS PLC	9,260	9,047	1,262	174,865	銀行
INTERTEK GROUP PLC	81	81	450	62,386	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	230	230	397	55,015	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	76	68	447	61,950	小売
KINGFISHER PLC	1,096	1,096	297	41,165	小売
ITV PLC	2,150	—	—	—	メディア・娯楽
SAINSBURY (J) PLC	1,128	1,128	244	33,839	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	742	—	—	—	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	121	115	328	45,500	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	53	71	336	46,651	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	2,549	—	—	—	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,237	2,204	2,952	409,019	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,944	2,020	2,635	365,101	エネルギー
BUNZL PLC	170	170	395	54,755	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	905	905	444	61,575	商業・専門サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	75	199	27,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	159	174	1,385	191,898	各種金融
UNILEVER PLC	588	1,399	6,416	889,057	家庭用品・パーソナル用品
TUI AG-DI	176	—	—	—	消費者サービス
EXPERIAN PLC	479	488	1,263	175,118	商業・専門サービス
MONDI PLC	251	251	424	58,819	素材
SEVERN TRENT PLC	144	124	296	41,085	公益事業
WHITBREAD PLC	68	112	356	49,425	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	144	195	280	38,872	各種金融
SMITHS GROUP PLC	235	241	354	49,138	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	559	669	1,515	210,014	素材
3I GROUP PLC	493	493	530	73,552	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	366	366	2,515	348,486	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,029	1,009	1,758	243,704	商業・専門サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	332	332	298	41,370	公益事業
OCADO GROUP PLC	221	221	491	68,150	小売
GLENCORE PLC	5,567	5,380	1,148	159,184	素材
GVC HOLDINGS PLC	238	288	300	41,692	消費者サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	869	4,951	533	73,856	資本財
EVRAZ PLC	282	282	110	15,364	素材
NMC HEALTH PLC	68	39	0.0394	5	ヘルスケア機器・サービス
EASYJET PLC	76	—	—	—	運輸
NATWEST GROUP PLC	2,452	2,452	393	54,586	銀行
SAGE GROUP PLC/THE	620	559	341	47,302	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	639	639	479	66,437	メディア・娯楽
COCA-COLA HBC AG-CDI	87	87	190	26,325	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	35	35	119	16,492	ソフトウェア・サービス
COMPASS GROUP PLC	826	930	1,318	182,746	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	1,783	1,925	1,682	233,107	公益事業
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,232	1,232	334	46,281	各種金融
BHP GROUP PLC	1,070	1,101	1,914	265,234	素材
VODAFONE GROUP PLC	13,673	14,408	1,799	249,336	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	97	103	493	68,338	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	151	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	74	66	394	54,622	素材
FERGUSON PLC	122	125	1,041	144,311	資本財
M&G PLC	1,330	1,330	257	35,664	各種金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	522	522	352	48,863	保険
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENTITLEMENT	39,981	—	—	—	資本財
INFORMA PLC	690	781	422	58,492	メディア・娯楽
AUTO TRADER GROUP PLC	420	439	240	33,384	メディア・娯楽

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等	
	株数	金額	株数	金額		
	株数	金額	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	36		36	399	55,395	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	632		632	188	26,051	保険
JD SPORTS FASHION PLC	288		288	211	29,317	小売
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,463		2,463	392	54,371	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	100		100	226	31,390	素材
小計	株数	金額	株数	84,084	11,649,901	
	銘柄数	<比率>	84	—	<4.6%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SGS SA	2		3	797	91,643	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1		1	283	32,647	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM AG-REG	14		13	673	77,381	電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG	0.49		0.59	455	52,400	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	0.05		0.05	410	47,137	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	4		4	1,763	202,716	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	77		82	3,053	351,072	保険
NOVARTIS AG-REG SHS	1,124		1,182	9,585	1,102,092	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	964		981	2,370	272,529	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	363		374	11,319	1,301,373	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		87	473	54,445	商業・専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD	257		272	1,309	150,539	素材
CLARIANT AG-REG	101		101	185	21,339	素材
NESTLE SA-REGISTERED	1,551		1,590	16,275	1,871,231	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG	24		24	393	45,215	保険
TEMENOS GROUP AG-REG	36		31	360	41,432	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG	26		26	595	68,411	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	5		6	623	71,668	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,296		1,267	1,484	170,666	各種金融
THE SWATCH GROUP AG-B	13		16	388	44,625	耐久消費財・アパレル
THE SWATCH GROUP AG-REG	25		25	111	12,849	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	37		39	2,198	252,746	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG	17		17	709	81,604	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5		5	420	48,398	素材
SWISS PRIME SITE-REG	39		39	319	36,734	不動産
PARGESA HOLDING SA-BR	18		—	—	—	各種金融
DUFREY AG-REG	22		—	—	—	小売
PARTNERS GROUP HOLDING AG	9		9	940	108,107	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	23		21	532	61,229	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	12		9	227	26,181	資本財
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	23		30	613	70,577	運輸
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	—		96	754	86,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEBERIT AG-REG	19		19	1,078	124,029	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD	126		124	650	74,759	各種金融
SWISS RE AG	154		151	1,270	146,031	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	272		278	2,138	245,887	耐久消費財・アパレル
SIKA AG	64		73	1,706	196,162	素材
ALCON INC	210		265	1,537	176,725	ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOISE REG	—		15	150	17,310	銀行
UBS GROUP AG	2,037		1,911	2,516	289,269	各種金融
VIFOR PHARMA AG	26		26	349	40,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数	金額	株数	71,027	8,166,020	
	銘柄数	<比率>	39	—	<3.2%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS	31		33	1,509	18,446	各種金融
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	887		883	8,248	100,800	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	459		459	7,178	87,719	銀行
SWEDISH MATCH AB	101		84	5,857	71,573	食品・飲料・タバコ
SECURITAS AB-B SHS	199		161	2,303	28,154	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	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
INVESTOR AB-B SHS	242	236	14,050	171,695	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	437	428	7,824	95,611	小売
ERICSSON LM-B SHS	1,594	1,615	17,145	209,512	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB	1,269	1,280	4,714	57,612	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	157	208	4,320	52,794	資本財
LUNDIN ENERGY AB	113	85	1,844	22,544	エネルギー
ALFA LAVAL AB	139	139	3,098	37,865	資本財
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	26	—	—	—	電気通信サービス
ICA GRUPPEN AB	35	56	2,310	28,237	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	185	185	1,698	20,753	耐久消費財・アパレル
ELECTROLUX AB-SER B	91	150	3,098	37,858	耐久消費財・アパレル
SKF AB-B SHARES	206	206	4,430	54,140	資本財
VOLVO AB-B SHS	795	800	15,997	195,495	資本財
SANDVIK AB	609	610	11,981	146,419	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	62	109	2,887	35,287	各種金融
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	—	343	4,779	58,401	素材
HEXAGON AB-B SHS	132	147	10,496	128,268	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS	291	255	2,829	34,576	電気通信サービス
ATLAS COPCO AB-A SHS	359	344	15,140	185,018	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	197	197	7,558	92,366	資本財
EPIROC AB-A	302	393	5,681	69,431	資本財
EPIROC AB-B	161	251	3,454	42,212	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	327	327	8,950	109,372	家庭用品・パーソナル用品
EQT AB	—	156	2,983	36,452	各種金融
BOLIDEN AB	162	130	3,912	47,813	素材
EVOLUTION GAMING GROUP	—	66	4,575	55,910	消費者サービス
KINNEVIK AB-B SHS	112	—	—	—	各種金融
KINNEVIK AB-REDEMPTION SHARE	112	—	—	—	各種金融
KINNEVIK AB-B SHS	—	136	5,603	68,479	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	776	776	6,851	83,729	銀行
ASSA ABLOY AB-B	534	521	10,778	131,709	資本財
NIBE INDUSTRIER-B	—	184	4,409	53,880	資本財
NORDEA BANK ABP	1,704	1,679	12,516	152,954	銀行
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	—	49	1,089	13,310	資本財
小計	株数	株数	232,112	2,836,412	
銘柄数	33	36	—	<1.1%>	
金額比率					
(ノルウェー)			ノルウェー		
DNB ASA	510	490	8,021	94,336	銀行
TELENOR ASA	396	374	5,752	67,645	電気通信サービス
EQUINOR ASA	507	518	7,617	89,578	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	90	90	3,277	38,547	素材
MOWI ASA	222	222	4,073	47,905	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA	790	643	2,347	27,603	素材
AKER BP ASA	53	—	—	—	エネルギー
ORKLA ASA	339	434	3,738	43,970	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	110	135	2,610	30,698	保険
ADEVINTA ASA-B	—	141	2,055	24,173	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS	39	54	1,874	22,040	メディア・娯楽
小計	株数	株数	41,369	486,500	
銘柄数	10	10	—	<0.2%>	
金額比率					
(デンマーク)			デンマーク		
CARLSBERG AS-B	58	55	5,248	87,707	食品・飲料・タバコ
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	3	3	4,332	72,401	運輸
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	1	1	1,935	32,339	運輸
GN STORE NORD A/S	—	72	3,659	61,153	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	327	401	4,179	69,842	銀行
GENMAB A/S	32	33	7,692	128,535	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等	
	株数	金額	株数	金額		
		株数	金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	95	104	12,942	216,264	資本財	
H LUNDBECK A/S	28	28	561	9,385	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DSV PANALPINA A S	116	108	11,095	185,412	運輸	
PANDORA A/S	47	47	3,092	51,669	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	60	55	3,359	56,135	素材	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	102	115	4,136	69,116	素材	
COLOPLAST-B	60	66	6,172	103,134	ヘルスケア機器・サービス	
AMBU A/S-B	—	83	1,683	28,135	ヘルスケア機器・サービス	
NOVO NORDISK A/S-B	928	922	38,655	645,936	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ISS A/S	85	—	—	—	商業・専門サービス	
TRYG A/S	82	57	1,041	17,406	保険	
ORSTED A/S	95	103	11,653	194,732	公益事業	
DEMANT A/S	44	44	974	16,280	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数	金額	株数	金額		
	17	2,172	18	2,306		
				122,417	2,045,589	
					<0.8%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	95	94	601	46,263	ヘルスケア機器・サービス	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,466	1,480	3,417	262,829	銀行	
WESTPAC BANKING CORPORATION	1,853	1,975	4,035	310,362	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	701	921	1,710	131,546	素材	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	2,169	2,169	674	51,890	電気通信サービス	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	198	—	—	—	銀行	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	234	343	434	33,408	食品・飲料・タバコ	
ASX LTD	92	111	863	66,415	各種金融	
BHP GROUP LTD	1,516	1,595	6,176	475,043	素材	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	133	—	—	—	エネルギー	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	205	—	—	—	小売	
COMPUTERSHARE LIMITED	300	279	397	30,564	ソフトウェア・サービス	
CSL LIMITED	234	241	7,327	563,554	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REA GROUP LTD	28	28	400	30,802	メディア・娯楽	
COCHLEAR LIMITED	29	37	843	64,908	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	893	1,094	568	43,687	エネルギー	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	920	949	7,663	589,368	銀行	
BORAL LIMITED	753	—	—	—	素材	
RIO TINTO LIMITED	197	193	1,972	151,687	素材	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	291	307	1,020	78,467	消費者サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,171	1,171	623	47,948	保険	
TPG CORP LTD	177	—	—	—	電気通信サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	26	—	—	—	消費者サービス	
ORICA LIMITED	179	179	303	23,343	素材	
BLUESCOPE STEEL LTD	230	230	399	30,720	素材	
WORLEY LIMITED	133	—	—	—	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	639	639	650	50,055	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,532	1,666	3,887	298,974	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	412	421	1,141	87,779	素材	
OIL SEARCH LTD	705	1,056	385	29,649	エネルギー	
INCITEC PIVOT LTD	613	—	—	—	素材	
AMP LIMITED	2,235	2,235	388	29,910	各種金融	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	458	458	252	19,457	運輸	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	670	855	878	67,551	保険	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	385	495	38,132	素材	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	230	—	—	—	各種金融	
SANTOS LTD	916	845	528	40,659	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	210	210	701	53,925	ヘルスケア機器・サービス	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	76	52	155	11,933	エネルギー	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	1,040	1,308	514	39,536	消費者サービス	
WESFARMERS LIMITED	585	596	2,977	228,971	小売	
ALUMINA LTD	1,069	—	—	—	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	501	503	1,144	88,027	エネルギー	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
WOOLWORTHS GROUP LTD	677	680	2,554	196,471	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	80	57	352	27,122	各種金融
SEEK LIMITED	181	181	473	36,449	メディア・娯楽
BRAMBLES LIMITED	883	837	929	71,476	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	169	173	2,383	183,317	各種金融
CROWN RESORTS LTD	218	218	217	16,730	消費者サービス
EVOLUTION MINING LTD	—	844	430	33,112	素材
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	258	247	964	74,164	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	364	364	336	25,885	食品・飲料・タバコ
AURIZON HOLDINGS LTD	868	944	406	31,232	運輸
AFTERPAY LTD	—	115	1,095	84,254	ソフトウェア・サービス
AMPOL LTD	—	133	410	31,534	エネルギー
TPG TELECOM LTD	—	177	137	10,612	電気通信サービス
AUSNET SERVICES	852	852	158	12,190	公益事業
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287	1,287	372	28,611	保険
AGL ENERGY LIMITED	341	324	445	34,285	公益事業
SOUTH32 LTD	2,946	3,006	739	56,886	素材
CIMIC GROUP LTD	40	40	103	7,985	資本財
COLES GROUP LIMITED	574	664	1,191	91,675	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	79	79	236	18,218	ソフトウェア・サービス
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	35,962 58	35,873 53	67,476 —	5,189,594 <2.0%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LIMITED	211	240	360	26,361	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	349	374	548	40,135	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	306	286	973	71,181	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	406	—	—	—	素材
SPARK NEW ZEALAND LIMITED	878	897	417	30,498	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	302	467	280	20,516	公益事業
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	552	707	541	39,573	運輸
MERIDIAN ENERGY LTD	818	677	418	30,588	公益事業
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	3,825 8	3,650 7	3,540 —	258,856 <0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	123	193	1,792	24,025	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	980	980	1,964	26,329	不動産
BANK OF EAST ASIA	872	872	1,433	19,214	銀行
CLP HOLDINGS LTD	851	851	6,212	83,244	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	606	629	24,291	325,512	各種金融
MTR CORPORATION	670	845	3,620	48,519	運輸
HANG SENG BANK LTD	388	388	5,338	71,540	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	633	833	2,693	36,090	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	715	715	2,945	39,473	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	5,450	5,775	6,987	93,638	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	1,180	1,180	7,286	97,639	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	275	275	550	7,370	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,875	1,875	4,725	63,315	銀行
NWS HOLDINGS LTD	695	—	—	—	資本財
PCCW LIMITED	2,690	2,560	1,195	16,019	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	270	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,563	—	—	—	不動産
SINO LAND CO	1,242	2,242	2,354	31,544	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	850	680	7,160	95,949	不動産
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	270	270	1,255	16,823	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	420	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WHEELLOCK&COMPANY LTD	520	—	—	—	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	780	705	7,134	95,603	資本財
SJM HOLDINGS LIMITED	800	800	728	9,765	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	708	708	971	13,016	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	
AIA GROUP LTD	6,326	6,482	57,365	768,700	保険
SANDS CHINA LTD	1,356	1,160	3,839	51,450	消費者サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	—	460	1,596	21,389	ヘルスケア機器・サービス
SWIRE PROPERTIES LIMITED	530	530	1,248	16,725	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	720	1,020	3,840	51,460	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	1,110	1,250	973	13,048	公益事業
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	650	896	2,486	33,317	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LIMITED	5,170	5,345	3,506	46,984	食品・飲料・タバコ
NEW WORLD DEVELOPMENT	—	848	3,512	47,061	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,434	1,509	8,678	116,286	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	300	300	1,201	16,100	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,394	1,399	6,121	82,030	不動産
小計	株数 銘柄数	46,417 35	185,014 —	2,479,192 —	<1.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	991	991	398	30,950	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD	942	950	2,439	189,532	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	258	258	203	15,774	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	47	51	107	8,320	小売
SATS LTD	268	—	—	—	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	356	428	394	30,657	各種金融
CAPITALAND LTD	1,366	1,366	428	33,323	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,167	—	—	—	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD	250	779	351	27,317	運輸
UNITED OVERSEAS BANK LTD	639	645	1,487	115,553	銀行
UOL GROUP LIMITED	217	217	163	12,728	不動産
VENTURE CORP LTD	119	115	220	17,127	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	690	—	—	—	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,391	4,655	1,126	87,521	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	437	—	—	—	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,762	1,834	1,861	144,620	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,170	1,032	442	34,395	食品・飲料・タバコ
KEPPEL CORP LTD	699	699	366	28,455	資本財
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	900	663	60	4,738	資本財
GENTING SINGAPORE LTD	3,702	3,275	276	21,499	消費者サービス
小計	株数 銘柄数	20,372 20	10,329 —	802,518 —	<0.3%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
BANK HAPUALIM BM	650	664	1,474	46,199	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	839	701	1,343	42,101	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	13	13	593	18,605	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	546	546	625	19,602	銀行
ICL GROUP LIMITED	287	287	446	13,991	素材
NICE LTD	27	32	2,588	81,121	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	54	92	673	21,102	銀行
AZRIELI GROUP	21	21	430	13,500	不動産
小計	株数 銘柄数	2,441 8	8,175 —	256,225 —	<0.1%>
合計	株数 銘柄数	612,636 1,260	—	245,917,079 —	<96.8%>

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

※〈〉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) 外国新株予約権証券

銘	柄	期首(前期末)	期 末	
		証 券 数	証 券 数	評 価 額
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(スイス)		証券	千スイスフラン	千円
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG WRT 231122		—	12	1,409
合 計	証 券 数 ・ 金 額	—	12	1,409
	銘 柄 数 <比 率>	—	—	<0.0%>
		—	1	—

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

※〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

※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。

(3) 外国投資信託証券

銘	柄	期首(前期末)	期 末		組 入 比 率
		口 数	口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		口	千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORPORATION		25,432	395	41,137	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.		5,727	1,053	109,423	0.0
AMERICAN TOWER CORP		23,336	5,527	574,283	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		80,296	697	72,411	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC		7,069	1,232	128,079	0.1
BOSTON PROPERTIES INC		7,835	802	83,375	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST		4,902	479	49,775	0.0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP		—	3,783	393,091	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC		10,561	1,914	198,896	0.1
DUKE REALTY CORP		20,240	806	83,763	0.0
EQUINIX INC		4,426	3,370	350,130	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC		8,664	508	52,845	0.0
EQUITY RESIDENTIAL		18,789	1,164	120,982	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		3,332	833	86,543	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC		6,463	823	85,514	0.0
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST		4,227	319	33,170	0.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		24,237	859	89,265	0.0
HOST HOTELS AND RESORTS INC		37,569	549	57,062	0.0
INVITATION HOMES INC		30,069	797	82,868	0.0
IRON MOUNTAIN INC		16,395	378	39,281	0.0
KIMCO REALTY CORPORATION		21,090	—	—	—
LIBERTY PROPERTY TRUST		9,193	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		29,675	621	64,551	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES		5,780	716	74,460	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		8,249	316	32,899	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC		12,872	514	53,490	0.0
PROLOGIS INC		33,100	4,028	418,471	0.2
PUBLIC STORAGE		7,965	1,815	188,563	0.1

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	口数	期首 (前期末)	期	評価額		組入比率
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	
REALTY INCOME CORPORATION	16,047	17,798	1,097	113,974	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	9,451	8,289	388	40,379	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	3,945	—	—	—	—	
SIMON PROPERTY GROUP INC	16,451	15,706	1,343	139,591	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	4,598	5,650	783	81,361	0.0	
UDR INC	14,289	16,633	652	67,772	0.0	
VENTAS INC	20,469	21,317	1,021	106,080	0.0	
VEREIT INC	54,273	54,273	398	41,386	0.0	
VICI PROPERTIES INC	26,533	23,498	603	62,690	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	8,706	8,706	351	36,477	0.0	
WP CAREY INC	8,640	8,640	603	62,733	0.0	
WELLTOWER INC	20,533	22,737	1,467	152,452	0.1	
WEYERHAEUSER CO	37,766	38,940	1,117	116,145	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	709,194 40	725,133 38	44,136 —	4,585,385 <1.8%>	
(カナダ)				千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP	4,697	3,971	203	16,299	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	6,546	102	8,164	0.0	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,391	—	—	—	—	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	7,441	135	10,809	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	3,585	86	6,950	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	26,114 4	21,543 4	528 —	42,223 <0.0%>	
(ユーロ・・・フランス)				千ユーロ		
ICADE	1,265	2,061	123	15,355	0.0	
KLEPIERRE	9,305	9,305	180	22,429	0.0	
GECINA SA	2,689	2,189	278	34,605	0.0	
COVIVIO	2,388	2,388	171	21,385	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,311	8,630	545	67,795	0.0	
ユーロ計	口数・金額 銘柄数 <比率>	22,958 5	24,573 5	1,299 —	161,571 <0.1%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC	44,962	44,962	211	29,284	0.0	
SEGRO PLC	61,311	59,874	539	74,776	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	39,861	265	36,731	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	138,976 3	144,697 3	1,016 —	140,792 <0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP	226,368	200,053	522	40,157	0.0	
TRANSURBAN GROUP	141,455	145,680	2,062	158,652	0.1	
APA GROUP	67,160	68,344	722	55,559	0.0	
GPT GROUP	97,296	97,296	461	35,469	0.0	
LENDLEASE GROUP	25,262	36,263	514	39,603	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	
STOCKLAND		103,417		127,393		588	45,265	0.0
DEXUS		62,385		54,256		532	40,977	0.0
GOODMAN GROUP		86,301		86,301		1,606	123,522	0.0
SYDNEY AIRPORT		49,760		73,899		496	38,193	0.0
SCENTRE GROUP		290,995		275,200		792	60,957	0.0
VICINITY CENTRES		146,656		250,037		417	32,114	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,297,055		1,414,722		8,717	670,473	
				11		11	—	<0.3%>
(香港)						千香港ドル		
LINK REIT		112,500		110,100		7,541	101,060	0.0
HKT TRUST AND HKT LTD		170,000		197,000		2,040	27,348	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	282,500		307,100		9,582	128,409	
				2		2	—	<0.1%>
(シンガポール)						千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		160,800		238,488		474	36,870	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		150,400		159,000		480	37,305	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		130,400		—		—	—	—
SUNTEC REIT		64,600		102,700		157	12,207	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		—		138,100		270	21,028	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		104,900		104,900		217	16,869	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	611,100		743,188		1,599	124,282	
				5		5	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,087,897		3,380,956		—	5,853,137	
				70		68	—	<2.3%>

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

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※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。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	期		末	
			買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
			百万円		百万円	
外	S P I 2 0 0		88		—	
	D J E U R 0		382		—	
国	F T S E		105		—	
	S P M I N I		1,718		—	

※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

(2020年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	245,917,080	96.5
新 株 予 約 権 証 券	1,409	0.0
投 資 証 券	5,853,137	2.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,165,609	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	254,937,235	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（253,578,568千円）の投資信託財産総額（254,937,235千円）に対する比率は99.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=103.89円、1カナダドル=79.95円、1ユーロ=124.38円、1英ポンド=138.55円、1スイスフラン=114.97円、1スウェーデンクローナ=12.22円、1ノルウェークローネ=11.76円、1デンマーククローネ=16.71円、1オーストラリアドル=76.91円、1ニュージーランドドル=73.11円、1香港ドル=13.40円、1シンガポールドル=77.69円、1イスラエルシェケル=31.34円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	255,224,931,819円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,192,443,838
株 式(評価額)	245,917,080,208
新株予約権証券(評価額)	1,409,095
投資証券(評価額)	5,853,137,269
未 収 入 金	381,543,821
未 収 配 当 金	294,778,194
差 入 委 託 証 拠 金	584,539,394
(B) 負 債	1,127,777,808
未 払 金	788,431,720
未 払 解 約 金	339,339,658
未 払 利 息	2,144
そ の 他 未 払 費 用	4,286
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	254,097,154,011
元 本	59,674,216,686
次 期 繰 越 損 益 金	194,422,937,325
(D) 受 益 権 総 口 数	59,674,216,686口
1万口当たり基準価額(C/D)	42,581円

※当期における期首元本額59,882,488,969円、期中追加設定元本額20,425,474,003円、期中一部解約元本額20,633,746,286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条の第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条の第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2019年12月3日 至2020年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,945,792,767円
受 取 配 当 金	3,940,134,235
受 取 利 息	951,812
そ の 他 収 益 金	4,980,533
支 払 利 息	△ 273,813
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	20,238,998,308
売 買 益	44,391,204,869
売 買 損	△ 24,152,206,561
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 79,843,737
取 引 益	2,378,100,774
取 引 損	△ 2,457,944,511
(D) 信 託 報 酬 等	△ 117,203,167
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)	23,987,744,171
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	172,536,430,782
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	54,373,403,543
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 56,474,641,171
(I) 計 (E + F + G + H)	194,422,937,325
次 期 繰 越 損 益 金(I)	194,422,937,325

※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	27,350,003,523円	バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	6,562,285円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	310,543,606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>	54,145,635円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,288,391,378円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,147,060,453円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	858,477,735円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,224,505,679円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	58,960,178円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,209,550,359円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2020(4資産タイプ)	1,706,572円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	16,031,634円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2025(4資産タイプ)	7,515,777円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	88,024,004円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2030(4資産タイプ)	21,641,411円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	274,725円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2035(4資産タイプ)	53,017,751円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	648,403,413円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2040(4資産タイプ)	46,975,874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>	54,665,475円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2045(4資産タイプ)	95,272,923円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	154,273,858円
外国株式指数ファンド	565,690,254円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	679,107,005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	7,816,684,732円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	523,402,551円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	275,982,943円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,244,537,154円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	280,503,009円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	516,296円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	177,883,661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)	261,805,221円
イオン・バランス戦略ファンド	16,925,077円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	108,092,846円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2050	11,438,962円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	13,733,300円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	88,460,460円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	11,124,088円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	72,449,250円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	5,922,681円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	232,812,161円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	33,604,511円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	112,882,937円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	89,623,024円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	122,445,007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>	302,499,958円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	29,486,288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>	101,952,579円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	119,850,668円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,548,116,430円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	2,018,507円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	200,729,573円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	9,294,678円	SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,582,545,591円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	7,425,834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>	11,572,621円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2060	1,858,286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>	34,675,816円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	4,845,211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>	47,860,932円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	978,623,890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>	249,228,446円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

第10期（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

信託期間	無期限（設定日：2011年4月18日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として新興国の株式（預託証券（DR）、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。）、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・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対円での為替ヘッジは原則として行いません。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		（ベンチマーク） MSCIエマージング・ マーケット・インデックス （配当込み、 円ベース）		株式組入 率	株式先物 率 （買建-売建）	債券組入 率	投資信託 証券組入 比率	純資産額
	期 騰 落 率	中 騰 落 率	期 騰 落 率	中 騰 落 率					
	円	%		%	%	%	%	%	百万円
6期（2016年11月30日）	10,817	△ 2.2	115.41	△ 2.3	—	100.6	69.2	—	6,806
7期（2017年11月30日）	14,363	32.8	156.96	36.0	—	100.2	79.8	—	4,291
8期（2018年11月30日）	13,023	△ 9.3	142.90	△ 9.0	43.2	53.6	—	3.1	4,401
9期（2019年12月2日）	13,315	2.2	148.27	3.8	48.2	45.1	—	6.8	8,381
10期（2020年11月30日）	15,253	14.6	170.44	15.0	61.5	30.4	—	8.3	11,054

※MSCIエマージング・マーケット・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2020年11月30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エマージング・マーケット・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

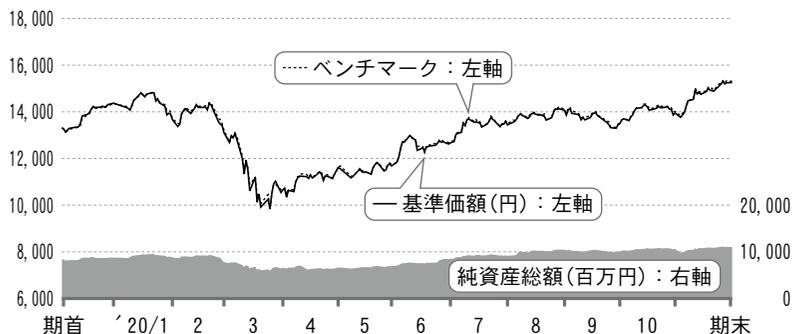
年 月 日	基準価額		（ベンチマーク） MSCIエマージング・ マーケット・インデックス （配当込み、 円ベース）		株式組入 率	株式先物 率 （買建-売建）	投資信託 証券組入 比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
（期首） 2019年12月2日	円	%		%	%	%	%
12月末	13,315	—	148.27	—	48.2	45.1	6.8
2020年1月末	14,370	7.9	159.83	7.8	49.5	43.7	7.0
2月末	13,660	2.6	152.63	2.9	46.8	46.6	6.7
3月末	13,107	△ 1.6	147.25	△ 0.7	55.8	36.5	8.0
4月末	10,663	△ 19.9	118.55	△ 20.0	53.4	38.8	7.7
5月末	11,616	△ 12.8	128.88	△ 13.1	57.4	34.7	8.3
6月末	11,680	△ 12.3	130.72	△ 11.8	55.4	36.9	8.0
7月末	12,667	△ 4.9	141.27	△ 4.7	54.8	37.9	7.6
8月末	13,440	0.9	150.17	1.3	54.2	38.7	7.3
9月末	14,067	5.6	157.01	5.9	59.7	32.0	8.5
10月末	13,489	1.3	150.53	1.5	59.1	32.8	8.5
（期末） 2020年11月30日	13,950	4.8	156.11	5.3	58.9	27.2	7.9
	15,253	14.6	170.44	15.0	61.5	30.4	8.3

※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12月3日から2020年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	13,315円
期末	15,253円
騰落率	+14.6%

※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エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）です。
 ※MSCIエマージング・マーケット・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（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

当ファンドはMSCIエマージング・マーケット・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を受け、期初から2020年1月前半にかけて、新興国株式市場が上昇したこと
- ・世界各国の政府・中央銀行が積極的な景気対策を講じたことから、新興国株式市場が3月下旬から期末にかけて上昇したこと

下落要因

- ・世界的な新型コロナウイルスの感染拡大を背景に世界景気の後退懸念が強まり、2月下旬から3月中旬にかけて新興国株式市場が大きく下落したこと
- ・米ドル、香港ドルや新興国通貨が円に対して下落したこと

▶ 投資環境について（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

当期の新興国株式市場は上昇しました。米ドル、香港ドルや新興国通貨は対円で下落しました。

株式市場

新興国株式市場は、期初から2020年1月中旬にかけては、米中貿易交渉が進展し、12月には第一段階の合意に達したことや中国景気の先行き不透明感が後退したこともあって、新興国株式市場は堅調に推移しました。

1月後半からは、中国の武漢が発生源とされる新型コロナウイルスの感染が拡大すると、中国株を中心に新興国株式市場は軟調に推移しました。2月後半からはイタリアなど欧州での感染拡大が明らかとなり、3月以降は米国内での感染拡大の懸念も強まり、3月中旬まで新興国株式市場は下落を続けました。加えて、サウジアラビアの増産発表を受けて、原油価格が急落したことも、世界的に金融市場の不安定な動きを増幅させました。

3月下旬以降、株価は反発・上昇に転じました。中国では新規感染者数の減少基調に加えて、3月の企業部門の活動回復や、政府の景気対策が打ち出されたことから、株価が比較的到底堅く推移しました。4月からは、欧米の感染者数・死者数の増加ペースが鈍化し始め、欧米での経済活動再開の期待が高まり、世界的に株式に対する買い安心感が広がりました。また、情報技術セクターを中心にアジア主要企業の業績が良好な内容だったことや、世界各国の政府・中央銀行から景気刺激策の発表が相次いだことから新興国株式市場は堅調に推移しました。

9月に入ると一旦調整する場面もありました。しかし、10月から期末にかけては、新型コロナウイルスに対するワクチンの開発進展期待や、米国大統領選においてバイデン候補の勝利が確実視されたことなどもあって、世界的に株式市場は堅調に推移し、新興国株式市場も一段高となりました。

当期の市場の動きをMSCIエマージング・マーケット・インデックス（米ドルベース）で見ると、期首に比べて18.3%上昇しました。

為替市場

為替相場は、総じて円に対して下落しました。米ドル・円相場は、期初からもみあい推移した後、3月下旬以降、米ドル安の展開となりました。世界景気が急速な落ち込みをみせたことを

受け、3月にFRB（米連邦準備制度理事会）はゼロ金利政策を選択したことで、米ドル・円レートは3月間で102円台～111円台と大きく変動しました。その後は未曾有の世界景気の落ち込みに対して、金融緩和策は長期化するとの観測から、米ドルは期末まで軟調に推移しました。

米ドル安・円高を受けて、米ドルと連動する香港ドルも円に対して下落しました。また、新型コロナウイルスの感染拡大による経済活動の停滞懸念もあって、総じて新興国通貨が円に対して軟調でしたが、韓国ウォンと台湾ドルは円に対して底堅く推移しました。

当期の米ドル・円は期首109円68銭から期末103円89銭へと5円79銭の米ドル安・円高、香港ドル・円は期首14円01銭から期末13円40銭へと0円61銭の香港ドル安・円高となりました。

▶ ポートフォリオについて（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

株式組入比率

期を通じて、株式、投資信託証券および先物の組入れにより、実質株式組入比率は100%に近い高位を保ちました。

運用経過

日々の追加設定・解約による資金変動には株式指数先物取引を利用し、実質株式組入比率の調整を行い、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。

長期売買停止銘柄について

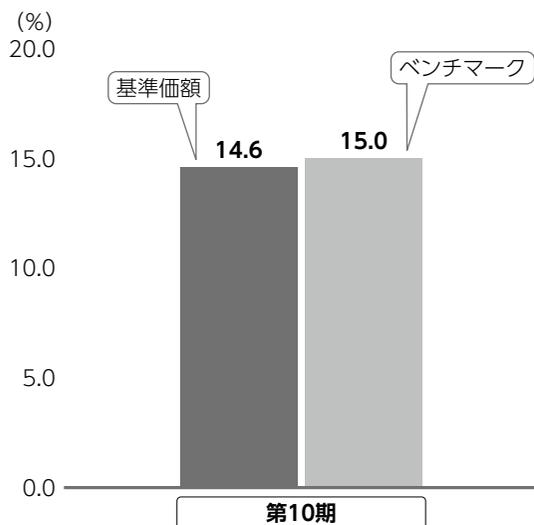
当ファンドで保有している長期売買停止銘柄（評価基準を変更した銘柄および売買停止期間が1年以上の銘柄）については以下の通りです。

銘柄名	売買停止日	評価基準	組入比率
FF GROUP	2018/9/25	売買最終相場の価格	0.0%

（2020年11月19日時点）

▶ ベンチマークとの差異について（2019年12月3日から2020年11月30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エマージング・マーケット・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+14.6%となり、ベンチマークの騰落率+15.0%から0.4%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・ 売買コスト、保管費用等の支払いが生じたこと
- ・ ベンチマークと先物にリターンの差異が生じたこと
- ・ 配当に対する現地源泉税が生じたこと

2 今後の運用方針

引き続き、MSCIエマージング・マーケット・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。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 (2019年12月3日から2020年11月30日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	14円 (7) (0) (1) (6)	0.107% (0.051) (0.000) (0.008) (0.048)	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) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0) (0)	0.015 (0.015) (0.000) (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)	32 (30) (2)	0.247 (0.229) (0.018)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	48	0.369	

期中の平均基準価額は12,973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12月3日から2020年11月30日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 433 (33)	千米ドル 3,223 (-)	百株 32	千米ドル 68
	メ キ シ コ	2,428 (-)	千メキシコペソ 6,844 (△ 3)	63	千メキシコペソ 202
	ブ ラ ジ ル	2,137 (479)	千ブラジルリアル 6,225 (△ 6)	141	千ブラジルリアル 98
	チ リ	4,273 (0.35)	千チリペソ 84,705 (583)	12,333 (0.17)	千チリペソ 11,286 (583)
	コ ロ ン ビ ア	222	千コロンビアペソ 149,737	306	千コロンビアペソ 43,222
	ユ ー ロ	-	千ユーロ	-	千ユーロ
国	ベ ル ギ ー	(-)	(△ 0.0668)	3	3
	ギ リ シ ャ	42	26	353	19

エマージング株式インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	トルコ	789 (21)	千トルコリラ 619 (-)	26	千トルコリラ 41
	チェコ	32	千チェココルナ 464	-	千チェココルナ -
	ハンガリー	13	千ハンガリーフォリント 9,414	-	千ハンガリーフォリント -
	ポーランド	175	千ポーランドズロチ 774	59	千ポーランドズロチ 45
	香港	27,271 (1,024)	千香港ドル 39,037 (△ 4)	1,803 (-)	千香港ドル 392 (21)
	マレーシア	2,182 (536)	千マレーシアリングギット 1,685 (-)	296	千マレーシアリングギット 90
	タイ	5,519 (227)	千タイバーツ 13,227 (-)	424 (-)	千タイバーツ 358 (23)
	フィリピン	1,040 (15)	千フィリピンペソ 7,737 (-)	193 (0.43)	千フィリピンペソ 448 (0.22317)
	インドネシア	7,194 (420)	千インドネシアルピア 3,925,318 (-)	1,700	千インドネシアルピア 212,473
	韓国	429 (7)	千韓国ウォン 2,686,757 (6,351)	38 (0.7)	千韓国ウォン 56,081 (3,582)
	台湾	8,970 (327)	千新台幣ドル 67,986 (△ 122)	352	千新台幣ドル 1,278
	インド	2,051 (99)	千インドルピー 126,685 (2,066)	301 (36)	千インドルピー 7,847 (2,066)
	エジプト	73	千エジプトポンド 365	-	千エジプトポンド -
南アフリカ	1,110 (181)	千南アフリカランド 12,437 (-)	405	千南アフリカランド 1,241	

※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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外国	イ	証券 4,680 (2,015)	千タイバーツ 4 (34)	証券 5,814 (881)	千タイバーツ 14 (14)

※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。

※（ ）内は権利付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 投資信託証券

		買 付		売 付		
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外	アメリカ	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	口 285 (△ 1,853)	千米ドル 1 (△ 13)	口 -	千米ドル -
		GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	口 177 (463)	千米ドル 4 (13)	口 35	千米ドル 0.81891
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	23,691	855	2,775	87
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	28,196	792	1,596	45
		ISHARES MSCI UAE ETF	16,173	178	812	7
		ISHARES MSCI QATAR ETF	8,641	148	1,007	15
	小	計	77,163 (△ 1,390)	1,980 (-)	6,225	158
	メキシコ	DEUTSCHE BANK MEX (FIBRA UNO ADMINISTR)	口 13,100 (-)	千メキシコペソ 228 (△ 26)	口 -	千メキシコペソ -
		小	計	13,100 (-)	228 (△ 26)	-
	ブラジル	SUL AMERICA SA-UNITS	口 700	千ブラジルレアル 31	口 -	千ブラジルレアル -
		SUL AMERICA SA-UNITS-NEW	-	-	-	-
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	1,500	48	-	-
		KLABIN SA-UNIT	2,500	56	-	-
	小	計	4,700 (56)	136 (-)	-	-
	南アフリカ	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	口 4,953	千南アフリカランド 90	口 -	千南アフリカランド -
FORTRESS REIT LTD-A		-	-	9,022	99	
REDEFINE PROPERTIES LTD		-	-	43,761	83	
RESILIENT REIT LTD		-	-	115	4	
RESILIENT REIT LTD-NEW		-	-	(17)	(0.58106)	
小	計	4,953 (132)	90 (-)	52,898 (17)	187 (0.58106)	
国	中国 (オフショア)	口 168,000	千中国元 (オフショア) 7,531	口 6,600	千中国元 (オフショア) 331	
	小	計	168,000	7,531	6,600	331

※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。

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引 M S C I E	百万円 17,171	百万円 17,989	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。

※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

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	2,045,167千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	4,900,589千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.41

※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12月3日から2020年11月30日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

(2019年12月3日から2020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 (2020年11月30日現在)

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			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	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	122	192	5,314	552,094	小売
AUTOHOME INC-ADR	4	6	64	6,699	メディア・娯楽
BAIDU INC - SPON ADR	20	27	388	40,382	メディア・娯楽
BANCO MACRO SA-ADR	3	—	—	—	銀行
BAOZUN INC-SPN-ADR	2	4	17	1,838	小売
BEST INC-ADR	18	18	5	558	運輸
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	—	12	78	8,126	メディア・娯楽
CIA DE MINAS BUENAVENTURA S. A-ADR	15	22	24	2,503	素材
58.COM INC-ADR	6	—	—	—	メディア・娯楽
51JOB INC-ADR	1	2	16	1,707	商業・専門サービス
GDS HOLDINGS LTD-ADR	4	8	73	7,615	ソフトウェア・サービス
GSX TECHEDU INC- ADR	—	7	50	5,220	消費者サービス
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	7	—	—	—	銀行
HUAZHU GROUP LTD-ADR	9	16	83	8,651	消費者サービス
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	4	7	22	2,324	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUYA INC-ADR	4	6	14	1,475	メディア・娯楽
IQIYI INC-ADR	7	23	50	5,282	メディア・娯楽
JOYY INC	—	5	53	5,609	メディア・娯楽
JD.COM INC-ADR	53	87	782	81,249	小売
KE HOLDINGS INC-ADR	—	9	60	6,268	不動産
LUFAX HOLDING LTD	—	17	26	2,749	各種金融
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	68	68	3	398	エネルギー
MOMO INC-SPON ADR	10	15	23	2,436	メディア・娯楽
NIO INC-ADR	43	109	589	61,194	自動車・自動車部品
NETEASE.COM INC -ADR	5	42	392	40,824	メディア・娯楽
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	10	15	262	27,297	消費者サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2	2	7	807	各種金融
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	70	70	5	595	不動産
PINDUODUO INC-ADR	14	27	401	41,723	小売
QUDIAN INC-SPON ADR	6	—	—	—	各種金融
SOUTHERN COPPER CORPORATION	6	8	53	5,537	素材
TAL EDUCATION GROUP-ADR	27	38	283	29,439	消費者サービス
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	5	8	7	762	電気通信サービス
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	8	37	64	6,661	メディア・娯楽
TRIP.COM GROUP-ADR	34	48	165	17,244	小売
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	31	45	117	12,219	小売
WEIBO CORP-SPON ADR	3	4	21	2,185	メディア・娯楽
XPENG INC - ADR	—	10	68	7,085	自動車・自動車部品

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
YPF S. A. -SPONSORED ADR	11	13	7	778	エネルギー	
YY INC-ADR	4	—	—	—	メディア・娯楽	
YUM CHINA HOLDINGS INC	25	40	236	24,620	消費者サービス	
ZAI LAB LTD-ADR	—	6	75	7,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	23	41	122	12,704	運輸	
CREDICORP LTD	4	7	108	11,307	銀行	
SINA CORP	4	5	24	2,504	メディア・娯楽	
GLOBANT SA	2	3	71	7,381	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数〈比率〉	713	1,148	10,240	1,063,911	
		39	41	—	< 9.6% >	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A	220	353	537	2,790	資本財	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	143	199	2,892	15,011	食品・飲料・タバコ	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	16	—	—	—	小売	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	174	273	877	4,552	メディア・娯楽	
GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	107	151	651	3,380	食品・飲料・タバコ	
GRUMA S. A. B. -B	15	19	439	2,282	食品・飲料・タバコ	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	17	17	282	1,468	運輸	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	36	36	168	873	資本財	
CEMEX SAB-CPO	1,156	1,644	1,530	7,943	素材	
GRUPO FINANCIERO BANORTE S. A. B. DE C. V.	184	265	2,783	14,448	銀行	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	11	11	355	1,845	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	100	176	585	3,037	家庭用品・パーソナル用品	
ALSEA SAB DE CV	38	—	—	—	消費者サービス	
GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	14	19	601	3,124	運輸	
GRUPO MEXICO SAB DE CV	262	331	2,360	12,251	素材	
AMERICA MOVIL SAB DE C. V.	2,447	3,468	5,111	26,530	電気通信サービス	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	150	202	408	2,118	銀行	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	29	43	426	2,215	食品・飲料・タバコ	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	25	43	873	4,533	運輸	
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	15	41	307	1,594	メディア・娯楽	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	43	43	309	1,606	公益事業	
ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV	86	86	352	1,829	素材	
COCA-COLA FEMSA S. A. DE C. V	34	45	397	2,060	食品・飲料・タバコ	
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	387	549	2,903	15,067	食品・生活必需品小売り	
BECLE SAB DE CV	—	60	287	1,490	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額 銘柄数〈比率〉	5,712	8,077	25,444	132,056	
		24	23	—	< 1.2% >	
(ブラジル)				千ブラジルリアル		
BRF-BRASIL FOODS SA	37	59	129	2,513	食品・飲料・タバコ	
VALE SA	232	378	2,965	57,699	素材	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	—	11	74	1,453	公益事業	

エマージング株式インデックス・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	
TIM PARTICIPACOES SA	56	—	—	—	電気通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	16	31	102	2,001	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	22	38	122	2,378	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	64	88	304	5,926	銀行
ITAUSA SA	326	451	491	9,556	銀行
LOJAS AMERICANAS SA	53	99	234	4,554	小売
GERDAU S. A. -PREF	71	111	252	4,916	素材
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	—	13	90	1,756	食品・生活必需品小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	219	381	986	19,202	エネルギー
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	48	86	181	3,537	小売
PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	308	487	1,241	24,166	エネルギー
COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	84	138	178	3,469	運輸
WEG SA	58	88	679	13,231	資本財
BANCO BRADESCO S. A. -PREF	294	453	1,117	21,741	銀行
BANCO BRADESCO SA	90	136	299	5,831	銀行
NATURA COSMETICOS SA	26	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S. A. -CSN	53	71	170	3,317	素材
SUZANO SA	36	77	428	8,336	素材
CPFL ENERGIA SA	—	24	73	1,429	公益事業
ITAU UNIVANCO HOLDING SA	354	496	1,436	27,952	銀行
PORTO SEGURO SA	6	6	28	559	保険
BRASKEM SA-PREF A	9	18	42	821	素材
LOCALIZA RENT A CAR SA	40	66	438	8,533	運輸
LOJAS RENNEN S. A.	59	81	379	7,378	小売
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	47	75	153	2,977	エネルギー
COSAN SA	13	16	131	2,559	エネルギー
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	13	84	185	3,619	公益事業
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD(NEW)	52	—	—	—	公益事業
EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S. A.	50	—	—	—	資本財
B2W CIA DIGITAL	15	22	173	3,370	小売
BR MALLS PARTICIPACOES SA	63	—	—	—	不動産
JBS SA	83	112	258	5,028	食品・飲料・タバコ
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	60	78	97	1,891	公益事業
COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	26	39	177	3,445	公益事業
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	24	24	56	1,097	不動産
HYPERMARCAS SA	27	39	123	2,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEFONICA BRASIL SA	34	—	—	—	電気通信サービス
MAGAZINE LUIZA SA	54	308	745	14,498	小売
ENERGISA SA-UNITS	11	18	82	1,605	公益事業
COMPANHIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRU	10	—	—	—	食品・生活必需品小売り
CIELO SA	93	93	34	680	ソフトウェア・サービス
TELEFONICA BRASIL SA	—	41	180	3,517	電気通信サービス

エマージング株式インデックス・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			
RAIA DROGASIL SA	18	110	282	5,497	食品・生活必需品小売り		
VIA VAREJO SA	—	140	258	5,037	小売		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	51	64	189	3,688	保険		
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	13	25	109	2,135	公益事業		
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	24	49	340	6,627	ヘルスケア機器・サービス		
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	18	115	165	3,211	ヘルスケア機器・サービス		
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	21	31	60	1,170	食品・生活必需品小売り		
BM&F BOVESPA SA	151	211	1,200	23,363	各種金融		
AMBEV SA	347	483	691	13,459	食品・飲料・タバコ		
COGNA EDUCACAO	104	141	68	1,341	消費者サービス		
NATURA &CO HOLDING SA	—	91	467	9,102	家庭用品・パーソナル用品		
CENTRAIS ELETRICAS BRASLIER-RTS	2	—	—	—	公益事業		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-RTS	3	—	—	—	公益事業		
TIM SA	—	72	101	1,975	電気通信サービス		
RUMO SA	75	118	228	4,447	運輸		
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	51	98	66	1,300	保険		
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	17	23	186	3,625	各種金融		
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	4,135	6,610	19,267	374,950	< 3.4% >
(チリ)			55	53	—	—	< 3.4% >
BANCO SANTANDER CHILE	4,322	5,677	19,013	2,574	銀行		
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3	6	17,280	2,339	銀行		
BANCO DE CHILE	3,191	5,043	34,232	4,635	銀行		
EMPRESAS CMPC SA	89	130	22,702	3,073	素材		
EMPRESAS COPEC SA	26	44	28,038	3,796	エネルギー		
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	8	15	8,500	1,151	食品・飲料・タバコ		
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	12	12	5,538	749	電気通信サービス		
ENEL AMERICAS SA	2,866	3,728	42,984	5,820	公益事業		
COLBUN SA	617	617	7,744	1,048	公益事業		
AGUAS ANDINAS SA-A	203	203	4,494	608	公益事業		
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	18	33	5,790	783	食品・飲料・タバコ		
LATAM AIRLINES GROUP	23	—	—	—	運輸		
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9	12	46,464	6,291	素材		
FALABELLA SA	52	72	19,977	2,704	小売		
CENCOSUD SA	83	125	17,163	2,323	食品・生活必需品小売り		
CENCOSUD SHOPPING SA	—	55	6,815	922	不動産		
ENEL CHILE SA	2,275	2,275	12,628	1,709	公益事業		
ITAU CORPBANCA	12,309	—	—	—	銀行		
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	26,114	18,053	299,367	40,534	< 0.4% >
(コロンビア)			17	16	—	—	< 0.4% >
INTERCONEXION ELECTRICA SA	32	42	95,575	2,752	公益事業		

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
ECOPETRO SA	341	523	113,732	3,275	エネルギー	
GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF	283	—	—	—	銀行	
GRUPO ARGOS SA	22	—	—	—	素材	
BANCOLOMBIA SA	17	22	60,830	1,751	銀行	
BANCOLOMBIA SA-PREF	31	46	127,594	3,674	銀行	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	19	29	65,572	1,888	各種金融	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	747 7	664 5	463,305 —	13,343 <0.1%>	
(ユーロ…ベルギー)			千ユーロ			
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	3	—	—	—	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3 1	— —	— —	— <-%>	
(ユーロ…ギリシャ)						
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	18	25	35	4,390	電気通信サービス	
MOTOR OIL (HELLAS) CORINTH REFINERIES SA	3	5	6	804	エネルギー	
OPAP SA	13	19	18	2,362	消費者サービス	
JUMBO S. A.	8	10	15	1,951	小売	
FOLLI FOLLIE GROUP	1	1	0.5904	73	耐久消費財・アパレル	
NATIONAL BANK OF GREECE	42	—	—	—	銀行	
EUROBANK ERGASIAS SEEVICES & HOLDINGS SA	191	—	—	—	銀行	
ALPHA BANK AE	94	—	—	—	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	373 8	63 5	77 —	9,581 <0.1%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	377 9	63 5	77 —	9,581 <0.1%>	
(トルコ)			千トルコリラ			
AKBANK T. A. S.	201	293	187	2,479	銀行	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	7	22	49	656	食品・飲料・タバコ	
ARCELIK AS	8	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	21	84	152	2,025	資本財	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	82	126	148	1,972	素材	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2	7	87	1,164	自動車・自動車部品	
KOC HOLDING AS	61	61	114	1,511	資本財	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	—	140	96	1,284	資本財	
TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	44	44	53	707	運輸	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	89	89	139	1,853	電気通信サービス	
TURKIYE GARANTI BANKASI	162	272	249	3,309	銀行	
TURKIYE IS BANKASI-C	96	96	65	872	銀行	
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10	10	94	1,252	エネルギー	
YAPI VE KREDI BANKASI	—	322	96	1,275	銀行	
HACI OMER SABANCI HOLDING	71	71	71	947	各種金融	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	29	50	349	4,629	食品・生活必需品小売り	

エマージング株式インデックス・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	
TAV HAVAL IMANLARI HOLDING AS		17	—	—	—	運輸
小計	株数・金額	907	1,691	1,958	25,943	
	銘柄数<比率>	15	15	—	<0.2%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS		5	7	415	1,970	銀行
CEZ AS		11	16	775	3,675	公益事業
MONETA MONEY BANK AS		39	65	448	2,124	銀行
小計	株数・金額	56	89	1,639	7,770	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
(ハンガリー)				千ハンガリーフォリント		
OTP BANK PLC		16	22	27,364	9,410	銀行
RICHTER GEDEON NYRT		10	10	7,848	2,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT		28	35	7,296	2,509	エネルギー
小計	株数・金額	55	68	42,508	14,618	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
BANK MILLENNIUM SA		48	—	—	—	銀行
MBANK SA		0.79	0.79	12	343	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA		11	15	236	6,558	素材
BANK PEKAO SA		11	18	111	3,089	銀行
ORANGE POLSKA SA		43	67	42	1,181	電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		22	30	163	4,539	エネルギー
LPP SA		0.09	0.12	85	2,372	耐久消費財・アパレル
SANTANDER BANK POLSKA SA		2	3	65	1,824	銀行
CD PROJEKT SA		4	7	256	7,115	メディア・娯楽
PKO BANK POLSKI SA		64	89	250	6,936	銀行
CCC SA		2	—	—	—	耐久消費財・アパレル
GRUPA LOTOS SA		5	9	32	905	エネルギー
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I		143	177	88	2,448	エネルギー
CYFROWY POLSAT SA		15	33	91	2,538	メディア・娯楽
PGE SA		70	70	43	1,195	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		41	61	165	4,585	保険
DINO POLSKA SA		3	5	127	3,540	食品・生活必需品小売り
AMREST HOLDINGS SE		7	—	—	—	消費者サービス
ALLEGRO. EU SA		—	26	196	5,432	小売
小計	株数・金額	500	616	1,970	54,606	
	銘柄数<比率>	18	16	—	<0.5%>	
(香港)				千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H		70	120	145	1,955	素材
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H		100	100	88	1,187	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H		80	240	116	1,556	運輸
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B		—	11	99	1,331	食品・飲料・タバコ

エマージング株式インデックス・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	
CHINA MOBILE LTD	450	630	2,995	40,141	電気通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	95	125	637	8,542	素材
DATANG INTL POWER GENERATION COMPANY LTD	120	—	—	—	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	35	60	154	2,074	公益事業
HUANENG POWER INTL INC-H	220	440	135	1,810	公益事業
YANZHOU COAL MINING CO-H	100	160	107	1,434	エネルギー
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	55	65	360	4,834	家庭用品・パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H	120	—	—	—	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR	180	180	64	863	運輸
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	220	300	208	2,797	自動車・自動車部品
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	340	928	709	9,512	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	280	405	785	10,528	不動産
CHINA RESOURCES LAND LTD	200	320	1,092	14,643	不動産
CITIC LIMITED	440	630	388	5,200	資本財
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	100	200	120	1,618	運輸
LENOVO GROUP LTD	500	740	428	5,741	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PETROCHINA CO LTD	1,580	2,160	568	7,612	エネルギー
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	460	620	297	3,987	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	106	166	237	3,180	保険
CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	1,880	2,480	934	12,528	エネルギー
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	80	80	145	1,944	ソフトウェア・サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	170	240	620	8,313	ソフトウェア・サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	59	84	870	11,661	公益事業
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	240	440	271	3,631	公益事業
TOWNGAS CHINA CO LTD	40	—	—	—	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	100	240	122	1,640	運輸
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	440	880	143	1,922	不動産
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	101	161	157	2,106	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	200	400	113	1,522	素材
WHARF HOLDINGS LTD	90	170	326	4,373	不動産
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	80	80	90	1,217	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	138	278	775	10,393	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	45	70	210	2,823	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	370	600	1,362	18,250	自動車・自動車部品
SHENZHEN INVESTMENT LTD	160	420	117	1,575	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	60	100	370	4,964	公益事業
BYD CO LTD-H	45	65	1,214	16,278	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD	1,060	1,340	325	4,363	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	100	140	96	1,296	エネルギー
SINOTRANS LIMITED	80	—	—	—	運輸
MAANSHAN IRON&STEEL-H	60	—	—	—	素材
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	260	430	187	2,517	商業・専門サービス

エマージング株式インデックス・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	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	60	130	84	1,134	素材
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	520	700	460	6,172	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	130	260	122	1,647	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	120	220	182	2,440	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	250	350	562	7,541	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO.	550	760	1,406	18,840	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	420	580	437	5,867	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	160	240	381	5,107	ヘルスケア機器・サービス
WEICHAJ POWER CO	140	180	310	4,158	資本財
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	80	80	27	365	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L	180	180	29	393	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	50	50	56	755	資本財
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	60	60	43	586	運輸
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	140	200	272	3,655	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	40	40	310	4,164	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT	220	320	414	5,548	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	120	220	74	1,002	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	100	140	833	11,162	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	120	120	66	889	運輸
CNOOC LTD	1,310	1,830	1,729	23,173	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	520	1,060	804	10,780	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	210	280	1,118	14,989	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	405	610	5,593	74,955	保険
LI NING COMPANY LIMITED	135	215	923	12,373	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	360	600	182	2,444	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	390	990	88	1,180	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	370	370	58	778	公益事業
AIR CHINA/HONG KONG	160	160	101	1,361	運輸
ZTE CORPORATION	62	78	157	2,111	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED	260	260	57	769	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	255	350	537	7,203	エネルギー
CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H	220	220	163	2,190	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	670	900	391	5,246	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	120	180	93	1,249	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	7,000	9,830	5,996	80,350	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	56	87	1,177	15,784	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR CORPORATION	200	320	263	3,529	自動車・自動車部品
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	80	120	134	1,807	不動産
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	140	140	147	1,981	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	280	400	433	5,810	素材
BANK OF CHINA LTD	5,810	8,120	2,257	30,248	銀行
SHUI ON LAND LIMITED	135	-	-	-	不動産

エマージング株式インデックス・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	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	80	135	388	5,209	不動産
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	60	172	174	2,332	不動産
CHINA MERCHANTS BANK- H	285	400	2,052	27,496	銀行
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	4,750	6,210	3,024	40,525	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	55	100	99	1,327	素材
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	70	70	90	1,217	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	200	200	84	1,125	資本財
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	310	410	169	2,269	資本財
CHINA COAL ENERGY COMPANY - H	110	-	-	-	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	40	70	155	2,082	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	40	66	169	2,268	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	90	120	454	6,094	耐久消費財・アパレル
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	110	-	-	-	食品・飲料・タバコ
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	560	790	834	11,178	不動産
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	210	360	128	1,722	素材
CHINA CITIC BANK	680	910	313	4,206	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	80	125	134	1,795	不動産
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	53	73	1,123	15,054	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	80	110	1,189	15,933	耐久消費財・アパレル
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	-	40	87	1,168	家庭用品・パーソナル用品
FOSUN INTERNATIONAL	180	235	259	3,482	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	360	620	245	3,289	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD.	190	190	30	414	不動産
BOSIDENG INTL HOLDGS LTD	260	260	88	1,188	耐久消費財・アパレル
SOHO CHINA LTD	75	245	58	784	不動産
KINGSOFT CORPORATION LTD.	60	80	310	4,154	ソフトウェア・サービス
SINOTRUK HONG KONG LTD	35	65	134	1,798	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	280	450	175	2,351	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	80	130	93	1,247	食品・飲料・タバコ
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	55	70	263	3,536	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H	145	245	130	1,746	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	330	510	276	3,710	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	196	284	860	11,530	保険
CRRC CORP LTD-H	310	420	134	1,806	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	175	245	202	2,711	食品・生活必需品小売り
BBMG CORPORATION - H	90	-	-	-	素材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	88	-	-	-	素材
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	84	136	267	3,579	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	180	260	262	3,511	素材
METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA LTD-H	110	-	-	-	資本財
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	212	332	291	3,901	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	115	115	79	1,058	素材

エマージング株式インデックス・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	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	130	240	79	1,070	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP	270	270	179	2,402	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	46	77	101	1,364	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	300	—	—	—	公益事業
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	180	260	777	10,417	不動産
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	170	170	51	692	不動産
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	130	130	103	1,384	資本財
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	135	190	957	12,831	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	54	85	287	3,849	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	511	596	266	3,569	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	210	210	85	1,150	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	66	66	81	1,089	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	210	340	107	1,444	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,170	2,830	846	11,338	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	45	60	355	4,767	小売
FAR EAST HORIZON LTD	180	180	146	1,968	各種金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	135	220	385	5,170	各種金融
SEAZEN GROUP LTD	100	—	—	—	不動産
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	100	170	137	1,845	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	188	280	190	2,551	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	50	75	325	4,361	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	540	850	215	2,881	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	30	50	161	2,164	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	220	300	202	2,717	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	75	75	25	342	資本財
CHINA GALAXY SECURITIES CO	255	360	184	2,469	各種金融
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED	50	—	—	—	自動車・自動車部品
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	100	100	143	1,926	資本財
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	80	—	—	—	各種金融
GREENTOWN SERVICE GROUP	100	180	160	2,149	商業・専門サービス
CHINA EVERGRANDE GROUP	130	200	335	4,497	不動産
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H	50	50	56	757	各種金融
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	590	1,020	448	6,013	銀行
YIHA1 INTERNATIONAL HOLDING LTD	30	50	456	6,113	食品・飲料・タバコ
GENSCRIPT BIOTECH CORP	60	100	109	1,465	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL	200	360	801	10,733	半導体・半導体製造装置
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	—	25	78	1,053	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	80	140	623	8,348	商業・専門サービス
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	140	140	65	874	不動産
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	26	53	490	6,576	ヘルスケア機器・サービス
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	180	—	—	—	自動車・自動車部品
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED	30	60	90	1,210	消費者サービス

エマージング株式インデックス・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	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	—	40	46	628	ヘルスケア機器・サービス
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	35	50	166	2,231	商業・専門サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	3,140	4,540	558	7,482	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	564	1,076	2,802	37,559	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI APPTec CO LTD	13	27	318	4,262	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN-B	75	365	11,388	152,599	小売
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	—	84	117	1,575	小売
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	30	90	466	6,247	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	240	420	578	7,755	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	60	95	493	6,613	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	640	900	136	1,833	各種金融
LOGAN GROUP COMPANY LIMITED	100	160	208	2,795	不動産
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	125	170	609	8,166	資本財
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	—	12	67	899	不動産
CHINA AOYUAN GROUP LTD	90	90	73	985	不動産
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	40	40	67	901	消費者サービス
CANSINO BIOLOGICS INC-H	—	6	96	1,299	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	—	110	125	1,683	小売
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	80	130	166	2,236	運輸
HANSON PHARMACEUTICAL GROUP	40	120	436	5,845	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA FEIHE LTD	—	120	215	2,884	食品・飲料・タバコ
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	—	8	10	142	不動産
KWG LIVING GROUP HOLDINGS LTD	—	62	35	479	不動産
TENCENT HOLDINGS LIMITED	416	586	34,163	457,794	メディア・娯楽
SEAZEN GROUP LTD	—	200	134	1,800	不動産
CHINA VANKE CO LTD -H	103	185	549	7,362	不動産
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	—	315	2,397	32,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LUYE PHARMA GROUP	95	185	82	1,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	1,100	1,100	112	1,503	メディア・娯楽
HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	20	50	187	2,505	半導体・半導体製造装置
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	240	340	765	10,251	ヘルスケア機器・サービス
CGN POWER CO LTD-H	700	930	152	2,043	公益事業
BAIC MOTOR CORP LTD-H	155	155	45	614	自動車・自動車部品
GF SECURITIES CO LTD-H	76	106	119	1,607	各種金融
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	28	48	180	2,424	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	108	140	175	2,345	各種金融
3SBIO INC	105	105	78	1,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGEND HOLDINGS CORP-H	20	49	51	694	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	120	120	49	667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	530	920	81	1,097	各種金融
CHINA LITERATURE LTD	14	30	178	2,385	メディア・娯楽
SSY GROUP LIMITED	100	100	47	640	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
DALI FOODS GROUP CO LTD	110	195	92	1,243	食品・飲料・タバコ	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	100	100	26	355	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	—	120	84	1,133	消費者サービス	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	—	150	76	1,021	不動産	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	300	300	24	321	保険	
BOC AVIATION LTD	13	19	129	1,740	資本財	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	28	38	141	1,891	保険	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	80	136	243	3,262	各種金融	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	40	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	64,009 208	90,502 206	131,202 — <15.9%>	1,758,111	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット			
AMMB HOLDINGS BERHAD	101	170	58	1,497	銀行	
GENTING PLANTATIONS BERHAD	9	25	24	615	食品・飲料・タバコ	
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	333	660	252	6,453	銀行	
DIGI.COM BHD	218	287	119	3,055	電気通信サービス	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	83	83	45	1,173	運輸	
RHB BANK BHD	118	164	84	2,156	銀行	
HAP SENG CONSOLIDATED	39	81	66	1,695	資本財	
GAMUDA BHD	133	133	48	1,246	資本財	
YTL CORP BHD	160	165	10	274	公益事業	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	19	19	30	780	銀行	
HONG LEONG BANK BERHAD	47	66	112	2,867	銀行	
IJM CORP BHD	185	—	—	—	資本財	
KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	35	50	117	2,989	食品・飲料・タバコ	
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12	12	38	980	食品・飲料・タバコ	
MALAYAN BANKING BERHAD	296	402	333	8,508	銀行	
MISC BHD	83	118	83	2,138	運輸	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6	6	83	2,121	食品・飲料・タバコ	
PPB GROUP BERHAD	41	60	111	2,852	食品・飲料・タバコ	
PETRONAS DAGANGAN BHD	19	30	66	1,684	エネルギー	
PETRONAS GAS BHD	43	89	148	3,799	公益事業	
BRITISH AMERICAN TOBACCO MALAYSIA BERHAD	5	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
TELEKOM MALAYSIA BHD	82	82	41	1,046	電気通信サービス	
TENAGA NASIONAL BHD	233	245	262	6,705	公益事業	
QL RESOURCES BHD	53	130	80	2,045	食品・飲料・タバコ	
DIALOG GROUP BHD	292	362	133	3,419	エネルギー	
PUBLIC BANK BERHAD	226	298	554	14,150	銀行	
AIRASIA GROUP BERHAD	55	—	—	—	運輸	
TOP GLOVE CORPORATION BHD	87	495	346	8,833	ヘルスケア機器・サービス	
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	—	12	23	601	食品・飲料・タバコ	
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	—	150	91	2,324	ヘルスケア機器・サービス	

エマージング株式インデックス・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		
SUPERMAX CORP BHD	—	166	141	3,610	ヘルスケア機器・サービス	
GENTING BHD	152	258	107	2,746	消費者サービス	
GENTING MALAYSIA BHD	175	266	67	1,718	消費者サービス	
IOI CORPORATION BERHAD	140	228	100	2,561	食品・飲料・タバコ	
SIME DARBY BERHAD	235	235	54	1,397	資本財	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	126	181	262	6,691	ヘルスケア機器・サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	219	326	121	3,104	電気通信サービス	
MAXIS BERHAD	187	268	134	3,434	電気通信サービス	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	168	270	185	4,728	素材	
IHH HEALTHCARE BHD	156	205	115	2,946	ヘルスケア機器・サービス	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	37	100	42	1,092	運輸	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	87	131	91	2,341	素材	
SIME DARBY PLANTATION BHD	150	239	120	3,081	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,845	7,268	4,914	125,474	
	銘柄数 <比率>	40	40	—	<1.1%>	
(タイ)			千タイバーツ			
BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	31	59	722	2,479	銀行	
BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	73	102	385	1,320	食品・生活必需品小売り	
KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	292	292	327	1,121	銀行	
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	48	79	450	1,544	公益事業	
ROBINSON DEPARTMENT STORE PLC-NVDR	41	—	—	—	小売	
SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	56	87	776	2,663	銀行	
TRUE CORPORATION PCL-NVDR	765	1,500	495	1,697	電気通信サービス	
KASIKORN BANK PUBLIC COMPANY LTD- NVDR	55	55	624	2,141	銀行	
TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	1,357	1,357	153	525	銀行	
IRPC PCL-NVDR	532	1,211	341	1,171	エネルギー	
BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR	374	—	—	—	エネルギー	
ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	19	25	545	1,869	公益事業	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	147	249	1,375	4,718	電気通信サービス	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	254	396	1,158	3,972	食品・飲料・タバコ	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	89	122	2,189	7,511	電気通信サービス	
HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	418	553	835	2,864	小売	
PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	843	1,196	4,993	17,127	エネルギー	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	219	319	488	1,674	食品・飲料・タバコ	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	—	85	439	1,508	各種金融	
LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	548	812	657	2,255	不動産	
SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	58	82	3,091	10,603	素材	
AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	319	457	3,027	10,384	運輸	
KASIKORN BANK PUBLIC COMPANY LTD- FOREIGN	89	120	1,362	4,671	銀行	
CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	173	252	1,367	4,689	不動産	
BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	709	975	2,193	7,524	ヘルスケア機器・サービス	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	32	54	683	2,343	ヘルスケア機器・サービス	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	194	366	933	3,201	消費者サービス	
THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	91	91	452	1,552	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	432	597	3,686	12,644	食品・生活必需品小売り	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	468	906	942	3,231	運輸	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	106	154	1,547	5,308	エネルギー	
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL -NVDR	46	46	173	595	電気通信サービス	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	142	142	429	1,473	素材	
PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	148	252	1,486	5,099	素材	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	110	147	676	2,319	公益事業	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	547	724	673	2,309	運輸	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	68	68	340	1,166	公益事業	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	35	200	725	2,486	公益事業	
OSOTSPA PCL-NVDR	70	70	259	888	食品・飲料・タバコ	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	—	180	379	1,302	各種金融	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	—	696	343	1,179	消費者サービス	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	—	208	705	2,418	小売	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	63	63	374	1,285	各種金融	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	42	76	427	1,466	各種金融	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	58	58	420	1,442	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	10,161 41	15,483 43	43,661 —	149,757 <1.4%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
AYALA LAND INC	559	882	3,351	7,239	不動産	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	164	164	694	1,499	資本財	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	77	77	642	1,387	銀行	
GLOBE TELECOM INC	2	3	652	1,409	電気通信サービス	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	72	117	1,374	2,969	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	200	334	2,195	4,742	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25	41	776	1,677	消費者サービス	
METROPOLITAN BANK & TRUST	130	130	625	1,350	銀行	
MEGAWORLD CORP	920	920	352	761	不動産	
ROBINSONS LAND CO	172	—	—	—	不動産	
SECURITY BANK CORP	20	—	—	—	銀行	
SM PRIME HOLDINGS INC	761	1,088	3,916	8,460	不動産	
UNIVERSAL ROBINA CORP	71	101	1,445	3,122	食品・飲料・タバコ	
SM INVESTMENTS CORP	16	26	2,565	5,541	資本財	
AYALA CORPORATION	19	31	2,561	5,531	資本財	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	1,109	1,109	454	982	各種金融	
ABOITIZ POWER CORP	120	120	309	667	公益事業	
MANILA ELECTRIC COMPANY	13	23	658	1,423	公益事業	
BDO UNIBANK INC	135	220	2,274	4,913	銀行	
PUREGOLD PRICE CLUB INC	—	61	257	555	食品・生活必需品小売り	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
GT CAPITAL HOLDINGS INC	6	6	348	751	資本財	
PLDT INC	5	8	1,090	2,355	電気通信サービス	
ALTUS SAN NICOLAS CORP-NEW	1	—	—	—	不動産	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	4,602	5,466	26,547	57,342	
		22	20	—	<0.5%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
BARITO PACIFIC TBK PT	2,082	2,082	232,143	1,717	素材	
PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	122	193	477,192	3,531	エネルギー	
PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	356	513	374,490	2,771	食品・飲料・タバコ	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	536	834	542,100	4,011	食品・飲料・タバコ	
PT GUDANG GARAM TBK	40	40	177,300	1,312	食品・飲料・タバコ	
PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	547	791	126,560	936	食品・飲料・タバコ	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	132	132	194,370	1,438	素材	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	161	297	276,952	2,049	素材	
BUKIT ASAM TBK PT	104	—	—	—	エネルギー	
PT BANK MANDIRI	1,396	1,909	1,269,485	9,394	銀行	
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	129	—	—	—	素材	
PT UNILEVER INDONESIA TBK	105	791	613,025	4,536	家庭用品・パーソナル用品	
PT BANK RAKYAT	4,096	5,676	2,423,652	17,935	銀行	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	656	656	97,744	723	公益事業	
BANK NEGARA INDONESIA PT	521	763	484,505	3,585	銀行	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	213	289	344,632	2,550	素材	
PT BANK CENTRAL ASIA TBK	721	1,008	3,218,040	23,813	銀行	
XL AXIATA TBK PT	354	354	89,562	662	電気通信サービス	
JASA MARGA(PERSERO)TBK PT	80	—	—	—	運輸	
BUMI SERPONG DAMAI PT	282	—	—	—	不動産	
ADARO ENERGY TBK PT	1,159	1,159	161,101	1,192	エネルギー	
PAKUWON JATI TBK PT	794	—	—	—	不動産	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	143	212	224,720	1,662	食品・飲料・タバコ	
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	155	—	—	—	銀行	
KALBE FARMA PT	1,531	2,461	364,228	2,695	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACE HARDWARE INDONESIA	669	669	111,054	821	小売	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,513	2,162	1,199,910	8,879	自動車・自動車部品	
TELEKOMUNIKASI TBK PT	3,666	5,186	1,794,356	13,278	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	22,263	28,177	14,797,122	109,498	
		28	22	—	<1.0%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5	5	11,272	1,061	メディア・娯楽	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	2	4	36,034	3,394	自動車・自動車部品	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2	3	62,527	5,890	保険	
DB INSURANCE CO LTD	3	5	22,713	2,139	保険	
COWAY CO LTD	3	5	38,305	3,608	耐久消費財・アパレル	

エマージング株式インデックス・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	
KT&G CORPORATION	8	11	100,689	9,484	食品・飲料・タバコ
S1 CORPORATION	1	2	17,914	1,687	商業・専門サービス
KOREA GAS CORPORATION	2	2	7,724	727	公益事業
CJ CORP	0.9	1	13,456	1,267	資本財
KAKAO CORP	3	5	219,697	20,695	メディア・娯楽
CJ ENM CO LTD	0.57	1	19,728	1,858	小売
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING	1	4	11,308	1,065	資本財
KMW CO LTD	2	2	17,279	1,627	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK TELECOM CO LTD	1	4	95,175	8,965	電気通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD	1	2	21,471	2,022	資本財
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	28	28	28,643	2,698	各種金融
NCSOFT CORP	1	1	142,206	13,395	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	6	18	22,914	2,158	電気通信サービス
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	6	—	—	—	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	4	4	5,909	556	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	0.7	0.96	147,168	13,863	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	3	4	383,940	36,167	素材
LG CHEM LTD	0.63	0.89	33,152	3,122	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	0.17	0.17	11,900	1,120	家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	33	46	159,558	15,030	銀行
S-OIL CORPORATION	3	4	29,751	2,802	エネルギー
HANWHA SOLUTIONS CORP	6	9	47,869	4,509	素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	15	15	5,925	558	各種金融
SAMSUNG SECURITIES CO,LTD.	4	6	25,655	2,416	各種金融
POSCO CHEMUCAL CO LTD	2	2	18,431	1,736	素材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1	1	46,207	4,352	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	2	2	20,898	1,968	小売
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	2	3	38,085	3,587	資本財
HYUNDAI MOBIS	4	6	173,701	16,362	自動車・自動車部品
HYNIX SEMICONDUCTOR INC	39	56	556,540	52,426	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	5	9	32,327	3,045	資本財
HYUNDAI MOTOR COMPANY	1	1	15,192	1,431	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	11	15	281,274	26,496	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL COMPANY	6	10	34,556	3,255	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18	26	25,435	2,396	銀行
KCC CORP	0.36	—	—	—	素材
KIA MOTORS CORPORATION	19	27	163,655	15,416	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO., LTD.	0.68	0.97	37,684	3,549	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	17	28	61,779	5,819	公益事業
HANWHA CORPORATION	1	5	15,151	1,427	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	2	10	26,110	2,459	運輸
OCI COMPANY LTD	1	—	—	—	素材

エマージング株式インデックス・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	
CJ LOGISTICS CORPORATION	0.74	0.74	12,025	1,132	運輸
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	1	2	32,461	3,057	素材
DUZONBIZON CO LTD	—	1	19,475	1,834	ソフトウェア・サービス
HLB INC	2	4	37,422	3,525	耐久消費財・アパレル
LG ELECTRONICS INC	7	11	99,565	9,379	耐久消費財・アパレル
LOTTE CORPORATION	1	3	10,745	1,012	資本財
LG CORP	6	10	76,478	7,204	資本財
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	7	7	8,377	789	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	5	5	16,844	1,586	資本財
NAVER CORPORATION	10	12	361,599	34,062	メディア・娯楽
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1	—	—	—	小売
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3	4	32,921	3,101	各種金融
OTTOGI CORPORATION	0.04	0.04	2,244	211	食品・飲料・タバコ
AMOREPACIFIC GROUP	2	2	12,552	1,182	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	8	8	19,604	1,846	消費者サービス
POSCO	5	7	186,570	17,574	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	12	12	17,801	1,676	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	4	5	310,213	29,222	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3	5	90,820	8,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	346	488	3,333,138	313,981	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	31	45	31,002	2,920	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	60	84	519,985	48,982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE CO LTD	0.63	0.63	14,521	1,367	小売
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	—	3	42,919	4,042	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUHAN CORPORATION	0.76	4	31,326	2,950	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	15	15	24,598	2,317	自動車・自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3	6	15,033	1,416	保険
GS HOLDINGS	4	4	15,724	1,481	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	16	23	37,453	3,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELLTRION INC	6	9	326,986	30,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HELIXMITH CO LTD	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANA FINANCIAL GROUP INC.	22	30	109,292	10,295	銀行
GLOVIS CO LTD	1	1	27,922	2,630	運輸
CELLTRION PHARM INC	—	1	32,096	3,023	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOTTE SHOPPING CO LTD	0.6	0.6	6,090	573	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	4	6	48,544	4,572	保険
AMOREPACIFIC CORP	2	3	60,371	5,686	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	0.33	0.33	1,805	170	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO LTD	1	3	10,524	991	各種金融
SK INNOVATION CO LTD	3	5	106,264	10,010	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	0.7	0.85	31,152	2,934	食品・飲料・タバコ
PAN OCEAN CO LTD	22	22	9,091	856	運輸

エマージング株式インデックス・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		
LG INNOTEK CO LTD	1	1	18,457	1,738	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SK HOLDINGS CO LTD	2	3	82,500	7,771	資本財	
KB FINANCIAL GROUP INC	29	40	193,670	18,243	銀行	
MEDY-TOC INC	0.23	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5	5	14,274	1,344	資本財	
BS FINANCIAL GROUP INC	20	20	11,411	1,074	銀行	
HANMI PHARM CO LTD	0.54	0.55	19,607	1,847	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	9	—	—	—	保険	
FILA HOLDINGS CORP	3	3	15,053	1,418	耐久消費財・アパレル	
SEEGENE INC	—	2	39,066	3,680	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
E-MART INC	1	1	26,419	2,488	食品・生活必需品小売り	
GS RETAIL CO LTD	0.99	2	9,758	919	食品・生活必需品小売り	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	6	6	21,018	1,979	自動車・自動車部品	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	1	—	—	—	資本財	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	0.7	1	32,832	3,092	資本財	
BGF RETAIL CO LTD	0.61	0.61	7,777	732	食品・生活必需品小売り	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1	2	28,917	2,723	食品・飲料・タバコ	
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	1	—	—	—	保険	
NETMARBLE CORPORATION	1	2	27,113	2,554	メディア・娯楽	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	33	55	56,497	5,322	銀行	
AMOREPACIFIC GROUP-RIGHTS	0.1	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
SAMSUNG SDS CO LTD	2	3	62,656	5,902	ソフトウェア・サービス	
ALTEOGEN INC	—	2	34,195	3,221	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAMSUNG C&T CORPORATION	6	8	109,760	10,339	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1	1	139,026	13,096	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PEARLABYSS CORP	0.54	0.54	11,248	1,059	メディア・娯楽	
DOOSAN BOBCAT INC	2	6	20,517	1,932	資本財	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	4	6	81,688	7,695	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 比 率	1,069	1,465	10,533,953	992,298
			112	107	—	< 9.0% >
(台湾)					千新台幣ドル	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	50	60	1,461	5,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ACER INC	180	340	785	2,858	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	50	80	2,012	7,323	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	30	50	1,867	6,797	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORPORATION	160	220	970	3,531	素材	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	20	30	576	2,096	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN BUSINESS BANK	442	465	458	1,668	銀行	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	50	100	1,070	3,894	半導体・半導体製造装置	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	40	60	762	2,773	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	40	70	597	2,176	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QUANTA COMPUTER INC	180	310	2,408	8,767	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

エマージング株式インデックス・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	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	60	66	289	1,053	不動産
EVA AIRWAYS CORP	188	188	243	887	運輸
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	50	70	1,361	4,955	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	362	481	856	3,116	銀行
CHINA AIRLINES LTD	100	—	—	—	運輸
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	140	210	907	3,302	自動車・自動車部品
CHINA STEEL CORP	880	1,260	2,916	10,617	素材
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	215	228	471	1,716	保険
ADVANTECH CO LTD	30	42	1,336	4,866	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	370	370	712	2,592	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	150	200	4,400	16,016	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	80	100	713	2,595	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	280	390	4,270	15,544	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	780	780	936	3,407	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	110	170	1,686	6,138	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE CORPORATION	223	227	570	2,077	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	250	250	692	2,520	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	22	46	881	3,209	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE CO LTD	20	20	815	2,966	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	40	60	1,824	6,639	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORPORATION	330	400	3,488	12,696	素材
FORMOSA TAFFETA CO LTD	100	80	250	910	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	260	370	2,923	10,639	素材
GIANT MANUFACTURING CO LTD	20	30	861	3,134	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INCORPORATION	110	150	10,875	39,585	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	500	680	3,104	11,299	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	603	851	1,553	5,655	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	20	30	2,040	7,425	小売
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	110	160	979	3,564	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	720	991	1,913	6,966	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	570	810	3,349	12,191	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	830	1,300	1,136	4,135	保険
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	777	1,158	2,948	10,733	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	918	1,278	10,556	38,424	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	810	1,110	3,230	11,757	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	3	10	3,596	13,090	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	626	1,004	1,341	4,882	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	684	1,134	985	3,588	保険
INVENTEC CORPORATION	240	240	560	2,039	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	150	240	1,177	4,285	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	697	1,037	1,177	4,286	銀行
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	1,370	1,790	3,535	12,868	銀行

エマージング株式インデックス・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		
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	748	1,054	2,255	8,210	銀行	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	60	60	546	1,987	半導体・半導体製造装置	
NAN YA PLASTICS CORP	380	540	3,542	12,894	素材	
WISTRON CORPORATION	252	252	782	2,849	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
POU CHEN	190	190	585	2,130	耐久消費財・アパレル	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	360	490	3,248	11,825	食品・飲料・タバコ	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	40	60	1,638	5,962	食品・生活必需品小売り	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	80	110	1,039	3,783	エネルギー	
PHISON ELECTRONICS CORP	10	10	324	1,181	半導体・半導体製造装置	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	18	87	359	1,309	不動産	
RUENTEX INDUSTRIES LIMITED	12	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	50	70	364	1,327	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STANDARD FOODS CORPORATION	20	20	123	450	食品・飲料・タバコ	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	100	160	719	2,617	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN CEMENT CORPORATION	340	520	2,254	8,207	素材	
TATUNG CO LTD	100	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,790	2,520	123,228	448,549	半導体・半導体製造装置	
UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	800	1,190	4,658	16,958	半導体・半導体製造装置	
WINBOND ELECTRONICS CORP	200	200	364	1,324	半導体・半導体製造装置	
YAGEO CORPORATION	21	41	1,830	6,662	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	120	170	531	1,933	運輸	
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	480	950	944	3,437	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WPG HOLDINGS CO LTD	95	155	630	2,296	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20	31	926	3,374	資本財	
PEGATRON CORP	140	220	1,463	5,325	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10	10	819	2,981	資本財	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	30	30	999	3,636	半導体・半導体製造装置	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	82	126	2,027	7,379	各種金融	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	40	70	854	3,108	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	692	955	1,930	7,028	銀行	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	252	342	1,368	4,981	銀行	
WIWYNN CORP	10	10	688	2,504	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	270	340	2,529	9,207	半導体・半導体製造装置	
SILERGY CORP	—	10	2,285	8,317	半導体・半導体製造装置	
GLOBALWAFERS CO LTD	20	20	1,016	3,698	半導体・半導体製造装置	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10	20	668	2,431	耐久消費財・アパレル	
小 計	株 数 ・ 金 額	23,895	32,841	267,985	975,467	
	銘柄数 <比率>	88	86	—	<8.8%>	
(インド)				千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	207	292	56,516	79,687	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	50	72	2,706	3,816	エネルギー	
EICHER MOTORS LTD	1	—	—	—	自動車・自動車部品	

エマージング株式インデックス・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	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	51	80	5,794	8,169	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	0.61	0.82	1,993	2,810	素材
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	44	74	1,551	2,188	エネルギー
LIC HOUSING FINANCE LTD	13	—	—	—	銀行
TATA STEEL LTD	20	31	1,811	2,553	素材
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	—	41	2,230	3,144	食品・飲料・タバコ
NESTLE INDIA LTD	1	2	4,239	5,977	食品・飲料・タバコ
GAIL INDIA LIMITED	89	138	1,422	2,005	公益事業
VEDANTA LTD	130	209	2,528	3,565	素材
TITAN CO LTD	21	33	4,622	6,517	耐久消費財・アパレル
OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	174	236	1,853	2,614	エネルギー
COLGATE PALMOLIVE INDIA	5	5	867	1,222	家庭用品・パーソナル用品
LUPIN LTD	13	20	1,853	2,612	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	118	168	37,961	53,525	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	56	88	1,703	2,402	メディア・娯楽
INFOSYS LIMITED	249	348	38,325	54,038	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	83	116	4,095	5,774	ソフトウェア・サービス
INDIAN OIL CORP LTD	133	192	1,628	2,296	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	47	84	17,980	25,351	家庭用品・パーソナル用品
HCL TECHNOLOGIES LTD	36	110	9,124	12,865	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LIMITED	41	54	2,709	3,820	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	6	9	2,835	3,997	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	7	12	5,915	8,340	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LIMITED	152	129	5,989	8,444	電気通信サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	57	90	4,631	6,531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIVI'S LABORATORIES LTD	5	8	2,934	4,137	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	7	12	8,942	12,608	自動車・自動車部品
AUROBINDO PHARMA LIMITED	15	26	2,330	3,285	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOCON LTD	—	29	1,257	1,773	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	74	74	1,101	1,553	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	13	7	840	1,184	各種金融
PETRONET LNG LTD	44	61	1,541	2,173	エネルギー
CIPLA LTD	20	31	2,318	3,269	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	35	51	5,765	8,129	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	6	12	5,954	8,395	素材
ASHOK LEYLAND LIMITED	103	—	—	—	資本財
BOSCH LIMITED	0.55	—	—	—	自動車・自動車部品
TATA CONSULTANCY SVS LTD	66	92	24,676	34,794	ソフトウェア・サービス
NTPC LTD	184	266	2,526	3,562	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	4	9	1,261	1,779	各種金融
AMBUJA CEMENTS LTD	44	68	1,783	2,515	素材
BHARAT FORGE LTD	7	20	1,018	1,435	自動車・自動車部品

エマージング株式インデックス・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		
HINDALCO INDUSTRIES LTD	92	132	2,994	4,222	素材	
ITC LIMITED	255	301	5,842	8,238	食品・飲料・タバコ	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8	14	2,181	3,075	素材	
UPL LTD	37	55	2,330	3,285	素材	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	—	5	1,312	1,851	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SIEMENS LTD	6	6	933	1,316	資本財	
INFO EDGE INDIA LTD	5	6	2,695	3,801	メディア・娯楽	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	28	41	2,925	4,125	家庭用品・パーソナル用品	
MARICO LTD	32	46	1,699	2,395	家庭用品・パーソナル用品	
PAGE INDUSTRIES LTD	0.46	0.46	1,046	1,475	耐久消費財・アパレル	
DLF LIMITED	49	49	933	1,316	不動産	
POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	125	200	3,857	5,438	公益事業	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	44	44	1,810	2,553	運輸	
REC LTD	53	53	652	920	各種金融	
BAJAJ FINSERV LTD	2	3	3,424	4,828	保険	
BAJAJ AUTO LTD	6	6	2,085	2,939	自動車・自動車部品	
JUBILANT FOODWORKS LTD	—	7	1,795	2,531	消費者サービス	
COAL INDIA LTD	87	126	1,582	2,231	エネルギー	
TATA MOTORS LTD	124	191	3,450	4,865	自動車・自動車部品	
TATA POWER CO LTD	41	—	—	—	公益事業	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	23	—	—	—	各種金融	
BHARTI INFRATEL LTD	12	33	740	1,043	電気通信サービス	
ASIAN PAINTS LTD	19	30	6,792	9,576	素材	
BAJAJ FINANCE LIMITED	12	18	9,032	12,735	各種金融	
INDRAPRASTHA GAS LTD	—	21	1,072	1,511	公益事業	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	35	72	4,673	6,590	保険	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	3	5	1,325	1,868	各種金融	
CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	16	16	651	918	運輸	
BANDHAN BANK LTD	25	74	2,719	3,834	銀行	
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	4	5	2,146	3,026	食品・飲料・タバコ	
EICHER MOTORS LTD	—	14	3,748	5,285	自動車・自動車部品	
AXIS BANK LIMITED	153	231	13,930	19,641	銀行	
HAVELLS INDIA LTD	14	22	1,779	2,509	資本財	
STATE BANK OF INDIA	121	182	4,458	6,285	銀行	
ICICI BANK LIMITED	349	521	24,692	34,816	銀行	
BERGER PAINTS INDIA LTD	20	20	1,298	1,830	素材	
TECH MAHINDRA LTD	32	47	4,158	5,862	ソフトウェア・サービス	
GRASIM INDUSTRIES LTD	21	33	2,969	4,187	素材	
AVENUE SUPERMARTS LTD	7	15	3,639	5,132	食品・生活必需品小売り	
UNITED SPIRITS LTD	21	29	1,629	2,298	食品・飲料・タバコ	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	14	18	2,725	3,843	保険	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	25	35	1,556	2,194	保険	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	金額	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	
INTERGLOBE AVIATION LTD	6		6		1,023	1,443	運輸
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	26		40		3,460	4,879	保険
JSW STEEL LTD	67		95		3,334	4,701	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	4,492	6,304	434,259	612,305		
	銘柄数 <比率>	84	84	—	< 5.5%>		
(エジプト)					千エジプトポンド		
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	101		148		931	6,183	銀行
EASTERN TOBACCO	59		86		94	630	食品・飲料・タバコ
ELSEWEDY ELECTRIC CO	54		54		50	333	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	215	289	1,076	7,147		
	銘柄数 <比率>	3	3	—	< 0.1%>		
(南アフリカ)					千南アフリカランド		
BIDVEST GROUP LTD	18		24		418	2,850	資本財
CLICKS GROUP LTD	20		27		660	4,501	食品・生活必需品小売り
DISCOVERY LTD	31		44		566	3,863	保険
GOLD FIELDS LIMITED	57		92		1,208	8,245	素材
REMGRO LTD	36		43		418	2,852	各種金融
THE FOSCHINI GROUP	13		—		—	—	小売
NORTHAM PLATINUM LTD	28		40		726	4,956	素材
HARMONY GOLD MINING CO LTD	—		61		383	2,614	素材
EXXARO RESOURCES LIMITED	18		18		227	1,554	エネルギー
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3		6		822	5,609	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD	4		—		—	—	保険
MTN GROUP LIMITED	126		182		1,259	8,588	電気通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	31		43		1,397	9,533	素材
TELKOM SA SOC LTD	21		—		—	—	電気通信サービス
FIRSTSTRAND LIMITED	248		501		2,377	16,213	各種金融
PSG GROUP LTD	8		—		—	—	各種金融
NASPERS LIMITED-N SHS	31		44		14,146	96,480	小売
NEDBANK GROUP LTD	28		28		367	2,506	銀行
PICK N PAY STORES LTD	31		—		—	—	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD	54		—		—	—	各種金融
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4		5		690	4,712	素材
SASOL LTD.	41		61		814	5,556	素材
SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	33		46		597	4,072	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LIMITED	95		137		1,752	11,949	銀行
SPAR GROUP LIMITED	11		17		331	2,258	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	77		77		281	1,921	小売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30		43		552	3,769	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIGER BRANDS LTD	9		16		325	2,218	食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD	139		166		961	6,559	保険
INVESTEC LTD	22		—		—	—	各種金融

エマージング株式インデックス・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	
		60	85	1,409	9,611	素材
		4	4	269	1,834	素材
		103	103	161	1,103	ヘルスケア機器・サービス
		44	69	872	5,950	電気通信サービス
		175	—	—	—	素材
		30	31	252	1,722	不動産
		331	527	659	4,500	保険
		10	16	465	3,177	各種金融
		48	80	925	6,314	銀行
		70	70	96	658	小売
		30	42	571	3,897	メディア・娯楽
		34	89	139	951	保険
		—	244	1,262	8,609	素材
		59	59	184	1,256	保険
		20	20	342	2,333	小売
		22	36	1,032	7,038	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	2,329	3,215	39,933	272,348	
	銘 柄 数 <比 率>	44	38	—	<2.5%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	177,205	228,099	—	6,797,069	
	銘 柄 数 <比 率>	860	829	—	<61.5%>	

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

※< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

※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。

エマージング株式インデックス・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)						千米ドル	千円	%
GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF		1,568	—	—	—	—	—	—
GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF		—	605	16	1,758	—	—	0.0
ISHARES MSCI RUSSIA ETF		39,708	60,624	2,207	229,381	—	—	2.1
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF		34,756	61,356	1,920	199,514	—	—	1.8
ISHARES MSCI UAE ETF		19,639	35,000	403	41,914	—	—	0.4
ISHARES MSCI QATAR ETF		22,394	30,028	535	55,685	—	—	0.5
小計	証券数・金額	118,065	187,613	5,084	528,254	—	—	—
	銘柄数 <比率>	5	5	—	<4.8%>	—	—	—
(メキシコ)						千メキシコペソ		
DEUTSCHE BANK MEX (FIBRA UNO ADMINISTR)		23,200	36,300	723	3,752	—	—	0.0
小計	証券数・金額	23,200	36,300	723	3,752	—	—	—
	銘柄数 <比率>	1	1	—	<0.0%>	—	—	—
(ブラジル)						千ブラジルリアル		
SUL AMERICA SA-UNITS		2,300	3,000	130	2,538	—	—	0.0
SUL AMERICA SA-UNITS-NEW		—	56	2	47	—	—	0.0
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		2,700	4,200	169	3,303	—	—	0.0
KLABIN SA-UNIT		4,600	7,100	176	3,430	—	—	0.0
小計	証券数・金額	9,600	14,356	478	9,320	—	—	—
	銘柄数 <比率>	3	4	—	<0.1%>	—	—	—
(南アフリカ)						千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		20,610	25,563	317	2,163	—	—	0.0
FORTRESS REIT LTD-A		9,022	—	—	—	—	—	—
REDEFINE PROPERTIES LTD		43,761	—	—	—	—	—	—
小計	証券数・金額	73,393	25,563	317	2,163	—	—	—
	銘柄数 <比率>	3	1	—	<0.0%>	—	—	—
(中国 (オフショア))						千中国元 (オフショア)		
CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF		301,800	463,200	23,549	372,311	—	—	3.4
小計	証券数・金額	301,800	463,200	23,549	372,311	—	—	—
	銘柄数 <比率>	1	1	—	<3.4%>	—	—	—
合計	証券数・金額	526,058	727,032	—	915,802	—	—	—
	銘柄数 <比率>	13	12	—	<8.3%>	—	—	—

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

※〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別						期		末	
						買	建	額	売
外国	M	S	C	I	E	百万円 3,361		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。

※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。

■ 投資信託財産の構成

(2020年11月30日現在)

項目		期		末	
		評	価	額	比
株	式	千円		%	
		6,797,070		60.9	
投資信託	受益証券	372,311		3.3	
投資	証券	543,491		4.9	
コール・ローン等、その他		3,449,058		30.9	
投資信託財産	総額	11,161,930		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（10,108,117千円）の投資信託財産総額（11,161,930千円）に対する比率は90.6%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=103.89円、1メキシコペソ=5.19円、1ブラジルリアル=19.46円、100チリペソ=13.54円、100コロンビアペソ=2.88円、1ユーロ=124.38円、1トルコリラ=13.25円、1チェココルナ=4.74円、100ハンガリーフォリント=34.39円、1ポーランドズロチ=27.71円、1香港ドル=13.40円、1マレーシアリングギット=25.53円、1タイバーツ=3.43円、1フィリピンペソ=2.16円、100インドネシアルピア=0.74円、100韓国ウォン=9.42円、1新台幣ドル=3.64円、1インドルピー=1.41円、1エジプトポンド=6.64円、1南アフリカランド=6.82円、1中国元（オフショア）=15.81円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	15,314,643,046円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,453,595,079
株 式(評価額)	6,797,070,179
投資信託受益証券(評価額)	372,311,081
投 資 証 券(評価額)	543,491,598
未 収 入 金	4,522,007,094
未 収 配 当 金	2,230,301
差 入 委 託 証 拠 金	623,937,714
(B) 負 債	4,259,732,019
未 払 金	4,198,643,715
未 払 解 約 金	61,074,900
未 払 利 息	2,616
そ の 他 未 払 費 用	10,788
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	11,054,911,027
元 本	7,247,902,983
次 期 繰 越 損 益 金	3,807,008,044
(D) 受 益 権 総 口 数	7,247,902,983口
1 万 口 当 ち 基 準 価 額(C/D)	15,253円

※当期における期首元本額6,294,909,292円、期中追加設定元本額4,068,693,633円、期中一部解約元本額3,115,699,942円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	3,448,791,070円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,982,112,036円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	390,895,787円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	430,924,258円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	280,878,303円
イオン・バランス戦略ファンド	92,837,244円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,962,617円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	49,410,126円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	33,556,032円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	161,545,110円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	107,264,458円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	177,089,278円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	41,698,761円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,609,064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>	32,828,839円

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

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2019年12月3日 至2020年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	111,123,665円
受 取 配 当 金	110,623,105
受 取 利 息	1,868
そ の 他 収 益 金	1,880,975
支 払 利 息	△ 1,382,283
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	752,751,029
売 買 益	1,758,749,257
売 買 損	△1,005,998,228
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	565,771,682
取 引 益	1,191,321,209
取 引 損	△ 625,549,527
(D) 信 託 報 酬 等	△ 21,043,899
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	1,408,602,477
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	2,086,766,026
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,258,389,346
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 946,749,805
(I) 計 (E+F+G+H)	3,807,008,044
次 期 繰 越 損 益 金(I)	3,807,008,044

※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。

リート・インデックス・マザーファンド

第33期（2021年2月26日から2021年8月25日まで）

信託期間	無期限（設定日：2005年6月21日）
運用方針	・日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）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。

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) 東証REIT指数(配当込み)		REIT指数 先物比率 (買建-売建)	投資信託 比率	純資産額
	円	%	騰落率	騰落率			
29期（2019年8月26日）	25,022	14.1	4,253.84	14.1	—	98.5	百万円 8,196
30期（2020年2月25日）	27,133	8.4	4,616.86	8.5	1.1	98.8	7,948
31期（2020年8月25日）	21,827	△19.6	3,707.66	△19.7	0.8	98.4	6,848
32期（2021年2月25日）	25,508	16.9	4,330.11	16.8	0.8	97.9	7,697
33期（2021年8月25日）	27,121	6.3	4,601.21	6.3	0.6	98.9	7,535

※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

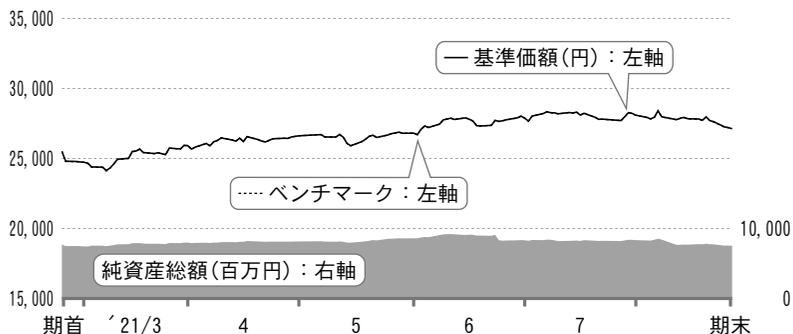
年月日	基準価額		(ベンチマーク) 東証REIT指数(配当込み)		REIT指数 先物比率 (買建-売建)	投資信託 比率
	円	%	騰落率	騰落率		
(期首) 2021年2月25日	25,508	—	4,330.11	—	0.8	97.9
2月末	24,805	△2.8	4,207.24	△2.8	0.8	97.8
3月末	25,917	1.6	4,399.26	1.6	0.8	98.4
4月末	26,619	4.4	4,518.99	4.4	0.8	98.8
5月末	26,809	5.1	4,551.00	5.1	0.7	99.2
6月末	27,881	9.3	4,732.24	9.3	0.5	98.8
7月末	28,091	10.1	4,767.40	10.1	0.5	98.6
(期末) 2021年8月25日	27,121	6.3	4,601.21	6.3	0.6	98.9

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2021年2月26日から2021年8月25日まで）

基準価額等の推移



期首	25,508円
期末	27,121円
騰落率	+6.3%

※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、東証REIT指数（配当込み）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2021年2月26日から2021年8月25日まで）

当ファンドは、主として日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）に投資し、東証REIT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。

上昇要因

- ・国内長期金利が低位で安定的に推移したこと、および新型コロナウイルスワクチン接種の加速により経済正常化が進むとの期待からJリート市場が上昇したこと

▶ 投資環境について（2021年2月26日から2021年8月25日まで）

Ｊリート市場は上昇しました。

期初は、長期金利上昇に対する警戒感から軟調な展開となりました。3月中旬以降は、長期金利が低位安定的に推移したことや、ワクチン接種の加速により経済正常化が進むとの期待からＪリート市場は上昇しました。期末にかけては、デルタ型の感染が拡大し、下落基調となりました。

▶ ポートフォリオについて（2021年2月26日から2021年8月25日まで）

リート組入比率

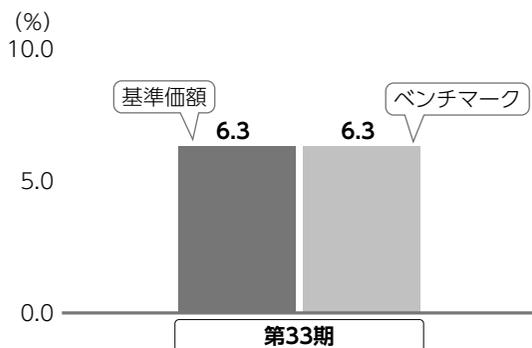
東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、リーートの組入比率は高位を保ちました。

ポートフォリオの特性

主として日本の取引所に上場しているリートに投資し、東証ＲＥＩＴ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、東証ＲＥＩＴ指数先物を利用することで、実質組入比率を高位に維持しました。

▶ベンチマークとの差異について（2021年2月26日から2021年8月25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、東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

期間における基準価額の騰落率は+6.3%となり、ベンチマークの騰落率+6.3%を追随しました。

2 今後の運用方針

引き続き、主として日本の取引所に上場しているリートに投資し、東証REIT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。また、東証REIT指数先物を含めたリートの組入比率は、原則として高位を保ちます。

■ 1万口当たりの費用明細 (2021年2月26日から2021年8月25日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 売買委託手数料 (投資信託証券) (先物・オプション)	5円 (5) (0)	0.020% (0.019) (0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 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	5	0.020	

期中の平均基準価額は26,687円です。

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年2月26日から2021年8月25日まで)

(1) 投資信託証券

		買付		売付	
		口数	買付額	口数	売付額
		口	千円	口	千円
国内	エスコンジャパンリート投資法人	31 ()	4,427 (1,307)	25	3,494
	エスコンジャパンリート投資法人	9 (△)	1,307 (1,307)	—	—
	サンケイリアルエステート投資法人	30	3,632	45	5,758
	サンケイリアルエステート投資法人	22	2,669	—	—
	S O S i L A 物流リート投資法人	141	22,969	52	8,424
	東海道リート投資法人	53	6,000	5	550
	日本アコモデーションファンド投資法人	49	31,153	67	43,438
	MCUBS MidCity投資法人	— (△ 864)	— (△ 93,386)	—	—
	森ヒルズリート投資法人	183	28,735	244	39,113
	産業ファンド投資法人	222	44,136	292	61,219
	アドバンス・レジデンス投資法人	174	61,637	192	70,043
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	110	24,206	143	33,088
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	78	38,509	105	51,955
	GLP投資法人	538	99,050	630	120,267
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	72	24,659	95	32,894
日本プロロジスリート投資法人	242	83,513	324	117,035	
星野リゾート・リート投資法人	26	16,626	32	21,299	
Oneリート投資法人	22	6,829	31	10,038	

Ｊリート・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
国内	イオンリート投資法人	198	30,545	149	23,443
	ヒューリックリート投資法人	166	29,864	159	29,457
	日本リート投資法人	46	19,940	75	33,309
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,011	21,230	2,496	55,520
	積水ハウス・リート投資法人	457	41,606	613	57,271
	トーセイ・リート投資法人	25	3,339	44	6,130
	ケネディクス商業リート投資法人	78	21,774	78	22,728
	ヘルスケア&メディカル投資法人	27	3,795	38	5,513
	サムティ・レジデンシャル投資法人	37	4,655	27	3,284
	野村不動産マスターファンド投資法人	497	86,335	670	116,685
	いちごホテルリート投資法人	16	1,455	31	2,887
	ラサールロジポート投資法人	250	43,999	238	44,475
	スターアジア不動産投資法人	139	8,021	198	11,814
	マリモ地方創生リート投資法人	9	1,153	15	1,979
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	65	37,002	69	40,893
	大江戸温泉リート投資法人	17	1,390	29	2,379
	投資法人みらい	192	9,956	206	10,703
	森トラスト・ホテルリート投資法人	33	4,490	35	4,792
	三菱地所物流リート投資法人	56	24,711	48	23,318
	CREロジスティクスファンド投資法人	54	10,006	55	10,714
	ザイマックス・リート投資法人	16	1,827	29	3,550
	タカラレーベン不動産投資法人	39	4,691	52	6,416
	タカラレーベン不動産投資法人	33	3,709	—	—
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	51	7,259	72	10,972
	日本ビルファンド投資法人	172	119,779	227	160,208
	ジャパンリアルエステイト投資法人	153	103,051	206	140,888
	日本都市ファンド投資法人	772 (864)	85,240 (93,386)	997	114,544
	オリックス不動産投資法人	310	61,655	416	86,339
	日本プライムリアルティ投資法人	115	48,789	126	54,140
	NTT都市開発リート投資法人	137	21,544	186	29,747
	東急リアル・エステート投資法人	107	20,435	142	27,959
	グローバル・ワン不動産投資法人	107	13,233	141	17,716
ユナイテッド・アーバン投資法人	394	62,776	434	70,031	
森トラスト総合リート投資法人	111	17,234	149	23,287	
インヴィンシブル投資法人	777	33,616	852	36,161	
フロンティア不動産投資法人	50	24,467	55	27,566	

Jリート・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
国内	平和不動産リート投資法人	110 ()	18,093 (1,449)	130	22,121
	平和不動産リート投資法人	9 (△)	1,449 (△ 1,449)	-	-
	日本ロジスティクスファンド投資法人	102	32,474	137	45,095
	福岡リート投資法人	81	14,323	106	19,338
	ケネディクス・オフィス投資法人	47	36,686	63	49,000
	いちごオフィスリート投資法人	114	10,834	164	15,947
	大和証券オフィス投資法人	21	16,174	35	27,123
	阪急阪神リート投資法人	64	9,942	90	14,218
	スタートアップリート投資法人	20	4,513	29	6,884
	大和ハウスリート投資法人	219	67,086	295	96,577
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	501	32,665	771	51,434
	大和証券リビング投資法人	106	11,880	183	21,968
	ジャパンエクセレント投資法人	147	22,023	195	29,993
合 計	10,260	1,812,800	13,837	2,335,161	

※金額は受渡し代金。

※ () 内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 R E I T 指数先物取引	百万円 120	百万円 142	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年2月26日から2021年8月25日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
投資信託証券	百万円 1,812	百万円 394	% 21.7	百万円 2,335	百万円 177	% 7.6

(2) 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
投資信託証券	百万円 88

(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	1,610千円
(b) うち利害関係人への支払額	151千円
(c) (b) / (a)	9.4%

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2021年2月26日から2021年8月25日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2021年8月25日現在)

(1) 国内投資信託証券

銘	柄	期首 (前期末)		期		末	
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率
						千円	%
エスコンジャパンリート投資法人		115	130			17,732	0.2
サンケイリアルエステート投資法人		174	159			20,034	0.3
サンケイリアルエステート投資法人		—	22			2,709	0.0
S O S i L A 物流リート投資法人		184	273			47,283	0.6
東海道リート投資法人		—	48			5,150	0.1
日本アコモデーションファンド投資法人※		243	225			149,175	2.0
MCUBS MidCity投資法人		864	—			—	—
森ヒルズリート投資法人		830	769			120,579	1.6
産業ファンド投資法人		998	928			196,643	2.6
アドバンス・レジデンス投資法人		671	653			235,406	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		480	447			101,692	1.3
アクティブア・プロパティーズ投資法人		354	327			146,986	2.0
GLP投資法人※		2,207	2,115			406,926	5.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		317	294			101,136	1.3
日本プロロジスリート投資法人※		1,117	1,035			390,195	5.2
星野リゾート・リート投資法人※		107	101			69,690	0.9
One リート投資法人		110	101			33,128	0.4
イオンリート投資法人		717	766			114,440	1.5
ヒューリックリート投資法人		568	575			106,605	1.4
日本リート投資法人		230	201			86,530	1.1
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人※		4,543	3,058			69,294	0.9
積水ハウス・リート投資法人		2,079	1,923			177,492	2.4
トーセイ・リート投資法人		154	135			18,616	0.2
ケネディクス商業リート投資法人		260	260			75,920	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人		150	139			20,307	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		133	143			16,874	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人※		2,285	2,112			353,337	4.7
いちごホテルリート投資法人※		120	105			9,135	0.1
ラサールロジポート投資法人※		788	800			152,800	2.0
スターアジア不動産投資法人		728	669			38,735	0.5
マリモ地方創生リート投資法人		65	59			7,422	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人※		247	243			148,959	2.0
大江戸温泉リート投資法人		114	102			8,037	0.1
投資法人みらい		761	747			39,964	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		153	151			20,007	0.3
三菱地所物流リート投資法人		158	166			83,166	1.1
CRE ロジスティクスファンド投資法人		225	224			47,667	0.6
ザイマックス・リート投資法人		105	92			10,846	0.1
タカラレーベン不動産投資法人		215	202			23,108	0.3
タカラレーベン不動産投資法人		—	33			3,672	0.0
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人		275	254			40,868	0.5
日本ビルファンド投資法人※		795	740			515,780	6.8

Jリート・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
ジャパンリアルエステイト投資法人	706	653	429,021	5.7
日本都市ファンド投資法人	2,656	3,295	352,235	4.7
オリックス不動産投資法人	1,408	1,302	256,363	3.4
日本プライムリアルティ投資法人	440	429	171,171	2.3
N T T都市開発リート投資法人	640	591	90,895	1.2
東急リアル・エステート投資法人	473	438	82,957	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人	489	455	55,419	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,511	1,471	225,798	3.0
森トラスト総合リート投資法人	505	467	69,863	0.9
インヴィンシブル投資法人※	2,955	2,880	116,352	1.5
フロンティア不動産投資法人※	234	229	108,088	1.4
平和不動産リート投資法人	434	423	69,414	0.9
日本ロジスティクスファンド投資法人	462	427	144,539	1.9
福岡リート投資法人※	364	339	60,003	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人※	218	202	155,944	2.1
いちごオフィスリート投資法人※	586	536	50,652	0.7
大和証券オフィス投資法人※	150	136	104,312	1.4
阪急阪神リート投資法人	319	293	46,528	0.6
スターツプロシード投資法人	110	101	25,421	0.3
大和ハウスリート投資法人※	1,008	932	292,648	3.9
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,275	2,005	125,312	1.7
大和証券リビング投資法人※	919	842	100,198	1.3
ジャパンエクセレント投資法人	656	608	86,032	1.1
合 計	口 数 銘 柄 数	口 数 銘 柄 数	評 価 額 金 額	組 入 比 率 <比 率>
	44,157 62	40,580 64	7,453,227 <98.9%>	

※〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※外国籍の投資信託証券を含む場合があります。

※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。

※末尾に※印のある銘柄については、当ファンドの委託会社の利害関係人である株式会社三井住友銀行が一般事務受託会社になっております。(当該投資法人で開示されている直近の資産運用報告書等に基づき記載しています。)

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	期 末	
	買 建 額	売 建 額
国 内	百万円	百万円
東 証 R E I T 指 数	41	—

■ 投資信託財産の構成

(2021年8月25日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,453,227	98.8
投 資 信 託 財 産 総 額	90,598	1.2
	7,543,825	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年8月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	7,543,825,844円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	42,617,909
投 資 証 券 (評価額)	7,453,227,616
未 収 配 当 金	45,036,319
差 入 委 託 証 拠 金	2,944,000
(B) 負 債	8,523,455
未 払 金	3,527,594
未 払 解 約 金	4,994,252
未 払 利 息	115
そ の 他 未 払 費 用	1,494
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	7,535,302,389
元 本	2,778,402,071
次 期 繰 越 損 益 金	4,756,900,318
(D) 受 益 権 総 口 数	2,778,402,071口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	27,121円

※当期における期首元本額3,017,517,799円、期中追加設定元本額762,885,720円、期中一部解約元本額1,002,001,448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。

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	78,770,360円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	150,473,342円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	118,476,327円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,718,887,201円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	10,848,331円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	41,617,020円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	30,211,212円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	96,470,805円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	49,285,081円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	39,384,500円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	17,465,411円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,505,159円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	43,903,899円
日興FWS・Jリートインデックス	357,488円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	361,377円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,502,958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>	13,334,954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>	32,495,863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>	68,374,511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>	73,367,543円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド2021-05(リスク3%)<適格機関投資家限定>	188,308,729円

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

■ 損益の状況

(自2021年2月26日 至2021年8月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	96,719,586円
受 取 配 当 金	96,729,152
そ の 他 収 益	27,654
支 払 利 息	△ 37,220
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	438,835,830
売 買 損 益	513,095,650
売 買 損 益	△ 74,259,820
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	3,973,900
取 引 損 益	7,534,800
取 引 損 益	△ 3,560,900
(D) 信 託 報 酬 等	△ 4,898
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	539,524,418
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	4,679,493,348
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,278,367,297
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 1,740,484,745
(I) 計 (E + F + G + H)	4,756,900,318
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	4,756,900,318

※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。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

第33期（2021年2月26日から2021年8月25日まで）

信託期間	無期限（設定日：2005年6月21日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・日本を除く世界各国の不動産投資信託（リート）などを主要投資対象とし、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		投資信託 証券組 入率 比	純資産 総額
	騰落率	中率	騰落率	中率		
	円	%		%	%	百万円
29期（2019年8月26日）	21,144	△ 1.0	235.00	△ 0.6	99.4	5,204
30期（2020年2月25日）	24,224	14.6	270.04	14.9	98.7	7,673
31期（2020年8月25日）	18,760	△ 22.6	209.38	△ 22.5	99.1	7,606
32期（2021年2月25日）	21,787	16.1	243.93	16.5	99.1	10,232
33期（2021年8月25日）	26,128	19.9	293.88	20.5	99.3	15,061

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

※S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）の所有権およびその他一切の権利は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスが有しています。三井住友DSアセットマネジメントは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスとの間で同指数の算出・管理に関する契約を締結しています。S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、同指数の算出に関し、いかなるものに対しても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) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		株式組 入率 比	投資信託 証券組 入率 比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2021年2月25日	円	%		%	%	%
	21,787	—	243.93	—	—	99.1
2月末	21,491	△ 1.4	241.42	△ 1.0	—	99.1
3月末	23,076	5.9	258.55	6.0	0.0	99.0
4月末	24,143	10.8	270.80	11.0	—	99.3
5月末	24,683	13.3	277.02	13.6	—	99.6
6月末	25,439	16.8	285.79	17.2	—	99.2
7月末	26,078	19.7	293.24	20.2	—	99.5
(期末) 2021年8月25日	26,128	19.9	293.88	20.5	—	99.3

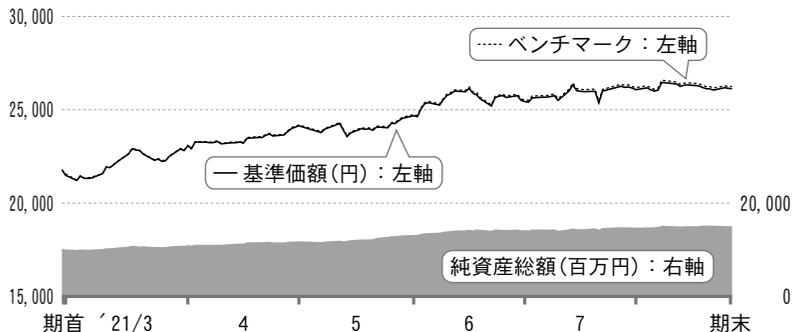
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2021年2月26日から2021年8月25日まで）

基準価額等の推移



期首	21,787円
期末	26,128円
騰落率	+19.9%

※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、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）です。

※S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）の所有権およびその他一切の権利は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスが有しています。三井住友DSアセットマネジメントは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスとの間で同指数の算出・管理に関する契約を締結しています。S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、同指数の算出に関し、いかなるものに対しても責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因（2021年2月26日から2021年8月25日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の上場リートに投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- ・世界経済の回復期待により、グローバルリート市場が上昇したこと
- ・主要通貨が対円で上昇したこと

▶ **投資環境について（2021年2月26日から2021年8月25日まで）**

グローバルリート市場は、上昇しました。米ドルは、対円で上昇しました。

リート市場

期を通じて上昇基調で推移しました。途中、欧州における新型コロナウイルスワクチン接種の遅れなどにより下落する局面もありました。しかし、米国を中心にワクチン接種の進展やバイデン政権による経済刺激策などを受けた世界経済の回復期待から、通期では上昇しました。

為替市場

米ドル・円は、ワクチン接種が進展するなか、世界的な景気回復により市場がリスク選好的な動きになったことから、米ドルが強含みました。また6月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で想定される利上げ時期が前倒しされたことから米国の量的緩和の早期縮小観測が強まったこともあり、通期では米ドルが対円で上昇しました。

▶ **ポートフォリオについて（2021年2月26日から2021年8月25日まで）**

ポートフォリオの特性

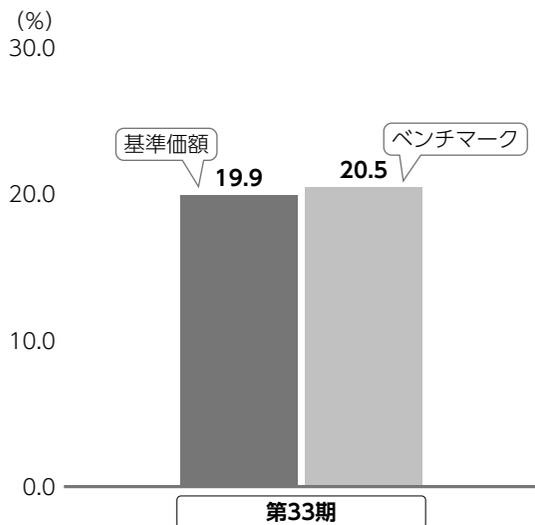
S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

日々の追加設定・解約による資金移動に応じてリーートの売買を行い、トラッキングエラー（ポートフォリオのリターンとベンチマークのリターンとの乖離）の抑制に努めました。

また、3、6月のベンチマークの定期銘柄見直しに応じて、ポートフォリオの修正を行いました。

▶ ベンチマークとの差異について（2021年2月26日から2021年8月25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S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）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+19.9%となり、ベンチマークの騰落率+20.5%を0.6%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
- ・売買コストや証券保管コストが生じたこと

2 今後の運用方針

引き続き、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。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、リート組入比率を高位に保つことを基本とします。

■ 1万口当たりの費用明細 (2021年2月26日から2021年8月25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)	10円 (0) (10)	0.043% (0.000) (0.043)	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 (投資信託証券)	3 (3)	0.011 (0.011)	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)	8 (8) (0)	0.033 (0.032) (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 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送回金・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	21	0.087	

期中の平均基準価額は24,151円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年2月26日から2021年8月25日まで)

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル
		23	44	(23)	(44)

※金額は受渡し代金。

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

(2) 投資信託証券

		買付		売付		
		口数	買付額	口数	売付額	
外国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル	
		ACADIA REALTY TRUST	4,171	88	3,155	66
		AGREE REALTY CORP	3,269	235	1,914	141
		ALEXANDER & BALDWIN INC	2,071	36	1,115	19
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	3,880	709	725	138
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,765	65	1,426	53
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	2,824	131	536	22
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	3,893	37	—	—
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	3,850	148	—	—
		AMERICOLD REALTY TRUST	7,884	299	—	—
		APARTMENT INVESTMENT & MANAGEMENT CO-A	6,178	47	—	—
		APARTMENT INCOME REIT CORP	4,562	218	1,044	54
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	3,589	55	—	—
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	1,848	23	—	—
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,870	585	569	116

外国リート・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	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,163	97	5,215	54
	BOSTON PROPERTIES INC	2,496	282	380	42
	BRANDYWINE REALTY TRUST	1,770	25	—	—
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,316	143	1,654	38
	BROADSTONE NET LEASE INC	(11,864 2,372)	(291 44)	—	—
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	—	—	3,309	61
	CIM COMMERCIAL TRUST CORP	5,279	43	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,896	243	251	33
	CARETRUST REIT INC	1,657	36	—	—
	COLONY CAPITAL INC-CLASS A	12,578	83	3,596	23
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,927	85	1,329	22
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	975	49	—	—
	CORESITE REALTY CORPORATION	1,301	164	551	74
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,641	44	—	—
	COUSINS PROPERTIES INC	2,899	109	1,218	46
	CUBESMART	3,658	160	—	—
	CYRUSONE INC	2,320	173	439	33
	DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	6,305	65	2,340	23
	DIGITAL REALTY TRUST INC	6,385	962	1,641	249
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	11,016	43	—	—
	DOUGLAS EMMETT INC	3,362	116	588	20
	DUKE REALTY CORP	6,724	318	774	39
	EPR PROPERTIES	1,803	90	35	1
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	1,813	38	—	—
	EASTGROUP PROPERTIES INC	667	104	—	—
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6,321	79	3,915	47
	EQUINIX INC	1,914	1,449	433	351
	EQUITY COMMONWEALTH REIT	1,457	40	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,569	261	1,117	85
	EQUITY RESIDENTIAL	8,987	686	3,200	248
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	3,259	86	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,007	301	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,763	423	237	41
	FARMLAND PARTNERS INC	2,873	36	1,956	26
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	1,450	163	—	—
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	2,566	129	—	—
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1,493	38	—	—
	FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	2,315	15	—	—
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	5,251	243	1,147	55
	GLADSTONE LAND CORP	1,130	20	—	—
GLOBAL NET LEASE INC	1,416	28	—	—	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2,427	74	—	—	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	6,142	175	2,215	64	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,313	314	1,190	40	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	—	—	1,025	10	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,499	109	—	—	

国

外国リート・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	SERVICE PROPERTIES TRUST	2,712	34	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,333	913	1,983	247
	SITE CENTERS CORP	2,637	37	—	—
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2,856	138	800	41
	STAG INDUSTRIAL INC	2,951	107	—	—
	STORE CAPITAL CORP	4,576	158	—	—
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,014	38	1,269	12
	SUN COMMUNITIES INC	2,561	432	412	77
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	2,606	33	—	—
	TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	3,207	61	—	—
	TERRENO REALTY CORP	1,734	108	596	37
	UDR INC	5,940	281	948	45
	UMH PROPERTIES INC	970	21	—	—
	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	569	36	—	—
	URBAN EDGE PROPERTIES	2,077	35	2,183	37
	VENTAS INC	8,613	486	2,252	127
	VEREIT INC	5,371	247	696	34
	VICI PROPERTIES INC	10,720	331	1,757	52
	VORNADO REALTY TRUST	4,579	216	2,356	108
	WP CAREY INC	2,817	213	—	—
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	—	—	682	2
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	921	21	—	—
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3,068	90	(11,210)	(309)
	WELLTOWER INC	8,550	671	1,628	132
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	1,355	26	781	16
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	(—)	(△ 0.9072)	—	—
PRIME US REIT	(39,200)	(△ 0.65582)	—	—	
小 計	(548,860)	(24,231)	(104,149)	(5,119)	
国 カ ナ ダ	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	□ 950	□ 千カナダドル 40	□ —	□ 千カナダドル —
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	846	10	809	9
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	803	13	—	—
	CAN APARTMENT PROP	2,087	123	760	46
	CHOICE PROPERTIES REIT	2,743	40	—	—
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	1,709	18	2,729	26
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,285	39	—	—
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVEST TRUS	1,429	31	1,210	27
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	3,149	48	—	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	1,933	33	—	—
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	705	58	325	26
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,849	59	—	—
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	757	12	—	—
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,104	21	—	—
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	533	12	—	—	

外国リート・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		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	605	7	—	—	
		PLAZA RETAIL REIT	8,509	34	—	—	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,516	53	—	—	
		SLATE OFFICE REIT	2,663	12	—	—	
		SLATE GROCERY REIT	2,696	33	—	—	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,097	32	—	—	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	3,826	78	3,319	67	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	—	—	1,833	13	
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	968	18	—	—	
		小 計	47,762	836	10,985	218	
ユ	ド イ ツ		□ 3,371	千ユーロ □ 50	□ 172	千ユーロ □ 2	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	(—)	(△ 6)			
		HAMBORNER REIT AG	870	8	372	3	
		小 計	(4,241 —)	(△ 59 6)	544	6	
	イ タ リ ア	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,300	17	2,910	12	
		小 計	4,300	17	2,910	12	
	フ ラ ン ス		ICADE	1,444	105	852	63
			ALTAREA	(49 —)	(△ 8 2)	152	23
			KLEPIERRE	(3,033 —)	(△ 67 17)	—	—
			GECINA SA	952	124	—	—
		COVIVIO	621	47	—	—	
		MERCIALYS	1,131	11	—	—	
		CARMILA	(2,951 —)	(△ 38 1)	831	11	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	2,502	182	228	16		
	小 計	(12,683 —)	(△ 586 20)	2,063	114		
オ ラ ン ダ		EUROCOMMERCIAL	(690 150)	(15 —)	500	10	
		VASTNED RETAIL	812	20	232	5	
		NSI NV	1,042	37	626	21	
		小 計	(2,544 150)	(73 —)	1,358	38	
ス ペ イ ン		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	(5,053 —)	(△ 45 4)	—	—	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	(—)	(△0.46951)	—	—	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	(5,348 —)	(△ 50 7)	—	—	
	小 計	(10,401 —)	(△ 95 12)	—	—		
口	ベ ル ギ ー		BEFIMMO SCA	166	5	161	5
			COFINIMMO	821	105	93	11
			RETAIL ESTATES	537	37	294	20
			MONTEA NV	236	21	113	10
			AEDIFICA	638	68	—	—

外国リート・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	ユ	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,643	83	—	—	
		CARE PROPERTY INVEST	1,233	32	118	3	
		XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS	(800)	(—)	800	0.3513	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	1,414	70	615	32	
	小	計	(7,688 800)	(425 —)	2,194	83	
	アイルランド	HIBERNIA REIT PLC	20,821	25	—	—	
	小	計	20,821	25	—	—	
	そ の 他	CROMWELL REIT EUR	11,700	29	13,500	33	
	そ の 他	CROMWELL EUROPEAN REIT	(14,200 15,320)	(33 36)	—	—	
	そ の 他	CROMWELL EUROPEAN REIT	(△ 76,600)	(△ 36)	—	—	
	小	計	(△ 25,900 61,280)	(63 —)	13,500	33	
	ユ	—	口 計	(△ 88,578 60,330)	(△ 1,346 40)	22,569	288
	イ ギ リ ス	国		口	千英ポンド	口	千英ポンド
			BRITISH LAND CO PLC	16,843	87	3,751	18
DERWENT LONDON PLC			3,410	121	1,673	60	
BIG YELLOW GROUP PLC			1,903	25	—	—	
UNITE GROUP PLC			8,485	96	—	—	
SHAFTESBURY PLC			4,010	23	—	—	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST			110,903	52	55,205	26	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT			23,562	17	—	—	
SAFESTORE HOLDINGS PLC			5,547	49	—	—	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC			15,610	35	—	—	
SEGRO PLC			24,734	264	5,044	59	
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE			4,955	8	—	—	
WORKSPACE GROUP PLC			4,137	34	—	—	
GCP STUDENT LIVING PLC			11,843	19	—	—	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC			9,613	11	—	—	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC			40,430	46	14,333	16	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC			5,958	43	4,594	33	
TRITAX BIG BOX REIT PLC			28,147	55	—	—	
RDI REIT PLC			24,543	29	32,563	39	
CUSTODIAN REIT PLC			28,951	29	—	—	
HOME REIT PLC			17,550	19	—	—	
HAMMERSON PLC			150,984	59	—	—	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC			21,036	18	47,365	39	
ASSURA PLC			42,146	31	—	—	
LXI REIT PLC			12,871	18	—	—	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC			29,686	46	—	—	
LAND SECURITIES GROUP PLC	12,081	86	—	—			
小	計	659,938	1,332	164,528	293		
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		
BWP TRUST	10,762	46	9,999	40			

外国リート・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	MIRVAC GROUP	75,312	205	—	—
	GPT GROUP	22,462	106	—	—
	CENTURIA CAPITAL GROUP	22,389	60	—	—
	ABACUS PROPERTY GROUP	28,243	88	18,472	57
	STOCKLAND	61,282	286	29,543	137
	DEXUS	19,165	200	—	—
	GOODMAN GROUP	42,621	846	15,972	324
	CHARTER HALL GROUP	6,472	93	—	—
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	14,509	54	—	—
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	6,393	35	—	—
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	18,879	45	—	—
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	10,755	51	8,879	41
	NATIONAL STORAGE REIT	11,173	23	—	—
	GDI PROPERTY GROUP	25,204	27	—	—
	APN INDUSTRIA REIT	12,221	36	—	—
	HOME CONSORTIUM	12,402	67	12,679	72
	RURAL FUNDS GROUP	15,701	38	—	—
	CENTURIA OFFICE REIT	19,525	48	—	—
	WAYPOINT REIT LTD	53,185	137	22,633	58
	SCENTRE GROUP	102,765	282	—	—
HOMECO DAILY NEEDS REIT	35,492	46	—	—	
VICINITY CENTRES	67,562	112	—	—	
AVENTUS GROUP	10,000	31	—	—	
小 計	704,474	2,974	118,177	734	
ニュージーランド	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	45,988	76	—	—
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	14,266	45	13,774	43
	GOODMAN PROPERTY TRUST	8,430	19	—	—
	ARGOSY PROPERTY LTD	43,280	65	—	—
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	27,252	32	22,748	27
小 計	139,216	238	36,522	70	
香 港	LINK REIT	39,100	2,906	4,900	366
	PROSPERITY REIT	38,000	104	—	—
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	110,000	443	87,000	346
	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	43,000	194	—	—
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,000	107	—	—
FORTUNE REIT	16,000	135	—	—	
小 計	273,100	3,890	91,900	713	
シ ン ガ ポ ー ル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	119,400	255	27,200	57
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	(64,500 —)	(Δ 193 5)	—	—
	SUNTEC REIT	39,200	57	—	—
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	(32,400 —)	(Δ 64 1)	—	—
	KEPPEL REIT	59,800	68	—	—

外国リート・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	FRASERS CENTREPOINT TRUST	24,400	57	—	—
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	—	14,200	17
	CAPITALAND CHINA TRUST	22,000	30	—	—
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	(148,400 —)	(△ 38 1)	—	—
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	(— —)	(△0.23542)	—	—
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	(288,700 —)	(△0.56009)	—	—
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	(49,900 —)	(△ 0.1278)	—	—
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	(30,700 —)	(△0.79625)	—	—
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	(— —)	(△0.05395)	27,400	19
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	(14,800 —)	(△0.28576)	—	—
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	(— —)	(△ 2)	—	—
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	53,600	31	—	—
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	—	—	26,000	13
	EC WORLD REIT	(52,800 —)	(△0.80889)	—	—
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	64,200	61	79,000	73
	ASCOTT TRUST	(72,100 —)	(△0.36053)	—	—
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	(— —)	(△0.17024)	—	—
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	(92,700 —)	(△0.09593)	—	—
	IREIT GLOBAL	57,600	36	—	—
	KEPPEL DC REIT	(10,200 —)	(△0.71941)	—	—
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	(56,700 —)	(△ 82 1)	—	—	
小 計	(1,354,100 —)	(△ 1,416 16)	173,800	181	
国 韓 国	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	□ 2,202	千韓国ウォン 18,082	□ —	千韓国ウォン —
	LOTTE REIT CO LTD	2,819	17,558	—	—
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	2,600	12,765	—	—
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	8,325	62,791	—	—
	小 計	15,946	111,197	—	—
イ ス ラ エ ル	REIT 1 LTD	□ 2,972	千イスラエルシュケル 51	□ —	千イスラエルシュケル —
小 計	2,972	51	—	—	

※金額は受渡し代金。

※（ ）内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年2月26日から2021年8月25日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	4,908千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	4,774千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	1.02

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年2月26日から2021年8月25日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

(2021年2月26日から2021年8月25日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2021年8月25日現在)

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	%
ACADIA REALTY TRUST		7,231		8,247	173	19,008	0.1
AGREE REALTY CORP		4,381		5,736	419	46,121	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC		4,576		5,532	111	12,270	0.1
ALEXANDER'S INC		136		136	36	4,011	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.		8,946		12,101	2,474	271,892	1.8
AMERICAN ASSETS TRUST INC		3,856		4,195	160	17,581	0.1
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC		9,656		11,944	584	64,217	0.4
AMERICAN FINANCE TRUST INC		6,262		10,155	86	9,493	0.1
AMERICAN HOMES 4 RENT-A		19,922		23,772	961	105,638	0.7
AMERICOLD REALTY TRUST		14,624		22,508	818	89,957	0.6
APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A		9,715		15,893	107	11,837	0.1
APARTMENT INCOME REIT CORP		10,468		13,986	693	76,179	0.5
APPLE HOSPITALITY REIT INC		14,879		18,468	269	29,621	0.2
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC		3,000		4,848	62	6,918	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC		10,010		12,311	2,730	299,967	2.0
BRT APARTMENTS CORP		500		500	9	1,033	0.0
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH		600		4,548	52	5,720	0.0
BOSTON PROPERTIES INC		10,408		12,524	1,431	157,291	1.0
BRANDYWINE REALTY TRUST		13,383		15,153	211	23,255	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		21,772		26,434	602	66,212	0.4
BROADSTONE NET LEASE INC		—		14,236	377	41,507	0.3
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC		3,309		—	—	—	—
CIM COMMERCIAL TRUST CORP		—		5,279	38	4,233	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST		6,983		8,628	1,229	135,071	0.9
CARETRUST REIT INC		6,670		8,327	182	20,034	0.1
CENTERSPACE		1,026		1,026	97	10,694	0.1
CHATHAM LODGING TRUST		4,019		4,019	47	5,192	0.0
CITY OFFICE REIT INC		4,603		4,603	73	8,121	0.1
CLIPPER REALTY INC		800		800	6	697	0.0
COLONY CAPITAL INC-CLASS A		34,696		—	—	—	—
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC		7,180		10,778	179	19,738	0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I		1,483		2,458	117	12,932	0.1
CORESITE REALTY CORPORATION		3,041		3,791	545	59,898	0.4
COREPOINT LODGING INC		4,226		4,226	58	6,397	0.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES		8,127		9,768	275	30,293	0.2
COUSINS PROPERTIES INC		11,001		12,682	497	54,643	0.4
CTO REALTY GROWTH INC		310		310	16	1,842	0.0
CUBESMART		14,237		17,895	909	99,928	0.7
CYRUSONE INC		8,925		10,806	814	89,522	0.6
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY		14,211		18,176	159	17,472	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC		20,087		24,831	4,012	440,779	2.9
DIGITALBRIDGE GROUP INC-CLASS A		—		43,678	297	32,677	0.2

外国リート・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	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	16,755	27,771	100	11,074	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	11,476	14,250	454	49,939	0.3
DUKE REALTY CORP	27,117	33,067	1,642	180,438	1.2
EPR PROPERTIES	5,198	6,966	340	37,414	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	5,244	7,057	151	16,598	0.1
EASTGROUP PROPERTIES INC	2,804	3,471	595	65,404	0.4
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	10,409	12,815	130	14,388	0.1
EQUINIX INC	6,421	7,902	6,481	712,061	4.7
EQUITY COMMONWEALTH REIT	8,994	10,451	270	29,725	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	12,500	14,952	1,228	134,908	0.9
EQUITY RESIDENTIAL	24,554	30,341	2,480	272,560	1.8
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	7,194	10,453	321	35,358	0.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,729	5,736	1,806	198,505	1.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	9,266	11,792	2,096	230,334	1.5
FARMLAND PARTNERS INC	300	1,217	14	1,592	0.0
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	4,841	6,291	742	81,518	0.5
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	9,075	11,641	632	69,519	0.5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	5,235	6,728	182	20,067	0.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	6,015	28	3,152	0.0
GEO GROUP INC	9,546	9,546	73	8,085	0.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	15,615	19,719	946	103,983	0.7
GETTY REALTY CORPORATION	3,220	3,220	99	10,983	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	3,102	3,102	69	7,606	0.1
GLADSTONE LAND CORP	600	1,730	40	4,464	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	6,857	8,273	141	15,559	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,403	4,403	67	7,376	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	9,567	11,994	357	39,305	0.3
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	15,370	19,297	571	62,751	0.4
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	39,203	47,326	1,663	182,753	1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,901	2,876	26	2,884	0.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	7,022	9,521	435	47,822	0.3
HOST HOTELS AND RESORTS INC	50,570	62,702	999	109,801	0.7
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	11,456	13,192	345	37,956	0.3
INDEPENDENCE REALTY TRUST	6,669	10,144	202	22,221	0.1
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	4,808	6,274	168	18,472	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,559	2,085	500	54,944	0.4
INVITATION HOMES INC	40,791	50,057	2,007	220,520	1.5
IRON MOUNTAIN INC	20,399	25,461	1,165	128,025	0.9
JBG SMITH PROPERTIES	7,477	9,249	272	29,883	0.2
KILROY REALTY CORP	7,690	9,193	602	66,171	0.4
KIMCO REALTY CORPORATION	30,414	52,918	1,144	125,747	0.8
KITE REALTY GROUP TRUST	7,036	7,036	134	14,787	0.1
LTC PROPERTIES INC	2,847	3,325	114	12,532	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	19,964	23,367	309	33,988	0.2
LIFE STORAGE INC	5,184	6,748	817	89,849	0.6
MACERICH COMPANY/THE	7,392	14,261	232	25,521	0.2

外国リート・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	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	7,519	7,798	136	15,000	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	41,554	51,869	1,045	114,821	0.8
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	8,335	10,096	1,880	206,600	1.4
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	7,136	9,490	180	19,850	0.1
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	3,379	4,003	241	26,496	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	12,217	15,676	724	79,564	0.5
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	4,465	7,212	392	43,172	0.3
NETSTREIT CORP	1,000	2,801	72	7,929	0.1
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	5,922	5,922	50	5,503	0.0
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	1,760	1,760	106	11,740	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	3,872	3,872	101	11,195	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	15,963	20,948	696	76,542	0.5
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,014	1,014	31	3,511	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,568	1,747	262	28,875	0.2
PARAMOUNT GROUP INC	11,445	14,599	130	14,386	0.1
PARK HOTELS AND RESORTS INC	17,591	20,001	373	41,067	0.3
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	9,393	11,099	234	25,776	0.2
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	—	5,400	10	1,192	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	14,181	19,886	368	40,460	0.3
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	9,036	11,314	203	22,398	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1,781	3,830	86	9,526	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,900	2,900	33	3,730	0.0
PROLOGIS INC	53,173	65,262	8,533	937,436	6.2
PUBLIC STORAGE	11,016	13,382	4,253	467,256	3.1
QTS REALTY TRUST INC-CL A	4,755	6,154	478	52,612	0.3
RLJ LODGING TRUST	11,185	14,708	210	23,090	0.2
RPT REALTY	6,346	6,346	79	8,756	0.1
REALTY INCOME CORPORATION	25,464	32,942	2,333	256,370	1.7
REGENCY CENTERS CORP	11,097	14,082	922	101,316	0.7
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	7,539	9,864	173	19,039	0.1
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	17,002	19,526	240	26,385	0.2
RETAIL VALUE INC	655	2,032	49	5,469	0.0
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	9,179	11,978	721	79,296	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3,826	4,944	390	42,865	0.3
SL GREEN REALTY CORP	5,137	6,241	448	49,297	0.3
SABRA HEALTH CARE REIT	14,693	18,103	290	31,880	0.2
SAFEHOLD INC	1,242	1,242	109	11,986	0.1
SAUL CENTERS INC	703	894	40	4,441	0.0
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,600	3,468	52	5,798	0.0
SERVICE PROPERTIES TRUST	10,711	13,423	150	16,530	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	23,621	28,971	3,840	421,905	2.8
SITE CENTERS CORP	12,194	14,831	232	25,531	0.2
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	8,476	10,532	522	57,354	0.4
STAG INDUSTRIAL INC	11,018	13,969	572	62,935	0.4
STORE CAPITAL CORP	17,088	21,664	760	83,585	0.6
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	6,976	9,721	87	9,558	0.1

外国リート・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		
SUN COMMUNITIES INC	7,712	9,861	1,941	213,318	1.4	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	15,464	18,070	204	22,412	0.1	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	5,911	9,118	152	16,748	0.1	
TERRENO REALTY CORP	4,963	6,101	399	43,888	0.3	
UDR INC	21,168	26,160	1,363	149,818	1.0	
UMH PROPERTIES INC	2,728	3,698	84	9,246	0.1	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	775	1,344	79	8,687	0.1	
URBAN EDGE PROPERTIES	9,028	8,922	165	18,191	0.1	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	2,927	2,927	55	6,125	0.0	
VENTAS INC	26,720	33,081	1,803	198,177	1.3	
VEREIT INC	15,530	20,205	997	109,543	0.7	
VICI PROPERTIES INC	38,340	47,303	1,394	153,146	1.0	
VORNADO REALTY TRUST	11,162	13,385	558	61,318	0.4	
WP CAREY INC	12,822	15,639	1,198	131,658	0.9	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	682	—	—	—	—	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,882	6,803	164	18,079	0.1	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	8,142	—	—	—	—	
WELLTOWER INC	30,111	37,033	3,128	343,702	2.3	
WHITESTONE REIT	4,511	4,511	43	4,767	0.0	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	9,012	9,586	163	17,966	0.1	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	54,000	54,000	40	4,449	0.0	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000	20,000	2	301	0.0	
PRIME US REIT	15,000	54,200	45	5,031	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	121,700	121,700	88	9,760	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	1,750,750 154	2,202,406 154	102,083 —	11,214,864 <74.5%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	4,531	5,481	235	20,556	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,337	5,337	61	5,386	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	1,678	1,715	22	1,958	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,000	2,000	93	8,105	0.1	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,200	4,003	70	6,130	0.0	
CAN APARTMENT PROP	6,062	7,389	444	38,731	0.3	
CHOICE PROPERTIES REIT	12,026	14,769	219	19,154	0.1	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR	8,945	7,925	86	7,563	0.1	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,613	4,898	89	7,778	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	1,695	38	3,368	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	5,837	8,986	148	12,930	0.1	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	7,380	9,313	163	14,286	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2,390	2,770	247	21,533	0.1	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,100	12,949	207	18,058	0.1	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	4,450	5,207	89	7,815	0.1	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	3,017	4,121	87	7,611	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	914	1,447	33	2,949	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RE	1,557	1,557	28	2,513	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	7,085	7,690	100	8,753	0.1	

外国リート・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		
PLAZA RETAIL REIT	—	8,509	38	3,381	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,952	13,468	295	25,778	0.2	
SLATE OFFICE REIT	1,000	3,663	19	1,720	0.0	
SLATE GROCERY REIT	500	3,196	43	3,777	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	5,277	6,374	191	16,705	0.1	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,456	6,963	147	12,854	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	6,603	4,770	35	3,134	0.0	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	2,449	3,417	93	8,166	0.1	
小計	口数 銘柄数	金額 <比率>	122,835 26	159,612 27	3,335 —	290,705 <1.9%>
(ユーロ・・・ドイツ)						
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	12,433	15,632	千ユーロ 275	35,511	0.2	
HAMBORNER REIT AG	6,085	6,583	65	8,405	0.1	
小計	口数 銘柄数	金額 <比率>	18,518 2	22,215 2	340 —	43,916 <0.3%>
(ユーロ・・・イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,408	4,798	千ユーロ 18	2,410	0.0	
小計	口数 銘柄数	金額 <比率>	3,408 1	4,798 1	18 —	2,410 <0.0%>
(ユーロ・・・フランス)						
ICADE	2,132	2,724	千ユーロ 198	25,669	0.2	
ALTAREA	432	329	62	8,021	0.1	
KLEPIERRE	14,137	17,170	348	44,940	0.3	
GECINA SA	3,890	4,842	632	81,606	0.5	
COVIVIO	3,596	4,217	329	42,464	0.3	
MERCIALYS	2,280	3,411	33	4,320	0.0	
CARMILA	2,634	4,754	55	7,175	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	9,952	12,226	890	114,832	0.8	
小計	口数 銘柄数	金額 <比率>	39,053 8	49,673 8	2,550 —	329,030 <2.2%>
(ユーロ・・・オランダ)						
EUROCOMMERCIAL	2,557	2,897	千ユーロ 62	8,102	0.1	
VASTNED RETAIL	925	1,505	35	4,630	0.0	
WERELDHAVE NV	3,304	3,304	44	5,715	0.0	
NSI NV	1,579	1,995	69	8,930	0.1	
小計	口数 銘柄数	金額 <比率>	8,365 4	9,701 4	212 —	27,378 <0.2%>
(ユーロ・・・スペイン)						
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	17,475	22,528	千ユーロ 206	26,576	0.2	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	4,421	4,421	24	3,136	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	24,871	30,219	291	37,602	0.2	
小計	口数 銘柄数	金額 <比率>	46,767 3	57,168 3	521 —	67,315 <0.4%>
(ユーロ・・・ベルギー)						
BEFIMMO SCA	2,235	2,240	千ユーロ 77	9,983	0.1	
COFINIMMO	1,903	2,631	363	46,938	0.3	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	金額	口数	金額	組入比率	
					外貨建金額	邦貨換算金額
RETAIL ESTATES	638		881	60	7,807	0.1
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	2,057		2,057	51	6,633	0.0
MONTEA NV	773		896	106	13,777	0.1
AEDIFICA	2,455		3,093	376	48,557	0.3
WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,306		11,949	453	58,450	0.4
CARE PROPERTY INVEST	1,592		2,707	75	9,690	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV	800		1,599	84	10,911	0.1
小計	口数 銘柄数	金額 <比率>	口数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	組入比率
	21,759 9		28,053 9	1,649 -	212,752 <1.4%>	
(ユーロ・・・アイルランド)				千ユーロ		
HIBERNIA REIT PLC	35,190		56,011	71	9,176	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	38,432		38,432	57	7,436	0.0
小計	口数 銘柄数	金額 <比率>	口数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	組入比率
	73,622 2		94,443 2	128 -	16,612 <0.1%>	
(ユーロ・・・その他)				千ユーロ		
CROMWELL REIT EUR	-		27,720	69	9,011	0.1
CROMWELL EUROPEAN REIT	76,600		-	-	-	-
小計	口数 銘柄数	金額 <比率>	口数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	組入比率
	76,600 1		27,720 1	69 -	9,011 <0.1%>	
ユーロ計	口数 銘柄数	金額 <比率>	口数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	組入比率
	288,092 30		293,771 30	5,491 -	708,428 <4.7%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC	70,201		83,293	433	65,339	0.4
DERWENT LONDON PLC	7,653		9,390	349	52,640	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC	12,633		14,536	220	33,305	0.2
INTU PROPERTIES PLC	28,500		28,500	0.285	42	0.0
UNITE GROUP PLC	27,991		36,476	436	65,843	0.4
SHAFTESBURY PLC	23,307		27,317	175	26,394	0.2
STANDARD LIFE INV PROP INC	53,280		53,280	38	5,862	0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000		70,698	35	5,349	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141		57,141	54	8,243	0.1
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	35,000		58,562	46	7,000	0.0
SAFESTORE HOLDINGS PLC	12,933		18,480	210	31,756	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	65,725		81,335	209	31,607	0.2
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	63,210		63,210	63	9,547	0.1
SEGR0 PLC	85,432		105,122	1,339	201,879	1.3
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	64,631		69,586	119	17,947	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	9,219		13,356	124	18,794	0.1
GCP STUDENT LIVING PLC	31,176		43,019	91	13,779	0.1
NEWRIVER REIT PLC	17,642		17,642	14	2,143	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	42,625		52,238	56	8,504	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770		34,770	37	5,629	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	47,251		73,348	89	13,488	0.1
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	19,544		20,908	161	24,409	0.2
TRITAX BIG BOX REIT PLC	121,677		149,824	350	52,847	0.4
REDI REIT PLC	8,020		-	-	-	-

外国リート・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		
CUSTODIAN REIT PLC	27,002	55,953	54	8,282	0.1	
HOME REIT PLC	—	17,550	20	3,015	0.0	
HAMMERSON PLC	229,862	380,846	128	19,427	0.1	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	67,150	40,821	38	5,851	0.0	
ASSURA PLC	192,407	234,553	181	27,401	0.2	
AEW UK REIT PLC	9,000	9,000	9	1,400	0.0	
LXI REIT PLC	36,635	49,506	72	10,984	0.1	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	88,137	117,823	195	29,411	0.2	
REGIONAL REIT LTD	45,664	45,664	40	6,043	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	53,906	65,987	472	71,199	0.5	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	23,000	23,000	26	4,056	0.0	
小計	1,727,324	2,222,734	5,900	889,432		
	口数・金額 銘柄数<比率>	34	34	—	<5.9%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BWP TRUST	44,252	45,015	182	14,551	0.1	
MIRVAC GROUP	277,214	352,526	1,096	87,291	0.6	
CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718	158,718	143	11,436	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	42,995	42,995	165	13,145	0.1	
GPT GROUP	145,221	167,683	811	64,618	0.4	
CENTURIA CAPITAL GROUP	24,254	46,643	155	12,403	0.1	
ABACUS PROPERTY GROUP	23,209	32,980	112	8,980	0.1	
STOCKLAND	170,508	202,247	938	74,717	0.5	
DEXUS	79,907	99,072	1,040	82,825	0.5	
GOODMAN GROUP	121,135	147,784	3,397	270,513	1.8	
CHARTER HALL GROUP	34,432	40,904	740	58,947	0.4	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	15,930	30,439	124	9,888	0.1	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	21,419	27,812	174	13,906	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	73,925	92,804	244	19,433	0.1	
ARENA REIT	28,622	28,622	115	9,206	0.1	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	40,528	40,528	160	12,746	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	45,425	47,301	247	19,696	0.1	
NATIONAL STORAGE REIT	80,507	91,680	209	16,715	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	15,921	15,921	53	4,297	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	18,000	43,204	49	3,921	0.0	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	33,955	33,955	123	9,840	0.1	
APN INDUSTRIA REIT	1,000	13,221	46	3,715	0.0	
HOME CONSORTIUM	10,000	9,723	58	4,637	0.0	
RURAL FUNDS GROUP	10,000	25,701	68	5,422	0.0	
IRONGATE GROUP	42,404	42,404	66	5,266	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	24,034	43,559	108	8,601	0.1	
WAYPOINT REIT LTD	50,503	81,055	221	17,618	0.1	
SCENTRE GROUP	363,619	466,384	1,268	101,003	0.7	
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	5,000	40,492	63	5,093	0.0	
VICINITY CENTRES	268,793	336,355	560	44,589	0.3	
AVENTUS GROUP	25,000	35,000	115	9,168	0.1	
小計	2,296,430	2,882,727	12,863	1,024,201		
	口数・金額 銘柄数<比率>	31	31	—	<6.8%>	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		組入比率
	口数	口数	評価額	評価額	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)					
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	64,995	110,983	185	14,130	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	35,571	36,063	118	9,004	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	83,533	91,963	240	18,334	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	39,995	83,275	135	10,348	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	127,180	131,684	150	11,445	0.1
小計	351,274	453,968	829	63,263	
	口数	口数	—	<0.4%>	
(香港)					
LINK REIT	148,100	182,300	13,271	187,260	1.2
PROSPERITY REIT	60,000	98,000	303	4,286	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	153,000	176,000	705	9,958	0.1
CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	127,000	170,000	746	10,530	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	54,000	81,000	392	5,543	0.0
FORTUNE REIT	114,000	130,000	1,082	15,279	0.1
小計	656,100	837,300	16,503	232,858	
	口数	口数	—	<1.5%>	
(シンガポール)					
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	314,508	406,708	850	68,936	0.5
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	227,300	291,800	901	73,124	0.5
SUNTEC REIT	147,500	186,700	272	22,106	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	219,750	252,150	519	42,125	0.3
STARHILL GLOBAL REIT	138,200	138,200	83	6,780	0.0
KEPPEL REIT	143,100	202,900	223	18,100	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	92,500	116,900	268	21,805	0.1
ESR REIT	217,952	217,952	103	8,396	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	83,250	69,050	81	6,607	0.0
CAPITALAND CHINA TRUST	61,000	83,000	106	8,616	0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	176,400	45	3,719	0.0
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	29,800	29,800	143	11,600	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	33,000	321,700	19	1,591	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	117,700	167,600	487	39,553	0.3
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	162,500	193,200	401	32,590	0.2
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	144,700	117,300	104	8,466	0.1
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	23,500	38,300	57	4,690	0.0
SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	31,000	31,000	13	1,131	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	167,200	167,200	168	13,695	0.1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	99,600	58	4,725	0.0
SPH REIT	74,600	74,600	66	5,384	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	—	—	—	—
EC WORLD REIT	—	52,800	43	3,489	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	20,000	5,200	4	383	0.0
ASCOTT TRUST	117,055	189,155	189	15,340	0.1
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	243,200	243,200	98	7,988	0.1
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	57,600	57,600	50	4,110	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	10,000	102,700	51	4,206	0.0

外国リート・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		
IREIT GLOBAL		-		57,600	36	2,989	0.0
KEPPEL DC REIT		99,300		109,500	278	22,556	0.1
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST		191,538		248,238	377	30,600	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,267,753 29	4,448,053 30	6,108 -	495,415 <3.3%>		
(韓国)				千韓国ウォン			
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		5,000		5,000	23,225	2,190	0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		3,100		5,302	42,840	4,039	0.0
LOTTE REIT CO LTD		9,703		12,522	72,126	6,801	0.0
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		-		2,600	15,548	1,466	0.0
JR REIT XXVII		8,500		8,500	44,795	4,224	0.0
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD		-		8,325	55,777	5,259	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	26,303 4	42,249 6	254,312 -	23,981 <0.2%>		
(イスラエル)				千イスラエルシェケル			
REIT 1 LTD		12,261		15,233	281	9,627	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	12,261 1	15,233 1	281 -	9,627 <0.1%>		
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	10,499,122 320	13,558,053 324	- -	14,952,778 <99.3%>		

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

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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

■ 投資信託財産の構成

(2021年8月25日現在)

項	目	期		末	
		評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
		千円		%	
投 資 証 券		14,952,778	99.2		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		116,333	0.8		
投 資 信 託 財 産 総 額		15,069,111	100.0		

※期末における外貨建資産（15,043,484千円）の投資信託財産総額（15,069,111千円）に対する比率は99.8%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.86円、1カナダドル=87.16円、1ユーロ=129.00円、1英ポンド=150.74円、1オーストラリアドル=79.62円、1ニュージーランドドル=76.24円、1香港ドル=14.11円、1シンガポールドル=81.10円、100韓国ウォン=9.43円、1イスラエルシェケル=34.1453円です。

外国リート・インデックス・マザーファンド

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年8月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	15,083,911,522円
コーポレートローン等	90,629,827
投資証券(評価額)	14,952,778,371
未収入金	15,458,529
未収配当金	25,044,795
(B) 負 債	22,857,221
未払金	14,808,704
未払解約金	8,048,038
未払利息	69
その他未払費用	410
(C) 純資産総額(A-B)	15,061,054,301
元本	5,764,243,708
次期繰越損益金	9,296,810,593
(D) 受益権総口数	5,764,243,708口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,128円

※当期における期首元本額4,696,644,685円、期中追加設定元本額1,540,917,041円、期中一部解約元本額473,318,018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。

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	20,163,828円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	21,022,305円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	14,256,771円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	4,992,660,768円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,089,180円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	44,209,437円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	31,754,760円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	102,018,644円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	53,161,543円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	42,155,749円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	56,526,132円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	578,654円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	74,942,568円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	378,061円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	381,491円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	383,201円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	48,479,961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>	20,034,522円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	38,198,071円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド2021-05(リスク3%)<適格機関投資家限定>	198,848,062円

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

■ 損益の状況

(自2021年2月26日 至2021年8月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	191,480,862円
受 取 配 当 金	189,826,027
そ の 他 収 益 金	1,665,227
支 払 利 息	△ 10,392
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,018,026,995
売 買 益	2,209,321,386
売 買 損	△ 191,294,391
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,062,603
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	2,205,445,254
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	5,535,791,093
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,262,961,190
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 707,386,944
(H) 計 (D+E+F+G)	9,296,810,593
次 期 繰 越 損 益 金(H)	9,296,810,593

※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。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。