

■ 当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：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、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、合成指数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		
	国内債券パッシブ・マザーファンド		
	日本の公社債および短期金融資産		
	外国株式インデックス・マザーファンド		
	日本を除く世界各国の株式		
当ファンドの運用方法	国内債券パッシブ・マザーファンド		
	日本を除く世界各国の債券		
	■内外の株式、公社債に投資する4つのマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資します。		
	■国内株式、外国株式、国内債券、外国債券および短期金融資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。		
	国内株式		国内債券
	20%		55%
	外国株式	外国債券	短期金融資産
	10%	10%	5%
組入制限	■委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指します。		
	■実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。		
	当ファンド		
	■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。		
	■外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。		
	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）		
	■株式への投資割合には、制限を設けません。		
	■外貨建資産への投資は行いません。		
	国内債券パッシブ・マザーファンド		
	■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。		
分配方針	■外貨建資産への投資は行いません。		
	外国株式インデックス・マザーファンド		
	■株式への投資割合には、制限を設けません。		
	■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。		
	外国債券パッシブ・マザーファンド		
	■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。		
	■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。		
	年1回（原則として毎年2月18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・年金バランス
30(債券重点型)
【愛称:マイパッケージNEXT30】
【運用報告書(全体版)】

(2021年2月19日から2022年2月18日まで)

第 3 期
決算日 2022年2月18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、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、合成指数の動きに連動する投資成果を目指します。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

 三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1
<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

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

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

■ 設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 込 期 中 分 配 金 騰 落 率	ベンチマーク 期 中 騰 落 率	株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 組 入 率 証 券 組 比	純 資 産 額
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	百万円
2019年6月28日	10,000	—	—	100.00	—	—	—	1
1期(2020年2月18日)	10,365	0	3.7	103.61	3.6	28.6	0.6	1
2期(2021年2月18日)	10,869	0	4.9	109.06	5.3	29.4	0.2	129
3期(2022年2月18日)	11,031	0	1.5	111.01	1.8	29.3	0.5	244

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※ベンチマークは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）、NOMURA-BPI（総合）、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）および有担保コール翌日物を基本資産配分で組み合わせた合成指数で、当報告書作成時に知りえた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、外国の指数については基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額 (分配落)	騰 落 率	ベンチマーク 騰 落 率	株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 組 入 率 証 券 組 比
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2021年2月18日	10,869	—	109.06	—	29.4	0.2	64.9
2月末	10,723	△1.3	107.61	△1.3	28.9	0.3	65.1
3月末	10,979	1.0	110.22	1.1	29.4	0.4	64.7
4月末	10,976	1.0	110.22	1.1	29.0	0.6	64.7
5月末	11,038	1.6	110.88	1.7	29.2	0.7	64.6
6月末	11,092	2.1	111.48	2.2	29.3	0.5	64.7
7月末	11,095	2.1	111.55	2.3	29.0	0.6	64.9
8月末	11,186	2.9	112.48	3.1	29.5	0.5	64.4
9月末	11,230	3.3	112.92	3.5	28.8	0.6	65.0
10月末	11,297	3.9	113.60	4.2	29.0	0.8	63.7
11月末	11,213	3.2	112.77	3.4	28.3	0.7	65.3
12月末	11,329	4.2	113.97	4.5	29.5	0.6	64.3
2022年1月末	11,075	1.9	111.43	2.2	29.5	0.5	64.3
(期 末)							
2022年2月18日	11,031	1.5	111.01	1.8	29.3	0.5	64.6

※騰落率は期首比です。

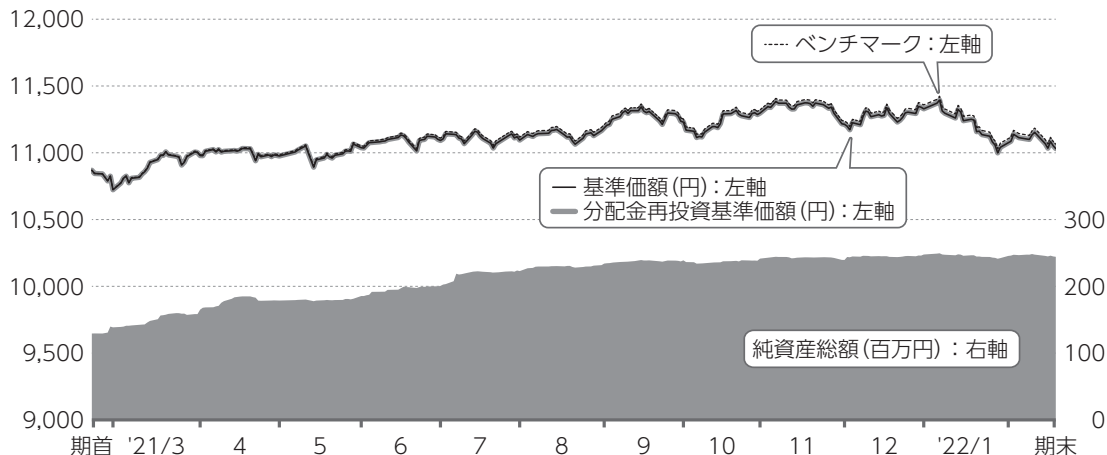
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年2月19日から2022年2月18日まで)

基準価額等の推移



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

期 首	10,869円
期 末	11,031円 (既払分配金0円(税引前))
騰 落 率	+1.5% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサインデックス(配当込み、円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)および有担保コール翌日物を基本資産配分で組み合わせた合成指数です。

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

基準価額の主な変動要因(2021年2月19日から2022年2月18日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、合成指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行っていません。

上昇要因

- 外国株式市場が上昇したこと
- 米ドル・ユーロ共に円に対して上昇したこと

組入れファンドの状況

組入れファンド	投資資産	騰落率	基本資産配分	期末組入比率
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	国内株式	+1.2%	20%	20.0%
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	-1.2%	55%	55.1%
外国株式インデックス・マザーファンド	外国株式	+19.5%	10%	9.9%
外国債券パッシブ・マザーファンド	外国債券	+1.1%	10%	9.9%
—	短期金融資産	—	5%	5.0%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について(2021年2月19日から2022年2月18日まで)

国内株式・外国株式は上昇しました。債券市場では、国内長期金利(10年国債利回り)・米国長期金利はともに上昇(債券価格は下落)しました。また欧州(ドイツ)長期金利も上昇しました。為替市場では、米ドル・ユーロ共に円に対して上昇しました。

国内株式

国内株式は小幅上昇しました。

期初は日本銀行の金融緩和スタンスが維持される中、米国を中心とした株価上昇等に連れる形で上昇しました。その後8月後半までは上値は重くもみ合いで推移しましたが、9月下旬にかけて自民党総裁選への期待感を背景に大きく上昇しました。

その後、1月上旬にかけては中国不動産大手のデフォルト(債務不履行)懸念や変異ウイルス感染拡大への警戒感、また米国長期金利の上昇等を背景に下落基調で推移しました。

期末にかけてはFOMC(米連邦公開市場委員会)を受けてタカ派(インフレ抑制を重視する立場)色の一段の強まりを警戒した売り優勢となった米国に連れる形で大きく下落しました。更に地政学リスクへの懸念も高まり、リスク・オフ(リスク回避)ムードが強まり下落基調で推移しました。

国内債券

日本の長期金利は上昇しました。

期初は、米金利の上昇や株価の上昇等を背景に国内でも長期金利は上昇しました。その後3月上旬から8月にかけて、日銀の金融緩和政策継続や米金利の低下等を背景に長期金利は低下しました。

10月下旬にかけては、FOMCで政策金利見通しが引き上げられたことによる米金利の上昇や、インフレ長期化懸念の強まり等を背景に国内長期金利は上昇しました。

1月にかけて、新たな変異ウイルス(オミクロン型)が検出され感染拡大懸念が高まったことから長期金利は再び低下しました。しかし、期末にかけてはコロナウイルス経口薬の承認が相次いだことで、変異ウイルスに対する警戒感が和らいだことや、米国金融政策への警戒感を背景に米金利が上昇したことに連れる形で、長期金利は大きく上昇しました。

外国株式

外国株式は、期を通して上昇しました。

米国市場は、期初から8月下旬にかけては、世界の主要国・中央銀行の景気支援的な政策の継続やワクチン接種の進展に伴う経済回復に対する期待等を背景に、株式市場は堅調に推移しました。その後、9月上旬から10月にかけては、軟調な雇用統計やFOMCで年内のテーパリング(量的緩和の段階的縮小)開始が示唆されたことを背景に下落しました。その後は企業業績が概ね予想を上回る決算となったことで、再び大きく上昇しました。しかし、11月中旬から1月にかけては変異ウイルス感染拡大への警戒感や米国長期金利の上昇等を背景に上値は重く、更に期末にかけては、米国金融政策への警戒感や地政学リスク等を背景に下落しました。

欧州市場も、米国市場に連れる形で推移し、ECB（欧州中央銀行）が金融緩和政策を当面維持するとの見方等が安心材料となり大きく上昇しました。しかし、期末は欧州を中心とした感染再拡大や地政学リスクへの警戒感の強まりを受けて下落しました。

外国債券

米国の長期金利は上昇しました。

期初から3月にかけて、経済活動の再開や株価の堅調な推移などから、米国の長期金利

は上昇しました。4月上旬から7月にかけては、感染再拡大によるインフレ期待の低下などを背景に低下しました。その後10月下旬にかけては、FOMCにて政策金利予想が引き上げられたことやテーパリング開始が示唆されたことを受け、長期金利は上昇しました。しかし、1月にかけては、変異ウイルスの感染拡大懸念から低下基調となりました。期末にかけては、インフレへの警戒感が根強く、また金融政策正常化プロセスの見通しが前倒しされる中で長期金利は大きく上昇しました。

欧州(ドイツ)の長期金利は上昇しました。

欧州では、期初から6月下旬にかけて、米金利の上昇や欧州景気の改善期待等から、長期金利が大きく上昇しました。7月から8月下旬にかけては、感染再拡大や米金利の低下等を受けて、欧州でも長期金利は低下基調で推移しましたが、その後は米金利に連れる形で上昇しました。しかし、再度感染が再拡大し、変異ウイルスへの警戒感も強まる中で長期金利は大きく低下しましたが、その後は、インフレ懸念の高まりやECBの金融政策正常化の前倒し観測等を背景には大きく上昇しました。期末にかけては、地政学リスクへの懸念が高まり、長期金利は低下しました。

外国為替

●米ドル・円

期を通して見ると、米ドル・円は上昇しました。

期初から3月下旬にかけては、米金利の上昇などを背景に米ドルが底堅く推移しました。4月以降9月下旬にかけては、米金利の低下等を背景に米ドルは上値が重くなり、もみ合いで推移しました。その後期末にかけては、米国の利上げの織り込みが加速したことや、株価上昇などによるリスク選好度の改善を背景に、米ドルは上昇しました。

●ユーロ・円

期を通して見ると、ユーロ・円は上昇しました。

期初から5月下旬にかけては、米金利の上昇やユーロ圏の景気回復期待などを背景に、ユーロがじり高の展開となりました。10月上旬にかけては、感染再拡大を受けたリスク回避的な動きにより、ユーロは下落しました。その後、利上げの織り込みが進んだことでユーロは上昇しましたが、感染の再拡大を受けて下落で推移しました。

期末にかけては、ECB高官によるタカ派的な発言を受けてユーロは一時的に上昇する場面がありましたが、感染再拡大への懸念が強まり、下落基調で推移しました。

ポートフォリオについて(2021年2月19日から2022年2月18日まで)

当ファンド

各マザーファンドへの投資を通じて、主として内外の株式および公社債に国際分散投資を行いました。時価変動等に伴う組入比率の変化については、追加設定や一部解約といった資金流出入に応じて各マザーファンドの売買を通じて資産配分の基準値からの乖離を調整しました。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

ベンチマークであるTOPIX（東証株価

指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、東証1部上場銘柄のうち流動性や信用リスクを考慮して投資し、また、連動性を高めつつ、ファンドの資金流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。

月次ベースの推定トラッキングエラー（ポートフォリオとベンチマークのリターンの乖離）が拡大する場合には、現物株式のリバランス（投資配分比率の調整）を実施しトラッキングエラーを低く抑えました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

国内債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、デュレーション（投資資金の平均回収期間）、満期・債券種別・格付け構成などをベンチマークに合わせつつ、個別銘柄については分散投資を図りました。また、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランスを行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

外国株式インデックス・マザーファンド

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

日々の追加設定・解約による資金変動に対しては、売買にかかるコストなどを勘案し、株式先物取引を利用した組入比率の調整を実施してトラッキングエラーを低く抑えました。

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

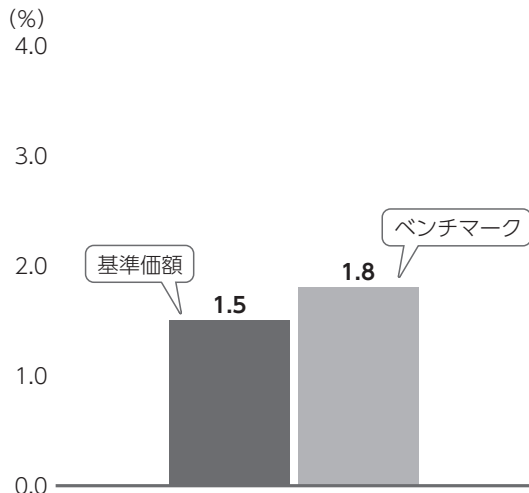
ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、通貨・国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りベンチマークに近似させるよう調整しました。

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

ベンチマークとの差異について(2021年2月19日から2022年2月18日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドのベンチマークは、国内株式…TOPIX(東証株価指数、配当込み)、国内債券…NOMURA-BPI(総合)、外国株式…MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)、外国債券…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)、短期金融資産…有担保コール翌日物を、基本資産配分で組み合わせた合成指数です。

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。

※基準価額は分配金再投資ベース

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は+1.5%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+1.8%を0.3%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 信託報酬等の支払い

分配金について(2021年2月19日から2022年2月18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	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	1,031

※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。

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。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続きマザーファンドへの投資を通じて、主として内外の株式および公社債に国際分散投資を行うことにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

引き続き、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）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

質株式組入比率を高位に保つことを基本とします。

国内債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、NOMURA-BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。デュレーション、満期構成、流動性などを考慮して選択した債券に分散投資し、債券組入比率を高位に保つことを基本とします。

外国株式インデックス・マザーファンド

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

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

通貨・国別配分、満期構成、デュレーション等を可能な限りベンチマークに近似させるよう調整します。

また月次のベンチマーク更新時や、日々の資金流入出に対応し、迅速なリバランスを行います。

債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

1万口当たりの費用明細（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

項 目	金額	比率	項目の概要
(a) 信 託 報 酬	17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） 期中の平均基準価額は11,131円です。
（投 信 会 社）	(7)	(0.066)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販 売 会 社）	(7)	(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）	(2)	(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	0.001	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株 式）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(0)	(0.000)	
（公 社 債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	2	0.015	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）	(1)	(0.007)	保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送回金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0.007)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
（そ の 他）	(0)	(0.001)	そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	19	0.170	

※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。

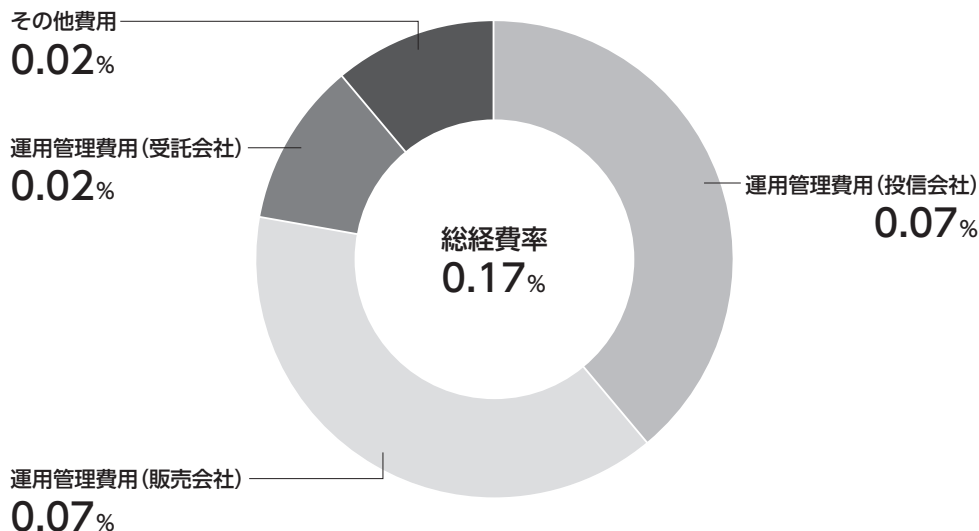
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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0.17%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	10,129	32,646	3,044	10,054
外国株式インデックス・マザーファンド	2,640	13,891	1,070	5,971
外国債券パッシブ・マザーファンド	7,080	13,873	1,325	2,608
国内債券パッシブ・マザーファンド	63,274	80,888	12,221	15,620

■ 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2月19日から2022年2月18日まで）

項 目	当 期	
	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	外国株式インデックス・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	35,926,123千円	38,250,818千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	192,794,498千円	310,066,553千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.18	0.12

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等（2021年2月19日から2022年2月18日まで）

(1) 利害関係人との取引状況

三井住友ＤＳ・年金バランス30（債券重点型）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 22,710	百万円 6,507	% 28.7	百万円 13,215	百万円 6,672	% 50.5
株式先物取引	51,218	51,199	100.0	49,065	48,008	97.8

※平均保有割合 0.0%

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 40,292	百万円 2,342	% 5.8	百万円 36,419	百万円 625	% 1.7

※平均保有割合 0.1%

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

外国株式インデックス・マザーファンド

外国債券パッシブ・マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(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 172	百万円 74	百万円 2,207

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
公社債	百万円 —	百万円 —	百万円 101

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	買 付 額
公社債	百万円 1,300

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

三井住友ＤＳ・年金バランス30（債券重点型）

項 目	当 期
(a) 売買委託手数料総額	1千円
(b) うち利害関係人への支払額	1千円
(c) (b) / (a)	56.5%

※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、ＳＭＢＣ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、株式会社三井住友銀行です。

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

(2021年2月19日から2022年2月18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2月18日現在）

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	8,116	15,201	48,951
外国株式インデックス・マザーファンド	2,741	4,312	24,251
外国債券パッシブ・マザーファンド	6,805	12,560	24,258
国内債券パッシブ・マザーファンド	55,942	106,995	134,653

※各親投資信託の期末の受益権総口数は以下の通りです。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号） 62,902,449,020口
外国債券パッシブ・マザーファンド 82,333,458,509口

外国株式インデックス・マザーファンド 61,407,657,975口
国内債券パッシブ・マザーファンド 102,053,846,373口

■ 投資信託財産の構成

（2022年2月18日現在）

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	48,951	20.0
国内債券パッシブ・マザーファンド	134,653	55.0
外国株式インデックス・マザーファンド	24,251	9.9
外国債券パッシブ・マザーファンド	24,258	9.9
コール・ローン等、その他	12,853	5.2
投資信託財産総額	244,969	100.0

※外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（345,013,700千円）の投資信託財産総額（346,185,785千円）に対する比率は99.7%です。

※外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（158,502,441千円）の投資信託財産総額（159,096,109千円）に対する比率は99.6%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝114.95円、1カナダ・ドル＝90.41円、1オーストラリア・ドル＝82.48円、1香港・ドル＝14.74円、1シンガポール・ドル＝85.60円、1ニュージーランド・ドル＝76.90円、1イギリス・ポンド＝156.42円、1イスラエル・シェケル＝35.793円、1スイス・フラン＝124.90円、1デンマーク・クローネ＝17.55円、1ノルウェー・クローネ＝12.89円、1スウェーデン・クローナ＝12.30円、1メキシコ・ペソ＝5.661円、1オフショア・人民元＝18.15円、1マレーシア・リンギット＝27.464円、1ポーランド・ズロチ＝28.86円、1ユーロ＝130.57円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年2月18日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	244,969,119円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	11,753,449
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	48,951,255
国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	134,653,923
外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	24,251,523
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	24,258,969
未 収 入 金	1,100,000
(B) 負 債	752,569
未 払 解 約 金	557,362
未 払 信 託 報 酬	187,223
そ の 他 未 払 費 用	7,984
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	244,216,550
元 本	221,385,852
次 期 繰 越 損 益 金	22,830,698
(D) 受 益 権 総 口 数	221,385,852口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	11,031円

※当期における期首元本額119,003,460円、期中追加設定元本額128,773,003円、期中一部解約元本額26,390,611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2月19日 至2022年2月18日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 6,552円
受 取 利 息	337
支 払 利 息	△ 6,889
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,631,777
売 買 益	4,076,288
売 買 損	△ 2,444,511
(C) 信 託 報 酬 等	△ 343,909
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	1,281,316
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	5,129,156
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	16,420,226
(配 当 等 相 当 額)	(14,083,042)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,337,184)
(G) 合 計 (D + E + F)	22,830,698
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	22,830,698
追 加 信 託 差 損 益 金	16,420,226
(配 当 等 相 当 額)	(14,191,698)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,228,528)
分 配 準 備 積 立 金	7,500,302
繰 越 損 益 金	△ 1,089,830

※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、信託の追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	2,371,146円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	15,330,396
(d) 分配準備積立金	5,129,156
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	22,830,698
1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	1,031.26
(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、T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

■ 最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建－売建)	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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		
(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

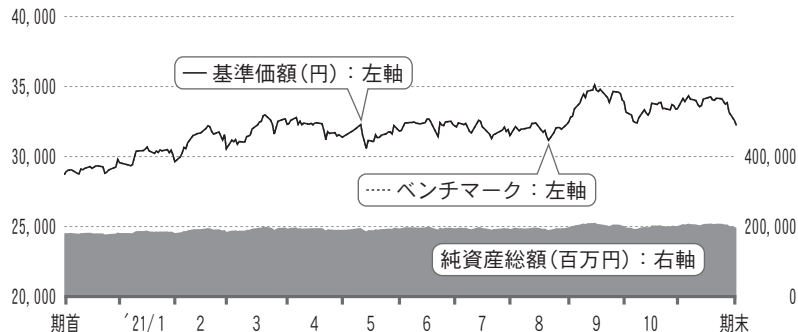
※騰落率は期首比です。

※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

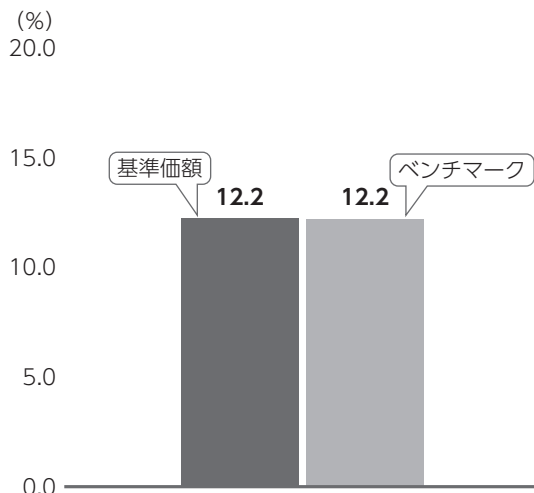
ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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
		千株	千円	千株	千円
国 内	上 場	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	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株 式	百万円 19,219	百万円 6,507	% 33.9	百万円 20,409	百万円 8,618	% 42.2
株 式 先 物 取 引	49,971	47,251	94.6	48,975	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	
	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	
	株	株	円	
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	
ビーエス三菱	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	—	—	
バコーボレーション	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	
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	
インフロア・ホールディングス	—	97.4	91,458	
OSJB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	
DM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	
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	56.3	50.9	64,388	
ジャパンホールディングス	48.6	48.8	195,444	
サントリー食品インターナショナル	3.8	3.7	18,167	
タイドグループホールディングス	22	22.2	148,074	
伊藤園	6.4	6.9	13,392	
キーコーヒー	8.9	8.4	23,335	
日清オイリオグループ	17.8	15.8	35,328	
不二製油グループ本社	1.3	1.4	5,656	
かどや製油	3.8	7.4	12,217	
J-オイルミルズ	52.2	52.6	455,516	
キッコーマン	160.9	161.3	549,549	
味の素	—	3.9	7,991	
ブルドックソース	40.4	38.3	88,434	
キュービー	26.9	27.2	75,860	
ハウス食品グループ本社	29.5	27.6	76,314	
カゴメ	4.1	7.7	7,168	
焼津水産化学工業	6.8	6.7	42,880	
アリアケジャパン	34.8	34.9	90,774	
ニチレイ	37.5	35	161,000	
東洋水産	2.6	3.6	7,484	
イートアンドホールディングス	5.1	—	—	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	31	28.6	238,524	
日清食品ホールディングス	4.2	4.1	7,925	
永谷園ホールディングス	2.9	6.6	5,629	
一正蒲鉾	7.7	7.5	13,560	
フジッコ	8.2	7.9	11,360	
ロック・フィールド	389	391.8	890,757	
日本たばこ産業	4.8	5.2	6,609	
ケンコーマヨネーズ	6	5.3	9,762	
わらべや日洋ホールディングス	4.6	5.2	9,885	
なとり	2.1	4.1	7,236	
ビックルスコーポレーション	—	7	15,904	
ファーマフーズ	31	38.5	30,607	
ユーグレナ				

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
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
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
日本バーカライジング	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	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	
積水化成成品工業	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	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 カネショウ	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	
クミアイ化学工業	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	
エフビコ	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	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	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
フジミインコーポレーテッド	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	
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	
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	
ジーテクト	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	—	—	
フリュー	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
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
ベガスミシン製造	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
レオン自動機	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
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
ユーシン精機	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	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	
I H I	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	
P H C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	
J V C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	
I P E X	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	
I D E C	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	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	
E I Z O	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	
T D K	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	
S M K	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	
T O A	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	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	
オブテックスグループ	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	
ヘリオス 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	
エンブラス	4.6	2.2	5,546	
大真空	—	11.6	18,212	
ローム	30	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	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) 株数	期末 株数	評価額
スズキ	143.4	166.5	763,402
S U B A R U	224.4	208.7	447,139
安永	4.5	5	4,815
ヤマハ発動機	102.1	95	271,605
T B K	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
日本ブラスト	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
J M S	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
マニーマニ	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
H O Y A	143.6	142.3	2,564,246
ノーリツ鋼機	5.6	6.7	18,378
エー・アンド・ディ	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
トラナザクション	6	5.5	5,318

銘柄	期首(前期末) 株数	期末 株数	評価額
ニホンフラッシュ	7.6	7.2	7,668
前田工機	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
バンダイナムコホールディングス	74.6	65.3	577,056
S H O E I	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
N I S S H A	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	—	—
ビジョン	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	
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	
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	
SG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	
ANA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%）				
NEC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
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
コ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
ボールトゥウィン・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
エニゴモ	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
S H I F T	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	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
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
マークラインズ	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・インフォメーション・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
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
SB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
CIJ	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JSA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
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
DTS	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
カプコン	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
SCSK	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
TKC	5.9	—	11.9	—	39,151
富士ソフト	7.6	—	7.6	—	40,128
NSD	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
JBC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
JALUX	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	
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	
バイタルケーエスケー・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	
佐島電機	7.6	6.2	5,772	
伯東	5.7	4.8	10,680	
コンドーテック	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	
SPK	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	—	—	
IDOM	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	
ダイトロン	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	
キャン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	
三愛石油	17.4	17.7	20,956	
稲畑産業	14.9	14.7	22,476	
GSI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	
ミツ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	
立花エレクトック	6	6.2	9,417	
PAL TAC	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	
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	
ジーンズホールディングス	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	
クリエイト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	
BEE N O S	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	期末	
	株数	数		株数	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	
T O K Y O B A S E	9.8	8.3		5,552	
J M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	
カップバ・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	
木曾路	8.7	10		20,880	

銘柄	期首(前期末)		期	期末	
	株数	数		株数	評価額
S R S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	
M r M a x H D	12.5	11.6		6,136	
A O K I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	
O l y m p i c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	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	—	—		
ペルーナ	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		
りそなホールディングス	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	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	
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	
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	
N E C 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
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
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
バリュエコマース	4.9		5.5		24,860
インフォーマート	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
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
シグマックス・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
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・ティール・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		—		—
カープ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		—		—
東京都競馬	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
乃村工芸社	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	期首(前期末)	期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
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	T O P I X	百万円 4,815	百万円 —

■■ 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

■ 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 た り 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ァンド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ァンド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ァンド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ァンド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ァンド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ァンド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ァンド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ァンド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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

第16期（2020年5月26日から2021年5月25日まで）

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

■ 最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合)		債券組入 比 率	純 資 産 額
		期 中 騰落率		期 中 騰落率		
	円	%		%	%	百万円
12期(2017年5月25日)	12,530	△1.9	379.26	△1.9	99.0	229,268
13期(2018年5月25日)	12,628	0.8	382.10	0.8	99.4	206,843
14期(2019年5月27日)	12,860	1.8	388.97	1.8	98.7	165,548
15期(2020年5月25日)	12,846	△0.1	388.47	△0.1	99.7	137,939
16期(2021年5月25日)	12,790	△0.4	386.73	△0.4	99.4	130,401

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

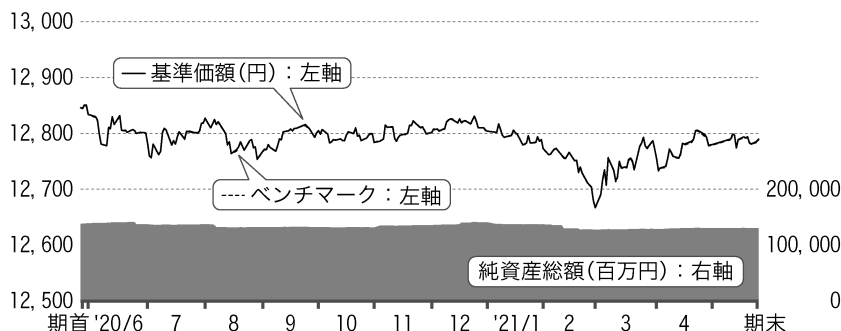
年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合)		債券組入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2020年5月25日	円 12,846	% —	388.47	% —	% 99.7
5月末	12,834	△0.1	388.13	△0.1	99.6
6月末	12,783	△0.5	386.56	△0.5	99.6
7月末	12,827	△0.1	387.91	△0.1	99.4
8月末	12,768	△0.6	386.09	△0.6	99.4
9月末	12,805	△0.3	387.22	△0.3	99.7
10月末	12,784	△0.5	386.63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

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

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

基準価額等の推移



期 首	12,846円
期 末	12,790円
騰 落 率	-0.4%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因 (2020年5月26日から2021年5月25日まで)

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

下落要因

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

▶ 投資環境について (2020年5月26日から2021年5月25日まで)

日本の長期金利の代表である10年国債利回りは上昇しました。

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

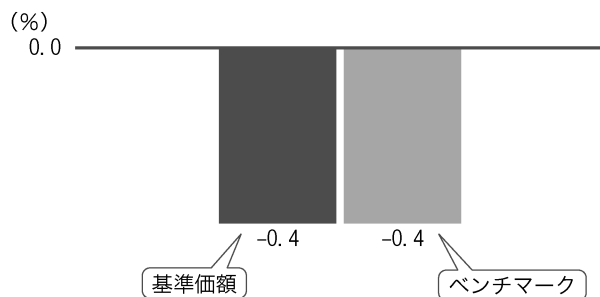
当期の市場の動きを10年国債利回りでみると、期首+0.002%から期末+0.078%へと上昇しました。

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

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

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

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



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

-1.0

第16期

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

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

2 今後の運用方針

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

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

項 目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用 (その他)	0円 (0)	0. 000% (0. 000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	0	0. 000	

期中の平均基準価額は12,781円です。

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

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

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	38,643,903	41,878,430
	地 方 債 証 券	824,238	101,705 (603,500)
	特 殊 債 券	2,455,335	2,012,483 (1,764,520)
	社 債 証 券 (投資法人債券を含む)	2,400,006	2,934,628 (900,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)
※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。
※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
※社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

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

(1)利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公 社 債	百万円 44,323	百万円 2,918	% 6.6	百万円 46,927	百万円 597	% 1.3

(2)利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
公 社 債	百万円 —	百万円 —	百万円 201

国内債券パッシブ・マザーファンド

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 2,300

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

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

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

■ 組入れ資産の明細(2021年5月25日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

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

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

国内債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 国内(邦貨建)公社債

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	第167回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	99,813	100,692	2056/4/10
	第1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	23,228	23,777	2042/5/10
	第2回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	25,900	26,800	2042/6/10
	第3回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	12,436	12,793	2037/11/10
	第6回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	11,982	12,253	2042/10/10
	第5回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.96	26,232	27,090	2038/11/10
	第9回 道路債券	2.9	100,000	128,815	2032/5/20
	第18回 政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.001	800,000	800,120	2022/5/30
	第42回 地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,196	2022/11/28
	第45回 地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	202,754	2023/2/28
	第61回 地方公共団体金融機構債券	0.69	100,000	102,071	2024/6/28
	第63回 地方公共団体金融機構債券	0.581	100,000	101,827	2024/8/28
	第67回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.466	100,000	101,621	2024/12/13
	第51回 政府保証関西国際空港債券	2.1	100,000	102,682	2022/8/31
	第3回 政府保証日本政策投資銀行社債	2.1	200,000	210,758	2023/12/18
	第34回 政府保証日本政策投資銀行社債	0.001	300,000	300,051	2022/6/30
	第81回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	232,464	2029/5/31
	第88回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	132,336	2039/8/31
	第90回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	300,000	350,226	2029/9/28
	第99回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	118,185	2030/1/31
	第176回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.645	100,000	116,153	2032/10/29
	第196回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.779	100,000	118,498	2033/7/29
	第210回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.547	200,000	232,192	2034/1/31
	第227回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.544	200,000	203,578	2024/9/30
	第231回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.495	300,000	305,115	2024/11/29
	第288回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.01	189,000	188,948	2026/9/30
	第20回 西日本高速道路社債	0.759	100,000	101,691	2023/9/20
	第342回 東京交通債券	2.4	100,000	102,561	2022/6/21
	第36回 日本政策投資銀行債券	2.23	100,000	112,753	2027/5/28
	第18回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.87	100,000	149,812	2046/12/20
	第22回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	300,000	436,344	2047/3/20
	第27回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.34	100,000	114,255	2027/10/20
	第37回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	300,000	348,861	2028/6/20
	第47回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	200,000	235,768	2029/4/20
	第104回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	400,000	405,128	2023/3/20
	第2回 地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.29	100,000	116,986	2029/4/27
	第3回 公営企業債券(20年)	1.03	100,000	101,861	2023/3/22
	第5回 公営企業債券(20年)	2.11	100,000	104,852	2023/9/20
	第17回 公営企業債券(20年)	2.39	100,000	111,438	2026/3/24
	第20回 公営企業債券(20年)	2.25	100,000	112,558	2027/3/24
	第22回 公営企業債券(20年)	2.32	100,000	113,451	2027/6/18
	第24回 公営企業債券(20年)	2.29	200,000	230,086	2028/4/25
	第62回 地方公共団体金融機構債券	0.631	400,000	407,740	2024/7/26
	第101回 地方公共団体金融機構債券	0.235	100,000	100,894	2027/10/28
	第106回 地方公共団体金融機構債券	0.215	200,000	201,562	2028/3/28
	第226回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.24	100,000	100,881	2027/12/20
	第12回 国際協力機構債券	0.901	100,000	100,953	2022/6/20
	第45回 中日本高速道路	0.904	100,000	101,169	2022/9/20

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 投資信託財産の構成

(2021年5月25日現在)

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

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年5月25日現在)

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

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

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

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

■ 損益の状況

(自2020年5月26日 至2021年5月25日)

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

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

■ 期末における、元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	6,107,406,137円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,723,802,531円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	10,781,816,542円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,849,038,912円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,397,304,721円	SMAM・バランスファンドVVL30<適格機関投資家限定>	329,649,062円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	641,931,738円	SMAM・バランスファンドVVL50<適格機関投資家限定>	596,483,349円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	43,241,043円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	274,171,613円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	184,044,133円	SMAM・バランスファンドVLI国際分散型<適格機関投資家限定>	117,615,876円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	434,154,953円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,898,851,071円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	583,046,424円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,193,869,711円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	261,715,284円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,535,669,870円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	412,399,004円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,205,091,355円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	136,805,557円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	948,903円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,167,274,213円	三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,259,749,712円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	336,338,695円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	468,541,289円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	13,590,257円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	595,459,501円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	34,209,543円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	182,525,240円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	1,282,563,419円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,116,807円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	409,872,922円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,610,117,052円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	612,321,166円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,259,171,883円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	123,710,024円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	786,132,548円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	35,616,100円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	215,565,314円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	97,879,738円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	19,071,373円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	77,545,541円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	296,118,831円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	130,303,297円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,582,241,420円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	36,291,637円	SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	323,429,939円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,882,878円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	817,827,093円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,587,722,151円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	996,614,616円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,242,266,453円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	3,599,244,808円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

外国株式インデックス・マザーファンド

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 5 月19日）
運用方針	・主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ・外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。

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) MSCIコクサイインデックス		株式組入 比	株 式 先 物 比 率 (買建-売建)	投資信託 組入比率	純 資 産 額
	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	(配当込み、 円ベース)	期 騰 落 中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
15期（2017年11月30日）	33,807	22.7	350.45	23.0	95.2	2.5	2.3	196,182
16期（2018年11月30日）	34,678	2.6	360.38	2.8	93.7	3.9	2.3	174,245
17期（2019年12月 2 日）	38,813	11.9	404.43	12.2	95.2	2.1	2.7	232,418
18期（2020年11月30日）	42,581	9.7	444.41	9.9	96.8	0.9	2.3	254,097
19期（2021年11月30日）	58,337	37.0	609.64	37.2	95.5	2.2	2.4	353,818

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	投 資 信 託 組 入 率 比
		騰 落 率	(配当込み、 円ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2020年11月30日	円	%		%	%	%	%
	42,581	—	444.41	—	96.8	0.9	2.3
12月末	43,814	2.9	457.26	2.9	96.3	2.0	2.2
2021年1月末	44,722	5.0	467.15	5.1	96.4	1.3	2.3
2月末	46,242	8.6	483.94	8.9	96.9	0.8	2.3
3月末	49,339	15.9	515.16	15.9	96.6	0.9	2.3
4月末	51,661	21.3	539.56	21.4	96.3	1.4	2.3
5月末	52,422	23.1	547.82	23.3	95.7	2.1	2.3
6月末	53,738	26.2	561.70	26.4	96.9	0.8	2.3
7月末	54,506	28.0	569.82	28.2	95.8	2.0	2.3
8月末	55,856	31.2	583.91	31.4	95.6	2.1	2.3
9月末	54,560	28.1	570.44	28.4	95.4	2.3	2.3
10月末	58,559	37.5	612.25	37.8	95.1	2.7	2.3
(期 末) 2021年11月30日							
	58,337	37.0	609.64	37.2	95.5	2.2	2.4

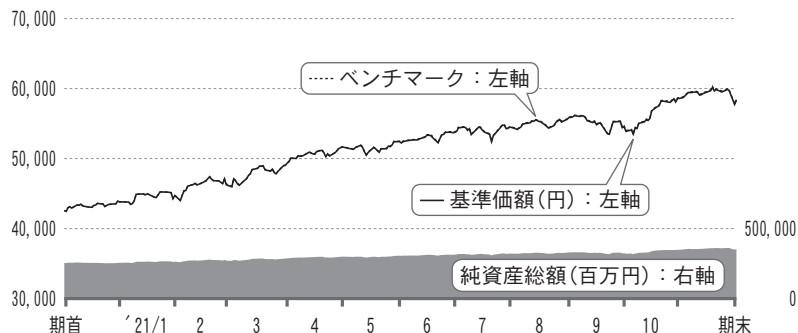
※騰落率は期首比です。

※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



※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	42,581円
期 末	58,337円
騰 落 率	+37.0%

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

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

上昇要因

- ・ 米国などの主要国経済が予想以上に堅調に回復したこと
- ・ 世界的に企業業績の想定以上の上振れが続いたこと
- ・ 先進国を中心に、ワクチン接種の広がりにより、新型コロナウイルス感染者数が減少したこと
- ・ 主要通貨に対して円安が進行したこと

▶ 投資環境について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

期間における世界の株式市場は、上昇しました。為替市場では、米ドルとユーロが対円で上昇しました。

株式市場

期初から2021年1月までは米バイデン新政権の大規模な景気対策案が好感され、2月も経済正常化への期待が高まり、上昇が続きました。他方、相場過熱への警戒感や長期金利の大幅な上昇により、3月中旬にかけては頭の重い展開となりました。

4月は各国の企業決算発表が押し並べて事前予想を上回ったことや、FOMC（米連邦公開市場委員会）で金融緩和政策の長期的な維持が確認されたことが安心材料となり、上昇しました。

5月は、物価指数が予想以上に上昇して一進一退となりました。

6月は、物価指数の上振れなどが警戒される場面もありましたが、一時的という見方から持ち直しました。7月から8月にかけては、感染拡大懸念や、世界景気の回復一巡感などから上値の重い展開となりました。

9月は、中国の大手不動産グループの経営不安や長期金利の上昇などから、株価は全般的に調整しました。10月から11月中旬にかけては、米国の7－9月期の企業業績が概ね事前予想を上回る決算となり上昇しました。しかし期末には新たな変異ウイルス（オミクロン型）が複数の国で報告され、下落しました。

期間を通じてみると、世界の株式市場は、大きく上昇しました。

為替市場

米ドル・円相場は、安全通貨とされる円を売る動きが強まる中で、期初から3月下旬にかけて円安基調となりました。4月から6月中旬までは米金利の動きに連れて一進一退となりました。

6月下旬には、FOMCでのタカ派（インフレ抑制を重視する立場）的な内容を受けて、米ドル高・円安となりました。7月から9月中旬にかけては、リスク回避的な動きが重石となり一進一退となりました。9月下旬には、米金利の上昇を受けて米ドル高・円安となりました。10月はリスク選好度の改善を背景に引き続き米ドル高・円安となりましたが、11月から期末にかけては米金利の動きに連れて一進一退となりました。

ユーロ・円相場は、期初から5月末までユーロ高基調が続きました。米ドルや円に比べて景気

回復局面に選好されやすい通貨であることも影響し、ユーロの上昇が継続しました。6月から8月中旬にかけてECB高官によるハト派（景気を重視する立場）的な発言を背景にユーロ安・円高となりましたが、8月下旬から9月下旬にかけてはリスク選好度や欧州金利の動きにつれて一進一退となりました。10月は中旬までユーロ圏でも利上げの織込みが進み、ユーロ高・円安となりましたが、10月下旬から期末にかけてはユーロ圏で感染が再拡大したことなどを背景に、ユーロ安・円高となりました。

期間を通じてみると、為替市場では、米ドル、ユーロとも対円で上昇しました。

▶ 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

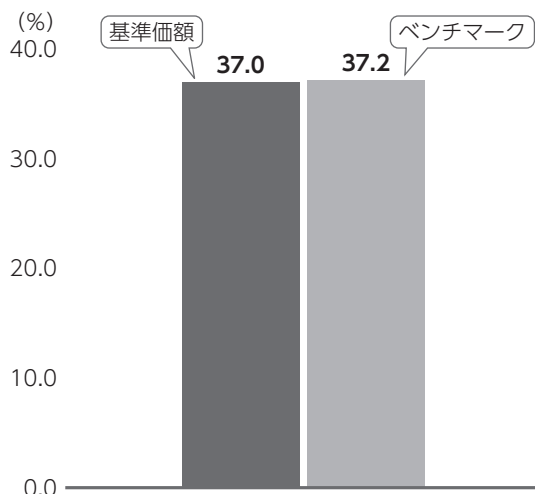
MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

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

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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+37.0%となり、ベンチマークの騰落率+37.2%を0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

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

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

1 万口当たりの費用明細（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) (新 株 予 約 権 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) (投 資 信 託 証 券)	2円 (1) (0) (0) (0)	0.004% (0.003) (0.000) (0.001) (0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0)	0.003 (0.003) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	22 (18) (4)	0.043 (0.034) (0.009)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	25	0.049	

期中の平均基準価額は51,446円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引状況 (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
外 国	ア メ リ カ	百株 15,401.97 (△ 621.98)	千アメリカ・ドル 169,438 (△ 1,555)	百株 12,306.33	千アメリカ・ドル 113,305
	カ ナ ダ	2,311.89 (273.32)	千カナダ・ドル 11,741 (△ 124)	1,703.76	千カナダ・ドル 6,821
	オーストラリア	3,476.46 (702.8)	千オーストラリア・ドル 6,595 (△ 136)	5,519.06	千オーストラリア・ドル 4,131
	香 港	7,757 (288.75)	千香港・ドル 16,831 (△ 28)	7,969.2	千香港・ドル 16,060
	シンガポール	2,247 (1,629.48)	千シンガポール・ドル 1,384 (△ 158)	4,981.48	千シンガポール・ドル 1,616
	ニュージーランド	1,355.71	千ニュージーランド・ドル 1,074	1,130.81	千ニュージーランド・ドル 937
	イ ギ リ ス	12,978.5 (△ 2,713.75)	千イギリス・ポンド 6,984 (△ 457)	10,357.68	千イギリス・ポンド 4,950
	ス イ ス	530.87 (-)	千スイス・フラン 5,382 (△ 138)	418.35	千スイス・フラン 4,186
	デ ン マ ー ク	270.26 (822.16)	千デンマーク・クローネ 10,740 (-)	622.97	千デンマーク・クローネ 9,472
	ノ ル ウ ェ ー	382.99	千ノルウェー・クローネ 4,726	179.18	千ノルウェー・クローネ 2,868
	ス ウ ェ ー デ ン	1,214.19 (3,955.6)	千スウェーデン・クローナ 31,613 (△ 4,424)	1,307.89	千スウェーデン・クローナ 12,485
	ユ ー ロ		千ユーロ		千ユーロ
	アイルランド	53.01	415	25.84	232
	オ ラ ン ダ	1,059.85 (875.14)	5,419 (442)	1,105.43	2,401

外国株式インデックス・マザーファンド

			買 付		売 付	
			株 数	金 額	株 数	金 額
外 国		ベ ル ギ ー	96.33	528	178.72	809
		ルクセンブルグ	191.85	222	356.97	235
		フ ラ ン ス	(776.95 319.6)	(△ 5,374 493)	1,466.99	4,578
		ド イ ツ	(1,064.12 610.92)	(5,909 61)	1,164.95	4,804
		ポ ル ト ガ ル	299.29	323	191.1	217
		ス ペ イ ン	(1,538.61 465.43)	(△ 1,659 46)	2,243.64	1,250
		イ タ リ ア	(3,933.92 ー)	(△ 1,309 1)	3,789.01	1,075
		フ ィ ン ラ ン ド	241.52	730	252.87	359
		オ ー ス ト リ ア	126.57	491	135.73	463

※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) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	ス イ ス	証券 ー	千スイス・フラン ー	証券 55,710	千スイス・フラン 9

※金額は受渡し代金。

外国株式インデックス・マザーファンド

(3) 投資信託証券

			買 付		売 付	
			口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	ア メ リ カ	SIMON PROPERTY GROUP INC	口 3,186	千アメリカ・ドル 344	口 1,547	千アメリカ・ドル 180
		VEREIT INC	— (△ 54,273)	— (—)	— (—)	— (—)
		EQUITY RESIDENTIAL	—	—	898	68
		EQUINIX INC	253	196	156	108
		AMERICAN TOWER CORP	1,608	451	574	125
		SUN COMMUNITIES INC	1,024	180	586	84
		REALTY INCOME CORP	2,848 (7,652)	200 (—)	— (—)	— (—)
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	—	8,249	310
		INVITATION HOMES INC	4,897	198	—	—
		VICI PROPERTIES INC	15,698	429	3,171	92
		ORION OFFICE REIT INC	— (2,829)	— (—)	2,829 (—)	54 (—)
		VENTAS INC	—	—	1,938	95
		PROLOGIS INC	3,055	422	2,917	316
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,166	240	—	—
		DUKE REALTY CORP	7,983	389	7,318	299
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	—	3,613	315
		WELLTOWER INC	2,373	203	1,722	107
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	—	—	20,481	163
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	—	3,998	140
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,124	182	—	—
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,212	193	1,319	148
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	7,876	167	7,768	160
国	カ ナ ダ	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	口 —	千カナダ・ドル —	口 6,546	千カナダ・ドル 101
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	—	—	3,585	86
	オーストラリア	TRANSURBAN GROUP	口 16,809 (16,148)	千オーストラリア・ドル 223 (225)	口 17,152 (—)	千オーストラリア・ドル 227 (—)
		SYDNEY AIRPORT	—	—	11,713	69
		APA GROUP	—	—	12,700	130
		GPT GROUP	23,925	109	—	—
		VICINITY CENTRES	159,671	265	168,467	276
	香 港	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	口 68,500	千香港・ドル 540	口 —	千香港・ドル —

外国株式インデックス・マザーファンド

			買 付		売 付	
			口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国	シンガポール	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	口 40,800 (—)	千シンガポール・ドル 124 (△ 4)	口 29,300 (—)	千シンガポール・ドル 86 (—)
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	— (21,128)	— (28)	— (—)	— (—)
		SUNTEC REIT	—	—	102,700	145
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	70,000 (—)	137 (△ 2)	— (—)	— (—)
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	58,300 (—)	118 (△ 0)	50,800 (—)	109 (—)
	イギリス	SEGRO PLC	口 8,749	千イギリス・ポンド 119	口 —	千イギリス・ポンド —
	ユ ー ロ	フランス		千ユーロ	口	千ユーロ
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	—	1,606	106
		ICADE	—	—	2,061	127
	ロ	KLEPIERRE	4,295 (—)	89 (△ 9)	— (—)	— (—)

※金額は受渡し代金。

※()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

※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。

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株 式 先 物 取 引	百万円 66,749	百万円 63,003	百万円 —	百万円 —

※金額は受渡し代金。

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

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(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	43,010,068千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	294,102,700千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.14

※(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。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 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)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

(1) 外国株式

銘柄	柄	期首(前期末)	期	末		業 種 等
		株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION		58.89	58.89	1,033	117,590	ソフトウェア・サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO		98.95	110.28	1,817	206,779	保険
ABBOTT LABORATORIES		948.44	957.32	12,256	1,394,429	ヘルスケア機器・サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS		30.92	35.59	1,488	169,388	素材
CONCHO RESOURCES INC		101.72	—	—	—	エネルギー
VERISK ANALYTICS INC		79.29	79.29	1,817	206,721	商業・専門サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC		20.6	23.71	1,023	116,499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LAS VEGAS SANDS CORP		176.34	176.34	657	74,751	消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC		—	22.43	1,265	144,006	半導体・半導体製造装置
SVB FINANCIAL GROUP		26.4	31.11	2,253	256,428	銀行
FIDELITY NATIONAL INFO SERV		333.93	339.4	3,576	406,948	ソフトウェア・サービス
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		13.81	14.69	2,465	280,457	消費者サービス
AFLAC INC		354.11	341.85	1,904	216,629	保険
DARDEN RESTAURANTS INC		74.25	76.06	1,078	122,661	消費者サービス
MONSTER BEVERAGE CORP		211.16	222.02	1,928	219,376	食品・飲料・タバコ
ADOBE INC		258.16	257.02	17,669	2,010,300	ソフトウェア・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		120.02	120.02	755	85,969	素材
LULULEMON ATHLETICA INC		64.81	64.81	3,002	341,581	耐久消費財・アパレル
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL		202	—	—	—	銀行
GARMIN LTD		81.24	84.44	1,175	133,764	耐久消費財・アパレル
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC		119.9	118.18	3,443	391,729	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		377.29	375.49	7,797	887,113	資本財
WR BERKLEY CORP		74.28	74.28	590	67,158	保険
AUTOZONE INC		12.71	11.37	2,090	237,846	小売
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR		599.62	637.19	547	62,271	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DR HORTON INC		193.85	181.62	1,793	204,066	耐久消費財・アパレル
DENTSPLY SIRONA INC		118.64	118.64	577	65,720	ヘルスケア機器・サービス
AUTODESK INC		115.06	115.06	3,004	341,855	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP		121.01	121.01	693	78,859	公益事業
CITIGROUP INC		1,123.53	1,105.27	7,188	817,855	銀行
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC		41.86	41.86	354	40,356	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING		224.63	223.87	5,281	600,829	ソフトウェア・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER		257.27	257.27	2,143	243,845	公益事業
HESS CORP		153.62	143.44	1,091	124,139	エネルギー
DAVITA INC		41.38	41.38	401	45,623	ヘルスケア機器・サービス
DOMINO'S PIZZA INC		21.21	21.21	1,132	128,845	消費者サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC		289.13	307.81	4,060	461,907	各種金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		309.87	303.41	1,966	223,717	食品・飲料・タバコ
BUNGE LTD		71.74	71.74	649	73,930	食品・飲料・タバコ

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	株数	期末	株数	評価額	業種等
				外貨建金額	邦貨換算金額	
TE CONNECTIVITY LTD		174.25	174.25	2,777	315,981	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC		9,240	8,929.29	143,082	16,278,546	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		164.25	164.25	1,861	211,757	各種金融
BOEING CO/THE		289.26	301.3	5,980	680,436	資本財
CINCINNATI FINANCIAL CORP		78.58	78.58	930	105,903	保険
BECTON DICKINSON AND CO		153.15	151.4	3,688	419,612	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		133.96	179.45	181	20,661	消費者サービス
NISOURCE INC		189.19	189.19	477	54,348	公益事業
ABBVIE INC		947.79	952.34	11,131	1,266,476	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERIZON COMMUNICATIONS INC		2,208.86	2,231.32	11,526	1,311,426	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		741.86	712.57	20,103	2,287,121	各種金融
KINDER MORGAN INC		1,059.4	1,059.4	1,696	192,965	エネルギー
TRUIST FINANCIAL CORP		703.16	703.16	4,293	488,470	銀行
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		1,216.01	1,210.07	6,611	752,227	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL		139.37	139.37	696	79,201	保険
CBOE GLOBAL MARKETS INC		56.61	56.61	734	83,533	各種金融
JPMORGAN CHASE & CO		1,628.89	1,618.84	26,100	2,969,460	銀行
T ROWE PRICE GROUP INC		123.64	123.14	2,549	290,027	各種金融
FAIR ISAAC CORP		14.94	14.94	523	59,602	ソフトウェア・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		21.07	21.07	382	43,560	資本財
CIGNA CORP		193.82	183.24	3,657	416,131	ヘルスケア機器・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD		30.52	30.52	473	53,854	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		161.3	161.3	1,196	136,146	食品・飲料・タバコ
CADENCE DESIGN SYS INC		142.5	154	2,875	327,091	ソフトウェア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC		64.12	65.01	1,909	217,233	各種金融
MERCADOLIBRE INC		23.64	24.57	3,032	344,971	小売
DOLLAR GENERAL CORP		137.41	127.46	2,868	326,376	小売
SERVICENOW INC		103.03	106.96	7,196	818,743	ソフトウェア・サービス
CATERPILLAR INC		292.34	297.38	5,826	662,854	資本財
BROWN & BROWN INC		140.36	142.73	933	106,215	保険
CHARLES RIVER LABORATORIES		—	25.77	967	110,035	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP		305.28	305.28	2,252	256,215	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC		397.09	456.88	1,757	199,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		44.11	44.11	863	98,295	運輸
MOSAIC CO/THE		185.84	185.84	669	76,178	素材
CISCO SYSTEMS INC		2,266.97	2,269.38	12,654	1,439,652	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MORGAN STANLEY		734.12	755.61	7,346	835,844	各種金融
BROADCOM INC		214.87	220.01	12,416	1,412,573	半導体・半導体製造装置
DELL TECHNOLOGIES -C		126.02	145.5	837	95,298	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DTE ENERGY COMPANY		104.96	105.36	1,174	133,640	公益事業
DOMINION ENERGY INC		455.18	443.47	3,300	375,475	公益事業
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		56.13	68.1	1,230	140,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DEERE & CO		161.07	157.22	5,472	622,625	資本財
VMWARE INC-CLASS A		41.94	106.05	1,276	145,242	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE INC		346.84	372.5	5,545	630,943	各種金融
NASDAQ INC		65.58	65.09	1,360	154,829	各種金融
ZOETIS INC		257.28	252.46	5,643	642,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONSOLIDATED EDISON INC		183.36	183.99	1,478	168,192	公益事業
KKR & CO INC		286.09	285.69	2,180	248,030	各種金融
COGNEX CORP		86.98	86.98	684	77,839	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALPHABET INC-CL C		161.54	156.03	45,596	5,187,495	メディア・娯楽
COLGATE-PALMOLIVE CO		441.81	430.41	3,344	380,528	家庭用品・パーソナル用品
HCA HEALTHCARE INC		143.52	143.12	3,290	374,373	ヘルスケア機器・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC		63.05	192.52	6,444	733,181	ヘルスケア機器・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A		139.31	139.31	1,242	141,328	素材
COSTCO WHOLESALE CORP		237.07	238.46	13,231	1,505,366	食品・生活必需品小売り

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	株数	期末	評価額	業種等
		株数	株数	外貨建金額 邦貨換算金額	
CUMMINS INC		80	82.07	1,783	資本財
ACTIVISION BLIZZARD INC		412.25	400.92	2,417	メディア・娯楽
DELTA AIR LINES INC		82.99	82.99	300	運輸
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC		69.25	69.25	662	運輸
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN		95.42	95.42	1,886	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COTERRA ENERGY INC		196.32	402.61	839	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC		26.81	26.81	1,566	資本財
MASIMO CORP		29.41	29.41	847	ヘルスケア機器・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		38.33	36.41	2,345	小売
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		396.55	378.73	1,745	食品・生活必需品小売り
SEAGEN INC		66.54	77.9	1,287	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COCA-COLA CO/THE	2,186.12	2,206.53	12,043	1,370,159	食品・飲料・タバコ
EXPEDITORS INTL WASH INC		86.89	86.89	1,101	運輸
BURLINGTON STORES INC		33.91	33.91	994	小売
FRANKLIN RESOURCES INC		142.98	142.98	482	各種金融
CSX CORP		415.38	1,218.27	4,339	運輸
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS		49.95	49.95	1,458	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDIA GROUP INC		68.94	80.61	1,342	消費者サービス
AMAZON.COM INC		226.03	242.97	86,535	小売
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		323.36	340.18	3,766	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	2,269.07	2,278.12	14,030	1,596,300	エネルギー
EVEREST RE GROUP LTD		20.65	20.65	545	保険
EOG RESOURCES INC		308.3	308.3	2,725	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC		83.21	83.21	950	ソフトウェア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP		79.93	79.93	960	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC		171.3	168.73	2,588	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FORD MOTOR CO	2,080.63	2,091.41	4,113	468,027	自動車・自動車部品
HORMEL FOODS CORP		149.39	149.39	634	食品・飲料・タバコ
LIBERTY GLOBAL PLC-A		84.32	84.32	233	電気通信サービス
KRAFT HEINZ CO/THE		380.96	384.38	1,336	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC		91.54	102.41	1,774	公益事業
EVERSOURCE ENERGY		175.57	175.57	1,497	公益事業
PAYPAL HOLDINGS INC		597.93	601.25	11,257	ソフトウェア・サービス
MSCI INC		43.83	43.83	2,829	各種金融
FORTINET INC		73.6	73.6	2,526	ソフトウェア・サービス
ALLY FINANCIAL INC		201.39	201.39	960	各種金融
ANTHEM INC		136.42	133.09	5,539	ヘルスケア機器・サービス
NEXTERA ENERGY INC	1,051.98	1,059.66	9,394	1,068,862	公益事業
PALO ALTO NETWORKS INC		52.21	53.93	2,972	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC		290.19	333.35	3,780	電気通信サービス
ELECTRONIC ARTS INC		153.52	153.52	1,917	メディア・娯楽
FREEMPORT-MCMORAN INC		754.31	808.28	3,069	素材
SYNCHRONY FINANCIAL		278.25	321.12	1,513	各種金融
MARATHON PETROLEUM CORP		339.33	339.33	2,096	エネルギー
KEURIG DR PEPPER INC		183.39	382.44	1,345	食品・飲料・タバコ
US BANCORP		707.43	746.23	4,283	銀行
AUTOLIV INC		40.01	40.01	383	自動車・自動車部品
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		125.9	—	—	素材
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE		638.81	638.81	933	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC		29.09	29.09	672	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OLD DOMINION FREIGHT LINE		49.26	55.39	1,978	運輸
FASTENAL CO		298.92	298.92	1,821	資本財
FISERV INC		301.44	315.64	3,076	ソフトウェア・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	4,736.99	589.47	5,800	659,909	資本財
ALIGN TECHNOLOGY INC		38.54	41.54	2,635	ヘルスケア機器・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC		25.22	25.22	1,128	ソフトウェア・サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末	評価額		業種等
				外貨建金額	邦貨換算金額	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	115.82	—	1,182	134,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	54.81	54.81	—	337	38,362	各種金融
TRANSUNION	94.97	94.97	—	1,083	123,314	商業・専門サービス
MATCH GROUP INC	127.73	137.29	—	1,840	209,426	メディア・娯楽
GODADDY INC - CLASS A	89.05	89.05	—	615	69,996	ソフトウェア・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	37.79	37.79	—	1,690	192,345	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	677.88	689.43	—	4,126	469,520	自動車・自動車部品
DIAMONDBACK ENERGY INC	79.33	—	—	—	—	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	71.66	71.66	—	737	83,940	資本財
HOLOGIC INC	135.92	135.92	—	1,032	117,477	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	126.42	126.42	—	2,458	279,659	資本財
GOLDMAN SACHS GROUP INC	177.23	181.67	—	7,022	798,923	各種金融
ALPHABET INC-CL A	160.21	161.11	—	46,892	5,334,998	メディア・娯楽
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	42.03	42.03	—	509	57,988	ヘルスケア機器・サービス
WABTEC CORP	92.31	92.31	—	853	97,112	資本財
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	27.37	27.37	—	1,661	189,075	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST REPUBLIC BANK/CA	88.97	88.97	—	1,907	217,068	銀行
CELANESE CORP	64.2	55.98	—	894	101,767	素材
VAIL RESORTS INC	20.38	20.38	—	679	77,314	消費者サービス
MOLINA HEALTHCARE INC	34.9	34.28	—	1,019	116,037	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	78.09	70.02	—	4,678	532,291	メディア・娯楽
GENERAL MILLS INC	314.89	314.89	—	2,000	227,560	食品・飲料・タバコ
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	108.56	108.56	—	1,340	152,533	ヘルスケア機器・サービス
FIRSTENERGY CORP	269.48	269.48	—	1,052	119,722	公益事業
GENUINE PARTS CO	74.06	74.06	—	984	111,987	小売
FORTIVE CORP	157.5	183.73	—	1,400	159,343	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	371.5	371.5	—	1,597	181,699	銀行
XYLEM INC	91.24	91.24	—	1,129	128,509	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	112.15	110.79	—	2,378	270,595	資本財
LKQ CORP	159.22	159.22	—	917	104,339	小売
HALLIBURTON CO	443.17	443.17	—	986	112,183	エネルギー
TELADOC HEALTH INC	61.22	74.96	—	797	90,748	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	575.38	571.04	—	23,231	2,642,996	小売
ALBEMARLE CORP	55.48	65.6	—	1,809	205,905	素材
CDW CORP/DE	74.04	74.04	—	1,442	164,090	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	31.14	31.14	—	485	55,281	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	530.62	758.17	—	1,165	132,577	銀行
HERSHEY CO/THE	75.14	75.14	—	1,346	153,158	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	68.99	67.44	—	2,886	328,443	ヘルスケア機器・サービス
SQUARE INC - A	197.41	207.89	—	4,425	503,472	ソフトウェア・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	99.21	99.21	—	2,645	301,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPLUNK INC	82.52	82.52	—	1,031	117,353	ソフトウェア・サービス
S&P GLOBAL INC	130.4	127.67	—	5,935	675,311	各種金融
MARKETAXESS HOLDINGS INC	19.12	19.12	—	674	76,778	各種金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	207.99	207.99	—	1,014	115,428	銀行
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	41.41	41.41	—	206	23,504	メディア・娯楽
HP INC	731.61	653.88	—	2,349	267,290	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	39.15	39.15	—	596	67,840	ソフトウェア・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	478.85	471.43	—	5,586	635,569	ソフトウェア・サービス
EAST WEST BANCORP INC	92.01	—	—	—	—	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	30.22	—	—	—	—	保険
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	70.05	76.75	—	2,257	256,794	ヘルスケア機器・サービス
SNAP INC - A	455.53	496.43	—	2,425	275,899	メディア・娯楽
XPO LOGISTICS INC	47.16	—	—	—	—	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	57.07	57.07	—	967	110,118	メディア・娯楽
LEIDOS HOLDINGS INC	69.47	69.47	—	629	71,567	商業・専門サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期		末		業種等
		株数	株数	評価額	価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額		
DUPONT DE NEMOURS INC		389.56	279.44	2,152	244,924	素材	
LIBERTY GLOBAL PLC- C		210.79	210.79	588	66,956	電気通信サービス	
BLACK KNIGHT INC		76.23	76.23	557	63,432	ソフトウェア・サービス	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION		79.4	79.4	459	52,239	運輸	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		81.99	81.95	690	78,550	保険	
JUNIPER NETWORKS INC		174.6	174.6	555	63,247	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JM SMUCKER CO/THE		57.68	57.68	746	84,895	食品・飲料・タバコ	
INGERSOLL-RAND INC		205.03	210.13	1,256	142,960	資本財	
JOHNSON & JOHNSON	1,407.94	1,413.74	22,584	2,569,438	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ON SEMICONDUCTOR CORP	209.12	209.12	1,317	149,934	半導体・半導体製造装置		
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	—	26.34	914	104,048	半導体・半導体製造装置		
HOWMET AEROSPACE INC	190.24	190.24	542	61,684	資本財		
QORVO INC	60.42	60.42	911	103,687	半導体・半導体製造装置		
IDEXX LABORATORIES INC	46.83	46.01	2,904	330,457	ヘルスケア機器・サービス		
ARISTA NETWORKS INC	32.97	129.52	1,639	186,551	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
EXACT SCIENCES CORP	84.28	84.28	729	83,007	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
JONES LANG LASALLE INC	26.18	—	—	—	不動産		
EVERGY INC	112.73	112.73	735	83,697	公益事業		
RINGCENTRAL INC-CLASS A	39.92	39.92	886	100,862	ソフトウェア・サービス		
SKYWORKS SOLUTIONS INC	87.57	87.57	1,356	154,344	半導体・半導体製造装置		
KIMBERLY-CLARK CORP	178	178	2,403	273,470	家庭用品・パーソナル用品		
INGREDION INC	33.2	—	—	—	食品・飲料・タバコ		
NORDSON CORP	32.07	28.84	756	86,014	資本財		
KROGER CO	408.43	389.55	1,649	187,691	食品・生活必需品小売り		
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	75.12	87.7	945	107,608	メディア・娯楽		
DISCOVERY INC-C	182.83	174.17	418	47,655	メディア・娯楽		
POOL CORP	—	21.07	1,180	134,263	小売		
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	106.9	999	113,690	消費者サービス		
DOCUSIGN INC	90.78	100.78	2,534	288,363	ソフトウェア・サービス		
FOX CORP - CLASS B	87.73	87.73	302	34,424	メディア・娯楽		
DOW INC	386.54	415.16	2,360	268,565	素材		
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	52.2	52.2	507	57,784	各種金融		
CBRE GROUP INC - A	182.44	182.44	1,787	203,327	不動産		
COUPA SOFTWARE INC	34.9	34.9	707	80,467	ソフトウェア・サービス		
KLA CORP	81.57	81.57	3,375	384,052	半導体・半導体製造装置		
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	83.07	110.98	2,430	276,488	ソフトウェア・サービス		
COPART INC	109.77	109.77	1,624	184,842	商業・専門サービス		
TRACTOR SUPPLY COMPANY	61.17	61.17	1,386	157,767	小売		
NRG ENERGY INC	135.47	135.47	496	56,455	公益事業		
DISCOVERY INC - A	70.75	70.75	173	19,793	メディア・娯楽		
TWILIO INC - A	65.43	89.93	2,637	300,013	ソフトウェア・サービス		
CORTEVA INC	417.98	393.48	1,833	208,565	素材		
LOCKHEED MARTIN CORP	136.32	133.59	4,558	518,619	資本財		
IDEX CORP	38.39	38.39	899	102,385	資本財		
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	224.6	—	—	—	ソフトウェア・サービス		
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12.88	12.88	262	29,921	保険		
EPAM SYSTEMS INC	31.28	30.95	1,962	223,302	ソフトウェア・サービス		
LENNOX INTERNATIONAL INC	20.56	15.27	491	55,960	資本財		
EQUITABLE HOLDINGS INC	228.2	228.2	735	83,702	各種金融		
CERNER CORP	155.37	155.37	1,132	128,790	ヘルスケア機器・サービス		
GLOBAL PAYMENTS INC	156.85	153.31	1,843	209,758	ソフトウェア・サービス		
RESMED INC	80.36	75.95	1,951	222,000	ヘルスケア機器・サービス		
BATH & BODY WORKS INC	—	154	1,168	132,928	小売		
DATADOG INC - CLASS A	68.59	104.23	1,907	216,994	ソフトウェア・サービス		
VISTRA CORP	257.77	257.77	517	58,916	公益事業		
GENERAC HOLDINGS INC	—	33	1,401	159,404	資本財		

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期		末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額		
LOWE'S COS INC		406.63	377.98	9,395	1,068,963	小売	
UNITED RENTALS INC		35.96	41.13	1,468	167,062	資本財	
ELI LILLY & CO		463.55	439.37	11,196	1,273,821	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZENDESK INC		—	60.67	577	65,648	ソフトウェア・サービス	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS		80.29	80.29	691	78,630	商業・専門サービス	
LAM RESEARCH CORP		75.81	77.79	5,293	602,289	半導体・半導体製造装置	
OKTA INC		59.12	63.06	1,410	160,425	ソフトウェア・サービス	
CARVANA CO		—	38.03	1,110	126,325	小売	
LOEWS CORP		139.14	127.27	701	79,796	保険	
BIO-RAD LABORATORIES-A		12.2	12.2	914	104,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MARKEL CORP		7.02	7.02	873	99,333	保険	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A		74.11	98.74	2,217	252,274	ソフトウェア・サービス	
NORTONLIFELOCK INC		313.47	313.47	793	90,264	ソフトウェア・サービス	
ROLLINS INC		76.62	114.93	406	46,196	商業・専門サービス	
ETSY INC		—	71.68	2,017	229,547	小売	
DYNATRACE INC		111.94	95.87	618	70,318	ソフトウェア・サービス	
LINCOLN NATIONAL CORP		116.2	86.77	592	67,464	保険	
PLUG POWER INC		—	285.84	1,189	135,348	資本財	
MCDONALD'S CORP		398.83	402.64	10,078	1,146,583	消費者サービス	
CABLE ONE INC		2.46	2.46	449	51,104	メディア・娯楽	
3M CO		310.51	306.04	5,393	613,600	資本財	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC		77.45	105.66	775	88,173	各種金融	
META PLATFORMS INC-CLASS A		1,283.26	1,284.02	43,403	4,938,042	メディア・娯楽	
ENPHASE ENERGY INC		—	72.93	1,872	212,998	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC		44.7	44.7	1,777	202,261	ソフトウェア・サービス	
COSTAR GROUP INC		20.54	205.4	1,642	186,923	商業・専門サービス	
IAC/INTERACTIVECORP		—	39.74	519	59,142	メディア・娯楽	
SNOWFLAKE INC-CLASS A		15.05	100.46	3,664	416,919	ソフトウェア・サービス	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		115.46	115.46	906	103,090	ソフトウェア・サービス	
VIATRIS INC		630.72	630.72	789	89,839	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DOORDASH INC - A		—	38.44	703	80,036	小売	
ZSCALER INC		42.74	45.51	1,619	184,283	ソフトウェア・サービス	
AMETEK INC		128.23	121.71	1,704	193,871	資本財	
MODERNA INC		144.09	178.13	6,564	746,816	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DOLLAR TREE INC		120.47	120.47	1,702	193,732	小売	
PELOTON INTERACTIVE INC-A		102.16	125.99	559	63,628	耐久消費財・アパレル	
FOX CORP - CLASS A		169.62	169.62	626	71,246	メディア・娯楽	
PHILLIPS 66		224.92	224.92	1,571	178,765	エネルギー	
MGM RESORTS INTERNATIONAL		258.78	221.98	913	103,872	消費者サービス	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		65.42	130.84	1,138	129,490	食品・飲料・タバコ	
METLIFE INC		415.34	397.03	2,377	270,523	保険	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		349.76	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
MOTOROLA SOLUTIONS INC		92.41	92.12	2,390	271,968	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ROCKWELL AUTOMATION INC		62.19	62.19	2,118	240,972	資本財	
MERCK & CO. INC.		1,353.01	1,364.93	10,221	1,162,952	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MASCO CORP		148.85	148.85	1,002	114,038	資本財	
MARSH & MCLENNAN COS		266.25	266.25	4,447	505,954	保険	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		422.07	445.47	2,539	288,933	各種金融	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		147.15	147.15	2,218	252,407	消費者サービス	
WORKDAY INC-CLASS A		90.8	98.64	2,777	316,007	ソフトウェア・サービス	
SUNRUN INC		61.12	106.69	510	58,093	資本財	
BAKER HUGHES CO		319.74	374.18	880	100,168	エネルギー	
AMERCO		3.9	6.5	466	53,039	運輸	
MARVELL TECHNOLOGY INC		—	451.11	3,384	385,023	半導体・半導体製造装置	
CHENIERE ENERGY INC		117.47	137.63	1,467	166,916	エネルギー	
NETAPP INC		109.19	109.19	999	113,691	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期	末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
NIKE INC -CL B		665.94	687.23	11,673	1,328,148	耐久消費財・アパレル
NORFOLK SOUTHERN CORP		139.42	137.09	3,684	419,146	運輸
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		127.45	287.04	2,422	275,621	半導体・半導体製造装置
NORTHROP GRUMMAN CORP		82.95	82.15	2,927	333,089	資本財
NEWMONT CORP		418.82	418.82	2,320	263,976	素材
MCKESSON CORP		84.11	84.11	1,877	213,651	ヘルスケア機器・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		138.14	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		838.74	843.16	7,365	837,916	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP		154.55	154.55	1,732	197,054	素材
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A		—	276.58	1,018	115,922	メディア・娯楽
WESTERN UNION CO		218.4	218.4	352	40,153	ソフトウェア・サービス
NEWELL BRANDS INC		251.06	175.87	393	44,719	耐久消費財・アパレル
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		442.07	485.8	1,460	166,140	エネルギー
PAYCHEX INC		177.34	177.29	2,193	249,566	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC		977.25	989.56	4,302	489,507	食品・飲料・タバコ
P G & E CORP		635.37	765.38	947	107,801	公益事業
PFIZER INC		2,976.7	3,012.01	15,782	1,795,624	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC		269.59	292.37	1,917	218,171	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP		66.91	66.91	2,068	235,328	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		88.58	121.84	2,234	254,168	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE		1,319.2	1,315.39	19,601	2,230,112	家庭用品・パーソナル用品
EXELON CORP		508.37	508.37	2,753	313,304	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		115.19	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVR INC		1.73	1.73	913	103,956	耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS		557.97	734.21	5,297	602,676	エネルギー
ABIOMED INC		22.88	22.88	730	83,068	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC		743.95	744.41	12,218	1,390,126	食品・飲料・タバコ
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		207.28	207.28	2,177	247,684	保険
ACCENTURE PLC-CL A		342.23	339.89	12,433	1,414,599	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC		82.2	82.2	631	71,822	資本財
QUALCOMM INC		604.16	608.94	11,188	1,272,934	半導体・半導体製造装置
ADVANCE AUTO PARTS INC		34.26	34.26	778	88,584	小売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		141.24	141.24	1,001	113,960	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS		52.97	54.95	3,595	409,108	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REPUBLIC SERVICES INC		114.15	114.15	1,577	179,517	商業・専門サービス
BOOKING HOLDINGS INC		22.15	22.31	4,868	553,839	消費者サービス
ROSS STORES INC		187.92	187.92	2,098	238,725	小売
PACKAGING CORP OF AMERICA		46.82	46.82	625	71,218	素材
QUEST DIAGNOSTICS INC		68.14	68.14	1,067	121,478	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC		55.55	55.55	637	72,527	商業・専門サービス
RALPH LAUREN CORP		19.71	—	—	—	耐久消費財・アパレル
RPM INTERNATIONAL INC		76.21	76.96	715	81,445	素材
PERKINELMER INC		56.24	56.24	1,041	118,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEICO CORP		18.88	18.88	264	30,110	資本財
HEICO CORP-CLASS A		44.35	45.7	580	66,030	資本財
REGIONS FINANCIAL CORP		557.26	470.41	1,107	125,982	銀行
CHEVRON CORP		1,033.25	1,041.57	11,962	1,360,965	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL		212.5	217.01	1,433	163,121	公益事業
IPG PHOTONICS CORP		17.76	17.76	289	32,971	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TESLA INC		395.14	438.7	49,879	5,674,819	自動車・自動車部品
STANLEY BLACK & DECKER INC		80.07	91.29	1,681	191,259	資本財
SYNOPSYS INC		78.69	78.69	2,800	318,594	ソフトウェア・サービス
SOUTHERN CO/THE		573.36	556.86	3,498	397,989	公益事業
SYSCO CORP		251.65	268.62	1,966	223,705	食品・生活必需品小売り
TRAVELERS COS INC/THE		131.26	131.26	2,000	227,585	保険
SIGNATURE BANK		25.08	—	—	—	銀行

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	株数	期末	株数	評価額		業種等
					外貨建金額	邦貨換算金額	
SCHLUMBERGER LTD		734.44		734.44	2,177	247,747	エネルギー
AT&T INC		3,819.17		3,854.89	9,209	1,047,745	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO		96.2		70.76	315	35,856	運輸
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		43.3		136.16	4,551	517,830	素材
SEMPRA ENERGY		153.04		163.53	2,031	231,071	公益事業
TIFFANY & CO		55.41		—	—	—	小売
SEAGATE TECHNOLOGY		126.34		—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TYLER TECHNOLOGIES INC		20.16		20.16	1,050	119,560	ソフトウェア・サービス
TEXAS INSTRUMENTS INC		493.45		498.76	9,694	1,102,988	半導体・半導体製造装置
SALESFORCE.COM INC		481.87		522.57	15,506	1,764,202	ソフトウェア・サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION		386.44		388.03	3,040	345,929	資本財
TERADYNE INC		85.42		85.42	1,319	150,098	半導体・半導体製造装置
UNION PACIFIC CORP		364.9		359.04	8,597	978,145	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP		816.34		820.39	6,804	774,126	資本財
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		379.28		391.13	8,004	910,624	運輸
DEXCOM INC		47.65		50.47	2,881	327,872	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION		124.54		147.6	1,255	142,886	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC		505.11		506.62	22,899	2,605,244	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC		52.27		52.27	1,277	145,374	ソフトウェア・サービス
VALERO ENERGY CORP		220.07		214.47	1,462	166,336	エネルギー
ULTA BEAUTY INC		27.65		27.65	1,109	126,276	小売
WALT DISNEY CO/THE		962.03		976.83	14,438	1,642,670	メディア・娯楽
WELLS FARGO & CO		2,103.54		2,228.62	10,955	1,246,452	銀行
INSULET CORP		34		34	1,005	114,447	ヘルスケア機器・サービス
WASTE MANAGEMENT INC		220.23		220.23	3,674	418,002	商業・専門サービス
WHIRLPOOL CORP		32.12		32.12	715	81,410	耐久消費財・アパレル
WALMART INC		759.45		833.65	11,890	1,352,765	食品・生活必需品小売り
WYNN RESORTS LTD		49.13		49.13	407	46,393	消費者サービス
TJX COMPANIES INC		649.28		638.82	4,514	513,619	小売
WATERS CORP		35.27		34.25	1,168	132,960	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WASTE CONNECTIONS INC		135.56		135.56	1,859	211,583	商業・専門サービス
WESTERN DIGITAL CORP		148.57		148.57	876	99,709	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEC ENERGY GROUP INC		164.38		164.38	1,487	169,229	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP		275.32		272.31	1,749	199,051	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES		901.86		908.92	17,841	2,029,792	ソフトウェア・サービス
PPL CORP		427.27		395.61	1,125	128,004	公益事業
PULTEGROUP INC		157.55		130.75	673	76,623	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC		122.56		122.56	1,928	219,417	素材
NORTHERN TRUST CORP		112.14		110.23	1,322	150,415	各種金融
NVIDIA CORP		328.93		1,335.64	44,578	5,071,675	半導体・半導体製造装置
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		225.26		231.68	4,653	529,484	銀行
TYSON FOODS INC-CL A		149.49		149.49	1,224	139,257	食品・飲料・タバコ
NETFLIX INC		235.71		238.52	15,833	1,801,424	メディア・娯楽
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		211.85		211.63	13,729	1,562,052	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBE LIFE INC		60.4		43.33	383	43,612	保険
TEXTRON INC		118.03		118.03	859	97,744	資本財
NEWS CORP - CLASS A		166.62		231.02	504	57,349	メディア・娯楽
OMNICOM GROUP		104.17		104.17	702	79,961	メディア・娯楽
ORACLE CORP		1,104.15		1,012.06	9,406	1,070,130	ソフトウェア・サービス
MASTERCARD INC - A		478.11		475.6	15,362	1,747,775	ソフトウェア・サービス
LUMEN TECHNOLOGIES INC		—		497.58	644	73,309	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC		56.03		56.57	2,723	309,879	資本財
YUM! BRANDS INC		155.49		155.49	1,947	221,568	消費者サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B		96.29		96.29	436	49,658	食品・飲料・タバコ
BANK OF AMERICA CORP		4,184.01		4,143.47	18,890	2,149,124	銀行
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		90.8		90.8	793	90,286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期		末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価	額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
AMERICAN EXPRESS CO		370.48	370.2	5,843	664,869	各種金融	
ANALOG DEVICES INC		192.98	292.73	5,362	610,127	半導体・半導体製造装置	
ADVANCED MICRO DEVICES		632.79	656.29	10,625	1,208,919	半導体・半導体製造装置	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP		447.45	447.45	2,458	279,730	保険	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		90.36	118.9	830	94,541	消費者サービス	
AVERY DENNISON CORP		48.32	42.32	912	103,772	素材	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		287.37	293.48	2,339	266,145	ソフトウェア・サービス	
EMERSON ELECTRIC CO		311.78	311.78	2,832	322,291	資本財	
AMGEN INC		316.21	311.56	6,339	721,223	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
EATON CORP PLC		212.53	213.26	3,569	406,107	資本財	
CONSTELLATION BRANDS INC-A		88.81	88.81	2,015	229,328	食品・飲料・タバコ	
APPLIED MATERIALS INC		482.6	496.83	7,513	854,761	半導体・半導体製造装置	
CME GROUP INC		187.12	187.12	4,216	479,696	各種金融	
ECOLAB INC		139.12	141.57	3,215	365,857	素材	
EQUIFAX INC		61.27	68.41	1,943	221,084	商業・専門サービス	
GILEAD SCIENCES INC		661.68	656.73	4,639	527,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
STATE STREET CORP		186.94	186.94	1,742	198,198	各種金融	
SCHWAB (CHARLES) CORP		828.87	773	6,191	704,433	各種金融	
BAXTER INTERNATIONAL INC		264.34	264.34	2,009	228,652	ヘルスケア機器・サービス	
CAMPBELL SOUP CO		106.38	106.38	438	49,863	食品・飲料・タバコ	
CROWN HOLDINGS INC		68.63	68.63	743	84,639	素材	
CARDINAL HEALTH INC		151.14	151.14	717	81,625	ヘルスケア機器・サービス	
FEDEX CORP		134.81	130.83	3,147	358,077	運輸	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		236.54	236.54	3,477	395,647	各種金融	
FMC CORP		66.76	66.76	691	78,641	素材	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		48.71	139.22	2,049	233,135	素材	
CITRIX SYSTEMS INC		64.9	64.9	534	60,819	ソフトウェア・サービス	
INTEL CORP		2,270.51	2,177.38	10,886	1,238,602	半導体・半導体製造装置	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		196.26	196.26	667	75,961	メディア・娯楽	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		183.31	183.31	1,257	143,087	保険	
ILLINOIS TOOL WORKS		166.9	168.69	4,016	456,977	資本財	
SIRIUS XM HOLDINGS INC		676.56	676.56	424	48,261	メディア・娯楽	
ILLUMINA INC		76.55	76.55	2,838	322,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHECK POINT SOFTWARE TECH		64.1	64	711	80,902	ソフトウェア・サービス	
SNAP-ON INC		31.57	31.06	661	75,204	資本財	
CARMAX INC		84.27	84.27	1,234	140,436	小売	
COMERICA INC		76.91	—	—	—	銀行	
DANAHER CORP		342.7	346.32	11,308	1,286,515	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DUKE ENERGY CORP		398.62	420.41	4,213	479,352	公益事業	
TARGET CORP		270.76	268.17	6,681	760,179	小売	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		69.27	69.27	1,011	115,131	商業・専門サービス	
CINTAS CORP		46.15	51.69	2,247	255,654	商業・専門サービス	
CONAGRA BRANDS INC		246.39	246.39	776	88,328	食品・飲料・タバコ	
CLOROX COMPANY		65.42	65.42	1,106	125,902	家庭用品・パーソナル用品	
ENTERGY CORP		108.66	108.66	1,141	129,890	公益事業	
MICROSOFT CORP		3,840.36	3,828.65	128,883	14,663,115	ソフトウェア・サービス	
INCYTE CORP		92.43	92.43	650	73,999	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CVS HEALTH CORP		706.17	693.53	6,381	726,064	ヘルスケア機器・サービス	
MEDTRONIC PLC		720.39	726.98	8,017	912,109	ヘルスケア機器・サービス	
MICRON TECHNOLOGY INC		595.08	612.23	5,273	599,994	半導体・半導体製造装置	
BLACKROCK INC		82.25	82.52	7,657	871,234	各種金融	
HASBRO INC		74.91	74.91	742	84,483	耐久消費財・アパレル	
KEYCORP		511.28	511.28	1,167	132,798	銀行	
KANSAS CITY SOUTHERN		51	48.66	1,441	163,972	運輸	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		772.58	751.11	4,554	518,191	食品・飲料・タバコ	
COOPER COS INC/THE		27.71	27.71	1,056	120,172	ヘルスケア機器・サービス	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期		末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価	額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
CHUBB LTD		245.03	245.24	4,537	516,279	保険	
ARROW ELECTRONICS INC		41.3	41.3	513	58,461	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ALLSTATE CORP		166.54	164.19	1,857	211,344	保険	
EBAY INC		366.68	355.51	2,508	285,349	小売	
EASTMAN CHEMICAL CO		70.27	70.27	774	88,084	素材	
XILINX INC		128.76	128.76	3,001	341,439	半導体・半導体製造装置	
DISH NETWORK CORP-A		129.37	129.37	428	48,762	メディア・娯楽	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		122.55	124	4,216	479,724	家庭用品・パーソナル用品	
TRIMBLE INC		127.59	127.59	1,104	125,606	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LENNAR CORP-A		144.94	144.94	1,554	176,853	耐久消費財・アパレル	
LEAR CORP		27.49	37.36	631	71,832	自動車・自動車部品	
STRYKER CORP		182.98	179.83	4,378	498,182	ヘルスケア機器・サービス	
AES CORP		336.56	336.56	794	90,441	公益事業	
PROGRESSIVE CORP		305.43	305.43	2,900	330,009	保険	
AIRBNB INC-CLASS A		—	65.54	1,180	134,276	消費者サービス	
ALLEGHANY CORP		6.89	6.89	457	52,106	保険	
ALTICE USA INC- A		180.72	96.67	154	17,586	メディア・娯楽	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC		35.39	35.39	488	55,619	保険	
AMPHENOL CORP-CL A		156.98	313.96	2,603	296,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ARAMARK		132.42	132.42	455	51,794	消費者サービス	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B		—	88.08	440	50,164	ソフトウェア・サービス	
ATMOS ENERGY CORP		69.65	69.65	653	74,327	公益事業	
AVALARA INC		43.19	43.19	616	70,118	ソフトウェア・サービス	
AVANTOR INC		256.06	304.28	1,210	137,710	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PACCAR INC		180.41	180.41	1,553	176,763	資本財	
BIO-TECHNE CORP		—	19.91	955	108,657	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CDK GLOBAL INC		58.08	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
CMS ENERGY CORP		140.4	169.96	1,038	118,203	公益事業	
CARLYLE GROUP INC/THE		93.41	100.94	573	65,228	各種金融	
CARRIER GLOBAL CORP		456.84	432.53	2,421	275,471	資本財	
CATALENT INC		89.35	89.35	1,196	136,175	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CENTERPOINT ENERGY INC		254.64	320.03	850	96,813	公益事業	
CENTURYLINK INC		497.58	—	—	—	電気通信サービス	
CERIDIAN HCM HOLDING INC		—	69.79	788	89,698	ソフトウェア・サービス	
CHEWY INC - CLASS A		—	39.69	272	31,003	小売	
CHURCH & DWIGHT CO INC		124.85	124.85	1,170	133,164	家庭用品・パーソナル用品	
CLOUDFLARE INC - CLASS A		—	126.73	2,421	275,514	ソフトウェア・サービス	
DEVON ENERGY CORP		—	361.96	1,589	180,863	エネルギー	
DOVER CORP		82.53	82.25	1,413	160,763	資本財	
DRAFTKINGS INC - CL A		—	167.42	589	67,046	消費者サービス	
DROPBOX INC-CLASS A		105.65	165.84	413	47,074	ソフトウェア・サービス	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC		208.11	208.11	628	71,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ESSENTIAL UTILITIES INC		138.81	139.09	673	76,652	公益事業	
FLIR SYSTEMS INC		68.67	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC		19.39	19.39	910	103,556	各種金融	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		43.71	43.71	930	105,912	ソフトウェア・サービス	
GARTNER INC		45.68	45.68	1,484	168,902	ソフトウェア・サービス	
WW GRAINGER INC		23.9	23.9	1,184	134,753	資本財	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC		47.31	47.31	560	63,765	ソフトウェア・サービス	
HD SUPPLY HOLDINGS INC		77.87	—	—	—	資本財	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		146.17	146.17	2,018	229,607	消費者サービス	
HUBSPOT INC		—	22.75	1,938	220,497	ソフトウェア・サービス	
IAC/INTERACTIVECORP		39.74	—	—	—	メディア・娯楽	
INTERNATIONAL PAPER CO		191.4	191.4	903	102,824	素材	
IONIS PHARMACEUTICALS INC		67.6	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KELLOGG CO		129.49	129.49	827	94,093	食品・飲料・タバコ	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期	末		業	種	等
		株数	株数	評価額	価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額			
LAMB WESTON HOLDINGS INC		74.17	74.17	395	44,967	食品・飲料・タバコ		
LIBERTY BROADBAND-A		13.12	13.12	205	23,336	メディア・娯楽		
LIBERTY BROADBAND-C		54.18	81.96	1,310	149,137	メディア・娯楽		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		76.48	76.48	380	43,270	メディア・娯楽		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		102.88	102.88	617	70,286	メディア・娯楽		
LYFT INC-A		—	131.45	549	62,542	運輸		
M & T BANK CORP		73.99	72.37	1,101	125,281	銀行		
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		12.58	12.58	1,932	219,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
MONGODB INC		26.59	31.55	1,659	188,797	ソフトウェア・サービス		
MOODY'S CORP		90.41	92.47	3,673	417,940	各種金融		
BIOGEN INC		85.16	79.87	1,885	214,548	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.		258.92	—	—	—	エネルギー		
OGE ENERGY CORP		118.7	—	—	—	公益事業		
NOVAVAX INC		—	36.01	698	79,462	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ONEOK INC		255.89	247.25	1,544	175,697	エネルギー		
OTIS WORLDWIDE CORP		211.11	211.11	1,764	200,742	資本財		
OWENS CORNING		52.05	52.05	453	51,596	資本財		
PPD INC		—	64.13	302	34,437	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A		—	820.71	1,729	196,735	ソフトウェア・サービス		
PINNACLE WEST CAPITAL		59.96	59.96	397	45,220	公益事業		
PINTEREST INC- CLASS A		210.89	285.63	1,157	131,739	メディア・娯楽		
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		64.26	96.39	969	110,287	各種金融		
ROKU INC		56.2	60.12	1,390	158,192	メディア・娯楽		
SAREPTA THERAPEUTICS INC		38.28	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
HENRY SCHEIN INC		75.59	75.59	557	63,441	ヘルスケア機器・サービス		
SEALED AIR CORP		78.95	78.95	506	57,665	素材		
SMITH (A.O.) CORP		71.57	71.57	578	65,840	資本財		
STEEL DYNAMICS INC		101.91	101.91	625	71,189	素材		
UNITY SOFTWARE INC		—	28.53	485	55,286	ソフトウェア・サービス		
10X GENOMICS INC-CLASS A		—	38.14	550	62,679	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
STARBUCKS CORP		629.62	638.21	7,066	804,001	消費者サービス		
TRADE DESK INC/THE -CLASS A		21.4	241	2,580	293,543	ソフトウェア・サービス		
TWITTER INC		407.95	407.95	1,867	212,476	メディア・娯楽		
UGI CORP		105.88	105.88	459	52,279	公益事業		
UBER TECHNOLOGIES INC		496.19	671.87	2,667	303,461	運輸		
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		47.18	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス		
VOYA FINANCIAL INC		73.08	73.08	454	51,756	各種金融		
WAYFAIR INC- CLASS A		32.66	37.56	1,004	114,312	小売		
WESTROCK CO		130.34	130.34	601	68,390	素材		
PTC INC		54.62	54.62	602	68,554	ソフトウェア・サービス		
WILLIAMS COS INC		648.02	648.02	1,815	206,504	エネルギー		
PERRIGO CO PLC		61.87	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ZILLOW GROUP INC - A		—	31.54	170	19,434	不動産		
ZILLOW GROUP INC - C		79.06	79.06	428	48,805	不動産		
ZIONS BANCORP NA		88.74	—	—	—	銀行		
BOSTON BEER COMPANY INC-A		—	4.67	206	23,503	食品・飲料・タバコ		
OAK STREET HEALTH INC		—	62.12	190	21,675	ヘルスケア機器・サービス		
INTUIT INC		140.94	147.65	10,256	1,166,899	ソフトウェア・サービス		
BORGWARNER INC		120.75	120.75	541	61,558	自動車・自動車部品		
BEST BUY CO INC		121.32	121.32	1,346	153,139	小売		
BALL CORP		181.03	171.66	1,627	185,161	素材		
BOSTON SCIENTIFIC CORP		745.56	745.56	2,877	327,329	ヘルスケア機器・サービス		
VULCAN MATERIALS CO		66.98	75.55	1,506	171,347	素材		
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		135.3	135.3	2,572	292,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
VF CORP		171.17	171.17	1,262	143,581	耐久消費財・アパレル		
VIACOMCBS INC - CLASS B		323.28	323.81	1,045	118,919	メディア・娯楽		

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期	末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
MOHAWK INDUSTRIES INC		28.63	28.63	499	56,799	耐久消費財・アパレル
CARNIVAL CORP		222.89	481.56	874	99,493	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A		2,440.57	2,468.63	12,720	1,447,251	メディア・娯楽
APTIV PLC		141.47	141.47	2,341	266,356	自動車・自動車部品
STERIS PLC		42.87	52.82	1,197	136,225	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC		68.23	68.23	1,571	178,840	保険
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE		126.11	122.53	634	72,238	食品・飲料・タバコ
LINDE PLC		282.34	280.91	9,009	1,025,057	素材
ROYALTY PHARMA PLC- CL A		—	74.31	307	34,949	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NIELSEN HOLDINGS PLC		180.26	—	—	—	商業・専門サービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		76	76	440	50,063	資本財
NXP SEMICONDUCTORS NV		144.57	144.57	3,237	368,330	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV		69.05	—	—	—	資本財
SEA LTD-ADR		—	37.25	1,109	126,273	メディア・娯楽
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		115	115	671	76,368	資本財
TELEFLEX INC		23.4	23.4	722	82,249	ヘルスケア機器・サービス
WIX.COM LTD		27.03	31.94	509	57,912	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL		20.55	20.55	363	41,372	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC		47.64	47.64	613	69,744	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD		204.76	204.76	854	97,212	保険
TRANE TECHNOLOGIES PLC		127.59	127.59	2,461	280,055	資本財
NOVOCURE LTD		—	45.17	421	47,972	ヘルスケア機器・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS		—	118	1,227	139,699	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		26.04	26.04	318	36,264	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIGENE LTD-ADR		22.91	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DAIRY FARM INTL HLDGS-900		135	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		523	523	290	33,082	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		106	—	—	—	資本財
AMCOR PLC		823.02	823.02	953	108,429	素材
AON PLC-CLASS A		120.05	120.05	3,561	405,221	保険
IHS MARKIT LTD		195.84	195.84	2,548	289,938	商業・専門サービス
INVESCO LTD		183.28	183.28	425	48,459	各種金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR		—	31.59	159	18,146	各種金融
CLARIVATE PLC		—	199.39	455	51,788	商業・専門サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	165,675.25 591銘柄	168,148.91 598銘柄	2,202,902 —	250,624,236 <70.8%>	
(カナダ)				千カナダ・ドル		
IMPERIAL OIL LTD		129.99	129.99	557	49,718	エネルギー
METRO INC/CN		131.09	131.09	814	72,722	食品・生活必需品小売り
HYDRO ONE LTD		150.52	188.21	585	52,280	公益事業
TECK RESOURCES LTD-CLS B		248.14	248.14	840	75,062	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC		—	170.08	332	29,709	資本財
WEST FRASER TIMBER CO LTD		—	44.38	473	42,279	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC		10.26	10.26	2,262	201,964	ソフトウェア・サービス
WSP GLOBAL INC		61.41	61.41	1,116	99,674	資本財
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		156.18	133.85	681	60,836	素材
ATCO LTD -CLASS I		30.3	30.3	128	11,505	公益事業
AIR CANADA		57.37	120.83	257	22,972	運輸
NUTRIEN LTD		298.98	298.98	2,608	232,870	素材
QUEBECOR INC -CL B		99.53	99.53	288	25,763	メディア・娯楽
ALGONQUIN POWER & UTILITIES		313.59	313.59	550	49,096	公益事業
LUNDIN MINING CORP		282.09	464.46	483	43,198	素材
ALTAS LTD		173.47	173.47	432	38,616	公益事業
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		241.17	243.35	1,312	117,187	素材
INTACT FINANCIAL CORP		70.58	100.95	1,628	145,398	保険
BCE INC		83.79	55.09	357	31,893	電気通信サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期		末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価	額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
FRANCO-NEVADA CORP		101.65	101.65	1,829	163,282	素材	
SUNCOR ENERGY INC		786.42	786.42	2,512	224,275	エネルギー	
NATIONAL BANK OF CANADA		169.93	169.93	1,731	154,515	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA		633.07	633.07	5,155	460,143	銀行	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		235.13	235.13	3,423	305,559	銀行	
TORONTO-DOMINION BANK		966.93	984.88	9,217	822,753	銀行	
ROYAL BANK OF CANADA		767.31	770.35	9,993	892,042	銀行	
TC ENERGY CORP		504.73	539.18	3,290	293,672	エネルギー	
BARRICK GOLD CORP		930.98	930.98	2,274	203,011	素材	
THOMSON REUTERS CORP		101.22	97.1	1,514	135,207	商業・専門サービス	
EMPIRE CO LTD 'A'		91.48	91.48	339	30,302	食品・生活必需品小売り	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		201.36	182.36	1,052	93,953	電気通信サービス	
AGNICO EAGLE MINES LTD		138.08	134.47	868	77,538	素材	
KINROSS GOLD CORP		635.01	635.01	488	43,644	素材	
BANK OF MONTREAL		330.57	354.24	4,853	433,218	銀行	
CAMECO CORP		266.96	188.9	601	53,669	エネルギー	
TELUS CORP		152.22	152.22	448	40,068	電気通信サービス	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		35.7	30.01	522	46,622	小売	
IVANHOE MINES LTD-CL A		—	326.98	337	30,149	素材	
CANADIAN NATURAL RESOURCES		648.7	643.74	3,439	307,010	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		13.93	13.93	789	70,467	保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC		143.64	163.31	1,639	146,309	自動車・自動車部品	
WESTON (GEORGE) LTD		42.81	35.78	488	43,587	食品・生活必需品小売り	
PAN AMERICAN SILVER CORP		117.63	117.63	383	34,249	素材	
BLACKBERRY LTD		259.93	259.93	326	29,140	ソフトウェア・サービス	
ENBRIDGE INC	1,101.69	1,077.03	5,249	468,565	エネルギー		
MANULIFE FINANCIAL CORP	998.1	998.1	2,387	213,104	保険		
BAUSCH HEALTH COS INC	193.8	164.47	522	46,669	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	71.15	347.38	3,176	283,529	運輸		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	90.66	90.66	483	43,115	耐久消費財・アパレル		
CGI INC	128.82	114.93	1,234	110,208	ソフトウェア・サービス		
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	272.32	272.32	1,014	90,520	メディア・娯楽		
IGM FINANCIAL INC	64.33	49.49	241	21,588	各種金融		
CI FINANCIAL CORP	110.41	—	—	—	各種金融		
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	316.72	316.72	889	79,355	素材		
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	459.24	442.7	2,103	187,737	食品・生活必需品小売り		
YAMANA GOLD INC	535.88	535.88	276	24,681	素材		
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	56.67	56.67	502	44,847	商業・専門サービス		
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	730.84	694.48	5,130	457,914	各種金融		
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	63.36	302	26,988	公益事業		
B2GOLD CORP	656.5	429.63	219	19,634	素材		
CAE INC	128.91	128.91	406	36,291	資本財		
CCL INDUSTRIES INC - CL B	65.63	87.05	552	49,308	素材		
CANADIAN NATL RAILWAY CO	378.75	386.87	6,335	565,496	運輸		
CANADIAN UTILITIES LTD-A	73.44	73.44	259	23,140	公益事業		
CANOPY GROWTH CORP	112.51	112.51	158	14,150	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
CENOVUS ENERGY INC	540.18	750.6	1,190	106,259	エネルギー		
CRONOS GROUP INC	80.26	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
DOLLARAMA INC	170.25	170.25	960	85,723	小売		
EMERA INC	142.79	142.79	847	75,644	公益事業		
FIRSTSERVICE CORP	—	25.16	636	56,836	不動産		
FORTIS INC	241.71	241.71	1,352	120,733	公益事業		
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	—	99.13	507	45,285	商業・専門サービス		
GREAT-WEST LIFE CO INC	142	142	531	47,467	保険		
IA FINANCIAL CORP INC	48.51	48.51	338	30,258	保険		
INTER PIPELINE LTD	193.94	—	—	—	エネルギー		

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	株数	期末		業種等
				評価額	外貨建金額 邦貨換算金額	
KEYERA CORP	113.74	113.74	327	29,228	エネルギー	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	63.63	433	38,712	ソフトウェア・サービス	
LOBLAW COMPANIES LTD	86.83	86.83	841	75,070	食品・生活必需品小売り	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	—	30.84	378	33,812	ソフトウェア・サービス	
NORTHLAND POWER INC	—	108.7	422	37,684	公益事業	
ONEX CORPORATION	42.17	42.17	403	35,988	各種金融	
OPEN TEXT CORP	136.65	136.65	847	75,672	ソフトウェア・サービス	
PARKLAND CORP	76.66	76.66	261	23,381	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	274.11	321.72	1,240	110,702	エネルギー	
POWER CORP OF CANADA	332.78	317.68	1,328	118,613	保険	
RESTAURANT BRANDS INTERN	145.1	145.1	1,058	94,495	消費者サービス	
SSR MINING INC	115.52	—	—	—	素材	
SAPUTO INC	134.25	134.25	389	34,727	食品・飲料・タバコ	
SHOPIFY INC - CLASS A	58.05	60.82	12,164	1,085,758	ソフトウェア・サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	324.94	305.5	2,097	187,255	保険	
TMX GROUP LTD	31.42	31.42	404	36,069	各種金融	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	38.43	426	38,055	資本財	
小計	株数	金額	20,792.08	21,673.53	134,073	11,967,436
銘柄数	82銘柄	88銘柄	—	—	—	< 3.4% >
(オーストラリア)						
AURIZON HOLDINGS LTD	944.4	944.4	322	26,178	運輸	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	57.83	57.83	188	15,339	各種金融	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	385.84	658.44	636	51,704	素材	
BHP GROUP LTD	1,595.2	1,575.18	6,075	493,874	素材	
REA GROUP LTD	28.33	28.33	456	37,077	メディア・娯楽	
AUSNET SERVICES	852.2	1,377.72	347	28,222	公益事業	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	37.94	493	40,146	消費者サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287.24	1,287.24	432	35,158	保険	
CIMIC GROUP LTD	40.62	—	—	—	資本財	
SOUTH32 LTD	3,006.71	2,763.48	986	80,197	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	503.54	503.54	1,069	86,941	エネルギー	
WISETECH GLOBAL LTD	79.09	79.09	409	33,309	ソフトウェア・サービス	
XERO LTD	—	74.59	1,053	85,621	ソフトウェア・サービス	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	52.94	140.25	436	35,468	エネルギー	
AFTERPAY LTD	115.68	114.91	1,270	103,265	ソフトウェア・サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	921.05	884.48	1,556	126,542	素材	
COLES GROUP LTD	664.43	735.52	1,326	107,802	食品・生活必需品小売り	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	—	656.07	449	36,532	食品・生活必需品小売り	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,666.95	1,731.85	4,710	382,927	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	1,975.23	2,017.31	4,220	343,061	銀行	
SANTOS LTD	845.86	1,003.76	641	52,139	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,480.02	1,480.02	3,939	320,267	銀行	
RIO TINTO LTD	193.36	193.36	1,844	149,936	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	1,094.48	880.6	433	35,219	公益事業	
EVOLUTION MINING LTD	844.2	844.2	347	28,273	素材	
OIL SEARCH LTD	1,056.18	1,056.18	412	33,570	エネルギー	
SEEK LTD	181.86	172.66	592	48,141	メディア・娯楽	
AGL ENERGY LTD	324.92	324.92	173	14,077	公益事業	
TREASURY WINE ESTATES LTD	364.64	364.64	434	35,332	食品・飲料・タバコ	
NEWCREST MINING LTD	421.31	421.31	1,018	82,812	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	949.46	960.41	9,006	732,156	銀行	
AMPOL LTD	133.86	109.27	316	25,697	エネルギー	
ORICA LTD	179.81	179.81	258	21,018	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	855.23	808.63	938	76,250	保険	
WOOLWORTHS GROUP LTD	680.13	656.07	2,630	213,861	食品・生活必需品小売り	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	343.39	—	—	—	食品・飲料・タバコ	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄		株数	期首(前期末)	期末		業種等
			株数	評価額	外貨建金額	
TABCORP HOLDINGS LTD		1,308.04	1,128.17	562	45,762	消費者サービス
CROWN RESORTS LTD		218.63	218.63	242	19,727	消費者サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		458.31	458.31	224	18,255	運輸
TELSTRA CORP LTD		2,169.43	2,169.43	867	70,541	電気通信サービス
AMP LTD		2,235.04	—	—	—	各種金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		247.13	261.08	1,434	116,579	素材
MACQUARIE GROUP LTD		173.36	189.53	3,677	298,909	各種金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		307.49	307.49	1,371	111,456	消費者サービス
CSL LTD		241.83	247.47	7,597	617,586	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESFARMERS LTD		596.74	606.28	3,529	286,885	小売
COCHLEAR LTD		37.98	33.68	763	62,058	ヘルスケア機器・サービス
BLUESCOPE STEEL LTD		230.89	254.62	517	42,079	素材
SUNCORP GROUP LTD		639.33	639.33	680	55,349	保険
ASX LTD		111.8	111.8	1,017	82,720	各種金融
COMPUTERSHARE LTD		279.67	335.63	642	52,220	ソフトウェア・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		1,171.87	1,171.87	512	41,629	保険
SONIC HEALTHCARE LTD		210.81	242.58	1,035	84,201	ヘルスケア機器・サービス
BRAMBLES LTD		837.26	746.38	753	61,279	商業・専門サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD		94.46	94.46	625	50,832	ヘルスケア機器・サービス
TPG TELECOM LTD		177.58	—	—	—	電気通信サービス
REECE LTD		—	193.09	452	36,823	資本財
小計	株数・金額 銘柄数・比率	35,873.64 53銘柄	34,533.84 53銘柄	75,938 —	6,173,027 〈1.7%〉	
(香港)				千香港・ドル		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		715	715	3,417	49,864	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		1,180	1,180	5,150	75,148	消費者サービス
MTR CORP		845	845	3,549	51,779	運輸
SUN HUNG KAI PROPERTIES		680	680	6,579	95,987	不動産
SINO LAND CO		2,242	2,482	2,395	34,944	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		270	270	1,189	17,352	不動産
CLP HOLDINGS LTD		851	851	6,535	95,355	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		833.84	833.84	2,755	40,207	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		5,775.14	6,063.89	7,179	104,751	公益事業
HANG SENG BANK LTD		388	388	5,466	79,762	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT		848.33	848.33	2,680	39,111	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		1,509.24	1,539.24	7,773	113,410	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD		1,399.24	1,029.24	4,662	68,025	不動産
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		629	629	27,990	408,381	各種金融
WH GROUP LTD		5,345	5,815	2,965	43,268	食品・飲料・タバコ
HANG LUNG PROPERTIES LTD		980	980	1,568	22,877	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		193	—	—	—	半導体・半導体製造装置
KERRY PROPERTIES LTD		275	—	—	—	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		872.2	—	—	—	銀行
MICROPORT SCIENTIFIC CORP		460	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		—	940	1,821	26,578	資本財
SJM HOLDINGS LTD		800	800	446	6,512	消費者サービス
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		896	896	1,809	26,406	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		1,020	910	3,662	53,439	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD		530	530	1,028	15,001	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		300	300	1,395	20,353	公益事業
PCCW LTD		2,560	—	—	—	電気通信サービス
AIA GROUP LTD		6,482	6,540	54,870	800,562	保険
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		—	700	2,016	29,413	運輸
SANDS CHINA LTD		1,160	1,160	2,166	31,614	消費者サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		—	1,170	1,703	24,854	小売
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		705	705	11,611	169,409	資本財

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	株数	期末		業種等
				評価額	価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,875	1,875	1,875	4,500	65,655	銀行
WYNN MACAU LTD	708	708	708	509	7,427	消費者サービス
ESR CAYMAN LTD	—	1,020	1,020	2,636	38,469	不動産
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	43,326.99 31銘柄	43,403.54 30銘柄	182,037 —	2,655,927 <0.8%>	
(シンガポール)				千シンガポール・ドル		
UNITED OVERSEAS BANK LTD	645	647	647	1,716	142,829	銀行
YANGZIJANG SHIPBUILDING	663	—	—	—	—	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD	950	966	966	2,974	247,492	銀行
SINGAPORE AIRLINES LTD	779.66	779.66	779.66	382	31,853	運輸
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	—	1,366	1,366	460	38,305	不動産
KEPPEL CORP LTD	699	547	547	284	23,713	資本財
UOL GROUP LTD	217	172	172	118	9,832	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	258	258	258	180	15,027	不動産
CAPITALAND LTD	1,366	—	—	—	—	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	51	—	—	—	—	小売
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,834	1,812	1,812	2,054	170,980	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	3,275	3,275	3,275	258	21,528	消費者サービス
VENTURE CORP LTD	115	87	87	163	13,617	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,655.15	4,398.15	4,398.15	1,059	88,198	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	991	1,086	1,086	417	34,700	資本財
SINGAPORE EXCHANGE LTD	428	428	428	395	32,871	各種金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,032	1,032	1,032	432	35,980	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,958.81 16銘柄	16,853.81 14銘柄	10,899 —	906,932 <0.3%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランド・ドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	897.12	1,114.59	1,114.59	485	37,633	電気通信サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	677.01	884.45	884.45	397	30,788	公益事業
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	707.11	707.11	707.11	550	42,679	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	286.78	312.5	312.5	1,031	79,952	ヘルスケア機器・サービス
RYMAN HEALTHCARE LTD	240.38	240.28	240.28	290	22,540	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	374.22	347.17	347.17	215	16,687	食品・飲料・タバコ
MERCURY NZ LTD	467.71	269.13	269.13	157	12,206	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,650.33 7銘柄	3,875.23 7銘柄	3,127 —	242,489 <0.1%>	
(イギリス)				千イギリス・ポンド		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	632.89	632.89	632.89	169	25,630	保険
BP PLC	10,572.5	10,791.42	10,791.42	3,536	535,968	エネルギー
ASHTED GROUP PLC	236.86	236.86	236.86	1,451	220,057	資本財
UNILEVER PLC	1,399.23	1,418.43	1,418.43	5,561	842,925	家庭用品・パーソナル用品
NMC HEALTH PLC	39.4	39.4	39.4	0	5	ヘルスケア機器・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	288.6	288.6	288.6	329	49,929	小売
BHP GROUP PLC	1,101.6	1,164.84	1,164.84	2,351	356,440	素材
AUTO TRADER GROUP PLC	439.54	439.54	439.54	321	48,790	メディア・娯楽
AVEVA GROUP PLC	35.27	60.37	60.37	194	29,461	ソフトウェア・サービス
BARCLAYS PLC	9,047.41	9,047.41	9,047.41	1,657	251,208	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,951.88	4,941.44	4,941.44	605	91,743	資本財
PRUDENTIAL PLC	1,401.78	1,434.05	1,434.05	1,856	281,352	保険
NATWEST GROUP PLC	2,452.44	3,162.87	3,162.87	665	100,858	銀行
EVRAZ PLC	282.75	282.75	282.75	161	24,512	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	100.74	100.74	100.74	214	32,566	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,781.01	1,657.53	1,657.53	911	138,118	資本財
AVIVA PLC	1,986.01	1,986.01	1,986.01	751	113,838	保険
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,708.24	2,665.28	2,665.28	4,064	616,023	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RELX PLC	1,009.74	1,062.84	1,062.84	2,490	377,419	商業・専門サービス
DIAGEO PLC	1,222.34	1,268.68	1,268.68	4,850	735,186	食品・飲料・タバコ

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期	末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
RIO TINTO PLC		608.69	611.3	2,825	428,175	素材
STANDARD CHARTERED PLC		1,465.61	1,465.61	607	92,005	銀行
TESCO PLC		—	3,999.3	1,115	169,111	食品・生活必需品小売り
PEARSON PLC		396.23	396.23	243	36,908	メディア・娯楽
NEXT PLC		68.6	68.6	546	82,781	小売
TAYLOR WIMPEY PLC		2,304.98	2,255.88	350	53,165	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC		170.64	170.64	489	74,146	資本財
VODAFONE GROUP PLC		14,408.41	15,460.57	1,702	257,986	電気通信サービス
KINGFISHER PLC		1,096.78	1,096.78	357	54,190	小売
WPP PLC		639.87	639.87	678	102,845	メディア・娯楽
UNITED UTILITIES GROUP PLC		332.07	332.07	361	54,782	公益事業
SEVERN TRENT PLC		124.18	124.18	360	54,711	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC		905.52	905.52	560	84,897	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		386.01	373.85	2,304	349,256	家庭用品・パーソナル用品
SSE PLC		558.79	558.79	870	131,947	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		466.94	647.66	448	68,004	耐久消費財・アパレル
ASTRAZENECA PLC		703.4	835.63	6,991	1,059,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		3,405.4	3,136.37	893	135,426	保険
3I GROUP PLC		493.38	493.38	684	103,790	各種金融
SAGE GROUP PLC/THE		559.87	559.87	435	65,931	ソフトウェア・サービス
NATIONAL GRID PLC		1,925.47	1,918.51	1,920	291,118	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		37,565.26	38,170.21	1,786	270,741	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		500.03	500.03	781	118,451	食品・飲料・タバコ
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		71.87	66.37	287	43,505	耐久消費財・アパレル
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,238.72	1,143.93	2,923	443,144	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC		10,767.78	11,079.75	4,613	699,238	銀行
ANGLO AMERICAN PLC		669.08	669.35	1,796	272,232	素材
COMPASS GROUP PLC		930.18	930.18	1,415	214,568	消費者サービス
PERSIMMON PLC		169.16	169.16	466	70,734	耐久消費財・アパレル
SAINSBURY (J) PLC		1,128.14	1,134.8	328	49,825	食品・生活必需品小売り
BT GROUP PLC		4,699.07	4,699.07	767	116,372	電気通信サービス
BURBERRY GROUP PLC		230.66	190.12	341	51,722	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC		443.55	443.55	550	83,358	ヘルスケア機器・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		174.88	177.16	1,217	184,462	各種金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		2,204.08	2,192.98	3,497	530,060	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		2,020.83	1,991.91	3,175	481,218	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		75.81	75.81	169	25,622	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADMIRAL GROUP PLC		115.35	115.35	347	52,674	保険
ANTOFAGASTA PLC		194.39	194.39	271	41,187	素材
ABRDN PLC		1,232.63	1,232.63	290	44,051	各種金融
EXPERIAN PLC		488.95	488.95	1,654	250,698	商業・専門サービス
TESCO PLC		5,065.78	—	—	—	食品・生活必需品小売り
SCHRODERS PLC		62.13	62.13	218	33,117	各種金融
HALMA PLC		198.39	198.39	600	91,075	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WM MORRISON SUPERMARKETS		1,462.35	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		167.71	167.71	319	48,472	食品・飲料・タバコ
ST JAMES'S PLACE PLC		261.57	261.57	408	61,943	各種金融
INTERTEK GROUP PLC		81.84	81.84	448	67,972	商業・専門サービス
MONDI PLC		251.28	251.28	439	66,570	素材
WHITBREAD PLC		112.82	112.82	324	49,159	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC		195.72	195.72	262	39,793	各種金融
SMITHS GROUP PLC		241.68	243.69	354	53,775	資本財
OCADO GROUP PLC		221.77	273.79	502	76,102	食品・生活必需品小売り
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		—	368.51	237	35,968	保険
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		103.34	95.87	441	66,838	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		66.26	78.38	788	119,564	素材

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)		期末		業	種	等
		株	数	株	数			
				外貨建金額	邦貨換算金額			
M&G PLC		1,330.64	1,330.64	253	38,378	各種金融		
RSA INSURANCE GROUP LTD		522.95	—	—	—	保険		
INFORMA PLC		781.52	781.52	370	56,143	メディア・娯楽		
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		36.85	36.85	583	88,466	資本財		
MELROSE INDUSTRIES PLC		2,463.49	2,217.14	323	49,060	資本財		
GLENCORE PLC		5,380.15	5,395.65	1,926	292,023	素材		
COCA-COLA HBC AG-DI		87.04	87.04	204	31,040	食品・飲料・タバコ		
DCC PLC		59.54	59.54	335	50,840	資本財		
ENTAIN PLC		288.65	288.65	503	76,383	消費者サービス		
FERGUSON PLC		125.13	120.17	1,388	210,450	資本財		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	157,200.09	157,107.16	94,813	14,369,899			
		84銘柄	83銘柄	—	< 4.1 %>			
(イスラエル)				キスラエル・シュケル				
BANK HAPOLIM BM		664.03	664.03	2,041	73,507	銀行		
BANK LEUMI LE-ISRAEL		701.5	701.5	2,177	78,412	銀行		
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		546.74	546.74	1,079	38,885	銀行		
NICE LTD		32.51	32.51	2,876	103,573	ソフトウェア・サービス		
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		92.49	92.49	1,083	39,002	銀行		
AZRIELI GROUP LTD		21.4	21.4	622	22,417	不動産		
ICL GROUP LTD		287.11	287.11	818	29,487	素材		
ELBIT SYSTEMS LTD		13.89	13.89	654	23,559	資本財		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,359.67	2,359.67	11,353	408,845			
		8銘柄	8銘柄	—	< 0.1 %>			
(スイス)				千スイス・フラン				
UBS GROUP AG-REG		1,911.89	1,911.89	3,012	371,251	各種金融		
JULIUS BAER GROUP LTD		124	125.5	717	88,445	各種金融		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		21.32	21.32	512	63,143	資本財		
HOLCIM LTD		272.39	272.39	1,238	152,685	素材		
SWISS PRIME SITE-REG		39.06	39.06	346	42,653	不動産		
VIFOR PHARMA AG		26.38	26.38	277	34,204	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.59	0.59	668	82,388	食品・飲料・タバコ		
ADECCO GROUP AG-REG		87.86	91.18	398	49,154	商業・専門サービス		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.05	0.05	561	69,204	食品・飲料・タバコ		
PARTNERS GROUP HOLDING AG		9.73	12.03	1,894	233,524	各種金融		
SCHINDLER HOLDING AG-REG		9.41	9.41	220	27,138	資本財		
SIKA AG-REG		73.99	78	2,836	349,642	素材		
ALCON INC		265.85	265.85	1,942	239,454	ヘルスケア機器・サービス		
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		15.7	15.7	111	13,699	銀行		
ROCHE HOLDING AG-BR		—	19.21	735	90,680	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SWATCH GROUP AG/THE-REG		25.16	25.16	133	16,450	耐久消費財・アパレル		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN		374.19	377.96	13,512	1,665,362	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ABB LTD-REG		981.55	908.36	2,901	357,585	資本財		
SWISS RE AG		151.68	151.68	1,314	162,007	保険		
NESTLE SA-REG		1,590.99	1,547.36	18,583	2,290,452	食品・飲料・タバコ		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		1,267.13	1,454.88	1,289	158,979	各種金融		
SGS SA-REG		3.08	3.08	876	108,037	商業・専門サービス		
SWATCH GROUP AG/THE-BR		16.92	17.16	468	57,780	耐久消費財・アパレル		
BALOISE HOLDING AG - REG		24.75	24.75	342	42,187	保険		
CLARIANT AG-REG		101.01	101.01	182	22,546	素材		
NOVARTIS AG-REG		1,182.57	1,195.88	8,878	1,094,239	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		278.55	283.58	3,938	485,472	耐久消費財・アパレル		
SWISSCOM AG-REG		13.99	13.99	718	88,523	電気通信サービス		
GIVAUDAN-REG		4.84	4.84	2,189	269,870	素材		
ZURICH INSURANCE GROUP AG		82.02	80.94	3,090	380,878	保険		
STRAUMANN HOLDING AG-REG		6.02	5.31	1,032	127,291	ヘルスケア機器・サービス		
SONOVA HOLDING AG-REG		26.6	26.6	915	112,844	ヘルスケア機器・サービス		

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	金額	期首(前期末)	期末	業種等
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	96.24	81.5	614	75,778	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG-REG	39.84	39.84	2,909	358,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEMENOS AG - REG	31.31	37.43	454	55,958	ソフトウェア・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	17.35	18.34	962	118,580	保険
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	30.3	29.81	793	97,767	運輸
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.44	1.83	404	49,845	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5.14	3.56	316	39,050	素材
GEBERIT AG-REG	19.86	19.86	1,386	170,852	資本財
小計	株数 銘柄数	金額 比率	9,230.75 39銘柄	9,343.27 40銘柄	83,685 10,314,264 — 〈2.9%〉
(デンマーク)					
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.68	1.68	3,111	53,733	運輸
PANDORA A/S	47.63	47.63	4,015	69,342	耐久消費財・アパレル
ORSTED A/S	103.45	95.55	8,085	139,635	公益事業
NOVO NORDISK A/S-B	922.02	908.61	65,029	1,123,054	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHR HANSEN HOLDING A/S	55.09	55.09	2,710	46,818	素材
DANSKE BANK A/S	401.89	391.03	4,289	74,081	銀行
H LUNDBECK A/S	28.96	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	524.4	11,615	200,598	資本財
GN STORE NORD A/S	72.99	64.84	2,500	43,178	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG AS-B	55.85	55.85	5,936	102,529	食品・飲料・タバコ
NOVOZYMES A/S-B SHARES	115.12	115.12	5,624	97,139	素材
COLOPLAST-B	66.38	63.99	6,875	118,743	ヘルスケア機器・サービス
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	3.49	3.11	6,114	105,593	運輸
TRYG A/S	57.52	169.89	2,688	46,430	保険
GENMAB A/S	33.17	36.88	9,404	162,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	—	5.13	1,407	24,301	資本財
DSV A/S	108.73	109.5	15,631	269,949	運輸
AMBU A/S-B	83.56	83.56	1,595	27,562	ヘルスケア機器・サービス
DEMANT A/S	44.55	44.55	1,401	24,204	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	104.88	—	—	—	資本財
小計	株数 銘柄数	金額 比率	2,306.96 18銘柄	2,776.41 18銘柄	158,037 2,729,313 — 〈0.8%〉
(ノルウェー)					
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	135.96	114.12	2,365	29,831	保険
NORSK HYDRO ASA	643.44	832.94	5,039	63,545	素材
DNB BANK ASA	—	459.57	9,274	116,946	銀行
DNB ASA	490.48	—	—	—	銀行
ORKLA ASA	434.56	469.55	3,948	49,795	食品・飲料・タバコ
TELENOR ASA	374.98	349.37	4,817	60,752	電気通信サービス
EQUINOR ASA	518.71	518.71	11,782	148,577	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	90.05	90.05	4,010	50,576	素材
MOWI ASA	222.42	233.18	4,906	61,866	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-CL A	—	33.38	1,369	17,274	メディア・娯楽
ADEVINTA ASA	141.86	155.4	2,050	25,856	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS	54.8	54.8	1,961	24,738	メディア・娯楽
小計	株数 銘柄数	金額 比率	3,107.26 10銘柄	3,311.07 11銘柄	51,527 649,762 — 〈0.2%〉
(スウェーデン)					
SWEDBANK AB - A SHARES	459.21	459.21	8,429	105,618	銀行
ERICSSON LM-B SHS	1,615.17	1,596.85	14,981	187,720	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VOLVO AB-B SHS	800.3	803.38	15,932	199,635	資本財
ICA GRUPPEN AB	56.14	56.14	2,998	37,577	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	109.3	106.42	2,889	36,202	各種金融
LUNDBERGS AB-B SHS	33.68	33.68	1,710	21,429	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B	327.01	299.42	8,755	109,700	家庭用品・パーソナル用品

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期	末		業	種	等
		株数	株数	評価額	価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額					
EPIROC AB-A	—	342.3	7,468	93,586	資本財			
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	49.51	82.23	2,811	35,227	資本財			
KINNEVIK AB - B	—	124.65	4,095	51,315	各種金融			
INDUSTRI VARDEN AB-A SHS	—	98.51	2,709	33,944	各種金融			
SKF AB-B SHARES	206.07	206.07	4,333	54,300	資本財			
ELECTROLUX AB-B	150.98	115.55	2,353	29,492	耐久消費財・アパレル			
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	428.37	401.48	6,528	81,806	小売			
NORDEA BANK ABP	1,679.42	1,679.42	18,010	225,666	銀行			
SWEDISH MATCH AB	—	846.4	5,669	71,034	食品・飲料・タバコ			
TELE2 AB-B SHS	255.37	255.37	3,349	41,965	電気通信サービス			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	883.17	883.17	11,613	145,519	銀行			
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	776.68	776.68	7,482	93,756	銀行			
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	343.7	343.7	5,179	64,899	素材			
SKANSKA AB-B SHS	208.21	171.83	3,613	45,278	資本財			
SANDVIK AB	610.7	610.7	14,009	175,538	資本財			
INVESTOR AB-B SHS	—	1,012.75	21,455	268,832	各種金融			
ATLAS COPCO AB-A SHS	344.34	373.42	20,821	260,898	資本財			
SECURITAS AB-B SHS	161.23	161.23	2,143	26,858	商業・専門サービス			
TELIA CO AB	1,280.45	1,434.04	5,072	63,563	電気通信サービス			
ALFA LAVAL AB	139.39	186.97	6,760	84,713	資本財			
ATLAS COPCO AB-B SHS	197.87	197.87	9,404	117,841	資本財			
ASSA ABLOY AB-B	521.19	521.19	13,498	169,140	資本財			
BOLIDEN AB	—	130.86	4,009	50,239	素材			
HUSQVARNA AB-B SHS	185.93	185.93	2,444	30,623	資本財			
HEXAGON AB-B SHS	—	1,031.1	13,765	172,477	テクノロジー・ハードウェアおよび機器			
LUNDIN ENERGY AB	85.81	85.81	2,906	36,417	エネルギー			
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	53.23	3,645	45,674	不動産			
SWEDISH MATCH AB	84.64	—	—	—	食品・飲料・タバコ			
EPIROC AB-B	251.32	—	—	—	資本財			
EQT AB	156.14	154.43	8,206	102,826	各種金融			
EVOLUTION AB	66.29	90.21	9,051	113,417	消費者サービス			
KINNEVIK AB-B SHS	136.78	—	—	—	各種金融			
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	184.41	—	—	—	資本財			
INVESTOR AB-B SHS	236.14	—	—	—	各種金融			
VOLVO AB-A SHS	—	132.83	2,683	33,620	資本財			
HEXAGON AB-B SHS	147.3	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器			
EPIROC AB-A	393.07	—	—	—	資本財			
BOLIDEN AB	130.86	—	—	—	素材			
EMBRACER GROUP AB	—	300.12	2,853	35,754	メディア・娯楽			
EPIROC AB-B	—	198.36	3,580	44,862	資本財			
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	—	737.64	9,375	117,473	資本財			
SINCH AB	—	276.9	3,421	42,866	ソフトウェア・サービス			
小計	株数・金 銘柄数・比率	13,696.15 36銘柄	17,558.05 41銘柄	300,025 —	3,759,319 < 1.1% >			
(ユーロ・・・アイルランド)								
KINGSPAN GROUP PLC	80.21	80.84	808	103,785	資本財			
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	129.21	129.21	592	76,106	素材			
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	82.37	88.69	1,082	138,998	消費者サービス			
KERRY GROUP PLC-A	85.06	81.93	887	113,991	食品・飲料・タバコ			
CRH PLC	410.91	434.26	1,884	242,012	素材			
小計	株数・金 銘柄数・比率	787.76 5銘柄	814.93 5銘柄	5,255 —	674,895 < 0.2% >			
(ユーロ・・・オランダ)								
KONINKLIJKE PHILIPS NV	480.02	477.6	1,516	194,687	ヘルスケア機器・サービス			
AIRBUS SE	314.64	320.94	3,199	410,841	資本財			
HEINEKEN HOLDING NV	61.68	61.68	476	61,224	食品・飲料・タバコ			

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末	評価額	業種等
株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
NN GROUP NV	159.22	140.69	617	79,291	保険
QIAGEN N.V.	125.43	125.43	617	79,292	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABN AMRO BANK NV-CVA	189.16	287.87	364	46,842	銀行
STELLANTIS NV	—	1,055.16	1,642	210,935	自動車・自動車部品
VOPAK	31.3	31.3	103	13,335	エネルギー
FERRARI NV	64.52	69.49	1,638	210,409	自動車・自動車部品
ADYEN NV	9.42	10.69	2,630	337,753	ソフトウェア・サービス
PROSUS NV	264.14	510.18	3,605	463,040	小売
CNH INDUSTRIAL NV	547.75	547.75	818	105,118	資本財
ASM INTERNATIONAL NV	—	24.55	973	124,963	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—	384.96	962	123,631	メディア・娯楽
HEINEKEN NV	131.43	131.43	1,228	157,697	食品・飲料・タバコ
AEGON NV	916.09	916.09	360	46,336	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	594.52	556.57	1,683	216,229	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL N.V.	103.99	98.86	933	119,913	素材
KONINKLIJKE DSM NV	89.94	94.22	1,807	232,054	素材
WOLTERS KLUWER	145.78	145.78	1,462	187,757	商業・専門サービス
ING GROEP NV	2,052.37	2,052.37	2,495	320,417	銀行
KONINKLIJKE KPN NV	1,736.03	1,736.03	454	58,383	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	228.41	225.44	15,889	2,040,307	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	72.79	62.41	350	44,958	商業・専門サービス
JDE PEET'S NV	—	21.66	54	6,967	食品・飲料・タバコ
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	280.21	280.21	366	47,082	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE	23.3	26.44	663	85,184	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	642.8	—	—	—	自動車・自動車部品
JUST EAT TAKEAWAY	63.55	93.07	541	69,495	小売
EXOR NV	62.04	62.04	489	62,840	各種金融
STMICROELECTRONICS NV	332.61	378.04	1,626	208,861	半導体・半導体製造装置
ALTICE EUROPE NV	376.25	—	—	—	電気通信サービス
小計	株数 銘柄数	金額 28銘柄	金額 30銘柄	金額 —	金額 6,365,856 < 1.8% >
(ユーロ・・・ベルギー)					
SOFINA	8.04	8.04	千ユーロ 327	41,998	各種金融
UCB SA	66.23	66.23	642	82,528	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KBC GROUP NV	144.07	130.92	950	122,017	銀行
COLRUYT SA	28.7	21.64	89	11,490	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	59.14	59.14	572	73,526	各種金融
SOLVAY SA	37.58	37.58	372	47,880	素材
UMICORE	105.6	102.88	443	56,899	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	398.98	409.43	2,081	267,290	食品・飲料・タバコ
AGEAS	87.65	112.47	520	66,882	保険
PROXIMUS	96.97	46.17	74	9,503	電気通信サービス
GALAPAGOS NV	23.18	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELIA GROUP SA/NV	19.57	20.63	225	28,901	公益事業
TELENET GROUP HOLDINGS NV	21.81	—	—	—	メディア・娯楽
小計	株数 銘柄数	金額 1,097.52 13銘柄	金額 1,015.13 11銘柄	金額 6,299 —	金額 808,919 < 0.2% >
(ユーロ・・・ルクセンブルグ)					
ARCELORMITTAL	366.89	366.89	千ユーロ 896	115,142	素材
SES	278.6	—	—	—	メディア・娯楽
TENARIS SA	259.63	259.63	231	29,745	エネルギー
EUROFINS SCIENTIFIC	70.1	70.1	791	101,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AROUNDTOWN SA	521.14	525.6	290	37,255	不動産
INPOST SA	—	109.02	112	14,436	運輸
小計	株数 銘柄数	金額 1,496.36 5銘柄	金額 1,331.24 5銘柄	金額 2,322 —	金額 298,278 < 0.1% >

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)	期	末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ・・・フランス)				千ユーロ		
BUREAU VERITAS SA		178.17	178.17	504	64,769	商業・専門サービス
ORANGE		1,061.32	1,061.32	1,019	130,887	電気通信サービス
JCDECAUX SA		28.28	—	—	—	メディア・娯楽
GETLINK SE		223.11	223.11	287	36,943	運輸
SUEZ		189.86	189.86	375	48,199	公益事業
DASSAULT AVIATION SA		1.72	17.2	145	18,652	資本財
FAURECIA		31.27	60.9	226	29,044	自動車・自動車部品
TOTALENERGIES SE		1,334.48	1,354.3	5,579	716,491	エネルギー
TELEPERFORMANCE		29.7	29.7	1,061	136,304	商業・専門サービス
WORLDFINE SA		127.74	127.74	606	77,865	ソフトウェア・サービス
ESSILORLUXOTTICA		153.58	157.04	2,832	363,745	耐久消費財・アパレル
AMUNDI SA		39.55	39.55	296	38,115	各種金融
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		15.55	15.55	798	102,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICHELIN (CGDE)		87.46	87.46	1,122	144,146	自動車・自動車部品
AIR LIQUIDE SA		256.34	251.83	3,710	476,525	素材
KERING		41.33	39.06	2,670	342,973	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE		294.47	293.3	4,435	569,609	資本財
BOUYGUES SA		110.49	110.49	330	42,436	資本財
BNP PARIBAS		604.36	612.93	3,394	435,875	銀行
PEUGEOT SA		281.39	—	—	—	自動車・自動車部品
THALES SA		54.03	54.03	399	51,257	資本財
DANONE		320.81	343	1,863	239,294	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA		358.27	359.9	545	70,107	食品・生活必需品小売り
VIVENDI SE		441.96	384.96	431	55,364	メディア・娯楽
L'OREAL		135.48	136.29	5,476	703,190	家庭用品・パーソナル用品
LEGRAND SA		149.97	133.23	1,276	163,861	資本財
PERNOD RICARD SA		111.12	111.08	2,294	294,689	食品・飲料・タバコ
SOCIETE GENERALE SA		410.25	410.25	1,127	144,791	銀行
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		149.19	148.67	10,365	1,331,004	耐久消費財・アパレル
ACCOR SA		104.51	104.51	278	35,791	消費者サービス
CAPGEMINI SE		80.59	89.61	1,809	232,322	ソフトウェア・サービス
VALEO		140.48	144.44	354	45,571	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE		107.36	133.01	770	98,994	メディア・娯楽
SODEXO SA		39	39	293	37,630	消費者サービス
SEB SA		10.25	11.27	150	19,290	耐久消費財・アパレル
AXA SA		1,063.04	1,004.73	2,434	312,673	保険
EDENRED		121.39	121.39	491	63,130	ソフトウェア・サービス
RENAULT SA		88.3	88.3	257	33,046	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL		16.76	16.76	2,748	352,952	耐久消費財・アパレル
ATOS SE		60.86	45.92	171	22,029	ソフトウェア・サービス
DASSAULT SYSTEMES SE		70.23	351.15	1,876	240,922	ソフトウェア・サービス
ALSTOM		96.68	176.65	571	73,426	資本財
CNP ASSURANCES		89.78	89.78	193	24,878	保険
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		255.83	264.13	1,511	194,140	資本財
SANOFI		606.98	615.68	5,270	676,828	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VINCI SA		276.68	293.09	2,466	316,741	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT		285.61	361.22	1,020	130,989	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		581.4	581.4	705	90,574	銀行
ENGIE		948.86	948.86	1,223	157,104	公益事業
UBISOFT ENTERTAINMENT		47.45	47.45	213	27,351	メディア・娯楽
EDF		296.44	207.79	256	32,939	公益事業
SAFRAN SA		173.98	182.12	1,850	237,602	資本財
ILIAD SA		10.16	—	—	—	電気通信サービス
ARKEMA		32.5	32.5	377	48,410	素材
SCOR SE		70.99	109.07	291	37,395	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄		株数	期首(前期末)	期		末	業種等
			株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
IPSEN		14.98	14.98	129	16,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOLLORE		394.33	394.33	187	24,133	メディア・娯楽	
REMY COINTREAU		12.73	12.73	271	34,883	食品・飲料・タバコ	
EURAZEO SE		17.92	17.92	131	16,901	各種金融	
ORPEA		26.95	26.95	225	28,931	ヘルスケア機器・サービス	
WENDEL		10.82	10.82	111	14,380	各種金融	
EIFFAGE		49.89	49.89	410	52,737	資本財	
ADP		13.46	13.46	140	18,044	運輸	
NATIXIS		453.62	—	—	—	各種金融	
BIOMERIEUX		25.91	15.7	199	25,674	ヘルスケア機器・サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		57.85	57.85	241	31,073	消費者サービス	
小計	株数・金 銘柄柄数<比率>	13,975.82	13,605.38	82,819	10,634,812		
		66銘柄	62銘柄	—	< 3.0% >		
(ユーロ・・・ドイツ)							
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		18.56	—	—	—	運輸	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		468.95	468.95	110	14,193	電気通信サービス	
BAYER AG-REG		532.63	517.33	2,344	301,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HENKEL AG & CO KGAA		59.74	59.74	399	51,243	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG		84.4	86.77	517	66,429	素材	
EVONIK INDUSTRIES AG		133.12	109.52	292	37,549	素材	
VONOVIA SE		280.71	395	1,942	249,399	不動産	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		77.65	77.65	582	74,782	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		25.08	25.64	180	23,211	自動車・自動車部品	
KION GROUP AG		31.79	31.79	298	38,331	資本財	
ZALANDO SE		79.11	123.67	1,007	129,425	小売	
BECHTLE AG		—	43.05	272	34,959	ソフトウェア・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		52.69	52.69	173	22,341	電気通信サービス	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		1,024.59	1,134.78	1,211	155,596	各種金融	
COVESTRO AG		93.46	117.97	597	76,772	素材	
MTU AERO ENGINES AG		29.57	29.57	495	63,658	資本財	
UNIPER SE		104.56	46.97	181	23,329	公益事業	
COMMERZBANK AG		466.44	466.44	290	37,344	銀行	
METRO AG		93.68	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
VOLKSWAGEN AG		19.84	19.6	500	64,279	自動車・自動車部品	
SARTORIUS AG-VORZUG		18.04	13.08	758	97,416	ヘルスケア機器・サービス	
VOLKSWAGEN AG-PREF		98.69	97.76	1,608	206,527	自動車・自動車部品	
LEG IMMOBILIEN SE		36.8	36.8	456	58,666	不動産	
DEUTSCHE WOHNEN SE		181.44	—	—	—	不動産	
NEMETSCHEK SE		30.11	30.11	323	41,583	ソフトウェア・サービス	
RATIONAL AG		—	3.5	284	36,476	資本財	
SYMRISE AG		65.24	65.24	821	105,472	素材	
DELIVERY HERO SE		66.75	80.61	961	123,488	小売	
SIEMENS ENERGY AG		198.55	198.55	478	61,419	資本財	
TEAMVIEWER AG		95.85	90.59	111	14,366	ソフトウェア・サービス	
VONOVIA SE-RTS		—	293.04	90	11,627	不動産	
SIEMENS AG-REG		409.59	409.05	5,913	759,317	資本財	
E.ON SE		1,166.81	1,269.98	1,395	179,255	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		178.73	178.73	1,533	196,871	自動車・自動車部品	
GEA GROUP AG		81.78	81.78	364	46,804	資本財	
CONTINENTAL AG		55.78	55.78	520	66,792	自動車・自動車部品	
BASF SE		499.52	494.39	2,866	368,083	素材	
ALLIANZ SE-REG		225.21	217.83	4,184	537,277	保険	
THYSSENKRUPP AG		193.67	—	—	—	素材	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF		90.43	90.43	642	82,562	家庭用品・パーソナル用品	
RWE AG		347.39	346.73	1,214	155,921	公益事業	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		165.74	331.48	182	23,415	運輸	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	柄	期首(前期末)		期		末		業	種	等		
		株	数	株	数	評	価				額	
		外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額
BRENTAG SE		73.92		73.92		564		72,462		資本財		
FRESENIUS SE & CO KGAA		221.74		213.63		721		92,666		ヘルスケア機器・サービス		
SAP SE		560.6		550.37		6,428		825,460		ソフトウェア・サービス		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		75.72		73.64		1,760		226,095		保険		
BEIERSDORF AG		51.38		51.38		458		58,891		家庭用品・パーソナル用品		
MERCK KGAA		65.53		68.32		1,500		192,654		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ADIDAS AG		102.34		101.46		2,580		331,314		耐久消費財・アパレル		
PUMA SE		59.94		50.52		537		68,992		耐久消費財・アパレル		
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		1,815.43		1,830.3		2,935		376,986		電気通信サービス		
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		111.18		111.18		595		76,408		ヘルスケア機器・サービス		
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		444.02		466.8		3,865		496,318		自動車・自動車部品		
INFINEON TECHNOLOGIES AG		650.83		715.33		2,877		369,442		半導体・半導体製造装置		
HANNOVER RUECK SE		30.58		30.58		475		61,061		保険		
DEUTSCHE POST AG-REG		513.45		544.53		2,917		374,647		運輸		
DEUTSCHE BOERSE AG		100.31		107.01		1,521		195,399		各種金融		
LANXESS AG		44.09		44.09		225		29,010		素材		
FUCHS PETROLUB SE-PREF		33.7		33.7		134		17,223		素材		
HOCHTIEF AG		19.31		—		—		—		資本財		
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		22.69		19.24		341		43,853		ヘルスケア機器・サービス		
KNORR-BREMSE AG		38.81		38.81		350		45,071		資本財		
SIEMENS HEALTHINEERS AG		141.82		164.26		1,058		135,963		ヘルスケア機器・サービス		
SCOUT24 SE		56.1		46.71		279		35,844		メディア・娯楽		
HELLOFRESH SE		—		97.9		925		118,799		食品・生活必需品小売り		
小計	株数・金 銘柄・額 数・比 率	13,116.18		13,626.27		69,167		8,881,824		< 2.5% >		
(ユーロ・・・ポルトガル)						千ユーロ						
GALP ENERGIA SGPS SA		304.82		296.87		249		31,983		エネルギー		
BANCO ESPIRITO SANTO-REG		1,879.06		1,879.06		1		241		銀行		
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,359.64		1,459.1		709		91,170		公益事業		
JERONIMO MARTINS		147.29		163.97		319		41,058		食品・生活必需品小売り		
小計	株数・金 銘柄・額 数・比 率	3,690.81		3,799		1,280		164,453		< 0.0% >		
(ユーロ・・・スペイン)						千ユーロ						
BANKINTER SA		364.05		—		—		—		銀行		
TELEFONICA SA		2,737		2,742.78		1,086		139,506		電気通信サービス		
FERROVIAL SA		275.2		246.93		619		79,587		資本財		
AENA SME SA		35.56		43.77		566		72,701		運輸		
EDP RENOVAVEIS SA		—		147.91		332		42,658		公益事業		
CAIXABANK SA		1,819.81		2,181.03		498		64,051		銀行		
CELLNEX TELECOM SA		163.78		270.81		1,441		185,140		電気通信サービス		
ENDESA SA		141.04		141.04		284		36,493		公益事業		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		3,528.89		3,528.89		1,694		217,600		銀行		
IBERDROLA SA		3,189.22		3,127.16		3,100		398,185		公益事業		
REPSOL SA		791.25		793.58		786		101,006		エネルギー		
GRIFOLS SA		151.69		151.69		253		32,587		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
BANCO SANTANDER SA		8,933.41		9,272.2		2,580		331,356		銀行		
AMADEUS IT GROUP SA		237.77		245.7		1,427		183,244		ソフトウェア・サービス		
NATURGY ENERGY GROUP SA		154.39		154.39		380		48,829		公益事業		
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		157.16		129.31		278		35,766		資本財		
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		580.98		583.28		1,730		222,225		小売		
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		114.82		114.82		269		34,618		資本財		
ENAGAS SA		144.71		144.71		291		37,387		公益事業		
RED ELECTRICA CORPORACION SA		236.32		236.32		437		56,200		公益事業		
MAPFRE SA		463.67		—		—		—		保険		
FERROVIAL SA RTS		275.2		—		—		—		資本財		
小計	株数・金 銘柄・額 数・比 率	24,495.92		24,256.32		18,060		2,319,148		< 0.7% >		

外国株式インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首(前期末)	期		末		業	種	等
		株	数	株	数	評			
		外貨建金額	邦貨換算金額						
(ユーロ・・・イタリア)		千ユーロ							
MONCLER SPA		104.37	122.09	788	101,277	耐久消費財・アパレル			
PRYSMIAN SPA		119.26	125.26	416	53,545	資本財			
DIASORIN SPA		13.13	13.13	243	31,208	ヘルスケア機器・サービス			
TELECOM ITALIA-RSP		2,513.78	3,783.08	168	21,617	電気通信サービス			
LEONARDO SPA		291.18	—	—	—	資本財			
POSTE ITALIANE SPA		265.62	265.62	297	38,184	保険			
FINECOBANK SPA		320.34	320.34	498	63,985	銀行			
ASSICURAZIONI GENERALI		573.03	573.03	1,019	130,977	保険			
MEDIOBANCA SPA		352.62	313.03	304	39,086	銀行			
UNICREDIT SPA		1,205.02	1,128.45	1,192	153,163	銀行			
INTESA SANPAOLO		8,785.7	9,050.32	1,939	249,049	銀行			
ATLANTIA SPA		265.01	265.01	428	54,992	運輸			
ENI SPA		1,331.96	1,369.72	1,616	207,545	エネルギー			
ENEL SPA		4,327.66	4,316.52	2,930	376,303	公益事業			
SNAM SPA		1,067.07	1,067.07	533	68,470	公益事業			
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE		789.8	871.42	566	72,689	公益事業			
TELECOM ITALIA SPA		4,919.82	3,905.36	183	23,620	電気通信サービス			
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		45.78	45.78	251	32,308	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
AMPLIFON SPA		—	75.67	323	41,548	ヘルスケア機器・サービス			
NEXI SPA		206.12	206.12	284	36,512	ソフトウェア・サービス			
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		158.04	158.04	162	20,851	電気通信サービス			
PIRELLI & C SPA		174.84	—	—	—	自動車・自動車部品			
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	27,830.15 21銘柄	27,975.06 20銘柄	14,149 —	1,816,938 <0.5%>				
(ユーロ・・・フィンランド)		千ユーロ							
WARTSILA OYJ ABP		267.53	267.53	329	42,375	資本財			
NESTE OYJ		221.53	214.27	920	118,256	エネルギー			
UPM-KYMMENE OYJ		306.53	280.55	917	117,803	素材			
NOKIA OYJ		2,968.4	2,801.61	1,406	180,560	テクノロジー・ハードウェアおよび機器			
STORA ENSO OYJ-R SHS		302.34	302.34	466	59,943	素材			
ELISA OYJ		69.88	86.81	462	59,392	電気通信サービス			
SAMPO OYJ-A SHS		245.63	284.54	1,225	157,331	保険			
FORTUM OYJ		243.12	243.12	621	79,795	公益事業			
KESKO OYJ-B SHS		—	134.02	374	48,134	食品・生活必需品小売り			
KONE OYJ-B		176.18	176.18	1,042	133,839	資本財			
ORION OYJ-CLASS B		63.79	62.61	231	29,690	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,864.93 10銘柄	4,853.58 11銘柄	7,998 —	1,027,124 <0.3%>				
(ユーロ・・・オーストリア)		千ユーロ							
OMV AG		81.06	83.89	396	50,899	エネルギー			
ERSTE GROUP BANK AG		149.68	193.83	751	96,472	銀行			
VOESTALPINE AG		60.56	60.56	178	22,925	素材			
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL		93.32	70.66	180	23,173	銀行			
ANDRITZ AG		26.6	—	—	—	資本財			
VERBUND AG		38.78	31.9	286	36,764	公益事業			
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	450 6銘柄	440.84 5銘柄	1,792 —	230,234 <0.1%>				
ユーロ通貨計	株数・金額 銘柄数<比率>	101,904.84 240銘柄	102,646.7 232銘柄	258,721 —	33,222,487 <9.4%>				
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	577,082.82 1,215銘柄	583,591.19 1,223銘柄	— —	338,023,942 <95.5%>				

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

※< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

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

※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。

外国株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国新株予約権証券

銘柄		期首(前期末)	期 末		
		証 券 数	証 券 数	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(スイス)		証券	証券	千スイス・フラン	千円
CIE FINANCIERE RIC-W		55,710	—	—	—
小 計	証 券 数 ・ 金 額	55,710	—	—	—
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	—	—	<—>
合 計	証 券 数 ・ 金 額	55,710	—	—	—
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	—	—	<—>

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

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(3) 外国投資信託証券

銘	柄	期首 (前期末)	期		末		
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率
						外 貨 建 金 額	
(アメリカ)		口	口	千アメリカ・ドル	千円	%	
AGNC INVESTMENT CORP		25,432	25,432	402	45,802	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC		7,344	7,344	1,768	201,178	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC		15,706	17,345	2,774	315,616	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC		7,835	7,835	864	98,355	0.0	
VORNADO REALTY TRUST		8,706	8,706	361	41,184	0.0	
VEREIT INC		54,273	—	—	—	—	
SBA COMMUNICATIONS CORP		5,916	5,916	2,103	239,321	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL		19,671	18,773	1,618	184,149	0.1	
EQUINIX INC		4,811	4,908	4,024	457,874	0.1	
AMERICAN TOWER CORP		23,614	24,648	6,579	748,553	0.2	
SUN COMMUNITIES INC		5,650	6,088	1,197	136,275	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC		37,569	37,569	616	70,182	0.0	
REALTY INCOME CORP		17,798	28,298	1,975	224,718	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM		5,780	5,780	1,213	138,094	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		8,249	—	—	—	—	
INVITATION HOMES INC		27,735	32,632	1,346	153,216	0.0	
VICI PROPERTIES INC		23,498	36,025	1,013	115,292	0.0	
VENTAS INC		21,317	19,379	951	108,297	0.0	
WEYERHAEUSER CO		38,940	38,940	1,508	171,670	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP		22,634	22,634	4,206	478,525	0.1	
IRON MOUNTAIN INC		14,204	14,204	665	75,725	0.0	
PROLOGIS INC		40,040	40,178	6,158	700,650	0.2	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		6,496	7,662	1,572	178,926	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST		4,902	4,902	827	94,167	0.0	
DUKE REALTY CORP		21,002	21,667	1,288	146,547	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC		3,332	3,332	1,154	131,351	0.0	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘 柄		期首（前期末）	期		末	
		口 数	口 数	評 価 額		組 入 比 率
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
FEDERAL REALTY INVS TRUST		3,613	—	—	—	—
WELLTOWER INC		22,737	23,388	1,918	218,296	0.1
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		28,756	28,756	979	111,429	0.0
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		8,664	8,664	734	83,607	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		85,417	64,936	542	61,687	0.0
PUBLIC STORAGE		8,249	8,249	2,737	311,475	0.1
REGENCY CENTERS CORP		8,289	8,289	586	66,729	0.0
UDR INC		16,633	16,633	955	108,752	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		14,362	10,364	287	32,732	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC		14,002	15,126	2,553	290,468	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC		7,483	7,376	1,497	170,392	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		31,750	31,858	684	77,890	0.0
WP CAREY INC		8,640	8,640	680	77,409	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	731,049	672,476	60,354	6,866,548	1.9
	銘 柄 数 <比 率>	39銘柄	36銘柄		<1.9%>	
(カナダ)				千カナダ・ドル		
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		6,546	—	—	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		3,585	—	—	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		3,971	3,971	232	20,721	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		7,441	7,441	164	14,691	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	21,543	11,412	396	35,412	0.0
	銘 柄 数 <比 率>	4銘柄	2銘柄		<0.0%>	
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル		
SCENTRE GROUP		275,200	275,200	836	68,007	0.0
LENDLEASE GROUP		36,263	36,263	384	31,246	0.0
DEXUS/AU		54,256	54,256	588	47,853	0.0
TRANSURBAN GROUP		145,680	161,485	2,210	179,710	0.1
SYDNEY AIRPORT		73,899	62,186	512	41,654	0.0
APA GROUP		68,344	55,644	539	43,876	0.0
GPT GROUP		97,296	121,221	629	51,142	0.0
MIRVAC GROUP		200,053	200,053	580	47,160	0.0
STOCKLAND		127,393	127,393	554	45,047	0.0
GOODMAN GROUP		86,301	86,301	2,118	172,228	0.0
VICINITY CENTRES		250,037	241,241	408	33,239	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,414,722	1,421,243	9,363	761,167	0.2
	銘 柄 数 <比 率>	11銘柄	11銘柄		<0.2%>	
(香港)				千香港・ドル		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		197,000	197,000	2,092	30,524	0.0
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		125,000	193,500	1,480	21,597	0.0
LINK REIT		110,100	110,100	7,563	110,356	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	432,100	500,600	11,136	162,478	0.0
	銘 柄 数 <比 率>	3銘柄	3銘柄		<0.0%>	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘 柄		期首（前期末）		期		末	
		口 数	口 数	評 価 額		組 入 比 率	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(シンガポール)				千シンガポール・ドル			
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		159,000	170,500	509	42,420	0.0	
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		238,488	259,616	555	46,229	0.0	
SUNTEC REIT		102,700	—	—	—	—	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		138,100	208,100	397	33,073	0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		104,900	112,400	234	19,547	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	743,188 5銘柄	750,616 4銘柄	1,697	141,270 <0.0%>	0.0	
(イギリス)				千イギリス・ポンド			
LAND SECURITIES GROUP PLC		39,861	39,861	299	45,370	0.0	
SEGRO PLC		59,874	68,623	972	147,427	0.0	
BRITISH LAND CO PLC		44,962	44,962	234	35,530	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	144,697 3銘柄	153,446 3銘柄	1,506	228,328 <0.1%>	0.1	
(ユーロ・・・フランス)				千ユーロ			
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		8,630	7,024	421	54,117	0.0	
ICADE		2,061	—	—	—	—	
GECINA SA		2,189	2,189	261	33,548	0.0	
KLEPIERRE		9,305	13,600	259	33,277	0.0	
COVIVIO		2,388	2,388	175	22,495	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	24,573 5銘柄	25,201 4銘柄	1,117	143,437 <0.0%>	0.0	
ユーロ通貨計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	24,573 5銘柄	25,201 4銘柄	1,117	143,437 <0.0%>	0.0	
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,511,872 70銘柄	3,534,994 63銘柄	—	8,338,643 <2.4%>	2.4	

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

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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

※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。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	期		末	
			買	建 額	売	建 額
外 国	S & P	5 0 0 E M I N I F U T	百万円		百万円	
	S P I	2 0 0 F U T U R E S	5,899		—	
	F T S E	1 0 0 I D X F U T	249		—	
	E U R O	S T O X X 5 0	323		—	
			1,138		—	

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

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	338, 023, 942	95. 5
投 資 証 券	8, 338, 643	2. 4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7, 605, 914	2. 1
投 資 信 託 財 産 総 額	353, 968, 499	100. 0

※期末における外貨建資産（352, 603, 331千円）の投資信託財産総額（353, 968, 499千円）に対する比率は99. 6%です。
 ※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1
 アメリカ・ドル＝113. 77円、1 カナダ・ドル＝89. 26円、1 オーストラリア・ドル＝81. 29円、1 香港・ドル＝14. 59円、1 シンガポール・
 ドル＝83. 21円、1 ニュージーランド・ドル＝77. 53円、1 イギリス・ポンド＝151. 56円、1 イスラエル・シェケル＝36. 011円、1 スイ
 ス・フラン＝123. 25円、1 デンマーク・クローネ＝17. 27円、1 ノルウェー・クローネ＝12. 61円、1 スウェーデン・クローナ＝12. 53円、
 1 ユーロ＝128. 41円です。

■ 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	355, 195, 433, 447円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5, 107, 560, 927
株 式 (評価額)	338, 023, 942, 089
投 資 証 券 (評価額)	8, 338, 643, 304
未 収 入 金	1, 276, 906, 399
未 収 配 当 金	378, 251, 525
差 入 委 託 証 拠 金	2, 070, 129, 203
(B) 負 債	1, 377, 196, 655
未 払 金	1, 295, 843, 875
未 払 解 約 金	81, 347, 754
そ の 他 未 払 費 用	5, 026
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	353, 818, 236, 792
元 本	60, 650, 874, 522
次 期 繰 越 損 益 金	293, 167, 362, 270
(D) 受 益 権 総 口 数	60, 650, 874, 522口
1 万口当たり基準価額 (C / D)	58, 337円

※当期における期首元本額59, 674, 216, 686円、期中追加設定元本
 額13, 275, 575, 985円、期中一部解約元本額12, 298, 918, 149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, 981, 491, 031円
受 取 配 当 金	4, 944, 288, 559
受 取 利 息	212
そ の 他 収 益 金	37, 690, 887
支 払 利 息	△ 488, 627
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	86, 164, 449, 326
売 買 損 益	93, 253, 928, 084
売 買 損	△ 7, 089, 478, 758
(C) 先 物 取 引 等 損 益	1, 224, 205, 499
取 引 益	1, 380, 162, 208
取 引 損	△ 155, 956, 709
(D) そ の 他 費 用 等	△ 130, 283, 930
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	92, 239, 861, 926
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	194, 422, 937, 325
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 49, 229, 658, 029
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	55, 734, 221, 048
(I) 合 計 (E + F + G + H)	293, 167, 362, 270
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	293, 167, 362, 270

※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。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	31,877,680,130円	三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	12,792,410円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	257,237,232円	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	591,445,429円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,092,113,150円	バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	3,447,518円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	759,876,748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＞	32,980,346円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	63,296,820円	SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	704,179,317円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	1,131,648円	SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	824,854,056円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	5,750,140円	SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	3,604,698,411円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	17,334,902円	SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	12,109,077円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	47,583,616円	SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	64,600,386円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	49,206,031円	SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	508,707,107円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	93,432,630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＞	41,029,721円
外国株式指数ファンド	762,591,588円	SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	102,099,408円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	12,154,970,474円	SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	495,008,013円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	136,154,453円	SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	350,695,262円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	161,478,755円	SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	829,398,471円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	106,177,098円	SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	218,848円
イオン・バランス戦略ファンド	26,039,960円	三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	218,605,667円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,113,153円	SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	75,145,593円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	110,598,046円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	8,737,379円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	97,319,132円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	7,911,776円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	330,128,909円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	4,096,558円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	170,705,412円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	21,448,701円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	195,254,066円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	60,189,060円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	38,559,109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＞	139,958,110円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	509,621,059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＞	63,429,174円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	4,097,387円	SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	817,767,596円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	17,354,910円	SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	118,979,244円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	15,630,593円	SMAM・外国株式インデックスファンドSA＜適格機関投資家限定＞	1,028,620,924円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,093,613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＞	27,233,124円
SMBC・DCインデックスファンド（MSCIコクサイ）	110,450,992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＞	37,994,675円
日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	67,713,873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＞	41,244,635円
日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	281,821,366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＞	222,731,531円

■ お知らせ

＜約款変更について＞

該当事項はございません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

第18期（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年12月18日）
運用方針	・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ・ 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		公 社 債 率 組 入 比	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
14期（2017年12月18日）	円	%		%	%	百万円
	17,897	4.6	181.01	4.9	98.9	196,212
15期（2018年12月17日）	17,553	△1.9	177.36	△2.0	98.7	168,894
16期（2019年12月17日）	18,248	4.0	184.64	4.1	98.6	171,892
17期（2020年12月17日）	19,109	4.7	193.48	4.8	99.0	161,689
18期（2021年12月17日）	19,947	4.4	201.87	4.3	99.1	162,393

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

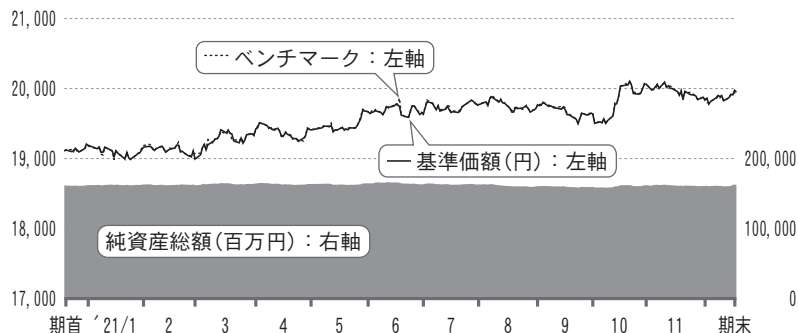
年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		公 社 債 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2020年12月17日	円 19,109	% —	193.48	% —	% 99.0
12月末	19,189	0.4	194.18	0.4	98.6
2021年1月末	19,162	0.3	194.26	0.4	98.7
2月末	18,992	△0.6	193.11	△0.2	98.8
3月末	19,424	1.6	196.58	1.6	98.8
4月末	19,409	1.6	196.54	1.6	98.7
5月末	19,669	2.9	199.12	2.9	98.9
6月末	19,632	2.7	198.94	2.8	99.1
7月末	19,768	3.4	200.30	3.5	98.9
8月末	19,768	3.4	200.22	3.5	98.8
9月末	19,635	2.8	198.94	2.8	99.0
10月末	20,063	5.0	203.09	5.0	98.8
11月末	19,840	3.8	200.65	3.7	98.5
(期 末) 2021年12月17日	19,947	4.4	201.87	4.3	99.1

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

基準価額等の推移



※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、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

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

期 首	19,109円
期 末	19,947円
騰 落 率	+4.4%

▶ 基準価額の主な変動要因（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の国債に分散投資し、ベンチマークであるF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に対し、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション（投資資金の平均回収期間）等を可能な限り近似させることにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因	・ グローバルに金利先高観が強まる中、米ドルを中心に対円で投資通貨が上昇したこと
下落要因	・ グローバルに中央銀行の将来の金融緩和策の縮小が意識され、米欧金利が上昇（債券価格は下落）したこと

▶ 投資環境について（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

債券市場は米国、欧州ともに下落しました。為替市場は米ドルを中心に投資通貨が対円で上昇しました。

債券市場

米欧を中心に新型コロナウイルスワクチンの接種が進展し、経済再開の動きが本格化する中、グローバルに中央銀行の将来の金融緩和策の縮小が意識され、米欧金利は上昇（債券価格は下落）しました。また、エネルギー価格の高騰や、人手不足に起因する供給制約を背景にインフレ率上昇への懸念が強まったことも、米欧金利の上昇要因となりました。

為替市場

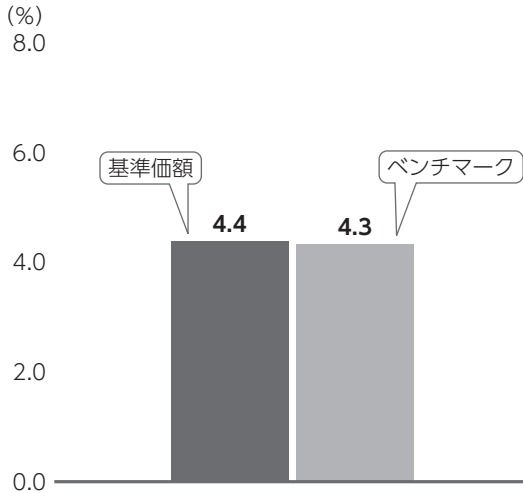
米欧を中心とした経済再開の本格化やインフレ率上昇懸念の高まりから、グローバルに中央銀行の金融緩和策の縮小が意識される中、米欧の金利先高観が強まり、米ドルを中心に対円で投資通貨が上昇しました。

▶ ポートフォリオについて（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。インデックス構成銘柄の変更が実施される毎月末において、ファンドの特性値（通貨・国別配分、満期構成、デュレーション等）をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資配分比率の調整）を行いました。

▶ ベンチマークとの差異について（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+4.4%となり、ベンチマークの騰落率+4.3%と0.1%の上方乖離となりました。

上方乖離要因 ・ キャッシュフローに伴う売買のタイミング

2 今後の運用方針

米国では、当面は変異ウイルスの感染拡大が警戒されますが、景気の回復や金融政策の正常化を背景に、長期金利は緩やかに水準を切り上げていく見通しです。ユーロ圏でも、資産購入ペースの減速など金融政策の正常化観測が長期金利の上昇要因となっていく見通しですが、当面はECB（欧州中央銀行）が緩和的な姿勢を維持していることや感染再拡大への懸念から、長期金利の上昇ペースは緩やかになると予想します。

為替相場は、米ドル・円は、米国の景気回復や金融政策の正常化を背景に、米ドル高・円安圧力がかかる見通しです。ユーロ・米ドルに関しては、米国とユーロ圏の中央銀行の政策姿勢や景気格差などを反映し、ユーロ安・米ドル高圧力がかかる見通しです。

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

■ 1 万口当たりの費用明細（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

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

期中の平均基準価額は19,551円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年12月18日から2021年12月17日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 195,849	千アメリカ・ドル 163,553
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 12,407	千カナダ・ドル 14,579
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 1,902	千オーストラリア・ドル 23,215
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 1,174	千シンガポール・ドル 932
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 7,602	千イギリス・ポンド 16,887
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シェケル 9,140	千イスラエル・シェケル 8,450
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 1,771	千デンマーク・クローネ 8,663
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 1,555	千ノルウェー・クローネ 2,049
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 2,614	千スウェーデン・クローナ 8,806
	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 20,788	千メキシコ・ペソ 52,993
	中国	国 債 証 券	千オフショア・人民元 39,140	千オフショア・人民元 —
	マレーシア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 4,583	千マレーシア・リンギット 7,324
	ポーランド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 35,968	千ポーランド・ズロチ 40,616
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
国	アイルランド	国 債 証 券	1,270	1,111
	オランダ	国 債 証 券	4,395	5,272
	ベルギー	国 債 証 券	4,624	8,181

外国債券パッシブ・マザーファンド

				買付額	売付額
外国		フランス	国債証券	26,142	32,170
		ドイツ	国債証券	22,150	24,196
		スペイン	国債証券	7,855	8,933
		イタリア	国債証券	15,196	23,507
		フィンランド	国債証券	1,451	3,116
		オーストリア	国債証券	2,517	4,650

※金額は受渡し代金。（経過利子分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。

利害関係人との取引状況等（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。
※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 （2020年12月18日から2021年12月17日まで）

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

組入れ資産の明細（2021年12月17日現在）

公社債
A 債券種類別開示
外国（外貨建）公社債

区分	期				末			
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 644,020	千アメリカ・ドル 672,251	千円 76,549,238	% 47.1	% —	% 21.6	% 17.3	% 8.3
カナダ	千カナダ・ドル 32,300	千カナダ・ドル 35,262	3,142,202	1.9	—	1.0	0.7	0.2
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 29,350	千オーストラリア・ドル 32,046	2,618,502	1.6	—	1.2	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,950	千シンガポール・ドル 8,624	720,460	0.4	—	0.3	0.0	0.1

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 48,450	千イギリス・ポンド 64,546	9,793,053	6.0	—	4.8	0.7	0.6
イ ス ラ エ ル	千イスラエル・シェケル 18,400	千イスラエル・シェケル 20,818	763,243	0.5	—	0.2	0.1	0.2
デ ン マ ー ク	千デンマーク・クローネ 31,900	千デンマーク・クローネ 41,093	712,971	0.4	—	0.4	0.0	0.0
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェー・クローネ 29,700	千ノルウェー・クローネ 30,253	383,313	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデン・クローナ 33,000	千スウェーデン・クローナ 36,917	465,525	0.3	—	0.1	0.1	0.1
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 201,000	千メキシコ・ペソ 208,282	1,139,138	0.7	—	0.4	0.2	0.1
中 国	千オフショア・人民元 39,000	千オフショア・人民元 39,234	700,385	0.4	—	0.2	0.2	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシア・リンギット 26,900	千マレーシア・リンギット 27,865	753,031	0.5	—	0.3	0.1	—
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 27,600	千ポーランド・ズロチ 27,894	776,753	0.5	—	0.2	0.1	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	9,000	10,300	1,328,861	0.8	—	0.6	0.2	0.0
オ ラ ン ダ	19,500	23,835	3,074,959	1.9	—	1.3	0.4	0.2
ベ ル ギ ー	22,750	27,521	3,550,490	2.2	—	1.6	0.5	0.1
フ ラ ン ス	105,370	123,265	15,902,433	9.8	—	6.3	2.9	0.6
ド イ ツ	78,500	91,073	11,749,439	7.2	—	4.5	2.0	0.7
ス バ イ ン	60,950	73,322	9,459,337	5.8	—	3.7	1.7	0.4
イ タ リ ア	93,470	109,645	14,145,323	8.7	—	5.5	2.3	0.9
フィンランド	6,300	7,279	939,103	0.6	—	0.4	0.1	0.1
オーストリア	14,500	17,402	2,245,153	1.4	—	0.9	0.3	0.2
合 計	—	—	160,912,922	99.1	—	55.6	30.4	13.1

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 外国（外貨建）公社債

区 分	銘 柄	種 類	期		評 価 額		末
			利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
ア メ リ カ	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.0000	千アメリカ・ドル 3,800	千アメリカ・ドル 3,872	千円 441,000	2023/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3.1250	2,300	2,792	318,002	2043/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.7500	2,700	2,749	313,032	2023/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.5000	5,000	5,160	587,671	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.7500	4,200	4,370	497,623	2023/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.8750	2,400	2,811	320,088	2043/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3.6250	2,400	3,138	357,343	2043/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3.7500	700	933	106,243	2043/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.5000	5,700	5,935	675,878	2024/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.7500	5,100	5,325	606,388	2024/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3.3750	3,000	3,806	433,441	2044/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.3750	5,600	5,828	663,701	2024/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3.6250	3,600	4,722	537,777	2044/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3.1250	3,300	4,038	459,906	2044/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.2500	5,100	5,298	603,374	2024/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.0000	3,500	3,613	411,465	2025/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3.0000	3,500	4,210	479,497	2044/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.5000	4,100	4,549	518,072	2045/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.1250	4,900	5,081	578,624	2025/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3.0000	3,000	3,621	412,357	2045/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.0000	4,300	4,445	506,239	2025/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.8750	3,700	4,384	499,229	2045/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.2500	4,000	4,176	475,584	2025/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.0000	5,000	5,081	578,641	2022/11/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.1250	4,000	4,074	463,929	2022/12/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.7500	3,000	3,046	346,959	2023/01/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3.0000	2,700	3,272	372,612	2045/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.6250	4,700	4,792	545,764	2026/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.5000	2,900	3,233	368,145	2046/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.5000	3,000	3,041	346,344	2023/02/28
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.5000	3,000	3,040	346,266	2023/03/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.6250	3,000	3,048	347,079	2023/04/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.6250	14,950	15,246	1,736,131	2026/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.5000	3,600	4,015	457,295	2046/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.6250	3,000	3,050	347,331	2023/05/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.3750	500	506	57,701	2023/06/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.2500	3,000	3,034	345,586	2023/07/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1.3750	2,500	2,533	288,543	2023/08/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2.2500	2,850	3,041	346,305	2046/08/15

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期		末		
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 3750	3, 000	3, 042	346, 399	2023/09/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 6250	3, 000	3, 056	348, 080	2023/10/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 0000	5, 000	5, 193	591, 366	2026/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 1250	3, 100	3, 190	363, 269	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 8750	3, 600	4, 299	489, 577	2046/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 2500	3, 000	3, 096	352, 616	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 2500	4, 400	4, 631	527, 407	2027/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 2500	2, 200	2, 272	258, 780	2024/01/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 0000	2, 500	3, 055	347, 901	2047/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 1250	6, 500	6, 703	763, 366	2024/03/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 0000	2, 000	2, 059	234, 465	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 1250	2, 000	2, 062	234, 811	2024/02/29
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 3750	4, 900	5, 196	591, 742	2027/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 0000	2, 200	2, 696	307, 014	2047/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 0000	3, 300	3, 397	386, 923	2024/05/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 0000	4, 100	4, 224	480, 999	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 1250	3, 500	3, 620	412, 227	2024/07/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 2500	4, 200	4, 429	504, 333	2027/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	3, 800	4, 467	508, 663	2047/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 8750	3, 800	3, 905	444, 704	2024/08/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 1250	4, 000	4, 140	471, 453	2024/09/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 2500	800	831	94, 654	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	1, 500	1, 764	200, 921	2047/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 2500	4, 400	4, 643	528, 779	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 1250	2, 600	2, 693	306, 655	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 2500	3, 100	3, 224	367, 116	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 3750	1, 200	1, 227	139, 722	2023/01/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 5000	3, 400	3, 563	405, 741	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	4, 800	5, 215	593, 931	2028/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 0000	3, 100	3, 821	435, 206	2048/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 6250	4, 000	4, 104	467, 418	2023/02/28
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	2, 000	2, 113	240, 620	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 6250	2, 300	2, 422	275, 873	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	2, 900	2, 989	340, 374	2023/04/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 8750	2, 200	2, 336	266, 090	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 8750	9, 000	9, 866	1, 123, 541	2028/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 1250	2, 400	3, 030	345, 026	2048/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	1, 000	1, 032	117, 623	2023/05/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 8750	1, 100	1, 169	133, 143	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	4, 600	4, 874	555, 020	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	2, 000	2, 070	235, 806	2023/07/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 8750	4, 500	4, 947	563, 333	2028/08/15

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘	種 類	期		末		
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 0000	5, 400	6, 674	760, 020	2048/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	2, 100	2, 228	253, 716	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	3, 800	3, 939	448, 642	2023/08/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 0000	4, 000	4, 286	488, 110	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 8750	1, 000	1, 042	118, 663	2023/10/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 0000	3, 100	3, 324	378, 613	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 1250	2, 900	3, 244	369, 486	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 3750	3, 100	4, 098	466, 672	2048/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 8750	2, 000	2, 087	237, 658	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 6250	1, 900	1, 975	224, 963	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 8750	2, 500	2, 673	304, 422	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 6250	4, 400	4, 667	531, 440	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 6250	2, 700	2, 864	326, 135	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 6250	2, 700	2, 938	334, 661	2029/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 0000	3, 800	4, 720	537, 567	2049/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 3750	3, 700	3, 834	436, 688	2024/02/29
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 5000	8, 500	8, 980	1, 022, 639	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 2500	13, 300	13, 919	1, 584, 984	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 2500	3, 800	3, 933	447, 898	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 3750	4, 100	4, 399	500, 966	2029/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 8750	1, 400	1, 703	193, 990	2049/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 7500	6, 200	6, 348	722, 867	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 7500	850	870	99, 159	2024/07/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 6250	4, 450	4, 545	517, 646	2029/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 2500	3, 500	3, 786	431, 189	2049/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 3750	7, 100	7, 171	816, 561	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 6250	3, 900	3, 981	453, 352	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 5000	5, 500	5, 596	637, 244	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 7500	4, 000	4, 125	469, 782	2029/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 3750	1, 900	2, 111	240, 404	2049/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 6250	200	204	23, 256	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 5000	800	813	92, 675	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 5000	4, 500	4, 551	518, 256	2030/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 0000	2, 800	2, 876	327, 552	2050/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 1250	2, 000	1, 992	226, 938	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 5000	1, 500	1, 477	168, 222	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 6250	1, 500	1, 455	165, 773	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 7500	2, 400	2, 466	280, 822	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 5000	1, 000	1, 015	115, 648	2027/01/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 2500	5, 000	4, 988	568, 012	2023/04/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 1250	1, 500	1, 507	171, 670	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 3750	1, 000	1, 013	115, 377	2025/01/31

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期		末		
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 3750	3, 000	3, 035	345, 651	2023/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 6250	4, 000	4, 052	461, 437	2022/12/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 6250	7, 500	7, 058	803, 782	2030/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 2500	5, 100	4, 380	498, 795	2050/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 1250	3, 500	3, 092	352, 086	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 5000	3, 000	2, 884	328, 451	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 2500	7, 700	7, 673	873, 747	2023/06/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 3750	3, 000	2, 938	334, 576	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 5000	3, 000	2, 888	328, 932	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 2500	2, 400	2, 334	265, 857	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 1250	4, 300	4, 273	486, 654	2023/07/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 5000	4, 400	4, 227	481, 412	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 2500	3, 300	3, 205	365, 054	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 3750	4, 700	4, 481	510, 350	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 6250	8, 800	8, 264	941, 070	2030/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 3750	4, 500	3, 986	453, 963	2050/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 1250	8, 000	7, 943	904, 510	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 2500	2, 000	1, 939	220, 853	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 3750	7, 800	7, 417	844, 602	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 1250	5, 700	5, 651	643, 503	2023/10/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 8750	7, 000	6, 704	763, 460	2030/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 6250	3, 200	3, 013	343, 118	2050/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 1250	8, 500	8, 310	946, 339	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 8750	5, 800	5, 799	660, 393	2051/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 7500	6, 700	6, 486	738, 606	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 3750	2, 000	1, 943	221, 297	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 3750	3, 000	2, 912	331, 679	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 6250	2, 100	2, 020	230, 047	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 6250	7, 200	6, 924	788, 471	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 2500	3, 000	2, 978	339, 205	2023/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 1250	7, 700	7, 608	866, 382	2024/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 1250	1, 800	1, 797	204, 644	2022/11/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 6250	3, 300	3, 367	383, 459	2031/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 2500	4, 500	4, 436	505, 128	2031/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 0000	4, 700	4, 843	551, 576	2051/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 6250	3, 600	3, 511	399, 810	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 0000	5, 900	5, 777	657, 865	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 2500	4, 500	4, 473	509, 412	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 6250	4, 400	4, 371	497, 836	2024/10/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 3750	3, 100	3, 087	351, 521	2031/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	0. 7500	5, 200	5, 179	589, 808	2024/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 2500	4, 200	4, 215	480, 061	2026/11/30

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期		評 価 額		末
			利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	1. 3750	6, 000	6, 013	684, 709	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	6. 2500	800	876	99, 752	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	6. 0000	1, 000	1, 199	136, 616	2026/02/15
	US TREASURY BOND	国 債 証 券	6. 1250	1, 000	1, 278	145, 611	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	5. 2500	500	630	71, 782	2028/11/15
	US TREASURY BOND	国 債 証 券	5. 3750	320	431	49, 154	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 5000	200	254	28, 937	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	4. 2500	300	416	47, 400	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	4. 5000	300	428	48, 775	2039/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	4. 3750	700	986	112, 314	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	4. 6250	600	870	99, 178	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	4. 3750	900	1, 273	145, 037	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 8750	500	666	75, 883	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	4. 2500	600	836	95, 260	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	4. 7500	900	1, 334	151, 986	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	4. 3750	300	426	48, 545	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 7500	1, 500	1, 974	224, 875	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 1250	1, 000	1, 213	138, 156	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3. 0000	800	954	108, 695	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	2, 000	2, 297	261, 632	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	2. 7500	300	344	39, 255	2042/11/15
小 計			—	644, 020	672, 251	76, 549, 238	—
カ ナ ダ	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	5. 7500	千カナダ・ドル 250	千カナダ・ドル 330	29, 439	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	5. 7500	500	723	64, 494	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	5. 0000	1, 450	2, 125	189, 361	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4. 0000	1, 500	2, 085	185, 799	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3. 5000	1, 300	1, 769	157, 641	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1. 5000	2, 000	2, 020	180, 018	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 5000	2, 100	2, 175	193, 856	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 2500	1, 000	1, 040	92, 680	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 7500	1, 400	1, 724	153, 699	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1. 5000	2, 900	2, 944	262, 354	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1. 0000	600	594	52, 939	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1. 7500	1, 100	1, 113	99, 213	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 0000	1, 200	1, 223	108, 985	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 0000	700	733	65, 392	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 2500	1, 900	2, 039	181, 729	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 2500	1, 000	1, 027	91, 601	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1. 5000	2, 000	2, 025	180, 497	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1. 2500	5, 900	5, 890	524, 934	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	0. 5000	2, 700	2, 640	235, 318	2025/09/01

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	CANADA GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	800	1,035	92,243	2064/12/01
小 計			—	32,300	35,262	3,142,202	—
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	5.5000	千オーストラリア・ドル 1,400	千オーストラリア・ドル 1,495	122,163	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	2,500	2,618	213,996	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.2500	1,300	1,459	119,252	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.5000	1,100	1,429	116,785	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.2500	1,300	1,388	113,484	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2500	2,650	2,977	243,307	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7500	1,200	1,498	122,415	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	800	894	73,104	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	1,100	1,182	96,619	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.2500	2,550	3,011	246,042	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.2500	2,800	2,936	239,952	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.0000	1,200	1,379	112,699	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	200	216	17,711	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	3,100	3,386	276,711	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.5000	1,850	1,991	162,760	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1.5000	2,900	2,884	235,724	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1.7500	800	718	58,668	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	0.2500	600	576	47,100	2025/11/21
小 計			—	29,350	32,046	2,618,502	—
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5000	千シンガポール・ドル 1,500	千シンガポール・ドル 1,659	138,592	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.0000	700	738	61,688	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.8750	500	550	45,967	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	400	454	37,967	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	1,200	1,237	103,345	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.3750	750	874	73,055	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	700	802	67,015	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.2500	1,200	1,258	105,135	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.6250	700	749	62,629	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.6250	200	200	16,737	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.2500	100	99	8,324	2026/11/01
小 計			—	7,950	8,624	720,460	—
イギリス	UK GILT	国 債 証 券	6.0000	千イギリス・ポンド 650	千イギリス・ポンド 889	134,884	2028/12/07
	UK GILT	国 債 証 券	4.2500	700	943	143,123	2032/06/07
	UK GILT	国 債 証 券	5.0000	1,300	1,485	225,342	2025/03/07
	UK GILT	国 債 証 券	4.2500	1,050	1,519	230,485	2036/03/07
	UK GILT	国 債 証 券	4.7500	1,200	1,922	291,748	2038/12/07
	UK GILT	国 債 証 券	4.2500	1,700	3,383	513,335	2055/12/07

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘	種 類	期		評 価 額		末
			利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
	UK GILT	国 債 証 券	4. 2500	1, 500	2, 583	391, 933	2046/12/07
	UK GILT	国 債 証 券	4. 2500	900	1, 092	165, 754	2027/12/07
	UK GILT	国 債 証 券	4. 5000	1, 350	2, 256	342, 300	2042/12/07
	UK GILT	国 債 証 券	4. 7500	1, 150	1, 555	236, 044	2030/12/07
	UK GILT	国 債 証 券	4. 2500	900	1, 631	247, 546	2049/12/07
	UK GILT	国 債 証 券	4. 2500	1, 250	1, 923	291, 837	2039/09/07
	UK GILT	国 債 証 券	4. 5000	1, 100	1, 584	240, 337	2034/09/07
	UK GILT	国 債 証 券	4. 0000	1, 700	3, 479	527, 862	2060/01/22
	UK GILT	国 債 証 券	4. 2500	700	1, 098	166, 655	2040/12/07
	UK GILT	国 債 証 券	3. 7500	1, 200	2, 102	318, 974	2052/07/22
	UK GILT	国 債 証 券	3. 2500	1, 600	2, 315	351, 327	2044/01/22
	UK GILT	国 債 証 券	2. 2500	2, 700	2, 785	422, 543	2023/09/07
	UK GILT	国 債 証 券	3. 5000	1, 450	3, 024	458, 881	2068/07/22
	UK GILT	国 債 証 券	2. 7500	600	636	96, 588	2024/09/07
	UK GILT	国 債 証 券	3. 5000	1, 650	2, 505	380, 078	2045/01/22
	UK GILT	国 債 証 券	2. 0000	1, 100	1, 159	175, 957	2025/09/07
	UK GILT	国 債 証 券	2. 5000	1, 600	2, 644	401, 252	2065/07/22
	UK GILT	国 債 証 券	1. 5000	1, 300	1, 357	205, 930	2026/07/22
	UK GILT	国 債 証 券	1. 5000	1, 700	1, 901	288, 431	2047/07/22
	UK GILT	国 債 証 券	1. 7500	900	1, 002	152, 139	2037/09/07
	UK GILT	国 債 証 券	1. 2500	1, 200	1, 246	189, 055	2027/07/22
	UK GILT	国 債 証 券	0. 7500	2, 650	2, 666	404, 607	2023/07/22
	UK GILT	国 債 証 券	1. 6250	900	962	146, 054	2028/10/22
	UK GILT	国 債 証 券	1. 0000	800	810	122, 993	2024/04/22
	UK GILT	国 債 証 券	1. 7500	850	1, 011	153, 498	2049/01/22
	UK GILT	国 債 証 券	1. 6250	500	602	91, 426	2054/10/22
	UK GILT	国 債 証 券	0. 8750	1, 000	1, 018	154, 472	2029/10/22
	UK GILT	国 債 証 券	0. 6250	800	804	122, 031	2025/06/07
	UK GILT	国 債 証 券	0. 3750	1, 800	1, 749	265, 471	2030/10/22
	UK GILT	国 債 証 券	0. 1250	500	499	75, 711	2023/01/31
	UK GILT	国 債 証 券	0. 1250	1, 500	1, 475	223, 897	2026/01/30
	UK GILT	国 債 証 券	0. 6250	600	575	87, 304	2035/07/31
	UK GILT	国 債 証 券	0. 2500	1, 600	1, 523	231, 175	2031/07/31
	UK TSY GILT	国 債 証 券	1. 1250	800	817	124, 058	2039/01/31
小 計			—	48, 450	64, 546	9, 793, 053	—
イ ス ラ エ ル	ISRAEL FIXED BOND	国 債 証 券	3. 7500	千イスラエル・シュケル 4, 100	千イスラエル・シュケル 5, 358	196, 456	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国 債 証 券	1. 5000	2, 900	2, 980	109, 271	2023/11/30
	ISRAEL FIXED BOND	国 債 証 券	6. 2500	3, 300	4, 218	154, 657	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国 債 証 券	2. 2500	1, 500	1, 651	60, 548	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国 債 証 券	0. 1500	6, 600	6, 609	242, 309	2023/07/31
小 計			—	18, 400	20, 818	763, 243	—

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
デン マ ー ク	KINGDOM OF DENMARK	国 債 証 券	4.5000	千デンマーク・クローネ 9,800	千デンマーク・クローネ 17,825	309,272	2039/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国 債 証 券	1.5000	3,000	3,122	54,178	2023/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国 債 証 券	1.7500	3,000	3,261	56,594	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国 債 証 券	0.5000	10,100	10,600	183,919	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国 債 証 券	0.5000	4,000	4,231	73,409	2029/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国 債 証 券	0.2500	2,000	2,051	35,595	2052/11/15
小 計			—	31,900	41,093	712,971	—
ノ ル ウ ェ ー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.0000	千ノルウェー・クローネ 4,000	千ノルウェー・クローネ 4,052	51,341	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.0000	4,000	4,153	52,618	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1.7500	3,000	3,034	38,441	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1.5000	3,500	3,506	44,431	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.0000	9,000	9,267	117,416	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1.7500	4,200	4,265	54,049	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	1.3750	2,000	1,974	25,014	2030/08/19
小 計			—	29,700	30,253	383,313	—
ス ウ ェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5000	千スウェーデン・クローナ 4,600	千スウェーデン・クローナ 7,008	88,373	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT	国 債 証 券	1.5000	7,000	7,230	91,179	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT	国 債 証 券	2.5000	5,000	5,450	68,724	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国 債 証 券	1.0000	6,400	6,720	84,743	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国 債 証 券	0.7500	4,000	4,184	52,767	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国 債 証 券	0.7500	6,000	6,323	79,737	2029/11/12
小 計			—	33,000	36,917	465,525	—
メ キ シ コ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国 債 証 券	8.0000	千メキシコ・ペソ 34,000	千メキシコ・ペソ 34,633	189,418	2023/12/07
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国 債 証 券	10.0000	32,000	34,470	188,523	2024/12/05
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国 債 証 券	7.5000	25,000	25,308	138,414	2027/06/03
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国 債 証 券	8.5000	23,000	24,601	134,551	2029/05/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国 債 証 券	8.5000	40,000	42,603	233,005	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国 債 証 券	7.7500	5,000	5,131	28,066	2031/05/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国 債 証 券	7.7500	18,000	18,440	100,855	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国 債 証 券	5.7500	19,000	18,056	98,755	2026/03/05
MEX BONOS DESARR FIX RT	国 債 証 券	8.0000	5,000	5,036	27,546	2047/11/07	
小 計			—	201,000	208,282	1,139,138	—
中 国	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.6900	千オフショア・人民元 6,000	千オフショア・人民元 5,998	107,077	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.4700	8,000	7,983	142,519	2024/09/02
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5600	8,000	8,013	143,052	2023/10/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9100	8,000	8,014	143,063	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7200	3,000	3,161	56,434	2051/04/12

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3. 0200	6, 000	6, 063	108, 237	2031/05/27
小 計			—	39, 000	39, 234	700, 385	—
マ レ ー シ ア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3. 5020	千マレーシア・リンギット 7, 700	千マレーシア・リンギット 7, 780	210, 259	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4. 4980	5, 000	5, 301	143, 269	2030/04/15
	MALAYSIA GOVERNMENT	国 債 証 券	3. 9550	5, 300	5, 481	148, 119	2025/09/15
	MALAYSIA GOVERNMENT	国 債 証 券	4. 7360	6, 400	6, 767	182, 876	2046/03/15
	MALAYSIA GOVT	国 債 証 券	3. 4780	2, 500	2, 535	68, 507	2024/06/14
	小 計			—	26, 900	27, 865	753, 031
ポ ー ラ ン ド	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5. 7500	千ポーランド・ズロチ 6, 100	千ポーランド・ズロチ 7, 141	198, 867	2029/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2. 7500	6, 000	5, 843	162, 726	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2. 5000	4, 000	3, 989	111, 096	2023/01/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2. 5000	4, 500	4, 463	124, 281	2024/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0. 7500	2, 800	2, 599	72, 395	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1. 2500	1, 800	1, 544	43, 010	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2, 400	2, 311	64, 375	2023/04/25
小 計			—	27, 600	27, 894	776, 753	—
ユ ー ロ				千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	5. 4000	800	954	123, 183	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	3. 9000	500	528	68, 167	2023/03/20
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	3. 4000	500	545	70, 415	2024/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	2. 4000	600	727	93, 860	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	2. 0000	1, 000	1, 324	170, 837	2045/02/18
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	1. 0000	1, 000	1, 064	137, 300	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	1. 7000	300	360	46, 461	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	0. 9000	700	752	97, 038	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	1. 3000	1, 000	1, 126	145, 385	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	1. 3500	500	564	72, 852	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	1. 1000	1, 600	1, 748	225, 540	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国 債 証 券	1. 5000	500	603	77, 818	2050/05/15
オ ラ ン ダ	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	5. 5000	700	958	123, 661	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	4. 0000	1, 800	2, 916	376, 262	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	3. 7500	500	524	67, 674	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	3. 7500	1, 300	2, 288	295, 292	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 5000	600	779	100, 557	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	1. 7500	1, 600	1, 663	214, 625	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 0000	1, 000	1, 069	137, 918	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 7500	1, 600	2, 698	348, 141	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	0. 2500	1, 700	1, 750	225, 850	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	0. 5000	1, 700	1, 784	230, 184	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国 債 証 券	0. 7500	400	428	55, 245	2027/07/15

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期		末		
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ベルギー	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	1,000	1,014	130,818	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	1,500	1,619	208,889	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	500	523	67,474	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,869	241,198	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	1,900	1,946	251,163	2030/07/15
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	1,100	1,516	195,651	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0000	1,000	1,637	211,238	2035/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.2500	1,200	2,039	263,141	2041/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	700	854	110,206	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	500	709	91,559	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	1,300	1,357	175,149	2023/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6000	800	865	111,716	2024/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	800	1,362	175,811	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	200	271	34,990	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	800	839	108,246	2025/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,300	1,433	184,932	2031/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	1,000	1,251	161,404	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,800	1,923	248,129	2026/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	850	1,040	134,248	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.1500	500	743	95,885	2066/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	1,000	1,068	137,839	2027/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.5000	1,300	1,342	173,207	2024/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	500	728	94,016	2057/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	400	468	60,377	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	1,000	1,075	138,783	2028/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	400	456	58,888	2033/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	1,300	1,413	182,384	2029/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	500	630	81,285	2050/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	700	715	92,343	2030/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	300	296	38,243	2040/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	200	179	23,130	2071/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	1,300	1,299	167,677	2031/10/22
フランス	FRANCE OAT.	国債証券	8.5000	600	674	87,003	2023/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	6.0000	3,000	3,768	486,237	2025/10/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.5000	2,750	3,930	507,016	2029/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.7500	400	650	83,935	2032/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.7500	2,200	3,538	456,439	2035/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	1,370	2,714	350,245	2055/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	2,000	3,224	415,982	2038/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.2500	1,000	1,091	140,819	2023/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.5000	2,300	4,061	523,914	2041/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	1,400	2,924	377,282	2060/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	1,400	2,924	377,282	2060/04/25

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期		末		
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	3.5000	2,500	2,937	378,928	2026/04/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	2.7500	3,850	4,568	589,355	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	3.2500	1,700	2,727	351,905	2045/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	1.7500	4,200	4,344	560,535	2023/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	2.2500	3,400	3,640	469,662	2024/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	1.7500	2,600	2,780	358,660	2024/11/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	2.5000	3,500	4,295	554,105	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.5000	2,900	3,004	387,578	2025/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	1.0000	2,050	2,172	280,225	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	1.5000	2,550	2,926	377,502	2031/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.5000	3,500	3,650	470,928	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	1.2500	3,400	3,873	499,740	2036/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	1.7500	800	1,078	139,136	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.2500	2,400	2,481	320,117	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	1.7500	1,800	2,244	289,578	2039/06/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	1.0000	2,500	2,691	347,259	2027/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	2.0000	2,200	2,962	382,254	2048/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.0000	2,000	2,016	260,125	2023/03/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.7500	3,300	3,528	455,223	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	1.2500	3,200	3,623	467,408	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.7500	3,500	3,751	483,973	2028/11/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.0000	4,800	4,868	628,103	2024/03/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	1.5000	2,400	2,933	378,459	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.5000	800	843	108,825	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.0000	1,900	1,933	249,452	2025/03/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.0000	4,500	4,562	588,626	2029/11/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.7500	3,300	3,349	432,140	2052/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.0000	3,100	3,161	407,889	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.0000	3,900	3,928	506,837	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.0000	1,900	1,925	248,462	2024/02/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.5000	100	85	11,006	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国 債 証 券	0.0000	3,800	3,794	489,546	2031/11/25
ド イ ツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	6.2500	1,200	1,374	177,354	2024/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	6.5000	1,000	1,403	181,086	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	5.6250	1,000	1,385	178,769	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	4.7500	1,600	2,171	280,141	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	6.2500	500	779	100,539	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	5.5000	900	1,399	180,605	2031/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	4.7500	600	994	128,290	2034/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	4.0000	1,800	2,985	385,124	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	4.2500	950	1,715	221,346	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	4.7500	1,650	3,211	414,261	2040/07/04

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期		末		
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	3. 2500	700	1, 205	155, 578	2042/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	2. 5000	2, 200	3, 550	458, 051	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	1. 5000	2, 100	2, 154	277, 937	2023/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	2. 0000	2, 000	2, 091	269, 821	2023/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	1. 5000	1, 300	1, 341	173, 019	2023/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	1. 5000	3, 600	3, 794	489, 575	2024/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	1. 7500	2, 200	2, 319	299, 207	2024/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	2. 5000	2, 500	4, 144	534, 649	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 5000	2, 500	2, 595	334, 900	2025/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	1. 0000	1, 300	1, 359	175, 442	2024/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	1. 0000	2, 050	2, 175	280, 653	2025/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 5000	3, 100	3, 246	418, 859	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 2500	2, 300	2, 399	309, 520	2027/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 5000	3, 400	3, 606	465, 276	2027/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	1. 2500	1, 650	2, 229	287, 661	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 5000	2, 100	2, 236	288, 582	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 2500	900	947	122, 196	2028/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 2500	800	843	108, 852	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 0000	3, 500	3, 627	468, 043	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 0000	2, 700	2, 725	351, 594	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 0000	1, 300	1, 348	173, 967	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 0000	3, 800	3, 896	502, 699	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 0000	5, 800	6, 015	776, 070	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国 債 証 券	0. 0000	2, 000	2, 073	267, 522	2031/08/15
	BUNDES OBLIGATION	国 債 証 券	0. 0000	1, 900	1, 918	247, 477	2023/04/14
	BUNDES OBLIGATION	国 債 証 券	0. 0000	1, 600	1, 621	209, 245	2023/10/13
	BUNDES OBLIGATION	国 債 証 券	0. 0000	1, 300	1, 322	170, 562	2024/04/05
	BUNDES OBLIGATION	国 債 証 券	0. 0000	600	612	78, 995	2024/10/18
	BUNDES OBLIGATION	国 債 証 券	0. 0000	3, 500	3, 579	461, 762	2025/04/11
	BUNDES OBLIGATION	国 債 証 券	0. 0000	1, 800	1, 845	238, 067	2025/10/10
	BUNDES OBLIGATION	国 債 証 券	0. 0000	800	822	106, 123	2026/10/09
ス ペ イ ン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	6. 0000	2, 200	3, 145	405, 814	2029/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1. 2000	500	524	67, 616	2040/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	5. 7500	1, 500	2, 341	302, 086	2032/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	4. 2000	1, 650	2, 489	321, 166	2037/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	4. 9000	1, 500	2, 567	331, 249	2040/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	4. 8000	3, 000	3, 342	431, 182	2024/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	4. 7000	1, 500	2, 543	328, 131	2041/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	4. 6500	1, 800	2, 129	274, 725	2025/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	5. 9000	500	643	83, 008	2026/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	5. 4000	2, 250	2, 401	309, 860	2023/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	5. 1500	1, 500	2, 031	262, 038	2028/10/31

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	期		末		
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	5.1500	1,000	1,863	240,463	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	3.8000	1,400	1,544	199,213	2024/04/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	2.7500	2,100	2,297	296,368	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.6000	1,700	1,816	234,333	2025/04/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	2.1500	2,400	2,635	339,945	2025/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.9500	1,700	1,952	251,878	2030/07/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.9500	2,600	2,854	368,260	2026/04/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	4.4000	2,000	2,188	282,335	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	2.9000	1,400	1,975	254,813	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	3.4500	1,300	2,083	268,744	2066/07/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.3000	2,700	2,905	374,890	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.5000	1,200	1,308	168,817	2027/04/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	2.3500	500	604	77,965	2033/07/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.4500	2,600	2,836	365,973	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.4000	2,200	2,400	309,703	2028/04/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	2.7000	1,250	1,720	221,900	2048/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.4000	1,600	1,751	225,897	2028/07/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.4500	2,900	3,191	411,758	2029/04/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.8500	2,700	3,119	402,432	2035/07/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	0.2500	700	713	92,056	2024/07/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	0.5000	1,000	1,025	132,348	2030/04/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	0.8000	400	420	54,241	2027/07/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.0000	300	288	37,206	2050/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	0.0000	1,000	1,013	130,761	2025/01/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.2500	3,000	3,264	421,127	2030/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	1.4500	400	376	48,626	2071/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国 債 証 券	0.5000	1,000	1,010	130,389	2031/10/31
イ タ リ ア	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	9.0000	300	352	45,450	2023/11/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	7.2500	400	537	69,286	2026/11/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	6.5000	1,700	2,302	297,071	2027/11/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	4.7500	2,000	2,558	330,131	2028/09/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	4.5000	2,300	2,458	317,128	2023/05/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	1.6500	2,200	2,352	303,507	2030/12/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	6.0000	2,200	3,227	416,432	2031/05/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	5.7500	1,700	2,548	328,738	2033/02/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	5.0000	2,070	3,004	387,672	2034/08/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	4.0000	2,600	3,555	458,644	2037/02/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	5.0000	1,800	2,798	361,010	2039/08/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	4.7500	2,500	2,709	349,610	2023/08/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	5.0000	1,000	1,161	149,896	2025/03/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	5.0000	1,700	2,685	346,446	2040/09/01	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	4.5000	1,800	2,132	275,073	2026/03/01	

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期		末		
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	4.5000	1,000	1,104	142,505	2024/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	4.7500	1,600	2,555	329,716	2044/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	3.7500	2,300	2,542	328,015	2024/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	3.5000	4,400	5,384	694,671	2030/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.5000	600	645	83,335	2024/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	3.2500	1,500	1,972	254,456	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	1.5000	2,700	2,840	366,509	2025/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.0000	1,300	1,399	180,534	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	1.6000	1,200	1,276	164,695	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.7000	1,550	1,866	240,804	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	0.9500	2,000	2,035	262,584	2023/03/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.2500	500	565	72,906	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	1.2500	800	840	108,412	2026/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	0.6500	2,000	2,037	262,857	2023/10/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.8000	600	701	90,518	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.4500	1,100	1,262	162,858	2033/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.2000	2,300	2,534	327,027	2027/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	1.8500	3,000	3,148	406,207	2024/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	3.4500	1,400	1,910	246,476	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.0500	1,500	1,640	211,703	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	1.4500	1,800	1,881	242,711	2024/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.9500	1,300	1,603	206,925	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.0000	3,900	4,271	551,098	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	0.9500	2,000	2,034	262,434	2023/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	1.4500	1,000	1,050	135,474	2025/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.8000	1,300	1,501	193,720	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.5000	2,100	2,300	296,831	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	3.3500	850	1,069	137,943	2035/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	3.8500	1,100	1,607	207,330	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	3.0000	3,000	3,529	455,340	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.1000	1,000	1,087	140,346	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	3.1000	900	1,132	146,103	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	0.3500	2,700	2,735	352,865	2025/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	0.8500	1,700	1,749	225,674	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	0.9500	1,800	1,822	235,113	2030/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	1.4500	200	205	26,475	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	2.4500	900	1,032	133,224	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	1.8500	1,000	1,064	137,364	2025/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	0.9500	800	825	106,504	2027/09/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	0.5000	1,000	1,015	131,003	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	1.7000	1,500	1,470	189,698	2051/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国 債 証 券	0.9000	2,000	2,001	258,234	2031/04/01

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期		評 価 額		末
			利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国 債 証 券	4. 0000	600	699	90, 303	2025/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 7500	400	483	62, 356	2028/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 6250	1, 000	1, 499	193, 450	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国 債 証 券	1. 5000	1, 000	1, 029	132, 841	2023/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国 債 証 券	2. 0000	1, 000	1, 064	137, 280	2024/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国 債 証 券	0. 7500	500	542	69, 955	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国 債 証 券	1. 3750	300	386	49, 852	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国 債 証 券	0. 5000	400	422	54, 531	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国 債 証 券	0. 5000	800	848	109, 416	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国 債 証 券	0. 2500	300	303	39, 114	2040/09/15
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	6. 2500	1, 000	1, 381	178, 195	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	4. 1500	500	806	104, 054	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	4. 8500	500	616	79, 560	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	3. 8000	700	1, 526	196, 928	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	3. 1500	600	983	126, 904	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	1. 7500	1, 000	1, 045	134, 881	2023/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	2. 4000	300	388	50, 150	2034/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	1. 6500	800	853	110, 086	2024/10/21
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	1. 2000	1, 000	1, 068	137, 830	2025/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	0. 7500	900	953	123, 061	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	1. 5000	900	1, 152	148, 632	2047/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	0. 0000	1, 100	1, 111	143, 447	2023/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	0. 5000	800	840	108, 394	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	0. 7500	700	748	96, 547	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	0. 5000	550	580	74, 863	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	0. 0000	900	912	117, 734	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	0. 7500	1, 100	1, 197	154, 455	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	1. 5000	200	280	36, 199	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	0. 8500	150	148	19, 188	2120/06/30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国 債 証 券	0. 0000	800	806	104, 036	2031/02/20
小 計			—	410, 340	483, 645	62, 395, 101	—
合 計			—	—	—	160, 912, 922	—

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

※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。

■ 投資信託財産の構成

(2021年12月17日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	160,912,922	97.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,496,304	2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	164,409,226	100.0

※期末における外貨建資産（162,014,412千円）の投資信託財産総額（164,409,226千円）に対する比率は98.5%です。
※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1
アメリカ・ドル＝113.87円、1カナダ・ドル＝89.11円、1オーストラリア・ドル＝81.71円、1シンガポール・ドル＝83.54円、1イギリ
ス・ポンド＝151.72円、1イスラエル・シェケル＝36.661円、1デンマーク・クローネ＝17.35円、1ノルウェー・クローネ＝12.67円、
1スウェーデン・クローナ＝12.61円、1メキシコ・ペソ＝5.469円、1オフショア・人民元＝17.851円、1マレーシア・リンギット＝
27.023円、1ポーランド・ズロチ＝27.846円、1ユーロ＝129.01円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	164,409,226,262円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,578,784,960
公 社 債(評価額)	160,912,922,160
未 収 利 息	888,434,735
前 払 費 用	29,084,407
(B) 負 債	2,015,915,423
未 払 金	1,724,888,171
未 払 解 約 金	291,025,136
そ の 他 未 払 費 用	2,116
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	162,393,310,839
元 本	81,412,102,331
次 期 繰 越 損 益 金	80,981,208,508
(D) 受 益 権 総 口 数	81,412,102,331口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,947円

※当期における期首元本額84,615,543,547円、期中追加設定元本
額10,172,463,204円、期中一部解約元本額13,375,904,420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18日 至2021年12月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,166,650,876円
受 取 利 息	3,167,076,148
支 払 利 息	△ 425,272
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,840,609,519
売 買 益	10,688,072,440
売 買 損	△ 6,847,462,921
(C) そ の 他 費 用 等	△ 61,469,784
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	6,945,790,611
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	77,074,312,782
(F) 解 約 差 損 益 金	△12,777,364,915
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,738,470,030
(H) 合 計(D＋E＋F＋G)	80,981,208,508
次 期 繰 越 損 益 金(H)	80,981,208,508

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	24,487,844,372円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,563,065,943円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	760,198,503円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	10,603,737,345円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,105,125,950円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,392,217円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,119,007,643円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	93,650,011円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	155,624,983円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	718,495,736円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	6,821,569円	SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	117,631,749円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	29,780,404円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,068,564,548円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	100,943,914円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,438,731,860円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	215,809,603円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,547,910,459円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	146,490,369円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,874,996,538円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	247,645,688円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	627,347円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	25,113,488円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,237,337,020円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	75,454,990円	三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	331,971,594円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	112,630,498円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	150,359,802円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	63,013,857円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	81,175,759円
イオン・バランス戦略ファンド	117,794,452円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	33,971,193円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,988,179円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	66,333,551円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	96,352,849円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	49,304,278円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	426,754,581円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	119,676,115円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	104,874,447円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	34,468,587円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,181,590円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	16,515,743円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	117,826,123円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,046,403,883円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	227,846,301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>	648,746,322円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	12,061,797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>	960,695,213円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	35,271,630円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,134,108,974円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	23,882,832円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	404,802,053円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,248,709円	SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド<適格機関投資家限定>	51,663,081円
日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	163,477,935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>	141,011,485円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	3,442,227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>	295,647,332円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,390,473,483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>	321,381,894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>	44,105,389円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	1,395,550,617円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	7,335,907,258円		

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。