

三井住友DS・ 国内株式インデックス 年金ファンド

【運用報告書(全体版)】

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

第 **3** 期

決算日 2021年11月30日

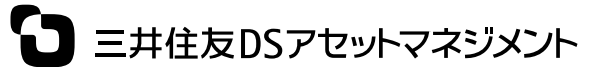
受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、T O P I X (東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。

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)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型
信託期間	無期限(設定日：2019年6月28日)
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、T O P I X (東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) 日本の取引所に上場している株式
当ファンドの運用方法	■マザーファンドへの投資を通じて、東京証券取引所第1部に上場している株式に投資します。 ■T O P I X (東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) ■株式への投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	■年1回(原則として毎年11月30日。休業日の場合は翌営業日)決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)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。 ※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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;">ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)</div>

三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド

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

■ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	純資産額
	(分配落) 円	税 分 配 金 円	期 騰 落 率 %	期 騰 落 率 %	期 騰 落 率 %			
(設定日) 2019年6月28日	10,000	—	—	2,342.11	—	—	—	百万円 1
1期(2019年12月2日)	11,139	0	11.4	2,611.46	11.5	97.8	2.3	1
2期(2020年11月30日)	11,625	0	4.4	2,738.72	4.9	97.8	2.0	362
3期(2021年11月30日)	13,011	0	11.9	3,073.26	12.2	97.8	2.4	1,418

※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。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2020年11月30日	円 11,625	% —	円 2,738.72	% —	% 97.8	% 2.0
12月末	11,969	3.0	2,819.93	3.0	98.9	1.7
2021年1月末	11,996	3.2	2,826.50	3.2	99.2	0.8
2月末	12,367	6.4	2,914.58	6.4	98.9	1.2
3月末	13,069	12.4	3,080.87	12.5	98.4	1.6
4月末	12,696	9.2	2,993.46	9.3	97.7	2.3
5月末	12,866	10.7	3,034.76	10.8	97.5	2.6
6月末	13,016	12.0	3,070.81	12.1	98.0	2.0
7月末	12,732	9.5	3,003.91	9.7	98.1	2.0
8月末	13,132	13.0	3,099.08	13.2	98.3	1.6
9月末	13,702	17.9	3,234.08	18.1	98.2	1.9
10月末	13,505	16.2	3,188.28	16.4	97.8	2.7
(期末) 2021年11月30日	円 13,011	% 11.9	円 3,073.26	% 12.2	% 97.8	% 2.4

※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12月1日から2021年11月30日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	11,625円
期末	13,011円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+11.9% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)です。

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

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

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

上昇要因

- 米国の追加経済対策への期待と国内製造業の好業績により、国内株式市場が上昇したこと
- 9月の菅総理の辞任表明により、新政権の政策期待から国内株式市場が上昇したこと

下落要因

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

投資環境について(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

国内株式市場は上昇しました。

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

9月になると、菅総理の辞任表明により、新政権の政策期待から国内株式市場は高値を更新しました。その後、中国の不動産大

手の信用不安で日本を含む世界的な株安が進行しました。しかし、債務が履行されたことや企業業績が好調な米国株が上昇したことで、国内株式市場も上昇に転じました。

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

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

当ファンド

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

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

●株式組入比率

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

●ポートフォリオの特性

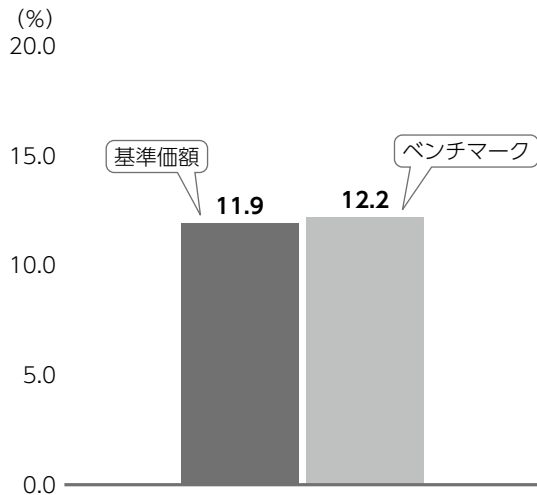
TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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

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

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

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は+11.9% (分配金再投資ベース) となり、ベンチマークの騰落率+12.2% を0.3% 下方乖離しました。

下方乖離要因

- 信託報酬等のコスト負担が日々生じたこと

分配金について(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第3期
当期分配金 (対基準価額比率)	0 (0.00%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	3,011

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

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

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

2 今後の運用方針

当ファンド

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

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド

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

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	20円	0.154%	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) <div style="border: 1px solid black; padding: 2px; display: inline-block;">期中の平均基準価額は12,989円です。</div>
(投 信 会 社)	(9)	(0.066)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販 売 会 社)	(9)	(0.066)	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	0	0.003	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(株 式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(株 式)	(-)	(-)	有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(公 社 債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.005	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(-)	(-)	保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	そ の 他:信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	21	0.162	

※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。

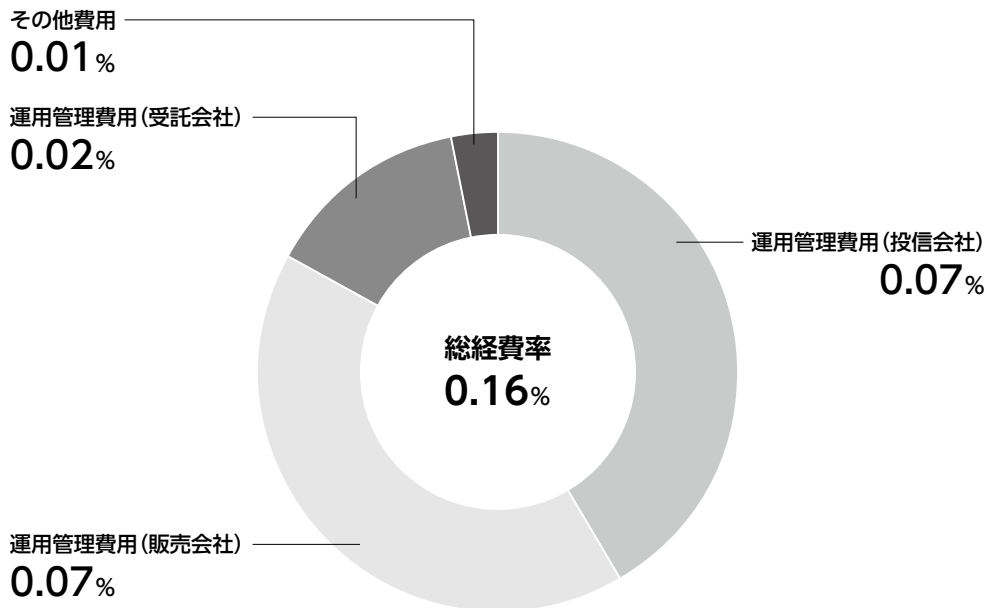
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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0.16%です。

三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド

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

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	千口 328,085	千円 1,053,937	千口 13,743	千円 44,435

■ 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12月1日から2021年11月30日まで)

項 目	当 期
	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	39,629,201千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	189,332,738千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.20

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

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

(1) 利害関係人との取引状況

三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	B/A		うち利害関係人との取引状況 D	D/C	
株 式	百万円 19,219	百万円 6,507	%	百万円 20,409	百万円 8,618	%
株 式 先 物 取 引	49,971	47,251	94.6	48,975	46,260	94.5

※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。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

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

三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	25千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	21千円
(c) (b) / (a)	86.2%

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

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

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

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

■ 組入れ資産の明細 (2021年11月30日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首(前期末)		期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	千口 126,244	千口 440,586	千円 1,419,217	千円 1,419,217

※国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の期末の受益権総口数は61,173,269,127口です。

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	千円 1,419,217	% 99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,114	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	1,421,332	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,421,332,499円
コール・ローン等	2,005,111
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	1,419,217,942
未 収 入 金	109,446
(B) 負 債	3,098,235
未 払 解 約 金	2,109,175
未 払 信 託 報 酬	955,017
そ の 他 未 払 費 用	34,043
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,418,234,264
元 本	1,090,023,993
次 期 繰 越 損 益 金	328,210,271
(D) 受 益 権 総 口 数	1,090,023,993口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,011円

※当期における期首元本額311,578,130円、期中追加設定元本額971,721,218円、期中一部解約元本額193,275,355円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2020年12月1日 至2021年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,015円
受 取 利 息	45
支 払 利 息	△ 1,060
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	31,084,648
売 買 損 益	47,298,930
売 買 損 益	△ 16,214,282
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,421,706
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	29,661,927
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	28,223,518
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	270,324,826
(配 当 等 相 当 額)	(228,021,691)
(売 買 損 益 相 当 額)	(42,303,135)
(G) 合 計(D+E+F)	328,210,271
次 期 繰 越 損 益 金(G)	328,210,271
追 加 信 託 差 損 益 金	270,324,826
(配 当 等 相 当 額)	(229,171,511)
(売 買 損 益 相 当 額)	(41,153,315)
分 配 準 備 積 立 金	57,885,445

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

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

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	18,593,224円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	11,068,703
(c) 収益調整金	270,324,826
(d) 分配準備積立金	28,223,518
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	328,210,271
1万口当たり当期分配対象額	3,011.04
(f) 分配金	0
1万口当たり分配金	0

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	当 期
	0円

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

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第19期（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

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

■ 最近5期の運用実績

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

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

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

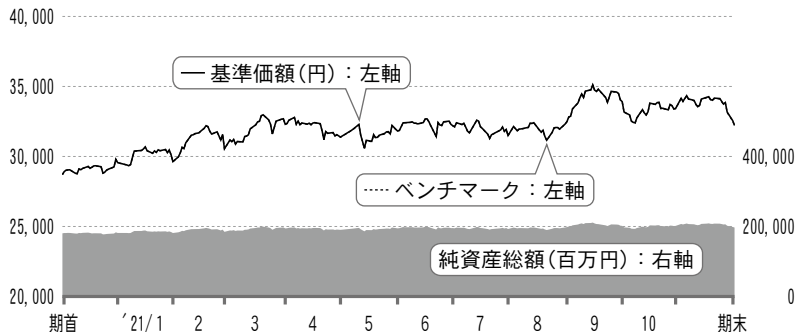
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

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

基準価額等の推移



期首	28,704円
期末	32,212円
騰落率	+12.2%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）です。

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

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

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

上昇要因

- ・米国の追加経済対策への期待と国内製造業の好業績により、国内株式市場が上昇したこと
- ・9月の菅総理の辞任表明により、新政権の政策期待から国内株式市場が上昇したこと

下落要因

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

▶ 投資環境について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

国内株式市場は上昇しました。

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

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

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

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

株式組入比率

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

ポートフォリオの特性

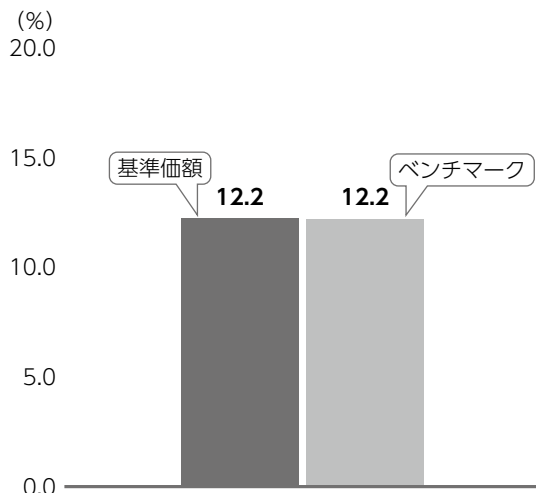
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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

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

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

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

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

2 今後の運用方針

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

期中の平均基準価額は31,986円です。

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

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

(1) 株 式

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

※金額は受渡し代金。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 先物取引の種類別取引状況

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

※金額は受渡し代金。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

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

(1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B A	%	うち利害関係人 との取引状況D	D C	%
株 式	百万円 6,507	33.9		百万円 8,618	42.2	
株 式 先 物 取 引	49,971	94.6		46,260	94.5	

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

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

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

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

（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 組入れ資産の明細（2021年11月30日現在）

(1) 国内株式

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
チノー	4.2	—	—	—
共和電業	15.2	16.2	6,285	—
日本電子材料	—	4	8,776	—
堀場製作所	14.5	13.4	90,450	—
アドバンテスト	53.7	54.1	540,459	—
エスベック	6.9	6.2	13,038	—
キーエンス	65.5	66	4,641,780	—
日置電機	3.5	3.5	31,010	—
シスメックス	51.7	61.6	872,256	—
日本マイクロニクス	12.1	13.1	23,501	—
メガチップス	7	6.9	32,809	—
OBARA GROUP	4.4	3.7	12,284	—
コーセル	11.7	10.6	9,518	—
イリソ電子工業	6.1	6.3	28,822	—
オプテックスグループ	12.6	12.7	18,859	—
千代田インテグレ	4.5	4	8,676	—
レーザーテック	31.7	32	951,840	—
スタンレー電気	50.9	50.9	150,256	—
岩崎電気	4.1	3.6	8,085	—
ウシオ電機	40.9	37.6	79,223	—
ハリオス テクノ ホールディング	13.3	—	—	—
日本セラミック	7.7	6.9	19,747	—
遠藤照明	—	4.8	4,910	—
古河電池	6.2	5.6	8,192	—
山一電機	6.3	6.1	14,060	—
図研	5.1	4.8	17,928	—
日本電子	14.6	15.2	143,944	—
カシオ計算機	64.5	53	78,122	—
ファナック	68	64	1,423,680	—
日本シイエムケイ	20.8	18.2	9,172	—
エンプラス	4.6	2.2	5,546	—
大真空	—	11.6	18,212	—
ローム	30.0	32.6	346,538	—
浜松ホトニクス	51.7	52.2	364,356	—
三井ハイテック	8.5	7.2	65,952	—
新光電気工業	24.7	21.3	113,955	—
京セラ	101.9	102.6	690,600	—
太陽誘電	32.3	35.3	220,978	—
村田製作所	212.5	214	1,793,320	—
双葉電子工業	12.9	14.5	9,990	—
北陸電気工業	5.7	6.1	7,722	—
ニチコン	25.3	23.1	26,842	—
日本ケミコン	—	7.3	13,147	—
KOA	11.6	11.2	17,136	—
市光工業	12.8	10.7	5,307	—

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

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

※銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	期末	
	買建額	売建額
国内	百万円 4,815	百万円 —
T O P I X		

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

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

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

(2021年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	197,359,314,147円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,159,862,470
株 式 (評価額)	192,569,963,990
未 収 配 当 金	1,330,297,687
差 入 委 託 証 拠 金	299,190,000
(B) 負 債	304,994,395
未 払 金	280,946,773
未 払 解 約 金	24,033,101
そ の 他 未 払 費 用	14,521
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	197,054,319,752
元 本	61,173,269,127
次 期 繰 越 損 益 金	135,881,050,625
(D) 受 益 権 総 口 数	61,173,269,127口
1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C / D)	32,212円

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

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

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

■ 損益の状況

(自2020年12月1日 至2021年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,117,818,618円
受 取 配 当 金	4,119,293,254
受 取 利 息	1,572
そ の 他 収 益 金	711,505
支 払 利 息	△ 2,187,713
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	17,412,905,832
売 買 益	28,936,137,486
売 買 損	△ 11,523,231,654
(C) 先 物 取 引 等 損 益	204,008,900
取 引 益	744,403,500
取 引 損	△ 540,394,600
(D) そ の 他 費 用 等	△ 299,666
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	21,734,433,684
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	117,608,389,911
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 27,114,163,119
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	23,652,390,149
(I) 合 計 (E + F + G + H)	135,881,050,625
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	135,881,050,625

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

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

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

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。