

<訂正のお知らせとお詫び>

「三井住友・DC つみたてNISA・世界分散ファンド」の運用報告書（全体版）におきまして、第1期から第3期にわたり誤記載がございました。

ここに深くお詫び申し上げますとともに、下記の通り訂正させていただきます（下線部が訂正箇所です）。

記

第1期（2017年10月3日から2018年9月10日まで）

P17. 利害関係人との取引状況等（2017年10月3日から2018年9月10日まで）

（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

Jリート・インデックス・マザーファンド

正

種類	買付額
投資信託証券	百万円 <u>75</u>

誤

種類	買付額
投資信託証券	百万円 <u>36</u>

Jリート・インデックス・マザーファンド 第27期（2018年2月27日から2018年8月27日まで）

P168. 利害関係人との取引状況等（2018年2月27日から2018年8月27日まで）

（2）利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

正

種類	買付額
投資信託証券	百万円 <u>68</u>

誤

種類	買付額
投資信託証券	百万円 <u>36</u>

第2期（2018年9月11日から2019年9月10日まで）

P18. 利害関係人との取引状況等（2018年9月11日から2019年9月10日まで）

（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

Jリート・インデックス・マザーファンド

正

種類	買付額
投資信託証券	百万円 <u>188</u>

誤

種類	買付額
投資信託証券	百万円 <u>172</u>

第3期（2019年9月11日から2020年9月10日まで）

P18. 利害関係人との取引状況等（2019年9月11日から2020年9月10日まで）

（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

Jリート・インデックス・マザーファンド

正

種類	買付額
投資信託証券	百万円 <u>201</u>

誤

種類	買付額
投資信託証券	百万円 <u>182</u>

Jリート・インデックス・マザーファンド 第31期（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

P191. 利害関係人との取引状況等（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

（2）利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

正

種類	買付額
投資信託証券	百万円 <u>74</u>

誤

種類	買付額
投資信託証券	百万円 <u>72</u>

以上

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/資産複合/インデックス型		
信託期間	無期限(設定日:2017年10月3日)		
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。		
主要投資対象	マザーファンド	対象指数	基本資産 配分比率
	国内債券パッシブ・マザーファンド	NOMURA-BPI(総合)	15%
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	5%
	外国債券パッシブ・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	20%
	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	TOPIX(東証株価指数、配当込み)	10%
	外国株式インデックス・マザーファンド	MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)	20%
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	10%
	リート・インデックス・マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	5%
	外国リート・インデックス・マザーファンド	S&P先産国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)	15%
	当ファンドの運用方法	<ul style="list-style-type: none"> ■マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資します。 ■各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ■実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対円で為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として為替ヘッジは行いません。 	
組入制限	当ファンド	<ul style="list-style-type: none"> ■株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 	
	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。 	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・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。 	
	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。 	
	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。 	
	エマージング株式インデックス・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。 	
	リート・インデックス・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資は行いません。 ■外貨建資産への投資は行いません。 	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資は行いません。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 	
	年1回(原則として毎年9月10日。休業日の場合は翌営業日)決算を行い、分配金額を決定します。		
	分配方針	<ul style="list-style-type: none"> ■分配対象額は、経費控除後の剰子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 	
		<p>ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)</p>	

三井住友・ DCつみたてNISA・ 世界分散ファンド

【運用報告書(全体版)】

(2018年9月11日から2019年9月10日まで)

第 2 期

決算日 2019年9月10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、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

 **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)

■ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) 合成指数		株式組入率	株式先物率 比 (買建-売建)	債券組入率 比	投資信託 証券組入率 比	純資産額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率					
(設定日) 2017年10月3日	円 10,000	円 -	% -	100.00	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 0.1
1期(2018年9月10日)	10,051	0	0.5	101.75	1.8	33.2	5.4	39.6	20.3	115
2期(2019年9月10日)	10,442	0	3.9	106.37	4.5	33.6	5.5	38.8	20.7	295

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※ベンチマークは、NOMURA-BPI(総合)15%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)5%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)20%、TOPIX(東証株価指数、配当込み)10%、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)20%、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)10%、東証REIT指数(配当込み)5%およびS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)15%の割合で組み合わせた合成指数で、設定時を100として2019年9月10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。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) 合成指数		株式組入率	株式先物率 比 (買建-売建)	債券組入率 比	投資信託 証券組入率 比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率				
(期首) 2018年9月10日	円 10,051	% -	101.75	% -	33.2	% 5.4	39.6	% 20.3
9月末	10,341	2.9	104.69	2.9	33.7	5.9	39.1	19.8
10月末	9,883	△1.7	100.00	△1.7	32.5	6.1	39.4	20.3
11月末	10,083	0.3	102.14	0.4	32.9	6.4	39.0	20.2
12月末	9,565	△4.8	96.90	△4.8	32.3	6.4	40.2	19.6
2019年1月末	9,950	△1.0	100.85	△0.9	32.7	6.2	38.7	20.9
2月末	10,191	1.4	103.46	1.7	32.2	7.1	43.4	20.1
3月末	10,308	2.6	104.74	2.9	31.9	6.8	39.3	20.4
4月末	10,430	3.8	106.04	4.2	32.6	6.2	42.5	20.3
5月末	10,098	0.5	102.65	0.9	31.8	6.7	43.3	20.1
6月末	10,302	2.5	104.79	3.0	32.4	6.7	43.5	20.0
7月末	10,430	3.8	106.23	4.4	32.4	6.4	43.2	20.3
8月末	10,261	2.1	104.51	2.7	33.3	5.3	38.9	20.6
(期末) 2019年9月10日	10,442	3.9	106.37	4.5	33.6	5.5	38.8	20.7

※騰落率は期首比です。

※各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9月11日から2019年9月10日まで)

基準価額等の推移



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

期首	10,051円
期末	10,442円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+3.9% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

※ベンチマークは、NOMURA-BPI(総合)15%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)5%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)20%、TOPIX(東証株価指数、配当込み)10%、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)20%、MSCIエマーGING・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)10%、東証REIT指数(配当込み)5%およびS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)15%を基本資産配分で組み合わせた合成指数です。

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

基準価額の主な変動要因(2018年9月11日から2019年9月10日まで)

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

上昇要因

- 期を通してみれば、海外の主要先進国の株式市場が上昇したこと
- 期を通してみれば、米国や日本の債券利回りが低下(価格は上昇)したこと
- 期を通してみれば、国内外のリート市場が上昇したこと

下落要因

- 期を通してみれば、国内および新興国の株式市場が下落したこと
- 期を通してみれば、米ドルやユーロ、新興国通貨に対して円高が進行したこと

組入れファンドの状況

組入れファンド	投資資産	騰落率	期末組入比率
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	+4.1%	14.6%
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	先進国債券 (除く日本、 為替ヘッジあり)	+8.2%	4.8%
外国債券パッシブ・マザーファンド	先進国債券 (除く日本)	+4.5%	19.7%
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	国内株式	-5.4%	9.9%
外国株式インデックス・マザーファンド	先進国株式 (除く日本)	+1.5%	20.2%
エマージング株式インデックス・マザーファンド	新興国株式	-1.9%	10.1%
Jリート・インデックス・マザーファンド	国内リート	+27.0%	4.9%
外国リート・インデックス・マザーファンド	外国リート	+8.0%	14.9%

※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9月11日から2019年9月10日まで)

海外の主要先進国株式市場は上昇しましたが、国内や新興国株式市場は下落しました。債券市場では、米欧や日本の債券利回りは低下しました。国内外のリート市場は上昇しました。外国為替市場では、米ドルやユーロなどに対して円が上昇する展開となりました。また新興国通貨は、円や米ドルなど主要通貨に対して総じて軟調な展開となりました。

株式市場

●先進国外国株式

期首から12月末にかけては、米国の利上げが継続する中、米中貿易摩擦の激化に伴い、世界経済の減速が警戒されたことなどを背景に、大幅に下落しました。年明けから4月末にかけては、FRB(米連邦準備制度理事会)が利上げを停止したことを受け、それまでの大幅な株価調整の反動や総じて堅調な企業業績などを背景に、米国を中心に海外株式は大きく上昇しました。5月に入り、米国が対中関税の引き上げを発表したことで米中貿易摩擦に対する警戒感が高まり株価は下落しました。6月から7月下旬にかけては、FRBによる金融緩和期待等もあり、米国株式を中心に先進国海外株式は底堅く推移しました。FRBは7月末に約10年半ぶりとなる利下げを実施しました。8月月初に再び米国が中国に対する追加関税の賦課を発表したことで、株価が下落しましたが、期末にかけては米中貿易交

渉に対する期待感などを背景に株価は反発しました。

当期のMSCIコクサイインデックス(配当込み、米ドルベース)で見ると、期首に比べて5.0%上昇しました。

●国内株式

国内株式市場は先進国海外株式市場に概ね連れた動きとなりました。

ただし、先進国株式に比べれば、米ドルやユーロなどの主要通貨に対して円高が進行したことで、企業業績への懸念が高まり、株価の戻りは限定的でした。

当期のTOPIX(東証株価指数、配当込み)は、期首に比べて5.5%下落しました。

●新興国株式

期首から、年末にかけては先進国株式市場に連れた動きとなり、下落しました。1月以降は、主要先進国の株価が上昇基調で推移したことに連れて上昇しました。FRBによる金融緩和観測の台頭に伴い、新興

国市場への資金流入期待が高まり、新興国株式市場は4月まで大幅に上昇しました。5月以降も概ね先進国株式市場に連れた動きとなりましたが、アルゼンチンを巡る混乱などもあり、戻りは限定的でした。

当期のMSCIエマージング・マーケット・インデックス(米ドルベース)は、期首に比べて1.2%下落しました。

債券市場

●先進国外国債券

米欧の債券市場では、期初から11月上旬にかけてはFRBの利上げ観測等を背景に、長期債利回りは上昇基調で推移しました。12月の世界的な株価下落の動きや、1月以降のFRBによる利上げの停止、その後の利下げ観測の台頭、米中貿易摩擦への懸念等を受け、先進国の債券利回りは期末まで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2.94%から期末には1.64%に低下しました。ドイツ10年国債利回りは期首0.39%から期末には-0.59%に低下しました。

●国内債券

日銀の金融緩和策が継続する中、米欧の債券利回りの低下につれて、日本の長期債利回り(10年国債利回り)は期を通じて緩やかながらも低下基調で推移しました。

当期の10年国債利回りは期首0.12%から

期末には-0.22%に低下しました。

リート市場

●グローバルリート

米国を中心に主要先進国の長期債利回りが低下基調で推移したことで、相対的に利回りの高いリート市場に資金が流入し、グローバルリート市場は、期を通して堅調に推移しました。

当期のMSCI米国REIT(不動産投資信託)インデックス(米ドルベース)は、期首に比べて10.2%上昇しました。

●国内リート

海外リート市場の上昇に加えて、日銀による金融緩和政策の継続や国内リート市場の良好な需給要因等が下支えとなり、国内リート市場は期を通じて大幅に上昇する展開となりました。

当期の市場の動きを東証REIT指数(配当込み)で見ると、期首に比べて27.1%上昇しました。

外国為替

●米ドル・円

米ドル・円相場は、期初から12月上旬にかけてはもみあい推移しました。その後、年末にかけて、世界的な株価下落の中で、米ドルは大きく下落しました、年明け以降

の株価反発の中で、4月まで再び米ドルが上昇しました。5月以降は、米中貿易摩擦に対する懸念や、FRBによる金融緩和姿勢への転換などが米ドルの上値抑制要因となり、期末まで、米ドルはじり安の展開となりました。

当期の米ドル・円は、期首110円93銭から期末107円45銭と3円48銭の米ドル安・円高となりました。

●ユーロ・円

ユーロ・円は、英国のEU(欧州連合)離脱交渉やイタリアの政局不安など欧州政治の混乱や欧州債券利回りの低下等がユーロの下押し材料となり、ユーロ・円相場は期を通じてユーロが下落する展開が続きました。

当期のユーロ・円は、期首128円27銭から期末118円67銭と9円60銭のユーロ安・円高となりました。

●新興国通貨

新興国通貨は、1月から4月にかけて世界的に株価が上昇する中で、一時的に買われる場面などもみられましたが、5月以降は米中貿易摩擦の激化に伴う新興国経済に対する悪影響が懸念材料となり、メキシコペソや人民元などの通貨が、円に対して大幅に下落するなど、新興国通貨は総じて軟調な相場展開となりました。

当期のメキシコペソ・円は期首5円75銭

から期末5円49銭と0円26銭のメキシコペソ安・円高、人民元・円は期首16円21銭から期末15円09銭と1円12銭の人民元安・円高となりました。

ポートフォリオについて(2018年9月11日から2019年9月10日まで)

当ファンド

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

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

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

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

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

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(日本除く、円ヘッジベース)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。具体的には、ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラー(ポートフォリオとベンチマークのリターン乖離)を最小化するように努めました。

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

保有する外貨建資産については、為替のフルヘッジを原則としました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

具体的には、東証1部上場銘柄のうち流動性や信用リスクを考慮して投資し、また、連動性を高めつつ、ファンドの資金流入に機動的に対応するため、株式先物の売買を行いました。

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

外国株式インデックス・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

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

また、MSCIコクサイインデックスの定期銘柄見直しに応じて、ポートフォリオの修正を行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、日々の追加設定・解約による資金変動に対しては売買にかかるコストなどを勘案し、ベンチマークに連動する先物取引を利用した組入比率の調整を実施しました。また先物取引に加えて余裕資金部分については、米ドル建て短期公社債などを組み入れました。

組入比率は期を通じて高位を保ちました。

Jリート・インデックス・マザーファンド

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

具体的には、原則として指数採用銘柄への時価構成比に応じた投資を行いました。

組入比率は期を通じて高位を保ちました。

外国リート・インデックス・マザーファンド

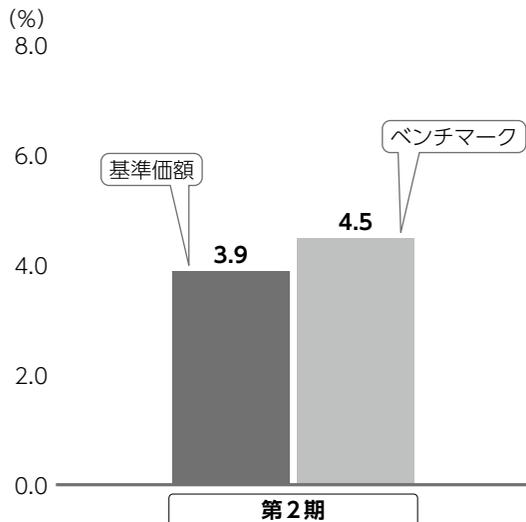
ベンチマークであるS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、原則として指数採用銘柄への時価構成比に応じた投資を行いました。

組入比率は期を通じて高位を保ちました。

ベンチマークとの差異について(2018年9月11日から2019年9月10日まで)

基準価額とベンチマークの対比(騰落率)



※基準価額は分配金再投資ベース

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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

ベンチマークとの差異の状況および要因

当期における基準価額の騰落率は+3.9%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+4.5%を0.6%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 外国リート、新興国株式、外国株式のマザーファンドなどが下方乖離したこと
- 信託報酬等の費用がかかったこと

分配金について(2018年9月11日から2019年9月10日まで)

(単位:円、1万口当たり、税引前)

項目	第2期
当期分配金	—
(対基準価額比率)	(—%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	442

※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。

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、見送りとしたしました。

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。

2 今後の運用方針

当ファンド

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

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

実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対円での為替ヘッジを行って

る場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行わない方針です。

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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

通貨に関してはフルヘッジを継続します。債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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

また月次のベンチマーク更新時や、日々の資金流出入に対応し、迅速なリバランス

を行います。

債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

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

外国株式インデックス・マザーファンド

引き続き、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

引き続き、MSCIエマージング・マー

ケット・インデックス(配当込み、円ベース)に連動する投資成果を目指して運用を行います。

株式組入比率(先物含む)は高位に保つことを基本とします。

Jリート・インデックス・マザーファンド

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

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

外国リート・インデックス・マザーファンド

引き続き、S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目指して運用を行います。採用銘柄への時価構成比に応じた投資を行うことにより、ベンチマークとの連動を目指した運用を行います。

組入比率は高位に保つことを基本とします。

3 お知らせ

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。

約款変更等のお知らせ

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)

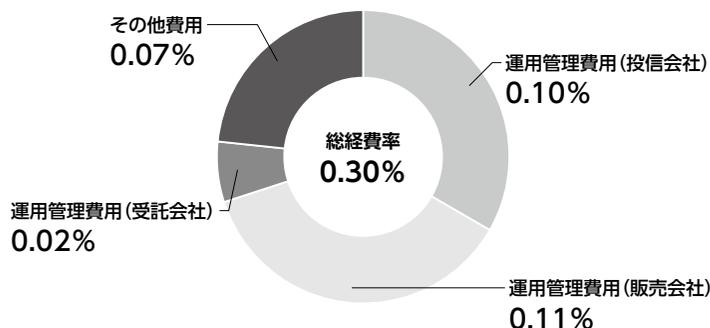
■ 1万口当たりの費用明細 (2018年9月11日から2019年9月10日まで)

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)	23円 (10) (11) (2)	0.227% (0.097) (0.108) (0.022)	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) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	4 (1) (0) (3) (1)	0.041 (0.008) (0.000) (0.026) (0.007)	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)	1 (0) (0)	0.006 (0.003) (0.003)	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)	7 (6) (1) (0)	0.067 (0.056) (0.006) (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・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	35	0.341	

期中の平均基準価額は10,153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）



※各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
 ※各比率は、年率換算した値（小数点以下第3位を四捨五入）です。
 ※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.30%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2018年9月11日から2019年9月10日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	8,022	19,832	429	1,184
外国株式インデックス・マザーファンド	10,632	36,826	498	1,815
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	5,589	7,852	242	345
外国債券パッシブ・マザーファンド	19,877	34,893	863	1,522
国内債券パッシブ・マザーファンド	20,215	25,895	1,007	1,283
Jリート・インデックス・マザーファンド	2,923	6,461	99	250
外国リート・インデックス・マザーファンド	12,047	25,269	440	917
エマージング株式インデックス・マザーファンド	15,882	20,220	926	1,229

※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9月11日から2019年9月10日まで)

項 目	当 期		
	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	外国株式インデックス・マザーファンド	エマージング株式インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	30,261,501千円	50,096,944千円	1,729,958千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	166,300,969千円	169,101,293千円	2,403,767千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.18	0.29	0.71

※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9月11日から2019年9月10日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

外国株式インデックス・マザーファンド

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

外国債券パッシブ・マザーファンド

外国リート・インデックス・マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	百万円	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	百万円	うち利害関係人との取引状況 D	D/C
株 式	17,150	百万円 533	% 3.1	13,110	百万円 2,078	% 15.9

※平均保有割合 0.0%

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
公 社 債	百万円 29,800	百万円 4,028	% 13.5	百万円 82,676	百万円 5,371	% 6.5

※平均保有割合 0.0%

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

Jリート・インデックス・マザーファンド

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
投 資 信 託 証 券	百万円 5,768	百万円 2,338	% 40.5	百万円 9,943	百万円 2,518	% 25.3

※平均保有割合 0.1%

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

エマージング株式インデックス・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	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
現 先 取 引 (公 社 債)	百万円 284,592	百万円 2,801	% 1.0	百万円 284,591	百万円 2,801	% 1.0

※平均保有割合 0.3%

※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 118	百万円 226	百万円 1,874

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 204

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 900

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

Jリート・インデックス・マザーファンド

種 類	買 付 額
投 資 信 託 証 券	百万円 172

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	80千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	3千円
(c) (b) / (a)	4.4%

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

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社三井住友銀行、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。

■ 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9月11日から2019年9月10日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2019年9月10日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首(前期末)		期 末	
	口 数	口 数	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)	4,349	11,942		29,394
外国株式インデックス・マザーファンド	6,412	16,546		59,611
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	4,144	9,490		14,091
外国債券パッシブ・マザーファンド	13,377	32,391		58,255
国内債券パッシブ・マザーファンド	13,834	33,042		43,192
Jリート・インデックス・マザーファンド	2,785	5,609		14,375
外国リート・インデックス・マザーファンド	8,256	19,863		44,085
エマージング株式インデックス・マザーファンド	8,621	23,577		29,893

※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)	67,012,358千口	外国株式インデックス・マザーファンド	49,466,918千口
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	17,979,833千口	外国債券パッシブ・マザーファンド	85,552,532千口
国内債券パッシブ・マザーファンド	112,020,381千口	Jリート・インデックス・マザーファンド	3,086,904千口
外国リート・インデックス・マザーファンド	2,482,007千口	エマージング株式インデックス・マザーファンド	5,738,111千口

※単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2019年9月10日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	29,394	9.9
外国株式インデックス・マザーファンド	59,611	20.1
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	14,091	4.8
外国債券パッシブ・マザーファンド	58,255	19.6
国内債券パッシブ・マザーファンド	43,192	14.6
Jリート・インデックス・マザーファンド	14,375	4.8
外国リート・インデックス・マザーファンド	44,085	14.9
エマージング株式インデックス・マザーファンド	29,893	10.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,626	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	296,522	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（178,182,197千円）の投資信託財産総額（178,315,086千円）に対する比率は99.9%です。

※ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（26,900,249千円）の投資信託財産総額（27,633,950千円）に対する比率は97.3%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（153,740,828千円）の投資信託財産総額（154,044,933千円）に対する比率は99.8%です。

※外国リート・インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（5,530,206千円）の投資信託財産総額（5,532,602千円）に対する比率は100.0%です。

※エマージング株式インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（4,560,376千円）の投資信託財産総額（7,327,069千円）に対する比率は62.2%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=107.45円、1カナダドル=81.55円、1メキシコペソ=5.49円、1ブラジルレアル=26.22円、100チリペソ=15.03円、100コロンビアペソ=3.19円、1ユーロ=118.67円、1英ポンド=132.66円、1スイスフラン=108.26円、1スウェーデンクローナ=11.12円、1ノルウェークローネ=12.04円、1デンマーククローネ=15.91円、1トルコリラ=18.71円、1チェココロンナ=4.59円、100ハンガリーフォリント=35.89円、1ポーランドズロチ=27.38円、1オーストラリアドル=73.72円、1ニュージーランドドル=69.10円、1香港ドル=13.71円、1シンガポールドル=77.82円、1マレーシアリングギット=25.76円、1タイバーツ=3.50円、1フィリピンペソ=2.07円、100インドネシアルピア=0.77円、100韓国ウォン=9.04円、1新台湾ドル=3.44円、1インドルピー=1.51円、1イスラエルシェケル=30.46円、1エジプトポンド=6.51円、1南アフリカランド=7.27円、1中国元（オフショア）=15.09円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年9月10日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	296,522,106円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,622,120
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	29,394,329
外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	59,611,708
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	14,091,391
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	58,255,213
国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	43,192,694
Jリート・インデックス・マザーファンド(評価額)	14,375,296
外国リート・インデックス・マザーファンド(評価額)	44,085,817
エマージング株式インデックス・マザーファンド(評価額)	29,893,538
(B) 負 債	938,762
未 払 解 約 金	654,548
未 払 信 託 報 酬	276,247
未 払 利 息	7
そ の 他 未 払 費 用	7,960
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	295,583,344
元 本	283,071,447
次 期 繰 越 損 益 金	12,511,897
(D) 受 益 権 総 口 数	283,071,447口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,442円

※当期における期首元本額114,481,559円、期中追加設定元本額198,345,231円、期中一部解約元本額29,755,343円です。

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

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

■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当	期

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

■ 損益の状況

(自2018年9月11日 至2019年9月10日)

項 目	当	期
(A) 配 当 等 収 益	△	1,040円
支 払 利 息	△	1,040
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		9,789,091
売 買 益		11,305,958
売 買 損	△	1,516,867
(C) 信 託 報 酬 等	△	456,379
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)		9,331,672
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△	81,590
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金		3,261,815
(配 当 等 相 当 額)	(2,291,779)
(売 買 損 益 相 当 額)	(970,036)
(G) 計 (D+E+F)		12,511,897
(H) 収 益 分 配 金		0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)		12,511,897
追 加 信 託 差 損 益 金		3,261,815
(配 当 等 相 当 額)	(2,571,149)
(売 買 損 益 相 当 額)	(690,666)
分 配 準 備 積 立 金		9,250,082

※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(4,428,726円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,858,097円)、信託約款に規定される収益調整金(3,261,815円)および分配準備積立金(963,259円)より分配可能額は12,511,897円(1万口当たり442円)ですが、分配は行っておりません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

第14期 (2018年5月26日から2019年5月27日まで)

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合)		債券組入 比	純資産 総額
	期中 騰落率	騰落率	期中 騰落率	騰落率		
10期 (2015年5月25日)	円	%		%	%	百万円
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
14期 (2019年5月27日)	12,860	1.8	388.97	1.8	98.7	165,548

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

■当期中の基準価額と市況等の推移

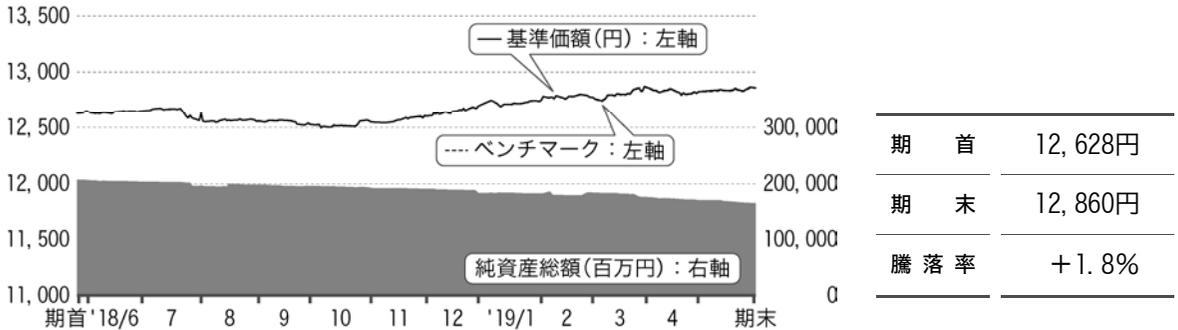
年月日	基準価額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合)		債券組入 比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2018年5月25日	円	%		%	%
5月末	12,628	-	382.10	-	99.4
6月末	12,642	0.1	382.50	0.1	99.4
7月末	12,648	0.2	382.67	0.1	99.5
8月末	12,626	△0.0	381.98	△0.0	99.5
9月末	12,558	△0.6	379.89	△0.6	99.5
10月末	12,527	△0.8	378.99	△0.8	99.6
11月末	12,549	△0.6	379.64	△0.6	99.3
12月末	12,602	△0.2	381.24	△0.2	99.4
2019年1月末	12,694	0.5	384.13	0.5	99.4
2月末	12,747	0.9	385.58	0.9	99.4
3月末	12,774	1.2	386.43	1.1	99.3
4月末	12,865	1.9	389.14	1.8	99.5
(期末) 2019年5月27日	12,824	1.6	387.94	1.5	99.3
	12,860	1.8	388.97	1.8	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 (2018年5月26日から2019年5月27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、野村証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証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証券株式会社およびその許諾者は、NOMURA-BPI（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村証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 (2018年5月26日から2019年5月27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	・10月以降、米中貿易摩擦問題への警戒や世界的な景気減速懸念を背景に、国内金利が低下（価格は上昇）したこと
下落要因	・7月、日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の許容変動幅を従来の倍程度としたことから国内金利が上昇（価格は下落）したこと

▶ 投資環境について (2018年5月26日から2019年5月27日まで)

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

長期金利は、期首からしばらくは0.0%台の狭い範囲で推移しましたが、7月末に日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の許容変動幅を従来の倍程度とすると、8月上旬には0.1%台前半へと上昇しました。しかし、急速な金利上昇に対して日銀が臨時的国債買入れオペを実施し金利上昇をけん制したため、長期金利は低下に転じました。

10月には、米国での利上げ観測を背景に海外金利が上昇していたこともあり、長期金利は再度0.1%台半ばへ上昇する場面がありました。しかしその後は、米中貿易摩擦問題や英国のEU（欧州連合）離脱問題を巡る混乱が警戒されるなか、世界的な株価の下落とともに、国内長期金利は年末まで低下基調で推移しました。

年明け以降は、世界的に景気減速への警戒感が高まるなかで欧米中央銀行が利上げ先送りのスタンスを示すと、海外金利の低下とともに、3月下旬には国内長期金利は一時-0.10%となるなど低下が進みました。期末にかけても、米中貿易摩擦問題への警戒が高まるなか、金利は低水準での推移が続きました。

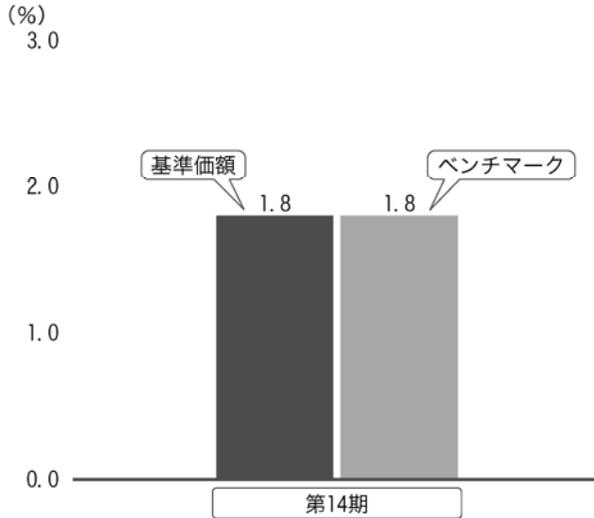
当期の市場の動きを10年国債利回りで見ると、期首の0.04%から期末には-0.07%へ低下しました。

▶ ポートフォリオについて (2018年5月26日から2019年5月27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 (2018年5月26日から2019年5月27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+1.8%となり、ベンチマークの騰落率+1.8%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(2018年5月26日から2019年5月27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12,671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5月26日から2019年5月27日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	31,576,321	65,587,604
	地方債証券	1,214,805	7,044,159 (250,600)
	特殊債証券	1,438,016	3,723,710 (1,413,736)
	社債証券 (投資法人債券を含む)	1,500,000	302,928 (700,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

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

■ 利害関係人との取引状況等(2018年5月26日から2019年5月27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	35,729	6,876	19.2	76,658	5,622	7.3

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	—	—	405

国内債券パッシブ・マザーファンド

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 1,300

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2018年5月26日から2019年5月27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5月27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	107,476,000 (17,585,000)	120,966,594 (19,622,403)	73.1 (11.9)	— (—)	54.1 (9.0)	18.2 (2.9)	0.8 (—)
地 方 債 証 券	12,000,500 (12,000,500)	12,772,620 (12,772,620)	7.7 (7.7)	— (—)	3.1 (3.1)	3.1 (3.1)	1.5 (1.5)
特 殊 債 券 (除く金融債)	19,345,994 (19,345,994)	20,442,309 (20,442,309)	12.3 (12.3)	— (—)	4.8 (4.8)	3.4 (3.4)	4.2 (4.2)
金 融 債 券	1,000,000 (1,000,000)	1,000,977 (1,000,977)	0.6 (0.6)	— (—)	— (—)	0.2 (0.2)	0.4 (0.4)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	8,000,000 (7,800,000)	8,288,373 (8,084,434)	5.0 (4.9)	— (—)	2.1 (2.0)	1.7 (1.7)	1.2 (1.2)
合 計	147,822,494 (57,731,494)	163,470,874 (61,922,744)	98.7 (37.4)	— (—)	64.1 (18.9)	26.5 (11.1)	8.2 (7.4)

※()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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 国内(邦貨建)公社債

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第396回 利付国債(2年)	0.1	40,000	40,166	2021/1/1
	第397回 利付国債(2年)	0.1	90,000	90,394	2021/2/1
	第400回 利付国債(2年)	0.1	100,000	100,502	2021/5/1
	第128回 利付国債(5年)	0.1	565,000	568,039	2021/6/20
	第129回 利付国債(5年)	0.1	950,000	955,842	2021/9/20
	第130回 利付国債(5年)	0.1	830,000	835,768	2021/12/20
	第131回 利付国債(5年)	0.1	140,000	141,066	2022/3/20
	第132回 利付国債(5年)	0.1	145,000	146,204	2022/6/20
	第133回 利付国債(5年)	0.1	108,000	108,989	2022/9/20
	第134回 利付国債(5年)	0.1	110,000	111,084	2022/12/20
	第135回 利付国債(5年)	0.1	190,000	192,004	2023/3/20
	第136回 利付国債(5年)	0.1	950,000	960,687	2023/6/20
	第137回 利付国債(5年)	0.1	700,000	708,365	2023/9/20
	第138回 利付国債(5年)	0.1	500,000	506,325	2023/12/20
	第1回 利付国債(40年)	2.4	40,000	60,432	2048/3/20
	第2回 利付国債(40年)	2.2	242,000	355,183	2049/3/20
	第3回 利付国債(40年)	2.2	225,000	332,896	2050/3/20
	第4回 利付国債(40年)	2.2	302,000	450,949	2051/3/20
	第5回 利付国債(40年)	2.0	295,000	426,334	2052/3/20
	第6回 利付国債(40年)	1.9	300,000	427,653	2053/3/20
	第7回 利付国債(40年)	1.7	345,000	473,364	2054/3/20
	第8回 利付国債(40年)	1.4	390,000	499,640	2055/3/20
	第9回 利付国債(40年)	0.4	551,000	524,893	2056/3/20
	第10回 利付国債(40年)	0.9	565,000	632,839	2057/3/20
	第11回 利付国債(40年)	0.8	460,000	499,173	2058/3/20
	第313回 利付国債(10年)	1.3	95,000	97,518	2021/3/20
	第315回 利付国債(10年)	1.2	1,800,000	1,850,652	2021/6/20
	第317回 利付国債(10年)	1.1	1,005,000	1,034,416	2021/9/20
	第318回 利付国債(10年)	1.0	895,000	919,120	2021/9/20
	第319回 利付国債(10年)	1.1	980,000	1,011,918	2021/12/20
	第320回 利付国債(10年)	1.0	960,000	988,800	2021/12/20
	第321回 利付国債(10年)	1.0	960,000	991,718	2022/3/20
	第322回 利付国債(10年)	0.9	1,065,000	1,097,184	2022/3/20
	第323回 利付国債(10年)	0.9	310,000	320,211	2022/6/20
	第324回 利付国債(10年)	0.8	390,000	401,645	2022/6/20
	第325回 利付国債(10年)	0.8	1,365,000	1,409,376	2022/9/20
	第326回 利付国債(10年)	0.7	77,000	79,416	2022/12/20
第327回 利付国債(10年)	0.8	375,000	388,113	2022/12/20	
第328回 利付国債(10年)	0.6	380,000	391,297	2023/3/20	
第329回 利付国債(10年)	0.8	2,030,000	2,110,976	2023/6/20	
第330回 利付国債(10年)	0.8	1,285,000	1,339,471	2023/9/20	
第332回 利付国債(10年)	0.6	793,000	821,270	2023/12/20	
第333回 利付国債(10年)	0.6	815,000	845,644	2024/3/20	
第334回 利付国債(10年)	0.6	315,000	327,467	2024/6/20	
第335回 利付国債(10年)	0.5	50,000	51,810	2024/9/20	
第336回 利付国債(10年)	0.5	470,000	487,822	2024/12/20	
第337回 利付国債(10年)	0.3	120,000	123,202	2024/12/20	

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	第338回 利付国債(10年)	0.4	805,000	831,927	2025/3/20
	第339回 利付国債(10年)	0.4	905,000	936,593	2025/6/20
	第340回 利付国債(10年)	0.4	770,000	798,012	2025/9/20
	第341回 利付国債(10年)	0.3	1,107,000	1,141,538	2025/12/20
	第342回 利付国債(10年)	0.1	950,000	967,670	2026/3/20
	第343回 利付国債(10年)	0.1	1,110,000	1,131,012	2026/6/20
	第344回 利付国債(10年)	0.1	1,021,000	1,040,644	2026/9/20
	第345回 利付国債(10年)	0.1	1,398,000	1,425,274	2026/12/20
	第346回 利付国債(10年)	0.1	990,000	1,009,552	2027/3/20
	第347回 利付国債(10年)	0.1	990,000	1,009,374	2027/6/20
	第348回 利付国債(10年)	0.1	665,000	677,854	2027/9/20
	第349回 利付国債(10年)	0.1	1,300,000	1,324,739	2027/12/20
	第350回 利付国債(10年)	0.1	1,330,000	1,354,844	2028/3/20
	第351回 利付国債(10年)	0.1	1,220,000	1,242,313	2028/6/20
	第352回 利付国債(10年)	0.1	1,200,000	1,221,408	2028/9/20
	第353回 利付国債(10年)	0.1	1,070,000	1,088,553	2028/12/20
	第354回 利付国債(10年)	0.1	135,000	137,266	2029/3/20
	第2回 利付国債(30年)	2.4	510,000	643,456	2030/2/20
	第4回 利付国債(30年)	2.9	300,000	399,894	2030/11/20
	第5回 利付国債(30年)	2.2	290,000	365,542	2031/5/20
	第7回 利付国債(30年)	2.3	474,000	611,123	2032/5/20
	第9回 利付国債(30年)	1.4	100,000	117,712	2032/12/20
	第10回 利付国債(30年)	1.1	585,000	665,595	2033/3/20
	第11回 利付国債(30年)	1.7	430,000	525,408	2033/6/20
	第12回 利付国債(30年)	2.1	590,000	755,465	2033/9/20
	第14回 利付国債(30年)	2.4	742,000	987,468	2034/3/20
	第16回 利付国債(30年)	2.5	465,000	629,535	2034/9/20
	第18回 利付国債(30年)	2.3	450,000	598,500	2035/3/20
	第19回 利付国債(30年)	2.3	490,000	653,189	2035/6/20
	第21回 利付国債(30年)	2.3	345,000	462,272	2035/12/20
	第22回 利付国債(30年)	2.5	315,000	433,184	2036/3/20
	第23回 利付国債(30年)	2.5	329,000	453,480	2036/6/20
	第24回 利付国債(30年)	2.5	310,000	428,606	2036/9/20
	第25回 利付国債(30年)	2.3	300,000	405,522	2036/12/20
	第26回 利付国債(30年)	2.4	363,000	498,202	2037/3/20
	第27回 利付国債(30年)	2.5	440,000	614,455	2037/9/20
	第28回 利付国債(30年)	2.5	386,000	541,546	2038/3/20
	第29回 利付国債(30年)	2.4	177,000	246,208	2038/9/20
	第30回 利付国債(30年)	2.3	472,000	650,345	2039/3/20
	第31回 利付国債(30年)	2.2	395,000	538,704	2039/9/20
	第32回 利付国債(30年)	2.3	420,000	583,963	2040/3/20
	第33回 利付国債(30年)	2.0	613,000	818,489	2040/9/20
	第34回 利付国債(30年)	2.2	477,000	659,156	2041/3/20
	第35回 利付国債(30年)	2.0	465,000	625,750	2041/9/20
	第36回 利付国債(30年)	2.0	240,000	324,336	2042/3/20
	第37回 利付国債(30年)	1.9	640,000	853,830	2042/9/20
	第38回 利付国債(30年)	1.8	375,000	493,425	2043/3/20
	第39回 利付国債(30年)	1.9	260,000	348,665	2043/6/20
	第40回 利付国債(30年)	1.8	295,000	389,538	2043/9/20
	第41回 利付国債(30年)	1.7	335,000	435,325	2043/12/20

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42回 利付国債(30年)	1.7	345,000	448,762	2044/3/20
	第43回 利付国債(30年)	1.7	315,000	410,148	2044/6/20
	第44回 利付国債(30年)	1.7	415,000	541,504	2044/9/20
	第45回 利付国債(30年)	1.5	415,000	522,082	2044/12/20
	第46回 利付国債(30年)	1.5	435,000	547,586	2045/3/20
	第47回 利付国債(30年)	1.6	360,000	462,506	2045/6/20
	第48回 利付国債(30年)	1.4	425,000	525,559	2045/9/20
	第49回 利付国債(30年)	1.4	395,000	488,674	2045/12/20
	第50回 利付国債(30年)	0.8	505,000	548,596	2046/3/20
	第51回 利付国債(30年)	0.3	520,000	498,175	2046/6/20
	第52回 利付国債(30年)	0.5	503,000	507,265	2046/9/20
	第53回 利付国債(30年)	0.6	197,000	203,497	2046/12/20
	第54回 利付国債(30年)	0.8	160,000	173,412	2047/3/20
	第55回 利付国債(30年)	0.8	425,000	460,912	2047/6/20
	第56回 利付国債(30年)	0.8	430,000	466,038	2047/9/20
	第57回 利付国債(30年)	0.8	590,000	639,029	2047/12/20
	第58回 利付国債(30年)	0.8	590,000	638,592	2048/3/20
	第59回 利付国債(30年)	0.7	400,000	422,444	2048/6/20
	第60回 利付国債(30年)	0.9	420,000	465,931	2048/9/20
	第61回 利付国債(30年)	0.7	355,000	374,248	2048/12/20
	第62回 利付国債(30年)	0.5	70,000	69,909	2049/3/20
	第50回 利付国債(20年)	1.9	918,000	952,443	2021/3/22
	第52回 利付国債(20年)	2.1	720,000	757,936	2021/9/21
	第54回 利付国債(20年)	2.2	965,000	1,023,768	2021/12/20
	第56回 利付国債(20年)	2.0	818,000	872,650	2022/6/20
	第59回 利付国債(20年)	1.7	1,455,000	1,552,848	2022/12/20
	第61回 利付国債(20年)	1.0	1,215,000	1,269,760	2023/3/20
	第64回 利付国債(20年)	1.9	1,025,000	1,117,229	2023/9/20
	第65回 利付国債(20年)	1.9	1,020,000	1,117,124	2023/12/20
	第69回 利付国債(20年)	2.1	1,020,000	1,132,302	2024/3/20
	第70回 利付国債(20年)	2.4	780,000	882,367	2024/6/20
	第72回 利付国債(20年)	2.1	753,000	844,677	2024/9/20
	第74回 利付国債(20年)	2.1	664,000	748,666	2024/12/20
	第75回 利付国債(20年)	2.1	490,000	555,116	2025/3/20
	第78回 利付国債(20年)	1.9	590,000	664,611	2025/6/20
	第82回 利付国債(20年)	2.1	620,000	709,614	2025/9/20
	第84回 利付国債(20年)	2.0	850,000	972,119	2025/12/20
	第85回 利付国債(20年)	2.1	645,000	745,374	2026/3/20
	第88回 利付国債(20年)	2.3	742,000	872,080	2026/6/20
	第89回 利付国債(20年)	2.2	20,000	23,363	2026/6/20
	第90回 利付国債(20年)	2.2	580,000	680,809	2026/9/20
	第92回 利付国債(20年)	2.1	734,000	860,027	2026/12/20
	第93回 利付国債(20年)	2.0	632,000	738,808	2027/3/20
	第95回 利付国債(20年)	2.3	305,000	365,390	2027/6/20
	第97回 利付国債(20年)	2.2	677,000	808,913	2027/9/20
	第99回 利付国債(20年)	2.1	693,000	825,411	2027/12/20
	第100回 利付国債(20年)	2.2	207,000	249,321	2028/3/20
	第101回 利付国債(20年)	2.4	355,000	433,891	2028/6/20
	第102回 利付国債(20年)	2.4	457,000	561,232	2028/9/20
	第105回 利付国債(20年)	2.1	390,000	470,008	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106回	利付国債(20年)	2.2	370,000	449,379	2028/9/20
第107回	利付国債(20年)	2.1	378,000	457,198	2028/12/20
第108回	利付国債(20年)	1.9	390,000	464,201	2028/12/20
第109回	利付国債(20年)	1.9	340,000	405,966	2029/3/20
第111回	利付国債(20年)	2.2	386,000	474,077	2029/6/20
第113回	利付国債(20年)	2.1	427,000	521,917	2029/9/20
第114回	利付国債(20年)	2.1	383,000	469,703	2029/12/20
第116回	利付国債(20年)	2.2	380,000	471,652	2030/3/20
第118回	利付国債(20年)	2.0	200,000	244,658	2030/6/20
第119回	利付国債(20年)	1.8	365,000	438,408	2030/6/20
第120回	利付国債(20年)	1.6	280,000	330,108	2030/6/20
第121回	利付国債(20年)	1.9	255,000	309,995	2030/9/20
第122回	利付国債(20年)	1.8	380,000	457,653	2030/9/20
第123回	利付国債(20年)	2.1	230,000	285,689	2030/12/20
第124回	利付国債(20年)	2.0	330,000	406,088	2030/12/20
第125回	利付国債(20年)	2.2	275,000	345,842	2031/3/20
第126回	利付国債(20年)	2.0	180,000	222,125	2031/3/20
第127回	利付国債(20年)	1.9	145,000	177,224	2031/3/20
第128回	利付国債(20年)	1.9	265,000	324,757	2031/6/20
第129回	利付国債(20年)	1.8	230,000	279,098	2031/6/20
第130回	利付国債(20年)	1.8	135,000	164,216	2031/9/20
第131回	利付国債(20年)	1.7	640,000	770,662	2031/9/20
第132回	利付国債(20年)	1.7	680,000	820,603	2031/12/20
第133回	利付国債(20年)	1.8	160,000	195,081	2031/12/20
第134回	利付国債(20年)	1.8	50,000	61,099	2032/3/20
第135回	利付国債(20年)	1.7	205,000	247,898	2032/3/20
第136回	利付国債(20年)	1.6	100,000	119,654	2032/3/20
第137回	利付国債(20年)	1.7	245,000	297,077	2032/6/20
第138回	利付国債(20年)	1.5	25,000	29,666	2032/6/20
第139回	利付国債(20年)	1.6	80,000	95,968	2032/6/20
第140回	利付国債(20年)	1.7	600,000	729,018	2032/9/20
第141回	利付国債(20年)	1.7	460,000	559,994	2032/12/20
第142回	利付国債(20年)	1.8	230,000	283,084	2032/12/20
第143回	利付国債(20年)	1.6	290,000	349,734	2033/3/20
第144回	利付国債(20年)	1.5	180,000	214,621	2033/3/20
第145回	利付国債(20年)	1.7	445,000	543,736	2033/6/20
第146回	利付国債(20年)	1.7	275,000	336,622	2033/9/20
第147回	利付国債(20年)	1.6	590,000	714,991	2033/12/20
第148回	利付国債(20年)	1.5	284,000	340,535	2034/3/20
第149回	利付国債(20年)	1.5	715,000	858,443	2034/6/20
第150回	利付国債(20年)	1.4	541,000	642,237	2034/9/20
第151回	利付国債(20年)	1.2	790,000	914,764	2034/12/20
第152回	利付国債(20年)	1.2	570,000	660,396	2035/3/20
第153回	利付国債(20年)	1.3	457,000	536,906	2035/6/20
第154回	利付国債(20年)	1.2	560,000	649,499	2035/9/20
第155回	利付国債(20年)	1.0	570,000	643,108	2035/12/20
第156回	利付国債(20年)	0.4	630,000	648,383	2036/3/20
第157回	利付国債(20年)	0.2	565,000	561,751	2036/6/20
第158回	利付国債(20年)	0.5	545,000	568,554	2036/9/20
第159回	利付国債(20年)	0.6	553,000	586,058	2036/12/20

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160回 利付国債(20年)	0.7	480,000	516,830	2037/3/20
	第161回 利付国債(20年)	0.6	540,000	571,671	2037/6/20
	第162回 利付国債(20年)	0.6	455,000	481,203	2037/9/20
	第163回 利付国債(20年)	0.6	710,000	750,093	2037/12/20
	第164回 利付国債(20年)	0.5	555,000	575,784	2038/3/20
	第165回 利付国債(20年)	0.5	610,000	631,996	2038/6/20
	第166回 利付国債(20年)	0.7	485,000	519,939	2038/9/20
	第167回 利付国債(20年)	0.5	660,000	681,872	2038/12/20
	小 計	-	107,476,000	120,966,594	-
地方債証券	第1回 東京都公募公債(20年)	1.54	100,000	106,219	2023/6/20
	第1回 東京都公募公債(30年)	2.21	100,000	126,898	2033/6/20
	第6回 東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	111,462	2025/3/19
	第7回 東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	113,463	2025/9/19
	第8回 東京都公募公債(20年)	2.36	100,000	115,800	2026/3/19
	第8回 東京都公募公債(30年)	2.23	400,000	528,368	2038/9/17
	第13回 東京都公募公債(30年)	1.93	500,000	646,445	2042/3/19
	第684回 東京都公募公債	1.26	100,000	101,322	2020/6/19
	第685回 東京都公募公債	1.13	100,000	101,185	2020/6/19
	第688回 東京都公募公債	0.94	193,500	195,847	2020/9/18
	第689回 東京都公募公債	1.08	200,000	202,794	2020/9/18
	第703回 東京都公募公債	0.99	100,000	102,514	2021/12/20
	第705回 東京都公募公債	1.06	100,000	102,950	2022/3/18
	第710回 東京都公募公債	0.81	100,000	102,452	2022/6/20
	平成21年度第14回 北海道公募公債	1.52	100,000	101,118	2020/2/26
	平成24年度第1回 北海道公募公債	0.99	100,000	102,799	2022/4/27
	平成24年度第14回 北海道公募公債	0.8	100,000	102,891	2023/2/28
	平成25年度第15回 北海道公募公債	0.67	100,000	103,041	2024/2/28
	平成26年度第10回 北海道公募公債(5年)	0.147	200,000	200,112	2019/11/28
	平成26年度第15回 北海道公募公債	0.434	100,000	102,299	2025/2/27
	平成29年度第6回 北海道公募公債(5年)	0.01	300,000	299,808	2022/7/28
	第1回 神奈川県公募公債(20年)	2.55	100,000	112,798	2024/6/20
	第3回 神奈川県公募公債(20年)	2.11	100,000	112,630	2025/6/20
	第7回 神奈川県公募公債(20年)	2.22	100,000	117,023	2027/3/19
	第342回 大阪府公募公債(10年)	1.2	200,000	203,126	2020/9/29
	第361回 大阪府公募公債(10年)	0.92	200,000	205,490	2022/6/28
	第373回 大阪府公募公債(10年)	0.904	100,000	103,565	2023/6/27
	第377回 大阪府公募公債(10年)	0.729	100,000	103,090	2023/10/30
	平成22年度第5回 京都府公募公債	1.26	110,000	112,158	2020/12/21
	平成26年度第13回 京都府公募公債	0.484	100,000	102,664	2025/3/19
	平成27年度第4回 京都府公募公債	0.553	100,000	103,196	2025/6/19
	平成29年度第12回 京都府公募公債	0.04	300,000	300,339	2023/3/16
	第5回 兵庫県公募公債(15年)	1.31	300,000	332,820	2028/5/26
	平成22年度第1回 兵庫県公募公債	1.46	100,000	101,268	2020/4/16
	第7回 静岡県公募公債(30年)	1.988	100,000	131,520	2043/6/19
	平成20年度第1回 静岡県公募公債	2.18	200,000	227,180	2025/9/19
	平成21年度第10回 愛知県公募公債(10年)	1.38	100,000	100,583	2019/10/30
	平成22年度第12回 愛知県公募公債(10年)	1.085	100,000	101,624	2020/11/30
	平成29年度第2回 埼玉県公募公債(5年)	0.01	200,000	200,000	2022/4/19
	平成29年度第7回 埼玉県公募公債(5年)	0.02	400,000	400,136	2022/10/27
	平成21年度第8回 福岡県公募公債	1.34	100,000	100,770	2019/12/25

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
	平成25年度第11回 福岡県公募公債	0.694	100,000	103,250	2024/2/26
	平成26年度第10回 福岡県公募公債	0.453	100,000	102,466	2025/2/26
	第9回 群馬県公募公債(10年)	0.801	100,000	102,766	2022/11/25
	第81回 共同発行市場公募地方債	1.32	100,000	100,758	2019/12/25
	第82回 共同発行市場公募地方債	1.42	100,000	100,932	2020/1/24
	第91回 共同発行市場公募地方債	0.9	300,000	303,744	2020/10/23
	第110回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	102,634	2022/5/25
	第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	300,000	308,118	2022/6/24
	第112回 共同発行市場公募地方債	0.84	150,000	153,934	2022/7/25
	第113回 共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	102,466	2022/8/25
	第114回 共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	102,691	2022/9/22
	第115回 共同発行市場公募地方債	0.8	600,000	616,176	2022/10/25
	第118回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	103,041	2023/1/25
	第137回 共同発行市場公募地方債	0.566	200,000	205,714	2024/8/23
	第149回 共同発行市場公募地方債	0.5	400,000	411,848	2025/8/25
	第172回 共同発行市場公募地方債	0.225	500,000	507,520	2027/7/23
	第1回 名古屋市長募公債(20年)	1.99	200,000	218,080	2023/12/20
	第3回 名古屋市長募公債(20年)	2.03	100,000	112,145	2025/6/20
	第1回 京都市公募公債(7年)	0.365	300,000	300,591	2019/12/18
	第1回 京都市公募公債(30年)	2.57	100,000	137,377	2037/9/18
	第7回 京都市公募公債(20年)	2.38	100,000	121,339	2028/9/21
	平成29年度第5回 京都市公募公債	0.04	100,000	100,114	2023/3/28
	平成26年度第17回 神戸市公募公債	0.28	100,000	101,460	2025/1/27
	第4回 横浜市公募公債(20年)	2.03	100,000	111,636	2025/3/19
	第9回 横浜市公募公債(20年)	2.35	100,000	116,313	2026/6/19
	第14回 横浜市公募公債(20年)	2.32	100,000	119,852	2028/3/17
	第47回 横浜市公募公債(5年)	0.04	100,000	100,110	2023/1/27
	平成26年度第4回 札幌市公募公債(10年)	0.54	100,000	102,626	2024/6/20
	第2回 川崎市15年公募公債	1.63	100,000	101,729	2020/6/22
	第4回 川崎市15年公募公債	2.11	100,000	105,390	2021/12/20
	平成24年度第2回 北九州市公募公債	0.715	100,000	102,525	2022/12/26
	平成23年度第9回 福岡市公募公債	1.01	147,000	151,168	2022/3/28
	平成29年度第11回 福岡市公募公債(5年)	0.04	300,000	300,339	2023/3/16
	小 計	-	12,000,500	12,772,620	-
特 殊 債 券 (除く金融債)	第340回 政府保証道路債券	1.7	100,000	101,591	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	200,472	2020/6/18
	第16回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	301,000	305,015	2020/9/14
	第3回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	12,876	13,253	2036/5/10
	第4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	15,482	16,308	2042/8/10
	第5回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	13,424	13,822	2036/11/10
	第6回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.94	20,510	20,620	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	17,022	17,991	2038/11/10
	第8回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	10,313	10,358	2037/10/10
	第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	29,074	30,487	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	17,123	18,255	2039/5/10
	第10回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	44,967	47,183	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	16,736	17,695	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	17,992	19,158	2040/5/10
	第12回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	11,611	11,818	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	15,977	16,322	2032/5/10

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
第17回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	37,218	38,302	2032/11/10
第19回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.15	21,971	23,501	2043/11/10
第24回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	45,428	49,014	2044/5/10
第26回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	71,601	77,009	2044/7/10
第27回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.05	25,852	27,817	2044/8/10
第28回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	28,514	30,657	2044/9/10
第29回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	14,159	14,638	2040/4/10
第29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	30,921	33,384	2044/10/10
第30回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	30,415	32,820	2044/11/10
第32回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	15,892	16,514	2040/7/10
第32回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	59,896	64,145	2045/1/10
第35回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	16,663	17,437	2040/10/10
第35回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	33,133	35,483	2045/4/10
第36回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	33,307	35,525	2045/5/10
第39回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	14,914	15,519	2041/2/10
第41回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	16,291	17,207	2041/4/10
第43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.28	30,814	32,564	2041/6/10
第43回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	43,613	46,564	2045/12/10
第46回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	36,051	38,658	2046/3/10
第48回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	67,566	72,373	2046/5/10
第49回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	33,471	35,700	2046/6/10
第51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	14,619	15,385	2042/2/10
第51回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	73,514	78,337	2046/8/10
第52回	一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	120,116	2030/7/16
第53回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	15,365	16,147	2042/4/10
第55回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	96,054	101,981	2046/12/10
第57回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	45,757	48,597	2047/2/10
第58回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4	48,302	51,275	2047/3/10
第59回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	93,734	99,628	2047/4/10
第60回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	146,409	155,091	2047/5/10
第61回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	47,217	49,824	2047/6/10
第67回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	52,957	55,490	2047/12/10
第69回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	108,036	114,218	2048/2/10
第70回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	95,450	100,507	2048/3/10
第73回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	53,575	56,760	2048/6/10
第95回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.065	100,000	102,934	2022/3/18
第99回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	77,377	80,477	2050/8/10
第123回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	93,010	94,390	2052/8/10
第124回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	93,137	94,282	2052/9/10
第125回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	93,337	94,517	2052/10/10
第127回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	94,425	95,465	2052/12/10
第128回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	94,339	95,555	2053/1/10
第129回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	95,061	96,547	2053/2/10
第130回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	200,000	239,716	2032/12/20
第137回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	97,784	99,393	2053/10/10
第1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	29,628	30,937	2042/5/10
第2回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	32,174	33,848	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	15,832	16,676	2037/11/10
第6回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	15,230	15,974	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	32,874	34,696	2038/11/10

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7回	道路債券	2.7	100,000	108,145	2022/6/20
第9回	道路債券	2.9	100,000	133,572	2032/5/20
第42回	道路債券	2.22	100,000	112,456	2025/3/21
第11回	地方公共団体金融機構債券	1.465	100,000	101,319	2020/4/28
第15回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	200,000	202,492	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	506,855	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	800,744	2022/5/30
第26回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	300,000	307,248	2021/7/16
第27回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	200,000	204,562	2021/8/13
第42回	地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	102,737	2022/11/28
第45回	地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	205,792	2023/2/28
第61回	地方公共団体金融機構債券	0.69	100,000	103,243	2024/6/28
第63回	地方公共団体金融機構債券	0.581	100,000	102,781	2024/8/28
第65回	地方公共団体金融機構債券	0.535	100,000	102,622	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	102,670	2024/12/13
第51回	政府保証関西国際空港債券	2.1	100,000	106,956	2022/8/31
第3回	政府保証日本政策投資銀行社債	2.1	200,000	219,458	2023/12/18
第9回	政府保証日本政策投資銀行社債	1.0	100,000	101,334	2020/9/14
第15回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	105,224	2021/12/22
第20回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	107,243	2022/12/19
第27回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.11	100,000	100,240	2021/2/12
第34回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.001	300,000	300,285	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	308,712	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	103,534	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	240,970	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	135,363	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	751,000	754,424	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	362,901	2029/9/28
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	160,437	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	122,457	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	1,516,155	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	303,966	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	101,323	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	1,025,750	2021/6/30
第147回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	102,498	2021/10/29
第152回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	300,000	308,778	2021/12/28
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	205,980	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	308,433	2024/11/29
第8回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	129,000	130,113	2020/1/20
第203回	政府保証預金保険機構債	0.1	300,000	300,240	2020/1/17
第208回	政府保証預金保険機構債	0.1	600,000	601,026	2020/10/6
第209回	政府保証預金保険機構債	0.1	600,000	601,194	2020/12/11
第20回	西日本高速道路社債	0.759	100,000	103,054	2023/9/20
第332回	東京交通債券	2.65	100,000	101,335	2019/11/29
第342回	東京交通債券	2.4	100,000	107,298	2022/6/21
第36回	日本政策投資銀行債券	2.23	100,000	117,239	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	116,017	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	155,186	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	451,305	2047/3/20
第47回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	200,000	244,694	2029/4/20

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107回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.935	300,000	311,151	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	103,335	2023/12/20
	第2回 地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.29	100,000	121,332	2029/4/27
	第3回 公営企業債券(20年)	1.03	100,000	103,854	2023/3/22
	第5回 公営企業債券(20年)	2.11	100,000	109,017	2023/9/20
	第11回 公営企業債券(20年)	2.11	100,000	111,965	2025/3/24
	第16回 公営企業債券(20年)	2.1	100,000	113,415	2025/12/19
	第17回 公営企業債券(20年)	2.39	100,000	115,642	2026/3/24
	第18回 公営企業債券(20年)	2.58	100,000	117,602	2026/6/19
	第22回 公営企業債券(20年)	2.32	100,000	118,084	2027/6/18
	第24回 公営企業債券(20年)	2.29	200,000	239,016	2028/4/25
	第44回 地方公共団体金融機構債券	0.791	300,000	308,484	2023/1/27
	第62回 地方公共団体金融機構債券	0.631	400,000	411,956	2024/7/26
	第15回 首都高速道路	0.21	100,000	100,196	2020/9/18
	第7回 本州四国連絡橋債券	2.26	100,000	113,161	2025/6/20
	第12回 国際協力機構債券	0.901	100,000	102,699	2022/6/20
	第28回 東日本高速道路	0.248	100,000	100,124	2019/12/20
	第35回 東日本高速道路	0.1	200,000	200,182	2021/3/19
	第45回 中日本高速道路	0.904	100,000	102,828	2022/9/20
	第22回 西日本高速道路	0.744	100,000	103,330	2024/3/19
	第23回 西日本高速道路	0.602	100,000	102,602	2024/6/20
	小 計	-	19,345,994	20,442,309	-
金 融 債 券	い第810号 農林債	0.1	300,000	300,522	2022/11/25
	第297回 信金中金債(5年)	0.2	200,000	200,088	2019/8/27
	第301回 信金中金債(5年)	0.225	300,000	300,369	2019/12/27
	第197号 商工債(3年)	0.02	200,000	199,998	2019/6/27
	小 計	-	1,000,000	1,000,977	-
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第528回 東京電力	1.905	100,000	100,085	2019/6/13
	第537回 東京電力	1.814	100,000	101,215	2020/2/28
	第547回 東京電力	1.948	100,000	101,944	2020/7/24
	第507回 中部電力	0.605	100,000	102,058	2026/1/23
	第518回 中部電力	0.19	100,000	100,091	2023/1/25
	第512回 関西電力	0.32	100,000	100,293	2024/10/25
	第527回 関西電力	0.28	100,000	100,167	2024/4/25
	第308回 北陸電力	0.769	100,000	102,703	2024/9/25
	第471回 東北電力	1.168	100,000	104,322	2023/12/25
	第472回 東北電力	0.954	100,000	103,422	2024/2/23
	第476回 東北電力	0.57	100,000	101,492	2025/1/24
	第508回 東北電力	0.465	200,000	201,332	2029/4/25
	第253回 四国電力	1.0	100,000	103,274	2023/6/23
	第328回 北海道電力	0.42	100,000	100,635	2023/1/25
	第13回 大和ハウス工業	0.285	100,000	100,598	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	100,087	2022/6/13
	第9回 セブン&アイ・ホールディングス	0.671	100,000	102,023	2023/3/20
	第30回 東レ	0.375	100,000	100,875	2027/7/16
	第7回 クラレ	0.19	100,000	100,188	2025/4/25
	第56回 住友化学	0.38	200,000	200,982	2027/9/13
	第47回 三井化学	0.26	100,000	100,072	2025/6/19
	第24回 三菱ケミカルホールディングス	0.37	100,000	100,602	2028/2/25
	第13回 プリチストン	0.23	100,000	99,974	2026/4/17

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3回 新日鐵住金	0.22	100,000	100,163	2024/5/20
	第8回 ジェイテクト	0.25	100,000	100,070	2025/3/7
	第16回 日立製作所	0.813	100,000	103,064	2023/12/13
	第12回 パナソニック	0.387	200,000	200,504	2020/3/19
	第13回 パナソニック	0.568	200,000	202,388	2022/3/18
	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	100,047	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	100,133	2022/2/22
	第63回 三井物産	2.37	100,000	116,984	2027/4/23
	第47回 住友商事	0.858	100,000	102,999	2023/10/23
	第69回 クレディセゾン	0.18	100,000	99,847	2023/6/19
	第8回 みずほコーポレート銀行	2.54	100,000	118,576	2027/7/27
	第25回 三菱東京UFJ銀行	1.31	300,000	305,292	2020/11/12
	第110回 三菱東京UFJ銀行	1.485	100,000	100,568	2019/10/16
	第1回 三井住友フィナンシャル	0.849	100,000	102,158	2024/9/12
	第4回 りそな銀行	2.766	100,000	100,173	2019/6/20
	第9回 三菱UFJ信託銀行	1.68	100,000	102,967	2021/4/28
	第8回 住友信託銀行	2.49	100,000	115,807	2027/5/10
	第1回 みずほフィナンシャルグループ	0.95	100,000	102,294	2024/7/16
	第20回 三井住友銀行	2.21	200,000	200,668	2019/7/24
	第24回 三井住友銀行	1.6	100,000	102,939	2021/6/1
	第9回 みずほ銀行	2.52	100,000	115,969	2027/4/27
	第50回 日産フィナンシャルサービス	0.1	100,000	99,690	2021/12/20
	第17回 トヨタファイナンス	1.91	100,000	102,426	2020/9/18
	第54回 トヨタファイナンス	0.508	100,000	100,480	2020/6/19
	第83回 トヨタファイナンス	0.08	100,000	100,019	2023/4/24
	第70回 日立キャピタル	0.2	100,000	100,080	2022/12/20
	第1回 野村ホールディングス	0.3	100,000	100,009	2023/9/4
	第21回 野村ホールディングス	1.86	100,000	101,432	2020/3/17
	第58回 三井不動産	0.1	100,000	99,934	2023/2/24
	第58回 三菱地所	2.9	100,000	131,177	2032/5/20
	第38回 京王電鉄	0.295	100,000	100,800	2027/11/29
	第15回 東日本旅客鉄道	2.65	100,000	103,271	2020/8/25
	第34回 東日本旅客鉄道	2.53	100,000	112,355	2024/6/20
	第110回 東日本旅客鉄道	1.76	100,000	125,647	2045/7/28
	第41回 東海旅客鉄道	2.166	100,000	118,666	2029/1/29
	第42回 東海旅客鉄道	2.312	200,000	240,936	2029/4/24
	第27回 KDDI	0.23	100,000	100,178	2026/4/24
	第11回 電源開発	2.05	100,000	109,978	2025/3/19
	第24回 東京電力パワーグリッド	0.61	200,000	200,650	2024/4/24
	第18回 大阪瓦斯	1.47	200,000	210,224	2022/12/20
	第27回 東邦瓦斯	1.12	100,000	104,112	2023/3/20
	第4回 ファーストリテイリング	0.749	100,000	103,132	2025/12/18
	第7回 ファーストリテイリング	0.405	100,000	100,573	2028/6/6
	第2回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20)	0.645	200,000	200,168	2023/7/12
	第11回 ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	200,000	200,392	2021/1/22
	小 計	—	8,000,000	8,288,373	—
	合 計	—	147,822,494	163,470,874	—

※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5月27日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	163,470,874	98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,817,662	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	166,288,536	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5月27日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	166,288,536,967円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	886,480,851
公 社 債 (評 価 額)	163,470,874,889
未 収 入 金	1,433,502,650
未 収 利 息	493,145,413
前 払 費 用	4,533,164
(B) 負 債	739,539,609
未 払 解 約 金	739,497,801
未 払 利 息	901
そ の 他 未 払 費 用	40,907
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	165,548,997,358
元 本	128,728,886,975
次 期 繰 越 損 益 金	36,820,110,383
(D) 受 益 権 総 口 数	128,728,886,975口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12,860円

※当期における期首元本額163,796,330,040円、期中追加設定元本額18,991,205,023円、期中一部解約元本額54,058,648,088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5月26日 至2019年5月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,031,762,455円
受 取 利 息	2,032,287,838
支 払 利 息	△ 525,383
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,218,113,376
売 買 損 益	2,203,039,987
売 買 損 益	△ 984,926,611
(C) 信 託 報 酬 等	△ 607,593
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	3,249,268,238
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	43,046,958,058
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,112,264,943
(G) 解 約 差 損 益 金	△14,588,380,856
(H) 計 (D + E + F + G)	36,820,110,383
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	36,820,110,383

※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）	4,544,382,925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>	112,648,590円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	7,764,734,486円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,014,357,930円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,670,199,620円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,167,297,178円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	690,559,127円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,802,135,470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）	49,679,212円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,589,912,942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）	168,403,515円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	3,063,620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）	310,024,681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）	2,148,625,675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）	271,423,917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）	9,593,375,639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）	103,009,207円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	510,755,318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）	209,045,221円	SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	224,809,413円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	90,014,140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）	7,679,220,975円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,427,872,977円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	919,958,791円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	643,158,344円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	186,847,552円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	33,591,719円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	44,401,846円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,423,988円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,996,661,675円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	36,601,395円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,502,256,041円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	13,811,555円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,365,436,017円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	7,776,181円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,012,950,975円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	3,623,027円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	244,033,609円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	4,896,557円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,430,319円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	26,417,100円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	354,495,506円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,800,435,855円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	6,233,010,024円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	18,018,659,061円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	301,457,933円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,267,490,683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>	142,628,061円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	17,716,923,693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>	1,365,633,107円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	351,415,849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>	654,311,594円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	578,749,942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>	1,624,886,083円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,668,525円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	1,846,803,949円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	252,488,538円		

■ お知らせ

<約款変更について>

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)

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

第16期 (2018年8月28日から2019年8月26日まで)

信託期間	無期限 (設定日: 2003年10月3日)
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジベース) をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。 ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。 ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。 保有する外貨建資産については、為替のフルヘッジを原則とします。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) FTSE世界国債 インデックス (除く日本、円 ヘッジベース)		債券組 入率 債 比	純資 産額
	円	騰落率	円	騰落率		
12期(2015年8月25日)	13,701	3.9%	378.66	4.1%	93.0%	百万円 31,942
13期(2016年8月25日)	14,399	5.1%	399.68	5.6%	93.4%	31,820
14期(2017年8月25日)	13,940	△3.2%	386.65	△3.3%	97.8%	61,516
15期(2018年8月27日)	13,764	△1.3%	382.07	△1.2%	97.5%	46,117
16期(2019年8月26日)	14,894	8.2%	414.04	8.4%	94.6%	27,583

※FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジベース) 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2019年8月26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。

※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。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

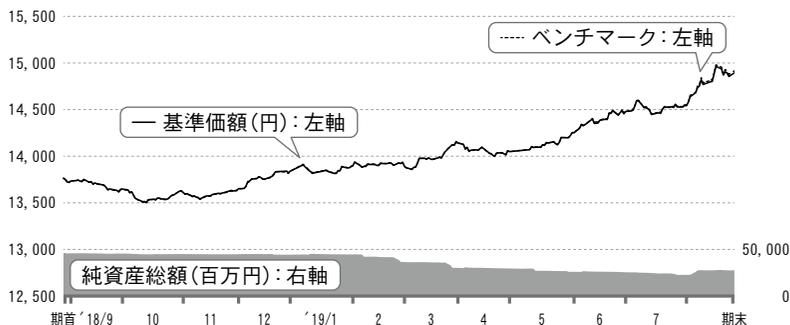
年月日	基準価額		(ベンチマーク) FTSE世界国債 インデックス (除く日本、円 ヘッジベース)		債券組 入率 債 比
	円	騰落率	円	騰落率	
(期首) 2018年8月27日	13,764	—	382.07	—	97.5%
8月末	13,734	△0.2%	381.23	△0.2%	97.9%
9月末	13,647	△0.9%	378.76	△0.9%	100.4%
10月末	13,610	△1.1%	377.76	△1.1%	96.5%
11月末	13,651	△0.8%	378.89	△0.8%	98.4%
12月末	13,839	0.5%	384.13	0.5%	95.9%
2019年1月末	13,897	1.0%	385.88	1.0%	100.1%
2月末	13,892	0.9%	385.50	0.9%	99.3%
3月末	14,141	2.7%	392.62	2.8%	96.0%
4月末	14,049	2.1%	389.98	2.1%	98.7%
5月末	14,251	3.5%	395.72	3.6%	96.0%
6月末	14,480	5.2%	401.98	5.2%	99.1%
7月末	14,541	5.6%	403.79	5.7%	97.1%
(期末) 2019年8月26日	14,894	8.2%	414.04	8.4%	94.6%

※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8月28日から2019年8月26日まで）

基準価額等の推移



期首	13,764円
期末	14,894円
騰落率	+8.2%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）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（2018年8月28日から2019年8月26日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の公社債に分散投資し、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）に連動する投資成果を目指しました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

上昇要因

- ・米中通商摩擦の先鋭化に伴い、グローバル経済の先行きに対する不透明感が高まり、米国や欧州の債券利回りが低下（価格は上昇）したこと

▶ 投資環境について（2018年8月28日から2019年8月26日まで）

米国および欧州（ドイツ）の長期金利はともに低下しました。

米国では、期初から11月にかけて、堅調な経済や市場の動きを背景にF R B（米連邦準備制度理事会）の政策金利の引上げが継続するとの見方が強く、金利は上昇しました。その後は、米中通商交渉の先鋭化に伴いグローバル経済への不透明感が高まったことや、F R Bが年明け以降に利上げを停止し、7月末には約10年半ぶりとなる利下げを実施したことなどを受け、期末まで金利は低下を続けました。

欧州の金利は、期初から10月にかけて上昇した後、予算案を巡るイタリアとEU（欧州連合）の対立や、イギリスのEUからの同意なき離脱が懸念され、低下しました。その後も、欧州域内の軟調な経済指標などからECB（欧州中央銀行）のハト派（景気を重視する立場）的な姿勢が強まり、期末まで金利は低下基調が続きました。

当期の市場の動きを米国10年国債でみると、期首2.81%から期末1.54%へと低下しました。欧州の動きをドイツ10年国債でみると、期首0.35%から期末-0.68%へと低下しました。

▶ ポートフォリオについて（2018年8月28日から2019年8月26日まで）

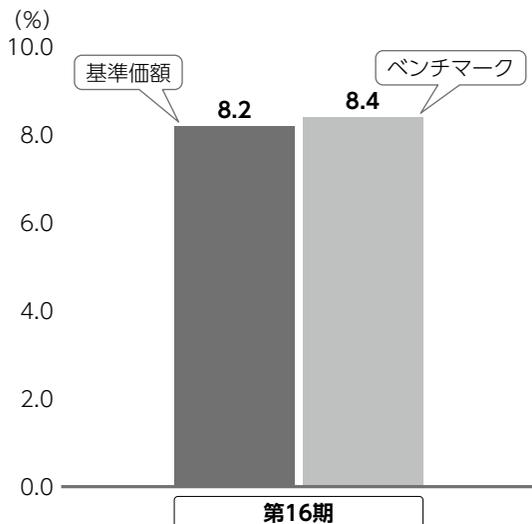
債券組入比率

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

また、組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

▶ ベンチマークとの差異について（2018年8月28日から2019年8月26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FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）をベンチマークとしています。

以下のグラフは、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+8.2%となり、ベンチマークの騰落率+8.4%を0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・カストディフィー（外国保管費用）やポートフォリオ維持のための売買コスト等が生じていること

2 今後の運用方針

米中間の通商交渉が長期化する見通しであることから、グローバル経済の先行きに対する不透明感が継続する見込みです。米国では抑制的なインフレ環境の中で、FRBのハト派化が引き続き意識されていることから、長期金利は低位での推移を予想します。ユーロ圏では、景気が低迷していることやECBによる金融緩和観測から、長期金利は低位での推移を予想します。

今後も引き続き、債券組入比率を高位に保ち、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション等を可能な限りベンチマークに近似させるよう運用します。また、組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細 (2018年8月28日から2019年8月26日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) その他費用 (保 管 費 用) (そ の 他)	7円 (7) (0)	0.053% (0.051) (0.001)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	7	0.053	

期中の平均基準価額は13,977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8月28日から2019年8月26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 66,606	千米ドル 137,399
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 3,723	千カナダドル 8,860
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 16,853	千メキシコペソ 47,468
	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	7,510	20,190
	イ タ リ ア	国 債 証 券	8,956	24,259
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	12,015	27,138
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	2,111	4,798
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	8,786	14,761
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	2,368	6,771
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	1,940	4,241
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	520	1,699
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	—	1,391
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 6,984	千英ポンド 16,270
	ス イ ス	国 債 証 券	千スイスフラン —	千スイスフラン 592
国	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 3,478	千スウェーデンクローナ 9,658
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 2,557	千ノルウェークローネ 5,260
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 3,211	千デンマーククローネ 10,769
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 3,130	千ポーランドズロチ 6,865
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 3,204	千オーストラリアドル 8,539
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 1,640	千シンガポールドル 3,637
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 10,942	千南アフリカランド 24,236

※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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 利害関係人との取引状況等 (2018年8月28日から2019年8月26日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2018年8月28日から2019年8月26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8月26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 間				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 112,450	千米ドル 119,501	千円 12,557,191	45.5	% —	% 18.8	% 17.1	% 9.6	
カ ナ ダ	千カナダドル 5,750	千カナダドル 6,292	496,850	1.8	—	1.0	0.5	0.3	
メ キ シ コ	千メキシコペソ 36,300	千メキシコペソ 37,297	196,187	0.7	—	0.4	0.2	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ 8,210	千ユーロ 11,146	1,304,886	4.7	—	3.0	1.3	0.3	
ド イ ツ	17,250	19,614	2,296,282	8.3	—	5.1	2.5	0.8	
イ タ リ ア	17,950	22,220	2,601,331	9.4	—	6.7	1.9	0.9	
フ ラ ン ス	3,950	4,904	574,199	2.1	—	1.4	0.5	0.2	
オ ラ ン ダ	12,620	15,161	1,774,924	6.4	—	3.4	2.1	0.9	
ス ペ イ ン	3,500	4,596	538,058	2.0	—	1.5	0.4	—	
オーストリア	3,050	3,749	438,943	1.6	—	1.3	0.3	—	
フィンランド	1,100	1,292	151,274	0.5	—	0.3	0.3	—	
アイルランド	1,800	2,125	248,784	0.9	—	0.4	0.2	0.3	
イ ギ リ ス	千英ポンド 9,350	千英ポンド 12,568	1,619,826	5.9	—	4.7	0.8	0.3	
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 6,900	千スウェーデンクローナ 8,070	88,044	0.3	—	0.2	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェークローネ 4,900	千ノルウェークローネ 5,126	59,883	0.2	—	0.1	0.0	0.0	
デンマーク	千デンマーククローネ 6,370	千デンマーククローネ 8,766	137,631	0.5	—	0.4	0.1	—	
ポーランド	千ポーランドズロチ 5,200	千ポーランドズロチ 5,521	147,580	0.5	—	0.3	0.2	0.1	
オーストラリア	千オーストラリアドル 6,050	千オーストラリアドル 7,175	506,960	1.8	—	1.2	0.5	0.2	
シンガポール	千シンガポールドル 2,750	千シンガポールドル 2,949	222,978	0.8	—	0.5	0.3	0.1	
南アフリカ	千南アフリカランド 24,300	千南アフリカランド 19,662	134,493	0.5	—	0.4	0.1	—	
合 計	—	—	26,096,314	94.6	—	50.9	29.5	14.2	

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示
外国(外貨建)公社債

種 類	銘 柄	期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	国債証券	US TREASURY N/B 1.125	%	千米ドル	千米ドル	千円	2021/2/28
		US TREASURY N/B 1.125	1.125	1,000	992	104,275	2021/6/30
		US TREASURY N/B 1.125	1.125	700	694	72,964	2021/7/31
		US TREASURY N/B 1.125	1.125	1,000	991	104,226	2021/8/31
		US TREASURY N/B 1.125	1.125	1,000	991	104,226	2021/9/30
		US TREASURY N/B 1.125	1.125	400	396	41,680	2021/3/31
		US TREASURY N/B 1.25	1.25	500	497	52,236	2021/10/31
		US TREASURY N/B 1.25	1.25	200	198	20,894	2020/8/31
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	1,500	1,494	157,016	2020/9/30
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	1,100	1,095	115,127	2020/10/31
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	1,000	995	104,644	2021/1/31
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	1,000	995	104,653	2021/4/30
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	2,750	2,739	287,886	2023/6/30
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	1,100	1,097	115,280	2023/8/31
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	200	199	20,974	2023/9/30
		US TREASURY N/B 1.375	1.375	1,000	997	104,825	2022/1/31
		US TREASURY N/B 1.5	1.5	600	600	63,077	2023/3/31
		US TREASURY N/B 1.5	1.5	500	500	52,634	2026/8/15
		US TREASURY N/B 1.5	1.5	450	450	47,352	2020/11/30
		US TREASURY N/B 1.625	1.625	1,200	1,199	126,007	2022/8/15
		US TREASURY N/B 1.625	1.625	300	301	31,681	2023/4/30
		US TREASURY N/B 1.625	1.625	1,000	1,006	105,736	2023/5/31
		US TREASURY N/B 1.625	1.625	1,000	1,006	105,744	2023/10/31
		US TREASURY N/B 1.625	1.625	1,200	1,209	127,041	2026/2/15
		US TREASURY N/B 1.625	1.625	1,400	1,413	148,479	2026/5/15
		US TREASURY N/B 1.625	1.625	800	807	84,852	2020/10/31
		US TREASURY N/B 1.75	1.75	700	700	73,584	2022/2/28
		US TREASURY N/B 1.75	1.75	200	201	21,157	2022/5/15
		US TREASURY N/B 1.75	1.75	600	604	63,530	2022/5/31
		US TREASURY N/B 1.75	1.75	300	302	31,762	2022/9/30
		US TREASURY N/B 1.75	1.75	1,000	1,008	106,007	2023/5/15
		US TREASURY N/B 1.75	1.75	1,100	1,112	116,870	2021/11/30
		US TREASURY N/B 1.875	1.875	600	604	63,565	2022/1/31
US TREASURY N/B 1.875	1.875	700	706	74,222	2022/2/28		
US TREASURY N/B 1.875	1.875	500	504	53,040	2022/3/31		
US TREASURY N/B 1.875	1.875	1,000	1,010	106,139	2022/4/30		
US TREASURY N/B 1.875	1.875	1,000	1,010	106,180	2022/8/31		
US TREASURY N/B 1.875	1.875	1,000	1,012	106,368	2024/8/31		
US TREASURY N/B 1.875	1.875	300	306	32,196	2026/6/30		
US TREASURY N/B 1.875	1.875	1,000	1,026	107,830	2020/9/30		
US TREASURY N/B 2	2.0	500	501	52,687	2020/11/30		
US TREASURY N/B 2	2.0	400	401	42,202			

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
	US TREASURY N/B 2	2.0	800	806	84,694	2021/5/31
	US TREASURY N/B 2	2.0	800	807	84,845	2021/8/31
	US TREASURY N/B 2	2.0	250	252	26,534	2021/10/31
	US TREASURY N/B 2	2.0	1,000	1,011	106,270	2021/11/15
	US TREASURY N/B 2	2.0	600	607	63,870	2022/2/15
	US TREASURY N/B 2	2.0	700	710	74,705	2022/7/31
	US TREASURY N/B 2	2.0	800	813	85,476	2022/10/31
	US TREASURY N/B 2	2.0	900	916	96,337	2023/2/15
	US TREASURY N/B 2	2.0	1,000	1,025	107,756	2024/4/30
	US TREASURY N/B 2	2.0	500	513	53,931	2024/5/31
	US TREASURY N/B 2	2.0	600	615	64,712	2024/6/30
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	500	501	52,745	2020/8/31
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	500	503	52,901	2021/1/31
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	800	808	84,904	2021/6/30
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	1,000	1,011	106,262	2021/8/15
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	400	404	42,547	2021/9/30
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	3,000	3,057	321,249	2022/6/30
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	1,000	1,022	107,403	2022/12/31
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	4,800	4,941	519,200	2024/2/29
	US TREASURY N/B 2.125	2.125	500	520	54,727	2026/5/31
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	2,800	2,824	296,844	2021/2/15
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	600	605	63,673	2021/3/31
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	500	505	53,102	2021/4/30
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	1,000	1,034	108,659	2023/12/31
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	3,550	3,672	385,944	2024/1/31
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	800	832	87,472	2024/10/31
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	900	936	98,391	2024/11/15
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	500	520	54,723	2024/12/31
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	950	993	104,442	2025/11/15
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	900	948	99,677	2027/2/15
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	900	950	99,928	2027/8/15
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	1,100	1,163	122,243	2027/11/15
	US TREASURY N/B 2.25	2.25	800	838	88,116	2046/8/15
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	900	908	95,473	2020/12/31
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	100	101	10,629	2021/3/15
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	500	506	53,184	2021/4/15
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	400	409	42,990	2022/3/15
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	1,000	1,044	109,800	2024/8/15
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	900	958	100,711	2027/5/15
	US TREASURY N/B 2.375	2.375	1,200	1,290	135,641	2029/5/15
	US TREASURY N/B 2.5	2.5	300	312	32,804	2023/8/15
	US TREASURY N/B 2.5	2.5	1,000	1,048	110,186	2024/5/15
	US TREASURY N/B 2.5	2.5	1,000	1,054	110,851	2025/1/31
	US TREASURY N/B 2.5	2.5	900	957	100,600	2026/2/28
	US TREASURY N/B 2.5	2.5	500	549	57,748	2046/2/15

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
	US TREASURY N/B 2. 5	2. 5	600	660	69, 352	2046/ 5/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 625	2. 625	100	100	10, 596	2020/ 8/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 625	2. 625	700	712	74, 917	2021/ 6/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 625	2. 625	400	410	43, 115	2021/ 12/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 625	2. 625	500	531	55, 823	2025/ 3/ 31	
	US TREASURY N/B 2. 625	2. 625	400	427	44, 964	2025/ 12/ 31	
	US TREASURY N/B 2. 625	2. 625	1, 100	1, 205	126, 704	2029/ 2/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 75	2. 75	900	944	99, 241	2023/ 7/ 31	
	US TREASURY N/B 2. 75	2. 75	600	632	66, 422	2023/ 11/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 75	2. 75	500	534	56, 143	2025/ 2/ 28	
	US TREASURY N/B 2. 75	2. 75	900	965	101, 413	2025/ 6/ 30	
	US TREASURY N/B 2. 75	2. 75	700	751	78, 986	2025/ 8/ 31	
	US TREASURY N/B 2. 75	2. 75	500	549	57, 720	2028/ 2/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 75	2. 75	400	457	48, 123	2042/ 11/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 75	2. 75	600	693	72, 849	2047/ 8/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 75	2. 75	600	693	72, 914	2047/ 11/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 875	2. 875	700	720	75, 722	2021/ 11/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 875	2. 875	900	953	100, 142	2023/ 11/ 30	
	US TREASURY N/B 2. 875	2. 875	800	861	90, 565	2025/ 4/ 30	
	US TREASURY N/B 2. 875	2. 875	600	646	67, 983	2025/ 5/ 31	
	US TREASURY N/B 2. 875	2. 875	1, 750	1, 943	204, 261	2028/ 5/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 875	2. 875	1, 000	1, 112	116, 950	2028/ 8/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 875	2. 875	400	468	49, 193	2043/ 5/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 875	2. 875	1, 400	1, 647	173, 132	2045/ 8/ 15	
	US TREASURY N/B 2. 875	2. 875	900	1, 062	111, 668	2046/ 11/ 15	
	US TREASURY N/B 3	3. 0	400	435	45, 782	2025/ 9/ 30	
	US TREASURY N/B 3	3. 0	400	476	50, 116	2042/ 5/ 15	
	US TREASURY N/B 3	3. 0	900	1, 078	113, 286	2044/ 11/ 15	
	US TREASURY N/B 3	3. 0	200	240	25, 238	2045/ 5/ 15	
	US TREASURY N/B 3	3. 0	900	1, 083	113, 855	2045/ 11/ 15	
	US TREASURY N/B 3	3. 0	250	302	31, 782	2047/ 2/ 15	
	US TREASURY N/B 3	3. 0	800	967	101, 691	2047/ 5/ 15	
	US TREASURY N/B 3	3. 0	800	969	101, 914	2048/ 2/ 15	
	US TREASURY N/B 3	3. 0	100	121	12, 766	2048/ 8/ 15	
	US TREASURY N/B 3	3. 0	850	1, 035	108, 793	2049/ 2/ 15	
	US TREASURY N/B 3. 125	3. 125	800	820	86, 244	2021/ 5/ 15	
	US TREASURY N/B 3. 125	3. 125	550	625	65, 709	2028/ 11/ 15	
	US TREASURY N/B 3. 125	3. 125	300	364	38, 321	2041/ 11/ 15	
	US TREASURY N/B 3. 125	3. 125	300	364	38, 338	2042/ 2/ 15	
	US TREASURY N/B 3. 125	3. 125	400	486	51, 160	2043/ 2/ 15	
	US TREASURY N/B 3. 125	3. 125	500	611	64, 209	2044/ 8/ 15	
	US TREASURY N/B 3. 375	3. 375	1, 050	1, 366	143, 554	2048/ 11/ 15	
	US TREASURY N/B 3. 5	3. 5	300	382	40, 200	2039/ 2/ 15	
	US TREASURY N/B 3. 625	3. 625	1, 200	1, 234	129, 731	2021/ 2/ 15	
	US TREASURY N/B 3. 625	3. 625	500	659	69, 315	2044/ 2/ 15	

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		US TREASURY N/B 3.75	3.75	250	332	34,896	2041/8/15
		US TREASURY N/B 3.75	3.75	100	134	14,098	2043/11/15
		US TREASURY N/B 3.875	3.875	1,700	2,289	240,530	2040/8/15
		US TREASURY N/B 4.25	4.25	100	140	14,731	2039/5/15
		US TREASURY N/B 4.25	4.25	300	423	44,552	2040/11/15
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	200	282	29,663	2038/2/15
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	300	428	45,007	2039/11/15
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	200	288	30,267	2041/5/15
		US TREASURY N/B 4.5	4.5	100	140	14,725	2036/2/15
		US TREASURY N/B 4.625	4.625	300	442	46,490	2040/2/15
		US TREASURY N/B 5.25	5.25	200	264	27,762	2028/11/15
		US TREASURY N/B 5.25	5.25	100	132	13,964	2029/2/15
		US TREASURY N/B 5.375	5.375	100	140	14,713	2031/2/15
		US TREASURY N/B 6.25	6.25	200	292	30,775	2030/5/15
		US TREASURY N/B 6.5	6.5	300	403	42,357	2026/11/15
		US TREASURY N/B 8	8.0	300	341	35,934	2021/11/15
小	計		-	-	-	12,557,191	-
(カナダ)	国債証券			千カナダドル	千カナダドル		
		CANADA-GOV'T 0.5	0.5	400	391	30,922	2022/3/1
		CANADA-GOV'T 0.75	0.75	100	99	7,817	2020/9/1
		CANADA-GOV'T 0.75	0.75	600	593	46,824	2021/3/1
		CANADA-GOV'T 0.75	0.75	300	295	23,319	2021/9/1
		CANADA-GOV'T 1	1.0	200	197	15,575	2027/6/1
		CANADA-GOV'T 1.5	1.5	400	403	31,844	2023/6/1
		CANADA-GOV'T 1.5	1.5	800	812	64,143	2026/6/1
		CANADA-GOV'T 2	2.0	300	320	25,308	2028/6/1
		CANADA-GOV'T 2.25	2.25	450	475	37,579	2025/6/1
		CANADA-GOV'T 2.25	2.25	200	219	17,345	2029/6/1
		CANADA-GOV'T 2.75	2.75	500	517	40,869	2022/6/1
		CANADA-GOV'T 2.75	2.75	250	327	25,879	2048/12/1
		CANADA-GOV'T 3.25	3.25	500	515	40,729	2021/6/1
		CANADA-GOV'T 3.5	3.5	150	216	17,120	2045/12/1
CANADA-GOV'T 4	4.0	350	515	40,726	2041/6/1		
CANADA-GOV'T 5	5.0	250	390	30,843	2037/6/1		
小	計		-	-	-	496,850	-
(メキシコ)	国債証券			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
		MEXICAN BONOS 10	10.0	2,000	2,280	11,997	2024/12/5
		MEXICAN BONOS 5.75	5.75	3,500	3,288	17,298	2026/3/5
		MEXICAN BONOS 6.5	6.5	6,000	5,947	31,284	2021/6/10
		MEXICAN BONOS 6.5	6.5	4,000	3,959	20,826	2022/6/9
		MEXICAN BONOS 7.5	7.5	5,300	5,478	28,816	2027/6/3
		MEXICAN BONOS 7.75	7.75	1,000	1,052	5,538	2031/5/29
		MEXICAN BONOS 7.75	7.75	1,000	1,046	5,506	2034/11/23
MEXICAN BONOS 7.75	7.75	6,000	6,219	32,716	2042/11/13		
MEXICAN BONOS 8	8.0	4,500	4,687	24,655	2023/12/7		

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		MEXICAN BONOS 8.5	8.5	1,000	1,108	5,831	2029/5/31
		MEXICAN BONOS 8.5	8.5	2,000	2,227	11,716	2038/11/18
小	計		—	—	—	196,187	—
(ユーロ)				千ユーロ	千ユーロ		
(ドイツ)	国債証券	BUNDESUBL-173 0	—	500	507	59,378	2021/4/9
		BUNDESUBL-174 0	—	200	203	23,870	2021/10/8
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	100	108	12,683	2027/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.25	0.25	400	436	51,130	2028/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5	250	272	31,959	2026/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5	0.5	350	387	45,379	2027/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1	1.0	300	329	38,553	2024/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1	1.0	200	223	26,131	2025/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1.25	1.25	100	141	16,611	2048/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5	400	430	50,349	2022/9/4
		DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5	300	327	38,384	2023/5/15
		DEUTSCHLAND REP 1.5	1.5	600	670	78,488	2024/5/15
		DEUTSCHLAND REP 1.75	1.75	100	107	12,619	2022/7/4
		DEUTSCHLAND REP 1.75	1.75	100	112	13,143	2024/2/15
		DEUTSCHLAND REP 2	2.0	250	267	31,322	2022/1/4
		DEUTSCHLAND REP 2	2.0	200	223	26,212	2023/8/15
		DEUTSCHLAND REP 2.25	2.25	200	212	24,927	2021/9/4
		DEUTSCHLAND REP 2.5	2.5	200	209	24,531	2021/1/4
		DEUTSCHLAND REP 2.5	2.5	400	679	79,592	2044/7/4
		DEUTSCHLAND REP 2.5	2.5	400	699	81,834	2046/8/15
		DEUTSCHLAND REP 3.25	3.25	100	107	12,617	2021/7/4
		DEUTSCHLAND REP 3.25	3.25	950	1,747	204,560	2042/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4	4.0	100	180	21,082	2037/1/4
DEUTSCHLAND REP 4.75	4.75	300	632	74,020	2040/7/4		
DEUTSCHLAND REP 5.5	5.5	500	864	101,240	2031/1/4		
DEUTSCHLAND REP 5.625	5.625	410	637	74,677	2028/1/4		
DEUTSCHLAND REP 6.25	6.25	200	264	30,920	2024/1/4		
DEUTSCHLAND REP 6.5	6.5	100	159	18,660	2027/7/4		
(イタリア)	国債証券	BTPS 0.35	0.35	400	401	47,051	2021/11/1
		BTPS 0.45	0.45	500	503	58,933	2021/6/1
		BTPS 0.65	0.65	200	201	23,629	2020/11/1
		BTPS 0.65	0.65	300	301	35,281	2023/10/15
		BTPS 0.95	0.95	600	609	71,326	2023/3/15
		BTPS 1.25	1.25	100	101	11,936	2026/12/1
		BTPS 1.35	1.35	350	359	42,064	2022/4/15
		BTPS 1.45	1.45	200	206	24,183	2022/9/15
		BTPS 1.45	1.45	300	310	36,306	2024/11/15
		BTPS 1.5	1.5	1,000	1,035	121,247	2025/6/1
		BTPS 1.6	1.6	100	104	12,223	2026/6/1
		BTPS 1.65	1.65	1,300	1,318	154,341	2032/3/1
		BTPS 1.85	1.85	300	315	36,992	2024/5/15

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		BTPS 2.05	2.05	150	161	18,869	2027/8/1
		BTPS 2.2	2.2	400	434	50,829	2027/6/1
		BTPS 2.25	2.25	500	531	62,164	2036/9/1
		BTPS 2.3	2.3	2,100	2,195	257,077	2021/10/15
		BTPS 2.45	2.45	300	329	38,556	2033/9/1
		BTPS 2.5	2.5	600	651	76,325	2024/12/1
		BTPS 2.7	2.7	800	879	102,953	2047/3/1
		BTPS 2.8	2.8	200	210	24,682	2067/3/1
		BTPS 3.45	3.45	200	248	29,097	2048/3/1
		BTPS 3.75	3.75	700	740	86,652	2021/3/1
		BTPS 3.75	3.75	400	424	49,743	2021/5/1
		BTPS 3.75	3.75	400	457	53,604	2024/9/1
		BTPS 4	4.0	450	586	68,704	2037/2/1
		BTPS 4.5	4.5	200	244	28,619	2026/3/1
		BTPS 4.75	4.75	300	327	38,373	2021/9/1
		BTPS 4.75	4.75	500	656	76,838	2028/9/1
		BTPS 4.75	4.75	200	294	34,438	2044/9/1
		BTPS 5	5.0	200	223	26,169	2022/3/1
		BTPS 5	5.0	400	568	66,519	2034/8/1
		BTPS 5	5.0	250	369	43,222	2039/8/1
		BTPS 5	5.0	200	295	34,633	2040/9/1
		BTPS 5.25	5.25	200	273	32,064	2029/11/1
		BTPS 5.5	5.5	100	115	13,557	2022/11/1
		BTPS 5.75	5.75	200	297	34,789	2033/2/1
		BTPS 6	6.0	400	590	69,119	2031/5/1
		BTPS 6.5	6.5	700	995	116,574	2027/11/1
		BTPS 9	9.0	550	739	86,580	2023/11/1
(フランス)	国債証券	FRANCE O. A. T. 0	—	500	506	59,238	2021/2/25
		FRANCE O. A. T. 0	—	700	709	83,117	2021/5/25
		FRANCE O. A. T. 0	—	500	510	59,761	2022/2/25
		FRANCE O. A. T. 0	—	200	204	23,962	2022/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.25	0.25	500	506	59,278	2020/11/25
		FRANCE O. A. T. 0.25	0.25	100	106	12,410	2026/11/25
		FRANCE O. A. T. 0.5	0.5	500	534	62,578	2025/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.5	0.5	1,800	1,956	229,063	2029/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.75	0.75	100	110	12,965	2028/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.75	0.75	300	332	38,979	2028/11/25
		FRANCE O. A. T. 1	1.0	1,600	1,767	206,910	2025/11/25
		FRANCE O. A. T. 1	1.0	450	504	59,053	2027/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.25	1.25	300	357	41,875	2034/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.25	1.25	700	838	98,197	2036/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.5	1.5	650	784	91,822	2031/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.75	1.75	900	987	115,646	2023/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.75	1.75	600	785	91,925	2039/6/25
		FRANCE O. A. T. 1.75	1.75	200	283	33,178	2066/5/25

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		FRANCE O. A. T. 2. 25	2. 25	700	769	90, 070	2022/10/25
		FRANCE O. A. T. 2. 25	2. 25	200	229	26, 817	2024/ 5 /25
		FRANCE O. A. T. 2. 5	2. 5	150	155	18, 229	2020/10/25
		FRANCE O. A. T. 2. 5	2. 5	400	522	61, 221	2030/ 5 /25
		FRANCE O. A. T. 2. 75	2. 75	800	1, 019	119, 374	2027/10/25
		FRANCE O. A. T. 3	3. 0	250	275	32, 304	2022/ 4 /25
		FRANCE O. A. T. 3. 25	3. 25	400	435	51, 005	2021/10/25
		FRANCE O. A. T. 3. 25	3. 25	400	686	80, 398	2045/ 5 /25
		FRANCE O. A. T. 3. 5	3. 5	650	833	97, 616	2026/ 4 /25
		FRANCE O. A. T. 3. 75	3. 75	200	215	25, 207	2021/ 4 /25
		FRANCE O. A. T. 4	4. 0	100	210	24, 642	2055/ 4 /25
		FRANCE O. A. T. 4	4. 0	300	662	77, 546	2060/ 4 /25
		FRANCE O. A. T. 4. 25	4. 25	600	728	85, 333	2023/10/25
		FRANCE O. A. T. 4. 5	4. 5	300	574	67, 291	2041/ 4 /25
		FRANCE O. A. T. 4. 75	4. 75	400	701	82, 143	2035/ 4 /25
		FRANCE O. A. T. 5. 5	5. 5	200	316	37, 099	2029/ 4 /25
		FRANCE O. A. T. 5. 75	5. 75	700	1, 255	147, 031	2032/10/25
		FRANCE O. A. T. 6	6. 0	400	567	66, 462	2025/10/25
		FRANCE O. A. T. 8. 5	8. 5	200	269	31, 565	2023/ 4 /25
(オランダ)	国債証券	NETHERLANDS GOVT 0	—	300	306	35, 862	2022/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVT 0. 25	0. 25	400	424	49, 662	2025/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVT 0. 5	0. 5	300	325	38, 133	2026/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVT 0. 75	0. 75	700	778	91, 186	2027/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVT 0. 75	0. 75	100	112	13, 159	2028/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVT 2	2. 0	400	456	53, 428	2024/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVT 2. 25	2. 25	100	109	12, 790	2022/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVT 2. 5	2. 5	100	139	16, 385	2033/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVT 2. 75	2. 75	100	180	21, 175	2047/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVT 3. 25	3. 25	400	431	50, 506	2021/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVT 3. 75	3. 75	200	232	27, 183	2023/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVT 4	4. 0	450	795	93, 113	2037/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVT 5. 5	5. 5	400	611	71, 612	2028/ 1 /15
(スペイン)	国債証券	SPANISH GOV' T 0. 05	0. 05	100	100	11, 805	2021/ 1 /31
		SPANISH GOV' T 0. 25	0. 25	1, 300	1, 337	156, 595	2024/ 7 /30
		SPANISH GOV' T 0. 35	0. 35	1, 700	1, 750	204, 878	2023/ 7 /30
		SPANISH GOV' T 0. 4	0. 4	100	102	12, 002	2022/ 4 /30
		SPANISH GOV' T 0. 45	0. 45	300	309	36, 179	2022/10/31
		SPANISH GOV' T 0. 75	0. 75	1, 600	1, 640	192, 062	2021/ 7 /30
		SPANISH GOV' T 1. 3	1. 3	200	220	25, 767	2026/10/31
		SPANISH GOV' T 1. 4	1. 4	100	112	13, 135	2028/ 7 /30
		SPANISH GOV' T 1. 45	1. 45	400	448	52, 521	2027/10/31
		SPANISH GOV' T 1. 5	1. 5	300	336	39, 368	2027/ 4 /30
		SPANISH GOV' T 1. 6	1. 6	300	331	38, 829	2025/ 4 /30
		SPANISH GOV' T 1. 95	1. 95	600	684	80, 127	2026/ 4 /30
		SPANISH GOV' T 2. 35	2. 35	500	631	73, 974	2033/ 7 /30

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期 末				
				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	
		SPANISH GOV	T 2.7	2.7	100	141	16,565	2048/10/31
		SPANISH GOV	T 2.75	2.75	500	579	67,875	2024/10/31
		SPANISH GOV	T 2.9	2.9	300	436	51,051	2046/10/31
		SPANISH GOV	T 3.45	3.45	100	172	20,163	2066/7/30
		SPANISH GOV	T 3.8	3.8	200	240	28,121	2024/4/30
		SPANISH GOV	T 4.2	4.2	170	272	31,920	2037/1/31
		SPANISH GOV	T 4.65	4.65	250	322	37,773	2025/7/30
		SPANISH GOV	T 4.7	4.7	200	357	41,891	2041/7/30
		SPANISH GOV	T 4.8	4.8	500	615	72,065	2024/1/31
		SPANISH GOV	T 4.85	4.85	200	212	24,907	2020/10/31
		SPANISH GOV	T 4.9	4.9	100	180	21,160	2040/7/30
		SPANISH GOV	T 5.15	5.15	700	1,028	120,370	2028/10/31
		SPANISH GOV	T 5.15	5.15	200	391	45,822	2044/10/31
		SPANISH GOV	T 5.5	5.5	200	220	25,804	2021/4/30
		SPANISH GOV	T 5.75	5.75	300	508	59,580	2032/7/30
		SPANISH GOV	T 5.85	5.85	600	693	81,218	2022/1/31
		SPANISH GOV	T 6	6.0	500	780	91,383	2029/1/31
(ベルギー)	国債証券	BELGIAN	0.8	0.8	100	108	12,685	2025/6/22
		BELGIAN	0.8	0.8	300	330	38,673	2027/6/22
		BELGIAN	0.8	0.8	200	221	25,922	2028/6/22
		BELGIAN	0304 5	5.0	250	442	51,845	2035/3/28
		BELGIAN	0308 4	4.0	300	337	39,560	2022/3/28
		BELGIAN	0320 4.25	4.25	200	364	42,694	2041/3/28
		BELGIAN	0321 4.25	4.25	100	110	12,954	2021/9/28
		BELGIAN	0324 4.5	4.5	100	134	15,701	2026/3/28
		BELGIAN	0328 2.25	2.25	400	447	52,338	2023/6/22
		BELGIAN	0332 2.6	2.6	100	116	13,595	2024/6/22
		BELGIAN	0338 0.5	0.5	100	106	12,411	2024/10/22
		BELGIAN	1	1.0	200	221	25,914	2026/6/22
		BELGIAN	1	1.0	250	285	33,369	2031/6/22
		BELGIAN	1.9	1.9	400	523	61,332	2038/6/22
		BELGIAN	2.15	2.15	200	300	35,216	2066/6/22
		BELGIAN	3.75	3.75	300	545	63,842	2045/6/22
(オーストリア)	国債証券	REP OF AUSTRIA	0.5	0.5	800	867	101,511	2027/4/20
		REP OF AUSTRIA	0.75	0.75	400	443	51,955	2028/2/20
		REP OF AUSTRIA	1.2	1.2	200	223	26,193	2025/10/20
		REP OF AUSTRIA	1.5	1.5	100	134	15,750	2047/2/20
		REP OF AUSTRIA	1.65	1.65	300	337	39,518	2024/10/21
		REP OF AUSTRIA	1.75	1.75	300	332	38,904	2023/10/20
		REP OF AUSTRIA	2.4	2.4	150	207	24,268	2034/5/23
		REP OF AUSTRIA	3.15	3.15	100	174	20,408	2044/6/20
		REP OF AUSTRIA	3.4	3.4	200	227	26,660	2022/11/22
		REP OF AUSTRIA	3.5	3.5	200	217	25,506	2021/9/15
		REP OF AUSTRIA	3.8	3.8	100	234	27,486	2062/1/26
		REP OF AUSTRIA	4.15	4.15	200	348	40,779	2037/3/15

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(フィンランド) 国債証券	FINNISH GOV'T 0.75	0.75	100	112	13,206	2031/4/15
	FINNISH GOV'T 0.875	0.875	100	109	12,824	2025/9/15
	FINNISH GOV'T 1.125	1.125	100	119	14,038	2034/4/15
	FINNISH GOV'T 1.5	1.5	300	325	38,106	2023/4/15
	FINNISH GOV'T 1.625	1.625	100	107	12,592	2022/9/15
	FINNISH GOV'T 2	2.0	200	226	26,484	2024/4/15
	FINNISH GOV'T 2.625	2.625	100	161	18,853	2042/7/4
	FINNISH GOV'T 2.75	2.75	100	129	15,166	2028/7/4
(アイルランド) 国債証券	IRISH GOVT 0.8	0.8	100	103	12,140	2022/3/15
	IRISH GOVT 1.7	1.7	100	120	14,136	2037/5/15
	IRISH GOVT 2	2.0	300	394	46,228	2045/2/18
	IRISH GOVT 3.4	3.4	200	236	27,673	2024/3/18
	IRISH GOVT 3.9	3.9	200	232	27,230	2023/3/20
	IRISH GOVT 5	5.0	600	638	74,790	2020/10/18
	IRISH GOVT 5.4	5.4	300	397	46,586	2025/3/13
小 計		-	-	-	9,928,686	-
(イギリス) 国債証券	UK TSY GILT 0.5	0.5	千英ポンド 500	千英ポンド 502	64,706	2022/7/22
	UK TSY GILT 0.75	0.75	200	202	26,156	2023/7/22
	UK TSY GILT 1	1.0	250	257	33,163	2024/4/22
	UK TSY GILT 1.25	1.25	150	159	20,606	2027/7/22
	UK TSY GILT 1.5	1.5	150	152	19,616	2021/1/22
	UK TSY GILT 1.5	1.5	400	431	55,564	2026/7/22
	UK TSY GILT 1.5	1.5	200	220	28,391	2047/7/22
	UK TSY GILT 1.625	1.625	450	496	63,940	2028/10/22
	UK TSY GILT 1.75	1.75	300	312	40,255	2022/9/7
	UK TSY GILT 1.75	1.75	200	226	29,175	2037/9/7
	UK TSY GILT 1.75	1.75	300	369	47,582	2057/7/22
	UK TSY GILT 2	2.0	150	165	21,273	2025/9/7
	UK TSY GILT 2.25	2.25	250	268	34,651	2023/9/7
	UK TSY GILT 2.5	2.5	200	310	39,986	2065/7/22
	UK TSY GILT 2.75	2.75	300	335	43,266	2024/9/7
	UK TSY GILT 3.25	3.25	1,200	1,759	226,716	2044/1/22
	UK TSY GILT 3.5	3.5	400	784	101,106	2068/7/22
	UK TSY GILT 3.75	3.75	200	206	26,639	2020/9/7
	UK TSY GILT 3.75	3.75	250	266	34,409	2021/9/7
	UK TSY GILT 3.75	3.75	50	87	11,280	2052/7/22
	UK TSY GILT 4	4.0	250	497	64,181	2060/1/22
	UK TSY GILT 4.25	4.25	350	460	59,305	2027/12/7
	UK TSY GILT 4.25	4.25	200	286	36,988	2032/6/7
	UK TSY GILT 4.25	4.25	450	684	88,229	2036/3/7
UK TSY GILT 4.25	4.25	300	485	62,568	2040/12/7	
UK TSY GILT 4.25	4.25	100	174	22,550	2046/12/7	
UK TSY GILT 4.25	4.25	200	364	46,969	2049/12/7	
UK TSY GILT 4.25	4.25	200	394	50,889	2055/12/7	

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		UK TSY GILT 4.5	4.5	150	228	29,472	2034/9/7
		UK TSY GILT 4.5	4.5	200	342	44,191	2042/12/7
		UK TSY GILT 4.75	4.75	300	436	56,314	2030/12/7
		UK TSY GILT 4.75	4.75	100	167	21,550	2038/12/7
		UK TSY GILT 5	5.0	150	188	24,243	2025/3/7
		UK TSY GILT 8	8.0	300	340	43,881	2021/6/7
小	計		—	—	—	1,619,826	—
(スウェーデン)	国債証券	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	0.75	千スウェーデンクローナ 700	千スウェーデンクローナ 771	8,419	2028/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 1	1.0	800	887	9,686	2026/11/12
		SWEDISH GOVRNMNT 1.5	1.5	600	655	7,156	2023/11/13
		SWEDISH GOVRNMNT 2.5	2.5	1,100	1,297	14,160	2025/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 3.5	3.5	2,000	2,235	24,387	2022/6/1
		SWEDISH GOVRNMNT 3.5	3.5	700	1,149	12,543	2039/3/30
		SWEDISH GOVRNMNT 5	5.0	1,000	1,071	11,691	2020/12/1
小	計		—	—	—	88,044	—
(ノルウェー)	国債証券	NORWEGIAN GOV'T 1.5	1.5	千ノルウェークローネ 1,000	千ノルウェークローネ 1,022	11,938	2026/2/19
		NORWEGIAN GOV'T 1.75	1.75	1,000	1,033	12,073	2025/3/13
		NORWEGIAN GOV'T 2	2.0	300	309	3,614	2023/5/24
		NORWEGIAN GOV'T 2	2.0	1,000	1,067	12,464	2028/4/26
		NORWEGIAN GOV'T 3	3.0	600	649	7,585	2024/3/14
		NORWEGIAN GOV'T 3.75	3.75	1,000	1,045	12,206	2021/5/25
小	計		—	—	—	59,883	—
(デンマーク)	国債証券	DENMARK - BULLET 0.5	0.5	千デンマーククローネ 950	千デンマーククローネ 1,050	16,491	2027/11/15
		DENMARK - BULLET 0.5	0.5	500	559	8,786	2029/11/15
		DENMARK - BULLET 1.5	1.5	800	882	13,847	2023/11/15
		DENMARK - BULLET 1.75	1.75	400	466	7,320	2025/11/15
		DENMARK - BULLET 3	3.0	1,500	1,631	25,615	2021/11/15
		DENMARK - BULLET 4.5	4.5	1,700	3,439	53,999	2039/11/15
		DENMARK - BULLET 7	7.0	520	736	11,570	2024/11/10
小	計		—	—	—	137,631	—
(ポーランド)	国債証券	POLAND GOVT BOND 1.75	1.75	千ポーランドズロチ 700	千ポーランドズロチ 702	18,772	2021/7/25
		POLAND GOVT BOND 2	2.0	200	201	5,378	2021/4/25
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	900	933	24,944	2026/7/25
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	1,100	1,136	30,373	2027/7/25
		POLAND GOVT BOND 3.25	3.25	400	431	11,525	2025/7/25
		POLAND GOVT BOND 4	4.0	500	546	14,615	2023/10/25
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	600	651	17,417	2021/10/25
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	700	785	21,006	2022/9/23
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	100	132	3,547	2029/4/25
小	計		—	—	—	147,580	—
(オーストラリア)	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 2	2.0	千オーストラリアドル 300	千オーストラリアドル 308	21,763	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	500	556	39,337	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	400	437	30,898	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	250	287	20,295	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	400	462	32,697	2028/11/21

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	100	122	8,667	2035/6/21
	AUSTRALIAN GOVT. 3	3.0	200	262	18,526	2047/3/21
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	250	284	20,126	2025/4/21
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	400	485	34,333	2029/4/21
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	200	265	18,754	2039/6/21
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	3.75	300	417	29,484	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	4.25	700	855	60,453	2026/4/21
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	4.5	350	503	35,590	2033/4/21
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	5.5	500	587	41,471	2023/4/21
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	5.75	600	651	46,022	2021/5/15
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	5.75	600	687	48,536	2022/7/15
小	計	—	—	—	506,960	—
(シンガポール)	国債証券		千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	SINGAPORE GOV'T 1.25	1.25	400	396	29,983	2021/10/1
	SINGAPORE GOV'T 2.125	2.125	200	204	15,495	2026/6/1
	SINGAPORE GOV'T 2.25	2.25	200	202	15,281	2021/6/1
	SINGAPORE GOV'T 2.75	2.75	300	311	23,586	2023/7/1
	SINGAPORE GOV'T 2.75	2.75	100	113	8,574	2042/4/1
	SINGAPORE GOV'T 2.75	2.75	200	228	17,245	2046/3/1
	SINGAPORE GOV'T 2.875	2.875	300	328	24,837	2029/7/1
	SINGAPORE GOV'T 3	3.0	100	106	8,033	2024/9/1
	SINGAPORE GOV'T 3.125	3.125	300	312	23,652	2022/9/1
	SINGAPORE GOV'T 3.375	3.375	250	295	22,319	2033/9/1
	SINGAPORE GOV'T 3.5	3.5	400	449	33,968	2027/3/1
小	計	—	—	—	222,978	—
(南アフリカ)	国債証券		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	REP SOUTH AFRICA 6.5	6.5	10,000	6,997	47,859	2041/2/28
	REP SOUTH AFRICA 7	7.0	10,800	9,119	62,377	2031/2/28
	REP SOUTH AFRICA 7.75	7.75	3,500	3,546	24,256	2023/2/28
小	計	—	—	—	134,493	—
合	計	—	—	—	26,096,314	—

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

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 投資信託財産の構成

(2019年8月26日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
コーポレートローン等、その他	26,096,314	94.0
投資信託財産総額	1,656,117	6.0
	27,752,431	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（26,373,172千円）の投資信託財産総額（27,752,431千円）に対する比率は95.0%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=105.08円、1カナダドル=78.96円、1メキシコペソ=5.26円、1ユーロ=117.07円、1英ポンド=128.88円、1スウェーデンクローナ=10.91円、1ノルウェークローネ=11.68円、1デンマーククローネ=15.70円、1ポーランドズロチ=26.73円、1オーストラリアドル=70.65円、1シンガポールドル=75.61円、1南アフリカランド=6.84円です。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年8月26日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	53,424,882,605円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	652,093,955
公 社 債 (評 価 額)	26,096,314,926
未 収 入 金	26,496,075,039
未 収 利 息	158,831,207
前 払 費 用	21,567,478
(B) 負 債	25,841,576,948
未 払 金	25,672,708,000
未 払 解 約 金	168,850,000
未 払 利 息	1,412
そ の 他 未 払 費 用	17,536
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	27,583,305,657
元 本	18,519,397,157
次 期 繰 越 損 益 金	9,063,908,500
(D) 受 益 権 総 口 数	18,519,397,157口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,894円

※当期における期首元本額33,505,526,660円、期中追加設定元本額8,656,459,751円、期中一部解約元本額23,642,589,254円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	5,125,792,994円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,092,725,913円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	924,682,626円
イオン・バランス戦略ファンド	653,295,526円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	43,140,493円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	4,912,620円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	8,979,459円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	3,829,212円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	4,749,100円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	9,429,542円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,258,766,383円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,984,140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)	440,683,516円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンドII<適格機関投資家限定>	3,018,699,108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>	70,712,567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>	362,837,760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>	494,176,198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>

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8月28日 至2019年8月26日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	850,492,109円
受 取 利 息	850,700,604
支 払 利 息	△ 208,495
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,479,172,782
売 買 益	8,101,536,126
売 買 損	△ 6,622,363,344
(C) 信 託 報 酬 等	△ 19,478,403
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	2,310,186,488
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	12,611,956,073
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,734,367,252
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 9,592,601,313
(H) 計 (D + E + F + G)	9,063,908,500
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	9,063,908,500

※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

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	%			%	百万円
	18,345	17.0	185.50	17.2	98.4	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

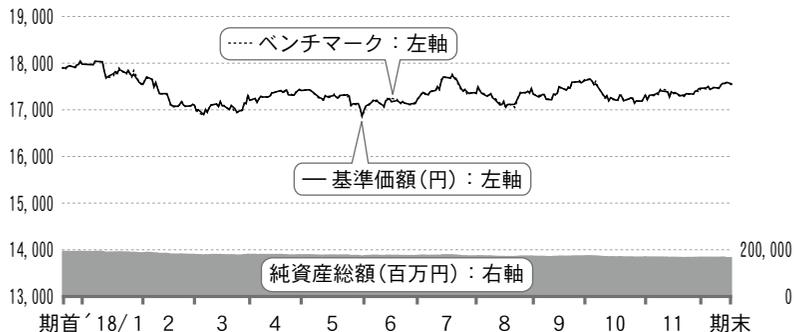
年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 率 比
	騰 落	率	騰 落	率	
(期 首) 2017年12月18日	円	%			%
	17,897	—	181.01	—	98.9
12月末	17,979	0.5	181.80	0.4	98.8
2018年 1月末	17,545	△2.0	177.34	△2.0	98.3
2月末	17,090	△4.5	172.94	△4.5	98.5
3月末	17,204	△3.9	174.09	△3.8	98.6
4月末	17,414	△2.7	176.17	△2.7	98.9
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。

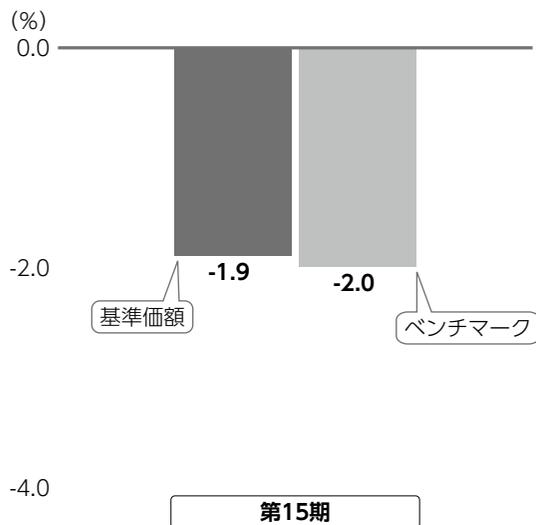
当期の米ドル・円は、期首112円76銭から期末113円47銭と0円71銭の米ドル高・円安、ユーロ・円は期首132円55銭から期末128円28銭と4円27銭のユーロ安・円高となりました。

▶ 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
	カ ナ ダ	国 債 証 券	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	国 債 証 券	7,680	26,721
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	19,426	36,070
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	2,515	6,920
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	9,765	17,373
	ベルギー	国 債 証 券	2,868	7,759
	オーストリア	国 債 証 券	2,037	7,206
フィンランド	国 債 証 券	301	1,045	
アイルランド	国 債 証 券	1,815	2,354	
国	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 7,853	千英ポンド 20,338
	ス イ ス	国 債 証 券	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 国	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
	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	千マレーシアリングgit 1,560	千マレーシアリングgit 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	額	評 価 額		償 還 年 月 日
						率	面	
(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	評 価 額		償 還 年 月 日
							面	金	
		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		債 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 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		US TREASURY N/B 2.375		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 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 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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		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 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				3.8	1,900	2,223	285,229	2024/4/30
				4.0	2,500	2,650	339,942	2020/4/30
				4.2	1,850	2,438	312,796	2037/1/31
				4.3	550	572	73,438	2019/10/31
				4.4	2,000	2,382	305,565	2023/10/31
				4.65	2,800	3,488	447,568	2025/7/30
				4.7	1,900	2,689	345,005	2041/7/30
				4.8	2,000	2,434	312,256	2024/1/31
				4.85	2,000	2,189	280,804	2020/10/31
				4.9	1,900	2,745	352,214	2040/7/30
				5.15	1,100	1,477	189,563	2028/10/31
				5.15	1,200	1,815	232,940	2044/10/31
				5.4	2,500	3,031	388,928	2023/1/31
				5.5	2,700	3,060	392,573	2021/4/30
				5.75	1,900	2,813	360,942	2032/7/30
				5.85	2,200	2,602	333,822	2022/1/31
				5.9	2,500	3,387	434,484	2026/7/30
				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	評 価 額		債 還 年 月 日
								外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			REP OF AUSTRIA 0.75	0.75	1,400	1,446	185,577	2026/10/20		
			REP OF AUSTRIA 0.75	0.75	200	204	26,214	2028/ 2 /20		
			REP OF AUSTRIA 1.2	1.2	400	428	54,941	2025/10/20		
			REP OF AUSTRIA 1.5	1.5	500	516	66,205	2047/ 2 /20		
			REP OF AUSTRIA 1.5	1.5	200	187	24,057	2086/11/ 2		
			REP OF AUSTRIA 1.65	1.65	1,500	1,645	211,094	2024/10/21		
			REP OF AUSTRIA 1.75	1.75	1,000	1,093	140,251	2023/10/20		
			REP OF AUSTRIA 2.4	2.4	600	721	92,614	2034/ 5 /23		
			REP OF AUSTRIA 3.15	3.15	500	707	90,699	2044/ 6 /20		
			REP OF AUSTRIA 3.4	3.4	600	688	88,305	2022/11/22		
			REP OF AUSTRIA 3.5	3.5	1,000	1,110	142,501	2021/ 9 /15		
			REP OF AUSTRIA 3.65	3.65	1,000	1,135	145,714	2022/ 4 /20		
			REP OF AUSTRIA 3.8	3.8	500	870	111,618	2062/ 1 /26		
			REP OF AUSTRIA 3.9	3.9	1,500	1,606	206,124	2020/ 7 /15		
			REP OF AUSTRIA 4.15	4.15	1,300	1,966	252,305	2037/ 3 /15		
			REP OF AUSTRIA 4.85	4.85	1,000	1,333	171,110	2026/ 3 /15		
			REP OF AUSTRIA 6.25	6.25	1,000	1,495	191,883	2027/ 7 /15		
(フィンランド)	国債証券		FINNISH GOV'T 0.5	0.5	100	99	12,761	2028/ 9 /15		
			FINNISH GOV'T 0.75	0.75	500	499	64,132	2031/ 4 /15		
			FINNISH GOV'T 1.125	1.125	200	205	26,425	2034/ 4 /15		
			FINNISH GOV'T 1.5	1.5	1,000	1,074	137,825	2023/ 4 /15		
			FINNISH GOV'T 1.625	1.625	1,000	1,072	137,612	2022/ 9 /15		
			FINNISH GOV'T 2	2.0	1,000	1,109	142,345	2024/ 4 /15		
			FINNISH GOV'T 2.625	2.625	500	666	85,477	2042/ 7 / 4		
			FINNISH GOV'T 2.75	2.75	600	725	93,105	2028/ 7 / 4		
			FINNISH GOV'T 3.375	3.375	700	736	94,528	2020/ 4 /15		
			FINNISH GOV'T 3.5	3.5	1,000	1,093	140,283	2021/ 4 /15		
			FINNISH GOV'T 4	4.0	1,000	1,254	160,922	2025/ 7 / 4		
(アイルランド)	国債証券		IRISH GOVT 0	—	400	400	51,405	2022/10/18		
			IRISH GOVT 0.8	0.8	700	721	92,583	2022/ 3 /15		
			IRISH GOVT 0.9	0.9	700	697	89,475	2028/ 5 /15		
			IRISH GOVT 1	1.0	1,000	1,026	131,738	2026/ 5 /15		
			IRISH GOVT 1.7	1.7	300	304	39,073	2037/ 5 /15		
			IRISH GOVT 2	2.0	1,000	1,044	134,038	2045/ 2 /18		
			IRISH GOVT 2.4	2.4	600	678	87,027	2030/ 5 /15		
			IRISH GOVT 3.4	3.4	1,000	1,167	149,764	2024/ 3 /18		
			IRISH GOVT 3.9	3.9	500	583	74,841	2023/ 3 /20		
			IRISH GOVT 4.5	4.5	990	1,056	135,490	2020/ 4 /18		
			IRISH GOVT 5	5.0	1,000	1,101	141,292	2020/10/18		
			IRISH GOVT 5.4	5.4	1,500	1,958	251,233	2025/ 3 /13		
	小	計		—	—	—	65,235,765	—		
(イギリス)	国債証券		UK TSY GILT 0.5	0.5	千英ポンド 1,200	千英ポンド 1,188	169,781	2022/ 7 /22		
			UK TSY GILT 0.75	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	評		額	債	還	年	月	日
							外	貨						
		SWEDISH GOVRNMNT	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	評		額	債	還	年	月	日
							外	貨						
		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		千シンガポールドル 1,100		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		2027/3/1		
	小	計		—		—		—		673,081		—		
(マレーシア)	国債証券	MALAYSIA GOVT 3.418		3.418		千マレーシアリンギット 5,000		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		千南アフリカランド 65,000		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
公 社 債	千円 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条の第6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

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

■ 損益の状況

(自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)

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) TOPIX (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株比	株式先物率 (買建-売建)	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
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。

※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。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) TOPIX (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株比	株式先物率 (買建-売建)
	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

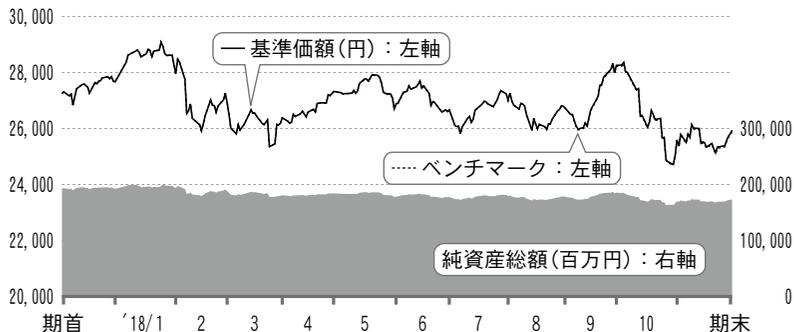
※騰落率は期首比です。

※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	<ul style="list-style-type: none"> ・ 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	<ul style="list-style-type: none"> ・ 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T O P I X（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

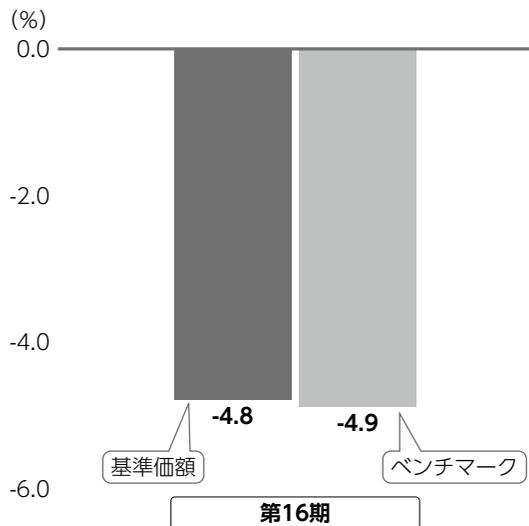
T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、期を通じて、先物を含めた実質株式投資比率は100%に近い高位を保ちました。

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	千円	千株	千円
		6,993 (△3,870)	13,483,729 ()	11,096	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		売	
			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	百万円	百万円	百万円
			55,505	53,293	—	—

※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	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株 式	13,483	2,548	18.9	22,724	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
	百万円	百万円	百万円
株 式	104	375	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
	百万円
株 式	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、株式会社みなと銀行、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	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	3.5	3.5	11,287	
日本水産	94.6	96.8	66,404	
マルハニチロ	15.6	14	57,470	
カネコ種苗	4.1	4	5,748	
サカタのタネ	12	11.5	44,792	
ホクト	8.4	7.9	15,950	
鉱業 (0.3%)				
住石ホールディングス	10	—	—	
日鉄鉱業	2.3	2.4	13,344	
三井松島ホールディングス	5	4.9	7,898	
国際石油開発帝石	405	389.5	469,347	
日本海洋掘削	3.2	—	—	
石油資源開発	13.2	13.7	32,249	
K&Oエナジーグループ	5.1	5.1	8,343	
建設業 (3.0%)				
ヒノキヤグループ	—	2.6	5,493	
ショーボンドホールディングス	7.7	7.5	65,250	
ミライト・ホールディングス	25.2	24.1	40,102	
タマホーム	9.9	7.2	7,999	
T A T E R U	1.6	12.5	4,925	
スペースバリューホールディングス	—	12.8	13,388	
ダイセキ環境ソリューション	3.6	—	—	
安藤・間	63.8	61.7	42,326	
東急建設	31.2	28.4	32,518	
コムシ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 評価額
	株数	株数	
ピ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
大末建設	—	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
ナカノフドール建設	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	—	—
バコーポレーション	—	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 評価額
	株数	株数	
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	—	—
新興ブランテック	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
中部銅料	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
寿スブリッツ	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	株数	評価額
雪印メグミルク	18.2	17.3	54,668	
プリマハム	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	
ダイドー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	
キュービー	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	
ビックルスコーポレーション	-	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	株数	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	
ホギメディカル	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	
パルプ・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	
中越パルプ工業	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	
レンゴー	75	72.1	69,432	
トーモク	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 評価額
	株数	株数	
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
太陽日酸	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 評価額
	株数	株数	
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	
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	
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
フジイ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	
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
日本輕金属ホールディングス	217	196.2	49,834
三井金属鋁業	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
住友金属鋁山	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
東洋製鐵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	
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
日本フィルコン	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
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	—	—
FUJII	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
D MG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
フリュー	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 評価額
	株数	株数	
レオン自動車	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・ビー機械	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
オカダアイヨン	2.7	3.2	5,497
ワイエイシイホールディングス	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
日島機械	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
オルガン	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 評価額
	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
ホンザキ	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
ユーション精機	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
日本ピラー工業	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 評価額
	株数	株数	
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 評価額
	株数	株数	
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	—	—
オブテックスグループ	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	
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
ユーション	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
K O A	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	
N O K	40.1	38.5	65,835
フタバ産業	23.2	20.3	12,423
K Y B	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
S U B A R U	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
T B K	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
J M S	11.5	12	7,140
長野計器	6.8	7.4	7,081
ブイ・テクノロジ	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	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
H O Y A	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・デイ	—	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	
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	—	—
バンダイ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
宝印刷	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	
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
サカイ引越センター	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
滋澤倉庫	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
キユ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
エアティイー	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
ファインデックス	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
ポルトウイン・ビッドクルーホールディ	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
イチチーム	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
オブティム	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 評価額
	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
CIJ	—	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JSA 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
NTT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 評価額
	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
カブコン	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
東京エレクトロン 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
バイタルケアエスケー・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
ジェ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	
	株数	株数	評価額	評価額
S P K	—	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	
I D O M	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	
キャノ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	
	株数	株数	評価額	評価額
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	
ミツウ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	
P A L T A C	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	
J K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	
キャンドウ	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
ハニースホールディングス	8.8	8.8	7,999
アルベン	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
ドトール・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
ブロンコビルー	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
テムニー	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	
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ビバ	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
カップ・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
ゼ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
V T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
Mr Max HD	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	
	株数	株数	株数	評価額
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	
バルコ	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	
サックスパー ホールディングス	7.9	7.3	8,205	
ベルーナ	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	
	株数	株数	株数	評価額
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 評価額
	株数	株数	
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
藍澤証券	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 評価額
	株数	株数	
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
オリエントコーポレーション	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	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	11.2	10.8	32,065
テオーシー	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	
日本エスリード	3.7	4.2	6,808
日神不動産	11.1	13.5	6,925
日本エスコン	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
サービスマザー (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
カカクコム	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	
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
びあ	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
みらいホールディングス	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
バリュエーション	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
エスクロー・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
	株数	株数	評価額
エポラブルアジア	2	2.4	5,421
ストライク	0.8	1.9	5,565
ソラスト	4.8	17	24,412
インソース	—	2.5	6,177
キャリアインデックス	—	2.8	5,927
M S - J a p a n	—	3.2	4,998
グレイステクノロジー	—	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	9,562
日総工産	—	2	3,930
キュービーネットホールディングス	—	4	8,876
スプリックス	—	2.2	4,283
リログループ	38.9	37.4	116,688
東祥	4.8	4.3	18,189
エイチ・アイ・エス	11	12	45,900
共立メンテナンス	12.6	10.4	59,280
イチネンホールディングス	9.5	8.5	12,376
建設技術研究所	7	5.7	8,367
スペース	5.2	5.3	6,587
燦ホールディングス	—	2.3	5,924
東京テアトル	4.4	4.9	6,615
ナガワ	1.6	2	12,700
よみうりランド	2.1	2.3	9,717
東京都競馬	5.5	4.6	15,663
常磐興産	4.8	5.3	9,312
カナモト	10.9	9.7	32,398
東京ドーム	29.5	25.8	26,806
西尾レントオール	6.3	7	29,015
トランス・コスモス	7.9	7.5	19,680
乃村工藝社	16.5	15.9	48,415
藤田観光	3.4	3.3	10,461
KNT-CTホールディングス	4.9	4.3	5,538
日本管財	8	7	14,623
トーカイ	3.6	6.6	18,433

銘柄	期首(前期末)	期	末
	株数	株数	評価額
セコム	75.3	72.4	695,474
セントラル警備保障	4.4	3.4	21,556
丹青社	14.5	13.2	17,028
メイテック	8.5	8.9	45,568
アサツー ディ・ケイ	13.5	—	—
応用地質	9	8.3	11,105
船井総研ホールディングス	9.9	14.1	29,539
オオバ	10.4	7.8	5,709
学究社	—	4.2	6,925
ベネッセホールディングス	26.1	25.1	84,587
イオンディライト	8.5	8.2	32,759
ナック	7.2	6	6,582
ニチイ学館	14	10.5	12,022
ダイセキ	12.7	11.4	29,959
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	89,136 1,639	81,162 1,659 168,579,248 <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	百万円 4,870	百万円 —
株式先物取引	TOPIX	

※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
株式	千円	%
株	168,579,248	97.1
コール・ローン等、その他	5,089,190	2.9
投資信託財産総額	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。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2018年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	175,422,343,818円
コーポレート等	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<適格機関投資家限定>	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ァンド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ァンド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ァンド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ァンド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ァンド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ァンド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（T O P I X）	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N I S A・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ァンド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N I S A・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・国内株式バシッパ・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。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	投資信託 証券 組入比率	純資産額 総
	期騰落	中率	期騰落	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				
(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



※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

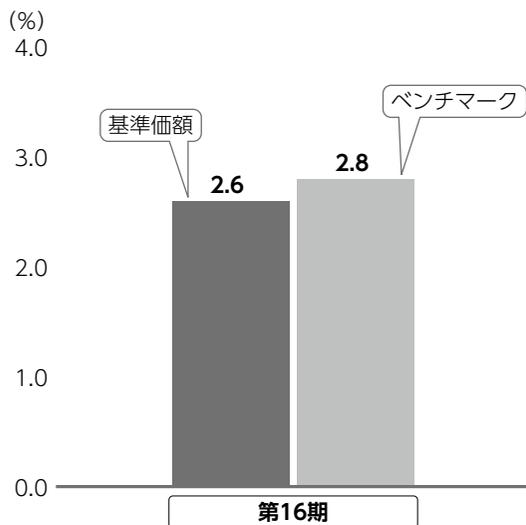
MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について (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-	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	千ニュージーランドドル 1,115	2,026	千ニュージーランドドル 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)	千イスラエルシュケル 305 (-)	108 (-)	千イスラエルシュケル 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		口 千米ドル	口 千米ドル	口 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	ナ ダ	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	千カナダドル	—	—	—	千カナダドル
			H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,060	—	—	3,432	—	66
			SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,960	61	—	3,839	—	77
	小	計	5,020	117	—	—	—	—	—
	ユ	ー ロ	フランス	KLEPIERRE	—	千ユーロ	—	—	千ユーロ
			GECINA SA	—	—	—	1,577	—	55
			UNIBAIL-RODAMCO SE	1,597 (△ 5,937)	308 (△ 1,251)	—	414	—	55
			UNIBAIL-GROUP STAPLED(NEW)	—	—	—	342	—	64
小	計	1,597	308	—	—	—	—	—	
ユ	ー	ロ	計	1,597	308	—	—	—	—
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	
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 (2,846)	—	389	
		APA GROUP-RIGHTS SHARE(NEW)	—	—	—	—	—	—	
		TRANSURBAN GROUP-RTS	—	—	—	—	—	—	
		TRANSURBAN GROUP-RTS-NEW	—	—	—	8,043 (8,043)	—	7 (8)	
		TRANSURBAN GROUP-RIGHT	—	—	—	—	—	—	
		TRANSURBAN GROUP-RIGHT NEW	—	—	—	—	—	—	
小		計	29,221 (28,191)	275 (9)	—	—	—	—	—
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 国	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	—	—	—	—
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	33,900 (—)	(△ 1) 64	—	—
		SUNTEC REIT	— (—)	— (△ 1)	47,300	85
小 計	33,900 (—)	64 (△ 3)	47,300	85		

※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
AKAMAI 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	評価金額	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
AUTONATION 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	
			株数	株数			
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 COMMUNICATTIONS 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	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
FIN 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	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	評価金額	価額	
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 CORP 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 VTC 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		評価額		業種等
	株数	株数	金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
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
OMNICOM 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	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
TRANSIDGM 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
US 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 BIOMER 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	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	
	銘柄数	銘柄数	—	<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	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ALTAGAS LTD	69	97	136	11,663	公益事業
ATCO LTD-CLASS I	30	30	122	10,451	公益事業
AURORA CANNABIS INC	—	285	214	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	395	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	74,414	素材
BAUSCH HEALTH COS INC	—	118	373	31,937	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	18,085	ソフトウェア・サービス
BOMBARDIER INC 'B'	758	758	164	14,060	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	430	343	2,018	172,433	各種金融
CAE INC	139	139	370	31,643	資本財
CCL INDUSTRIES INC-CL B	69	53	284	24,316	素材
CI FINANCIAL CORP	110	110	219	18,768	各種金融
CAMECO CORP	163	163	259	22,182	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	31,266	小売
CANADIAN UTILITIES LIMITED	64	39	125	10,690	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	—	83	370	31,669	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	34,507	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE	9	8	795	67,945	ソフトウェア・サービス
CRESCENT POINT ENERGY CORP	225	225	90	7,748	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 LIFE CO 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	17,304 89	71,004 —	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	株数	株数	金額	金額	
	11,332	10,261	42,748	5,522,646	
	銘柄数	銘柄数	<比率>	<比率>	
	57	63	—	<3.2%>	
(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	株数	評価額	評価額	
	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
SOCIEETE 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	期首(前期末)		期末		業種等	
	株数	金額	株数	金額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ALSTOM RGPT	64	252	64	32,566	資本財	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	87	158	87	20,438	メディア・娯楽	
ELECTRICITE DE FRANCE (EDF)	238	351	238	45,375	公益事業	
IPSEN	18	170	14	22,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARKEMA	32	275	32	35,537	素材	
LEGRAND SA	126	575	106	74,289	資本財	
EIFPAGE SA	35	305	35	39,423	資本財	
TOTAL SA	1,110	4,792	989	619,125	エネルギー	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	13	233	13	30,117	運輸	
NATIXIS	453	224	453	28,979	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	—	248	35	32,150	ソフトウェア・サービス	
SCOR SE	83	301	71	38,983	保険	
REXEL SA	128	136	128	17,610	資本財	
VINCI S. A.	235	1,625	209	210,012	資本財	
DANONE	281	1,649	251	213,083	食品・飲料・タバコ	
AIR LIQUIDE SA	206	1,829	175	236,393	素材	
BUREAU VERITAS SA	126	245	126	31,734	商業・専門サービス	
GETLINK	234	194	169	25,143	運輸	
SUEZ	177	232	177	30,089	公益事業	
EDENRED	94	317	94	41,015	商業・専門サービス	
VALEO SA	111	254	99	32,859	自動車・自動車部品	
BIOMERIEUX	—	115	17	14,938	ヘルスケア機器・サービス	
AMUNDI SA	—	121	23	15,656	各種金融	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	12,520 65	11,269 68	47,672 —	6,158,828 <3.5%>
(ユーロ・・・オランダ)						
AIRBUS SE	278	2,270	239	293,298	資本財	
RELX NV	461	—	—	—	商業・専門サービス	
RANDSTAD NV	57	199	46	25,742	商業・専門サービス	
AKZO NOBEL	115	801	108	103,541	素材	
WOLTERS KLUWER-CVA	137	690	128	89,188	商業・専門サービス	
VOPAK	31	121	31	15,693	エネルギー	
AEGON NV	872	370	745	47,885	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	1,625	359	1,415	46,394	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	298	363	280	46,987	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	448	1,286	390	166,184	ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	125	835	104	107,923	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	52	405	52	52,437	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	87	569	73	73,570	素材	
UNILEVER NV-CVA	765	3,112	635	402,086	家庭用品・パーソナル用品	
BOSKALIS WESTMINSTER NV	37	—	—	—	資本財	
ASML HOLDING NV	174	2,551	168	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	1,135	504	146,714	食品・生活必需品小売り	
FERRARI NV	57	464	48	60,039	自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	513	364	431	47,127	資本財	
NN GROUP NV	163	493	129	63,694	保険	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	502	635	431	82,059	自動車・自動車部品	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	189	431	189	55,766	銀行	
EXOR NV	55	242	46	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	312	100	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	1,720	1,592	222,299	銀行	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	9,909 28	7,897 23	19,737 —	2,549,933 <1.5%>
(ユーロ・・・スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	313	—	—	—	運輸	
ENDESA S. A.	150	254	129	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
MAPFRE 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	金額 —	金額 —	
	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	金額 —	金額 —	
	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	金額 —	金額 —	
	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	金額 —	金額 —	
	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	株数	期		末		業種等
		期首(前期末)	期	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		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
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	181,979	159,056	73,911	10,717,912			
株数	105	97	—	<6.2%>			
金額							
比率							
(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	
DUFY 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	外 貨 建 金 額 : 47,617	邦 貨 換 算 金 額 : 5,423,660	
	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >	—	< 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
TELIA 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
GETTINGE 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	外 貨 建 金 額 : 131,949	邦 貨 換 算 金 額 : 1,650,689	
	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >	—	< 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	株数	期首(前期末)	期末		業種等
		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	2,812	2,548	34,948	464,113	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	<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	2,447	1,769	61,747	1,068,853	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	<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	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 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	33,338 58	30,067 57	46,312 —	3,847,682 <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 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	3,209 7	2,822 7	1,797 —	139,934 <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 COMPANYY	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
AIA 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	株数 銘柄数	44,674 40	41,035 40	136,909 —	1,986,554 <1.1%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
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	株数 銘柄数	22,753 22	19,318 21	8,961 —	742,810 <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		期末		業種等
	株数	株数	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)					千イスラエルシケル		
BANK HAPOLIM 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	2,543	株数	2,496	6,095	186,528	
	銘柄数	9	銘柄数	8	—	<0.1%>	
合計	株数	572,624	株数	505,064	—	163,192,742	
	銘柄数	1,265	銘柄数	1,250	—	<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。

※—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		組 入 比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			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	
LENDLEASE 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	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 損 益	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 損 益	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・年金ワ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)

エマージング株式インデックス・マザーファンド

第8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：2011年4月18日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として新興国の株式（預託証券（DR）、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。）、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ・外貨建資産について対円で為替ヘッジは原則として行いません。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		（ベンチマーク） MSCIエマージング・ マーケット・インデックス （配当込み、 円ベース）		株式組入 率 比	株式先物 率 比 （買建-売建）	債券組入 率 比	投資信託 証券組入 率 比	純資産 総額
	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率					
4期（2014年12月1日）	円 12,703	% 16.2	円 135.27	% 17.7	% —	% 99.5	% 57.0	% —	百万円 166
5期（2015年11月30日）	11,059	△12.9	118.14	△12.7	—	102.4	38.3	—	993
6期（2016年11月30日）	10,817	△2.2	115.41	△2.3	—	100.6	69.2	—	6,806
7期（2017年11月30日）	14,363	32.8	156.96	36.0	—	100.2	79.8	—	4,291
8期（2018年11月30日）	13,023	△9.3	142.90	△9.0	43.2	53.6	—	3.1	4,401

※MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したもので、設定時を100として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エマージング・マーケット・インデックス（配当込み）の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

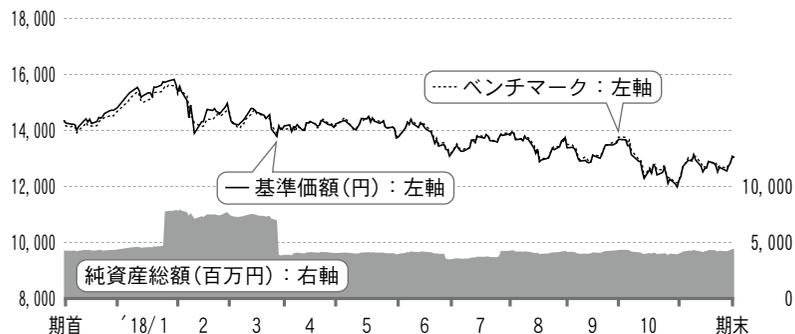
年月日	基準価額		（ベンチマーク） MSCIエマージング・ マーケット・インデックス （配当込み、 円ベース）		株式組入 率 比	株式先物 率 比 （買建-売建）	債券組入 率 比	投資信託 証券組入 率 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
（期首） 2017年11月30日	円 14,363	% —	円 156.96	% —	% —	% 100.2	% 79.8	% —
12月末	14,808	3.1	160.42	2.2	—	99.7	80.7	—
2018年1月末	15,385	7.1	167.10	6.5	—	100.5	87.3	—
2月末	14,610	1.7	160.47	2.2	—	100.2	—	—
3月末	14,164	△1.4	153.47	△2.2	47.6	44.9	—	7.6
4月末	14,234	△0.9	154.77	△1.4	45.8	46.6	—	7.5
5月末	13,763	△4.2	149.96	△4.5	45.2	47.6	—	7.4
6月末	13,172	△8.3	144.19	△8.1	55.6	40.9	—	3.5
7月末	13,833	△3.7	151.71	△3.3	47.9	49.2	—	3.0
8月末	13,381	△6.8	147.62	△5.9	47.8	49.4	—	2.9
9月末	13,685	△4.7	150.39	△4.2	46.5	50.5	—	3.2
10月末	12,216	△14.9	133.72	△14.8	44.3	52.4	—	3.3
（期末） 2018年11月30日	13,023	△9.3	142.90	△9.0	43.2	53.6	—	3.1

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（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	14,363円
期末	13,023円
騰落率	-9.3%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）です。

※MSCIエマージング・マーケット・インデックスの著作権、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MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

下落要因

- ・中国の景気減速懸念に加えて、米中貿易摩擦拡大のリスクが嫌気され、2月以降新興国株式市場が下落したこと
- ・米国の利上げ継続に伴う投資資金の流出懸念を背景に、新興国通貨が円に対して下落したこと

▶ 投資環境について (2017年12月1日から2018年11月30日まで)

当期の新興国株式市場は下落しました。新興国通貨は円に対して下落しました。

株式市場

当期の新興国株式市場は、下落しました。

期初から2018年1月までは、堅調な世界経済、総じて好調な企業業績、米国での税制改革法案の成立などを背景に、世界的に株価が上昇傾向で推移しました。2月以降は、米国の金利上昇や米中貿易摩擦への懸念が強まる中、中国で主要な経済指標が市場予想を下回ったことから景気の先行き不透明感が強まりました。エマージング株式市場でもリスク回避のムードが強まり、期末まで売り圧力が続きました。

当期の市場の動きをMSCIエマージング・マーケット・インデックス（米ドルベース）で見ると、期首に比べて12.6%下落しました。

為替市場

F R B（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げ継続や、2月にみられた世界的な株価下落の動き、トルコ情勢等新興国の政局不安など不透明要因が重なったこともあり、期首から9月上旬まで、新興国通貨は総じて円や米ドルなど主要通貨に対して下落する動きとなりました。特に、トルコリラ、ブラジルリアル、ロシアルーブルなどは、政治・経済動向に焦点が当たった形で一時は大幅に調整する場面もありました。

9月から期末にかけては、それまでの新興国通貨売りの揺り戻し等もあり、新興国通貨が主要通貨に対して買い戻される動きがみられました。

当期のトルコリラ・円は期首28円63銭から期末21円68銭へと6円95銭のトルコリラ安・円高、ブラジルリアル・円は期首34円32銭から期末29円37銭へと4円95銭のブラジルリアル安・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

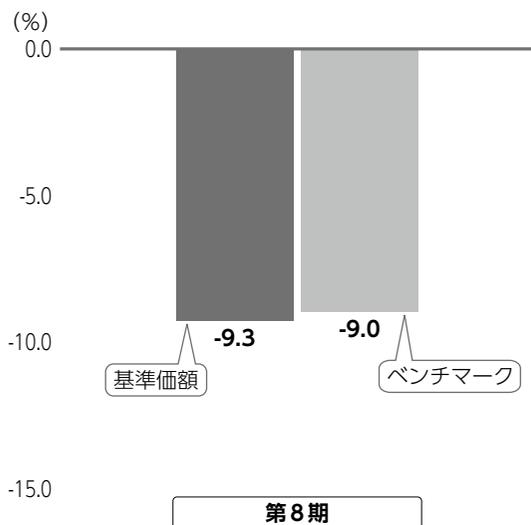
期を通じて、株式、投資信託証券および先物の組入れにより、実質株式組入比率は100%に近い高位を保ちました。

運用経過

日々の追加設定・解約による資金変動には株式指数先物取引を利用し、実質株式組入比率の調整を行い、トラッキングエラー（ポートフォリオとベンチマークのリターン乖離）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MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は-9.3%となり、ベンチマークの騰落率-9.0%から0.3%下方乖離しました。

下方乖離要因 ・ 保管費用等の支払い

2 今後の運用方針

引き続き、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。先物の組入れにより、実質株式組入比率を概ね100%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)	35円 (20) (2) (12)	0.248% (0.144) (0.017) (0.088)	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)	4 (4) (0)	0.032 (0.032) (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)	43 (41) (3)	0.309 (0.290) (0.019)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	82	0.589	

期中の平均基準価額は13,967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
外	アメリカ	百株 261	千米ドル 1,757	百株 7	千米ドル 1
	メキシコ	(2,965 -)	千メキシコペソ (△ 10,960 9)	59	千メキシコペソ 101
	ブラジル	(1,798 100)	千ブラジルリアル (5,013 -)	29	千ブラジルリアル 44
	チリ	(11,517 21)	千チリペソ (150,195 45)	228 (0.01)	千チリペソ (7,845 45)
	コロンビア	389	千コロンビアペソ 242,115	-	千コロンビアペソ -
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ギリシャ	(△ 354 180)	(△ 52 0.08909)	98	6
トルコ	(638 34)	(千トルコリラ 812 -)	153	千トルコリラ 59	
国					

エマージング株式インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	チ エ コ	(28 -)	千チェココルナ 763 (△ 0.908)	2	千チェココルナ 50
	ハ ン ガ リ ー	27	千ハンガリーフォリント 16,346	-	千ハンガリーフォリント -
	ポ ー ラ ン ド	288	千ポーランドズロチ 885	44	千ポーランドズロチ 19
	香 港	(33,658 299)	千香港ドル 38,694 (△ 6)	(1,514 -)	千香港ドル 320 (1)
	マ レ ー シ ア	(3,069 53)	千マレーシアリングット 1,995 (-)	402	千マレーシアリングット 57
	タ イ	(3,522 361)	千タイバーツ 16,197 (-)	31	千タイバーツ 563
	フ ィ リ ピ ン	(2,415 5)	千フィリピンペソ 11,254 (-)	5	千フィリピンペソ -
	イ ン ド ネ シ ア	11,079	千インドネシアルピア 6,316,854	448	千インドネシアルピア 121,233
	韓 国	(351 215)	千韓国ウォン 3,233,492 (-)	(17 1)	千韓国ウォン 31,560 (51)
	台 湾	(12,163 △ 12)	千新台幣ドル 69,314 (△ 106)	(321 146)	千新台幣ドル 846 (134)
	イ ン ド	(2,021 93)	千インドルピー 114,688 (886)	(35 -)	千インドルピー 467 (886)
	エ ジ プ ト	(119 44)	千エジプトポンド 468 (-)	77	千エジプトポンド 36
国 南 ア フ リ カ	(1,275 13)	千南アフリカランド 17,670 (-)	203	千南アフリカランド 187	

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(2) 公社債

		買 付 額	売 付 額
国	内 国 債 証 券	千円 273,466,420	千円 276,667,282
外国	ア メ リ カ 国 債 証 券	千米ドル -	千米ドル 1,997

※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。

(3) 投資信託証券

			買 付 額		売 付 額	
			口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	ア メ リ カ	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	1,272	千米ドル 16	94	千米ドル 1
		ISHARES MSCI INDIA ETF	49,559	1,702	49,559	1,659
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	20,110	751	-	-
		ISHARES MSCI UAE ETF	7,671	130	-	-
		ISHARES MSCI QATAR ETF	9,231	149	-	-
	小	計	87,843	2,750	49,653	1,660
	メ キ シ コ	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	11,700 (-)	千メキシコペソ 317 (△3)	-	-
		小	計	11,700 (-)	317 (△3)	-
	ブ ラ ジ ル	TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	800	千ブラジルリアル 16	800	千ブラジルリアル 15
		SUL AMERICA SA-UNITS	700	15	-	-
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	1,500	55	-	-
		KLABIN SA-UNIT	2,200	39	-	-
	小	計	5,200	127	800	15
	ト ル コ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	6,960	千トルコリラ 18	6,960	千トルコリラ 11
	小	計	6,960	18	6,960	11
南 ア フ リ カ	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	11,038	千南アフリカランド 330	-	-	
	FORTRESS REIT LTD-A	3,905	64	-	-	
	FORTRESS REIT LTD-B	2,984	45	-	-	
	FORTRESS REIT LTD-B(NEW)	-	-	436	6	
		(436)	(-)	-	-	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	18,627	214	-	-	
	HYPROP INVESTMENTS LTD	910	102	-	-	
RESILIENT REIT LTD	1,090	64	-	-		
小	計	38,554 (436)	822 (-)	436	6	
中 国 (オ フ シ ョ ア)	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	28,400	千中国元 (オフショア) 1,032	-	-	
	小	計	28,400	1,032	-	-

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引 M S C I E	百万円 18,774	百万円 20,114	百万円 —	百万円 —

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※外国の取引金額は、各月末（ただし、決算日の属する月については決算日）の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	2,168,169千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,911,856千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	1.13

※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)

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	%
現 先 取 引(公社債)	百万円 31,416	11.5	%	百万円 31,416	11.4	%

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

■ 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	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	—	42	664	75,347	ソフトウェア・サービス
AUTOHOME INC-ADR	—	2	15	1,809	ソフトウェア・サービス
BAIDU INC - SPON ADR	—	10	187	21,330	ソフトウェア・サービス
BAOZUN INC-SPN-ADR	—	1	4	515	ソフトウェア・サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTURA S. A-ADR	—	7	9	1,119	素材
CTRI.P.COM INTERNATIONAL-ADR	—	14	39	4,454	小売
58.COM INC-ADR	—	3	17	1,948	ソフトウェア・サービス
51JOB INC-ADR	—	0.92	5	668	商業・専門サービス
GDS HOLDINGS LTD-ADR	—	2	6	724	ソフトウェア・サービス
HUAZHU GROUP LTD-ADR	—	4	14	1,673	消費者サービス
JD.COM INC-ADR	—	26	56	6,384	小売
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	—	39	4	531	エネルギー
MOMO INC-SPON ADR	—	4	12	1,377	ソフトウェア・サービス
NETEASE.COM INC -ADR	—	3	66	7,598	ソフトウェア・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	—	5	27	3,174	消費者サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	—	1	5	575	各種金融
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	—	34	4	514	不動産
SOUTHERN COPPER CORPORATION	—	3	10	1,141	素材
TAL EDUCATION GROUP-ADR	—	12	33	3,758	消費者サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	—	15	8	937	小売
WEIBO CORP-SPON ADR	—	2	11	1,355	ソフトウェア・サービス
YY INC-ADR	—	2	13	1,490	ソフトウェア・サービス
YUM CHINA HOLDINGS INC	—	14	50	5,683	消費者サービス
CREDICORP LTD	—	2	56	6,416	銀行
SINA CORP	—	2	12	1,420	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	253 25	1,339 —	151,953 < 3.5%>	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A	—	111	225	1,262	資本財
COCA-COLA FEMSA S. A. DE C. V	—	18	227	1,275	食品・飲料・タバコ
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	—	71	1,252	7,023	食品・飲料・タバコ
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	—	7	86	486	小売
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	—	90	513	2,882	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	—	60	239	1,346	食品・飲料・タバコ
GRUMA S. A. B. -B	—	7	180	1,015	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	—	8	151	850	運輸
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	—	17	113	638	資本財

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
CEMEX SAB-CPO	—	534	553	3,103	素材	
GRUPO FINANCIERO BANORTE S. A. B. DE C. V.	—	91	836	4,693	銀行	
MEXICHEM SAB DE CV	—	38	183	1,030	素材	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	—	5	121	683	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	—	56	172	965	家庭用品・パーソナル用品	
ALSEA SAB DE CV	—	19	96	544	消費者サービス	
GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	—	7	210	1,178	運輸	
GRUPO MEXICO SAB DE CV	—	140	589	3,304	素材	
AMERICA MOVIL SAB DE C. V.	—	1,233	1,722	9,663	電気通信サービス	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	—	85	232	1,303	銀行	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	—	16	172	966	食品・飲料・タバコ	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	—	13	183	1,030	運輸	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	—	20	157	884	公益事業	
BANCO SANTANDER MEXICO-B	—	66	170	956	銀行	
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	—	192	956	5,364	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	—	2,906	9,350	52,454	
(ブラジル)		—	24	—	<1.2%>	
千ブラジルレアル						
BRF-BRASIL FOODS SA	—	16	36	1,059	食品・飲料・タバコ	
VALE SA	—	116	603	17,758	素材	
TIM PARTICIPACOES SA	—	31	37	1,098	電気通信サービス	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	—	8	23	688	公益事業	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	—	8	20	606	公益事業	
BANCO DO BRASIL S. A.	—	31	140	4,128	銀行	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	—	162	203	5,986	銀行	
LOJAS AMERICANAS SA	—	27	53	1,588	小売	
GERDAU S. A. -PREF	—	38	57	1,689	素材	
PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	—	109	303	8,936	エネルギー	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	—	13	31	936	小売	
PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	—	144	362	10,670	エネルギー	
KROTON EDUCACIONAL SA	—	51	55	1,636	消費者サービス	
COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	—	44	56	1,650	運輸	
WEG SA	—	27	49	1,463	資本財	
BANCO BRADESCO S. A. -PREF	—	123	479	14,116	銀行	
BANCO BRADESCO SA	—	37	129	3,811	銀行	
NATURA COSMETICOS SA	—	6	24	713	家庭用品・パーソナル用品	
COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S. A. -CSN	—	23	20	594	素材	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	—	16	62	1,833	素材	
ITAU UNIVANCO HOLDING SA	—	177	643	18,941	銀行	
PORTO SEGURO SA	—	4	21	629	保険	
FIBRIA CELULOSE SA	—	9	65	1,915	素材	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
BRASKEM SA-PREF A	—	6	33	986	素材	
LOCALIZA RENT A CAR SA	—	18	50	1,474	運輸	
LOJAS RENNEN S.A.	—	26	102	3,018	小売	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	—	13	62	1,853	エネルギー	
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	—	6	20	598	エネルギー	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	—	7	51	1,524	公益事業	
EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S.A.	—	24	52	1,536	資本財	
M DIAS BRANCO SA	—	4	16	492	食品・飲料・タバコ	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	—	30	38	1,144	不動産	
JBS SA	—	30	35	1,037	食品・飲料・タバコ	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	—	32	40	1,189	公益事業	
COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	—	13	37	1,098	公益事業	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	—	9	21	622	不動産	
HYPERMARCAS SA	—	13	41	1,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELEFONICA BRASIL SA	—	16	74	2,202	電気通信サービス	
MAGAZINE LUIZA SA	—	3	51	1,512	小売	
COMPANHIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRU	—	6	50	1,475	食品・生活必需品小売り	
CIELO SA	—	45	40	1,180	ソフトウェア・サービス	
RAIA DROGASIL SA	—	8	49	1,464	食品・生活必需品小売り	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	—	26	74	2,179	保険	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	—	6	26	774	公益事業	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	—	15	25	737	食品・生活必需品小売り	
BM&F BOVESPA SA	—	75	214	6,325	各種金融	
AMBEV SA	—	173	287	8,474	食品・飲料・タバコ	
RUMO SA	—	40	70	2,072	運輸	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	—	4	30	890	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	—	1,869	5,079	149,553	
	銘柄数 <比率>	—	49	—	< 3.4% >	
(チリ)			千チリペソ			
BANCO SANTANDER CHILE	—	2,416	12,696	2,150	銀行	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	—	1	7,116	1,205	銀行	
BANCO DE CHILE	—	931	9,201	1,558	銀行	
EMPRESAS CMPC SA	—	45	10,854	1,838	素材	
EMPRESAS COPEC SA	—	14	13,327	2,257	エネルギー	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	—	5	4,756	805	食品・飲料・タバコ	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	—	5	3,072	520	電気通信サービス	
ENEL AMERICAS SA	—	1,052	12,353	2,092	公益事業	
COLBUN SA	—	289	4,075	690	公益事業	
AGUAS ANDINAS SA-A	—	95	3,719	630	公益事業	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	—	9	2,273	385	食品・飲料・タバコ	
LATAM AIRLINES GROUP	—	11	7,553	1,279	運輸	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	—	3	10,461	1,772	素材
S. A. C. I. FALABELLA	—	26	13,523	2,290	小売
CENCOSUD SA	—	52	6,660	1,128	食品・生活必需品小売り
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-RIGHTS	—	0.12	22	3	銀行
ENEL CHILE SA	—	719	4,696	795	公益事業
ITAU CORPBANCA	—	5,630	3,655	619	銀行
小計	株数・金額	—	11,310	130,023	22,025
	銘柄数<比率>	—	18	—	<0.5%>
(コロンビア)			千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA	—	14	18,488	647	公益事業
ECOPETRO SA	—	180	56,207	1,967	エネルギー
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	—	4	12,627	441	各種金融
GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF	—	129	13,438	470	銀行
CEMENTOS ARGOS SA	—	16	11,842	414	素材
GRUPO ARGOS SA	—	10	17,045	596	素材
BANCOLOMBIA SA	—	8	28,140	984	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	—	16	54,979	1,924	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA	—	8	27,745	971	各種金融
小計	株数・金額	—	389	240,514	8,417
	銘柄数<比率>	—	9	—	<0.2%>
(ユーロ…ギリシャ)			千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	—	8	9	1,174	電気通信サービス
OPAP SA	—	8	6	850	消費者サービス
JUMBO S. A.	—	3	4	632	小売
TITAN CEMENT CO. S. A.	—	1	3	425	素材
FOLLI FOLLIE GROUP	—	1	0.5904	76	小売
ALPHA BANK AE	—	50	6	782	銀行
ユーロ計	株数・金額	—	74	30	3,941
	銘柄数<比率>	—	6	—	<0.1%>
(トルコ)			千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.	—	80	60	1,335	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	—	7	16	364	食品・飲料・タバコ
ARCELIK AS	—	8	13	300	耐久消費財・アパレル
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	—	7	19	438	資本財
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	—	51	38	849	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	—	2	14	311	自動車・自動車部品
KOC HOLDING AS	—	27	42	936	資本財
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	—	27	14	319	素材
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	—	28	14	313	資本財
TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	—	20	34	752	運輸
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	—	40	51	1,141	電気通信サービス

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
TURKIYE GARANTI BANKASI	—	84	68	1,505	銀行	
TURKIYE IS BANKASI-C	—	57	24	534	銀行	
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	—	4	57	1,268	エネルギー	
HACI OMER SABANCI HOLDING	—	33	27	609	各種金融	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	—	7	65	1,438	食品・生活必需品小売り	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	—	5	13	305	運輸	
TURKIYE HALK BANKASI A. S.	—	22	16	360	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	519 18	595 —	13,087 < 0.3%>	
(チェコ)			千チェココルナ			
KOMERCNI BANKA AS	—	2	250	1,248	銀行	
CEZ AS	—	5	325	1,618	公益事業	
MONETA MONEY BANK AS	—	17	142	708	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	26 3	718 —	3,575 < 0.1%>	
(ハンガリー)			千ハンガリーフォリント			
OTP BANK PLC	—	8	9,940	3,968	銀行	
RICHTER GEDEON NYRT	—	5	2,795	1,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	—	13	4,293	1,713	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	27 3	17,029 —	6,798 < 0.2%>	
(ポーランド)			千ポーランドズロチ			
BANK MILLENNIUM SA	—	22	20	623	銀行	
MBANK SA	—	0.54	22	689	銀行	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	—	1	8	257	銀行	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	—	5	46	1,395	素材	
BANK PEKAO SA	—	5	63	1,903	銀行	
ORANGE POLSKA SA	—	24	11	344	電気通信サービス	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	—	10	123	3,731	エネルギー	
LPP SA	—	0.05	38	1,162	耐久消費財・アパレル	
SANTANDER BANK POLSKA SA	—	1	46	1,404	銀行	
CD PROJEKT SA	—	2	34	1,045	ソフトウェア・サービス	
PKO BANK POLSKI SA	—	34	143	4,315	銀行	
CCC SA	—	1	21	661	耐久消費財・アパレル	
GRUPA LOTOS SA	—	3	27	830	エネルギー	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	—	63	40	1,211	エネルギー	
CYFROWY POLSAT SA	—	8	18	556	メディア・娯楽	
PGE SA	—	30	35	1,056	公益事業	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	—	22	95	2,866	保険	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	—	1	13	392	素材	
ALIOR BANK SA	—	3	17	536	銀行	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	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
DINO POLSKA SA		—	1	17	515	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	—	244	846	25,499	
	銘柄 数 <比 率>	—	20	—	< 0.6%>	
(香港)				千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H		—	50	47	682	素材
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H		—	40	42	623	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H		—	60	32	466	運輸
ANGANG STEEL CO LTD-H		—	40	24	355	素材
CHINA MOBILE LTD		—	230	1,759	25,530	電気通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H		—	45	182	2,644	素材
DATANG INTL POWER GENERATION COMPANY LTD		—	120	22	320	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED		—	20	91	1,320	公益事業
HUANENG POWER INTL INC-H		—	160	76	1,112	公益事業
YANZHOU COAL MINING CO-H		—	60	41	599	エネルギー
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD		—	25	159	2,319	家庭用品・パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H		—	20	6	93	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR		—	60	29	422	運輸
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE		—	120	82	1,199	自動車・自動車部品
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD		—	180	285	4,137	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST		—	140	372	5,403	不動産
CHINA RESOURCES LAND LTD		—	100	282	4,099	不動産
CITIC LIMITED		—	210	263	3,821	資本財
CHINA TRAVEL INTL INV HK		—	40	8	120	消費者サービス
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H		—	60	53	769	運輸
LENOVO GROUP LTD		—	260	144	2,090	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PETROCHINA CO LTD		—	780	423	6,145	エネルギー
CHINA UNICOM HONG KONG LTD		—	220	198	2,872	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD		—	60	155	2,259	保険
CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H		—	940	619	8,988	エネルギー
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H		—	10	11	161	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H		—	30	61	892	ソフトウェア・サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP		—	40	30	436	ソフトウェア・サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD		—	30	211	3,064	公益事業
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD		—	120	113	1,640	エネルギー
TOWNGAS CHINA CO LTD		—	40	23	347	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED		—	60	47	690	運輸
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD		—	260	37	543	不動産
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD		—	41	59	859	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD		—	140	38	562	素材
CHINA EVERBRIGHT LIMITED		—	40	57	833	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LIMITED		—	64	168	2,451	公益事業

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	—	25	52	763	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	—	180	277	4,032	自動車・自動車部品
SHENZHEN INVESTMENT LTD	—	120	30	440	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	—	40	124	1,805	公益事業
BYD CO LTD-H	—	25	148	2,154	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD	—	500	209	3,039	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	—	60	42	623	エネルギー
SINOTRANS LIMITED	—	80	24	355	運輸
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	—	90	61	894	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	—	60	43	625	素材
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	—	240	192	2,799	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	—	80	43	624	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	—	80	118	1,717	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	—	115	57	837	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO.	—	270	453	6,573	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	—	220	64	932	素材
MMG LIMITED	—	80	30	439	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	—	80	59	864	ヘルスケア機器・サービス
WEICHAI POWER CO	—	70	59	867	資本財
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	—	20	7	115	運輸
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L	—	120	42	614	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	—	20	34	495	資本財
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	—	80	83	1,204	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	—	20	62	905	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT	—	100	151	2,191	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	—	80	43	627	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	—	60	162	2,359	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	—	60	38	564	運輸
CNOOC LTD	—	650	833	12,091	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	—	170	120	1,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	—	100	243	3,525	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	—	195	1,478	21,447	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	—	200	90	1,305	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	—	390	26	390	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	—	160	28	417	公益事業
AIR CHINA/HONG KONG	—	60	45	652	運輸
ZTE CORPORATION	—	26	39	579	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED	—	100	27	391	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	—	125	217	3,152	エネルギー
CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H	—	95	29	424	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	—	320	190	2,758	銀行

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	—	80	54	785	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	—	3,570	2,370	34,395	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	—	30	288	4,183	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR CORPORATION	—	100	74	1,076	自動車・自動車部品
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	—	60	61	891	不動産
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	—	60	47	684	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	—	140	84	1,222	素材
BANK OF CHINA LTD	—	2,910	998	14,482	銀行
SHUI ON LAND LIMITED	—	135	24	356	不動産
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED	—	45	85	1,240	不動産
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	—	30	18	271	不動産
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	—	36	42	621	不動産
CHINA MERCHANTS BANK- H	—	145	466	6,774	銀行
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	—	2,580	1,424	20,664	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	—	20	15	217	素材
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	—	20	13	202	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	—	80	59	864	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	—	160	123	1,792	資本財
CHINA COAL ENERGY COMPANY - H	—	40	12	183	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	—	20	34	493	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	—	20	85	1,246	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	—	50	93	1,355	耐久消費財・アパレル
CHINA AGRY-INDUSTRIES HLDGS	—	40	11	164	食品・飲料・タバコ
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	—	280	265	3,847	不動産
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	—	150	47	694	素材
CHINA CITIC BANK	—	330	165	2,394	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	—	45	30	443	不動産
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	26	199	2,891	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	—	40	142	2,063	耐久消費財・アパレル
FOSUN INTERNATIONAL	—	95	115	1,678	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	—	200	73	1,059	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD.	—	110	38	552	不動産
SOHO CHINA LTD	—	75	22	324	不動産
KINGSOFT CORPORATION LTD.	—	30	39	567	ソフトウェア・サービス
SINOTRUK HONG KONG LTD	—	10	12	185	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	—	150	109	1,586	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	—	50	35	511	食品・飲料・タバコ
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	—	25	27	391	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H	—	70	71	1,040	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	—	180	104	1,509	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	—	96	266	3,872	保険

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	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	
CRRC CORP LTD-H	-	150	108	1,575	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	-	85	75	1,100	食品・生活必需品小売り
BBMG CORPORATION - H	-	90	22	326	素材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	-	28	9	145	素材
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	-	44	171	2,483	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	-	80	60	882	素材
METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA LTD-H	-	110	21	314	資本財
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	-	112	92	1,337	自動車・自動車部品
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	-	90	40	591	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP	-	120	74	1,077	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	-	32	60	880	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	-	180	44	639	公益事業
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	-	140	24	349	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	-	90	224	3,251	不動産
YUZHOU PROPERTIES COMPANY	-	60	19	286	不動産
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	-	55	121	1,755	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	-	30	103	1,501	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	-	246	142	2,066	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	-	80	18	264	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	-	22	16	235	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	-	90	31	462	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	-	1,080	383	5,563	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	-	20	31	455	小売
FAR EAST HORIZON LTD	-	70	52	768	各種金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	-	85	124	1,803	各種金融
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	-	60	30	446	不動産
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	-	50	44	648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	-	120	98	1,433	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	-	25	137	1,991	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	-	260	87	1,267	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	-	20	52	766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	-	120	46	672	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	-	50	36	527	資本財
CHINA GALAXY SECURITIES CO	-	120	50	729	各種金融
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED	-	30	34	507	自動車・自動車部品
GREENTOWN SERVICE GROUP	-	40	25	376	商業・専門サービス
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	-	40	56	813	不動産
CHINA EVERGRANDE GROUP	-	100	227	3,293	不動産
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H	-	22	35	513	各種金融
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	-	100	46	674	銀行
GENSCRIPT BIOTECH CORP	-	20	27	402	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	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		
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONA	—	110	78	1,142	半導体・半導体製造装置	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	—	40	50	737	商業・専門サービス	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	—	120	42	619	自動車・自動車部品	
CHINA TOWER CORP LTD-H	—	1,260	144	2,102	電気通信サービス	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	—	120	35	513	半導体・半導体製造装置	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	—	320	66	965	各種金融	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	—	60	55	800	不動産	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	—	60	144	2,102	資本財	
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	—	35	54	793	運輸	
TENCENT HOLDINGS LIMITED	—	209	6,520	94,616	ソフトウェア・サービス	
CHINA VANKE CO LTD -H	—	43	117	1,703	不動産	
LUYE PHARMA GROUP	—	45	28	408	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	—	500	61	892	メディア・娯楽	
CAR INC	—	30	20	296	運輸	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	—	20	31	459	半導体・半導体製造装置	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	—	120	85	1,236	ヘルスケア機器・サービス	
CGN POWER CO LTD-H	—	390	74	1,086	公益事業	
FULLSHARE HOLDING LTD	—	250	73	1,070	資本財	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	—	65	31	449	自動車・自動車部品	
GF SECURITIES CO LTD-H	—	50	59	856	各種金融	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	—	20	47	687	自動車・自動車部品	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	—	60	78	1,137	各種金融	
3SBIO INC	—	35	40	589	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	—	6	13	195	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	—	70	81	1,182	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	—	370	58	853	各種金融	
CHINA LITERATURE LTD	—	6	24	360	メディア・娯楽	
SSY GROUP LIMITED	—	20	16	235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DALI FOODS GROUP CO LTD	—	75	42	611	食品・飲料・タバコ	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	—	30	16	240	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	—	210	33	481	保険	
MEITU INC	—	45	15	221	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
BOC AVIATION LTD	—	8	47	694	資本財	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	—	6	19	286	保険	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	—	40	58	850	各種金融	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	—	15	96	1,396	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	—	400	11	159	耐久消費財・アパレル	
小 計	株 数 ・ 金 額	—	32,443	32,201	467,250	
	銘柄 数 <比率>	—	197	—	<10.6%>	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット			
AMMB HOLDINGS BERHAD	—	61	26	707	銀行	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
GENTING PLANTATIONS BERHAD	—	9	8	235	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	—	169	98	2,680	銀行
DIGI.COM BHD	—	114	48	1,307	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	—	30	23	634	運輸
RHB BANK BHD	—	29	15	409	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	—	23	22	617	資本財
GAMUDA BHD	—	63	14	406	資本財
YTL CORP BHD	—	160	19	520	公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	—	8	15	422	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	—	24	49	1,346	銀行
IJM CORP BHD	—	106	17	474	資本財
KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	—	18	44	1,207	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	—	5	16	452	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BERHAD	—	141	133	3,612	銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	—	37	15	408	銀行
MISC BHD	—	49	31	850	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	—	2	29	797	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	—	20	36	989	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	—	9	23	637	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	—	25	47	1,274	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO MALAYSIA BERHAD	—	5	18	503	食品・飲料・タバコ
TELEKOM MALAYSIA BHD	—	41	9	261	電気通信サービス
SP SETIA BHD	—	55	11	310	不動産
TENAGA NASIONAL BHD	—	125	178	4,825	公益事業
DIALOG GROUP BHD	—	114	36	998	エネルギー
PUBLIC BANK BERHAD	—	107	266	7,222	銀行
AIRASIA GROUP BERHAD	—	55	16	444	運輸
TOP GLOVE CORPORATION BHD	—	52	31	862	ヘルスケア機器・サービス
GENTING BHD	—	85	53	1,460	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BHD	—	109	30	839	消費者サービス
IOI CORPORATION BERHAD	—	81	35	966	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	—	87	20	566	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	—	48	30	827	ヘルスケア機器・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	—	99	37	1,014	電気通信サービス
MAXIS BERHAD	—	72	38	1,054	電気通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	—	88	81	2,206	素材
IHH HEALTHCARE BHD	—	75	41	1,118	ヘルスケア機器・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	—	37	13	376	運輸
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	—	48	23	624	素材
SIME DARBY PROPERTY BHD	—	87	8	234	不動産
SIME DARBY PLANTATION BHD	—	87	43	1,172	食品・飲料・タバコ

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数・金額 銘柄数<比率>	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
101 PROPERTIES GROUP BHD	—	61	10	274	不動産	
小計	—	2,720	1,776	48,156		
	—	43	—	< 1.1% >		
(タイ)			千タイバーツ			
BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	—	9	185	637	銀行	
BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	—	44	228	787	食品・生活必需品小売り	
KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	—	128	258	889	銀行	
ROBINSON DEPARTMENT STORE PLC-NVDR	—	18	122	422	小売	
SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	—	67	914	3,146	銀行	
TRUE CORPORATION PCL-NVDR	—	367	212	732	電気通信サービス	
KASIKORNBANK PUBLIC COMPANY LTD- NVDR	—	25	480	1,651	銀行	
TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	—	401	91	314	銀行	
IRPC PCL-NVDR	—	367	220	757	エネルギー	
BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR	—	76	127	439	エネルギー	
ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	—	5	118	407	公益事業	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	—	110	275	946	食品・飲料・タバコ	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	—	38	670	2,307	電気通信サービス	
HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	—	145	221	763	小売	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	—	18	124	427	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	—	390	1,920	6,607	エネルギー	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	—	70	124	428	食品・飲料・タバコ	
LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	—	111	113	389	不動産	
SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	—	14	618	2,128	素材	
AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	—	157	1,016	3,497	運輸	
KASIKORNBANK PUBLIC COMPANY LTD- FOREIGN	—	43	825	2,840	銀行	
CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	—	49	374	1,289	不動産	
BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	—	142	372	1,282	ヘルスケア機器・サービス	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	—	13	250	863	ヘルスケア機器・サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	—	83	296	1,020	消費者サービス	
THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	—	41	307	1,057	エネルギー	
GLOW ENERGY PLC- NVDR	—	19	163	562	公益事業	
CP ALL PCL-NVDR	—	181	1,239	4,265	食品・生活必需品小売り	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	—	214	201	691	運輸	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	—	51	657	2,263	エネルギー	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	—	58	310	1,067	素材	
PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	—	83	651	2,241	素材	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	—	41	195	673	エネルギー	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	—	274	243	838	運輸	
小計	—	3,852	14,138	48,636		
	—	34	—	< 1.1% >		
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
AYALA LAND INC	—	270	1,124	2,429	不動産	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	—	72	376	814	資本財
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	—	32	308	667	銀行
ALLIANCE GLOBAL GROUP, INC.	—	150	171	370	資本財
DMCI HOLDINGS INC	—	146	180	389	資本財
GLOBE TELECOM INC	—	1	236	510	電気通信サービス
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	—	18	173	375	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC	—	105	506	1,093	資本財
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	—	15	442	956	消費者サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST	—	23	173	375	銀行
MEGAWORLD CORP	—	410	184	399	不動産
ROBINSONS LAND CO	—	76	155	335	不動産
SECURITY BANK CORP	—	8	133	288	銀行
SM PRIME HOLDINGS INC	—	376	1,304	2,818	不動産
UNIVERSAL ROBINA CORP	—	32	413	893	食品・飲料・タバコ
SM INVESTMENTS CORP	—	8	799	1,726	資本財
AYALA CORPORATION	—	9	865	1,869	各種金融
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	—	519	243	526	各種金融
ABOITIZ POWER CORP	—	54	171	369	公益事業
MANILA ELECTRIC COMPANY	—	8	318	688	公益事業
BDO UNIBANK INC	—	72	937	2,024	銀行
GT CAPITAL HOLDINGS INC	—	3	289	625	各種金融
PLDT INC	—	3	364	787	電気通信サービス
小 計	株 数	—	2,415	9,877	21,335
	・ 金 額	—	—	—	—
	銘 柄 数 <比 率>	—	23	—	< 0.5%>
(インドネシア)			千インドネシアルピア		
PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	—	61	179,035	1,414	エネルギー
PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	—	161	103,040	814	食品・飲料・タバコ
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	—	270	159,975	1,263	食品・飲料・タバコ
PT GUDANG GARAM TBK	—	18	150,345	1,187	食品・飲料・タバコ
PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	—	341	126,852	1,002	食品・飲料・タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	—	67	134,670	1,063	素材
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	—	102	119,340	942	素材
PT BANK DANAMON INDONESIA TBK	—	123	92,250	728	銀行
PT BANK MANDIRI	—	684	523,260	4,133	銀行
PT UNILEVER INDONESIA TBK	—	56	235,760	1,862	家庭用品・パーソナル用品
PT BANK RAKYAT	—	2,033	754,243	5,958	銀行
PT PERUSAHAAN GAS NEGARA	—	400	77,600	613	公益事業
BANK NEGARA INDONESIA PT	—	273	239,557	1,892	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	—	109	130,800	1,033	素材
PT BANK CENTRAL ASIA TBK	—	361	945,820	7,471	銀行
JASA MARGA(PERSERO)TBK PT	—	80	32,000	252	運輸

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
BUMI SERPONG DAMAI PT	—	282	37,647	297	不動産	
ADARO ENERGY TBK PT	—	527	67,456	532	エネルギー	
PAKUWON JATI TBK PT	—	794	47,640	376	不動産	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	—	85	82,450	651	食品・飲料・タバコ	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	—	75	30,000	237	電気通信サービス	
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	—	155	42,005	331	銀行	
KALBE FARMA PT	—	773	118,655	937	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	—	741	627,997	4,961	自動車・自動車部品	
PT SURYA CITRA MEDIA TBK	—	214	41,730	329	メディア・娯楽	
TELEKOMUNIKASI TBK PT	—	1,846	690,404	5,454	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数〈比率〉	— —	10,631 26	5,790,532 —	45,745 〈1.0%〉	
(韓国)			千韓国ウォン			
CHEIL COMMUNICATIONS INC	—	2	5,983	607	メディア・娯楽	
HANMI SCIENCE CO LTD	—	0.47	3,501	355	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	—	1	9,218	936	自動車・自動車部品	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	—	1	31,357	3,185	保険	
DB INSURANCE CO LTD	—	1	12,521	1,272	保険	
COWAY CO LTD	—	1	14,668	1,490	耐久消費財・アパレル	
KT&G CORPORATION	—	4	45,048	4,576	食品・飲料・タバコ	
S1 CORPORATION	—	0.63	6,117	621	商業・専門サービス	
KOREA GAS CORPORATION	—	1	5,034	511	公益事業	
CJ CORP	—	0.53	6,890	700	資本財	
KAKAO CORP	—	1	18,704	1,900	ソフトウェア・サービス	
CJ ENM CO LTD	—	0.28	6,241	634	小売	
SK TELECOM CO LTD	—	0.74	21,016	2,135	電気通信サービス	
DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD	—	1	9,700	985	資本財	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	—	13	9,528	968	各種金融	
NCSOFT CORP	—	0.64	32,512	3,303	ソフトウェア・サービス	
LG UPLUS CORP	—	7	13,841	1,406	電気通信サービス	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	—	6	3,002	305	資本財	
POSCO DAEWOO CORP	—	1	2,577	261	資本財	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	—	0.34	39,780	4,041	家庭用品・パーソナル用品	
LG CHEM LTD	—	1	58,380	5,931	素材	
LG CHEM LTD	—	0.28	5,684	577	素材	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	—	0.08	5,600	568	家庭用品・パーソナル用品	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	—	15	65,880	6,693	銀行	
S-OIL CORPORATION	—	1	17,490	1,776	エネルギー	
HANWHA CHEMICAL CORP	—	3	7,448	756	素材	
SAMSUNG SECURITIES CO, LTD.	—	2	7,533	765	各種金融	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	—	0.56	15,428	1,567	素材	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
HOTEL SHILLA CO LTD	—	1	9,625	977	小売
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	—	1	18,157	1,844	資本財
HYUNDAI MOBIS	—	2	43,375	4,406	自動車・自動車部品
HYNIX SEMICONDUCTOR INC	—	21	152,509	15,494	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	—	2	15,644	1,589	資本財
HYUNDAI MOTOR COMPANY	—	0.87	5,454	554	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	—	5	56,500	5,740	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL COMPANY	—	2	12,599	1,280	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	—	9	13,937	1,416	銀行
KCC CORP	—	0.21	5,974	607	資本財
KIA MOTORS CORPORATION	—	9	28,419	2,887	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO., LTD.	—	0.31	13,438	1,365	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	—	9	28,606	2,906	公益事業
HANWHA CORPORATION	—	1	4,999	507	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	—	1	5,811	590	運輸
OCI COMPANY LTD	—	0.61	6,496	660	素材
CJ LOGISTICS CORPORATION	—	0.29	4,495	456	運輸
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	—	0.67	5,942	603	素材
HLB INC	—	1	9,625	977	耐久消費財・アパレル
LG ELECTRONICS INC	—	3	28,782	2,924	耐久消費財・アパレル
LOTTE CORPORATION	—	1	6,069	616	資本財
LG CORP	—	3	25,404	2,581	資本財
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	—	5	7,107	722	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	—	1	7,902	802	資本財
NAVER CORPORATION	—	5	67,207	6,828	ソフトウェア・サービス
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	—	0.51	4,763	483	小売
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	—	1	9,824	998	各種金融
OTTOGI CORPORATION	—	0.04	2,912	295	食品・飲料・タバコ
AMOREPACIFIC GROUP	—	1	6,720	682	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	—	4	13,942	1,416	消費者サービス
POSCO	—	2	71,248	7,238	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	—	5	11,018	1,119	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	—	2	42,319	4,299	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	—	2	24,907	2,530	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	178	771,867	78,421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	—	14	10,713	1,088	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	32	110,720	11,249	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE CO LTD	—	0.27	7,668	779	小売
YUHAN CORPORATION	—	0.31	7,161	727	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	—	6	7,318	743	自動車・自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	—	2	9,400	955	保険

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘	柄	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	
GS HOLDINGS	—	1	9,686	984	エネルギー	
LG DISPLAY CO LTD	—	8	15,293	1,553	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CELLTRION INC	—	2	70,626	7,175	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VIOMED CO LTD	—	0.5	9,810	996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HANA FINANCIAL GROUP INC.	—	10	41,950	4,262	銀行	
GLOVIS CO LTD	—	0.69	8,245	837	運輸	
CELLTRION PHARM INC	—	0.57	3,687	374	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LOTTE SHOPPING CO LTD	—	0.41	9,143	928	小売	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	—	2	22,528	2,288	保険	
AMOREPACIFIC CORP	—	1	19,647	1,996	家庭用品・パーソナル用品	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	—	0.33	2,871	291	家庭用品・パーソナル用品	
SAMSUNG CARD CO LTD	—	1	3,402	345	各種金融	
SK INNOVATION CO LTD	—	2	46,570	4,731	エネルギー	
CJ CHEILJEDANG CORP	—	0.3	10,260	1,042	食品・飲料・タバコ	
PAN OCEAN CO LTD	—	7	3,597	365	運輸	
LG INNOTEK CO LTD	—	0.52	5,226	530	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SK HOLDINGS CO LTD	—	1	32,596	3,311	資本財	
KB FINANCIAL GROUP INC	—	14	70,567	7,169	銀行	
MEDY-TOC INC	—	0.16	8,982	912	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	—	2	7,987	811	資本財	
BS FINANCIAL GROUP INC	—	9	7,630	775	銀行	
HANMI PHARM CO LTD	—	0.23	10,338	1,050	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	—	9	4,283	435	保険	
E-MART INC	—	0.77	14,938	1,517	食品・生活必需品小売り	
DGB FINANCIAL GROUP INC	—	6	5,518	560	銀行	
GS RETAIL CO LTD	—	0.99	3,732	379	食品・生活必需品小売り	
HANKOOK TIRE CO LTD	—	2	11,519	1,170	自動車・自動車部品	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINE	—	1	5,337	542	資本財	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	—	0.36	14,238	1,446	資本財	
BGF RETAIL CO LTD	—	0.32	6,176	627	食品・生活必需品小売り	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	—	0.8	9,120	926	食品・飲料・タバコ	
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	—	1	3,696	375	保険	
NETMARBLE CORPORATION	—	0.93	12,322	1,251	ソフトウェア・サービス	
SAMSUNG SDS CO LTD	—	1	25,472	2,587	ソフトウェア・サービス	
WOORI BANK	—	17	27,381	2,781	銀行	
SAMSUNG C&T CORPORATION	—	2	29,051	2,951	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	—	0.61	20,404	2,073	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PEARLABYSS CORP	—	0.21	4,137	420	ソフトウェア・サービス	
DOOSAN BOBCAT INC	—	1	4,573	464	資本財	
SILLAJEN INC	—	1	14,029	1,425	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	—	1	9,984	1,014	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	—	547	2,823,840	286,902	
	銘 柄 数 <比 率>	—	110	—	< 6.5%>	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)			千新台幣ドル		
ACER INC	—	110	216	795	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASUSTEK COMPUTER INC	—	30	654	2,406	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	—	20	282	1,037	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORPORATION	—	90	293	1,081	素材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	—	10	179	658	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN BUSINESS BANK	—	145	153	565	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	—	30	193	710	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	—	20	141	520	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	—	20	121	447	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC	—	100	491	1,808	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	—	30	139	513	不動産
EVA AIRWAYS CORP	—	73	118	436	運輸
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	—	20	505	1,858	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	—	176	311	1,145	銀行
CHINA AIRLINES LTD	—	100	112	412	運輸
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	—	70	291	1,071	自動車・自動車部品
CHINA STEEL CORP	—	460	1,097	4,037	素材
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	—	95	276	1,016	保険
ADVANTECH CO LTD	—	10	225	829	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	—	150	262	966	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	—	70	899	3,310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	—	40	241	887	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	—	140	1,491	5,486	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	—	320	406	1,495	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	—	60	654	2,406	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE CORPORATION	—	73	88	324	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	—	120	339	1,249	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	—	10	199	732	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE CO LTD	—	10	379	1,394	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	—	20	254	934	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORPORATION	—	170	1,691	6,224	素材
FORMOSA TAFFETA CO LTD	—	30	100	369	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	—	130	1,358	4,999	素材
GIANT MANUFACTURING CO LTD	—	10	140	515	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INCORPORATION	—	60	1,389	5,111	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	—	240	1,166	4,292	各種金融
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	—	271	479	1,764	銀行
HOTA MOTOR COMPANY LTD	—	10	231	851	小売
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	—	60	438	1,614	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	—	370	577	2,124	各種金融

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	—	300	1,456	5,359	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	—	490	489	1,801	銀行
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	—	360	745	2,741	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	—	488	3,533	13,001	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	—	400	1,030	3,790	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	—	3	1,335	4,915	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	—	365	493	1,815	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	—	304	314	1,159	保険
INVENTEC CORPORATION	—	90	198	731	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	—	80	320	1,177	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO., LTD.	—	387	406	1,497	銀行
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	—	640	1,305	4,804	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	—	343	693	2,552	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	—	30	217	800	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	—	190	1,411	5,195	素材
WISTRON CORPORATION	—	102	201	740	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	—	80	261	961	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	—	180	1,299	4,782	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	—	20	647	2,380	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	—	50	555	2,042	エネルギー
PHISON ELECTRONICS CORP	—	10	242	892	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	—	18	86	319	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LIMITED	—	12	102	375	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	—	30	183	676	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD FOODS CORPORATION	—	20	98	361	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	—	50	179	658	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT CORPORATION	—	143	486	1,791	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	—	900	20,610	75,844	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	—	440	506	1,862	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	—	110	165	609	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORPORATION	—	11	430	1,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	—	60	185	681	運輸
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	—	330	341	1,256	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS CO LTD	—	55	207	764	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	—	10	244	898	資本財
TAI MED BIOLOGICS INC	—	10	158	583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEGATRON CORP	—	70	366	1,349	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WIN SEMICONDUCTORS CORP	—	10	120	441	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	—	40	388	1,429	各種金融
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	—	20	158	582	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	—	298	531	1,956	銀行

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	—	130	806	2,966	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	—	10	356	1,310	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	—	10	229	842	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	— —	11,682 84	62,691 —	230,705 < 5.2% >
(インド)			千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	—	105	12,374	20,294	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	—	28	926	1,519	エネルギー
EICHER MOTORS LTD	—	0.5	1,176	1,928	自動車・自動車部品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	—	27	2,142	3,513	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	—	0.31	508	834	素材
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	—	22	550	902	エネルギー
LIC HOUSING FINANCE LTD	—	11	520	853	銀行
TATA STEEL LTD	—	12	692	1,135	素材
NESTLE INDIA LTD	—	0.86	912	1,495	食品・飲料・タバコ
GAIL INDIA LIMITED	—	29	994	1,631	公益事業
VEDANTA LTD	—	48	960	1,576	素材
TITAN CO LTD	—	11	1,074	1,762	耐久消費財・アパレル
OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	—	52	737	1,209	エネルギー
LUPIN LTD	—	8	714	1,171	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	—	58	11,489	18,842	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	—	17	860	1,410	メディア・娯楽
INFOSYS LIMITED	—	129	8,583	14,076	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	—	42	1,323	2,170	ソフトウェア・サービス
INDIAN OIL CORP LTD	—	54	729	1,197	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	—	24	4,267	6,998	家庭用品・パーソナル用品
HCL TECHNOLOGIES LTD	—	20	2,096	3,438	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LIMITED	—	19	814	1,335	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	—	1	561	920	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	—	4	1,128	1,850	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LIMITED	—	51	1,648	2,704	電気通信サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	—	31	1,511	2,478	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	—	3	2,965	4,864	自動車・自動車部品
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	—	5	327	537	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LIMITED	—	9	776	1,273	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	—	35	545	894	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	—	5	645	1,058	各種金融
PETRONET LNG LTD	—	22	476	781	エネルギー
CIPLA LTD	—	12	674	1,106	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	—	17	2,517	4,129	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	—	3	1,438	2,359	素材

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ASHOK LEYLAND LIMITED	—	43	479	785	資本財
BOSCH LIMITED	—	0.27	507	831	自動車・自動車部品
TATA CONSULTANCY SVS LTD	—	34	6,693	10,977	ソフトウェア・サービス
NTPC LTD	—	73	1,045	1,715	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	—	3	649	1,065	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMBUJA CEMENTS LTD	—	22	479	786	素材
BHARAT FORGE LTD	—	7	445	730	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	—	43	973	1,596	素材
ITC LIMITED	—	126	3,648	5,983	食品・飲料・タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	—	4	536	880	素材
UPL LTD	—	13	1,029	1,689	素材
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	—	13	990	1,623	家庭用品・パーソナル用品
VODAFONE IDEA LTD	—	72	275	452	電気通信サービス
MARICO LTD	—	16	604	991	家庭用品・パーソナル用品
POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	—	58	1,052	1,726	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	—	19	711	1,166	運輸
REC LTD	—	25	272	447	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD	—	1	853	1,399	保険
BAJAJ AUTO LTD	—	3	849	1,393	自動車・自動車部品
COAL INDIA LTD	—	25	626	1,027	エネルギー
TATA MOTORS LTD	—	59	1,045	1,715	自動車・自動車部品
TATA POWER CO LTD	—	41	309	508	公益事業
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	—	11	496	814	各種金融
BHARTI INFRA TEL LTD	—	12	328	538	電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	—	10	722	1,184	銀行
ASIAN PAINTS LTD	—	10	1,443	2,367	素材
BAJAJ FINANCE LIMITED	—	6	1,611	2,643	各種金融
YES BANK LTD	—	63	1,015	1,664	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	—	6	415	681	運輸
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	—	1	324	532	食品・飲料・タバコ
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED-NEW	—	1	324	532	食品・飲料・タバコ
AXIS BANK LIMITED	—	66	4,212	6,907	銀行
HAVELLS INDIA LTD	—	9	640	1,050	資本財
STATE BANK OF INDIA	—	64	1,836	3,012	銀行
ICICI BANK LIMITED	—	88	3,199	5,246	銀行
TECH MAHINDRA LTD	—	17	1,201	1,969	ソフトウェア・サービス
CADILA HEALTHCARE LTD	—	7	271	445	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GRASIM INDUSTRIES LTD	—	12	1,040	1,705	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD	—	4	667	1,094	食品・生活必需品小売り
UNITED SPIRITS LTD	—	10	684	1,122	食品・飲料・タバコ
INTERGLOBE AVIATION LTD	—	3	359	589	運輸

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数・金額 銘柄数<比率>	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
JSW STEEL LTD	—	31	997	1,636	素材	
小計	—	2,079	115,542	189,490		
	—	77	—	< 4.3% >		
(エジプト)			千エジプトポンド			
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	—	38	285	1,814	銀行	
EASTERN TOBACCO	—	33	61	388	食品・飲料・タバコ	
ELSEWEDY ELECTRIC CO	—	14	22	144	資本財	
小計	—	85	369	2,347		
	—	3	—	< 0.1% >		
(南アフリカ)			千南アフリカランド			
BIDVEST GROUP LTD	—	12	257	2,140	資本財	
CLICKS GROUP LTD	—	9	181	1,502	食品・生活必需品小売り	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	—	16	143	1,194	小売	
DISCOVERY LTD	—	13	207	1,726	保険	
GOLD FIELDS LIMITED	—	30	126	1,048	素材	
REMGRO LTD	—	19	407	3,379	各種金融	
THE FOSCHINI GROUP	—	8	148	1,235	小売	
EXXARO RESOURCES LIMITED	—	9	121	1,011	エネルギー	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	—	1	164	1,367	銀行	
LIBERTY HOLDINGS LTD	—	4	51	427	保険	
MTN GROUP LIMITED	—	62	557	4,630	電気通信サービス	
ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	—	15	211	1,751	素材	
TELKOM SA SOC LTD	—	9	54	455	電気通信サービス	
FIRSTRAND LIMITED	—	123	863	7,170	各種金融	
PSG GROUP LTD	—	5	130	1,083	各種金融	
NASPERS LIMITED-N SHS	—	16	4,596	38,151	メディア・娯楽	
NEDBANK GROUP LTD	—	13	381	3,167	銀行	
NETCARE LTD	—	37	98	818	ヘルスケア機器・サービス	
PICK N PAY STORES LTD	—	13	99	824	食品・生活必需品小売り	
RMB HOLDINGS LTD	—	25	210	1,744	各種金融	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	—	1	89	746	素材	
SAPPI LIMITED	—	20	159	1,325	素材	
SASOL LTD.	—	20	856	7,105	素材	
SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	—	16	325	2,704	食品・生活必需品小売り	
STANDARD BANK GROUP LIMITED	—	47	854	7,091	銀行	
SPAR GROUP LIMITED	—	7	141	1,174	食品・生活必需品小売り	
WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	—	36	206	1,714	小売	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	—	5	35	297	運輸	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	—	14	214	1,782	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TIGER BRANDS LTD	—	5	161	1,342	食品・飲料・タバコ	
SANLAM LTD	—	64	505	4,194	保険	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘	柄	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	
INVESTEC LTD		—	10	88	734	各種金融
KUMBA IRON ORE LTD		—	2	60	499	素材
MONDI LTD		—	4	135	1,121	素材
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD		—	48	130	1,082	ヘルスケア機器・サービス
MMI HOLDINGS LTD		—	34	63	523	保険
VODACOM GROUP LIMITED		—	22	283	2,349	電気通信サービス
NEPI ROCKCASTLE PLC		—	13	152	1,264	不動産
MOTUS HOLDINGS LTD-NEW		—	5	48	405	小売
OLD MUTUAL LTD		—	180	423	3,514	保険
REINET INVESTMENTS SCA		—	5	114	951	各種金融
ABSA GROUP LTD		—	26	419	3,479	銀行
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE		—	25	90	750	保険
MR PRICE GROUP LTD		—	8	224	1,863	小売
BID CORP LTD		—	12	330	2,739	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	—	1,086	15,131	125,589	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	—	85,166	—	1,903,467	

※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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘	柄	期首 (前期末)		期		末	
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率
						外貨建金額	
(アメリカ)						千円	%
	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	—	1,178		11	1,318	0.0
	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	—	20,110		681	77,378	1.8
	ISHARES MSCI UAE ETF	—	7,671		110	12,568	0.3
	ISHARES MSCI QATAR ETF	—	9,231		180	20,446	0.5
小 計	証券数・金額	—	38,190		984	111,712	
	銘柄数 <比率>	—	4		—	<2.5%>	
(メキシコ)						千メキシコペソ	
	DEUTSCHE BANK MEX (FIBRA UNO ADMINISTR)	—	11,700		244	1,374	0.0
小 計	証券数・金額	—	11,700		244	1,374	
	銘柄数 <比率>	—	1		—	<0.0%>	
(ブラジル)						千ブラジルレアル	
	SUL AMERICA SA-UNITS	—	700		18	556	0.0
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	—	1,500		65	1,920	0.0
	KLABIN SA-UNIT	—	2,200		37	1,104	0.0
小 計	証券数・金額	—	4,400		121	3,581	
	銘柄数 <比率>	—	3		—	<0.1%>	
(南アフリカ)						千南アフリカランド	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	—	11,038		262	2,178	0.0
	FORTRESS REIT LTD-A	—	3,905		66	549	0.0
	FORTRESS REIT LTD-B	—	2,984		42	350	0.0
	REDEFINE PROPERTIES LTD	—	18,627		182	1,512	0.0
	HYPROP INVESTMENTS LTD	—	910		83	691	0.0
	RESILIENT REIT LTD	—	1,090		65	545	0.0
小 計	証券数・金額	—	38,554		702	5,827	
	銘柄数 <比率>	—	6		—	<0.1%>	
(中国 (オフショア))						千中国元 (オフショア)	
	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	—	28,400		911	14,905	0.3
小 計	証券数・金額	—	28,400		911	14,905	
	銘柄数 <比率>	—	1		—	<0.3%>	
合 計	証券数・金額	—	121,244		—	137,401	
	銘柄数 <比率>	—	15		—	<3.1%>	

※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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			期	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引	M S C I E	百万円 2,359	百万円 -

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※邦貨換算金額は、期末の時価を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	
	評価額	比率
株式	千円	%
株	1,903,467	42.8
投資信託受益証券	126,617	2.8
投資証券	10,784	0.2
コール・ローン等、その他	2,410,466	54.2
投資信託財産総額	4,451,334	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（2,659,931千円）の投資信託財産総額（4,451,334千円）に対する比率は59.8%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メキシコペソ=5.61円、1ブラジルレアル=29.44円、100チリペソ=16.94円、100コロンビアペソ=3.50円、1ユーロ=129.19円、1トルコリラ=21.97円、1チェココルナ=4.98円、100ハンガリーフォリント=39.92円、1ポーランドズロチ=30.14円、1香港ドル=14.51円、1マレーシアリンギット=27.11円、1タイバーツ=3.44円、1フィリピンペソ=2.16円、100インドネシアルピア=0.79円、100韓国ウォン=10.16円、1新台幣ドル=3.68円、1インドルピー=1.64円、1エジプトポンド=6.35円、1南アフリカランド=8.30円、1中国元（オフショア）=16.35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	6,702,778,625円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,733,497,930
株 式(評価額)	1,903,467,962
投資信託受益証券(評価額)	126,617,599
投 資 証 券(評価額)	10,784,021
未 収 入 金	2,312,593,537
未 収 配 当 金	886,346
差 入 委 託 証 拠 金	614,931,230
(B) 負 債	2,301,180,619
未 払 金 息	2,301,043,121
未 払 利 息	769
そ の 他 未 払 費 用	136,729
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,401,598,006
元 本	3,379,960,257
次 期 繰 越 損 益 金	1,021,637,749
(D) 受 益 権 総 口 数	3,379,960,257口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,023円

※当期における期首元本額2,987,969,778円、期中追加設定元本額3,839,802,002円、期中一部解約元本額3,447,811,523円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DCつみたてNISA・全海外株式インデックスファンド	915,400,939円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,262,181,268円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	83,167,154円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	506,367,397円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	454,934,555円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	7,332,370円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	6,412,938円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	4,696,784円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	22,538,530円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	21,788,377円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	69,866,830円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	11,249,367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>	14,023,748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>

- ・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)

■ 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	41,635,616円
受 取 配 当 金	39,699,295
受 取 利 息	△ 1,060,154
そ の 他 収 益 金	3,554,985
支 払 利 息	△ 558,510
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 426,376,150
売 買 益	579,987,641
売 買 損	△1,006,363,791
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 437,991,165
取 引 益	332,747,191
取 引 損	△ 770,738,356
(D) 信 託 報 酬 等	△ 14,384,457
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△ 837,116,156
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	1,303,504,299
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,870,929,883
(H) 解 約 差 損 益 金	△1,315,680,277
(I) 計 (E+F+G+H)	1,021,637,749
次 期 繰 越 損 益 金(I)	1,021,637,749

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

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

リート・インデックス・マザーファンド

第29期（2019年2月26日から2019年8月26日まで）

信託期間	無期限（設定日：2005年6月21日）
運用方針	・日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) 東証REIT指数(配当込み)		投資信託 証券組 比率	純資産額
	期騰落率	中率	期騰落率	中率		
	円	%		%	%	百万円
25期（2017年8月25日）	18,657	△ 6.2	3,175.07	△ 6.4	98.7	10,010
26期（2018年2月26日）	19,528	4.7	3,323.50	4.7	97.4	11,493
27期（2018年8月27日）	20,253	3.7	3,440.91	3.5	98.1	10,341
28期（2019年2月25日）	21,933	8.3	3,726.78	8.3	97.6	10,930
29期（2019年8月26日）	25,022	14.1	4,253.84	14.1	98.5	8,196

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

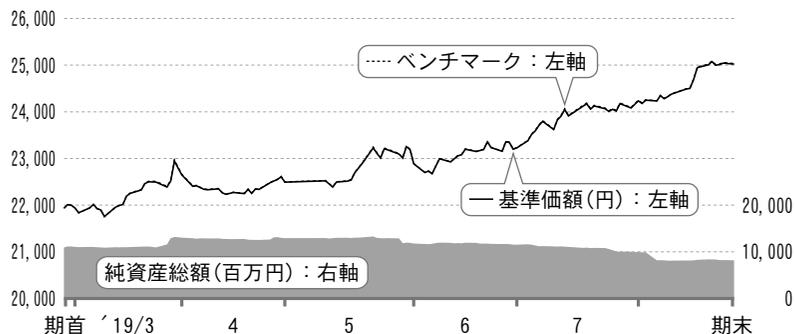
年月日	基準価額		(ベンチマーク) 東証REIT指数(配当込み)		投資信託 証券組 比率
	騰落率	率	騰落率	率	
(期首) 2019年2月25日	円	%		%	%
	21,933	—	3,726.78	—	97.6
2月末	21,940	0.0	3,728.00	0.0	98.2
3月末	22,648	3.3	3,851.10	3.3	97.8
4月末	22,493	2.6	3,822.76	2.6	98.4
5月末	22,886	4.3	3,889.57	4.4	98.3
6月末	23,227	5.9	3,947.76	5.9	98.9
7月末	24,235	10.5	4,120.33	10.6	97.8
(期末) 2019年8月26日	25,022	14.1	4,253.84	14.1	98.5

※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（2019年2月26日から2019年8月26日まで）

基準価額等の推移



期首	21,933円
期末	25,022円
騰落率	+14.1%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2019年2月26日から2019年8月26日まで）

主として日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

上昇要因

- ・ Jリーートの好調な業績動向、および国内の長期金利が低位で安定的に推移したこと

▶ 投資環境について（2019年2月26日から2019年8月26日まで）

当期のＪリート市場は上昇しました。

Ｊリート市場

Ｊリートの好調な業績動向が続いたこと、日銀の金融緩和策の継続による長期金利の低位安定が続いたこと、7月末にFRB（米連邦準備制度理事会）が利下げを実施するなど世界的にも低金利環境が続いたことなどを背景に、Ｊリート市場は期を通じて上昇しました。

当期の市場の動きを東証REIT指数（配当込み）で見ると、期首に比べて14.1%上昇しました。

▶ ポートフォリオについて（2019年2月26日から2019年8月26日まで）

株式組入比率

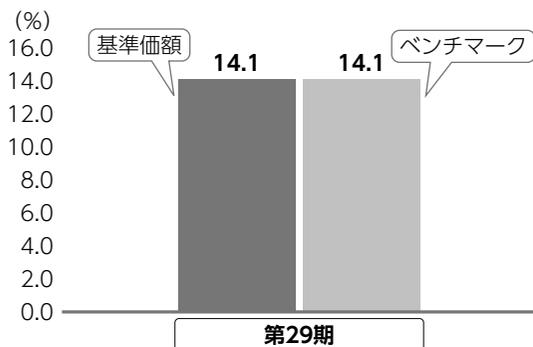
東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、期を通じて不動産投資信託の組入比率は高位を保ちました。

ポートフォリオの特性

主として日本の取引所に上場している不動産投資信託に投資し、ベンチマークを構成する全銘柄を概ね市場ウェイトで保有することにより、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

▶ ベンチマークとの差異について（2019年2月26日から2019年8月26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、東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期の基準価額の騰落率は+14.1%となり、ベンチマークの騰落率+14.1%を追随しました。

2 今後の運用方針

引き続き、主として日本の取引所に上場している不動産投資信託に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。また、不動産投資信託の組入比率は、原則として高位を保ちます。

■ 1万口当たりの費用明細 (2019年2月26日から2019年8月26日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	12円 (12)	0.054% (0.054)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	12	0.054	

期中の平均基準価額は22,904円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2019年2月26日から2019年8月26日まで)

投資信託証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
		口	千円	口	千円
国内	エスコンジャパンリート投資法人	146	15,019	64	6,939
	サンケイリアルエステート投資法人	132	14,611	57	6,584
	サンケイリアルエステート投資法人	9	1,068	—	—
	日本アコモデーションファンド投資法人	101	57,630	233	142,719
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	365	37,326	769	81,152
	森ヒルズリート投資法人	344	50,282	795	123,786
	産業ファンド投資法人	358	44,216	771	106,116
	アドバンス・レジデンス投資法人	292	91,101	716	235,657
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	185	33,437	430	81,626
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	158	73,847	385	187,268
	GLP投資法人	745	88,138	1,717	212,134
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	125	37,109	287	90,013
	日本プロロジスリート投資法人	472	112,510	933	235,229
	星野リゾート・リート投資法人	46	25,070	107	59,052
	Oneリート投資法人	49	13,812	98	28,637
	イオンリート投資法人	309	40,738	702	96,850
	ヒューリックリート投資法人	243	44,081	559	105,028
	日本リート投資法人	97	40,750	225	96,982
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,978	34,220	3,974	73,088
	日本ヘルスケア投資法人	20	3,519	34	6,046
積水ハウス・リート投資法人	1,009	82,378	1,774	146,874	
トーセイ・リート投資法人	57	6,663	137	16,488	

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	ケネディクス商業リート投資法人	110	30,165	257	68,121
	ヘルスケア&メディカル投資法人	63	7,179	147	18,460
	サムティ・レジデンシャル投資法人	58	5,712	138	15,318
	野村不動産マスターファンド投資法人	1,080 (19)	171,363 (2,952)	2,138	361,730
	野村不動産マスターファンド投資法人	— (△ 19)	— (△ 2,952)	—	—
	いちごホテルリート投資法人	53	6,999	126	15,928
	ラサールロジポート投資法人	238	26,445	477	61,738
	スターアジア不動産投資法人	104	11,382	212	24,418
	マリモ地方創生リート投資法人	26	2,892	57	6,670
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	73	25,505	166	62,687
	大江戸温泉リート投資法人	48	4,066	108	9,352
	さくら総合リート投資法人	65	5,606	154	14,488
	投資法人みらい	100 (1,113)	16,165 (—)	694	40,196
	森トラスト・ホテルリート投資法人	71	9,635	165	23,232
	三菱地所物流リート投資法人	83	24,103	82	23,789
	CREロジスティクスファンド投資法人	59	6,896	66	8,056
	ザイマックス・リート投資法人	78	9,936	73	9,403
	タカラレーベン不動産投資法人	101	11,028	108	12,038
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	47	4,502	105	10,679
	日本ビルファンド投資法人	291	215,720	676	511,355
	ジャパンリアルエステイト投資法人	302	197,379	700	466,757
	日本リートリアルファンド投資法人	568	125,323	1,318	288,301
	オリックス不動産投資法人	598	114,818	1,390	282,103
	日本プライムリアルティ投資法人	190	85,807	442	208,896
	プレミア投資法人	285	39,189	700	100,153
	東急リアル・エステート投資法人	202	35,020	467	88,700
	グローバル・ワン不動産投資法人	250	32,537	462	62,316
	ユナイテッド・アーバン投資法人	666	117,661	1,512	276,446
	森トラスト総合リート投資法人	214	37,415	499	88,753
	インヴィンシブル投資法人	1,631	92,581	2,285	136,482
	フロンティア不動産投資法人	103	47,760	232	107,195
	平和不動産リート投資法人	186	23,485	436	56,155
	日本ロジスティクスファンド投資法人	197	46,545	457	115,754
福岡リート投資法人	156	26,461	360	63,558	
ケネディクス・オフィス投資法人	92	70,796	214	164,377	

Jリート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	いちごオフィスリート投資法人	249	25,935	620	64,188
	大和証券オフィス投資法人	70	54,778	162	127,320
	阪急阪神リート投資法人	135	19,926	313	47,651
	スターツプロシード投資法人	46	7,989	109	19,531
	大和ハウスリート投資法人	495 (14)	122,471 (3,508)	920	241,222
	大和ハウスリート投資法人	— (△ 14)	— (△ 3,508)	—	—
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	968	85,341	2,242	199,078
	日本賃貸住宅投資法人	338	30,038	784	69,196
	ジャパンエクセレント投資法人	269	43,214	621	100,040
	合 計	18,198 (1,113)	3,025,323 (—)	37,961	6,810,131

※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。

■ 利害関係人との取引状況等 (2019年2月26日から2019年8月26日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	A			C		
投資信託証券	百万円 3,025	百万円 1,674	% 55.3	百万円 6,810	百万円 1,572	% 23.1

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
投 資 信 託 証 券	百万円 99

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	6,356千円
(b) うち利害関係人への支払額	2,707千円
(c) (b) / (a)	42.6%

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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2019年2月26日から2019年8月26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8月26日現在)

国内投資信託証券

銘柄	柄	期首 (前期末)		期		末	
		口	数	口	数	評価額	組入比率
			口			千円	%
エスコンジャパンリート投資法人		—	82			9,471	0.1
サンケイリアルエステート投資法人		—	75			9,412	0.1
サンケイリアルエステート投資法人		—	9			1,119	0.0
日本アコモデーションファンド投資法人		387	255			170,595	2.1
MCUBS MidCity投資法人		1,316	912			101,505	1.2
森ヒルズリート投資法人		1,335	884			145,506	1.8
産業ファンド投資法人		1,357	944			138,296	1.7
アドバンス・レジデンス投資法人		1,136	712			240,656	2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		722	477			95,256	1.2
アクティブ・プロパティーズ投資法人		612	385			200,970	2.5
GLP投資法人※		2,886	1,914			260,112	3.2
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		482	320			105,120	1.3
日本プロロジスリート投資法人※		1,564	1,103			313,913	3.8
星野リゾート・リート投資法人※		178	117			63,999	0.8
Oneリート投資法人		170	121			37,812	0.5
イオンリート投資法人		1,198	805			108,916	1.3
ヒューリックリート投資法人		942	626			120,442	1.5
日本リート投資法人		377	249			110,929	1.4
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人※		6,915	4,919			95,035	1.2
日本ヘルスケア投資法人		52	38			6,847	0.1
積水ハウス・リート投資法人		3,007	2,242			200,210	2.4
トーセイ・リート投資法人		222	142			18,360	0.2
ケネディクス商業リート投資法人		428	281			75,055	0.9
ヘルスケア&メディカル投資法人		245	161			21,413	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		231	151			17,440	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人※		3,436	2,397			448,239	5.5
野村不動産マスターファンド投資法人※		19	—			—	—
いちごホテルリート投資法人		203	130			15,730	0.2
ラサールロジポート投資法人※		877	638			93,275	1.1
スターアジア不動産投資法人		360	252			28,980	0.4
マリモ地方創生リート投資法人		99	68			8,126	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		282	189			83,349	1.0
大江戸温泉リート投資法人		187	127			11,074	0.1
さくら総合リート投資法人		251	162			15,276	0.2
投資法人みらい		315	834			47,538	0.6
森トラスト・ホテルリート投資法人		272	178			25,436	0.3
三菱地所物流リート投資法人		122	123			40,774	0.5
CREロジスティクスファンド投資法人		114	107			14,113	0.2

Jリート・インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首 (前期末)		期		末	
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率
ザイマックス・リート投資法人			108		113	15,334	0.2
タカラレーベン不動産投資法人			171		164	20,434	0.2
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人			178		120	12,852	0.2
日本ビルファンド投資法人			1,129		744	573,624	7.0
ジャパンリアルエステイト投資法人			1,166		768	541,440	6.6
日本リテールファンド投資法人			2,203		1,453	315,301	3.8
オリックス不動産投資法人			2,322		1,530	345,780	4.2
日本プライムリアルティ投資法人			738		486	238,626	2.9
プレミアム投資法人			1,108		693	102,771	1.3
東急リアル・エステート投資法人			780		515	104,339	1.3
グローバル・ワン不動産投資法人			743		531	77,738	0.9
ユナイテッド・アーバン投資法人			2,571		1,725	345,862	4.2
森トラスト総合リート投資法人			832		547	104,805	1.3
インヴィンシブル投資法人※			4,023		3,369	208,541	2.5
フロンティア不動産投資法人			397		268	121,136	1.5
平和不動産リート投資法人			727		477	62,630	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人			762		502	133,230	1.6
福岡リート投資法人※			603		399	72,378	0.9
ケネディクス・オフィス投資法人※			360		238	192,066	2.3
いちごオフィスリート投資法人※			966		595	62,058	0.8
大和証券オフィス投資法人※			269		177	148,149	1.8
阪急阪神リート投資法人			525		347	54,305	0.7
スターツプロシード投資法人			184		121	23,195	0.3
大和ハウスリート投資法人			1,446		1,035	290,214	3.5
大和ハウスリート投資法人			14		—	—	—
ジャパン・ホテル・リート投資法人※			3,753		2,479	208,483	2.5
日本賃貸住宅投資法人			1,312		866	84,608	1.0
ジャパンエクセレント投資法人			1,042		690	116,541	1.4
合 計	口 数	金 額	62,731	44,081	8,076,757		
	銘 柄 数	<比 率>	63	64	<98.5%>		

※< >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。

※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。

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

■ 投資信託財産の構成

(2019年8月26日現在)

項 目	期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円		%	
	8,076,757	97.4		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	211,786	2.6		
投 資 信 託 財 産 総 額	8,288,543	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8月26日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	8,288,543,384円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	118,150,876
投 資 証 券 (評 価 額)	8,076,757,091
未 収 入 金	24,898,608
未 収 配 当 金	68,736,809
(B) 負 債	92,264,878
未 払 解 約 金	92,260,000
未 払 利 息	300
そ の 他 未 払 費 用	4,578
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	8,196,278,506
元 本	3,275,692,387
次 期 繰 越 損 益 金	4,920,586,119
(D) 受 益 権 総 口 数	3,275,692,387口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	25,022円

※当期における期首元本額4,983,536,875円、期中追加設定元本額2,094,273,683円、期中一部解約元本額3,802,118,171円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	375,157,845円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	515,139,596円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	482,494,392円
イオン・バランス戦略ファンド	59,421,274円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	883,131,401円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,898,538円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	10,190,396円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	7,279,095円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	19,780,057円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	11,411,325円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,278,443円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	5,694,824円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	426,898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)	424,494,173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)	85,651,131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>	19,733,080円
SMAM・年金リスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	23,836,459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>	142,812,038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>	194,861,422円

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

■ 損益の状況

(自2019年2月26日 至2019年8月26日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	212,893,154円
受 取 配 当 金	212,939,684
そ の 他 収 益 金	8
支 払 利 息	△ 46,538
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,190,267,500
売 買 益	1,231,285,154
売 買 損	△ 41,017,654
(C) 信 託 報 酬 等	△ 31,300
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	1,403,129,354
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	5,947,094,736
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,658,908,860
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 5,088,546,831
(H) 計 (D + E + F + G)	4,920,586,119
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	4,920,586,119

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

■ お知らせ

<約款変更について>

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)

外国リート・インデックス・マザーファンド

第29期（2019年2月26日から2019年8月26日まで）

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		投資信託 証券組 託入率 比	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
25期（2017年8月25日）	19,340	△ 0.8	211.75	△ 0.6	99.1	百万円 3,706
26期（2018年2月26日）	18,041	△ 6.7	197.81	△ 6.6	99.6	4,803
27期（2018年8月27日）	20,790	15.2	229.10	15.8	99.1	5,795
28期（2019年2月25日）	21,366	2.8	236.48	3.2	98.0	4,927
29期（2019年8月26日）	21,144	△ 1.0	235.00	△ 0.6	99.4	5,204

※S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）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2019年8月26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。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

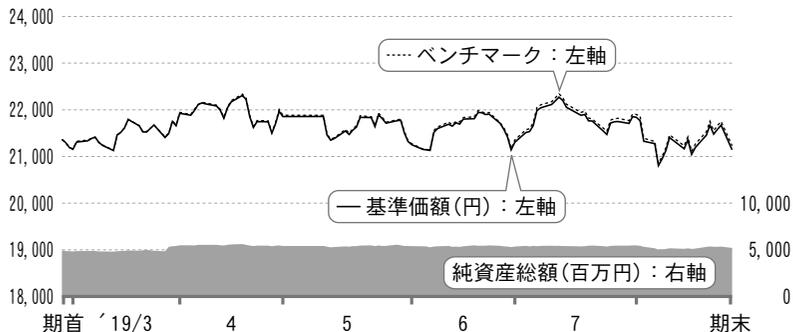
年月日	基準価額		(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		投資信託 証券組 託入率 比
	円	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2019年2月25日	21,366	—	236.48	—	98.0
2月末	21,154	△1.0	234.23	△1.0	99.0
3月末	21,924	2.6	242.88	2.7	98.6
4月末	21,856	2.3	242.21	2.4	99.4
5月末	21,253	△0.5	235.45	△0.4	98.9
6月末	21,306	△0.3	236.35	△0.1	98.5
7月末	21,839	2.2	242.38	2.5	98.4
(期末) 2019年8月26日	21,144	△1.0	235.00	△0.6	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（2019年2月26日から2019年8月26日まで）

基準価額等の推移



期首	21,366円
期末	21,144円
騰落率	-1.0%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2019年2月26日から2019年8月26日まで）

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

上昇要因	・ 期を通してみれば、米国やECB（欧州中央銀行）の緩和的な金融姿勢を受けて欧米の金利が低下し、グローバルリート市場が上昇したこと
下落要因	・ 5月から期末にかけて、米中貿易摩擦激化への警戒感が高まったことや、米国の利下げ観測が高まったことを受けて、米ドルが対円で下落したこと

▶ 投資環境について (2019年2月26日から2019年8月26日まで)

当期のグローバルリート市場は上昇しました。米ドルは対円で下落しました。

グローバルリート市場

グローバルリート市場は、もみ合いながらも期を通してみれば上昇しました。パウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長の発言やFOMC（米連邦公開市場委員会）を受けて、米国の利下げ観測が高まったことや、ドラギECB総裁が追加緩和の可能性を示唆し、欧州長期金利が低下したことなどが好感され、上昇しました。米国では、7月に約10年半ぶりとなる利下げが実施されました。一方で中国の経済指標が市場予想を上回るなど、世界的な景気後退への不安が和らいだことを受けて米欧主要国の長期金利が一時的に上昇した局面や、5月以降、米中貿易摩擦激化への警戒感が高まったことなどが嫌気され、下落する局面もありました。

当期の市場の動きをS&P先進国REIT指数（米ドルベース）で見ると、期首に比べて3.8%上昇しました。

為替市場

期初から4月下旬にかけて、米中通商協議の継続によって貿易摩擦が解消に向かうとの見方が広がったことや、米国の堅調な経済指標を受けて景気後退への不安が和らいだことなどから、米ドルが対円で上昇しました。5月に入り、トランプ米大統領が中国製品に対する追加関税を表明したことで米中貿易摩擦激化への警戒感が高まったことや、パウエルFRB議長の発言やFOMCを受けて米国の利下げ観測が高まったことなどから、米国金利が低下し、日米の金利差の縮小が意識され、米ドルは対円で下落しました。

当期の米ドル・円は期首110円78銭から期末105円08銭と5円70銭の米ドル安・円高となりました。

▶ ポートフォリオについて (2019年2月26日から2019年8月26日まで)

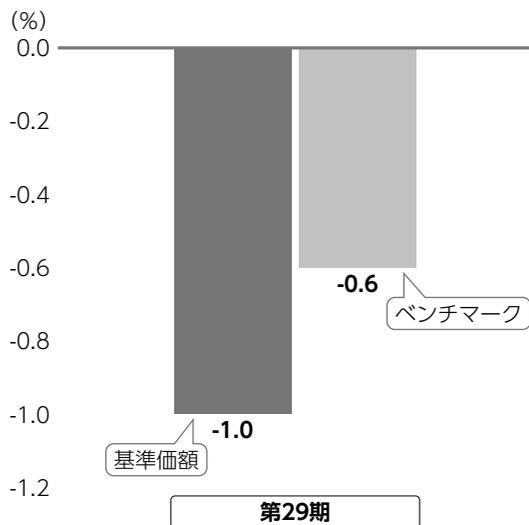
S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、投資信託証券組入比率は期を通じて高位（概ね99%）を保ち、期末では99.4%としました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について (2019年2月26日から2019年8月26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S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース) をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの対比です。

【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-1.0%となり、ベンチマークの騰落率-0.6%を0.4%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストや証券保管コストが生じたこと

2 今後の運用方針

引き続き、S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース) の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。個別銘柄においてもベンチマーク時価ウェイトに沿った投資を行い、トラッキングエラーを抑制します。また、投資信託証券組入比率を高位に保つことを基本とします。

■ 1万口当たりの費用明細 (2019年2月26日から2019年8月26日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 売買委託手数料 (投資信託証券)	12円 (12)	0.056% (0.056)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (投資信託証券)	2 (2)	0.009 (0.009)	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)	11 (11) (0)	0.051 (0.049) (0.002)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	25	0.116	

期中の平均基準価額は21,555円です。

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

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2019年2月26日から2019年8月26日まで)

(1) 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	AGREE REALTY CORP	□ 2,277	千米ドル 154	□ 1,551	千米ドル 103
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	2,033	289	1,565	222
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,052	49	—	—
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	11,336	278	8,559	210
		AMERICOLD REALTY TRUST	5,580	170	—	—
		APARTMENT INVESTMENT & MANAGEMENT CO-A	(1,104 178)	(55 8)	935	47
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	6,627	106	6,600	101
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	999	201	664	135
		BOSTON PROPERTIES INC	2,888	381	2,103	278
		BRANDYWINE REALTY TRUST	3,474	55	3,000	45
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	4,987	99	2,626	49
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,635	170	1,071	112
		CARETRUST REIT INC	2,049	49	—	—
		CORESITE REALTY CORPORATION	981	107	870	100
		国		COUSINS PROPERTIES INC	5,961 (△ 19,083)	59 (△ 184)
COUSINS PROPERTIES INC	(6,111)			(228)	—	—
CUBESMART	3,539			118	1,530	52

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	CYRUSONE INC	666	37	—	—
	DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	5,077	55	4,803	51
	DIGITAL REALTY TRUST INC	2,983	355	2,286	268
	DOUGLAS EMMETT INC	2,682	110	2,544	105
	DUKE REALTY CORP	1,802	55	1,969	59
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	3,048	56	2,718	49
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	889	105	740	88
	EQUITY RESIDENTIAL	3,871	294	2,949	228
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	2,671	58	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	242	70	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,936	200	1,363	143
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	1,987	261	1,661	219
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	4,338	154	4,265	154
	HCP, INC.	2,061	65	1,149	37
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,844	58	1,496	47
	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	2,078	58	—	—
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,264	58	—	—
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	2,140	55	—	—
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	3,048	57	—	—
	INFREAREIT INC	—	—	2,200	46
	INVITATION HOMES INC	8,753	235	2,827	76
	IRON MOUNTAIN INC	1,388	48	—	—
	LIBERTY PROPERTY TRUST	—	—	300	14
	LIFE STORAGE INC	1,125	110	530	53
	MACERICH COMPANY/THE	1,037	44	1,259	54
	MACK-CALI REALTY CORPORATION	2,299	52	2,229	47
	MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	—	—	(1,500)	(16)
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,281	95	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	457	49	340	36
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	2,294	123	1,657	87
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC(NEW)	(352)	(13)	—	—
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	952	158	606	104
	PARK HOTELS AND RESORTS INC	1,832	53	1,787	52
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,322	104	1,485	47	
PHYSICIANS REALTY TRUST	3,064	58	2,701	48	
PROLOGIS INC	5,880	440	4,201	314	
PUBLIC STORAGE	1,793	414	1,278	297	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	1,113	51	1,121	50	
REALTY INCOME CORPORATION	2,388	172	904	63	
REGENCY CENTERS CORP	711	47	—	—	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	4,220	53	3,939	47	
国					

外国リート・インデックス・マザーファンド

			買 付		売 付		
			口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	1,380	49	—	—	
		SL GREEN REALTY CORP	649	58	570	45	
		SABRA HEALTH CARE REIT	1,998	38	—	—	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,839	653	3,117	522	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2,648	105	1,940	81	
		STAG INDUSTRIAL INC	1,712	48	—	—	
		SUN COMMUNITIES INC	2,877	367	2,125	271	
		TAUBMAN CENTERS INC	1,034	53	—	—	
		TIER REIT INC	—	—	(1,800)	(43)	
		UDR INC	1,237	55	—	—	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	591	50	572	52	
		VENTAS INC	3,872	268	2,031	138	
		VEREIT INC	20,236	182	12,102	109	
		VICI PROPERTIES INC	3,081	67	—	—	
		VORNADO REALTY TRUST	1,610	107	1,695	113	
		WP CAREY INC	1,616	125	582	44	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1,911	54	—	—	
		WELLTOWER INC	4,836	385	3,044	240	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	(—)	(0.80518)	—	—		
	小 計	204,185 (△ 12,442)	9,504 (66)	121,020 (3,300)	6,022 (60)		
カ ナ ダ		ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	1,019	49	—	—	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	4,168	46	—	—	
		CHOICE PROPERTIES REIT	1,835	26	3,000	41	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	756	17	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,332	47	1,853	25	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,662	69	1,395	36	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,648	56	594	20	
	小 計	14,664	295	7,598	140		
国	ユ	ド イ ツ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	(4,965)	(△ 68)	2,791	38
		小 計	(4,965)	(△ 68)	2,791	38	
	イ	イ タ リ ア	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	(—)	(△0.04423)	—	—
		小 計	(—)	(△0.04423)	—	—	
	ロ	フ ラ ン ス	ICADE	—	—	400	30
ALTAREA			(—)	(△ 0.9216)	—	—	
KLEPIERRE			3,105	94	2,716	77	

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付		
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外		GECINA SA	280	36	—	—
		COVIVIO	406	38	—	—
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	514	78	—	—
	小	計	(4,305 —)	247 (△ 0.9216)	3,116	107
	オランダ	EUROCOMMERCIAL	5,061	119	3,325	78
		WERELDHAVE NV	2,076	45	3,440	77
	小	計	7,137	164	6,765	155
	スペイン	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	(—)	(△ —)	4,200	42
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	(—)	(△ 0.1834)	—	—
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	(3,000 —)	(△ 36 1)	3,895	45
	小	計	(3,000 —)	(△ 36 2)	8,095	87
	ベルギー	BEFIMMO SCA	599	30	508	25
		COFINIMMO	218	25	—	—
		RETAIL ESTATES	874	71	512	41
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	3,193	76	2,191	55
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	347	48	396	54
		MONTEA	363	27	—	—
		AEDIFICA	1,124	92	1,010	82
		MONTEA-RIGHTS	—	—	248	0.2916
		AEDIFICA SA-RTS	—	—	732	—
小	計	(6,718 732)	(372 —)	5,597	259	
ユ	—	口 計	(26,125 732)	(△ 890 6)	26,364	649
国			□	千英ポンド	□	千英ポンド
	イギリス	DERWENT LONDON PLC	2,641	82	1,137	35
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	31,027	62	18,423	38
		SEGRO PLC	3,844	26	—	—
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	5,101	38	—	—
		LX1 REIT PLC	32,635	41	—	—
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	39,369	52	25,533	34
		LAND SECURITIES GROUP PLC	10,180	94	9,221	78
		小	計	124,797	397	54,314
オーストラリア			□	千オーストラリアドル	□	千オーストラリアドル
	MIRVAC GROUP	112,126	347	96,542	294	
	GPT GROUP	32,153	193	25,053	150	
	ABACUS PROPERTY GROUP	—	—	12,029	43	
	DEXUS	7,892	99	—	—	

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付			
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額		
外	小	GOODMAN GROUP	20,931	286	14,244	198	
		CHARTER HALL GROUP	8,163	79	4,597	52	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	14,930	62	—	—	
		PROPERTYLINK GROUP	—	—	28,000	32	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	12,693	65	13,936	72	
		NATIONAL STORAGE REIT	32,936	55	—	—	
		SCENTRE GROUP	72,593	289	40,587	163	
		計	314,417	1,480	234,988	1,008	
	ニューージーランド	GOODMAN PROPERTY TRUST	36,615	62	22,221	38	
	小	計	36,615	62	22,221	38	
	香 港	LINK REIT	20,500	1,881	11,500	1,061	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	68,000	361	116,000	611	
	小	計	88,500	2,242	127,500	1,672	
	国	シンガポール	CAPITALAND MALL TRUST	33,300	79	25,500	62
			ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	(—)	(△ — 1)	—	—
			CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	67,300	132	56,600	110
			SUNTEC REIT	(—)	(△0.45504)	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST			(—)	(△0.94403)	—	—	
STARHILL GLOBAL REIT			(—)	(△ 0.1404)	—	—	
ASCOTT RESIDENCE TRUST			(—)	(△ 0.7552)	—	—	
FRASERS COMMERCIAL TRUST			(—)	(△0.49203)	—	—	
KEPPEL REIT			113,400	139	57,900	69	
			(—)	(△0.13176)	—	—	
FRASERS CENTREPOINT TRUST			28,200	66	—	—	
ESR REIT			(—)	(△0.04085)	—	—	
CDL HOSPITALITY TRUSTS			(—)	(△ 0.2164)	—	—	
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST			(—)	(△ — 1)	—	—	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST			(—)	(△ 0.504)	—	—	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE			(—)	(△ 0.1365)	—	—	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	(—)	(△ 0.2145)	—	—			
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	(—)	(△0.06474)	—	—			

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国	CACHE LOGISTICS TRUST	(-)	(△ 0.0162)	-	-
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	(-)	(△0.02373)	-	-
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	(-)	(△ 0.0372)	-	-
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	(-)	(△0.69222)	-	-
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	(-)	(△ 0.19)	-	-
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	(-)	(△0.01638)	-	-
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	(-)	(△0.16969)	-	-
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	(-)	(△ 1)	-	-
小 計	(242, 200)	(△ 417 8)	140, 000	242	

※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。

■ 利害関係人との取引状況等 (2019年2月26日から2019年8月26日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2019年2月26日から2019年8月26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8月26日現在)

外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		期 末		組 入 比 率
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			千米ドル	千円	%
ACADIA REALTY TRUST	3,108	3,108	84	8,886	0.2
AGREE REALTY CORP	1,153	1,879	136	14,295	0.3
ALEXANDER'S INC	136	136	48	5,147	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,195	4,663	684	71,944	1.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,000	2,052	95	9,998	0.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	5,299	5,299	246	25,925	0.5
AMERICAN FINANCE TRUST INC	2,086	2,086	24	2,547	0.0
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	8,578	11,355	286	30,127	0.6

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		
	口	数	口	数	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
							組入比率
AMERICOLD REALTY TRUST	2,500	8,080	294	30,905		0.6	
APARTMENT INVESTMENT & MANAGEMENT CO-A	5,637	5,984	301	31,666		0.6	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	6,667	6,694	103	10,902		0.2	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,012	6,012	15	1,617		0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,117	5,452	1,123	118,108		2.3	
BRT APARTMENTS CORP	500	500	7	747		0.0	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	600	7	765		0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	5,556	6,341	797	83,842		1.6	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	602	602	5	528		0.0	
BRANDYWINE REALTY TRUST	5,244	5,718	81	8,574		0.2	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11,502	11,502	207	21,827		0.4	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	—	2,361	44	4,631		0.1	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,201	7,201	5	606		0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,518	4,082	434	45,625		0.9	
CARETRUST REIT INC	2,149	4,198	99	10,463		0.2	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,130	2,130	4	512		0.0	
CHATHAM LODGING TRUST	706	706	11	1,215		0.0	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,300	2,300	58	6,196		0.1	
CITY OFFICE REIT INC	600	600	7	838		0.0	
CLIPPER REALTY INC	800	800	8	924		0.0	
COLONY CAPITAL INC-CLASS A	22,060	22,060	96	10,129		0.2	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,500	4,500	95	10,000		0.2	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	300	300	12	1,336		0.0	
CORESITE REALTY CORPORATION	1,154	1,265	142	14,951		0.3	
CORECIVIC INC	5,301	5,301	88	9,291		0.2	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,364	4,364	125	13,193		0.3	
COUSINS PROPERTIES INC	17,983	—	—	—		—	
COUSINS PROPERTIES INC	—	6,111	206	21,704		0.4	
CUBESMART	6,188	8,197	288	30,293		0.6	
CYRUSONE INC	4,095	4,761	331	34,814		0.7	
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	10,056	10,330	95	10,062		0.2	
DIGITAL REALTY TRUST INC	7,455	8,152	984	103,410		2.0	
DOUGLAS EMMETT INC	5,837	5,975	248	26,093		0.5	
DUKE REALTY CORP	13,816	13,649	448	47,085		0.9	
EPR PROPERTIES	2,875	2,875	218	22,984		0.4	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	1,099	1,429	29	3,052		0.1	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,502	1,502	183	19,296		0.4	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	5,000	5,000	67	7,056		0.1	
EQUITY COMMONWEALTH REIT	4,608	4,608	155	16,327		0.3	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,467	3,616	488	51,352		1.0	
EQUITY RESIDENTIAL	13,641	14,563	1,205	126,630		2.4	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	1,346	4,017	88	9,248		0.2	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,368	2,610	822	86,443		1.7	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,459	5,032	608	63,980		1.2	
FARMLAND PARTNERS INC	300	300	1	196		0.0	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	2,842	3,168	407	42,840		0.8	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	4,394	4,467	170	17,912		0.3	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,339	3,339	93	9,785	0.2	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	3,700	27	2,900	0.1	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	2,000	2,000	21	2,288	0.0	
GEO GROUP INC	5,536	5,536	92	9,738	0.2	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	7,880	7,880	300	31,547	0.6	
GETTY REALTY CORPORATION	1,428	1,428	43	4,617	0.1	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,440	1,440	31	3,315	0.1	
GLADSTONE LAND CORP	600	600	6	724	0.0	
GLOBAL NET LEASE INC	3,433	3,433	65	6,908	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,000	1,000	10	1,108	0.0	
HCP, INC.	17,678	18,590	634	66,709	1.3	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,372	5,720	185	19,450	0.4	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	6,908	8,986	249	26,212	0.5	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,018	1,018	13	1,441	0.0	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,365	4,629	197	20,784	0.4	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	5,305	7,445	177	18,666	0.4	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	26,375	29,423	461	48,509	0.9	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	5,905	5,905	195	20,575	0.4	
INDEPENDENCE REALTY TRUST	4,641	4,641	64	6,749	0.1	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	2,254	2,254	47	4,940	0.1	
INFREIT INC	2,200	—	—	—	—	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	200	200	20	2,133	0.0	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	323	323	22	2,363	0.0	
INVITATION HOMES INC	11,664	17,590	502	52,844	1.0	
IRON MOUNTAIN INC	9,991	11,379	354	37,234	0.7	
JBG SMITH PROPERTIES	4,364	4,364	167	17,558	0.3	
KILROY REALTY CORP	3,892	3,892	301	31,654	0.6	
KIMCO REALTY CORPORATION	16,855	16,855	305	32,145	0.6	
KITE REALTY GROUP TRUST	3,261	3,261	46	4,927	0.1	
LTC PROPERTIES INC	1,576	1,576	76	8,088	0.2	
LEXINGTON REALTY TRUST	7,127	7,127	74	7,788	0.1	
LIBERTY PROPERTY TRUST	5,952	5,652	289	30,449	0.6	
LIFE STORAGE INC	1,504	2,099	218	22,920	0.4	
MACERICH COMPANY/THE	4,637	4,415	123	12,934	0.2	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	4,599	4,669	96	10,096	0.2	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,500	—	—	—	—	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	12,326	17,607	322	33,876	0.7	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,408	4,525	564	59,350	1.1	
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	3,536	3,536	46	4,867	0.1	
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	1,704	1,704	139	14,648	0.3	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5,472	6,109	339	35,659	0.7	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,600	1,600	53	5,607	0.1	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,800	2,800	17	1,824	0.0	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	500	500	22	2,388	0.0	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,216	2,216	37	3,939	0.1	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,919	1,919	51	5,394	0.1	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	7,746	8,098	327	34,369	0.7	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,000	1,000	26	2,835	0.1	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	592	938	164	17,244	0.3	
PARAMOUNT GROUP INC	8,400	8,400	108	11,439	0.2	
PARK HOTELS AND RESORTS INC	7,300	7,345	171	18,068	0.3	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	4,094	5,931	154	16,210	0.3	
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,331	2,331	10	1,146	0.0	
PHYSICIANS REALTY TRUST	8,144	8,507	146	15,437	0.3	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	5,400	5,400	106	11,155	0.2	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,900	2,900	39	4,138	0.1	
PROLOGIS INC	23,614	25,293	2,071	217,646	4.2	
PUBLIC STORAGE	5,552	6,067	1,574	165,436	3.2	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	1,700	1,692	80	8,450	0.2	
RLJ LODGING TRUST	7,377	7,377	118	12,418	0.2	
RPT REALTY	2,740	2,740	32	3,426	0.1	
REALTY INCOME CORPORATION	10,917	12,401	899	94,474	1.8	
REGENCY CENTERS CORP	5,945	6,656	421	44,300	0.9	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	4,100	4,100	71	7,509	0.1	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	10,074	10,355	115	12,175	0.2	
RETAIL VALUE INC	594	594	21	2,300	0.0	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	2,817	4,197	179	18,813	0.4	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,074	2,074	164	17,245	0.3	
SL GREEN REALTY CORP	2,919	2,998	230	24,191	0.5	
SABRA HEALTH CARE REIT	5,502	7,500	161	16,975	0.3	
SAFEHOLD INC	—	600	16	1,752	0.0	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	600	—	—	—	—	
SAUL CENTERS INC	703	703	34	3,675	0.1	
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	10,696	10,696	89	9,373	0.2	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,500	1,500	57	6,035	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	11,572	12,294	1,795	188,649	3.6	
SITE CENTERS CORP	5,797	5,797	78	8,223	0.2	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2,624	3,332	152	16,063	0.3	
SPIRIT MTA REIT	1,580	1,580	13	1,394	0.0	
STAG INDUSTRIAL INC	3,269	4,981	139	14,681	0.3	
STORE CAPITAL CORP	7,400	7,400	271	28,514	0.5	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,300	4,300	46	4,907	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	3,007	3,759	555	58,388	1.1	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,659	9,659	124	13,062	0.3	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	3,736	3,736	52	5,554	0.1	
TAUBMAN CENTERS INC	1,849	2,883	110	11,572	0.2	
TERRENO REALTY CORP	2,200	2,200	109	11,494	0.2	
TIER REIT INC	1,800	—	—	—	—	
UDR INC	9,714	10,951	520	54,659	1.1	
UMH PROPERTIES INC	800	800	9	1,031	0.0	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	215	234	22	2,318	0.0	
URBAN EDGE PROPERTIES	3,834	3,834	66	6,945	0.1	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	442	442	9	962	0.0	
VENTAS INC	13,197	15,038	1,082	113,758	2.2	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	口数	期首(前期末)		期末		組入比率
		口数	口数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
VEREIT INC	33,170	41,304	387	40,711	0.8	
VICI PROPERTIES INC	12,330	15,411	323	34,007	0.7	
VORNADO REALTY TRUST	6,695	6,610	388	40,848	0.8	
WP CAREY INC	5,672	6,706	588	61,820	1.2	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	6,130	6,130	20	2,125	0.0	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,270	3,270	85	8,968	0.2	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3,687	5,598	148	15,558	0.3	
WELLTOWER INC	14,027	15,819	1,388	145,863	2.8	
WHITESTONE REIT	200	200	2	261	0.0	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	4,000	4,000	79	8,309	0.2	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	63,400	63,400	56	5,962	0.1	
小計	858,116	925,539	36,178	3,801,602		
	口数・金額 銘柄数<比率>	157	155	—	<73.0%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	1,287	2,306	117	9,260	0.2	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	900	5,068	61	4,850	0.1	
BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	735	735	32	2,565	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,200	3,200	45	3,595	0.1	
CAN APARTMENT PROP	2,821	2,821	147	11,669	0.2	
CHOICE PROPERTIES REIT	6,836	5,671	76	6,040	0.1	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR	3,192	3,192	39	3,097	0.1	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,500	1,500	23	1,820	0.0	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	1,476	39	3,118	0.1	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	3,700	3,700	46	3,643	0.1	
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,714	3,714	52	4,178	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,000	1,000	62	4,923	0.1	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,012	5,256	117	9,312	0.2	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,000	2,479	38	3,002	0.1	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,000	1,000	20	1,604	0.0	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	303	303	6	548	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RE	100	100	1	154	0.0	
NORTHVIEW APARTMENT REIT	1,052	1,052	30	2,391	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	1,500	1,500	17	1,359	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,362	6,629	174	13,797	0.3	
SLATE OFFICE REIT	1,000	1,000	5	457	0.0	
SLATE RETAIL REIT	500	500	6	504	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,202	3,256	102	8,090	0.2	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	1,500	1,500	18	1,499	0.0	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	1,000	1,000	6	544	0.0	
小計	52,892	59,958	1,292	102,031		
	口数・金額 銘柄数<比率>	25	25	—	<2.0%>	
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ			
HAMBORNER REIT AG	2,840	2,840	26	3,133	0.1	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,399	6,573	97	11,427	0.2	
小計	7,239	9,413	124	14,560		
	口数・金額 銘柄数<比率>	2	2	—	<0.3%>	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	口数	期首(前期末)		期末		組入比率
		口数	口数	評価額	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ・・・イタリア)				千ユーロ		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,408	3,408	3,408	18	2,110	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	3,408 1	3,408 1	18 -	2,110 <0.0%>	
(ユーロ・・・フランス)				千ユーロ		
ICADE	2,012	1,612	1,612	127	14,899	0.3
ALTAREA	80	80	80	14	1,727	0.0
KLEPIERRE	7,049	7,438	7,438	203	23,841	0.5
GECINA SA	2,064	2,344	2,344	331	38,774	0.7
COVIVIO	2,095	2,501	2,501	237	27,785	0.5
MERCIALYS	2,280	2,280	2,280	24	2,834	0.1
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	4,963	5,477	5,477	668	78,225	1.5
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	20,543 7	21,732 7	1,606 -	188,088 <3.6%>	
(ユーロ・・・オランダ)				千ユーロ		
EUROCOMMERCIAL	864	2,600	2,600	59	6,952	0.1
VASTNED RETAIL	925	925	925	24	2,902	0.1
WERELDHAVE NV	1,995	631	631	11	1,324	0.0
NSI NV	727	727	727	28	3,349	0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	4,511 4	4,883 4	124 -	14,527 <0.3%>	
(ユーロ・・・スペイン)				千ユーロ		
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	12,558	8,358	8,358	87	10,205	0.2
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,620	2,620	2,620	17	2,082	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	15,500	14,605	14,605	178	20,928	0.4
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	30,678 3	25,583 3	283 -	33,216 <0.6%>	
(ユーロ・・・ベルギー)				千ユーロ		
BEFIMMO SCA	744	835	835	44	5,200	0.1
COFINIMMO	620	838	838	102	12,008	0.2
RETAIL ESTATES	200	562	562	45	5,296	0.1
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	300	1,302	1,302	33	3,932	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA	763	714	714	115	13,524	0.3
MONTEA	248	611	611	47	5,522	0.1
AEDIFICA	921	1,035	1,035	106	12,504	0.2
MONTEA-RIGHTS-NEW	248	-	-	-	-	-
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	4,044 8	5,897 7	495 -	57,988 <1.1%>	
(ユーロ・・・アイルランド)				千ユーロ		
GREEN REIT PLC	27,000	27,000	27,000	51	6,012	0.1
HIBERNIA REIT PLC	25,270	25,270	25,270	37	4,384	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,100	10,100	10,100	16	1,974	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	62,370 3	62,370 3	105 -	12,370 <0.2%>	
ユーロ計	口数・金額 銘柄数<比率>	132,793 28	133,286 27	2,757 -	322,863 <6.2%>	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		組入比率	
	口数	口数	評価額	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)			千英ポンド			
BRITISH LAND CO PLC	37,600	37,600	186	24,074	0.5	
CAPITAL & REGIONAL PLC	20,000	20,000	2	373	0.0	
DERWENT LONDON PLC	3,580	5,084	160	20,692	0.4	
BIG YELLOW GROUP PLC	6,736	6,736	69	8,941	0.2	
HAMMERSON PLC	27,400	27,400	62	8,033	0.2	
INTU PROPERTIES PLC	28,500	28,500	9	1,280	0.0	
UNITE GROUP PLC	11,494	11,494	120	15,539	0.3	
SHAFTESBURY PLC	7,700	7,700	63	8,221	0.2	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000	15,000	8	1,049	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	15,000	15,000	13	1,689	0.0	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	11,700	11,700	10	1,355	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	35,000	35,000	28	3,680	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	7,700	7,700	50	6,549	0.1	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	16,891	29,495	60	7,830	0.2	
SEGREO PLC	40,793	44,637	344	44,457	0.9	
WORKSPACE GROUP PLC	6,465	6,465	55	7,161	0.1	
NEWRIVER REIT PLC	17,642	17,642	29	3,797	0.1	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	19,661	19,661	16	2,125	0.0	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	10,000	10,000	8	1,131	0.0	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	8,169	13,270	91	11,773	0.2	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	64,900	64,900	90	11,609	0.2	
RDI REIT PLC	8,020	8,020	8	1,093	0.0	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20,000	20,000	18	2,443	0.0	
ASSURA PLC	116,800	116,800	79	10,266	0.2	
LXI REIT PLC	4,000	36,635	47	6,128	0.1	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	22,148	35,984	49	6,325	0.1	
REGIONAL REIT LTD	5,000	5,000	5	670	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	25,910	26,869	204	26,310	0.5	
小計	口数 銘柄数	金額 <比率>	613,809 28	684,292 28	1,897 — <4.7%>	244,608 <4.7%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BWP TRUST	26,090	26,090	100	7,096	0.1	
MIRVAC GROUP	145,322	160,906	516	36,491	0.7	
CROMWELL PROPERTY GROUP	82,000	82,000	99	7,038	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	11,701	11,701	50	3,596	0.1	
GPT GROUP	68,000	75,100	476	33,691	0.6	
ABACUS PROPERTY GROUP	20,971	8,942	35	2,489	0.0	
STOCKLAND	95,730	95,730	425	30,029	0.6	
DEXUS	34,872	42,764	561	39,639	0.8	
GOODMAN GROUP	56,962	63,649	986	69,700	1.3	
CHARTER HALL GROUP	13,692	17,258	215	15,228	0.3	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	4,000	18,930	83	5,871	0.1	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	8,166	8,166	30	2,175	0.0	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	42,042	42,042	108	7,663	0.1	
ARENA REIT	3,100	3,100	8	604	0.0	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	口数	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	
PROPERTYLINK GROUP	28,000	—	—	—	—	—
CHARTER HALL LONG WALE REIT	5,000	3,757	21	1,534	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	11,000	43,936	80	5,664	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	100	100	0.343	24	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	18,000	18,000	27	1,920	0.0	
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	7,100	7,100	26	1,866	0.0	
APN INDUSTRIA REIT	1,000	1,000	2	207	0.0	
RURAL FUNDS GROUP	10,000	10,000	19	1,391	0.0	
SCENTRE GROUP	189,281	221,287	871	61,597	1.2	
VICINITY CENTRES	124,829	124,829	313	22,136	0.4	
VIVA ENERGY REIT	18,000	18,000	51	3,611	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,024,958 25	1,104,387 24	5,113 —	361,269 <6.9%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	44,000	44,000	82	5,532	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	19,000	19,000	49	3,350	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	21,925	36,319	79	5,309	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	30,000	30,000	44	2,957	0.1	
STRIDE STAPLED GROUP	23,000	23,000	53	3,609	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	44,907	44,907	73	4,923	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	182,832 6	197,226 6	382 —	25,683 <0.5%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT	77,100	86,100	7,925	106,201	2.0	
PROSPERITY REIT	60,000	60,000	182	2,444	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	88,000	40,000	209	2,808	0.1	
CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	72,000	376	5,045	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,000	37,000	196	2,627	0.1	
FORTUNE REIT	58,000	58,000	542	7,274	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	392,100 6	353,100 6	9,433 —	126,402 <2.4%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST	91,600	99,400	262	19,841	0.4	
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	103,100	103,100	315	23,853	0.5	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	116,000	126,700	262	19,830	0.4	
SUNTEC REIT	96,000	96,000	183	13,863	0.3	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	87,250	87,250	134	10,159	0.2	
STARHILL GLOBAL REIT	54,000	54,000	41	3,123	0.1	
ASCOTT RESIDENCE TRUST	40,000	40,000	52	3,931	0.1	
FRASERS COMMERCIAL TRUST	44,800	44,800	71	5,419	0.1	
KEPPEL REIT	43,400	98,900	122	9,272	0.2	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	8,600	36,800	98	7,456	0.1	
ESR REIT	57,552	57,552	29	2,262	0.0	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	34,350	34,350	54	4,155	0.1	
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	20,000	20,000	30	2,328	0.0	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	28,000	28	2,159	0.0	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額	評価額	組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	13,000	13,000	39	2,978		0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	33,000	33,000	7	561		0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	49,800	49,800	113	8,585		0.2
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	82,000	82,000	174	13,206		0.3
CACHE LOGISTICS TRUST	27,000	27,000	19	1,480		0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	23,500	23,500	33	2,540		0.0
SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	31,000	31,000	13	1,054		0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	83,000	83,000	108	8,221		0.2
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	25,000	25,000	26	2,022		0.0
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	46,000	30	2,278		0.0
SPH REIT	16,000	16,000	17	1,306		0.0
QUE HOSPITALITY TRUST	36,000	36,000	26	1,987		0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	26,000	14	1,071		0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	10,000	10,000	7	529		0.0
KEPPEL DC REIT	24,000	24,000	41	3,157		0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	59,000	59,000	71	5,397		0.1
小計	1,408,952	1,511,152	2,434	184,037		
	口数・金額 銘柄数<比率>	30	30	—	<3.5%>	
(イスラエル) REIT 1 LTD	8,000	8,000	千イスラエルシェケル 166	4,975		0.1
小計	8,000	8,000	166	4,975		
	口数・金額 銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>	
合計	4,674,452	4,976,940	—	5,173,473		
	口数・金額 銘柄数<比率>	306	302	—	<99.4%>	

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

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※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。

■ 投資信託財産の構成

(2019年8月26日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	5,173,474	99.1
コール・ローン等、その他	46,315	0.9
投資信託財産総額	5,219,789	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（5,201,645千円）の投資信託財産総額（5,219,789千円）に対する比率は99.7%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=105.08円、1カナダドル=78.96円、1ユーロ=117.07円、1英ポンド=128.88円、1オーストラリアドル=70.65円、1ニュージーランドドル=67.06円、1香港ドル=13.40円、1シンガポールドル=75.61円、1イスラエルシェケル=29.93円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年8月26日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	5,230,288,789円
コール・ローン等	32,648,593
投資証券(評価額)	5,173,474,115
未 収 入 金	10,865,968
未 収 配 当 金	13,300,113
(B) 負 債	26,167,845
未 払 金	10,500,000
未 払 解 約 金	15,667,142
未 払 利 息	46
その他未払費用	657
(C) 純資産総額(A-B)	5,204,120,944
元 本	2,461,322,340
次期繰越損益金	2,742,798,604
(D) 受益権総口数	2,461,322,340口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,144円

※当期における期首元本額2,306,106,684円、期中追加設定元本額1,231,094,593円、期中一部解約元本額1,075,878,937円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	53,067,845円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	55,975,211円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	53,855,896円
イオン・バランス戦略ファンド	6,395,426円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	2,082,486,535円
三井住友・DCターゲッティヤーファンド2050	1,318,645円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	11,909,912円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	8,560,920円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	22,710,908円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	13,277,563円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	13,110,719円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	19,643,601円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	439,070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)	99,712,823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>	2,419,962円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	16,437,304円

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

■ 損益の状況

(自2019年2月26日 至2019年8月26日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	104,614,118円
受 取 配 当 金	103,310,480
受 取 利 息	105,497
そ の 他 収 益 金	1,208,848
支 払 利 息	△ 10,707
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 167,040,704
売 買 益	386,489,515
売 買 損	△ 553,530,219
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,730,126
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 65,156,712
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,621,023,349
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,436,154,875
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,249,222,908
(H) 計 (D+E+F+G)	2,742,798,604
次 期 繰 越 損 益 金(H)	2,742,798,604

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

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

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

■ お知らせ

<約款変更について>

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)