

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)】

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

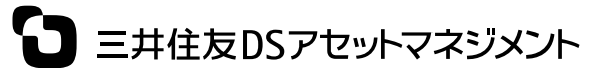
第 **4** 期
決算日 2022年11月30日

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、TOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。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、TOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。
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、TOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資します。 ■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。 ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)

三井住友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)	税 分 配 金	期 騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(設定日) 2019年6月28日	円 10,000	円 -	% -		% -	% -	% -	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
4期(2022年11月30日)	13,734	0	5.6	3,249.61	5.7	98.0	2.0	2,770

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2021年11月30日	円 13,011	% -		% -	% 97.8	% 2.4
12月末	13,465	3.5	3,179.28	3.4	98.1	1.9
2022年1月末	12,811	△1.5	3,025.69	△1.5	98.4	1.6
2月末	12,752	△2.0	3,012.57	△2.0	98.8	1.2
3月末	13,297	2.2	3,142.06	2.2	97.6	2.4
4月末	12,978	△0.3	3,066.68	△0.2	97.5	2.6
5月末	13,072	0.5	3,090.73	0.6	97.4	2.6
6月末	12,804	△1.6	3,027.34	△1.5	98.1	1.9
7月末	13,280	2.1	3,140.07	2.2	98.8	1.2
8月末	13,437	3.3	3,177.98	3.4	99.1	0.9
9月末	12,697	△2.4	3,003.39	△2.3	96.6	3.5
10月末	13,343	2.6	3,156.44	2.7	97.8	2.3
(期末) 2022年11月30日	13,734	5.6	3,249.61	5.7	98.0	2.0

※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(2021年12月1日から2022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	13,011円
期末	13,734円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+5.6% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)です。

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

基準価額の主な変動要因(2021年12月1日から2022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

- 日本銀行の金融緩和政策の維持が示されたこと
- 米C P I (消費者物価指数)の結果を受けて、インフレがピークアウトし利上げペースが鈍化すると期待が広がったこと

下落要因

- 新型コロナの新たな変異ウイルス(オミクロン型)の感染拡大やウクライナ情勢が緊迫化したこと
- 欧米において金融引き締めの方針が確認され、長期金利(10年国債利回り)が上昇したこと

投資環境について(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

国内株式市場は上昇しました。

期初から3月中旬にかけては、変異ウイルス(オミクロン型)の感染急拡大や、ウクライナ情勢の緊迫化、ロシアへの経済制裁を背景とした原油市況の高騰などから世界景気の回復の遅れが懸念され、下落しました。

その後、ウクライナ情勢に対する過度な

警戒感の緩和や米国の金融政策イベント通過により投資家心理が持ち直し、国内でも日本銀行の金融緩和政策の維持が示されたことで、上昇しました。6月から期末にかけては、欧米の金融政策動向に左右される形で一進一退の展開が続きました。

ポートフォリオについて(2021年12月1日から2022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

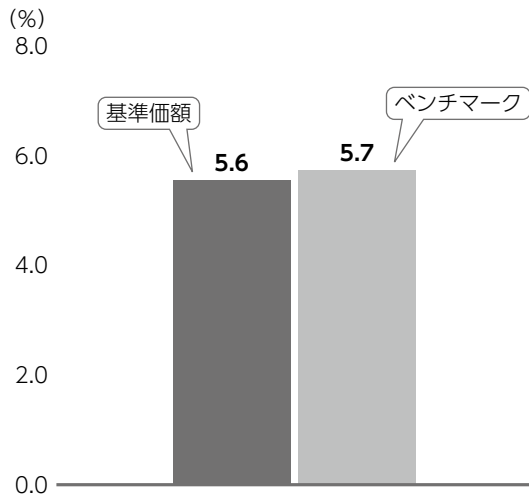
TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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(2021年12月1日から2022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+5.6%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+5.7%を0.1%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(2021年12月1日から2022年11月30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	0
(対基準価額比率)	(0.00%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	3,733

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

- 2022年4月の東京証券取引所の市場区分の見直しに伴い、関連する記載について、所要の変更を行いました。(適用日：2022年4月4日)

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(2021年12月1日から2022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13,123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)	(0.003)	
(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。

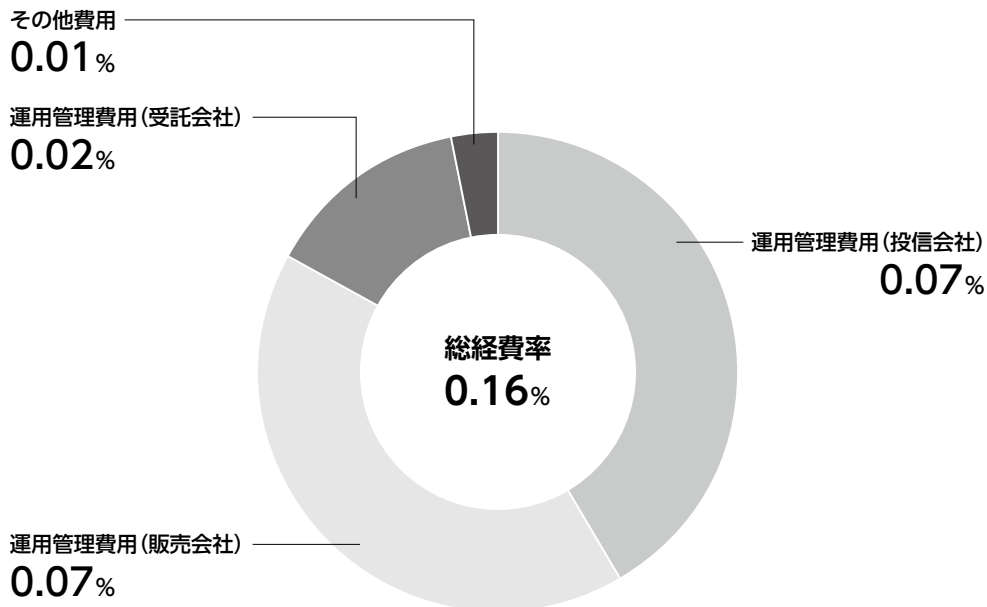
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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 (2021年12月1日から2022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 412,427	千円 1,333,838	千口 39,256	千円 128,372

■ 親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年12月1日から2022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	43,567,786千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	204,530,294千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.21

※(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12月1日から2022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 31,388	百万円 -	%	百万円 12,178	百万円 24	%
株 式 先 物 取 引	49,332	28,561	57.9	50,112	33,581	67.0

※平均保有割合 1.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	百万円 206	百万円 9	百万円 2,553

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	64千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	31千円
(c) (b) / (a)	49.3%

※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 (2021年12月1日から2022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 (2022年11月30日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首(前期末)	期 末	評 価 額
	口 数	口 数	
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	440,586	813,757	2,772,798

※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65,393,298,021口です。

■ 投資信託財産の構成

(2022年11月30日現在)

項 目	期	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)	2,772,798	99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,250	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	2,776,048	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	2, 776, 048, 644円
コー ル ・ ロ ー ン 等	3, 250, 174
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	2, 772, 798, 470
(B) 負 債	5, 214, 290
未 払 解 約 金	3, 245, 710
未 払 信 託 報 酬	1, 900, 751
そ の 他 未 払 費 用	67, 829
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	2, 770, 834, 354
元 本	2, 017, 560, 680
次 期 繰 越 損 益 金	753, 273, 674
(D) 受 益 権 総 口 数	2, 017, 560, 680口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	13, 734円

※当期における期首元本額1,090,023,993円、期中追加設定元本額1,288,102,784円、期中一部解約元本額360,566,097円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2021年12月1日 至2022年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 845円
受 取 利 息	86
支 払 利 息	△ 931
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	143, 697, 865
売 買 損 益	152, 205, 227
売 買 損 益	△ 8, 507, 362
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3, 275, 205
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	140, 421, 815
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	45, 506, 134
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	567, 345, 725
(配 当 等 相 当 額)	(485, 815, 436)
(売 買 損 益 相 当 額)	(81, 530, 289)
(G) 合 計(D + E + F)	753, 273, 674
次 期 繰 越 損 益 金(G)	753, 273, 674
追 加 信 託 差 損 益 金	567, 345, 725
(配 当 等 相 当 額)	(488, 231, 801)
(売 買 損 益 相 当 額)	(79, 113, 924)
分 配 準 備 積 立 金	185, 927, 949

※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	53, 169, 480円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	87, 252, 335
(c) 収益調整金	567, 345, 725
(d) 分配準備積立金	45, 506, 134
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	753, 273, 674
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	3, 733. 59
(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20期（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

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

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) TOPIX (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株比	株式先物率 (買建-売建)	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
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
20期（2022年11月30日）	34,074	5.8	3,249.61	5.7	97.9	2.0	222,819

※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) 2021年11月30日	円 32,212	% —	3,073.26	% —	% 97.7	% 2.4
12月末	33,341	3.5	3,179.28	3.4	98.1	1.9
2022年1月末	31,728	△1.5	3,025.69	△1.5	98.4	1.6
2月末	31,588	△1.9	3,012.57	△2.0	98.8	1.2
3月末	32,945	2.3	3,142.06	2.2	97.6	2.4
4月末	32,159	△0.2	3,066.68	△0.2	97.4	2.6
5月末	32,401	0.6	3,090.73	0.6	97.3	2.6
6月末	31,742	△1.5	3,027.34	△1.5	98.1	1.9
7月末	32,927	2.2	3,140.07	2.2	98.7	1.2
8月末	33,322	3.4	3,177.98	3.4	99.0	0.9
9月末	31,493	△2.2	3,003.39	△2.3	96.6	3.4
10月末	33,100	2.8	3,156.44	2.7	97.7	2.3
(期 末) 2022年11月30日	34,074	5.8	3,249.61	5.7	97.9	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（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	32,212円
期末	34,074円
騰落率	+5.8%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、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（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

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

上昇要因

- ・日本銀行の金融緩和政策の維持が示されたこと
- ・米CPI（消費者物価指数）の結果を受けて、インフレがピークアウトし利上げペースが鈍化すると期待が広がったこと

下落要因

- ・新型コロナの新たな変異ウイルス（オミクロン型）の感染拡大やウクライナ情勢が緊迫化したこと
- ・欧米において金融引き締めの方針が確認され、長期金利（10年国債利回り）が上昇したこと

▶ **投資環境について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）**

国内株式市場は上昇しました。

期初から3月中旬にかけては、変異ウイルス（オミクロン型）の感染急拡大や、ウクライナ情勢の緊迫化、ロシアへの経済制裁を背景とした原油市況の高騰などから世界景気の回復の遅れが懸念され、下落しました。

その後、ウクライナ情勢に対する過度な警戒感の緩和や米国の金融政策イベント通過により投資家心理が持ち直し、国内でも日本銀行の金融緩和政策の維持が示されたことで、上昇しました。6月から期末にかけては、欧米の金融政策動向に左右される形で一進一退の展開が続きました。

▶ **ポートフォリオについて（2021年12月1日から2022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

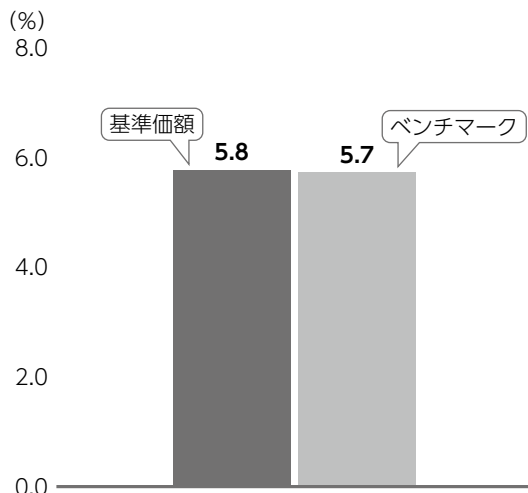
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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（2021年12月1日から2022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+5.8%となり、ベンチマークの騰落率+5.7%を0.1%上方乖離しました。

上方乖離要因

・先物と現物のリターンに、差が生じたこと

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（2021年12月1日から2022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) (0.003)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (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32,526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12月1日から2022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 14,312.2 (1,313.824)	千円 31,388,823 ()	千株 6,390.324	千円 12,178,963

※金額は受渡し代金。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 49,332	百万円 50,112	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

（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	43,567,786千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	204,530,294千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.21

※(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12月1日から2022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 31,388	百万円 -	% -	百万円 12,178	百万円 24	% 0.2
株 式 先 物 取 引	49,332	28,561	57.9	50,112	33,581	67.0

(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 206	百万円 9	百万円 2,553

(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	6,618千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	3,594千円
(c) (b)／(a)	54.3%

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

（2021年12月1日から2022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（2022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	3.7	3.9	14,410	
日本水産	97.1	106.9	55,801	
マルハニチロ	15	16.2	39,787	
雪国まいたけ	8.1	10.6	10,610	
カネコ種苗	5	5.3	7,573	
サカタのタネ	11.6	13.5	63,315	
ホクト	8	9.4	17,766	
鉱業 (0.3%)				
住石ホールディングス	—	21.8	5,537	
日鉄鉱業	2.3	4.3	13,523	
三井松島ホールディングス	4.8	5	16,125	
INPEX	396.9	394	604,002	
石油資源開発	11.7	12.3	53,320	
K&Oエナジーグループ	5.5	4.9	11,892	
建設業 (1.9%)				
ヒノキヤグループ	2.9	—	—	
ショーボンドホールディングス	14.1	14.5	87,870	
ミライト・ワン	31.3	37.2	56,320	
タマホーム	6.1	7.6	18,840	
日本アクア	—	5.9	5,192	
ベステラ	3.9	—	—	
Robot Home	20.8	0.8	147	
ダイセキ環境ソリューション	2.7	—	—	
安藤・間	54.1	61.9	54,100	
東急建設	30.2	32.6	21,385	
コムシスホールディングス	31.6	35.9	88,565	
ビーアールホールディングス	17	22.2	7,481	
高松コンストラクショングループ	6.7	7.2	14,112	
東建コーポレーション	2.9	3.4	27,030	
ヤマウラ	—	7.6	7,630	
オリエンタル白石	36.7	41.3	11,481	
大成建設	66	74.2	309,043	
大林組	227.9	265.9	272,281	
清水建設	213.8	223.6	165,016	
飛鳥建設	8.7	10.4	10,628	
長谷工コーポレーション	67.2	76.9	116,657	
松井建設	11.6	2.7	1,517	
銭高組	1.7	2.1	5,640	
鹿島建設	167	164.9	255,595	
不動テトラ	5.8	6	9,144	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
大木建設	5.1	3.7	4,425	
鉄建建設	6.5	7	12,733	
西松建設	14	13.1	51,286	
三井住友建設	53.2	63.2	26,670	
大豊建設	3.5	3.3	14,652	
奥村組	13.3	12.3	36,112	
東鉄工業	9.9	10.3	26,285	
浅沼組	2.9	6.3	18,396	
戸田建設	95.7	92.7	67,856	
熊谷組	11.2	13	33,007	
北野建設	2.7	3	7,338	
矢作建設工業	12.5	11.3	8,350	
ピーエス三菱	9.3	11.1	6,693	
日本ハウスホールディングス	20.7	17.8	7,778	
新日本建設	10.6	10.7	8,003	
NIPPO	18.6	—	—	
東亜道路工業	1.4	1.7	10,370	
日本道路	2.2	1.7	10,557	
東亜建設工業	5.9	6.8	16,007	
日本国土開発	22.2	23.7	13,556	
若築建設	4.8	3.8	10,385	
東洋建設	25.7	24.8	20,757	
五洋建設	91.2	106.9	69,164	
世紀東急工業	12.8	11.2	8,937	
福田組	2.8	2.9	14,108	
住友林業	58.5	57.2	135,621	
巴コーポレーション	14.6	15.1	5,768	
大和ハウス工業	211.2	208.4	658,335	
ライト工業	14.8	13.5	27,918	
積水ハウス	247.9	233.7	599,907	
日特建設	—	8	7,288	
北陸電気工事	5.2	—	—	
ユアテック	14.1	16.6	11,935	
日本リーテック	5.8	6.3	4,624	
四電工	—	1.8	3,193	
中電工	9.9	10.1	21,058	
関電工	37.5	38.3	33,244	
きんでん	50	51.5	75,756	
東京エネリス	8.8	8.5	7,998	
トーエネック	2.9	2.7	9,234	
住友電設	5.8	6.9	17,526	
日本電設工業	11.7	11.9	20,170	

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
エクシオグループ	33.9	36.4	77,422	
新日本空調	6.3	4.4	8,439	
九電工	17.7	18.3	60,207	
三機工業	13.6	16.2	25,887	
日揮ホールディングス	70.9	74.1	140,271	
中外炉工業	3.6	2.6	4,152	
ヤマト	8.8	10.1	6,969	
太平電業	5.3	4.8	15,096	
高砂熱学工業	21.1	17.8	31,933	
朝日工業社	2.2	3.5	7,462	
明星工業	17	14	10,136	
大気社	11.1	8.9	31,461	
ダイダン	5.4	5.1	11,220	
日比谷総合設備	7.5	6.8	12,886	
フィル・カンパニー	1.7	—	—	
テスホールディングス	4.7	8.7	9,674	
インフロニア・ホールディングス	97.4	78.4	80,752	
東洋エンジニアリング	11.1	11.2	6,518	
レイズネクスト	10.8	10.5	13,177	
食料品（3.5%）				
ニッポン	20.1	19.4	30,787	
日清製粉グループ本社	82.2	69.1	111,596	
日東富士製粉	—	1.7	7,607	
昭和産業	6.4	6.2	15,177	
鳥越製粉	8.7	—	—	
中部飼料	8.6	10.8	11,221	
フィード・ワン	10.3	11.1	7,425	
日本甜菜製糖	5.3	5.3	8,623	
DM三井製糖ホールディングス	6.4	7.4	14,474	
日新製糖	4.3	4.1	6,900	
森永製菓	17.3	15.6	57,642	
中村屋	2.5	2.9	9,019	
江崎グリコ	20	21.6	77,436	
名糖産業	5	1.6	2,576	
井村屋グループ	4.5	4.4	9,816	
不二家	4.4	5	13,165	
山崎製パン	54.7	50.5	79,840	
モロゾフ	1.7	2.7	9,693	
亀田製菓	4.1	4.8	20,904	
寿スピリッツ	7	8	62,160	
カルビー	33.4	34.5	100,188	
森永乳業	13.6	13.8	61,341	
六甲バター	6.5	5.9	8,230	
ヤクルト本社	54.1	53.5	468,125	
明治ホールディングス	48.1	46.3	305,580	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
雪印メグミルク	17.4	18.6	32,159	
プリマハム	8.4	9.9	20,205	
日本ハム	27.7	29.3	108,410	
丸大食品	7.8	8.6	12,255	
S Foods	6.3	8.4	24,469	
柿安本店	2.9	3.2	6,947	
伊藤ハム米久ホールディングス	41.4	53.4	36,525	
サッポロホールディングス	25	24.8	89,032	
アサヒグループホールディングス	171.8	173.1	761,293	
キリンホールディングス	268.3	338.2	732,203	
宝ホールディングス	50.2	51	54,468	
オエノンホールディングス	24.5	25.6	7,219	
養命酒製造	3.7	—	—	
コカ・コーラ ボトラーズ ジャパンホールディングス	50.9	58.9	85,994	
サントリー食品インターナショナル	48.8	52.5	244,912	
ダイドーグループホールディングス	3.7	4.2	20,370	
伊藤園	22.2	27.9	147,033	
キーコーヒー	6.9	8.5	17,595	
日清オイリオグループ	8.4	10.4	34,684	
不二製油グループ本社	15.8	17.7	37,400	
かどや製油	1.4	2.9	10,150	
J-オイルミルズ	7.4	7.8	11,809	
キッコーマン	52.6	49.5	382,140	
味の素	161.3	183.4	795,039	
ブルドックソース	3.9	3.5	6,020	
キュービー	38.3	40.2	98,369	
ハウス食品グループ本社	27.2	22.9	62,150	
カゴメ	27.6	35	106,750	
焼津水産化学工業	7.7	11.7	9,734	
アリアケジャパン	6.7	6.6	30,393	
ニチレイ	34.9	34.6	96,222	
東洋水産	35	37.8	218,106	
イトアンドホールディングス	3.6	3.9	8,704	
日清食品ホールディングス	28.6	26.6	278,768	
永谷園ホールディングス	4.1	4.1	8,212	
一正蒲鉾	6.6	—	—	
フジッコ	7.5	7.8	14,781	
ロック・フィールド	7.9	9.6	14,169	
日本たばこ産業	391.8	492.9	1,387,759	
ケンコーマヨネーズ	5.2	5.5	9,080	
わらべや日洋ホールディングス	5.3	6.1	11,272	
なとり	5.2	5.2	10,712	
ビックルスコーポレーション	4.1	—	—	
ファーマフーズ	7	11.8	15,163	

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
ユーグレナ	38.5	49.3	44,419	
紀文食品	5	6.9	6,506	
ビックルスホールディングス	—	1.5	1,624	
ミヨシ油脂	5.1	3.8	3,746	
理研ビタミン	8.1	6.8	12,076	
繊維製品 (0.4%)				
片倉工業	—	8.2	16,195	
グンゼ	5.1	5.8	23,084	
東洋紡	29.2	34.3	35,500	
ユニチカ	23.1	27.8	7,450	
富士紡ホールディングス	3.5	3.2	10,832	
倉敷紡績	6.7	6.1	13,291	
シキボウ	8.2	7.9	6,936	
日本毛織	23.3	22.2	22,377	
帝国繊維	9.1	9	14,967	
帝人	68	73.5	97,608	
東レ	519.2	511.5	377,793	
住江織物	3.3	—	—	
アツギ	10.2	3	1,140	
ダイニック	7.4	6.3	3,899	
セーレン	15.5	14.7	38,558	
小松マテール	13	12.3	9,827	
ワコールホールディングス	18.4	14.9	34,702	
ホギメディカル	10.2	10.3	35,947	
T S I ホールディングス	27.3	29.1	13,997	
マツオカコーポレーション	3.5	—	—	
ワールド	11	10.4	13,676	
三陽商会	—	4	5,288	
オンワードホールディングス	47.4	52.1	17,193	
ルックホールディングス	—	3.4	8,489	
ゴールドウイン	13	13.4	126,228	
デサント	14.2	13.1	43,885	
パルプ・紙 (0.2%)				
特種東海製紙	4.7	4.3	12,181	
王子ホールディングス	297.1	316.8	167,270	
日本製紙	35.2	40.3	38,889	
北越コーポレーション	47.8	48.3	37,529	
大王製紙	35.2	34.2	36,388	
レンゴー	68.6	70.5	61,053	
トーモク	5.6	5.4	8,640	
ザ・バック	5.9	6	15,126	
化学 (6.1%)				
北の達人コーポレーション	26.6	34.5	10,419	
クラレ	103.4	121	132,616	
旭化成	473	475.3	484,330	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
昭和電工	61.9	73.7	161,255	
住友化学	520.7	562.9	280,324	
住友精化	3.6	3.3	13,992	
日産化学	38.8	36.1	243,314	
ラサ工業	2.8	3.4	7,197	
クレハ	5.6	6.5	63,245	
多木化学	2.9	3	15,750	
テイカ	6.2	5.4	6,885	
石原産業	12.2	14.3	16,030	
日本曹達	9	8.2	35,096	
東ソー	102.6	101.2	164,247	
トクヤマ	23	25	47,825	
セントラル硝子	12	12.3	42,988	
東亜合成	40.9	38.8	45,667	
大阪ソーダ	6.4	4.6	18,998	
関東電化工業	16.2	15.3	15,697	
デンカ	25.9	27.7	91,687	
信越化学工業	122.6	130.3	2,289,371	
日本カーバイド工業	—	4.4	5,750	
堺化学工業	5.2	6.2	11,649	
第一稀元素化学工業	8.4	7.6	9,142	
エア・ウォーター	67.3	71.8	115,957	
日本酸素ホールディングス	68.5	73.3	166,610	
日本化学工業	2.6	3.2	5,945	
日本パーカライジング	36.4	36.6	36,270	
高压ガス工業	13.1	12	7,776	
四国化成工業	9.4	9.2	12,429	
ステラ ケミファ	4	4.8	12,561	
保土谷化学工業	2.4	2.5	7,762	
日本触媒	12.1	11.6	63,916	
大日精化工業	5.7	5.7	9,786	
カネカ	18.4	17.2	60,200	
三菱瓦斯化学	66.2	56.5	110,796	
三井化学	64.5	63.7	197,470	
J S R	66.5	71.2	204,557	
東京応化工業	12.3	13.3	90,972	
大阪有機化学工業	6	5.9	12,466	
三菱ケミカルグループ	476.7	515.3	375,756	
K H ネオケム	11.8	12.7	35,140	
ダイセル	103.3	112.2	111,975	
住友ベークライト	11.3	11.2	48,384	
積水化学工業	148.6	157.2	302,924	
日本ゼオン	64.7	45.7	60,552	
アイカ工業	20	19.2	62,112	
U B E	33.2	39.3	78,560	

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
積水樹脂	10.8	10.7	19,356	
タキロンシーアイ	16.5	16.8	8,534	
旭有機材	4.9	5.2	13,800	
ニチバン	5.7	5.3	9,296	
リケンテクノス	19.3	17.4	8,682	
大倉工業	4.2	4	8,056	
群栄化学工業	2.5	2.2	5,332	
ミライアル	2.9	3.6	6,177	
ダイキョーニシカワ	16.3	17.4	10,266	
森六ホールディングス	5	4.4	7,730	
恵和	1.9	2.5	9,312	
日本化薬	56.8	58.1	72,508	
カーリットホールディングス	8.8	8.5	6,111	
日本精化	6	4.3	9,623	
扶桑化学工業	6.4	6.9	24,322	
トリケミカル研究所	7.3	10.3	24,833	
ADEKA	32.8	26.2	59,002	
日油	24.3	23.5	135,830	
新日本理化	20.1	19.1	4,870	
ハリマ化成グループ	7.3	6.6	5,550	
花王	161.3	185.7	1,014,107	
第一工業製薬	3.1	3.4	6,830	
石原ケミカル	4.5	4.1	5,059	
ニイタカ	2.4	2.1	4,399	
三洋化成工業	4.1	4.5	19,822	
大日本塗料	11	11.8	9,050	
日本ペイントホールディングス	268.5	336.9	377,328	
関西ペイント	74.1	70	131,390	
中国塗料	17.7	14.9	15,391	
日本特殊塗料	7	6.2	5,406	
藤倉化成	11.7	4	1,636	
太陽ホールディングス	10.4	11.5	29,198	
DIC	30.1	29.7	74,428	
サカタインクス	14.4	17	18,785	
東洋インキSCホールディングス	13.8	14.3	26,884	
T&K TOKA	8.4	7.4	7,414	
富士フイルムホールディングス	128.1	146.3	1,070,184	
資生堂	135.8	159.4	924,360	
ライオン	88	92.1	134,926	
高砂香料工業	5	5.2	14,788	
マンダム	15.7	17	24,446	
ミルボン	9.1	11.4	64,980	
ファンケル	29.5	33.4	85,704	
コーセー	13.7	15.5	224,595	
コタ	6	6.3	10,602	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ポーラ・オルビスホールディングス	31.4	39.3	70,189	
ノエビアホールディングス	6.1	6.8	39,644	
新日本製薬	3.6	4.8	6,590	
エステー	5.6	6.6	10,150	
コニシ	11.9	12.6	21,709	
長谷川香料	12.4	15.7	48,277	
小林製薬	20.4	23.3	198,050	
荒川化学工業	7.2	7.5	7,462	
メック	5.5	6.3	16,197	
日本高純度化学	—	2.4	6,009	
タカラバイオ	19	20.5	36,920	
JCU	8	8.6	28,982	
新田ゼラチン	—	5.9	6,348	
OATアグリオ	—	3.5	6,216	
デクセリアルズ	18.9	22.1	71,383	
アース製薬	6	6.9	36,708	
北興化学工業	7.8	9.7	8,817	
大成ラミック	3.3	3.9	11,992	
クミアイ化学工業	27.5	30.7	28,336	
日本農薬	16.1	14.5	10,860	
アキレス	6.2	6	8,106	
有沢製作所	11.7	13	16,692	
日東電工	44	55.2	475,272	
レック	11	11.8	9,593	
三光合成	—	12.5	5,737	
きもと	—	19.4	4,617	
藤森工業	6.4	5.9	18,850	
前澤化成工業	6.8	6.2	8,587	
未来工業	3.8	3.2	4,761	
JSP	5.2	5.6	8,327	
エフビコ	13.6	14.6	55,261	
天馬	6	6.4	13,331	
信越ポリマー	13.4	13.8	17,208	
東リ	27.3	9.1	1,920	
ニフコ	24.4	27.4	98,366	
バルカー	6	6.5	17,745	
ユニ・チャーム	140.5	159	808,197	
医薬品（5.8%）				
協和キリン	85.3	91.8	291,465	
武田薬品工業	572.5	675	2,733,750	
アステラス製薬	631.5	730.9	1,555,355	
住友ファーマ	45.3	56.9	60,712	
塩野義製薬	91.5	97.6	678,320	
日本新薬	19.1	18	145,620	
中外製薬	227.8	238.5	864,324	

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
科研製薬	11.5	13.3	52,402	
エーザイ	87.1	92.9	866,942	
ロート製薬	37.5	37	166,130	
小野薬品工業	167	147.3	517,906	
久光製薬	19.2	17.2	66,564	
持田製薬	9.4	8.9	30,082	
参天製薬	135.8	144	160,416	
扶桑薬品工業	3.4	3.2	6,550	
日本ケミファ	2.5	—	—	
ツムラ	22.6	24.1	72,275	
日医工	23.3	—	—	
キッセイ薬品工業	13.2	11.8	29,901	
生化学工業	13	13.5	12,730	
栄研化学	12.7	11.9	22,645	
鳥居薬品	4.1	4	11,608	
JCRファーマ	20.7	26.2	50,094	
東和薬品	10.2	11.9	25,132	
富士製薬工業	6.3	6.6	6,725	
ゼリア新薬工業	13.1	10.5	23,373	
第一三共	572.5	664.4	3,001,759	
キョーリン製薬ホールディングス	14.5	16.6	29,382	
大幸薬品	12.9	15.9	8,315	
ダイト	4.8	5.4	14,007	
大塚ホールディングス	151.3	174.4	817,936	
大正製薬ホールディングス	17.2	17.5	98,000	
ペプチドリーム	38.4	37.4	64,028	
あすか製薬ホールディングス	9.2	8.4	10,743	
サワイグループホールディングス	16	17.4	73,776	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	69.2	81.6	7,180	
ニチレキ	10.4	9.4	12,173	
ユシロ化学工業	7	10.5	8,694	
富士石油	—	20	5,500	
MORESCO	5.4	—	—	
出光興産	80.6	84.4	273,456	
ENEOSホールディングス	1,096.1	1,378.6	642,427	
コスモエネルギーホールディングス	21.2	29	112,520	
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	41.8	43.3	97,641	
TOYO TIRE	38.6	44.1	69,104	
ブリヂストン	209.8	243.5	1,258,164	
住友ゴム工業	65.4	75.2	89,337	
藤倉コンポジット	7.4	6.6	5,590	
オカモト	4.4	4.5	17,325	
ニッタ	7.6	7.6	22,268	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
住友理工	15.8	15.6	9,609	
三ツ星ベルト	8.9	11.3	38,759	
バンドー化学	13	12.7	12,687	
ガラス・土石製品 (0.7%)				
日東紡績	11	9.4	20,529	
AGC	66.8	77.4	356,040	
日本板硝子	19.6	—	—	
日本電気硝子	29.5	31.5	79,758	
オハラ	3.8	5	6,325	
住友大阪セメント	13.8	11.3	36,555	
太平洋セメント	41.6	49.1	106,399	
日本ヒューム	12.1	9.5	6,156	
日本コンクリート工業	22.9	22.5	5,265	
三谷セキサン	3.6	3.6	15,156	
アジアパイルホールディングス	16.5	15.1	8,093	
東海カーボン	61.2	64.8	67,845	
日本カーボン	3.8	4.6	19,941	
東洋炭素	4.8	4.9	19,257	
ノリタケカンパニーリミテド	4.1	4.2	16,968	
TOYO	52.1	50.2	238,199	
日本碍子	78.7	89.7	162,446	
日本特殊陶業	55.4	58.2	155,976	
MARUWA	2.6	3	56,460	
品川リフラクトリーズ	2	2.3	9,073	
黒崎播磨	1.6	1.8	9,054	
ヨータイ	5.4	5	6,880	
東京窯業	15.3	22.5	6,075	
フジインコーポレーテッド	6	6.5	45,630	
ニチアス	17.7	20	48,360	
ニチハ	10.2	9.9	27,947	
鉄鋼 (0.8%)				
日本製鉄	322.2	351.2	770,006	
神戸製鋼所	133.7	173	107,260	
中山製鋼所	14.9	17.3	13,061	
合同製鐵	5.2	4.4	8,373	
JFEホールディングス	194	215	328,090	
東京製鐵	24.6	21.9	30,725	
共英製鋼	9.1	13	16,809	
大和工業	14	14.8	69,708	
東京製鋼	4.7	4.5	6,354	
大阪製鐵	—	5.6	6,356	
淀川製鋼所	9.6	8.4	21,361	
丸一鋼管	25.6	27.2	77,329	
モリ工業	2.6	2.8	7,876	
大同特殊鋼	11.9	12	52,980	

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
日本冶金工業	5.5	5.9	25,399	
山陽特殊製鋼	7.6	7.6	16,818	
愛知製鋼	4.7	7	15,911	
日立金属	77.3	—	—	
大平洋金属	4.9	8	16,400	
新日本電工	47.2	52.1	21,986	
栗本鐵工所	4.7	4.4	7,902	
三菱製鋼	5.7	6.1	6,069	
日本精線	1.5	2	8,730	
エンビプロ・ホールディングス	3.4	10	7,200	
新家工業	—	3.1	7,167	
非鉄金属（0.7%）				
大紀アルミニウム工業所	10.6	11.1	14,374	
日本軽金属ホールディングス	18.4	21.7	33,244	
三井金属鉱業	19.3	22.9	71,791	
東邦亜鉛	4.6	5.1	11,010	
三菱マテリアル	47.4	52.6	115,036	
住友金属鉱山	92.1	91.1	423,159	
DOWAホールディングス	19.5	17.9	80,908	
古河機械金属	11.8	11.1	14,330	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11	11.7	49,081	
東邦チタニウム	13.5	14.4	39,571	
UACJ	10.8	11.1	25,585	
CKサンエツ	2	2.2	9,295	
古河電気工業	22.6	26.3	68,301	
住友電気工業	269.8	270.6	433,095	
フジクラ	80.4	85.3	95,280	
昭和電線ホールディングス	6.4	8.9	15,975	
タツタ電線	14.9	16.1	6,939	
平河ヒューテック	5.4	5	5,490	
リョービ	10.2	8.9	11,062	
アサヒホールディングス	28.7	31.7	64,794	
金属製品（0.6%）				
稲葉製作所	—	8.9	12,344	
宮地エンジニアリンググループ	3.2	2.5	8,512	
トーカロ	18.4	21.4	26,578	
アルファ	4.9	7.4	7,081	
SUMCO	110.9	149.4	302,236	
川田テクノロジーズ	2.1	2.2	7,414	
RS Technologies	2.4	2.6	21,320	
信和	—	11.2	8,836	
東洋製罐グループホールディングス	46.3	52	82,888	
ホッカンホールディングス	5.4	5.8	7,673	
横河ブリッジホールディングス	12.4	10.3	19,909	
駒井ハルテック	3.1	—	—	

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	68.4	72	92,880	
文化シャッター	23	22.6	25,402	
三協立山	12	12.5	7,062	
アルインコ	8	7.5	7,500	
LIXIL	113.4	114.2	240,847	
ノーリツ	13.9	11.7	17,362	
長府製作所	7.3	7.9	15,578	
リンナイ	13.6	14.2	144,556	
日東精工	13	12.5	6,537	
岡部	18	14.2	10,209	
ジーテクト	9.2	8.6	13,192	
東プレ	13.7	13.9	17,500	
高周波熱錬	16.3	14.5	9,860	
東京製鋼	7	5.8	5,167	
サンコール	—	8.4	5,342	
モリテックスチール	—	8.8	2,156	
パイオラックス	11	11.1	19,314	
エイチワン	9.9	—	—	
日本発条	66.8	69.5	63,592	
立川プラインド工業	5	—	—	
三益半導体工業	5.6	7	17,906	
機械（5.2%）				
日本製鋼所	22.2	21.4	62,488	
三浦工業	31.3	32.2	104,972	
タクマ	24.1	24	30,624	
ツガミ	17.4	17.4	20,601	
オークマ	8.5	7.7	40,117	
芝浦機械	8.3	8.7	23,855	
アマダ	113.4	121.6	133,516	
アイダエンジニアリング	19	16.3	13,610	
FUJII	33	33.3	69,064	
牧野フライス製作所	7.8	8.5	39,227	
オーエスジー	34	36.9	71,438	
旭ダイヤモンド工業	19.4	23.1	16,632	
DMG森精機	42.9	46.8	85,690	
ソディック	16.8	21	16,023	
ディスコ	10.6	12.3	499,380	
日東工器	4.8	4.4	6,714	
日進工具	6.3	6.7	7,550	
パンチ工業	—	3.3	1,389	
豊和工業	—	6.5	5,726	
石川製作所	—	3.5	5,078	
島精機製作所	10.8	12.3	25,731	
オプトラン	9.3	11.6	29,545	
NCホールディングス	3	2.5	5,240	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
イワキ	—	5.7	7,449	
フリー	7.2	8.9	10,279	
ヤマシンフィルタ	15.4	20.4	9,832	
日阪製作所	11.3	9.1	7,443	
やまびこ	13.9	13.1	14,855	
野村マイクロ・サイエンス	2	2.6	12,233	
平田機工	3.5	3.8	20,786	
ペガサスミシン製造	—	9.6	9,283	
マルマエ	3.3	4.2	7,984	
タツモ	4.2	5	8,830	
ナフテスコ	41.1	48.4	165,044	
三井海洋開発	8.2	9.9	15,137	
レオン自動機	8.6	8.7	10,179	
S M C	21.3	24.9	1,537,824	
ホソカワミクロン	5.1	6.1	17,958	
ユニオンツール	2.8	3.3	11,583	
オイレス工業	10	10.9	16,284	
日精エー・エス・ピー機械	2.7	3.6	15,156	
サトーホールディングス	9.7	11.1	21,689	
技研製作所	6.4	8.2	26,937	
日本エアーテック	4.7	5.3	6,211	
日精樹脂工業	6.5	7.2	6,890	
オカダアイヨン	—	1.4	2,165	
ワイエイシイホールディングス	—	4.1	6,010	
小松製作所	330.5	360	1,144,440	
住友重機械工業	41.6	45.3	131,913	
日立建機	29.2	30.6	98,226	
日工	13.6	13.7	8,494	
巴工業	3.5	4	9,672	
井関農機	7.7	8.5	10,854	
T O W A	6.5	8.1	15,948	
北川鉄工所	4.8	—	—	
ローツェ	3.6	4	33,560	
クボタ	355.8	406.5	825,195	
荏原実業	3.6	4	9,068	
三菱化工機	3	3.1	6,559	
月島機械	13.8	11.6	11,379	
帝国電機製作所	6.1	6.1	14,438	
新東工業	18.5	17.1	11,457	
澁谷工業	6.4	7.2	17,841	
アイチ コーポレーション	11.8	11.5	9,200	
小森コーポレーション	20.4	19.2	15,628	
鶴見製作所	6.3	6.1	12,175	
酒井重工業	—	1.8	6,345	
荏原製作所	30.3	31.4	165,164	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
西島製作所	10	7.7	11,935	
北越工業	9.1	8.8	10,146	
ダイキン工業	92.9	91.7	2,054,538	
オルガノ	2	10.5	29,589	
トーヨーカネツ	3.4	3.7	9,201	
栗田工業	39.4	42.9	261,690	
椿本チエイン	9.5	10.6	33,337	
大同工業	5.3	7.9	6,083	
木村化工機	7.5	8.6	6,020	
アネスト岩田	12.8	13.9	13,121	
ダイフク	40	39.6	278,784	
サムコ	2.3	2.7	10,435	
タダノ	39	41.4	40,572	
フジテック	27.3	28.2	84,882	
C K D	21.4	21.3	43,515	
キトー	7.2	—	—	
平和	20.4	25.8	63,081	
理想科学工業	6.4	7	16,646	
S A N K Y O	16.1	15.3	82,008	
日本金銭機械	9.1	10.5	10,647	
マースグループホールディングス	6.2	5.5	11,275	
フクシマガリレイ	5.1	5.7	24,795	
ダイコク電機	5	5.4	8,672	
竹内製作所	11	14	44,450	
アマノ	19.3	22	54,450	
J U K I	11.8	13.8	9,259	
ジャノメ	8.1	9.8	6,076	
マックス	9.9	9.4	19,354	
グローリー	19.2	20.4	47,001	
新晃工業	7	8.3	12,848	
大和冷機工業	10.5	11.6	14,210	
セガサミーホールディングス	72.5	62	113,026	
日本ピストンリング	4.4	1.2	1,449	
リケン	3.7	3.8	8,652	
T P R	10	9.8	12,073	
ツバキ・ナカシマ	16.5	18	18,630	
ホンザキ	21.3	49.5	229,432	
大豊工業	8.2	8	5,592	
日本精工	136.1	141.2	107,312	
N T N	157.9	155.1	44,979	
ジェイテクト	69.6	68	68,680	
不二越	6.1	5.7	22,059	
日本トムソン	22.1	20.4	12,423	
T H K	42.5	44.4	118,503	
ユースン精機	8.7	—	—	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
前澤給装工業	7.3	6.8	6,344	
イーグル工業	10	9.2	10,202	
日本ビラー工業	7.4	7.3	20,184	
キッツ	25.3	29	24,476	
マキタ	88.9	95.9	300,167	
日立造船	61.6	63.5	56,896	
三菱重工業	114.6	134.5	733,966	
I H I	45.6	48.5	182,360	
スター精密	11.6	14.6	25,623	
電気機器 (17.4%)				
日清紡ホールディングス	44.9	63.3	64,186	
イビデン	38.2	44	242,440	
コニカミノルタ	160.3	173.4	98,664	
ブラザー工業	88.8	102.2	226,270	
ミネベアミツミ	125.2	133	298,319	
日立製作所	350.5	385.5	2,813,764	
東芝	127.3	147.9	693,651	
三菱電機	729	793.7	1,093,321	
富士電機	43.9	46.6	261,892	
安川電機	78.3	90.9	404,050	
シンフォニア テクノロジー	9.5	9.2	13,864	
明電舎	12.6	12	23,844	
オリジン	4.3	3.7	4,869	
山洋電気	3.3	3.5	21,700	
デンヨー	7	6.6	9,900	
P H Cホールディングス	8	10.9	17,385	
ソシオネクスト	—	7.5	50,025	
東芝テック	7.9	11.4	42,123	
芝浦メカトロニクス	1.4	1.5	16,470	
マブチモーター	17.1	19	78,470	
日本電産	188.9	186.6	1,592,444	
トレックス・セミコンダクター	4.2	3.9	11,411	
東光高岳	5.2	5.2	9,604	
ダブル・スコープ	—	19.5	36,426	
ダイヘン	8	7.1	28,968	
ヤーマン	12.4	15.7	20,504	
J V Cケンウッド	65.9	75.6	27,972	
ミマキエンジニアリング	8.5	8.5	5,559	
I - P E X	4.1	5.3	6,937	
日新電機	17.2	18.1	24,272	
大崎電気工業	18	21.4	11,406	
オムロン	60.7	70.4	495,897	
日東工業	9.8	10.5	24,475	
I D E C	9.4	11.5	37,547	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	24.4	25.6	55,321	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
メルコホールディングス	2.2	2.3	7,153	
日本電気	92.5	108.6	527,253	
富士通	65.6	76.5	1,412,572	
沖電気工業	31.1	36.6	26,644	
電気興業	4.4	4	8,400	
サンケン電気	6.9	7.2	47,736	
アイホン	4.7	5.1	9,776	
ルネサスエレクトロニクス	394.7	500.9	659,184	
セイコーエプソン	90.5	102.2	219,934	
ワコム	56.5	61.4	39,787	
アルバック	13.5	18.3	108,519	
アクセル	—	4	6,028	
E I Z O	5.7	5.8	20,851	
日本信号	19.1	17.8	18,387	
京三製作所	18.7	19.4	8,031	
能美防災	9.9	10.4	16,536	
ホーチキ	6.5	6.4	9,248	
エレコム	16.8	18.5	26,862	
パナソニック ホールディングス	777.6	907.3	1,155,900	
シャープ	83.3	92.8	90,294	
アンリツ	46.9	54.6	80,043	
富士通ゼネラル	19.9	21.9	70,846	
ソニーグループ	456.5	537.9	6,054,064	
T D K	105.5	121.6	593,408	
帝国通信工業	5	4.3	6,032	
タムラ製作所	29.1	34.1	27,825	
アルプスアルパイン	65.1	69.6	90,619	
日本電波工業	8.2	9.6	16,752	
鈴木	—	3	2,757	
メイコー	6	8.6	25,843	
日本トリム	2.1	2.4	5,908	
ローランド ディー・ジー	4.8	4.5	13,882	
フォスター電機	9.8	9.1	8,745	
S M K	2.5	2.3	6,069	
ヨコオ	5.5	6.4	15,449	
ホシデン	17.4	18.7	30,406	
ヒロセ電機	11.2	12.7	231,140	
日本航空電子工業	17	15.7	36,847	
T O A	9.8	10.3	7,889	
マクセル	15	17.4	24,534	
古野電気	9.6	10.7	10,914	
ユニデンホールディングス	2.1	—	—	
スミダコーポレーション	7.9	8	11,696	
アイコム	3.4	3.2	8,912	
リオン	3.6	3.6	7,380	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
横河電機	73.1	84	215,544	
新電元工業	3.1	3.2	10,672	
アズビル	42.7	53.1	221,692	
東亜ディーケーケー	5.4	7.6	6,452	
日本光電工業	29.9	35.3	112,783	
チノー	—	4.2	7,728	
共和電業	16.2	—	—	
日本電子材料	4	6.4	9,868	
堀場製作所	13.4	17	106,080	
アドバンテスト	54.1	59.8	545,974	
エスベック	6.2	6.6	13,582	
キーエンス	66	76.1	4,348,354	
日置電機	3.5	4	27,280	
シスメックス	61.6	65.5	544,829	
日本マイクロニクス	13.1	12.9	18,821	
メガチップス	6.9	6.5	17,192	
OBARA GROUP	3.7	4.4	15,334	
コーセル	10.6	11.5	9,786	
イリソ電子工業	6.3	7.1	33,796	
オブテックスグループ	12.7	14.3	30,687	
千代田インテグレ	4	4.3	10,350	
レーザーテック	32	37.5	942,562	
スタンレー電気	50.9	54	150,822	
岩崎電気	3.6	3.1	7,892	
ウシオ電機	37.6	40	71,280	
ヘリオス テクノ ホールディング	—	11.5	5,129	
エノモト	—	2.5	4,855	
日本セラミック	6.9	8	21,176	
遠藤照明	4.8	—	—	
古河電池	5.6	6.2	6,962	
双信電機	—	2.8	1,190	
山一電機	6.1	7.1	13,099	
図研	4.8	6.7	22,043	
日本電子	15.2	19	86,640	
カシオ計算機	53	57.1	76,514	
ファナック	64	74.6	1,519,229	
日本シイエムケイ	18.2	18.6	10,750	
エンプラス	2.2	2.4	10,728	
大真空	11.6	10.2	8,557	
ローム	32.6	35.1	380,835	
浜松ホトニクス	52.2	60.8	435,328	
三井ハイテック	7.2	7.9	62,884	
新光電気工業	21.3	26.8	101,974	
京セラ	102.6	118.1	824,456	
太陽誘電	35.3	37	161,505	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
村田製作所	214	230.5	1,720,452	
双葉電子工業	14.5	17.6	10,419	
北陸電気工業	6.1	1.6	2,064	
ニチコン	23.1	15.9	22,482	
日本ケミコン	7.3	8.1	14,912	
KOA	11.2	11.8	25,948	
市光工業	10.7	12.9	5,495	
小糸製作所	39.9	91.1	197,231	
ミツバ	15.6	16.5	8,794	
SCREENホールディングス	12.7	13	117,390	
キャノン電子	7.7	8.7	13,746	
キャノン	362	417.3	1,340,367	
リコー	202.3	190	206,340	
象印マホービン	19.7	22.7	36,297	
東京エレクトロン	46.2	53.6	2,416,824	
イノテック	5.5	6	7,812	
輸送用機器 (7.7%)				
トヨタ紡織	29.6	32	61,152	
ユニプレス	12.6	15	13,230	
豊田自動織機	58.9	55.3	431,893	
モリタホールディングス	12.4	14	17,724	
三櫻工業	11.1	12.5	8,362	
デンソー	160.5	156.7	1,177,443	
東海理化電機製作所	19.3	20.9	32,436	
川崎重工業	53.2	57.6	168,537	
日本車輛製造	3.6	3.7	7,270	
三菱ロジスネクスト	10.6	14	12,516	
日産自動車	859.2	1,081.7	531,331	
いすゞ自動車	228.5	220.6	395,756	
トヨタ自動車	3,691.1	4,175.6	8,395,043	
日野自動車	91.5	99	61,380	
三菱自動車工業	269.9	297.8	189,400	
武蔵精密工業	16.4	18.6	32,884	
日産車体	12.7	13.7	11,398	
新明和工業	20.3	24.7	25,021	
極東開発工業	13.4	13.7	18,673	
トビー工業	7.9	6.9	11,937	
ティラド	2.5	2.5	6,620	
曙ブレーキ工業	44.8	53.4	8,811	
タチエス	13.3	13.1	14,357	
NOK	36	30	37,920	
フタバ産業	20.8	24	9,000	
KYB	7.5	7.4	26,825	
大同メタル工業	18.4	19.6	9,702	
プレス工業	39.7	35.7	16,100	

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
ミクニ	—	13.5	4,590	
太平洋工業	15.6	17.9	19,314	
アイシン	53.1	58.3	219,499	
マツダ	228.8	252	274,932	
本田技研工業	573.8	618	2,074,008	
スズキ	166.5	139.8	686,837	
S U B A R U	208.7	241.1	566,946	
安永	5	—	—	
ヤマハ発動機	95	119.2	407,068	
T B K	14.5	18.5	4,828	
エクセディ	10.9	12.7	21,183	
豊田合成	23.5	22.2	50,660	
愛三工業	13.4	13.8	9,687	
日本プラスト	—	15.9	6,789	
ヨロズ	8.9	9	7,245	
エフ・シー・シー	11.8	13.4	19,095	
シマノ	29.4	31.1	727,118	
テイ・エス テック	30.8	34.9	56,084	
ジャムコ	6.3	2.4	3,866	
精密機器 (2.7%)				
テルモ	206.3	237.5	960,212	
日機装	21.7	19.5	19,519	
日本エム・ディ・エム	4.7	5	5,180	
島津製作所	93.5	92.3	385,814	
J M S	8.1	—	—	
長野計器	5.9	6.4	7,392	
ブイ・テクノロジー	3.4	4.1	11,041	
東京計器	6.8	7	8,239	
愛知時計電機	—	3.8	5,202	
インターアクション	3.9	5.1	8,073	
オーバル	—	8	4,016	
東京精密	12.2	16.6	72,044	
マニー	29.6	33.6	75,936	
ニコン	111.7	118.4	157,945	
トプコン	34.7	40.3	66,374	
オリンパス	382.7	475.4	1,333,972	
理研計器	5.7	4.8	24,000	
タムロン	5.7	5.7	19,750	
H O Y A	142.3	164.3	2,310,058	
ノーリツ鋼機	6.7	7.3	19,228	
A&Dホロンホールディングス	7.6	11.1	11,577	
朝日インテック	80.1	100.5	242,607	
シチズン時計	83.8	83.7	50,220	
リズム	3.4	3	5,292	
メニコン	24	26.2	76,111	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
松風	3.6	3.7	8,991	
セイコーグループ	10.1	11.8	37,347	
ニプロ	55.6	64.5	65,596	
その他製品 (2.4%)				
スノーピーク	9.6	13.3	30,124	
パラマウントベッドホールディングス	14	17.3	46,381	
トランザクション	5.5	6.6	8,487	
ニホンフラッシュ	7.2	7.8	7,527	
前田工織	8	8.4	27,258	
永大産業	20.5	27.2	6,147	
アートネイチャー	9.3	8.9	6,915	
バンダイナムコホールディングス	65.3	69.4	627,723	
S H O E I	7.2	8	44,320	
フランスベッドホールディングス	12.4	10.6	9,879	
パイロットコーポレーション	12.7	11.9	58,905	
萩原工業	5.8	6.5	6,909	
フジセールインターナショナル	17.7	15.5	28,969	
タカラトミー	31	35.3	44,336	
広済堂ホールディングス	5.4	5.5	10,697	
プロネクサス	7.6	7.5	7,245	
ウッドワン	—	5	4,660	
大建工業	4.6	5	10,690	
凸版印刷	110.4	98.9	210,854	
大日本印刷	86	89.8	255,121	
共同印刷	3.1	2.7	7,840	
N I S S H A	15.2	14.6	25,681	
TAKARA & COMPANY	4.8	5.8	12,116	
アシックス	64.7	70.3	207,736	
ローランド	5.2	5.7	23,142	
小松ウオール工業	—	3	5,520	
ヤマハ	43.3	47.8	258,598	
河合楽器製作所	2.4	2.2	5,673	
クリナップ	—	9.7	6,499	
ビジョン	44.3	49	100,156	
キングジム	8.4	7.9	7,062	
リンテック	15.8	15.2	34,169	
イトーキ	19.7	18.1	9,683	
任天堂	41.2	480.2	2,830,298	
三菱鉛筆	12.1	10.9	15,194	
タカラスタンダード	16.4	14.2	18,800	
コクヨ	35.1	36.5	65,955	
ナカバヤシ	11.4	3.3	1,653	
グローブライト	6.5	6.2	16,603	
オカムラ	26.7	22.5	31,837	
美津濃	7.4	7.6	21,804	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
電気・ガス業 (1.2%)				
東京電力ホールディングス	545.7	686.3	342,463	
中部電力	221	278.9	359,223	
関西電力	275.5	292.3	340,821	
中国電力	113.7	121.9	87,158	
北陸電力	68.2	73.7	39,576	
東北電力	168	186.2	121,588	
四国電力	66.5	65.8	49,547	
九州電力	147.8	174.3	125,147	
北海道電力	64.2	75.2	34,140	
沖縄電力	15.5	19.1	20,131	
電源開発	62.1	57.5	121,785	
エフオン	6.4	6.8	3,726	
イーレックス	10.9	13.5	34,047	
レノバ	14.2	20.3	55,439	
東京瓦斯	139.3	160.6	405,675	
大阪瓦斯	131.1	153.6	325,939	
東邦瓦斯	33.4	30	80,730	
北海道瓦斯	5.5	5	8,460	
広島ガス	20.4	13.7	4,658	
西部ガスホールディングス	8.4	7.1	11,913	
静岡ガス	18.8	17	18,700	
メタウォーター	8.5	9.4	16,816	
陸運業 (3.2%)				
SBSホールディングス	5.2	6.6	19,569	
東武鉄道	70.3	83.1	275,061	
相鉄ホールディングス	23.7	25.4	55,626	
東急	182.9	212.2	371,137	
京浜急行電鉄	93.3	86.6	124,704	
小田急電鉄	107.7	115	207,230	
京王電鉄	37.7	40.2	205,824	
京成電鉄	50.7	48.9	191,443	
富士急行	8.8	9.4	46,248	
新京成電鉄	3.5	—	—	
東日本旅客鉄道	128.4	129.1	1,008,400	
西日本旅客鉄道	88.4	97.5	569,010	
東海旅客鉄道	60.7	58.7	976,181	
西武ホールディングス	95.6	92.4	127,512	
鴻池運輸	11.9	13.1	20,711	
西日本鉄道	20.5	20.2	56,681	
ハマキョウレックス	5.2	5.9	20,207	
サカイ引越センター	3.3	3.7	17,001	
近鉄グループホールディングス	68.4	75.7	370,930	
阪急阪神ホールディングス	85.7	100.7	432,003	
南海電気鉄道	31.5	36.4	109,564	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
京阪ホールディングス	30.8	31.4	108,644	
神戸電鉄	2.8	2.8	9,058	
名古屋鉄道	56.5	84	189,756	
山陽電気鉄道	6.7	6.3	14,080	
アルプス物流	—	6	6,960	
日本通運	23.8	—	—	
ヤマトホールディングス	96.6	97.2	222,879	
山九	19.1	19.3	95,438	
丸全昭和運輸	5.7	4.7	15,134	
センコーグループホールディングス	33.2	39.8	40,436	
トナミホールディングス	1.9	1.8	6,570	
ニッコンホールディングス	23.7	24.3	58,781	
福山通運	11.2	6.3	22,050	
セイノーホールディングス	46.6	47	56,588	
神奈川中央交通	2.5	2.5	8,412	
日立物流	13.6	16.7	148,463	
AZ-COM丸和ホールディングス	14.3	18.5	27,010	
C&Fロジホールディングス	7.8	7.8	9,562	
九州旅客鉄道	53.7	54.1	163,652	
SGホールディングス	130.4	145.4	309,702	
NIPPON EXPRESS ESホールディングス	—	28.1	227,329	
海運業 (0.6%)				
日本郵船	57.5	202	613,474	
商船三井	38.1	133.3	448,554	
川崎汽船	21.3	64.7	168,090	
NSユニテッド海運	4	4.2	15,876	
明治海運	9.3	9.3	6,705	
飯野海運	33	29	27,057	
乾汽船	5.3	10.6	19,366	
空運業 (0.5%)				
日本航空	158.6	185.8	507,791	
ANAホールディングス	175.6	207.3	610,394	
パスコ	—	3.2	4,259	
倉庫・運輸関連業 (0.1%)				
トランコム	2	2.2	17,424	
日新	6.3	6.3	12,814	
三菱倉庫	22.1	16.2	54,108	
三井倉庫ホールディングス	7.5	7.1	25,098	
住友倉庫	23.7	20.4	40,840	
澁澤倉庫	4.6	3.5	7,273	
東陽倉庫	19.9	27.4	7,041	
日本トランスシティ	16.4	16	8,016	
川西倉庫	3.5	5.2	5,231	
安田倉庫	7.4	—	—	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)	期	末
	株数	株数	評価額
東洋埠頭	5.9	0.9	1,154
上組	37.3	37.4	104,682
キューソー流通システム	—	6.6	6,817
近鉄エクスプレス	12.7	—	—
エアイテイー	5.9	5.4	7,759
内外トランスライン	3.2	3.2	7,052
日本コンセプト	3	2.9	5,066
情報・通信業（8.8%）			
NECネットエスアイ	23.2	25.3	41,542
クロスキャット	—	4.8	7,675
システナ	101.2	126.9	53,298
デジタルアーツ	3.9	4.9	31,605
日鉄ソリューションズ	10.1	12.7	43,624
キューブシステム	—	5.7	5,796
コア	4	3.9	5,733
手間いらざ	1.1	1.3	6,695
ラクーンホールディングス	6	8.5	10,710
ソリトンシステムズ	5	5.1	5,941
ソフトクリエイティブホールディングス	3.3	3.4	11,968
T I S	68.1	85.4	332,206
グリー	44.1	41.9	32,179
コーエーテックモホールディングス	22.8	47.8	113,525
三菱総合研究所	3.1	3.7	19,055
ファインデックス	8.7	8	4,416
ブレインパッド	2	8.2	7,322
K L a b	15.4	17.2	8,428
ポルトゥウィンホールディングス	11.6	13.7	12,836
ネクソン	161.4	197.1	570,407
アイスタイル	26	25.3	13,611
エムアップホールディングス	2.3	9.6	12,998
エイチーム	5.9	7	5,803
エニグモ	8.9	11.2	6,686
コロブラ	24.4	30	20,580
ブロードリーフ	37.1	46.4	23,014
クロス・マーケティンググループ	—	4.2	3,288
デジタルハーツホールディングス	4.2	5.2	9,828
システム情報	7	7.4	6,645
メディアアドゥ	2.7	3.5	6,685
じげん	25.2	25.2	8,996
ブイキューブ	7.8	10.2	8,109
サイバーリンクス	—	3.1	3,506
ディー・エル・イー	—	8.6	2,889
フィックスターズ	10.6	9.6	13,209
CARTA HOLDINGS	3.5	4.2	7,140
オプティム	6	7.3	8,482

銘柄	期首(前期末)	期	末
	株数	株数	評価額
セレス	3	—	—
S H I F T	3.6	5.6	161,672
ティーガイア	7	8.1	13,381
テクマトリックス	12.6	14.3	23,537
プロシップ	—	3.9	5,955
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19.8	23.8	49,504
GMOペイメントゲートウェイ	13.9	17.4	211,584
システムリサーチ	3.1	2.7	5,483
インターネットイニシアティブ	19.1	42.4	103,880
さくらインターネット	12.8	11.1	5,849
ヴィンクス	—	1	1,682
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1.8	2.5	10,000
S R Aホールディングス	4.2	4.1	12,812
朝日ネット	—	9.4	5,367
e B A S E	10.2	12.1	7,502
アバントグループ	8.3	9.8	14,700
アドソル日進	3.7	4	6,032
フリービット	5.3	5.7	6,589
コムチュア	8	10.3	26,852
アステリア	7.9	7.5	6,090
アイル	4.4	4.4	8,760
マークライন্ズ	4.1	4.5	12,523
メディカル・データ・ビジョン	10	12.2	12,224
g u m i	11	13.3	9,802
テラスカイ	3.3	3.6	10,080
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4.3	4.5	8,932
P C Iホールディングス	5.9	—	—
ネオジャパン	—	0.9	900
P R T I M E S	1.7	2.2	5,451
ラクス	24.7	36.2	62,264
ダブルスタンダード	2.4	3.4	7,524
オープンドア	4.7	5.7	11,211
アカツキ	3.5	4.2	9,550
Ubicomホールディングス	2.5	2.8	6,426
カナミックネットワーク	10.6	12.8	8,256
チェンジ	13.2	18.8	41,002
シンクロ・フード	—	6.4	3,046
オークネット	4.5	4.3	8,389
マクロミル	17.5	18	19,854
オロ	2.6	2.9	5,414
ユーザーローカル	3.4	3.2	5,088
マネーフォワード	10.9	17.2	84,022
電算システムホールディングス	3.3	4	9,088
プロトコーポレーション	8.6	10	12,600
野村総合研究所	138.1	156.3	468,274

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
サイバネットシステム	—	8.4	8.4	8,122	
日本システム技術	—	3.9	3.9	6,762	
インテージホールディングス	9.3	10.6	10.6	16,239	
ソースネクスト	37.9	41.1	41.1	11,466	
インフォコム	8.1	9.9	9.9	20,255	
シンプレクス・ホールディングス	7.4	12.9	12.9	29,940	
HEROZ	2.4	3.3	3.3	4,115	
ラクスル	7.9	11	11	33,715	
メルカリ	—	33.6	33.6	94,449	
I P S	2.7	2.7	2.7	8,302	
F I G	—	11.9	11.9	4,867	
システムサポート	—	3.9	3.9	5,818	
イーソル	6.5	3.1	3.1	2,824	
アルテリア・ネットワークス	9.8	8.3	8.3	10,375	
ウイングアーク1st	4.7	8.1	8.1	17,973	
サーバーワークス	1.4	1.8	1.8	5,052	
S a n s a n	25.6	29	29	48,430	
ギフトィ	6.5	8.5	8.5	19,218	
ベース	1.5	2.6	2.6	10,049	
J M D C	—	12.6	12.6	64,512	
フォーカスシステムズ	7.2	7	7	7,014	
クレスコ	6.1	6.3	6.3	10,930	
フジ・メディア・ホールディングス	69.2	73.6	73.6	79,267	
オービック	22.5	25.4	25.4	551,180	
ジャストシステム	10.2	11.2	11.2	36,960	
T D C ソフト	7.4	6.7	6.7	9,842	
Zホールディングス	1,040.9	1,087.2	1,087.2	406,069	
トレンドマイクロ	38.3	44.1	44.1	300,321	
日本オラクル	14.6	14.8	14.8	118,844	
アルファシステムズ	2.1	2.4	2.4	10,176	
フューチャー	7.4	18.9	18.9	31,581	
C A C H o l d i n g s	5.3	4.9	4.9	7,506	
S B テクノロジー	3.6	3.6	3.6	7,416	
オービックビジネスコンサルタント	6.8	15	15	70,125	
伊藤忠テクノソリューションズ	32.5	40.8	40.8	136,680	
アイティフォー	10.4	11.3	11.3	9,051	
東計電算	—	1.4	1.4	8,274	
大塚商会	38.6	43.3	43.3	197,881	
サイボウズ	9.8	10.8	10.8	23,965	
電通国際情報サービス	10.2	9.1	9.1	41,632	
A C C E S S	10.5	10.3	10.3	7,704	
デジタルガレージ	11.9	13.6	13.6	54,468	
イーエムシステムズ	14.8	13.5	13.5	13,338	
ウェザーニューズ	2.2	2.8	2.8	21,308	
C I J	7.3	7.8	7.8	7,285	

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
ビジネスエンジニアリング	—	2	2	4,438	
WOWOW	4	5.8	5.8	7,261	
スカラ	10.3	10	10	7,470	
インテリジェント ウェイブ	—	5.3	5.3	4,271	
I M A G I C A G R O U P	7.3	7	7	5,285	
ネットワンシステムズ	27.3	28.6	28.6	97,240	
アルゴグラフィックス	5.7	7	7	26,600	
マーベラス	14.3	13.6	13.6	9,234	
エイベックス	13	13.5	13.5	20,641	
B I P R O G Y	22.5	28.2	28.2	92,637	
兼松エレクトロニクス	3.9	4.8	4.8	21,912	
都築電気	4.4	4.6	4.6	6,136	
T B S ホールディングス	43.7	39.1	39.1	61,308	
日本テレビホールディングス	59.8	67.6	67.6	71,588	
朝日放送グループホールディングス	10.9	2.6	2.6	1,617	
テレビ朝日ホールディングス	17.6	18.8	18.8	25,774	
スカパーJ S A Tホールディングス	60.7	68.6	68.6	34,848	
テレビ東京ホールディングス	5.8	6	6	11,046	
ビジョン	12.7	10.5	10.5	14,458	
USEN-NEXT HOLDINGS	7	7	7	16,457	
コネクシオ	5.7	5.3	5.3	6,354	
日本通信	—	75.2	75.2	16,694	
日本電信電話	836.5	977.2	977.2	3,732,904	
K D D I	521.6	589.4	589.4	2,423,023	
ソフトバンク	1,083.9	1,225.3	1,225.3	1,834,886	
光通信	8.4	9	9	172,530	
エムティーアイ	10.4	9.1	9.1	4,604	
G M O インターネットグループ	25.7	28.5	28.5	72,247	
ファイバーゲート	3.4	5.3	5.3	4,982	
K A D O K A W A	21	40.5	40.5	102,991	
学研ホールディングス	11.1	13.8	13.8	14,158	
ゼンリン	13.6	13.6	13.6	11,709	
アイネット	5.8	5.8	5.8	7,569	
松竹	4.9	4.5	4.5	53,550	
東宝	42.2	47.6	47.6	251,804	
東映	2.3	2.1	2.1	39,711	
エヌ・ティ・ティ・データ	190	238.5	238.5	501,327	
ピー・シー・エー	4.9	5.3	5.3	6,794	
ビジネスブレイン太田昭和	3.3	4	4	7,804	
D T S	13.1	16.3	16.3	53,708	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	33.3	38.4	38.4	237,696	
シーイーシー	8.8	11.1	11.1	16,794	
カプコン	67.4	75.7	75.7	316,047	
アイ・エス・ビー	4.7	4.5	4.5	5,886	
ジャステック	5.9	5.6	5.6	6,708	

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
SCSK	49.6	61.9	136,303	
NSW	3.3	3.3	7,161	
アイネス	7.6	6	8,664	
TKC	11.9	13.2	49,302	
富士ソフト	7.6	8.5	69,190	
NSD	22.8	26.7	68,352	
コナミグループ	26.1	32.7	210,915	
福井コンピュータホールディングス	3.7	5.4	15,897	
JBCCHホールディングス	5.9	5.9	11,558	
ミロク情報サービス	7.6	7.6	11,407	
ソフトバンクグループ	429.1	441.1	2,625,427	
卸売業（5.9%）				
高千穂交易	—	3.3	7,227	
伊藤忠食品	2	1.8	9,342	
エレマテック	7	7.4	11,366	
あらた	5.6	6.2	24,955	
トーメンデバイス	1.2	1.3	7,241	
東京エレクトロン デバイス	2.1	3	20,610	
円谷フィーズホールディングス	10	7.2	17,078	
双日	78.9	85.3	207,961	
アルフレッサ ホールディングス	79.7	81.1	135,112	
横浜冷凍	21.5	24.1	23,979	
ラサ商事	—	5.8	5,852	
アルコニックス	7.9	11.4	14,991	
神戸物産	55.7	62.2	222,365	
あい ホールディングス	10.6	12.8	28,416	
ダイワボウホールディングス	34.8	32.9	71,590	
マクニカホールディングス	16.9	19.5	67,177	
ラクト・ジャパン	2.8	3.6	7,635	
グリムス	3.3	3.5	6,352	
バイタルケ-エスケ-ホールディングス	14.7	13.4	11,068	
八洲電機	8.4	7.8	7,917	
メディアスホールディングス	—	6.8	5,202	
レスターホールディングス	6.6	7.6	16,864	
ジュテックホールディングス	3.1	4.7	5,419	
TOKAIホールディングス	33.6	39.5	34,602	
三洋貿易	8.9	8.9	10,137	
ビューティガレージ	1.5	1.8	5,427	
ウイン・パートナーズ	5.6	5.6	5,555	
シップヘルスケアホールディングス	22.9	29.1	80,694	
コメダホールディングス	16.3	20.3	48,963	
アセンテック	3.7	—	—	
フルサト・マルカホールディングス	7.1	8	31,760	
ヤマエグループホールディングス	6.2	5	7,165	
小野建	7.3	8.2	11,840	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
佐島電機	6.2	6.1	8,222	
伯東	4.8	4.7	17,554	
コンドーテック	7.6	7.3	7,329	
ナガイレーベン	9.8	10.5	21,073	
三菱食品	6.4	8.3	26,975	
松田産業	5.3	6.2	14,278	
第一興商	13.9	15.7	64,213	
メディバルホールディングス	77.1	83.6	152,988	
SPK	5.3	4.8	6,676	
萩原電気ホールディングス	3.5	3.7	9,312	
アズワン	5.1	11.8	72,098	
スズデン	—	3.8	8,713	
尾家産業	5	4.7	4,352	
シモジマ	6.3	6.2	5,958	
ドウシシャ	7.5	8.5	12,954	
高速	5.2	4.4	7,779	
リックス	—	2	4,412	
丸文	8.6	8.6	7,826	
ハビネット	6.9	7.2	13,975	
日本ライフライン	21.9	24.3	23,012	
タカショー	7.4	9.1	6,406	
IDOM	22.5	25.1	18,774	
進和	5	5.8	11,936	
ダイトロン	3.6	3.6	8,805	
シークス	11.1	11.7	16,368	
オーハシテクニカ	5.4	4.9	6,855	
白銅	2.8	3.2	7,977	
伊藤忠商事	501.7	495.4	2,123,779	
丸紅	706.9	633	979,884	
高島	—	1	2,970	
長瀬産業	39.2	37.2	75,106	
蝶理	4.8	4.4	8,742	
豊田通商	71.9	70	366,100	
三共生興	12.8	17.3	8,355	
兼松	25.5	30.7	46,909	
三井物産	557	588.6	2,344,393	
日本紙パルプ商事	3.9	4.3	21,629	
カメイ	8.8	8.9	10,688	
スターゼン	5.9	6.4	13,292	
山善	28.6	21.4	21,400	
椿本興業	1.8	1.5	5,992	
住友商事	452.5	497.6	1,118,107	
内田洋行	3.2	3.7	17,168	
三菱商事	537.7	502.5	2,314,012	
第一実業	3.3	3.1	13,144	

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
キャノンマーケティングジャパン	17.7	18.6	57,846	
西華産業	5.2	4.1	6,359	
佐藤商事	6.9	6.1	7,295	
菱洋エレクトロ	5.4	7.4	17,375	
東京産業	8.5	8.4	6,636	
ユアサ商事	6.6	7.1	25,489	
神鋼商事	2	2.2	9,944	
阪和興業	14.1	14.3	51,194	
正栄食品工業	4.6	5.5	23,512	
カナデン	7.7	7.3	8,051	
菱電商事	6.5	6.7	11,296	
岩谷産業	17.1	18.4	106,168	
ナイス	3	3.4	4,481	
極東貿易	2.7	6	7,950	
アステナホールディングス	12.1	17.8	7,422	
三愛オプリー	17.7	22.3	28,811	
稲畑産業	14.7	16.3	38,614	
G S I クレオス	5.4	5.6	8,164	
明和産業	7	11.6	8,131	
ワキタ	15.6	15.5	18,569	
東邦ホールディングス	23	20.8	44,304	
サンゲツ	20.2	20.5	43,070	
ミツロコグループホールディングス	10.9	11.8	12,484	
シナネンホールディングス	3	2.7	10,260	
伊藤忠エネクス	14.9	19.3	19,686	
サンリオ	22.6	23	104,075	
サンワテクノス	5.1	4.8	7,324	
リョーサン	8.1	8.8	25,009	
新光商事	12.7	12.1	13,612	
トーヨー	5.2	4.2	7,270	
三信電気	4.4	3.7	8,310	
東陽テクニカ	8.7	9.5	13,290	
モスフードサービス	9.4	12	38,160	
加賀電子	6.5	6.6	28,974	
ソーダニッカ	10.9	—	—	
立花エレテック	6.2	6	10,656	
P A L T A C	10.1	12.7	54,800	
三谷産業	—	19.1	5,978	
太平洋興発	7.7	9.5	7,106	
西本Wismettacホールディングス	2	2.2	8,140	
コーア商事ホールディングス	7.7	6.6	4,098	
K P P グループホールディングス	17.8	19.3	18,759	
ヤマタネ	4.7	5	8,480	
日鉄物産	4.9	5.2	26,520	
泉州電業	2.2	3.8	10,594	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
トラスコ中山	14.5	16.8	35,061	
オートボックスセブン	24.8	29	42,282	
モリト	9.5	7.8	5,912	
加藤産業	9.7	9.5	33,202	
イエローハット	12.2	14.1	24,308	
J K ホールディングス	6.8	6.8	7,085	
日伝	6	5	8,500	
杉本商事	4.2	3.8	7,835	
因幡電機産業	18.6	20.2	56,196	
東テック	3	2.8	9,170	
ミスミグループ本社	90	121.3	406,355	
タキヒヨー	3.8	6.6	5,940	
スズケン	28.2	25	92,375	
ジェコス	7.5	2	1,606	
小売業 (4.5%)				
ローソン	15.9	20.2	99,485	
サンエー	5	6	26,160	
カワチ薬品	5.9	6.6	13,932	
エービーシー・マート	11.1	11.7	81,549	
ハードオフコーポレーション	—	4.2	5,980	
アスクル	11.9	19.7	31,145	
ゲオホールディングス	10.2	8.8	17,256	
アダストリア	7.9	10	20,070	
くら寿司	7.5	9.6	32,160	
キャンドウ	3.9	4.5	9,688	
パルグループホールディングス	7	8.2	19,852	
エディオン	30.8	31.5	39,501	
サーラコーポレーション	16.5	17.9	13,425	
ハローズ	3.4	3.7	11,077	
フジオフードグループ本社	7.9	7.5	10,410	
あみやき亭	2.7	—	—	
ひらまつ	—	26.4	4,910	
大黒天物産	2.4	3	15,840	
ハニーズホールディングス	7.1	7.8	9,578	
アルペン	5.7	6.8	13,804	
クオールホールディングス	9.3	11.7	13,338	
ジンズホールディングス	5	5	21,625	
ビックカメラ	41.5	53.5	67,677	
D C M ホールディングス	43.3	49.3	56,596	
M o n o t a R O	90.9	113.9	266,070	
アーランドサービスホールディングス	6.1	6.9	15,331	
J・フロント リテイリング	86.3	100.6	116,595	
ドトール・日レスホールディングス	12.2	14.3	24,181	
マツキヨココカラ&カンパニー	44	48.8	279,136	
ブロンコビリー	5.1	5	12,500	

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
Z O Z O	49.6	53.3	182,552	
トレジャー・ファクトリー	—	2.6	6,229	
物語コーポレーション	3.8	4.5	31,590	
三越伊勢丹ホールディングス	125.5	135.7	179,666	
H a m e e	—	4.3	3,788	
ウエルシアホールディングス	37.9	41.8	126,236	
クリエイトSDホールディングス	10.2	13	39,845	
チムニー	4.8	7.5	8,452	
シュッピン	7.1	6.5	9,555	
オイシックス・ラ・大地	10.3	11	21,197	
ネクステージ	14.4	18.4	56,764	
ジョイフル本田	20.1	25.6	47,334	
鳥貴族ホールディングス	3.6	3.7	9,046	
ホットランド	7.6	7.4	11,299	
すかいらーくホールディングス	93.1	110.6	176,517	
S F Pホールディングス	5.1	5	8,555	
綿半ホールディングス	7	6.8	9,227	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	19.4	27.8	30,607	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5	4.2	7,312	
B E E N O S	4	4.7	14,946	
あさひ	6.3	6.8	9,057	
日本調剤	5.2	6.1	7,307	
コスモス薬品	7.2	9.1	127,036	
セブン&アイ・ホールディングス	280.9	277.3	1,547,056	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	38.8	61.1	57,372	
ツルハホールディングス	15.6	19.8	175,626	
サンマルクホールディングス	7.7	7.3	12,337	
フェリシモ	—	5	5,135	
トリドールホールディングス	17.7	20.1	54,109	
T O K Y O B A S E	8.3	—	—	
J Mホールディングス	5.6	7.2	12,664	
アレンザホールディングス	6.4	6.6	6,494	
串カツ田中ホールディングス	2.5	3.6	6,490	
パロックジャパンリミテッド	7.7	1.4	1,118	
クスリのアオキホールディングス	7.2	8.1	61,398	
力の源ホールディングス	—	6.2	5,635	
FOOD & LIFE COMPANIES	42	46.4	115,768	
メディカルシステムネットワーク	8.6	5.3	2,141	
ノジマ	11.5	26.2	36,549	
カッパ・クリエイト	11.3	13.5	18,603	
ライトオン	—	9.2	5,851	
良品計画	82.7	104.1	150,840	
アドヴァングループ	9.4	11	9,790	
アルビス	3.3	3.1	7,390	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
G-7ホールディングス	8.1	9.9	15,077	
イオン北海道	13.2	13.2	15,549	
コジマ	13.4	16.2	9,946	
コーナン商事	10.3	10.9	36,079	
エコス	3.3	3.7	6,782	
ワタミ	10.4	11	11,649	
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	143.5	180.4	430,073	
西松屋チェーン	15.7	18.1	25,249	
ゼンショーホールディングス	35.4	43.9	152,113	
幸楽苑ホールディングス	6.8	6.8	7,004	
サイゼリヤ	10.9	13.7	38,538	
V Tホールディングス	27.9	31.1	15,798	
フジ・コーポレーション	5.6	5.1	6,568	
ユナイテッドアローズ	7.8	9	16,965	
ハイデイ日高	10.3	12.1	23,691	
コロワイド	30.2	37.7	67,445	
壱番屋	5.2	6.3	28,696	
スギホールディングス	14.4	16.3	100,897	
薬王堂ホールディングス	3.9	4.6	11,868	
スクロール	11.9	12.8	9,100	
ヨンドシーホールディングス	7.6	7.6	13,163	
木曾路	10	12.9	27,631	
S R Sホールディングス	14.6	16	13,552	
千趣会	17.9	17.1	6,993	
リテールパートナーズ	9.6	12	14,844	
ケーヨー	15.2	13.9	12,551	
上新電機	7.8	7.1	13,525	
日本瓦斯	34.9	43.3	91,059	
ロイヤルホールディングス	12.7	15.8	37,872	
いなげや	9.3	8.1	9,590	
チヨダ	12.1	10.2	7,782	
ライフコーポレーション	6.7	7.1	17,444	
リンガーハット	9.7	11.3	24,803	
M r M a x H D	11.6	12.2	8,076	
A O K Iホールディングス	15.6	15.9	10,907	
オークワ	12.5	13.5	12,717	
コメリ	10.7	12.3	31,857	
青山商事	17.1	18.2	18,181	
しまむら	8.3	9.4	117,406	
高島屋	52.7	61.3	109,481	
松屋	15.4	14.4	14,040	
エイチ・ツー・オー リテイリング	33.2	39.5	48,190	
近鉄百貨店	3.4	4	9,860	
丸井グループ	61	59.3	138,406	

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
アクシアル リテイリング	5.5	5.4	18,333	
イオン	276.1	272.8	770,114	
イズミ	13.1	12.4	37,386	
平和堂	12.5	13.2	26,809	
フジ	8.7	12.5	23,350	
ヤオコー	8.2	9.1	60,970	
ゼビオホールディングス	10.6	11.3	10,644	
ケースホールディングス	65.7	64.3	73,302	
Olympicグループ	—	8	4,192	
日産東京販売ホールディングス	21.5	—	—	
シルバーライフ	—	2.5	3,892	
Genky DrugStores	3.2	4.1	14,186	
ブックオフグループホールディングス	5.6	5.2	6,832	
ギフトホールディングス	1.6	1.9	7,505	
アインホールディングス	10.6	11.2	75,376	
元氣寿司	2.8	3.3	10,494	
ヤマダホールディングス	263.4	331	157,887	
アーケランズ	11.5	12.3	18,425	
ニトリホールディングス	28.6	32.6	507,419	
グルメ杵屋	10.8	8.7	8,673	
ケーユーホールディングス	—	3.3	4,290	
吉野家ホールディングス	25.6	32	74,272	
松屋フーズホールディングス	3.6	3.8	15,181	
サガミホールディングス	13.7	14.2	17,338	
関西フードマーケット	5.9	8.1	11,250	
王将フードサービス	4.7	5.1	30,906	
ブレナス	8.3	—	—	
ミニストップ	6.6	7	9,961	
アークス	13.1	14.2	29,805	
パローホールディングス	15.4	15.1	26,545	
ベルク	3.2	3.9	22,308	
大庄	—	7.8	8,275	
ファーストリテイリング	9.6	12.1	977,801	
サンドラッグ	27	30.6	111,996	
サクスパー ホールディングス	—	9.4	7,520	
やまや	—	3.5	8,666	
ベルーナ	16.7	19.7	13,573	
銀行業 (5.6%)				
いよぎんホールディングス	—	88.1	64,224	
しずおかフィナンシャルグループ	—	168	168,840	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	—	62.3	60,306	
めぶきフィナンシャルグループ	369.6	372	116,064	
東京きらばしフィナンシャルグループ	9.7	9.7	23,153	
九州フィナンシャルグループ	141.4	126.7	50,299	
ゆうちょ銀行	168.2	212.4	223,232	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
富山第一銀行	16.8	21.1	11,984	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	406.8	410.5	195,808	
西日本フィナンシャルホールディングス	47	47.6	41,602	
三十三フィナンシャルグループ	8.7	7.4	11,100	
第四北越フィナンシャルグループ	11.7	11.1	29,059	
ひろぎんホールディングス	106.2	97.8	61,809	
おきなわフィナンシャルグループ	7	7.6	16,294	
十六フィナンシャルグループ	10.1	10	26,400	
北國フィナンシャルホールディングス	7.4	6.4	28,512	
プロクレアホールディングス	—	9.7	20,942	
あいちフィナンシャルグループ	—	10.4	23,036	
新生銀行	46.7	22.7	53,095	
あおぞら銀行	39.4	46.7	121,186	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,609.1	4,906.5	3,704,898	
りそなホールディングス	822.5	953.5	630,168	
三井住友トラスト・ホールディングス	135.1	138.1	608,606	
三井住友フィナンシャルグループ	497.6	546.5	2,553,794	
千葉銀行	240.4	207.6	173,138	
群馬銀行	133.9	144.5	65,169	
武蔵野銀行	11.2	9.9	18,641	
千葉興業銀行	—	22	8,272	
筑波銀行	—	41.1	8,713	
七十七銀行	22.9	24.1	46,946	
青森銀行	5.6	—	—	
秋田銀行	4.3	5.9	9,935	
山形銀行	10.6	10	12,170	
岩手銀行	6	6	11,610	
東邦銀行	73.1	67.9	14,259	
東北銀行	4	—	—	
みちのく銀行	4.5	—	—	
ふくおかフィナンシャルグループ	59.8	59.6	160,383	
静岡銀行	173.8	—	—	
スルガ銀行	63.4	67.7	29,043	
八十二銀行	155.6	150.8	78,265	
山梨中央銀行	10.8	9.4	9,804	
大垣共立銀行	14.2	14.5	26,738	
福井銀行	8	8.1	11,858	
清水銀行	4.4	1.5	2,293	
富山銀行	2.4	3.4	5,936	
滋賀銀行	13.5	12.4	32,438	
南都銀行	11.6	11.5	26,852	
百五銀行	69.9	72.4	25,340	
京都銀行	25.5	23.5	133,950	
紀陽銀行	25.1	26.4	40,154	
ほくほくフィナンシャルグループ	44.6	48.6	45,149	

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
山陰合同銀行	43.9	47	35,485	
中国銀行	55.9	—	—	
伊予銀行	91.9	—	—	
百十四銀行	9.2	8.1	14,531	
四国銀行	13.4	14.4	13,233	
阿波銀行	11.3	11.1	22,666	
大分銀行	5.5	5.8	11,484	
宮崎銀行	5.4	5.8	13,444	
佐賀銀行	4.5	5.4	8,694	
琉球銀行	18.2	21	17,535	
セブン銀行	210.5	268.2	70,000	
みずほフィナンシャルグループ	919.4	1,081.3	1,856,592	
山口フィナンシャルグループ	83.1	83.2	67,891	
長野銀行	—	3.3	4,118	
名古屋銀行	5.8	5.1	16,396	
北洋銀行	109.8	117.9	28,885	
愛知銀行	2.9	—	—	
中京銀行	4.7	—	—	
愛媛銀行	13.1	12	10,572	
京葉銀行	33.5	38.4	20,928	
栃木銀行	46	38.2	12,262	
東和銀行	17.4	16.6	9,080	
トモニホールディングス	60.3	64.9	22,650	
フィデアホールディングス	8.5	9.5	12,929	
池田泉州ホールディングス	94.2	106.3	24,661	
証券・商品先物取引業 (0.7%)				
F P G	26.4	31.2	36,348	
ジャパンインベストメントアドバイザー	6.7	6.7	8,220	
S B Iホールディングス	88.2	107.9	282,482	
ジャフコ グループ	9.2	25.4	61,137	
大和証券グループ本社	538.1	529.9	322,179	
野村ホールディングス	1,098.6	1,374.4	688,162	
岡三証券グループ	56.7	66.1	25,580	
丸三証券	24.3	29.9	12,617	
東洋証券	—	29.1	8,235	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	79.2	81.2	28,988	
水戸証券	24.7	23.7	5,356	
いちよし証券	16.3	17	10,404	
松井証券	35.3	44.7	35,134	
マネックスグループ	58.6	84.3	36,249	
極東証券	9.7	12.9	7,946	
岩井コスモホールディングス	8.1	10	12,740	
アイザワ証券グループ	12.5	11.9	8,175	
スパークス・グループ	38.7	8.7	14,850	
保険業 (2.4%)				
かんぽ生命保険	72.5	91.2	208,574	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
SOMPOホールディングス	126.8	128.3	777,369	
アニコム ホールディングス	22.2	29	21,025	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	161	168.4	690,440	
第一生命ホールディングス	353.9	381.2	969,582	
東京海上ホールディングス	236.7	753.5	2,130,144	
T & Dホールディングス	186.2	201.2	335,601	
アドバンスクリエイティブ	4	7.4	7,932	
その他金融業 (1.1%)				
全国保証	17.3	19.7	100,470	
ジェイリース	2.8	2.8	8,694	
イントラスト	5.1	—	—	
日本モーゲージサービス	4.1	7.6	6,536	
アルヒ	12.2	16.2	16,313	
プレミアグループ	4.2	12.9	24,832	
ネットプロテクションズホールディングス	—	26	12,376	
クレディセゾン	45.8	47.8	83,984	
芙蓉総合リース	7.4	6.8	59,772	
みずほリース	11.1	10.9	36,024	
東京センチュリー	13.7	13.8	65,136	
日本証券金融	29.4	31.4	32,216	
アイフル	121.5	126.3	51,530	
リコーリース	6.8	7.3	26,645	
イオンフィナンシャルサービス	38.5	42.6	62,579	
アコム	141.9	140.9	45,228	
ジャックス	8.2	8	31,240	
オリエンタコーポレーション	196.9	19.8	23,700	
オリックス	436.7	499.8	1,104,807	
三菱HCキャピタル	261	287.4	187,959	
日本取引所グループ	181.9	210.6	416,040	
イー・キャランティ	11.2	12.5	30,737	
NECキャピタルソリューション	3.4	4	8,320	
不動産業 (2.1%)				
大東建託	23.4	27.5	421,300	
いちご	83.3	89	27,501	
日本駐車場開発	93.1	95.8	23,566	
スター・マイカ・ホールディングス	5.2	9	6,444	
S R Eホールディングス	1.9	3.9	17,842	
ヒューリック	170.8	175	201,775	
三栄建築設計	3.9	4.7	7,228	
野村不動産ホールディングス	38.1	46.8	155,376	
三重交通グループホールディングス	18.4	18.9	9,298	
サムティ	10.1	10.1	22,967	
ディア・ライフ	12.8	13.5	8,410	
地主	7	7.3	14,862	

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
ブレサンスコーポレーション	10.8	11.4	18,114	
J P M C	5.6	5.8	6,066	
フージャースホールディングス	13.3	13.7	10,918	
オープンハウスグループ	22.8	27.4	158,372	
東急不動産ホールディングス	210.2	225.5	167,321	
飯田グループホールディングス	60.2	65.6	143,860	
And Doホールディングス	—	5.8	4,947	
シーアールイー	3.1	4.2	6,262	
ケイアイスター不動産	3.4	4.4	21,692	
グッドコムアセット	4.4	8.4	6,342	
ジェイ・エス・ビー	2.1	2.1	9,166	
ロードスターキャピタル	—	3.7	6,438	
パーク24	38.9	58.8	117,894	
バラカ	4.4	4.4	8,395	
宮越ホールディングス	4.3	0.8	707	
三井不動産	327.6	325.8	904,583	
三菱地所	471.9	475.7	922,858	
平和不動産	13	13	53,170	
東京建物	71	71.6	137,543	
ダイビル	18.9	—	—	
京阪神ビルディング	12.9	11	14,102	
住友不動産	150.8	135.8	504,632	
テオーシー	16.2	16.8	12,213	
東京楽天地	2.1	1.9	8,274	
スターツコーポレーション	10.4	11.4	31,327	
フジ住宅	11.6	13.7	8,987	
空港施設	13.2	12.6	6,791	
明和地所	—	9.3	5,868	
ゴールドクレスト	6.9	8.1	14,288	
エスリード	—	4.5	8,496	
日神グループホールディングス	15.4	17.1	7,353	
日本エスコ	16.1	19.5	16,341	
M I R A R T Hホールディングス	37.4	43	16,770	
A V A N T I A	7.8	—	—	
イオンモール	35.8	39.5	65,372	
カチタス	18.2	20.6	65,199	
トーセイ	11.5	13.5	18,927	
サンフロンティア不動産	11.7	13.5	15,822	
F Jネクストホールディングス	8.8	9.2	8,887	
グランディハウス	—	4.1	2,246	
日本空港ビルデング	27.5	26.7	166,074	
サービス業 (5.4%)				
日本工営	4.3	5.8	20,445	
L I F U L L	27.1	34.3	8,540	
M I X I	16	18	44,352	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ジェイエイシーリクルートメント	6.1	7.1	18,367	
日本M&Aセンターホールディングス	114.5	134.6	247,664	
メンバーズ	2.6	2.6	5,891	
U Tグループ	10.1	11.6	31,262	
アイティメディア	3.9	3.3	6,144	
E・Jホールディングス	4.8	5.7	7,438	
夢真ビーネックスグループ	18.8	28.6	54,969	
コシダカホールディングス	19.2	23.8	27,298	
パソナグループ	7.5	9.5	19,551	
リンクアンドモチベーション	16.6	23.2	16,495	
エス・エム・エス	23.9	30	108,300	
パーソルホールディングス	69.7	87.8	276,570	
リニカル	6.8	6.4	4,659	
クックパッド	29.6	36	7,632	
学情	—	4.1	6,141	
スタジオアリス	4	4.7	9,808	
シミックホールディングス	5.4	5.1	8,858	
総合警備保障	27.6	29.3	109,142	
カカコム	51.7	58.7	142,523	
アイロムグループ	3.2	3.1	6,875	
セントケア・ホールディング	—	5.8	4,953	
ルネサンス	6.7	7.1	6,397	
ディップ	12.3	13.8	56,511	
デジタルホールディングス	5.4	6.8	8,071	
新日本科学	9.2	8.5	23,485	
ベネフィット・ワン	25.3	36.6	79,056	
エムスリー	123	154.6	650,093	
アウトソーシング	40.4	47.2	47,577	
ウェルネット	15.2	9.6	6,163	
ワールドホールディングス	3.2	4	11,620	
ディー・エヌ・エー	27	33.8	62,530	
博報堂D Yホールディングス	96.8	100.5	133,765	
ぐるなび	14.7	15	6,285	
タカミヤ	14.9	14	5,390	
ジャパンベストレスキューシステム	5.7	5.9	5,144	
ファンコミュニケーションズ	23.3	18.4	8,114	
ライク	—	3.4	7,078	
エスプール	19.8	22.8	21,409	
W D Bホールディングス	3.5	4.2	9,983	
アドウェイズ	11.5	11.5	6,290	
バリューコマース	5.5	6.3	13,173	
インフォマート	77.1	82.9	37,636	
J Pホールディングス	26.3	27.4	7,617	
プレステージ・インターナショナル	26.8	33.8	24,065	
アミューズ	4.7	4.9	8,780	

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
ドリームインキュベータ	—	2.8	7,912	
クイック	6.1	6.5	13,539	
電通グループ	71.9	82.2	361,680	
びあ	2.8	2.9	9,512	
イオンファンタジー	3.7	3.7	10,815	
シーティーエス	9.8	10.2	8,517	
H. U. グループホールディングス	18.6	23.4	64,935	
アルプス技研	6.8	7.1	14,846	
日本空調サービス	10	10.3	7,292	
オリエンタルランド	82.3	82.8	1,632,816	
ダスキン	16.5	17.7	52,268	
明光ネットワークジャパン	12.3	14.3	8,823	
ファルコホールディングス	4.5	4.5	8,131	
ラウンドワン	19.8	66.3	40,443	
リゾートトラスト	32.5	31.3	76,215	
ビー・エム・エル	9	9.7	33,562	
りらいあコミュニケーションズ	11.5	13	13,351	
リソー教育	33.8	39.9	12,887	
早稲田アカデミー	—	5.6	6,456	
ユー・エス・エス	78.2	80.7	185,287	
東京個別指導学院	8.5	12.1	6,400	
サイバーエージェント	172	187.7	230,683	
楽天グループ	358.3	345.7	225,742	
クリーク・アンド・リバー社	4.2	4.9	10,084	
モーニングスター	16.6	15.2	7,144	
テー・オー・ダブリュー	—	22	6,534	
山田コンサルティンググループ	5	4.9	5,605	
セントラルスポーツ	3.9	3.6	8,697	
フルキャストホールディングス	6.1	7.5	23,062	
エン・ジャパン	11.3	14.3	35,006	
テクノプロ・ホールディングス	41.9	52.7	199,733	
アイ・アールジャパンホールディングス	3.3	4.4	7,955	
Keeper 技研	4.6	5.7	24,253	
Gunosy	—	6.2	4,147	
イー・ガーディアン	3.3	3.3	9,457	
ジャパンマテリアル	21.5	24	58,392	
ベクトル	10.5	13	16,653	
チャーム・ケア・コーポレーション	6	7.3	8,453	
キャリアリンク	3.4	3.3	9,949	
I B J	7.4	5.6	5,488	
アサンテ	5.2	5.2	8,325	
バリュートHR	4	7.5	12,562	
M&Aキャピタルパートナーズ	5.7	7.4	35,927	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4	4.2	4,716	
ERIホールディングス	2.6	3.8	4,104	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
シグマクス・ホールディングス	4.5	12.3	16,408	
ウィルグループ	6.1	7	9,520	
メドピア	5.4	6.5	10,718	
リクルートホールディングス	537.4	578.7	2,505,192	
エラン	9.7	10.5	10,762	
日本郵政	910.1	1,025.7	1,105,704	
ベルシステム24ホールディングス	10.3	10.9	14,693	
鎌倉新書	9.2	9.7	8,148	
エアトリ	4.7	5.4	14,434	
アトラエ	5.6	6.6	9,748	
ストライク	2.9	3.9	17,413	
ソラスト	17.3	22.1	18,144	
セラク	2.8	3.3	4,088	
インソース	7	9.8	33,075	
ペイカレント・コンサルティング	4.9	58	258,970	
Orchestra Holdings	1.8	2	4,610	
アイモバイル	2.8	5	6,330	
グレイステクノロジー	11.9	—	—	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	21.9	27.7	48,253	
ウェルビー	5.6	6.9	5,940	
エル・ティール・エス	1.3	1.3	4,543	
ミダックホールディングス	3.1	4.8	16,176	
日総工産	7.7	—	—	
キュービーネットホールディングス	4.4	5.2	7,763	
R P Aホールディングス	12.1	13.6	3,903	
マネジメントソリューションズ	3.6	4.6	17,595	
フロンティア・マネジメント	—	3.4	4,777	
カープスホールディングス	19.7	24.4	23,960	
フォーラムエンジニアリング	—	0.7	609	
FAST FITNESS JAPAN	—	3.2	4,272	
ダイレクトマーケティングミックス	4	9.3	13,903	
ポピンズ	2.1	—	—	
L I T A L I C O	5.9	6.2	14,495	
アドバンテッジリスクマネジメント	5.7	—	—	
リロググループ	38.6	44	99,572	
東祥	6	7	8,582	
ビーウィズ	—	3.3	3,917	
T R Eホールディングス	9.8	16.7	26,235	
人・夢・技術グループ	3.5	3.8	8,002	
エイチ・アイ・エス	15.6	20.8	41,912	
ラックランド	3.7	3.3	9,764	
共立メンテナンス	12.5	13.4	81,740	
イチネンホールディングス	8.2	8.9	11,142	
建設技術研究所	4.6	4.2	13,671	

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
スペース	—	7.2	6,408
燦ホールディングス	4.4	4.1	7,466
東京テアトル	6.1	9	10,269
ナガワ	2.2	2	15,320
東京都競馬	5.3	6.8	27,404
カナモト	12.2	14.6	32,777
西尾レントオール	6.5	7.3	22,557
トランス・コスモス	9	9.7	31,379
乃村工藝社	30.1	34.3	35,397
藤田観光	—	4.1	12,218
KNT-CTホールディングス	—	5.7	9,861
日本管財	7.2	7.9	20,081
トーカイ	6.1	7.2	13,456
セコム	68.7	79.6	675,406
セントラル警備保障	3.9	4.6	11,219
丹青社	15.5	16.1	12,847
メイテック	8.6	31.6	80,516
応用地質	7.6	7.7	16,139
船井総研ホールディングス	14.4	16.5	46,117

銘柄	株数	期首(前期末)	期 末	
		株数	株数	評価額
オオバ	—	8.1	—	—
学究社	—	—	4.9	8,751
ベネッセホールディングス	23.8	29.9	59,530	
イオンディライト	8.5	8.6	25,155	
ダイセキ	12.8	16	75,200	
ステップ	—	3.6	6,462	
合 計	株数・金額	千株	千株	千円
	銘柄数<比率>	78,890.9	88,126.6	218,143,627
		1,659銘柄	1,724銘柄	<97.9%>

※銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円 4,557	百万円 —
T O P I X		

■ 投資信託財産の構成

(2022年11月30日現在)

項 目	期	末
	評 価 額	比 率
株 式	千円 218,143,627	% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,615,182	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	223,758,810	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2022年11月30日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	223,548,520,349円
コール・ローン等	3,272,840,597
株 式(評価額)	218,143,627,430
未 収 入 金	414,739,700
未 収 配 当 金	1,741,212,622
差 入 委 託 証 拠 金	△ 23,900,000
(B) 負 債	729,179,742
未 払 金	124,125,858
未 払 解 約 金	605,043,303
そ の 他 未 払 費 用	10,581
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	222,819,340,607
元 本	65,393,298,021
次 期 繰 越 損 益 金	157,426,042,586
(D) 受 益 権 総 口 数	65,393,298,021口
1万口当たり基準価額(C/D)	34,074円

※当期における期首元本額61,173,269,127円、期中追加設定元本額11,653,465,066円、期中一部解約元本額7,433,436,172円です。

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

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

■ 損益の状況

（自2021年12月1日 至2022年11月30日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	5,416,252,082円
受 取 配 当 金	5,415,660,123
受 取 利 息	36,384
そ の 他 収 益 金	1,872,280
支 払 利 息	△ 1,316,705
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,363,803,273
売 買 益	21,992,241,699
売 買 損	△ 15,628,438,426
(C) 先 物 取 引 等 損 益	521,076,300
取 引 益	1,128,293,600
取 引 損	△ 607,217,300
(D) そ の 他 費 用 等	△ 109,623
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	12,301,022,032
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	135,881,050,625
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 16,899,287,962
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	26,143,257,891
(I) 合 計(E+F+G+H)	157,426,042,586
次 期 繰 越 損 益 金(I)	157,426,042,586

※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	9,574,760,676円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,456,182,387円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	1,036,137,254円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,446,188,375円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,637,683,641円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,623,103,466円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,605,989,911円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	37,493,396円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	147,542,223円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	135,694,110円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2020（4資産タイプ）	4,234,860円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	684,565,549円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2025（4資産タイプ）	19,508,324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>	44,118,775円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2030（4資産タイプ）	63,979,125円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	254,234,553円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2035（4資産タイプ）	165,870,052円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	796,235,497円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2040（4資産タイプ）	149,775,143円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	533,449,238円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2045（4資産タイプ）	266,593,539円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,657,079,267円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,398,015,768円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	372,784円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	22,016,808,347円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	36,667,207円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	179,974,667円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	39,482,192円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	253,617,658円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	32,479,210円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	167,938,880円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,795,425円
イオン・バランス戦略ファンド	20,272,782円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	95,429,547円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2050	41,931,085円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	219,105,114円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	191,067,731円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	52,522,560円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	178,416,019円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	38,723,328円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	669,872,498円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,680,964円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	375,434,831円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	41,326,285円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	427,891,807円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	542,525,688円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	49,851,584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）	167,317,059円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	813,757,842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>	202,591,112円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	39,664,361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>	85,721,825円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	202,349,704円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	94,168,528円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	191,586,051円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	44,811,453円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2060	5,500,206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>	42,807,427円
日興FWS・日本株インデックス	1,276,658,198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>	5,577,900円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	18,140,230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>	7,187,543円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,564,092,115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>	92,673,351円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	11,882,906円	SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,136,348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>	74,050,540円		

■ お知らせ

<約款変更について>

・2022年4月の東京証券取引所の市場区分の見直しに伴い、関連する記載について、所要の変更を行いました。

（適用日：2022年4月4日）