

■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
信託期間	無期限（設定日：2008年3月31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、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、各ファンドのターゲットイヤーに向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下の各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 外国債券パッシブ・マザーファンド FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）採用国の国債 マネーインカム・マザーファンド 円貨建の短期公社債および短期金融商品
当ファンドの運用方法	<ul style="list-style-type: none"> ■日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行います。 ■基本資産配分は、ターゲットイヤー*までの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とします。基本資産配分は、原則として年1回決算時に変更します。 ※各ファンドのターゲットイヤーは次の通りです。 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020…西暦2020年 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025…西暦2025年 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030…西暦2030年 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035…西暦2035年 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040…西暦2040年 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045…西暦2045年 ■実質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。
組入制限	当ファンド <ul style="list-style-type: none"> ■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。 ■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70%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） <ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。 国内債券パッシブ・マザーファンド <ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■外貨建資産への投資は行いません。 外国株式インデックス・マザーファンド <ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 外国債券パッシブ・マザーファンド <ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 マネーインカム・マザーファンド <ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	年1回（原則として毎年4月13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。

三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2020/2025/2030/ 2035/2040/2045 (4資産タイプ)

【運用報告書(全体版)】

(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

第 11 期

決算日 2019年4月15日

受益者の皆さまへ

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、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、各ファンドのターゲットイヤーに向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

 **三井住友DSアセットマネジメント**
 (旧:三井住友アセットマネジメント)
 〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1
<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

フリーダイヤル 0120-88-2976
 受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

■最近5期の運用実績

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）

決算期	基準価額			株式組入 比率	株式先物 比率 (買建-売建)	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率					
	円	円	%	%	%	%	%	百万円
7期(2015年4月13日)	12,311	0	10.0	20.6	0.4	77.7	0.2	104
8期(2016年4月13日)	12,190	0	△1.0	18.4	0.4	72.6	0.2	129
9期(2017年4月13日)	12,318	0	1.1	17.2	0.4	74.4	0.1	161
10期(2018年4月13日)	12,731	0	3.4	16.0	0.4	73.8	0.1	179
11期(2019年4月15日)	12,797	0	0.5	14.9	0.4	72.8	0.1	199

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）

決算期	基準価額			株式組入 比率	株式先物 比率 (買建-売建)	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率					
	円	円	%	%	%	%	%	百万円
7期(2015年4月13日)	12,932	0	13.9	28.9	0.5	68.8	0.2	152
8期(2016年4月13日)	12,613	0	△2.5	26.1	0.6	70.4	0.2	207
9期(2017年4月13日)	12,841	0	1.8	24.4	0.5	71.9	0.2	308
10期(2018年4月13日)	13,523	0	5.3	23.6	0.6	71.7	0.2	381
11期(2019年4月15日)	13,661	0	1.0	22.3	0.5	72.5	0.2	431

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）

決算期	基準価額			株式組入 比率	株式先物 比率 (買建-売建)	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率					
	円	円	%	%	%	%	%	百万円
7期(2015年4月13日)	13,691	0	17.9	39.9	0.7	57.6	0.4	118
8期(2016年4月13日)	13,053	0	△4.7	37.1	0.9	59.6	0.4	512
9期(2017年4月13日)	13,448	0	3.0	34.1	0.7	63.2	0.3	590
10期(2018年4月13日)	14,419	0	7.2	32.7	0.9	64.7	0.3	700
11期(2019年4月15日)	14,621	0	1.4	31.0	0.7	66.2	0.3	802

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）

決算期	基準価額			株式組入 比率	株式先物 比率 (買建-売建)	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率					
	円	円	%	%	%	%	%	百万円
7期(2015年4月13日)	14,331	0	21.3	50.3	0.9	47.3	0.5	152
8期(2016年4月13日)	13,306	0	△7.2	48.7	1.3	47.5	0.5	317
9期(2017年4月13日)	13,954	0	4.9	46.2	1.0	50.8	0.5	476
10期(2018年4月13日)	15,233	0	9.2	44.4	1.2	52.2	0.4	656
11期(2019年4月15日)	15,510	0	1.8	42.5	1.0	54.5	0.4	945

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

決算期	基準価額			株式組入 比率	株式先物 比率 (買建-売建)	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率					
	円	円	%	%	%	%	%	百万円
7期(2015年4月13日)	14,379	0	22.2	52.9	1.0	44.0	0.5	81
8期(2016年4月13日)	13,267	0	△7.7	51.6	1.3	44.7	0.6	178
9期(2017年4月13日)	14,009	0	5.6	50.5	1.1	46.3	0.6	236
10期(2018年4月13日)	15,438	0	10.2	50.6	1.4	45.7	0.5	331
11期(2019年4月15日)	15,763	0	2.1	50.6	1.2	45.9	0.5	494

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）

決算期	基準価額			株式組入 比率	株式先物 比率 (買建-売建)	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率					
	円	円	%	%	%	%	%	百万円
7期(2015年4月13日)	14,615	0	23.3	56.1	1.0	40.7	0.6	172
8期(2016年4月13日)	13,389	0	△8.4	54.4	1.4	41.7	0.6	376
9期(2017年4月13日)	14,221	0	6.2	53.8	1.1	42.7	0.6	572
10期(2018年4月13日)	15,749	0	10.7	53.8	1.5	42.5	0.5	867
11期(2019年4月15日)	16,081	0	2.1	53.5	1.3	43.3	0.6	1,166

※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。

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）

年 月 日	基 準 価 額		株式組入 比 率	株式先物 比 率 (買建-売建)	債券組入 比 率	投資信託 証券組入 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2018年4月13日	12,731	—	16.0	0.4	73.8	0.1
4月末	12,765	0.3	14.7	0.3	74.4	0.1
5月末	12,726	△0.0	14.1	0.4	72.0	0.1
6月末	12,732	0.0	14.3	0.4	71.8	0.1
7月末	12,770	0.3	14.6	0.2	71.7	0.1
8月末	12,740	0.1	14.5	0.3	73.8	0.1
9月末	12,830	0.8	14.9	0.4	72.4	0.1
10月末	12,633	△0.8	14.5	0.4	72.2	0.1
11月末	12,688	△0.3	14.4	0.5	73.3	0.1
12月末	12,513	△1.7	13.9	0.4	71.0	0.1
2019年1月末	12,617	△0.9	14.7	0.2	71.3	0.1
2月末	12,705	△0.2	14.7	0.2	68.0	0.1
3月末	12,753	0.2	14.4	0.4	71.9	0.1
(期 末) 2019年4月15日	12,797	0.5	14.9	0.4	72.8	0.1

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）

年 月 日	基 準 価 額		株式組入 比 率	株式先物 比 率 (買建-売建)	債券組入 比 率	投資信託 証券組入 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2018年4月13日	13,523	—	23.6	0.6	71.7	0.2
4月末	13,582	0.4	22.1	0.5	73.0	0.1
5月末	13,516	△0.1	21.3	0.6	72.4	0.1
6月末	13,531	0.1	21.5	0.6	72.5	0.2
7月末	13,593	0.5	21.9	0.3	72.3	0.2
8月末	13,549	0.2	21.9	0.5	72.8	0.2
9月末	13,702	1.3	22.1	0.6	72.4	0.1
10月末	13,391	△1.0	21.4	0.6	72.7	0.1
11月末	13,479	△0.3	21.7	0.7	72.8	0.2
12月末	13,197	△2.4	21.7	0.6	71.7	0.2
2019年1月末	13,366	△1.2	22.1	0.3	72.0	0.2
2月末	13,512	△0.1	22.3	0.2	70.8	0.2
3月末	13,587	0.5	21.7	0.6	72.5	0.2
(期 末) 2019年4月15日	13,661	1.0	22.3	0.5	72.5	0.2

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）

年 月 日	基 準 価 額		株式組入 比 率	株式先物 比 率 (買建-売建)	債券組入 比 率	投資信託 証券組入 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2018年4月13日	14,419	% -	% 32.7	% 0.9	% 64.7	% 0.3
4月末	14,517	0.7	30.8	0.7	67.0	0.2
5月末	14,413	△0.0	29.9	0.8	66.9	0.2
6月末	14,438	0.1	30.0	0.9	67.3	0.2
7月末	14,542	0.9	30.6	0.4	66.9	0.2
8月末	14,503	0.6	30.7	0.7	66.6	0.2
9月末	14,742	2.2	30.8	0.8	66.4	0.2
10月末	14,268	△1.0	30.3	0.9	66.8	0.2
11月末	14,389	△0.2	30.5	1.0	66.6	0.2
12月末	13,948	△3.3	29.5	0.8	67.3	0.2
2019年1月末	14,186	△1.6	30.9	0.5	66.4	0.3
2月末	14,403	△0.1	31.0	0.3	66.4	0.3
3月末	14,494	0.5	30.5	0.9	66.9	0.3
(期 末) 2019年4月15日	14,621	1.4	31.0	0.7	66.2	0.3

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）

年 月 日	基 準 価 額		株式組入 比 率	株式先物 比 率 (買建-売建)	債券組入 比 率	投資信託 証券組入 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2018年4月13日	15,233	% -	% 44.4	% 1.2	% 52.2	% 0.4
4月末	15,382	1.0	42.1	1.0	54.8	0.4
5月末	15,265	0.2	41.6	1.1	55.0	0.4
6月末	15,293	0.4	41.7	1.3	55.1	0.4
7月末	15,458	1.5	42.3	0.6	54.9	0.4
8月末	15,439	1.4	42.4	1.0	54.6	0.4
9月末	15,769	3.5	42.0	1.1	54.9	0.4
10月末	15,093	△0.9	40.9	1.2	55.3	0.4
11月末	15,248	0.1	41.8	1.4	54.7	0.4
12月末	14,576	△4.3	40.7	1.2	55.5	0.4
2019年1月末	14,917	△2.1	42.1	0.7	54.9	0.4
2月末	15,217	△0.1	42.4	0.5	54.6	0.4
3月末	15,309	0.5	41.7	1.2	55.1	0.4
(期 末) 2019年4月15日	15,510	1.8	42.5	1.0	54.5	0.4

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

年 月 日	基 準 価 額		株式組入 比 率	株式先物 比 率 (買建-売建)	債券組入 比 率	投資信託 証券組入 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2018年4月13日	15,438	% -	% 50.6	% 1.4	% 45.7	% 0.5
4月末	15,621	1.2	50.5	1.2	46.1	0.5
5月末	15,494	0.4	49.6	1.4	46.6	0.5
6月末	15,523	0.6	49.8	1.5	46.6	0.5
7月末	15,730	1.9	50.2	0.7	46.7	0.5
8月末	15,728	1.9	50.4	1.1	46.4	0.5
9月末	16,121	4.4	50.4	1.3	46.1	0.5
10月末	15,299	△0.9	49.5	1.5	47.0	0.5
11月末	15,474	0.2	49.9	1.7	46.2	0.5
12月末	14,649	△5.1	48.9	1.4	47.3	0.5
2019年1月末	15,059	△2.5	50.4	0.8	46.4	0.5
2月末	15,419	△0.1	50.6	0.6	46.2	0.5
3月末	15,508	0.5	49.8	1.4	46.6	0.5
(期 末) 2019年4月15日	15,763	2.1	50.6	1.2	45.9	0.5

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）

年 月 日	基 準 価 額		株式組入 比 率	株式先物 比 率 (買建-売建)	債券組入 比 率	投資信託 証券組入 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2018年4月13日	15,749	% -	% 53.8	% 1.5	% 42.5	% 0.5
4月末	15,949	1.3	53.8	1.3	43.3	0.5
5月末	15,811	0.4	52.5	1.5	43.6	0.5
6月末	15,841	0.6	52.5	1.6	43.8	0.5
7月末	16,065	2.0	53.4	0.7	43.6	0.5
8月末	16,069	2.0	53.2	1.2	43.4	0.5
9月末	16,486	4.7	52.8	1.4	43.6	0.5
10月末	15,606	△0.9	51.5	1.6	44.2	0.5
11月末	15,791	0.3	52.8	1.8	43.1	0.5
12月末	14,891	△5.4	51.6	1.5	44.7	0.5
2019年1月末	15,328	△2.7	53.4	0.9	43.3	0.6
2月末	15,714	△0.2	53.5	0.6	43.3	0.6
3月末	15,804	0.3	52.7	1.5	43.6	0.6
(期 末) 2019年4月15日	16,081	2.1	53.5	1.3	43.3	0.6

※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（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）

基準価額等の推移

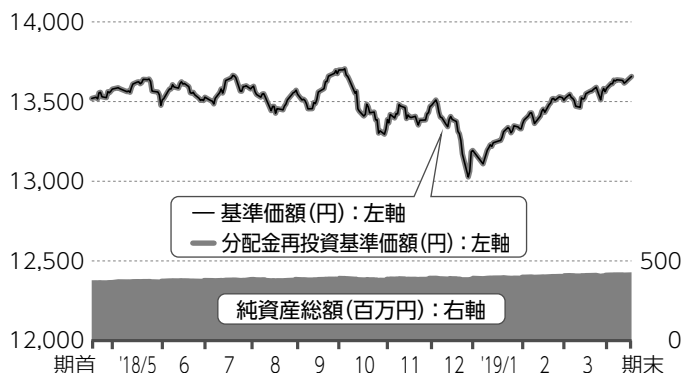


期首	12,731円
期末	12,797円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+0.5% (分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、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。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）

基準価額等の推移

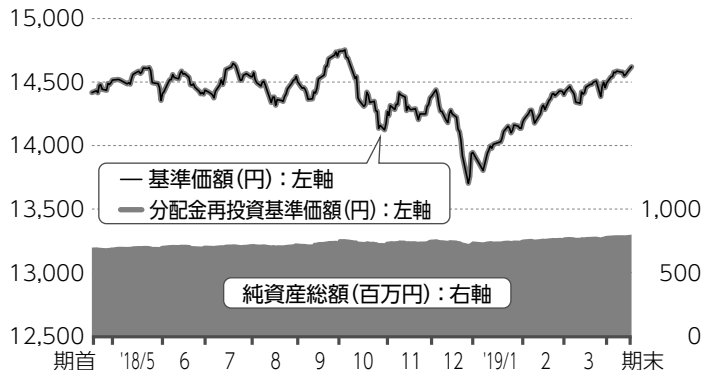


期首	13,523円
期末	13,661円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+1.0% (分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、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。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)

基準価額等の推移

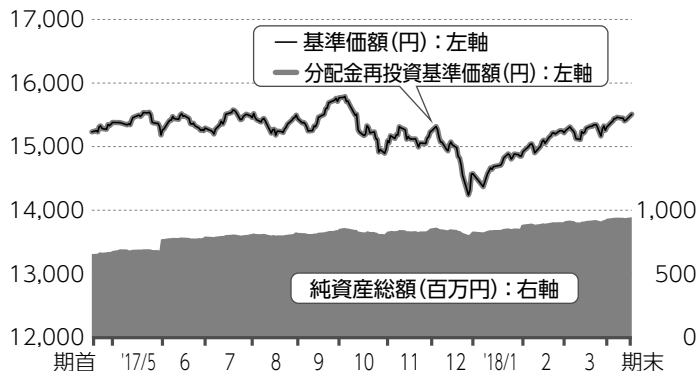


期首	14,419円
期末	14,621円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+1.4% (分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、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。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)

基準価額等の推移

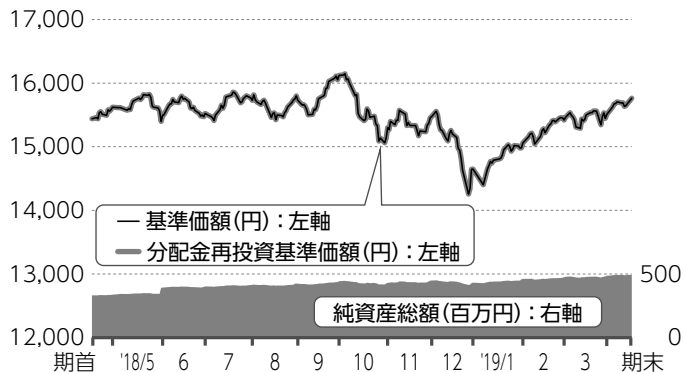


期首	15,233円
期末	15,510円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+1.8% (分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、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。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)

基準価額等の推移

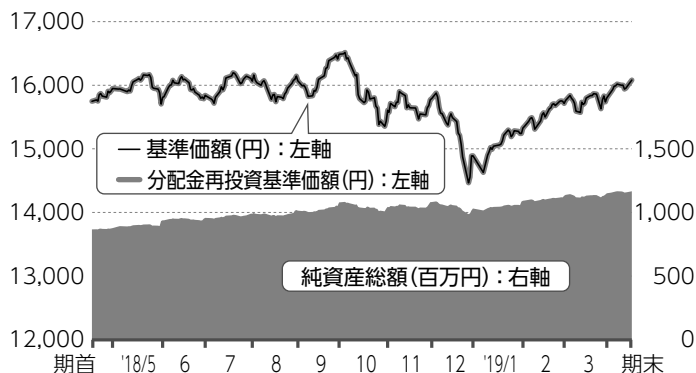


※分配金再投資基準価額は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	15,438円
期末	15,763円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+2.1% (分配金再投資ベース)

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、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	15,749円
期末	16,081円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+2.1% (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)

基準価額の主な変動要因(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045

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、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、各ファンドのターゲットイヤーに向けた運用を行いました。実質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でした。

なお、各ファンドのターゲットイヤーは、三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020…西暦2020年、三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025…西暦2025年、三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030…西暦2030年、三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035…西暦2035年、三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040…西暦2040年、三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045…西暦2045年となっています。

上昇要因

- 海外の株式市場が上昇したこと
- 円に対して米ドルが上昇したこと

下落要因

- 国内株式市場が下落したこと
- 円に対してユーロが下落したこと

組入れファンドの状況

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)

組入れファンド	投資資産	騰落率	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	-3.5%	10.2%
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	+1.4%	35.6%
外国株式インデックス・マザーファンド	外国株式	+11.4%	5.2%
外国債券パッシブ・マザーファンド	外国債券	+2.6%	8.4%
マネーインカム・マザーファンド	短期金融資産	-0.1%	40.1%

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)

組入れファンド	投資資産	騰落率	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	-3.5%	15.9%
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	+1.4%	49.3%
外国株式インデックス・マザーファンド	外国株式	+11.4%	7.2%
外国債券パッシブ・マザーファンド	外国債券	+2.6%	14.0%
マネーインカム・マザーファンド	短期金融資産	-0.1%	13.3%

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)

組入れファンド	投資資産	騰落率	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	-3.5%	21.2%
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	+1.4%	45.5%
外国株式インデックス・マザーファンド	外国株式	+11.4%	10.8%
外国債券パッシブ・マザーファンド	外国債券	+2.6%	19.8%
マネーインカム・マザーファンド	短期金融資産	-0.1%	1.8%

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)

組入れファンド	投資資産	騰落率	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	-3.5%	26.8%
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	+1.4%	33.8%
外国株式インデックス・マザーファンド	外国株式	+11.4%	17.2%
外国債券パッシブ・マザーファンド	外国債券	+2.6%	19.7%
マネーインカム・マザーファンド	短期金融資産	-0.1%	1.8%

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)

組入れファンド	投資資産	騰落率	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	-3.5%	30.1%
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	+1.4%	25.4%
外国株式インデックス・マザーファンド	外国株式	+11.4%	22.3%
外国債券パッシブ・マザーファンド	外国債券	+2.6%	19.6%
マネーインカム・マザーファンド	短期金融資産	-0.1%	1.8%

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)

組入れファンド	投資資産	騰落率	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	-3.5%	31.7%
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	+1.4%	22.6%
外国株式インデックス・マザーファンド	外国株式	+11.4%	23.7%
外国債券パッシブ・マザーファンド	外国債券	+2.6%	19.7%
マネーインカム・マザーファンド	短期金融資産	-0.1%	1.8%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

海外の株式市場が上昇する一方で、国内株式市場は下落しました。国内債券・外国債券共に利回りは低下（価格は上昇）しました。為替市場では、米ドルが円に対して上昇、ユーロが円に対して下落する展開となりました。

国内株式

期首から9月にかけては、米国株の持直しや円高の一服などを好感する一方で、米中貿易摩擦に対する警戒感等を背景に、もみあいでも推移しました。10月以降は、米国株の下落や米ドルの下落などを受け、国内株式も年末にかけて下落しました。年明け以降は、米国株式の反発等もあり、年末にかけて上昇基調で推移しましたが、先行きの企業業績に対する慎重な見方や一時的に円高が進んだことなどもあり、戻りは限定的でした。

当期の市場の動きを代表的な指数であるTOPIX（東証株価指数、配当込み）で見ると、期首に比べて3.6%下落しました。

国内債券

期首から7月中旬まで、日銀による低金利政策の維持等を背景に、長期金利（10年国債利回り）は概ね0～0.05%の低位で推移しました。7月下旬に日銀の金融緩和策修正の思惑が広がったことや、8月月初の金融政策決定会合で長期金利の変動幅の拡大を容認したことなどを背景に、10月上旬にかけて長期

金利は0.15%程度まで上昇する動きとなりました。10月半ば以降は、株価の下落や世界的な債券利回りの低下の影響等から期末まで低下基調となり、2月以降は概ねマイナス圏で推移しました。

当期の市場の動きを代表的な指数であるNOMURA-BPI（総合）で見ると、期首に比べて1.4%の上昇となりました。

外国株式

主要先進国の株価は、期首から9月にかけて、企業業績に対する期待感等を背景に米国株式を中心にじり高傾向で推移しました。10月以降は、米中貿易摩擦に対する不透明感等を背景に、年末まで下落基調で推移しました。年明けから年末にかけては、FRB（米連邦準備制度理事会）が利上げに慎重姿勢を示したことを好感し、米国株式を中心に上昇基調で推移しました。

当期の市場の動きを代表的な指数であるMSCIコクサイインデックス（配当込み、米ドルベース）で見ると、期首に比べて7.2%上昇しました。

外国債券

米国の債券市場では、F R Bによる政策金利引上げの継続や株式の上昇等を背景に、期初から10月半ばにかけて、利回りが上昇傾向で推移しました。11月以降は、株価の下落、年明け以降は米国の利上げ見通しの後退などを背景に、利回りは期末まで低下傾向で推移しました。

欧州の債券市場では、イタリアの政局を巡る不透明感や、関係の深いトルコの政治・経済情勢の不安定化、英国のE U (欧州連合) 離脱に向けた混乱等を背景に、期を通して利回りは低下基調で推移しました。

当期の米国10年国債利回りは期首2.84%から期末2.57%に低下しました。ドイツ10年国債利回りは期首0.52%から期末0.06%に低下しました。

当期の市場の動きを代表的な指数であるF T S E 世界国債インデックス (除く日本、米ドルベース) でみると、米欧等の主要先進国で債券利回りが低下したものの、米ドルに対してユーロが下落したこともあり、期首比で1.6%の下落となりました。

外国為替

米ドル・円相場は、期首から11月にかけて、底堅い米国景気動向や、米国で利上げが続いたことを背景に、米ドルが円に対して上昇しました。12月には米国株の急落から投資家のリスク回避姿勢が強まったことで、米ドルが急落しました。年明け以降は、F R Bが利上げに慎重な姿勢を示したことで株価が反発に転じ、リスク回避姿勢の後退を受け米ドルが期末まで上昇基調で推移しました。

当期の米ドル・円は、期首107円41銭から期末112円01銭と4円60銭の米ドル高・円安となりました。

ユーロは、対米ドルおよび対円で下落しました。米中貿易摩擦問題等により世界景気に対する減速懸念が強まるとともに、イタリアやスペインの政治動向の不安定化やイギリスのE U 離脱交渉における混乱など、通貨ユーロを取り巻く不安材料が払拭されず、期を通じてユーロの下押し材料となりました。

当期のユーロ・円は、期首132円40銭から期末126円60銭と5円80銭のユーロ安・円高となりました。

ポートフォリオについて（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド 2020/2025/2030/2035/2040/2045

追加信託や一部解約等の資金流出入に応じて、各マザーファンドの売買を行いました。各資産の時価変動等に伴う組入比率の変化については、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に対する調整を図っています。

実際の組入比率と基準値との乖離が拡大し、資金流出入に対応した売買のみでは調整が困難となった局面においては、必要に応じてリバランス（投資配分比率調整を目的とした親投資信託の売買）を実施することで乖離の調整に努めました。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数、配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、東証1部上場銘柄のうち流動性や信用リスクを考慮して投資し、また、連動性を高めつつ、ファンドの資金流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NOMUR A-BPI（総合）に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、デュレーション（投資資金の平均回収期間）、満期・債券種別・格付け構成などをベンチマークに合わせつつ、個別銘柄については分散投資を図りました。また、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランスを行いました。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）に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

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

また、MSCIコクサイインデックスの定期銘柄見直しに応じて、ポートフォリオの修

正を行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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

インデックス構成銘柄の変更が実施される

毎月末において、ファンドの特性値(国別比率、デュレーション等)をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランスを行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

マネーインカム・マザーファンド

主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

ベンチマークとの差異について(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

各ファンドはベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

分配金について（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045

当期の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りといたしました。

なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

（単位：円、1万円当たり、税引前）

項 目	第11期					
	2020	2025	2030	2035	2040	2045
当期分配金	—	—	—	—	—	—
（対基準価額比率）	（—％）	（—％）	（—％）	（—％）	（—％）	（—％）
当期の収益	—	—	—	—	—	—
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,886	4,744	6,441	6,870	6,280	6,775

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

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

2 今後の運用方針

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045

引き続き、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産を主要投資対象とするマザーファンドに国際分散投資を行います。長期的な視点に基づき時間的経過に従い資産配分を変更し、値上がり益の獲得と配当等収益の獲得により、信託財産の着実な成長を目指した運用を目指します。

今後の資産配分方針は下記の通りです。

	2020	2025	2030	2035	2040	2045
国内株式	9.0%	14.0%	19.5%	25.0%	30.0%	31.0%
国内債券	32.0%	50.0%	50.0%	37.0%	26.5%	23.5%
外国株式	4.0%	7.0%	10.0%	16.0%	21.5%	23.5%
外国債券	8.0%	12.5%	18.5%	20.0%	20.0%	20.0%
短期金融資産	47.0%	16.5%	2.0%	2.0%	2.0%	2.0%

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

引き続き、TOPIX（東証株価指数、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

流動性や信用リスクに懸念のある銘柄を除き、個別銘柄においてもTOPIX時価ウェイトに沿った投資を行い、トラッキングエラーを抑制します。また、先物を含めた実質株式組入比率を高位に保つことを基本とします。

国内債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、NOMURA-BPI（総合）に

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

外国株式インデックス・マザーファンド

引き続き、MSCIコクサインデックス（配当込み、円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

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（先物含む）を高位に保つことを基本とします。

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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

また月次のベンチマーク更新時や、日々の

資金流入に対応し、迅速なリバランスを行います。

債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

マネーインカム・マザーファンド

円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

3 お知らせ

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045

合併について

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友DSアセットマネジメント株式会社に変更しました。

約款変更について

- 一般社団法人投資信託協会規則の「信用リスク集中回避のための投資制限」に適合するよう、所要の変更を行いました。（適用日：2018年7月11日）
- 委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。（適用日：2019年4月1日）

■ 1万口当たりの費用明細(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	58円 (26) (28) (4)	0.456% (0.206) (0.217) (0.033)	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) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 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：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 (株式) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0)	0.001 (0.000) (0.000) (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
(c) 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	0 (0) (0)	0.000 (0.000) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	2 (1) (1) (1)	0.018 (0.005) (0.005) (0.008)	その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送回数・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	60	0.475	

期中の平均基準価額は12,706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。

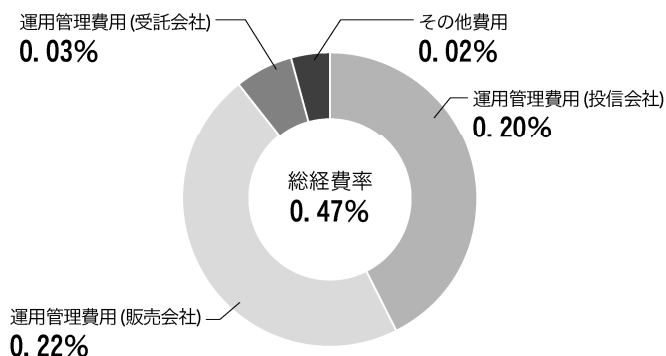
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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）

当ファンドの費用は以下の通りです。（マザーファンド含む）



※各費用は、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す。

※各費用は、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、年率換算した値です。

※上記の前提条件で算出したものです。このため、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（1万口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.47%です。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	62円 (28) (29) (4)	0.456% (0.206) (0.217) (0.033)	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) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 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：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 (株式) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0)	0.001 (0.000) (0.000) (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
(c) 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	0 (0) (0)	0.000 (0.000) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	2 (1) (1) (1)	0.018 (0.008) (0.005) (0.004)	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付金・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	64	0.475	

期中の平均基準価額は13,500円です。

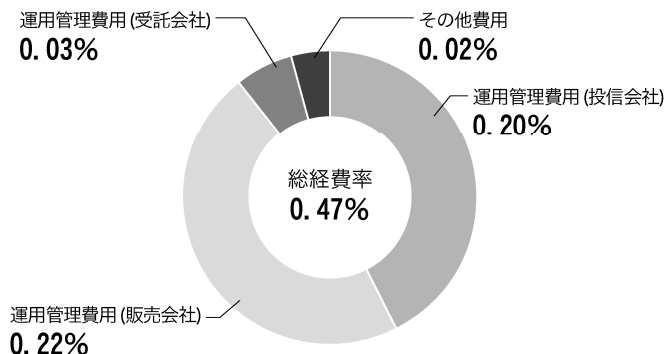
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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）

当ファンドの費用は以下の通りです。（マザーファンド含む）



※各費用は、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す。

※各費用は、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、年率換算した値です。

※上記の前提条件で算出したものです。このため、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（1万口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.47%です。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	66円 (30) (31) (5)	0.456% (0.206) (0.217) (0.033)	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) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 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：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 (株式) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0)	0.001 (0.001) (0.000) (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
(c) 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	0 (0) (0)	0.000 (0.000) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	3 (2) (1) (0)	0.020 (0.012) (0.005) (0.003)	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付金・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	69	0.477	

期中の平均基準価額は14,403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。

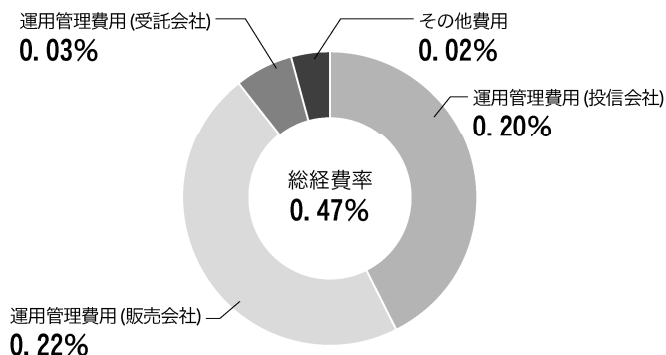
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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）

当ファンドの費用は以下の通りです。（マザーファンド含む）



※各費用は、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す。

※各費用は、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、年率換算した値です。

※上記の前提条件で算出したものです。このため、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（1万口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.47%です。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	70円 (31) (33) (5)	0.456% (0.206) (0.217) (0.033)	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) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 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：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 (株式) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0)	0.002 (0.001) (0.000) (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
(c) 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	0 (0) (0)	0.001 (0.001) (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
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	4 (2) (1) (1)	0.024 (0.014) (0.005) (0.004)	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付金・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	74	0.483	

期中の平均基準価額は15,247円です。

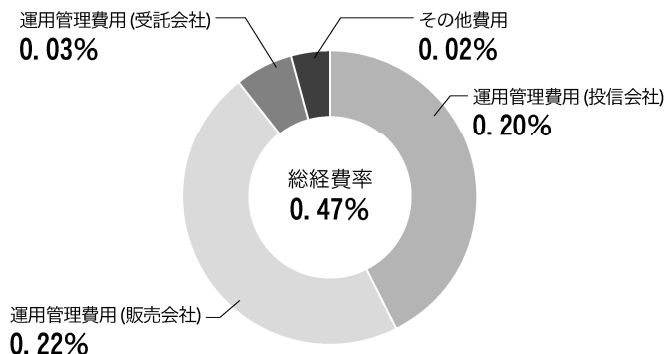
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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）

当ファンドの費用は以下の通りです。（マザーファンド含む）



※各費用は、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す。

※各費用は、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、年率換算した値です。

※上記の前提条件で算出したものです。このため、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（1万口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.47%です。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	71円 (32) (34) (5)	0.456% (0.206) (0.217) (0.033)	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) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 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：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 (株式) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0)	0.002 (0.001) (0.000) (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
(c) 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	0 (0) (0)	0.001 (0.001) (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
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	4 (3) (1) (1)	0.027 (0.016) (0.005) (0.005)	その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	75	0.486	

期中の平均基準価額は15,468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。

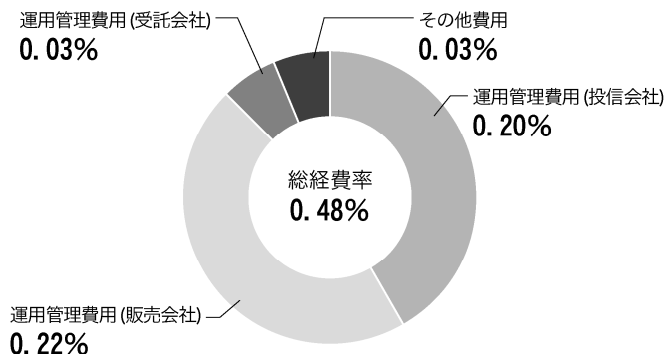
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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）

当ファンドの費用は以下の通りです。（マザーファンド含む）



※各費用は、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す。

※各費用は、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、年率換算した値です。

※上記の前提条件で算出したものです。このため、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（1万口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.48%です。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	72円 (33) (34) (5)	0.456% (0.206) (0.217) (0.033)	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) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 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：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 (株式) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0)	0.003 (0.001) (0.000) (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
(c) 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	0 (0) (0)	0.001 (0.001) (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
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	4 (3) (1) (1)	0.027 (0.017) (0.005) (0.005)	その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	76	0.487	

期中の平均基準価額は15,779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。

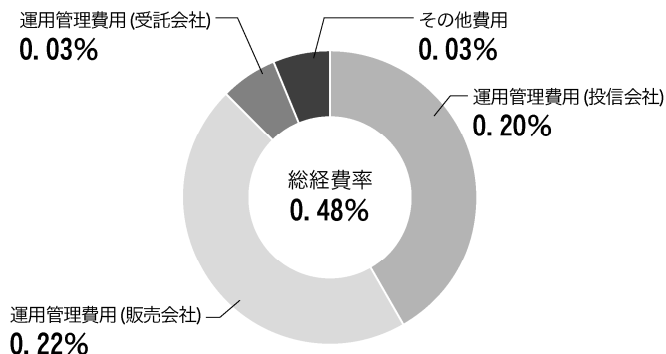
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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）

当ファンドの費用は以下の通りです。（マザーファンド含む）



※各費用は、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す。

※各費用は、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、年率換算した値です。

※上記の前提条件で算出したものです。このため、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（1万口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.48%です。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

■ 当期中の売買及び取引の状況(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）

	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）	1,853	4,580	1,366	3,540
外国株式インデックス・マザーファンド	243	810	465	1,560
外国債券パッシブ・マザーファンド	818	1,417	1,237	2,150
国内債券パッシブ・マザーファンド	4,947	6,250	5,204	6,580
マネーインカム・マザーファンド	19,840	20,050	1,296	1,310

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）

	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）	7,553	18,670	4,431	11,500
外国株式インデックス・マザーファンド	1,327	4,350	2,026	6,880
外国債券パッシブ・マザーファンド	4,167	7,200	2,784	4,840
国内債券パッシブ・マザーファンド	19,798	25,050	3,268	4,140
マネーインカム・マザーファンド	18,187	18,380	791	800

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）

	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）	15,941	39,700	7,243	19,000
外国株式インデックス・マザーファンド	2,610	8,450	4,257	14,200
外国債券パッシブ・マザーファンド	9,461	16,410	1,148	2,000
国内債券パッシブ・マザーファンド	51,929	65,640	9,105	11,500
マネーインカム・マザーファンド	1,623	1,640	-	-

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）

	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）	36,002	92,340	4,916	13,300
外国株式インデックス・マザーファンド	13,840	46,120	6,719	22,920
外国債券パッシブ・マザーファンド	31,509	54,440	1,286	2,250
国内債券パッシブ・マザーファンド	100,096	126,600	14,209	17,900
マネーインカム・マザーファンド	4,849	4,900	—	—

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

	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）	22,102	56,730	1,784	4,530
外国株式インデックス・マザーファンド	10,176	34,150	2,630	9,110
外国債券パッシブ・マザーファンド	17,706	30,590	1,148	2,000
国内債券パッシブ・マザーファンド	38,648	48,897	6,011	7,600
マネーインカム・マザーファンド	2,830	2,860	—	—

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）

	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）	44,425	113,040	3,817	9,620
外国株式インデックス・マザーファンド	18,006	61,630	5,978	20,700
外国債券パッシブ・マザーファンド	35,390	61,420	4,917	8,600
国内債券パッシブ・マザーファンド	67,670	85,540	10,346	13,050
マネーインカム・マザーファンド	4,888	4,940	98	100

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 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

（2018年4月14日から2019年4月15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	36,724,341千円	28,415,671千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	171,334,778千円	169,516,427千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.21	0.16

※単位未満は切捨て。

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

（1）利害関係人との取引状況

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
			%			%
株 式	百万円 21,157	百万円 115	0.5	百万円 15,566	百万円 265	1.7

※平均保有割合 2020：0.0%、2025：0.0%、2030：0.1%、2035：0.1%、2040：0.1%、2045：0.2%

※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	$\frac{B}{A}$	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 36,234	百万円 6,921	19.1	百万円 68,912	百万円 6,323	9.2

※平均保有割合 2020：0.0%、2025：0.1%、2030：0.2%、2035：0.2%、2040：0.1%、2045：0.1%

※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

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

マネーインカム・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	$\frac{B}{A}$	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 2,122	百万円 100	% 4.7	百万円 200	百万円 -	% -

※平均保有割合 2020：2.8%、2025：2.0%、2030：0.5%、2035：0.6%、2040：0.3%、2045：0.7%

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

(2)利害関係人の発行する有価証券等

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	百万円 171	百万円 264	百万円 2,089

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 406

(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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

種 類	買 付 額
株 式	百万円 1

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 600

(4)売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）

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	0.038千円
(c) (b) / (a)	3.0%

※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。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	4千円
(b) うち利害関係人への支払額	0.128千円
(c) (b) / (a)	3.1%

※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。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	10千円
(b) うち利害関係人への支払額	0.316千円
(c) (b) / (a)	3.0%

※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。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	16千円
(b) うち利害関係人への支払額	0.45千円
(c) (b) / (a)	2.7%

※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。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	10千円
(b) うち利害関係人への支払額	0.266千円
(c) (b) / (a)	2.6%

※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。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	25千円
(b) うち利害関係人への支払額	0.663千円
(c) (b) / (a)	2.6%

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

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

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

■ 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 (2018年4月14日から2019年4月15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(2019年4月15日現在)

親投資信託残高

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）

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）	7,451	7,938	20,367
外国株式インデックス・マザーファンド	3,023	2,801	10,325
外国債券パッシブ・マザーファンド	9,847	9,428	16,808
国内債券パッシブ・マザーファンド	55,572	55,315	70,914
マネーインカム・マザーファンド	60,612	79,155	79,955

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）

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）	23,605	26,728	68,574
外国株式インデックス・マザーファンド	9,140	8,441	31,112
外国債券パッシブ・マザーファンド	32,425	33,808	60,266
国内債券パッシブ・マザーファンド	149,647	166,178	213,040
マネーインカム・マザーファンド	39,269	56,665	57,238

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）

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）	57,669	66,367	170,273
外国株式インデックス・マザーファンド	25,231	23,584	86,920
外国債券パッシブ・マザーファンド	80,647	88,960	158,580
国内債券パッシブ・マザーファンド	242,124	284,949	365,304
マネーインカム・マザーファンド	12,867	14,490	14,637

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）

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）	67,460	98,546	252,830
外国株式インデックス・マザーファンド	36,982	44,103	162,542
外国債券パッシブ・マザーファンド	74,257	104,480	186,247
国内債券パッシブ・マザーファンド	163,622	249,509	319,871
マネーインカム・マザーファンド	12,031	16,880	17,050

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

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）	37,694	58,012	148,837
外国株式インデックス・マザーファンド	22,367	29,913	110,247
外国債券パッシブ・マザーファンド	37,838	54,396	96,966
国内債券パッシブ・マザーファンド	65,165	97,802	125,382
マネーインカム・マザーファンド	5,975	8,805	8,894

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）

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）	103,594	144,202	369,967
外国株式インデックス・マザーファンド	63,089	75,117	276,847
外国債券パッシブ・マザーファンド	98,716	129,190	230,294
国内債券パッシブ・マザーファンド	148,161	205,486	263,433
マネーインカム・マザーファンド	15,944	20,734	20,943

※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）	69,243,723千口	外国株式インデックス・マザーファンド	51,227,388千口
外国債券パッシブ・マザーファンド	93,585,617千口	国内債券パッシブ・マザーファンド	135,164,231千口
マネーインカム・マザーファンド	2,470,784千口		

※単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

（2019年4月15日現在）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）

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）	20,367	10.2
外国株式インデックス・マザーファンド	10,325	5.2
外国債券パッシブ・マザーファンド	16,808	8.4
国内債券パッシブ・マザーファンド	70,914	35.5
マネーインカム・マザーファンド	79,955	40.0
コール・ローン等、その他	1,462	0.7
投資信託財産総額	199,831	100.0

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）

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）	68,574	15.8
外国株式インデックス・マザーファンド	31,112	7.2
外国債券パッシブ・マザーファンド	60,266	13.9
国内債券パッシブ・マザーファンド	213,040	49.2
マネーインカム・マザーファンド	57,238	13.2
コール・ローン等、その他	2,678	0.7
投資信託財産総額	432,908	100.0

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）

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）	170,273	21.2
外国株式インデックス・マザーファンド	86,920	10.8
外国債券パッシブ・マザーファンド	158,580	19.7
国内債券パッシブ・マザーファンド	365,304	45.4
マネーインカム・マザーファンド	14,637	1.8
コール・ローン等、その他	8,161	1.1
投資信託財産総額	803,875	100.0

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）

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）	252,830	26.7
外国株式インデックス・マザーファンド	162,542	17.2
外国債券パッシブ・マザーファンド	186,247	19.7
国内債券パッシブ・マザーファンド	319,871	33.8
マネーインカム・マザーファンド	17,050	1.8
コール・ローン等、その他	8,592	0.8
投資信託財産総額	947,132	100.0

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020/2025/2030/2035/2040/2045（4資産タイプ）

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

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）	148,837	30.0
外国株式インデックス・マザーファンド	110,247	22.2
外国債券パッシブ・マザーファンド	96,966	19.6
国内債券パッシブ・マザーファンド	125,382	25.3
マネーインカム・マザーファンド	8,894	1.8
コール・ローン等、その他	5,360	1.1
投資信託財産総額	495,686	100.0

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）

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）	369,967	31.6
外国株式インデックス・マザーファンド	276,847	23.7
外国債券パッシブ・マザーファンド	230,294	19.7
国内債券パッシブ・マザーファンド	263,433	22.5
マネーインカム・マザーファンド	20,943	1.8
コール・ローン等、その他	8,296	0.7
投資信託財産総額	1,169,780	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。

※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(188,720,815千円)の投資信託財産総額(189,401,784千円)に対する比率は99.6%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(166,772,622千円)の投資信託財産総額(166,995,901千円)に対する比率は99.9%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=112.01円、1カナダドル=84.01円、1メキシコペソ=5.97円、1ユーロ=126.60円、1英ポンド=146.68円、1スイスフラン=111.71円、1スウェーデンクローナ=12.09円、1ノルウェークローネ=13.19円、1デンマーククローネ=16.96円、1ポーランドズロチ=29.58円、1オーストラリアドル=80.30円、1ニュージーランドドル=75.81円、1香港ドル=14.28円、1シンガポールドル=82.78円、1マレーシアリンギット=27.24円、1イスラエルシェケル=31.39円、1南アフリカランド=8.03円です。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年4月15日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	199,831,350円
コール・ローン等	1,459,734
国内株式インテックス・マザーファンド(B号)(評価額)	20,367,372
外国株式インテックス・マザーファンド(評価額)	10,325,945
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	16,808,058
国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	70,914,914
マネーインカム・マザーファンド(評価額)	79,955,327
(B) 負 債	458,003
未払解約金	10,029
未払信託報酬	442,724
その他未払費用	5,250
(C) 純資産総額(A-B)	199,373,347
元 本	155,799,244
次期繰越損益金	43,574,103
(D) 受益権総口数	155,799,244口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,797円

※当期における期首元本額141,370,639円、期中追加設定元本額21,566,244円、期中一部解約元本額7,137,639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2018年4月14日 至2019年4月15日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 689円
支 払 利 息	△ 689
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,977,981
売 買 益	2,517,229
売 買 損	△ 539,248
(C) 信 託 報 酬 等	△ 876,112
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	1,101,180
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	15,394,615
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	27,078,308
(配 当 等 相 当 額)	(43,450,022)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△16,371,714)
(G) 計 (D+E+F)	43,574,103
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	43,574,103
追 加 信 託 差 損 益 金	27,078,308
(配 当 等 相 当 額)	(43,467,880)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△16,389,572)
分 配 準 備 積 立 金	17,078,487
繰 越 損 益 金	△ 582,692

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

※期末における、費用控除後の配当等収益(1,683,872円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(43,467,880円)および分配準備積立金(15,394,615円)より分配可能額は60,546,367円(1万口当たり3,886円)ですが、分配は行っておりません。

■ 分配金のお知らせ

	当 期
1万口当たり分配金(税引前)	-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）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年4月15日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	432,908,677円
コール・ローン等	2,675,928
国内株式インテックス・マザーファンド(B号)(評価額)	68,574,216
外国株式インテックス・マザーファンド(評価額)	31,112,906
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	60,266,750
国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	213,040,757
マネーインカム・マザーファンド(評価額)	57,238,120
(B) 負 債	1,037,009
未払解約金	79,073
未払信託報酬	946,669
その他未払費用	11,267
(C) 純資産総額(A-B)	431,871,668
元 本	316,124,813
次期繰越損益金	115,746,855
(D) 受益権総口数	316,124,813口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,661円

※当期における期首元本額282,367,005円、期中追加設定元本額53,941,775円、期中一部解約元本額20,183,967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2018年4月14日 至2019年4月15日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,569円
支 払 利 息	△ 1,569
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,597,479
売 買 益	8,177,494
売 買 損	△ 1,580,015
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,870,080
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	4,725,830
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	32,109,781
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	78,911,244
(配 当 等 相 当 額)	(113,102,717)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 34,191,473)
(G) 計 (D + E + F)	115,746,855
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	115,746,855
追 加 信 託 差 損 益 金	78,911,244
(配 当 等 相 当 額)	(113,160,571)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 34,249,327)
分 配 準 備 積 立 金	36,835,611

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

※期末における、費用控除後の配当等収益(4,528,089円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(197,741円)、信託約款に規定される収益調整金(113,160,571円)および分配準備積立金(32,109,781円)より分配可能額は149,996,182円(1万口当たり4,744円)ですが、分配は行っておりません。

■ 分配金のお知らせ

	当 期
1万口当たり分配金(税引前)	－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）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年4月15日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	803,875,754円
コール・ローン等	8,159,206
国内株式インテックス・マザーファンド(B号) (評価額)	170,273,199
外国株式インテックス・マザーファンド (評価額)	86,920,593
外国債券パッシブ・マザーファンド (評価額)	158,580,898
国内債券パッシブ・マザーファンド (評価額)	365,304,716
マネーインカム・マザーファンド (評価額)	14,637,142
(B) 負 債	1,764,422
未払信託報酬	1,743,582
未払利息	1
その他未払費用	20,839
(C) 純資産総額 (A - B)	802,111,332
元 本	548,603,685
次期繰越損益金	253,507,647
(D) 受益権総口数	548,603,685口
1万口当たり基準価額 (C/D)	14,621円

※当期における期首元本額485,724,621円、期中追加設定元本額83,564,352円、期中一部解約元本額20,685,288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2018年4月14日 至2019年4月15日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 2,908円
支 払 利 息	△ 2,908
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	14,563,158
売 買 益	18,738,805
売 買 損	△ 4,175,647
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,430,188
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	11,130,062
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	60,125,290
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	182,252,295
(配 当 等 相 当 額)	(282,041,044)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 99,788,749)
(G) 計 (D + E + F)	253,507,647
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	253,507,647
追 加 信 託 差 損 益 金	182,252,295
(配 当 等 相 当 額)	(282,154,236)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 99,901,941)
分 配 準 備 積 立 金	71,255,352

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

※期末における、費用控除後の配当等収益(10,099,548円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,030,514円)、信託約款に規定される収益調整金(282,154,236円)および分配準備積立金(60,125,290円)より分配可能額は353,409,588円(1万口当たり6,441円)ですが、分配は行っておりません。

■ 分配金のお知らせ

	当 期
1万口当たり分配金(税引前)	-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）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年4月15日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	947,132,897円
コール・ローン等	6,590,477
国内株式インテックス・マザーファンド(B号) (評価額)	252,830,361
外国株式インテックス・マザーファンド (評価額)	162,542,140
外国債券パッシブ・マザーファンド (評価額)	186,247,388
国内債券パッシブ・マザーファンド (評価額)	319,871,758
マネーインカム・マザーファンド (評価額)	17,050,773
未 収 入 金	2,000,000
(B) 負 債	2,089,692
未 払 解 約 金	79,104
未 払 信 託 報 酬	1,986,827
未 払 利 息	1
そ の 他 未 払 費 用	23,760
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	945,043,205
元 本	609,293,546
次 期 繰 越 損 益 金	335,749,659
(D) 受 益 権 総 口 数	609,293,546口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	15,510円

※当期における期首元本額430,833,611円、期中追加設定元本額208,815,864円、期中一部解約元本額30,355,929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2018年4月14日 至2019年4月15日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 3,257円
支 払 利 息	△ 3,257
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	20,669,599
売 買 益	26,846,402
売 買 損	△ 6,176,803
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,799,951
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	16,866,391
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	61,277,065
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	257,606,203
(配 当 等 相 当 額)	(340,226,955)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 82,620,752)
(G) 計 (D + E + F)	335,749,659
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	335,749,659
追 加 信 託 差 損 益 金	257,606,203
(配 当 等 相 当 額)	(340,500,707)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 82,894,504)
分 配 準 備 積 立 金	78,143,456

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

※期末における、費用控除後の配当等収益(13,115,315円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,751,076円)、信託約款に規定される収益調整金(340,500,707円)および分配準備積立金(61,277,065円)より分配可能額は418,644,163円(1万口当たり6,870円)ですが、分配は行っておりません。

■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当 期
	- 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）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年4月15日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	495,686,390円
コール・ローン等	4,356,426
国内株式インテックス・マザーファンド(B号)(評価額)	148,837,888
外国株式インテックス・マザーファンド(評価額)	110,247,674
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	96,966,937
国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	125,382,576
マネーインカム・マザーファンド(評価額)	8,894,889
未 収 入 金	1,000,000
(B) 負 債	1,335,301
未 払 解 約 金	290,904
未 払 信 託 報 酬	1,032,076
そ の 他 未 払 費 用	12,321
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	494,351,089
元 本	313,611,077
次 期 繰 越 損 益 金	180,740,012
(D) 受 益 権 総 口 数	313,611,077口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	15,763円

※当期における期首元本額214,950,711円、期中追加設定元本額113,641,120円、期中一部解約元本額14,980,754円です。

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

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

■ 分配金のお知らせ

	当 期
1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	- 円

■ 損益の状況

（自2018年4月14日 至2019年4月15日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,675円
支 払 利 息	△ 1,675
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	12,060,745
売 買 益	15,762,973
売 買 損	△ 3,702,228
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,954,920
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	10,104,150
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	29,250,587
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	141,385,275
(配 当 等 相 当 額)	(157,448,286)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 16,063,011)
(G) 計 (D + E + F)	180,740,012
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	180,740,012
追 加 信 託 差 損 益 金	141,385,275
(配 当 等 相 当 額)	(157,606,599)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 16,221,324)
分 配 準 備 積 立 金	39,354,737

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

※期末における、費用控除後の配当等収益(7,352,655円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(2,751,495円)、信託約款に規定される収益調整金(157,606,599円)および分配準備積立金(29,250,587円)より分配可能額は196,961,336円(1万口当たり6,280円)ですが、分配は行っておりません。

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年4月15日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	1,169,780,011円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,194,295
国内株式インテックス・マザーファンド(B号) (評価額)	369,967,211
外国株式インテックス・マザーファンド (評価額)	276,847,337
外国債券パッシブ・マザーファンド (評価額)	230,294,206
国内債券パッシブ・マザーファンド (評価額)	263,433,153
マネーインカム・マザーファンド (評価額)	20,943,809
未 収 入 金	1,100,000
(B) 負 債	3,057,586
未 払 解 約 金	563,424
未 払 信 託 報 酬	2,464,678
未 払 利 息	1
そ の 他 未 払 費 用	29,483
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,166,722,425
元 本	725,517,767
次 期 繰 越 損 益 金	441,204,658
(D) 受 益 権 総 口 数	725,517,767口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,081円

※当期における期首元本額550,506,470円、期中追加設定元本額217,772,319円、期中一部解約元本額42,761,022円です。

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

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

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	当 期
	-1円

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

■ 損益の状況

（自2018年4月14日 至2019年4月15日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 4,002円
支 払 利 息	△ 4,002
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	27,916,012
売 買 益	37,248,482
売 買 損	△ 9,332,470
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,716,381
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	23,195,629
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	73,693,864
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	344,315,165
(配 当 等 相 当 額)	(394,294,037)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 49,978,872)
(G) 計 (D + E + F)	441,204,658
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	441,204,658
追 加 信 託 差 損 益 金	344,315,165
(配 当 等 相 当 額)	(394,664,538)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 50,349,373)
分 配 準 備 積 立 金	96,889,493

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

※期末における、費用控除後の配当等収益(17,839,867円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(5,355,762円)、信託約款に規定される収益調整金(394,664,538円)および分配準備積立金(73,693,864円)より分配可能額は491,554,031円(1万口当たり6,775円)ですが、分配は行っておりません。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第16期 (2017年12月1日から2018年11月30日まで)

信託期間	無期限 (設定日: 2003年2月17日)
運用方針	主として東京証券取引所第一部に上場している株式に投資を行い、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。

■ 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 株 比	株式先物率 比 (買建-売建)	純資産額
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
12期 (2014年12月1日)	円 20,320	% 15.2	1,942.38	% 15.2	% 97.5	% 2.4	百万円 278,871
13期 (2015年11月30日)	23,013	13.3	2,200.15	13.3	98.0	1.9	224,719
14期 (2016年11月30日)	21,863	△ 5.0	2,091.95	△ 4.9	97.9	2.1	204,698
15期 (2017年11月30日)	27,242	24.6	2,604.86	24.5	98.5	1.5	193,025
16期 (2018年11月30日)	25,937	△ 4.8	2,475.92	△ 4.9	97.1	2.8	173,547

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※T O P I X (東証株価指数) 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 株 比	株式先物率 比 (買建-売建)
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2017年11月30日	円 27,242	% -	2,604.86	% -	% 98.5	% 1.5
12月末	27,663	1.5	2,645.77	1.6	99.2	0.7
2018年1月末	27,956	2.6	2,673.82	2.6	99.0	0.9
2月末	26,923	△1.2	2,574.87	△1.2	98.0	1.9
3月末	26,379	△3.2	2,522.26	△3.2	97.1	2.8
4月末	27,323	0.3	2,611.85	0.3	97.6	2.3
5月末	26,879	△1.3	2,568.21	△1.4	97.8	2.3
6月末	26,660	△2.1	2,548.78	△2.2	97.3	2.7
7月末	27,007	△0.9	2,581.96	△0.9	98.6	1.2
8月末	26,737	△1.9	2,556.25	△1.9	97.5	2.4
9月末	28,255	3.7	2,698.09	3.6	97.3	2.4
10月末	25,593	△6.1	2,444.11	△6.2	97.7	2.4
(期 末) 2018年11月30日	25,937	△4.8	2,475.92	△4.9	97.1	2.8

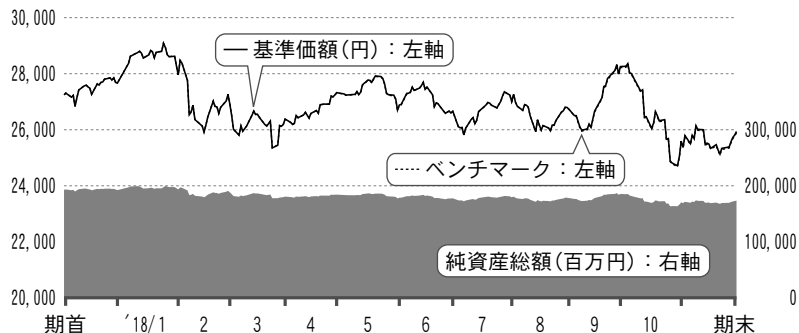
※騰落率は期首比です。

※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（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	27,242円
期末	25,937円
騰落率	-4.8%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）です。

※TOPIX（東証株価指数）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（2017年12月1日から2018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

- ・ 期初から2018年1月下旬にかけて、好調な米国株式市場や企業業績の改善期待を好感
- ・ 9月中旬から下旬にかけて、堅調な米国株式市場や円安を好感

下落要因

- ・ 2月上旬から3月下旬にかけて、米国長期金利が急騰したこと
- ・ 10月上旬から期末にかけて、米国長期金利上昇や中国経済の減速懸念を嫌気

▶ 投資環境について（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

国内株式市場は下落しました。

期初は、好調な米国株式市場や企業業績の改善期待から、国内株式市場は上昇して始まりしました。2月には米国雇用統計で賃金上昇が確認され、米国長期金利が急騰し、世界的な株安となりました。その後もトランプ大統領の保護貿易政策が重荷となり、8月まで上値の重い展開が続きました。

9月中旬から下旬にかけては、堅調な米国株式市場や円安を背景に上昇しましたが、10月上旬から期末にかけては米国長期金利の上昇や中国経済の減速懸念から国内株式は下落しました。

当期の市場の動きをベンチマークであるTOPIX（東証株価指数、配当込み）でみると、期首に比べて4.9%下落しました。

▶ ポートフォリオについて（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

株式組入比率

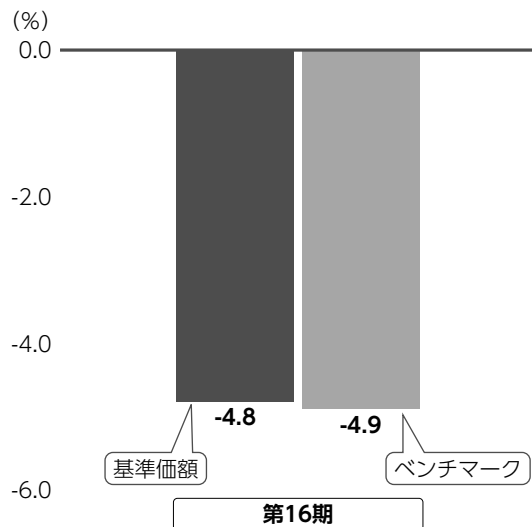
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、期を通じて、先物を含めた実質株式投資比率は100%に近い高位を保ちました。

東証1部上場銘柄のうち、流動性や信用リスクを考慮し、銘柄組入れを行いました。またファンドの資金流入に機動的に対応するため、株式先物の売買を行いました。

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

▶ ベンチマークとの差異について（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



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

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は-4.8%となり、ベンチマークの騰落率-4.9%を0.1%上方乖離しました。

上方乖離要因 ・オリンパス株式会社に対する損害賠償請求訴訟の和解金が計上されたこと

2 今後の運用方針

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 1万口当たりの費用明細（2017年12月1日から2018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)	0.004% (0.001) (0.003)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	2 (2)	0.006 (0.006)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	3	0.010	

期中の平均基準価額は27,051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（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 6,993 (△3,870)	千円 13,483,729 ()	千株 11,096	千円 22,724,796

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類	別	買 建		売 建		
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	
国 内	株式先物取引	T O P I X	百万円 55,505	百万円 53,293	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	36,208,526千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	177,975,266千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.20

※単位未満は切捨て。

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末（ただし、決算日の属する月については決算日）のわが国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。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 利害関係人との取引状況等（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

(1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B A		うち利害関係人 との取引状況D	D C	
株 式	百万円 13,483	百万円 2,548	% 18.9	百万円 22,724	百万円 0.66033	% 0.0
株 式 先 物 取 引	55,505	3,213	5.8	53,293	6,051	11.4

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	百万円 104	百万円 375	百万円 2,109

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株 式	百万円 1

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	6,889千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	620千円
(c) (b) / (a)	9.0%

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社関西アーバン銀行、株式会社みさと銀行、株式会社関西みらいフィナンシャルグループ、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、NECキャピタルソリューション株式会社、SMBC日興証券株式会社です。

■ 組入れ資産の明細（2018年11月30日現在）

(1) 国内株式

銘 柄	期首(前期末)		期 末	評 価 額	銘 柄	期首(前期末)		期 末	評 価 額
	株 数	株 数				株 数	株 数		
水産・農林業 (0.1%)	千株	千株	千円		石油資源開発	13.2	13.7	32,249	
極洋	3.5	3.5	11,287		K&Oエナジーグループ	5.1	5.1	8,343	
日本水産	94.6	96.8	66,404		建設業 (3.0%)				
マルハニチロ	15.6	14	57,470		ヒノキヤグループ	—	2.6	5,493	
カネコ種苗	4.1	4	5,748		ショーボンドホールディングス	7.7	7.5	65,250	
サカタのタネ	12	11.5	44,792		ミライト・ホールディングス	25.2	24.1	40,102	
ホクト	8.4	7.9	15,950		タマホーム	9.9	7.2	7,999	
鉱業 (0.3%)					TATERU	1.6	12.5	4,925	
住石ホールディングス	10	—	—		スペースバリューホールディングス	—	12.8	13,388	
日鉄鉱業	2.3	2.4	13,344		ダイセキ環境ソリューション	3.6	—	—	
三井松島ホールディングス	5	4.9	7,898		安藤・間	63.8	61.7	42,326	
国際石油開発帝石	405	389.5	469,347		東急建設	31.2	28.4	32,518	
日本海洋掘削	3.2	—	—		コムスホールディングス	29.2	34.3	100,499	
					ミサワホーム	8.1	9.3	7,728	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ビーアールホールディングス	10.9	10.5	4,168	
高松コンストラクショングループ	5.3	6	17,394	
東建コーポレーション	3	2.9	22,562	
大成建設	84.5	79.5	396,705	
大林組	248.8	239	270,548	
清水建設	253.7	243.6	236,292	
飛鳥建設	87	7.5	11,700	
長谷工コーポレーション	96.6	99.8	137,125	
松井建設	11.3	10.8	9,212	
銭高組	1.4	1.3	7,150	
鹿島建設	365	187	293,777	
不動テトラ	71.7	7	13,664	
大木建設	—	5.4	6,426	
鉄建建設	5.1	5.1	15,402	
西松建設	19.2	17.8	46,600	
三井住友建設	60	59.3	41,806	
大豊建設	30	5.5	20,762	
前田建設工業	59.3	57.8	68,897	
ナカノフド一建設	8.6	—	—	
奥村組	13.7	13.6	51,476	
東鉄工業	9.7	9.4	31,396	
イチケン	2	—	—	
浅沼組	31	3.2	11,120	
戸田建設	97	93.4	71,357	
熊谷組	13	11.4	40,983	
青木あすなろ建設	6.5	—	—	
北野建設	21	2.2	8,965	
三井ホーム	13	—	—	
矢作建設工業	12.6	13.1	10,008	
ビーエス三菱	11.6	11.1	7,892	
日本ハウスホールディングス	19	18.3	9,223	
大東建託	30.1	28.6	424,138	
新日本建設	10.4	10.2	12,342	
NIPPO	19	20.6	39,861	
東亜道路工業	2	2.2	7,150	
前田道路	26	25.2	56,196	
日本道路	2.5	2.3	14,191	
東亜建設工業	6.8	7.5	11,820	
若築建設	5.8	5.8	9,993	
東洋建設	26.4	32.3	13,662	
五洋建設	99	96.4	69,022	
世紀東急工業	13.9	14.8	9,975	
福田組	2.7	2.8	15,148	
住友林業	53.1	56.5	94,637	
日成ビルド工業	12.3	—	—	
ヤマダ・エスバイエルホーム	67	—	—	
巴コーポレーション	—	16	7,216	
大和ハウス工業	245.6	221.4	791,505	
ライト工業	16	15.6	24,102	
積水ハウス	270.8	245.5	420,050	
日特建設	10.4	8.7	6,090	
北陸電気工事	5.4	—	—	
ユアテック	13.5	13.3	12,448	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
中電工	9.9	9.6	24,230	
関電工	32.1	35	41,230	
きんでん	55.2	52.8	103,804	
東京エネシス	9.8	9.1	8,781	
トーエネック	2.8	2.8	8,792	
住友電設	6.7	6.2	12,889	
日本電設工業	12.6	13.2	32,762	
協和エクシオ	30	31.3	89,518	
新日本空調	7.5	7.5	15,472	
NDS	1.8	—	—	
九電工	16.4	15.8	69,757	
三機工業	17.4	18.2	22,222	
日揮	71.7	69	114,402	
中外炉工業	3.6	3.1	7,650	
ヤマト	9.2	10	6,360	
太平電業	5.7	5.5	15,345	
高砂熱学工業	22.6	19.7	40,128	
朝日工業社	2.3	2.3	7,659	
明星工業	16.3	14.8	12,506	
大気社	10.8	10.9	34,771	
ダイダン	5.6	5.6	14,296	
日比谷総合設備	9.4	7.9	15,215	
東芝プラントシステム	17.9	17	42,211	
OSJBホールディングス	38.8	40.7	13,756	
東洋エンジニアリング	10.2	—	—	
千代田化工建設	54	—	—	
新興プランテック	16.8	15.1	17,425	
食料品（4.4%）				
日本製粉	23.7	22.6	43,776	
日清製粉グループ本社	89.9	79.9	190,561	
日東富士製粉	1.5	0.6	3,372	
昭和産業	6.6	6.3	17,873	
鳥越製粉	9.4	9.1	8,626	
中部飼料	9.2	9.2	12,926	
フィード・ワン	50.8	52.4	11,004	
日本甜菜製糖	5.3	5.3	10,425	
三井製糖	5.8	5.5	16,610	
日新製糖	4.1	3.8	9,063	
森永製菓	17.6	18.1	90,319	
中村屋	2.6	2.5	11,287	
江崎グリコ	20.8	21.5	118,895	
名糖産業	5.3	5.4	7,965	
井村屋グループ	—	3.5	10,902	
不二家	5.8	4.5	11,313	
山崎製パン	60.8	58.5	139,405	
モロゾフ	1.6	1.6	8,752	
亀田製菓	4.6	4.5	24,120	
寿スピリッツ	7.1	7.5	36,375	
カルビー	34.1	32.7	122,952	
森永乳業	15	14.5	48,212	
六甲バター	4.2	5.5	13,106	
ヤクルト本社	44.5	53	453,150	
明治ホールディングス	49	50.5	450,965	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
雪印メグミルク	18.2	17.3	54,668	
ブリマハム	51	9.9	21,344	
日本ハム	64	30.7	129,247	
丸大食品	39	8	16,168	
S Foods	5.1	6.4	31,392	
伊藤ハム米久ホールディングス	42.1	40.6	30,653	
サッポロホールディングス	27.3	26.3	67,985	
アサヒグループホールディングス	156.1	150.1	713,575	
キリンホールディングス	358.1	324.1	863,726	
宝ホールディングス	60.7	53.9	77,993	
オエノンホールディングス	28.9	24.8	9,572	
養命酒製造	3.5	3.2	7,753	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	52	54.7	177,775	
サントリー食品インターナショナル	56.5	47.5	226,100	
ガイドグループホールディングス	3.8	3.9	24,102	
伊藤園	24.8	23.7	123,477	
キーコーヒー	7.5	6.9	14,828	
日清オイリオグループ	8.6	9	31,680	
不二製油グループ本社	20.4	17.5	63,525	
かどや製油	1.1	1	5,840	
J-オイルミルズ	3.9	3.6	14,580	
キッコーマン	57.6	47.1	311,802	
味の素	171.5	158.3	310,663	
キユーピー	42.5	39.9	109,964	
ハウス食品グループ本社	28.4	27.1	109,077	
カゴメ	30	28.6	94,809	
焼津水産化学工業	7.8	7.7	8,408	
アリアケジャパン	6.6	6.4	62,784	
ニチレイ	35.4	37.1	118,905	
東洋水産	40.7	36.6	142,374	
イートアンド	-	3.6	6,375	
日清食品ホールディングス	32.3	30.2	221,366	
永谷園ホールディングス	10	4.6	12,820	
一正蒲鉾	4.6	3.3	3,616	
フジッコ	8.2	7.8	19,453	
ロック・フィールド	8	7.6	12,821	
日本たばこ産業	461.1	413.6	1,167,799	
ケンコーマヨネーズ	5	4.5	10,350	
わらべや日洋ホールディングス	5	5.1	9,980	
なとり	5.3	5.5	10,312	
ビックルスコオペレーション	-	2.3	5,188	
北の達人コーポレーション	7.7	28.9	15,172	
ユーグレナ	29.2	29.4	20,521	
ミヨシ油脂	4.9	3.5	4,473	
理研ビタミン	3.1	3.6	13,932	
繊維製品 (0.7%)				
片倉工業	10.8	10	12,180	
グンゼ	5.8	5.1	22,720	
東洋紡	29.6	30.3	49,782	
ユニチカ	22.2	21.3	11,672	
富士紡ホールディングス	4.4	3.9	12,129	
倉敷紡績	79	6.7	19,430	
シキボウ	5.7	6.3	7,333	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本毛織	22.5	23	21,137	
ダイドーリミテッド	-	23	8,418	
帝国繊維	8.6	8	19,632	
帝人	63.5	56.7	111,132	
東レ	565.1	543.1	483,521	
サカイオーベックス	2.7	-	-	
住江織物	2.7	2.4	6,552	
アツギ	7.9	8.1	8,675	
ダイニック	4	6.2	5,003	
セーレン	17.9	17.1	32,455	
小松マテーレ	12.6	12.5	11,312	
ワコールホールディングス	21.9	20.5	63,447	
ホクメディカル	4.9	8.8	30,140	
レナウン	26.7	-	-	
T S Iホールディングス	29.6	25.8	19,427	
マツオカコーポレーション	-	2.5	8,112	
ワールド	-	8	15,800	
三陽商会	4.9	4.9	10,064	
オンワードホールディングス	48	45.4	30,735	
ルックホールディングス	16	-	-	
ゴールドウイン	2.3	6.3	74,151	
デサント	17.8	17	37,791	
バルブ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	4.7	4.5	20,812	
王子ホールディングス	326	311.9	207,101	
日本製紙	34.5	33.3	70,263	
三菱製紙	12.2	14.8	8,672	
北越コーポレーション	42	45.8	26,335	
中越バルブ工業	3.7	4	6,396	
巴川製紙所	17	3.1	3,534	
大王製紙	29.9	33.1	46,141	
レンゴ	75	72.1	69,432	
トンモク	5.3	5.2	9,802	
ザ・バック	5.5	5.4	17,442	
化学 (7.3%)				
クラレ	130.7	117	206,388	
旭化成	485.1	497.5	618,392	
共和レザー	6.3	-	-	
昭和電工	51.8	46.5	211,575	
住友化学	572	546.5	336,644	
住友精化	3.2	3.4	16,388	
日産化学	45.1	42.8	263,648	
ラサ工業	3.4	3.4	5,654	
クレハ	6.2	6.3	50,085	
多木化学	-	1.1	10,637	
テイカ	6.1	5.9	12,036	
石原産業	14.3	13.9	17,333	
日東エフシー	6.5	-	-	
日本曹達	52	10.9	29,517	
東ソー	112.1	107.7	172,320	
トクヤマ	22.7	20.4	63,444	
セントラル硝子	16	15.8	44,208	
東亜合成	46	44.3	55,020	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
大阪ソーダ	7	7.5	19,927	
関東電化工業	18.6	16.9	15,953	
デンカ	28.6	27.4	100,284	
信越化学工業	129.5	123.2	1,248,632	
日本カーバイド工業	3.2	3.2	6,198	
堺化学工業	5.5	4.8	13,334	
第一稀元素化学工業	—	6.7	7,008	
エア・ウォーター	63.9	56.5	103,790	
大陽日酸	59.4	57.6	110,131	
日本化学工業	3.3	2.6	7,144	
日本パーカライジング	40	38.9	57,844	
高圧ガス工業	13.5	12.8	11,353	
チタン工業	1.2	—	—	
四国化成工業	11.3	11.8	14,702	
戸田工業	1.7	2.1	5,155	
ステラ ケミファ	4.2	4.3	13,824	
保土谷化学工業	2.6	2.9	7,508	
日本触媒	12.3	11.7	88,569	
大日精化工業	5.9	5.7	18,924	
カネカ	105	18.4	78,200	
三菱瓦斯化学	66.6	71.8	133,835	
三井化学	70.5	63	181,503	
J S R	78.1	70.2	127,553	
東京応化工業	13.7	12.2	44,103	
大阪有機化学工業	6.2	7.2	10,044	
三菱ケミカルホールディングス	520.4	467	433,656	
K H ネオケム	12.1	10.8	32,886	
ダイセル	105.2	108.4	137,668	
住友ベークライト	63	12.2	50,264	
積水化学工業	161.3	151.5	279,063	
日本ゼオン	65.9	63.2	72,932	
アイカ工業	21.8	21.1	80,707	
宇部興産	39.2	35.2	91,062	
積水樹脂	11.9	11.5	25,714	
タキロンシーアイ	17	16.9	10,799	
旭有機材	5.4	5.3	9,810	
日立化成	38.2	32.2	57,831	
ニチバン	4.2	4.1	9,274	
リケンテクノス	18.3	21.8	11,161	
大倉工業	19	4.4	9,473	
積水化成成品工業	10	11.3	12,215	
群栄化学工業	2.3	2.4	7,560	
ミライアル	3.4	—	—	
ダイキョーニシカワ	15.3	14.6	16,760	
森六ホールディングス	—	4.1	12,361	
日本化薬	50.5	44.4	66,378	
カーリットホールディングス	8.9	9.1	8,390	
日本精化	8	7.3	8,088	
扶桑化学工業	5.5	7.1	16,855	
トリケミカル研究所	—	1.7	7,633	
A D E K A	34	34.6	62,245	
日油	30.2	27	101,250	
新日本理化	12.1	—	—	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ハリマ化成グループ	8	7.3	8,526	
花王	182.6	173.3	1,448,441	
第一工業製薬	15	3	8,259	
石原ケミカル	—	2.8	5,983	
三洋化成工業	4.8	4.6	25,852	
大日本塗料	9.4	9.3	10,425	
日本ペイントホールディングス	59.8	57.6	231,840	
関西ペイント	81.5	78.6	167,182	
中国塗料	22.8	23.2	24,174	
日本特殊塗料	5.2	5.6	9,923	
藤倉化成	12.3	12.6	7,988	
太陽ホールディングス	5.9	5.7	20,833	
D I C	30.6	31.6	113,918	
サカタインクス	15.7	15.2	20,565	
東洋インキ S C ホールディングス	74	14.1	39,578	
T & K T O K A	6.5	6.4	7,712	
富士フイルムホールディングス	154.1	148.2	668,382	
資生堂	138.4	141.9	1,025,085	
ライオン	103.4	99.5	222,780	
高砂香料工業	4.9	5	19,450	
マンダム	14.1	15.8	52,614	
ミルボン	4.9	8.9	43,788	
ファンケル	17.9	31.6	93,599	
コーセー	12.5	12.1	204,853	
コタ	—	4.4	6,890	
シーズ・ホールディングス	10.1	8.7	50,982	
ポーラ・オルビスホールディングス	31.7	30.5	97,752	
ノエビアホールディングス	4.7	4.4	23,276	
エステー	5.7	5.6	12,219	
アグロ カネショウ	3.7	3.3	8,144	
コニシ	12.2	12.5	23,412	
長谷川香料	9.8	8.7	13,641	
星光 P M C	5	6	5,496	
小林製薬	20.7	20	158,000	
荒川化学工業	6.9	7.1	11,580	
メック	5.4	5.6	7,504	
日本高純度化学	2.7	3.2	7,638	
タカラバイオ	19.4	18.6	52,786	
J C U	4.6	9.4	17,371	
新田ゼラチン	7.4	—	—	
デクセリアルズ	19.5	18.8	18,630	
アース製薬	5.5	5.3	29,627	
北興化学工業	10	10.5	5,859	
大成ラミック	2.8	3.6	11,124	
クミアイ化学工業	33.6	29.7	21,562	
日本農薬	21.3	18.6	10,378	
アキレス	6.3	5.8	13,084	
有沢製作所	13	12.8	10,508	
日東電工	56.1	54	334,962	
レック	4.7	7.8	16,052	
きもと	19	—	—	
藤森工業	6.1	6.2	20,088	
前澤化成工業	5.7	7.7	8,731	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
J S P	4.2	4.5	10,881	
エフピコ	6	5.8	40,194	
天馬	5.9	5.4	11,269	
信越ポリマー	15.2	13.7	11,371	
東リ	22.5	23.5	6,979	
ニフコ	13.6	28.6	82,797	
バルカー	6.2	6.1	16,793	
ユニ・チャーム	157.7	151.6	538,786	
医薬品 (5.2%)				
協和発酵キリン	92.5	88.7	206,404	
武田薬品工業	273.5	281.9	1,199,484	
アステラス製薬	763.1	658	1,147,881	
大日本住友製薬	54.9	52.9	195,730	
塩野義製薬	106.3	93.4	701,247	
田辺三菱製薬	90	73.9	128,807	
あすか製薬	8.7	9.4	11,562	
日本新薬	19.4	18.7	145,112	
中外製薬	77.3	74.1	575,757	
科研製薬	13.5	13	75,530	
エーザイ	88.9	85.5	890,482	
ロート製薬	41.1	36.7	131,569	
小野薬品工業	190.3	168.9	463,714	
久光製薬	22	21.1	152,975	
持田製薬	5.3	5.5	56,705	
参天製薬	140.3	135.2	262,693	
扶桑薬品工業	3.5	3.8	10,799	
日本ケミファ	1.4	1.6	6,616	
ツムラ	26.7	22.3	78,384	
日医工	19.4	17.1	29,822	
キッセイ薬品工業	14	12.8	44,928	
生化学工業	14.7	14	21,840	
栄研化学	6.1	12.6	32,823	
鳥居薬品	4.7	4.1	10,783	
J C R ファーマ	5.3	5.1	29,631	
東和薬品	3.7	3.4	28,696	
富士製薬工業	2.8	5.3	10,191	
沢井製薬	13.3	14.8	88,800	
ゼリア新薬工業	16	14.2	29,876	
第一三共	212.5	204.3	851,318	
キョーリン製薬ホールディングス	21	18.3	49,922	
大幸薬品	4.4	4.1	8,241	
ダイト	5.2	4.3	14,706	
大塚ホールディングス	154.3	136	752,760	
大正製薬ホールディングス	16.5	15.9	208,608	
ペプチドリーム	30.7	33.1	153,915	
石油・石炭製品 (0.8%)				
日本コークス工業	69	75	7,950	
昭和シェル石油	69.3	66.9	117,677	
ニチレキ	10	10.1	11,554	
ユシロ化学工業	4.5	5.1	6,915	
ビービー・カストロール	3.5	—	—	
富士石油	19.5	19.7	6,698	
M O R E S C O	3	3.8	6,323	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
出光興産	62.2	55.2	227,976	
J X T Gホールディングス	1,185.4	1,215.3	834,060	
コスモエネルギーホールディングス	20.7	20.2	53,509	
ゴム製品 (0.8%)				
横浜ゴム	43.3	41.6	98,841	
東洋ゴム工業	44.4	37.3	66,878	
ブリヂストン	262.4	219.5	1,009,700	
住友ゴム工業	71.8	64.3	97,543	
藤倉ゴム工業	7	—	—	
オカモト	27	5.1	30,447	
ニッタ	7.6	8	31,280	
住友理工	14.8	14.1	15,679	
三ツ星ベルト	19	9.6	23,625	
バンドー化学	15.3	14.2	17,508	
ガラス・土石製品 (0.9%)				
日東紡績	11.3	10.6	23,044	
A G C	75.9	71.5	275,632	
日本板硝子	26.9	33.5	32,428	
日本山村硝子	47	4.2	7,484	
日本電気硝子	32.5	30.9	94,245	
オハラ	3.4	3.1	7,405	
住友大阪セメント	149	14.6	74,460	
太平洋セメント	46.9	45	172,800	
日本ヒューム	10.5	8.9	8,544	
日本コンクリート工業	20.6	20.5	6,314	
三谷セキサン	4.4	3.7	10,511	
アジアパイルホールディングス	12.3	11.7	8,119	
東海カーボン	67.5	64.7	101,967	
日本カーボン	4.1	3.5	18,970	
東洋炭素	5.1	4.4	12,042	
ノリタケカンパニーリミテド	4.7	4.3	24,209	
T O T O	57.2	54.7	240,406	
日本碍子	90.7	86.5	145,579	
日本特殊陶業	63.9	60	139,920	
M A R U W A	2.7	2.6	16,692	
品川リフラクトリーズ	2.5	2.2	9,471	
黒崎播磨	1.9	1.5	10,125	
ヨータイ	—	7.8	5,350	
東京窯業	—	12.6	5,871	
ニッカトー	—	4.3	4,639	
フジミンコーポレーテッド	7	6.4	15,590	
ニチアス	41	19.3	42,517	
ニチハ	11.3	9.9	30,739	
鉄鋼 (1.0%)				
新日鐵住金	328.6	316	656,016	
神戸製鋼所	134.7	129.4	120,859	
中山製鋼所	10	11.9	6,961	
合同製鐵	4.7	4.1	7,978	
ジェイ エフ イー ホールディングス	198.4	190.7	381,686	
日新製鋼	20.5	17.2	25,198	
東京製鐵	39	37.7	36,870	
共英製鋼	8.4	8	17,600	
大和工業	15.8	15.2	45,113	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
東京鐵鋼	4.1	4.1	5,621	
大阪製鐵	5.1	5.1	10,205	
淀川製鋼所	10.5	9.2	22,346	
東洋鋼鈑	19.9	—	—	
丸一鋼管	26.2	25.1	84,587	
モリ工業	2.9	2.7	7,333	
大同特殊鋼	13.1	11.8	54,221	
日本冶金工業	63.7	61.4	17,314	
山陽特殊製鋼	8.5	8.9	22,962	
愛知製鋼	4	3.9	15,580	
日立金属	78.8	77.7	99,300	
日本金属	2.2	—	—	
大平洋金属	4.7	5	16,600	
新日本電工	44.8	46.4	12,435	
栗本鐵工所	4.4	4.6	7,567	
三菱製鋼	5.4	6	12,174	
日本精線	1.3	—	—	
シンニッタン	8.8	14.7	6,071	
非鉄金属 (0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	13.1	13.1	8,528	
日本軽金属ホールディングス	217	196.2	49,834	
三井金属鉱業	20	19.4	50,304	
東邦亜鉛	4.2	4	15,320	
三菱マテリアル	48.6	46.6	148,421	
住友金属鉱山	94.3	97	320,585	
DOWAホールディングス	18.9	16.6	62,084	
古河機械金属	12.4	11.8	16,980	
大阪チタニウムテクノロジーズ	8.5	8.6	18,223	
東邦チタニウム	14.6	13.2	18,414	
UACJ	11.3	10.5	24,958	
CKサンエツ	—	1.7	4,692	
古河電気工業	24.6	20.6	68,289	
住友電気工業	275.5	264.2	420,738	
フジクラ	89.9	87.2	42,989	
タツタ電線	16.1	16.3	8,753	
平河ヒューテック	5	3.6	4,766	
リョービ	9.3	8.8	27,236	
アーレスティ	10.6	10.2	7,446	
アサヒホールディングス	12.2	13.4	31,503	
金属製品 (0.6%)				
稲葉製作所	5.1	5.7	7,734	
宮地エンジニアリンググループ	2.6	2.7	5,799	
トーカロ	5.2	19.6	19,404	
アルファC o	3.3	4	5,580	
SUMCO	67.7	78.5	136,590	
川田テクノロジーズ	1.6	1.7	14,501	
RS Technologies	1.3	1.6	8,064	
東洋製罐グループホールディングス	49.9	44.9	116,066	
ホッカンホールディングス	25	4.8	8,241	
コロナ	5.3	5.6	6,389	
横河ブリッジホールディングス	13.8	13.3	24,738	
駒井ハルテック	2.7	—	—	
三和ホールディングス	70.5	73.2	100,869	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
文化シャッター	22.2	21.5	16,856	
三協立山	10.6	10.2	13,433	
アルインコ	7.5	8.9	9,781	
LIXILグループ	107.9	104.2	153,278	
日本ファイルコン	7.3	—	—	
ノーリツ	16.6	15.7	26,501	
長府製作所	8.3	7	16,716	
リンナイ	13.1	12.6	102,564	
日東精工	12.8	12.5	8,037	
岡部	16.1	15.2	15,048	
ジーテクト	8.3	8.3	13,205	
東プレ	13.4	12.8	29,593	
高周波熱錬	15	14.4	14,745	
東京製網	6.3	5.9	6,802	
パイオラックス	10.8	11.2	31,136	
エイチワン	6.1	8	8,800	
日本発條	73.6	71	71,710	
三益半導体工業	6.8	6.1	9,424	
機械 (5.1%)				
日本製鋼所	24.3	21.8	45,213	
三浦工業	32.1	30.7	92,867	
タクマ	24.9	25.7	40,991	
ツガミ	20	16.1	13,717	
オークマ	8.6	9	50,850	
東芝機械	41	8	15,872	
アマダホールディングス	112.5	107.8	132,809	
アイダエンジニアリング	18.6	19.5	17,725	
滝澤鉄工所	3.2	—	—	
FUJI	21.5	20.6	30,755	
牧野フライス製作所	35	8.1	37,300	
オーエスジー	33.8	35	79,765	
旭ダイヤモンド工業	22	19.2	13,478	
DMG森精機	40.6	44.9	71,391	
ソディック	16.1	15.6	13,072	
ディスコ	9.9	9.6	158,880	
日東工器	5.1	4.4	11,044	
日進工具	—	2.4	6,362	
パンチ工業	3.5	—	—	
豊和工業	4.3	5	4,320	
OKK	4.4	—	—	
石川製作所	2.1	—	—	
東洋機械金属	6.8	—	—	
津田駒工業	27	2.2	4,875	
島精機製作所	9.2	9.8	34,447	
オプトラン	—	7.1	17,458	
フリーユ	6.5	7.6	7,790	
ヤマシンフィルタ	10.5	12.9	11,674	
日阪製作所	12.6	10.1	9,625	
やまびこ	14.5	13.7	17,782	
平田機工	2	3.4	20,536	
ペガサスミシン製造	9	8.6	7,146	
ナプテスコ	40.3	39	122,460	
三井海洋開発	7.8	7.5	21,187	

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		
レオン自動機	6.9	7.1	12,936	
S M C	23.3	20.9	804,232	
新川	7.8	—	—	
ホソカワミクロン	2.8	2.6	13,442	
ユニオンツール	3.4	3.2	11,616	
オイレス工業	9.6	9.8	19,570	
日精エー・エス・ピー機械	2.5	2.3	9,349	
サトーホールディングス	9.7	8.6	25,757	
技研製作所	3.9	4.9	20,286	
日精樹脂工業	7	7.3	7,453	
オカダアイオン	2.7	3.2	5,497	
ワイエイシホールディングス	3.9	—	—	
小松製作所	358.6	323.3	980,568	
住友重機械工業	42.3	40.5	152,482	
日立建機	34.4	28.5	89,347	
日工	3	2.7	6,763	
巴工業	4.1	3.7	8,754	
井関農機	7.5	7.5	13,852	
T O W A	6.2	7.3	5,409	
北川鉄工所	4.3	3.7	9,520	
ローツェ	3.8	3.6	6,692	
クボタ	400.5	382.8	741,483	
荏原実業	—	3.5	7,017	
三菱化工機	3	3.9	6,750	
月島機械	15	14.2	18,886	
帝国電機製作所	7	5.8	9,604	
新東工業	17.9	17	16,660	
澁谷工業	6.6	6.3	26,050	
アイチ コーポレーション	13.1	14.2	9,329	
小森コーポレーション	18.7	19.1	23,913	
鶴見製作所	6.4	6	11,928	
住友精密工業	18	1.8	6,327	
酒井重工業	2	1.8	4,849	
荏原製作所	30.5	31.8	93,619	
西島製作所	9.3	9.8	10,211	
北越工業	9.3	8.1	10,222	
ダイキン工業	101.3	97.4	1,228,214	
オルガノ	3.3	3.1	9,734	
トーヨーカネツ	3.4	3.1	7,483	
栗田工業	40.2	38.5	117,232	
椿本チエイン	43	9.1	38,629	
大同工業	4	5.7	6,133	
アネスト岩田	13.5	11.8	14,537	
ダイフク	36.9	39.3	228,333	
加藤製作所	3.7	3.9	11,836	
タダノ	36.1	35	47,635	
フジテック	22.6	25.5	35,547	
CKD	20.4	19.9	22,705	
キトー	6.3	6.1	11,413	
平和	22.7	19.7	47,634	
理想科学工業	7.2	6.2	12,015	
SANKYO	18.9	17.9	81,266	
日本金銭機械	7.9	9	10,152	

銘柄	期首(前期末)		期	末
	株数	株数		
マースグループホールディングス	4.9	5.1	11,954	
福島工業	4.6	4.3	18,812	
ダイコク電機	4.1	4.3	7,314	
竹内製作所	12.3	11.9	27,191	
アマノ	22.8	20.7	50,673	
J U K I	11.1	10.2	15,453	
サンデンホールディングス	9.2	9.3	8,184	
蛇の目ミシン工業	9.3	9.9	5,613	
マックス	11.6	10.9	16,262	
グローリー	22.4	19.9	57,132	
新晃工業	8	7.4	12,210	
大和冷機工業	12	10.3	13,534	
セガサミーホールディングス	73.8	71	113,742	
日本ピストンリング	3.8	3.5	7,301	
リケン	3.5	3.3	18,678	
T P R	8.2	9.4	25,370	
ツバキ・ナカシマ	7.5	11	21,263	
ホシザキ	23.4	20.8	183,248	
大豊工業	6.5	6.9	7,693	
日本精工	151.2	145	154,715	
N T N	170.8	152.2	57,988	
ジェイテクト	78.3	67.6	97,614	
不二越	71	6.8	32,980	
日本トムソン	25	22.3	14,004	
T H K	46.2	44.7	116,264	
ユーシン精機	3.6	6.3	7,396	
前澤給装工業	—	4.1	7,925	
イーグル工業	8.3	9.3	13,847	
日本ビラー工業	8.4	8.3	12,765	
キッツ	33.4	28.9	28,090	
マキタ	96.4	86.6	385,803	
日立造船	57.9	54.2	21,138	
三菱重工業	124.6	119.7	516,744	
I H I	57.1	54.8	189,334	
スター精密	12	12.5	21,150	
電気機器 (13.0%)				
日清紡ホールディングス	45.7	39.6	40,906	
イビデン	45.8	44.1	69,633	
コニカミノルタ	173.1	156.2	159,636	
ブラザー工業	90.6	92.7	175,851	
ミネベアミツミ	137.5	132.3	243,696	
日立製作所	1,783	321.1	1,055,776	
三菱電機	742.2	713.2	1,068,373	
富士電機	223	46.3	165,059	
東洋電機製造	4	4	6,136	
安川電機	85.8	82.8	293,112	
シンフォニアテクノロジー	49	10.3	17,396	
明電舎	64	14.2	22,805	
オリジン電気	2.7	3.2	6,182	
山洋電気	3.6	3.6	15,696	
デンヨー	7.4	7.5	12,030	
東芝テック	52	8.8	26,972	
芝浦メカトロニクス	13	1.7	6,902	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
マブチモーター	20.6	19.6	77,518	
日本電産	89.3	85.9	1,298,808	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3.1	4.2	10,462	
トレックス・セミコンダクター	—	3.2	4,988	
東光高岳	4.5	4.4	6,960	
ダブル・スコープ	11.2	10.9	15,031	
ダイヘン	40	7.9	21,922	
ヤーマン	9.9	10.6	19,832	
JVCケンウッド	56	53.2	15,321	
ミマキエンジニアリング	7.6	7.3	6,781	
第一精工	3.9	3.9	5,397	
日新電機	17.4	17	16,167	
大崎電気工業	16.8	15.9	12,926	
オムロン	78.6	75.7	377,743	
日東工業	11.1	11.6	22,364	
I D E C	9.6	9.9	24,918	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	134	26	68,198	
サクサホールディングス	2.4	2.7	5,445	
メルコホールディングス	3.9	3	11,670	
日本電気	95.9	92	323,840	
富士通	763	68.9	481,404	
沖電気工業	30.5	31.4	47,100	
電気興業	4.9	4.3	12,728	
サンケン電気	44	8.6	20,803	
アイホン	5.2	5.4	9,271	
ルネサスエレクトロニクス	37.8	73	39,055	
セイコーエプソン	109.8	88.4	159,473	
ワコム	58.7	53	30,422	
アルバック	12.5	16.6	69,222	
E I Z O	6.8	6.6	31,350	
ジャパンディスプレイ	108.1	93	6,510	
日本信号	21	18.3	18,519	
京三製作所	20	18.5	9,342	
能美防災	9.4	9.5	21,413	
ホーチキ	5.6	5.3	6,958	
エレコム	6.7	6.5	19,532	
パナソニック	848.4	815.1	949,183	
シャープ	—	71.1	119,732	
アンリツ	54.7	45.8	85,233	
富士通ゼネラル	22.9	22.3	35,746	
日立国際電気	14.3	—	—	
ソニー	495.7	478.4	2,840,260	
T D K	38.7	37.3	333,835	
帝国通信工業	—	5.4	6,582	
タムラ製作所	29.1	28.1	18,433	
アルプス電気	63.5	65.3	171,804	
池上通信機	34	—	—	
バイオニア	120	—	—	
日本電波工業	9.5	—	—	
日本トリム	1.9	1.6	9,920	
ローランド ディー・ジー	4.2	4.3	10,582	
フォスター電機	8.9	8.8	13,613	
クラリオン	39	6.2	15,438	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
S M K	21	2.6	6,635	
ヨコオ	5.7	5.7	9,855	
ホシデン	18.9	21.3	18,744	
ヒロセ電機	12	10.3	123,291	
日本航空電子工業	19	16.4	23,452	
T O A	8.7	8.6	10,560	
マクセルホールディングス	14.5	15.3	24,357	
古野電気	10.8	9.7	12,532	
ユニデンホールディングス	25	2.8	7,058	
アルパイン	18	12.9	23,723	
スミダコーポレーション	8	7	10,640	
アイコム	4.8	4.4	10,348	
リオン	3.6	3.8	7,721	
本多通信工業	6.4	7.6	4,780	
船井電機	9.2	10.7	7,992	
横河電機	74.3	71.4	148,940	
新電元工業	2.7	2.7	12,622	
アズビル	22.3	46.2	113,190	
東亜ディーケーケー	—	4.6	4,406	
日本光電工業	31.3	31.6	116,762	
チノー	4	4.5	6,664	
共和電業	13	11.7	4,925	
堀場製作所	14.8	14.3	76,076	
アドバンテスト	41.6	49.1	119,607	
エスベック	6.7	6.9	14,538	
キーエンス	36.4	35	2,156,000	
日置電機	4.7	3.9	16,536	
シスメックス	57.6	55.6	336,324	
日本マイクロニクス	13.2	12.9	12,654	
メガチップス	6.1	6	16,494	
O B A R A G R O U P	4.3	4.2	20,412	
澤藤電機	1.2	—	—	
コーセル	10.7	10.9	12,644	
イリソ電子工業	6.2	6.5	32,337	
新日本無線	5.5	—	—	
オプテックスグループ	6.2	12.8	29,491	
千代田インテグレ	3.9	3.6	8,784	
アイ・オー・データ機器	4.3	4.1	4,842	
レーザーテック	16.4	14.7	53,728	
スタンレー電気	56.7	50.5	166,902	
岩崎電気	3.5	4.7	7,162	
ウシオ電機	45.3	43.7	55,586	
ヘリオス テクノ ホールディング	7.2	7.6	5,973	
日本セラミック	7.7	7.4	21,164	
遠藤照明	5.3	—	—	
古河電池	5.9	6.8	5,637	
双信電機	3.7	—	—	
山一電機	5.6	5.8	8,903	
図研	5.5	5.4	9,536	
日本電子	28	14.3	28,414	
カシオ計算機	60	63.2	100,045	
ファナック	70.6	67.8	1,314,642	
日本シイエムケイ	13.8	19.4	17,460	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
エンブラス	3.5	3.6	11,286	
大真空	3.7	—	—	
ローム	33.2	34.5	272,550	
浜松ホトニクス	54	51.1	201,845	
三井ハイテック	10	8.5	10,922	
新光電気工業	28.2	23.7	19,031	
京セラ	121.9	108.8	666,400	
太陽誘電	33.7	32.1	69,111	
村田製作所	77.9	74.9	1,296,893	
ユージン	13.4	13.9	13,691	
双葉電子工業	12.2	11.6	20,636	
北陸電気工業	4.1	—	—	
ニチコン	23.3	22.9	20,655	
日本ケミコン	6.1	5.4	12,652	
KOA	10.5	11.2	17,102	
市光工業	11.5	11.3	8,407	
小糸製作所	44.2	42.5	258,825	
ミツバ	13.8	14	10,458	
SCREENホールディングス	14.1	12.5	71,000	
キャノン電子	6.8	6.5	13,929	
キャノン	399.8	384.4	1,237,768	
リコー	222.8	214.3	236,158	
象印マホービン	—	13.6	15,925	
東京エレクトロン	49.5	47.6	755,650	
輸送用機器（8.0%）				
トヨタ紡織	21.8	24.9	43,550	
芦森工業	1.9	—	—	
ユニプレス	14.4	14.5	31,001	
豊田自動織機	59.8	57.5	334,650	
モリタホールディングス	12	12.5	27,975	
三櫻工業	11.7	11.2	7,257	
デンソー	164.8	158.2	830,075	
東海理化電機製作所	19.6	19	39,615	
三井E&Sホールディングス	26.9	26.4	32,498	
川崎重工業	57.4	55.5	146,686	
名村造船所	23.3	23.5	13,136	
日本車輛製造	33	3.1	8,202	
三菱ロジスネクスト	9.8	9.2	12,052	
日産自動車	875.9	841.4	836,604	
いすゞ自動車	215.5	226.2	365,539	
トヨタ自動車	902.9	795.5	5,411,786	
日野自動車	105.7	88.9	103,124	
三菱自動車工業	274.6	263.9	183,674	
エフテック	5.5	6.7	7,457	
武蔵精密工業	8	16.8	30,172	
日産車体	29	14.8	13,956	
新明和工業	31.3	33	50,391	
極東開発工業	14	14.4	23,702	
日信工業	14.8	12.8	19,251	
トビー工業	6.2	6	16,068	
ティラド	3.2	3.3	8,438	
曙ブレーキ工業	36.7	—	—	
タチエス	13	12.3	19,667	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
NOK	40.1	38.5	65,835	
フタバ産業	23.2	20.3	12,423	
KYB	7.8	7.6	21,485	
大同メタル工業	11.7	13.3	12,635	
プレス工業	40.2	35.9	22,006	
ミクニ	12.7	11.2	6,585	
太平洋工業	15.9	14.9	25,374	
ケーヒン	17	16.1	31,620	
河西工業	9.4	9.9	9,870	
アイシン精機	60.8	58.5	262,665	
マツダ	233.2	224.9	272,129	
今仙電機製作所	8.5	8.8	9,328	
本田技研工業	668.3	602	1,927,604	
スズキ	147.2	130.7	739,108	
SUBARU	230.5	221.6	559,096	
安永	3.7	3.9	7,464	
ヤマハ発動機	104.3	100.5	234,667	
ショーワ	19.6	16.9	25,654	
TBK	14.5	16.5	7,392	
エクセディ	8.8	9.2	26,808	
豊田合成	27.1	23.2	50,692	
愛三工業	13.6	12.9	10,719	
日本ブラスト	—	7.4	6,830	
ヨロズ	7.5	7.4	11,055	
エフ・シー・シー	12.3	12.7	37,477	
シマノ	29.9	28.7	475,846	
テイ・エス テック	17.3	16.8	55,272	
ジャムコ	3.9	3.9	12,499	
精密機器（1.8%）				
テルモ	113.8	100.7	673,179	
日機装	26.9	23.2	26,262	
島津製作所	88.5	91.4	242,575	
JMS	11.5	12	7,140	
長野計器	6.8	7.4	7,081	
ブイ・テクノロジー	1.7	1.7	27,081	
東京計器	5.7	6	6,654	
インターアクション	—	4.3	11,094	
東京精密	13.4	12.7	42,926	
マニー	9.3	8.8	46,992	
ニコン	129.2	123.9	220,542	
トプコン	40.2	38.6	67,588	
オリンパス	110.5	105.9	338,350	
理研計器	7.2	6.4	15,206	
タムロン	6.4	6.4	11,699	
HOYA	152.9	143.7	991,530	
シード	—	3.5	5,544	
ノーリツ鋼機	7.8	5.8	11,339	
エー・アンド・デー	—	7.9	6,580	
朝日インテック	—	25.6	136,192	
シチズン時計	90	78.4	47,040	
リズム時計工業	4	3.5	7,157	
大研医器	10	8.5	6,502	
メニコン	5.2	9.9	29,630	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
松風	6.2	3.2	3,945	
セイコーホールディングス	10.9	11.1	27,972	
ニプロ	52.4	49.9	76,995	
その他製品 (2.1%)				
スノーピーク	3	3.2	4,438	
パラマウントベッドホールディングス	7.8	8.1	38,839	
トランザクション	4	5.1	4,217	
ニホンフラッシュ	4.1	3.6	7,488	
前田工織	7.5	8.1	21,108	
永大産業	14	16.8	7,543	
アートネイチャー	11	10.7	7,297	
ダンロップスポーツ	6.3	—	—	
パンダインナムコホールディングス	76.6	73.7	351,549	
SHOEI	3.5	3.5	15,522	
フランスベッドホールディングス	11.1	12.8	12,403	
パイロットコーポレーション	13	12.6	73,962	
萩原工業	5	4.7	8,037	
トッパン・フォームズ	13.8	15.1	15,719	
フジシールインターナショナル	16.4	15.9	65,031	
タカラトミー	31	30.1	42,621	
廣済堂	—	12	5,136	
アーク	40.9	—	—	
プロネクサス	8.5	7.9	9,061	
大建工業	5.8	5.8	12,272	
凸版印刷	208	99.6	182,068	
大日本印刷	96.8	100	262,600	
図書印刷	5.7	8.1	6,723	
共同印刷	2.5	3.3	8,748	
NISSHA	14.7	14.9	26,536	
ニ印刷	5.3	5.1	9,389	
アシックス	73.8	71	116,156	
ツツミ	3.1	—	—	
小松ウオール工業	3.4	—	—	
ヤマハ	49.9	42.4	207,336	
河合楽器製作所	3.3	2.5	10,075	
クリナップ	8.8	9.5	6,887	
ビジョン	44.9	43.3	202,427	
キングジム	8.3	8.8	8,043	
リンテック	17.6	17.2	44,204	
イトーキ	16.9	15.8	9,748	
任天堂	45.7	44	1,522,840	
三菱鉛筆	12	11.7	25,470	
タカラスタンダード	15.1	14.3	25,425	
コクヨ	35.6	34.4	60,165	
ナカバヤシ	9.9	7.8	4,609	
グローブライド	4.5	3.9	11,267	
オカムラ	25.7	24.6	40,270	
美津濃	7.3	7.1	18,332	
電気・ガス業 (1.9%)				
東京電力ホールディングス	591.4	568.1	391,420	
中部電力	227.7	218.2	371,376	
関西電力	303.4	291.2	496,204	
中国電力	101.7	97.5	139,815	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
北陸電力	73.3	70.1	70,871	
東北電力	173	166.5	247,086	
四国電力	66.9	64.3	87,769	
九州電力	162.8	145.8	194,351	
北海道電力	74.8	67.5	52,515	
沖縄電力	12	13.1	29,579	
電源開発	59.2	56.5	165,093	
エフオン	4.3	5.2	5,314	
イーレックス	12.4	12.9	8,939	
レノバ	—	7.7	8,978	
東京瓦斯	158.7	140.2	410,014	
大阪瓦斯	144.5	139.1	287,797	
東邦瓦斯	36.9	35.2	161,568	
北海道瓦斯	—	5	7,520	
広島ガス	22.2	20.5	7,400	
西部瓦斯	9.1	8.1	20,233	
静岡ガス	21.3	21.7	21,200	
メタウォーター	4.5	3.8	12,103	
陸運業 (4.6%)				
SBSホールディングス	8.7	7.8	10,678	
東武鉄道	79	74.8	243,100	
相鉄ホールディングス	24.5	24.5	84,525	
東京急行電鉄	200.5	193.5	382,356	
京浜急行電鉄	102	97.9	177,296	
小田急電鉄	109.7	113.6	289,112	
京王電鉄	41.3	39.6	248,688	
京成電鉄	51.8	53.3	196,144	
富士急行	10.4	9.8	31,556	
新京成電鉄	—	3.4	7,214	
東日本旅客鉄道	133.4	126.9	1,309,608	
西日本旅客鉄道	67.1	64.2	507,757	
東海旅客鉄道	66.5	63.9	1,490,467	
西武ホールディングス	94.8	91	190,918	
鴻池運輸	10.7	11.2	19,969	
西日本鉄道	20.5	20	59,160	
ハマキョウレックス	5.1	5.5	23,127	
サイ引越センター	3.9	3.8	24,434	
近鉄グループホールディングス	69.9	67.2	317,856	
阪急阪神ホールディングス	93.4	90	346,500	
南海電気鉄道	33.6	30.4	92,264	
京阪ホールディングス	31.8	29.9	141,726	
神戸電鉄	2.5	2.7	10,800	
名古屋鉄道	54.2	53.7	152,776	
山陽電気鉄道	6	5.6	13,232	
日本通運	27.5	26.4	180,576	
ヤマトホールディングス	123.8	118.8	356,221	
山九	18.3	18.8	100,016	
丸全昭和運輸	29	5.5	17,132	
センコーグループホールディングス	40.2	37.2	32,884	
トナミホールディングス	1.8	1.8	11,736	
ニッコンホールディングス	26.5	25.9	75,291	
福山通運	10.1	8.6	42,828	
セイノーホールディングス	52.7	50.8	85,598	

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	
神奈川中央交通	2.4	2.5	9,762
日立物流	14.8	14.3	43,901
丸和運輸機関	4	3.6	12,078
C&Fロジホールディングス	8.6	8.6	11,180
九州旅客鉄道	59.3	56.8	213,000
S Gホールディングス	—	63.9	177,578
海運業 (0.2%)			
日本郵船	58.4	56	107,912
商船三井	44.2	39.9	106,493
川崎汽船	32.8	21.2	34,577
N Sユナイテッド海運	3.8	4.1	12,546
飯野海運	37.7	33.8	15,243
乾汽船	9	8	8,216
空運業 (0.6%)			
日本航空	130.8	124.1	508,065
A N Aホールディングス	138.1	124.1	502,729
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	2.1	1.9	12,388
日新	6.3	6	11,736
三菱倉庫	24.3	23.4	65,613
三井倉庫ホールディングス	45	8.6	17,243
住友倉庫	51	26.1	38,027
澁澤倉庫	5.2	5.5	9,141
東陽倉庫	22.3	25.3	7,944
日本トランスシティ	22	19.5	9,594
川西倉庫	1.9	2.6	4,323
安田倉庫	8.7	8.7	7,612
東洋埠頭	3.5	2.4	3,741
上組	44.2	42.2	107,567
キューソー流通システム	2.4	2.3	5,770
郵船ロジスティクス	6.9	—	—
近鉄エクスプレス	13	12.6	24,103
エアアイティー	6.3	5.4	5,502
情報・通信業 (7.6%)			
N E Cネットエスアイ	8	7.6	19,212
システナ	6	25.3	36,963
デジタルアーツ	3.7	3.9	25,311
新日鉄住金ソリューションズ	11.2	10.4	33,748
キューブシステム	6.9	6.1	4,703
コア	3.8	4.4	6,164
ソリトンシステムズ	—	5.3	4,801
ソフトクリエイトホールディングス	5	4.4	7,651
T I S	24.5	23.4	122,616
ネオス	—	2.9	3,871
電算システム	3.7	3.9	8,864
グリー	45.4	38	18,848
コーエーテクモホールディングス	12.4	14.4	27,129
三菱総合研究所	3.6	3	11,580
フィンテックス	8	8.1	5,848
ヒト・コミュニケーションズ	2.3	—	—
ブレインパッド	—	1.6	11,792
K L a b	14.5	13	15,444
ポルトゥワイン・ビツクルーホールディ	6.1	4.9	12,862

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
イーブックイニシアティブジャパン	—	1.5	2,635
ネクソン	81.6	178.6	239,681
アイスタイル	18.1	18.4	21,399
エムアップ	2.9	2.7	5,948
エイチーム	5.3	4.9	8,305
テクノスジャパン	7.3	6.9	7,051
コロプラ	24	20.8	17,784
ブロードリーフ	19	36.3	23,050
デジタルハーツホールディングス	4.6	4.3	7,181
メディアドゥホールディングス	2.7	2.4	6,650
じげん	—	9.3	6,221
フィックスターズ	1.5	7.3	9,876
VOYAGE GROUP	4.3	4.8	6,067
オプティム	1.7	1.8	8,595
セレス	3	2.8	5,975
ティーガイア	7.2	6.9	16,711
セック	—	1.4	6,146
日本アジアグループ	11.8	—	—
豆蔵ホールディングス	6.6	7.1	7,611
テクマトリックス	4.8	5.4	10,206
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200	174.5	43,974
GMOペイメントゲートウェイ	5.2	11.6	81,084
システムリサーチ	—	1.2	4,326
インターネットイニシアティブ	11.9	11.6	32,387
さくらインターネット	9.9	10.5	6,216
ヴィンクス	—	2.7	4,957
GMOクラウド	2	2	8,020
S R Aホールディングス	4.3	4.1	12,464
e B A S E	—	2.9	5,014
アドソル日進	—	2.9	5,689
フリービット	6.4	5.8	5,730
コムチュア	4.4	4.2	13,965
アステリア	—	4.4	3,977
マークライnz	—	3.3	5,029
メディカル・データ・ビジョン	3.3	6.6	6,771
g u m i	9.2	9.1	6,752
モバイルファクトリー	—	2.5	3,385
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	—	3.6	5,806
P C Iホールディングス	1.6	1.7	4,749
オーブントア	1.2	3.8	12,635
アカツキ	1.5	2.6	14,404
L I N E	20.5	21.6	88,128
オークネット	3.7	5.2	5,824
A O I T Y O Holdings	6.8	8.3	8,715
マクロミル	9.6	9.2	16,385
オロ	—	0.9	3,424
フェイス	5	4.5	5,368
野村総合研究所	48.6	44.5	221,832
サイバネットシステム	7.9	7.6	5,137
インテージホールディングス	9.6	10.7	10,903
ソースネクスト	—	28.2	20,755
フォーカスシステムズ	5.6	6	6,684
クレスコ	1.8	2.4	9,240

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
フジ・メディア・ホールディングス	76.7	73	129,137
オービック	23	24.3	238,383
ジャストシステム	12	10.1	25,765
TDCソフト	4.8	7.1	6,908
ヤフー	524	457.5	148,687
トレンドマイクロ	35.6	37.4	243,474
日本オラクル	11.8	11.4	84,018
アルファシステムズ	3.4	2.9	7,731
フューチャー	11.3	10.1	17,705
CAC Holdings	7.9	7.7	8,269
ソフトバンク・テクノロジー	3.6	3.2	6,777
トーセ	2.2	—	—
オービックビジネスコンサルタント	3.8	3.6	35,784
伊藤忠テクノソリューションズ	16.7	32	70,048
アイティフォー	14.4	9.9	8,464
大塚商会	21.8	37.9	144,778
サイボウズ	14.5	10.2	7,140
電通国際情報サービス	4.9	4.5	17,280
デジタルガレージ	13.4	13.9	43,159
EMシステムズ	3.6	7.2	8,438
ウェザーニューズ	3.3	3	9,645
C I J	—	9	6,777
WOWOW	3.7	3.6	11,952
スカラ	7	7.4	6,238
IMAGICA GROUP	7.1	7.4	4,491
ネットワンシステムズ	29.9	24.9	58,440
アルゴグラフィックス	3.8	3.1	14,074
マーベラス	13.3	12.2	11,187
エイベックス	14	12.3	19,003
日本ユニシス	20.1	21.8	63,111
兼松エレクトロニクス	4.7	3.9	14,196
東京放送ホールディングス	44.2	46.7	99,284
日本テレビホールディングス	67.1	64.4	114,438
朝日放送グループホールディングス	10.2	10.5	8,242
テレビ朝日ホールディングス	20	19.6	44,786
スカパーJ S A Tホールディングス	53.2	53.4	29,209
テレビ東京ホールディングス	6.2	5.8	15,950
ビジョン	2.2	2.3	10,982
ワイヤレスゲート	4.4	—	—
コネクシオ	5.5	5.5	8,123
日本電信電話	523	479.1	2,242,188
KDDI	656.1	617.2	1,644,220
光通信	8.8	8.3	150,313
N T Tドコモ	539.4	503	1,322,135
エムティーアイ	11.6	10.2	6,130
GMOインターネット	26.7	25.9	38,591
カドカワ	21.3	20.6	29,066
学研ホールディングス	3.3	2.5	10,987
ゼンリン	9	14.1	39,719
アイネット	5.6	5.2	8,678
松竹	4.9	4.8	57,072
東宝	48	46.1	182,095
東映	2.8	2.9	40,020

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
エヌ・ティ・ティ・データ	225.5	186.5	246,180
D T S	7.6	7.7	31,493
スクウェア・エニックス・ホールディングス	33.9	32.7	120,990
シーイーシー	4.8	7.7	18,903
カプコン	16	30.5	67,771
アイ・エス・ビー	—	1.7	4,035
ジャステック	5.8	5.8	6,177
S C S K	17.5	18.6	83,793
日本システムウエア	2.8	2.8	6,927
アイネス	11.5	10.1	12,816
T K C	6.9	5.9	24,072
富士ソフト	10.1	10.4	53,456
N S D	11.6	11.2	26,790
コナミホールディングス	29.9	28.7	145,796
福井コンピュータホールディングス	2.5	3	5,265
J B C Cホールディングス	8.5	6.6	11,688
ミロク情報サービス	6.6	7.3	17,885
ソフトバンクグループ	329.9	292.8	2,789,212
卸売業 (5.0%)			
伊藤忠食品	2	1.9	10,108
エレマテック	3.6	3.8	8,591
J A L U X	2.7	2.4	6,868
あらた	3.7	4	19,720
東京エレクトロニクス デバイス	3.8	3.8	7,261
フィールズ	6.7	7.8	7,144
双日	433.3	387.2	155,654
アルフレッサ ホールディングス	81.4	77.8	234,956
横浜冷凍	18	19.1	18,106
アルコニックス	8	8.7	11,353
神戸物産	4.8	10.6	36,888
ペッパーフードサービス	3.9	—	—
あい ホールディングス	10.8	11.5	26,024
ダイワボウホールディングス	6.3	6.4	40,704
マクニカ・富士エレホールディングス	13.4	19	33,288
ラクト・ジャパン	1.2	1.6	12,736
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15.5	13.3	16,119
八洲電機	—	9	7,515
U K Cホールディングス	5.5	5.2	12,667
ジーテックホールディングス	2.1	2.5	2,662
T O K A Iホールディングス	38.7	36.7	36,846
三洋貿易	4.4	4.4	8,901
ウイン・パートナーズ	5.5	5.3	6,158
シップヘルスケアホールディングス	15.3	14.5	61,915
コメダホールディングス	13.9	16.6	39,342
小野建	7.2	7.1	11,913
佐島電機	8.1	6.6	6,936
伯東	5.3	5.7	7,632
コンドーテック	8	8	8,264
ナガイレーベン	9.8	10.4	28,860
三菱食品	7.6	7.5	22,987
松田産業	6.3	6.2	9,250
第一興商	11	10.7	55,426
メディバルホールディングス	73.4	75.6	196,560

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	数	株数	数	
SPK	—	—	2	—	4,780
萩原電気ホールディングス	2.9	—	3.2	—	10,256
アズワン	5.8	—	5	—	41,900
尾家産業	4.4	—	4.1	—	5,477
シモジマ	6	—	4.1	—	4,624
ドウシシャ	8.2	—	6.5	—	13,676
高速	6.4	—	6.5	—	7,858
黒田電気	9.1	—	—	—	—
丸文	8.5	—	9	—	7,623
ハビネット	5.4	—	6.3	—	10,174
日本ライフライン	10.5	—	22.1	—	39,735
エクセル	3.3	—	3.2	—	6,428
マルカキカイ	3.7	—	3.1	—	6,956
IDOM	22.7	—	25.4	—	14,478
日本エム・ディ・エム	6.5	—	4.8	—	6,667
進和	5.2	—	4.8	—	11,664
ダイトロン	4.1	—	3.9	—	6,006
シークス	4.7	—	9.2	—	16,633
オーハシテクニカ	5.6	—	5.7	—	7,968
白銅	—	—	3.5	—	6,202
伊藤忠商事	536.8	—	491.8	—	991,468
丸紅	602	—	693.9	—	588,080
長瀬産業	44.6	—	39.7	—	67,370
蝶理	5.5	—	5.4	—	10,227
豊田通商	81.6	—	77.8	—	304,976
三共生興	18.8	—	16.8	—	7,677
兼松	30.8	—	27.4	—	39,675
三井物産	621.8	—	579.1	—	1,027,612
日本紙パルプ商事	4	—	4.1	—	18,388
日立ハイテクノロジーズ	25.4	—	21.4	—	86,563
カメイ	10	—	9.9	—	13,711
スターゼン	3.1	—	2.7	—	11,853
山善	28.1	—	26.6	—	31,999
椿本興業	—	—	2.2	—	7,414
住友商事	461.8	—	415.9	—	725,121
内田洋行	3.7	—	3.9	—	10,533
三菱商事	513.3	—	493.2	—	1,510,178
第一実業	3.9	—	3.5	—	14,035
キャンマーケティングジャパン	21.1	—	20.4	—	44,431
西華産業	5	—	4.8	—	7,905
佐藤商事	8.7	—	8	—	7,968
菱洋エレクトロ	7.3	—	7.8	—	14,024
東京産業	12.5	—	9.4	—	5,593
ユアサ商事	7	—	7	—	26,635
神鋼商事	1.9	—	2	—	5,516
阪和興業	14	—	12.4	—	42,160
正栄食品工業	4.2	—	3.8	—	18,392
カナデン	9.1	—	8.2	—	10,733
菱電商事	6.7	—	6.9	—	11,040
フルサト工業	5.8	—	5.2	—	9,963
岩谷産業	16.5	—	15.8	—	59,724
すてきなイスグループ	4.9	—	—	—	—
極東貿易	—	—	3	—	5,301

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額	
	株数	数	株数	数		
イワキ	—	—	14	—	10.8	5,702
三菱石油	—	—	19.5	—	18.6	24,142
稲畑産業	—	—	17.4	—	16.3	26,536
ワキタ	—	—	16	—	15.7	20,488
東邦ホールディングス	—	—	22.1	—	20.9	63,013
サンゲツ	—	—	25.2	—	21.9	47,566
ミツロコグループホールディングス	—	—	12.6	—	11.9	8,449
シナネンホールディングス	—	—	4.2	—	3.6	9,896
伊藤忠エネクス	—	—	16.1	—	14.8	15,791
サンリオ	—	—	21	—	22.5	52,785
サンワテクノス	—	—	5	—	5.7	7,107
リョーサン	—	—	9.4	—	8.2	27,142
新光商事	—	—	8.5	—	7.4	13,001
トーホー	—	—	4.1	—	4.1	9,819
三信電気	—	—	7.4	—	6.2	12,517
東陽テクニカ	—	—	10.7	—	11	9,988
モスフードサービス	—	—	9.6	—	8.9	27,278
加賀電子	—	—	6.7	—	7	16,828
ソーダニッカ	—	—	12.8	—	9.9	6,256
立花エレテック	—	—	5.7	—	6.1	10,790
PALTAAC	—	—	10	—	12.5	76,000
三谷産業	—	—	13.6	—	—	—
太平洋興発	—	—	5.6	—	5.4	4,789
西本Wismettacホールディングス	—	—	1.6	—	1.7	8,806
ヤマタネ	—	—	5.2	—	4.8	9,403
日鉄住金物産	—	—	5.5	—	4.7	24,064
泉州電業	—	—	—	—	3	8,007
トラスコ中山	—	—	15.1	—	14.3	46,117
オートボックスセブン	—	—	29.1	—	28.5	49,476
モリト	—	—	7.9	—	7.4	6,016
加藤産業	—	—	11.2	—	10.6	37,259
イノテック	—	—	8	—	5.8	6,797
イエローハット	—	—	7.1	—	6.7	19,986
JKホールディングス	—	—	10.3	—	10	6,150
日伝	—	—	6.2	—	6.6	12,064
杉本商事	—	—	6	—	4.8	8,640
因幡電機産業	—	—	9.5	—	9.6	45,264
バイテックホールディングス	—	—	4	—	3	7,296
東テック	—	—	—	—	2.8	7,868
ミスミグループ本社	—	—	84.9	—	88	226,336
タキヒヨー	—	—	3.2	—	3.4	6,687
スズケン	—	—	33.4	—	32	195,520
ジェコス	—	—	6.5	—	6.5	7,501
小売業 (5.3%)	—	—	—	—	—	—
ローソン	—	—	18.5	—	17.8	132,254
サンエー	—	—	5.4	—	5.2	24,778
カワチ薬品	—	—	5.8	—	6	13,254
エービーシー・マート	—	—	13.4	—	11	70,180
ハードオフコーポレーション	—	—	5.8	—	—	—
アスクル	—	—	7.7	—	6.1	18,086
ゲオホールディングス	—	—	13.3	—	10.8	20,638
アダストリア	—	—	11.3	—	10	18,590
くらコーポレーション	—	—	4.4	—	4.2	29,988

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
キャンドゥ	5.1	5.1	8,588	
バルグループホールディングス	4	3.9	12,012	
エディオン	27.8	29.3	36,566	
サーラコーポレーション	14.3	16.6	10,972	
ハローズ	3.2	3.1	8,053	
あみやき亭	1.9	1.9	7,790	
ひらまつ	14.2	19.6	7,232	
ゲンキー	3.4	—	—	
大黒天物産	2	2	8,970	
ハニーズホールディングス	8.8	8.8	7,999	
アルペン	6.1	6	11,682	
クオールホールディングス	7.5	10.5	21,315	
ジンズ	5.1	4.9	34,398	
ビックカメラ	41.8	37.1	59,211	
DCMホールディングス	39.7	37	41,662	
ペッパーフードサービス	—	5.7	23,370	
Monotaro	26.3	44.8	137,760	
DDホールディングス	1.7	2	4,932	
アークランドサービスホールディングス	6.4	5.5	13,827	
J.フロントリテイリング	87.1	90.1	139,655	
ドール・日レスホールディングス	12.8	12.1	26,801	
マツモトキヨシホールディングス	15.1	29.1	122,656	
ブロンコビリー	4.3	3.9	11,625	
ZOZO	71.9	76.3	192,657	
物語コーポレーション	2.2	2.1	23,247	
ココカラファイン	7.6	7.8	50,544	
三越伊勢丹ホールディングス	136.5	131.3	172,396	
Hamee	2.7	2.2	4,028	
ウエルシアホールディングス	19.3	18.5	106,375	
クリエイトSDホールディングス	10.7	10.1	31,259	
チムニー	2.7	2.8	7,702	
シュッピン	2.4	5.3	5,803	
ネクステージ	7.8	11	13,189	
ジョイフル本田	11.9	20.3	35,139	
鳥貴族	3.1	2.9	6,501	
キリン堂ホールディングス	—	3.4	5,491	
ホットランド	5.3	5.1	7,563	
すかいらーくホールディングス	45.2	65.8	122,388	
綿半ホールディングス	3.4	3.1	8,422	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	21.8	19	25,061	
あさひ	6.5	6.7	9,788	
日本調剤	2.9	2.7	9,909	
コスモス薬品	3.7	3.6	82,908	
セブン&アイ・ホールディングス	306.5	294.5	1,455,713	
薬王堂	3.3	3.1	10,540	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	19.5	18.8	24,910	
ツルハホールディングス	14.7	15.3	171,360	
サンマルクホールディングス	4.9	5.4	14,979	
トリドールホールディングス	9.1	8.9	19,686	
TOKYO BASE	1.5	7.3	5,080	
ジャパンミート	—	3.1	6,162	
ダイユー・リックホールディングス	—	5	5,955	
パロックジャパンリミテッド	7.2	6.9	7,403	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
クスリのアオキホールディングス	5.7	5.5	46,200	
スシローグローバルホールディングス	6.9	7.8	48,516	
LIXILヒバ	7.5	6.2	11,029	
メディカルシステムネットワーク	12.2	9.6	4,416	
総合メディカル	3.2	—	—	
ノジマ	12.8	12.4	32,302	
カッパ・クリエイト	11.2	11.2	16,800	
ライトオン	8	7.6	7,174	
良品計画	9.7	10	305,500	
三城ホールディングス	—	14.5	7,163	
アドヴァン	9	12.3	13,517	
アルビス	2	3.1	8,884	
コナカ	14	13.8	6,858	
G-7ホールディングス	2.8	2.6	6,853	
イオン北海道	—	10.1	8,201	
コジマ	16.6	12.8	6,630	
コーナン商事	10.6	9.2	25,760	
エコス	4.8	3.1	6,469	
ワタミ	10	10.3	14,646	
ドンキホーテホールディングス	47.4	45.6	314,184	
西松屋チェーン	15.9	15.6	15,553	
センショーホールディングス	38.5	33.6	94,953	
幸楽苑ホールディングス	5.5	6.2	13,894	
サイゼリヤ	10.8	11.5	24,955	
VTホールディングス	26	26	12,194	
ユナイテッドアローズ	9.2	8.1	30,982	
ハイデイ日高	8.1	9.1	21,448	
京都きもの友禅	7.2	—	—	
コロワイド	24	23.2	61,294	
ピーシーデポコーポレーション	11.9	10.8	5,983	
壱番屋	5.1	4.9	23,348	
スギホールディングス	16.2	15.5	82,770	
ヴィア・ホールディングス	9.3	11.8	8,625	
スクロール	15.7	12.7	5,765	
ヨンドシーホールディングス	7.7	7.9	19,473	
ユニ・ファミリーマートホールディングス	23.4	19.6	315,756	
木曾路	9.3	8.5	22,253	
SRSホールディングス	11.8	10.4	10,732	
千趣会	15.3	—	—	
ケーヨー	15.7	17	10,353	
上新電機	8.7	8.3	24,003	
日本瓦斯	13.5	12.9	52,116	
ロイヤルホールディングス	12.9	12.2	34,879	
いなげや	8.4	7.7	12,181	
島忠	19.4	16.1	49,346	
チヨダ	8.5	7.3	14,957	
ライフコーポレーション	5.4	5.2	14,081	
リンガーハット	9	8.9	22,045	
MrMaxHD	11.4	11.8	6,419	
AOKIホールディングス	14.7	13.8	20,217	
オークワ	12	11	13,728	
コメリ	12	11.3	30,702	
青山商事	14.4	13.7	39,017	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
しまむら	8.5		8.2		79,048
高島屋	115		55.4		91,410
松屋	15		14.9		21,068
エイチ・ツー・オー リテイリング	35		36.3		70,676
近鉄百貨店	3		3		11,190
パルコ	7.2		7.7		10,087
丸井グループ	70.3		59.6		145,841
アクシアル リテイリング	5.9		5.7		22,999
イオン	281.9		270.5		736,030
イズミ	13.3		14.3		91,949
平和堂	14.6		13.8		43,470
フジ	8.4		8.6		18,395
ヤオコー	8.2		7.7		52,283
ゼビオホールディングス	9.9		8.1		11,931
ケーズホールディングス	31.3		73.2		87,620
Olympicグループ	9.1		5.8		5,017
日産東京販売ホールディングス	15.7		17.8		6,176
Genky DrugStores	—		2.9		10,744
総合メディカルホールディングス	—		6.1		16,256
アインホールディングス	10.6		9.5		83,125
元気寿司	2.4		2.1		10,521
ヤマダ電機	244.8		215.5		118,309
アークランドサカモト	12.8		11.9		18,468
ニトリホールディングス	29		30.5		463,752
グルメ軒屋	7		8.2		9,799
吉野家ホールディングス	25.6		25.5		49,699
松屋フーズホールディングス	3.7		3.3		12,853
サガミホールディングス	11.2		10.4		14,372
関西スーパーマーケット	6.9		6.9		7,590
王将フードサービス	5.3		5.1		40,443
ブレナス	8.2		7.7		15,284
ミニストップ	5.7		5.6		11,603
アークス	13.5		12.8		36,403
パローホールディングス	17.5		15.5		45,384
ベルク	3.3		3.4		20,502
大庄	5.6		5.5		9,449
ファーストリテイリング	12.2		9.4		554,976
サンドラッグ	31		26.4		101,112
サクスパー ホールディングス	7.9		7.3		8,205
ペルーナ	18		17.3		22,126
銀行業 (6.7%)					
じもとホールディングス	53		60.3		9,045
めぶきフィナンシャルグループ	378		365.5		125,366
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10.1		10		20,990
九州フィナンシャルグループ	121.2		113.5		60,268
ゆうちょ銀行	205.4		198.4		263,078
富山第一銀行	20		21.6		9,352
コンコルディア・フィナンシャルグループ	445.6		446.2		237,824
西日本フィナンシャルホールディングス	50		45.9		56,548
関西みらいフィナンシャルグループ	—		33.3		30,469
三十三フィナンシャルグループ	—		7		13,433
第四北越フィナンシャルグループ	—		12.2		45,140
新生銀行	63.3		50.8		79,146

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
あおぞら銀行	43.6		38.7		144,351
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,174.5		4,902		3,061,299
りそなホールディングス	803		768.8		462,740
三井住友トラスト・ホールディングス	143.9		137.6		626,355
三井住友フィナンシャルグループ	554.3		495.8		2,073,931
第四銀行	9.1		—		—
北越銀行	7.6		—		—
千葉銀行	261		247		184,015
群馬銀行	150		138.4		74,874
武蔵野銀行	12		10.6		32,542
千葉興業銀行	21		23.6		10,502
筑波銀行	31.8		36.8		8,905
七十七銀行	23.2		21.9		49,778
青森銀行	5.8		6.1		19,062
秋田銀行	4.9		5.3		12,359
山形銀行	8.5		8.2		19,573
岩手銀行	5		5.1		21,114
東邦銀行	67		63.4		23,838
東北銀行	4		5.5		7,397
みちのく銀行	5		5.5		9,993
ふくおかフィナンシャルグループ	298		56.7		146,796
静岡銀行	191		175.7		179,038
十六銀行	10		9.4		25,342
スルガ銀行	74.9		69.8		37,552
八十二銀行	130.8		122.9		64,030
山梨中央銀行	46		9.3		15,465
大垣共立銀行	11.7		11		27,390
福井銀行	6.4		6.9		13,289
北國銀行	8.2		7.8		33,150
清水銀行	2.6		3.9		7,413
富山銀行	1.5		1.7		6,426
滋賀銀行	70		13.9		39,587
南都銀行	8.8		8.6		22,136
百五銀行	69		62.9		28,305
京都銀行	27.9		25		136,500
紀陽銀行	28		24.8		44,838
三重銀行	3.5		—		—
ほくほくフィナンシャルグループ	49		46.3		68,709
広島銀行	108.5		101.8		69,631
山陰合同銀行	44		42		37,590
中国銀行	51		45		47,565
伊予銀行	105		91.4		63,705
百十四銀行	79		7.8		22,487
四国銀行	11.5		11.1		15,528
阿波銀行	59		11.1		36,408
大分銀行	4.3		4.6		17,572
宮崎銀行	5		5.2		17,082
佐賀銀行	4.7		4.7		9,705
十八銀行	46		4.6		13,123
沖縄銀行	7.2		6.6		24,651
琉球銀行	14.5		17		22,066
セブン銀行	276.4		237.5		83,600
みずほフィナンシャルグループ	9,950		9,556		1,799,394

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
山口フィナンシャルグループ	69	86.6	101,841	
名古屋銀行	6	6	22,020	
北洋銀行	112	107.2	35,268	
愛知銀行	2.5	2.8	12,292	
第三銀行	4.5	—	—	
中京銀行	3.3	3.7	8,713	
大光銀行	2.8	3.5	7,437	
愛媛銀行	10.5	11	12,705	
みなと銀行	7	—	—	
京葉銀行	63	31	24,800	
関西アーバン銀行	10.5	—	—	
栃木銀行	39	39.2	11,564	
北日本銀行	2.4	3	7,452	
東和銀行	13.3	13.8	12,889	
福島銀行	7.5	10	5,640	
大東銀行	3.8	—	—	
トモニホールディングス	62	57	26,961	
フィデアホールディングス	73	83	12,865	
池田泉州ホールディングス	79	77.8	26,296	
証券・商品先物取引業 (0.9%)				
F P G	26.6	23.2	28,536	
S B I ホールディングス	83	83.8	215,868	
ジャフコ	10.6	11.7	48,555	
大和証券グループ本社	627	563.5	353,032	
野村ホールディングス	1,322	1,291	660,217	
岡三証券グループ	63	61.4	34,261	
丸三証券	24	23	20,562	
東洋証券	27	32	6,560	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	85	84.3	46,786	
水戸証券	24	24	7,368	
いちよし証券	16	16	15,312	
松井証券	36.5	34.5	44,367	
マネックスグループ	80	66.5	27,930	
カブドットコム証券	49	55.2	23,128	
極東証券	10.2	10	13,120	
岩井コスモホールディングス	7.6	8	11,288	
監澤證券	14.8	15.4	11,781	
マネーパートナーズグループ	11	—	—	
保険業 (2.4%)				
かんぽ生命保険	27.8	26.6	76,209	
S O M P O ホールディングス	143.6	137.9	604,829	
アニコム ホールディングス	5.1	5.9	22,213	
M S & A D インシュアランスグループホール	191.4	183.8	633,191	
ソニーフィナンシャルホールディングス	60.3	57.7	137,326	
第一生命ホールディングス	414.2	398	787,244	
東京海上ホールディングス	276	255	1,429,275	
T & D ホールディングス	226.2	216.9	349,859	
アドバンスクリエイト	2	4	8,228	
その他金融業 (1.2%)				
全国保証	20.9	20.2	78,376	
アルヒ	—	7	12,579	
クレディセゾン	55.6	49.4	71,975	
芙蓉総合リース	8.6	8.1	55,728	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
興銀リース	14	13.7	38,360	
東京センチュリー	14.7	14.1	76,422	
日本証券金融	33	34.2	22,572	
アイフル	127	113.3	35,236	
リコーリース	6.2	5.8	21,431	
イオンフィナンシャルサービス	51.9	44.7	98,340	
アコム	148.4	142.3	59,339	
ジャックス	9.1	8.7	17,904	
オリエン特コーポレーション	162.7	194	34,144	
日立キャピタル	20.5	16.7	46,843	
オリックス	488.4	469.5	863,645	
三菱UFJリース	185.5	158.2	97,925	
日本取引所グループ	214.7	190.2	388,959	
イー・ギャランティ	2.5	8	8,960	
NECキャピタルソリューション	3.8	3.3	5,563	
不動産業 (2.4%)				
いちご	103	90.3	35,126	
日本駐車場開発	96.8	90.4	14,464	
ヒューリック	152.9	147	152,586	
三栄建築設計	3.3	3.6	5,670	
スター・マイカ	—	4	7,140	
野村不動産ホールディングス	48.9	46.8	104,925	
三重交通グループホールディングス	17.5	16.4	10,069	
サムティ	6.8	10.2	15,463	
ディア・ライフ	—	10.1	5,312	
日本商業開発	4.7	5.1	8,833	
プレサンスコーポレーション	10.7	11.4	16,142	
ユニゾホールディングス	8.7	11	25,432	
日本管理センター	5.8	5.8	5,910	
フージャースホールディングス	10.9	17.4	11,414	
オープンハウス	11.8	11.5	46,460	
東急不動産ホールディングス	175.8	189.1	120,456	
飯田グループホールディングス	60.8	58.7	117,576	
ムゲンエステート	5.6	6.5	4,491	
ハウスドゥ	—	2.9	3,619	
ケイアイスター不動産	3	—	—	
パーク24	41	41.3	126,584	
バラカ	3.4	2.8	5,420	
三井不動産	365.5	373.5	1,014,052	
三菱地所	545.1	493.4	898,481	
平和不動産	13.4	13.5	26,203	
東京建物	80.1	77.5	100,285	
ダイビル	19.3	20.7	25,709	
京阪神ビルディング	17.1	15	13,680	
住友不動産	176	158.4	666,547	
大京	111.2	10.8	32,065	
テオージー	26.3	16.7	14,211	
東京楽天地	1.9	1.8	8,721	
レオパレス21	92.1	91.4	45,060	
スターツコーポレーション	9.7	9.3	24,682	
フジ住宅	13.4	11.8	10,702	
空港施設	13.4	13.3	7,966	
ゴールドクレスト	6.1	6.2	10,936	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本エスリード	3.7	4.2	6,808	
日神不動産	11.1	13.5	6,925	
日本エスコ	14.1	14.1	10,391	
タカラレーベン	34.4	35.8	12,279	
サンヨーハウジング名古屋	6.5	7	7,308	
イオンモール	47.5	35.4	72,251	
カチタス	—	8	26,120	
トーセイ	10.1	10.8	11,113	
エヌ・ティ・ティ都市開発	46.2	44	73,876	
サンフロンティア不動産	8.3	10.5	12,621	
エフ・ジェー・ネクスト	7.2	8.2	7,740	
日本空港ビルデング	21.5	22.6	99,666	
サービス業 (4.8%)				
日本工営	5	5	13,655	
L I F U L L	25.2	24.4	21,886	
ジェイエイシーリクルートメント	6.1	5.9	13,658	
日本M&Aセンター	24.7	51.3	135,791	
タケエイ	8.7	9.9	8,573	
トラスト・テック	3.3	3.4	11,084	
コシダカホールディングス	3.9	18.5	28,397	
パソナグループ	6.2	7	9,779	
リンクアンドモチベーション	13.9	12.9	13,428	
G C A	9.5	8.5	6,817	
エス・エム・エス	14.1	25.3	47,311	
パーソルホールディングス	65.3	68.3	145,205	
リニカル	5.4	4.4	7,110	
クックパッド	23.8	23.9	9,870	
学情	4.3	3.6	5,529	
スタジオアリス	4.3	3.8	9,872	
シミックホールディングス	5.3	4.4	9,578	
総合警備保障	28.2	27.1	144,714	
カカコム	55.3	51.9	118,539	
アイロムグループ	3	3.1	6,798	
ルネサンス	4.6	4.3	10,199	
ディップ	10	10.9	27,795	
オプトホールディング	6.1	4.5	9,526	
新日本科学	—	11.6	8,247	
ツクイ	18.3	16.6	16,948	
エムスリー	74.8	143.9	263,912	
アウトソーシング	21	36	51,228	
ウェルネット	7	8.4	9,618	
ワールドホールディングス	2.4	2.2	6,019	
ディー・エヌ・エー	38.6	37.1	78,132	
博報堂DYホールディングス	97.9	94.3	163,893	
ぐるなび	11.8	10.7	9,009	
エスアールジータカミヤ	10.7	9.4	6,533	
ジャパンベストレスキューシステム	11.5	6.3	10,231	
ファンコミュニケーションズ	20.1	20.2	14,241	
ライク	3.2	3.3	5,484	
W D Bホールディングス	3.6	3.4	9,785	
バリューコマース	7.5	5	7,430	
インフォマート	36.9	38	52,972	
J Pホールディングス	26	25.4	7,848	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
E P Sホールディングス	11.1	10.4	22,724	
プレステージ・インターナショナル	15.5	13.4	19,309	
アミューズ	5	4.3	11,769	
ドリームインキュベータ	3.1	2.9	5,495	
クイック	4.9	4.7	7,129	
ケネディクス	98.5	64.9	34,721	
電通	86.3	83	419,980	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6	3	5,787	
ぴあ	2.5	2.1	10,731	
イオンファンタジー	2.5	2.3	7,291	
シーティーエス	8.5	9.2	6,964	
ネクシィーズグループ	3.2	2.4	4,327	
みらかホールディングス	21.4	19.5	51,187	
アルプス技研	3.4	6.1	12,797	
日本空調サービス	10.1	9.6	7,305	
オリエンタルランド	83.9	80.6	910,377	
ダスキン	19.8	18.6	48,676	
明光ネットワークジャパン	10.1	10.2	10,597	
ファルコホールディングス	5.5	5.2	8,663	
ラウンドワン	22.4	21.4	26,964	
リゾートトラスト	30.7	29.5	55,076	
ビー・エム・エル	9.2	8.8	25,388	
りらいあコミュニケーションズ	11.4	12.1	12,838	
リソー教育	13.6	36.3	14,157	
ユー・エス・エス	87	83.4	167,967	
サイバーエージェント	46.8	42.2	216,908	
楽天	364.5	319.7	292,205	
クリーク・アンド・リバー社	4.4	4.9	5,811	
テー・オー・ダブリュー	8.7	8.3	7,436	
セントラルスポーツ	3.1	2.9	10,991	
フルキャストホールディングス	6.3	6.8	15,714	
エン・ジャパン	—	7.6	34,808	
テクノプロ・ホールディングス	12.9	13	73,840	
G u n o s y	—	4.4	14,872	
イー・ガーディアン	4.1	3.6	9,630	
ジャパンマテリアル	6.6	18.9	24,834	
ベクトル	9	8.6	15,824	
I B J	6.6	—	—	
アサンテ	4.1	3.5	7,973	
N ・ フィールド	4.6	5	5,770	
バリューHR	1.1	2.2	4,562	
M&Aキャピタルパートナーズ	1.5	1.8	7,677	
ライドオンエクスプレスホールディングス	—	3.7	5,816	
アビスト	1.3	1.4	4,942	
シグマクシス	—	4.4	4,734	
ウィルグループ	3.7	5.4	6,377	
エスコロー・エージェント・ジャパン	11	11.5	5,347	
リクルートホールディングス	547.5	488.7	1,526,210	
エラン	—	2.6	7,800	
日本郵政	401.8	556.7	769,359	
ベルシステム24ホールディングス	12.4	11.6	17,481	
鎌倉新書	—	5.4	6,771	
L I T A L I C O	—	2	3,820	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
エポラブルアジア	2	2.4	2.4	5,421	
ストライク	0.8	1.9	1.9	5,565	
ソラスト	4.8	17	17	24,412	
インソース	—	2.5	2.5	6,177	
キャリアインデックス	—	2.8	2.8	5,927	
MS-Japan	—	3.2	3.2	4,998	
グレイステクノロジー	—	2	2	4,302	
ジャパンエレベーターサービスホールディング	—	4.5	4.5	9,562	
日総工業	—	2	2	3,930	
キュービernetホールディングス	—	4	4	8,876	
スプリックス	—	2.2	2.2	4,283	
リログループ	38.9	37.4	37.4	116,688	
東祥	4.8	4.3	4.3	18,189	
エイチ・アイ・エス	11	12	12	45,900	
共立メンテナンス	12.6	10.4	10.4	59,280	
イチネンホールディングス	9.5	8.5	8.5	12,376	
建設技術研究所	7	5.7	5.7	8,367	
スペース	5.2	5.3	5.3	6,587	
燦ホールディングス	—	2.3	2.3	5,924	
東京テアトル	4.4	4.9	4.9	6,615	
ナガワ	1.6	2	2	12,700	
よみうりランド	2.1	2.3	2.3	9,717	
東京都競馬	5.5	4.6	4.6	15,663	
常磐興産	4.8	5.3	5.3	9,312	
カナモト	10.9	9.7	9.7	32,398	
東京ドーム	29.5	25.8	25.8	26,806	
西尾レントオール	6.3	7	7	29,015	
トランス・コスモス	7.9	7.5	7.5	19,680	
乃村工藝社	16.5	15.9	15.9	48,415	
藤田観光	3.4	3.3	3.3	10,461	
KNT-CTホールディングス	4.9	4.3	4.3	5,538	
日本管財	8	7	7	14,623	
トーカイ	3.6	6.6	6.6	18,433	

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
セコム	75.3	72.4	72.4	695,474	
セントラル警備保障	4.4	3.4	3.4	21,556	
丹青社	14.5	13.2	13.2	17,028	
メイテック	8.5	8.9	8.9	45,568	
アサツー ディ・ケイ	13.5	—	—	—	
応用地質	9	8.3	8.3	11,105	
船井総研ホールディングス	9.9	14.1	14.1	29,539	
オオバ	10.4	7.8	7.8	5,709	
学究社	—	4.2	4.2	6,925	
ベネッセホールディングス	26.1	25.1	25.1	84,587	
イオンディライト	8.5	8.2	8.2	32,759	
ナック	7.2	6	6	6,582	
ニチイ学館	14	10.5	10.5	12,022	
ダイセキ	12.7	11.4	11.4	29,959	
合計	株数・金額	89,136	81,162	168,579,248	
	銘柄数<比率>	1,639	1,659	<97.1%>	

※銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※評価額の単位未満は切捨て。ただし、評価額が単位未満の場合は小数で記載。

※－印は組入れなし。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	期		末
		買建額	売建額	
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 4,870	百万円 —

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※－印は組入れなし。

■ 投資信託財産の構成

(2018年11月30日現在)

項目	期		末	
	評価額	比率	評価額	比率
株式	千円	%	千円	%
株	168,579,248	97.1	168,579,248	97.1
コール・ローン等、その他	5,089,190	2.9	5,089,190	2.9
投資信託財産総額	173,668,438	100.0	173,668,438	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

（2018年11月30日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	175,422,343,818円
コール・ローン等	3,883,859,051
株式(評価額)	168,579,248,010
未 収 入 金	212,664,436
未 収 配 当 金	1,095,772,321
差入委託証拠金	1,650,800,000
(B) 負 債	1,874,569,440
未 払 金	1,592,960
未 払 解 約 金	116,111,681
未 払 利 息	1,758
差入委託証拠金代用有価証券	1,756,600,000
その他未払費用	263,041
(C) 純資産総額(A-B)	173,547,774,378
元 本	66,912,228,971
次期繰越損益金	106,635,545,407
(D) 受益権総口数	66,912,228,971口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,937円

※当期における期首元本額70,854,907,568円、期中追加設定元本額13,339,206,384円、期中一部解約元本額17,281,884,981円です。

※代用として、担保に供している資産は、株式2,721,200,000円です。（受渡しベース）

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

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

■ 損益の状況

（自2017年12月1日 至2018年11月30日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,028,021,049円
受 取 配 当 金	3,834,209,166
そ の 他 収 益 金	195,258,423
支 払 利 息	△ 1,446,540
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 12,214,498,968
売 買 益	9,382,392,710
売 買 損	△ 21,596,891,678
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 144,042,760
取 引 益	694,569,640
取 引 損	△ 838,612,400
(D) 信 託 報 酬 等	△ 11,482,188
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 8,342,002,867
(F) 前期繰越損益金	122,170,396,782
(G) 追加信託差損益金	22,507,601,491
(H) 解約差損益金	△ 29,700,449,999
(I) 計 (E+F+G+H)	106,635,545,407
次期繰越損益金(I)	106,635,545,407

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

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,354,216,475円	SMAM・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定>	55,007,822円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	768,941,629円	SMAM・インデックス・バランスVA 2 5<適格機関投資家専用>	384,921,677円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	3,698,515,899円	SMAM・インデックス・バランスVA 5 0<適格機関投資家専用>	1,118,064,318円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,692,088,576円	SMAM・バランスファンドVA 4 0<適格機関投資家専用>	928,739,841円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	180,714,188円	SMAM・バランスファンドVA 3 5<適格機関投資家専用>	3,098,232,570円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2020（4資産タイプ）	7,445,740円	SMAM・バランスVA株4 0 T<適格機関投資家限定>	1,510,156円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2025（4資産タイプ）	24,782,474円	三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,207,656,106円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2030（4資産タイプ）	62,529,551円	SMAM・グローバルバランス4 0 VA<適格機関投資家限定>	64,109,227円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2035（4資産タイプ）	87,629,751円	SMAM・バランスファンドVA 2 0<適格機関投資家専用>	85,263,426円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2040（4資産タイプ）	51,789,894円	三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,640,032,255円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2045（4資産タイプ）	131,284,628円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 0 A<適格機関投資家専用>	106,297,419円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,987,526,237円	SMAM・アセットバランスファンドVA 3 5 A<適格機関投資家専用>	48,499,056円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	7,498,073,954円	SMAM・アセットバランスファンドVA 5 0 A<適格機関投資家専用>	22,363,154円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	443,898,286円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 0 L<適格機関投資家専用>	211,902,924円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	618,202,967円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 5 L<適格機関投資家専用>	386,107,457円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	611,775,561円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 0 T<適格機関投資家専用>	169,452,674円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2050	8,569,755円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	120,236,114円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	9,514,881円	SMAM・アセットバランスファンドVA 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	60,898,000円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	10,918,100円	SMAM・アセットバランスファンドVA 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	11,117,259円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	39,419,537円	SMAM・アセットバランスファンドVA 3 0 L 2<適格機関投資家専用>	78,033,493円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	28,365,827円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 5 L 2<適格機関投資家専用>	973,799,546円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	63,515,584円	SMAM・国内株式インデックスファンド・VA（適格機関投資家専用）	202,412,662円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	5,621,357円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 0 T 2<適格機関投資家専用>	19,535,802円
SMAM・国内株式バッシュ・ファンド（適格機関投資家専用）	5,957,306,958円	SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	1,677,781,097円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	24,723,073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>	232,095,874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>	514,312,458円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,575,906,619円
SMAM・バランスファンドVA 2 5<適格機関投資家専用>	3,486,172,970円	SMAM・世界バランスファンドVA 2<適格機関投資家限定>	133,573,058円
SMAM・バランスファンドVA 3 7. 5<適格機関投資家専用>	2,450,832,018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>	8,319,114円
SMAM・バランスファンドVA 5 0<適格機関投資家専用>	9,016,678,236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>	73,059,305円
SMAM・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	57,327,222円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	35,005,032円
SMAM・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	223,654,156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>	86,203,195円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	758,842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<適格機関投資家限定>	20,774円
SMAM・バランスファンドVA 7 5<適格機関投資家専用>	978,965,161円		

■ お知らせ

<約款変更について>

- ・受益者に対してする公告を電子公告の方法によるものとするため、所要の変更を行いました。
(適用日：2018年2月1日)
- ・一般社団法人投資信託協会規則の「信用リスク集中回避のための投資制限」に適合するよう、所要の変更を行いました。
(適用日：2018年2月23日)

<当ファンドにかかる損害賠償請求訴訟の和解成立と和解金について>

オリンパス株式会社の有価証券報告書虚偽記載に関して、当ファンドが被った損害の回復を目的として、2014年4月に同社に対して提起した損害賠償請求訴訟は2018年7月31日に和解が成立いたしました。

なお、本訴訟でかかった費用10,056,959円と和解金192,946,492円は2018年9月4日に当ファンドに計上しております。また、この和解金の受領に伴う当ファンドの基準価額への影響は+27円程度となります。

国内債券パッシブ・マザーファンド

第13期（2017年5月26日から2018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 総額
	期中 騰落率	騰落率	期中 騰落率	騰落率		
	円	%		%	%	百万円
9期(2014年5月26日)	11,689	2.7	354.08	2.7	99.2	370,307
10期(2015年5月25日)	11,956	2.3	362.06	2.3	99.4	296,491
11期(2016年5月25日)	12,773	6.8	386.72	6.8	99.4	243,829
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

※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）を用いて行われる三井住友アセットマネジメント株式会社の事業活動・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係するものではなく、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

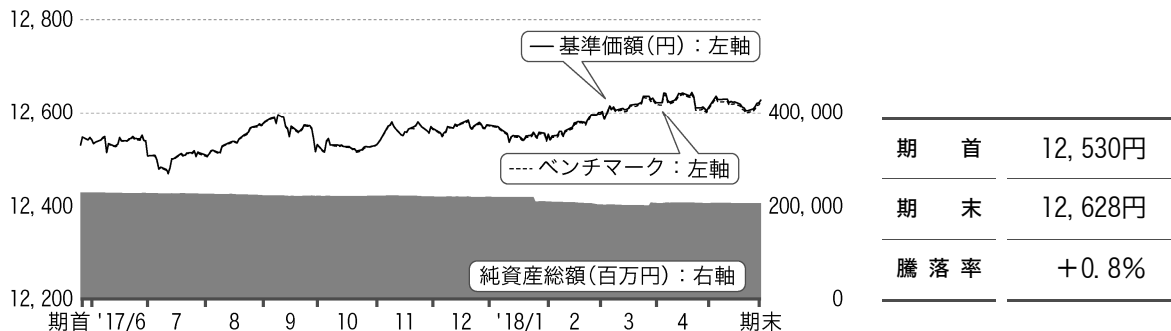
年月日	基準価額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI(総合)		債券組入 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2017年5月25日	円	%		%	%
	12,530	—	379.26	—	99.0
5月末	12,541	0.1	379.55	0.1	99.3
6月末	12,507	△0.2	378.57	△0.2	99.4
7月末	12,509	△0.2	378.55	△0.2	99.5
8月末	12,576	0.4	380.58	0.3	99.3
9月末	12,531	0.0	379.27	0.0	99.6
10月末	12,531	0.0	379.27	0.0	99.5
11月末	12,565	0.3	380.26	0.3	99.4
12月末	12,573	0.3	380.51	0.3	99.5
2018年1月末	12,553	0.2	379.85	0.2	99.4
2月末	12,601	0.6	381.29	0.5	99.4
3月末	12,622	0.7	381.91	0.7	99.5
4月末	12,612	0.7	381.64	0.6	99.6
(期末) 2018年5月25日	12,628	0.8	382.10	0.8	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 (2017年5月26日から2018年5月25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、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）を用いて行われる三井住友アセットマネジメント株式会社の事業活動・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 (2017年5月26日から2018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。

上昇要因

- ・ 8月上旬から9月上旬にかけて、北朝鮮情勢の緊迫化などを背景に国内金利が低下したこと
- ・ 2月中旬の黒田日銀総裁再任案の国会提出などから日銀の金融緩和政策の継続が改めて認識され、国内金利が低下したこと

下落要因

- ・ 期首から7月上旬にかけては海外金利が上昇したこと、9月中旬から10月下旬にかけては衆議院選挙に向けた不透明感が強まり国内金利が上昇したこと

▶ 投資環境について (2017年5月26日から2018年5月25日まで)

日本の長期金利の代表である10年国債利回りは小幅低下（債券価格は上昇）しました。

長期金利は、期首から7月上旬にかけて、欧州の金融緩和政策縮小を意識した海外金利の上昇に連動して上昇しました。しかし、日銀が指値オペ（日銀が指定する利回りで国債を無制限に買い入れるオペ）等を行い、上昇は一服しました。

その後、9月上旬まで、米国政治の不透明感や北朝鮮情勢の緊迫を背景に、長期金利は一時マイナス圏となるなど、低下しました。9月中旬以降は、衆議院選挙に向けた不透明感からアベノミクスの終焉が意識されて金利は一時上昇しましたが、与党の勝利により日銀の金融緩和政策継続への安心感が広がると、金利は再び低下しました。

1月以降、日銀オペの減額や海外金利の上昇に伴って国内金利は上昇に転じましたが、2月上旬に再び日銀が指値オペ等を行い、金利上昇を抑制しました。その後、黒田日銀総裁再任の人事案が国会に提出・承認されたことから金融緩和の長期化が意識されると、金利は低下基調で推移しました。

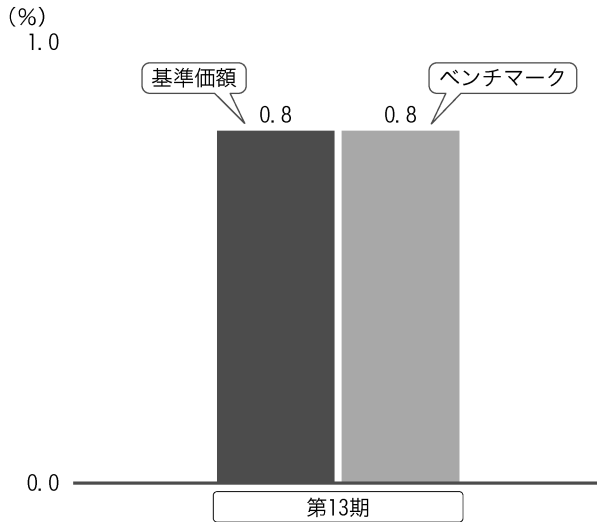
当期の市場の動きを10年国債利回りでみると、期首の0.05%から期末には0.04%へ小幅低下しました。

▶ ポートフォリオについて (2017年5月26日から2018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 (2017年5月26日から2018年5月25日まで)

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



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

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+0.8%となり、ベンチマークの騰落率+0.8%に概ね連動した運用成果となりました。

2 今後の運用方針

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細(2017年5月26日から2018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12,560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(2017年5月26日から2018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	28,807,146	43,843,610
	地方債証券	3,672,053	3,991,431 (30,760)
	特殊債証券	6,229,673	8,145,046 (1,671,881)
	社債証券 (投資法人債券を含む)	2,320,924	2,028,651 (2,100,000)

※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。

※社債証券(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(2017年5月26日から2018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 41,029	百万円 5,691	% 13.9	百万円 58,008	百万円 12,346	% 21.3

国内債券パッシブ・マザーファンド

(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 411

(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 1,500

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。

■ 組入れ資産の明細 (2018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	138,773,000 (22,800,000)	153,504,619 (25,099,357)	74.2 (12.1)	-	54.7 (11.5)	18.6 (0.6)	1.0 (0.0)	
地 方 債 証 券	18,051,200 (18,051,200)	18,937,520 (18,937,520)	9.2 (9.2)	-	2.6 (2.6)	2.5 (2.5)	4.0 (4.0)	
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	22,759,730 (22,759,730)	23,976,146 (23,976,146)	11.6 (11.6)	-	4.2 (4.2)	3.5 (3.5)	4.0 (4.0)	
金 融 債 証 券	1,300,000 (1,300,000)	1,301,817 (1,301,817)	0.6 (0.6)	-	-	0.1 (0.1)	0.5 (0.5)	
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	7,500,000 (7,300,000)	7,826,255 (7,622,731)	3.8 (3.7)	-	1.7 (1.6)	1.3 (1.3)	0.8 (0.8)	
合 計	188,383,930 (72,210,930)	205,546,357 (76,937,572)	99.4 (37.2)	-	63.1 (19.9)	26.0 (8.0)	10.2 (9.3)	

※()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386回 利付国債(2年)	0.1	2,000,000	2,008,820	2020/3/15
	第123回 利付国債(5年)	0.1	10,000	10,041	2020/3/20
	第125回 利付国債(5年)	0.1	1,060,000	1,065,777	2020/9/20
	第126回 利付国債(5年)	0.1	910,000	915,496	2020/12/20
	第127回 利付国債(5年)	0.1	920,000	925,961	2021/3/20
	第128回 利付国債(5年)	0.1	1,215,000	1,223,590	2021/6/20
	第129回 利付国債(5年)	0.1	1,610,000	1,622,316	2021/9/20
	第130回 利付国債(5年)	0.1	930,000	937,486	2021/12/20
	第131回 利付国債(5年)	0.1	2,170,000	2,188,271	2022/3/20
	第132回 利付国債(5年)	0.1	655,000	660,881	2022/6/20
	第133回 利付国債(5年)	0.1	600,000	605,724	2022/9/20
	第134回 利付国債(5年)	0.1	1,150,000	1,161,603	2022/12/20
	第135回 利付国債(5年)	0.1	720,000	727,660	2023/3/20
	第1回 利付国債(40年)	2.4	40,000	57,696	2048/3/20
	第2回 利付国債(40年)	2.2	287,000	400,677	2049/3/20
	第3回 利付国債(40年)	2.2	255,000	357,772	2050/3/20
	第4回 利付国債(40年)	2.2	387,000	544,799	2051/3/20
	第5回 利付国債(40年)	2.0	390,000	527,892	2052/3/20
	第6回 利付国債(40年)	1.9	405,000	537,273	2053/3/20
	第7回 利付国債(40年)	1.7	400,000	506,552	2054/3/20
	第8回 利付国債(40年)	1.4	460,000	539,248	2055/3/20
	第9回 利付国債(40年)	0.4	731,000	620,882	2056/3/20
	第10回 利付国債(40年)	0.9	755,000	759,363	2057/3/20
	第310回 利付国債(10年)	1.0	1,480,000	1,518,820	2020/9/20
	第312回 利付国債(10年)	1.2	2,145,000	2,218,680	2020/12/20
	第313回 利付国債(10年)	1.3	2,105,000	2,189,915	2021/3/20
	第315回 利付国債(10年)	1.2	1,800,000	1,873,908	2021/6/20
	第317回 利付国債(10年)	1.1	1,005,000	1,046,154	2021/9/20
	第318回 利付国債(10年)	1.0	895,000	928,669	2021/9/20
	第319回 利付国債(10年)	1.1	980,000	1,022,973	2021/12/20
	第320回 利付国債(10年)	1.0	960,000	998,659	2021/12/20
	第321回 利付国債(10年)	1.0	960,000	1,001,155	2022/3/20
	第322回 利付国債(10年)	0.9	1,065,000	1,106,588	2022/3/20
	第323回 利付国債(10年)	0.9	510,000	531,129	2022/6/20
	第324回 利付国債(10年)	0.8	790,000	819,506	2022/6/20
第325回 利付国債(10年)	0.8	1,365,000	1,418,849	2022/9/20	
第326回 利付国債(10年)	0.7	527,000	546,578	2022/12/20	
第327回 利付国債(10年)	0.8	375,000	390,652	2022/12/20	
第328回 利付国債(10年)	0.6	380,000	393,140	2023/3/20	
第329回 利付国債(10年)	0.8	2,530,000	2,646,531	2023/6/20	
第330回 利付国債(10年)	0.8	1,335,000	1,398,826	2023/9/20	
第332回 利付国債(10年)	0.6	793,000	823,593	2023/12/20	
第333回 利付国債(10年)	0.6	815,000	847,600	2024/3/20	
第334回 利付国債(10年)	0.6	1,265,000	1,317,004	2024/6/20	
第335回 利付国債(10年)	0.5	1,250,000	1,295,187	2024/9/20	

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336回 利付国債(10年)	0.5	920,000	954,260	2024/12/20
	第337回 利付国債(10年)	0.3	120,000	122,887	2024/12/20
	第338回 利付国債(10年)	0.4	1,105,000	1,139,752	2025/3/20
	第339回 利付国債(10年)	0.4	1,655,000	1,708,390	2025/6/20
	第340回 利付国債(10年)	0.4	1,930,000	1,993,747	2025/9/20
	第341回 利付国債(10年)	0.3	1,187,000	1,218,075	2025/12/20
	第342回 利付国債(10年)	0.1	1,520,000	1,536,066	2026/3/20
	第343回 利付国債(10年)	0.1	1,620,000	1,636,345	2026/6/20
	第344回 利付国債(10年)	0.1	2,201,000	2,222,063	2026/9/20
	第345回 利付国債(10年)	0.1	1,528,000	1,541,736	2026/12/20
	第346回 利付国債(10年)	0.1	1,980,000	1,996,552	2027/3/20
	第347回 利付国債(10年)	0.1	1,520,000	1,531,688	2027/6/20
	第348回 利付国債(10年)	0.1	635,000	639,718	2027/9/20
	第349回 利付国債(10年)	0.1	2,020,000	2,034,443	2027/12/20
	第350回 利付国債(10年)	0.1	810,000	815,143	2028/3/20
	第2回 利付国債(30年)	2.4	510,000	644,920	2030/2/20
	第4回 利付国債(30年)	2.9	300,000	401,577	2030/11/20
	第5回 利付国債(30年)	2.2	290,000	365,214	2031/5/20
	第7回 利付国債(30年)	2.3	474,000	609,350	2032/5/20
	第9回 利付国債(30年)	1.4	100,000	116,405	2032/12/20
	第10回 利付国債(30年)	1.1	585,000	656,013	2033/3/20
	第11回 利付国債(30年)	1.7	430,000	520,128	2033/6/20
	第12回 利付国債(30年)	2.1	590,000	749,890	2033/9/20
	第14回 利付国債(30年)	2.4	742,000	980,167	2034/3/20
	第16回 利付国債(30年)	2.5	465,000	624,113	2034/9/20
	第18回 利付国債(30年)	2.3	500,000	657,405	2035/3/20
	第19回 利付国債(30年)	2.3	490,000	645,403	2035/6/20
	第21回 利付国債(30年)	2.3	345,000	455,565	2035/12/20
	第22回 利付国債(30年)	2.5	335,000	454,611	2036/3/20
	第23回 利付国債(30年)	2.5	329,000	447,268	2036/6/20
	第24回 利付国債(30年)	2.5	310,000	422,170	2036/9/20
	第25回 利付国債(30年)	2.3	300,000	398,502	2036/12/20
	第26回 利付国債(30年)	2.4	383,000	516,103	2037/3/20
	第27回 利付国債(30年)	2.5	440,000	602,430	2037/9/20
	第28回 利付国債(30年)	2.5	386,000	530,414	2038/3/20
	第29回 利付国債(30年)	2.4	177,000	240,571	2038/9/20
	第30回 利付国債(30年)	2.3	572,000	768,973	2039/3/20
	第31回 利付国債(30年)	2.2	425,000	564,710	2039/9/20
	第32回 利付国債(30年)	2.3	735,000	994,205	2040/3/20
	第33回 利付国債(30年)	2.0	483,000	625,306	2040/9/20
	第34回 利付国債(30年)	2.2	682,000	913,777	2041/3/20
	第35回 利付国債(30年)	2.0	735,000	956,220	2041/9/20
	第36回 利付国債(30年)	2.0	280,000	365,092	2042/3/20
	第37回 利付国債(30年)	1.9	790,000	1,014,375	2042/9/20
	第38回 利付国債(30年)	1.8	445,000	562,751	2043/3/20
	第39回 利付国債(30年)	1.9	395,000	509,091	2043/6/20
	第40回 利付国債(30年)	1.8	455,000	576,257	2043/9/20
	第41回 利付国債(30年)	1.7	475,000	590,809	2043/12/20
	第42回 利付国債(30年)	1.7	445,000	553,780	2044/3/20

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43回 利付国債 (30年)	1.7	485,000	603,878	2044/6/20
	第44回 利付国債 (30年)	1.7	520,000	648,518	2044/9/20
	第45回 利付国債 (30年)	1.5	285,000	341,811	2044/12/20
	第46回 利付国債 (30年)	1.5	600,000	719,724	2045/3/20
	第47回 利付国債 (30年)	1.6	600,000	734,562	2045/6/20
	第48回 利付国債 (30年)	1.4	415,000	487,761	2045/9/20
	第49回 利付国債 (30年)	1.4	575,000	675,809	2045/12/20
	第50回 利付国債 (30年)	0.8	565,000	578,147	2046/3/20
	第51回 利付国債 (30年)	0.3	520,000	465,207	2046/6/20
	第52回 利付国債 (30年)	0.5	633,000	597,431	2046/9/20
	第53回 利付国債 (30年)	0.6	477,000	461,793	2046/12/20
	第54回 利付国債 (30年)	0.8	550,000	560,494	2047/3/20
	第55回 利付国債 (30年)	0.8	595,000	605,710	2047/6/20
	第56回 利付国債 (30年)	0.8	320,000	325,408	2047/9/20
	第57回 利付国債 (30年)	0.8	930,000	944,675	2047/12/20
	第58回 利付国債 (30年)	0.8	330,000	334,834	2048/3/20
	第46回 利付国債 (20年)	2.2	775,000	812,533	2020/6/22
	第48回 利付国債 (20年)	2.5	955,000	1,019,815	2020/12/21
	第50回 利付国債 (20年)	1.9	918,000	970,674	2021/3/22
	第52回 利付国債 (20年)	2.1	720,000	773,496	2021/9/21
	第54回 利付国債 (20年)	2.2	965,000	1,045,133	2021/12/20
	第56回 利付国債 (20年)	2.0	818,000	888,797	2022/6/20
	第59回 利付国債 (20年)	1.7	1,455,000	1,575,808	2022/12/20
	第61回 利付国債 (20年)	1.0	1,215,000	1,279,917	2023/3/20
	第64回 利付国債 (20年)	1.9	1,025,000	1,133,926	2023/9/20
	第65回 利付国債 (20年)	1.9	1,020,000	1,133,189	2023/12/20
	第69回 利付国債 (20年)	2.1	1,020,000	1,149,815	2024/3/20
	第70回 利付国債 (20年)	2.4	780,000	897,577	2024/6/20
	第72回 利付国債 (20年)	2.1	753,000	856,642	2024/9/20
	第74回 利付国債 (20年)	2.1	664,000	758,766	2024/12/20
	第75回 利付国債 (20年)	2.1	490,000	562,382	2025/3/20
	第78回 利付国債 (20年)	1.9	590,000	671,543	2025/6/20
	第82回 利付国債 (20年)	2.1	620,000	717,600	2025/9/20
	第84回 利付国債 (20年)	2.0	850,000	981,563	2025/12/20
	第85回 利付国債 (20年)	2.1	645,000	752,856	2026/3/20
	第88回 利付国債 (20年)	2.3	742,000	881,377	2026/6/20
	第89回 利付国債 (20年)	2.2	20,000	23,595	2026/6/20
	第90回 利付国債 (20年)	2.2	580,000	686,952	2026/9/20
	第92回 利付国債 (20年)	2.1	734,000	866,376	2026/12/20
	第93回 利付国債 (20年)	2.0	632,000	743,042	2027/3/20
	第95回 利付国債 (20年)	2.3	305,000	368,074	2027/6/20
	第97回 利付国債 (20年)	2.2	677,000	814,221	2027/9/20
	第99回 利付国債 (20年)	2.1	693,000	830,200	2027/12/20
	第100回 利付国債 (20年)	2.2	207,000	250,817	2028/3/20
	第101回 利付国債 (20年)	2.4	355,000	437,086	2028/3/20
	第102回 利付国債 (20年)	2.4	457,000	564,810	2028/6/20
	第105回 利付国債 (20年)	2.1	390,000	471,560	2028/9/20
	第106回 利付国債 (20年)	2.2	370,000	451,170	2028/9/20
	第107回 利付国債 (20年)	2.1	378,000	458,468	2028/12/20

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108回 利付国債(20年)	1.9	390,000	464,841	2028/12/20
	第109回 利付国債(20年)	1.9	410,000	489,978	2029/3/20
	第111回 利付国債(20年)	2.2	456,000	561,390	2029/6/20
	第113回 利付国債(20年)	2.1	327,000	400,169	2029/9/20
	第114回 利付国債(20年)	2.1	508,000	623,437	2029/12/20
	第116回 利付国債(20年)	2.2	830,000	1,031,050	2030/3/20
	第118回 利付国債(20年)	2.0	460,000	562,161	2030/6/20
	第119回 利付国債(20年)	1.8	425,000	509,294	2030/6/20
	第120回 利付国債(20年)	1.6	280,000	328,882	2030/6/20
	第121回 利付国債(20年)	1.9	255,000	309,519	2030/9/20
	第122回 利付国債(20年)	1.8	535,000	642,513	2030/9/20
	第123回 利付国債(20年)	2.1	380,000	471,667	2030/12/20
	第124回 利付国債(20年)	2.0	365,000	448,544	2030/12/20
	第125回 利付国債(20年)	2.2	455,000	571,880	2031/3/20
	第126回 利付国債(20年)	2.0	280,000	344,892	2031/3/20
	第127回 利付国債(20年)	1.9	335,000	408,428	2031/3/20
	第128回 利付国債(20年)	1.9	445,000	543,380	2031/6/20
	第129回 利付国債(20年)	1.8	440,000	531,652	2031/6/20
	第130回 利付国債(20年)	1.8	485,000	587,165	2031/9/20
	第131回 利付国債(20年)	1.7	460,000	550,919	2031/9/20
	第132回 利付国債(20年)	1.7	970,000	1,163,679	2031/12/20
	第133回 利付国債(20年)	1.8	60,000	72,773	2031/12/20
	第134回 利付国債(20年)	1.8	50,000	60,751	2032/3/20
	第135回 利付国債(20年)	1.7	275,000	330,437	2032/3/20
	第136回 利付国債(20年)	1.6	320,000	379,952	2032/3/20
	第137回 利付国債(20年)	1.7	415,000	499,460	2032/6/20
	第138回 利付国債(20年)	1.5	25,000	29,405	2032/6/20
	第139回 利付国債(20年)	1.6	280,000	333,160	2032/6/20
	第140回 利付国債(20年)	1.7	850,000	1,024,581	2032/9/20
	第141回 利付国債(20年)	1.7	445,000	536,803	2032/12/20
	第142回 利付国債(20年)	1.8	380,000	464,071	2032/12/20
	第143回 利付国債(20年)	1.6	360,000	429,717	2033/3/20
	第144回 利付国債(20年)	1.5	180,000	212,133	2033/3/20
	第145回 利付国債(20年)	1.7	485,000	586,656	2033/6/20
	第146回 利付国債(20年)	1.7	460,000	556,738	2033/9/20
	第147回 利付国債(20年)	1.6	960,000	1,148,995	2033/12/20
	第148回 利付国債(20年)	1.5	394,000	465,719	2034/3/20
	第149回 利付国債(20年)	1.5	1,040,000	1,230,299	2034/6/20
	第150回 利付国債(20年)	1.4	901,000	1,051,872	2034/9/20
	第151回 利付国債(20年)	1.2	980,000	1,113,907	2034/12/20
	第152回 利付国債(20年)	1.2	525,000	596,321	2035/3/20
	第153回 利付国債(20年)	1.3	627,000	722,322	2035/6/20
	第154回 利付国債(20年)	1.2	1,060,000	1,203,163	2035/9/20
	第155回 利付国債(20年)	1.0	820,000	902,959	2035/12/20
	第156回 利付国債(20年)	0.4	770,000	768,082	2036/3/20
	第157回 利付国債(20年)	0.2	555,000	532,711	2036/6/20
	第158回 利付国債(20年)	0.5	725,000	732,366	2036/9/20
	第159回 利付国債(20年)	0.6	798,000	818,500	2036/12/20
	第160回 利付国債(20年)	0.7	1,025,000	1,067,588	2037/3/20

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161回 利付国債(20年)	0.6	550,000	562,017	2037/6/20
	第162回 利付国債(20年)	0.6	830,000	846,102	2037/9/20
	第163回 利付国債(20年)	0.6	1,140,000	1,160,314	2037/12/20
	第164回 利付国債(20年)	0.5	240,000	239,352	2038/3/20
	小 計	-	138,773,000	153,504,619	-
地 方 債 証 券	第1回 東京都公募公債(20年)	1.54	100,000	107,678	2023/6/20
	第1回 東京都公募公債(30年)	2.21	100,000	125,900	2033/6/20
	第6回 東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	113,091	2025/3/19
	第7回 東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	115,175	2025/9/19
	第8回 東京都公募公債(20年)	2.36	100,000	117,616	2026/3/19
	第8回 東京都公募公債(30年)	2.23	400,000	515,236	2038/9/17
	第13回 東京都公募公債(30年)	1.93	500,000	622,350	2042/3/19
	第668回 東京都公募公債	1.54	200,000	202,472	2019/3/20
	第674回 東京都公募公債	1.38	100,100	101,886	2019/9/20
	第684回 東京都公募公債	1.26	100,000	102,541	2020/6/19
	第685回 東京都公募公債	1.13	100,000	102,272	2020/6/19
	第688回 東京都公募公債	0.94	193,500	197,573	2020/9/18
	第689回 東京都公募公債	1.08	200,000	204,858	2020/9/18
	第703回 東京都公募公債	0.99	100,000	103,444	2021/12/20
	第705回 東京都公募公債	1.06	100,000	103,941	2022/3/18
	第710回 東京都公募公債	0.81	100,000	103,192	2022/6/20
	平成21年度第14回 北海道公募公債	1.52	100,000	102,619	2020/2/26
	平成24年度第1回 北海道公募公債	0.99	100,000	103,760	2022/4/27
	平成24年度第14回 北海道公募公債	0.8	100,000	103,638	2023/2/28
	平成25年度第15回 北海道公募公債	0.67	100,000	103,474	2024/2/28
	平成26年度第15回 北海道公募公債	0.434	100,000	102,311	2025/2/27
	平成29年度第6回 北海道公募公債(5年)	0.01	300,000	299,685	2022/7/28
	第1回 神奈川県公募公債(20年)	2.55	100,000	115,060	2024/6/20
	第3回 神奈川県公募公債(20年)	2.11	100,000	114,269	2025/6/20
	第7回 神奈川県公募公債(20年)	2.22	100,000	118,059	2027/3/19
	第157回 神奈川県公募公債	1.59	115,600	116,631	2018/12/20
	第167回 神奈川県公募公債	1.52	100,000	101,971	2019/9/20
	第326回 大阪府公募公債(10年)	1.66	200,000	203,286	2019/5/28
	第332回 大阪府公募公債(10年)	1.58	100,000	102,339	2019/11/27
	第342回 大阪府公募公債(10年)	1.2	200,000	205,488	2020/9/29
	第361回 大阪府公募公債(10年)	0.92	200,000	207,232	2022/6/28
	第373回 大阪府公募公債(10年)	0.904	100,000	104,393	2023/6/27
	第377回 大阪府公募公債(10年)	0.729	100,000	103,650	2023/10/30
	平成22年度第5回 京都府公募公債	1.26	110,000	113,495	2020/12/21
	平成26年度第13回 京都府公募公債	0.484	100,000	102,738	2025/3/19
	平成27年度第4回 京都府公募公債	0.553	100,000	103,287	2025/6/19
	平成29年度第12回 京都府公募公債	0.04	300,000	300,216	2023/3/16
	第5回 兵庫県公募公債(15年)	1.31	300,000	332,502	2028/5/26
	平成21年度第3回 兵庫県公募公債	1.62	390,000	396,146	2019/5/22
	平成21年度第11回 兵庫県公募公債	1.66	200,000	203,482	2019/6/19
	平成22年度第1回 兵庫県公募公債	1.46	100,000	102,705	2020/4/16
	平成25年度第15回 兵庫県公募公債(5年)	0.18	100,000	100,116	2019/3/5
	第7回 静岡県公募公債(30年)	1.988	100,000	126,514	2043/6/19
	平成20年度第1回 静岡県公募公債	2.18	200,000	230,306	2025/9/19
	平成21年度第5回 静岡県公募公債	1.35	300,000	305,541	2019/10/18

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	
	平成21年度第1回	愛知県公募公債(10年)	1.61	100,000	101,471	2019/4/30
	平成21年度第7回	愛知県公募公債(10年)	1.54	200,000	203,788	2019/8/26
	平成21年度第8回	愛知県公募公債(10年)	1.39	100,000	101,836	2019/9/30
	平成21年度第10回	愛知県公募公債(10年)	1.38	100,000	101,933	2019/10/30
	平成22年度第12回	愛知県公募公債(10年)	1.085	100,000	102,663	2020/11/30
	平成23年度第18回	愛知県公募公債(7年)	0.572	100,000	100,393	2019/2/14
	平成21年度第1回	広島県公募公債	1.57	100,000	101,552	2019/5/28
	平成20年度第7回	埼玉県公募公債	1.48	100,000	101,100	2019/2/26
	平成21年度第1回	埼玉県公募公債	1.53	100,000	101,368	2019/4/23
	平成21年度第2回	埼玉県公募公債	1.57	100,000	101,547	2019/5/27
	平成21年度第4回	埼玉県公募公債	1.46	200,000	203,368	2019/7/29
	平成29年度第7回	埼玉県公募公債(5年)	0.02	400,000	399,908	2022/10/27
	平成20年度第10回	福岡県公募公債	1.5	100,000	101,115	2019/2/26
	平成21年度第3回	福岡県公募公債	1.55	100,000	101,911	2019/8/27
	平成21年度第8回	福岡県公募公債	1.34	100,000	102,077	2019/12/25
	平成25年度第11回	福岡県公募公債	0.694	100,000	103,667	2024/2/26
	平成25年度第12回	福岡県公募公債	0.16	100,000	100,108	2019/3/26
	平成26年度第4回	福岡県公募公債	0.135	100,000	100,140	2019/9/26
	平成26年度第10回	福岡県公募公債	0.453	100,000	102,507	2025/2/26
	平成20年度第8回	千葉県公募公債	1.48	100,000	101,096	2019/2/25
	平成21年度第2回	千葉県公募公債	1.57	345,000	350,295	2019/5/24
	平成21年度第6回	千葉県公募公債	1.41	100,000	101,844	2019/9/25
	第9回	群馬県公募公債(10年)	0.801	100,000	103,491	2022/11/25
	平成21年度第1回	岐阜県公募公債(10年)	1.35	200,000	203,766	2019/10/28
	第73回	共同発行市場公募地方債	1.59	400,000	405,724	2019/4/25
	第74回	共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	101,535	2019/5/24
	第75回	共同発行市場公募地方債	1.64	900,000	915,714	2019/6/25
	第76回	共同発行市場公募地方債	1.4	300,000	304,794	2019/7/25
	第77回	共同発行市場公募地方債	1.54	300,000	305,643	2019/8/23
	第79回	共同発行市場公募地方債	1.34	200,000	203,716	2019/10/25
	第81回	共同発行市場公募地方債	1.32	100,000	102,045	2019/12/25
	第82回	共同発行市場公募地方債	1.42	100,000	102,318	2020/1/24
	第91回	共同発行市場公募地方債	0.9	300,000	306,303	2020/10/23
	第110回	共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	103,455	2022/5/25
	第111回	共同発行市場公募地方債	0.89	300,000	310,581	2022/6/24
	第112回	共同発行市場公募地方債	0.84	150,000	155,088	2022/7/25
	第114回	共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	103,437	2022/9/22
	第115回	共同発行市場公募地方債	0.8	600,000	620,520	2022/10/25
	第118回	共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	103,802	2023/1/25
	第137回	共同発行市場公募地方債	0.566	200,000	206,176	2024/8/23
	第172回	共同発行市場公募地方債	0.225	500,000	502,480	2027/7/23
	平成21年度第4回	大阪市公募公債	1.62	300,000	305,904	2019/8/20
	平成26年度第2回	大阪市公募公債(5年)	0.214	200,000	200,368	2019/5/27
	第1回	名古屋市公募公債(20年)	1.99	200,000	221,558	2023/12/20
	第3回	名古屋市公募公債(20年)	2.03	100,000	113,707	2025/6/20
	第467回	名古屋市公募公債(10年)	1.62	100,000	101,702	2019/6/20
	第1回	京都市公募公債(7年)	0.365	300,000	301,572	2019/12/18
	第1回	京都市公募公債(30年)	2.57	100,000	134,677	2037/9/18
	第7回	京都市公募公債(20年)	2.38	100,000	121,933	2028/9/21
	平成26年度第1回	京都市公募公債	0.168	100,000	100,160	2019/7/23

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
	平成29年度第5回 京都市公募公債	0.04	100,000	100,072	2023/3/28
	平成26年度第17回 神戸市公募公債	0.28	100,000	101,328	2025/1/27
	第4回 横浜市公募公債(20年)	2.03	100,000	113,256	2025/3/19
	第9回 横浜市公募公債(20年)	2.35	100,000	117,817	2026/6/19
	第14回 横浜市公募公債(20年)	2.32	100,000	120,627	2028/3/17
	第47回 横浜市公募公債(5年)	0.04	100,000	100,069	2023/1/27
	平成25年度第11回 札幌市公募公債(5年)	0.2	100,000	100,138	2019/3/20
	平成26年度第4回 札幌市公募公債(10年)	0.54	100,000	102,872	2024/6/20
	第2回 川崎市15年公募公債	1.63	100,000	103,319	2020/6/22
	第4回 川崎市15年公募公債	2.11	100,000	107,441	2021/12/20
	平成24年度第2回 北九州市公募公債	0.715	100,000	103,162	2022/12/26
	平成23年度第9回 福岡市公募公債	1.01	147,000	152,552	2022/3/28
	平成21年度第1回 千葉市公募公債	1.59	200,000	202,870	2019/4/26
	小 計	-	18,051,200	18,937,520	-
特 殊 債 券 (除く金融債)	第340回 政府保証道路債券	1.7	100,000	103,333	2020/4/28
	第14回 政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.199	200,000	200,944	2020/6/18
	第16回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	201,000	205,773	2020/9/14
	第15回 政府保証東日本高速道路債券	1.3	100,000	101,005	2019/2/25
	第5回 中日本高速道路社債	1.86	100,000	100,594	2018/9/20
	第6回 中日本高速道路社債	1.73	100,000	100,979	2018/12/20
	第25回 政府保証中日本高速道路債券	1.5	200,000	203,226	2019/6/14
	第19回 政府保証西日本高速道路債券	1.4	100,000	101,276	2019/4/16
	第3回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.85	9,802	9,854	2036/9/10
	第3回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	14,543	15,115	2036/5/10
	第4回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	10,293	10,347	2036/12/10
	第4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	17,922	18,981	2042/8/10
	第5回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	14,955	15,520	2036/11/10
	第6回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.94	23,282	23,748	2037/6/10
	第7回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.0	19,207	20,400	2038/11/10
	第8回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	11,612	11,805	2037/10/10
	第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	32,968	34,889	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	19,347	20,600	2039/5/10
	第10回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	50,898	53,872	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	18,902	19,921	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	20,120	21,389	2040/5/10
	第12回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	13,075	13,429	2038/9/10
	第14回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7	20,188	20,754	2032/5/10
	第17回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	46,094	47,713	2032/11/10
	第19回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.15	25,479	27,298	2043/11/10
	第21回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.92	100,000	100,614	2018/9/20
	第24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	52,888	57,341	2044/5/10
	第25回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.67	200,000	201,890	2018/12/20
	第26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	81,075	87,428	2044/7/10
	第27回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.05	28,931	31,119	2044/8/10
	第28回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	32,199	34,574	2044/9/10
	第29回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	15,814	16,400	2040/4/10
	第29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	34,730	37,281	2044/10/10
	第30回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	34,407	36,888	2044/11/10
	第32回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	18,326	19,033	2040/7/10
	第32回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	67,784	72,278	2045/1/10

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35回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	18,808	19,644	2040/10/10
第35回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	37,347	39,720	2045/4/10
第36回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	38,138	40,444	2045/5/10
第39回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	17,064	17,796	2041/2/10
第41回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	18,583	19,602	2041/4/10
第43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.28	35,294	37,484	2041/6/10
第43回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	49,219	52,145	2045/12/10
第46回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	41,408	44,167	2046/3/10
第48回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	77,812	83,085	2046/5/10
第49回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	38,153	40,517	2046/6/10
第51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	16,639	17,574	2042/2/10
第51回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	83,916	88,889	2046/8/10
第52回	一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	119,900	2030/7/16
第53回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	17,991	19,024	2042/4/10
第55回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	107,162	112,919	2046/12/10
第57回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	51,011	53,790	2047/2/10
第58回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4	53,981	56,854	2047/3/10
第59回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	104,508	110,247	2047/4/10
第60回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	163,953	172,204	2047/5/10
第61回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	52,801	55,284	2047/6/10
第67回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	58,957	61,357	2047/12/10
第69回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	120,106	126,232	2048/2/10
第70回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	107,830	112,956	2048/3/10
第73回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	60,294	63,494	2048/6/10
第95回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.065	100,000	103,920	2022/3/18
第99回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	82,782	85,572	2050/8/10
第123回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	97,159	97,895	2052/8/10
第124回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	97,406	97,832	2052/9/10
第125回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	97,712	98,133	2052/10/10
第127回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	98,487	98,754	2052/12/10
第128回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	98,657	99,083	2053/1/10
第129回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	99,020	99,726	2053/2/10
第130回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	200,000	237,054	2032/12/20
第1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	33,976	35,703	2042/5/10
第2回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	36,536	38,649	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	17,819	18,926	2037/11/10
第6回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	17,790	18,762	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	36,570	38,645	2038/11/10
第7回	道路債券	2.7	100,000	110,766	2022/6/20
第9回	道路債券	2.9	100,000	133,726	2032/5/20
第42回	道路債券	2.22	100,000	114,169	2025/3/21
第6回	政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.3	100,000	101,070	2019/3/15
第7回	政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.4	500,000	506,365	2019/4/15
第11回	地方公共団体金融機構債券	1.465	100,000	102,742	2020/4/28
第15回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	102,288	2020/8/14
第18回	政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	500,000	511,580	2020/11/17
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	800,992	2022/5/30
第27回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	200,000	206,670	2021/8/13
第42回	地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	103,311	2022/11/28
第45回	地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	206,896	2023/2/28

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61回 地方公共団体金融機構債券	0.69	100,000	103,542	2024/6/28
	第63回 地方公共団体金融機構債券	0.581	100,000	102,932	2024/8/28
	第65回 地方公共団体金融機構債券	0.535	100,000	102,715	2024/10/28
	第67回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.466	100,000	102,885	2024/12/13
	第74回 地方公共団体金融機構債券	0.663	100,000	100,526	2019/3/20
	第51回 政府保証関西国際空港債券	2.1	100,000	109,102	2022/8/31
	第3回 政府保証日本政策投資銀行社債	2.1	200,000	223,458	2023/12/18
	第5回 政府保証日本政策投資銀行社債	1.4	100,000	101,273	2019/4/15
	第9回 政府保証日本政策投資銀行社債	1.0	100,000	102,375	2020/9/14
	第15回 政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	107,289	2021/12/22
	第20回 政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	109,288	2022/12/19
	第27回 政府保証日本政策投資銀行社債	0.11	100,000	100,385	2021/2/12
	第34回 政府保証日本政策投資銀行社債	0.001	300,000	300,381	2022/6/30
	第2回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	300,000	314,274	2020/12/27
	第9回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	105,476	2021/3/26
	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	241,222	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	131,932	2039/8/31
	第89回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	1,251,000	1,273,467	2019/9/30
	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	363,051	2029/9/28
	第95回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	101,958	2019/12/27
	第98回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	159,000	162,569	2020/1/31
	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	122,423	2030/1/31
	第103回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	1,500,000	1,536,255	2020/3/19
	第104回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	300,000	308,286	2020/4/30
	第120回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	102,267	2020/10/30
	第137回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	1,000,000	1,038,300	2021/6/30
	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	206,656	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	309,174	2024/11/29
	第2回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	200,000	203,236	2019/7/12
	第8回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	129,000	131,844	2020/1/20
	第203回 政府保証預金保険機構債	0.1	600,000	601,284	2020/1/17
	第208回 政府保証預金保険機構債	0.1	600,000	601,848	2020/10/6
	第209回 政府保証預金保険機構債	0.1	600,000	602,052	2020/12/11
	第20回 西日本高速道路社債	0.759	100,000	103,379	2023/9/20
	第332回 東京交通債券	2.65	100,000	103,984	2019/11/29
	第342回 東京交通債券	2.4	100,000	109,420	2022/6/21
	第36回 日本政策投資銀行債券	2.23	100,000	118,168	2027/5/28
	第8回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	100,000	117,812	2026/3/19
	第18回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.87	100,000	148,646	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	431,856	2047/3/20
	第42回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.63	100,000	100,921	2018/12/20
	第47回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	200,000	245,596	2029/4/20
	第107回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.935	300,000	313,125	2023/6/20
	第120回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.751	100,000	103,664	2023/12/20
	第1回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	300,000	304,839	2019/6/14
	第1回 地方公共団体金融機構債券	1.648	100,000	101,762	2019/6/28
	第2回 地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.29	100,000	121,563	2029/4/27
	第3回 公営企業債券(20年)	1.03	100,000	104,666	2023/3/22
	第3回 地方公共団体金融機構債券	1.573	300,000	305,832	2019/8/28
	第4回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	101,735	2019/9/13

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5回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	101,722	2019/10/18
	第5回 公営企業債券(20年)	2.11	100,000	110,788	2023/9/20
	第6回 地方公共団体金融機構債券	1.518	200,000	204,482	2019/11/28
	第8回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.199	100,000	100,155	2019/1/29
	第11回 公営企業債券(20年)	2.11	100,000	113,519	2025/3/24
	第16回 公営企業債券(20年)	2.1	100,000	114,765	2025/12/19
	第17回 公営企業債券(20年)	2.39	100,000	117,423	2026/3/24
	第18回 公営企業債券(20年)	2.58	100,000	119,416	2026/6/19
	第22回 公営企業債券(20年)	2.32	100,000	119,085	2027/6/18
	第24回 公営企業債券(20年)	2.29	200,000	240,530	2028/4/25
	第44回 地方公共団体金融機構債券	0.791	300,000	310,152	2023/1/27
	第15回 首都高速道路	0.21	100,000	100,379	2020/9/18
	第11回 阪神高速道路	0.319	200,000	200,342	2018/12/20
	第7回 本州四国連絡橋債券	2.26	100,000	115,000	2025/6/20
	第13回 関西国際空港	1.72	100,000	100,549	2018/9/20
	第16回 関西国際空港	1.85	100,000	101,047	2018/12/20
	第12回 国際協力機構債券	0.901	100,000	103,478	2022/6/20
	第28回 東日本高速道路	0.248	100,000	100,318	2019/12/20
	第35回 東日本高速道路	0.1	200,000	200,334	2021/3/19
	第45回 中日本高速道路	0.904	100,000	103,505	2022/9/20
	第22回 西日本高速道路	0.744	100,000	103,514	2024/3/19
	第23回 西日本高速道路	0.602	100,000	102,750	2024/6/20
	小 計	-	22,759,730	23,976,146	-
金 融 債 券	い第768号 農林債	0.3	100,000	100,281	2019/5/27
	い第810号 農林債	0.1	300,000	300,066	2022/11/25
	第291回 信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,170	2019/2/27
	第293回 信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,206	2019/4/26
	第297回 信金中金債(5年)	0.2	200,000	200,388	2019/8/27
	第301回 信金中金債(5年)	0.225	300,000	300,882	2019/12/27
	第197号 商工債(3年)	0.02	200,000	199,824	2019/6/27
	小 計	-	1,300,000	1,301,817	-
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第528回 東京電力	1.905	100,000	101,859	2019/6/13
	第537回 東京電力	1.814	100,000	102,864	2020/2/28
	第544回 東京電力	1.976	100,000	100,161	2018/6/25
	第547回 東京電力	1.948	100,000	103,687	2020/7/24
	第507回 中部電力	0.605	100,000	102,285	2026/1/23
	第518回 中部電力	0.19	100,000	100,069	2023/1/25
	第467回 関西電力	1.67	100,000	100,528	2018/9/20
	第512回 関西電力	0.32	100,000	100,035	2024/10/25
	第308回 北陸電力	0.769	100,000	103,243	2024/9/25
	第471回 東北電力	1.168	100,000	105,028	2023/12/25
	第472回 東北電力	0.954	100,000	103,961	2024/2/23
	第476回 東北電力	0.57	100,000	101,798	2025/1/24
	第253回 四国電力	1.0	100,000	104,105	2023/6/23
	第328回 北海道電力	0.42	100,000	100,854	2023/1/25
	第13回 大和ハウス工業	0.285	100,000	100,130	2027/6/1
	第10回 アサヒグループホールディングス	0.17	100,000	100,089	2022/6/13
	第9回 セブン&アイ・ホールディングス	0.671	100,000	102,071	2023/3/20
	第30回 東レ	0.375	100,000	100,044	2027/7/16
	第7回 クラレ	0.19	100,000	99,891	2025/4/25

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56回 住友化学	0.38	200,000	199,998	2027/9/13
	第24回 三菱ケミカルホールディングス	0.37	100,000	100,236	2028/2/25
	第3回 新日鐵住金	0.22	100,000	100,024	2024/5/20
	第8回 ジェイテクト	0.25	100,000	99,927	2025/3/7
	第16回 日立製作所	0.813	100,000	103,480	2023/12/13
	第36回 富士通	0.562	100,000	101,201	2021/6/11
	第12回 パナソニック	0.387	200,000	201,058	2020/3/19
	第13回 パナソニック	0.568	200,000	203,146	2022/3/18
	第1回 日本生命2012基金特定目的会社特定社債	0.87	100,000	100,147	2018/8/3
	第1回 明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	0.82	100,000	100,147	2018/8/8
	第1回 明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	0.51	100,000	100,347	2019/8/7
	第1回 ユニー・ファミリーマートホールディングス	0.14	100,000	100,100	2022/2/22
	第63回 三井物産	2.37	100,000	117,506	2027/4/23
	第47回 住友商事	0.858	100,000	103,132	2023/10/23
	第8回 みずほコーポレート銀行	2.54	100,000	120,259	2027/7/27
	第25回 三菱東京UFJ銀行	1.31	300,000	308,463	2020/11/12
	第110回 三菱東京UFJ銀行	1.485	100,000	102,006	2019/10/16
	第1回 三井住友フィナンシャル	0.849	100,000	102,220	2024/9/12
	第4回 りそな銀行	2.766	100,000	102,792	2019/6/20
	第9回 三菱UFJ信託銀行	1.68	100,000	104,235	2021/4/28
	第8回 住友信託銀行	2.49	100,000	117,563	2027/5/10
	第1回 みずほフィナンシャルグループ	0.95	100,000	102,798	2024/7/16
	第20回 三井住友銀行	2.21	200,000	204,848	2019/7/24
	第24回 三井住友銀行	1.6	100,000	104,129	2021/6/1
	第9回 みずほ銀行	2.52	100,000	117,753	2027/4/27
	第17回 トヨタファイナンス	1.91	100,000	104,074	2020/9/18
	第53回 トヨタファイナンス	0.336	100,000	100,009	2018/6/20
	第54回 トヨタファイナンス	0.508	100,000	100,789	2020/6/19
	第83回 トヨタファイナンス	0.08	100,000	100,001	2023/4/24
	第70回 日立キャピタル	0.2	100,000	100,014	2022/12/20
	第48回 三菱UFJリース	0.15	100,000	99,879	2022/1/26
	第21回 野村ホールディングス	1.86	100,000	103,153	2020/3/17
	第58回 三井不動産	0.1	100,000	100,016	2023/2/24
	第58回 三菱地所	2.9	100,000	131,209	2032/5/20
	第38回 京王電鉄	0.295	100,000	99,999	2027/11/29
	第15回 東日本旅客鉄道	2.65	100,000	105,906	2020/8/25
	第34回 東日本旅客鉄道	2.53	100,000	114,524	2024/6/20
	第110回 東日本旅客鉄道	1.76	100,000	120,489	2045/7/28
	第41回 東海旅客鉄道	2.166	100,000	119,811	2029/1/29
	第42回 東海旅客鉄道	2.312	200,000	243,304	2029/4/24
	第11回 電源開発	2.05	100,000	111,793	2025/3/19
	第18回 大阪瓦斯	1.47	200,000	212,518	2022/12/20
	第27回 東邦瓦斯	1.12	100,000	104,765	2023/3/20
	第4回 ファーストリテイリング	0.749	100,000	103,049	2025/12/18
	第11回 ジェー・ビー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	0.665	200,000	200,068	2018/6/13
	第11回 ウェストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	200,000	200,668	2021/1/22
	小 計	—	7,500,000	7,826,255	—
	合 計	—	188,383,930	205,546,357	—

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2018年5月25日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	205,546,357	99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,461,557	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	207,007,914	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

(2018年5月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	207,007,914,738円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	848,754,824
公 社 債 (評 価 額)	205,546,357,564
未 収 利 息	600,533,630
前 払 費 用	12,268,720
(B) 負 債	164,626,640
未 払 解 約 金	164,607,966
未 払 利 息	742
そ の 他 未 払 費 用	17,932
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	206,843,288,098
元 本	163,796,330,040
次 期 繰 越 損 益 金	43,046,958,058
(D) 受 益 権 総 口 数	163,796,330,040口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12,628円

※当期における期首元本額182,979,096,987円、期中追加設定元本額15,035,579,852円、期中一部解約元本額34,218,346,799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2017年5月26日 至2018年5月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,378,340,233円
受 取 利 息	2,377,105,954
そ の 他 収 益	1,867,210
支 払 利 息	△ 632,931
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 747,616,793
売 買 益	668,545,704
売 買 損	△ 1,416,162,497
(C) 信 託 報 酬 等	△ 291,971
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	1,630,431,469
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	46,289,553,211
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,904,997,424
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 8,778,024,046
(H) 計 (D + E + F + G)	43,046,958,058
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	43,046,958,058

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 期末における、元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型)	3,885,439,011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>	122,207,154円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	6,946,579,619円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,202,521,177円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	1,556,617,338円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,399,859,067円
SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	494,855,098円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,605,548,218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)	52,258,028円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	12,265,414,255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)	154,085,069円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	119,296,586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)	260,659,732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)	6,710,475,322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)	188,135,697円	三井住友・5資産バランスファンド・VAS (適格機関投資家専用)	19,037,044,247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)	71,048,352円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	603,732,535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)	163,077,420円	SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	955,632,302円
三井住友・DC年金バランスゼロ (債券型)	67,246,299円	三井住友・7資産バランスファンド・VAS (適格機関投資家専用)	16,533,976,390円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	4,336,695,588円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,030,019,406円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	556,562,259円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	203,749,833円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	501,774,767円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	47,246,353円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,260,689円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,324,635,231円
三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)	145,281円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,869,064,591円
三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)	215,991円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,617,799,198円
三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型)	1,084,853円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,101,983,016円
三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型)	1,020,266円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	256,456,760円
三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型)	3,192,019円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	23,600,693円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	8,704,663円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	392,257,900円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,868,073,331円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,056,763,281円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	21,966,108,626円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	318,834,767円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,267,510,005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>	184,282,268円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	20,010,677,598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>	1,632,030,696円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	371,397,018円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	782,109,512円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	662,265,340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>	1,684,120,665円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,683,310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<適格機関投資家限定>	551,905円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	309,743,445円		

■ お知らせ

<約款変更について>

- ・デリバティブ取引の利用目的をより明確にするため、信託約款に所要の変更を実施しました。
(適用日：2017年9月21日)
- ・受益者に対してする公告を電子公告の方法によるものとするため、所要の変更を行いました。
(適用日：2018年2月1日)
- ・一般社団法人投資信託協会規則の「信用リスク集中回避のための投資制限」に適合するよう、所要の変更を行いました。
(適用日：2018年5月17日)

外国株式インデックス・マザーファンド

第16期（2017年12月1日から2018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。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	投資信託 証券 組入比率	純資産額
	騰落率	中率	騰落率	中率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
12期（2014年12月1日）	28,352	27.9	292.09	28.3	94.9	2.7	2.2	211,760
13期（2015年11月30日）	29,051	2.5	299.80	2.6	93.7	3.9	2.3	174,039
14期（2016年11月30日）	27,558	△5.1	284.85	△5.0	95.6	2.0	2.4	165,583
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

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）は、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したもので、設定時を100として2018年11月30日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	投資信託 証券 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2017年11月30日	円	%		%	%	%	%
12月末	33,807	—	350.45	—	95.2	2.5	2.3
2018年1月末	34,857	3.1	361.31	3.1	95.5	2.2	2.3
2月末	35,253	4.3	365.47	4.3	95.1	2.7	2.1
3月末	33,671	△0.4	349.18	△0.4	93.6	4.6	2.0
4月末	32,240	△4.6	334.47	△4.6	95.0	2.9	2.2
5月末	33,684	△0.4	349.63	△0.2	95.8	2.1	2.1
6月末	33,855	0.1	351.24	0.2	94.6	3.2	2.1
7月末	34,128	0.9	354.48	1.2	94.5	3.3	2.2
8月末	35,478	4.9	368.60	5.2	96.3	1.4	2.2
9月末	36,246	7.2	376.53	7.4	95.9	1.9	2.2
10月末	37,163	9.9	386.40	10.3	95.4	2.6	2.1
(期末) 2018年11月30日	33,893	0.3	352.33	0.5	94.1	3.8	2.3
	34,678	2.6	360.38	2.8	93.7	3.9	2.3

※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	33,807円
期末	34,678円
騰落率	+2.6%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

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

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・米国株式市場が好調な景気動向などを背景に上昇したこと ・米国の利上げの継続を背景に、米ドルが円に対して上昇したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・米中の貿易摩擦問題やEU（欧州連合）域内の政治問題に対する懸念が強まったことなどを背景に、欧州株式市場が下落したこと

▶ 投資環境について（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

当期の世界の株式市場は上昇しました。うち、米国株式市場は上昇しました。欧州株式市場は下落しました。また、米ドルは円に対して上昇した一方で、ユーロは円に対して下落しました。

株式市場

主要先進国の株式市場は、上昇しました。

米国株式市場は、期首から上昇基調をたどりました。好調な景気動向が続く中で12月に税制改革法案が可決され、企業業績への好影響を織り込む形で1月下旬にかけて上昇しました。2月から3月下旬までは、金利上昇や米中の貿易摩擦問題の深刻化への懸念などから、調整局面となりました。4月以降は、好調な企業決算などに支えられ、株式市場は9月まで緩やかに上昇しました。10月から期末にかけては、金利上昇や米中の貿易摩擦問題、中国景気の減速懸念からリスク回避姿勢が強まり、株式市場は下落しました。FOMC（米連邦公開市場委員会）では、12月、3月、6月、9月の4回にわたり政策金利が引き上げられましたが、いずれも市場に織り込まれていたこともあり、株式市場への影響は限定的でした。

欧州の株式市場は、下落しました。米国の通商政策が世界の景気拡大に対し阻害要因になるとの見方、トルコでの通貨の暴落（8月）など新興国市場への懸念の高まり、イタリアやスペインの政権の不安定化、ドイツ国内におけるメルケル首相の求心力の低下などが、マイナス要因となりました。

当期のS & P 500種指数（米ドルベース）は期首に比べて4.3%上昇しました。ユーロ・ストックス50インデックス（ユーロベース）は期首に比べて11.6%下落しました。MSCIコクサイインデックス（配当込み、米ドルベース）は、期首に比べて1.5%上昇しました。

為替市場

米ドル・円相場は、2月から3月にかけては米国政府高官による米ドル安容認発言や世界的な株価の下落などを受け、米ドル安・円高が進行する局面となりました。しかし、3月下旬から期末にかけては、好調な米国景気環境や米国金利の上昇などをサポート材料に、米ドルが上昇する展開となりました。

一方ユーロは、対円で下落しました。貿易摩擦問題により世界景気に対し減速懸念が強まると

ともに、イタリアやスペインの政治面での不安定化やイギリスのEU離脱交渉における混乱など、ユーロを取り巻く不安材料は払拭されず、期末まで下落基調で推移しました。

当期の米ドル・円は期首112円05銭から期末113円47銭へと1円42銭の米ドル高・円安、ユーロ・円は期首132円81銭から期末129円19銭へと3円62銭のユーロ安・円高となりました。

▶ ポートフォリオについて（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

株式組入比率

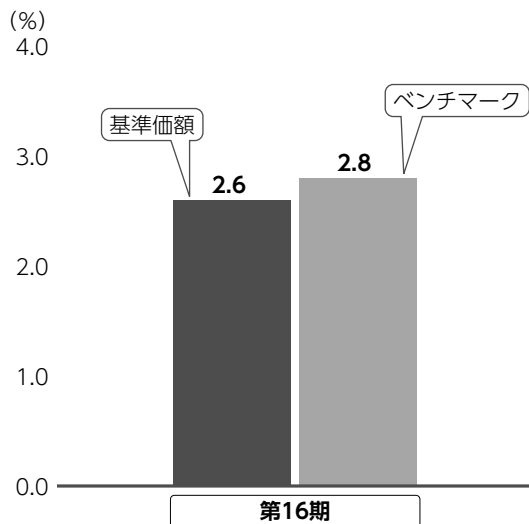
M S C I コクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について (2017年12月1日から2018年11月30日まで)

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は+2.6%となり、ベンチマークの騰落率+2.8%から0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

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

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

■ 1万口当たりの費用明細（2017年12月1日から2018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) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	2円 (1) (0) (1)	0.004% (0.002) (0.000) (0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	1 (1) (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)	17 (14) (3)	0.050 (0.042) (0.008)	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付金・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	20	0.057	

期中の平均基準価額は34,522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 (2017年12月1日から2018年11月30日まで)

(1) 株 式

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	ア メ リ カ	百株 4,120 (1,591)	千米ドル 29,167 (5,857)	百株 22,947 (637)	千米ドル 171,936 (12,600)
	カ ナ ダ	992 (△ 56)	千カナダドル 2,688 (-)	3,005 (-)	千カナダドル 11,733 (51)
	ユ ー ロ		千ユーロ		千ユーロ
	ド イ ツ	547 (399)	4,365 (105)	1,652 (365)	10,909 (62)
	イ タ リ ア	642 (106)	776 (-)	3,842	1,550
	フ ラ ン ス	299 (1)	1,964 (△ 52)	1,551	7,571
	オ ラ ン ダ	116	641	1,698	3,923
	ス ペ イ ン	501 (13,607)	476 (82)	7,588 (9,730)	3,312 (82)
	ベ ル ギ ー	44	252	143	994
	オ ー ス ト リ ア	15 (-)	80 (△ 15)	71	301
	ル ク セ ン ブ ル ク	16	46	140	282
	フ ィ ン ラ ン ド	100 (126)	74 (-)	707	825
	ア イ ル ラ ン ド	601	722	248	435
	ポ ル ト ガ ル	118	39	300	119
そ の 他	-	-	524	1,046	
国	イ ギ リ ス	7,252 (83,618)	千英ポンド 3,373 (△ 69)	113,794 (-)	千英ポンド 15,046 (132)
	ス イ ス	404 (90)	千スイスフラン 1,533 (△ 234)	1,236 (30)	千スイスフラン 7,620 (1)
	ス ウ ェ ー デ ン	301 (1,169)	千スウェーデンクローナ 2,786 (431)	2,355 (-)	千スウェーデンクローナ 23,133 (431)
	ノ ル ウ ェ ー	86	千ノルウェークローネ 2,110	350	千ノルウェークローネ 5,962
	デ ン マ ー ク	27	千デンマーククローネ 890	705	千デンマーククローネ 12,970
	オ ー ス ト ラ リ ア	444 (355)	千オーストラリアドル 1,169 (-)	4,070 (-)	千オーストラリアドル 7,578 (38)
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	1,639	千ニューージーランドドル 1,115	2,026	千ニューージーランドドル 882

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	香 港	3,141 (464)	千香港ドル 7,140 (263)	7,188 (56)	千香港ドル 23,306 (263)
	シ ン ガ ポ ー ル	653	千シンガポールドル 474	2,802 (1,286)	千シンガポールドル 1,580 (434)
国	イ ス ラ エ ル	79 (△ 13)	千イスラエルシケル 305 (-)	108 (-)	千イスラエルシケル 603 (477)

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

(2) 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		千米ドル		千米ドル
	AGNC INVESTMENT CORPORATION	2,396	45	4,727	87
	AMERICAN TOWER CORP	855	118	2,803	394
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	4,470	44	7,499	75
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	-	-	903	155
	BOSTON PROPERTIES INC	-	-	848	98
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	-	-	16,568	272
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	-	-	-	-
		(11,010)	(244)		
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	-	-	24,561	144
	DIGITAL REALTY TRUST INC	-	-	1,087	117
	DUKE REALTY CORP	-	-	2,925	80
	EQUITY RESIDENTIAL	-	-	2,414	150
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	-	-	395	86
	EXTRA SPACE STORAGE INC	-	-	1,018	88
	GGP INC	3,980	80	5,976 (29,282)	133 (672)
	HCP, INC.	-	-	3,737	94
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	-	-	3,695	75
	KIMCO REALTY CORPORATION	-	-	5,260	79
	MACERICH COMPANY/THE	-	-	1,423	73
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	-	-	860	78	
PROLOGIS INC	5,031	332	3,960	239	
PUBLIC STORAGE	265	51	1,312	258	
REALTY INCOME CORPORATION	-	-	1,476	77	
REGENCY CENTERS CORP	-	-	1,366	75	
SL GREEN REALTY CORP	-	-	909	82	
SIMON PROPERTY GROUP INC	668	104	2,511	413	
UDR INC	-	-	2,479	81	
VENTAS INC	-	-	1,438	73	
WP CAREY INC	6,694	433	-	-	
WELLTOWER INC	844	44	2,698	158	
WEYERHAEUSER CO	-	-	5,710	178	
国					

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		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	—	—	283,000	77	
	小	計	25,203 (11,010)	1,255 (244)	393,558 (29,282)	4,003 (672)	
	カ	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	千カナダドル	—	千カナダドル	
	ナ	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,060	61	3,432	66	
	ダ	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,960	56	3,839	77	
	小	計	5,020	117	—	—	
					7,271	144	
	ユ	フランス	KLEPIERRE	—	千ユーロ	—	千ユーロ
	ー		GECINA SA	—	—	1,577	55
	ロ		UNIBAIL-RODAMCO SE	1,597 (△ 5,937)	308 (△ 1,251)	414	55
		UNIBAIL-GROUP STAPLED(NEW)	—	—	342	64	
	小	計	(5,937)	(1,251)	—	—	
ユ		計	1,597	308	2,333	175	
		計	1,597	308	2,333	175	
イ	イギリス	BRITISH LAND CO PLC	—	千英ポンド	—	千英ポンド	
		INTU PROPERTIES PLC	—	—	12,755	76	
		SEGRO PLC	—	—	39,039	76	
小	計	—	—	8,709	50		
		計	—	—	60,503	203	
オ	オーストラリア	MIRVAC GROUP	—	千オーストラリアドル	—	千オーストラリアドル	
		TRANSURBAN GROUP	11,306	128	41,459	85	
		APA GROUP	—	—	5,730 (—)	72 (8)	
		GPT GROUP	—	—	7,671 (—)	66 (0. 83528)	
		STOCKLAND	—	—	17,877	87	
		DEXUS	—	—	15,146	64	
		GOODMAN GROUP	17,915	146	9,461	96	
		APA GROUP-RIGHTS SHARE	—	—	43,412	389	
		APA GROUP-RIGHTS SHARE(NEW)	—	—	—	—	
		TRANSURBAN GROUP-RTS	(2,846)	(0. 83528)	(2,846)	—	
		TRANSURBAN GROUP-RTS-NEW	—	—	8,043	7	
		TRANSURBAN GROUP-RIGHT	(8,043)	(8)	—	—	
		TRANSURBAN GROUP-RIGHT NEW	—	—	(17,302)	—	
		SCENTRE GROUP	(17,302)	(—)	—	—	
		WESTFIELD CORP	—	—	25,604	111	
小	計	29,221 (28,191)	275 (9)	262,206 (20,148)	1,757 (9)		
香	香港	LINK REIT	—	千香港ドル	—	千香港ドル	
			—	—	8,500	560	

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	HKT TRUST AND HKT LTD	—	—	46,000	499	
	小 計	—	—	54,500	1,060	
	シンガポール	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
			(—)	(△ 1)	—	—
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		33,900	64	—	—	
	(—)	(△ 0.156)				
国	SUNTEC REIT	—	—	47,300	85	
		(—)	(△ 1)			
	小 計	33,900	64	47,300	85	
	(—)	(△ 3)				

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建		
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	
外 国	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円	
		S P M I N I	41,731	40,627	—	—
		S P I 2 0 0	2,810	2,735	—	—
		F T S E	4,080	3,981	—	—
	D J E U R O	10,889	10,599	—	—	

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※外国の取引金額は、各月末（ただし、決算日の属する月については決算日）のわが国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

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	35,385,456千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	174,246,463千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.20

※単位未満は切捨て。

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末（ただし、決算日の属する月については決算日）のわが国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 (2017年12月1日から2018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。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2018年11月30日現在)

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC	191	321	1,460	165,724	保険
AGCO CORP	34	22	134	15,247	資本財
AES CORPORATION	349	271	419	47,643	公益事業
AT&T INC	2,900	3,017	9,224	1,046,707	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	821	728	5,337	605,604	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	753	630	5,666	642,935	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	—	18	610	69,276	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	340	296	1,559	176,909	ソフトウェア・サービス
ACUITY BRANDS INC	18	18	243	27,590	資本財
ADOBE INC	234	204	5,097	578,399	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	33	33	587	66,609	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	391	394	845	95,933	半導体・半導体製造装置
AETNA INC	155	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	26	22	251	28,512	各種金融
AGILENT TECHNOLOGIES INC	156	128	919	104,314	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	103	89	1,419	161,126	素材
AKAMAII TECHNOLOGIES	80	73	503	57,144	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORPORATION	50	46	443	50,360	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	103	90	1,111	126,112	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	36	31	723	82,107	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORPORATION	7	6	401	45,537	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	22	22	437	49,594	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	112	91	409	46,439	公益事業
ALLSTATE CORP	172	142	1,264	143,469	保険
ALLY FINANCIAL INC	207	177	470	53,432	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	39	315	35,745	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	147	130	14,172	1,608,202	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	140	123	13,555	1,538,117	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	909	786	4,399	499,212	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	192	171	28,654	3,251,467	小売
AMERCO	3	3	135	15,429	運輸
AMEREN CORPORATION	118	103	700	79,541	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	65	56	218	24,744	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER	228	204	1,562	177,305	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	356	303	3,382	383,823	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	35	35	363	41,281	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	440	373	1,620	183,866	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	82	70	653	74,106	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	80	70	638	72,478	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	74	62	803	91,173	各種金融
AMETEK INC	103	96	704	79,950	資本財
AMGEN INC	348	273	5,534	627,967	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORPORATION -CL A	149	125	1,089	123,669	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	258	214	1,149	130,421	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	170	154	1,379	156,552	半導体・半導体製造装置
ANDEAVOR	74	—	—	—	エネルギー
ANSYS INC	42	36	583	66,235	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	92	92	124	14,122	エネルギー
ANTHEM INC	125	106	3,098	351,582	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORPORATION	183	163	582	66,132	エネルギー
APPLE INC	2,466	2,041	36,659	4,159,807	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	508	418	1,530	173,675	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	107	107	408	46,299	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	272	226	1,041	118,165	食品・飲料・タバコ

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株	数	株	数	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ARCONIC INC	198	190	405	46,065	資本財		
ARISTA NETWORKS INC	23	22	534	60,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
ARROW ELECTRONICS INC	41	41	315	35,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
ASSURANT INC	30	21	214	24,392	保険		
ATMOS ENERGY CORP	46	46	438	49,805	公益事業		
AUTODESK INC	95	91	1,325	150,374	ソフトウェア・サービス		
AUTOLIV INC	40	40	345	39,193	自動車・自動車部品		
AUTOMATIC DATA PROCESSING	211	183	2,669	302,940	ソフトウェア・サービス		
AUTOMATION INC	28	—	—	—	小売		
AUTOZONE INC	13	10	880	99,891	小売		
AVERY DENNISON CORP	39	39	375	42,630	素材		
AVNET INC	65	45	197	22,451	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
BB & T CORPORATION	377	317	1,607	182,392	銀行		
BAKER HUGHES A GE CO	194	163	377	42,795	エネルギー		
BALL CORPORATION	158	136	677	76,889	素材		
BANK OF AMERICA CORP	4,701	4,002	11,223	1,273,519	銀行		
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	485	419	2,128	241,516	各種金融		
BARD(C.R.) INC	33	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス		
BAXTER INTERNATIONAL INC	231	211	1,437	163,155	ヘルスケア機器・サービス		
BECTON DICKINSON & CO	106	111	2,776	315,090	ヘルスケア機器・サービス		
BED BATH & BEYOND INC	59	—	—	—	小売		
W.R.BERKLEY CORPORATION	50	38	303	34,476	保険		
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	588	529	11,536	1,309,079	各種金融		
BEST BUY COMPANY INC	127	105	675	76,647	小売		
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	85	75	727	82,512	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
BIOGEN INC	100	86	2,834	321,647	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
BLACKROCK INC	57	49	2,080	236,019	各種金融		
H&R BLOCK INC	108	78	220	25,058	消費者サービス		
BOEING CO	270	229	7,878	893,938	資本財		
BOOKING HOLDINGS INC	—	20	3,734	423,700	小売		
BORGWARNER INC	101	85	337	38,267	自動車・自動車部品		
BOSTON SCIENTIFIC CORP	650	573	2,123	240,983	ヘルスケア機器・サービス		
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	42	42	170	19,345	保険		
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	779	679	3,519	399,382	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	53	49	498	56,584	ソフトウェア・サービス		
BROADCOM INC	—	170	4,024	456,636	半導体・半導体製造装置		
BROWN-FORMAN CORPORATION	104	113	547	62,073	食品・飲料・タバコ		
CBS CORP-CL B	181	136	755	85,717	メディア・娯楽		
CBOE GLOBAL MARKETS INC	44	49	525	59,676	各種金融		
CBRE GROUP INC-A	149	131	569	64,580	不動産		
CDK GLOBAL INC	62	50	251	28,486	ソフトウェア・サービス		
CDW CORP/DE	69	63	582	66,108	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	101	101	441	50,045	素材		
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	71	60	556	63,121	運輸		
CIGNA CORP	121	101	2,249	255,245	ヘルスケア機器・サービス		
CIT GROUP INC	75	47	220	25,054	銀行		
CME GROUP INC.	161	139	2,641	299,734	各種金融		
CMS ENERGY CORPORATION	141	114	588	66,745	公益事業		
CSX CORPORATION	430	345	2,480	281,415	運輸		
CVS HEALTH CORPORATION	488	535	4,280	485,715	ヘルスケア機器・サービス		
CA INC	151	—	—	—	ソフトウェア・サービス		
CABOT OIL & GAS CORPORATION	225	196	484	55,000	エネルギー		
CADENCE DESIGN SYS INC	142	117	516	58,643	ソフトウェア・サービス		
CAMPBELL SOUP CO	90	78	312	35,430	食品・飲料・タバコ		
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	225	202	1,796	203,829	各種金融		
CARDINAL HEALTH INC	144	128	708	80,367	ヘルスケア機器・サービス		
CARMAX INC	86	74	492	55,891	小売		
CARNIVAL CORP	166	177	1,078	122,412	消費者サービス		
CATERPILLAR INC	276	248	3,235	367,139	資本財		

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
CELANESE CORPORATION	65	56	567	64,428	素材
CELGENE CORP	369	301	2,113	239,779	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	79	83	1,180	133,969	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	205	193	536	60,897	公益事業
CENTURYLINK INC	485	406	756	85,797	電気通信サービス
CERNER CORP	147	124	711	80,751	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	103	69	2,281	258,891	メディア・娯楽
CHEMOURS CO	-	80	229	26,087	素材
CHENIERE ENERGY INC	98	81	504	57,250	エネルギー
CHEVRON CORPORATION	893	791	9,406	1,067,409	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	12	11	531	60,286	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	116	99	659	74,807	家庭用品・パーソナル用品
CIMAREX ENERGY CO	48	40	341	38,703	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	74	63	514	58,348	保険
CISCO SYSTEMS INC	2,367	1,947	9,220	1,046,213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	40	36	678	76,962	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	1,298	1,055	6,848	777,114	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	240	201	725	82,347	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	70	56	624	70,829	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	61	55	927	105,193	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO/THE	1,921	1,673	8,195	929,935	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	-	71	304	34,544	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATI	274	239	1,682	190,944	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	392	344	2,170	246,325	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CLASS A	2,232	1,899	7,489	849,831	メディア・娯楽
COMERICA INC	87	71	564	64,040	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	88	88	155	17,660	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONAGRA BRANDS INC	195	171	552	62,695	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	71	83	1,093	124,070	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	579	486	3,251	368,923	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	146	129	1,023	116,096	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	79	68	1,344	152,508	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	45	45	210	23,856	エネルギー
COOPER COMPANIES INC (THE)	24	20	570	64,689	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	-	85	442	50,185	商業・専門サービス
CORNING INC	433	335	1,069	121,360	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	210	182	4,212	477,967	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	16	15	558	63,343	商業・専門サービス
COTY INC-CL A	225	225	192	21,823	家庭用品・パーソナル用品
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	187	172	1,947	221,027	不動産
CROWN HOLDINGS INC	67	52	268	30,467	素材
CUMMINS INC	75	62	933	105,908	資本財
D. R. HORTON INC	175	156	584	66,360	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	86	73	865	98,177	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	135	118	737	83,670	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	292	261	2,820	319,989	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	63	53	597	67,819	消費者サービス
DAVITA INC	69	58	380	43,220	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	128	126	1,889	214,449	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	98	82	878	99,638	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	88	72	426	48,428	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	108	99	367	41,737	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	241	220	593	67,347	エネルギー
DEXCOM INC	42	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	42	38	432	49,106	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	42	-	-	-	小売
THE WALT DISNEY CO.	737	615	7,174	814,042	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	178	144	1,031	117,033	各種金融
DISCOVERY INC-A	70	70	223	25,392	メディア・娯楽

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種	等
	株 数	株 数	評 価	額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
DISCOVERY INC-C	114	127	364	41,401	メディア・娯楽	
DISH NETWORK CORP.	115	97	322	36,576	メディア・娯楽	
DOLLAR GENERAL CORP	125	108	1,202	136,421	小売	
DOLLAR TREE INC	110	102	907	102,980	小売	
DOMINION EVERGY INC	297	271	1,999	226,917	公益事業	
DOMINO'S PIZZA INC	23	16	465	52,806	消費者サービス	
DOVER CORP	75	66	562	63,786	資本財	
DOWDUPONT INC	1,104	962	5,509	625,191	素材	
DR. PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	91	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
DUKE ENERGY CORP	327	291	2,551	289,551	公益事業	
EOG RESOURCES INC	269	240	2,536	287,870	エネルギー	
EQT CORPORATION	81	—	—	—	エネルギー	
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	136	109	564	64,038	各種金融	
EAST WEST BANCORP INC	75	62	329	37,399	銀行	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	68	59	470	53,417	素材	
EATON VANCE CORP	55	55	225	25,538	各種金融	
EBAY INC	498	392	1,158	131,436	ソフトウェア・サービス	
ECOLAB INC	124	105	1,676	190,257	素材	
EDISON INTERNATIONAL	157	135	740	84,064	公益事業	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	98	85	1,394	158,275	ヘルスケア機器・サービス	
ELECTRONIC ARTS INC	146	127	1,101	124,984	ソフトウェア・サービス	
EMERSON ELECTRIC CO	306	261	1,762	200,036	資本財	
ENTERGY CORP	81	71	613	69,647	公益事業	
ENVISION HEALTHCARE CORP	63	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
EQUIFAX INC	60	47	488	55,465	商業・専門サービス	
EQUINIX INC	36	32	1,239	140,692	不動産	
EVERGY INC	—	118	697	79,103	公益事業	
EVERSOURCE ENERGY	150	137	920	104,491	公益事業	
EXELON CORP	430	401	1,832	207,888	公益事業	
EXPEDIA GROUP INC	57	51	618	70,217	小売	
EXPEDITORS INTL WASH INC	92	68	517	58,704	運輸	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	281	233	2,362	268,092	ヘルスケア機器・サービス	
EXXON MOBIL CORPORATION	2,004	1,755	13,879	1,574,946	エネルギー	
FLIR SYSTEMS INC	70	52	241	27,392	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FMC CORPORATION	65	56	473	53,696	素材	
FACEBOOK INC-A	1,119	994	13,796	1,565,450	ソフトウェア・サービス	
FASTENAL COMPANY	144	119	708	80,374	資本財	
FEDEX CORP	118	105	2,399	272,316	運輸	
F5 NETWORKS INC	32	26	454	51,588	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	156	137	1,455	165,208	ソフトウェア・サービス	
FNFG GROUP	130	108	360	40,853	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	357	284	784	89,014	銀行	
FIRST DATA CORP-CLASS A	209	209	398	45,168	ソフトウェア・サービス	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	78	67	646	73,368	銀行	
FISERV INC	99	166	1,304	148,025	ソフトウェア・サービス	
FIRSTENERGY CORP	208	202	751	85,273	公益事業	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	43	38	732	83,171	ソフトウェア・サービス	
FLUOR CORP	72	56	233	26,462	資本財	
FLOWSERVE CORPORATION	65	48	231	26,267	資本財	
FOOT LOCKER INC	59	—	—	—	小売	
FORD MOTOR COMPANY	1,768	1,545	1,447	164,281	自動車・自動車部品	
FORTINET INC	68	59	438	49,784	ソフトウェア・サービス	
FORTIVE CORP	149	124	922	104,673	資本財	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	76	64	280	31,778	資本財	
FRANKLIN RESOURCES INC	155	134	451	51,198	各種金融	
FREEMPORT-MCMORAN INC	640	602	712	80,792	素材	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	88	75	592	67,175	保険	
GAP INC/THE	116	92	245	27,875	小売	
GARTNER INC	40	40	614	69,702	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	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	
GENERAL DYNAMICS CORP	119	104	1,911	216,857	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	4,111	3,609	2,865	325,163	資本財
GENERAL MILLS INC	272	250	1,055	119,767	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	635	527	1,937	219,865	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	74	60	628	71,332	小売
GILEAD SCIENCES INC	618	540	3,765	427,262	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	70	66	734	83,317	ソフトウェア・サービス
GODADDY INC - CLASS A	-	66	437	49,606	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	166	149	2,905	329,676	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	129	103	238	27,049	自動車・自動車部品
WR GRACE & CO	35	-	-	-	素材
WW GRAINGER INC	27	19	616	69,915	資本財
HCA HEALTHCARE INC	138	116	1,677	190,395	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	96	77	305	34,707	資本財
HP INC	796	682	1,559	176,921	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	412	364	1,160	131,715	エネルギー
HANESBRANDS INC	175	131	206	23,421	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	89	73	312	35,422	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	56	49	712	80,896	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	167	152	673	76,447	保険
HASBRO INC	55	51	499	56,662	耐久消費財・アパレル
HELMERICH & PAYNE INC	52	40	249	28,309	エネルギー
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	40	32	446	50,708	ソフトウェア・サービス
THE HERSHEY COMPANY	65	56	602	68,374	食品・飲料・タバコ
HESS CORPORATION	142	110	601	68,277	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	773	615	929	105,516	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	96	114	875	99,365	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	83	73	454	51,546	エネルギー
HOLOGIC INC	140	121	537	61,024	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	565	477	8,391	952,178	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	340	310	4,523	513,279	資本財
HORMEL FOODS CORPORATION	149	124	562	63,860	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC.	68	57	1,889	214,411	ヘルスケア機器・サービス
J. B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	43	35	374	42,469	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	543	458	664	75,399	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	21	18	393	44,662	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	-	32	582	66,094	ソフトウェア・サービス
IPG PHOTONICS CORP	-	17	250	28,473	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEX CORP	36	30	413	46,926	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	43	36	724	82,201	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	145	126	1,721	195,363	資本財
ILLUMINA INC	67	61	2,064	234,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	81	75	490	55,696	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGREDION INC	33	33	344	39,107	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	2,229	1,929	9,205	1,044,518	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	281	240	1,951	221,465	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	422	381	4,633	525,803	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	39	39	560	63,601	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	185	171	783	88,911	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	191	155	378	42,947	メディア・娯楽
INTUIT INC	113	101	2,118	240,429	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	52	47	2,452	278,310	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	67	68	853	96,793	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	1,681	1,414	15,571	1,766,899	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	60	49	320	36,358	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	-	128	283	32,121	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	1,275	1,112	16,223	1,840,927	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	20	20	283	32,153	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	167	150	429	48,745	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
KLA-TENCOR CORPORATION	72	64	627	71, 149	半導体・半導体製造装置
KANSAS CITY SOUTHERN	53	46	470	53, 374	運輸
KELLOGG CO	121	112	709	80, 496	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	500	456	827	93, 891	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	75	467	53, 039	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	168	145	1, 668	189, 337	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	971	808	1, 363	154, 703	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	66	51	175	19, 936	運輸
KOHL'S CORP	79	69	469	53, 228	小売
KRAFT HEINZ COMPANY	290	247	1, 269	144, 016	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	415	326	991	112, 536	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	106	106	358	40, 687	小売
LKQ CORPORATION	139	139	387	43, 957	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	38	33	614	69, 768	資本財
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	50	44	712	80, 878	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	77	68	1, 041	118, 155	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	194	158	864	98, 081	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	105	90	1, 283	145, 676	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	31	25	341	38, 733	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	68	50	195	22, 160	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	74	60	377	42, 786	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	91	112	484	55, 015	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-B	1	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	18	15	343	38, 934	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	152	—	—	—	各種金融
LIBERTY BROADBAND-C	49	40	344	39, 103	メディア・娯楽
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	189	—	—	—	小売
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	41	41	164	18, 616	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	76	76	305	34, 617	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	—	85	260	29, 535	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	470	405	4, 749	538, 925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	103	91	574	65, 185	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	—	60	339	38, 477	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	122	106	3, 229	366, 421	資本財
LOEWS CORPORATION	143	106	510	57, 921	保険
LOWE'S COMPANIES INC	399	341	3, 183	361, 224	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	54	42	553	62, 857	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	66	55	935	106, 157	銀行
MGM MIRAGE	230	224	614	69, 743	消費者サービス
MSCI INC-A	44	38	597	67, 802	各種金融
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	38	—	—	—	運輸
MACY'S INC	135	135	456	51, 764	小売
MANPOWERGROUP	32	32	259	29, 466	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	421	368	609	69, 139	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	250	287	1, 863	211, 396	エネルギー
MARKEL CORP	6	5	644	73, 076	保険
MARSH & MCLENNAN COS	245	210	1, 837	208, 545	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	149	124	1, 520	172, 552	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	29	25	507	57, 549	素材
MASCO CORP	142	119	373	42, 432	資本財
MASTERCARD INC-CL A	449	383	7, 548	856, 494	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	140	140	193	21, 949	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	129	116	643	72, 979	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	56	50	751	85, 240	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORPORATION	383	326	6, 174	700, 675	消費者サービス
MCKESSON CORP	101	83	1, 066	121, 001	ヘルスケア機器・サービス
MEDNAX INC	49	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	128	111	202	22, 925	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	18	18	659	74, 824	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	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	
MERCK & CO. INC.	1,294	1,113	8,676	984,569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	426	359	1,593	180,851	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	11	11	701	79,608	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	3,472	3,030	33,390	3,788,875	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	110	101	752	85,432	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	497	474	1,799	204,233	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	27	23	273	31,014	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	28	28	364	41,381	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING COMPANY	94	78	505	57,385	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	709	612	2,729	309,712	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	204	—	—	—	素材
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	186	181	1,068	121,197	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	80	71	1,124	127,563	各種金融
MORGAN STANLEY	650	551	2,455	278,643	各種金融
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	—	135	119	13,556	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE	155	155	562	63,820	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	73	67	893	101,350	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MURPHY OIL CORPORATION	67	—	—	—	エネルギー
NVR INC	1	1	353	40,139	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC	53	53	482	54,800	各種金融
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	191	168	551	62,571	エネルギー
NAVIENT CORPORATION	159	—	—	—	各種金融
NEKTAR THERAPEUTICS	—	70	276	31,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	138	111	750	85,166	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	202	179	5,191	589,105	小売
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	523	523	333	37,861	不動産
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	107	94	610	69,223	資本財
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	107	91	336	38,195	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	219	219	231	26,254	銀行
NEWELL BRANDS INC	225	184	439	49,898	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	107	82	144	16,437	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	256	212	686	77,891	素材
NEWS CORP-CLASS A	166	166	220	24,975	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	219	195	3,469	393,716	公益事業
NIKE INC -CL B	619	533	3,962	449,613	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	157	157	411	46,685	公益事業
NOBLE ENERGY INC	209	209	507	57,622	エネルギー
NORDSTROM INC	64	47	248	28,224	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	137	117	1,977	224,404	運輸
NORTHERN TRUST CORP	105	85	830	94,216	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	79	68	1,794	203,616	資本財
NUANCE COMMUNICATIONS INC	164	—	—	—	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	154	132	792	89,960	素材
NVIDIA CORP	281	239	3,770	427,856	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	90	90	352	39,962	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	44	33	1,175	133,397	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	356	318	2,256	256,036	エネルギー
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	26	356	40,428	運輸
OMNICO GROUP	113	94	728	82,715	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP	—	174	322	36,599	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	183	170	1,046	118,783	エネルギー
ORACLE CORPORATION	1,460	1,265	6,063	688,070	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	—	48	250	28,444	資本財
P G & E CORPORATION	247	208	557	63,282	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	226	195	2,607	295,874	銀行
PPG INDUSTRIES INC	120	100	1,090	123,720	素材
PPL CORPORATION	328	290	890	101,094	公益事業
PVH CORP	39	33	362	41,140	耐久消費財・アパレル
PACCAR INC	165	141	866	98,293	資本財

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PACKAGING CORP OF AMERICA	46	40	390	44,303	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	44	39	689	78,247	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PARKER HANNIFIN CORPORATION	63	53	901	102,322	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	119	92	192	21,805	エネルギー
PATTERSON COS INC	41	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
PAYCHEX INC	150	134	939	106,598	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	540	468	3,949	448,161	ソフトウェア・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	183	140	229	26,070	銀行
PEPSICO INC	676	586	6,935	786,927	食品・飲料・タバコ
PFIZER INC	2,825	2,423	11,031	1,251,727	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	732	645	5,617	637,381	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	203	184	1,706	193,596	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	51	51	454	51,613	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	80	70	1,056	119,872	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	78	78	170	19,326	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	31	24	237	26,982	耐久消費財・アパレル
PRAXAIR INC	133	—	—	—	素材
T ROWE PRICE GROUP INC	115	100	984	111,741	各種金融
PRICELINE GROUP INC/THE	23	—	—	—	小売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	139	119	591	67,082	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,210	1,041	9,664	1,096,642	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	273	237	1,549	175,836	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	204	171	1,593	180,793	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	246	209	1,144	129,876	公益事業
PULTE GROUP INC	129	129	345	39,217	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	66	48	316	35,968	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	699	579	3,369	382,331	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	64	59	519	58,973	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC	—	189	425	48,333	小売
RALPH LAUREN CORPORATION	26	20	231	26,228	耐久消費財・アパレル
RANGE RESOURCES CORPORATION	129	—	—	—	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	63	54	418	47,512	各種金融
RAYTHEON COMPANY	135	119	2,071	235,092	資本財
RED HAT INC	82	73	1,311	148,805	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	36	33	1,219	138,394	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	568	473	766	87,021	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	29	29	438	49,735	保険
REPUBLIC SERVICES INC	109	97	746	84,702	商業・専門サービス
RESMED INC	65	59	655	74,365	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC	58	46	288	32,730	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	60	50	866	98,272	資本財
ROCKWELL COLLINS INC	75	—	—	—	資本財
ROLLINS INC	43	43	274	31,112	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	47	42	1,259	142,951	資本財
ROSS STORES INC	184	157	1,352	153,431	小売
S&P GLOBAL INC	122	103	1,871	212,358	各種金融
SBA COMMUNICATIONS CORP	58	47	806	91,534	不動産
SEI INVESTMENTS COMPANY	58	58	313	35,572	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	81	90	438	49,760	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	23	23	568	64,518	銀行
SABRE CORP	122	98	256	29,104	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM, INC.	320	292	4,091	464,301	ソフトウェア・サービス
SCANA CORP	64	64	299	33,998	公益事業
HENRY SCHEIN INC	72	60	539	61,194	ヘルスケア機器・サービス
SCHLUMBERGER LTD	652	575	2,641	299,777	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	573	504	2,228	252,836	各種金融
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	44	—	—	—	メディア・娯楽
SEALED AIR CORP	91	58	212	24,123	素材
SEATTLE GENETICS INC	42	42	269	30,609	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SEMPRA ENERGY	112	104	1,175	133,407	公益事業
SERVICENOW INC	79	73	1,314	149,207	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	39	34	1,437	163,133	素材
SIGNATURE BANK	25	25	307	34,887	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	829	682	431	48,945	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	87	79	565	64,158	半導体・半導体製造装置
SMITH(A.O.) CORP	69	59	278	31,591	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	59	49	508	57,677	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	29	24	401	45,555	資本財
SOUTHERN CO	464	420	1,956	221,992	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES	68	55	293	33,292	運輸
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	9	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	—	51	419	47,621	資本財
SPLUNK INC	62	62	634	72,040	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	367	367	232	26,347	電気通信サービス
SQUARE INC-A	—	123	865	98,264	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	70	67	858	97,393	資本財
STARBUCKS CORP	679	573	3,835	435,183	消費者サービス
STATE STREET CORP	182	148	1,072	121,666	各種金融
STEEL DYNAMICS, INC.	121	101	356	40,449	素材
STERICYCLE, INC.	42	42	206	23,413	商業・専門サービス
STRYKER CORP	160	139	2,388	271,038	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	227	193	1,206	136,957	銀行
SYMANTEC CORPORATION	290	272	614	69,759	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	76	61	549	62,358	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	380	306	795	90,305	各種金融
SYSCO CORP	234	201	1,360	154,325	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	127	117	626	71,064	各種金融
TJX COMPANIES INC	306	521	2,474	280,761	小売
T-MOBILE US INC	137	140	966	109,695	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	—	48	538	61,054	ソフトウェア・サービス
TAPESTRY INC	139	119	455	51,699	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	247	210	1,497	169,960	小売
TARGA RESOURCES CORP	103	86	392	44,487	エネルギー
TELEFLEX INC	21	19	529	60,106	ヘルスケア機器・サービス
TESARO INC	17	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	61	54	1,851	210,054	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	415	387	848	96,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	468	406	3,963	449,710	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	120	106	595	67,555	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	183	167	4,155	471,535	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M COMPANY	281	246	5,046	572,625	資本財
TIFFANY & CO	62	46	416	47,294	小売
TIME WARNER INC	363	—	—	—	メディア・娯楽
TOLL BROTHERS INC	70	70	237	26,928	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORPORATION	55	46	402	45,726	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	82	71	626	71,033	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	64	52	499	56,697	小売
TRANSDIGM GROUP INC	23	20	742	84,204	資本財
TRANSUNION	—	75	482	54,748	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC(THE)	129	112	1,466	166,457	保険
TRIMBLE INC	117	103	387	43,948	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC-W/I	58	40	257	29,207	小売
TWENTY-FIRST CE CL-A	506	437	2,169	246,157	メディア・娯楽
TWENTY-FIRST CE CL-B	218	175	866	98,366	メディア・娯楽
TWITTER INC	278	295	924	104,914	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	137	126	728	82,654	食品・飲料・タバコ
UGI CORPORATION	74	74	425	48,293	公益事業
UGI BANCORP	791	648	3,503	397,581	銀行

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ULTA BEAUTY INC	26	23	717	81,424	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	111	86	199	22,670	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	114	82	180	20,461	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	379	322	4,849	550,291	運輸
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	37	28	273	31,068	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	323	286	3,245	368,250	運輸
UNITED RENTALS INC	41	36	426	48,365	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	357	341	4,138	469,540	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	21	18	212	24,075	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	454	398	11,250	1,276,634	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	45	37	518	58,817	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	112	97	355	40,337	保険
VF CORP	162	135	1,080	122,567	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	19	16	466	52,951	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	207	179	1,423	161,475	エネルギー
VANTIV INC-CL A	75	-	-	-	ソフトウェア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	41	41	499	56,655	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	50	50	496	56,383	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	46	43	688	78,144	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,928	1,711	10,174	1,154,447	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	70	62	775	88,029	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	118	105	1,900	215,615	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC-CLASS B	164	146	469	53,310	メディア・娯楽
VISA INC	874	740	10,294	1,168,149	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	-	138	321	36,465	公益事業
VMWARE INC	30	30	493	55,977	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	94	75	336	38,157	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	62	54	586	66,520	素材
WABCO HOLDINGS INC	26	21	253	28,776	資本財
WEC ENERGY GROUP INC	147	131	933	105,876	公益事業
WABTEC CORP	42	34	319	36,294	資本財
WALMART INC	713	613	5,968	677,206	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	429	350	2,972	337,237	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	125	109	857	97,314	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	209	176	1,634	185,494	商業・専門サービス
WATERS CORP	37	34	703	79,868	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WELLS FARGO & COMPANY	2,241	1,923	10,395	1,179,554	銀行
WESTAR ENERGY INC	64	-	-	-	公益事業
WESTERN DIGITAL CORP	136	129	591	67,095	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION COMPANY	214	190	355	40,387	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	-	14	105	12,020	素材
WESTROCK CO	113	113	525	59,588	素材
WHIRLPOOL CORP	33	26	329	37,348	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	399	502	1,284	145,794	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	62	60	874	99,186	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CL A	-	123	1,057	120,005	ソフトウェア・サービス
WYNDHAM DESTINATIONS INC	46	-	-	-	消費者サービス
WYNN RESORTS LTD	40	42	459	52,165	消費者サービス
XPO LOGISTICS INC	-	49	377	42,835	運輸
XCEL ENERGY INC	243	205	1,057	119,965	公益事業
XILINX INC	115	110	1,005	114,050	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	96	96	260	29,576	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XYLEM INC	91	79	567	64,440	資本財
YUM! BRANDS INC	152	134	1,233	139,996	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	91	92	240	27,262	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC-C	53	53	195	22,214	ソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	95	82	943	107,108	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORPORATION	88	88	427	48,544	銀行
ZOETIS INC	237	201	1,865	211,658	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ALKERMES PLC	79	64	229	26,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGION PLC	45	39	362	41,081	資本財
ALLERGAN PLC	157	140	2,187	248,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AON PLC	127	101	1,662	188,699	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	59	178	505	57,395	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	60	262	29,756	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	39	39	219	24,859	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	107	107	265	30,131	素材
ACCENTURE PLC-CL A	291	267	4,312	489,392	ソフトウェア・サービス
BUNGE LIMITED	71	59	345	39,249	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	—	93	455	51,710	食品・飲料・タバコ
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	126	—	—	—	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	211	181	1,381	156,730	資本財
EVEREST RE GROUP LTD	19	16	363	41,212	保険
IHS MARKIT LTD	198	162	858	97,423	商業・専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC	119	103	1,065	120,859	資本財
INVESCO LIMITED	183	183	371	42,113	各種金融
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	29	26	384	43,588	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	445	395	1,355	153,806	資本財
LIBERTY GLOBAL PLC-A	114	84	210	23,842	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	262	235	574	65,205	メディア・娯楽
LINDE PLC	—	225	3,587	407,128	素材
MALLINCKRODT PLC	55	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	212	268	431	49,009	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	648	562	5,435	616,819	ヘルスケア機器・サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	71	62	272	30,958	耐久消費財・アパレル
APTIV PLC	—	105	757	85,942	自動車・自動車部品
NIELSEN HOLDINGS PLC	174	151	410	46,629	商業・専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	91	91	471	53,444	消費者サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	21	15	196	22,318	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	147	113	483	54,841	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PENTAIR PLC-REGISTERED	83	70	297	33,762	資本財
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	—	71	325	36,937	資本財
SIGNET JEWELERS LTD	28	—	—	—	小売
TECHNIPFMC PLC	210	181	430	48,888	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	62	54	865	98,191	保険
PERRIGO CO PLC	62	55	356	40,453	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XL GROUP LTD	115	—	—	—	保険
CHUBB LTD	218	191	2,565	291,144	保険
GARMIN LTD	58	49	325	36,954	耐久消費財・アパレル
TE CONNECTIVITY LTD	167	145	1,101	124,979	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	65	52	577	65,504	ソフトウェア・サービス
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AERCAP HOLDINGS NV	69	48	254	28,850	資本財
CORE LABORATORIES N.V.	18	—	—	—	エネルギー
LYONDELLBASELL INDU-CL A	162	135	1,258	142,851	素材
MYLAN NV	219	225	765	86,910	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	168	142	1,183	134,343	半導体・半導体製造装置
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	81	—	—	—	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	80	67	757	85,981	消費者サービス
BROADCOM LTD	190	—	—	—	半導体・半導体製造装置
FLEX LTD	232	232	198	22,511	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数	株数	983,639	111,613,588	
	銘柄柄数	銘柄柄数	—	<64.1%>	
(カナダ)			千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD	170	170	156	13,344	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	112	96	449	38,433	素材
AGRIUM INC	66	—	—	—	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	199	183	1,282	109,530	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)		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ALTAGAS LTD	69	97		11,663	公益事業	
ATCO LTD-CLASS I	30	30		10,451	公益事業	
AURORA CANNABIS INC	—	285		18,323	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BCE INC	69	69		33,803	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	310	262	2,607	222,733	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	575	492	3,586	306,327	銀行	
BARRICK GOLD CORP	551	502		871	素材	
BAUSCH HEALTH COS INC	—	118		373	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BLACKBERRY LIMITED	237	180		211	ソフトウェア・サービス	
BOMBARDIER INC 'B'	758	758		164	資本財	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	430	343	2,018	172,433	各種金融	
CAE INC	139	139		370	資本財	
CCL INDUSTRIES INC-CL B	69	53		284	素材	
CI FINANCIAL CORP	110	110		219	各種金融	
CAMECO CORP	163	163		259	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	199	191	2,153	183,961	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	361	302	3,410	291,332	運輸	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	531	499	1,672	142,847	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	67	59	1,661	141,905	運輸	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	33	24		366	小売	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	64	39		125	10,690	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	—	83		370	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CENOVUS ENERGY INC	512	414		403	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE	9	8		795	ソフトウェア・サービス	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	225	225		90	エネルギー	
DOLLARAMA INC	48	119		428	36,596	小売
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	196	—		—	各種金融	
EMERA INC	24	24		107	9,218	公益事業
EMPIRE CO LTD A	72	72		183	15,648	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	487	418		386	33,050	エネルギー
ENBRIDGE INC	773	701	3,083	263,380	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	13	11		708	60,490	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	79	61		165	14,145	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	65	65		130	11,149	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	316	316		384	32,843	素材
FORTIS INC	194	179		825	70,541	公益事業
FRANCO-NEVADA CORPORATION	91	80		731	62,497	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	115	90		388	33,222	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	403	333		417	35,625	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	142	142		435	37,165	保険
CGI GROUP INC - CL A	102	101		854	72,991	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	145	145		232	19,902	エネルギー
HYDRO ONE LTD	149	150		295	25,277	公益事業
IGM FINANCIAL INC	30	30		102	8,758	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	129	129		527	45,036	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	48	48		234	20,010	保険
INTACT FINANCIAL CORPORATION	62	62		648	55,401	保険
INTER PIPELINE LTD	180	180		390	33,345	エネルギー
JEAN COUTU GROUP INC A	28	—		—	—	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	84	84		242	20,721	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	570	570		206	17,656	素材
LINAMAR CORP	22	22		105	9,020	自動車・自動車部品
LOBLAW COMPANIES LTD	99	85		523	44,734	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	—	282		160	13,734	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	168	146		962	82,241	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	920	804	1,752	149,691	保険	
METHANEX CORPORATION	43	24		181	15,522	素材
METRO INC	113	91		417	35,683	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	163	147		889	75,995	銀行

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
NUTRIEN LTD	—	262	1,787	152,670	素材
ONEX CORPORATION	42	42	345	29,512	各種金融
OPEN TEXT CORPORATION	116	116	527	45,081	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	243	217	961	82,155	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	88	—	—	—	エネルギー
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	388	—	—	—	素材
POWER CORP OF CANADA	180	145	388	33,187	保険
POWER FINANCIAL CORP	110	110	311	26,604	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	90	90	160	13,680	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	106	91	715	61,114	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	174	145	1,026	87,663	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	685	595	5,824	497,570	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	82	82	403	34,425	資本財
SAPUTO INC	111	98	402	34,384	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	144	85	86	7,428	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	193	193	483	41,317	メディア・娯楽
SHOPIFY INC-CLASS A	41	38	756	64,630	ソフトウェア・サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	288	258	1,254	107,161	保険
SUNCOR ENERGY INC	780	678	2,956	252,568	エネルギー
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	267	198	529	45,255	素材
TELUS CORPORATION	96	76	361	30,920	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	144	—	—	—	各種金融
THOMSON REUTERS CORP-NEW	—	78	524	44,793	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	866	761	5,596	478,087	銀行
TOURMALINE OIL CORP	128	128	235	20,144	エネルギー
TRANSCANADA CORP	423	363	1,977	168,940	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	451	451	109	9,324	素材
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	145	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERMILION ENERGY INC	55	55	188	16,084	エネルギー
WSP GLOBAL INC	—	45	291	24,921	資本財
WEST FRASER TIMBER CO LTD	28	28	201	17,200	素材
WESTON (GEORGE) LTD	26	31	302	25,851	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	195	195	408	34,918	素材
YAMANA GOLD INC	513	—	—	—	素材
小 計	株 数 銘柄 数	19,373 90	71,004 89	6,065,227 —	< 3.5% >
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	87	76	1,519	196,312	耐久消費財・アパレル
FRESENIUS SE & CO KGAA	200	168	866	111,968	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	59	59	241	31,177	ソフトウェア・サービス
FUCHS PETROLUB SE-PREF	33	33	125	16,230	素材
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	30	23	293	37,883	保険
GEA GROUP AG	81	81	196	25,419	資本財
CONTINENTAL AG	53	46	618	79,893	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	471	413	1,181	152,693	運輸
AXEL SPRINGER SE	16	16	95	12,339	メディア・娯楽
MERCK KGAA	61	57	554	71,668	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	251	228	435	56,240	公益事業
SAP SE	462	405	3,696	477,570	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	1,033	883	793	102,511	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	46	46	427	55,212	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	—	2	126	16,281	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	388	384	2,449	316,455	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA	87	71	729	94,303	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	433	380	2,467	318,730	素材
BEIERSDORF AG	46	40	384	49,656	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	8	8	104	13,439	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	75	65	390	50,499	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	104	91	664	85,896	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	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	
ALLIANZ SE-REG	214	181	3,433	443,590	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	122	92	199	25,744	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	71	60	1,166	150,716	保険
VOLKSWAGEN AG	16	12	182	23,641	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	86	75	1,130	146,036	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	453	372	1,889	244,102	自動車・自動車部品
MAN SE	14	—	—	—	資本財
THYSSENKRUPP AG	193	193	324	41,858	素材
SIEMENS AG-REG	361	315	3,225	416,731	資本財
1&1 DRILLISCH AG	—	21	98	12,725	電気通信サービス
LINDE AG	86	—	—	—	素材
DEUTSCHE BANK AG -REG	980	789	654	84,606	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	160	140	1,023	132,287	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE (BMW) AG-PFD	25	25	161	20,801	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,531	1,366	2,102	271,655	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	—	13	151	19,567	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	536	484	888	114,735	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG	90	82	914	118,188	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	75	66	375	48,504	自動車・自動車部品
FRAPORT AG	18	18	124	16,132	運輸
WIRECARD AG	—	48	658	85,014	ソフトウェア・サービス
LANXESS	41	31	155	20,093	素材
MTU AERO ENGINES AG	—	20	353	45,699	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	177	142	603	77,982	不動産
SYMRISE AG	60	49	354	45,790	素材
BRENNTAG AG	81	66	271	35,112	資本財
K+S AG	96	96	153	19,797	素材
EVONIK INDUSTRIES AG	87	64	155	20,095	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	403	403	144	18,661	電気通信サービス
HUGO BOSS AG	31	22	137	17,736	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	527	466	368	47,562	銀行
OSRAM LICHT AG	45	45	189	24,455	資本財
KION GROUP AG	31	31	162	20,978	資本財
VONOVIA SE	219	200	867	112,008	不動産
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	108	108	197	25,471	メディア・娯楽
SIEMENS HEALTHINEERS AG	—	65	255	33,002	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG	83	83	114	14,811	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE	58	58	234	30,235	公益事業
ZALANDO SE	53	53	154	19,904	小売
COVESTRO AG	52	80	413	53,412	素材
SCHAEFFLER AG	95	95	72	9,350	自動車・自動車部品
UNIPER SE	—	89	206	26,729	公益事業
DELIVERY HERO SE	—	34	113	14,726	ソフトウェア・サービス
小計	11,332	10,261	42,748	5,522,646	
株数	57	63	—	<3.2%>	
金額					
比率					
(ユーロ・イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	583	469	692	89,465	保険
INTESA SANPAOLO	6,282	6,179	1,255	162,256	銀行
INTESA SANPAOLO-RSP	505	—	—	—	銀行
MEDIOBANCA SPA	267	267	209	27,015	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	82	72	373	48,283	耐久消費財・アパレル
ENEL SPA	3,850	3,320	1,579	204,090	公益事業
ENI SPA	1,186	1,057	1,502	194,145	エネルギー
SNAM SPA	1,112	999	383	49,507	エネルギー
TELECOM ITALIA SPA	5,475	4,940	278	36,037	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	3,110	2,513	121	15,734	電気通信サービス
ATLANTIA SPA	204	198	364	47,129	運輸
TERNA SPA	663	663	324	41,885	公益事業
RECORDATI SPA	45	45	127	16,512	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
LEONARDO SPA	183	183	158	20,480	資本財
PRYSMIAN SPA	93	93	149	19,374	資本財
UNIPOLSAI SPA	499	—	—	—	保険
SAIPEM SPA	292	—	—	—	エネルギー
MONCLER SPA	—	77	227	29,397	耐久消費財・アパレル
UNICREDIT SPA	952	812	935	120,845	銀行
POSTE ITALIANE SPA	265	265	178	23,011	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	—	229	167	21,695	食品・飲料・タバコ
PIRELLI & C SPA	—	174	109	14,103	自動車・自動車部品
小計	25,658	22,565	9,141	1,180,973	
株数・金額 銘柄数<比率>	19	19	—	<0.7%>	
(ユーロ・・・フランス)					
BOUYGUES SA	102	83	291	37,654	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	238	215	404	52,262	公益事業
L'OREAL	120	103	2,160	279,058	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	131	114	2,939	379,719	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA	1	0.89	120	15,522	資本財
THALES SA	54	45	485	62,765	資本財
CAPGEMINI SA	73	65	678	87,668	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	27	18	74	9,590	食品・生活必需品小売り
INGENICO S.A.	26	26	173	22,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PUBLICIS GROUPE	91	91	480	62,064	メディア・娯楽
FAURECIA	—	31	114	14,834	自動車・自動車部品
LAGARDERE S. C. A.	61	—	—	—	メディア・娯楽
BOLLORE	394	394	156	20,204	運輸
MICHELIN (CGDE)-B	83	68	627	81,006	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD SA	98	86	1,213	156,803	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	82	76	474	61,331	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	12	12	129	16,774	食品・飲料・タバコ
SEB SA	10	10	133	17,225	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE	268	233	1,503	194,178	資本財
VIVENDI SA	485	454	1,012	130,828	メディア・娯楽
ORANGE S. A.	950	829	1,245	160,865	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	14	13	636	82,223	耐久消費財・アパレル
BIC	13	13	126	16,322	商業・専門サービス
DASSAULT SYSTEMES SA	61	55	593	76,714	ソフトウェア・サービス
KERING	37	30	1,196	154,615	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	89	89	181	23,452	保険
CARREFOUR SA	263	263	432	55,815	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	45	36	276	35,694	ソフトウェア・サービス
SANOFI	536	464	3,664	473,472	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA	93	75	301	38,893	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	365	311	1,022	132,099	銀行
TELEPERFORMANCE	—	24	360	46,561	商業・専門サービス
EURAZEO	20	21	142	18,417	各種金融
SODEXO	45	39	355	45,960	消費者サービス
AXA SA	907	794	1,711	221,127	保険
PSA PEUGEOT CITROEN	233	261	508	65,702	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA	28	28	84	10,938	メディア・娯楽
ESSILORLUXOTTICA	97	88	982	126,960	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT AGRICOLE SA	552	495	547	70,787	銀行
ZODIAC AEROSPACE	103	—	—	—	資本財
BNP PARIBAS	527	461	2,067	267,104	銀行
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	244	212	699	90,333	資本財
WENDEL	15	10	116	15,096	各種金融
ILIAD SA	12	10	126	16,354	電気通信サービス
IMERYS SA	13	13	67	8,700	素材
SAFRAN SA	144	136	1,519	196,263	資本財
ENGIE	877	736	920	118,859	公益事業

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	
		株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
ALSTOM RCPT	64	64	252	32,566	資本財	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	87	87	158	20,438	メディア・娯楽	
ELECTRICITE DE FRANCE (EDF)	238	238	351	45,375	公益事業	
IPSEN	18	14	170	22,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARKEMA	32	32	275	35,537	素材	
LEGRAND SA	126	106	575	74,289	資本財	
EIFPAGE SA	35	35	305	39,423	資本財	
TOTAL SA	1,110	989	4,792	619,125	エネルギー	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	13	13	233	30,117	運輸	
NATIXIS	453	453	224	28,979	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	—	35	248	32,150	ソフトウェア・サービス	
SCOR SE	83	71	301	38,983	保険	
REXEL SA	128	128	136	17,610	資本財	
VINCI S. A.	235	209	1,625	210,012	資本財	
DANONE	281	251	1,649	213,083	食品・飲料・タバコ	
AIR LIQUIDE SA	206	175	1,829	236,393	素材	
BUREAU VERITAS SA	126	126	245	31,734	商業・専門サービス	
GETLINK	234	169	194	25,143	運輸	
SUEZ	177	177	232	30,089	公益事業	
EDENRED	94	94	317	41,015	商業・専門サービス	
VALEO SA	111	99	254	32,859	自動車・自動車部品	
BIOMERIEUX	—	17	115	14,938	ヘルスケア機器・サービス	
AMUNDI SA	—	23	121	15,656	各種金融	
小計	株数	金額	株数	金額	比率	
	12,520	11,269	47,672	6,158,828	<3.5%>	
(ユーロ・・・オランダ)	65	68	—	—		
AIRBUS SE	278	239	2,270	293,298	資本財	
RELX NV	461	—	—	—	商業・専門サービス	
RANDSTAD NV	57	46	199	25,742	商業・専門サービス	
AKZO NOBEL	115	108	801	103,541	素材	
WOLTERS KLUWER-CVA	137	128	690	89,188	商業・専門サービス	
VOPAK	31	31	121	15,693	エネルギー	
AEGON NV	872	745	370	47,885	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	1,625	1,415	359	46,394	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	298	280	363	46,987	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	448	390	1,286	166,184	ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	125	104	835	107,923	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	52	52	405	52,437	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	87	73	569	73,570	素材	
UNILEVER NV-CVA	765	635	3,112	402,086	家庭用品・パーソナル用品	
BOSKALIS WESTMINSTER NV	37	—	—	—	資本財	
ASML HOLDING NV	174	168	2,551	329,598	半導体・半導体製造装置	
GEMALTO	38	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	624	504	1,135	146,714	食品・生活必需品小売り	
FERRARI NV	57	48	464	60,039	自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	513	431	364	47,127	資本財	
NN GROUP NV	163	129	493	63,694	保険	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	502	431	635	82,059	自動車・自動車部品	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	189	189	431	55,766	銀行	
EXOR NV	55	46	242	31,375	各種金融	
ALTICE NV -B W/I	46	—	—	—	メディア・娯楽	
ALTICE NV -A W/I	226	—	—	—	メディア・娯楽	
QIAGEN N. V.	100	100	312	40,325	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ING GROEP NV-CVA	1,820	1,592	1,720	222,299	銀行	
小計	株数	金額	株数	金額	比率	
	9,909	7,897	19,737	2,549,933	<1.5%>	
(ユーロ・・・スペイン)	28	23	—	—		
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	313	—	—	—	運輸	
ENDESA S. A.	150	129	254	32,851	公益事業	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
BANKINTER, S. A.	340	269	199	25,831	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,123	2,770	1,382	178,619	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	161	161	350	45,310	公益事業
REPSOL SA	589	565	856	110,692	エネルギー
BANCO SANTANDER SA	7,758	6,728	2,835	366,260	銀行
TELEFONICA S. A.	2,136	1,912	1,492	192,791	電気通信サービス
ENAGAS	104	104	252	32,560	エネルギー
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	124	114	145	18,764	資本財
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	111	115	391	50,522	資本財
FERROVIAL SA	254	187	338	43,749	資本財
MAPPRE SA	463	463	117	15,119	保険
BANCO DE SABADELL SA	2,683	2,350	264	34,128	銀行
CAIXABANK	1,665	1,491	539	69,744	銀行
IBERDROLA SA	2,729	2,448	1,616	208,850	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA	207	182	1,167	150,817	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROU	301	232	163	21,185	運輸
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	296	—	—	—	食品・生活必需品小売り
FERROVIAL SA-RIGHTS	—	187	7	1,001	資本財
RED ELECTRICA CORPORATION SA	211	183	348	45,018	公益事業
INDITEX	508	450	1,230	158,919	小売
AENA SME SA	31	28	409	52,870	運輸
GRIFOLS S.A.	139	119	312	40,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANKIA SA	483	483	140	18,187	銀行
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	評価額 <比率>	評価額 <比率>	
	24,892 24	21,683 23	14,816 —	1,914,150 <1.1%>	
(ユーロ・・・ベルギー)					
KBC GROUPE SA	121	108	693	89,575	銀行
SOLVAY SA	36	28	273	35,271	素材
UCB SA	56	52	384	49,685	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT NV	32	31	175	22,675	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	35	33	270	34,907	各種金融
PROXIMUS SA	63	63	152	19,671	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDINGS NV	27	21	94	12,149	メディア・娯楽
AGEAS	89	72	313	40,462	保険
UMICORE	88	87	331	42,812	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	360	313	2,109	272,478	食品・飲料・タバコ
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	評価額 <比率>	評価額 <比率>	
	911 10	812 10	4,796 —	619,690 <0.4%>	
(ユーロ・・・オーストリア)					
OMV AG	74	63	284	36,812	エネルギー
VOESTALPINE AG	50	50	148	19,159	素材
ERSTE GROUP BANK AG	140	120	420	54,303	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	79	66	175	22,677	銀行
ANDRITZ AG	37	25	106	13,751	資本財
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	評価額 <比率>	評価額 <比率>	
	381 5	326 5	1,135 —	146,704 <0.1%>	
(ユーロ・・・ルクセンブルク)					
EUROFINS SCIENTIFIC	4	4	191	24,748	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS S. A.	233	184	200	25,851	エネルギー
SES	176	138	254	32,815	メディア・娯楽
RTL GROUP	16	16	86	11,204	メディア・娯楽
ARCELORMITTAL	302	265	532	68,770	素材
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	評価額 <比率>	評価額 <比率>	
	733 5	609 5	1,264 —	163,389 <0.1%>	
(ユーロ・・・フィンランド)					
WARTSILA OYJ-B SHARES	71	189	277	35,910	資本財
UPM-KYMMENE OYJ	250	213	509	65,785	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	258	247	275	35,640	素材
SAMPO OYJ-A SHS	209	177	705	91,093	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
FORTUM OYJ	217	170	312	40,414	公益事業
ELISA OYJ	59	59	204	26,451	電気通信サービス
METSO OYJ	55	39	100	12,968	資本財
NOKIA OYJ	2,765	2,340	1,132	146,262	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	64	56	392	50,655	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	55	55	156	20,226	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	157	146	650	83,987	資本財
ORION OYJ	54	42	125	16,253	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	4,218	3,737	4,842	625,649	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ・・・アイルランド)					
CRH PLC	399	349	865	111,814	素材
KERRY GROUP PLC-A	76	68	624	80,633	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	—	101	242	31,376	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC	433	376	219	28,323	銀行
AIB GROUP PLC	—	369	141	18,247	銀行
PADDY POWER BETFAIR PLC	38	34	274	35,472	消費者サービス
RYANAIR HOLDINGS PLC	16	16	18	2,417	運輸
小 計	964	1,316	2,386	308,286	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	5	7	—	<0.2%>	
(ユーロ・・・ポルトガル)					
BANCO ESPIRITO SANTO, S. A (BES)	1,879	1,879	1	242	銀行
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,137	979	300	38,867	公益事業
GALP ENERGIA SGPS S. A	234	209	302	39,033	エネルギー
JERONIMO MARTINS SGPS S. A.	122	122	129	16,786	食品・生活必需品小売り
小 計	3,373	3,190	734	94,930	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	4	4	—	<0.1%>	
(ユーロ・・・その他)					
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	94	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小 計	94	—	—	—	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	1	—	—	<—%>	
ユーロ計	94,990	83,670	149,277	19,285,186	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	235	239	—	<11.1%>	
(イギリス)					
ANTOFAGASTA PLC	194	194	162	23,576	素材
ASHTED GROUP PLC	231	192	345	50,031	資本財
BHP BILLITON PLC	985	—	—	—	素材
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	491	397	187	27,237	耐久消費財・アパレル
SKY PLC	461	—	—	—	メディア・娯楽
AVIVA PLC	1,958	1,608	661	95,981	保険
DIAGEO PLC	1,181	1,022	2,892	419,496	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	62	62	160	23,334	各種金融
DCC PLC	44	37	221	32,118	資本財
BAE SYSTEMS PLC	1,556	1,285	630	91,409	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,083	946	2,631	381,532	食品・飲料・タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	1,523	1,224	753	109,290	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	465	389	940	136,452	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	9,457	8,294	5,550	804,908	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,781	2,492	616	89,415	保険
MEGGITT PLC	369	369	191	27,698	資本財
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	1,008	1,008	245	35,595	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	167	167	410	59,510	食品・飲料・タバコ
PEARSON PLC	386	296	285	41,361	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	139	139	273	39,662	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	1,210	1,062	1,644	238,505	保険
RIO TINTO PLC	584	487	1,764	255,798	素材
ST JAMES'S PLACE PLC	261	218	225	32,716	各種金融
TRAVIS PERKINS PLC	124	92	101	14,762	資本財
SSE PLC	471	445	489	71,013	公益事業

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
BP PLC	9,316	8,272	4,318	626,292	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	34,307	29,961	1,682	243,910	銀行
TATE & LYLE PLC	245	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	1,579	1,296	179	26,055	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	3,735	4,269	853	123,836	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	396	354	504	73,141	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,309	2,045	3,267	473,844	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	92	92	135	19,597	資本財
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	114	114	66	9,646	商業・専門サービス
ASTRAZENECA PLC	606	522	3,214	466,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GKN PLC	768	—	—	—	自動車・自動車部品
BT GROUP PLC	3,910	3,652	956	138,750	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	94	80	374	54,299	消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	713	713	215	31,318	小売
BARCLAYS PLC	7,924	6,968	1,165	169,003	銀行
INTERTEK GROUP PLC	78	67	326	47,328	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	204	174	319	46,321	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	69	54	273	39,666	小売
KINGFISHER PLC	1,003	799	205	29,870	小売
ITV PLC	1,870	1,510	227	32,946	メディア・娯楽
SAINSBURY (J) PLC	892	641	200	29,072	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	45	38	251	36,449	素材
G4S PLC	742	742	145	21,163	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	107	78	165	23,948	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	63	53	176	25,580	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	2,632	2,549	347	50,328	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,119	1,901	4,509	653,895	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,765	1,547	3,736	541,771	エネルギー
BUNZL PLC	162	134	329	47,755	資本財
COBHAM PLC	1,080	—	—	—	資本財
INMARSAT PLC	208	—	—	—	電気通信サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	74	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	158	129	529	76,833	各種金融
UNILEVER PLC	600	501	2,134	309,515	家庭用品・パーソナル用品
TUI AG-DI	210	176	210	30,586	消費者サービス
INVESTEC PLC	330	330	161	23,420	各種金融
EXPERIAN PLC	457	381	723	104,958	商業・専門サービス
MONDI PLC	171	140	243	35,245	素材
SEVERN TRENT PLC	120	98	185	26,859	公益事業
WHITBREAD PLC	93	77	362	52,579	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	110	110	214	31,132	各種金融
SMITHS GROUP PLC	187	187	265	38,524	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	625	447	720	104,468	素材
3I GROUP PLC	443	377	323	46,980	各種金融
PROVIDENT FINANCIAL PLC	70	—	—	—	各種金融
CAPITA PLC	308	—	—	—	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	319	274	1,818	263,676	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	495	806	1,334	193,481	商業・専門サービス
SHIRE PLC	429	386	1,740	252,319	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FRESNILLO PLC	117	85	66	9,593	素材
UNITED UTILITIES GROUP PLC	331	250	194	28,263	公益事業
GLENCORE PLC	5,842	4,722	1,384	200,836	素材
DIXONS CARPHONE PLC	498	—	—	—	小売
WOOD GROUP (JOHN) PLC	326	326	211	30,623	エネルギー
GVC HOLDINGS PLC	—	238	179	25,981	消費者サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	786	716	607	88,100	資本財
OLD MUTUAL PLC	2,252	—	—	—	保険
NMC HEALTH PLC	—	37	132	19,173	ヘルスケア機器・サービス
EASYJET PLC	76	76	87	12,651	運輸

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,715	2,091	463	67,149	銀行
SAGE GROUP PLC/THE	551	409	248	36,023	ソフトウェア・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	198	198	72	10,508	ヘルスケア機器・サービス
WPP PLC	627	545	473	68,687	メディア・娯楽
COCA-COLA HBC AG-CDI	87	87	207	30,039	食品・飲料・タバコ
CONVATEC GROUP PLC	612	612	93	13,609	ヘルスケア機器・サービス
COMPASS GROUP PLC	738	652	1,089	158,005	消費者サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	86	76	328	47,604	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	203	182	286	41,548	ソフトウェア・サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	36,165	—	—	—	資本財
NATIONAL GRID PLC	1,598	1,366	1,139	165,239	公益事業
ROYAL MAIL PLC	360	360	116	16,928	運輸
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	325	325	112	16,287	消費者サービス
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	—	1,024	277	40,203	各種金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	—	32,972	3	478	資本財
FERGUSON PLC	124	—	—	—	資本財
FERGUSON PLC	—	99	502	72,856	資本財
IMI PLC	120	—	—	—	資本財
BHP GROUP PLC	—	899	1,377	199,804	素材
VODAFONE GROUP PLC	12,751	10,933	1,834	265,975	電気通信サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	500	405	218	31,708	保険
INFORMA PLC	—	546	387	56,226	メディア・娯楽
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,288	—	—	—	各種金融
AUTO TRADER GROUP PLC	420	420	183	26,667	ソフトウェア・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	632	632	206	30,001	保険
WORLDPAY GROUP PLC	905	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	62	62	306	44,488	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	2,125	391	56,843	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	94	72	219	31,826	素材
小計	株数 181,979	株数 159,056	評価額 73,911	評価額 10,717,912	
	銘柄数 97	銘柄数 97	比率 —	比率 < 6.2% >	
(スイス)			千スイスフラン		
SIKA AG	0.99	—	—	—	素材
SGS SA	2	2	521	59,342	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	187	21,391	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM AG-REG	12	10	479	54,646	電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG	0.45	0.45	308	35,109	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	0.05	0.04	321	36,584	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	4	3	919	104,712	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	70	64	2,025	230,673	保険
NOVARTIS AG-REG SHS	1,050	900	8,137	926,846	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	949	751	1,526	173,870	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	331	290	7,388	841,587	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	82	70	347	39,589	商業・専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD	209	206	936	106,667	素材
CLARIANT AG-REG	—	101	206	23,470	素材
NESTLE SA-REGISTERED	1,469	1,290	10,992	1,252,036	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG	23	19	295	33,698	保険
TEMENOS GROUP AG-REG	—	24	305	34,783	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG	26	26	426	48,617	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4	4	265	30,198	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,128	1,039	1,239	141,228	各種金融
THE SWATCH GROUP AG-B	15	13	400	45,582	耐久消費財・アパレル
THE SWATCH GROUP AG-REG	25	25	149	16,979	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	37	31	1,008	114,851	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG	14	14	576	65,706	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	4	3	173	19,816	素材
SWISS PRIME SITE-REG	35	32	267	30,428	不動産
PARGESA HOLDING SA-BR	18	18	130	14,896	各種金融

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
DUFRY AG-REG	16	11	128	14,609	小売
PARTNERS GROUP HOLDING AG	8	6	453	51,700	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	19	17	349	39,833	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	10	7	139	15,890	資本財
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	23	23	335	38,229	運輸
GEBERIT AG-REG	17	15	624	71,107	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD	108	95	392	44,656	各種金融
SWISS RE AG	157	132	1,216	138,517	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	243	212	1,397	159,164	耐久消費財・アパレル
SIKA AG	—	52	655	74,707	素材
UBS GROUP AG	1,748	1,584	2,161	246,245	各種金融
VIFOR PHARMA AG	22	17	225	25,681	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株 数 : 7,896	株 数 : 7,124	47,617	5,423,660	
	株 銘 柄 数 < 金 額 > 36	株 銘 柄 数 < 金 額 > 38	—	< 3.1% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS	15	31	857	10,726	各種金融
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	708	647	6,149	76,926	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	418	390	8,223	102,877	銀行
SWEDISH MATCH AB	90	75	2,702	33,807	食品・飲料・タバコ
NORDEA BANK AB	1,442	—	—	—	銀行
SECURITAS AB-B SHS	164	122	1,862	23,293	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	222	198	7,830	97,961	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	440	362	6,146	76,889	小売
ERICSSON LM-B SHS	1,497	1,265	9,603	120,142	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELI A CO AB	1,232	1,269	5,338	66,788	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	157	157	2,271	28,410	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	88	68	1,633	20,432	エネルギー
ALFA LAVAL AB	149	120	2,334	29,207	資本財
GETINGE AB-B SHS	99	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	33	26	1,429	17,878	電気通信サービス
ICA GRUPPEN AB	35	35	1,177	14,730	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	185	185	1,344	16,816	耐久消費財・アパレル
ELECTROLUX AB-SER B	117	110	2,276	28,480	耐久消費財・アパレル
SKF AB-B SHARES	166	166	2,369	29,646	資本財
VOLVO AB-B SHS	741	645	8,192	102,483	資本財
SANDVIK AB	548	450	6,064	75,866	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	92	62	1,160	14,517	各種金融
BOLIDEN AB	129	—	—	—	素材
HEXAGON AB-B SHS	118	110	5,083	63,591	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS	182	131	1,506	18,847	電気通信サービス
KINNEVIK AB-B SHS	112	112	2,671	33,417	各種金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	—	267	5,858	73,295	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	—	161	3,263	40,823	資本財
BOLIDEN AB	—	102	2,074	25,955	素材
EPIROC AB-A	—	302	2,277	28,490	資本財
EPIROC AB-B	—	161	1,167	14,604	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	282	239	5,581	69,824	家庭用品・パーソナル用品
ATLAS COPCO AB-A SHS	310	—	—	—	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	191	—	—	—	資本財
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	699	608	6,116	76,511	銀行
ASSA ABLOY AB-B	466	434	7,324	91,629	資本財
NORDEA BANK ABP	—	1,231	10,056	125,811	銀行
小 計	株 数 : 11,140	株 数 : 10,255	131,949	1,650,689	
	株 銘 柄 数 < 金 額 > 31	株 銘 柄 数 < 金 額 > 32	—	< 0.9% >	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	467	406	6,044	80,274	銀行
TELENOR ASA	355	311	5,169	68,646	電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	36	—	—	—	メディア・娯楽
EQUINOR ASA	541	498	9,959	132,261	エネルギー

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
YARA INTERNATIONAL ASA	87	74	2,607	34,623	素材
MARINE HARVEST ASA	189	169	3,367	44,722	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA	604	604	2,474	32,864	素材
AKER BP ASA	—	36	902	11,979	エネルギー
ORKLA ASA	392	339	2,409	32,004	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	100	69	959	12,739	保険
SCIBSTED ASA-B SHS	37	37	1,053	13,995	メディア・娯楽
小計	株数 銘柄数	2,812 10	2,548 10	34,948 —	464,113 < 0.3% >
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B	52	46	3,355	58,092	食品・飲料・タバコ
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	2	2	2,861	49,532	運輸
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	1	1	1,516	26,245	運輸
DANSKE BANK A/S	353	297	3,922	67,899	銀行
GENMAB A/S	27	27	2,786	48,240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TDC A/S	371	—	—	—	電気通信サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	100	76	3,715	64,314	資本財
H LUNDBECK A/S	36	28	768	13,309	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DSV A/S	92	75	3,868	66,956	運輸
PANDORA A/S	52	47	1,706	29,540	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	49	40	2,446	42,356	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES	102	85	2,658	46,011	素材
COLOPLAST-B	62	49	3,212	55,603	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B	878	751	22,487	389,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S	83	64	1,388	24,040	商業・専門サービス
TRYG A/S	50	50	812	14,061	保険
ORSTED A/S	85	77	3,358	58,142	公益事業
WILLIAM DEMANT HOLDING	44	44	880	15,245	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数 銘柄数	2,447 18	1,769 17	61,747 —	1,068,853 < 0.6% >
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	72	61	343	28,503	ヘルスケア機器・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,389	1,202	3,265	271,283	銀行
AMCOR LIMITED	558	503	675	56,146	素材
WESTPAC BANKING CORPORATION	1,579	1,406	3,716	308,738	銀行
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	178	178	180	15,008	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	728	728	293	24,394	素材
TELSTRA CORPORATION LIMITED	1,846	1,697	502	41,739	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	198	198	214	17,835	銀行
COCA-COLA AMATIL LIMITED	268	168	169	14,103	食品・飲料・タバコ
ASX LTD	92	92	571	47,466	各種金融
BHP BILLITON LTD	1,511	1,334	4,134	343,499	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	125	99	274	22,811	エネルギー
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	337	205	64	5,324	小売
COMPUTERSHARE LIMITED	230	194	359	29,825	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	213	185	3,359	279,072	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	27	17	135	11,223	ソフトウェア・サービス
COCHLEAR LIMITED	29	21	374	31,149	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	831	745	491	40,836	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	813	724	5,250	436,225	銀行
BORAL LIMITED	556	422	222	18,447	素材
RIO TINTO LIMITED	194	165	1,215	100,996	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	238	260	663	55,096	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,126	1,010	750	62,346	保険
TPG TELECOM LTD	177	177	134	11,183	電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	26	26	127	10,629	消費者サービス
ORICA LIMITED	179	179	318	26,471	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	292	230	257	21,407	素材
SUNCORP GROUP LTD	592	523	709	58,958	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,279	1,114	2,777	230,737	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	366	313	652	54,184	素材
OIL SEARCH LTD	608	608	445	37,016	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD	854	613	233	19,420	素材
AMP LIMITED	1,297	1,297	316	26,304	各種金融
QANTAS AIRWAYS LIMITED	246	—	—	—	運輸
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	686	582	668	55,534	保険
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	300	230	226	18,820	各種金融
SANTOS LTD	918	715	403	33,516	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	178	178	415	34,498	ヘルスケア機器・サービス
TABCORP HOLDINGS LIMITED	337	743	331	27,558	消費者サービス
WESFARMERS LIMITED	526	464	1,462	121,486	食品・生活必需品小売り
ALUMINA LTD	1,069	1,069	247	20,530	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	354	381	1,190	98,881	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	615	556	1,658	137,824	食品・生活必需品小売り
SEEK LIMITED	165	125	234	19,488	商業・専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	33	21	99	8,253	消費者サービス
TATTS GROUP LTD	680	—	—	—	消費者サービス
BRAMBLES LIMITED	724	724	759	63,108	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	158	130	1,527	126,887	各種金融
CROWN RESORTS LTD	165	165	194	16,196	消費者サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	219	186	307	25,544	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	355	319	474	39,459	食品・飲料・タバコ
AURIZON HOLDINGS LTD	1,004	868	369	30,677	運輸
HEALTHSCOPE LTD	760	760	167	13,893	ヘルスケア機器・サービス
AUSNET SERVICES	852	852	135	11,221	公益事業
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287	1,287	319	26,522	保険
AGL ENERGY LIMITED	313	250	467	38,828	公益事業
SOUTH32 LTD	2,517	2,234	701	58,297	素材
CIMIC GROUP LTD	40	40	174	14,491	資本財
COLES GROUP LIMITED	—	464	574	47,769	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 33,338	株 数 30,067	外貨建金額 46,312	邦貨換算金額 3,847,682	
	銘柄数 58	銘柄数 57		< 2.2% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
CONTACT ENERGY LIMITED	353	—	—	—	公益事業
RYMAN HEALTHCARE LIMITED	135	198	228	17,826	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	—	319	348	27,140	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	—	219	290	22,643	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	334	310	148	11,574	素材
SPARK NEW ZEALAND LIMITED	994	798	332	25,915	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	212	—	—	—	公益事業
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	469	342	241	18,802	運輸
MERIDIAN ENERGY LTD	708	633	205	16,031	公益事業
小 計	株 数 3,209	株 数 2,822	外貨建金額 1,797	邦貨換算金額 139,934	
	銘柄数 7	銘柄数 7		< 0.1% >	
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	123	123	984	14,277	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	980	980	1,526	22,154	不動産
BANK OF EAST ASIA	528	528	1,391	20,195	銀行
CLP HOLDINGS LTD	746	661	5,806	84,257	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	539	478	10,907	158,274	各種金融
LI & FUNG LTD	2,372	2,372	389	5,644	耐久消費財・アパレル
MTR CORPORATION	725	670	2,690	39,032	運輸
FIRST PACIFIC COMPANY	860	—	—	—	各種金融
HANG LUNG GROUP LTD	420	420	896	13,011	不動産
HANG SENG BANK LTD	378	331	5,961	86,498	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	560	486	1,949	28,290	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	700	600	3,207	46,533	公益事業
WHARF HOLDINGS LTD	590	590	1,256	18,234	不動産

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
HONG KONG & CHINA GAS	3,960	3,872	6,041	87,664	公益事業
HYSAN DEVELOPMENT CO	290	290	1,154	16,747	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	1,060	930	4,510	65,447	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	275	275	743	10,793	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,865	1,570	4,757	69,025	銀行
NWS HOLDINGS LTD	695	695	1,174	17,042	資本財
PCCW LIMITED	1,940	1,940	878	12,751	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	270	270	642	9,324	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,613	2,613	2,806	40,725	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD.	640	640	714	10,363	消費者サービス
SINO LAND CO	1,602	1,242	1,676	24,328	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	710	640	7,251	105,214	不動産
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	255	180	1,554	22,552	不動産
WHEELLOCK&COMPANY LTD	410	330	1,488	21,595	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	655	560	2,385	34,615	耐久消費財・アパレル
MINTH GROUP LTD	—	320	872	12,652	自動車・自動車部品
SJM HOLDINGS LIMITED	800	800	563	8,172	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	780	708	1,261	18,306	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	440	440	581	8,440	消費者サービス
ATA GROUP LTD	5,672	4,980	32,071	465,353	保険
SANDS CHINA LTD	1,196	936	3,187	46,244	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LIMITED	530	530	1,462	21,225	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	590	480	2,301	33,396	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	1,110	1,110	842	12,224	公益事業
WH GROUP LIMITED	3,955	3,975	2,313	33,568	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,259	1,094	8,918	129,400	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	300	300	1,770	25,682	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,279	1,074	6,015	87,288	不動産
小計	44,674	41,035	136,909	1,986,554	
	株数	株数	金額	金額	
	銘柄数	銘柄数	<比率>	<比率>	
	40	40	—	<1.1%>	
(シンガポール)			シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	683	683	236	19,588	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	3,536	3,536	81	6,741	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP HOLDINGS LTD	865	769	1,859	154,129	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	210	161	140	11,610	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	47	47	165	13,748	小売
SATS LTD	268	268	125	10,396	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	356	356	259	21,482	各種金融
CAPITALAND LTD	1,243	1,045	330	27,371	不動産
GENTING SINGAPORE LTD	2,807	—	—	—	消費者サービス
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,070	711	148	12,317	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD	250	250	241	20,050	運輸
UNITED OVERSEAS BANK LTD	637	546	1,371	113,642	銀行
UOL GROUP LIMITED	217	217	135	11,205	不動産
VENTURE CORP LTD	—	119	182	15,111	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	895	563	149	12,424	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,947	3,349	1,031	85,504	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	437	437	115	9,603	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,477	1,268	1,425	118,137	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	699	699	215	17,903	食品・飲料・タバコ
STARHUB LIMITED	219	—	—	—	電気通信サービス
KEPPEL CORP LTD	703	586	360	29,872	資本財
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	900	900	113	9,399	資本財
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	1,286	—	—	—	不動産
GENTING SINGAPORE LTD	—	2,807	272	22,569	消費者サービス
小計	22,753	19,318	8,961	742,810	
	株数	株数	金額	金額	
	銘柄数	銘柄数	<比率>	<比率>	
	22	21	—	<0.4%>	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
BANK HAPOALIM BM	534	440	1,123	34,381	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	655	655	1,601	49,000	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	1,001	1,001	428	13,112	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	11	8	366	11,208	資本財
FRUTAROM INDUSTRIES LTD	18	—	—	—	素材
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	215	287	624	19,099	素材
NICE LTD	27	27	1,184	36,251	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	54	54	367	11,248	銀行
AZRIELI GROUP	23	21	399	12,225	不動産
小計	株数 銘柄数	2,543 9	2,496 8	6,095 —	186,528 <0.1%>
合計	株数 銘柄数	572,624 1,265	505,064 1,250	—	163,192,742 <93.7%>

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

※<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

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

※一部の銘柄において、資産区分を変更しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘	柄	期首 (前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額		組 入 比 率
						外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		口		口		千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORPORATION		19,807		17,476		309	35,158	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.		4,326		4,326		529	60,072	0.0
AMERICAN TOWER CORP		20,301		18,353		2,986	338,866	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		54,341		51,312		516	58,573	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC		6,474		5,571		1,047	118,886	0.1
BOSTON PROPERTIES INC		7,005		6,157		799	90,696	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		16,568		—		—	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC		—		11,010		192	21,850	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST		4,242		4,242		397	45,111	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A		24,561		—		—	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC		9,619		8,532		970	110,066	0.1
DUKE REALTY CORP		16,657		13,732		385	43,737	0.0
EQUITY RESIDENTIAL		17,242		14,828		1,041	118,231	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC		3,108		2,713		703	79,836	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC		6,423		5,405		510	57,889	0.0
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST		3,224		3,224		421	47,883	0.0
GGP INC		31,278		—		—	—	—
HCP, INC.		23,899		20,162		580	65,888	0.0
HOST HOTELS AND RESORTS INC		35,763		32,068		618	70,227	0.0
INVITATION HOMES INC		14,734		14,734		315	35,761	0.0
IRON MOUNTAIN INC		12,165		12,165		410	46,587	0.0
KIMCO REALTY CORPORATION		20,926		15,666		249	28,317	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST		6,876		6,876		305	34,649	0.0
MACERICH COMPANY/THE		5,229		3,806		190	21,619	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES		5,619		4,759		486	55,199	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		6,416		6,416		317	36,015	0.0
PROLOGIS INC		24,581		25,652		1,723	195,543	0.1
PUBLIC STORAGE		7,563		6,516		1,380	156,643	0.1
REALTY INCOME CORPORATION		13,190		11,714		748	84,881	0.0
REGENCY CENTERS CORP		7,446		6,080		381	43,339	0.0
SL GREEN REALTY CORP		4,854		3,945		370	41,997	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC		14,712		12,869		2,375	269,561	0.2
UDR INC		13,130		10,651		446	50,626	0.0
VENTAS INC		16,268		14,830		926	105,088	0.1
VEREIT INC		44,740		44,740		341	38,734	0.0
VORNADO REALTY TRUST		7,603		7,603		536	60,890	0.0
WP CAREY INC		—		6,694		453	51,491	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	
WELLTOWER INC		16,834		14,980		1,070	121,415	0.1
WEYERHAEUSER CO		36,098		30,388		812	92,202	0.1
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST		283,000		—		—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	866,822		480,195		25,853	2,933,542	
	銘 柄 数 < 比 率 >	38		36		—	< 1.7 % >	
(カナダ)						千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		—		3,825		81	6,933	0.0
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		8,036		—		—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		7,441		7,441		183	15,661	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS		1,625		3,585		112	9,585	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	17,102		14,851		376	32,179	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3		3		—	< 0.0 % >	
(ユーロ・・・フランス)						千ユーロ		
ICADE		1,265		1,265		90	11,644	0.0
KLEPIERRE		10,882		9,305		271	35,125	0.0
GECINA SA		2,152		1,738		217	28,156	0.0
COVIVIO		1,550		1,550		135	17,491	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		4,682		—		—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED		—		5,937		918	118,624	0.1
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	20,531		19,795		1,633	211,041	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5		5		—	< 0.1 % >	
(イギリス)						千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		47,527		34,772		198	28,741	0.0
HAMMERSON PLC		34,414		34,414		133	19,417	0.0
INTU PROPERTIES PLC		39,039		—		—	—	—
SEGRO PLC		49,582		40,873		251	36,451	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		32,703		32,703		272	39,474	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	203,265		142,762		855	124,084	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5		4		—	< 0.1 % >	
(オーストラリア)						千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP		182,452		140,993		318	26,472	0.0
TRANSURBAN GROUP		99,199		104,775		1,203	100,017	0.1
APA GROUP		56,058		48,387		443	36,863	0.0
GPT GROUP		87,590		69,713		375	31,159	0.0
LENLEASE GROUP		25,262		25,262		331	27,577	0.0
STOCKLAND		118,563		103,417		388	32,305	0.0
DEXUS		47,512		38,051		412	34,236	0.0
GOODMAN GROUP		89,762		64,265		686	57,021	0.0
SYDNEY AIRPORT		49,760		49,760		340	28,318	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
SCENTRE GROUP		259,894		234,290		939	78,053	0.0
WESTFIELD CORP		87,803		—		—	—	—
VICINITY CENTRES		146,656		146,656		400	33,262	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,250,511		1,025,569		5,841	485,289	
	銘 柄 数 <比 率>	12		11		—	<0.3%>	
(香港)						千香港ドル		
LINK REIT		101,000		92,500		6,979	101,267	0.1
HKT TRUST AND HKT LTD		182,000		136,000		1,525	22,141	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	283,000		228,500		8,505	123,408	
	銘 柄 数 <比 率>	2		2		—	<0.1%>	
(シンガポール)						千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		102,800		102,800		232	19,257	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		118,300		118,300		306	25,397	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		96,100		130,000		228	18,965	0.0
SUNTEC REIT		112,900		65,600		118	9,787	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	430,100		416,700		885	73,407	
	銘 柄 数 <比 率>	4		4		—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	3,071,331		2,328,372		—	3,982,954	
	銘 柄 数 <比 率>	69		65		—	<2.3%>	

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

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※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。

(3) 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	株 式 先 物 取 引	S P I 2 0 0		百万円 298		百万円 —
		D J E U R 0		1,151		—
		F T S E		440		—
		S P M I N I		4,842		—

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

※—印は組入れなし。

■ 投資信託財産の構成

(2018年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	163,192,743	93.6
投 資 証 券	3,982,954	2.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,148,379	4.1
投 資 信 託 財 産 総 額	174,324,076	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※期末における外貨建資産（174,020,097千円）の投資信託財産総額（174,324,076千円）に対する比率は99.8%です。

※外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=113.47円、1カナダドル=85.42円、1ユーロ=129.19円、1英ポンド=145.01円、1スイスフラン=113.90円、1スウェーデンクローナ=12.51円、1ノルウェークローネ=13.28円、1デンマーククローネ=17.31円、1オーストラリアドル=83.08円、1ニュージーランドドル=77.87円、1香港ドル=14.51円、1シンガポールドル=82.89円、1イスラエルシェケル=30.60円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2018年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	174,401,805,463円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,912,704,311
株 式(評価額)	163,192,743,028
投 資 証 券(評価額)	3,982,954,412
未 収 入 金	138,098,428
未 収 配 当 金	314,330,892
差 入 委 託 証 拠 金	1,860,974,392
(B) 負 債	156,417,856
未 払 金	149,637,737
未 払 解 約 金 息	6,754,706
未 払 利 息	105
そ の 他 未 払 費 用	25,308
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	174,245,387,607
元 本	50,246,578,230
次 期 繰 越 損 益 金	123,998,809,377
(D) 受 益 権 総 口 数	50,246,578,230口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	34,678円

※当期における期首元本額58,029,292,656円、期中追加設定元本額10,049,653,315円、期中一部解約元本額17,832,367,741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2017年12月1日 至2018年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,941,074,658円
受 取 配 当 金	3,924,640,141
受 取 利 息	1,587,167
そ の 他 収 益 金	15,171,397
支 払 利 息	△ 324,047
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	708,916,164
売 買 益 損	15,962,464,915
売 買 損 益	△ 15,253,548,751
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	332,966,226
取 引 益 損	997,088,210
取 引 損 益	△ 664,121,984
(D) 信 託 報 酬 等	△ 92,915,856
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	4,890,041,192
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	138,152,776,641
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	24,713,961,962
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 43,757,970,418
(I) 計 (E+F+G+H)	123,998,809,377
次 期 繰 越 損 益 金(I)	123,998,809,377

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

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

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

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	13,963,534,928円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	109,197,074円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	292,292,873円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	415,799円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,202,931,749円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	836,811,730円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	817,090,506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>	62,459,560円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	93,736,744円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	192,420,422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)	2,767,111円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	832,243,444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)	8,246,340円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	700,715,521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)	23,067,469円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,758,084,467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)	42,427,347円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,127,823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)	28,725,353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)	644,159,199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)	74,091,002円	三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	910,046,061円
外国株式指数ファンド	515,784,016円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	144,875,919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	2,565,814,517円	SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	62,409,967円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	315,400,400円	三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,238,982,181円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	365,627,690円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	26,076,116円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	327,166,698円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	14,479,541円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,473,135円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	7,145,659円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	7,216,701円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	50,091,943円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	8,212,729円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	117,258,620円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	29,595,220円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	124,968,964円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	21,315,967円	SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	1,290,643,460円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	47,876,942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>	176,401,107円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	8,473,697円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,575,845,522円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,124,666,265円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	330,173,733円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	9,021,436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>	508,770,876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>	179,443,768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>	8,425,418円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,755,823,811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>	80,662,210円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,622,654,012円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	38,640,683円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,828,627,561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>	95,159,906円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	20,758,586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<適格機関投資家限定>	20,732円

■ お知らせ

<約款変更について>

- ・受益者に対してする公告を電子公告の方法によるものとするため、所要の変更を行いました。
(適用日：2018年2月1日)
- ・一般社団法人投資信託協会規則の「信用リスク集中回避のための投資制限」に適合するよう、所要の変更を行いました。

(適用日：2018年2月23日)

外国債券パッシブ・マザーファンド

第15期（2017年12月19日から2018年12月17日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年12月18日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ・ 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

■ 最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		債 券 組 入 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
11期 (2014年12月17日)	円 18,345	% 17.0	185.50	% 17.2	% 98.4	百万円 231,601
12期 (2015年12月17日)	18,044	△ 1.6	182.96	△ 1.4	98.5	198,255
13期 (2016年12月19日)	17,116	△ 5.1	172.59	△ 5.7	98.4	180,203
14期 (2017年12月18日)	17,897	4.6	181.01	4.9	98.9	196,212
15期 (2018年12月17日)	17,553	△ 1.9	177.36	△ 2.0	98.7	168,894

※ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したもので、設定時を100として2018年12月17日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

※ F T S E 世界国債インデックス（除く日本）の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		債 券 組 入 率 比
	騰 落	率	騰 落	率	
(期 首) 2017年12月18日	円 17,897	% —	181.01	% —	% 98.9
12月末	17,979	0.5	181.80	0.4	98.8
2018年 1月末	17,545	△2.0	177.34	△2.0	98.3
2月末	17,090	△4.5	172.94	△4.5	98.5
3月末	17,204	△3.9	174.09	△3.8	98.6
4月末	17,414	△2.7	176.17	△2.7	98.9
5月末	16,976	△5.1	171.29	△5.4	97.9
6月末	17,216	△3.8	174.18	△3.8	98.6
7月末	17,351	△3.1	175.51	△3.0	98.7
8月末	17,337	△3.1	175.30	△3.2	98.8
9月末	17,627	△1.5	178.59	△1.3	98.8
10月末	17,312	△3.3	175.24	△3.2	98.5
11月末	17,461	△2.4	176.60	△2.4	98.9
(期 末) 2018年12月17日	17,553	△1.9	177.36	△2.0	98.7

※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（2017年12月19日から2018年12月17日まで）

基準価額等の推移



期首	17,897円
期末	17,553円
騰落率	-1.9%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2017年12月19日から2018年12月17日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の公社債に分散投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に対し、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション（投資資金の平均回収期間）等を可能な限り近似させるよう運用を行いました。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。

下落要因

- ・良好な米国のファンダメンタルズ（経済の基礎的諸条件）を背景に、FRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利正常化が進展し、米国金利が上昇（債券価格は下落）したこと
- ・イタリアや英国を巡る政治的な不透明感を背景に、ユーロが円に対して下落したこと

▶ 投資環境について（2017年12月19日から2018年12月17日まで）

長期金利は米国で上昇しました。欧州（ドイツ）では低下しました。為替市場では、米ドルは対円で横ばいとなった一方、ユーロは対円で下落しました。

債券市場

米国では、期初から2018年5月にかけて、良好なファンダメンタルズや財政政策による景気の上振れ期待を背景に、長期金利が大きく上昇しました。その後は、中国との貿易摩擦激化に伴い投資家のリスク選好姿勢が後退、金利上昇が抑えられ、夏場にかけて一定のレンジ内での値動きとなりました。9月以降は、堅調な経済指標に市場の焦点が移ったことで、金利は再度上昇しました。

11月に実施された中間選挙の結果は、ほぼ事前の予想通りで市場では材料視されなかったものの、選挙後には、トランプ政権の強硬な姿勢から、米中貿易摩擦が再度意識される展開となりました。期末にかけては、海外経済の減速や、財政政策による景気押し上げ効果が剥落する懸念も重なり、米国金利は年初来の高値水準から低下しました。

欧州では、期初から2018年2月にかけては米国金利に連動する形で上昇基調となりました。しかし、景気の下振れ懸念に加え、5月にはイタリアの政治懸念に伴う投資家のリスク選好姿勢の後退もあり、金利は低下傾向となりました。

その後、レンジでの揉み合いが続き、期末にかけては、予算案を巡るEU（欧州連合）とイタリアの協議が難航したこと、イギリスのEUからの無秩序な離脱リスクへの懸念、軟調な経済指標などを背景に、金利は低下しました。

当期の市場の動きを米国10年国債利回りで見ると、期首2.35%から期末2.89%へと上昇し、ドイツ10年国債利回りで見ると、期首0.30%から期末0.25%へと低下しました。

為替市場

米ドル・円相場は、期初から2018年3月にかけて、日銀の金融緩和縮小への思惑や米中貿易摩擦への警戒から円高が進行しました。その後は、米国の堅調な経済指標やFRBによる金融政策正常化の継続を背景に、期末まで米ドル高・円安が続きました。

ユーロ・円は、期の前半は投資家のリスク回避姿勢の高まりから円高傾向となりました。6月以降は、ECB（欧州中央銀行）の金融緩和縮小観測がユーロのサポート要因となりましたが、ユーロ圏で軟調な経済指標が続いたことから、一進一退の展開となりました。

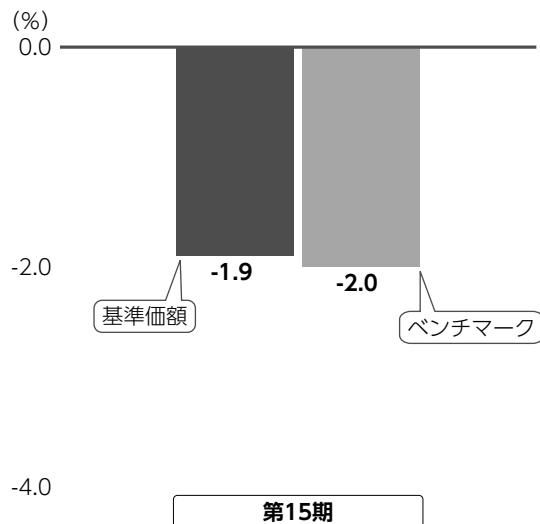
当期の米ドル・円は、期首112円76銭から期末113円47銭と0円71銭の米ドル高・円安、ユーロ・円は期首132円55銭から期末128円28銭と4円27銭のユーロ安・円高となりました。

▶ ポートフォリオについて (2017年12月19日から2018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 (2017年12月19日から2018年12月17日まで)

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は-1.9%となり、ベンチマークの騰落率-2.0%を0.1%上方乖離しました。

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などが、上方乖離要因となりました。

2 今後の運用方針

米国では、当面はF R Bの慎重な政策スタンスが想定されること、足元でインフレが抑制されていることから、長期金利はレンジ内での推移を予想します。ユーロ圏においては、当面は景気の弱さが重しとなるものの、インフレの緩やかな上昇やE C Bが金融緩和政策を徐々に縮小していくことなどが予想され、欧州（ドイツ）の長期金利は上昇しやすい展開を予想します。

為替相場は、リスク回避やポジション調整等を背景とした円買いの動きが強まる可能性があります。ただし、日本からの根強い対外証券投資による資本フローなどが中期的な円安要因として働き、相対的に金利水準の高い通貨は円に対して底堅く推移していくものと見込んでいます。

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細 (2017年12月19日から2018年12月17日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	7円 (7)	0.039% (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：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	7	0.039	

期中の平均基準価額は17,376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 (2017年12月19日から2018年12月17日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額	
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 149,437	千米ドル 193,142	
			千カナダドル 4,358	千カナダドル 11,793	
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 9,858	千メキシコペソ 25,649	
			ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	17,688	34,425	
			イ タ リ ア	7,680	26,721
			フ ラ ン ス	19,426	36,070
			オ ラ ン ダ	2,515	6,920
			ス ペ イ ン	9,765	17,373
			ベルギー	2,868	7,759
			オーストリア	2,037	7,206
			フィンランド	301	1,045
アイルランド			1,815	2,354	
国			イ ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 7,853
	ス イ ス	千スイスフラン -			千スイスフラン 2,924

外国債券パッシブ・マザーファンド

			買 付 額	売 付 額
外	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ -	千スウェーデンクローナ 17,338
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 2,041	千ノルウェークローネ 13,803
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 4,575	千デンマーククローネ 18,975
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 4,341	千ポーランドズロチ 9,550
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 3,954	千オーストラリアドル 9,632
国	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 2,484	千シンガポールドル 3,116
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 1,560	千マレーシアリンギット 4,942
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 13,628	千南アフリカランド 19,710

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等 (2017年12月19日から2018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。

■ 組入れ資産の明細 (2018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	千米ドル 688,320	千米ドル 677,596	千円 76,886,921	% 45.5	% -	% 18.9	% 17.8	% 8.7
カナダ	千カナダドル 37,300	千カナダドル 39,435	3,344,166	2.0	-	0.9	0.5	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 242,000	千メキシコペソ 232,232	1,309,793	0.8	-	0.4	0.2	0.2

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	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ							
ド イ ツ	73,380	86,368	11,079,408	6.6	—	4.3	1.6	0.7	
イ タ リ ア	110,730	118,007	15,138,058	9.0	—	4.7	3.1	1.1	
フ ラ ン ス	110,970	129,564	16,620,596	9.8	—	6.4	2.5	1.0	
オ ラ ン ダ	22,600	26,564	3,407,724	2.0	—	1.2	0.5	0.3	
ス ペ イ ン	66,200	76,989	9,876,153	5.8	—	3.9	1.2	0.7	
ベルギー	26,300	31,481	4,038,463	2.4	—	1.7	0.5	0.1	
オーストリア	17,300	20,283	2,601,975	1.5	—	1.0	0.4	0.1	
フィンランド	7,600	8,539	1,095,419	0.6	—	0.3	0.2	0.1	
アイルランド	9,690	10,741	1,377,964	0.8	—	0.5	0.1	0.2	
イ ギ リ ス	千英ポンド 62,320	千英ポンド 77,392	11,053,163	6.5	—	4.9	1.3	0.4	
ス イ ス	千スイスフラン —	千スイスフラン —	—	—	—	—	—	—	
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 43,100	千スウェーデンクローナ 49,096	615,175	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 29,900	千ノルウェークローネ 30,742	404,577	0.2	—	0.1	0.1	—	
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 41,000	千デンマーククローネ 52,804	907,176	0.5	—	0.4	0.1	0.0	
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 32,800	千ポーランドズロチ 34,342	1,026,498	0.6	—	0.2	0.3	0.1	
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 40,100	千オーストラリアドル 43,055	3,502,956	2.1	—	1.4	0.5	0.2	
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 7,800	千シンガポールドル 8,161	673,081	0.4	—	0.2	0.2	0.0	
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 28,600	千マレーシアリンギット 28,113	761,873	0.5	—	0.3	0.1	0.1	
南 ア フ リ カ	千南アフリカランド 156,000	千南アフリカランド 121,253	956,691	0.6	—	0.5	0.1	—	
合 計	—	—	166,677,841	98.7	—	52.5	31.6	14.6	

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 外国（外貨建）公社債

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ)	国債証券	US TREASURY N/B 1		1.0	2,000	1,969	223,447	2019/11/15
		US TREASURY N/B 1		1.0	3,000	2,951	334,904	2019/11/30
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	3,000	2,951	334,878	2019/12/31
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	2,800	2,742	311,187	2020/3/31
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	3,000	2,934	332,936	2020/4/30
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	3,800	3,669	416,363	2021/2/28
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	3,000	2,883	327,245	2021/6/30
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	4,500	4,317	489,951	2021/7/31
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	2,700	2,587	293,635	2021/8/31
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	3,500	3,351	380,266	2021/9/30
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	500	493	56,030	2019/10/31
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	3,000	2,950	334,798	2020/1/31
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	3,000	2,946	334,346	2020/2/29
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	3,600	3,483	395,279	2021/3/31
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	3,500	3,357	380,979	2021/10/31
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	3,000	2,805	318,389	2023/7/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,960	335,942	2019/12/15
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,956	335,490	2020/1/15
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	4,000	3,939	447,036	2020/1/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,952	335,037	2020/2/15
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	5,000	4,917	558,041	2020/2/29
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	4,000	3,929	445,901	2020/3/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	4,000	3,925	445,440	2020/4/30
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,941	333,734	2020/5/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	4,000	3,908	443,454	2020/8/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,300	3,223	365,791	2020/9/15
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,928	332,298	2020/9/30
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,700	3,607	409,375	2020/10/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,915	330,835	2021/1/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,400	2,325	263,902	2021/4/30
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	4,000	3,871	439,306	2021/5/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,500	3,296	373,998	2023/6/30
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,500	2,349	266,588	2023/8/31
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,815	319,453	2023/9/30
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	5,000	4,942	560,878	2019/11/30
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	2,945	334,266	2020/5/31
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	1,000	981	111,386	2020/6/15
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	2,000	1,961	222,525	2020/7/15
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	2,890	327,990	2022/1/31
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	2,852	323,655	2023/2/28
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	2,849	323,309	2023/3/31

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末							
				利	率	額	面		額	償	還	年	月	日
							額	金						
				外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額
		US TREASURY	N/B 1.5	1.5	4,800	4,361	494,871	2026/8/15						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	4,000	3,954	448,738	2019/12/31						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	2,000	1,972	223,801	2020/3/15						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	3,500	3,440	390,350	2020/6/30						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	3,000	2,946	334,293	2020/7/31						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	3,500	3,425	388,736	2020/11/30						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	3,000	2,883	327,245	2022/8/15						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	4,000	3,844	436,185	2022/8/31						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	3,500	3,355	380,793	2022/11/15						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	3,000	2,862	324,825	2023/4/30						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	3,000	2,859	324,453	2023/5/31						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	3,000	2,846	322,990	2023/10/31						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	6,000	5,535	628,109	2026/2/15						
		US TREASURY	N/B 1.625	1.625	5,300	4,876	553,326	2026/5/15						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	2,300	2,257	256,169	2020/10/31						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	2,000	1,961	222,613	2020/12/31						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	3,000	2,917	330,995	2021/11/30						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	3,000	2,910	330,250	2022/2/28						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	3,500	3,392	384,951	2022/3/31						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	3,000	2,905	329,665	2022/4/30						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	3,000	2,904	329,532	2022/5/15						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	3,000	2,903	329,426	2022/5/31						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	3,000	2,901	329,213	2022/6/30						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	3,000	2,893	328,282	2022/9/30						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	3,000	2,883	327,245	2023/1/31						
		US TREASURY	N/B 1.75	1.75	5,700	5,465	620,149	2023/5/15						
		US TREASURY	N/B 1.875	1.875	3,000	2,960	335,888	2020/6/30						
		US TREASURY	N/B 1.875	1.875	2,400	2,338	265,370	2022/1/31						
		US TREASURY	N/B 1.875	1.875	2,000	1,947	220,929	2022/3/31						
		US TREASURY	N/B 1.875	1.875	3,000	2,917	331,048	2022/4/30						
		US TREASURY	N/B 1.875	1.875	3,000	2,915	330,782	2022/5/31						
		US TREASURY	N/B 1.875	1.875	1,700	1,649	187,172	2022/7/31						
		US TREASURY	N/B 1.875	1.875	4,000	3,877	440,015	2022/8/31						
		US TREASURY	N/B 1.875	1.875	3,000	2,904	329,586	2022/10/31						
		US TREASURY	N/B 1.875	1.875	1,800	1,715	194,687	2024/8/31						
		US TREASURY	N/B 2	2.0	3,000	2,964	336,341	2020/7/31						
		US TREASURY	N/B 2	2.0	2,300	2,270	257,616	2020/9/30						
		US TREASURY	N/B 2	2.0	1,600	1,577	178,984	2020/11/30						
		US TREASURY	N/B 2	2.0	3,000	2,955	335,357	2021/1/15						
		US TREASURY	N/B 2	2.0	3,000	2,952	335,011	2021/2/28						
		US TREASURY	N/B 2	2.0	3,000	2,948	334,559	2021/5/31						
		US TREASURY	N/B 2	2.0	3,000	2,942	333,841	2021/8/31						
		US TREASURY	N/B 2	2.0	3,000	2,940	333,681	2021/10/31						
		US TREASURY	N/B 2	2.0	4,300	4,214	478,238	2021/11/15						

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末		
				利	率	額	評 価 額		償 還 年 月 日
							面	金	
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,500		3,427	388,891	2021/12/31
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,100		3,032	344,117	2022/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,000		2,923	331,766	2022/ 7 /31
		US TREASURY N/B 2		2.0	500		486	55,205	2022/10/31
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,000		2,917	331,022	2022/11/30
		US TREASURY N/B 2		2.0	5,500		5,338	605,703	2023/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2		2.0	2,000		1,923	218,287	2024/ 4 /30
		US TREASURY N/B 2		2.0	4,200		4,037	458,106	2024/ 5 /31
		US TREASURY N/B 2		2.0	2,500		2,400	272,416	2024/ 6 /30
		US TREASURY N/B 2		2.0	5,600		5,345	606,539	2025/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2		2.0	4,300		4,088	463,868	2025/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2		2.0	6,200		5,829	661,468	2026/11/15
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,000		2,969	336,899	2020/ 8 /31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	2,700		2,665	302,467	2021/ 1 /31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	1,700		1,675	190,095	2021/ 6 /30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	4,000		3,937	446,788	2021/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,000		2,951	334,958	2021/ 9 /30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,000		2,947	334,426	2021/12/31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,000		2,938	333,442	2022/ 6 /30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	4,000		3,905	443,171	2022/12/31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,100		3,009	341,534	2023/11/30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	2,000		1,938	219,954	2024/ 2 /29
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	4,000		3,874	439,589	2024/ 3 /31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,500		3,382	383,772	2024/ 7 /31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	4,400		4,246	481,793	2024/ 9 /30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	1,800		1,734	196,842	2024/11/30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,400		3,263	370,335	2025/ 5 /15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	4,000		3,959	449,234	2021/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	3,000		2,968	336,793	2021/ 3 /31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	2,000		1,978	224,493	2021/ 4 /30
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	2,800		2,766	313,893	2021/ 7 /31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	3,000		2,928	332,351	2023/12/31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	2,000		1,951	221,443	2024/ 1 /31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	1,500		1,456	165,271	2024/10/31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	6,300		6,112	693,638	2024/11/15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	3,100		3,006	341,176	2024/12/31
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	5,500		5,302	601,705	2025/11/15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	5,200		4,972	564,229	2027/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	5,200		4,955	562,247	2027/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	6,200		5,895	668,997	2027/11/15
		US TREASURY N/B 2.25		2.25	4,200		3,504	397,604	2046/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2.375		2.375	2,000		1,986	225,379	2020/12/31
		US TREASURY N/B 2.375		2.375	3,000		2,976	337,777	2021/ 3 /15
		US TREASURY N/B 2.375		2.375	2,000		1,983	225,078	2021/ 4 /15

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末							
				利	率	額	面		額	償	還	年	月	日
							額	金						
				外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	1,200	1,182	134,227	2023/ 1 /31						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	7,000	6,849	777,225	2024/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.375	2.375	6,000	5,787	656,725	2027/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	5,000	4,944	561,055	2023/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	5,700	5,621	637,885	2024/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	4,600	4,524	513,357	2025/ 1 /31						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	5,100	4,514	512,282	2045/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	4,400	3,880	440,369	2046/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B 2.5	2.5	4,900	4,314	489,543	2046/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 2.625	2.625	4,000	3,991	452,922	2020/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.625	2.625	5,500	5,487	622,622	2020/11/15						
		US TREASURY	N/B 2.625	2.625	500	498	56,584	2021/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 2.625	2.625	4,000	3,990	452,745	2021/ 6 /15						
		US TREASURY	N/B 2.625	2.625	4,000	3,989	452,674	2021/ 7 /15						
		US TREASURY	N/B 2.625	2.625	4,000	3,981	451,787	2023/ 2 /28						
		US TREASURY	N/B 2.625	2.625	4,300	4,257	483,079	2025/ 3 /31						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	4,000	4,001	454,021	2021/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	1,400	1,400	158,932	2021/ 9 /15						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	6,000	6,002	681,139	2023/ 4 /30						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	2,000	2,000	227,028	2023/ 7 /31						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	6,100	6,104	692,707	2023/ 8 /31						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	6,200	6,201	703,733	2023/11/15						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	5,100	5,096	578,290	2024/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	2,000	1,994	226,337	2025/ 2 /28						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	5,000	4,983	565,532	2025/ 6 /30						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	600	597	67,837	2025/ 8 /31						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	4,800	4,746	538,613	2028/ 2 /15						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	2,000	1,873	212,543	2042/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	2,800	2,619	297,188	2042/11/15						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	2,400	2,218	251,775	2047/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.75	2.75	1,500	1,386	157,333	2047/11/15						
		US TREASURY	N/B 2.875	2.875	7,200	7,228	820,175	2021/11/15						
		US TREASURY	N/B 2.875	2.875	2,200	2,209	250,706	2025/ 4 /30						
		US TREASURY	N/B 2.875	2.875	1,100	1,104	125,324	2025/ 5 /31						
		US TREASURY	N/B 2.875	2.875	4,500	4,493	509,896	2028/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 2.875	2.875	8,300	8,287	940,329	2028/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.875	2.875	3,000	2,867	325,330	2043/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 2.875	2.875	4,000	3,806	431,895	2045/ 8 /15						
		US TREASURY	N/B 2.875	2.875	3,600	3,420	388,067	2046/11/15						
		US TREASURY	N/B 3	3.0	4,000	4,048	459,340	2025/ 9 /30						
		US TREASURY	N/B 3	3.0	3,100	3,137	355,989	2025/10/31						
		US TREASURY	N/B 3	3.0	1,800	1,763	200,065	2042/ 5 /15						
		US TREASURY	N/B 3	3.0	4,000	3,904	443,029	2044/11/15						
		US TREASURY	N/B 3	3.0	4,000	3,903	442,887	2045/ 5 /15						

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末		
				利	率	額	評 価 額		償 還 年 月 日
							面	金	
						外貨建金額	邦貨換算金額		
		US TREASURY	N/B 3	3.0	4,900	4,779	542,320	2045/11/15	
		US TREASURY	N/B 3	3.0	2,500	2,433	276,184	2047/2/15	
		US TREASURY	N/B 3	3.0	2,200	2,139	242,788	2047/5/15	
		US TREASURY	N/B 3	3.0	3,100	3,011	341,726	2048/2/15	
		US TREASURY	N/B 3	3.0	1,500	1,457	165,364	2048/8/15	
		US TREASURY	N/B 3.125	3.125	3,000	3,028	343,681	2021/5/15	
		US TREASURY	N/B 3.125	3.125	1,500	1,529	173,595	2028/11/15	
		US TREASURY	N/B 3.125	3.125	2,000	2,002	227,205	2041/11/15	
		US TREASURY	N/B 3.125	3.125	2,000	2,002	227,259	2042/2/15	
		US TREASURY	N/B 3.125	3.125	1,400	1,398	158,647	2043/2/15	
		US TREASURY	N/B 3.125	3.125	5,100	5,092	577,883	2044/8/15	
		US TREASURY	N/B 3.125	3.125	1,200	1,193	135,461	2048/5/15	
		US TREASURY	N/B 3.375	3.375	5,000	5,029	570,718	2019/11/15	
		US TREASURY	N/B 3.375	3.375	4,000	4,168	472,992	2044/5/15	
		US TREASURY	N/B 3.375	3.375	900	940	106,678	2048/11/15	
		US TREASURY	N/B 3.5	3.5	4,500	4,545	515,721	2020/5/15	
		US TREASURY	N/B 3.5	3.5	1,500	1,604	182,052	2039/2/15	
		US TREASURY	N/B 3.625	3.625	6,000	6,059	687,521	2020/2/15	
		US TREASURY	N/B 3.625	3.625	5,000	5,092	577,899	2021/2/15	
		US TREASURY	N/B 3.625	3.625	3,800	4,120	467,601	2043/8/15	
		US TREASURY	N/B 3.625	3.625	5,000	5,426	615,707	2044/2/15	
		US TREASURY	N/B 3.75	3.75	1,500	1,657	188,076	2041/8/15	
		US TREASURY	N/B 3.75	3.75	4,000	4,426	502,246	2043/11/15	
		US TREASURY	N/B 3.875	3.875	1,500	1,687	191,480	2040/8/15	
		US TREASURY	N/B 4.25	4.25	1,000	1,181	134,116	2039/5/15	
		US TREASURY	N/B 4.25	4.25	1,800	2,132	241,951	2040/11/15	
		US TREASURY	N/B 4.375	4.375	500	599	68,064	2038/2/15	
		US TREASURY	N/B 4.375	4.375	1,500	1,801	204,458	2039/11/15	
		US TREASURY	N/B 4.375	4.375	1,400	1,684	191,088	2040/5/15	
		US TREASURY	N/B 4.375	4.375	1,800	2,171	246,355	2041/5/15	
		US TREASURY	N/B 4.5	4.5	900	1,085	123,193	2036/2/15	
		US TREASURY	N/B 4.5	4.5	1,000	1,218	138,318	2038/5/15	
		US TREASURY	N/B 4.5	4.5	1,000	1,220	138,495	2039/8/15	
		US TREASURY	N/B 4.625	4.625	2,100	2,608	296,015	2040/2/15	
		US TREASURY	N/B 4.75	4.75	1,500	1,899	215,535	2041/2/15	
		US TREASURY	N/B 5	5.0	500	642	72,882	2037/5/15	
		US TREASURY	N/B 5.25	5.25	500	600	68,121	2028/11/15	
		US TREASURY	N/B 5.375	5.375	720	899	102,040	2031/2/15	
		US TREASURY	N/B 5.5	5.5	500	608	69,083	2028/8/15	
		US TREASURY	N/B 6	6.0	1,000	1,206	136,944	2026/2/15	
		US TREASURY	N/B 6.125	6.125	1,000	1,254	142,351	2027/11/15	
		US TREASURY	N/B 6.25	6.25	800	921	104,612	2023/8/15	
		US TREASURY	N/B 6.25	6.25	500	660	74,996	2030/5/15	
		US TREASURY	N/B 6.5	6.5	500	630	71,486	2026/11/15	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		US TREASURY N/B 8	8.0	1,300	1,489	169,015	2021/11/15	
		US TREASURY N/B 8.75	8.75	1,000	1,096	124,426	2020/8/15	
小		計	—	—	—	76,886,921	—	
(カナダ)	国債証券	CANADA-GOV' T 0.5	0.5	千カナダドル 2,000	千カナダドル 1,904	161,460	2022/3/1	
		CANADA-GOV' T 0.75	0.75	1,300	1,271	107,823	2020/9/1	
		CANADA-GOV' T 0.75	0.75	2,000	1,944	164,867	2021/3/1	
		CANADA-GOV' T 0.75	0.75	2,000	1,931	163,791	2021/9/1	
		CANADA-GOV' T 1	1.0	1,000	916	77,722	2027/6/1	
		CANADA-GOV' T 1.25	1.25	1,500	1,488	126,220	2020/2/1	
		CANADA-GOV' T 1.5	1.5	2,000	1,989	168,677	2020/3/1	
		CANADA-GOV' T 1.5	1.5	2,000	1,954	165,729	2023/6/1	
		CANADA-GOV' T 1.5	1.5	1,400	1,343	113,923	2026/6/1	
		CANADA-GOV' T 1.75	1.75	1,000	999	84,719	2019/9/1	
		CANADA-GOV' T 1.75	1.75	1,100	1,087	92,189	2023/3/1	
		CANADA-GOV' T 2	2.0	1,100	1,091	92,524	2028/6/1	
		CANADA-GOV' T 2.25	2.25	1,500	1,516	128,632	2025/6/1	
		CANADA-GOV' T 2.5	2.5	2,300	2,352	199,508	2024/6/1	
		CANADA-GOV' T 2.75	2.75	1,000	1,022	86,682	2022/6/1	
		CANADA-GOV' T 2.75	2.75	1,800	1,984	168,285	2048/12/1	
		CANADA-GOV' T 2.75	2.75	500	572	48,570	2064/12/1	
		CANADA-GOV' T 3.25	3.25	1,000	1,028	87,249	2021/6/1	
		CANADA-GOV' T 3.5	3.5	2,000	2,043	173,258	2020/6/1	
		CANADA-GOV' T 3.5	3.5	1,500	1,863	158,023	2045/12/1	
CANADA-GOV' T 3.75	3.75	2,500	2,521	213,802	2019/6/1			
CANADA-GOV' T 4	4.0	1,500	1,946	165,083	2041/6/1			
CANADA-GOV' T 5	5.0	1,200	1,692	143,561	2037/6/1			
CANADA-GOV' T 5.75	5.75	600	802	68,070	2029/6/1			
CANADA-GOV' T 5.75	5.75	1,000	1,438	122,016	2033/6/1			
CANADA-GOV' T 8	8.0	500	728	61,769	2027/6/1			
小		計	—	—	—	3,344,166	—	
(メキシコ)	国債証券	MEXICAN BONOS 10	10.0	千メキシコペソ 36,000	千メキシコペソ 37,899	213,752	2024/12/5	
		MEXICAN BONOS 5.75	5.75	20,000	16,655	93,936	2026/3/5	
		MEXICAN BONOS 6.5	6.5	33,000	30,749	173,424	2022/6/9	
		MEXICAN BONOS 7.5	7.5	10,000	9,144	51,577	2027/6/3	
		MEXICAN BONOS 8	8.0	50,000	49,618	279,848	2020/6/11	
		MEXICAN BONOS 8	8.0	20,000	19,347	109,118	2023/12/7	
		MEXICAN BONOS 8.5	8.5	33,000	31,838	179,566	2029/5/31	
		MEXICAN BONOS 8.5	8.5	40,000	36,980	208,569	2038/11/18	
小		計	—	—	—	1,309,793	—	
(ユーロ)				千ユーロ	千ユーロ			
(ドイツ)	国債証券	BUNDESUBL-171 0	—	2,000	2,017	258,792	2020/4/17	
		BUNDESUBL-172 0.25	0.25	2,000	2,033	260,847	2020/10/16	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末										
				利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
			BUNDESOBL-173 0	—		2,500				2,535		325,295			2021/4/9		
			BUNDESOBL-174 0	—		3,000				3,048		391,020			2021/10/8		
			DEUTSCHLAND REP 0	—		1,700				1,698		217,886			2026/8/15		
			DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25		2,800				2,841		364,467			2027/2/15		
			DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25		2,850				2,849		365,554			2028/8/15		
			DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5		3,600				3,746		480,566			2025/2/15		
			DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5		900				935		119,970			2026/2/15		
			DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5		1,500				1,548		198,633			2027/8/15		
			DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5		2,300				2,364		303,364			2028/2/15		
			DEUTSCHLAND REP 1	1.0		1,800				1,924		246,919			2024/8/15		
			DEUTSCHLAND REP 1	1.0		2,950				3,168		406,418			2025/8/15		
			DEUTSCHLAND REP 1.25	1.25		400				437		56,178			2048/8/15		
			DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5		2,500				2,684		344,342			2022/9/4		
			DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5		2,500				2,700		346,432			2023/2/15		
			DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5		2,000				2,167		278,103			2023/5/15		
			DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5		3,700				4,052		519,797			2024/5/15		
			DEUTSCHLAND REP 1.75	1.75		2,500				2,700		346,368			2022/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 1.75	1.75		2,000				2,211		283,660			2024/2/15		
			DEUTSCHLAND REP 2	2.0		1,500				1,665		213,709			2023/8/15		
			DEUTSCHLAND REP 2.25	2.25		1,500				1,575		202,077			2020/9/4		
			DEUTSCHLAND REP 2.25	2.25		1,400				1,508		193,483			2021/9/4		
			DEUTSCHLAND REP 2.5	2.5		1,500				1,597		204,963			2021/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 2.5	2.5		2,200				3,045		390,728			2044/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 2.5	2.5		2,100				2,949		378,385			2046/8/15		
			DEUTSCHLAND REP 3	3.0		3,000				3,171		406,791			2020/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 3.25	3.25		1,200				1,842		236,359			2042/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 4	4.0		2,500				3,936		504,948			2037/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 4.25	4.25		1,500				2,520		323,284			2039/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 4.75	4.75		1,100				1,574		201,963			2028/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 4.75	4.75		1,900				3,095		397,122			2034/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 4.75	4.75		1,700				3,073		394,274			2040/7/4		
			DEUTSCHLAND REP 5.5	5.5		300				482		61,892			2031/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 5.625	5.625		1,580				2,361		302,969			2028/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 6.25	6.25		1,200				1,598		205,061			2024/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 6.25	6.25		700				1,154		148,125			2030/1/4		
			DEUTSCHLAND REP 6.5	6.5		1,000				1,548		198,646			2027/7/4		
(イタリア)	国債証券		BTPS 0.05	0.05		500				499		64,020			2019/10/15		
			BTPS 0.05	0.05		1,000				981		125,944			2021/4/15		
			BTPS 0.2	0.2		2,000				1,987		254,941			2020/10/15		
			BTPS 0.35	0.35		500				499		64,029			2020/6/15		
			BTPS 0.35	0.35		1,500				1,469		188,444			2021/11/1		
			BTPS 0.45	0.45		2,000				1,980		254,014			2021/6/1		
			BTPS 0.65	0.65		1,600				1,601		205,502			2020/11/1		
			BTPS 0.65	0.65		2,000				1,886		241,946			2023/10/15		

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		BTPS 0.7		0.7	2,000	2,007	257,470	2020/5/1
		BTPS 0.9		0.9	800	781	100,263	2022/8/1
		BTPS 0.95		0.95	2,000	1,932	247,960	2023/3/15
		BTPS 1.05		1.05	500	503	64,588	2019/12/1
		BTPS 1.2		1.2	1,000	992	127,378	2022/4/1
		BTPS 1.25		1.25	2,000	1,822	233,818	2026/12/1
		BTPS 1.35		1.35	2,000	1,993	255,751	2022/4/15
		BTPS 1.45		1.45	2,000	1,989	255,182	2022/9/15
		BTPS 1.45		1.45	1,000	943	121,069	2025/5/15
		BTPS 1.5		1.5	700	663	85,107	2025/6/1
		BTPS 1.6		1.6	2,000	1,883	241,669	2026/6/1
		BTPS 1.65		1.65	2,000	1,701	218,204	2032/3/1
		BTPS 1.85		1.85	1,000	983	126,208	2024/5/15
		BTPS 2		2.0	1,300	1,263	162,142	2025/12/1
		BTPS 2		2.0	1,600	1,508	193,491	2028/2/1
		BTPS 2.05		2.05	1,500	1,422	182,533	2027/8/1
		BTPS 2.15		2.15	2,000	2,054	263,507	2021/12/15
		BTPS 2.2		2.2	1,000	963	123,545	2027/6/1
		BTPS 2.25		2.25	1,200	1,048	134,441	2036/9/1
		BTPS 2.3		2.3	600	617	79,225	2021/10/15
		BTPS 2.45		2.45	600	549	70,451	2033/9/1
		BTPS 2.5		2.5	600	607	77,927	2024/12/1
		BTPS 2.7		2.7	1,900	1,669	214,133	2047/3/1
		BTPS 2.8		2.8	900	763	97,919	2067/3/1
		BTPS 2.95		2.95	1,000	933	119,776	2038/9/1
		BTPS 3.25		3.25	1,500	1,441	184,886	2046/9/1
		BTPS 3.45		3.45	1,100	1,079	138,490	2048/3/1
		BTPS 3.5		3.5	2,300	2,396	307,456	2030/3/1
		BTPS 3.75		3.75	2,500	2,658	341,086	2021/3/1
		BTPS 3.75		3.75	2,000	2,130	273,251	2021/5/1
		BTPS 3.75		3.75	3,200	3,416	438,257	2021/8/1
		BTPS 3.75		3.75	2,000	2,154	276,420	2024/9/1
		BTPS 4		4.0	2,500	2,644	339,217	2020/9/1
		BTPS 4		4.0	2,700	2,944	377,746	2037/2/1
		BTPS 4.25		4.25	2,300	2,406	308,695	2020/3/1
		BTPS 4.5		4.5	2,700	2,825	362,406	2020/2/1
		BTPS 4.5		4.5	2,300	2,556	327,938	2023/5/1
		BTPS 4.5		4.5	3,000	3,341	428,707	2024/3/1
		BTPS 4.5		4.5	1,700	1,919	246,223	2026/3/1
		BTPS 4.75		4.75	2,600	2,846	365,113	2021/9/1
		BTPS 4.75		4.75	2,500	2,815	361,175	2023/8/1
		BTPS 4.75		4.75	2,100	2,443	313,400	2028/9/1
		BTPS 4.75		4.75	1,600	1,905	244,489	2044/9/1
		BTPS 5		5.0	2,000	2,223	285,287	2022/3/1

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		BTPS 5		5.0	1,000	1,151	147,652	2025/3/1
		BTPS 5		5.0	2,570	3,089	396,297	2034/8/1
		BTPS 5		5.0	2,000	2,423	310,912	2039/8/1
		BTPS 5		5.0	1,900	2,299	294,944	2040/9/1
		BTPS 5.25		5.25	1,900	2,291	293,994	2029/11/1
		BTPS 5.5		5.5	2,000	2,279	292,452	2022/9/1
		BTPS 5.5		5.5	2,000	2,281	292,624	2022/11/1
		BTPS 5.75		5.75	2,200	2,807	360,189	2033/2/1
		BTPS 6		6.0	2,900	3,740	479,776	2031/5/1
		BTPS 6.5		6.5	3,360	4,333	555,960	2027/11/1
		BTPS 7.25		7.25	1,000	1,328	170,443	2026/11/1
		BTPS 9		9.0	1,000	1,324	169,946	2023/11/1
(フランス)	国債証券	FRANCE O. A. T. 0		—	3,000	3,024	387,995	2020/5/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,700	2,728	350,041	2021/5/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	1,000	1,010	129,637	2022/5/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,000	2,012	258,189	2023/3/25
		FRANCE O. A. T. 0.25		0.25	2,300	2,333	299,387	2020/11/25
		FRANCE O. A. T. 0.25		0.25	3,000	2,959	379,590	2026/11/25
		FRANCE O. A. T. 0.5		0.5	2,900	2,958	379,511	2025/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.5		0.5	3,000	3,035	389,369	2026/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.75		0.75	3,500	3,532	453,088	2028/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.75		0.75	900	903	115,902	2028/11/25
		FRANCE O. A. T. 1		1.0	2,500	2,627	337,001	2025/11/25
		FRANCE O. A. T. 1		1.0	2,500	2,602	333,794	2027/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.25		1.25	2,000	1,998	256,316	2036/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.5		1.5	3,200	3,408	437,231	2031/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	4,000	4,338	556,529	2023/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	3,600	3,953	507,139	2024/11/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	1,400	1,498	192,255	2039/6/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	1,000	968	124,281	2066/5/25
		FRANCE O. A. T. 2		2.0	2,000	2,169	278,329	2048/5/25
		FRANCE O. A. T. 2.25		2.25	3,200	3,508	450,125	2022/10/25
		FRANCE O. A. T. 2.25		2.25	4,300	4,824	618,877	2024/5/25
		FRANCE O. A. T. 2.5		2.5	3,500	3,697	474,360	2020/10/25
		FRANCE O. A. T. 2.5		2.5	3,300	3,895	499,708	2030/5/25
		FRANCE O. A. T. 2.75		2.75	4,500	5,366	688,463	2027/10/25
		FRANCE O. A. T. 3		3.0	5,000	5,562	713,551	2022/4/25
		FRANCE O. A. T. 3.25		3.25	3,400	3,756	481,917	2021/10/25
		FRANCE O. A. T. 3.25		3.25	2,700	3,706	475,508	2045/5/25
		FRANCE O. A. T. 3.5		3.5	4,000	4,221	541,500	2020/4/25
		FRANCE O. A. T. 3.5		3.5	3,300	4,074	522,707	2026/4/25
		FRANCE O. A. T. 3.75		3.75	3,900	4,288	550,106	2021/4/25
		FRANCE O. A. T. 4		4.0	1,800	2,658	341,082	2038/10/25
FRANCE O. A. T. 4		4.0	1,170	1,885	241,902	2055/4/25		

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		FRANCE O. A. T. 4	4.0	1,500	2,476	317,656	2060/4/25	
		FRANCE O. A. T. 4.25	4.25	3,800	4,605	590,816	2023/10/25	
		FRANCE O. A. T. 4.5	4.5	3,300	5,274	676,645	2041/4/25	
		FRANCE O. A. T. 4.75	4.75	2,300	3,551	455,621	2035/4/25	
		FRANCE O. A. T. 5.5	5.5	3,000	4,441	569,797	2029/4/25	
		FRANCE O. A. T. 5.75	5.75	2,900	4,695	602,391	2032/10/25	
		FRANCE O. A. T. 6	6.0	3,000	4,179	536,109	2025/10/25	
		FRANCE O. A. T. 8.5	8.5	600	827	106,155	2023/4/25	
(オランダ)	国債証券	NETHERLANDS GOVT 0	—	1,500	1,522	195,250	2022/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 0.25	0.25	2,000	2,020	259,197	2020/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 0.25	0.25	1,700	1,723	221,033	2025/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 0.5	0.5	1,500	1,538	197,295	2026/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 0.75	0.75	1,400	1,453	186,468	2027/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 0.75	0.75	400	412	52,965	2028/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 1.75	1.75	1,600	1,749	224,442	2023/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 2	2.0	1,000	1,117	143,291	2024/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 2.25	2.25	1,500	1,644	210,998	2022/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 2.5	2.5	1,800	2,246	288,198	2033/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 2.75	2.75	1,300	1,878	240,982	2047/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 3.25	3.25	800	879	112,816	2021/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 3.5	3.5	1,500	1,599	205,148	2020/7/15	
		NETHERLANDS GOVT 3.75	3.75	1,000	1,169	150,040	2023/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 3.75	3.75	1,500	2,415	309,811	2042/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 4	4.0	1,400	2,166	277,941	2037/1/15	
		NETHERLANDS GOVT 5.5	5.5	700	1,027	131,841	2028/1/15	
(スペイン)	国債証券	SPANISH GOV'T 0.05	0.05	1,100	1,104	141,638	2021/1/31	
		SPANISH GOV'T 0.4	0.4	2,000	2,025	259,874	2022/4/30	
		SPANISH GOV'T 0.75	0.75	2,000	2,045	262,355	2021/7/30	
		SPANISH GOV'T 1.15	1.15	2,000	2,046	262,573	2020/7/30	
		SPANISH GOV'T 1.3	1.3	2,000	2,031	260,554	2026/10/31	
		SPANISH GOV'T 1.4	1.4	2,000	2,040	261,755	2020/1/31	
		SPANISH GOV'T 1.4	1.4	1,200	1,206	154,730	2028/4/30	
		SPANISH GOV'T 1.4	1.4	1,200	1,198	153,789	2028/7/30	
		SPANISH GOV'T 1.45	1.45	1,000	1,014	130,169	2027/10/31	
		SPANISH GOV'T 1.5	1.5	1,500	1,534	196,807	2027/4/30	
		SPANISH GOV'T 1.6	1.6	2,200	2,315	297,052	2025/4/30	
		SPANISH GOV'T 1.95	1.95	2,200	2,347	301,149	2026/4/30	
		SPANISH GOV'T 1.95	1.95	2,000	2,066	265,039	2030/7/30	
		SPANISH GOV'T 2.15	2.15	2,000	2,167	278,080	2025/10/31	
		SPANISH GOV'T 2.35	2.35	1,000	1,051	134,904	2033/7/30	
		SPANISH GOV'T 2.7	2.7	100	101	13,083	2048/10/31	
		SPANISH GOV'T 2.75	2.75	2,100	2,352	301,792	2024/10/31	
		SPANISH GOV'T 2.9	2.9	1,800	1,930	247,695	2046/10/31	
		SPANISH GOV'T 3.45	3.45	1,100	1,258	161,437	2066/7/30	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末		
				利	率	額	評 価 額		償 還 年 月 日
							面	金	
			SPANISH GOV T 3.8	3.8	1,900		2,223	285,229	2024/4/30
			SPANISH GOV T 4	4.0	2,500		2,650	339,942	2020/4/30
			SPANISH GOV T 4.2	4.2	1,850		2,438	312,796	2037/1/31
			SPANISH GOV T 4.3	4.3	550		572	73,438	2019/10/31
			SPANISH GOV T 4.4	4.4	2,000		2,382	305,565	2023/10/31
			SPANISH GOV T 4.65	4.65	2,800		3,488	447,568	2025/7/30
			SPANISH GOV T 4.7	4.7	1,900		2,689	345,005	2041/7/30
			SPANISH GOV T 4.8	4.8	2,000		2,434	312,256	2024/1/31
			SPANISH GOV T 4.85	4.85	2,000		2,189	280,804	2020/10/31
			SPANISH GOV T 4.9	4.9	1,900		2,745	352,214	2040/7/30
			SPANISH GOV T 5.15	5.15	1,100		1,477	189,563	2028/10/31
			SPANISH GOV T 5.15	5.15	1,200		1,815	232,940	2044/10/31
			SPANISH GOV T 5.4	5.4	2,500		3,031	388,928	2023/1/31
			SPANISH GOV T 5.5	5.5	2,700		3,060	392,573	2021/4/30
			SPANISH GOV T 5.75	5.75	1,900		2,813	360,942	2032/7/30
			SPANISH GOV T 5.85	5.85	2,200		2,602	333,822	2022/1/31
			SPANISH GOV T 5.9	5.9	2,500		3,387	434,484	2026/7/30
			SPANISH GOV T 6	6.0	2,200		3,146	403,591	2029/1/31
(ベルギー)	国債証券	BELGIAN 0326 4		4.0	1,000		1,364	175,070	2032/3/28
		BELGIAN 0.8		0.8	1,800		1,863	239,059	2025/6/22
		BELGIAN 0.8		0.8	700		711	91,259	2027/6/22
		BELGIAN 0.8		0.8	500		502	64,506	2028/6/22
		BELGIAN 0291 5.5		5.5	2,000		2,867	367,860	2028/3/28
		BELGIAN 0304 5		5.0	1,800		2,783	357,019	2035/3/28
		BELGIAN 0308 4		4.0	1,500		1,716	220,207	2022/3/28
		BELGIAN 0318 3.75		3.75	1,600		1,723	221,125	2020/9/28
		BELGIAN 0320 4.25		4.25	1,700		2,564	328,980	2041/3/28
		BELGIAN 0321 4.25		4.25	1,300		1,470	188,653	2021/9/28
		BELGIAN 0324 4.5		4.5	1,000		1,295	166,164	2026/3/28
		BELGIAN 0325 4.25		4.25	1,700		1,994	255,818	2022/9/28
		BELGIAN 0328 2.25		2.25	1,500		1,664	213,551	2023/6/22
		BELGIAN 0332 2.6		2.6	500		569	73,070	2024/6/22
		BELGIAN 0333 3		3.0	500		622	79,903	2034/6/22
		BELGIAN 0338 0.5		0.5	1,000		1,019	130,827	2024/10/22
		BELGIAN 0338 2.25		2.25	500		536	68,826	2057/6/22
		BELGIAN 1		1.0	1,400		1,457	186,980	2026/6/22
		BELGIAN 1		1.0	1,300		1,295	166,171	2031/6/22
		BELGIAN 1.25		1.25	400		404	51,889	2033/4/22
		BELGIAN 1.6		1.6	500		485	62,227	2047/6/22
		BELGIAN 1.9		1.9	700		750	96,251	2038/6/22
		BELGIAN 2.15		2.15	500		513	65,864	2066/6/22
		BELGIAN 3.75		3.75	900		1,303	167,173	2045/6/22
(オーストリア)	国債証券	REP OF AUSTRIA 0		—	1,100		1,108	142,243	2023/7/15
		REP OF AUSTRIA 0.5		0.5	2,000		2,015	258,512	2027/4/20

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				0.75	1,400	1,446	185,577	2026/10/20
				0.75	200	204	26,214	2028/2/20
				1.2	400	428	54,941	2025/10/20
				1.5	500	516	66,205	2047/2/20
				1.5	200	187	24,057	2086/11/2
				1.65	1,500	1,645	211,094	2024/10/21
				1.75	1,000	1,093	140,251	2023/10/20
				2.4	600	721	92,614	2034/5/23
				3.15	500	707	90,699	2044/6/20
				3.4	600	688	88,305	2022/11/22
				3.5	1,000	1,110	142,501	2021/9/15
				3.65	1,000	1,135	145,714	2022/4/20
				3.8	500	870	111,618	2062/1/26
				3.9	1,500	1,606	206,124	2020/7/15
				4.15	1,300	1,966	252,305	2037/3/15
				4.85	1,000	1,333	171,110	2026/3/15
				6.25	1,000	1,495	191,883	2027/7/15
(フィンランド)	国債証券			0.5	100	99	12,761	2028/9/15
				0.75	500	499	64,132	2031/4/15
				1.125	200	205	26,425	2034/4/15
				1.5	1,000	1,074	137,825	2023/4/15
				1.625	1,000	1,072	137,612	2022/9/15
				2.0	1,000	1,109	142,345	2024/4/15
				2.625	500	666	85,477	2042/7/4
				2.75	600	725	93,105	2028/7/4
				3.375	700	736	94,528	2020/4/15
				3.5	1,000	1,093	140,283	2021/4/15
				4.0	1,000	1,254	160,922	2025/7/4
(アイルランド)	国債証券			—	400	400	51,405	2022/10/18
				0.8	700	721	92,583	2022/3/15
				0.9	700	697	89,475	2028/5/15
				1.0	1,000	1,026	131,738	2026/5/15
				1.7	300	304	39,073	2037/5/15
				2.0	1,000	1,044	134,038	2045/2/18
				2.4	600	678	87,027	2030/5/15
				3.4	1,000	1,167	149,764	2024/3/18
				3.9	500	583	74,841	2023/3/20
				4.5	990	1,056	135,490	2020/4/18
				5.0	1,000	1,101	141,292	2020/10/18
				5.4	1,500	1,958	251,233	2025/3/13
	小	計		—	—	—	65,235,765	—
(イギリス)	国債証券			0.5	千英ポンド 1,200	千英ポンド 1,188	169,781	2022/7/22
				0.75	300	298	42,630	2023/7/22

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末	
				利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		UK TSY GILT 1.25	1.25	1,700	1,715	245,020	2027/7/22	
		UK TSY GILT 1.5	1.5	2,900	2,947	420,920	2021/1/22	
		UK TSY GILT 1.5	1.5	2,250	2,327	332,408	2026/7/22	
		UK TSY GILT 1.5	1.5	1,700	1,590	227,114	2047/7/22	
		UK TSY GILT 1.625	1.625	1,400	1,450	207,090	2028/10/22	
		UK TSY GILT 1.625	1.625	450	442	63,237	2071/10/22	
		UK TSY GILT 1.75	1.75	3,000	3,105	443,524	2022/9/7	
		UK TSY GILT 1.75	1.75	1,300	1,310	187,121	2037/9/7	
		UK TSY GILT 1.75	1.75	500	495	70,773	2049/1/22	
		UK TSY GILT 2	2.0	2,100	2,142	306,037	2020/7/22	
		UK TSY GILT 2	2.0	2,100	2,242	320,271	2025/9/7	
		UK TSY GILT 2.25	2.25	2,700	2,873	410,405	2023/9/7	
		UK TSY GILT 2.5	2.5	1,600	2,026	289,412	2065/7/22	
		UK TSY GILT 2.75	2.75	1,700	1,873	267,544	2024/9/7	
		UK TSY GILT 3.25	3.25	2,100	2,712	387,331	2044/1/22	
		UK TSY GILT 3.5	3.5	2,300	3,109	444,106	2045/1/22	
		UK TSY GILT 3.5	3.5	2,000	3,214	459,032	2068/7/22	
		UK TSY GILT 3.75	3.75	2,000	2,103	300,410	2020/9/7	
		UK TSY GILT 3.75	3.75	1,650	1,784	254,844	2021/9/7	
		UK TSY GILT 3.75	3.75	1,600	2,421	345,882	2052/7/22	
		UK TSY GILT 4	4.0	1,500	1,654	236,321	2022/3/7	
		UK TSY GILT 4	4.0	1,700	2,867	409,472	2060/1/22	
		UK TSY GILT 4.25	4.25	1,100	1,394	199,194	2027/12/7	
		UK TSY GILT 4.25	4.25	1,400	1,879	268,450	2032/6/7	
		UK TSY GILT 4.25	4.25	1,700	2,368	338,207	2036/3/7	
		UK TSY GILT 4.25	4.25	1,100	1,583	226,208	2039/9/7	
		UK TSY GILT 4.25	4.25	1,600	2,332	333,152	2040/12/7	
		UK TSY GILT 4.25	4.25	1,700	2,615	373,582	2046/12/7	
		UK TSY GILT 4.25	4.25	1,400	2,225	317,793	2049/12/7	
		UK TSY GILT 4.25	4.25	1,700	2,882	411,645	2055/12/7	
		UK TSY GILT 4.5	4.5	700	986	140,824	2034/9/7	
		UK TSY GILT 4.5	4.5	1,800	2,761	394,439	2042/12/7	
		UK TSY GILT 4.75	4.75	1,250	1,718	245,500	2030/12/7	
		UK TSY GILT 4.75	4.75	1,300	1,974	281,976	2038/12/7	
		UK TSY GILT 5	5.0	1,600	1,991	284,396	2025/3/7	
		UK TSY GILT 6	6.0	600	869	124,209	2028/12/7	
		UK TSY GILT 8	8.0	1,620	1,910	272,887	2021/6/7	
	小	計	—	—	—	11,053,163	—	
(スウェーデン)	国債証券	SWEDISH GOVRNMNT 1	1.0	7,200	7,589	95,095	2026/11/12	
		SWEDISH GOVRNMNT 1.5	1.5	7,000	7,523	94,272	2023/11/13	
		SWEDISH GOVRNMNT 2.5	2.5	5,000	5,747	72,011	2025/5/12	
		SWEDISH GOVRNMNT 3.5	3.5	10,300	11,633	145,766	2022/6/1	
		SWEDISH GOVRNMNT 3.5	3.5	5,000	7,081	88,729	2039/3/30	

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末								
				利	率	額	面	金	額	額	償	還	年	月	日
		SWEDISH GOVRMNT	5	5.0	8,600	9,521	119,298	2020/12/1							
	小	計		—	—	—	615,175	—							
(ノルウェー)	国債証券	NORWEGIAN GOV'T 1.5		1.5	5,000	4,929	64,872	2026/2/19							
		NORWEGIAN GOV'T 1.75		1.75	5,000	5,035	66,267	2025/3/13							
		NORWEGIAN GOV'T 2		2.0	7,900	8,090	106,469	2023/5/24							
		NORWEGIAN GOV'T 2		2.0	2,000	2,025	26,649	2028/4/26							
		NORWEGIAN GOV'T 3		3.0	4,000	4,296	56,543	2024/3/14							
		NORWEGIAN GOV'T 3.75		3.75	6,000	6,366	83,776	2021/5/25							
	小	計		—	—	—	404,577	—							
(デンマーク)	国債証券	DENMARK - BULLET 0.25		0.25	3,500	3,556	61,104	2020/11/15							
		DENMARK - BULLET 0.5		0.5	1,000	1,022	17,569	2027/11/15							
		DENMARK - BULLET 1.5		1.5	5,000	5,429	93,278	2023/11/15							
		DENMARK - BULLET 1.75		1.75	11,000	12,333	211,884	2025/11/15							
		DENMARK - BULLET 3		3.0	7,000	7,715	132,550	2021/11/15							
		DENMARK - BULLET 4		4.0	1,000	1,041	17,896	2019/11/15							
		DENMARK - BULLET 4.5		4.5	12,500	21,705	372,891	2039/11/15							
	小	計		—	—	—	907,176	—							
(ポーランド)	国債証券	POLAND GOVT BOND 1.5		1.5	2,300	2,306	68,936	2020/4/25							
		POLAND GOVT BOND 1.75		1.75	3,000	3,003	89,768	2021/7/25							
		POLAND GOVT BOND 2		2.0	2,000	2,010	60,078	2021/4/25							
		POLAND GOVT BOND 2.5		2.5	4,500	4,422	132,191	2026/7/25							
		POLAND GOVT BOND 2.5		2.5	2,000	1,950	58,309	2027/7/25							
		POLAND GOVT BOND 3.25		3.25	6,300	6,457	193,014	2025/7/25							
		POLAND GOVT BOND 4		4.0	1,500	1,611	48,152	2023/10/25							
		POLAND GOVT BOND 5.25		5.25	2,000	2,140	63,964	2020/10/25							
		POLAND GOVT BOND 5.75		5.75	4,000	4,432	132,472	2021/10/25							
		POLAND GOVT BOND 5.75		5.75	4,200	4,768	142,515	2022/9/23							
		POLAND GOVT BOND 5.75		5.75	1,000	1,241	37,093	2029/4/25							
	小	計		—	—	—	1,026,498	—							
(オーストラリア)	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 1.75		1.75	3,000	2,986	243,010	2020/11/21							
		AUSTRALIAN GOVT. 2		2.0	1,000	1,000	81,433	2021/12/21							
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25		2.25	400	403	32,825	2022/11/21							
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25		2.25	2,300	2,263	184,152	2028/5/21							
		AUSTRALIAN GOVT. 2.5		2.5	400	400	32,586	2030/5/21							
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75		2.75	2,500	2,572	209,327	2024/4/21							
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75		2.75	2,000	2,053	167,048	2027/11/21							
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75		2.75	1,800	1,845	150,170	2028/11/21							
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75		2.75	1,500	1,540	125,359	2029/11/21							
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75		2.75	800	802	65,322	2035/6/21							
		AUSTRALIAN GOVT. 3		3.0	1,100	1,102	89,663	2047/3/21							

外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末										
				利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
		AUSTRALIAN GOVT.	3.25	3.25	2,300			2,435	198,187	2025/4/21							
		AUSTRALIAN GOVT.	3.25	3.25	1,900			2,039	165,945	2029/4/21							
		AUSTRALIAN GOVT.	3.25	3.25	1,000			1,060	86,314	2039/6/21							
		AUSTRALIAN GOVT.	3.75	3.75	1,200			1,363	110,929	2037/4/21							
		AUSTRALIAN GOVT.	4.25	4.25	3,300			3,727	303,284	2026/4/21							
		AUSTRALIAN GOVT.	4.5	4.5	1,100			1,136	92,428	2020/4/15							
		AUSTRALIAN GOVT.	4.5	4.5	1,600			1,961	159,582	2033/4/21							
		AUSTRALIAN GOVT.	4.75	4.75	2,600			3,063	249,231	2027/4/21							
		AUSTRALIAN GOVT.	5.5	5.5	2,500			2,856	232,384	2023/4/21							
		AUSTRALIAN GOVT.	5.75	5.75	2,800			3,047	247,957	2021/5/15							
		AUSTRALIAN GOVT.	5.75	5.75	3,000			3,390	275,810	2022/7/15							
	小	計		—	—			—	3,502,956	—							
(シンガポール)	国債証券	SINGAPORE GOVT	2.25	2.25	1,100	千シンガポールドル	千シンガポールドル	1,107	91,324	2021/6/1							
		SINGAPORE GOVT	2.75	2.75	1,000			1,029	84,924	2023/7/1							
		SINGAPORE GOVT	2.75	2.75	400			410	33,873	2042/4/1							
		SINGAPORE GOVT	2.75	2.75	700			716	59,124	2046/3/1							
		SINGAPORE GOVT	2.875	2.875	600			631	52,081	2030/9/1							
		SINGAPORE GOVT	3	3.0	300			314	25,914	2024/9/1							
		SINGAPORE GOVT	3.125	3.125	1,000			1,040	85,782	2022/9/1							
		SINGAPORE GOVT	3.25	3.25	800			817	67,383	2020/9/1							
		SINGAPORE GOVT	3.375	3.375	500			554	45,758	2033/9/1							
		SINGAPORE GOVT	3.5	3.5	1,400			1,538	126,913	2022/7/1							
	小	計		—	—			—	673,081	—							
(マレーシア)	国債証券	MALAYSIA GOVT	3.418	3.418	5,000	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	4,938	133,845	2022/8/15							
		MALAYSIA GOVT	3.502	3.502	9,100			8,663	234,770	2027/5/31							
		MALAYSIA GOVT	4.378	4.378	6,500			6,553	177,604	2019/11/29							
		MALAYSIA GOVT	4.498	4.498	5,000			5,050	136,865	2030/4/15							
		MALAYSIA GOVT	4.736	4.736	3,000			2,907	78,787	2046/3/15							
	小	計		—	—			—	761,873	—							
(南アフリカ)	国債証券	REP SOUTH AFRICA	6.5	6.5	65,000	千南アフリカランド	千南アフリカランド	43,875	346,173	2041/2/28							
		REP SOUTH AFRICA	6.75	6.75	22,000			21,723	171,401	2021/3/31							
		REP SOUTH AFRICA	7	7.0	63,000			50,362	397,357	2031/2/28							
		REP SOUTH AFRICA	8	8.0	6,000			5,292	41,758	2030/1/31							
	小	計		—	—			—	956,691	—							
	合	計		—	—			—	166,677,841	—							

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

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2018年12月17日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	166,677,841	97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,536,958	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	171,214,799	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※期末における外貨建資産（171,030,817千円）の投資信託財産総額（171,214,799千円）に対する比率は99.9%です。

※外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=113.47円、1カナダドル=84.80円、1メキシコペソ=5.64円、1ユーロ=128.28円、1英ポンド=142.82円、1スウェーデンクローナ=12.53円、1ノルウェークローネ=13.16円、1デンマーククローネ=17.18円、1ポーランドズロチ=29.89円、1オーストラリアドル=81.36円、1シンガポールドル=82.47円、1マレーシアリングギット=27.10円、1南アフリカランド=7.89円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2018年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	173,987,375,870円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	481,703,976
公 社 債(評価額)	166,677,841,454
未 収 入 金	5,524,436,188
未 収 利 息	1,272,190,048
前 払 費 用	31,204,204
(B) 負 債	5,093,070,763
未 払 金	2,772,888,210
未 払 解 約 金	2,320,178,213
そ の 他 未 払 費 用	4,340
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	168,894,305,107
元 本	96,220,120,290
次 期 繰 越 損 益 金	72,674,184,817
(D) 受 益 権 総 口 数	96,220,120,290口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,553円

※当期における期首元本額109,632,576,441円、期中追加設定元本額6,453,267,073円、期中一部解約元本額19,865,723,224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2017年12月19日 至2018年12月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,421,645,472円
受 取 利 息	4,421,957,843
支 払 利 息	△ 312,371
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 8,390,674,558
売 買 益	1,173,908,197
売 買 損	△ 9,564,582,755
(C) 信 託 報 酬 等	△ 69,869,829
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 4,038,898,915
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	86,579,816,258
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,789,174,741
(G) 解 約 差 損 益 金	△14,655,907,267
(H) 計 (D+E+F+G)	72,674,184,817
次 期 繰 越 損 益 金(H)	72,674,184,817

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	10,560,536,835円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,634,134,044円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	554,981,860円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,118,348,717円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,516,082,759円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,000,329,579円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	773,983,428円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,309,441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)	9,185,952円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	11,734,925,595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)	32,173,453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)	834,753,818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)	86,784,416円	三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,743,566,951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)	96,489,932円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	201,180,452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)	50,853,340円	SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	482,946,071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)	119,916,910円	三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,602,285,947円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	14,936,786円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	158,765,980円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	63,685,311円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	42,642,821円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	180,813,690円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	14,415,303円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	286,012,337円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	154,553,068円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,247,019円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	575,923,329円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	28,706,099円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	187,653,987円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	19,953,597円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	178,937,055円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	42,385,475円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	54,605,679円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	19,177,877円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,141,130円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	12,207,524円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,432,790,555円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	17,457,257円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	23,188,295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>	2,126,900,904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>	3,987,530,729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>	159,425,172円	SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	1,806,119,969円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	12,246,477,953円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,414,338,550円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,926,974,285円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	749,089,023円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	13,384,699,436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>	28,771,508円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	42,432,859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>	43,259,298円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	109,586,916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>	475,549,050円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	544,270円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	227,852,361円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	801,961,439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>	561,077,401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>	123,320,327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<適格機関投資家限定>	25,855円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,328,213,311円		

■ お知らせ

<約款変更について>

- ・「運用の基本方針」記載のベンチマークの名称変更に伴う所要の変更を行いました。
(適用日：2018年1月16日)
- ・受益者に対してする公告を電子公告の方法によるものとするため、所要の変更を行いました。
(適用日：2018年2月1日)
- ・一般社団法人投資信託協会規則の「信用リスク集中回避のための投資制限」に適合するよう、所要の変更を行いました。
(適用日：2018年3月16日)

マネーインカム・マザーファンド

第11期（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

信託期間	無期限（設定日：2008年3月31日）
運用方針	主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比	純総資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
7期（2015年4月13日）	円	%		%	%	百万円
8期（2016年4月13日）	10,122	0.1	100.93	0.1	96.9	1,498
9期（2017年4月13日）	10,124	0.0	101.01	0.1	64.1	1,306
10期（2018年4月13日）	10,115	△0.1	100.97	△0.0	76.0	1,323
11期（2019年4月15日）	10,108	△0.1	100.92	△0.0	75.0	2,421
	10,101	△0.1	100.85	△0.1	72.5	2,495

※無担保コール翌日物は、設定時を100として日々の無担保コール翌日物で運用したと仮定した当社計算値です。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

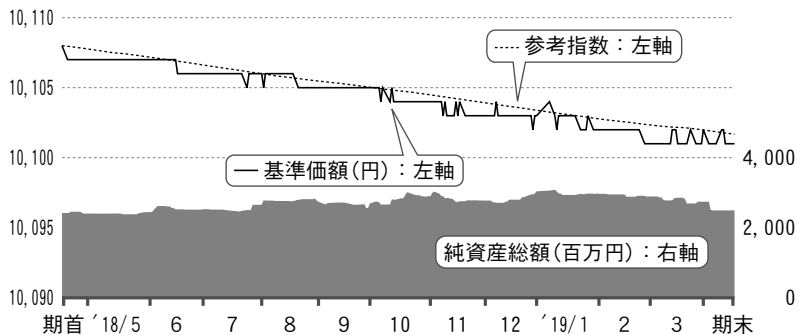
年月日	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2018年4月13日	円	%		%	%
4月末	10,108	—	100.92	—	75.0
5月末	10,107	△0.0	100.91	△0.0	75.4
6月末	10,107	△0.0	100.91	△0.0	70.0
7月末	10,106	△0.0	100.90	△0.0	68.9
8月末	10,106	△0.0	100.90	△0.0	69.4
9月末	10,105	△0.0	100.89	△0.0	74.6
10月末	10,105	△0.0	100.89	△0.0	72.2
11月末	10,104	△0.0	100.88	△0.0	70.7
12月末	10,103	△0.0	100.88	△0.0	73.7
2019年1月末	10,103	△0.0	100.87	△0.0	67.2
2月末	10,102	△0.1	100.86	△0.1	68.9
3月末	10,101	△0.1	100.86	△0.1	60.3
(期末) 2019年4月15日	10,102	△0.1	100.86	△0.1	69.6
	10,101	△0.1	100.85	△0.1	72.5

※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（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

基準価額等の推移



期首	10,108円
期末	10,101円
騰落率	-0.1%

※参考指数は、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。

※当ファンドの参考指数は、無担保コール翌日物です。

※無担保コール翌日物は、設定時を100として日々の無担保コール翌日物で運用したと仮定した当社計算値です。

▶ 基準価額の主な変動要因（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

当ファンドは、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

下落要因

- ・日銀によるマイナス金利政策が継続され、主要投資対象である短期公社債や短期金融商品におけるマイナス利回りが続いたこと

▶ 投資環境について (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

当期の短期金利は小幅低下し、マイナス圏での推移が継続しました。

物価上昇率が目標とする2%まで乖離がある状態が続いたことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。

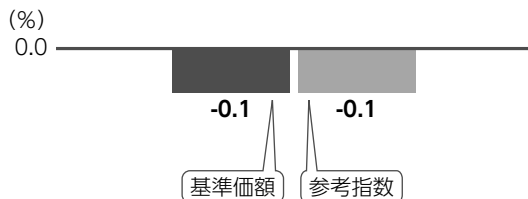
日銀は需給動向を勘案しながら短期国債の買入れを調整したことから、国庫短期証券3ヵ月物利回りはマイナス圏でのレンジ推移となりました。国庫短期証券3ヵ月物利回りは期首-0.180%に対し、期末には-0.190%へ小幅低下しました。

▶ ポートフォリオについて (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、残存0年から1年3ヵ月の円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを継続しました。また、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮しながら、短期公社債の組入れを行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

基準価額と参考指数の対比 (騰落率)



当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数として無担保コール翌日物を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

2 今後の運用方針

日銀によるマイナス金利政策が継続され、短期国債利回りやコールローン翌日物金利など、主要投資対象である短期公社債および短期金融商品の利回りは引き続きマイナスで推移しています。

残存0年から1年3ヵ月の公社債や短期金融商品で利回りのマイナス幅が小さい投資対象を選定し、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮して運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細 (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用 (その他)	2円 (2)	0.015% (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 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	2	0.015	

期中の平均基準価額は10,104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 (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	特殊債券	2,122,845	200,278 (1,901,000)

※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。

※（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	うち利害関係人 との取引状況D	D/C		
公社債	百万円 2,122	百万円 100	% 4.7	百万円 200	百万円 -	% -

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2018年4月14日から2019年4月15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 (2019年4月15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	%	%	%	%	%
特殊債券(除く金融債)	1,796,600 (1,796,600)	1,809,408 (1,809,408)	72.5 (72.5)	— (—)	— (—)	— (—)	72.5 (72.5)
合 計	1,796,600 (1,796,600)	1,809,408 (1,809,408)	72.5 (72.5)	— (—)	— (—)	— (—)	72.5 (72.5)

※()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。

※—印は組入れなし。

B 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債

種 類	銘 柄	期			末
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
特殊債券(除く金融債)	第5回 政府保証阪神高速道路株式会社債券	1.3	64,600	65,404	2020/3/18
	第6回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	1.2	100,000	100,835	2019/12/16
	第82回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	131,000	131,408	2019/6/28
	第85回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	100,423	2019/7/31
	第89回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	100,619	2019/9/30
	第91回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	300,000	302,034	2019/10/31
	第93回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	201,000	202,813	2019/11/29
	第95回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	100,873	2019/12/27
	第98回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	101,072	2020/1/31
	第8回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	101,031	2020/1/20
	第10回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	101,226	2020/3/13
	第203回 政府保証預金保険機構債	0.1	100,000	100,109	2020/1/17
	第3回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	300,000	301,560	2019/8/16
	合 計		—	1,796,600	1,809,408

※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

(2019年4月15日現在)

項 目	期		末
	評 価 額	比 率	
	千円	%	
公 社 債	1,809,408	72.5	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	686,411	27.5	
投 資 信 託 財 産 総 額	2,495,819	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

(2019年4月15日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	2,495,819,787円
コ ー ル ・ ロ ー ン 債 (評価額)	682,225,729
公 社 債 (評価額)	1,809,408,010
未 収 利 息	3,743,916
前 払 費 用	442,132
(B) 負 債	87,685
未 払 解 約 金 息	70,000
未 払 利 息	155
そ の 他 未 払 費 用	17,530
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,495,732,102
元 本	2,470,784,621
次 期 繰 越 損 益 金	24,947,481
(D) 受 益 権 総 口 数	2,470,784,621口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,101円

※当期における期首元本額2,395,913,189円、期中追加設定元本額2,164,761,637円、期中一部解約元本額2,089,890,205円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	14,875,223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)	79,155,853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)	56,665,796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)	14,490,786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)	16,880,283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)	8,805,949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)	20,734,392円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	699,943,772円
SMAM・バランス先物ファンドVA20<適格機関投資家限定>	492,643,108円
SMAM・FGマネーファンドVA<適格機関投資家限定>	1,066,192,947円

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

■ お知らせ

<約款変更について>

- ・一般社団法人投資信託協会規則の「信用リスク集中回避のための投資制限」に適合するよう、所要の変更を行いました。

(適用日：2018年4月20日)

- ・委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

(適用日：2019年4月1日)

■ 損益の状況

(自2018年4月14日 至2019年4月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	26,292,005円
受 取 利 息	26,682,079
支 払 買 入 損 益	△ 390,074
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△27,721,660
売 買 損 益	△27,721,660
(C) 信 託 報 酬 等	△ 421,327
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 1,850,982
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	25,804,967
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	22,603,367
(G) 解 約 差 損 益 金	△21,609,871
(H) 計 (D + E + F + G)	24,947,481
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	24,947,481

※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。