

<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先遣国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価の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。 ■外貨建資産への投資は行いません。 | |
| | 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。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 | |
| | 外国債券パッシブ・マザーファンド | <ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 | |
| | 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。 | | |
| | 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、市況動向によっては変更する場合があります。) | | |

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)】

(2019年9月11日から2020年9月10日まで)

第 3 期

決算日 2020年9月10日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、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。今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

三井住友DSアセットマネジメント

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

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

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

■ 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 (買建-売建) | 債券組入 率 | 投資信託 証券組入 率 | 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 |
| 3期(2020年9月10日) | 10,720 | 0 | 2.7 | 110.12 | 3.5 | 34.8 | 3.6 | 39.3 | 20.9 | 544 |

※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2020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 (買建-売建) | 債券組入 率 | 投資信託 証券組入 率 |
|--------------------|-------------|--------|------------------|--------|-----------|----------------------|-----------|-------------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | | |
| (期首) 2019年9月10日 | 円 10,442 | % - | 106.37 | % - | 33.6 | 5.5 | 38.8 | 20.7 |
| 9月末 | 10,505 | 0.6 | 107.13 | 0.7 | 32.9 | 5.4 | 39.3 | 20.7 |
| 10月末 | 10,777 | 3.2 | 109.87 | 3.3 | 33.1 | 6.0 | 41.2 | 21.0 |
| 11月末 | 10,876 | 4.2 | 110.95 | 4.3 | 33.6 | 5.2 | 38.9 | 20.8 |
| 12月末 | 10,995 | 5.3 | 112.21 | 5.5 | 33.8 | 4.9 | 38.9 | 20.7 |
| 2020年1月末 | 11,002 | 5.4 | 112.38 | 5.7 | 32.6 | 5.0 | 39.6 | 21.1 |
| 2月末 | 10,579 | 1.3 | 108.03 | 1.6 | 32.4 | 4.2 | 41.1 | 20.3 |
| 3月末 | 9,525 | △8.8 | 97.16 | △8.7 | 34.2 | 4.5 | 37.4 | 21.0 |
| 4月末 | 9,903 | △5.2 | 101.16 | △4.9 | 35.2 | 4.1 | 37.8 | 21.2 |
| 5月末 | 10,131 | △3.0 | 103.75 | △2.5 | 34.2 | 4.5 | 38.3 | 21.6 |
| 6月末 | 10,288 | △1.5 | 105.52 | △0.8 | 34.1 | 4.6 | 39.4 | 20.3 |
| 7月末 | 10,436 | △0.1 | 107.13 | 0.7 | 33.5 | 4.5 | 39.4 | 21.0 |
| 8月末 | 10,783 | 3.3 | 110.76 | 4.1 | 35.1 | 3.8 | 38.6 | 21.0 |
| (期末) 2020年9月10日 | 10,720 | 2.7 | 110.12 | 3.5 | 34.8 | 3.6 | 39.3 | 20.9 |

※騰落率は期首比です。

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

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2019年9月11日から2020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 | 10,442円 |
| 期末 | 10,720円 (分配金0円(税引前)込み) |
| 騰落率 | +2.7% (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(2019年9月11日から2020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、国内株式、主要先進国、新興国の株式市場が上昇したこと
- 期を通してみれば、米国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、ユーロに対して円安が進行したこと

下落要因

- 期を通してみれば、日本や欧州の債券利回りが上昇(価格は下落)したこと
- 期を通してみれば、国内外のリート市場が下落したこと
- 期を通してみれば、米ドルや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 | -2.2% | 15.0% |
| 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) | +3.5% | 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) | +6.5% | 19.9% |
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 国内株式 | +7.0% | 10.0% |
| 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) | +11.3% | 19.8% |
| 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 | +8.5% | 9.8% |
| Jリート・インデックス・マザーファンド | 国内リート | -16.1% | 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 | -15.3% | 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(2019年9月11日から2020年9月10日まで)

国内株式や主要先進国株式市場、新興国株式市場は上昇しました。債券市場では、米国の債券利回りは低下した一方で、日本や欧州の債券利回りは上昇しました。国内外のリート市場は下落しました。外国為替市場では、ユーロに対して円が下落する一方で、米ドルや新興国通貨に対して円が上昇する展開となりました。

株式市場

●先進国外国株式

先進国株式は、期初から2020年2月中旬にかけては、米中貿易協議の進展などを背景に、株価は底堅く推移しました。2月下旬から3月中旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の減速懸念を背景に、株価は大幅に下落しました。その後、期末にかけては、世界の主要国、中央銀行の積極的な政策対応を好感し、上昇基調で推移しました。

当期のMSCIコクサイインデックス(配当込み、米ドルベース)は、期首に比べて12.8%上昇しました。

●国内株式

国内株式は、期初から1月中旬にかけて、米中貿易交渉の進展など(12月には貿易協議の第一段階の合意が発表されました)を背景に、株価は上昇傾向で推移しました。その後、2月中旬から3月中旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受

け、大幅に下落しました。その後は、日本を含む世界主要国の政府、中央銀行が矢継ぎ早に財政、金融政策を打ち出したことを好感し、株価は期末まで上昇基調で推移する展開となりました。

当期のTOPIX(東証株価指数、配当込み)は、期首に比べて7.0%上昇しました。

●新興国株式

新興国株式は、期初から1月中旬まで、米中貿易交渉の進展等を背景にグローバルに株価が上昇する展開となり、新興国株式も底堅く推移しました。2月中旬から3月中旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大に伴いリスク回避的な動きが強まり、新興国株式市場は大幅に下落しました。3月下旬から期末にかけては、先進国株式市場に連れて底堅く推移する展開となりました。

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7.4%上昇しました。

債券市場

●先進国外国債券

米国国債利回りは、期を通してみれば低下しました。

米国国債利回りは期初から1月中旬にかけては、米中貿易協議の進展を受けてリスク回避姿勢が後退し、上昇する展開となりました。その後は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴う景気減速懸念や、3月に入ってのFRB(米連邦準備制度理事会)の緊急利下げ等を受けて、3月上旬まで大きく低下しました。4月以降は、FRBの金融緩和策が継続する中、債券利回りは期末まで低位、もみあいでの推移となりました。

欧州では、期初から1月中旬にかけて、米中貿易協議の進展や、英国のEU(欧州連合)離脱にめどがついたことなどを受け(1月末に正式に離脱しました)、ドイツ国債利回りは上昇する動きとなりました。その後は3月上旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大やFRBによる緊急利下げ等を背景に大幅に低下しました。3月中旬には、市場の混乱を背景に、現金化目的の債券売りが強まり利回りが急上昇しましたが、FRBやECB(欧州中央銀行)の政策対応を受け、低下に転じました。5月以降は、ECBの金融緩和策が継続する中、期末まで概ねもみあいでの推移となりました。

当期の米国10年国債利回りは期首1.64%

から期末には0.70%に低下しました。ドイツ10年国債利回りは期首-0.59%から期末には-0.46%に上昇しました。

●国内債券

日本の長期債利回り(10年国債利回り)は期初から1月中旬まで、米中貿易協議の進展を受けた米欧債券利回りの上昇に連れる形で、上昇基調で推移しました。その後は、新型コロナウイルスの感染拡大に伴い、3月上旬にかけて低下しました。3月中旬には世界的な金融市場の混乱を受けて、現金化目的の売りが債券市場にも波及し、下旬にかけて利回りが急上昇しました。4月以降は、日本銀行の金融緩和策が継続する中、期末までもみあいでの推移となりました。

当期の10年国債利回りは期首-0.22%から期末には0.03%に上昇しました。

リート市場

●グローバルリート

グローバルリート市場は、世界的に金融緩和環境が続く中、期初から1月まで、相対的に利回りの高いリート市場への底堅い資金フローなどを背景に堅調に推移しました。2月中旬以降は、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に世界的に株価が下落するなどリスク回避的な動きが強まり、グローバルリート市場も3月中旬にかけて大幅に下落しました。その後は、世界の主要

国、中央銀行の政策対応を好感し、リスク回避姿勢が後退する中、期末まで上昇基調で推移しました。

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17.1%下落しました。

●国内リート

期初から2月中旬にかけては、株式市場の堅調などを背景に、リート市場も堅調に推移しました。2月下旬から3月中旬にかけては、世界的に株価が下落する中、リート市場も大幅に下落しました。

4月以降は、市場が落ち着きを取り戻す中、期末まで緩やかに上昇しました。

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16.2%下落しました。

外国為替

●米ドル・円

米ドル・円は、期初から2月中旬まで、米国株価の上昇等も背景に、米ドルはじり高の展開となりました。その後は新型コロナウイルスの感染拡大やFRBによる緊急利下げの動きなどを背景に、3月上旬まで米ドルは大幅に下落しました。3月中旬から下旬にかけては、米ドル資金需要の高まりを背景に、米ドルが急上昇するなど、非常に値動きの荒い展開となりました。4月

以降は、市場が落ち着きを取り戻す中、FRBの金融緩和の継続を背景に米国債券利回りが低位で推移したことを受け、期末まで米ドルは緩やかな下落基調で推移しました。

当期の米ドル・円は、期首107円45銭から期末106円22銭と1円23銭の米ドル安・円高となりました。

●ユーロ・円

ユーロ・円は、期初から1月中旬にかけては、米ドル・円相場に連れて、ユーロが円に対してじり高の展開となりました。しかし、その後は新型コロナウイルスの感染拡大を受けてリスク回避的な動きが強まると、5月上旬にかけてユーロが下落しました。5月中旬以降は、欧州復興基金設立の動き(7月に設立が合意されました)などを背景に、ユーロが期末まで上昇傾向で推移しました。

当期のユーロ・円は、期首118円67銭から期末125円40銭と6円73銭のユーロ高・円安となりました。

●新興国通貨

新興国通貨は、期を通じて軟調な展開となりました。

期初から2月中旬にかけては、概ねもみあい推移しました。その後は、新型コロナウイルスの感染拡大が止まらないことや政策対応余地に対する懸念等を背景に、期

未まで米ドルや円など主要通貨に対して軟調に推移しました。

当期のブラジルレアル・円は期首26円22銭から期末20円01銭と6円21銭のブラジル

レアル安・円高、トルコリラ・円は期首18円71銭から期末14円19銭と4円52銭のトルコリラ安・円高となりました。

ポートフォリオについて(2019年9月11日から2020年9月10日まで)

当ファンド

主として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

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

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

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

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。

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。

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を低く抑えました。

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

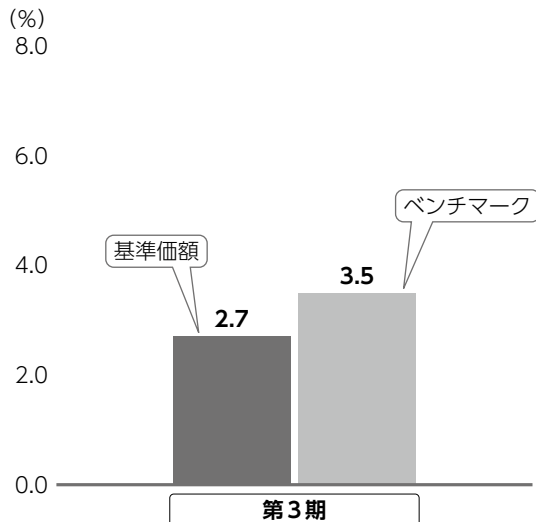
S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

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9月11日から2020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+2.7%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+3.5%を0.8%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 信託報酬等の費用がかかったこと

分配金について(2019年9月11日から2020年9月10日まで)

(単位:円、1万口当たり、税引前)

| 項目 | 第3期 |
|-----------|------|
| 当期分配金 | — |
| (対基準価額比率) | (—%) |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 719 |

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。

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

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

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、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)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。

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)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、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。

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)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、リート組入比率を高位に保つことを基本とします。

3 お知らせ

約款変更等のお知らせ

該当事項はございません。

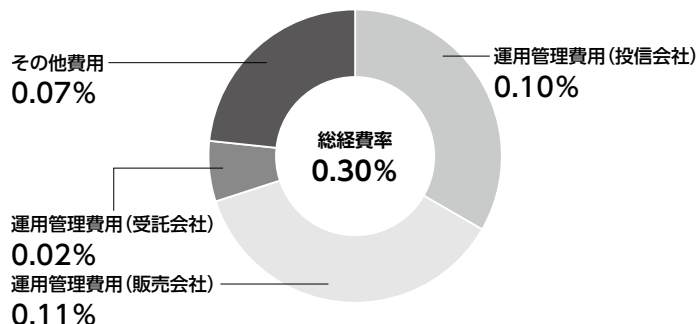
■ 1万口当たりの費用明細 (2019年9月11日から2020年9月10日まで)

| 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) | 24円 (10) (12) (2) | 0.231% (0.099) (0.110) (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) (2) (1) | 0.036 (0.008) (0.000) (0.023) (0.006) | 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) (新株予約権証券) (投資信託証券) | 1 (0) (0) (0) | 0.008 (0.004) (0.000) (0.004) | 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) (1) | 0.070 (0.057) (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 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 | 36 | 0.345 | |

期中の平均基準価額は10,483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 (2019年9月11日から2020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) | 9,236 | 23,341 | 487 | 1,255 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 12,688 | 45,254 | 2,306 | 8,317 |
| ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 9,616 | 14,469 | 2,118 | 3,194 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 32,419 | 59,844 | 8,082 | 15,003 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 37,844 | 48,706 | 7,104 | 9,130 |
| Jリート・インデックス・マザーファンド | 6,812 | 14,907 | 106 | 244 |
| 外国リート・インデックス・マザーファンド | 25,828 | 47,830 | 2,454 | 4,542 |
| エマージング株式インデックス・マザーファンド | 18,004 | 22,403 | 2,773 | 3,789 |

※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

(2019年9月11日から2020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 | 外国リート・ 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 | 41,264,222千円 | 98,086,219千円 | 567千円 | 2,541,860千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 161,606,569千円 | 209,764,363千円 | 28千円 | 4,232,235千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b) | 0.25 | 0.46 | 19.97 | 0.60 |

※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 (2019年9月11日から2020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

エマージング株式インデックス・マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

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 | | | 売付額等 | | |
|-------------|---------------|----------------|-----------|---------------|----------------|-----------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| 株 式 | 百万円 20,489 | 百万円 6,789 | % 33.1 | 百万円 20,774 | 百万円 12,438 | % 59.9 |
| 株 式 先 物 取 引 | 49,072 | 46,689 | 95.1 | 50,091 | 45,031 | 89.9 |

※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 | | | 売付額等 | | |
|-------|---------------|----------------|----------|---------------|----------------|----------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| 公 社 債 | 百万円 50,379 | 百万円 3,029 | % 6.0 | 百万円 58,186 | 百万円 2,764 | % 4.8 |

※平均保有割合 0.0%

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

Jリート・インデックス・マザーファンド

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-------------|--------------|----------------|-----------|--------------|----------------|-----------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 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 5,141 | 百万円 2,085 | % 40.6 | 百万円 5,048 | 百万円 912 | % 18.1 |

※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 170 | 百万円 174 | 百万円 1,604 |

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 202 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|----------|
| 株 式 | 百万円 7 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 買 付 額 |
|-------|--------------|
| 公 社 債 | 百万円 1,200 |

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 182 |

(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 | 149千円 |
| (b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 | 3千円 |
| (c) (b) / (a) | 2.4% |

※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、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

(2019年9月11日から2020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 (2020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) | 11,942 | 20,691 | 54,506 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 16,546 | 26,928 | 108,015 |
| ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 9,490 | 16,988 | 26,116 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 32,391 | 56,728 | 108,611 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 33,042 | 63,782 | 81,571 |
| Jリート・インデックス・マザーファンド | 5,609 | 12,315 | 26,475 |
| 外国リート・インデックス・マザーファンド | 19,863 | 43,237 | 81,325 |
| エマージング株式インデックス・マザーファンド | 23,577 | 38,808 | 53,381 |

※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) | 65,642,531千口 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 59,853,159千口 |
| ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 14,934,455千口 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 86,651,796千口 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 103,519,056千口 | Jリート・インデックス・マザーファンド | 3,156,320千口 |
| 外国リート・インデックス・マザーファンド | 4,109,013千口 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 7,337,581千口 |

※単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2020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） | 54,506 | 10.0 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド | 108,015 | 19.8 |
| ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 26,116 | 4.8 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 108,611 | 19.9 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 81,571 | 14.9 |
| Jリート・インデックス・マザーファンド | 26,475 | 4.8 |
| 外国リート・インデックス・マザーファンド | 81,325 | 14.9 |
| エマージング株式インデックス・マザーファンド | 53,381 | 9.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 6,262 | 1.1 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 546,262 | 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（239,897,598千円）の投資信託財産総額（240,250,124千円）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（22,716,101千円）の投資信託財産総額（23,030,322千円）に対する比率は98.6%です。

※外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（165,524,506千円）の投資信託財産総額（166,156,388千円）に対する比率は99.6%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（7,719,035千円）の投資信託財産総額（7,763,706千円）に対する比率は99.4%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（8,251,359千円）の投資信託財産総額（10,119,425千円）に対する比率は81.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=106.22円、1カナダドル=80.70円、1メキシコペソ=4.96円、1ブラジルレアル=20.01円、100チリペソ=13.84円、100コロンビアペソ=2.86円、1ユーロ=125.40円、1英ポンド=137.97円、1スイスフラン=116.48円、1スウェーデンクローナ=12.14円、1ノルウェークローネ=11.79円、1デンマーククローネ=16.86円、1トルコリラ=14.19円、1チェココルナ=4.73円、100ハンガリーフォリント=35.13円、1ポーランドズロチ=28.23円、1オーストラリアドル=77.18円、1ニュージーランドドル=70.91円、1香港ドル=13.71円、1シンガポールドル=77.70円、1マレーシアリングギット=25.50円、1タイバーツ=3.40円、1フィリピンペソ=2.18円、100インドネシアルピア=0.72円、100韓国ウォン=8.98円、1新台湾ドル=3.62円、1インドルピー=1.46円、1イスラエルシェケル=31.27円、1エジプトポンド=6.72円、1南アフリカランド=6.40円、1中国元（オフショア）=15.54円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年9月10日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-----------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 546,262,653円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 6,259,369 |
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額) | 54,506,601 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド(評価額) | 108,015,883 |
| ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 26,116,025 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 108,611,564 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 81,571,074 |
| Jリート・インデックス・マザーファンド(評価額) | 26,475,158 |
| 外国リート・インデックス・マザーファンド(評価額) | 81,325,317 |
| エマージング株式インデックス・マザーファンド(評価額) | 53,381,662 |
| (B) 負 債 | 1,482,035 |
| 未 払 解 約 金 | 938,247 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 528,637 |
| 未 払 利 息 | 18 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 15,133 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 544,780,618 |
| 元 本 | 508,204,609 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 36,576,009 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 508,204,609口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 10,720円 |

※当期における期首元本額283,071,447円、期中追加設定元本額284,669,114円、期中一部解約元本額59,535,952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2019年9月11日 至2020年9月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △ 2,452円 |
| 支 払 利 息 | △ 2,452 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 15,915,738 |
| 売 買 益 | 27,283,978 |
| 売 買 損 | △11,368,240 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 968,458 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 14,944,828 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 7,908,894 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 13,722,287 |
| (配 当 等 相 当 額) | (13,313,116) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (409,171) |
| (G) 計 (D + E + F) | 36,576,009 |
| (H) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G + H) | 36,576,009 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 13,722,287 |
| (配 当 等 相 当 額) | (13,694,370) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (27,917) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 22,853,722 |

※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(8,343,778円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(6,601,050円)、信託約款に規定される収益調整金(13,722,287円)および分配準備積立金(7,908,894円)より分配可能額は36,576,009円(1万口当たり719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15期 (2019年5月28日から2020年5月25日まで)

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | (ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合) | | 債券組入 比 | 純資産 総額 |
|------------------|--------|------|-----------------------------|------|-----------|-----------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | | |
| 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 |
| 15期 (2020年5月25日) | 12,846 | △0.1 | 388.47 | △0.1 | 99.7 | 137,939 |

※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 |
|--------------------|--------|------|-----------------------------|------|-----------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | |
| (期首) 2019年5月27日 | 12,860 | — | 388.97 | — | 98.7 |
| 5月末 | 12,906 | 0.4 | 390.32 | 0.3 | 99.2 |
| 6月末 | 12,983 | 1.0 | 392.69 | 1.0 | 99.3 |
| 7月末 | 12,999 | 1.1 | 393.15 | 1.1 | 99.1 |
| 8月末 | 13,174 | 2.4 | 398.50 | 2.4 | 99.1 |
| 9月末 | 13,036 | 1.4 | 394.27 | 1.4 | 99.2 |
| 10月末 | 12,984 | 1.0 | 392.61 | 0.9 | 99.5 |
| 11月末 | 12,939 | 0.6 | 391.33 | 0.6 | 99.4 |
| 12月末 | 12,901 | 0.3 | 390.14 | 0.3 | 99.7 |
| 2020年1月末 | 12,956 | 0.7 | 391.77 | 0.7 | 99.4 |
| 2月末 | 13,056 | 1.5 | 394.74 | 1.5 | 97.0 |
| 3月末 | 12,846 | △0.1 | 388.45 | △0.1 | 99.6 |
| 4月末 | 12,890 | 0.2 | 389.79 | 0.2 | 99.6 |
| (期末) 2020年5月25日 | 12,846 | △0.1 | 388.47 | △0.1 | 99.7 |

※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 (2019年5月28日から2020年5月25日まで)

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 12,860円 |
| 期末 | 12,846円 |
| 騰落率 | -0.1% |

※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、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 (2019年5月28日から2020年5月25日まで)

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

| | |
|------|--|
| 上昇要因 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 期初から9月初旬にかけて、米中通商摩擦の激化を背景に景気減速懸念が高まったことから、国内債券利回りが低下（債券価格は上昇）したこと ・ 1月下旬から3月上旬にかけて、新型コロナウイルス感染の拡大に伴う景気悪化懸念から、国内債券利回りが低下したこと |
| 下落要因 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 9月初旬から12月にかけて、米中通商交渉の進展期待や部分合意の成立を背景に、国内債券利回りが上昇（債券価格は下落）したこと ・ 3月中旬に、金融市場において投資を縮小する動きから、国内債券利回りが上昇したこと |

▶ 投資環境について (2019年5月28日から2020年5月25日まで)

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

長期金利は、米中通商交渉の長期化が懸念されるなか、期初から低下基調で推移しました。8月に米中通商摩擦が激化すると、内外での追加金融緩和期待の高まりとともに、 -0.3% 近辺へと金利低下しました。

しかし9月初旬以降は、米中通商摩擦への懸念が後退したことで長期金利は上昇基調に転じました。12月には、米中通商交渉で第一段階の合意が成立すると、株高・債券安の流れのなかで長期金利は一時 $+0.01\%$ と小幅プラス圏へと上昇しました。

しばらく 0% 近辺で推移していた長期金利は、新型コロナウイルス感染の拡大に伴う景気下振れリスクへの警戒から、1月下旬以降に再度低下基調となりました。世界各地で新型コロナウイルスの感染が拡大すると、3月に米国で緊急利下げが実施されるなど、各国が政策対応に動くなかで、長期金利は一時 -0.1% 台後半へ低下しました。しかし、3月の中旬以降、資産価格のボラティリティ（価格変動性）の上昇を受けて投資を縮小する動きが広がると、長期金利は 0.1% 近辺へと急上昇しました。金利の急上昇に対しては、日銀が国債買入れを積極化したことから、次第に長期金利は上昇幅を縮小しました。

期末にかけては、政府の財政政策拡大に伴う国債増発への警戒と、日銀の国債買入の一段の積極化への期待が交錯し、長期金利は 0% 前後での推移となりました。

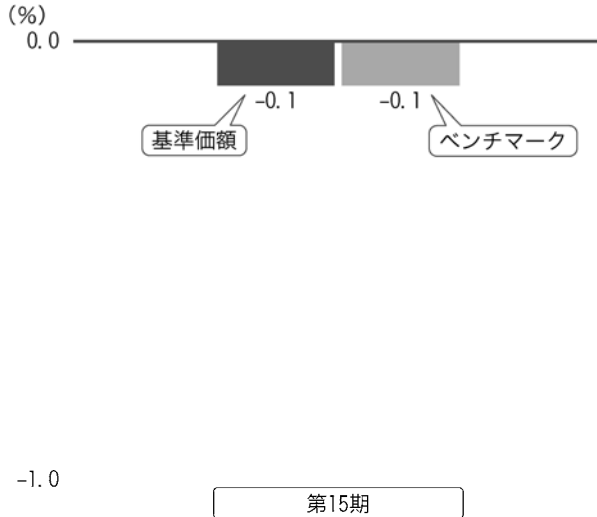
当期の市場の動きを10年国債利回りで見ると、期首 -0.069% から期末 $+0.002\%$ へと上昇しました。

▶ ポートフォリオについて (2019年5月28日から2020年5月25日まで)

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

▶ ベンチマークとの差異について (2019年5月28日から2020年5月25日まで)

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



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

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は-0.1%となり、ベンチマークの騰落率-0.1%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(2019年5月28日から2020年5月25日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|--------------------|-----------|-------------------|--|
| (a) その他費用 (その他) | 0円 (0) | 0.000% (0.000) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 その他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 0 | 0.000 | |

期中の平均基準価額は12,972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5月28日から2020年5月25日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|---------------------|------------|--------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 44,725,768 | 54,126,659 |
| | 地方債証券 | — | 4,193,930 |
| | 特殊債証券 | — | 6,955,398 (1,321,475) |
| | 社債証券 (投資法人債券を含む) | — | 1,853,226 (1,000,000) |

※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(2019年5月28日から2020年5月25日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D | |
|-----|---------------|--------------------|----------|---|---------------|--------------------|----------|---|
| | | | A | % | | | C | % |
| 公社債 | 百万円 44,725 | 百万円 3,131 | % 7.0 | | 百万円 67,129 | 百万円 5,735 | % 8.5 | |

国内債券パッシブ・マザーファンド

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

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 (2019年5月28日から2020年5月25日まで)

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

■ 組入れ資産の明細(2020年5月25日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

| 区 分 | 期 | | | | 末 | | |
|---------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|--------------|
| | 額面金額 | 評価額 | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | 千円 | 千円 | % | % | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 国債証券 | 99,765,000 (14,995,000) | 110,576,999 (16,451,810) | 80.2 (11.9) | - (-) | 57.6 (7.9) | 17.3 (4.0) | 5.3 (-) |
| 地方債証券 | 7,900,500 (7,900,500) | 8,500,189 (8,500,189) | 6.2 (6.2) | - (-) | 2.4 (2.4) | 2.9 (2.9) | 0.9 (0.9) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 11,923,519 (11,923,519) | 12,721,420 (12,721,420) | 9.2 (9.2) | - (-) | 3.9 (3.9) | 2.7 (2.7) | 2.6 (2.6) |
| 金融債券 | 300,000 (300,000) | 300,261 (300,261) | 0.2 (0.2) | - (-) | - (-) | 0.2 (0.2) | - (-) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 5,200,000 (5,000,000) | 5,368,179 (5,166,421) | 3.9 (3.7) | - (-) | 1.6 (1.5) | 1.5 (1.5) | 0.7 (0.7) |
| 合 計 | 125,089,019 (40,119,019) | 137,467,050 (43,140,103) | 99.7 (31.3) | - (-) | 65.5 (15.8) | 24.5 (11.2) | 9.6 (4.3) |

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※-印は組入れなし。

国内債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 国内(邦貨建)公社債

| 種 類 | 銘 柄 | | 期 末 | | | |
|---------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国 債 証 券 | 第403回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 20,000 | 20,067 | 2021/8/1 |
| | 第404回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 20,000 | 20,072 | 2021/9/1 |
| | 第405回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 60,000 | 60,243 | 2021/10/1 |
| | 第407回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 20,000 | 20,086 | 2021/12/1 |
| | 第409回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 30,000 | 30,141 | 2022/2/1 |
| | 第410回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 3,110,000 | 3,125,394 | 2022/3/1 |
| | 第411回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 1,810,000 | 1,819,393 | 2022/4/1 |
| | 第412回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 630,000 | 633,351 | 2022/5/1 |
| | 第130回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 90,000 | 90,388 | 2021/12/20 |
| | 第131回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 140,000 | 140,701 | 2022/3/20 |
| | 第132回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 95,000 | 95,551 | 2022/6/20 |
| | 第133回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 148,000 | 148,964 | 2022/9/20 |
| | 第134回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 110,000 | 110,794 | 2022/12/20 |
| | 第135回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 190,000 | 191,504 | 2023/3/20 |
| | 第136回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 400,000 | 403,452 | 2023/6/20 |
| | 第137回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 100,000 | 100,901 | 2023/9/20 |
| | 第138回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 600,000 | 605,706 | 2023/12/20 |
| | 第139回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 100,000 | 100,998 | 2024/3/20 |
| | 第140回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 600,000 | 606,264 | 2024/6/20 |
| | 第141回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 15,000 | 15,159 | 2024/9/20 |
| | 第142回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 2,090,000 | 2,113,052 | 2024/12/20 |
| | 第143回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 430,000 | 434,897 | 2025/3/20 |
| | 第1回 | 利付国債(40年) | 2.4 | 40,000 | 60,175 | 2048/3/20 |
| | 第2回 | 利付国債(40年) | 2.2 | 242,000 | 355,009 | 2049/3/20 |
| | 第3回 | 利付国債(40年) | 2.2 | 185,000 | 274,073 | 2050/3/20 |
| | 第4回 | 利付国債(40年) | 2.2 | 247,000 | 369,479 | 2051/3/20 |
| | 第5回 | 利付国債(40年) | 2.0 | 245,000 | 355,639 | 2052/3/20 |
| | 第6回 | 利付国債(40年) | 1.9 | 270,000 | 386,923 | 2053/3/20 |
| | 第7回 | 利付国債(40年) | 1.7 | 285,000 | 393,602 | 2054/3/20 |
| | 第8回 | 利付国債(40年) | 1.4 | 330,000 | 426,934 | 2055/3/20 |
| | 第9回 | 利付国債(40年) | 0.4 | 498,000 | 484,339 | 2056/3/20 |
| | 第10回 | 利付国債(40年) | 0.9 | 490,000 | 557,879 | 2057/3/20 |
| | 第11回 | 利付国債(40年) | 0.8 | 380,000 | 420,264 | 2058/3/20 |
| | 第12回 | 利付国債(40年) | 0.5 | 415,000 | 416,352 | 2059/3/20 |
| | 第317回 | 利付国債(10年) | 1.1 | 55,000 | 55,931 | 2021/9/20 |
| | 第321回 | 利付国債(10年) | 1.0 | 960,000 | 980,553 | 2022/3/20 |
| | 第322回 | 利付国債(10年) | 0.9 | 365,000 | 372,146 | 2022/3/20 |
| | 第323回 | 利付国債(10年) | 0.9 | 310,000 | 316,950 | 2022/6/20 |
| | 第324回 | 利付国債(10年) | 0.8 | 390,000 | 397,932 | 2022/6/20 |
| | 第325回 | 利付国債(10年) | 0.8 | 1,265,000 | 1,293,879 | 2022/9/20 |
| | 第326回 | 利付国債(10年) | 0.7 | 77,000 | 78,738 | 2022/12/20 |
| | 第327回 | 利付国債(10年) | 0.8 | 25,000 | 25,629 | 2022/12/20 |
| | 第328回 | 利付国債(10年) | 0.6 | 130,000 | 132,870 | 2023/3/20 |
| 第329回 | 利付国債(10年) | 0.8 | 2,030,000 | 2,091,366 | 2023/6/20 | |
| 第330回 | 利付国債(10年) | 0.8 | 1,285,000 | 1,326,621 | 2023/9/20 | |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-----------------|-----|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第332回 利付国債(10年) | 0.6 | 793,000 | 814,783 | 2023/12/20 |
| | 第333回 利付国債(10年) | 0.6 | 815,000 | 838,781 | 2024/3/20 |
| | 第334回 利付国債(10年) | 0.6 | 315,000 | 324,736 | 2024/6/20 |
| | 第335回 利付国債(10年) | 0.5 | 50,000 | 51,413 | 2024/9/20 |
| | 第336回 利付国債(10年) | 0.5 | 340,000 | 350,087 | 2024/12/20 |
| | 第337回 利付国債(10年) | 0.3 | 120,000 | 122,427 | 2024/12/20 |
| | 第338回 利付国債(10年) | 0.4 | 805,000 | 826,074 | 2025/3/20 |
| | 第339回 利付国債(10年) | 0.4 | 785,000 | 806,634 | 2025/6/20 |
| | 第340回 利付国債(10年) | 0.4 | 770,000 | 792,283 | 2025/9/20 |
| | 第341回 利付国債(10年) | 0.3 | 857,000 | 878,167 | 2025/12/20 |
| | 第342回 利付国債(10年) | 0.1 | 890,000 | 902,255 | 2026/3/20 |
| | 第343回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,110,000 | 1,125,950 | 2026/6/20 |
| | 第344回 利付国債(10年) | 0.1 | 981,000 | 995,695 | 2026/9/20 |
| | 第345回 利付国債(10年) | 0.1 | 938,000 | 952,295 | 2026/12/20 |
| | 第346回 利付国債(10年) | 0.1 | 640,000 | 649,894 | 2027/3/20 |
| | 第347回 利付国債(10年) | 0.1 | 430,000 | 436,897 | 2027/6/20 |
| | 第348回 利付国債(10年) | 0.1 | 755,000 | 767,261 | 2027/9/20 |
| | 第349回 利付国債(10年) | 0.1 | 720,000 | 731,815 | 2027/12/20 |
| | 第350回 利付国債(10年) | 0.1 | 980,000 | 995,827 | 2028/3/20 |
| | 第351回 利付国債(10年) | 0.1 | 840,000 | 853,314 | 2028/6/20 |
| | 第352回 利付国債(10年) | 0.1 | 650,000 | 660,075 | 2028/9/20 |
| | 第353回 利付国債(10年) | 0.1 | 800,000 | 811,720 | 2028/12/20 |
| | 第354回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,035,000 | 1,049,210 | 2029/3/20 |
| | 第355回 利付国債(10年) | 0.1 | 860,000 | 870,956 | 2029/6/20 |
| | 第356回 利付国債(10年) | 0.1 | 850,000 | 859,919 | 2029/9/20 |
| | 第357回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,635,000 | 1,652,216 | 2029/12/20 |
| | 第358回 利付国債(10年) | 0.1 | 220,000 | 222,158 | 2030/3/20 |
| | 第2回 利付国債(30年) | 2.4 | 510,000 | 629,518 | 2030/2/20 |
| | 第4回 利付国債(30年) | 2.9 | 300,000 | 390,015 | 2030/11/20 |
| | 第5回 利付国債(30年) | 2.2 | 290,000 | 358,106 | 2031/5/20 |
| | 第7回 利付国債(30年) | 2.3 | 474,000 | 598,192 | 2032/5/20 |
| | 第9回 利付国債(30年) | 1.4 | 100,000 | 115,922 | 2032/12/20 |
| | 第10回 利付国債(30年) | 1.1 | 555,000 | 622,865 | 2033/3/20 |
| | 第11回 利付国債(30年) | 1.7 | 430,000 | 516,417 | 2033/6/20 |
| | 第12回 利付国債(30年) | 2.1 | 590,000 | 741,217 | 2033/9/20 |
| | 第14回 利付国債(30年) | 2.4 | 742,000 | 966,670 | 2034/3/20 |
| | 第16回 利付国債(30年) | 2.5 | 465,000 | 616,036 | 2034/9/20 |
| | 第18回 利付国債(30年) | 2.3 | 450,000 | 586,404 | 2035/3/20 |
| | 第19回 利付国債(30年) | 2.3 | 490,000 | 640,518 | 2035/6/20 |
| | 第21回 利付国債(30年) | 2.3 | 345,000 | 453,367 | 2035/12/20 |
| | 第22回 利付国債(30年) | 2.5 | 315,000 | 424,771 | 2036/3/20 |
| | 第23回 利付国債(30年) | 2.5 | 329,000 | 445,071 | 2036/6/20 |
| | 第24回 利付国債(30年) | 2.5 | 310,000 | 420,691 | 2036/9/20 |
| | 第25回 利付国債(30年) | 2.3 | 300,000 | 398,484 | 2036/12/20 |
| | 第26回 利付国債(30年) | 2.4 | 363,000 | 489,342 | 2037/3/20 |
| | 第27回 利付国債(30年) | 2.5 | 440,000 | 603,354 | 2037/9/20 |
| | 第28回 利付国債(30年) | 2.5 | 386,000 | 532,321 | 2038/3/20 |
| | 第29回 利付国債(30年) | 2.4 | 177,000 | 242,180 | 2038/9/20 |
| | 第30回 利付国債(30年) | 2.3 | 472,000 | 641,278 | 2039/3/20 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|------|-----------|-----|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 第31回 | 利付国債(30年) | 2.2 | 315,000 | 424,683 | 2039/9/20 |
| 第32回 | 利付国債(30年) | 2.3 | 390,000 | 535,891 | 2040/3/20 |
| 第33回 | 利付国債(30年) | 2.0 | 378,000 | 500,116 | 2040/9/20 |
| 第34回 | 利付国債(30年) | 2.2 | 457,000 | 625,285 | 2041/3/20 |
| 第35回 | 利付国債(30年) | 2.0 | 390,000 | 520,248 | 2041/9/20 |
| 第36回 | 利付国債(30年) | 2.0 | 100,000 | 133,986 | 2042/3/20 |
| 第37回 | 利付国債(30年) | 1.9 | 495,000 | 655,196 | 2042/9/20 |
| 第38回 | 利付国債(30年) | 1.8 | 370,000 | 483,356 | 2043/3/20 |
| 第39回 | 利付国債(30年) | 1.9 | 170,000 | 226,242 | 2043/6/20 |
| 第40回 | 利付国債(30年) | 1.8 | 340,000 | 445,811 | 2043/9/20 |
| 第41回 | 利付国債(30年) | 1.7 | 310,000 | 400,250 | 2043/12/20 |
| 第42回 | 利付国債(30年) | 1.7 | 240,000 | 310,204 | 2044/3/20 |
| 第43回 | 利付国債(30年) | 1.7 | 315,000 | 407,587 | 2044/6/20 |
| 第44回 | 利付国債(30年) | 1.7 | 320,000 | 414,499 | 2044/9/20 |
| 第45回 | 利付国債(30年) | 1.5 | 355,000 | 443,845 | 2044/12/20 |
| 第46回 | 利付国債(30年) | 1.5 | 345,000 | 431,646 | 2045/3/20 |
| 第47回 | 利付国債(30年) | 1.6 | 330,000 | 421,182 | 2045/6/20 |
| 第48回 | 利付国債(30年) | 1.4 | 345,000 | 424,318 | 2045/9/20 |
| 第49回 | 利付国債(30年) | 1.4 | 355,000 | 437,349 | 2045/12/20 |
| 第50回 | 利付国債(30年) | 0.8 | 385,000 | 418,583 | 2046/3/20 |
| 第51回 | 利付国債(30年) | 0.3 | 405,000 | 390,825 | 2046/6/20 |
| 第52回 | 利付国債(30年) | 0.5 | 333,000 | 337,312 | 2046/9/20 |
| 第53回 | 利付国債(30年) | 0.6 | 247,000 | 256,400 | 2046/12/20 |
| 第54回 | 利付国債(30年) | 0.8 | 65,000 | 70,697 | 2047/3/20 |
| 第55回 | 利付国債(30年) | 0.8 | 425,000 | 462,004 | 2047/6/20 |
| 第56回 | 利付国債(30年) | 0.8 | 390,000 | 424,238 | 2047/9/20 |
| 第57回 | 利付国債(30年) | 0.8 | 505,000 | 549,020 | 2047/12/20 |
| 第58回 | 利付国債(30年) | 0.8 | 400,000 | 435,148 | 2048/3/20 |
| 第59回 | 利付国債(30年) | 0.7 | 400,000 | 424,920 | 2048/6/20 |
| 第60回 | 利付国債(30年) | 0.9 | 360,000 | 401,194 | 2048/9/20 |
| 第61回 | 利付国債(30年) | 0.7 | 345,000 | 366,369 | 2048/12/20 |
| 第62回 | 利付国債(30年) | 0.5 | 115,000 | 116,022 | 2049/3/20 |
| 第63回 | 利付国債(30年) | 0.4 | 380,000 | 372,719 | 2049/6/20 |
| 第64回 | 利付国債(30年) | 0.4 | 335,000 | 328,531 | 2049/9/20 |
| 第65回 | 利付国債(30年) | 0.4 | 295,000 | 289,262 | 2049/12/20 |
| 第66回 | 利付国債(30年) | 0.4 | 100,000 | 98,041 | 2050/3/20 |
| 第56回 | 利付国債(20年) | 2.0 | 818,000 | 855,022 | 2022/6/20 |
| 第59回 | 利付国債(20年) | 1.7 | 1,455,000 | 1,525,611 | 2022/12/20 |
| 第61回 | 利付国債(20年) | 1.0 | 1,215,000 | 1,255,581 | 2023/3/20 |
| 第64回 | 利付国債(20年) | 1.9 | 1,025,000 | 1,095,663 | 2023/9/20 |
| 第65回 | 利付国債(20年) | 1.9 | 1,020,000 | 1,095,439 | 2023/12/20 |
| 第69回 | 利付国債(20年) | 2.1 | 1,020,000 | 1,108,301 | 2024/3/20 |
| 第70回 | 利付国債(20年) | 2.4 | 780,000 | 861,416 | 2024/6/20 |
| 第72回 | 利付国債(20年) | 2.1 | 753,000 | 826,492 | 2024/9/20 |
| 第74回 | 利付国債(20年) | 2.1 | 664,000 | 732,405 | 2024/12/20 |
| 第75回 | 利付国債(20年) | 2.1 | 490,000 | 543,091 | 2025/3/20 |
| 第78回 | 利付国債(20年) | 1.9 | 590,000 | 651,271 | 2025/6/20 |
| 第82回 | 利付国債(20年) | 2.1 | 620,000 | 694,257 | 2025/9/20 |
| 第84回 | 利付国債(20年) | 2.0 | 850,000 | 951,838 | 2025/12/20 |

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85回 利付国債(20年) | 2.1 | 645,000 | 729,507 | 2026/3/20 |
| | 第88回 利付国債(20年) | 2.3 | 742,000 | 852,283 | 2026/6/20 |
| | 第89回 利付国債(20年) | 2.2 | 20,000 | 22,850 | 2026/6/20 |
| | 第90回 利付国債(20年) | 2.2 | 580,000 | 666,118 | 2026/9/20 |
| | 第92回 利付国債(20年) | 2.1 | 734,000 | 842,176 | 2026/12/20 |
| | 第93回 利付国債(20年) | 2.0 | 632,000 | 724,082 | 2027/3/20 |
| | 第95回 利付国債(20年) | 2.3 | 305,000 | 357,618 | 2027/6/20 |
| | 第97回 利付国債(20年) | 2.2 | 677,000 | 792,699 | 2027/9/20 |
| | 第99回 利付国債(20年) | 2.1 | 693,000 | 809,902 | 2027/12/20 |
| | 第100回 利付国債(20年) | 2.2 | 207,000 | 244,506 | 2028/3/20 |
| | 第101回 利付国債(20年) | 2.4 | 355,000 | 424,917 | 2028/3/20 |
| | 第102回 利付国債(20年) | 2.4 | 457,000 | 549,483 | 2028/6/20 |
| | 第105回 利付国債(20年) | 2.1 | 390,000 | 461,214 | 2028/9/20 |
| | 第106回 利付国債(20年) | 2.2 | 370,000 | 440,658 | 2028/9/20 |
| | 第107回 利付国債(20年) | 2.1 | 378,000 | 448,523 | 2028/12/20 |
| | 第108回 利付国債(20年) | 1.9 | 390,000 | 456,042 | 2028/12/20 |
| | 第109回 利付国債(20年) | 1.9 | 340,000 | 398,711 | 2029/3/20 |
| | 第111回 利付国債(20年) | 2.2 | 386,000 | 464,481 | 2029/6/20 |
| | 第113回 利付国債(20年) | 2.1 | 427,000 | 511,768 | 2029/9/20 |
| | 第114回 利付国債(20年) | 2.1 | 363,000 | 436,365 | 2029/12/20 |
| | 第116回 利付国債(20年) | 2.2 | 200,000 | 243,192 | 2030/3/20 |
| | 第118回 利付国債(20年) | 2.0 | 200,000 | 240,032 | 2030/6/20 |
| | 第119回 利付国債(20年) | 1.8 | 295,000 | 348,111 | 2030/6/20 |
| | 第120回 利付国債(20年) | 1.6 | 200,000 | 231,984 | 2030/6/20 |
| | 第121回 利付国債(20年) | 1.9 | 255,000 | 304,373 | 2030/9/20 |
| | 第122回 利付国債(20年) | 1.8 | 330,000 | 390,495 | 2030/9/20 |
| | 第123回 利付国債(20年) | 2.1 | 80,000 | 97,396 | 2030/12/20 |
| | 第124回 利付国債(20年) | 2.0 | 190,000 | 229,316 | 2030/12/20 |
| | 第125回 利付国債(20年) | 2.2 | 205,000 | 252,551 | 2031/3/20 |
| | 第126回 利付国債(20年) | 2.0 | 180,000 | 217,877 | 2031/3/20 |
| | 第127回 利付国債(20年) | 1.9 | 145,000 | 173,952 | 2031/3/20 |
| | 第128回 利付国債(20年) | 1.9 | 215,000 | 258,638 | 2031/6/20 |
| | 第129回 利付国債(20年) | 1.8 | 190,000 | 226,474 | 2031/6/20 |
| | 第130回 利付国債(20年) | 1.8 | 135,000 | 161,320 | 2031/9/20 |
| | 第131回 利付国債(20年) | 1.7 | 560,000 | 662,888 | 2031/9/20 |
| | 第132回 利付国債(20年) | 1.7 | 300,000 | 355,917 | 2031/12/20 |
| | 第133回 利付国債(20年) | 1.8 | 190,000 | 227,593 | 2031/12/20 |
| | 第134回 利付国債(20年) | 1.8 | 200,000 | 240,126 | 2032/3/20 |
| | 第135回 利付国債(20年) | 1.7 | 295,000 | 350,734 | 2032/3/20 |
| | 第136回 利付国債(20年) | 1.6 | 120,000 | 141,267 | 2032/3/20 |
| | 第137回 利付国債(20年) | 1.7 | 145,000 | 172,767 | 2032/6/20 |
| | 第138回 利付国債(20年) | 1.5 | 125,000 | 145,955 | 2032/6/20 |
| | 第139回 利付国債(20年) | 1.6 | 180,000 | 212,322 | 2032/6/20 |
| | 第140回 利付国債(20年) | 1.7 | 530,000 | 632,820 | 2032/9/20 |
| | 第141回 利付国債(20年) | 1.7 | 270,000 | 323,025 | 2032/12/20 |
| | 第142回 利付国債(20年) | 1.8 | 110,000 | 132,965 | 2032/12/20 |
| | 第143回 利付国債(20年) | 1.6 | 170,000 | 201,630 | 2033/3/20 |
| | 第144回 利付国債(20年) | 1.5 | 170,000 | 199,484 | 2033/3/20 |
| | 第145回 利付国債(20年) | 1.7 | 200,000 | 240,194 | 2033/6/20 |

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146回 利付国債(20年) | 1.7 | 85,000 | 102,272 | 2033/9/20 |
| | 第147回 利付国債(20年) | 1.6 | 400,000 | 476,816 | 2033/12/20 |
| | 第148回 利付国債(20年) | 1.5 | 229,000 | 270,295 | 2034/3/20 |
| | 第149回 利付国債(20年) | 1.5 | 695,000 | 821,434 | 2034/6/20 |
| | 第150回 利付国債(20年) | 1.4 | 401,000 | 468,969 | 2034/9/20 |
| | 第151回 利付国債(20年) | 1.2 | 730,000 | 833,937 | 2034/12/20 |
| | 第152回 利付国債(20年) | 1.2 | 335,000 | 382,928 | 2035/3/20 |
| | 第153回 利付国債(20年) | 1.3 | 277,000 | 321,098 | 2035/6/20 |
| | 第154回 利付国債(20年) | 1.2 | 720,000 | 824,572 | 2035/9/20 |
| | 第155回 利付国債(20年) | 1.0 | 330,000 | 368,194 | 2035/12/20 |
| | 第156回 利付国債(20年) | 0.4 | 380,000 | 388,968 | 2036/3/20 |
| | 第157回 利付国債(20年) | 0.2 | 375,000 | 371,816 | 2036/6/20 |
| | 第158回 利付国債(20年) | 0.5 | 480,000 | 498,033 | 2036/9/20 |
| | 第159回 利付国債(20年) | 0.6 | 448,000 | 471,820 | 2036/12/20 |
| | 第160回 利付国債(20年) | 0.7 | 335,000 | 358,171 | 2037/3/20 |
| | 第161回 利付国債(20年) | 0.6 | 610,000 | 641,793 | 2037/6/20 |
| | 第162回 利付国債(20年) | 0.6 | 180,000 | 189,201 | 2037/9/20 |
| | 第163回 利付国債(20年) | 0.6 | 720,000 | 756,676 | 2037/12/20 |
| | 第164回 利付国債(20年) | 0.5 | 215,000 | 222,084 | 2038/3/20 |
| | 第165回 利付国債(20年) | 0.5 | 570,000 | 588,525 | 2038/6/20 |
| | 第166回 利付国債(20年) | 0.7 | 335,000 | 357,337 | 2038/9/20 |
| | 第167回 利付国債(20年) | 0.5 | 500,000 | 515,320 | 2038/12/20 |
| | 第168回 利付国債(20年) | 0.4 | 190,000 | 192,356 | 2039/3/20 |
| | 第169回 利付国債(20年) | 0.3 | 630,000 | 626,043 | 2039/6/20 |
| | 第170回 利付国債(20年) | 0.3 | 325,000 | 322,640 | 2039/9/20 |
| | 第171回 利付国債(20年) | 0.3 | 545,000 | 540,999 | 2039/12/20 |
| | 小 計 | - | 99,765,000 | 110,576,999 | - |
| 地方債証券 | 第1回 東京都公募公債(20年) | 1.54 | 100,000 | 104,630 | 2023/6/20 |
| | 第1回 東京都公募公債(30年) | 2.21 | 100,000 | 124,498 | 2033/6/20 |
| | 第6回 東京都公募公債(20年) | 2.0 | 100,000 | 109,477 | 2025/3/19 |
| | 第8回 東京都公募公債(30年) | 2.23 | 400,000 | 527,332 | 2038/9/17 |
| | 第13回 東京都公募公債(30年) | 1.93 | 500,000 | 647,655 | 2042/3/19 |
| | 第688回 東京都公募公債 | 0.94 | 193,500 | 194,059 | 2020/9/18 |
| | 第705回 東京都公募公債 | 1.06 | 100,000 | 101,866 | 2022/3/18 |
| | 第710回 東京都公募公債 | 0.81 | 100,000 | 101,614 | 2022/6/20 |
| | 平成24年度第1回 北海道公募公債 | 0.99 | 100,000 | 101,786 | 2022/4/27 |
| | 平成24年度第14回 北海道公募公債 | 0.8 | 100,000 | 102,042 | 2023/2/28 |
| | 平成26年度第15回 北海道公募公債 | 0.434 | 100,000 | 101,776 | 2025/2/27 |
| | 平成29年度第6回 北海道公募公債(5年) | 0.01 | 300,000 | 299,673 | 2022/7/28 |
| | 第1回 神奈川県公募公債(20年) | 2.55 | 100,000 | 110,249 | 2024/6/20 |
| | 第3回 神奈川県公募公債(20年) | 2.11 | 100,000 | 110,311 | 2025/6/20 |
| | 第7回 神奈川県公募公債(20年) | 2.22 | 100,000 | 114,434 | 2027/3/19 |
| | 第342回 大阪府公募公債(10年) | 1.2 | 200,000 | 200,798 | 2020/9/29 |
| | 第361回 大阪府公募公債(10年) | 0.92 | 200,000 | 203,638 | 2022/6/28 |
| | 第373回 大阪府公募公債(10年) | 0.904 | 100,000 | 102,632 | 2023/6/27 |
| | 第377回 大阪府公募公債(10年) | 0.729 | 100,000 | 102,325 | 2023/10/30 |
| | 平成22年度第5回 京都府公募公債 | 1.26 | 110,000 | 110,777 | 2020/12/21 |
| | 平成27年度第4回 京都府公募公債 | 0.553 | 100,000 | 102,439 | 2025/6/19 |
| | 平成29年度第12回 京都府公募公債 | 0.04 | 300,000 | 300,084 | 2023/3/16 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|--------------------|-------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第5回 兵庫県公募公債(15年) | 1.31 | 300,000 | 328,437 | 2028/5/26 |
| | 第7回 静岡県公募公債(30年) | 1.988 | 100,000 | 131,595 | 2043/6/19 |
| | 平成20年度第1回 静岡県公募公債 | 2.18 | 100,000 | 111,187 | 2025/9/19 |
| | 平成22年度第12回 愛知県公募公債(10年) | 1.085 | 100,000 | 100,545 | 2020/11/30 |
| | 平成29年度第2回 埼玉県公募公債(5年) | 0.01 | 200,000 | 199,922 | 2022/4/19 |
| | 平成25年度第11回 福岡県公募公債 | 0.694 | 100,000 | 102,492 | 2024/2/26 |
| | 平成26年度第10回 福岡県公募公債 | 0.453 | 100,000 | 102,010 | 2025/2/26 |
| | 第9回 群馬県公募公債(10年) | 0.801 | 100,000 | 101,929 | 2022/11/25 |
| | 第111回 共同発行市場公募地方債 | 0.89 | 200,000 | 203,578 | 2022/6/24 |
| | 第112回 共同発行市場公募地方債 | 0.84 | 150,000 | 152,631 | 2022/7/25 |
| | 第113回 共同発行市場公募地方債 | 0.77 | 100,000 | 101,665 | 2022/8/25 |
| | 第114回 共同発行市場公募地方債 | 0.82 | 100,000 | 101,838 | 2022/9/22 |
| | 第118回 共同発行市場公募地方債 | 0.84 | 100,000 | 102,162 | 2023/1/25 |
| | 第137回 共同発行市場公募地方債 | 0.566 | 200,000 | 204,546 | 2024/8/23 |
| | 第172回 共同発行市場公募地方債 | 0.225 | 500,000 | 504,440 | 2027/7/23 |
| | 第1回 名古屋市公募公債(20年) | 1.99 | 200,000 | 213,984 | 2023/12/20 |
| | 第3回 名古屋市公募公債(20年) | 2.03 | 100,000 | 109,906 | 2025/6/20 |
| | 第1回 京都市公募公債(30年) | 2.57 | 100,000 | 136,075 | 2037/9/18 |
| | 第7回 京都市公募公債(20年) | 2.38 | 100,000 | 118,686 | 2028/9/21 |
| | 平成29年度第5回 京都市公募公債 | 0.04 | 100,000 | 100,028 | 2023/3/28 |
| | 平成26年度第17回 神戸市公募公債 | 0.28 | 100,000 | 101,167 | 2025/1/27 |
| | 第4回 横浜市公募公債(20年) | 2.03 | 100,000 | 109,621 | 2025/3/19 |
| | 第9回 横浜市公募公債(20年) | 2.35 | 100,000 | 113,643 | 2026/6/19 |
| | 第14回 横浜市公募公債(20年) | 2.32 | 100,000 | 117,212 | 2028/3/17 |
| | 第47回 横浜市公募公債(5年) | 0.04 | 100,000 | 100,026 | 2023/1/27 |
| | 平成26年度第4回 札幌市公募公債(10年) | 0.54 | 100,000 | 102,074 | 2024/6/20 |
| | 第4回 川崎市15年公募公債 | 2.11 | 100,000 | 103,269 | 2021/12/20 |
| | 平成24年度第2回 北九州市公募公債 | 0.715 | 100,000 | 101,693 | 2022/12/26 |
| | 平成23年度第9回 福岡市公募公債 | 1.01 | 147,000 | 149,648 | 2022/3/28 |
| | 平成29年度第11回 福岡市公募公債(5年) | 0.04 | 300,000 | 300,084 | 2023/3/16 |
| | 小 計 | — | 7,900,500 | 8,500,189 | — |
| 特 殊 債 券 (除く金融債) | 第3回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 1.82 | 11,365 | 11,568 | 2036/5/10 |
| | 第4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.29 | 13,623 | 14,172 | 2042/8/10 |
| | 第5回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 1.76 | 11,864 | 12,083 | 2036/11/10 |
| | 第7回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.0 | 15,123 | 15,831 | 2038/11/10 |
| | 第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.19 | 25,850 | 26,791 | 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 | 15,205 | 16,045 | 2039/5/10 |
| | 第10回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.15 | 39,954 | 41,418 | 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 | 15,110 | 15,901 | 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 | 16,186 | 17,137 | 2040/5/10 |
| | 第12回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.69 | 10,421 | 10,498 | 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 | 12,106 | 12,244 | 2032/5/10 |
| | 第17回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.71 | 29,466 | 30,048 | 2039/11/10 |
| | 第19回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.15 | 19,907 | 21,192 | 2043/11/10 |
| | 第24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.34 | 40,870 | 43,876 | 2044/5/10 |
| | 第26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.14 | 62,886 | 67,354 | 2044/7/10 |
| | 第27回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.05 | 22,917 | 24,563 | 2044/8/10 |
| | 第28回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.98 | 24,793 | 26,566 | 2044/9/10 |
| | 第29回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.81 | 12,607 | 12,950 | 2040/4/10 |

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29回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.95 | 27,450 | 29,547 | 2044/10/10 |
| 第30回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.97 | 27,175 | 29,254 | 2044/11/10 |
| 第32回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.69 | 14,048 | 14,486 | 2040/7/10 |
| 第32回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.82 | 53,588 | 57,211 | 2045/1/10 |
| 第35回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.79 | 14,750 | 15,323 | 2040/10/10 |
| 第35回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.87 | 28,785 | 30,661 | 2045/4/10 |
| 第36回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.81 | 28,700 | 30,433 | 2045/5/10 |
| 第39回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.84 | 13,240 | 13,696 | 2041/2/10 |
| 第41回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.09 | 14,491 | 15,159 | 2041/4/10 |
| 第43回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.28 | 27,302 | 28,652 | 2041/6/10 |
| 第43回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.6 | 38,321 | 40,698 | 2045/12/10 |
| 第46回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.85 | 31,749 | 33,831 | 2046/3/10 |
| 第48回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.89 | 59,490 | 63,310 | 2046/5/10 |
| 第49回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.76 | 29,589 | 31,407 | 2046/6/10 |
| 第51回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.21 | 13,057 | 13,576 | 2042/2/10 |
| 第51回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.64 | 65,648 | 69,550 | 2046/8/10 |
| 第52回 | 一般担保住宅金融支援機構債券 | 2.01 | 100,000 | 118,291 | 2030/7/16 |
| 第53回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.09 | 13,802 | 14,418 | 2042/4/10 |
| 第55回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.41 | 86,438 | 91,429 | 2046/12/10 |
| 第57回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 41,066 | 43,466 | 2047/2/10 |
| 第58回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.4 | 43,712 | 46,241 | 2047/3/10 |
| 第59回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 84,180 | 89,105 | 2047/4/10 |
| 第60回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.34 | 131,487 | 138,713 | 2047/5/10 |
| 第61回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.26 | 42,453 | 44,627 | 2047/6/10 |
| 第67回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.09 | 48,286 | 50,469 | 2047/12/10 |
| 第69回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.28 | 97,814 | 103,193 | 2048/2/10 |
| 第70回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.25 | 85,748 | 90,109 | 2048/3/10 |
| 第73回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.3 | 48,352 | 51,048 | 2048/6/10 |
| 第95回 | 一般担保住宅金融支援機構債券 | 1.065 | 100,000 | 101,894 | 2022/3/18 |
| 第99回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.88 | 71,319 | 73,984 | 2050/8/10 |
| 第123回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 88,681 | 89,912 | 2052/8/10 |
| 第124回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 88,436 | 89,420 | 2052/9/10 |
| 第125回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 88,850 | 89,835 | 2052/10/10 |
| 第127回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4 | 89,957 | 90,816 | 2052/12/10 |
| 第128回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 89,468 | 90,451 | 2053/1/10 |
| 第129回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 90,492 | 91,725 | 2053/2/10 |
| 第130回 | 一般担保住宅金融支援機構債券 | 1.763 | 200,000 | 236,884 | 2032/12/20 |
| 第137回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.47 | 93,640 | 94,985 | 2053/10/10 |
| 第1回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 25,890 | 26,686 | 2042/5/10 |
| 第2回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.19 | 28,654 | 29,969 | 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 | 14,119 | 14,741 | 2037/11/10 |
| 第6回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 13,641 | 14,151 | 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 | 29,398 | 30,784 | 2038/11/10 |
| 第9回 | 道路債券 | 2.9 | 100,000 | 131,303 | 2032/5/20 |
| 第18回 | 政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 0.001 | 800,000 | 799,768 | 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 | 303,906 | 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 | 202,536 | 2021/8/13 |
| 第42回 | 地方公共団体金融機構債券 | 0.801 | 100,000 | 101,935 | 2022/11/28 |
| 第45回 | 地方公共団体金融機構債券 | 0.791 | 200,000 | 204,204 | 2023/2/28 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-------------------------|-----------------------------|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第61回 地方公共団体金融機構債券 | 0.69 | 100,000 | 102,614 | 2024/6/28 |
| | 第63回 地方公共団体金融機構債券 | 0.581 | 100,000 | 102,257 | 2024/8/28 |
| | 第67回 政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.466 | 100,000 | 102,052 | 2024/12/13 |
| | 第51回 政府保証関西国際空港債券 | 2.1 | 100,000 | 104,728 | 2022/8/31 |
| | 第3回 政府保証日本政策投資銀行社債 | 2.1 | 200,000 | 214,860 | 2023/12/18 |
| | 第15回 政府保証日本政策投資銀行債券 | 2.0 | 100,000 | 103,221 | 2021/12/22 |
| | 第27回 政府保証日本政策投資銀行社債 | 0.11 | 100,000 | 100,107 | 2021/2/12 |
| | 第34回 政府保証日本政策投資銀行社債 | 0.001 | 300,000 | 299,910 | 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 | 303,264 | 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 | 101,620 | 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 | 236,604 | 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 | 135,303 | 2039/8/31 |
| | 第90回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.1 | 300,000 | 356,730 | 2029/9/28 |
| | 第99回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.2 | 100,000 | 120,383 | 2030/1/31 |
| | 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 | 100,406 | 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 | 1,013,620 | 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 | 101,488 | 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 | 305,454 | 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 | 204,600 | 2029/9/30 |
| | 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 | 306,498 | 2024/11/29 |
| | 第209回 政府保証預金保険機構債 | 0.1 | 600,000 | 600,456 | 2020/12/11 |
| | 第20回 西日本高速道路社債 | 0.759 | 100,000 | 102,352 | 2023/9/20 |
| | 第342回 東京交通債券 | 2.4 | 100,000 | 104,858 | 2022/6/21 |
| | 第36回 日本政策投資銀行債券 | 2.23 | 100,000 | 114,668 | 2027/5/28 |
| | 第18回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.87 | 100,000 | 155,558 | 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 | 452,658 | 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 | 239,942 | 2029/4/20 |
| | 第2回 地方公営企業等金融機構債券(20年) | 2.29 | 100,000 | 118,955 | 2029/4/27 |
| | 第3回 公営企業債券(20年) | 1.03 | 100,000 | 102,822 | 2023/3/22 |
| | 第5回 公営企業債券(20年) | 2.11 | 100,000 | 106,889 | 2023/9/20 |
| | 第17回 公営企業債券(20年) | 2.39 | 100,000 | 113,342 | 2026/3/24 |
| | 第22回 公営企業債券(20年) | 2.32 | 100,000 | 115,418 | 2027/6/18 |
| | 第24回 公営企業債券(20年) | 2.29 | 200,000 | 233,868 | 2028/4/25 |
| | 第62回 地方公共団体金融機構債券 | 0.631 | 400,000 | 409,672 | 2024/7/26 |
| | 第15回 首都高速道路社債 | 0.21 | 100,000 | 100,057 | 2020/9/18 |
| | 第12回 国際協力機構債券 | 0.901 | 100,000 | 101,803 | 2022/6/20 |
| | 第35回 東日本高速道路 | 0.1 | 200,000 | 200,120 | 2021/3/19 |
| | 第45回 中日本高速道路 | 0.904 | 100,000 | 102,005 | 2022/9/20 |
| | 第23回 西日本高速道路 | 0.602 | 100,000 | 102,201 | 2024/6/20 |
| | 小 計 | - | 11,923,519 | 12,721,420 | - |
| 金 融 債 券 | い第810号 農林債 | 0.1 | 300,000 | 300,261 | 2022/11/25 |
| 普 通 社 債 券 (含む投資法人債券) | 第547回 東京電力 | 1.948 | 100,000 | 100,279 | 2020/7/24 |
| | 第507回 中部電力 | 0.605 | 100,000 | 101,926 | 2026/1/23 |
| | 第512回 関西電力 | 0.32 | 100,000 | 100,261 | 2024/10/25 |
| | 第527回 関西電力 | 0.28 | 100,000 | 100,232 | 2024/4/25 |
| | 第308回 北陸電力 | 0.769 | 100,000 | 102,402 | 2024/9/25 |
| | 第471回 東北電力 | 1.168 | 100,000 | 103,554 | 2023/12/25 |
| | 第472回 東北電力 | 0.954 | 100,000 | 102,882 | 2024/2/23 |
| | 第508回 東北電力 | 0.465 | 200,000 | 200,598 | 2029/4/25 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|---------------------------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償還年月日 |
| | 第253回 四国電力 | 1.0 | 100,000 | 102,681 | 2023/6/23 |
| | 第328回 北海道電力 | 0.42 | 100,000 | 100,638 | 2023/1/25 |
| | 第13回 大和ハウス工業 | 0.285 | 100,000 | 99,309 | 2027/6/1 |
| | 第30回 東レ | 0.375 | 100,000 | 99,617 | 2027/7/16 |
| | 第7回 クラレ | 0.19 | 100,000 | 99,418 | 2025/4/25 |
| | 第56回 住友化学 | 0.38 | 200,000 | 199,556 | 2027/9/13 |
| | 第24回 三菱ケミカルホールディングス | 0.37 | 100,000 | 99,725 | 2028/2/25 |
| | 第13回 プリチストン | 0.23 | 100,000 | 99,418 | 2026/4/17 |
| | 第3回 新日鐵住金 | 0.22 | 100,000 | 99,905 | 2024/5/20 |
| | 第8回 ジェイテクト | 0.25 | 100,000 | 99,717 | 2025/3/7 |
| | 第16回 日立製作所 | 0.813 | 100,000 | 102,141 | 2023/12/13 |
| | 第63回 三井物産 | 2.37 | 100,000 | 113,368 | 2027/4/23 |
| | 第47回 住友商事 | 0.858 | 100,000 | 101,961 | 2023/10/23 |
| | 第69回 クレディセゾン | 0.18 | 100,000 | 99,628 | 2023/6/19 |
| | 第8回 みずほコーポレート銀行 | 2.54 | 100,000 | 114,837 | 2027/7/27 |
| | 第25回 三菱東京UFJ銀行 | 1.31 | 300,000 | 301,329 | 2020/11/12 |
| | 第1回 三井住友フィナンシャル | 0.849 | 100,000 | 100,415 | 2024/9/12 |
| | 第9回 三菱UFJ信託銀行 | 1.68 | 100,000 | 101,266 | 2021/4/28 |
| | 第8回 住友信託銀行 | 2.49 | 100,000 | 111,614 | 2027/5/10 |
| | 第1回 みずほフィナンシャルグループ | 0.95 | 100,000 | 100,766 | 2024/7/16 |
| | 第24回 三井住友銀行 | 1.6 | 100,000 | 101,369 | 2021/6/1 |
| | 第9回 みずほ銀行 | 2.52 | 100,000 | 111,718 | 2027/4/27 |
| | 第54回 トヨタファイナンス | 0.508 | 100,000 | 100,024 | 2020/6/19 |
| | 第1回 野村ホールディングス | 0.3 | 100,000 | 99,748 | 2023/9/4 |
| | 第58回 三菱地所 | 2.9 | 100,000 | 127,165 | 2032/5/20 |
| | 第38回 京王電鉄 | 0.295 | 100,000 | 99,843 | 2027/11/29 |
| | 第15回 東日本旅客鉄道 | 2.65 | 100,000 | 100,658 | 2020/8/25 |
| | 第110回 東日本旅客鉄道 | 1.76 | 100,000 | 123,727 | 2045/7/28 |
| | 第41回 東海旅客鉄道 | 2.166 | 100,000 | 116,089 | 2029/1/29 |
| | 第42回 東海旅客鉄道 | 2.312 | 100,000 | 117,731 | 2029/4/24 |
| | 第27回 KDDI | 0.23 | 100,000 | 99,071 | 2026/4/24 |
| | 第11回 電源開発 | 2.05 | 100,000 | 108,465 | 2025/3/19 |
| | 第24回 東京電力パワーグリッド | 0.61 | 200,000 | 202,172 | 2024/4/24 |
| | 第4回 ファーストリテイリング | 0.749 | 100,000 | 102,289 | 2025/12/18 |
| | 第7回 ファーストリテイリング | 0.405 | 100,000 | 99,753 | 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 | 198,934 | 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 | 199,980 | 2021/1/22 |
| | 小 計 | — | 5,200,000 | 5,368,179 | — |
| | 合 計 | — | 125,089,019 | 137,467,050 | — |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2020年5月25日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 137,467,050 | 99.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 902,682 | 0.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 138,369,732 | 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

(2020年5月25日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|--------------------------------|-------------------------|
| (A) 資 産 | 138,369,732,121円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 519,073,025 |
| 公 社 債 (評 価 額) | 137,467,050,204 |
| 未 収 利 息 | 371,121,323 |
| 前 払 費 用 | 12,487,569 |
| (B) 負 債 | 430,338,088 |
| 未 払 金 | 356,097,800 |
| 未 払 解 約 金 | 74,215,615 |
| 未 払 利 息 | 1,511 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 23,162 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 137,939,394,033 |
| 元 本 | 107,378,343,953 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 30,561,050,080 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 107,378,343,953口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 12,846円 |

※当期における期首元本額128,728,886,975円、期中追加設定元本額30,830,879,698円、期中一部解約元本額52,181,422,720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2019年5月28日 至2020年5月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------------|-------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 1,497,490,837円 |
| 受 取 利 息 | 1,498,017,323 |
| 支 払 利 息 | △ 526,486 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 1,278,904,515 |
| 売 買 益 | 477,408,410 |
| 売 買 損 | △ 1,756,312,925 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 514,105 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 218,072,217 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 36,820,110,383 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 9,053,574,436 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △ 15,530,706,956 |
| (H) 計 (D + E + F + G) | 30,561,050,080 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 30,561,050,080 |

※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) | 5,046,916,704円 | SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 15,866,650,322円 |
| 三井住友・DC年金バランス50 (標準型) | 8,539,975,518円 | SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 314,024,049円 |
| 三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型) | 1,813,599,427円 | SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 540,260,899円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型) | 687,551,639円 | 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 1,785,962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) | 45,770,116円 | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 233,792,190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) | 170,968,659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> | 107,027,307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) | 351,054,288円 | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 1,881,069,406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) | 362,283,069円 | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 1,967,867,759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) | 143,207,058円 | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 2,476,778,519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) | 257,972,136円 | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 9,184,997,370円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ (債券型) | 122,577,956円 | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 2,169,320円 |
| アセットアロケーション・ファンド (安定型) | 3,587,688,135円 | 三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用) | 1,349,806,663円 |
| アセットアロケーション・ファンド (安定成長型) | 1,332,579,445円 | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 458,164,223円 |
| アセットアロケーション・ファンド (成長型) | 618,268,109円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 622,144,119円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 15,591,079円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 173,295,639円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型) | 1,217,957,665円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 42,741,114円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型) | 383,127,858円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 1,741,600,075円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型) | 539,212,680円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 2,263,783,029円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型) | 94,046,768円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 883,259,850円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型) | 7,992,067円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 200,166,752円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 49,693,659円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 17,824,367円 |
| 三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型) | 4,767,335円 | SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 299,712,439円 |
| 三井住友DS・年金バランス50 (標準型) | 13,319,729円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 5,568,724,251円 |
| 三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型) | 3,058,101円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 257,779,674円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,727,191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> | 403,843,344円 |
| SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 5,903,494,951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> | 1,157,916,046円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 15,299,917,326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> | 1,411,037,976円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 6,548,994,028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> | 4,785,808,593円 |

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

第17期 (2019年8月27日から2020年8月25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 | | |
| 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 |
| 17期(2020年8月25日) | 15,423 | 3.6 | 428.86 | 3.6 | 98.4 | 23,201 |

※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2020年8月25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) 2019年8月26日 | 14,894 | — | 414.04 | — | 94.6 |
| 8月末 | 14,972 | 0.5 | 416.34 | 0.6 | 95.8 |
| 9月末 | 14,869 | △0.2 | 413.28 | △0.2 | 99.9 |
| 10月末 | 14,691 | △1.4 | 408.17 | △1.4 | 100.5 |
| 11月末 | 14,687 | △1.4 | 407.93 | △1.5 | 99.8 |
| 12月末 | 14,601 | △2.0 | 405.42 | △2.1 | 98.3 |
| 2020年1月末 | 14,862 | △0.2 | 412.91 | △0.3 | 97.7 |
| 2月末 | 15,037 | 1.0 | 417.52 | 0.8 | 98.4 |
| 3月末 | 15,253 | 2.4 | 423.40 | 2.3 | 98.3 |
| 4月末 | 15,260 | 2.5 | 423.84 | 2.4 | 96.6 |
| 5月末 | 15,245 | 2.4 | 423.57 | 2.3 | 99.3 |
| 6月末 | 15,351 | 3.1 | 426.81 | 3.1 | 99.2 |
| 7月末 | 15,502 | 4.1 | 431.07 | 4.1 | 98.7 |
| (期末) 2020年8月25日 | 15,423 | 3.6 | 428.86 | 3.6 | 98.4 |

※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8月27日から2020年8月25日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 14,894円 |
| 期末 | 15,423円 |
| 騰落率 | +3.6% |

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、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（2019年8月27日から2020年8月25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）の動き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 | ・米国やカナダなどの国債利回りが大幅に低下（価格は上昇）したこと |
| 下落要因 | ・ドイツやフランスなど、ほとんどのユーロ圏諸国の国債利回りが上昇（価格は下落）したこと |

▶ 投資環境について（2019年8月27日から2020年8月25日まで）

米国やカナダなど多くの国の長期金利が低下した一方で、ドイツやフランスなどほとんどのユーロ圏諸国の長期金利は上昇しました。

米国では、期初から年末にかけて、底堅い経済指標や米中通商協議の進展などを背景に、金利は緩やかに上昇しました。2020年1月から3月にかけては、新型コロナウイルスの感染が世界的に拡がりをみせる中で、世界的な株価の急落やF R B（米連邦準備制度理事会）の緊急利下げなどを受けて、金利は大幅に低下しました。4月から期末にかけては、財政支出拡大による国債増発懸念や感染拡大ペースの鈍化を背景に、金利に上昇圧力がかかる局面もありました。しかし、6月以降は感染再拡大のリスクが警戒されたことや、F R Bが緩和的な金融政策を継続するとの見方から、金利はもみ合いで推移しました。

欧州では、期初から年末にかけては、英国のE U（欧州連合）離脱に道筋がついた（英国は1月31日にE Uを離脱しました）ことや景気底入れ期待から、金利は上昇しました。1月から3月上旬にかけては、新型コロナウイルスの感染が欧州でも拡大したことなどから、金利は低下しました。3月中旬には、世界的な資産売却の動きや大規模な財政支援策への思惑から、金利が急上昇するなど乱高下しました。その後、E C B（欧州中央銀行）が大規模な追加資産購入策を決定すると、次第に落ち着きを取り戻す動きとなりました。5月以降は、感染拡大ペースの鈍化を受けた経済活動の再開や欧州復興基金の設立合意に向けた動き（7月に合意されました）が金利上昇圧力となった一方で、E C Bの積極的な金融緩和策が金利上昇を抑制し、期末にかけてもみ合いが続きしました。

当期の市場の動きを米国10年国債でみると、期首1.54%から期末0.65%へと大きく低下しました。欧州の動きをドイツ10年国債でみると、期首-0.68%から期末-0.49%へと上昇しました。

▶ ポートフォリオについて（2019年8月27日から2020年8月25日まで）

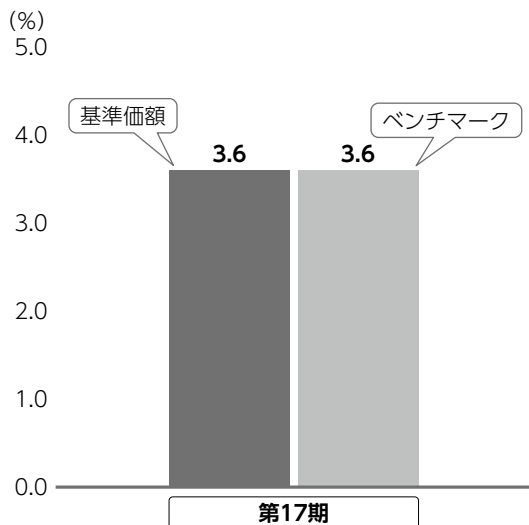
債券組入比率

F T S E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（2019年8月27日から2020年8月25日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



当ファンドはF T S E 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。

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+3.6%となり、ベンチマークの騰落率+3.6%を追随しました。

2 今後の運用方針

新型コロナウイルスの感染再拡大のリスクが警戒されるなか、グローバル景気の先行きに対する不透明感が継続する見込みです。米国では感染再拡大に歯止めがかかり始めた可能性があるものの、今後も再拡大に警戒しながら経済活動を進める必要があり、景気回復ペースは上がりにくいと予想しています。財政拡張による国債増発懸念がくすぶるものの、金融政策面ではF R Bによる米国債等の買入れが継続されていることなどから、長期金利は低位での推移が続くと予想します。

ユーロ圏では、欧州復興基金設立で合意に至りましたが、欧州各国において感染再拡大のリスクが高まっており、経済活動再開への足取りは慎重なものになるとみられます。また、E C Bの国債買入れ策も継続的に実施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。

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 (2019年8月27日から2020年8月25日まで)

| 項 目 | 金 額 | 比 率 | 項 目 の 概 要 |
|-------------|-----|---------|--|
| (a) その他費用 | 8円 | 0.053% | 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 |
| (保 管 費 用) | (8) | (0.052) | |
| (そ の 他) | (0) | (0.001) | |
| 合 計 | 8 | 0.053 | |

期中の平均基準価額は15,027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8月27日から2020年8月25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 56,060 | 千米ドル 85,275 |
| | カ ナ ダ | 国 債 証 券 | 千カナダドル 3,411 | 千カナダドル 4,462 |
| | メ キ シ コ | 国 債 証 券 | 千メキシコペソ 16,894 | 千メキシコペソ 20,731 |
| | ユ ー ロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | ド イ ツ | 国 債 証 券 | 10,735 | 7,653 |
| | イ タ リ ア | 国 債 証 券 | 8,577 | 11,175 |
| | フ ラ ン ス | 国 債 証 券 | 10,583 | 13,205 |
| | オ ラ ン ダ | 国 債 証 券 | 2,656 | 4,023 |
| | ス ベ イ ン | 国 債 証 券 | 6,880 | 10,615 |
| | ベ ル ギ ー | 国 債 証 券 | 2,943 | 2,941 |
| | オ ー ス ト リ ア | 国 債 証 券 | 1,531 | 2,022 |
| | フィンランド | 国 債 証 券 | 550 | 571 |
| | アイルランド | 国 債 証 券 | 507 | 1,083 |
| | イ ギ リ ス | 国 債 証 券 | 千英ポンド 5,845 | 千英ポンド 7,910 |
| | 国 | ス ウ ェ ー デ ン | 国 債 証 券 | 千スウェーデンクローナ 3,041 |
| ノ ル ウ ェ ー | | 国 債 証 券 | 千ノルウェークローネ 2,570 | 千ノルウェークローネ 3,238 |
| デ ン マ ー ク | | 国 債 証 券 | 千デンマーククローネ 3,110 | 千デンマーククローネ 4,272 |
| ポ ー ラ ン ド | | 国 債 証 券 | 千ポーランドズロチ 2,448 | 千ポーランドズロチ 3,330 |
| オ ー ス ト ラ リ ア | | 国 債 証 券 | 千オーストラリアドル 5,039 | 千オーストラリアドル 5,095 |
| シ ン ガ ポ ー ル | | 国 債 証 券 | 千シンガポールドル 1,288 | 千シンガポールドル 1,647 |
| イ ス ラ エ ル | | 国 債 証 券 | 千イスラエルシュケル 3,398 | 千イスラエルシュケル 526 |
| 南 ア フ リ カ | | 国 債 証 券 | 千南アフリカランド 5,347 | 千南アフリカランド 22,729 |

※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 (2019年8月27日から2020年8月25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8月27日から2020年8月25日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2020年8月25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 | | 組入比率 | うちBB格 以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | | | |
|---------------|----------------------|----------------------|------------------|-----------------|-----------|------|------|--------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 | |
| | | 外貨建金額 | | | | | | 邦貨換算金額 |
| ア メ リ カ | 千米ドル 85,100 | 千米ドル 95,285 | 千円 10,101,237 | 43.5 | — | 18.8 | 16.9 | 7.8 |
| カ ナ ダ | 千カナダドル 4,740 | 千カナダドル 5,430 | 434,931 | 1.9 | — | 0.9 | 0.6 | 0.4 |
| メ キ シ コ | 千メキシコペソ 32,100 | 千メキシコペソ 35,527 | 171,242 | 0.7 | — | 0.5 | 0.2 | 0.1 |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ド イ ツ | 11,120 | 13,777 | 1,723,026 | 7.4 | — | 4.5 | 2.0 | 0.9 |
| イ タ リ ア | 14,930 | 17,414 | 2,177,893 | 9.4 | — | 5.5 | 2.8 | 1.0 |
| フ ラ ン ス | 15,580 | 19,101 | 2,388,832 | 10.3 | — | 7.1 | 2.2 | 0.9 |
| オ ラ ン ダ | 2,710 | 3,399 | 425,138 | 1.8 | — | 1.2 | 0.5 | 0.2 |
| ス ペ イ ン | 9,210 | 11,157 | 1,395,383 | 6.0 | — | 4.0 | 1.7 | 0.4 |
| ベ ル ギ ー | 3,640 | 4,531 | 566,698 | 2.4 | — | 1.9 | 0.3 | 0.2 |
| オ ー ス ト リ ア | 2,500 | 3,160 | 395,244 | 1.7 | — | 1.3 | 0.2 | 0.2 |
| フ ィ ン ラ ン ド | 1,070 | 1,234 | 154,324 | 0.7 | — | 0.4 | 0.3 | — |
| ア イ ル ラ ン ド | 1,300 | 1,535 | 192,062 | 0.8 | — | 0.5 | 0.3 | 0.1 |
| イ ギ リ ス | 千英ポンド 7,800 | 千英ポンド 10,724 | 1,486,698 | 6.4 | — | 4.9 | 1.0 | 0.4 |
| ス ウ ェ ー デ ン | 千スウェーデンクローナ 4,920 | 千スウェーデンクローナ 5,610 | 67,715 | 0.3 | — | 0.1 | 0.1 | 0.1 |
| ノ ル ウ ェ ー | 千ノルウェークローネ 4,230 | 千ノルウェークローネ 4,544 | 53,583 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| デ ン マ ー ク | 千デンマーククローネ 5,610 | 千デンマーククローネ 7,199 | 120,953 | 0.5 | — | 0.4 | 0.1 | 0.1 |
| ポ ー ラ ン ド | 千ポーランドズロチ 4,350 | 千ポーランドズロチ 4,775 | 135,781 | 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 6,120 | 千オーストラリアドル 7,000 | 532,674 | 2.3 | — | 1.6 | 0.6 | 0.1 |
| シ ン ガ ポ ー ル | 千シンガポールドル 2,400 | 千シンガポールドル 2,736 | 211,830 | 0.9 | — | 0.5 | 0.3 | 0.1 |
| イ ス ラ エ ル | 千イスラエルシェケル 2,450 | 千イスラエルシェケル 2,875 | 89,527 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| 合 計 | — | — | 22,824,785 | 98.4 | — | 54.7 | 30.4 | 13.2 |

※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 0.125 | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | 2023/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 0.125 | 900 | 898 | 95,274 | 2025/5/31 |
| | | US TREASURY N/B 0.375 | 0.25 | 100 | 99 | 10,590 | 2025/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 0.5 | 0.375 | 900 | 904 | 95,878 | 2027/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 0.5 | 0.5 | 700 | 702 | 74,491 | 2027/6/30 |
| | | US TREASURY N/B 0.625 | 0.5 | 460 | 461 | 48,909 | 2027/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 0.625 | 0.625 | 300 | 303 | 32,195 | 2030/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | 0.625 | 820 | 819 | 86,860 | 2021/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | 1.125 | 400 | 404 | 42,841 | 2040/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.25 | 1.125 | 190 | 190 | 20,211 | 2021/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.25 | 1.25 | 200 | 202 | 21,475 | 2024/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.25 | 1.25 | 350 | 364 | 38,610 | 2050/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.25 | 1.25 | 260 | 253 | 26,882 | 2022/10/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | 1.375 | 1,000 | 1,025 | 108,743 | 2023/6/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | 1.375 | 950 | 982 | 104,155 | 2023/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | 1.375 | 200 | 207 | 21,968 | 2023/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | 1.375 | 300 | 311 | 32,970 | 2026/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | 1.375 | 240 | 254 | 26,949 | 2021/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | 1.5 | 550 | 558 | 59,166 | 2022/1/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | 1.5 | 600 | 611 | 64,808 | 2022/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | 1.5 | 280 | 287 | 30,461 | 2023/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | 1.5 | 1,200 | 1,241 | 131,584 | 2024/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | 1.5 | 450 | 473 | 50,246 | 2026/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | 1.5 | 550 | 586 | 62,177 | 2027/1/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | 1.5 | 230 | 245 | 26,060 | 2030/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | 1.5 | 590 | 638 | 67,671 | 2022/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 250 | 257 | 27,268 | 2022/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 1,300 | 1,342 | 142,281 | 2022/12/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 800 | 826 | 87,663 | 2023/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 1,000 | 1,038 | 110,126 | 2023/5/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 1,000 | 1,040 | 110,266 | 2023/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 800 | 836 | 88,703 | 2026/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 600 | 642 | 68,078 | 2026/5/15 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 650 | 696 | 73,875 | 2026/9/30 | | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 700 | 752 | 79,749 | 2026/11/30 | | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 500 | 537 | 57,017 | 2029/8/15 | | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 680 | 742 | 78,681 | 2022/2/28 | | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 1.75 | 200 | 204 | 21,712 | 2022/5/15 | | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 1.75 | 600 | 616 | 65,345 | 2022/5/31 | | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 1.75 | 300 | 308 | 32,692 | | | |

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 1.75 | 1.75 | 350 | 361 | 38,335 | 2022/9/30 | |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | 1.75 | 1,000 | 1,038 | 110,076 | 2023/1/31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | 1.75 | 700 | 730 | 77,389 | 2023/5/15 | |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | 1.75 | 300 | 331 | 35,122 | 2029/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | 1.875 | 600 | 612 | 64,957 | 2021/11/30 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | 1.875 | 700 | 716 | 75,998 | 2022/1/31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | 1.875 | 500 | 512 | 54,363 | 2022/2/28 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | 1.875 | 300 | 308 | 32,670 | 2022/3/31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | 1.875 | 1,000 | 1,028 | 109,057 | 2022/4/30 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | 1.875 | 1,000 | 1,034 | 109,654 | 2022/8/31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | 1.875 | 300 | 319 | 33,897 | 2024/8/31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | 1.875 | 600 | 652 | 69,186 | 2026/6/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 800 | 815 | 86,404 | 2021/8/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 250 | 255 | 27,073 | 2021/10/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 1,000 | 1,022 | 108,403 | 2021/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 700 | 717 | 76,038 | 2021/12/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 600 | 616 | 65,325 | 2022/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 700 | 724 | 76,833 | 2022/7/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 600 | 623 | 66,145 | 2022/10/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 1,000 | 1,044 | 110,763 | 2023/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 200 | 213 | 22,604 | 2024/4/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 500 | 533 | 56,557 | 2024/5/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 600 | 640 | 67,944 | 2024/6/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 600 | 650 | 68,962 | 2025/8/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 300 | 329 | 34,918 | 2026/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | 2.0 | 600 | 696 | 73,847 | 2050/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 400 | 408 | 43,318 | 2021/9/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 750 | 769 | 81,588 | 2021/12/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 800 | 828 | 87,869 | 2022/6/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 430 | 449 | 47,678 | 2022/12/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 1,100 | 1,174 | 124,464 | 2024/2/29 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 800 | 854 | 90,631 | 2024/3/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 700 | 752 | 79,743 | 2024/7/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 750 | 807 | 85,644 | 2024/9/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 500 | 540 | 57,257 | 2024/11/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 320 | 352 | 37,365 | 2026/5/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | 2.25 | 550 | 587 | 62,295 | 2023/12/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | 2.25 | 1,000 | 1,070 | 113,472 | 2024/1/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | 2.25 | 800 | 867 | 91,910 | 2024/10/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | 2.25 | 900 | 976 | 103,466 | 2024/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | 2.25 | 500 | 543 | 57,609 | 2024/12/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | 2.25 | 720 | 792 | 84,007 | 2025/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | 2.25 | 450 | 502 | 53,265 | 2027/2/15 | |

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 2.25 | 2.25 | 570 | 639 | 67,837 | 2027/8/15 |
| | US TREASURY N/B 2.25 | 2.25 | 700 | 787 | 83,523 | 2027/11/15 |
| | US TREASURY N/B 2.25 | 2.25 | 300 | 360 | 38,267 | 2046/8/15 |
| | US TREASURY N/B 2.25 | 2.25 | 600 | 731 | 77,539 | 2049/8/15 |
| | US TREASURY N/B 2.375 | 2.375 | 400 | 413 | 43,858 | 2022/3/15 |
| | US TREASURY N/B 2.375 | 2.375 | 1,000 | 1,085 | 115,045 | 2024/8/15 |
| | US TREASURY N/B 2.375 | 2.375 | 750 | 845 | 89,681 | 2027/5/15 |
| | US TREASURY N/B 2.375 | 2.375 | 800 | 922 | 97,833 | 2029/5/15 |
| | US TREASURY N/B 2.375 | 2.375 | 500 | 625 | 66,351 | 2049/11/15 |
| | US TREASURY N/B 2.5 | 2.5 | 250 | 258 | 27,357 | 2022/1/15 |
| | US TREASURY N/B 2.5 | 2.5 | 300 | 320 | 33,989 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY N/B 2.5 | 2.5 | 830 | 900 | 95,494 | 2024/5/15 |
| | US TREASURY N/B 2.5 | 2.5 | 700 | 769 | 81,558 | 2025/1/31 |
| | US TREASURY N/B 2.5 | 2.5 | 900 | 1,007 | 106,753 | 2026/2/28 |
| | US TREASURY N/B 2.5 | 2.5 | 190 | 237 | 25,202 | 2045/2/15 |
| | US TREASURY N/B 2.5 | 2.5 | 500 | 628 | 66,583 | 2046/2/15 |
| | US TREASURY N/B 2.5 | 2.5 | 200 | 251 | 26,674 | 2046/5/15 |
| | US TREASURY N/B 2.625 | 2.625 | 400 | 412 | 43,772 | 2021/12/15 |
| | US TREASURY N/B 2.625 | 2.625 | 500 | 554 | 58,744 | 2025/3/31 |
| | US TREASURY N/B 2.625 | 2.625 | 430 | 483 | 51,246 | 2026/1/31 |
| | US TREASURY N/B 2.625 | 2.625 | 350 | 409 | 43,445 | 2029/2/15 |
| | US TREASURY N/B 2.75 | 2.75 | 850 | 873 | 92,565 | 2021/9/15 |
| | US TREASURY N/B 2.75 | 2.75 | 900 | 967 | 102,587 | 2023/7/31 |
| | US TREASURY N/B 2.75 | 2.75 | 900 | 974 | 103,287 | 2023/11/15 |
| | US TREASURY N/B 2.75 | 2.75 | 500 | 556 | 58,959 | 2025/2/28 |
| | US TREASURY N/B 2.75 | 2.75 | 600 | 671 | 71,184 | 2025/6/30 |
| | US TREASURY N/B 2.75 | 2.75 | 600 | 673 | 71,422 | 2025/8/31 |
| | US TREASURY N/B 2.75 | 2.75 | 850 | 990 | 104,983 | 2028/2/15 |
| | US TREASURY N/B 2.75 | 2.75 | 400 | 519 | 55,065 | 2042/11/15 |
| | US TREASURY N/B 2.75 | 2.75 | 300 | 397 | 42,119 | 2047/8/15 |
| | US TREASURY N/B 2.75 | 2.75 | 300 | 397 | 42,188 | 2047/11/15 |
| | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 700 | 723 | 76,676 | 2021/11/15 |
| | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 900 | 978 | 103,742 | 2023/11/30 |
| | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 1,000 | 1,121 | 118,896 | 2025/4/30 |
| | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 600 | 674 | 71,472 | 2025/5/31 |
| | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 640 | 754 | 79,963 | 2028/5/15 |
| | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 440 | 520 | 55,189 | 2028/8/15 |
| | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 200 | 264 | 28,089 | 2043/5/15 |
| | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 110 | 146 | 15,575 | 2045/8/15 |
| | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 540 | 727 | 77,120 | 2046/11/15 |
| | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 420 | 575 | 60,980 | 2049/5/15 |
| | US TREASURY N/B 3 | 3.0 | 620 | 705 | 74,748 | 2025/9/30 |
| | US TREASURY N/B 3 | 3.0 | 400 | 539 | 57,175 | 2042/5/15 |

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 | | |
| | US TREASURY N/B 3 | 3.0 | 400 | 542 | 57,546 | 2044/11/15 | |
| | US TREASURY N/B 3 | 3.0 | 610 | 830 | 88,021 | 2045/5/15 | |
| | US TREASURY N/B 3 | 3.0 | 300 | 409 | 43,443 | 2045/11/15 | |
| | US TREASURY N/B 3 | 3.0 | 250 | 344 | 36,565 | 2047/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 3 | 3.0 | 570 | 787 | 83,448 | 2047/5/15 | |
| | US TREASURY N/B 3 | 3.0 | 400 | 554 | 58,812 | 2048/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 3 | 3.0 | 480 | 668 | 70,872 | 2048/8/15 | |
| | US TREASURY N/B 3 | 3.0 | 550 | 768 | 81,472 | 2049/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 3.125 | 750 | 905 | 96,005 | 2028/11/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 3.125 | 300 | 411 | 43,577 | 2041/11/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 3.125 | 150 | 206 | 21,840 | 2042/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 3.125 | 400 | 549 | 58,235 | 2043/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 3.125 | 500 | 691 | 73,258 | 2044/8/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 3.125 | 600 | 851 | 90,305 | 2048/5/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.375 | 3.375 | 450 | 644 | 68,366 | 2044/5/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.375 | 3.375 | 640 | 951 | 100,884 | 2048/11/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.5 | 3.5 | 100 | 142 | 15,083 | 2039/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.625 | 3.625 | 200 | 295 | 31,352 | 2043/8/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.625 | 3.625 | 140 | 207 | 22,015 | 2044/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.75 | 3.75 | 350 | 527 | 55,901 | 2043/11/15 | |
| | US TREASURY N/B 3.875 | 3.875 | 120 | 180 | 19,090 | 2040/8/15 | |
| | US TREASURY N/B 4.25 | 4.25 | 170 | 264 | 27,999 | 2039/5/15 | |
| | US TREASURY N/B 4.25 | 4.25 | 140 | 220 | 23,355 | 2040/11/15 | |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 4.375 | 200 | 311 | 33,071 | 2038/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 4.375 | 300 | 474 | 50,308 | 2039/11/15 | |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 4.375 | 360 | 577 | 61,186 | 2041/5/15 | |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 4.5 | 100 | 153 | 16,240 | 2036/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 4.625 | 4.625 | 100 | 163 | 17,291 | 2040/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 5.25 | 5.25 | 200 | 276 | 29,301 | 2028/11/15 | |
| | US TREASURY N/B 5.25 | 5.25 | 260 | 361 | 38,344 | 2029/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 5.375 | 5.375 | 80 | 118 | 12,575 | 2031/2/15 | |
| | US TREASURY N/B 5.5 | 5.5 | 120 | 166 | 17,696 | 2028/8/15 | |
| | US TREASURY N/B 8 | 8.0 | 1,500 | 1,643 | 174,233 | 2021/11/15 | |
| 小 | 計 | - | - | - | 10,101,237 | - | |
| (カナダ) | 国債証券 | CANADA-GOV'T 0.5 | 0.5 | 400 | 401 | 32,160 | 2022/3/1 |
| | | CANADA-GOV'T 0.75 | 0.75 | 110 | 110 | 8,849 | 2021/9/1 |
| | | CANADA-GOV'T 1 | 1.0 | 210 | 218 | 17,477 | 2027/6/1 |
| | | CANADA-GOV'T 1.5 | 1.5 | 350 | 356 | 28,535 | 2022/2/1 |
| | | CANADA-GOV'T 1.5 | 1.5 | 500 | 517 | 41,438 | 2023/6/1 |
| | | CANADA-GOV'T 1.5 | 1.5 | 250 | 266 | 21,328 | 2026/6/1 |
| | | CANADA-GOV'T 1.75 | 1.75 | 280 | 290 | 23,263 | 2023/3/1 |
| | | CANADA-GOV'T 2 | 2.0 | 200 | 210 | 16,841 | 2023/9/1 |

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 | | |
| | | CANADA-GOV T 2 | 2.0 | 380 | 424 | 34,033 | 2028/6/1 |
| | | CANADA-GOV T 2 | 2.0 | 40 | 49 | 3,996 | 2051/12/1 |
| | | CANADA-GOV T 2.25 | 2.25 | 350 | 382 | 30,602 | 2025/6/1 |
| | | CANADA-GOV T 2.25 | 2.25 | 190 | 218 | 17,516 | 2029/6/1 |
| | | CANADA-GOV T 2.5 | 2.5 | 250 | 270 | 21,683 | 2024/6/1 |
| | | CANADA-GOV T 2.75 | 2.75 | 350 | 365 | 29,284 | 2022/6/1 |
| | | CANADA-GOV T 2.75 | 2.75 | 300 | 424 | 34,016 | 2048/12/1 |
| | | CANADA-GOV T 2.75 | 2.75 | 50 | 80 | 6,415 | 2064/12/1 |
| | | CANADA-GOV T 3.5 | 3.5 | 200 | 310 | 24,850 | 2045/12/1 |
| | | CANADA-GOV T 4 | 4.0 | 100 | 157 | 12,610 | 2041/6/1 |
| | | CANADA-GOV T 5 | 5.0 | 70 | 115 | 9,258 | 2037/6/1 |
| | | CANADA-GOV T 5.75 | 5.75 | 160 | 259 | 20,766 | 2033/6/1 |
| 小 | 計 | | - | - | - | 434,931 | - |
| (メキシコ) | 国債証券 | MEXICAN BONOS 10 | 10.0 | 千メキシコペソ 3,700 | 千メキシコペソ 4,408 | 21,248 | 2024/12/5 |
| | | MEXICAN BONOS 5.75 | 5.75 | 4,500 | 4,605 | 22,196 | 2026/3/5 |
| | | MEXICAN BONOS 6.5 | 6.5 | 600 | 608 | 2,935 | 2021/6/10 |
| | | MEXICAN BONOS 6.5 | 6.5 | 4,000 | 4,128 | 19,897 | 2022/6/9 |
| | | MEXICAN BONOS 7.5 | 7.5 | 4,700 | 5,214 | 25,135 | 2027/6/3 |
| | | MEXICAN BONOS 7.75 | 7.75 | 1,000 | 1,138 | 5,486 | 2031/5/29 |
| | | MEXICAN BONOS 7.75 | 7.75 | 3,000 | 3,416 | 16,467 | 2034/11/23 |
| | | MEXICAN BONOS 7.75 | 7.75 | 3,400 | 3,764 | 18,144 | 2042/11/13 |
| | | MEXICAN BONOS 8 | 8.0 | 2,200 | 2,411 | 11,623 | 2023/12/7 |
| | | MEXICAN BONOS 8 | 8.0 | 1,500 | 1,667 | 8,036 | 2024/9/5 |
| | | MEXICAN BONOS 8.5 | 8.5 | 2,500 | 2,967 | 14,305 | 2029/5/31 |
| | | MEXICAN BONOS 8.5 | 8.5 | 1,000 | 1,196 | 5,764 | 2038/11/18 |
| 小 | 計 | | - | - | - | 171,242 | - |
| (ユーロ) | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| (ドイツ) | 国債証券 | BUNDESUBL-120 0 | - | 330 | 341 | 42,649 | 2025/4/11 |
| | | BUNDESUBL-174 0 | - | 200 | 201 | 25,203 | 2021/10/8 |
| | | BUNDESUBL-175 0 | - | 200 | 202 | 25,289 | 2022/4/8 |
| | | BUNDESSCHATZANW 0 | - | 180 | 181 | 22,744 | 2022/3/11 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0 | - | 300 | 312 | 39,102 | 2026/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0 | - | 250 | 262 | 32,878 | 2029/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0 | - | 150 | 157 | 19,719 | 2030/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0 | - | 70 | 73 | 9,144 | 2035/5/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0 | - | 70 | 71 | 8,911 | 2050/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.25 | 0.25 | 400 | 424 | 53,095 | 2027/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.25 | 0.25 | 400 | 428 | 53,555 | 2028/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.25 | 0.25 | 450 | 482 | 60,397 | 2029/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | 0.5 | 450 | 475 | 59,417 | 2025/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | 0.5 | 520 | 555 | 69,408 | 2026/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | 0.5 | 200 | 216 | 27,079 | 2027/8/15 |

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 | | 償還年月日 | |
|--------|------|-----------------------|-------|-------|--------|--------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | DEUTSCHLAND REP 1 | 1.0 | 100 | 106 | 13,379 | 2024/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1 | 1.0 | 200 | 217 | 27,183 | 2025/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.25 | 1.25 | 230 | 316 | 39,597 | 2048/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.5 | 1.5 | 450 | 470 | 58,814 | 2022/9/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.5 | 1.5 | 350 | 369 | 46,207 | 2023/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.5 | 1.5 | 400 | 424 | 53,089 | 2023/5/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.5 | 1.5 | 600 | 650 | 81,354 | 2024/5/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.75 | 1.75 | 600 | 627 | 78,484 | 2022/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.75 | 1.75 | 200 | 217 | 27,206 | 2024/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 2 | 2.0 | 250 | 259 | 32,436 | 2022/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 2 | 2.0 | 200 | 216 | 27,067 | 2023/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 2.25 | 2.25 | 200 | 206 | 25,771 | 2021/9/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2.5 | 360 | 593 | 74,261 | 2044/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2.5 | 320 | 540 | 67,646 | 2046/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 3.25 | 3.25 | 210 | 373 | 46,656 | 2042/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 4 | 4.0 | 380 | 656 | 82,106 | 2037/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 4.25 | 4.25 | 250 | 469 | 58,704 | 2039/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 4.75 | 4.75 | 240 | 416 | 52,137 | 2034/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 4.75 | 4.75 | 250 | 505 | 63,265 | 2040/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 5.5 | 5.5 | 200 | 328 | 41,081 | 2031/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 5.625 | 5.625 | 410 | 604 | 75,589 | 2028/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 6.25 | 6.25 | 200 | 247 | 30,961 | 2024/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 6.25 | 6.25 | 290 | 480 | 60,141 | 2030/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 6.5 | 6.5 | 60 | 90 | 11,283 | 2027/7/4 |
| (イタリア) | 国債証券 | BTPS 0.35 | 0.35 | 400 | 402 | 50,361 | 2021/11/1 |
| | | BTPS 0.65 | 0.65 | 300 | 305 | 38,235 | 2023/10/15 |
| | | BTPS 0.95 | 0.95 | 400 | 410 | 51,278 | 2023/3/15 |
| | | BTPS 1.25 | 1.25 | 500 | 521 | 65,201 | 2026/12/1 |
| | | BTPS 1.35 | 1.35 | 350 | 358 | 44,837 | 2022/4/15 |
| | | BTPS 1.35 | 1.35 | 590 | 613 | 76,783 | 2030/4/1 |
| | | BTPS 1.45 | 1.45 | 700 | 722 | 90,314 | 2022/9/15 |
| | | BTPS 1.45 | 1.45 | 500 | 524 | 65,645 | 2024/11/15 |
| | | BTPS 1.45 | 1.45 | 100 | 101 | 12,688 | 2036/3/1 |
| | | BTPS 1.5 | 1.5 | 600 | 631 | 79,029 | 2025/6/1 |
| | | BTPS 1.6 | 1.6 | 240 | 254 | 31,876 | 2026/6/1 |
| | | BTPS 1.65 | 1.65 | 50 | 53 | 6,646 | 2030/12/1 |
| | | BTPS 1.65 | 1.65 | 400 | 424 | 53,145 | 2032/3/1 |
| | | BTPS 1.85 | 1.85 | 300 | 318 | 39,841 | 2024/5/15 |
| | | BTPS 2 | 2.0 | 220 | 237 | 29,754 | 2025/12/1 |
| | | BTPS 2.05 | 2.05 | 200 | 218 | 27,357 | 2027/8/1 |
| | | BTPS 2.15 | 2.15 | 100 | 103 | 12,893 | 2021/12/15 |
| | | BTPS 2.2 | 2.2 | 400 | 441 | 55,196 | 2027/6/1 |
| | | BTPS 2.25 | 2.25 | 250 | 281 | 35,211 | 2036/9/1 |

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 2.3 | 2.3 | 800 | 823 | 102,930 | 2021/10/15 | |
| | | BTPS 2.45 | 2.45 | 250 | 287 | 35,926 | 2033/9/1 | |
| | | BTPS 2.45 | 2.45 | 100 | 112 | 14,105 | 2050/9/1 | |
| | | BTPS 2.5 | 2.5 | 350 | 382 | 47,836 | 2024/12/1 | |
| | | BTPS 2.5 | 2.5 | 350 | 386 | 48,391 | 2025/11/15 | |
| | | BTPS 2.7 | 2.7 | 240 | 284 | 35,555 | 2047/3/1 | |
| | | BTPS 2.8 | 2.8 | 150 | 174 | 21,784 | 2028/12/1 | |
| | | BTPS 2.8 | 2.8 | 140 | 168 | 21,114 | 2067/3/1 | |
| | | BTPS 2.95 | 2.95 | 150 | 183 | 22,959 | 2038/9/1 | |
| | | BTPS 3 | 3.0 | 200 | 236 | 29,630 | 2029/8/1 | |
| | | BTPS 3.1 | 3.1 | 100 | 124 | 15,585 | 2040/3/1 | |
| | | BTPS 3.25 | 3.25 | 160 | 207 | 25,929 | 2046/9/1 | |
| | | BTPS 3.35 | 3.35 | 210 | 265 | 33,253 | 2035/3/1 | |
| | | BTPS 3.45 | 3.45 | 200 | 269 | 33,659 | 2048/3/1 | |
| | | BTPS 3.75 | 3.75 | 100 | 113 | 14,241 | 2024/9/1 | |
| | | BTPS 3.85 | 3.85 | 100 | 144 | 18,011 | 2049/9/1 | |
| | | BTPS 4 | 4.0 | 170 | 232 | 29,087 | 2037/2/1 | |
| | | BTPS 4.5 | 4.5 | 200 | 224 | 28,047 | 2023/5/1 | |
| | | BTPS 4.5 | 4.5 | 80 | 92 | 11,527 | 2024/3/1 | |
| | | BTPS 4.5 | 4.5 | 200 | 243 | 30,448 | 2026/3/1 | |
| | | BTPS 4.75 | 4.75 | 300 | 341 | 42,713 | 2023/8/1 | |
| | | BTPS 4.75 | 4.75 | 270 | 353 | 44,178 | 2028/9/1 | |
| | | BTPS 4.75 | 4.75 | 200 | 316 | 39,519 | 2044/9/1 | |
| | | BTPS 5 | 5.0 | 200 | 215 | 26,988 | 2022/3/1 | |
| | | BTPS 5 | 5.0 | 300 | 362 | 45,342 | 2025/3/1 | |
| | | BTPS 5 | 5.0 | 400 | 588 | 73,540 | 2034/8/1 | |
| | | BTPS 5 | 5.0 | 250 | 390 | 48,819 | 2039/8/1 | |
| | | BTPS 5 | 5.0 | 180 | 283 | 35,393 | 2040/9/1 | |
| | | BTPS 5.25 | 5.25 | 360 | 498 | 62,381 | 2029/11/1 | |
| | | BTPS 5.5 | 5.5 | 350 | 392 | 49,076 | 2022/11/1 | |
| | | BTPS 5.75 | 5.75 | 200 | 305 | 38,148 | 2033/2/1 | |
| | | BTPS 6 | 6.0 | 250 | 374 | 46,866 | 2031/5/1 | |
| | | BTPS 6.5 | 6.5 | 470 | 659 | 82,416 | 2027/11/1 | |
| | | BTPS 9 | 9.0 | 350 | 449 | 56,179 | 2023/11/1 | |
| (フランス) | 国債証券 | FRANCE 0. A. T. 0 | — | 250 | 252 | 31,554 | 2022/2/25 | |
| | | FRANCE 0. A. T. 0 | — | 700 | 707 | 88,501 | 2022/5/25 | |
| | | FRANCE 0. A. T. 0 | — | 300 | 304 | 38,107 | 2023/2/25 | |
| | | FRANCE 0. A. T. 0 | — | 200 | 203 | 25,421 | 2023/3/25 | |
| | | FRANCE 0. A. T. 0 | — | 200 | 204 | 25,556 | 2024/3/25 | |
| | | FRANCE 0. A. T. 0 | — | 220 | 225 | 28,229 | 2025/3/25 | |
| | | FRANCE 0. A. T. 0 | — | 480 | 492 | 61,539 | 2029/11/25 | |
| | | FRANCE 0. A. T. 0.25 | 0.25 | 330 | 345 | 43,178 | 2026/11/25 | |
| | | FRANCE 0. A. T. 0.5 | 0.5 | 440 | 462 | 57,858 | 2025/5/25 | |

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. 0.5 | 0.5 | 350 | 370 | 46,366 | 2026/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 0.5 | 0.5 | 650 | 696 | 87,152 | 2029/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 0.75 | 0.75 | 610 | 664 | 83,073 | 2028/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 0.75 | 0.75 | 380 | 414 | 51,892 | 2028/11/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 0.75 | 0.75 | 220 | 236 | 29,617 | 2052/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 1 | 1.0 | 80 | 86 | 10,826 | 2025/11/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 1 | 1.0 | 330 | 362 | 45,355 | 2027/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 1.25 | 1.25 | 300 | 352 | 44,095 | 2034/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 1.25 | 1.25 | 220 | 260 | 32,594 | 2036/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 1.5 | 1.5 | 650 | 768 | 96,143 | 2031/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 1.5 | 1.5 | 250 | 323 | 40,456 | 2050/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 1.75 | 1.75 | 170 | 181 | 22,667 | 2023/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 1.75 | 1.75 | 750 | 825 | 103,237 | 2024/11/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 1.75 | 1.75 | 350 | 453 | 56,715 | 2039/6/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 1.75 | 1.75 | 150 | 221 | 27,741 | 2066/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 2 | 2.0 | 300 | 426 | 53,288 | 2048/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 2.25 | 2.25 | 320 | 340 | 42,544 | 2022/10/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 2.25 | 2.25 | 430 | 476 | 59,602 | 2024/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 2.5 | 2.5 | 550 | 699 | 87,454 | 2030/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 2.75 | 2.75 | 430 | 529 | 66,273 | 2027/10/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 3 | 3.0 | 250 | 265 | 33,158 | 2022/4/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 3.25 | 3.25 | 450 | 470 | 58,827 | 2021/10/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 3.25 | 3.25 | 300 | 507 | 63,472 | 2045/5/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 3.5 | 3.5 | 850 | 1,047 | 130,978 | 2026/4/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 4 | 4.0 | 250 | 424 | 53,129 | 2038/10/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 4 | 4.0 | 170 | 359 | 44,985 | 2055/4/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 4 | 4.0 | 110 | 246 | 30,812 | 2060/4/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 4.25 | 4.25 | 600 | 693 | 86,772 | 2023/10/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 4.5 | 4.5 | 430 | 802 | 100,369 | 2041/4/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 4.75 | 4.75 | 360 | 613 | 76,668 | 2035/4/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 5.5 | 5.5 | 200 | 302 | 37,882 | 2029/4/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 5.75 | 5.75 | 400 | 689 | 86,237 | 2032/10/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 6 | 6.0 | 400 | 538 | 67,293 | 2025/10/25 |
| | | FRANCE | O. A. T. 8.5 | 8.5 | 200 | 249 | 31,193 | 2023/4/25 |
| (オランダ) | 国債証券 | NETHERLANDS | GOVT 0 | — | 250 | 252 | 31,534 | 2022/1/15 |
| | | NETHERLANDS | GOVT 0 | — | 170 | 173 | 21,728 | 2024/1/15 |
| | | NETHERLANDS | GOVT 0.25 | 0.25 | 200 | 208 | 26,108 | 2025/7/15 |
| | | NETHERLANDS | GOVT 0.5 | 0.5 | 120 | 127 | 15,986 | 2026/7/15 |
| | | NETHERLANDS | GOVT 0.5 | 0.5 | 130 | 145 | 18,184 | 2040/1/15 |
| | | NETHERLANDS | GOVT 0.75 | 0.75 | 250 | 272 | 34,063 | 2027/7/15 |
| | | NETHERLANDS | GOVT 0.75 | 0.75 | 100 | 110 | 13,762 | 2028/7/15 |
| | | NETHERLANDS | GOVT 1.75 | 1.75 | 200 | 214 | 26,768 | 2023/7/15 |
| | | NETHERLANDS | GOVT 2 | 2.0 | 60 | 66 | 8,291 | 2024/7/15 |

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 | |
| | | NETHERLANDS GOVT | 2.25 | 100 | 105 | 13,192 | 2022/7/15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT | 2.5 | 210 | 284 | 35,517 | 2033/1/15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT | 2.75 | 200 | 348 | 43,610 | 2047/1/15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT | 3.75 | 200 | 221 | 27,669 | 2023/1/15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT | 3.75 | 170 | 312 | 39,020 | 2042/1/15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT | 4.0 | 200 | 339 | 42,446 | 2037/1/15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT | 5.5 | 150 | 217 | 27,252 | 2028/1/15 | |
| (スペイン) | 国債証券 | SPANISH GOV'T | 0.25 | 200 | 204 | 25,568 | 2024/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 0.35 | 400 | 408 | 51,094 | 2023/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 0.4 | 300 | 304 | 38,069 | 2022/4/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 0.45 | 500 | 509 | 63,764 | 2022/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 0.5 | 230 | 235 | 29,446 | 2030/4/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 0.6 | 300 | 310 | 38,864 | 2029/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 0.8 | 200 | 210 | 26,377 | 2027/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.0 | 60 | 58 | 7,288 | 2050/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.2 | 60 | 63 | 7,950 | 2040/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.25 | 220 | 240 | 30,063 | 2030/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.3 | 700 | 761 | 95,172 | 2026/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.4 | 350 | 386 | 48,307 | 2028/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.45 | 200 | 220 | 27,555 | 2027/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.45 | 280 | 310 | 38,868 | 2029/4/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.5 | 200 | 220 | 27,614 | 2027/4/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.6 | 300 | 325 | 40,762 | 2025/4/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.85 | 150 | 176 | 22,052 | 2035/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.95 | 220 | 246 | 30,808 | 2026/4/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 1.95 | 270 | 314 | 39,311 | 2030/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 2.15 | 50 | 56 | 7,018 | 2025/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 2.35 | 50 | 61 | 7,704 | 2033/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 2.7 | 210 | 293 | 36,659 | 2048/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 2.75 | 400 | 451 | 56,426 | 2024/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 2.9 | 210 | 300 | 37,567 | 2046/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 3.45 | 130 | 223 | 27,960 | 2066/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 3.8 | 350 | 403 | 50,467 | 2024/4/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 4.2 | 280 | 434 | 54,364 | 2037/1/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 4.4 | 300 | 345 | 43,257 | 2023/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 4.65 | 250 | 310 | 38,813 | 2025/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 4.7 | 250 | 434 | 54,339 | 2041/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 4.8 | 100 | 117 | 14,731 | 2024/1/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 4.9 | 200 | 351 | 43,899 | 2040/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 5.15 | 300 | 422 | 52,880 | 2028/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 5.15 | 160 | 304 | 38,113 | 2044/10/31 | |
| | | SPANISH GOV'T | 5.75 | 300 | 487 | 60,930 | 2032/7/30 | |
| | | SPANISH GOV'T | 5.85 | 350 | 381 | 47,757 | 2022/1/31 | |

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 | 評 | | 額 | 償 |
| | | | | | | | | 外 | 貨 | | |
| | | SPANISH GOV | T 6 | 6.0 | 180 | 268 | 33,548 | 2029/1/31 | | | |
| (ベルギー) | 国債証券 | BELGIAN 0.1 | | 0.1 | 150 | 154 | 19,357 | 2030/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 0.2 | | 0.2 | 80 | 82 | 10,268 | 2023/10/22 | | | |
| | | BELGIAN 0.4 | | 0.4 | 50 | 51 | 6,395 | 2040/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 0.8 | | 0.8 | 100 | 106 | 13,343 | 2025/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 0.8 | | 0.8 | 250 | 271 | 33,914 | 2027/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 0.8 | | 0.8 | 360 | 393 | 49,203 | 2028/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 0291 5.5 | | 5.5 | 120 | 174 | 21,815 | 2028/3/28 | | | |
| | | BELGIAN 0304 5 | | 5.0 | 220 | 379 | 47,446 | 2035/3/28 | | | |
| | | BELGIAN 0308 4 | | 4.0 | 300 | 322 | 40,310 | 2022/3/28 | | | |
| | | BELGIAN 0320 4.25 | | 4.25 | 200 | 358 | 44,773 | 2041/3/28 | | | |
| | | BELGIAN 0321 4.25 | | 4.25 | 100 | 105 | 13,169 | 2021/9/28 | | | |
| | | BELGIAN 0324 4.5 | | 4.5 | 80 | 102 | 12,849 | 2026/3/28 | | | |
| | | BELGIAN 0328 2.25 | | 2.25 | 100 | 108 | 13,534 | 2023/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 0332 2.6 | | 2.6 | 100 | 112 | 14,060 | 2024/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 0333 3 | | 3.0 | 120 | 169 | 21,238 | 2034/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 0338 0.5 | | 0.5 | 100 | 104 | 13,080 | 2024/10/22 | | | |
| | | BELGIAN 0347 0.9 | | 0.9 | 130 | 143 | 17,999 | 2029/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 0348 1.7 | | 1.7 | 40 | 53 | 6,709 | 2050/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 1 | | 1.0 | 200 | 217 | 27,227 | 2026/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 1 | | 1.0 | 250 | 281 | 35,204 | 2031/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 1.25 | | 1.25 | 170 | 198 | 24,855 | 2033/4/22 | | | |
| | | BELGIAN 1.6 | | 1.6 | 140 | 181 | 22,677 | 2047/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 1.9 | | 1.9 | 50 | 65 | 8,131 | 2038/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 2.15 | | 2.15 | 130 | 213 | 26,666 | 2066/6/22 | | | |
| | | BELGIAN 3.75 | | 3.75 | 100 | 179 | 22,465 | 2045/6/22 | | | |
| (オーストリア) | 国債証券 | REP OF AUSTRIA 0.5 | | 0.5 | 150 | 160 | 20,039 | 2027/4/20 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.5 | | 0.5 | 150 | 161 | 20,192 | 2029/2/20 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.75 | | 0.75 | 200 | 216 | 27,044 | 2026/10/20 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.75 | | 0.75 | 230 | 251 | 31,392 | 2028/2/20 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.75 | | 0.75 | 50 | 57 | 7,207 | 2051/3/20 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 1.2 | | 1.2 | 200 | 218 | 27,375 | 2025/10/20 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 1.5 | | 1.5 | 100 | 134 | 16,816 | 2047/2/20 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 1.75 | | 1.75 | 80 | 86 | 10,764 | 2023/10/20 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 2.4 | | 2.4 | 100 | 134 | 16,870 | 2034/5/23 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 3.15 | | 3.15 | 100 | 171 | 21,504 | 2044/6/20 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 3.4 | | 3.4 | 200 | 218 | 27,306 | 2022/11/22 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 3.5 | | 3.5 | 400 | 417 | 52,207 | 2021/9/15 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 3.8 | | 3.8 | 140 | 330 | 41,324 | 2062/1/26 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 4.15 | | 4.15 | 200 | 339 | 42,461 | 2037/3/15 | | | |
| | | REP OF AUSTRIA 4.85 | | 4.85 | 200 | 261 | 32,736 | 2026/3/15 | | | |
| (フィンランド) | 国債証券 | FINNISH GOV | T 0 | — | 120 | 122 | 15,300 | 2023/9/15 | | | |
| | | FINNISH GOV | T 0.5 | 0.5 | 100 | 107 | 13,468 | 2029/9/15 | | | |

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 | | |
| | | FINNISH GOV T 0.875 | 0.875 | 100 | 107 | 13,450 | 2025/9/15 |
| | | FINNISH GOV T 1.125 | 1.125 | 100 | 117 | 14,689 | 2034/4/15 |
| | | FINNISH GOV T 1.375 | 1.375 | 50 | 66 | 8,356 | 2047/4/15 |
| | | FINNISH GOV T 1.5 | 1.5 | 100 | 105 | 13,216 | 2023/4/15 |
| | | FINNISH GOV T 1.625 | 1.625 | 100 | 104 | 13,094 | 2022/9/15 |
| | | FINNISH GOV T 2 | 2.0 | 200 | 219 | 27,449 | 2024/4/15 |
| | | FINNISH GOV T 2.625 | 2.625 | 100 | 156 | 19,614 | 2042/7/4 |
| | | FINNISH GOV T 2.75 | 2.75 | 100 | 125 | 15,683 | 2028/7/4 |
| (アイルランド) | 国債証券 | IRISH GOVT 0.8 | 0.8 | 100 | 102 | 12,780 | 2022/3/15 |
| | | IRISH GOVT 0.9 | 0.9 | 220 | 241 | 30,179 | 2028/5/15 |
| | | IRISH GOVT 1.1 | 1.1 | 130 | 145 | 18,209 | 2029/5/15 |
| | | IRISH GOVT 1.7 | 1.7 | 100 | 125 | 15,736 | 2037/5/15 |
| | | IRISH GOVT 2 | 2.0 | 200 | 279 | 34,965 | 2045/2/18 |
| | | IRISH GOVT 2.4 | 2.4 | 100 | 125 | 15,706 | 2030/5/15 |
| | | IRISH GOVT 3.4 | 3.4 | 200 | 228 | 28,583 | 2024/3/18 |
| | | IRISH GOVT 3.9 | 3.9 | 200 | 223 | 27,943 | 2023/3/20 |
| | | IRISH GOVT 5.4 | 5.4 | 50 | 63 | 7,958 | 2025/3/13 |
| 小 | 計 | | — | — | — | 9,418,606 | — |
| (イギリス) | 国債証券 | UK TSY GILT 0.5 | 0.5 | 470 | 474 | 65,831 | 2022/7/22 |
| | | UK TSY GILT 0.625 | 0.625 | 170 | 175 | 24,318 | 2025/6/7 |
| | | UK TSY GILT 0.75 | 0.75 | 310 | 317 | 44,018 | 2023/7/22 |
| | | UK TSY GILT 0.875 | 0.875 | 160 | 170 | 23,601 | 2029/10/22 |
| | | UK TSY GILT 1 | 1.0 | 250 | 259 | 36,033 | 2024/4/22 |
| | | UK TSY GILT 1.25 | 1.25 | 200 | 216 | 30,032 | 2027/7/22 |
| | | UK TSY GILT 1.25 | 1.25 | 70 | 76 | 10,642 | 2041/10/22 |
| | | UK TSY GILT 1.5 | 1.5 | 170 | 185 | 25,693 | 2026/7/22 |
| | | UK TSY GILT 1.5 | 1.5 | 200 | 234 | 32,506 | 2047/7/22 |
| | | UK TSY GILT 1.625 | 1.625 | 220 | 247 | 34,293 | 2028/10/22 |
| | | UK TSY GILT 1.625 | 1.625 | 40 | 50 | 6,934 | 2054/10/22 |
| | | UK TSY GILT 1.625 | 1.625 | 80 | 114 | 15,863 | 2071/10/22 |
| | | UK TSY GILT 1.75 | 1.75 | 280 | 290 | 40,246 | 2022/9/7 |
| | | UK TSY GILT 1.75 | 1.75 | 280 | 330 | 45,756 | 2037/9/7 |
| | | UK TSY GILT 1.75 | 1.75 | 90 | 112 | 15,529 | 2049/1/22 |
| | | UK TSY GILT 1.75 | 1.75 | 220 | 290 | 40,260 | 2057/7/22 |
| | | UK TSY GILT 2 | 2.0 | 150 | 165 | 22,960 | 2025/9/7 |
| | | UK TSY GILT 2.25 | 2.25 | 250 | 267 | 37,105 | 2023/9/7 |
| | | UK TSY GILT 2.5 | 2.5 | 220 | 368 | 51,140 | 2065/7/22 |
| | | UK TSY GILT 2.75 | 2.75 | 300 | 334 | 46,340 | 2024/9/7 |
| | | UK TSY GILT 3.25 | 3.25 | 210 | 321 | 44,510 | 2044/1/22 |
| | | UK TSY GILT 3.5 | 3.5 | 250 | 400 | 55,574 | 2045/1/22 |
| | | UK TSY GILT 3.5 | 3.5 | 200 | 426 | 59,086 | 2068/7/22 |
| | | UK TSY GILT 3.75 | 3.75 | 150 | 155 | 21,614 | 2021/9/7 |

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 3.75 | 3.75 | 220 | 405 | 56,152 | 2052/7/22 |
| | | UK TSY GILT 4 | 4.0 | 100 | 106 | 14,720 | 2022/3/7 |
| | | UK TSY GILT 4 | 4.0 | 140 | 296 | 41,042 | 2060/1/22 |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 200 | 261 | 36,181 | 2027/12/7 |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 250 | 362 | 50,278 | 2032/6/7 |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 180 | 278 | 38,671 | 2036/3/7 |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 150 | 246 | 34,138 | 2039/9/7 |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 190 | 317 | 43,953 | 2040/12/7 |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 230 | 419 | 58,120 | 2046/12/7 |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 170 | 324 | 44,950 | 2049/12/7 |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 200 | 415 | 57,569 | 2055/12/7 |
| | | UK TSY GILT 4.5 | 4.5 | 150 | 232 | 32,167 | 2034/9/7 |
| | | UK TSY GILT 4.5 | 4.5 | 200 | 354 | 49,131 | 2042/12/7 |
| | | UK TSY GILT 4.75 | 4.75 | 200 | 292 | 40,516 | 2030/12/7 |
| | | UK TSY GILT 4.75 | 4.75 | 140 | 239 | 33,249 | 2038/12/7 |
| | | UK TSY GILT 5 | 5.0 | 80 | 98 | 13,637 | 2025/3/7 |
| | | UK TSY GILT 6 | 6.0 | 60 | 88 | 12,320 | 2028/12/7 |
| 小 | 計 | | — | — | — | 1,486,698 | — |
| (スウェーデン) | 国債証券 | SWEDISH GOVRNMNT 0.75 | 0.75 | 200 | 213 | 2,582 | 2028/5/12 |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 0.75 | 0.75 | 350 | 376 | 4,541 | 2029/11/12 |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 1 | 1.0 | 820 | 882 | 10,657 | 2026/11/12 |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 1.5 | 1.5 | 900 | 953 | 11,509 | 2023/11/13 |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 2.5 | 2.5 | 850 | 963 | 11,625 | 2025/5/12 |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 3.5 | 1,200 | 1,282 | 15,475 | 2022/6/1 |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 3.5 | 600 | 938 | 11,324 | 2039/3/30 |
| 小 | 計 | | — | — | — | 67,715 | — |
| (ノルウェー) | 国債証券 | NORWEGIAN GOV'T 1.375 | 1.375 | 330 | 352 | 4,150 | 2030/8/19 |
| | | NORWEGIAN GOV'T 1.5 | 1.5 | 800 | 844 | 9,962 | 2026/2/19 |
| | | NORWEGIAN GOV'T 1.75 | 1.75 | 600 | 636 | 7,503 | 2025/3/13 |
| | | NORWEGIAN GOV'T 1.75 | 1.75 | 900 | 969 | 11,435 | 2027/2/17 |
| | | NORWEGIAN GOV'T 1.75 | 1.75 | 100 | 109 | 1,291 | 2029/9/6 |
| | | NORWEGIAN GOV'T 2 | 2.0 | 300 | 314 | 3,704 | 2023/5/24 |
| | | NORWEGIAN GOV'T 2 | 2.0 | 400 | 442 | 5,211 | 2028/4/26 |
| | | NORWEGIAN GOV'T 3 | 3.0 | 800 | 875 | 10,324 | 2024/3/14 |
| 小 | 計 | | — | — | — | 53,583 | — |
| (デンマーク) | 国債証券 | DENMARK - BULLET 0.5 | 0.5 | 1,350 | 1,443 | 24,256 | 2027/11/15 |
| | | DENMARK - BULLET 0.5 | 0.5 | 870 | 940 | 15,799 | 2029/11/15 |
| | | DENMARK - BULLET 1.5 | 1.5 | 150 | 160 | 2,688 | 2023/11/15 |
| | | DENMARK - BULLET 1.75 | 1.75 | 400 | 448 | 7,533 | 2025/11/15 |
| | | DENMARK - BULLET 3 | 3.0 | 1,100 | 1,147 | 19,274 | 2021/11/15 |

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 | | |
| | | DENMARK - BULLET 4.5 | 4.5 | 1,320 | 2,503 | 42,063 | 2039/11/15 |
| | | DENMARK - BULLET 7 | 7.0 | 420 | 555 | 9,337 | 2024/11/10 |
| 小 | 計 | | - | - | - | 120,953 | - |
| (ポーランド) | 国債証券 | POLAND GOVT BOND 2.25 | 2.25 | 千ポーランドズロチ 700 | 千ポーランドズロチ 748 | 21,290 | 2024/10/25 |
| | | POLAND GOVT BOND 2.5 | 2.5 | 280 | 305 | 8,676 | 2026/7/25 |
| | | POLAND GOVT BOND 2.5 | 2.5 | 800 | 874 | 24,866 | 2027/7/25 |
| | | POLAND GOVT BOND 2.75 | 2.75 | 350 | 389 | 11,075 | 2028/4/25 |
| | | POLAND GOVT BOND 2.75 | 2.75 | 220 | 248 | 7,050 | 2029/10/25 |
| | | POLAND GOVT BOND 3.25 | 3.25 | 350 | 392 | 11,154 | 2025/7/25 |
| | | POLAND GOVT BOND 4 | 4.0 | 650 | 725 | 20,625 | 2023/10/25 |
| | | POLAND GOVT BOND 5.75 | 5.75 | 500 | 533 | 15,170 | 2021/10/25 |
| | | POLAND GOVT BOND 5.75 | 5.75 | 500 | 558 | 15,871 | 2022/9/23 |
| 小 | 計 | | - | - | - | 135,781 | - |
| (オーストラリア) | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVT. 0.25 | 0.25 | 千オーストラリアドル 180 | 千オーストラリアドル 179 | 13,638 | 2024/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 1 | 1.0 | 260 | 262 | 19,977 | 2030/12/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 1.25 | 1.25 | 270 | 278 | 21,158 | 2032/5/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 1.5 | 1.5 | 170 | 179 | 13,680 | 2031/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2 | 2.0 | 190 | 194 | 14,778 | 2021/12/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 2.25 | 310 | 323 | 24,628 | 2022/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 2.25 | 350 | 390 | 29,718 | 2028/5/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.5 | 2.5 | 210 | 242 | 18,415 | 2030/5/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 420 | 457 | 34,816 | 2024/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 350 | 401 | 30,575 | 2027/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 400 | 463 | 35,292 | 2028/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 250 | 292 | 22,254 | 2029/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 150 | 181 | 13,812 | 2035/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 30 | 36 | 2,759 | 2041/5/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3 | 3.0 | 120 | 154 | 11,774 | 2047/3/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 3.25 | 400 | 452 | 34,432 | 2025/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 3.25 | 450 | 542 | 41,266 | 2029/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 3.25 | 200 | 258 | 19,690 | 2039/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.75 | 3.75 | 80 | 109 | 8,325 | 2037/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 4.25 | 4.25 | 500 | 604 | 45,996 | 2026/4/21 |
| AUSTRALIAN GOVT. 4.75 | 4.75 | 400 | 508 | 38,711 | 2027/4/21 | | |
| AUSTRALIAN GOVT. 5.5 | 5.5 | 330 | 375 | 28,582 | 2023/4/21 | | |
| AUSTRALIAN GOVT. 5.75 | 5.75 | 100 | 110 | 8,390 | 2022/7/15 | | |
| 小 | 計 | | - | - | - | 532,674 | - |
| (シンガポール) | 国債証券 | SINGAPORE GOV'T 1.25 | 1.25 | 千シンガポールドル 250 | 千シンガポールドル 252 | 19,564 | 2021/10/1 |
| | | SINGAPORE GOV'T 1.875 | 1.875 | 70 | 83 | 6,432 | 2050/3/1 |
| | | SINGAPORE GOV'T 2.125 | 2.125 | 250 | 271 | 21,023 | 2026/6/1 |

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 | | |
| | SINGAPORE GOV T 2.625 | 2.625 | 310 | 352 | 27,281 | 2028/5/1 | |
| | SINGAPORE GOV T 2.75 | 2.75 | 300 | 320 | 24,778 | 2023/7/1 | |
| | SINGAPORE GOV T 2.75 | 2.75 | 100 | 128 | 9,957 | 2042/4/1 | |
| | SINGAPORE GOV T 2.75 | 2.75 | 200 | 266 | 20,603 | 2046/3/1 | |
| | SINGAPORE GOV T 2.875 | 2.875 | 170 | 199 | 15,447 | 2029/7/1 | |
| | SINGAPORE GOV T 3 | 3.0 | 300 | 330 | 25,604 | 2024/9/1 | |
| | SINGAPORE GOV T 3.125 | 3.125 | 200 | 211 | 16,359 | 2022/9/1 | |
| | SINGAPORE GOV T 3.375 | 3.375 | 250 | 320 | 24,777 | 2033/9/1 | |
| 小 | 計 | — | — | — | 211,830 | — | |
| (イスラエル) | 国 債 証 券 | | 千イスラエルシェケル | 千イスラエルシェケル | | | |
| | | ISRAEL FIXED 0.75 | 0.75 | 750 | 758 | 23,634 | 2022/7/31 |
| | | ISRAEL FIXED 1.5 | 1.5 | 430 | 447 | 13,945 | 2023/11/30 |
| | | ISRAEL FIXED 2.25 | 2.25 | 450 | 510 | 15,887 | 2028/9/28 |
| | | ISRAEL FIXED 3.75 | 3.75 | 400 | 588 | 18,333 | 2047/3/31 |
| | ISRAEL FIXED 6.25 | 6.25 | 420 | 569 | 17,726 | 2026/10/30 | |
| 小 | 計 | — | — | — | 89,527 | — | |
| 合 | 計 | — | — | — | 22,824,785 | — | |

※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

(2020年8月25日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 | % |
| | 22,824,785 | 98.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 446,513 | 1.9 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 23,271,298 | 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（23,017,586千円）の投資信託財産総額（23,271,298千円）に対する比率は98.9%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=106.01円、1カナダドル=80.09円、1メキシコペソ=4.82円、1ユーロ=125.06円、1英ポンド=138.62円、1スウェーデンクローナ=12.07円、1ノルウェークローネ=11.79円、1デンマーククローネ=16.80円、1ポーランドズロチ=28.43円、1オーストラリアドル=76.09円、1シンガポールドル=77.40円、1イスラエルシェケル=31.14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

(2020年8月25日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|--------------------------------------|------------------------|
| (A) 資 産 | 46,312,910,024円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 292,787,202 |
| 公 社 債 (評 価 額) | 22,824,785,634 |
| 未 収 入 金 | 23,045,468,753 |
| 未 収 利 息 | 138,994,595 |
| 前 払 費 用 | 10,873,840 |
| (B) 負 債 | 23,111,113,454 |
| 未 払 金 | 23,095,112,460 |
| 未 払 解 約 金 | 16,000,000 |
| 未 払 利 息 | 567 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 427 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 23,201,796,570 |
| 元 本 | 15,043,454,758 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 8,158,341,812 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 15,043,454,758口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 15,423円 |

※当期における期首元本額18,519,397,157円、期中追加設定元本額9,192,734,440円、期中一部解約元本額12,668,676,839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) | 2,308,022,113円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 642,030,251円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 14,020,472円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 479,981,737円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 722,593,652円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 246,103,854円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 389,520,031円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 86,994,226円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 17,236,408円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 16,479,849円 |
| SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 5,047,561,449円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 1,338,321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> | 4,058,708,804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> | 127,890,909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> | 384,364,133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> | 500,608,549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>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2019年8月27日 至2020年8月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------------|-----------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 522,482,102円 |
| 受 取 利 息 | 514,727,821 |
| そ の 他 収 益 金 | 7,925,831 |
| 支 払 利 息 | △ 171,550 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 206,484,201 |
| 売 買 益 | 3,738,858,993 |
| 売 買 損 | △3,532,374,792 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 12,753,726 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 716,212,577 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 9,063,908,500 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 4,708,583,564 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △6,330,362,829 |
| (H) 計 (D + E + F + G) | 8,158,341,812 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 8,158,341,812 |

※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16期（2018年12月18日から2019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 | | |
| 12期 (2015年12月17日) | 円 | % | | | % | 百万円 |
| 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 |
| 16期 (2019年12月17日) | 18,248 | 4.0 | 184.64 | 4.1 | 98.6 | 171,892 |

※ 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2019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

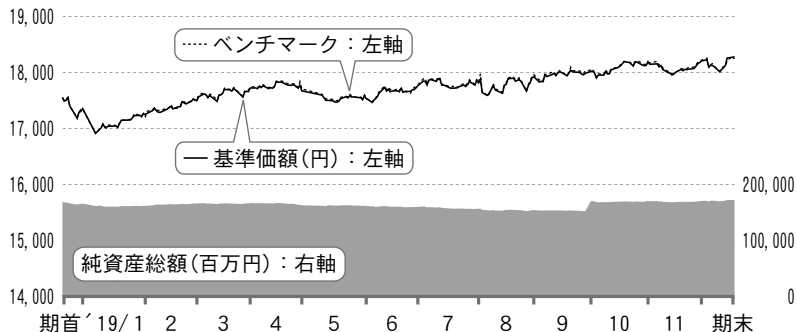
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | (ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース) | | 債 券 組 入 率 比 |
|----------------------|---------|------|---|------|----------------|
| | 騰 落 | 率 | 騰 落 | 率 | |
| (期 首) 2018年12月17日 | 円 | % | | | % |
| 2018年12月17日 | 17,553 | — | 177.36 | — | 98.7 |
| 12月末 | 17,355 | △1.1 | 175.20 | △1.2 | 98.7 |
| 2019年 1 月末 | 17,249 | △1.7 | 173.91 | △1.9 | 98.8 |
| 2 月末 | 17,495 | △0.3 | 176.93 | △0.2 | 98.2 |
| 3 月末 | 17,722 | 1.0 | 179.31 | 1.1 | 98.8 |
| 4 月末 | 17,671 | 0.7 | 178.91 | 0.9 | 98.4 |
| 5 月末 | 17,533 | △0.1 | 177.32 | △0.0 | 98.9 |
| 6 月末 | 17,763 | 1.2 | 179.64 | 1.3 | 99.1 |
| 7 月末 | 17,814 | 1.5 | 180.05 | 1.5 | 98.8 |
| 8 月末 | 17,925 | 2.1 | 181.49 | 2.3 | 98.8 |
| 9 月末 | 18,017 | 2.6 | 182.32 | 2.8 | 98.5 |
| 10 月末 | 18,192 | 3.6 | 183.72 | 3.6 | 98.1 |
| 11 月末 | 18,202 | 3.7 | 184.08 | 3.8 | 98.5 |
| (期 末) 2019年12月17日 | 18,248 | 4.0 | 184.64 | 4.1 | 98.6 |

※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12月18日から2019年12月17日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 17,553円 |
| 期末 | 18,248円 |
| 騰落率 | +4.0% |

※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、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（2018年12月18日から2019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、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）に対し、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション（投資資金の平均回収期間）等を可能な限り近似させることにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- ・FRB（米連邦準備制度理事会）が保険的な利下げを実施するなど、ハト派（景気を重視する立場）的な金融政策に転換したことにより、米国金利が低下したこと

下落要因

- ・景気見通しに対する不透明感や投資家のリスク回避的な姿勢などから、円が対ドルや対ユーロで上昇したこと

▶ 投資環境について（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

長期金利は米国、欧州（ドイツ）ともに低下（債券価格は上昇）しました。為替市場では、米ドルやユーロは対円で下落しました。

債券市場

米国では、期初からもみ合い推移が続いた後、2019年3月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利の見通しが大幅に引き下げられると、年内の利下げを織り込む形で金利が低下しました。その後、5月にトランプ大統領が中国に対する関税引上げを実施し、8月にも中国に対する追加関税が発表されるなど、米中通商摩擦に対する不透明感から金利は大きく低下しました。7月末にグローバルな景気見通しの悪化を受けてFRBが保険的な利下げを実施したことも、金利低下要因になりました。その後、米中協議の再開を受けて、米中間の対立先鋭化に対する警戒感が後退し、10月に金利は上昇に転じ、期末まで上昇基調で推移しました。

欧州では、域内の経済指標の低迷や、ECB（欧州中央銀行）が金利据え置き期間を長期化するなどハト派的な姿勢を示したことから、期首から8月にかけて金利低下が進行しました。ECBは9月に政策金利の引下げと量的緩和を含む金融緩和策を発表しました。ドイツの財政支出拡大観測や米中通商協議の進展に対する期待から、9月以降、金利は上昇に転じ、期末にかけて上昇傾向が続きました。

当期の市場の動きを米国10年国債利回りで見ると、期首2.89%から期末1.87%へと低下し、ドイツ10年国債利回りで見ると、期首0.25%から期末-0.28%へと低下しました。

為替市場

米ドル・円は、期初は株式市場の下落を受けてリスク回避の動きが強まるなか、円高が進行しましたが、2019年1月中旬以降は、米国の利上げ停止観測などを受けたリスク選好度の改善とともに、米ドルが反発しました。5月以降は、米中通商協議に対する警戒感が高まると、円が強含みで推移しました。10月から期末にかけては、米国金利の上昇に連れて米ドル高・円安基調となりました。

ユーロ・円は、期初から8月にかけて、投資家のリスク回避姿勢の強まりと欧州景気の低迷から、円高傾向となりました。その後は英国のEU（欧州連合）からの離脱交渉が進展するなどリスク選好度の改善とともにユーロが反発に転じ、期末までユーロ高・円安となりました。

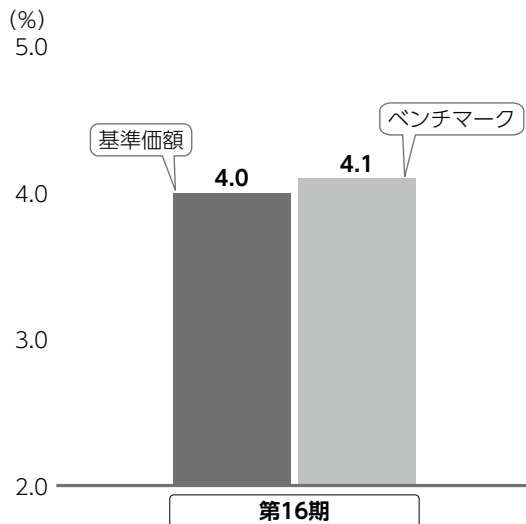
当期の米ドル・円は、期首113円47銭から期末109円56銭と3円91銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首128円28銭から期末122円01銭と6円27銭のユーロ安・円高となりました。

▶ポートフォリオについて（2018年12月18日から2019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（2018年12月18日から2019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+4.0%となり、ベンチマークの騰落率+4.1%を0.1%下方乖離しました。

下方乖離要因

・カストディフィーやポートフォリオの維持のための売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

米国では、景気に底入れの兆候が見られるものの、F R Bは慎重なスタンスを継続する見通しです。インフレ環境が抑制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。ユーロ圏でも、景気の底入れが見込まれる一方で、低インフレ環境やE C Bの緩和政策が続くことから、金利は低位での推移を予想します。

為替相場は、米ドル・円では、日米金利差は米ドルの支援材料ですが、F R Bの慎重な姿勢を背景にレンジ相場を予想します。ユーロ・米ドルに関しても、米国、ユーロ圏ともに慎重な金融政策が継続することから、レンジ相場を予想します。

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 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

| 項 目 | 金 額 | 比 率 | 項 目 の 概 要 |
|---------------|-----|---------|--|
| (a) そ の 他 費 用 | 7円 | 0.038% | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：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 |
| （保 管 費 用） | (7) | (0.037) | |
| （そ の 他） | (0) | (0.001) | |
| 合 計 | 7 | 0.038 | |

期中の平均基準価額は17,744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12月18日から2019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 237,118 | 千米ドル 211,041 |
| | カ ナ ダ | 国 債 証 券 | 千カナダドル 14,012 | 千カナダドル 15,881 |
| | メ キ シ コ | 国 債 証 券 | 千メキシコペソ 89,136 | 千メキシコペソ 89,554 |
| | ユ ー ロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | ド イ ツ | 国 債 証 券 | 20,446 | 30,435 |
| | イ タ リ ア | 国 債 証 券 | 30,062 | 31,992 |
| | フ ラ ン ス | 国 債 証 券 | 41,083 | 35,251 |
| | オ ラ ン ダ | 国 債 証 券 | 4,653 | 6,453 |
| | ス ペ イ ン | 国 債 証 券 | 16,882 | 22,494 |
| | ベルギー | 国 債 証 券 | 6,308 | 5,023 |
| | オーストリア | 国 債 証 券 | 4,238 | 3,509 |
| フィンランド | 国 債 証 券 | 2,223 | 725 | |
| アイルランド | 国 債 証 券 | 1,637 | 2,094 | |
| 国 | イ ギ リ ス | 国 債 証 券 | 千英ポンド 17,673 | 千英ポンド 22,451 |
| | ス ウ ェ ー デ ン | 国 債 証 券 | 千スウェーデンクローナ 7,478 | 千スウェーデンクローナ 7,012 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|---------------|---------|-----------------------|-----------------------|
| 外 | ノ ル ウ ェ ー | 国 債 証 券 | 千ノルウェークローネ 4,912 | 千ノルウェークローネ 3,486 |
| | デ ン マ ー ク | 国 債 証 券 | 千デンマーククローネ 7,725 | 千デンマーククローネ 8,503 |
| | ポ ー ラ ン ド | 国 債 証 券 | 千ポーランドズロチ 6,066 | 千ポーランドズロチ 6,826 |
| | オ ー ス ト ラ リ ア | 国 債 証 券 | 千オーストラリアドル 6,849 | 千オーストラリアドル 8,893 |
| 国 | シ ン ガ ポ ー ル | 国 債 証 券 | 千シンガポールドル 2,281 | 千シンガポールドル 1,898 |
| | マ レ ー シ ア | 国 債 証 券 | 千マレーシアリングット 10,439 | 千マレーシアリングット 10,746 |
| | 南 ア フ リ カ | 国 債 証 券 | 千南アフリカランド 24,197 | 千南アフリカランド 17,148 |

※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 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2019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 | 額 面 金 額 | 期 | | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 末 | | |
|---------|------------------|------------------|------------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|----------|
| | | 評 価 額 | | | | 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 711,170 | 千米ドル 741,288 | 千円 81,215,588 | % 47.2 | % - | % 20.2 | % 17.2 | % 9.8 |
| カ ナ ダ | 千カナダドル 35,500 | 千カナダドル 38,573 | 3,209,295 | 1.9 | - | 0.9 | 0.7 | 0.3 |

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 |
| メ キ シ コ | 千メキシコペソ 241,000 | 千メキシコペソ 257,176 | 1,486,478 | 0.9 | — | 0.5 | 0.4 | — |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ド イ ツ | 63,000 | 78,385 | 9,563,778 | 5.6 | — | 3.9 | 1.2 | 0.5 |
| イ タ リ ア | 109,120 | 125,910 | 15,362,296 | 8.9 | — | 5.1 | 2.7 | 1.1 |
| フ ラ ン ス | 117,270 | 140,636 | 17,159,073 | 10.0 | — | 6.6 | 2.4 | 1.0 |
| オ ラ ン ダ | 21,400 | 25,565 | 3,119,239 | 1.8 | — | 1.1 | 0.6 | 0.1 |
| ス ペ イ ン | 61,550 | 75,673 | 9,232,969 | 5.4 | — | 3.5 | 1.4 | 0.4 |
| ベ ル ギ ー | 27,450 | 34,658 | 4,228,633 | 2.5 | — | 1.7 | 0.4 | 0.3 |
| オ ー ス ト リ ア | 17,750 | 21,765 | 2,655,644 | 1.5 | — | 1.1 | 0.4 | 0.1 |
| フ ィ ン ラ ン ド | 9,000 | 10,106 | 1,233,111 | 0.7 | — | 0.4 | 0.3 | 0.1 |
| ア イ ル ラ ン ド | 9,200 | 10,745 | 1,311,063 | 0.8 | — | 0.6 | 0.2 | — |
| イ ギ リ ス | 千英ポンド 58,020 | 千英ポンド 75,864 | 11,035,227 | 6.4 | — | 5.1 | 1.1 | 0.3 |
| ス ウ ェ ー デ ン | 千スウェーデンクローナ 43,800 | 千スウェーデンクローナ 49,622 | 580,091 | 0.3 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| ノ ル ウ ェ ー | 千ノルウェークローネ 31,200 | 千ノルウェークローネ 32,213 | 391,397 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | 0.0 |
| デ ン マ ー ク | 千デンマーククローネ 41,100 | 千デンマーククローネ 53,848 | 879,343 | 0.5 | — | 0.4 | 0.1 | 0.1 |
| ポ ー ラ ン ド | 千ポーランドズロチ 31,900 | 千ポーランドズロチ 34,087 | 976,939 | 0.6 | — | 0.3 | 0.1 | 0.2 |
| オ ー ス ト ラ リ ア | 千オーストラリアドル 38,250 | 千オーストラリアドル 43,919 | 3,307,106 | 1.9 | — | 1.3 | 0.5 | 0.1 |
| シ ン ガ ポ ー ル | 千シンガポールドル 8,050 | 千シンガポールドル 8,775 | 709,066 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| マ レ ー シ ア | 千マレーシアリンギット 28,200 | 千マレーシアリンギット 29,136 | 770,358 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | — |
| 南 ア フ リ カ | 千南アフリカランド 162,500 | 千南アフリカランド 132,294 | 1,006,764 | 0.6 | — | 0.5 | — | 0.1 |
| 合 計 | — | — | 169,433,468 | 98.6 | — | 53.8 | 30.1 | 14.6 |

※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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | |
|--------|------|-----------------------|---|-------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | | % | 千 米 ド ル | 千 米 ド ル | 千 円 | |
| (アメリカ) | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.125 | | 1.125 | 3,800 | 3,774 | 413,530 | 2021/2/28 |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | | 1.125 | 3,000 | 2,974 | 325,906 | 2021/6/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | | 1.125 | 4,500 | 4,458 | 488,474 | 2021/7/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | | 1.125 | 2,700 | 2,673 | 292,946 | 2021/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | | 1.125 | 2,100 | 2,079 | 227,775 | 2021/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.25 | | 1.25 | 3,600 | 3,579 | 392,197 | 2021/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.25 | | 1.25 | 4,500 | 4,463 | 489,014 | 2021/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.25 | | 1.25 | 3,000 | 2,952 | 323,493 | 2023/7/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 3,000 | 2,989 | 327,550 | 2021/1/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 2,400 | 2,389 | 261,814 | 2021/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 4,000 | 3,981 | 436,219 | 2021/5/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 4,000 | 3,966 | 434,610 | 2022/10/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 3,500 | 3,460 | 379,176 | 2023/6/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 2,500 | 2,470 | 270,626 | 2023/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 3,000 | 2,962 | 324,622 | 2023/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 2,600 | 2,526 | 276,777 | 2026/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | | 1.5 | 3,000 | 2,989 | 327,575 | 2022/1/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | | 1.5 | 5,800 | 5,774 | 632,618 | 2022/9/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | | 1.5 | 3,000 | 2,982 | 326,754 | 2023/2/28 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | | 1.5 | 3,000 | 2,982 | 326,754 | 2023/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | | 1.5 | 1,500 | 1,469 | 161,001 | 2026/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,500 | 3,498 | 383,250 | 2020/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 2,000 | 1,997 | 218,897 | 2022/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,400 | 3,395 | 372,038 | 2022/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,500 | 3,494 | 382,830 | 2022/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,000 | 2,993 | 327,961 | 2023/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,000 | 2,992 | 327,858 | 2023/5/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,000 | 2,990 | 327,652 | 2023/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 2,400 | 2,374 | 260,129 | 2026/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 6,050 | 5,980 | 655,225 | 2026/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 5,500 | 5,429 | 594,812 | 2026/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 9,650 | 9,420 | 1,032,144 | 2029/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 2,000 | 2,001 | 219,274 | 2020/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 10,500 | 10,507 | 1,151,188 | 2021/7/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,004 | 329,142 | 2021/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,005 | 329,296 | 2022/2/28 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 1,800 | 1,803 | 197,577 | 2022/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 2,400 | 2,404 | 263,457 | 2022/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 4,100 | 4,108 | 450,108 | 2022/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,006 | 329,347 | 2022/5/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,006 | 329,373 | 2022/6/30 |

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 | |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,005 | 329,296 | 2022/ 9 /30 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,006 | 329,347 | 2023/ 1 /31 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 5,700 | 5,709 | 625,516 | 2023/ 5 /15 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 11,800 | 11,809 | 1,293,818 | 2024/ 6 /30 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 850 | 850 | 93,184 | 2024/ 7 /31 |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 2,400 | 2,409 | 264,012 | 2022/ 1 /31 |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 2,000 | 2,008 | 220,095 | 2022/ 3 /31 |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 3,000 | 3,014 | 330,220 | 2022/ 4 /30 |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 3,000 | 3,015 | 330,349 | 2022/ 5 /31 |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 1,700 | 1,708 | 187,183 | 2022/ 7 /31 |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 4,800 | 4,825 | 528,640 | 2022/ 8 /31 |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 3,000 | 3,016 | 330,451 | 2022/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 1,800 | 1,810 | 198,409 | 2024/ 8 /31 |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 3,500 | 3,512 | 384,778 | 2026/ 6 /30 |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 3,200 | 3,210 | 351,769 | 2026/ 7 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 5,300 | 5,315 | 582,391 | 2020/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,010 | 329,784 | 2021/ 1 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,011 | 329,886 | 2021/ 2 /28 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,013 | 330,143 | 2021/ 5 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,015 | 330,400 | 2021/ 8 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,017 | 330,554 | 2021/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 4,300 | 4,327 | 474,089 | 2021/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,500 | 3,521 | 385,856 | 2021/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,100 | 3,121 | 341,997 | 2022/ 2 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,024 | 331,401 | 2022/ 7 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,500 | 3,531 | 386,905 | 2022/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,027 | 331,658 | 2022/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 5,500 | 5,552 | 608,370 | 2023/ 2 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 2,000 | 2,022 | 221,602 | 2024/ 4 /30 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,300 | 3,338 | 365,756 | 2024/ 5 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 2,500 | 2,528 | 277,024 | 2024/ 6 /30 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,500 | 3,541 | 387,983 | 2025/ 2 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 4,300 | 4,349 | 476,555 | 2025/ 8 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 7,000 | 7,077 | 775,428 | 2026/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 2,700 | 2,712 | 297,198 | 2021/ 1 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 1,700 | 1,711 | 187,474 | 2021/ 6 /30 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 4,000 | 4,028 | 441,355 | 2021/ 8 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 3,000 | 3,022 | 331,145 | 2021/ 9 /30 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 3,000 | 3,026 | 331,581 | 2021/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 4,500 | 4,547 | 498,219 | 2022/ 5 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 3,000 | 3,034 | 332,429 | 2022/ 6 /30 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 4,000 | 4,052 | 443,991 | 2022/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 3,100 | 3,147 | 344,863 | 2023/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 2,000 | 2,031 | 222,612 | 2024/ 2 /29 |

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. 125 | | 2. 125 | 6, 500 | 6, 606 | 723, 767 | 2024/ 3 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 125 | | 2. 125 | 3, 500 | 3, 559 | 389, 990 | 2024/ 7 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 125 | | 2. 125 | 4, 000 | 4, 069 | 445, 874 | 2024/ 9 /30 |
| | | US TREASURY N/B 2. 125 | | 2. 125 | 1, 800 | 1, 831 | 200, 705 | 2024/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 2. 125 | | 2. 125 | 4, 900 | 4, 989 | 546, 616 | 2025/ 5 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 125 | | 2. 125 | 5, 700 | 5, 806 | 636, 152 | 2026/ 5 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 4, 000 | 4, 025 | 441, 047 | 2021/ 2 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 3, 000 | 3, 021 | 330, 991 | 2021/ 3 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 4, 500 | 4, 533 | 496, 640 | 2021/ 4 /30 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 2, 800 | 2, 824 | 309, 404 | 2021/ 7 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 4, 300 | 4, 356 | 477, 254 | 2022/ 4 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 3, 000 | 3, 061 | 335, 459 | 2023/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 5, 200 | 5, 308 | 581, 551 | 2024/ 1 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 4, 800 | 4, 904 | 537, 309 | 2024/ 4 /30 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 1, 500 | 1, 535 | 168, 230 | 2024/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 6, 300 | 6, 448 | 706, 459 | 2024/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 3, 100 | 3, 174 | 347, 808 | 2024/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 4, 000 | 4, 100 | 449, 298 | 2025/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 7, 200 | 7, 387 | 809, 415 | 2026/ 3 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 4, 400 | 4, 525 | 495, 772 | 2027/ 2 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 5, 200 | 5, 351 | 586, 358 | 2027/ 8 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 5, 600 | 5, 764 | 631, 558 | 2027/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 2, 850 | 2, 813 | 308, 196 | 2046/ 8 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 25 | | 2. 25 | 4, 500 | 4, 440 | 486, 472 | 2049/ 8 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 375 | | 2. 375 | 2, 000 | 2, 014 | 220, 694 | 2020/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 375 | | 2. 375 | 5, 000 | 5, 042 | 552, 507 | 2021/ 3 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 375 | | 2. 375 | 2, 000 | 2, 017 | 221, 071 | 2021/ 4 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 375 | | 2. 375 | 3, 600 | 3, 656 | 400, 609 | 2022/ 3 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 375 | | 2. 375 | 1, 200 | 1, 224 | 134, 204 | 2023/ 1 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 375 | | 2. 375 | 3, 700 | 3, 797 | 416, 013 | 2024/ 2 /29 |
| | | US TREASURY N/B 2. 375 | | 2. 375 | 5, 600 | 5, 756 | 630, 695 | 2024/ 8 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 375 | | 2. 375 | 4, 900 | 5, 084 | 557, 101 | 2027/ 5 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 375 | | 2. 375 | 6, 200 | 6, 458 | 707, 557 | 2029/ 5 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 375 | | 2. 375 | 700 | 709 | 77, 782 | 2049/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 5 | | 2. 5 | 8, 900 | 8, 986 | 984, 530 | 2021/ 2 /28 |
| | | US TREASURY N/B 2. 5 | | 2. 5 | 1, 900 | 1, 931 | 211, 611 | 2022/ 1 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 5 | | 2. 5 | 3, 500 | 3, 560 | 390, 140 | 2022/ 2 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 5 | | 2. 5 | 5, 000 | 5, 139 | 563, 078 | 2023/ 8 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 5 | | 2. 5 | 5, 700 | 5, 883 | 644, 641 | 2024/ 5 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 5 | | 2. 5 | 4, 600 | 4, 768 | 522, 481 | 2025/ 1 /31 |
| | | US TREASURY N/B 2. 5 | | 2. 5 | 1, 400 | 1, 456 | 159, 603 | 2026/ 2 /28 |
| | | US TREASURY N/B 2. 5 | | 2. 5 | 4, 100 | 4, 248 | 465, 514 | 2045/ 2 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 5 | | 2. 5 | 2, 900 | 3, 006 | 329, 365 | 2046/ 2 /15 |
| | | US TREASURY N/B 2. 5 | | 2. 5 | 4, 100 | 4, 252 | 465, 900 | 2046/ 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 2.625 | | 2.625 | 1,500 | 1,513 | 165,765 | 2020/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.625 | | 2.625 | 500 | 506 | 55,494 | 2021/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.625 | | 2.625 | 4,000 | 4,055 | 444,300 | 2021/6/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.625 | | 2.625 | 4,000 | 4,057 | 444,573 | 2021/7/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.625 | | 2.625 | 3,000 | 3,056 | 334,842 | 2021/12/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.625 | | 2.625 | 4,000 | 4,116 | 450,976 | 2023/2/28 |
| | | US TREASURY N/B 2.625 | | 2.625 | 4,300 | 4,487 | 491,608 | 2025/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.625 | | 2.625 | 5,800 | 6,072 | 665,333 | 2025/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.625 | | 2.625 | 6,300 | 6,691 | 733,097 | 2029/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 4,000 | 4,068 | 445,772 | 2021/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 1,400 | 1,425 | 156,152 | 2021/9/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 4,900 | 5,068 | 555,339 | 2023/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 2,000 | 2,072 | 227,097 | 2023/7/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 5,000 | 5,185 | 568,171 | 2023/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 6,200 | 6,439 | 705,540 | 2023/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 5,100 | 5,308 | 581,586 | 2024/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 2,000 | 2,098 | 229,921 | 2025/2/28 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 5,000 | 5,256 | 575,874 | 2025/6/30 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 600 | 631 | 69,171 | 2025/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 4,800 | 5,124 | 561,385 | 2028/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 2,000 | 2,164 | 237,163 | 2042/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 2,800 | 3,028 | 331,764 | 2042/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 3,800 | 4,138 | 453,439 | 2047/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.75 | | 2.75 | 1,500 | 1,634 | 179,079 | 2047/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 4,000 | 4,089 | 447,997 | 2021/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 5,000 | 5,216 | 571,509 | 2023/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 2,000 | 2,088 | 228,792 | 2023/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 2,200 | 2,324 | 254,721 | 2025/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 1,100 | 1,162 | 127,417 | 2025/5/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 2,500 | 2,651 | 290,526 | 2025/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 4,500 | 4,853 | 531,768 | 2028/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 7,000 | 7,560 | 828,273 | 2028/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 3,000 | 3,314 | 363,088 | 2043/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 4,000 | 4,438 | 486,275 | 2045/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 3,600 | 4,008 | 439,219 | 2046/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.875 | | 2.875 | 900 | 1,008 | 110,444 | 2049/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 4,000 | 4,266 | 467,444 | 2025/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 3,100 | 3,307 | 362,402 | 2025/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 1,800 | 2,026 | 222,074 | 2042/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 4,000 | 4,525 | 495,861 | 2044/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 4,000 | 4,534 | 496,786 | 2045/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 4,200 | 4,768 | 522,488 | 2045/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 2,500 | 2,851 | 312,374 | 2047/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 2,200 | 2,508 | 274,795 | 2047/5/15 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | | |
|-------|------|-----------------------|---|-------|-------|-------|------------|------------|-----------|
| | | | | 利 | 率 | 額 | 評 価 額 | | 債 還 年 月 日 |
| | | | | | | | 面 | 金 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 3,100 | 3,542 | 388,113 | 2048/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 7,400 | 8,466 | 927,605 | 2048/8/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | 3,800 | 4,353 | 477,020 | 2049/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | 3,000 | 3,060 | 335,253 | 2021/5/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | 6,700 | 7,383 | 808,948 | 2028/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | 1,100 | 1,263 | 138,405 | 2041/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | 2,000 | 2,297 | 251,679 | 2042/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | 2,300 | 2,643 | 289,589 | 2043/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | 3,800 | 4,385 | 480,468 | 2044/8/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | 2,400 | 2,805 | 307,315 | 2048/5/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.375 | | 3.375 | 4,000 | 4,803 | 526,298 | 2044/5/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.375 | | 3.375 | 3,100 | 3,797 | 416,080 | 2048/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.5 | | 3.5 | 800 | 968 | 106,156 | 2039/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.625 | | 3.625 | 5,000 | 5,110 | 559,911 | 2021/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.625 | | 3.625 | 3,400 | 4,225 | 462,923 | 2043/8/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.625 | | 3.625 | 3,600 | 4,483 | 491,201 | 2044/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.75 | | 3.75 | 1,500 | 1,884 | 206,477 | 2041/8/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.75 | | 3.75 | 4,000 | 5,067 | 555,229 | 2043/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3.875 | | 3.875 | 1,500 | 1,912 | 209,494 | 2040/8/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.25 | | 4.25 | 1,000 | 1,330 | 145,757 | 2039/5/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.25 | | 4.25 | 600 | 803 | 87,978 | 2040/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.375 | | 4.375 | 500 | 671 | 73,572 | 2038/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.375 | | 4.375 | 700 | 947 | 103,809 | 2039/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.375 | | 4.375 | 1,400 | 1,901 | 208,374 | 2040/5/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.375 | | 4.375 | 1,800 | 2,453 | 268,834 | 2041/5/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.5 | | 4.5 | 750 | 1,002 | 109,806 | 2036/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.5 | | 4.5 | 200 | 272 | 29,896 | 2038/5/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.5 | | 4.5 | 1,000 | 1,372 | 150,396 | 2039/8/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.625 | | 4.625 | 4,200 | 5,871 | 643,278 | 2040/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 4.75 | | 4.75 | 1,500 | 2,139 | 234,377 | 2041/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 5 | | 5.0 | 500 | 714 | 78,258 | 2037/5/15 | |
| | | US TREASURY N/B 5.25 | | 5.25 | 500 | 638 | 69,964 | 2028/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 5.375 | | 5.375 | 320 | 431 | 47,253 | 2031/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 5.5 | | 5.5 | 500 | 645 | 70,691 | 2028/8/15 | |
| | | US TREASURY N/B 6 | | 6.0 | 1,000 | 1,245 | 136,462 | 2026/2/15 | |
| | | US TREASURY N/B 6.125 | | 6.125 | 1,000 | 1,316 | 144,225 | 2027/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 6.25 | | 6.25 | 800 | 929 | 101,794 | 2023/8/15 | |
| | | US TREASURY N/B 6.5 | | 6.5 | 500 | 652 | 71,505 | 2026/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 8 | | 8.0 | 1,300 | 1,453 | 159,274 | 2021/11/15 | |
| | 小 | 計 | | — | — | — | 81,215,588 | — | |
| (カナダ) | 国債証券 | CANADA-GOV' T 0.5 | | 0.5 | 2,000 | 1,948 | 162,136 | 2022/3/1 | |
| | | CANADA-GOV' T 0.75 | | 0.75 | 1,800 | 1,785 | 148,540 | 2020/9/1 | |
| | | CANADA-GOV' T 0.75 | | 0.75 | 2,000 | 1,976 | 164,428 | 2021/3/1 | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | | |
|---------|------|----------------------|---|------|---------|---------|-----------|------------|-----------|
| | | | | 利 | 率 | 額 | 評 価 額 | | 債 還 年 月 日 |
| | | | | | | | 面 | 金 | |
| | | CANADA-GOV T 0.75 | | 0.75 | 2,000 | 1,965 | 163,556 | 2021/9/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1 | | 1.0 | 3,000 | 2,946 | 245,137 | 2022/9/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1 | | 1.0 | 1,600 | 1,526 | 126,983 | 2027/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1.25 | | 1.25 | 600 | 576 | 47,985 | 2030/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1.5 | | 1.5 | 2,000 | 1,989 | 165,519 | 2023/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1.5 | | 1.5 | 1,000 | 993 | 82,667 | 2024/9/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1.5 | | 1.5 | 1,000 | 991 | 82,501 | 2026/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1.75 | | 1.75 | 1,100 | 1,102 | 91,743 | 2023/3/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2 | | 2.0 | 900 | 924 | 76,885 | 2028/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.25 | | 2.25 | 1,000 | 1,024 | 85,201 | 2024/3/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.25 | | 2.25 | 1,400 | 1,444 | 120,173 | 2025/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.25 | | 2.25 | 1,400 | 1,474 | 122,676 | 2029/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.5 | | 2.5 | 2,100 | 2,176 | 181,118 | 2024/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.75 | | 2.75 | 1,800 | 1,846 | 153,593 | 2022/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.75 | | 2.75 | 1,100 | 1,354 | 112,661 | 2048/12/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.75 | | 2.75 | 500 | 661 | 55,021 | 2064/12/1 | |
| | | CANADA-GOV T 3.25 | | 3.25 | 1,000 | 1,021 | 85,005 | 2021/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 3.5 | | 3.5 | 1,500 | 2,047 | 170,354 | 2045/12/1 | |
| | | CANADA-GOV T 4 | | 4.0 | 1,500 | 2,100 | 174,759 | 2041/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 5 | | 5.0 | 1,750 | 2,605 | 216,807 | 2037/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 5.75 | | 5.75 | 250 | 338 | 28,153 | 2029/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 5.75 | | 5.75 | 500 | 742 | 61,783 | 2033/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 8 | | 8.0 | 700 | 1,008 | 83,898 | 2027/6/1 | |
| | 小 | 計 | | - | - | - | 3,209,295 | - | |
| (メキシコ) | 国債証券 | MEXICAN BONOS 10 | | 10.0 | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 211,052 | 2024/12/5 | |
| | | MEXICAN BONOS 5.75 | | 5.75 | 20,000 | 19,058 | 110,157 | 2026/3/5 | |
| | | MEXICAN BONOS 6.5 | | 6.5 | 52,000 | 51,819 | 299,514 | 2022/6/9 | |
| | | MEXICAN BONOS 7.5 | | 7.5 | 25,000 | 26,059 | 150,625 | 2027/6/3 | |
| | | MEXICAN BONOS 7.75 | | 7.75 | 6,000 | 6,436 | 37,201 | 2031/5/29 | |
| | | MEXICAN BONOS 7.75 | | 7.75 | 11,000 | 11,859 | 68,545 | 2034/11/23 | |
| | | MEXICAN BONOS 8 | | 8.0 | 27,000 | 28,240 | 163,229 | 2023/12/7 | |
| | | MEXICAN BONOS 8.5 | | 8.5 | 28,000 | 31,311 | 180,980 | 2029/5/31 | |
| | | MEXICAN BONOS 8.5 | | 8.5 | 40,000 | 45,877 | 265,172 | 2038/11/18 | |
| | 小 | 計 | | - | - | - | 1,486,478 | - | |
| (ユ - ロ) | | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| (ドイツ) | 国債証券 | BUNDESUBL-173 0 | | - | 2,500 | 2,521 | 307,669 | 2021/4/9 | |
| | | BUNDESUBL-174 0 | | - | 3,000 | 3,035 | 370,327 | 2021/10/8 | |
| | | BUNDESUBL-176 0 | | - | 1,000 | 1,018 | 124,226 | 2022/10/7 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0 | | - | 3,400 | 3,507 | 427,996 | 2026/8/15 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0 | | - | 500 | 513 | 62,667 | 2029/8/15 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.25 | | 0.25 | 1,800 | 1,890 | 230,673 | 2027/2/15 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.25 | | 0.25 | 2,900 | 3,055 | 372,751 | 2028/8/15 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.25 | | 0.25 | 2,400 | 2,526 | 308,317 | 2029/2/15 | |

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 | 債 | 還 | 年 | 月 | 日 |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | 0.5 | | 2,500 | | | | | 2,636 | | | 321,633 | 2025/2/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | 0.5 | | 1,400 | | | | | 1,487 | | | 181,450 | 2026/2/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | 0.5 | | 1,500 | | | | | 1,607 | | | 196,093 | 2027/8/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | 0.5 | | 2,000 | | | | | 2,147 | | | 262,023 | 2028/2/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 1 | 1.0 | | 1,300 | | | | | 1,396 | | | 170,342 | 2024/8/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 1 | 1.0 | | 2,050 | | | | | 2,228 | | | 271,946 | 2025/8/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 1.25 | 1.25 | | 1,450 | | | | | 1,867 | | | 227,910 | 2048/8/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 1.5 | 1.5 | | 500 | | | | | 534 | | | 65,166 | 2023/2/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 1.5 | 1.5 | | 1,300 | | | | | 1,395 | | | 170,228 | 2023/5/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 1.5 | 1.5 | | 2,000 | | | | | 2,185 | | | 266,679 | 2024/5/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 1.75 | 1.75 | | 2,200 | | | | | 2,334 | | | 284,878 | 2022/7/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 1.75 | 1.75 | | 4,000 | | | | | 4,393 | | | 536,048 | 2024/2/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 2 | 2.0 | | 1,500 | | | | | 1,645 | | | 200,772 | 2023/8/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 2.25 | 2.25 | | 1,400 | | | | | 1,469 | | | 179,334 | 2021/9/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2.5 | | 500 | | | | | 517 | | | 63,104 | 2021/1/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2.5 | | 2,200 | | | | | 3,451 | | | 421,172 | 2044/7/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2.5 | | 2,100 | | | | | 3,367 | | | 410,809 | 2046/8/15 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 3.25 | 3.25 | | 1,200 | | | | | 2,045 | | | 249,611 | 2042/7/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 4 | 4.0 | | 1,800 | | | | | 3,042 | | | 371,207 | 2037/1/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 4.25 | 4.25 | | 950 | | | | | 1,734 | | | 211,657 | 2039/7/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 4.75 | 4.75 | | 1,600 | | | | | 2,309 | | | 281,813 | 2028/7/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 4.75 | 4.75 | | 4,300 | | | | | 7,380 | | | 900,502 | 2034/7/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 4.75 | 4.75 | | 1,150 | | | | | 2,260 | | | 275,787 | 2040/7/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 5.5 | 5.5 | | 900 | | | | | 1,480 | | | 180,665 | 2031/1/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 5.625 | 5.625 | | 1,000 | | | | | 1,492 | | | 182,138 | 2028/1/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 6.25 | 6.25 | | 1,200 | | | | | 1,536 | | | 187,524 | 2024/1/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 6.25 | 6.25 | | 500 | | | | | 834 | | | 101,809 | 2030/1/4 | | |
| | | | DEUTSCHLAND REP 6.5 | 6.5 | | 1,000 | | | | | 1,531 | | | 186,832 | 2027/7/4 | | |
| (イタリア) | 国債証券 | | BTPS 0.05 | 0.05 | | 1,000 | | | | | 1,003 | | | 122,417 | 2021/4/15 | | |
| | | | BTPS 0.35 | 0.35 | | 1,500 | | | | | 1,512 | | | 184,515 | 2021/11/1 | | |
| | | | BTPS 0.45 | 0.45 | | 1,500 | | | | | 1,513 | | | 184,678 | 2021/6/1 | | |
| | | | BTPS 0.65 | 0.65 | | 2,000 | | | | | 2,028 | | | 247,511 | 2023/10/15 | | |
| | | | BTPS 0.9 | 0.9 | | 2,250 | | | | | 2,298 | | | 280,471 | 2022/8/1 | | |
| | | | BTPS 0.95 | 0.95 | | 3,000 | | | | | 3,071 | | | 374,741 | 2023/3/1 | | |
| | | | BTPS 0.95 | 0.95 | | 2,000 | | | | | 2,048 | | | 249,922 | 2023/3/15 | | |
| | | | BTPS 1 | 1.0 | | 2,300 | | | | | 2,355 | | | 287,414 | 2022/7/15 | | |
| | | | BTPS 1.2 | 1.2 | | 1,000 | | | | | 1,027 | | | 125,317 | 2022/4/1 | | |
| | | | BTPS 1.25 | 1.25 | | 1,600 | | | | | 1,643 | | | 200,469 | 2026/12/1 | | |
| | | | BTPS 1.35 | 1.35 | | 2,000 | | | | | 2,060 | | | 251,440 | 2022/4/15 | | |
| | | | BTPS 1.45 | 1.45 | | 2,000 | | | | | 2,074 | | | 253,092 | 2022/9/15 | | |
| | | | BTPS 1.45 | 1.45 | | 1,800 | | | | | 1,880 | | | 229,386 | 2024/11/15 | | |
| | | | BTPS 1.45 | 1.45 | | 1,000 | | | | | 1,041 | | | 127,084 | 2025/5/15 | | |
| | | | BTPS 1.5 | 1.5 | | 2,700 | | | | | 2,818 | | | 343,895 | 2025/6/1 | | |
| | | | BTPS 1.6 | 1.6 | | 1,200 | | | | | 1,261 | | | 153,905 | 2026/6/1 | | |

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 | 債 | 還 | 年 | 月 | 日 |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | BTPS 1.65 | | 1.65 | | 2,400 | | 2,458 | | 299,980 | | 2032/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 1.85 | | 1.85 | | 1,000 | | 1,061 | | 129,500 | | 2024/5/15 | | | | | |
| | | BTPS 2 | | 2.0 | | 2,300 | | 2,469 | | 301,310 | | 2025/12/1 | | | | | |
| | | BTPS 2 | | 2.0 | | 1,600 | | 1,724 | | 210,384 | | 2028/2/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.05 | | 2.05 | | 1,500 | | 1,617 | | 197,319 | | 2027/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.1 | | 2.1 | | 1,000 | | 1,079 | | 131,713 | | 2026/7/15 | | | | | |
| | | BTPS 2.15 | | 2.15 | | 500 | | 522 | | 63,689 | | 2021/12/15 | | | | | |
| | | BTPS 2.2 | | 2.2 | | 1,000 | | 1,088 | | 132,867 | | 2027/6/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.25 | | 2.25 | | 1,200 | | 1,277 | | 155,896 | | 2036/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.3 | | 2.3 | | 600 | | 625 | | 76,375 | | 2021/10/15 | | | | | |
| | | BTPS 2.45 | | 2.45 | | 1,100 | | 1,213 | | 148,011 | | 2033/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.5 | | 2.5 | | 600 | | 656 | | 80,083 | | 2024/12/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.5 | | 2.5 | | 1,100 | | 1,211 | | 147,782 | | 2025/11/15 | | | | | |
| | | BTPS 2.7 | | 2.7 | | 2,050 | | 2,254 | | 275,057 | | 2047/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.8 | | 2.8 | | 300 | | 343 | | 41,867 | | 2028/12/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.8 | | 2.8 | | 900 | | 960 | | 117,244 | | 2067/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.95 | | 2.95 | | 1,000 | | 1,150 | | 140,366 | | 2038/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 3 | | 3.0 | | 3,500 | | 4,075 | | 497,265 | | 2029/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.1 | | 3.1 | | 1,700 | | 1,979 | | 241,474 | | 2040/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.25 | | 3.25 | | 1,500 | | 1,807 | | 220,503 | | 2046/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.35 | | 3.35 | | 850 | | 1,029 | | 125,582 | | 2035/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.45 | | 3.45 | | 1,600 | | 1,987 | | 242,526 | | 2048/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.5 | | 3.5 | | 1,900 | | 2,304 | | 281,187 | | 2030/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.75 | | 3.75 | | 2,500 | | 2,621 | | 319,852 | | 2021/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.75 | | 3.75 | | 2,000 | | 2,108 | | 257,255 | | 2021/5/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.75 | | 3.75 | | 3,200 | | 3,401 | | 415,001 | | 2021/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.75 | | 3.75 | | 2,000 | | 2,298 | | 280,427 | | 2024/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.85 | | 3.85 | | 400 | | 528 | | 64,439 | | 2049/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 4 | | 4.0 | | 2,100 | | 2,739 | | 334,263 | | 2037/2/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.5 | | 4.5 | | 2,300 | | 2,627 | | 320,617 | | 2023/5/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.5 | | 4.5 | | 3,000 | | 3,508 | | 428,020 | | 2024/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.5 | | 4.5 | | 1,800 | | 2,207 | | 269,306 | | 2026/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.75 | | 4.75 | | 2,600 | | 2,815 | | 343,501 | | 2021/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.75 | | 4.75 | | 2,500 | | 2,901 | | 354,066 | | 2023/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.75 | | 4.75 | | 2,500 | | 3,259 | | 397,630 | | 2028/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.75 | | 4.75 | | 1,600 | | 2,359 | | 287,873 | | 2044/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 5 | | 5.0 | | 2,000 | | 2,221 | | 271,013 | | 2022/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 5 | | 5.0 | | 1,000 | | 1,224 | | 149,437 | | 2025/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 5 | | 5.0 | | 2,070 | | 2,946 | | 359,547 | | 2034/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 5 | | 5.0 | | 1,800 | | 2,658 | | 324,320 | | 2039/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 5 | | 5.0 | | 1,700 | | 2,512 | | 306,533 | | 2040/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 5.5 | | 5.5 | | 1,200 | | 1,375 | | 167,865 | | 2022/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 5.5 | | 5.5 | | 2,000 | | 2,307 | | 281,572 | | 2022/11/1 | | | | | |
| | | BTPS 5.75 | | 5.75 | | 1,700 | | 2,536 | | 309,505 | | 2033/2/1 | | | | | |

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 6 | 6.0 | 2,700 | 4,008 | 489,113 | 2031/5/1 | |
| | | BTPS 6.5 | 6.5 | 3,700 | 5,233 | 638,553 | 2027/11/1 | |
| | | BTPS 7.25 | 7.25 | 400 | 569 | 69,502 | 2026/11/1 | |
| | | BTPS 9 | 9.0 | 300 | 400 | 48,814 | 2023/11/1 | |
| (フランス) | 国債証券 | FRANCE O. A. T. 0 | — | 3,000 | 3,021 | 368,712 | 2021/2/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | — | 4,200 | 4,237 | 517,012 | 2021/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | — | 2,000 | 2,027 | 247,375 | 2022/2/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | — | 2,200 | 2,233 | 272,534 | 2022/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | — | 2,000 | 2,038 | 248,722 | 2023/3/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | — | 5,000 | 5,105 | 622,873 | 2024/3/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | — | 2,200 | 2,243 | 273,688 | 2025/3/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | — | 4,000 | 3,993 | 487,278 | 2029/11/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0.25 | 0.25 | 2,400 | 2,481 | 302,785 | 2026/11/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0.5 | 0.5 | 2,900 | 3,038 | 370,763 | 2025/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0.5 | 0.5 | 3,500 | 3,676 | 448,604 | 2026/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0.5 | 0.5 | 3,300 | 3,464 | 422,668 | 2029/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0.75 | 0.75 | 3,300 | 3,542 | 432,218 | 2028/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 0.75 | 0.75 | 1,700 | 1,825 | 222,682 | 2028/11/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 1 | 1.0 | 2,050 | 2,212 | 269,945 | 2025/11/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 1 | 1.0 | 2,500 | 2,723 | 332,333 | 2027/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 1.25 | 1.25 | 1,700 | 1,932 | 235,843 | 2034/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 1.25 | 1.25 | 2,400 | 2,727 | 332,809 | 2036/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 1.5 | 1.5 | 3,650 | 4,229 | 516,047 | 2031/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 1.75 | 1.75 | 4,000 | 4,322 | 527,405 | 2023/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 1.75 | 1.75 | 2,300 | 2,549 | 311,036 | 2024/11/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 1.75 | 1.75 | 2,900 | 3,578 | 436,639 | 2039/6/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 1.75 | 1.75 | 800 | 1,038 | 126,730 | 2066/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 2 | 2.0 | 3,000 | 3,960 | 483,163 | 2048/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 2.25 | 2.25 | 1,900 | 2,056 | 250,923 | 2022/10/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 2.25 | 2.25 | 3,400 | 3,816 | 465,676 | 2024/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 2.5 | 2.5 | 3,500 | 4,399 | 536,829 | 2030/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 2.75 | 2.75 | 4,050 | 4,992 | 609,097 | 2027/10/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 3 | 3.0 | 5,000 | 5,431 | 662,666 | 2022/4/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 3.25 | 3.25 | 2,500 | 2,681 | 327,212 | 2021/10/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 3.25 | 3.25 | 2,200 | 3,529 | 430,615 | 2045/5/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 3.5 | 3.5 | 2,500 | 3,110 | 379,457 | 2026/4/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 3.75 | 3.75 | 3,400 | 3,602 | 439,566 | 2021/4/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 4 | 4.0 | 2,000 | 3,288 | 401,195 | 2038/10/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 4 | 4.0 | 1,170 | 2,294 | 279,993 | 2055/4/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 4 | 4.0 | 1,400 | 2,873 | 350,635 | 2060/4/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 4.25 | 4.25 | 3,000 | 3,560 | 434,448 | 2023/10/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 4.5 | 4.5 | 2,900 | 5,223 | 637,277 | 2041/4/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 4.75 | 4.75 | 2,200 | 3,670 | 447,870 | 2035/4/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 5.5 | 5.5 | 2,750 | 4,189 | 511,179 | 2029/4/25 | |

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. 5. 75 | 5. 75 | 2, 800 | 4, 800 | 585, 676 | 2032/10/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 6 | 6. 0 | 3, 000 | 4, 123 | 503, 082 | 2025/10/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 8. 5 | 8. 5 | 600 | 785 | 95, 794 | 2023/ 4 /25 | |
| (オランダ) | 国債証券 | NETHERLANDS GOVT 0 | — | 1, 800 | 1, 823 | 222, 435 | 2022/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0 | — | 2, 000 | 2, 043 | 249, 320 | 2024/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 25 | 0. 25 | 1, 700 | 1, 764 | 215, 228 | 2025/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 25 | 0. 25 | 300 | 311 | 38, 024 | 2029/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 5 | 0. 5 | 1, 500 | 1, 586 | 193, 553 | 2026/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 5 | 0. 5 | 600 | 634 | 77, 439 | 2040/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 75 | 0. 75 | 1, 400 | 1, 511 | 184, 385 | 2027/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 75 | 0. 75 | 1, 200 | 1, 301 | 158, 843 | 2028/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 1. 75 | 1. 75 | 1, 600 | 1, 735 | 211, 739 | 2023/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 2 | 2. 0 | 1, 000 | 1, 115 | 136, 127 | 2024/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 2. 25 | 2. 25 | 1, 500 | 1, 612 | 196, 746 | 2022/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 2. 5 | 2. 5 | 1, 000 | 1, 329 | 162, 161 | 2033/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 2. 75 | 2. 75 | 1, 200 | 1, 987 | 242, 436 | 2047/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 3. 25 | 3. 25 | 800 | 849 | 103, 624 | 2021/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 3. 75 | 3. 75 | 700 | 795 | 97, 029 | 2023/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 3. 75 | 3. 75 | 1, 300 | 2, 308 | 281, 607 | 2042/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 4 | 4. 0 | 1, 100 | 1, 827 | 223, 015 | 2037/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 5. 5 | 5. 5 | 700 | 1, 028 | 125, 521 | 2028/ 1 /15 | |
| (スペイン) | 国債証券 | SPANISH GOV' T 0. 05 | 0. 05 | 1, 100 | 1, 105 | 134, 931 | 2021/ 1 /31 | |
| | | SPANISH GOV' T 0. 25 | 0. 25 | 3, 000 | 3, 049 | 372, 069 | 2024/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 0. 4 | 0. 4 | 2, 000 | 2, 036 | 248, 461 | 2022/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 0. 45 | 0. 45 | 500 | 511 | 62, 375 | 2022/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 0. 75 | 0. 75 | 2, 000 | 2, 038 | 248, 724 | 2021/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 3 | 1. 3 | 2, 700 | 2, 916 | 355, 899 | 2026/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 4 | 1. 4 | 2, 000 | 2, 185 | 266, 613 | 2028/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 4 | 1. 4 | 1, 600 | 1, 748 | 213, 310 | 2028/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 45 | 1. 45 | 600 | 656 | 80, 143 | 2027/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 45 | 1. 45 | 2, 900 | 3, 185 | 388, 610 | 2029/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 5 | 1. 5 | 1, 200 | 1, 315 | 160, 510 | 2027/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 6 | 1. 6 | 2, 200 | 2, 392 | 291, 898 | 2025/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 85 | 1. 85 | 400 | 459 | 56, 119 | 2035/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 95 | 1. 95 | 400 | 447 | 54, 610 | 2026/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 95 | 1. 95 | 1, 700 | 1, 956 | 238, 766 | 2030/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 2. 15 | 2. 15 | 2, 000 | 2, 248 | 274, 341 | 2025/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 2. 35 | 2. 35 | 2, 200 | 2, 674 | 326, 283 | 2033/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 2. 7 | 2. 7 | 1, 750 | 2, 342 | 285, 816 | 2048/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 2. 75 | 2. 75 | 2, 100 | 2, 391 | 291, 787 | 2024/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 2. 9 | 2. 9 | 1, 400 | 1, 926 | 235, 084 | 2046/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 3. 45 | 3. 45 | 1, 100 | 1, 759 | 214, 646 | 2066/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 3. 8 | 3. 8 | 1, 900 | 2, 226 | 271, 701 | 2024/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 4. 2 | 4. 2 | 1, 650 | 2, 531 | 308, 924 | 2037/ 1 /31 | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | | 末 | | |
|----------|------|---------------------|---|------|-------|-------|---------|------------|-------------|-----------|
| | | | | 利 | 率 | 額 | 面 | 評 価 額 | | 債 還 年 月 日 |
| | | | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | | 4.4 | 2,000 | 2,356 | 287,511 | 2023/10/31 | | |
| | | | | 4.65 | 1,800 | 2,268 | 276,780 | 2025/7/30 | | |
| | | | | 4.7 | 1,800 | 3,067 | 374,251 | 2041/7/30 | | |
| | | | | 4.8 | 2,000 | 2,409 | 293,944 | 2024/1/31 | | |
| | | | | 4.9 | 1,500 | 2,587 | 315,688 | 2040/7/30 | | |
| | | | | 5.15 | 1,500 | 2,131 | 260,024 | 2028/10/31 | | |
| | | | | 5.15 | 1,200 | 2,231 | 272,217 | 2044/10/31 | | |
| | | | | 5.4 | 2,250 | 2,650 | 323,382 | 2023/1/31 | | |
| | | | | 5.5 | 2,700 | 2,919 | 356,248 | 2021/4/30 | | |
| | | | | 5.75 | 1,500 | 2,444 | 298,211 | 2032/7/30 | | |
| | | | | 5.85 | 2,200 | 2,492 | 304,068 | 2022/1/31 | | |
| | | | | 5.9 | 500 | 690 | 84,250 | 2026/7/30 | | |
| | | | | 6.0 | 2,200 | 3,317 | 404,761 | 2029/1/31 | | |
| (ベルギー) | 国債証券 | BELGIAN 0326 4 | | 4.0 | 700 | 1,028 | 125,503 | 2032/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0.8 | | 0.8 | 1,300 | 1,382 | 168,645 | 2025/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0.8 | | 0.8 | 700 | 751 | 91,634 | 2027/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0.8 | | 0.8 | 500 | 537 | 65,619 | 2028/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0291 5.5 | | 5.5 | 2,000 | 2,941 | 358,911 | 2028/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0304 5 | | 5.0 | 1,600 | 2,710 | 330,695 | 2035/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0308 4 | | 4.0 | 700 | 774 | 94,473 | 2022/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0320 4.25 | | 4.25 | 1,500 | 2,596 | 316,782 | 2041/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0321 4.25 | | 4.25 | 4,300 | 4,677 | 570,706 | 2021/9/28 | | |
| | | BELGIAN 0324 4.5 | | 4.5 | 1,000 | 1,302 | 158,965 | 2026/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0325 4.25 | | 4.25 | 1,700 | 1,931 | 235,673 | 2022/9/28 | | |
| | | BELGIAN 0328 2.25 | | 2.25 | 1,500 | 1,649 | 201,226 | 2023/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0332 2.6 | | 2.6 | 500 | 569 | 69,448 | 2024/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0333 3 | | 3.0 | 1,500 | 2,080 | 253,821 | 2034/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0338 0.5 | | 0.5 | 1,000 | 1,043 | 127,325 | 2024/10/22 | | |
| | | BELGIAN 0338 2.25 | | 2.25 | 500 | 707 | 86,380 | 2057/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0344 1.45 | | 1.45 | 400 | 465 | 56,831 | 2037/6/22 | | |
| | | BELGIAN 1 | | 1.0 | 1,400 | 1,515 | 184,936 | 2026/6/22 | | |
| | | BELGIAN 1 | | 1.0 | 1,300 | 1,430 | 174,477 | 2031/6/22 | | |
| | | BELGIAN 1.25 | | 1.25 | 400 | 453 | 55,363 | 2033/4/22 | | |
| | | BELGIAN 1.6 | | 1.6 | 1,150 | 1,397 | 170,528 | 2047/6/22 | | |
| | | BELGIAN 1.9 | | 1.9 | 500 | 623 | 76,081 | 2038/6/22 | | |
| | | BELGIAN 2.15 | | 2.15 | 500 | 711 | 86,828 | 2066/6/22 | | |
| | | BELGIAN 3.75 | | 3.75 | 800 | 1,375 | 167,768 | 2045/6/22 | | |
| (オーストリア) | 国債証券 | REP OF AUSTRIA 0 | | — | 1,100 | 1,121 | 136,778 | 2023/7/15 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.5 | | 0.5 | 1,300 | 1,368 | 167,002 | 2027/4/20 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.5 | | 0.5 | 850 | 894 | 109,083 | 2029/2/20 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.75 | | 0.75 | 900 | 963 | 117,512 | 2026/10/20 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.75 | | 0.75 | 200 | 214 | 26,195 | 2028/2/20 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 1.2 | | 1.2 | 2,000 | 2,182 | 266,279 | 2025/10/20 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 1.5 | | 1.5 | 1,000 | 1,248 | 152,297 | 2047/2/20 | | |

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 1.5 | | 1.5 | | 200 | | 262 | 32,009 | 2086/11/2 |
| | | REP OF AUSTRIA 1.65 | | 1.65 | | 1,100 | | 1,211 | 147,830 | 2024/10/21 |
| | | REP OF AUSTRIA 1.75 | | 1.75 | | 1,000 | | 1,087 | 132,744 | 2023/10/20 |
| | | REP OF AUSTRIA 2.4 | | 2.4 | | 600 | | 787 | 96,126 | 2034/5/23 |
| | | REP OF AUSTRIA 3.15 | | 3.15 | | 600 | | 979 | 119,485 | 2044/6/20 |
| | | REP OF AUSTRIA 3.4 | | 3.4 | | 1,100 | | 1,229 | 149,978 | 2022/11/22 |
| | | REP OF AUSTRIA 3.5 | | 3.5 | | 1,000 | | 1,072 | 130,809 | 2021/9/15 |
| | | REP OF AUSTRIA 3.65 | | 3.65 | | 1,000 | | 1,100 | 134,265 | 2022/4/20 |
| | | REP OF AUSTRIA 3.8 | | 3.8 | | 500 | | 1,074 | 131,047 | 2062/1/26 |
| | | REP OF AUSTRIA 4.15 | | 4.15 | | 1,300 | | 2,149 | 262,249 | 2037/3/15 |
| | | REP OF AUSTRIA 4.85 | | 4.85 | | 1,000 | | 1,325 | 161,758 | 2026/3/15 |
| | | REP OF AUSTRIA 6.25 | | 6.25 | | 1,000 | | 1,493 | 182,191 | 2027/7/15 |
| (フィンランド) | 国債証券 | FINNISH GOV'T 0 | | — | | 400 | | 405 | 49,489 | 2022/4/15 |
| | | FINNISH GOV'T 0.5 | | 0.5 | | 400 | | 421 | 51,444 | 2028/9/15 |
| | | FINNISH GOV'T 0.5 | | 0.5 | | 1,400 | | 1,476 | 180,087 | 2029/9/15 |
| | | FINNISH GOV'T 0.75 | | 0.75 | | 500 | | 539 | 65,863 | 2031/4/15 |
| | | FINNISH GOV'T 1.125 | | 1.125 | | 200 | | 226 | 27,610 | 2034/4/15 |
| | | FINNISH GOV'T 1.5 | | 1.5 | | 1,000 | | 1,069 | 130,437 | 2023/4/15 |
| | | FINNISH GOV'T 1.625 | | 1.625 | | 1,000 | | 1,061 | 129,483 | 2022/9/15 |
| | | FINNISH GOV'T 2 | | 2.0 | | 1,000 | | 1,107 | 135,184 | 2024/4/15 |
| | | FINNISH GOV'T 2.625 | | 2.625 | | 500 | | 748 | 91,314 | 2042/7/4 |
| | | FINNISH GOV'T 2.75 | | 2.75 | | 600 | | 748 | 91,345 | 2028/7/4 |
| | | FINNISH GOV'T 3.5 | | 3.5 | | 1,000 | | 1,055 | 128,737 | 2021/4/15 |
| FINNISH GOV'T 4 | | 4.0 | | 1,000 | | 1,246 | 152,113 | 2025/7/4 | | |
| (アイルランド) | 国債証券 | IRISH GOVT 0 | | — | | 400 | | 405 | 49,477 | 2022/10/18 |
| | | IRISH GOVT 0.8 | | 0.8 | | 700 | | 720 | 87,894 | 2022/3/15 |
| | | IRISH GOVT 0.9 | | 0.9 | | 700 | | 757 | 92,384 | 2028/5/15 |
| | | IRISH GOVT 1 | | 1.0 | | 1,000 | | 1,077 | 131,517 | 2026/5/15 |
| | | IRISH GOVT 1.1 | | 1.1 | | 1,100 | | 1,212 | 147,985 | 2029/5/15 |
| | | IRISH GOVT 1.5 | | 1.5 | | 400 | | 472 | 57,606 | 2050/5/15 |
| | | IRISH GOVT 1.7 | | 1.7 | | 300 | | 361 | 44,056 | 2037/5/15 |
| | | IRISH GOVT 2 | | 2.0 | | 1,000 | | 1,307 | 159,519 | 2045/2/18 |
| | | IRISH GOVT 2.4 | | 2.4 | | 600 | | 744 | 90,777 | 2030/5/15 |
| | | IRISH GOVT 3.4 | | 3.4 | | 1,000 | | 1,163 | 141,902 | 2024/3/18 |
| | | IRISH GOVT 3.9 | | 3.9 | | 500 | | 571 | 69,783 | 2023/3/20 |
| IRISH GOVT 5.4 | | 5.4 | | 1,500 | | 1,951 | 238,159 | 2025/3/13 | | |
| 小 | | 計 | | — | | — | | — | 63,865,811 | — |
| (イギリス) | 国債証券 | UK TSY GILT 0.5 | | 0.5 | | 千英ポンド 1,800 | | 千英ポンド 1,796 | 261,306 | 2022/7/22 |
| | | UK TSY GILT 0.625 | | 0.625 | | 1,000 | | 998 | 145,185 | 2025/6/7 |
| | | UK TSY GILT 0.75 | | 0.75 | | 750 | | 753 | 109,625 | 2023/7/22 |
| | | UK TSY GILT 0.875 | | 0.875 | | 700 | | 703 | 102,353 | 2029/10/22 |
| | | UK TSY GILT 1 | | 1.0 | | 1,000 | | 1,015 | 147,761 | 2024/4/22 |
| | | UK TSY GILT 1.25 | | 1.25 | | 1,500 | | 1,563 | 227,408 | 2027/7/22 |

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 1.5 | 1.5 | 1,000 | 1,055 | 153,573 | 2026/7/22 | |
| | | UK TSY GILT 1.5 | 1.5 | 1,700 | 1,773 | 257,949 | 2047/7/22 | |
| | | UK TSY GILT 1.625 | 1.625 | 2,000 | 2,152 | 313,029 | 2028/10/22 | |
| | | UK TSY GILT 1.625 | 1.625 | 100 | 110 | 16,074 | 2054/10/22 | |
| | | UK TSY GILT 1.625 | 1.625 | 450 | 531 | 77,276 | 2071/10/22 | |
| | | UK TSY GILT 1.75 | 1.75 | 3,000 | 3,094 | 450,099 | 2022/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 1.75 | 1.75 | 2,600 | 2,821 | 410,437 | 2037/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 1.75 | 1.75 | 1,650 | 1,823 | 265,200 | 2049/1/22 | |
| | | UK TSY GILT 2 | 2.0 | 1,100 | 1,186 | 172,579 | 2025/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 2.25 | 2.25 | 2,700 | 2,863 | 416,495 | 2023/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 2.5 | 2.5 | 1,600 | 2,335 | 339,748 | 2065/7/22 | |
| | | UK TSY GILT 2.75 | 2.75 | 1,700 | 1,867 | 271,673 | 2024/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 3.25 | 3.25 | 1,600 | 2,239 | 325,821 | 2044/1/22 | |
| | | UK TSY GILT 3.5 | 3.5 | 2,550 | 3,740 | 544,099 | 2045/1/22 | |
| | | UK TSY GILT 3.5 | 3.5 | 1,450 | 2,682 | 390,131 | 2068/7/22 | |
| | | UK TSY GILT 3.75 | 3.75 | 1,500 | 1,581 | 229,998 | 2021/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 3.75 | 3.75 | 1,600 | 2,664 | 387,612 | 2052/7/22 | |
| | | UK TSY GILT 4 | 4.0 | 1,500 | 1,613 | 234,663 | 2022/3/7 | |
| | | UK TSY GILT 4 | 4.0 | 1,700 | 3,216 | 467,820 | 2060/1/22 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,100 | 1,405 | 204,404 | 2027/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,400 | 1,939 | 282,089 | 2032/6/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,050 | 1,534 | 223,220 | 2036/3/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,350 | 2,064 | 300,331 | 2039/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,300 | 2,015 | 293,149 | 2040/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,500 | 2,501 | 363,799 | 2046/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,400 | 2,423 | 352,583 | 2049/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,700 | 3,194 | 464,630 | 2055/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.5 | 4.5 | 1,100 | 1,614 | 234,815 | 2034/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.5 | 4.5 | 1,350 | 2,213 | 321,934 | 2042/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.75 | 4.75 | 1,450 | 2,042 | 297,150 | 2030/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.75 | 4.75 | 1,200 | 1,925 | 280,110 | 2038/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 5 | 5.0 | 1,600 | 1,958 | 284,880 | 2025/3/7 | |
| | | UK TSY GILT 6 | 6.0 | 950 | 1,384 | 201,410 | 2028/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 8 | 8.0 | 1,320 | 1,462 | 212,791 | 2021/6/7 | |
| | 小 | 計 | — | — | — | 11,035,227 | — | |
| (スウェーデン) | 国債証券 | SWEDISH GOVRNMNT 0.75 | 0.75 | 4,000 | 4,271 | 49,934 | 2028/5/12 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 1 | 1.0 | 7,400 | 7,982 | 93,316 | 2026/11/12 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 1.5 | 1.5 | 7,000 | 7,488 | 87,540 | 2023/11/13 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 2.5 | 2.5 | 5,000 | 5,740 | 67,109 | 2025/5/12 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 3.5 | 8,000 | 8,754 | 102,337 | 2022/6/1 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 3.5 | 4,600 | 7,191 | 84,065 | 2039/3/30 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 5 | 5.0 | 7,800 | 8,193 | 95,786 | 2020/12/1 | |
| | 小 | 計 | — | — | — | 580,091 | — | |

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 | |
| (ノルウェー) | 国債証券 | NORWEGIAN GOV T 1.5 | 1.5 | 3,500 | 3,533 | 42,937 | 2026/2/19 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 1.75 | 1.75 | 5,000 | 5,110 | 62,092 | 2025/3/13 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 1.75 | 1.75 | 2,700 | 2,766 | 33,615 | 2029/9/6 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 2 | 2.0 | 6,000 | 6,136 | 74,553 | 2023/5/24 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 2 | 2.0 | 4,000 | 4,178 | 50,767 | 2028/4/26 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 3 | 3.0 | 4,000 | 4,280 | 52,006 | 2024/3/14 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 3.75 | 3.75 | 6,000 | 6,207 | 75,424 | 2021/5/25 | |
| | | 小 計 | | | | — | — | 391,397 |
| (デンマーク) | 国債証券 | DENMARK - BULLET 0.25 | 0.25 | 3,500 | 3,531 | 57,675 | 2020/11/15 | |
| | | DENMARK - BULLET 0.5 | 0.5 | 8,100 | 8,673 | 141,637 | 2027/11/15 | |
| | | DENMARK - BULLET 1.5 | 1.5 | 5,000 | 5,413 | 88,402 | 2023/11/15 | |
| | | DENMARK - BULLET 1.75 | 1.75 | 6,000 | 6,805 | 111,128 | 2025/11/15 | |
| | | DENMARK - BULLET 3 | 3.0 | 7,000 | 7,498 | 122,448 | 2021/11/15 | |
| | | DENMARK - BULLET 4.5 | 4.5 | 11,500 | 21,925 | 358,049 | 2039/11/15 | |
| 小 計 | | | | — | — | 879,343 | — | |
| (ポーランド) | 国債証券 | POLAND GOVT BOND 1.75 | 1.75 | 3,000 | 3,015 | 86,427 | 2021/7/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 2 | 2.0 | 2,000 | 2,013 | 57,692 | 2021/4/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 2.5 | 2.5 | 4,500 | 4,659 | 133,535 | 2026/7/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 2.5 | 2.5 | 3,000 | 3,099 | 88,817 | 2027/7/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 3.25 | 3.25 | 8,900 | 9,523 | 272,929 | 2025/7/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 4 | 4.0 | 2,700 | 2,943 | 84,346 | 2023/10/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 5.75 | 5.75 | 4,000 | 4,306 | 123,409 | 2021/10/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 5.75 | 5.75 | 2,400 | 2,670 | 76,537 | 2022/9/23 | |
| | | POLAND GOVT BOND 5.75 | 5.75 | 1,400 | 1,857 | 53,244 | 2029/4/25 | |
| 小 計 | | | | — | — | 976,939 | — | |
| (オーストラリア) | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVT. 1.5 | 1.5 | 1,400 | 1,438 | 108,297 | 2031/6/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 1.75 | 1.75 | 300 | 302 | 22,770 | 2020/11/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2 | 2.0 | 1,000 | 1,021 | 76,952 | 2021/12/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 2.25 | 2,000 | 2,084 | 156,992 | 2022/11/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 2.25 | 3,000 | 3,264 | 245,801 | 2028/5/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.5 | 2.5 | 1,350 | 1,519 | 114,392 | 2030/5/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 2,500 | 2,707 | 203,901 | 2024/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 2,200 | 2,472 | 186,152 | 2027/11/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 1,800 | 2,047 | 154,143 | 2028/11/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 1,300 | 1,487 | 112,005 | 2029/11/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 800 | 943 | 71,041 | 2035/6/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3 | 3.0 | 1,100 | 1,394 | 104,993 | 2047/3/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 3.25 | 1,900 | 2,130 | 160,453 | 2025/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 3.25 | 2,100 | 2,480 | 186,783 | 2029/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 3.25 | 1,150 | 1,459 | 109,915 | 2039/6/21 | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | |
|----------|------|-----------------------|-------|----------------------|----------------------|-------------|-------------|-----------|
| | | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.75 | 3.75 | 1,200 | 1,615 | 121,654 | 2037/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 4.25 | 4.25 | 2,150 | 2,578 | 194,144 | 2026/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 4.5 | 4.5 | 1,400 | 1,946 | 146,533 | 2033/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 4.75 | 4.75 | 2,300 | 2,905 | 218,790 | 2027/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 5.5 | 5.5 | 2,000 | 2,309 | 173,920 | 2023/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 5.75 | 5.75 | 2,800 | 2,993 | 225,373 | 2021/5/15 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 5.75 | 5.75 | 2,500 | 2,816 | 212,091 | 2022/7/15 | |
| | 小 | 計 | — | — | — | 3,307,106 | — | |
| (シンガポール) | 国債証券 | SINGAPORE GOV'T 2.25 | 2.25 | 千シンガポールドル 1,100 | 千シンガポールドル 1,111 | 89,785 | 2021/6/1 | |
| | | SINGAPORE GOV'T 2.75 | 2.75 | 1,200 | 1,248 | 100,878 | 2023/7/1 | |
| | | SINGAPORE GOV'T 2.75 | 2.75 | 400 | 454 | 36,703 | 2042/4/1 | |
| | | SINGAPORE GOV'T 2.75 | 2.75 | 700 | 793 | 64,124 | 2046/3/1 | |
| | | SINGAPORE GOV'T 2.875 | 2.875 | 400 | 443 | 35,841 | 2030/9/1 | |
| | | SINGAPORE GOV'T 3 | 3.0 | 700 | 745 | 60,201 | 2024/9/1 | |
| | | SINGAPORE GOV'T 3.125 | 3.125 | 800 | 833 | 67,363 | 2022/9/1 | |
| | | SINGAPORE GOV'T 3.375 | 3.375 | 950 | 1,122 | 90,669 | 2033/9/1 | |
| | | SINGAPORE GOV'T 3.5 | 3.5 | 1,800 | 2,023 | 163,499 | 2027/3/1 | |
| | 小 | 計 | — | — | — | 709,066 | — | |
| (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 7,000 | 千マレーシアリンギット 7,059 | 186,660 | 2022/8/15 | |
| | | MALAYSIA GOVT 3.502 | 3.502 | 7,900 | 7,937 | 209,866 | 2027/5/31 | |
| | | MALAYSIA GOVT 3.955 | 3.955 | 5,300 | 5,485 | 145,035 | 2025/9/15 | |
| | | MALAYSIA GOVT 4.498 | 4.498 | 5,000 | 5,382 | 142,301 | 2030/4/15 | |
| | | MALAYSIA GOVT 4.736 | 4.736 | 3,000 | 3,271 | 86,494 | 2046/3/15 | |
| | 小 | 計 | — | — | — | 770,358 | — | |
| (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 60,000 | 千南アフリカランド 41,310 | 314,369 | 2041/2/28 | |
| | | REP SOUTH AFRICA 6.75 | 6.75 | 16,000 | 15,986 | 121,655 | 2021/3/31 | |
| | | REP SOUTH AFRICA 7 | 7.0 | 59,000 | 49,536 | 376,972 | 2031/2/28 | |
| | | REP SOUTH AFRICA 8 | 8.0 | 27,500 | 25,462 | 193,767 | 2030/1/31 | |
| | 小 | 計 | — | — | — | 1,006,764 | — | |
| | 合 | 計 | — | — | — | 169,433,468 | — | |

※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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2019年12月17日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-------------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 169,433,469 | % |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,747,300 | 1.6 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 172,180,769 | 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（171,602,207千円）の投資信託財産総額（172,180,769千円）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=109.56円、1カナダドル=83.20円、1メキシコペソ=5.78円、1ユーロ=122.01円、1英ポンド=145.46円、1スウェーデンクローナ=11.69円、1ノルウェークローネ=12.15円、1デンマーククローネ=16.33円、1ポーランドズロチ=28.66円、1オーストラリアドル=75.30円、1シンガポールドル=80.80円、1マレーシアリンギット=26.44円、1南アフリカランド=7.61円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月17日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|--------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 173,190,376,657円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 1,588,753,970 |
| 公 社 債(評価額) | 169,433,469,191 |
| 未 収 入 金 | 1,009,996,247 |
| 未 収 利 息 | 1,093,891,665 |
| 前 払 費 用 | 64,265,584 |
| (B) 負 債 | 1,297,746,532 |
| 未 払 金 | 1,009,610,339 |
| 未 払 解 約 金 | 288,134,468 |
| 未 払 利 息 | 1,725 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 171,892,630,125 |
| 元 本 | 94,197,787,250 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 77,694,842,875 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 94,197,787,250口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 18,248円 |

※当期における期首元本額96,220,120,290円、期中追加設定元本額19,281,670,482円、期中一部解約元本額21,304,003,522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2018年12月18日 至2019年12月17日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 3,862,550,604円 |
| 受 取 利 息 | 3,862,909,631 |
| 支 払 利 息 | △ 359,027 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 2,383,483,514 |
| 売 買 益 | 9,490,306,434 |
| 売 買 損 | △ 7,106,822,920 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 61,607,846 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 6,184,426,272 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 72,674,184,817 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 15,131,895,633 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △16,295,663,847 |
| (H) 計 (D+E+F+G) | 77,694,842,875 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 77,694,842,875 |

※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 | 21,416,234,918円 | SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 105,090,890円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 653,338,604円 | 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 558,555円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,771,536,835円 | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 748,096,890円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 890,673,798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> | 123,648,852円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 136,965,014円 | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 1,233,947,890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) | 8,807,362円 | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 1,543,643,762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) | 31,937,213円 | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 1,892,409,294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) | 90,257,895円 | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 6,151,843,262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) | 129,206,353円 | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 1,620,816円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 71,166,457円 | SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定> | 10,187,665,851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) | 151,244,659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> | 413,794,737円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 21,944,188円 | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 171,764,970円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 209,755,424円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 104,353,401円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 228,446,383円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 39,453,718円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 178,930,457円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 13,885,160円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 53,824,408円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 130,916,754円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050 | 6,018,684円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 511,180,891円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 48,085,507円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用> | 886,798円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 53,273,704円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 164,457,715円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 102,132,606円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 51,439,144円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 39,851,024円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 5,536,577円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 18,271,008円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 1,260,435,983円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 40,500,450円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 21,829,928円 |
| 三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド | 563,635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> | 2,731,528,169円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 56,364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> | 1,403,654,156円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 56,364円 | SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 5,798,596,392円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 57,463円 | SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 610,297,468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> | 2,659,394,714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> | 76,064,013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> | 68,956,145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> | 49,676,039円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 10,485,338,822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> | 193,332,563円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 5,453,787,775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> | 124,745,649円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 12,406,346,106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> | 862,645,245円 |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 41,825,379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)

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第17期 (2018年12月1日から2019年12月2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 比 | 株式先物率 比 (買建-売建) | 純資産額 |
|-------------------|--------|----------|------------------------------------|----------|------------|-----------------------|---------|
| | 円 | 騰落率 % | 円 | 騰落率 % | | | |
| 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 |
| 17期 (2019年12月2日) | 27,359 | 5.5 | 2,611.46 | 5.5 | 97.7 | 2.3 | 174,398 |

※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 比 | 株式先物率 比 (買建-売建) |
|---------------------|--------|----------|------------------------------------|----------|------------|-----------------------|
| | 円 | 騰落率 % | 円 | 騰落率 % | | |
| (期首) 2018年11月30日 | 25,937 | — | 2,475.92 | — | 97.1 | 2.8 |
| 12月末 | 23,280 | △10.2 | 2,223.11 | △10.2 | 98.3 | 1.8 |
| 2019年1月末 | 24,425 | △5.8 | 2,332.52 | △5.8 | 99.1 | 0.9 |
| 2月末 | 25,062 | △3.4 | 2,393.08 | △3.3 | 99.0 | 0.9 |
| 3月末 | 25,084 | △3.3 | 2,395.21 | △3.3 | 97.1 | 2.8 |
| 4月末 | 25,502 | △1.7 | 2,434.82 | △1.7 | 98.2 | 1.8 |
| 5月末 | 23,846 | △8.1 | 2,275.96 | △8.1 | 97.8 | 2.2 |
| 6月末 | 24,496 | △5.6 | 2,338.89 | △5.5 | 97.8 | 2.3 |
| 7月末 | 24,720 | △4.7 | 2,360.18 | △4.7 | 98.6 | 1.3 |
| 8月末 | 23,885 | △7.9 | 2,280.58 | △7.9 | 97.9 | 2.0 |
| 9月末 | 25,328 | △2.3 | 2,418.29 | △2.3 | 97.6 | 2.3 |
| 10月末 | 26,600 | 2.6 | 2,539.02 | 2.5 | 97.0 | 2.8 |
| 11月末 | 27,116 | 4.5 | 2,588.40 | 4.5 | 97.6 | 2.3 |
| (期末) 2019年12月2日 | 27,359 | 5.5 | 2,611.46 | 5.5 | 97.7 | 2.3 |

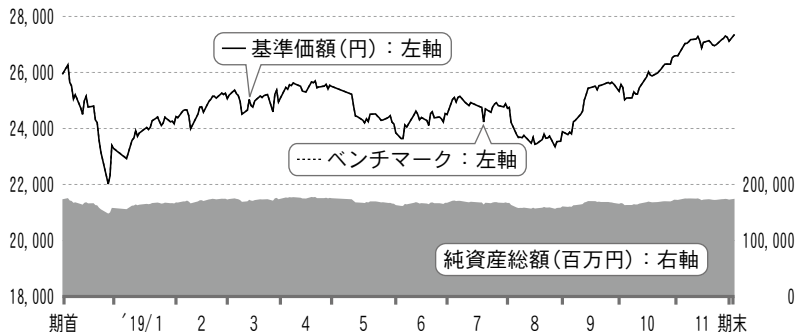
※騰落率は期首比です。

※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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 25,937円 |
| 期末 | 27,359円 |
| 騰落率 | +5.5% |

※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（2018年12月1日から2019年12月2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

- ・ 2018年12月下旬から2019年4月下旬にかけて、米中貿易摩擦問題に対する懸念の後退や中国の景気対策期待が高まったこと
- ・ 8月下旬から期末にかけて、トランプ米大統領が中国との貿易協議継続に前向きな姿勢を示したことや、世界景気や企業業績の底打ち回復期待が高まったこと

下落要因

- ・ 期首から12月下旬にかけて、低調な国内企業決算に加え、米国で金利上昇への警戒感の高まりなどから株式市場が急落し、世界的にリスク回避の動きが広がったこと
- ・ 4月下旬から8月下旬にかけて、再び米中貿易摩擦問題が激化したこと

▶ 投資環境について（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期首から2018年12月下旬にかけては、低調な国内企業決算に加え、米国で金利上昇への警戒感の高まりなどから株式市場が急落し、世界的にリスク回避の動きが広がったことから、国内株式市場も大幅に下落しました。

12月下旬から2019年4月下旬にかけては、米中貿易摩擦問題に対する懸念の後退や中国の景気対策に対する期待が高まったことから、上昇しました。

4月下旬から8月下旬にかけては、5月の追加関税の相互引上げや8月の米国による新たな対中追加関税の導入発表など、米中貿易摩擦問題が激化したことなどが重石となり、軟調な推移となりました。

8月下旬から期末にかけては、トランプ米大統領が中国との貿易協議継続に前向きな姿勢を示したことなどから反発し、世界景気・企業業績の底打ち回復期待を背景に、上昇する展開となりました。

当期の市場の動きをベンチマークであるTOPIX（東証株価指数、配当込み）でみると、期首に比べて5.5%上昇しました。

▶ ポートフォリオについて（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

株式組入比率

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

ポートフォリオの特性

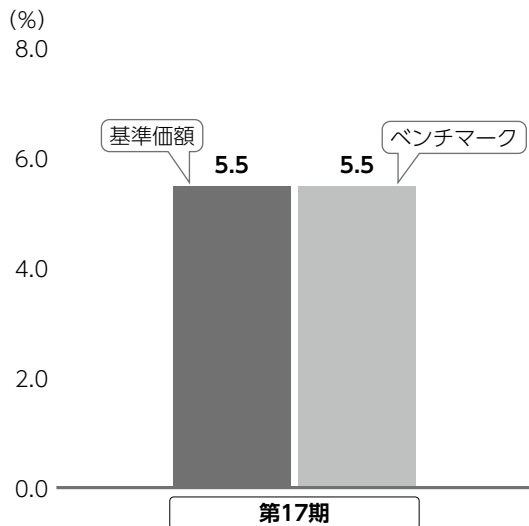
TOPIX（東証株価指数、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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（2018年12月1日から2019年12月2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+5.5%となり、ベンチマークの騰落率+5.5%を追随しました。

2 今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細（2018年12月1日から2019年12月2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) | 0.005% (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) | 0 (0) | 0.001 (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 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合 計 | 1 | 0.006 | |

期中の平均基準価額は25,021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12月1日から2019年12月2日まで）

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|-----|------------------|-------------------|-------|------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 内 | 上 場 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 8,251 (1,286) | 14,919,624 () | 8,990 | 18,015,919 |

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | | 買 | | 建 | | 売 | | 建 | |
|-------|--------|-----------|---------------|---------------|----------|----------|----------|----------|----------|--|
| | | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 | | |
| 国 内 | 株式先物取引 | T O P I X | 百万円 43,587 | 百万円 44,780 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 - | |

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 32,935,543千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 164,850,191千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b) | 0.19 |

※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。

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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

(1) 利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|-------------|-----------------|--------|------|-----------------|-------|------|
| | うち利害関係人との取引状況 B | B/A | | うち利害関係人との取引状況 D | D/C | |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株 式 | 14,919 | 464 | 3.1 | 18,015 | 7,954 | 44.2 |
| 株 式 先 物 取 引 | 43,587 | 10,428 | 23.9 | 44,780 | 6,674 | 14.9 |

(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 | 110 | 162 | 1,955 |

(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 | 7,657千円 |
| (b) うち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 | 1,075千円 |
| (c) (b) / (a) | 14.0% |

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12月1日から2019年12月2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12月2日現在）

(1) 国内株式

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 期 末 | |
|---------------|---------|-------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | 千円 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | | | |
| 極洋 | 3.5 | 3.6 | 10,458 | |
| 日本水産 | 96.8 | 95.8 | 63,802 | |
| マルハニチロ | 14 | 13.8 | 40,544 | |
| カネコ種苗 | 4 | 4.3 | 6,544 | |
| サカタのタネ | 11.5 | 10.9 | 38,531 | |
| ホクト | 7.9 | 7.2 | 14,407 | |
| 鉱業 (0.3%) | | | | |
| 日鉄鉱業 | 2.4 | 2.5 | 11,425 | |
| 三井松島ホールディングス | 4.9 | 3.3 | 3,969 | |
| 国際石油開発帝石 | 389.5 | 384.9 | 408,571 | |
| 石油資源開発 | 13.7 | 12.4 | 35,203 | |
| K&Oエナジーグループ | 5.1 | 5.3 | 8,358 | |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 期 末 | |
|------------------|---------|------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 評 価 額 |
| 建設業 (2.8%) | | | | |
| ヒノキヤグループ | 2.6 | 3.2 | 7,145 | |
| ショーボンドホールディングス | 7.5 | 13.5 | 57,510 | |
| ミライト・ホールディングス | 24.1 | 27.6 | 45,208 | |
| タマホーム | 7.2 | 5.5 | 10,131 | |
| T A T E R U | 12.5 | — | — | |
| スペースバリューホールディングス | 12.8 | 13.8 | 7,107 | |
| 安藤・間 | 61.7 | 57.3 | 51,856 | |
| 東急建設 | 28.4 | 28 | 21,952 | |
| コムシスホールディングス | 34.3 | 33.8 | 107,822 | |
| ミサワホーム | 9.3 | 8.5 | 10,183 | |
| ピーアールホールディングス | 10.5 | 13 | 6,292 | |
| 高松コンストラクショングループ | 6 | 6 | 16,398 | |
| 東建コーポレーション | 2.9 | 2.8 | 20,440 | |

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 | |
| 大成建設 | 79.5 | 73.4 | 318,923 |
| 大林組 | 239 | 220.7 | 260,426 |
| 清水建設 | 243.6 | 223.8 | 238,347 |
| 飛島建設 | 7.5 | 8 | 11,760 |
| 長谷工コーポレーション | 99.8 | 84.4 | 120,523 |
| 松井建設 | 10.8 | 11.2 | 8,758 |
| 銭高組 | 1.3 | 1.3 | 5,206 |
| 鹿島建設 | 187 | 172.2 | 251,412 |
| 不動テトラ | 7 | 7 | 10,801 |
| 大末建設 | 5.4 | 5.4 | 5,205 |
| 鉄建建設 | 5.1 | 5.1 | 14,514 |
| 西松建設 | 17.8 | 17.7 | 43,081 |
| 三井住友建設 | 59.3 | 56 | 34,160 |
| 大豊建設 | 5.5 | 5.1 | 15,294 |
| 前田建設工業 | 57.8 | 56.7 | 56,359 |
| 奥村組 | 13.6 | 12.6 | 38,997 |
| 東鉄工業 | 9.4 | 9 | 29,475 |
| 浅沼組 | 3.2 | 3 | 13,125 |
| 戸田建設 | 93.4 | 92.7 | 63,221 |
| 熊谷組 | 11.4 | 10.3 | 33,732 |
| 北野建設 | 2.2 | 2 | 5,212 |
| 矢作建設工業 | 13.1 | 12.1 | 9,244 |
| ピーエス三菱 | 11.1 | 10.6 | 7,409 |
| 日本ハウスホールディングス | 18.3 | 20 | 9,640 |
| 大東建託 | 28.6 | 26.5 | 353,907 |
| 新日本建設 | 10.2 | 10.4 | 9,651 |
| NIPPO | 20.6 | 17.7 | 39,931 |
| 東亜道路工業 | 2.2 | 1.8 | 6,219 |
| 前田道路 | 25.2 | 23.2 | 60,366 |
| 日本道路 | 2.3 | 2.3 | 16,123 |
| 東亜建設工業 | 7.5 | 8.3 | 13,089 |
| 日本国土開発 | — | 15 | 9,390 |
| 若築建設 | 5.8 | 5.3 | 9,015 |
| 東洋建設 | 32.3 | 26.1 | 13,154 |
| 五洋建設 | 96.4 | 89.3 | 56,884 |
| 世紀東急工業 | 14.8 | 13.3 | 11,757 |
| 福田組 | 2.8 | 2.8 | 13,510 |
| 住友林業 | 56.5 | 55.3 | 88,148 |
| 日本基礎技術 | — | 12.2 | 4,916 |
| バコーポレーション | 16 | 14.4 | 5,745 |
| 大和ハウス工業 | 221.4 | 218.4 | 741,468 |
| ライト工業 | 15.6 | 12.6 | 19,996 |
| 積水ハウス | 245.5 | 241.5 | 578,271 |
| 日特建設 | 8.7 | — | — |
| ユアテック | 13.3 | 13.8 | 9,342 |
| 中電工 | 9.6 | 8.2 | 21,172 |
| 関電工 | 35 | 29.2 | 30,776 |
| きんでん | 52.8 | 51.8 | 85,936 |
| 東京エネシス | 9.1 | 9.4 | 8,817 |
| トーエネック | 2.8 | 2.9 | 10,556 |
| 住友電設 | 6.2 | 6.3 | 15,554 |
| 日本電設工業 | 13.2 | 11.2 | 25,401 |
| 協和エクシオ | 31.3 | 33.3 | 95,804 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 評価額 |
|-----------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | |
| 新日本空調 | 7.5 | 6.1 | 13,676 |
| 九電工 | 15.8 | 15.5 | 54,947 |
| 三機工業 | 18.2 | 15.7 | 23,236 |
| 日揮ホールディングス | 69 | 68.6 | 111,269 |
| 中外炉工業 | 3.1 | 3.2 | 5,465 |
| ヤマト | 10 | 9.4 | 6,786 |
| 太平電業 | 5.5 | 5.7 | 13,298 |
| 高砂熱学工業 | 19.7 | 18.6 | 35,358 |
| 朝日工業社 | 2.3 | 2.1 | 7,287 |
| 明星工業 | 14.8 | 14.7 | 13,671 |
| 大気社 | 10.9 | 10.7 | 39,643 |
| ダイダ | 5.6 | 5.5 | 14,476 |
| 日比谷総合設備 | 7.9 | 7.4 | 14,422 |
| 東芝プラントシステム | 17 | 17 | 45,288 |
| OSJBホールディングス | 40.7 | 41.7 | 11,300 |
| レイズネクスト | 15.1 | 12.6 | 15,649 |
| 食料品（3.9%） | | | |
| 日本製粉 | 22.6 | 20.2 | 34,663 |
| 日清製粉グループ本社 | 79.9 | 79.4 | 163,405 |
| 日東富士製粉 | 0.6 | — | — |
| 昭和産業 | 6.3 | 6.1 | 19,703 |
| 鳥越製粉 | 9.1 | 8.5 | 8,032 |
| 中部銅料 | 9.2 | 8.9 | 12,371 |
| フィード・ワン | 52.4 | 53.4 | 9,078 |
| 日本甜菜製糖 | 5.3 | 4.7 | 9,588 |
| 三井製糖 | 5.5 | 5.9 | 13,688 |
| 日新製糖 | 3.8 | 3.4 | 6,864 |
| 森永製菓 | 18.1 | 16.5 | 92,565 |
| 中村屋 | 2.5 | 2.5 | 11,175 |
| 江崎グリコ | 21.5 | 21 | 106,890 |
| 名糖産業 | 5.4 | 4.9 | 6,443 |
| 井村屋グループ | 3.5 | 3.8 | 7,820 |
| 不二家 | 4.5 | 4.3 | 9,520 |
| 山崎製パン | 58.5 | 53.3 | 108,518 |
| モロゾフ | 1.6 | 1.7 | 8,449 |
| 亀田製菓 | 4.5 | 4 | 20,120 |
| 寿スピリッツ | 7.5 | 6.7 | 51,322 |
| カルビー | 32.7 | 32.2 | 114,632 |
| 森永乳業 | 14.5 | 13.3 | 61,645 |
| 六甲バター | 5.5 | 5.3 | 9,582 |
| ヤクルト本社 | 53 | 48.5 | 316,705 |
| 明治ホールディングス | 50.5 | 46.5 | 350,145 |
| 雪印メグミルク | 17.3 | 17.1 | 45,588 |
| プリマハム | 9.9 | 10.7 | 27,327 |
| 日本ハム | 30.7 | 26.9 | 125,085 |
| 丸大食品 | 8 | 7 | 16,387 |
| S Foods | 6.4 | 5.4 | 16,227 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 40.6 | 45.3 | 32,525 |
| サッポロホールディングス | 26.3 | 24.4 | 65,367 |
| アサヒグループホールディングス | 150.1 | 148 | 779,368 |
| キリンホールディングス | 324.1 | 299.6 | 731,473 |
| 宝ホールディングス | 53.9 | 53.7 | 57,673 |
| オエノンホールディングス | 24.8 | 22.2 | 8,991 |

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 | |
| 養命酒製造 | 3.2 | 3.5 | 7,000 |
| コカ・コーラ ホトラズジャパンホールデ | 54.7 | 49.8 | 131,770 |
| サントリー食品インターナショナル | 47.5 | 47 | 223,485 |
| ダイトグループホールディングス | 3.9 | 3.5 | 16,222 |
| 伊藤園 | 23.7 | 21.3 | 118,002 |
| キーコーヒー | 6.9 | 6.7 | 16,073 |
| 日清オイリオグループ | 9 | 8.8 | 34,496 |
| 不二製油グループ本社 | 17.5 | 17.3 | 53,197 |
| かどや製油 | 1 | 1.3 | 4,959 |
| J-オイルミルズ | 3.6 | 3.6 | 15,714 |
| キッコーマン | 47.1 | 50.6 | 283,360 |
| 味の素 | 158.3 | 157.2 | 288,619 |
| キュービー | 39.9 | 39.4 | 96,766 |
| ハウス食品グループ本社 | 27.1 | 26.3 | 100,992 |
| カゴメ | 28.6 | 27.1 | 72,844 |
| 焼津水産化学工業 | 7.7 | 5.7 | 5,996 |
| アリアケジャパン | 6.4 | 6.4 | 50,432 |
| ニチレイ | 37.1 | 33.6 | 86,721 |
| 東洋水産 | 36.6 | 36.1 | 171,294 |
| イトアンド | 3.6 | 3.7 | 6,604 |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | - | 4.4 | 5,310 |
| 日清食品ホールディングス | 30.2 | 29.9 | 246,077 |
| 永谷園ホールディングス | 4.6 | 4.2 | 9,038 |
| 一正蒲鉾 | 3.3 | 4.3 | 4,570 |
| フジッコ | 7.8 | 7.6 | 15,283 |
| ロック・フィールド | 7.6 | 7.8 | 11,544 |
| 日本たばこ産業 | 413.6 | 407.7 | 1,025,977 |
| ケンコーマヨネーズ | 4.5 | 4.4 | 11,448 |
| わらべや日洋ホールディングス | 5.1 | 5.1 | 9,276 |
| なとり | 5.5 | 5.4 | 9,180 |
| ビックルスコーポレーション | 2.3 | 2 | 5,570 |
| 北の達人コーポレーション | 28.9 | 23.6 | 16,614 |
| ユーグレナ | 29.4 | 29.1 | 24,327 |
| ミヨシ油脂 | 3.5 | 4.3 | 5,551 |
| 理研ビタミン | 3.6 | 3 | 12,195 |
| 繊維製品 (0.6%) | | | |
| 片倉工業 | 10 | 11.1 | 15,295 |
| グンゼ | 5.1 | 5.1 | 26,520 |
| 東洋紡 | 30.3 | 28.2 | 45,740 |
| ユニチカ | 21.3 | 23.7 | 8,911 |
| 富士紡ホールディングス | 3.9 | 3.9 | 13,572 |
| 倉敷紡績 | 6.7 | 7.1 | 18,332 |
| シキボウ | 6.3 | - | - |
| 日本毛織 | 23 | 22.5 | 24,187 |
| ダイドーリミテッド | 23 | 15 | 4,200 |
| 帝国繊維 | 8 | 8.3 | 16,948 |
| 帝人 | 56.7 | 55.3 | 115,908 |
| 東レ | 543.1 | 500.4 | 369,295 |
| 住江織物 | 2.4 | 2.6 | 7,415 |
| アツギ | 8.1 | 9.6 | 7,958 |
| ダイニック | 6.2 | 6.4 | 4,915 |
| セーレン | 17.1 | 16.9 | 26,364 |
| 小松マテーレ | 12.5 | 12.8 | 10,624 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期 末 |
|----------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | |
| ワコールホールディングス | 20.5 | 18.2 | 56,147 |
| ホギメディカル | 8.8 | 8 | 28,880 |
| レナウン | - | 35 | 4,025 |
| T S I ホールディングス | 25.8 | 24.5 | 13,548 |
| マツオカコーポレーション | 2.5 | 2.8 | 6,151 |
| ワールド | 8 | 10 | 27,660 |
| 三陽商会 | 4.9 | 5.1 | 7,175 |
| オンワードホールディングス | 45.4 | 41.7 | 26,813 |
| ゴールドウイン | 6.3 | 12.6 | 100,044 |
| デサント | 17 | 13.9 | 25,159 |
| パルプ・紙 (0.3%) | | | |
| 特種東海製紙 | 4.5 | 4.4 | 17,842 |
| 王子ホールディングス | 311.9 | 285.3 | 180,309 |
| 日本製紙 | 33.3 | 30.7 | 59,404 |
| 三菱製紙 | 14.8 | 11.7 | 5,943 |
| 北越コーポレーション | 45.8 | 45.7 | 26,003 |
| 中越パルプ工業 | 4 | 4.3 | 7,077 |
| 巴川製紙所 | 3.1 | - | - |
| 大王製紙 | 33.1 | 29.4 | 43,923 |
| レンゴー | 72.1 | 65.3 | 53,937 |
| トーモク | 5.2 | 5.1 | 9,078 |
| ザ・バック | 5.4 | 5 | 19,550 |
| 化学 (7.2%) | | | |
| クラレ | 117 | 108 | 145,584 |
| 旭化成 | 497.5 | 459.4 | 562,535 |
| 昭和電工 | 46.5 | 48.7 | 144,395 |
| 住友化学 | 546.5 | 507.3 | 255,171 |
| 住友精化 | 3.4 | 3.3 | 11,517 |
| 日産化学 | 42.8 | 38.5 | 170,940 |
| ラサ工業 | 3.4 | 3.3 | 5,029 |
| クレハ | 6.3 | 5.8 | 37,990 |
| 多木化学 | 1.1 | 2.3 | 10,465 |
| テイカ | 5.9 | 5.2 | 10,160 |
| 石原産業 | 13.9 | 12.9 | 15,273 |
| 日本曹達 | 10.9 | 10.2 | 30,151 |
| 東ソー | 107.7 | 105.2 | 174,526 |
| トクヤマ | 20.4 | 19.9 | 59,222 |
| セントラル硝子 | 15.8 | 14.5 | 39,106 |
| 東亜合成 | 44.3 | 43.6 | 55,590 |
| 大阪ソーダ | 7.5 | 6.9 | 21,045 |
| 関東電化工業 | 16.9 | 16.8 | 17,690 |
| デンカ | 27.4 | 24.9 | 82,045 |
| 信越化学工業 | 123.2 | 118.4 | 1,409,552 |
| 日本カーバイド工業 | 3.2 | 3.2 | 4,758 |
| 堺化学工業 | 4.8 | 4.6 | 11,564 |
| 第一稀元素化学工業 | 6.7 | 9.4 | 8,206 |
| エア・ウォーター | 56.5 | 55.7 | 97,586 |
| 大陽日酸 | 57.6 | 66.2 | 162,190 |
| 日本化学工業 | 2.6 | 2.4 | 7,656 |
| 日本パーカライジング | 38.9 | 35.4 | 41,311 |
| 高圧ガス工業 | 12.8 | 12.4 | 9,957 |
| チタン工業 | - | 1.8 | 4,820 |
| 四国化成工業 | 11.8 | 10.4 | 13,457 |

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 | |
| 戸田工業 | 2.1 | 2.5 | 5,535 |
| ステラ ケミファ | 4.3 | 4 | 12,940 |
| 保土谷化学工業 | 2.9 | 2.8 | 10,920 |
| 日本触媒 | 11.7 | 10.8 | 74,196 |
| 大日精化学工業 | 5.7 | 6.2 | 20,026 |
| カネカ | 18.4 | 17.7 | 63,100 |
| 三菱瓦斯化学 | 71.8 | 64.5 | 111,198 |
| 三井化学 | 63 | 62.6 | 165,890 |
| J S R | 70.2 | 64.3 | 124,099 |
| 東京応化工業 | 12.2 | 12 | 48,900 |
| 大阪有機化学工業 | 7.2 | 7.2 | 10,072 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 467 | 461 | 377,328 |
| K H ネオケム | 10.8 | 12.3 | 30,922 |
| ダイセル | 108.4 | 94 | 102,460 |
| 住友ベークライト | 12.2 | 10.9 | 47,415 |
| 積水化学工業 | 151.5 | 148.2 | 284,544 |
| 日本ゼオン | 63.2 | 62.3 | 87,531 |
| アイカ工業 | 21.1 | 20.7 | 72,864 |
| 宇部興産 | 35.2 | 34.2 | 82,216 |
| 積水樹脂 | 11.5 | 12.3 | 28,117 |
| タキロンシーアイ | 16.9 | 16.1 | 10,883 |
| 旭有機材 | 5.3 | 4.5 | 7,740 |
| 日立化成 | 32.2 | 31.9 | 128,078 |
| ニチバン | 4.1 | 4.1 | 7,978 |
| リケンテクノス | 21.8 | 19.2 | 9,792 |
| 大倉工業 | 4.4 | 3.9 | 7,585 |
| 積水化成成品工業 | 11.3 | 10.2 | 8,160 |
| 群栄化学工業 | 2.4 | 2.4 | 5,997 |
| ミライアル | — | 3.3 | 4,544 |
| ダイキョーニシカワ | 14.6 | 14.4 | 12,441 |
| 森六ホールディングス | 4.1 | 4.1 | 9,753 |
| 日本化薬 | 44.4 | 43.1 | 59,822 |
| カーリットホールディングス | 9.1 | 9.5 | 5,985 |
| 日本精化 | 7.3 | 6.7 | 8,361 |
| 扶桑化学工業 | 7.1 | 6.9 | 21,217 |
| トリケミカル研究所 | 1.7 | 1.6 | 12,480 |
| A D E K A | 34.6 | 31.9 | 53,273 |
| 日油 | 27 | 25.9 | 96,607 |
| ハリマ化成グループ | 7.3 | 6.2 | 7,712 |
| 花王 | 173.3 | 168.5 | 1,467,298 |
| 第一工業製薬 | 3 | 2.9 | 10,802 |
| 石原ケミカル | 2.8 | — | — |
| 三洋化成工業 | 4.6 | 4 | 21,960 |
| 大日本塗料 | 9.3 | 9.1 | 10,610 |
| 日本ペイントホールディングス | 57.6 | 56.8 | 333,984 |
| 関西ペイント | 78.6 | 77.6 | 217,047 |
| 中国塗料 | 23.2 | 20.3 | 20,990 |
| 日本特殊塗料 | 5.6 | 5.9 | 8,118 |
| 藤倉化成 | 12.6 | 13.2 | 7,550 |
| 太陽ホールディングス | 5.7 | 5 | 20,875 |
| D I C | 31.6 | 28.7 | 86,042 |
| サカタインクス | 15.2 | 15.1 | 18,074 |
| 東洋インキSCホールディングス | 14.1 | 13.9 | 37,265 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 評価額 |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | |
| T & K T O K A | 6.4 | 7.1 | 7,114 |
| 富士フイルムホールディングス | 148.2 | 134.8 | 698,533 |
| 資生堂 | 141.9 | 139.8 | 1,121,056 |
| ライオン | 99.5 | 91.3 | 201,225 |
| 高砂香料工業 | 5 | 4.6 | 11,877 |
| マンダム | 15.8 | 15.8 | 47,953 |
| ミルボン | 8.9 | 9.4 | 59,314 |
| ファンケル | 31.6 | 28.6 | 83,912 |
| コーセー | 12.1 | 13.2 | 232,716 |
| コタ | 4.4 | 5.1 | 7,073 |
| シーズ・ホールディングス | 8.7 | — | — |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 30.5 | 30 | 81,660 |
| ノエビアホールディングス | 4.4 | 6.6 | 41,448 |
| エステー | 5.6 | 5.4 | 9,374 |
| アグロ カネショウ | 3.3 | 3.3 | 4,735 |
| コニシ | 12.5 | 11.8 | 17,546 |
| 長谷川香料 | 8.7 | 9.7 | 19,225 |
| 星光P M C | 6 | — | — |
| 小林製薬 | 20 | 19.7 | 178,088 |
| 荒川化学工業 | 7.1 | 7 | 11,067 |
| メック | 5.6 | 5.4 | 8,775 |
| 日本高純度化学 | 3.2 | — | — |
| タカラバイオ | 18.6 | 18.7 | 40,279 |
| J C U | 9.4 | 8.7 | 25,682 |
| デクセリアルズ | 18.8 | 19 | 20,805 |
| アース製薬 | 5.3 | 5.3 | 30,210 |
| 北興化学工業 | 10.5 | 9.1 | 5,350 |
| 大成ラミック | 3.6 | 3.3 | 9,405 |
| クミアイ化学工業 | 29.7 | 29.5 | 30,296 |
| 日本農薬 | 18.6 | 14.6 | 8,584 |
| アキレス | 5.8 | 5.6 | 10,225 |
| 有沢製作所 | 12.8 | 11.7 | 11,676 |
| 日東電工 | 54 | 48.2 | 299,322 |
| レック | 7.8 | 8.1 | 10,530 |
| 三光合成 | — | 11.6 | 5,011 |
| 藤森工業 | 6.2 | 6.1 | 21,533 |
| 前澤化成工業 | 7.7 | 6.6 | 7,900 |
| 未来工業 | — | 4.5 | 10,093 |
| J S P | 4.5 | 4.6 | 8,763 |
| エフビコ | 5.8 | 7.8 | 51,870 |
| 天馬 | 5.4 | 5.3 | 10,663 |
| 信越ポリマー | 13.7 | 12.6 | 12,196 |
| 東リ | 23.5 | 23.1 | 7,299 |
| ニフコ | 28.6 | 25.5 | 77,775 |
| バルカー | 6.1 | 5.9 | 15,481 |
| ユニ・チャーム | 151.6 | 136.1 | 494,587 |
| 医薬品（6.0%） | | | |
| 協和キリン | 88.7 | 70.2 | 164,338 |
| 武田薬品工業 | 281.9 | 586 | 2,631,726 |
| アステラス製薬 | 658 | 619.5 | 1,175,811 |
| 大日本住友製薬 | 52.9 | 52.5 | 111,457 |
| 塩野義製薬 | 93.4 | 89.9 | 585,878 |
| 田辺三菱製薬 | 73.9 | 85.2 | 170,655 |

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 | |
| あすか製薬 | 9.4 | 9 | 11,898 |
| 日本新薬 | 18.7 | 18.4 | 183,264 |
| 中外製薬 | 74.1 | 73.4 | 720,274 |
| 科研製薬 | 13 | 12.2 | 72,834 |
| エーザイ | 85.5 | 84.3 | 680,469 |
| ロート製薬 | 36.7 | 35.9 | 125,829 |
| 小野薬品工業 | 168.9 | 162 | 398,115 |
| 久光製薬 | 21.1 | 20.7 | 111,987 |
| 持田製薬 | 5.5 | 10 | 44,750 |
| 参天製薬 | 135.2 | 130.9 | 270,177 |
| 扶桑薬品工業 | 3.8 | 3.6 | 7,570 |
| 日本ケミファ | 1.6 | 1.5 | 4,458 |
| ツムラ | 22.3 | 22.1 | 70,609 |
| 日医工 | 17.1 | 20.1 | 27,135 |
| キッセイ薬品工業 | 12.8 | 12.8 | 39,040 |
| 生化学工業 | 14 | 14.2 | 18,048 |
| 栄研化学 | 12.6 | 12.8 | 25,446 |
| 鳥居薬品 | 4.1 | 4.5 | 12,829 |
| JCRファーマ | 5.1 | 5 | 46,750 |
| 東和薬品 | 3.4 | 9 | 25,551 |
| 富士製薬工業 | 5.3 | 5.6 | 7,896 |
| 沢井製薬 | 14.8 | 14.7 | 95,991 |
| ゼリア新薬工業 | 14.2 | 13 | 28,314 |
| 第一三共 | 204.3 | 201.4 | 1,412,216 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 18.3 | 14.7 | 27,621 |
| 大幸薬品 | 4.1 | 3.3 | 11,121 |
| ダイト | 4.3 | 4.4 | 13,970 |
| 大塚ホールディングス | 136 | 134.1 | 648,909 |
| 大正製薬ホールディングス | 15.9 | 14.8 | 121,064 |
| ペプチドリーム | 33.1 | 35.7 | 182,427 |
| 石油・石炭製品（0.5%） | | | |
| 日本コークス工業 | 75 | 81.7 | 6,617 |
| 昭和シェル石油 | 66.9 | — | — |
| ニチレキ | 10.1 | 9.5 | 12,350 |
| ユシロ化学工業 | 5.1 | 5.9 | 8,112 |
| 富士石油 | 19.7 | 25.2 | 5,997 |
| MORESCO | 3.8 | — | — |
| 出光興産 | 55.2 | 79.1 | 234,610 |
| JXTGホールディングス | 1,215.3 | 1,090.7 | 531,825 |
| コスモエネルギーホールディングス | 20.2 | 20.7 | 49,555 |
| ゴム製品（0.8%） | | | |
| 横浜ゴム | 41.6 | 40.7 | 93,732 |
| TOYO TIRE | 37.3 | 41.2 | 65,096 |
| ブリヂストン | 219.5 | 216.7 | 958,030 |
| 住友ゴム工業 | 64.3 | 63.4 | 89,520 |
| オカモト | 5.1 | 4.5 | 18,810 |
| ニッタ | 8 | 7.9 | 25,240 |
| 住友理工 | 14.1 | 13.7 | 14,015 |
| 三ツ星ベルト | 9.6 | 9.6 | 20,265 |
| バンドー化学 | 14.2 | 13.5 | 12,501 |
| ガラス・土石製品（0.9%） | | | |
| 日東紡績 | 10.6 | 10.6 | 43,460 |
| AGC | 71.5 | 69.5 | 283,212 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 評価額 |
|-------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | |
| 日本板硝子 | 33.5 | 21.5 | 13,953 |
| 日本山村硝子 | 4.2 | 5.4 | 6,928 |
| 日本電気硝子 | 30.9 | 28.5 | 67,830 |
| オハラ | 3.1 | 3.6 | 5,259 |
| 住友大阪セメント | 14.6 | 13.7 | 64,253 |
| 太平洋セメント | 45 | 44.5 | 144,180 |
| 日本ヒューム | 8.9 | 9.3 | 7,635 |
| 日本コンクリート工業 | 20.5 | 20.5 | 5,576 |
| 三谷セキサン | 3.7 | 3.5 | 12,565 |
| アジアパイルホールディングス | 11.7 | 13.3 | 7,315 |
| 東海カーボン | 64.7 | 73.8 | 80,368 |
| 日本カーボン | 3.5 | 3.7 | 15,854 |
| 東洋炭素 | 4.4 | 4.6 | 11,164 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 4.3 | 4 | 19,040 |
| TOTO | 54.7 | 50.3 | 240,685 |
| 日本碍子 | 86.5 | 85.4 | 158,587 |
| 日本特殊陶業 | 60 | 54.6 | 121,648 |
| MARUWA | 2.6 | 2.8 | 21,140 |
| 品川リフラクトリーズ | 2.2 | 2.4 | 7,728 |
| 黒崎播磨 | 1.5 | 1.5 | 8,730 |
| ヨータイ | 7.8 | 8.2 | 5,690 |
| 東京窯業 | 12.6 | 16.5 | 5,626 |
| ニッカトー | 4.3 | — | — |
| フジミンコーポレーテッド | 6.4 | 6.4 | 18,489 |
| ニチアス | 19.3 | 19.3 | 50,392 |
| ニチハ | 9.9 | 9.7 | 26,936 |
| 鉄鋼（0.8%） | | | |
| 日本製鉄 | 316 | 311.5 | 507,277 |
| 神戸製鋼所 | 129.4 | 129.3 | 73,571 |
| 中山製鋼所 | 11.9 | 13 | 6,461 |
| 合同製鐵 | 4.1 | 4.1 | 10,799 |
| ジェイエフイーホールディングス | 190.7 | 187.9 | 265,314 |
| 日新製鋼 | 17.2 | — | — |
| 東京製鐵 | 37.7 | 34.2 | 28,591 |
| 共英製鋼 | 8 | 8 | 16,800 |
| 大和工業 | 15.2 | 15.1 | 41,600 |
| 東京製鋼 | 4.1 | 4 | 6,128 |
| 大阪製鐵 | 5.1 | 4.5 | 6,520 |
| 淀川製鋼所 | 9.2 | 9.1 | 19,373 |
| 丸一鋼管 | 25.1 | 22.9 | 72,822 |
| モリ工業 | 2.7 | 2.7 | 6,760 |
| 大同特殊鋼 | 11.8 | 11.4 | 56,601 |
| 日本冶金工業 | 61.4 | 5.9 | 13,747 |
| 山陽特殊製鋼 | 8.9 | 5.4 | 8,083 |
| 愛知製鋼 | 3.9 | 3.9 | 14,196 |
| 日立金属 | 77.7 | 74.9 | 115,121 |
| 大平洋金属 | 5 | 4.9 | 11,848 |
| 新日本電工 | 46.4 | 50.2 | 9,086 |
| 栗本鐵工所 | 4.6 | 4.3 | 8,518 |
| 三菱製鋼 | 6 | 6.7 | 7,638 |
| シンニッタン | 14.7 | 14.7 | 6,556 |
| 非鉄金属（0.8%） | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 13.1 | 11.2 | 8,769 |

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | |
|--------------------|---------|------|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| 日本軽金属ホールディングス | 196.2 | 178 | 40,406 | |
| 三井金属鉱業 | 19.4 | 18.9 | 52,182 | |
| 東邦亜鉛 | 4 | 4 | 8,540 | |
| 三菱マテリアル | 46.6 | 45.7 | 134,906 | |
| 住友金属鉱山 | 97 | 89.2 | 294,449 | |
| DOWAホールディングス | 16.6 | 17.6 | 69,520 | |
| 古河機械金属 | 11.8 | 12.5 | 18,950 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 8.6 | 7.8 | 12,269 | |
| 東邦チタニウム | 13.2 | 13.7 | 13,289 | |
| UACJ | 10.5 | 10.7 | 26,610 | |
| CKサンエツ | 1.7 | 1.8 | 5,409 | |
| 古河電気工業 | 20.6 | 21.5 | 65,145 | |
| 住友電気工業 | 264.2 | 260 | 435,370 | |
| フジクラ | 87.2 | 85.9 | 39,428 | |
| 昭和電線ホールディングス | — | 9.6 | 9,744 | |
| タツタ電線 | 16.3 | 15.3 | 8,981 | |
| 平河ヒューテック | 3.6 | — | — | |
| リョービ | 8.8 | 8.5 | 17,875 | |
| アーレスティ | 10.2 | 11.5 | 6,141 | |
| アサヒホールディングス | 13.4 | 12.5 | 32,587 | |
| 金属製品 (0.6%) | | | | |
| 稲葉製作所 | 5.7 | 5.5 | 7,870 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 2.7 | 3.3 | 6,880 | |
| トーカロ | 19.6 | 19.4 | 21,572 | |
| アルファC o | 4 | 4.3 | 5,637 | |
| SUMCO | 78.5 | 83.5 | 141,198 | |
| 川田テクノロジーズ | 1.7 | 1.7 | 11,645 | |
| RS Technologies | 1.6 | 2.2 | 8,173 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 44.9 | 44.6 | 86,613 | |
| ホッカンホールディングス | 4.8 | 4.8 | 9,408 | |
| コロナ | 5.6 | 5.9 | 7,021 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 13.3 | 13 | 24,583 | |
| 三和ホールディングス | 73.2 | 66.8 | 81,496 | |
| 文化シャッター | 21.5 | 21.2 | 20,585 | |
| 三協立山 | 10.2 | 10.5 | 13,104 | |
| アルインコ | 8.9 | 7 | 8,379 | |
| LIXILグループ | 104.2 | 103 | 194,155 | |
| ノーリツ | 15.7 | 14.9 | 20,979 | |
| 長府製作所 | 7 | 7.2 | 17,719 | |
| リンナイ | 12.6 | 13.6 | 114,648 | |
| 日東精工 | 12.5 | 13 | 8,502 | |
| 岡部 | 15.2 | 14.6 | 13,519 | |
| ジーテクト | 8.3 | 8.7 | 15,103 | |
| 東ブレ | 12.8 | 12.9 | 22,304 | |
| 高周波熱錬 | 14.4 | 14.2 | 12,595 | |
| 東京製綱 | 5.9 | 6.7 | 7,745 | |
| パイオラックス | 11.2 | 10.2 | 22,603 | |
| エイチワン | 8 | 9.3 | 7,858 | |
| 日本発條 | 71 | 75 | 73,650 | |
| 三益半導体工業 | 6.1 | 6.2 | 12,474 | |
| 機械 (5.1%) | | | | |
| 日本製鋼所 | 21.8 | 21.5 | 48,697 | |
| 三浦工業 | 30.7 | 30.1 | 111,219 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | |
|----------------|---------|-------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| タクマ | 25.7 | 23.7 | 30,288 | |
| ツガミ | 16.1 | 14.8 | 16,738 | |
| オークマ | 9 | 8 | 49,200 | |
| 東芝機械 | 8 | 7.9 | 22,127 | |
| アマダホールディングス | 107.8 | 87.3 | 108,863 | |
| アイダエンジニアリング | 19.5 | 18.2 | 18,236 | |
| F U J I | 20.6 | 28.7 | 55,878 | |
| 牧野フライス製作所 | 8.1 | 8 | 43,280 | |
| オーエスジー | 35 | 32.4 | 73,126 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 19.2 | 19.1 | 12,529 | |
| D M G 森精機 | 44.9 | 43.9 | 76,956 | |
| ソディック | 15.6 | 16.7 | 17,067 | |
| ディスコ | 9.6 | 9.4 | 221,370 | |
| 日東工器 | 4.4 | 4.3 | 9,576 | |
| 日進工具 | 2.4 | 2.1 | 4,882 | |
| パンチ工業 | — | 9.2 | 5,280 | |
| 豊和工業 | 5 | 5.7 | 4,263 | |
| 津田駒工業 | 2.2 | — | — | |
| 島精機製作所 | 9.8 | 11.3 | 31,402 | |
| オプトラン | 7.1 | 8 | 23,464 | |
| イワキポンプ | — | 4.5 | 5,157 | |
| フリーユ | 7.6 | 8.6 | 9,030 | |
| ヤマシンフィルタ | 12.9 | 15.2 | 13,315 | |
| 日阪製作所 | 10.1 | 10.3 | 10,300 | |
| やまびこ | 13.7 | 13.8 | 15,745 | |
| 平田機工 | 3.4 | 3.3 | 26,301 | |
| ペガサスマシン製造 | 8.6 | 10.7 | 5,489 | |
| マルマエ | — | 3.5 | 3,650 | |
| タツモ | — | 3.6 | 4,312 | |
| ナプテスコ | 39 | 40.9 | 139,469 | |
| 三井海洋開発 | 7.5 | 7.6 | 18,977 | |
| レオン自動機 | 7.1 | 6.9 | 11,433 | |
| S M C | 20.9 | 22.1 | 1,103,453 | |
| ホソカワミクロン | 2.6 | 2.7 | 12,190 | |
| ユニオンツール | 3.2 | 2.6 | 8,554 | |
| オイレス工業 | 9.8 | 9.3 | 15,735 | |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 2.3 | 2.6 | 12,727 | |
| サトーホールディングス | 8.6 | 10.1 | 34,037 | |
| 技研製作所 | 4.9 | 6.4 | 28,416 | |
| 日精樹脂工業 | 7.3 | 7.3 | 7,489 | |
| オカダアイヨン | 3.2 | — | — | |
| ワイエイシイホールディングス | — | 4.1 | 2,931 | |
| 小松製作所 | 323.3 | 318.7 | 824,476 | |
| 住友重機械工業 | 40.5 | 39.8 | 125,967 | |
| 日立建機 | 28.5 | 27.5 | 81,152 | |
| 日工 | 2.7 | 12.4 | 9,312 | |
| 巴工業 | 3.7 | 3.9 | 8,899 | |
| 井関農機 | 7.5 | 7.9 | 13,090 | |
| T O W A | 7.3 | 7.8 | 8,970 | |
| 北川鉄工所 | 3.7 | 3.6 | 8,164 | |
| ローツェ | 3.6 | 3.2 | 12,560 | |
| クボタ | 382.8 | 373.2 | 643,956 | |
| 荏原実業 | 3.5 | 2.6 | 5,891 | |

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 | |
| 三菱化工機 | 3.9 | 3.7 | 7,052 |
| 月島機械 | 14.2 | 13.4 | 22,860 |
| 帝国電機製作所 | 5.8 | 7.1 | 9,386 |
| 新東工業 | 17 | 16.7 | 17,334 |
| 澁谷工業 | 6.3 | 6.3 | 19,908 |
| アイチ コーポレーション | 14.2 | 13.7 | 9,905 |
| 小森コーポレーション | 19.1 | 17.6 | 20,433 |
| 鶴見製作所 | 6 | 6.1 | 12,541 |
| 住友精密工業 | 1.8 | 1.8 | 6,210 |
| 酒井重工業 | 1.8 | 1.9 | 5,823 |
| 荏原製作所 | 31.8 | 29.3 | 98,008 |
| 西島製作所 | 9.8 | 8.9 | 8,561 |
| 北越工業 | 8.1 | 8.5 | 10,863 |
| ダイキン工業 | 97.4 | 89.7 | 1,414,569 |
| オルガノ | 3.1 | 2.6 | 17,004 |
| トーヨーカネツ | 3.1 | 3.9 | 8,907 |
| 栗田工業 | 38.5 | 37.8 | 118,503 |
| 椿本チエイン | 9.1 | 9.6 | 36,672 |
| 大同工業 | 5.7 | 6.2 | 5,189 |
| アネスト岩田 | 11.8 | 11.9 | 12,090 |
| ダイフク | 39.3 | 35.6 | 234,604 |
| 加藤製作所 | 3.9 | 4.5 | 8,284 |
| タダノ | 35 | 34.8 | 37,966 |
| フジテック | 25.5 | 25.1 | 43,799 |
| CKD | 19.9 | 19.7 | 36,543 |
| キトー | 6.1 | 6 | 9,906 |
| 平和 | 19.7 | 19.7 | 44,699 |
| 理想科学工業 | 6.2 | 6.6 | 12,493 |
| SANKYO | 17.9 | 16.1 | 59,892 |
| 日本金銭機械 | 9 | 9.4 | 8,732 |
| マースグループホールディングス | 5.1 | 5.5 | 11,198 |
| 福島工業 | 4.3 | 4.4 | 15,400 |
| ダイコク電機 | 4.3 | 4.5 | 7,569 |
| 竹内製作所 | 11.9 | 11.6 | 19,627 |
| アマノ | 20.7 | 18.5 | 60,772 |
| JUK I | 10.2 | 10.6 | 9,688 |
| サンデンホールディングス | 9.3 | — | — |
| 蛇の目マシン工業 | 9.9 | — | — |
| マックス | 10.9 | 10.7 | 22,534 |
| グローリー | 19.9 | 19.7 | 65,601 |
| 新晃工業 | 7.4 | 6.9 | 13,047 |
| 大和冷機工業 | 10.3 | 10.7 | 13,824 |
| セガサミーホールディングス | 71 | 70.4 | 111,584 |
| 日本ピストンリング | 3.5 | 4.4 | 6,340 |
| リケン | 3.3 | 3.4 | 14,603 |
| T P R | 9.4 | 9 | 18,819 |
| ツバキ・ナカシマ | 11 | 14.6 | 25,053 |
| ホシザキ | 20.8 | 20.6 | 197,966 |
| 大豊工業 | 6.9 | 7.4 | 6,467 |
| 日本精工 | 145 | 130.7 | 140,763 |
| NTN | 152.2 | 161.9 | 56,017 |
| ジェイテクト | 67.6 | 65.9 | 91,205 |
| 不二越 | 6.8 | 6.6 | 33,924 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 評価額 |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | |
| 日本トムソン | 22.3 | 22.9 | 11,427 |
| T H K | 44.7 | 40.8 | 127,296 |
| ユーシン精機 | 6.3 | 6.7 | 7,095 |
| 前澤給装工業 | 4.1 | 3.7 | 7,943 |
| イーグル工業 | 9.3 | 8.9 | 9,665 |
| 日本ビラー工業 | 8.3 | 7.8 | 11,793 |
| キッツ | 28.9 | 29 | 22,098 |
| マキタ | 86.6 | 91.5 | 339,007 |
| 日立造船 | 54.2 | 56 | 24,360 |
| 三菱重工業 | 119.7 | 117.7 | 499,518 |
| I H I | 54.8 | 50.9 | 131,525 |
| スター精密 | 12.5 | 11.2 | 17,348 |
| 電気機器 (14.2%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | 39.6 | 47.8 | 48,708 |
| イビデン | 44.1 | 43.5 | 112,186 |
| コニカミノルタ | 156.2 | 155.1 | 112,602 |
| ブラザー工業 | 92.7 | 85.5 | 188,185 |
| ミネベアミツミ | 132.3 | 130.1 | 280,885 |
| 日立製作所 | 321.1 | 338.3 | 1,457,734 |
| 三菱電機 | 713.2 | 704 | 1,080,288 |
| 富士電機 | 46.3 | 42.2 | 144,535 |
| 東洋電機製造 | 4 | 3.8 | 5,947 |
| 安川電機 | 82.8 | 75.6 | 307,314 |
| シンフォニアテクノロジー | 10.3 | 9.4 | 12,943 |
| 明電舎 | 14.2 | 13.1 | 28,138 |
| オリジン | 3.2 | 3.4 | 5,157 |
| 山洋電気 | 3.6 | 3.5 | 19,110 |
| デンヨー | 7.5 | 6.5 | 13,585 |
| 東芝テック | 8.8 | 8.8 | 39,248 |
| 芝浦メカトロニクス | 1.7 | 1.6 | 6,352 |
| マブチモーター | 19.6 | 19.3 | 81,542 |
| 日本電産 | 85.9 | 84.7 | 1,382,727 |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 4.2 | — | — |
| トレックス・セミコンダクター | 3.2 | 4.9 | 7,198 |
| 東光高岳 | 4.4 | 5.5 | 6,583 |
| ダブル・スコープ | 10.9 | — | — |
| 宮越ホールディングス | — | 3.9 | 4,009 |
| ダイヘン | 7.9 | 7.7 | 28,451 |
| ヤーマン | 10.6 | 11.2 | 7,862 |
| J V C ケンウッド | 53.2 | 60 | 16,500 |
| ミマキエンジニアリング | 7.3 | 9.3 | 4,910 |
| 第一精工 | 3.9 | 3 | 7,935 |
| 日新電機 | 17 | 16.7 | 19,238 |
| 大崎電気工業 | 15.9 | 16.2 | 12,069 |
| オムロン | 75.7 | 65.3 | 427,062 |
| 日東工業 | 11.6 | 10.7 | 26,792 |
| I D E C | 9.9 | 10.5 | 24,832 |
| ジー・エス・ユアサ コーポレーション | 26 | 24.1 | 55,526 |
| サクサホールディングス | 2.7 | 3 | 5,934 |
| メルコホールディングス | 3 | 2.8 | 8,680 |
| 日本電気 | 92 | 85.4 | 379,176 |
| 富士通 | 68.9 | 67.9 | 682,395 |
| 沖電気工業 | 31.4 | 29.9 | 45,747 |

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 | |
| 電気興業 | 4.3 | 3.7 | 11,525 |
| サンケン電気 | 8.6 | 8 | 25,360 |
| アイホン | 5.4 | 5.1 | 9,720 |
| ルネサスエレクトロニクス | 73 | 336.3 | 241,799 |
| セイコーエプソン | 88.4 | 86.9 | 144,427 |
| ワコム | 53 | 47.8 | 21,414 |
| アルバック | 16.6 | 14.1 | 60,630 |
| EIZO | 6.6 | 5.5 | 22,990 |
| ジャパンディスプレイ | 93 | — | — |
| 日本信号 | 18.3 | 18.5 | 24,124 |
| 京三製作所 | 18.5 | 19 | 9,804 |
| 能美防災 | 9.5 | 9.6 | 22,876 |
| ホーチキ | 5.3 | 6 | 10,002 |
| エレコム | 6.5 | 7.7 | 31,916 |
| パナソニック | 815.1 | 805.2 | 830,966 |
| シャープ | 71.1 | 81.6 | 135,129 |
| アンリツ | 45.8 | 45.7 | 94,690 |
| 富士通ゼネラル | 22.3 | 19.8 | 41,718 |
| ソニー | 478.4 | 444.9 | 3,113,410 |
| TDK | 37.3 | 33.8 | 395,122 |
| 帝国通信工業 | 5.4 | 5.8 | 6,989 |
| タムラ製作所 | 28.1 | 24.2 | 15,972 |
| アルプスアルパイン | 65.3 | 62.2 | 154,691 |
| 日本トリム | 1.6 | 1.3 | 6,448 |
| ローランド ディー・ジー | 4.3 | 4.8 | 10,440 |
| フォスター電機 | 8.8 | 7.7 | 15,577 |
| クラリオン | 6.2 | — | — |
| SMK | 2.6 | 2.4 | 7,149 |
| ヨコオ | 5.7 | 4.6 | 14,973 |
| ホシデン | 21.3 | 19.3 | 25,437 |
| ヒロセ電機 | 10.3 | 10.9 | 149,439 |
| 日本航空電子工業 | 16.4 | 16 | 33,664 |
| TOA | 8.6 | 8.9 | 9,790 |
| マクセルホールディングス | 15.3 | 15.4 | 23,007 |
| 古野電気 | 9.7 | 10.1 | 12,756 |
| ユニデンホールディングス | 2.8 | 2.8 | 5,143 |
| アルパイン | 12.9 | — | — |
| スミダコーポレーション | 7 | 6.4 | 8,480 |
| アイコム | 4.4 | 4.6 | 11,904 |
| リオン | 3.8 | 3.5 | 10,374 |
| 本多通信工業 | 7.6 | — | — |
| 船井電機 | 10.7 | 9.5 | 7,030 |
| 横河電機 | 71.4 | 64.7 | 130,305 |
| 新電元工業 | 2.7 | 2.8 | 10,318 |
| アズビル | 46.2 | 44.1 | 140,458 |
| 東亜ディーケーケー | 4.6 | 5.5 | 4,730 |
| 日本光電工業 | 31.6 | 29.6 | 87,882 |
| チノー | 4.5 | 4.2 | 5,972 |
| 共和電業 | 11.7 | 15.2 | 6,733 |
| 堀場製作所 | 14.3 | 14 | 102,900 |
| アドバンテスト | 49.1 | 52.4 | 278,768 |
| エスベック | 6.9 | 6.5 | 13,858 |
| キーエンス | 35 | 63.8 | 2,422,486 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | |
| 日置電機 | 3.9 | 3.9 | 14,586 |
| シスメックス | 55.6 | 50.5 | 391,930 |
| 日本マイクロニクス | 12.9 | 11.5 | 13,271 |
| メガチップス | 6 | 7 | 17,234 |
| OBARA GROUP | 4.2 | 3.8 | 14,763 |
| コーセル | 10.9 | 9.9 | 12,384 |
| イリソ電子工業 | 6.5 | 6 | 31,800 |
| オプテックスグループ | 12.8 | 11.9 | 19,301 |
| 千代田インテグレ | 3.6 | 3.8 | 9,101 |
| アイ・オー・データ機器 | 4.1 | — | — |
| レーザーテック | 14.7 | 14.4 | 137,952 |
| スタンレー電気 | 50.5 | 49.3 | 153,076 |
| 岩崎電気 | 4.7 | 4.6 | 6,555 |
| ウシオ電機 | 43.7 | 41.4 | 68,020 |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 7.6 | 9.2 | 4,600 |
| アイ・オー・データ機器 | 7.4 | 7.4 | 21,171 |
| 古河電池 | 6.8 | — | — |
| 山一電機 | 5.8 | 5.7 | 9,091 |
| 図研 | 5.4 | 5.1 | 12,801 |
| 日本電子 | 14.3 | 14 | 43,260 |
| カシオ計算機 | 63.2 | 62.6 | 130,208 |
| ファナック | 67.8 | 66.9 | 1,420,956 |
| 日本シイエムケイ | 19.4 | 17.8 | 11,712 |
| エンプラス | 3.6 | 3.6 | 13,140 |
| ローム | 34.5 | 31.2 | 286,104 |
| 浜松ホトニクス | 51.1 | 50.4 | 224,532 |
| 三井ハイテック | 8.5 | 8 | 16,408 |
| 新光電気工業 | 23.7 | 23.6 | 25,865 |
| 京セラ | 108.8 | 99.1 | 737,799 |
| 太陽誘電 | 32.1 | 31.3 | 93,117 |
| 村田製作所 | 74.9 | 206.8 | 1,350,197 |
| ユーション | 13.9 | — | — |
| 双葉電子工業 | 11.6 | 11.5 | 15,973 |
| 北陸電気工業 | — | 4.2 | 4,720 |
| ニチコン | 22.9 | 24.2 | 29,887 |
| 日本ケミコン | 5.4 | 5.9 | 12,277 |
| KOA | 11.2 | 11 | 15,840 |
| 市光工業 | 11.3 | 11.2 | 9,721 |
| 小糸製作所 | 42.5 | 42.1 | 239,970 |
| ミツバ | 14 | 14 | 10,374 |
| SCREENホールディングス | 12.5 | 12.3 | 93,480 |
| キャノン電子 | 6.5 | 7.5 | 15,562 |
| キャノン | 384.4 | 378.8 | 1,153,824 |
| リコー | 214.3 | 179.1 | 201,308 |
| 象印マホービン | 13.6 | 21.1 | 37,937 |
| 東京エレクトロン | 47.6 | 46.9 | 1,058,533 |
| 輸送用機器 (7.8%) | | | |
| トヨタ紡織 | 24.9 | 20.2 | 34,865 |
| ユニプレス | 14.5 | 13.8 | 23,294 |
| 豊田自動織機 | 57.5 | 56.9 | 368,143 |
| モリタホールディングス | 12.5 | 12.5 | 21,950 |
| 三櫻工業 | 11.2 | 8.5 | 11,390 |
| デンソー | 158.2 | 155 | 767,715 |

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 | |
| 東海理化電機製作所 | 19 | 18.4 | 39,799 |
| 三井E&Sホールディングス | 26.4 | 14.9 | 13,737 |
| 川崎重工 | 55.5 | 54.7 | 135,710 |
| 名村造船所 | 23.5 | 27.4 | 7,863 |
| 日本車輜製造 | 3.1 | 3.3 | 10,477 |
| 三菱ロジスネクスト | 9.2 | 9.2 | 11,279 |
| 日産自動車 | 841.4 | 830.6 | 571,701 |
| いすゞ自動車 | 226.2 | 204.9 | 264,423 |
| トヨタ自動車 | 795.5 | 784.8 | 6,072,782 |
| 日野自動車 | 88.9 | 87.7 | 96,645 |
| 三菱自動車工業 | 263.9 | 261.1 | 129,505 |
| エフテック | 6.7 | 7.6 | 5,738 |
| 武蔵精密工業 | 16.8 | 15.9 | 24,215 |
| 日産車体 | 14.8 | 14.2 | 16,159 |
| 新明和工業 | 33 | 19.2 | 28,032 |
| 極東開発工業 | 14.4 | 12.7 | 20,713 |
| 日信工業 | 12.8 | 14.3 | 31,803 |
| トビー工業 | 6 | 6 | 12,504 |
| ティラド | 3.3 | 3.5 | 7,122 |
| タチエス | 12.3 | 12 | 17,304 |
| NOK | 38.5 | 38.1 | 65,874 |
| フタバ産業 | 20.3 | 20.1 | 16,602 |
| KYB | 7.6 | 8 | 26,520 |
| 大同メタル工業 | 13.3 | 16.8 | 12,230 |
| プレス工業 | 35.9 | 35.7 | 15,850 |
| ミクニ | 11.2 | — | — |
| 太平洋工業 | 14.9 | 15 | 22,695 |
| ケーヒン | 16.1 | 16 | 41,152 |
| 河西工業 | 9.9 | 11 | 9,603 |
| アイシン精機 | 58.5 | 57.7 | 244,936 |
| マツダ | 224.9 | 206.8 | 202,043 |
| 今仙電機製作所 | 8.8 | 9.5 | 8,939 |
| 本田技研工業 | 602 | 554.3 | 1,720,547 |
| スズキ | 130.7 | 139.7 | 664,273 |
| SUBARU | 221.6 | 218.9 | 629,009 |
| 安永 | 3.9 | 4.1 | 5,301 |
| ヤマハ発動機 | 100.5 | 92 | 212,244 |
| ショーワ | 16.9 | 16.6 | 37,798 |
| TBK | 16.5 | 15.3 | 6,594 |
| エクセディ | 9.2 | 9.4 | 23,575 |
| 豊田合成 | 23.2 | 22.7 | 59,110 |
| 愛三工業 | 12.9 | 12.3 | 10,651 |
| 日本プラスト | 7.4 | 8.4 | 6,031 |
| ヨロズ | 7.4 | 7.7 | 11,134 |
| エフ・シー・シー | 12.7 | 11.3 | 27,255 |
| シマノ | 28.7 | 26.3 | 471,296 |
| テイ・エス テック | 16.8 | 16.4 | 56,006 |
| ジャムコ | 3.9 | 4.8 | 7,248 |
| 精密機器 (2.3%) | | | |
| テルモ | 100.7 | 199.3 | 779,263 |
| 日機装 | 23.2 | 21.6 | 29,116 |
| 日本エム・ディ・エム | — | 4.6 | 10,704 |
| 島津製作所 | 91.4 | 84.3 | 279,454 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 |
|---------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | |
| JMS | 12 | 9.6 | 7,132 |
| 長野計器 | 7.4 | 7.8 | 6,107 |
| ブイ・テクノロジ | 1.7 | 3.3 | 19,833 |
| 東京計器 | 6 | 6.4 | 6,496 |
| インターアクション | 4.3 | 4.2 | 10,508 |
| 東京精密 | 12.7 | 12.8 | 50,368 |
| マニー | 8.8 | 28.3 | 83,060 |
| ニコン | 123.9 | 113.6 | 171,081 |
| トプコン | 38.6 | 36.1 | 53,103 |
| オリンパス | 105.9 | 390 | 637,260 |
| 理研計器 | 6.4 | 6.1 | 14,182 |
| タムロン | 6.4 | 5.9 | 14,921 |
| HOYA | 143.7 | 141.8 | 1,421,545 |
| シード | 3.5 | — | — |
| ノーリツ鋼機 | 5.8 | 5.2 | 9,859 |
| エー・アンド・デイ | 7.9 | 7.9 | 6,343 |
| 朝日インテック | 25.6 | 59.7 | 190,741 |
| シチズン時計 | 78.4 | 82.7 | 50,447 |
| リズム時計工業 | 3.5 | — | — |
| 大研医器 | 8.5 | — | — |
| メニコン | 9.9 | 9.6 | 41,760 |
| 松風 | 3.2 | 4.3 | 7,310 |
| セイコーホールディングス | 11.1 | 9.8 | 27,596 |
| ニプロ | 49.9 | 49.9 | 66,217 |
| その他製品 (2.3%) | | | |
| スノーピーク | 3.2 | 4.5 | 4,932 |
| パラマウントベッドホールディングス | 8.1 | 7.3 | 31,463 |
| トランザクション | 5.1 | 5.3 | 5,300 |
| ニホンフラッシュ | 3.6 | 3.7 | 10,430 |
| 前田工織 | 8.1 | 8.1 | 15,795 |
| 永大産業 | 16.8 | 14.7 | 5,012 |
| アートネイチャー | 10.7 | 8.2 | 6,338 |
| バンダイナムコホールディングス | 73.7 | 73 | 488,224 |
| SHOEI | 3.5 | 3.4 | 17,204 |
| フランスベッドホールディングス | 12.8 | 11.8 | 12,059 |
| パイロットコーポレーション | 12.6 | 12.5 | 53,375 |
| 萩原工業 | 4.7 | 4.4 | 7,114 |
| トッパン・フォームズ | 15.1 | 14.9 | 17,313 |
| フジシールインターナショナル | 15.9 | 15.9 | 39,543 |
| タカラトミー | 30.1 | 31.8 | 42,771 |
| 廣済堂 | 12 | 7.6 | 6,688 |
| プロネクス | 7.9 | 7.2 | 8,683 |
| 大建工業 | 5.8 | 5 | 9,870 |
| 凸版印刷 | 99.6 | 99.2 | 216,057 |
| 大日本印刷 | 100 | 91.7 | 269,598 |
| 図書印刷 | 8.1 | — | — |
| 共同印刷 | 3.3 | 2 | 5,900 |
| NISSHA | 14.9 | 14.8 | 16,768 |
| TAKARA & COMPANY | 5.1 | 3.7 | 6,297 |
| アシックス | 71 | 58.9 | 105,195 |
| 小松ウオール工業 | — | 2.6 | 6,260 |
| ヤマハ | 42.4 | 41.7 | 255,621 |
| 河合楽器製作所 | 2.5 | 2.5 | 9,187 |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 |
|---------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | |
| クリナップ | 9.5 | 9 | 6,345 |
| ビジョン | 43.3 | 42.6 | 215,982 |
| キングジム | 8.8 | 6.8 | 6,065 |
| リンテック | 17.2 | 17 | 41,871 |
| イトーキ | 15.8 | 18.5 | 9,564 |
| 任天堂 | 44 | 43.2 | 1,867,968 |
| 三菱鉛筆 | 11.7 | 11.5 | 19,975 |
| タカラスタンダード | 14.3 | 14.1 | 28,298 |
| コクヨ | 34.4 | 34 | 55,590 |
| ナカバヤシ | 7.8 | 7.4 | 4,395 |
| グロープライド | 3.9 | 3.6 | 9,730 |
| オカムラ | 24.6 | 24.3 | 26,244 |
| 美津濃 | 7.1 | 6.5 | 18,232 |
| 電気・ガス業（1.5%） | | | |
| 東京電力ホールディングス | 568.1 | 558.3 | 269,658 |
| 中部電力 | 218.2 | 215.4 | 330,746 |
| 関西電力 | 291.2 | 267.2 | 334,267 |
| 中国電力 | 97.5 | 96.8 | 140,940 |
| 北陸電力 | 70.1 | 66 | 52,140 |
| 東北電力 | 166.5 | 176 | 194,480 |
| 四国電力 | 64.3 | 63.8 | 67,564 |
| 九州電力 | 145.8 | 143.7 | 139,532 |
| 北海道電力 | 67.5 | 68.1 | 36,229 |
| 沖縄電力 | 13.1 | 13 | 26,039 |
| 電源開発 | 56.5 | 55.7 | 149,164 |
| エフオン | 5.2 | — | — |
| イーレックス | 12.9 | 10.4 | 18,168 |
| レノバ | 7.7 | 11.5 | 13,340 |
| 東京瓦斯 | 140.2 | 136 | 360,808 |
| 大阪瓦斯 | 139.1 | 136.7 | 283,925 |
| 東邦瓦斯 | 35.2 | 34.9 | 145,533 |
| 北海道瓦斯 | 5 | 4.6 | 7,295 |
| 広島ガス | 20.5 | 17 | 6,103 |
| 西部瓦斯 | 8.1 | 7.8 | 19,656 |
| 静岡ガス | 21.7 | 20.4 | 18,931 |
| メタウォーター | 3.8 | 3.2 | 13,024 |
| 陸運業（4.5%） | | | |
| SBSホールディングス | 7.8 | 6.6 | 12,982 |
| 東武鉄道 | 74.8 | 73.9 | 299,664 |
| 相鉄ホールディングス | 24.5 | 22.8 | 69,312 |
| 東急 | 193.5 | 177.4 | 386,199 |
| 京浜急行電鉄 | 97.9 | 90.4 | 202,676 |
| 小田急電鉄 | 113.6 | 104 | 281,632 |
| 京王電鉄 | 39.6 | 36.5 | 257,690 |
| 京成電鉄 | 53.3 | 48.8 | 221,308 |
| 富士急行 | 9.8 | 9.8 | 41,797 |
| 新京成電鉄 | 3.4 | 2.8 | 6,448 |
| 東日本旅客鉄道 | 126.9 | 124 | 1,250,540 |
| 西日本旅客鉄道 | 64.2 | 62.8 | 607,590 |
| 東海旅客鉄道 | 63.9 | 58.5 | 1,301,332 |
| 西武ホールディングス | 91 | 94.6 | 182,578 |
| 鴻池運輸 | 11.2 | 10.6 | 17,627 |
| 西日本鉄道 | 20 | 20 | 52,580 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 |
|-----------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | |
| ハマキョウレックス | 5.5 | 5.5 | 20,157 |
| サカイ引越センター | 3.8 | 3.7 | 25,789 |
| 近鉄グループホールディングス | 67.2 | 66.6 | 409,590 |
| 阪急阪神ホールディングス | 90 | 88.9 | 421,830 |
| 南海電気鉄道 | 30.4 | 32.1 | 97,584 |
| 京阪ホールディングス | 29.9 | 29.6 | 161,320 |
| 神戸電鉄 | 2.7 | 1.7 | 6,783 |
| 名古屋鉄道 | 53.7 | 54.5 | 190,477 |
| 山陽電気鉄道 | 5.6 | 5.9 | 13,263 |
| 日本通運 | 26.4 | 23.5 | 164,735 |
| ヤマトホールディングス | 118.8 | 117.1 | 222,607 |
| 山九 | 18.8 | 18.5 | 105,265 |
| 丸全昭和運輸 | 5.5 | 5.7 | 17,727 |
| センコーグループホールディングス | 37.2 | 35.9 | 32,920 |
| トナミホールディングス | 1.8 | 1.8 | 9,216 |
| ニッコンホールディングス | 25.9 | 23.8 | 64,974 |
| 福山通運 | 8.6 | 8.4 | 35,154 |
| セイノーホールディングス | 50.8 | 49.7 | 73,506 |
| 神奈川中央交通 | 2.5 | 2.3 | 9,234 |
| 日立物流 | 14.3 | 11.8 | 36,698 |
| 丸和運輸機関 | 3.6 | 6.9 | 17,733 |
| C&Fロジホールディングス | 8.6 | 7.6 | 10,700 |
| 九州旅客鉄道 | 56.8 | 59.6 | 225,288 |
| SGホールディングス | 63.9 | 70 | 184,310 |
| 海運業（0.2%） | | | |
| 日本郵船 | 56 | 55.4 | 106,645 |
| 商船三井 | 39.9 | 41.9 | 123,269 |
| 川崎汽船 | 21.2 | 19.8 | 37,204 |
| N Sユナイテッド海運 | 4.1 | 4.4 | 10,203 |
| 飯野海運 | 33.8 | 38.2 | 13,752 |
| 乾汽船 | 8 | 5.8 | 6,658 |
| 空運業（0.5%） | | | |
| 日本航空 | 124.1 | 122.3 | 414,719 |
| A N Aホールディングス | 124.1 | 122.2 | 459,227 |
| 倉庫・運輸関連業（0.2%） | | | |
| トランコム | 1.9 | 2 | 15,600 |
| 日新 | 6 | 6.3 | 10,980 |
| 三菱倉庫 | 23.4 | 21.3 | 60,385 |
| 三井倉庫ホールディングス | 8.6 | 8.1 | 16,191 |
| 住友倉庫 | 26.1 | 24 | 36,240 |
| 澁澤倉庫 | 5.5 | 4.6 | 9,885 |
| 東陽倉庫 | 25.3 | 20.9 | 7,022 |
| 日本トランスシティ | 19.5 | 17.3 | 9,480 |
| 川西倉庫 | 2.6 | 3.2 | 3,372 |
| 安田倉庫 | 8.7 | 7.5 | 7,462 |
| 東洋埠頭 | 2.4 | 4.9 | 6,918 |
| 上組 | 42.2 | 38.6 | 94,338 |
| キューソー流通システム | 2.3 | — | — |
| 近鉄エクスプレス | 12.6 | 14 | 27,216 |
| エアアティー | 5.4 | 6.4 | 6,195 |
| 日本コンセプト | — | 3.6 | 5,148 |
| 情報・通信業（8.5%） | | | |
| NECネットエスアイ | 7.6 | 6.5 | 22,392 |

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 |
| システナ | 25.3 | 24.4 | 42,846 | |
| デジタルアーツ | 3.9 | 3.5 | 22,120 | |
| 日鉄ソリューションズ | 10.4 | 10.2 | 38,862 | |
| キューブシステム | 6.1 | 6.8 | 5,426 | |
| コア | 4.4 | 3.9 | 5,635 | |
| ソリトンシステムズ | 5.3 | 4.7 | 5,165 | |
| ソフトクリエイトホールディングス | 4.4 | 4 | 7,136 | |
| T I S | 23.4 | 23 | 152,030 | |
| ネオス | 2.9 | — | — | |
| 電算システム | 3.9 | 3.3 | 9,850 | |
| グリー | 38 | 49.7 | 25,993 | |
| ユーエーテックモホールディングス | 14.4 | 14.1 | 37,844 | |
| 三菱総合研究所 | 3 | 3.3 | 13,827 | |
| ファインデックス | 8.1 | 7.6 | 9,074 | |
| ブレインパッド | 1.6 | 1.5 | 8,625 | |
| K L a b | 13 | 14 | 11,900 | |
| ホールトゥウィン・ビットクルーホールディ | 4.9 | 9.5 | 10,203 | |
| イーブックイニシアティブジャパン | 1.5 | — | — | |
| ネクソン | 178.6 | 196.8 | 295,396 | |
| アイスタイル | 18.4 | 18.7 | 15,128 | |
| エムアップ | 2.7 | 2.5 | 6,462 | |
| エイチーム | 4.9 | 6.7 | 7,624 | |
| エンゲモ | — | 6.5 | 6,870 | |
| テクノスジャパン | 6.9 | — | — | |
| コロブラ | 20.8 | 23.2 | 29,533 | |
| ブロードリーフ | 36.3 | 36.1 | 25,594 | |
| デジタルハーツホールディングス | 4.3 | 5.4 | 5,518 | |
| システム情報 | — | 4.3 | 4,790 | |
| メディアドゥホールディングス | 2.4 | 2.5 | 9,400 | |
| じげん | 9.3 | 19.6 | 10,858 | |
| フィックスターズ | 7.3 | 8 | 13,024 | |
| CARTA HOLDINGS | 4.8 | 4.5 | 6,129 | |
| オブティム | 1.8 | 2.4 | 8,364 | |
| セレス | 2.8 | 3.2 | 3,900 | |
| S H I F T | — | 1.8 | 14,364 | |
| ティーガイア | 6.9 | 6.1 | 15,975 | |
| セック | 1.4 | 1.5 | 5,827 | |
| 豆蔵ホールディングス | 7.1 | 5.4 | 7,792 | |
| テクマトリックス | 5.4 | 5 | 11,625 | |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 174.5 | 17.3 | 41,468 | |
| GMOペイメントゲートウェイ | 11.6 | 11.5 | 90,965 | |
| システムリサーチ | 1.2 | 2.6 | 4,755 | |
| インターネットイニシアティブ | 11.6 | 10.6 | 27,061 | |
| さくらインターネット | 10.5 | 8.4 | 5,577 | |
| ヴィンクス | 2.7 | — | — | |
| GMOクラウド | 2 | 1.8 | 5,250 | |
| S R Aホールディングス | 4.1 | 4.4 | 11,202 | |
| e B A S E | 2.9 | 4.8 | 5,745 | |
| アバント | — | 5.8 | 6,008 | |
| アドソル日進 | 2.9 | 2.8 | 6,678 | |
| フリービット | 5.8 | 5.5 | 5,131 | |
| コムチュア | 4.2 | 7.9 | 18,975 | |
| アステリア | 4.4 | 5.7 | 3,687 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | |
|-----------------------|---------|-------|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| マークラインズ | 3.3 | 4.3 | 8,987 | |
| メディカル・データ・ビジョン | 6.6 | 6.1 | 6,002 | |
| g u m i | 9.1 | 10.2 | 7,354 | |
| モバイルファクトリー | 2.5 | 2.3 | 3,210 | |
| テラスカイ | — | 3 | 8,553 | |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 3.6 | 3.9 | 6,606 | |
| P C Iホールディングス | 1.7 | — | — | |
| ダブルスタンダード | — | 1.1 | 6,050 | |
| オーブンドア | 3.8 | 4 | 7,136 | |
| アカツキ | 2.6 | 2.6 | 16,692 | |
| Ubicomホールディングス | — | 2.3 | 2,895 | |
| L I N E | 21.6 | 16.1 | 82,754 | |
| チェンジ | — | 1.8 | 4,528 | |
| オークネット | 5.2 | 5.8 | 7,801 | |
| A O I T Y O Holdings | 8.3 | 8.7 | 6,011 | |
| マクロミル | 9.2 | 13.6 | 13,940 | |
| オロ | 0.9 | 2.2 | 9,449 | |
| サインポスト | — | 1.5 | 2,749 | |
| ソルクシーズ | — | 4.4 | 4,184 | |
| フェイス | 4.5 | — | — | |
| プロトコーポレーション | — | 7.5 | 7,807 | |
| 野村総合研究所 | 44.5 | 115.1 | 265,765 | |
| サイバネットシステム | 7.6 | 6.5 | 5,096 | |
| インテージホールディングス | 10.7 | 10.7 | 10,314 | |
| ソースネクスト | 28.2 | 34.8 | 17,086 | |
| インフォコム | — | 7.7 | 19,003 | |
| ラクスル | — | 3.9 | 14,293 | |
| アルテリア・ネットワークス | — | 8.5 | 13,829 | |
| フォーカスシステムズ | 6 | 6.2 | 5,592 | |
| クレスコ | 2.4 | 2.5 | 8,950 | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 73 | 67.1 | 100,448 | |
| オービック | 24.3 | 23.9 | 349,179 | |
| ジャストシステム | 10.1 | 11.2 | 63,392 | |
| T D Cソフト | 7.1 | 7.2 | 6,472 | |
| Zホールディングス | 457.5 | 949.7 | 363,735 | |
| トレンドマイクロ | 37.4 | 30.9 | 185,400 | |
| I Dホールディングス | — | 3.9 | 5,616 | |
| 日本オラクル | 11.4 | 13.9 | 139,417 | |
| アルファシステムズ | 2.9 | 2.7 | 7,570 | |
| フューチャー | 10.1 | 8.7 | 16,051 | |
| C A C Holdings | 7.7 | 5.9 | 9,274 | |
| S Bテクノロジー | 3.2 | 3 | 5,973 | |
| オービックビジネスコンサルタント | 3.6 | 7 | 34,230 | |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 32 | 31.4 | 92,661 | |
| アイティフォー | 9.9 | 10.3 | 9,053 | |
| 大塚商会 | 37.9 | 37.2 | 164,424 | |
| サイボウズ | 10.2 | 9.7 | 11,620 | |
| ソフトブレイン | — | 5.5 | 3,118 | |
| 電通国際情報サービス | 4.5 | 4.3 | 18,081 | |
| デジタルガレージ | 13.9 | 12.7 | 52,514 | |
| E Mシステムズ | 7.2 | 5.3 | 10,907 | |
| ウェザーニューズ | 3 | 3 | 10,320 | |
| C I J | 9 | 8.2 | 8,241 | |

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 |
| WOWOW | 3.6 | 3.5 | 9,453 | |
| スカラ | 7.4 | 6.4 | 5,036 | |
| IMAGICA GROUP | 7.4 | 7.8 | 5,023 | |
| ネットワンシステムズ | 24.9 | 26.5 | 83,475 | |
| アルゴグラフィックス | 3.1 | 6 | 20,010 | |
| マーベラス | 12.2 | 13.1 | 9,929 | |
| エイベックス | 12.3 | 12.6 | 16,808 | |
| 日本ユニシス | 21.8 | 21.7 | 78,011 | |
| 兼松エレクトロニクス | 3.9 | 3.8 | 13,015 | |
| 東京放送ホールディングス | 46.7 | 42.3 | 74,025 | |
| 日本テレビホールディングス | 64.4 | 58.3 | 84,651 | |
| 朝日放送グループホールディングス | 10.5 | 10.8 | 8,089 | |
| テレビ朝日ホールディングス | 19.6 | 19.7 | 34,849 | |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 53.4 | 47 | 21,808 | |
| テレビ東京ホールディングス | 5.8 | 6 | 13,818 | |
| ビジョン | 2.3 | 6.7 | 12,013 | |
| コネクシオ | 5.5 | 4.8 | 7,320 | |
| 日本電信電話 | 479.1 | 461.8 | 2,585,156 | |
| KDD I | 617.2 | 514.8 | 1,621,620 | |
| ソフトバンク | — | 627.4 | 930,747 | |
| 光通信 | 8.3 | 7.1 | 183,748 | |
| N T T ドコモ | 503 | 510.1 | 1,533,870 | |
| エムティーアイ | 10.2 | 9.1 | 6,297 | |
| GMOインターネット | 25.9 | 27.5 | 62,397 | |
| K A D O K A W A | 20.6 | 19.1 | 33,921 | |
| 学研ホールディングス | 2.5 | 2.5 | 18,725 | |
| ゼンリン | 14.1 | 14 | 26,698 | |
| アイネット | 5.2 | 4.7 | 7,167 | |
| 松竹 | 4.8 | 4.6 | 74,658 | |
| 東宝 | 46.1 | 41.5 | 185,297 | |
| 東映 | 2.9 | 2.6 | 44,642 | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 186.5 | 182.8 | 277,490 | |
| ビー・シー・エー | — | 1.3 | 5,824 | |
| D T S | 7.7 | 14.9 | 35,044 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 32.7 | 29.7 | 162,459 | |
| シーイーシー | 7.7 | 7.7 | 17,409 | |
| カプコン | 30.5 | 33.1 | 86,821 | |
| アイ・エス・ビー | 1.7 | — | — | |
| ジャステック | 5.8 | 6.4 | 7,168 | |
| S C S K | 18.6 | 16 | 92,320 | |
| 日本システムウエア | 2.8 | 2.6 | 6,692 | |
| アイネス | 10.1 | 8.3 | 11,329 | |
| T K C | 5.9 | 5.7 | 29,241 | |
| 富士ソフト | 10.4 | 9 | 38,475 | |
| N S D | 11.2 | 11.4 | 40,926 | |
| コナミホールディングス | 28.7 | 25.2 | 122,472 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 3 | 3 | 11,625 | |
| J B C Cホールディングス | 6.6 | 5.6 | 10,432 | |
| ミロク情報サービス | 7.3 | 6.3 | 21,325 | |
| ソフトバンクグループ | 292.8 | 548.1 | 2,321,751 | |
| 卸売業（5.0%） | | | | |
| 伊藤忠食品 | 1.9 | 1.9 | 9,918 | |
| エレマテック | 3.8 | 8.1 | 8,561 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| J A L U X | 2.4 | 2.7 | 6,806 | |
| あらた | 4 | 5.6 | 24,164 | |
| 東京エレクトロン デバイス | 3.8 | 3.6 | 8,118 | |
| フィールズ | 7.8 | 8.5 | 4,241 | |
| 双日 | 387.2 | 378.2 | 132,748 | |
| アルフレッサ ホールディングス | 77.8 | 76.5 | 176,179 | |
| 横浜冷凍 | 19.1 | 20.7 | 22,356 | |
| アルコニックス | 8.7 | 8.3 | 12,010 | |
| 神戸物産 | 10.6 | 23.8 | 80,682 | |
| あい ホールディングス | 11.5 | 10.5 | 20,968 | |
| ダイワボウホールディングス | 6.4 | 5.9 | 32,922 | |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 19 | 16.9 | 31,670 | |
| ラクト・ジャパン | 1.6 | 2.8 | 9,744 | |
| バイタルケ-エスケー-ホールディングス | 13.3 | 13.5 | 14,958 | |
| 八洲電機 | 9 | 8.4 | 7,408 | |
| レスターホールディングス | 5.2 | 7.4 | 15,066 | |
| ジュテックホールディングス | 2.5 | 2.4 | 2,608 | |
| T O K A Iホールディングス | 36.7 | 36.2 | 40,109 | |
| 三洋貿易 | 4.4 | 4.1 | 9,643 | |
| ウイン・パートナーズ | 5.3 | 5.6 | 8,321 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 14.5 | 11.2 | 51,296 | |
| コメダホールディングス | 16.6 | 15.9 | 33,787 | |
| 小野建 | 7.1 | 7.5 | 10,110 | |
| 佐鳥電機 | 6.6 | 7.3 | 6,679 | |
| 伯東 | 5.7 | 5.3 | 6,948 | |
| コンドーテック | 8 | 5.8 | 6,391 | |
| ナガイレーベン | 10.4 | 10.6 | 27,146 | |
| 三菱食品 | 7.5 | 7 | 20,524 | |
| 松田産業 | 6.2 | 5.8 | 9,088 | |
| 第一興商 | 10.7 | 10.6 | 57,452 | |
| メディバルホールディングス | 75.6 | 74.3 | 176,239 | |
| S P K | 2 | 2.6 | 7,410 | |
| 萩原電気ホールディングス | 3.2 | 3.2 | 9,056 | |
| アズワン | 5 | 4.6 | 43,976 | |
| 尾家産業 | 4.1 | 3.6 | 4,849 | |
| シモジマ | 4.1 | 6.1 | 7,564 | |
| ドウシシャ | 6.5 | 6.8 | 12,308 | |
| 高速 | 6.5 | 5.5 | 6,512 | |
| 丸文 | 9 | — | — | |
| ハビネット | 6.3 | 6.7 | 9,594 | |
| 日本ライフライン | 22.1 | 20.4 | 31,497 | |
| エクセル | 3.2 | — | — | |
| マルカ | 3.1 | 3.3 | 7,583 | |
| I D O M | 25.4 | 21 | 11,130 | |
| 日本エム・ディ・エム | 4.8 | — | — | |
| 進和 | 4.8 | 4.7 | 11,054 | |
| タイトロン | 3.9 | 3.9 | 6,618 | |
| シークス | 9.2 | 9.2 | 14,296 | |
| オーハシテクニカ | 5.7 | 5.7 | 8,333 | |
| 白銅 | 3.5 | — | — | |
| 伊藤忠商事 | 491.8 | 484.9 | 1,182,186 | |
| 丸紅 | 693.9 | 722.3 | 596,041 | |
| 長瀬産業 | 39.7 | 39 | 63,492 | |

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 | |
| 蝶理 | 5.4 | 4.9 | 9,672 |
| 豊田通商 | 77.8 | 77.4 | 300,699 |
| 三共生興 | 16.8 | 15 | 9,015 |
| 兼松 | 27.4 | 24.9 | 35,158 |
| 三井物産 | 579.1 | 609.2 | 1,198,601 |
| 日本紙バルブ商事 | 4.1 | 4.1 | 16,646 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 21.4 | 24.1 | 172,797 |
| カメイ | 9.9 | 9.6 | 11,779 |
| スターゼン | 2.7 | 2.7 | 11,893 |
| 山善 | 26.6 | 26.1 | 27,274 |
| 椿本興業 | 2.2 | 1.6 | 6,432 |
| 住友商事 | 415.9 | 437.8 | 725,215 |
| 内田洋行 | 3.9 | 3.2 | 16,768 |
| 三菱商事 | 493.2 | 486.7 | 1,415,080 |
| 第一実業 | 3.5 | 3.8 | 14,117 |
| キャンノマーケティングジャパン | 20.4 | 20.3 | 50,953 |
| 西華産業 | 4.8 | 5.4 | 7,608 |
| 佐藤商事 | 8 | 7.7 | 7,022 |
| 菱洋エレクトロ | 7.8 | 7.2 | 14,731 |
| 東京産業 | 9.4 | 9.1 | 5,105 |
| ユアサ商事 | 7 | 6.2 | 21,700 |
| 神鋼商事 | 2 | 2.2 | 5,838 |
| 阪和興業 | 12.4 | 13.1 | 37,204 |
| 正栄食品工業 | 3.8 | 4.7 | 15,909 |
| カナデン | 8.2 | 7 | 9,275 |
| 菱電商事 | 6.9 | 6.1 | 10,095 |
| フルサト工業 | 5.2 | 5.2 | 8,559 |
| 岩谷産業 | 15.8 | 15.6 | 57,330 |
| 極東貿易 | 3 | 3.2 | 7,020 |
| イワキ | 10.8 | 12.3 | 5,854 |
| 三愛石油 | 18.6 | 17.2 | 18,214 |
| 稲畑産業 | 16.3 | 14.3 | 22,679 |
| 明和産業 | — | 8.4 | 5,208 |
| ワキタ | 15.7 | 15.7 | 17,191 |
| 東邦ホールディングス | 20.9 | 22.6 | 57,336 |
| サンゲツ | 21.9 | 19 | 40,565 |
| ミツロコグループホールディングス | 11.9 | 10.7 | 15,194 |
| シナネンホールディングス | 3.6 | 3.9 | 7,534 |
| 伊藤忠エネクス | 14.8 | 14.8 | 13,246 |
| サンリオ | 22.5 | 19.5 | 43,563 |
| サンワテクノス | 5.7 | 6.6 | 7,913 |
| リョーサン | 8.2 | 7.7 | 22,691 |
| 新光商事 | 7.4 | 11.7 | 10,530 |
| トーヨー | 4.1 | 4.3 | 8,053 |
| 三信電気 | 6.2 | 4.4 | 7,480 |
| 東陽テクニカ | 11 | 10 | 11,400 |
| モスフードサービス | 8.9 | 9.3 | 28,551 |
| 加賀電子 | 7 | 7.1 | 17,522 |
| ソーダニッカ | 9.9 | 10.5 | 6,415 |
| 立花エレテック | 6.1 | 5.8 | 10,196 |
| PAL TAC | 12.5 | 11 | 59,400 |
| 太平洋興発 | 5.4 | 6.6 | 5,332 |
| 西本Wismettacホールディングス | 1.7 | 1.7 | 6,655 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 |
|--------------------|---------|------|---------|
| | 株数 | 株数 | |
| 国際紙バルブ商事 | — | 20.5 | 6,170 |
| ヤマタネ | 4.8 | 4.8 | 7,219 |
| 日鉄物産 | 4.7 | 4.6 | 23,322 |
| 泉州電業 | 3 | 2.8 | 8,173 |
| トラスコ中山 | 14.3 | 14.2 | 39,745 |
| オートボックスセブン | 28.5 | 26.1 | 47,006 |
| モリト | 7.4 | 7.7 | 6,160 |
| 加藤産業 | 10.6 | 10.6 | 38,849 |
| イノテック | 5.8 | 5.8 | 6,101 |
| イエローハット | 6.7 | 13.1 | 26,252 |
| JKホールディングス | 10 | 9.3 | 6,017 |
| 日伝 | 6.6 | 6.6 | 13,833 |
| 杉本商事 | 4.8 | 4.7 | 9,423 |
| 因幡電機産業 | 9.6 | 19.4 | 51,817 |
| バイテックホールディングス | 3 | — | — |
| 東テク | 2.8 | 2.8 | 6,792 |
| ミスミグループ本社 | 88 | 86.7 | 237,384 |
| タキヒヨー | 3.4 | 2.8 | 5,426 |
| スズケン | 32 | 29.4 | 143,766 |
| ジェコス | 6.5 | 7.2 | 6,876 |
| 小売業（4.7%） | | | |
| ローソン | 17.8 | 17.7 | 107,616 |
| サンエー | 5.2 | 5.6 | 28,280 |
| カワチ薬品 | 6 | 5.5 | 12,677 |
| エービーシー・マート | 11 | 10.8 | 80,568 |
| アスクル | 6.1 | 7.5 | 22,537 |
| ゲオホールディングス | 10.8 | 12.7 | 16,738 |
| アダストリア | 10 | 9.8 | 24,852 |
| くら寿司 | 4.2 | 3.7 | 18,074 |
| キャンドゥ | 5.1 | 5 | 8,175 |
| バルグループホールディングス | 3.9 | 3.7 | 13,227 |
| エディオン | 29.3 | 31.1 | 36,915 |
| サーラコーポレーション | 16.6 | 16.3 | 10,154 |
| ハローズ | 3.1 | 2.9 | 7,482 |
| フジオフードシステム | — | 3.4 | 12,138 |
| あみやき亭 | 1.9 | 2.2 | 8,019 |
| ひらまつ | 19.6 | 20.5 | 6,252 |
| 大黒天物産 | 2 | 2.1 | 6,741 |
| ハニーズホールディングス | 8.8 | 7.1 | 9,869 |
| アルペン | 6 | 5.9 | 10,856 |
| クオールホールディングス | 10.5 | 10.6 | 16,790 |
| ジンスホールディングス | 4.9 | 3.8 | 25,536 |
| ビックカメラ | 37.1 | 40.3 | 48,883 |
| DCMホールディングス | 37 | 36.4 | 38,911 |
| ペッパーフードサービス | 5.7 | — | — |
| MonotaRO | 44.8 | 49.4 | 152,399 |
| DDホールディングス | 2 | 3.3 | 5,171 |
| アークランドサービスホールディングス | 5.5 | 5.6 | 10,477 |
| J. フロント リテイリング | 90.1 | 82.7 | 121,817 |
| ドトール・日レスホールディングス | 12.1 | 10.5 | 23,446 |
| マツモトキヨシホールディングス | 29.1 | 28.4 | 119,280 |
| ブロンコピリー | 3.9 | 3.9 | 10,689 |
| ZOZO | 76.3 | 48 | 105,888 |

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 |
| 物語コーポレーション | 2.1 | 1.8 | 15,534 | |
| ココカラファイン | 7.8 | 7.2 | 46,368 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 131.3 | 121.4 | 120,186 | |
| H a m e e | 2.2 | 2.8 | 3,914 | |
| ウエルシアホールディングス | 18.5 | 20.6 | 139,874 | |
| クリエイトSDホールディングス | 10.1 | 9.5 | 25,422 | |
| チムニー | 2.8 | 3 | 6,924 | |
| シュッピン | 5.3 | 5.9 | 6,885 | |
| ネクステージ | 11 | 10.3 | 12,308 | |
| ジョイフル本田 | 20.3 | 20.4 | 29,845 | |
| 鳥貴族 | 2.9 | 3 | 5,691 | |
| キリン堂ホールディングス | 3.4 | 3.2 | 6,588 | |
| ホットランド | 5.1 | 6.3 | 8,523 | |
| すかいらーくホールディングス | 65.8 | 77.9 | 172,704 | |
| S F Pホールディングス | — | 3.7 | 8,140 | |
| 綿半ホールディングス | 3.1 | 3.1 | 6,246 | |
| コイテッド・スーパーマーケット・ホール | 19 | 18.5 | 18,148 | |
| B E E N O S | — | 3.4 | 5,232 | |
| あさひ | 6.7 | 6.2 | 7,830 | |
| 日本調剤 | 2.7 | 2.3 | 8,694 | |
| コスモス薬品 | 3.6 | 3.1 | 68,975 | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 294.5 | 271.5 | 1,116,679 | |
| 薬王堂 | 3.1 | — | — | |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 18.8 | 18.6 | 34,242 | |
| ツルハホールディングス | 15.3 | 15 | 196,050 | |
| サンマルクホールディングス | 5.4 | 5.4 | 12,592 | |
| トリドールホールディングス | 8.9 | 8.7 | 25,047 | |
| T O K Y O B A S E | 7.3 | 7.3 | 5,234 | |
| ジャバンミート | 3.1 | 3.9 | 8,443 | |
| アレンザホールディングス | 5 | — | — | |
| パロックジャパンリミテッド | 6.9 | 6.7 | 6,338 | |
| クスリのアオキホールディングス | 5.5 | 6.9 | 57,201 | |
| 力の源ホールディングス | — | 4.1 | 3,575 | |
| スシローグローバルホールディングス | 7.8 | 7.6 | 65,056 | |
| L I X I L ビバ | 6.2 | 7 | 13,419 | |
| メディカルシステムネットワーク | 9.6 | 9.2 | 5,299 | |
| ノジマ | 12.4 | 11.6 | 26,459 | |
| カッパ・クリエイト | 11.2 | 10.2 | 14,943 | |
| ライトオン | 7.6 | — | — | |
| 良品計画 | 10 | 92 | 229,816 | |
| 三城ホールディングス | 14.5 | — | — | |
| アドヴァン | 12.3 | 11.3 | 14,780 | |
| アルビス | 3.1 | 3.3 | 7,566 | |
| コナカ | 13.8 | 15.2 | 6,171 | |
| G-7ホールディングス | 2.6 | 2.1 | 9,450 | |
| イオン北海道 | 10.1 | 8.4 | 6,711 | |
| コジマ | 12.8 | 14.1 | 6,471 | |
| コーナン商事 | 9.2 | 9.4 | 23,951 | |
| エコス | 3.1 | 3.3 | 5,553 | |
| ワタミ | 10.3 | 9 | 11,808 | |
| バン・バンフィック・インターナショナルホ | 45.6 | 166 | 298,468 | |
| 西松屋チェーン | 15.6 | 15.4 | 15,477 | |
| ゼンショーホールディングス | 33.6 | 33.5 | 84,219 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | |
|--------------------|---------|-------|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| 幸楽苑ホールディングス | 6.2 | 5.2 | 11,008 | |
| サイゼリヤ | 11.5 | 11.4 | 29,993 | |
| V Tホールディングス | 26 | 30.1 | 14,237 | |
| フジ・コーポレーション | — | 2.5 | 5,810 | |
| ユナイテッドアローズ | 8.1 | 7.5 | 25,050 | |
| ハイデイ日高 | 9.1 | 9.6 | 20,995 | |
| コロナイド | 23.2 | 23.9 | 52,962 | |
| ピーシーデポコーポレーション | 10.8 | 11.8 | 5,640 | |
| 壱番屋 | 4.9 | 4.9 | 25,872 | |
| スキホールディングス | 15.5 | 13.9 | 85,763 | |
| 薬王堂ホールディングス | — | 3.2 | 8,102 | |
| ヴィア・ホールディングス | 11.8 | 13.3 | 8,871 | |
| スクロール | 12.7 | 15.8 | 5,530 | |
| ヨンドシーホールディングス | 7.9 | 7.3 | 19,074 | |
| ファミリーマート | 19.6 | 55.5 | 144,355 | |
| 木曽路 | 8.5 | 9.1 | 26,208 | |
| S R Sホールディングス | 10.4 | 11.2 | 11,692 | |
| 千趣会 | — | 17.8 | 7,689 | |
| ケーヨー | 17 | 18.8 | 10,133 | |
| 上新電機 | 8.3 | 8 | 19,720 | |
| 日本瓦斯 | 12.9 | 11.2 | 38,528 | |
| ロイヤルホールディングス | 12.2 | 11.8 | 29,995 | |
| いなげや | 7.7 | 8.9 | 13,172 | |
| 島忠 | 16.1 | 13.2 | 39,666 | |
| チヨダ | 7.3 | 7.6 | 12,289 | |
| ライフコーポレーション | 5.2 | 5.4 | 13,521 | |
| リンガーハット | 8.9 | 8.8 | 21,859 | |
| M r M a x H D | 11.8 | 12.5 | 6,237 | |
| A O K Iホールディングス | 13.8 | 13.6 | 15,422 | |
| オークワ | 11 | 11 | 15,873 | |
| コメリ | 11.3 | 10.5 | 24,811 | |
| 青山商事 | 13.7 | 14.6 | 24,484 | |
| しまむら | 8.2 | 8 | 71,760 | |
| 高島屋 | 55.4 | 51.6 | 67,286 | |
| 松屋 | 14.9 | 14.9 | 12,724 | |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 36.3 | 33 | 40,689 | |
| 近鉄百貨店 | 3 | 2.8 | 10,108 | |
| バルコ | 7.7 | 7.2 | 9,820 | |
| 丸井グループ | 59.6 | 63.6 | 168,603 | |
| アクシアル リテイリング | 5.7 | 5.6 | 21,672 | |
| イオン | 270.5 | 266.4 | 603,396 | |
| イズミ | 14.3 | 14.2 | 60,634 | |
| 平和堂 | 13.8 | 13.6 | 28,764 | |
| フジ | 8.6 | 8.5 | 16,753 | |
| ヤオコー | 7.7 | 7.6 | 38,836 | |
| ゼビオホールディングス | 8.1 | 8.8 | 11,686 | |
| ケーズホールディングス | 73.2 | 67.1 | 91,658 | |
| O l y m p i c グループ | 5.8 | 6.3 | 4,101 | |
| 日産東京販売ホールディングス | 17.8 | 17.8 | 4,948 | |
| Genky DrugStores | 2.9 | 3.7 | 9,394 | |
| 総合メディカルホールディングス | 6.1 | 6.3 | 13,009 | |
| ブックオフグループホールディングス | — | 4.9 | 5,223 | |
| アインホールディングス | 9.5 | 9.5 | 65,360 | |

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 | |
| 元気寿司 | 2.1 | 2.4 | 7,185 |
| ヤマダ電機 | 215.5 | 210.5 | 117,248 |
| アークランドサカモト | 11.9 | 10.9 | 13,962 |
| ニトリホールディングス | 30.5 | 30 | 517,800 |
| グルメ軒屋 | 8.2 | 6.2 | 7,409 |
| 吉野家ホールディングス | 25.5 | 23.5 | 64,766 |
| 松屋フーズホールディングス | 3.3 | 3.3 | 14,883 |
| サガミホールディングス | 10.4 | 9.8 | 13,484 |
| 関西スーパーマーケット | 6.9 | 6.6 | 7,167 |
| 王将フードサービス | 5.1 | 5 | 33,100 |
| ブレナス | 7.7 | 7.8 | 15,100 |
| ミニストップ | 5.6 | 5.8 | 8,537 |
| アークス | 12.8 | 13.4 | 30,605 |
| パローホールディングス | 15.5 | 14.8 | 30,547 |
| ベルク | 3.4 | 3.2 | 16,736 |
| 大庄 | 5.5 | 5.2 | 8,346 |
| ファーストリテイリング | 9.4 | 9.3 | 630,540 |
| サンドラッグ | 26.4 | 26 | 100,620 |
| サックスパー ホールディングス | 7.3 | 8.3 | 7,511 |
| ペルーナ | 17.3 | 15.3 | 10,893 |
| 銀行業（5.8%） | | | |
| じもとホールディングス | 60.3 | 59.1 | 6,323 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 365.5 | 361.1 | 102,552 |
| 東京きらばしフィナンシャルグループ | 10 | 10 | 15,320 |
| 九州フィナンシャルグループ | 113.5 | 112.6 | 55,511 |
| ゆうちょ銀行 | 198.4 | 196.3 | 210,041 |
| 富山第一銀行 | 21.6 | 19.6 | 6,781 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 446.2 | 409.1 | 182,867 |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 45.9 | 47.3 | 40,488 |
| 関西みらいフィナンシャルグループ | 33.3 | 41.1 | 30,085 |
| 三十三フィナンシャルグループ | 7 | 6.5 | 11,102 |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 12.2 | 12.1 | 36,360 |
| 新生銀行 | 50.8 | 50.8 | 87,223 |
| あおぞら銀行 | 38.7 | 41.1 | 115,819 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 4,902 | 4,780.6 | 2,782,787 |
| りそなホールディングス | 768.8 | 760.7 | 355,094 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 137.6 | 131.1 | 549,964 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 495.8 | 480.3 | 1,925,042 |
| 千葉銀行 | 247 | 238.2 | 148,636 |
| 群馬銀行 | 138.4 | 135.4 | 52,806 |
| 武蔵野銀行 | 10.6 | 10.6 | 20,786 |
| 千葉興業銀行 | 23.6 | 20.6 | 7,086 |
| 筑波銀行 | 36.8 | 30.8 | 7,484 |
| 七十七銀行 | 21.9 | 23.7 | 42,517 |
| 青森銀行 | 6.1 | 5.4 | 15,287 |
| 秋田銀行 | 5.3 | 5.2 | 11,746 |
| 山形銀行 | 8.2 | 8.7 | 14,433 |
| 岩手銀行 | 5.1 | 5 | 14,825 |
| 東邦銀行 | 63.4 | 60 | 16,680 |
| 東北銀行 | 5.5 | 4 | 4,136 |
| みちのく銀行 | 5.5 | 5 | 7,835 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 56.7 | 58.3 | 121,963 |
| 静岡銀行 | 175.7 | 171.2 | 143,636 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 評価額 |
|-------------------------|---------|---------|-----------|
| | 株数 | 株数 | |
| 十六銀行 | 9.4 | 9 | 23,958 |
| スルガ銀行 | 69.8 | 72.7 | 39,621 |
| 八十二銀行 | 122.9 | 166.8 | 79,230 |
| 山梨中央銀行 | 9.3 | 9.2 | 10,616 |
| 大垣共立銀行 | 11 | 13.7 | 34,935 |
| 福井銀行 | 6.9 | 5.9 | 10,230 |
| 北國銀行 | 7.8 | 7.6 | 26,676 |
| 清水銀行 | 3.9 | 2.9 | 6,322 |
| 富山銀行 | 1.7 | 1.6 | 4,225 |
| 滋賀銀行 | 13.9 | 13.7 | 37,579 |
| 南都銀行 | 8.6 | 11.9 | 32,879 |
| 百五銀行 | 62.9 | 64.7 | 22,903 |
| 京都銀行 | 25 | 24.7 | 113,126 |
| 紀陽銀行 | 24.8 | 24.5 | 42,238 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 46.3 | 46.8 | 53,071 |
| 広島銀行 | 101.8 | 101.2 | 55,154 |
| 山陰合同銀行 | 42 | 42 | 28,854 |
| 中国銀行 | 45 | 60 | 65,820 |
| 伊予銀行 | 91.4 | 97.6 | 59,340 |
| 百十四銀行 | 7.8 | 7.6 | 17,160 |
| 四国銀行 | 11.1 | 10.4 | 10,868 |
| 阿波銀行 | 11.1 | 11.4 | 30,848 |
| 大分銀行 | 4.6 | 4.2 | 11,986 |
| 宮崎銀行 | 5.2 | 4.5 | 11,947 |
| 佐賀銀行 | 4.7 | 4.7 | 8,178 |
| 十八銀行 | 4.6 | — | — |
| 沖縄銀行 | 6.6 | 6.5 | 23,887 |
| 琉球銀行 | 17 | 15.7 | 19,750 |
| セブン銀行 | 237.5 | 235.6 | 80,339 |
| みずほフィナンシャルグループ | 9,556 | 9,433.6 | 1,600,881 |
| 山口フィナンシャルグループ | 86.6 | 87.8 | 66,464 |
| 名古屋銀行 | 6 | 6 | 20,340 |
| 北洋銀行 | 107.2 | 108.3 | 26,100 |
| 愛知銀行 | 2.8 | 2.9 | 11,150 |
| 中京銀行 | 3.7 | 3 | 6,771 |
| 大光銀行 | 3.5 | 2.5 | 4,377 |
| 愛媛銀行 | 11 | 10.2 | 12,484 |
| 京葉銀行 | 31 | 30.8 | 19,373 |
| 栃木銀行 | 39.2 | 39.6 | 9,147 |
| 北日本銀行 | 3 | — | — |
| 東和銀行 | 13.8 | 12.3 | 10,922 |
| 福島銀行 | 10 | — | — |
| トモニホールディングス | 57 | 57.6 | 24,134 |
| フィデアホールディングス | 83 | 73 | 9,782 |
| 池田泉州ホールディングス | 77.8 | 78.2 | 15,874 |
| 証券・商品先物取引業（0.8%） | | | |
| F P G | 23.2 | 22.8 | 24,373 |
| S B Iホールディングス | 83.8 | 77.7 | 175,446 |
| ジャフコ | 11.7 | 10.6 | 44,838 |
| 大和証券グループ本社 | 563.5 | 557.3 | 309,914 |
| 野村ホールディングス | 1,291 | 1,223.1 | 687,749 |
| 岡三証券グループ | 61.4 | 62.6 | 25,415 |
| 丸三証券 | 23 | 22.5 | 12,307 |

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 | |
| 東洋証券 | 32 | — | — |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 84.3 | 82.4 | 27,851 |
| 水戸証券 | 24 | 26.5 | 7,499 |
| いちよし証券 | 16 | 13.6 | 9,275 |
| 松井証券 | 34.5 | 40.9 | 36,319 |
| マネックスグループ | 66.5 | 56.1 | 15,764 |
| カブドットコム証券 | 55.2 | — | — |
| 極東証券 | 10 | 11.1 | 8,713 |
| 岩井コスモホールディングス | 8 | 8 | 10,256 |
| 藍澤證券 | 15.4 | 12.5 | 9,225 |
| スパークス・グループ | — | 30 | 7,470 |
| 保険業（2.3%） | | | |
| かんぽ生命保険 | 26.6 | 24.9 | 46,712 |
| SOMPOホールディングス | 137.9 | 130.6 | 570,852 |
| アニコムホールディングス | 5.9 | 5.8 | 20,793 |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 183.8 | 181.7 | 646,852 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 57.7 | 56.9 | 146,403 |
| 第一生命ホールディングス | 398 | 393.1 | 692,445 |
| 東京海上ホールディングス | 255 | 248.3 | 1,494,766 |
| T&Dホールディングス | 216.9 | 214.5 | 277,777 |
| アドバンスクリエイト | 4 | 1.5 | 2,796 |
| その他金融業（1.2%） | | | |
| 全国保証 | 20.2 | 19.6 | 86,436 |
| C a s a | — | 3 | 3,789 |
| アルヒ | 7 | 11.2 | 28,168 |
| プレミアグループ | — | 4 | 9,344 |
| クレディセゾン | 49.4 | 48.9 | 88,509 |
| 芙蓉総合リース | 8.1 | 7.3 | 52,779 |
| みずほリース | 13.7 | 10.9 | 35,752 |
| 東京センチュリー | 14.1 | 14 | 83,860 |
| 日本証券金融 | 34.2 | 32.2 | 17,484 |
| アイフル | 113.3 | 111.7 | 28,148 |
| リコーリース | 5.8 | 5.8 | 22,678 |
| イオンフィナンシャルサービス | 44.7 | 42.5 | 71,612 |
| アコム | 142.3 | 138.8 | 63,570 |
| ジャックス | 8.7 | 7.8 | 21,028 |
| オリエントコーポレーション | 194 | 195.6 | 31,687 |
| 日立キャピタル | 16.7 | 16.2 | 43,659 |
| アプラスフィナンシャル | — | 44.1 | 4,101 |
| オリックス | 469.5 | 434.3 | 780,654 |
| 三菱UFJリース | 158.2 | 176.2 | 124,221 |
| 日本取引所グループ | 190.2 | 199.5 | 373,863 |
| イー・ギャランティ | 8 | 7.1 | 10,053 |
| NECキャピタルソリューション | 3.3 | 3.3 | 8,127 |
| 不動産業（2.4%） | | | |
| いちご | 90.3 | 90.2 | 39,597 |
| 日本駐車場開発 | 90.4 | 85.3 | 14,159 |
| スター・マイカ・ホールディングス | — | 4.5 | 7,992 |
| ヒューリック | 147 | 149 | 186,846 |
| 三栄建築設計 | 3.6 | 4 | 6,500 |
| スター・マイカ | 4 | — | — |
| 野村不動産ホールディングス | 46.8 | 42.2 | 111,956 |
| 三重交通グループホールディングス | 16.4 | 18 | 10,872 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 |
|--------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | |
| サムティ | 10.2 | 9.9 | 20,077 |
| ディア・ライフ | 10.1 | 10.3 | 5,757 |
| 日本商業開発 | 5.1 | 6.1 | 9,796 |
| プレサンスコーポレーション | 11.4 | 11.1 | 19,491 |
| ユニゾホールディングス | 11 | 10.8 | 52,920 |
| 日本管理センター | 5.8 | 5.8 | 7,650 |
| フージャースホールディングス | 17.4 | 16.6 | 11,736 |
| オープンハウス | 11.5 | 20.1 | 58,692 |
| 東急不動産ホールディングス | 189.1 | 188.2 | 140,020 |
| 飯田グループホールディングス | 58.7 | 56.6 | 110,539 |
| ムゲンエステート | 6.5 | 8.2 | 6,560 |
| ピーロット | — | 2.5 | 5,077 |
| ハウスドゥ | 2.9 | 4.8 | 7,771 |
| ジェイ・エス・ビー | — | 1.2 | 5,544 |
| パーク24 | 41.3 | 37.7 | 97,077 |
| パラカ | 2.8 | 3.1 | 6,302 |
| 三井不動産 | 373.5 | 347.3 | 948,649 |
| 三菱地所 | 493.4 | 487 | 978,870 |
| 平和不動産 | 13.5 | 13 | 33,982 |
| 東京建物 | 77.5 | 77 | 127,281 |
| ダイビル | 20.7 | 18.4 | 21,564 |
| 京阪神ビルディング | 15 | 12.1 | 17,387 |
| 住友不動産 | 158.4 | 156.5 | 600,803 |
| 大京 | 10.8 | — | — |
| テオオーシー | 16.7 | 15 | 13,425 |
| 東京築天地 | 1.8 | 1.7 | 10,438 |
| レオパレス21 | 91.4 | — | — |
| スターツコーポレーション | 9.3 | 9.2 | 24,757 |
| FJ住宅 | 11.8 | 11.8 | 8,389 |
| 空港施設 | 13.3 | 13.3 | 7,182 |
| ゴールドクレスト | 6.2 | 5.9 | 12,755 |
| エスリード | 4.2 | 3.8 | 8,249 |
| 日神不動産 | 13.5 | 14.1 | 6,993 |
| 日本エスコン | 14.1 | 14.1 | 13,944 |
| タカラレーベン | 35.8 | 33.5 | 16,381 |
| サンヨーハウジング名古屋 | 7 | 7 | 6,965 |
| イオンモール | 35.4 | 35.7 | 63,367 |
| ファースト住建 | — | 5.2 | 6,858 |
| カチタス | — | 8.8 | 43,296 |
| トーセイ | 10.8 | 9.9 | 13,196 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 44 | — | — |
| サンフロンティア不動産 | 10.5 | 10.2 | 12,994 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 8.2 | 7.8 | 8,330 |
| ランドビジネス | — | 7.4 | 5,631 |
| 日本空港ビルデング | 22.6 | 22.4 | 130,592 |
| サービス業（5.1%） | | | |
| 日本工営 | 5 | 4.6 | 15,548 |
| L I F U L L | 24.4 | 24.8 | 13,764 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 5.9 | 5 | 10,460 |
| 日本M&Aセンター | 51.3 | 50.9 | 190,875 |
| メンバーズ | — | 2.3 | 5,423 |
| タケエイ | 9.9 | 8.1 | 10,392 |
| トラスト・テック | 3.4 | 8.1 | 10,959 |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| コシダカホールディングス | 18.5 | 16.6 | 26,709 | |
| パソナグループ | 7 | 8.4 | 14,338 | |
| リンクアンドモチベーション | 12.9 | 16.3 | 11,833 | |
| GCA | 8.5 | 9.8 | 9,339 | |
| エス・エム・エス | 25.3 | 21.3 | 64,006 | |
| パーソルホールディングス | 68.3 | 67.3 | 136,888 | |
| リニカル | 4.4 | 4.7 | 5,546 | |
| クックパッド | 23.9 | 28.3 | 10,527 | |
| 学情 | 3.6 | 3.4 | 5,402 | |
| スタジオアリス | 3.8 | 4.3 | 8,380 | |
| シミックホールディングス | 4.4 | 4.7 | 8,544 | |
| 総合警備保障 | 27.1 | 26.7 | 155,127 | |
| カカコム | 51.9 | 50.8 | 134,823 | |
| アイロムグループ | 3.1 | 3.3 | 4,804 | |
| ルネサンス | 4.3 | 4.9 | 8,555 | |
| ディップ | 10.9 | 9.5 | 29,592 | |
| オプトホールディング | 4.5 | 4.2 | 7,488 | |
| 新日本科学 | 11.6 | 9.3 | 7,309 | |
| ツクイ | 16.6 | 18.4 | 10,451 | |
| ベネフィット・ワン | — | 18.1 | 43,892 | |
| エムスリー | 143.9 | 148.3 | 453,056 | |
| アウトソーシング | 36 | 38.3 | 46,036 | |
| ウェルネット | 8.4 | 9.1 | 7,471 | |
| ワールドホールディングス | 2.2 | 2.7 | 5,316 | |
| ディー・エヌ・エー | 37.1 | 33.7 | 59,986 | |
| 博報堂DYホールディングス | 94.3 | 93 | 166,284 | |
| ぐるなび | 10.7 | 13.5 | 14,107 | |
| タカミヤ | 9.4 | 9.4 | 6,796 | |
| ジャパンベストレスキューシステム | 6.3 | 5.6 | 6,053 | |
| ファンコミュニケーションズ | 20.2 | 21 | 10,605 | |
| ライク | 3.3 | 3.2 | 5,430 | |
| エスプール | — | 14.2 | 10,096 | |
| WDBホールディングス | 3.4 | 3.3 | 8,362 | |
| バリューコマース | 5 | 4.3 | 8,604 | |
| インフォマート | 38 | 37.5 | 72,750 | |
| J Pホールディングス | 25.4 | 27.2 | 7,996 | |
| E P Sホールディングス | 10.4 | 10.7 | 15,375 | |
| プレステージ・インターナショナル | 13.4 | 26 | 24,024 | |
| アミューズ | 4.3 | 4.1 | 12,792 | |
| ドリームインキュベータ | 2.9 | 3.1 | 5,177 | |
| クイック | 4.7 | 4.9 | 8,246 | |
| ケネディクス | 64.9 | 65.4 | 38,324 | |
| 電通 | 83 | 69.2 | 279,914 | |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 3 | 3.4 | 4,522 | |
| びあ | 2.1 | 2.1 | 10,122 | |
| イオンファンタジー | 2.3 | 2.8 | 8,848 | |
| シーティーエス | 9.2 | 9 | 6,777 | |
| ネクシィーズグループ | 2.4 | 2.8 | 5,269 | |
| みらかホールディングス | 19.5 | 19.4 | 53,369 | |
| アルプス技研 | 6.1 | 6.3 | 11,497 | |
| 日本空調サービス | 9.6 | 9.6 | 7,516 | |
| オリエンタルランド | 80.6 | 71.5 | 1,085,370 | |
| ダスキン | 18.6 | 17.4 | 53,070 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | |
|-----------------------|---------|-------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| 明光ネットワークジャパン | 10.2 | 10.1 | 10,413 | |
| ファルコホールディングス | 5.2 | 5.1 | 8,991 | |
| ラウンドワン | 21.4 | 19.3 | 21,365 | |
| リゾートトラスト | 29.5 | 31.7 | 58,518 | |
| ビー・エム・エル | 8.8 | 8.6 | 27,563 | |
| りらいあコミュニケーションズ | 12.1 | 12.2 | 17,287 | |
| リソー教育 | 36.3 | 32.3 | 13,339 | |
| ユー・エス・エス | 83.4 | 75.4 | 160,677 | |
| サイバーエージェント | 42.2 | 39 | 149,370 | |
| 楽天 | 319.7 | 313.9 | 295,693 | |
| クリーク・アンド・リバー社 | 4.9 | 4.5 | 5,062 | |
| テー・オー・ダブリュ | 8.3 | 8.3 | 6,972 | |
| 山田コンサルティン ググループ | — | 3.8 | 6,938 | |
| セントラルスポーツ | 2.9 | 2.9 | 9,483 | |
| フルキャストホールディングス | 6.8 | 6.6 | 16,401 | |
| エン・ジャパン | 7.6 | 11.9 | 60,928 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 13 | 13.5 | 100,980 | |
| アイ・アールジャパンホールディングス | — | 3.1 | 13,051 | |
| Gunosy | 4.4 | 5.3 | 8,787 | |
| イー・ガーディアン | 3.6 | 3.6 | 8,078 | |
| ジャパンマテリアル | 18.9 | 20.6 | 31,106 | |
| ベクトル | 8.6 | 9.3 | 10,592 | |
| チャーム・ケア・コーポレーション | — | 2.5 | 4,882 | |
| I B J | — | 5.6 | 6,025 | |
| Aサンテ | 3.5 | 3.7 | 7,499 | |
| N・フィールド | 5 | 7 | 4,921 | |
| バリューHR | 2.2 | 1.7 | 5,958 | |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 1.8 | 4.8 | 20,640 | |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 3.7 | 3.7 | 7,185 | |
| アビスト | 1.4 | — | — | |
| シグマクシス | 4.4 | 5 | 11,255 | |
| ウィルグループ | 5.4 | 5.1 | 5,900 | |
| エスクロー・エージェント・ジャパン | 11.5 | — | — | |
| リクルートホールディングス | 488.7 | 481.7 | 1,916,202 | |
| エラン | 2.6 | 4.4 | 7,524 | |
| 日本郵政 | 556.7 | 551.6 | 571,733 | |
| ベルシステム24ホールディングス | 11.6 | 11.6 | 19,940 | |
| 鎌倉新書 | 5.4 | 5.4 | 10,411 | |
| L I T A L I C O | 2 | 2.9 | 7,777 | |
| エポラブルアジア | 2.4 | 3.5 | 7,710 | |
| アトラエ | — | 2 | 7,670 | |
| ストライク | 1.9 | 2.6 | 11,388 | |
| ソラスト | 17 | 18.9 | 24,702 | |
| インソース | 2.5 | 3.5 | 12,022 | |
| ベイカレント・コンサルティング | — | 4.2 | 25,032 | |
| キャリアインデックス | 2.8 | — | — | |
| M S - J a p a n | 3.2 | — | — | |
| グレイステクノロジー | 2 | 3.3 | 9,771 | |
| ジャパンエレベーターサービスホールディング | 4.5 | 7.3 | 21,410 | |
| グリーンズ | — | 4.3 | 5,254 | |
| 日総工産 | 2 | 5.2 | 5,631 | |
| キュービーネットホールディングス | 4 | 4.7 | 11,740 | |
| R P Aホールディングス | — | 4.4 | 5,513 | |

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 |
| スプリックス | 2.2 | 3.1 | 3,906 | |
| アドバンテッジリスクマネジメント | — | 4.7 | 4,653 | |
| リログループ | 37.4 | 36.8 | 109,884 | |
| 東祥 | 4.3 | 4.8 | 11,779 | |
| エイチ・アイ・エス | 12 | 10.6 | 32,542 | |
| 共立メンテナンス | 10.4 | 11 | 57,200 | |
| イチネンホールディングス | 8.5 | 8.3 | 11,744 | |
| 建設技術研究所 | 5.7 | 5.6 | 11,368 | |
| スペース | 5.3 | — | — | |
| 燦ホールディングス | 2.3 | 4.4 | 5,931 | |
| 東京テアトル | 4.9 | 4.7 | 6,547 | |
| ナガワ | 2 | 2.1 | 15,813 | |
| よみうりランド | 2.3 | 2.1 | 9,534 | |
| 東京都競馬 | 4.6 | 4.6 | 15,985 | |
| 常磐興産 | 5.3 | 4.9 | 8,168 | |
| カナモト | 9.7 | 11.1 | 35,131 | |
| 東京ドーム | 25.8 | 28.2 | 28,566 | |
| 西尾レントオール | 7 | 6.8 | 20,978 | |
| トランス・コスモス | 7.5 | 6.4 | 18,393 | |
| 乃村工藝社 | 15.9 | 28.8 | 40,608 | |
| 藤田観光 | 3.3 | 3.7 | 10,611 | |
| KNT-CTホールディングス | 4.3 | 4.8 | 7,252 | |
| 日本管財 | 7 | 6.4 | 12,486 | |
| トーカイ | 6.6 | 6.6 | 18,935 | |
| セコム | 72.4 | 71.3 | 676,351 | |
| セントラル警備保障 | 3.4 | 3.3 | 21,318 | |
| 丹青社 | 13.2 | 13.1 | 16,139 | |
| メイテック | 8.9 | 8.5 | 49,555 | |
| 応用地質 | 8.3 | 7.9 | 11,060 | |
| 船井総研ホールディングス | 14.1 | 13.7 | 34,880 | |
| オオバ | 7.8 | 8.2 | 6,543 | |
| 学究社 | 4.2 | — | — | |
| ベネッセホールディングス | 25.1 | 22.7 | 66,011 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | |
|----------|----------------|----------------|-------------|---------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| イオンディライト | 8.2 | 8.1 | 31,347 | |
| ナック | 6 | 6 | 6,336 | |
| ニチイ学館 | 10.5 | 9.9 | 16,047 | |
| ダイセキ | 11.4 | 11.3 | 36,838 | |
| 合計 | 株数・金額 1,659 | 株数・金額 1,661 | 170,406,746 | <97.7%> |

※銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※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。

※一印は組入れなし。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別 | 期末 | |
|----|--------|-------|-----|
| | | 買建額 | 売建額 |
| 国内 | 株式先物取引 | TOPIX | — |
| | | 百万円 | 百万円 |
| | | 3,999 | — |

※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。

■ 投資信託財産の構成

(2019年12月2日現在)

| 項目 | 期末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| 株式 | 千円 | % |
| 株 | 170,406,746 | 97.5 |
| コール・ローン等、その他 | 4,281,756 | 2.5 |
| 投資信託財産総額 | 174,688,502 | 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12月2日現在）

| 項 目 | 期 末 |
|-------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 176,445,102,542円 |
| コール・ローン等 株 式(評価額) | 3,379,265,534 |
| 未 収 入 金 | 170,406,746,760 |
| 未 収 配 当 金 | 72,899,200 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 857,351,048 |
| (B) 負 債 | 2,046,808,561 |
| 未 払 解 約 金 | 1,728,840,000 |
| 未 払 利 息 | 290,138,959 |
| 差入委託証拠金代用有価証券 | 6,480 |
| その他未払費用 | 1,756,600,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 63,122 |
| 元 本 | 174,398,293,981 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 63,743,430,458 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 110,654,863,523 |
| 1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C/D) | 63,743,430,458円 |
| | 27,359円 |

※当期における期首元本額66,912,228,971円、期中追加設定元本額13,207,087,179円、期中一部解約元本額16,375,885,692円です。

※代用として、担保に供している資産は、株式3,095,200,000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2018年12月1日 至2019年12月2日）

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 4,180,864,487円 |
| 受 取 配 当 金 | 4,179,624,536 |
| そ の 他 収 益 金 | 2,800,929 |
| 支 払 利 息 | △ 1,560,978 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 4,923,794,035 |
| 売 買 益 | 16,144,533,878 |
| 売 買 損 | △ 11,220,739,843 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | 321,575,500 |
| 取 引 益 | 860,998,660 |
| 取 引 損 | △ 539,423,160 |
| (D) 信 託 報 酬 等 | △ 1,078,963 |
| (E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D) | 9,425,155,059 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | 106,635,545,407 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 19,374,291,115 |
| (H) 解 約 差 損 益 金 | △ 24,780,128,058 |
| (I) 計 (E + F + G + H) | 110,654,863,523 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (I) | 110,654,863,523 |

※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 | 10,093,895,533円 | SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 8,366,581,213円 |
| 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） | 871,994,826円 | SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 55,996,005円 |
| 三井住友・DC年金バランス50（標準型） | 4,134,711,529円 | SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 212,637,976円 |
| 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） | 2,984,021,207円 | 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 794,882円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 171,270,930円 | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 882,312,334円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ） | 6,770,604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> | 55,058,558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） | 24,018,495円 | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 363,346,655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） | 65,633,993円 | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 1,058,492,761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） | 108,427,212円 | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 861,659,534円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ） | 71,148,493円 | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 2,778,991,517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） | 157,127,838円 | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 1,137,750円 |
| 国内株式指数ファンド（TOPIX） | 1,522,887,951円 | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 58,214,802円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド | 11,405,867,081円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 71,457,145円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 750,808,584円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 44,386,681円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 754,464,975円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 21,663,542円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 588,252,205円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 179,161,011円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 102,533,812円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 345,072,882円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050 | 11,657,198円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用> | 11,140,518円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） | 55,140,191円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 111,594,783円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） | 50,085,566円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 58,092,653円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） | 139,661,373円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 9,215,706円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） | 75,363,090円 | SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 70,883,973円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型） | 94,884,854円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 848,254,810円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 12,899,750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） | 194,795,060円 |
| 三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド | 407,382円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 19,380,760円 |
| 三井住友DS・年金バランス30（債券重点型） | 77,860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> | 1,164,508,623円 |
| 三井住友DS・年金バランス50（標準型） | 137,846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> | 193,275,461円 |
| 三井住友DS・年金バランス70（株式重点型） | 198,857円 | SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 1,504,949,363円 |
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 3,810,058,037円 | SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 111,253,748円 |
| バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定> | 22,375,907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> | 14,465,450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> | 218,475,561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> | 81,986,207円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 3,018,643,305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> | 51,058,228円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 2,309,967,382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> | 307,740,440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)

外国株式インデックス・マザーファンド

第17期（2018年12月1日から2019年12月2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 | 株式先物 率 (買建-売建) | 投資信託 証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|------------------|---------|--------|---|--------|-----------|----------------------|--------------------|-----------|
| | 騰落 率 | 中 率 | 騰落 率 | 中 率 | | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 17期（2019年12月2日） | 38,813 | 11.9 | 404.43 | 12.2 | 95.2 | 2.1 | 2.7 | 232,418 |

※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2019年12月2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 | 株式先物 率 (買建-売建) | 投資信託 証券 組入比率 |
|---------------------|---------|---------|---|---------|-----------|----------------------|--------------------|
| | 騰落 率 | 騰落 率 | 騰落 率 | 騰落 率 | | | |
| (期首) 2018年11月30日 | 円 | % | | % | % | % | % |
| | 34,678 | — | 360.38 | — | 93.7 | 3.9 | 2.3 |
| 12月末 | 31,058 | △10.4 | 322.64 | △10.5 | 93.8 | 4.3 | 2.4 |
| 2019年1月末 | 33,076 | △4.6 | 343.47 | △4.7 | 94.9 | 2.7 | 2.4 |
| 2月末 | 35,061 | 1.1 | 364.78 | 1.2 | 96.3 | 1.3 | 2.4 |
| 3月末 | 35,307 | 1.8 | 367.43 | 2.0 | 94.8 | 2.7 | 2.4 |
| 4月末 | 36,886 | 6.4 | 384.07 | 6.6 | 96.5 | 1.0 | 2.4 |
| 5月末 | 34,561 | △0.3 | 359.86 | △0.1 | 95.6 | 1.9 | 2.5 |
| 6月末 | 35,808 | 3.3 | 372.93 | 3.5 | 96.5 | 1.1 | 2.5 |
| 7月末 | 36,786 | 6.1 | 383.06 | 6.3 | 96.2 | 1.2 | 2.5 |
| 8月末 | 34,963 | 0.8 | 364.33 | 1.1 | 94.4 | 3.0 | 2.6 |
| 9月末 | 36,096 | 4.1 | 376.07 | 4.4 | 94.7 | 2.6 | 2.7 |
| 10月末 | 37,532 | 8.2 | 390.60 | 8.4 | 94.2 | 3.1 | 2.6 |
| 11月末 | 38,931 | 12.3 | 405.57 | 12.5 | 95.2 | 2.2 | 2.6 |
| (期末) 2019年12月2日 | 38,813 | 11.9 | 404.43 | 12.2 | 95.2 | 2.1 | 2.7 |

※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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 34,678円 |
| 期末 | 38,813円 |
| 騰落率 | +11.9% |

※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、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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

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

上昇要因

- ・米中貿易交渉の進展期待や先進国の緩和的な金融政策を背景に、株式市場が上昇したこと

下落要因

- ・米ドル、ユーロが対円で下落したこと

▶ 投資環境について（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

当期の世界の株式市場は上昇しました。為替市場では、米ドル、ユーロともに対円で下落しました。

株式市場

世界の株式市場は、期初から2018年12月下旬まで下落しました。米中貿易摩擦問題がくすぶる中、12月上旬に行われた米中首脳会談の後に二国間の問題解決への期待が後退したことが下押し材料になりました。また、中国景気の減速や関税率引上げの影響で、堅調だった米国の企業業績についても懸念が高まりました。また、フランスにおける反政府デモ、英国のEU（欧州連合）離脱問題など、EU域内の不安定な政治動向も嫌気されました。年明けから4月にかけては、株式市場の下落に呼応して米国や中国で政策対応への期待が高まったことや、FRB（米連邦準備制度理事会）が利上げを停止し、景気動向や市場動向に配慮する姿勢に転換したことを好感し、上昇しました。5月は、トランプ米大統領が対中輸入関税率の追加引上げを指示したことから再び米中貿易摩擦問題の深刻化に対する懸念が高まり、株価が下落しました。6月から7月後半にかけては、堅調な企業決算発表を受けて企業業績に対する悲観的な見方が後退したことなどから、株価が再度上昇に転じました。8月には米国が中国に対する新たな追加関税の導入を発表し、株価が下落しましたが、9月以降は米中貿易交渉の再開を受け、貿易摩擦問題の進展期待が高まり、あわせて欧米主要国の中銀による緩和的な金融政策を受け期末にかけて値を戻す展開となりました。

FRBは7月以降3回の利下げを実施しました。またECB（欧州中央銀行）は9月に再び金融緩和に舵を切りました。米中貿易交渉については、10月に第一段階の合意の大枠が発表され、その後の株価の下支えになりました。

当期のMSCIコクサイインデックス（配当込み、米ドルベース）は、期首に比べて16.1%上昇しました。

為替市場

米ドル・円相場は、期初から2019年1月初にかけて、株価の下落などを受け、急激な米ドル安・円高となりました。1月上旬から4月末にかけては、緩やかな米ドル高・円安基調での推移となりました。FRBが利上げを停止したことや、堅調な景気指標が発表されたことなどが要因

です。5月から8月にかけては、中国に対する関税の引上げや新たな追加関税の導入が発表されるなど再び米中の貿易摩擦への懸念が高まったことや、米国の金融緩和期待が高まったことなどを受け、安全資産とされる円が上昇しました。9月から期末にかけては、米中通商協議に対する期待などから円は米ドルに対し下落しました。

ユーロは、対円で下落しました。概ね米ドル・円相場と同様の動きとなりましたが、欧州域内の景気減速懸念の高まりや、英国のEUからの強硬離脱懸念といった域内情勢の不安定化など、通貨ユーロを取り巻く不安材料が払拭されず、戻りは限定的でした。

当期の米ドル・円は期首113円47銭から期末109円68銭へと3円79銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首129円19銭から期末120円86銭へと8円33銭のユーロ安・円高となりました。

▶ ポートフォリオについて（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

株式組入比率

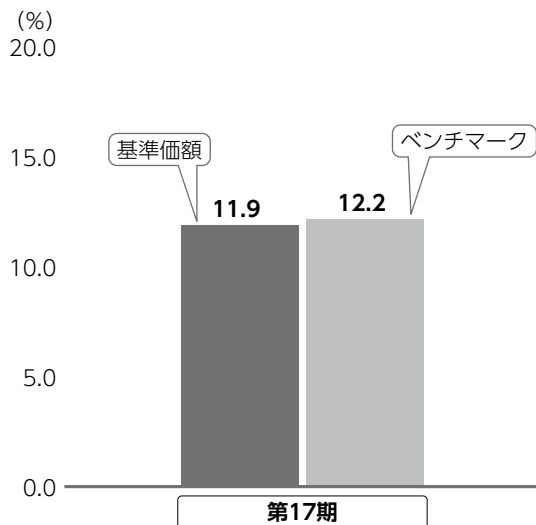
M S C I コクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について (2018年12月1日から2019年12月2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+11.9%となり、ベンチマークの騰落率+12.2%から0.3%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（2018年12月1日から2019年12月2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) | 0.006% (0.004) (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） | 5 (5) (0) | 0.015 (0.015) (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） | 16 (15) (1) | 0.046 (0.042) (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 | 23 | 0.067 | |

期中の平均基準価額は35,441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 (2018年12月1日から2019年12月2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 45,643 (1,208) | 千米ドル 377,391 (5,899) | 百株 17,140 (1,164) | 千米ドル 124,023 (11,300) |
| | カ ナ ダ | 6,052 184) | 千カナダドル 30,353 (433) | 2,734 (-) | 千カナダドル 9,391 (5) |
| | ユ ー ロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | ド イ ツ | 3,258 34) | 16,084 (△ 217) | 1,303 | 5,596 |
| | イ タ リ ア | 7,416 | 3,212 | 3,812 | 1,203 |
| | フ ラ ン ス | 3,391 41) | 18,431 (△ 6) | 940 | 4,920 |
| | オ ラ ン ダ | 3,705 (△ 12) | 10,184 (-) | 861 (-) | 2,264 (84) |
| | ス ペ イ ン | 7,730 (6,571) | 5,668 (111) | 2,379 (6,065) | 1,870 (112) |
| | ベルギ- | 277 | 2,082 | 77 | 482 |
| | オーストリア | 157 (-) | 581 (△ 18) | 56 | 200 |
| | ルクセンブルク | 931 | 1,072 | 278 | 405 |
| | フィンランド | 1,169 (131) | 1,926 (-) | 323 | 578 |
| | アイルランド | 411 | 1,301 | 110 | 475 |
| ポルトガル | 820 | 441 | 403 | 252 | |
| 国 | イ ギ リ ス | 43,416 (92,311) | 千英ポンド 27,325 (-) | 98,313 (38) | 千英ポンド 10,077 (410) |
| | ス イ ス | 2,319 (189) | 千スイスフラン 17,868 (△ 242) | 548 | 千スイスフラン 5,409 |
| | ス ウ ェ ー デ ン | 3,471 (228) | 千スウェーデンクローナ 48,476 (-) | 1,133 (-) | 千スウェーデンクローナ 12,677 (607) |
| | ノ ル ウ ェ ー | 735 (54) | 千ノルウェークローネ 10,987 (-) | 277 | 千ノルウェークローネ 4,486 |
| | デ ン マ ー ク | 579 (9) | 千デンマーククローネ 24,806 (-) | 185 | 千デンマーククローネ 7,535 |
| | オーストラリア | 9,157 (△ 7) | 千オーストラリアドル 19,167 (△ 10) | 3,256 (-) | 千オーストラリアドル 6,611 (25) |

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 | ニュージーランド | 1,830 | 千ニュージーランドドル 1,236 | 827 | 千ニュージーランドドル 517 |
| | 香 港 | 11,965 (454) | 千香港ドル 53,075 (-) | 7,037 | 千香港ドル 18,743 |
| 国 | シンガポール | 5,676 | 千シンガポールドル 3,093 | 4,622 | 千シンガポールドル 829 |
| | イスラエル | 1,035 | 千イスラエルシェケル 2,253 | 1,090 | 千イスラエルシェケル 375 |

※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 |
| | AGNC INVESTMENT CORPORATION | 7,956 | 141 | - | - |
| | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC. | 1,401 | 204 | - | - |
| | AMERICAN TOWER CORP | 7,328 | 1,521 | 2,345 | 477 |
| | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 28,984 | 281 | - | - |
| | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 1,498 | 299 | - | - |
| | BOSTON PROPERTIES INC | 1,678 | 209 | - | - |
| | BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | - | - | 11,010 | 215 |
| | CAMDEN PROPERTY TRUST | 660 | 73 | - | - |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 3,603 | 437 | 1,574 | 183 |
| | DUKE REALTY CORP | 9,969 | 317 | 3,461 | 114 |
| | EQUINIX INC | 4,426 | 1,855 | - | - |
| | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 6,163 | 757 | 1,831 | 231 |
| | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC-NEW | - | - | - | - |
| | | (4,332) | (-) | - | - |
| | EQUITY RESIDENTIAL | 3,961 | 311 | - | - |
| | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 1,247 | 376 | 628 | 177 |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 1,058 | 124 | - | - |
| | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST HCP, INC. | 1,003 | 136 | - | - |
| | | 4,075 | 144 | (24,237) | (724) |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC(NEW) | - | - | - | - | |
| | (24,237) | (724) | - | - | |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 5,501 | 92 | - | - | |
| INVITATION HOMES INC | 15,335 | 448 | - | - | |
| IRON MOUNTAIN INC | 4,230 | 134 | - | - | |
| 国 | KIMCO REALTY CORPORATION | 11,493 | 223 | 6,069 | 115 |
| | LIBERTY PROPERTY TRUST | 2,317 | 117 | - | - |
| | MACERICH COMPANY/THE | 1,923 | 62 | 5,729 | 153 |
| | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 29,675 | 615 | - | - |
| | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 1,021 | 133 | - | - |
| | NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 1,833 | 103 | - | - |
| | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | 12,872 | 541 | - | - |

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 | | PROLOGIS INC | 8,952 | 732 | 1,504 | 122 |
| | | PUBLIC STORAGE | 1,449 | 341 | — | — |
| | | REALTY INCOME CORPORATION | 4,333 | 321 | — | — |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 3,371 | 226 | — | — |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 3,582 | 564 | — | — |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 6,358 | 833 | 1,760 | 237 |
| | | UDR INC | 8,738 | 407 | 5,100 | 236 |
| | | VENTAS INC | 9,317 | 618 | 3,678 | 249 |
| | | VEREIT INC | 9,533 | 92 | — | — |
| | | VICI PROPERTIES INC | 26,533 | 652 | — | — |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 1,103 | 70 | — | — |
| | | WP CAREY INC | 4,757 | 414 | 2,811 | 240 |
| | | WELLTOWER INC | 6,907 | 581 | 1,354 | 114 |
| | | WEYERHAEUSER CO | 16,679 | 444 | 9,301 | 230 |
| | 小 | 計 | 282,822 (28,569) | 15,968 (724) | 58,155 (24,237) | 3,100 (724) |
| カナダ | | | 口 千カナダドル | 口 千カナダドル | | |
| | | CAN APARTMENT PROP | 4,697 | 257 | — | — |
| | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 6,566 | 152 | — | — | |
| 小 | 計 | 11,263 | 410 | — | — | |
| ユーロ | フランス | | 口 千ユーロ | 口 千ユーロ | | |
| | | GECINA SA | 951 | 137 | — | — |
| | | COVIVIO | 838 | 71 | — | — |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED | 1,772 | 233 | 398 | 48 | |
| 小 | 計 | 3,561 | 441 | 398 | 48 | |
| ユ | ロ | 計 | 3,561 | 441 | 398 | 48 |
| イギリス | | | 口 千英ポンド | 口 千英ポンド | | |
| | | BRITISH LAND CO PLC | 10,190 | 60 | — | — |
| | | HAMMERSON PLC | — | — | 34,414 | 95 |
| | SEGRO PLC | 20,438 | 165 | — | — | |
| 小 | 計 | 30,628 | 225 | 34,414 | 95 | |
| オーストラリア | | | 口 千オーストラリアドル | 口 千オーストラリアドル | | |
| | | MIRVAC GROUP | 137,742 | 430 | 52,367 | 170 |
| | | TRANSURBAN GROUP | 42,076 | 573 | 5,396 | 72 |
| | | APA GROUP | 42,240 | 471 | 23,467 | 247 |
| | | GPT GROUP | 49,328 | 298 | 21,745 | 127 |
| | | DEXUS | 30,104 | 362 | 5,770 | 78 |
| | GOODMAN GROUP | 22,036 | 278 | — | — | |
| | SCENTRE GROUP | 56,705 | 222 | — | — | |
| 小 | 計 | 380,231 | 2,637 | 108,745 | 695 | |
| 香港 | | | 口 千香港ドル | 口 千香港ドル | | |
| | | LINK REIT | 20,000 | 1,715 | — | — |
| | HKT TRUST AND HKT LTD | 34,000 | 426 | — | — | |
| 小 | 計 | 54,000 | 2,142 | — | — | |
| シンガポール | | | 口 千シンガポールドル | 口 千シンガポールドル | | |
| | | CAPITALAND MALL TRUST | 58,000 | 154 | — | — |
| | | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 32,100 (—) | 95 (△ 1) | — (—) | — (7) |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 34,700 | 65 | 34,300 | 59 | |

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 | | SUNTEC REIT | 112,400 (-) | 210 (△ 1) | 113,400 | 209 |
| | | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 104,900 | 255 | - | - |
| | | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT RIGHT | - | - | 18,928 | 4 |
| | | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT RIGHT-N | - | - | - | - |
| 小 計 | | 342,100 (18,928) | 780 (5) | 166,628 (-) | 273 (7) | |

※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 | SPMINI | 39,655 | 41,330 | - | - |
| | | SP1200 | 2,642 | 2,755 | - | - |
| | | FTSE | 3,289 | 3,491 | - | - |
| | | DJEURO | 9,422 | 9,887 | - | - |

※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）の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 79,649,627千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 179,517,456千円 |
| (c) 売買高比率(a)/(b) | 0.44 |

※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12月1日から2019年12月2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12月1日から2019年12月2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12月2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 | 321 | 378 | 2,073 | 227,367 | 保険 |
| AGCO CORP | 22 | — | — | — | 資本財 |
| AES CORPORATION | 271 | 336 | 636 | 69,804 | 公益事業 |
| AT&T INC | 3,017 | 3,819 | 14,278 | 1,566,056 | 電気通信サービス |
| ABBOTT LABORATORIES | 728 | 919 | 7,861 | 862,210 | ヘルスケア機器・サービス |
| ABBVIE INC | 630 | 768 | 6,739 | 739,150 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ABIOMED INC | 18 | 22 | 448 | 49,230 | ヘルスケア機器・サービス |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 296 | 410 | 2,252 | 247,099 | メディア・娯楽 |
| ACUITY BRANDS INC | 18 | 18 | 246 | 27,024 | 資本財 |
| ADOBE INC | 204 | 253 | 7,832 | 859,085 | ソフトウェア・サービス |
| ADVANCE AUTO PARTS | 33 | 40 | 637 | 69,896 | 小売 |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 394 | 552 | 2,163 | 237,267 | 半導体・半導体製造装置 |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 22 | — | — | — | 各種金融 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 128 | 160 | 1,294 | 141,945 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 89 | 114 | 2,710 | 297,310 | 素材 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 73 | 83 | 724 | 79,509 | ソフトウェア・サービス |
| ALBEMARLE CORPORATION | 46 | 63 | 412 | 45,291 | 素材 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 90 | 113 | 1,295 | 142,090 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 31 | 38 | 1,068 | 117,233 | ヘルスケア機器・サービス |
| ALLEGHANY CORPORATION | 6 | 8 | 627 | 68,871 | 保険 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 22 | 22 | 237 | 26,054 | ソフトウェア・サービス |
| ALLIANT ENERGY CORP | 91 | 132 | 703 | 77,214 | 公益事業 |
| ALLSTATE CORP | 142 | 168 | 1,880 | 206,287 | 保険 |
| ALLY FINANCIAL INC | 177 | 201 | 641 | 70,329 | 各種金融 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 39 | 56 | 657 | 72,115 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALPHABET INC-CL C | 130 | 163 | 21,296 | 2,335,849 | メディア・娯楽 |
| ALPHABET INC-CL A | 123 | 156 | 20,394 | 2,236,886 | メディア・娯楽 |
| ALTICE USA INC-A | — | 63 | 161 | 17,675 | メディア・娯楽 |
| ALTRIA GROUP INC | 786 | 975 | 4,849 | 531,874 | 食品・飲料・タバコ |
| AMAZON.COM INC | 171 | 219 | 39,475 | 4,329,654 | 小売 |
| AMERCO | 3 | 3 | 141 | 15,494 | 運輸 |
| AMEREN CORPORATION | 103 | 124 | 925 | 101,531 | 公益事業 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 56 | 56 | 163 | 17,891 | 運輸 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 204 | 263 | 2,409 | 264,278 | 公益事業 |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY | 303 | 370 | 4,445 | 487,532 | 各種金融 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 35 | 35 | 388 | 42,584 | 保険 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 373 | 464 | 2,445 | 268,214 | 保険 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 70 | 91 | 1,107 | 121,515 | 公益事業 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 70 | 79 | 702 | 77,068 | ヘルスケア機器・サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 62 | 67 | 1,112 | 122,038 | 各種金融 |
| AMETEK INC | 96 | 121 | 1,206 | 132,376 | 資本財 |
| AMGEN INC | 273 | 314 | 7,383 | 809,806 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMPHENOL CORPORATION -CL A | 125 | 151 | 1,575 | 172,788 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ANADARKO PETROLEUM CORP | 214 | — | — | — | エネルギー |
| ANALOG DEVICES INC | 154 | 187 | 2,117 | 232,281 | 半導体・半導体製造装置 |
| ANSYS INC | 36 | 42 | 1,083 | 118,888 | ソフトウェア・サービス |
| ANTERO RESOURCES CORP | 92 | — | — | — | エネルギー |
| ANTHEM INC | 106 | 135 | 3,904 | 428,267 | ヘルスケア機器・サービス |
| APACHE CORPORATION | 163 | 190 | 424 | 46,581 | エネルギー |
| APPLE INC | 2,041 | 2,354 | 62,929 | 6,902,062 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| APPLIED MATERIALS INC | 418 | 474 | 2,748 | 301,437 | 半導体・半導体製造装置 |
| AQUA AMERICA INC | — | 126 | 560 | 61,437 | 公益事業 |
| ARAMARK | 107 | 132 | 577 | 63,381 | 消費者サービス |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 226 | 284 | 1,219 | 133,742 | 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 | 邦貨換算金額 | |
| ARCONIC INC | 190 | 190 | 588 | 64,599 | 資本財 |
| ARISTA NETWORKS INC | 22 | 27 | 530 | 58,213 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 41 | 41 | 328 | 36,075 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ASSURANT INC | 21 | 31 | 413 | 45,380 | 保険 |
| ATMOS ENERGY CORP | 46 | 64 | 688 | 75,503 | 公益事業 |
| AUTODESK INC | 91 | 111 | 2,019 | 221,506 | ソフトウェア・サービス |
| AUTOLIV INC | 40 | 40 | 326 | 35,861 | 自動車・自動車部品 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 183 | 229 | 3,912 | 429,093 | ソフトウェア・サービス |
| AUTOZONE INC | 10 | 12 | 1,470 | 161,234 | 小売 |
| AVERY DENNISON CORP | 39 | 48 | 633 | 69,478 | 素材 |
| AVNET INC | 45 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC | — | 228 | 564 | 61,921 | 各種金融 |
| BB & T CORPORATION | 317 | 388 | 2,125 | 233,093 | 銀行 |
| BAKER HUGHES COMPANY | 163 | 319 | 716 | 78,624 | エネルギー |
| BALL CORPORATION | 136 | 161 | 1,065 | 116,833 | 素材 |
| BANK OF AMERICA CORP | 4,002 | 4,621 | 15,398 | 1,688,951 | 銀行 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE) | 419 | 436 | 2,139 | 234,703 | 各種金融 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 211 | 245 | 2,014 | 220,949 | ヘルスケア機器・サービス |
| BECTON DICKINSON & CO | 111 | 141 | 3,645 | 399,880 | ヘルスケア機器・サービス |
| BEIGENE LTD-ADR | — | 19 | 401 | 44,080 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| W. R. BERKLEY CORPORATION | 38 | 74 | 505 | 55,399 | 保険 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 529 | 688 | 15,164 | 1,663,250 | 各種金融 |
| BEST BUY COMPANY INC | 105 | 130 | 1,054 | 115,704 | 小売 |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | — | 13 | 490 | 53,802 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 75 | 90 | 732 | 80,378 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOGEN INC | 86 | 98 | 2,947 | 323,307 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED | — | 87 | 553 | 60,760 | ソフトウェア・サービス |
| BLACKROCK INC | 49 | 61 | 3,049 | 334,484 | 各種金融 |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE-A | — | 356 | 1,931 | 211,886 | 各種金融 |
| H&R BLOCK INC | 78 | — | — | — | 消費者サービス |
| BOEING CO | 229 | 279 | 10,250 | 1,124,232 | 資本財 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 20 | 22 | 4,295 | 471,129 | 小売 |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | — | 81 | 593 | 65,143 | ソフトウェア・サービス |
| BORGWARNER INC | 85 | 120 | 507 | 55,690 | 自動車・自動車部品 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 573 | 718 | 3,108 | 340,983 | ヘルスケア機器・サービス |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC | 42 | — | — | — | 保険 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 679 | 1,221 | 6,952 | 762,598 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 49 | 58 | 728 | 79,904 | ソフトウェア・サービス |
| BROADCOM INC | 170 | 205 | 6,501 | 713,060 | 半導体・半導体製造装置 |
| BROWN & BROWN INC | — | 140 | 531 | 58,260 | 保険 |
| BROWN-FORMAN CORPORATION | 113 | 156 | 1,059 | 116,189 | 食品・飲料・タバコ |
| BURLINGTON STORES INC | — | 37 | 843 | 92,517 | 小売 |
| CBS CORP-CL B | 136 | 182 | 738 | 80,999 | メディア・娯楽 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 49 | 56 | 673 | 73,824 | 各種金融 |
| CBRE GROUP INC-A | 131 | 161 | 923 | 101,307 | 不動産 |
| CDK GLOBAL INC | 50 | 74 | 400 | 43,979 | ソフトウェア・サービス |
| CDW CORP/DE | 63 | 74 | 999 | 109,670 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 101 | 120 | 554 | 60,829 | 素材 |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE, INC. | 60 | 69 | 532 | 58,370 | 運輸 |
| CIGNA CORP | 101 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| CIGNA CORPORATION | — | 199 | 3,990 | 437,689 | ヘルスケア機器・サービス |
| CIT GROUP INC | 47 | — | — | — | 銀行 |
| CME GROUP INC. | 139 | 186 | 3,788 | 415,491 | 各種金融 |
| CMS ENERGY CORPORATION | 114 | 150 | 921 | 101,106 | 公益事業 |
| CSX CORPORATION | 345 | 389 | 2,788 | 305,849 | 運輸 |
| CVS HEALTH CORPORATION | 535 | 677 | 5,097 | 559,045 | ヘルスケア機器・サービス |
| CABOT OIL & GAS CORPORATION | 196 | 196 | 312 | 34,322 | エネルギー |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 117 | 142 | 1,001 | 109,796 | ソフトウェア・サービス |
| CAMPBELL SOUP CO | 78 | 78 | 366 | 40,244 | 食品・飲料・タバコ |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|--|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 202 | 251 | 2,511 | 275,444 | 各種金融 |
| CARDINAL HEALTH INC | 128 | 151 | 831 | 91,223 | ヘルスケア機器・サービス |
| CARMAX INC | 74 | 84 | 819 | 89,894 | 小売 |
| CARNIVAL CORP | 177 | 213 | 963 | 105,671 | 消費者サービス |
| CATERPILLAR INC | 248 | 295 | 4,275 | 468,901 | 資本財 |
| CELANESE CORPORATION | 56 | 64 | 806 | 88,419 | 素材 |
| CELGENE CORP | 301 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CENTENE CORP | 83 | 209 | 1,267 | 139,020 | ヘルスケア機器・サービス |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 193 | 254 | 625 | 68,593 | 公益事業 |
| CENTURYLINK INC | 406 | 497 | 720 | 79,078 | 電気通信サービス |
| CERNER CORP | 124 | 165 | 1,181 | 129,565 | ヘルスケア機器・サービス |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 69 | 79 | 3,753 | 411,632 | メディア・娯楽 |
| CHEMOURS CO | 80 | — | — | — | 素材 |
| CHENIERE ENERGY INC | 81 | 117 | 711 | 78,000 | エネルギー |
| CHEVRON CORPORATION | 791 | 984 | 11,534 | 1,265,051 | エネルギー |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 11 | 14 | 1,143 | 125,425 | 消費者サービス |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 99 | 124 | 876 | 96,183 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CIMAREX ENERGY CO | 40 | — | — | — | エネルギー |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 63 | 78 | 841 | 92,262 | 保険 |
| CISCO SYSTEMS INC | 1,947 | 2,241 | 10,158 | 1,114,169 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CINTAS CORP | 36 | 45 | 1,158 | 127,071 | 商業・専門サービス |
| CITIGROUP INC | 1,055 | 1,184 | 8,895 | 975,623 | 銀行 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 201 | 232 | 893 | 98,041 | 銀行 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 56 | 66 | 753 | 82,602 | ソフトウェア・サービス |
| CLOROX COMPANY | 55 | 64 | 957 | 104,993 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| COCA-COLA CO/THE | 1,673 | 2,126 | 11,353 | 1,245,249 | 食品・飲料・タバコ |
| COGNEX CORP | 71 | 86 | 436 | 47,871 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATI | 239 | 288 | 1,850 | 202,980 | ソフトウェア・サービス |
| COLGATE-PALMOLIVE COMPANY | 344 | 433 | 2,940 | 322,481 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| COMCAST CORP-CLASS A | 1,899 | 2,374 | 10,483 | 1,149,879 | メディア・娯楽 |
| COMERICA INC | 71 | 88 | 620 | 68,004 | 銀行 |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC | 88 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CONAGRA BRANDS INC | 171 | 246 | 711 | 78,018 | 食品・飲料・タバコ |
| CONCHO RESOURCES INC | 83 | 101 | 738 | 80,952 | エネルギー |
| CONOCOPHILLIPS | 486 | 584 | 3,500 | 383,973 | エネルギー |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 129 | 180 | 1,564 | 171,589 | 公益事業 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 68 | 90 | 1,683 | 184,602 | 食品・飲料・タバコ |
| CONTINENTAL RESOURCES, INC. | 45 | 45 | 140 | 15,359 | エネルギー |
| COOPER COMPANIES INC (THE) | 20 | 25 | 785 | 86,158 | ヘルスケア機器・サービス |
| COPART INC | 85 | 104 | 930 | 102,066 | 商業・専門サービス |
| CORNING INC | 335 | 397 | 1,155 | 126,744 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CORTEVA INC | — | 381 | 991 | 108,763 | 素材 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 182 | 228 | 6,840 | 750,262 | 食品・生活必需品小売り |
| COSTAR GROUP INC | 15 | 18 | 1,135 | 124,555 | 商業・専門サービス |
| COTY INC-CL A | 225 | 169 | 196 | 21,498 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 172 | 218 | 2,916 | 319,848 | 不動産 |
| CROWN HOLDINGS INC | 52 | 68 | 520 | 57,132 | 素材 |
| CUMMINS INC | 62 | 79 | 1,452 | 159,325 | 資本財 |
| D. R. HORTON INC | 156 | 190 | 1,055 | 115,794 | 耐久消費財・アパレル |
| DTE ENERGY COMPANY | 73 | 92 | 1,160 | 127,304 | 公益事業 |
| DXC TECHNOLOGY CO | 118 | 158 | 590 | 64,789 | ソフトウェア・サービス |
| DANAHER CORP | 261 | 335 | 4,899 | 537,412 | ヘルスケア機器・サービス |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 53 | 67 | 796 | 87,322 | 消費者サービス |
| DAVITA INC | 58 | 51 | 367 | 40,263 | ヘルスケア機器・サービス |
| DEERE & CO | 126 | 152 | 2,566 | 281,452 | 資本財 |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V | 82 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| DELL TECHNOLOGIES INC-C | — | 79 | 383 | 42,015 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DELTA AIR LINES INC | 72 | 82 | 475 | 52,165 | 運輸 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 99 | 118 | 670 | 73,572 | 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 | 評価金額 | 価額 | |
| | | | 外貨 | 邦貨換算金額 | |
| DEVON ENERGY CORPORATION | 220 | 210 | 460 | 50,548 | エネルギー |
| DEXCOM INC | — | 46 | 1,049 | 115,108 | ヘルスケア機器・サービス |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 38 | 79 | 613 | 67,292 | エネルギー |
| THE WALT DISNEY CO. | 615 | 941 | 14,276 | 1,565,803 | メディア・娯楽 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 144 | 164 | 1,393 | 152,799 | 各種金融 |
| DISCOVERY INC-A | 70 | 70 | 233 | 25,560 | メディア・娯楽 |
| DISCOVERY INC-C | 127 | 182 | 557 | 61,201 | メディア・娯楽 |
| DISH NETWORK CORP. | 97 | 122 | 419 | 45,996 | メディア・娯楽 |
| DISH NETWORK CORP-RIGHTS | — | 6 | 0.45152 | 49 | メディア・娯楽 |
| DOCUSIGN INC | — | 54 | 384 | 42,183 | ソフトウェア・サービス |
| DOLLAR GENERAL CORP | 108 | 130 | 2,061 | 226,078 | 小売 |
| DOLLAR TREE INC | 102 | 120 | 1,101 | 120,847 | 小売 |
| DOMINION ENERGY INC | 271 | 435 | 3,617 | 396,743 | 公益事業 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 16 | 22 | 653 | 71,626 | 消費者サービス |
| DOVER CORP | 66 | 79 | 886 | 97,193 | 資本財 |
| DOW INC | — | 379 | 2,026 | 222,267 | 素材 |
| DOWDUPONT INC | 962 | — | — | — | 素材 |
| DROPBOX INC-CLASS A | — | 105 | 195 | 21,425 | ソフトウェア・サービス |
| DUKE ENERGY CORP | 291 | 375 | 3,307 | 362,817 | 公益事業 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | — | 381 | 2,469 | 270,906 | 素材 |
| EOG RESOURCES INC | 240 | 310 | 2,201 | 241,485 | エネルギー |
| E*TRADE FINANCIAL CORPORATION | 109 | 124 | 549 | 60,283 | 各種金融 |
| EAST WEST BANCORP INC | 62 | 88 | 404 | 44,350 | 銀行 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 59 | 70 | 550 | 60,401 | 素材 |
| EATON VANCE CORP | 55 | 55 | 260 | 28,610 | 各種金融 |
| EBAY INC | 392 | 419 | 1,491 | 163,558 | 小売 |
| ECOLAB INC | 105 | 138 | 2,579 | 282,909 | 素材 |
| EDISON INTERNATIONAL | 135 | 179 | 1,239 | 135,972 | 公益事業 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 85 | 105 | 2,589 | 284,043 | ヘルスケア機器・サービス |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | — | 179 | 497 | 54,596 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ELECTRONIC ARTS INC | 127 | 150 | 1,522 | 166,990 | メディア・娯楽 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 261 | 328 | 2,426 | 266,157 | 資本財 |
| ENTERGY CORP | 71 | 107 | 1,245 | 136,630 | 公益事業 |
| EPAM SYSTEMS INC | — | 30 | 653 | 71,658 | ソフトウェア・サービス |
| EQUIFAX INC | 47 | 61 | 855 | 93,839 | 商業・専門サービス |
| EQUINIX INC | 32 | — | — | — | 不動産 |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | — | 12 | 218 | 23,916 | 保険 |
| EVERGY INC | 118 | 123 | 783 | 85,896 | 公益事業 |
| EVERSOURCE ENERGY | 137 | 175 | 1,454 | 159,480 | 公益事業 |
| EXACT SCIENCES CORP | — | 84 | 680 | 74,671 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EXELON CORP | 401 | 492 | 2,185 | 239,759 | 公益事業 |
| EXPEDIA GROUP INC | 51 | 75 | 766 | 84,049 | 小売 |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 68 | 95 | 711 | 78,003 | 運輸 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO | 233 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| EXXON MOBIL CORPORATION | 1,755 | 2,208 | 15,044 | 1,650,114 | エネルギー |
| FLIR SYSTEMS INC | 52 | 68 | 367 | 40,339 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| FMC CORPORATION | 56 | 66 | 653 | 71,728 | 素材 |
| FACEBOOK INC-A | 994 | 1,252 | 25,249 | 2,769,416 | メディア・娯楽 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | — | 19 | 503 | 55,219 | 各種金融 |
| FASTENAL COMPANY | 119 | 290 | 1,030 | 113,060 | 資本財 |
| FEDEX CORP | 105 | 129 | 2,071 | 227,222 | 運輸 |
| F5 NETWORKS INC | 26 | 35 | 510 | 55,999 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 137 | 320 | 4,420 | 484,888 | ソフトウェア・サービス |
| FINF GROUP | 108 | 139 | 663 | 72,807 | 保険 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 284 | 372 | 1,124 | 123,307 | 銀行 |
| FIRST DATA CORP-CLASS A | 209 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 67 | 91 | 1,009 | 110,702 | 銀行 |
| FISERV INC | 166 | 306 | 3,558 | 390,304 | ソフトウェア・サービス |
| FIRSTENERGY CORP | 202 | 269 | 1,285 | 140,955 | 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 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 38 | 43 | 1,341 | 147,140 | ソフトウェア・サービス |
| FLUOR CORP | 56 | — | — | — | 資本財 |
| FLOWSERVE CORPORATION | 48 | — | 323 | 35,520 | 資本財 |
| FORD MOTOR COMPANY | 1,545 | 1,987 | 1,800 | 197,454 | 自動車・自動車部品 |
| FORTINET INC | 59 | 73 | 773 | 84,849 | ソフトウェア・サービス |
| FORTIVE CORP | 124 | 161 | 1,165 | 127,781 | 資本財 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY | 64 | 64 | 408 | 44,752 | 資本財 |
| FOX CORPORATION-CLASS A | — | 197 | 706 | 77,537 | メディア・娯楽 |
| FOX CORPORATION-CLASS B | — | 87 | 306 | 33,658 | メディア・娯楽 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 134 | 178 | 489 | 53,723 | 各種金融 |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 602 | 807 | 919 | 100,826 | 素材 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 75 | 93 | 876 | 96,099 | 保険 |
| GAP INC/THE | 92 | 92 | 153 | 16,793 | 小売 |
| GARTNER INC | 40 | 45 | 732 | 80,393 | ソフトウェア・サービス |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 104 | 131 | 2,383 | 261,464 | 資本財 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 3,609 | 4,551 | 5,129 | 562,558 | 資本財 |
| GENERAL MILLS INC | 250 | 325 | 1,737 | 190,555 | 食品・飲料・タバコ |
| GENERAL MOTORS CO | 527 | 662 | 2,386 | 261,721 | 自動車・自動車部品 |
| GENUINE PARTS CO | 60 | 74 | 772 | 84,778 | 小売 |
| GILEAD SCIENCES INC | 540 | 662 | 4,457 | 488,910 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 66 | 159 | 2,890 | 317,073 | ソフトウェア・サービス |
| GLOBE LIFE INC | — | 59 | 606 | 66,497 | 保険 |
| GODADDY INC - CLASS A | 66 | 89 | 591 | 64,833 | ソフトウェア・サービス |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 149 | 169 | 3,756 | 411,992 | 各種金融 |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 103 | — | — | — | 自動車・自動車部品 |
| WW GRAINGER INC | 19 | 23 | 757 | 83,083 | 資本財 |
| GRUBHUB INC | — | 44 | 189 | 20,823 | 小売 |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | — | 47 | 583 | 64,032 | ソフトウェア・サービス |
| HCA HEALTHCARE INC | 116 | 138 | 1,925 | 211,181 | ヘルスケア機器・サービス |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | 77 | 77 | 310 | 34,009 | 資本財 |
| HP INC | 682 | 763 | 1,533 | 168,217 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HALLIBURTON CO | 364 | 443 | 930 | 102,025 | エネルギー |
| HANESBRANDS INC | 131 | 222 | 334 | 36,700 | 耐久消費財・アパレル |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 73 | 73 | 267 | 29,315 | 自動車・自動車部品 |
| HARRIS CORP | 49 | — | — | — | 資本財 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 152 | 183 | 1,133 | 124,372 | 保険 |
| HASBRO INC | 51 | 73 | 746 | 81,851 | 耐久消費財・アパレル |
| HEICO CORP | — | 18 | 245 | 26,897 | 資本財 |
| HEICO CORP-CLASS A | — | 44 | 445 | 48,857 | 資本財 |
| HELMERICH & PAYNE INC | 40 | — | — | — | エネルギー |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 32 | 39 | 594 | 65,242 | ソフトウェア・サービス |
| THE HERSHEY COMPANY | 56 | 75 | 1,113 | 122,103 | 食品・飲料・タバコ |
| HESS CORPORATION | 110 | 145 | 900 | 98,786 | エネルギー |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C | 615 | 679 | 1,074 | 117,898 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 114 | 140 | 1,472 | 161,471 | 消費者サービス |
| HOLLYFRONTIER CORP | 73 | 94 | 485 | 53,249 | エネルギー |
| HOLOGIC INC | 121 | 135 | 697 | 76,506 | ヘルスケア機器・サービス |
| HOME DEPOT INC | 477 | 572 | 12,632 | 1,385,541 | 小売 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 310 | 377 | 6,746 | 739,976 | 資本財 |
| HORMEL FOODS CORPORATION | 124 | 149 | 665 | 72,962 | 食品・飲料・タバコ |
| HUMANA INC. | 57 | 72 | 2,461 | 269,991 | ヘルスケア機器・サービス |
| J. B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 35 | 44 | 509 | 55,936 | 運輸 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 458 | 530 | 790 | 86,657 | 銀行 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES | 18 | 21 | 530 | 58,159 | 資本財 |
| IAC/INTERACTIVECORP | 32 | 39 | 885 | 97,067 | メディア・娯楽 |
| IPG PHOTONICS CORP | 17 | 17 | 252 | 27,677 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| IDEX CORP | 30 | 38 | 624 | 68,523 | 資本財 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 36 | 43 | 1,097 | 120,334 | ヘルスケア機器・サービス |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 126 | 171 | 2,997 | 328,739 | 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 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ILLUMINA INC | 61 | 74 | 2,390 | 262,238 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INCYTE CORP | 75 | 92 | 870 | 95,456 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INGREDION INC | 33 | 33 | 276 | 30,285 | 食品・飲料・タバコ |
| INSULET CORP | — | 34 | 647 | 71,001 | ヘルスケア機器・サービス |
| INTEL CORP | 1,929 | 2,313 | 13,430 | 1,473,057 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 240 | 285 | 2,692 | 295,314 | 各種金融 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 381 | 460 | 6,186 | 678,485 | ソフトウェア・サービス |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 39 | 48 | 687 | 75,452 | 素材 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 171 | 191 | 886 | 97,280 | 素材 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 155 | 196 | 439 | 48,217 | メディア・娯楽 |
| INTUIT INC | 101 | 137 | 3,566 | 391,141 | ソフトウェア・サービス |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 47 | 61 | 3,621 | 397,198 | ヘルスケア機器・サービス |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | — | 67 | 432 | 47,422 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| IQVIA HOLDINGS INC | 68 | 85 | 1,240 | 136,110 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JPMORGAN CHASE & CO | 1,414 | 1,669 | 21,991 | 2,412,060 | 銀行 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 49 | 69 | 637 | 69,965 | 資本財 |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC | 128 | 128 | 269 | 29,536 | 各種金融 |
| JOHNSON & JOHNSON | 1,112 | 1,378 | 18,949 | 2,078,342 | 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 | 26 | 435 | 47,760 | 不動産 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 150 | 174 | 437 | 47,990 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| KLA CORPORATION | 64 | 81 | 1,342 | 147,281 | 半導体・半導体製造装置 |
| KKR & CO INC -A | — | 248 | 732 | 80,292 | 各種金融 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 46 | 51 | 777 | 85,258 | 運輸 |
| KELLOGG CO | 112 | 129 | 843 | 92,486 | 食品・飲料・タバコ |
| KEYCORP | 456 | 511 | 991 | 108,733 | 銀行 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 75 | 95 | 1,021 | 112,014 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 145 | 183 | 2,505 | 274,835 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| KINDER MORGAN INC | 808 | 1,091 | 2,140 | 234,749 | エネルギー |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 51 | 83 | 307 | 33,775 | 運輸 |
| KOHL'S CORP | 69 | 82 | 388 | 42,661 | 小売 |
| KRAFT HEINZ COMPANY | 247 | 340 | 1,037 | 113,768 | 食品・飲料・タバコ |
| KROGER CO | 326 | 409 | 1,118 | 122,659 | 食品・生活必需品小売り |
| L BRANDS INC | 106 | — | — | — | 小売 |
| LKQ CORPORATION | 139 | 159 | 561 | 61,610 | 小売 |
| L3 TECHNOLOGIES INC | 33 | — | — | — | 資本財 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | — | 118 | 2,385 | 261,622 | 資本財 |
| LABORATORY CRP OF AMR HLDGS | 44 | 49 | 860 | 94,389 | ヘルスケア機器・サービス |
| LAM RESEARCH CORP | 68 | 76 | 2,028 | 222,479 | 半導体・半導体製造装置 |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | — | 74 | 622 | 68,317 | 食品・飲料・タバコ |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 158 | 176 | 1,106 | 121,364 | 消費者サービス |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 90 | 118 | 2,313 | 253,710 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| LEAR CORP | 25 | 35 | 424 | 46,514 | 自動車・自動車部品 |
| LEGGETT & PLATT INC | 50 | 66 | 348 | 38,195 | 耐久消費財・アパレル |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 60 | 69 | 631 | 69,215 | ソフトウェア・サービス |
| LENNAR CORP-CL A | 112 | 156 | 934 | 102,480 | 耐久消費財・アパレル |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 15 | 20 | 519 | 56,965 | 資本財 |
| LIBERTY BROADBAND-C | 40 | 54 | 647 | 71,006 | メディア・娯楽 |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A | 41 | 41 | 201 | 22,118 | メディア・娯楽 |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | 76 | 76 | 371 | 40,691 | メディア・娯楽 |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 85 | 102 | 463 | 50,879 | メディア・娯楽 |
| ELI LILLY & CO | 405 | 454 | 5,336 | 585,254 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 91 | 112 | 662 | 72,648 | 保険 |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT INC | 60 | 75 | 524 | 57,517 | メディア・娯楽 |
| LOCKHEED MARTIN CORPORATION | 106 | 133 | 5,234 | 574,143 | 資本財 |
| LOEWS CORPORATION | 106 | 139 | 708 | 77,677 | 保険 |
| LOWE'S COMPANIES INC | 341 | 409 | 4,799 | 526,435 | 小売 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 42 | 56 | 1,267 | 138,991 | 耐久消費財・アパレル |
| M & T BANK CORP | 55 | 65 | 1,084 | 118,910 | 銀行 |
| MGM MIRAGE | 224 | 258 | 826 | 90,683 | 消費者サービス |

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 | |
| MSCI INC-A | 38 | 42 | 1,112 | 122,069 | 各種金融 |
| MACY'S INC | 135 | — | — | — | 小売 |
| MANPOWERGROUP | 32 | 32 | 302 | 33,164 | 商業・専門サービス |
| MARATHON OIL CORP | 368 | 470 | 547 | 60,093 | エネルギー |
| MARATHON PETROLEUM CORPORATION | 287 | 335 | 2,037 | 223,466 | エネルギー |
| MARKEL CORP | 5 | 7 | 797 | 87,432 | 保険 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | — | 19 | 772 | 84,684 | 各種金融 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 210 | 259 | 2,802 | 307,339 | 保険 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 124 | 143 | 2,014 | 220,944 | 消費者サービス |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 25 | 33 | 907 | 99,530 | 素材 |
| MASCO CORP | 119 | 148 | 692 | 75,996 | 資本財 |
| MASTERCARD INC-CL A | 383 | 469 | 13,721 | 1,504,927 | ソフトウェア・サービス |
| MATCH GROUP INC | — | 37 | 263 | 28,849 | メディア・娯楽 |
| MATTEL INC | 140 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 116 | 138 | 782 | 85,861 | 半導体・半導体製造装置 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 50 | 62 | 1,050 | 115,259 | 食品・飲料・タバコ |
| MCDONALD'S CORPORATION | 326 | 395 | 7,692 | 843,666 | 消費者サービス |
| MCKESSON CORP | 83 | 96 | 1,393 | 152,803 | ヘルスケア機器・サービス |
| MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR | 111 | 115 | 245 | 26,899 | 消費者サービス |
| MERCADOLIBRE INC | 18 | 22 | 1,306 | 143,339 | 小売 |
| MERCK & CO. INC. | 1,113 | 1,328 | 11,580 | 1,270,155 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| METLIFE INC | 359 | 409 | 2,044 | 224,231 | 保険 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | 11 | 12 | 905 | 99,262 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICROSOFT CORP | 3,030 | 3,779 | 57,218 | 6,275,737 | ソフトウェア・サービス |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 101 | 120 | 1,140 | 125,103 | 半導体・半導体製造装置 |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 474 | 588 | 2,793 | 306,405 | 半導体・半導体製造装置 |
| MIDDLEBY CORP | 23 | 28 | 326 | 35,842 | 資本財 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 28 | 28 | 399 | 43,764 | 耐久消費財・アパレル |
| MOLSON COORS BREWING COMPANY | 78 | 96 | 486 | 53,312 | 食品・飲料・タバコ |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 612 | 751 | 3,949 | 433,156 | 食品・飲料・タバコ |
| MONGDB INC | — | 18 | 281 | 30,824 | ソフトウェア・サービス |
| MONSTER BEVERAGE CORPORATION | 181 | 206 | 1,236 | 135,630 | 食品・飲料・タバコ |
| MOODY'S CORP | 71 | 86 | 1,961 | 215,123 | 各種金融 |
| MORGAN STANLEY | 551 | 639 | 3,165 | 347,195 | 各種金融 |
| DAIRY FARM INTL HLDGS-900 | 135 | 135 | 78 | 8,661 | 食品・生活必需品小売り |
| MOSAIC CO/THE | 155 | 185 | 354 | 38,829 | 素材 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 67 | 83 | 1,397 | 153,328 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| NRG ENERGY INC | — | 135 | 538 | 59,032 | 公益事業 |
| NVR INC | 1 | 1 | 655 | 71,949 | 耐久消費財・アパレル |
| NASDAQ INC | 53 | 65 | 688 | 75,472 | 各種金融 |
| NATIONAL-OILWELL VARCO INC. | 168 | 221 | 499 | 54,798 | エネルギー |
| NEKTAR THERAPEUTICS | 70 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NETAPP INC | 111 | 125 | 758 | 83,221 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| NETFLIX INC | 179 | 226 | 7,140 | 783,144 | メディア・娯楽 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | — | 50 | 590 | 64,818 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 523 | 523 | 287 | 31,549 | 不動産 |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED | 94 | 115 | 646 | 70,911 | 資本財 |
| JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED | 91 | 131 | 415 | 45,618 | 資本財 |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 219 | — | — | — | 銀行 |
| NEWELL BRANDS INC | 184 | 184 | 355 | 38,950 | 耐久消費財・アパレル |
| NEWFIELD EXPLORATION CO | 82 | — | — | — | エネルギー |
| NEWMONT GOLD CORP CORPORATION | 212 | 415 | 1,595 | 175,042 | 素材 |
| NEWS CORP-CLASS A | 166 | 166 | 214 | 23,538 | メディア・娯楽 |
| NEXTERA ENERGY INC | 195 | 249 | 5,831 | 639,544 | 公益事業 |
| NIKE INC -CL B | 533 | 652 | 6,100 | 669,082 | 耐久消費財・アパレル |
| NISOURCE INC | 157 | 189 | 500 | 54,884 | 公益事業 |
| NOBLE ENERGY INC | 209 | 267 | 555 | 60,924 | エネルギー |
| NORDSTROM INC | 47 | 47 | 181 | 19,910 | 小売 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 117 | 134 | 2,609 | 286,214 | 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 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 85 | 104 | 1,124 | 123,337 | 各種金融 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 68 | 85 | 3,005 | 329,645 | 資本財 |
| NORTONLIFELOCK INC | — | 313 | 780 | 85,609 | ソフトウェア・サービス |
| NUCOR CORP | 132 | 154 | 871 | 95,536 | 素材 |
| NVIDIA CORP | 239 | 300 | 6,513 | 714,421 | 半導体・半導体製造装置 |
| OGE ENERGY CORP | 90 | 116 | 491 | 53,881 | 公益事業 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW | 33 | 39 | 1,755 | 192,533 | 小売 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 318 | 453 | 1,749 | 191,897 | エネルギー |
| OKTA INC | — | 52 | 683 | 75,014 | ソフトウェア・サービス |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 26 | 32 | 629 | 69,008 | 運輸 |
| OMNICOM GROUP | 94 | 118 | 945 | 103,719 | メディア・娯楽 |
| ON SEMICONDUCTOR CORP | 174 | 209 | 448 | 49,244 | 半導体・半導体製造装置 |
| ONEOK INC | 170 | 209 | 1,487 | 163,102 | エネルギー |
| ORACLE CORPORATION | 1,265 | 1,226 | 6,885 | 755,147 | ソフトウェア・サービス |
| OWENS CORNING | 48 | 65 | 437 | 47,940 | 資本財 |
| P G & E CORPORATION | 208 | — | — | — | 公益事業 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 195 | 236 | 3,620 | 397,097 | 銀行 |
| PPG INDUSTRIES INC | 100 | 119 | 1,542 | 169,178 | 素材 |
| PPL CORPORATION | 290 | 365 | 1,245 | 136,595 | 公益事業 |
| PVH CORP | 33 | 33 | 320 | 35,125 | 耐久消費財・アパレル |
| PTC INC | — | 54 | 418 | 45,888 | ソフトウェア・サービス |
| PACCAR INC | 141 | 175 | 1,429 | 156,779 | 資本財 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 40 | 53 | 597 | 65,526 | 素材 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 39 | 48 | 1,105 | 121,292 | ソフトウェア・サービス |
| PARKER HANNIFIN CORPORATION | 53 | 65 | 1,293 | 141,830 | 資本財 |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A | 92 | — | — | — | エネルギー |
| PAYCHEX INC | 134 | 164 | 1,412 | 154,917 | ソフトウェア・サービス |
| PAYCOM SOFTWARE INC | — | 25 | 698 | 76,569 | ソフトウェア・サービス |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 468 | 579 | 6,261 | 686,755 | ソフトウェア・サービス |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 140 | 202 | 333 | 36,556 | 銀行 |
| PEPSICO INC | 586 | 725 | 9,850 | 1,080,450 | 食品・飲料・タバコ |
| PERKINELMER INC | — | 56 | 522 | 57,304 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PFIZER INC | 2,423 | 2,871 | 11,060 | 1,213,087 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. | 645 | 807 | 6,697 | 734,601 | 食品・飲料・タバコ |
| PHILLIPS 66 | 184 | 230 | 2,640 | 289,661 | エネルギー |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION | 51 | 59 | 523 | 57,471 | 公益事業 |
| PINTEREST INC- CLASS A | — | 109 | 213 | 23,391 | メディア・娯楽 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 70 | 85 | 1,091 | 119,743 | エネルギー |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A | 78 | — | — | — | エネルギー |
| POLARIS INC | 24 | 24 | 241 | 26,435 | 耐久消費財・アパレル |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 100 | 119 | 1,481 | 162,502 | 各種金融 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 119 | 141 | 778 | 85,356 | 保険 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 1,041 | 1,307 | 15,963 | 1,750,822 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PROGRESSIVE CORP | 237 | 296 | 2,163 | 237,255 | 保険 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 171 | 205 | 1,927 | 211,392 | 保険 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 209 | 256 | 1,520 | 166,719 | 公益事業 |
| PULTE GROUP INC | 129 | 130 | 518 | 56,817 | 耐久消費財・アパレル |
| QORVO INC | 48 | 60 | 629 | 69,058 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUALCOMM INC | 579 | 632 | 5,286 | 579,855 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 59 | 68 | 726 | 79,631 | ヘルスケア機器・サービス |
| QURATE RETAIL INC | 189 | — | — | — | 小売 |
| RPM INTERNATIONAL INC | — | 76 | 560 | 61,483 | 素材 |
| RALPH LAUREN CORPORATION | 20 | 33 | 355 | 39,027 | 耐久消費財・アパレル |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 54 | 64 | 577 | 63,305 | 各種金融 |
| RAYTHEON COMPANY | 119 | 147 | 3,214 | 352,524 | 資本財 |
| RED HAT INC | 73 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 33 | 40 | 1,511 | 165,813 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REGIONS FINANCIAL CORPORATION | 473 | 558 | 929 | 101,976 | 銀行 |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 29 | 30 | 500 | 54,842 | 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 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 97 | 114 | 1,011 | 110,989 | 商業・専門サービス |
| RESMED INC | 59 | 72 | 1,087 | 119,303 | ヘルスケア機器・サービス |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | — | 41 | 707 | 77,576 | ソフトウェア・サービス |
| ROBERT HALF INTL INC | 46 | 70 | 410 | 45,053 | 商業・専門サービス |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 50 | 60 | 1,175 | 128,921 | 資本財 |
| ROKU INC | — | 46 | 741 | 81,333 | メディア・娯楽 |
| ROLLINS INC | 43 | 64 | 231 | 25,365 | 商業・専門サービス |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 42 | 52 | 1,897 | 208,101 | 資本財 |
| ROSS STORES INC | 157 | 186 | 2,164 | 237,359 | 小売 |
| S&P GLOBAL INC | 103 | 128 | 3,412 | 374,271 | 各種金融 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 47 | 57 | 1,358 | 148,950 | 不動産 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 58 | 76 | 493 | 54,179 | 各種金融 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 90 | 115 | 693 | 76,045 | ソフトウェア・サービス |
| SVB FINANCIAL GROUP | 23 | 26 | 611 | 67,098 | 銀行 |
| SABRE CORP | 98 | 139 | 312 | 34,269 | ソフトウェア・サービス |
| SALESFORCE.COM, INC. | 292 | 431 | 7,028 | 770,854 | ソフトウェア・サービス |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC | — | 44 | 504 | 55,286 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCANA CORP | 64 | — | — | — | 公益事業 |
| HENRY SCHEIN INC | 60 | 75 | 520 | 57,123 | ヘルスケア機器・サービス |
| SCHLUMBERGER LTD | 575 | 736 | 2,666 | 292,516 | エネルギー |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 504 | 609 | 3,015 | 330,771 | 各種金融 |
| SEALED AIR CORP | 58 | 78 | 297 | 32,671 | 素材 |
| SEATTLE GENETICS INC | 42 | 57 | 689 | 75,583 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEMPRA ENERGY | 104 | 139 | 2,048 | 224,730 | 公益事業 |
| SERVICENOW INC | 73 | 99 | 2,824 | 309,755 | ソフトウェア・サービス |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 34 | 44 | 2,582 | 283,268 | 素材 |
| SIGNATURE BANK | 25 | 25 | 309 | 33,933 | 銀行 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 682 | 817 | 570 | 62,598 | メディア・娯楽 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 79 | 87 | 860 | 94,413 | 半導体・半導体製造装置 |
| SMITH(A. O.) CORP | 59 | 71 | 346 | 37,993 | 資本財 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW COM | 49 | 57 | 606 | 66,483 | 食品・飲料・タバコ |
| SNAP-ON INC | 24 | 32 | 516 | 56,687 | 資本財 |
| SNAP INC-A | — | 351 | 535 | 58,712 | メディア・娯楽 |
| SOUTHERN CO | 420 | 544 | 3,376 | 370,344 | 公益事業 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 55 | 63 | 364 | 39,929 | 運輸 |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A | 51 | 51 | 446 | 49,012 | 資本財 |
| SPLUNK INC | 62 | 76 | 1,136 | 124,614 | ソフトウェア・サービス |
| SPRINT CORP | 367 | 367 | 217 | 23,855 | 電気通信サービス |
| SQUARE INC-A | 123 | 170 | 1,178 | 129,265 | ソフトウェア・サービス |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 67 | 76 | 1,212 | 132,940 | 資本財 |
| STARBUCKS CORP | 573 | 629 | 5,379 | 590,026 | 消費者サービス |
| STATE STREET CORP | 148 | 189 | 1,421 | 155,859 | 各種金融 |
| STEEL DYNAMICS, INC. | 101 | 101 | 343 | 37,701 | 素材 |
| STERICYCLE, INC. | 42 | — | — | — | 商業・専門サービス |
| STRYKER CORP | 139 | 175 | 3,600 | 394,915 | ヘルスケア機器・サービス |
| SUNTRUST BANKS INC | 193 | 225 | 1,594 | 174,857 | 銀行 |
| SYMANTEC CORPORATION | 272 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| SYNOPTIS INC | 61 | 76 | 1,072 | 117,581 | ソフトウェア・サービス |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 306 | 314 | 1,176 | 129,076 | 各種金融 |
| SYSCO CORP | 201 | 261 | 2,106 | 231,089 | 食品・生活必需品小売り |
| TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION | 117 | 140 | 727 | 79,745 | 各種金融 |
| TJX COMPANIES INC | 521 | 625 | 3,822 | 419,240 | 小売 |
| T-MOBILE US INC | 140 | 173 | 1,361 | 149,287 | 電気通信サービス |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 48 | 57 | 692 | 75,958 | メディア・娯楽 |
| TAPESTRY INC | 119 | 147 | 395 | 43,390 | 耐久消費財・アパレル |
| TARGET CORP | 210 | 270 | 3,385 | 371,310 | 小売 |
| TARGA RESOURCES CORP | 86 | 117 | 430 | 47,229 | エネルギー |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | — | 20 | 707 | 77,644 | 資本財 |
| TELEFLEX INC | 19 | 23 | 826 | 90,685 | 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 | 評価金額 | 価額 | |
| | | | 外貨 | 邦貨換算金額 | |
| TERADYNE INC | — | 98 | 616 | 67,564 | 半導体・半導体製造装置 |
| TESLA INC | 54 | 71 | 2,366 | 259,575 | 自動車・自動車部品 |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR | 387 | 569 | 593 | 65,107 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 406 | 486 | 5,853 | 642,052 | 半導体・半導体製造装置 |
| TEXTRON INC | 106 | 118 | 545 | 59,860 | 資本財 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 167 | 207 | 6,522 | 715,401 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 3M COMPANY | 246 | 300 | 5,093 | 558,704 | 資本財 |
| TIFFANY & CO | 46 | 55 | 741 | 81,315 | 小売 |
| TOLL BROTHERS INC | 70 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| TORCHMARK CORPORATION | 46 | — | — | — | 保険 |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 71 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 52 | 61 | 577 | 63,360 | 小売 |
| TRANSNIGM GROUP INC | 20 | 24 | 1,376 | 150,958 | 資本財 |
| TRANSUNION | 75 | 94 | 819 | 89,903 | 商業・専門サービス |
| TRAVELERS COS INC(THE) | 112 | 132 | 1,815 | 199,154 | 保険 |
| TRIMBLE INC | 103 | 127 | 517 | 56,717 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TRIPADVISOR INC-W/I | 40 | 40 | 115 | 12,618 | メディア・娯楽 |
| TWENTY-FIRST CE CL-A | 437 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| TWENTY-FIRST CE CL-B | 175 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| TWILIO INC-A | — | 56 | 583 | 63,990 | ソフトウェア・サービス |
| TWITTER INC | 295 | 370 | 1,144 | 125,525 | メディア・娯楽 |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | — | 22 | 645 | 70,748 | ソフトウェア・サービス |
| TYSON FOODS INC-CL A | 126 | 149 | 1,343 | 147,384 | 食品・飲料・タバコ |
| UGI CORPORATION | 74 | 105 | 461 | 50,574 | 公益事業 |
| US BANCORP | 648 | 788 | 4,734 | 519,333 | 銀行 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | — | 93 | 277 | 30,468 | 運輸 |
| ULTA BEAUTY INC | 23 | 30 | 715 | 78,513 | 小売 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 86 | 86 | 163 | 17,888 | 耐久消費財・アパレル |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 82 | 82 | 143 | 15,731 | 耐久消費財・アパレル |
| UNION PACIFIC CORP | 322 | 367 | 6,469 | 709,620 | 運輸 |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 28 | 28 | 267 | 29,313 | 運輸 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 286 | 363 | 4,355 | 477,702 | 運輸 |
| UNITED RENTALS INC | 36 | 42 | 647 | 71,057 | 資本財 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 341 | 425 | 6,313 | 692,464 | 資本財 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 18 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 398 | 491 | 13,747 | 1,507,825 | ヘルスケア機器・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 37 | 42 | 586 | 64,302 | ヘルスケア機器・サービス |
| UNUM GROUP | 97 | 97 | 300 | 32,936 | 保険 |
| VF CORP | 135 | 171 | 1,515 | 166,224 | 耐久消費財・アパレル |
| VAIL RESORTS INC | 16 | 20 | 494 | 54,243 | 消費者サービス |
| VALERO ENERGY CORP | 179 | 211 | 2,020 | 221,584 | エネルギー |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 41 | 51 | 694 | 76,197 | ヘルスケア機器・サービス |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 50 | 64 | 966 | 106,042 | ヘルスケア機器・サービス |
| VERISIGN INC | 43 | 54 | 1,037 | 113,785 | ソフトウェア・サービス |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 1,711 | 2,163 | 13,031 | 1,429,259 | 電気通信サービス |
| VERISK ANALYTICS INC | 62 | 78 | 1,162 | 127,528 | 商業・専門サービス |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 105 | 131 | 2,926 | 320,947 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VIACOM INC-CLASS B | 146 | 202 | 488 | 53,525 | メディア・娯楽 |
| VISA INC | 740 | 902 | 16,649 | 1,826,111 | ソフトウェア・サービス |
| VISTRA ENERGY CORP | 138 | 183 | 486 | 53,406 | 公益事業 |
| VMWARE INC | 30 | 41 | 652 | 71,584 | ソフトウェア・サービス |
| VOYA FINANCIAL INC | 75 | 73 | 425 | 46,713 | 各種金融 |
| VULCAN MATERIALS CO | 54 | 66 | 950 | 104,222 | 素材 |
| WABCO HOLDINGS INC | 21 | 25 | 350 | 38,396 | 資本財 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 131 | 159 | 1,417 | 155,521 | 公益事業 |
| WABTEC CORP | 34 | 92 | 725 | 79,548 | 資本財 |
| WALMART INC | 613 | 742 | 8,838 | 969,406 | 食品・生活必需品小売り |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 350 | 394 | 2,348 | 257,600 | 食品・生活必需品小売り |
| WASTE CONNECTIONS INC | 109 | 133 | 1,210 | 132,794 | 商業・専門サービス |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 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 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 176 | 226 | 2,556 | 280,360 | 商業・専門サービス |
| WATERS CORP | 34 | 35 | 782 | 85,808 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WAYFAIR INC-CLASS A | — | 28 | 245 | 26,889 | 小売 |
| WELLCARE HEALTH PLANS INC | — | 25 | 821 | 90,113 | ヘルスケア機器・サービス |
| WELLS FARGO & COMPANY | 1,923 | 2,190 | 11,927 | 1,308,226 | 銀行 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | — | 42 | 626 | 68,697 | ヘルスケア機器・サービス |
| WESTERN DIGITAL CORP | 129 | 148 | 747 | 82,013 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WESTERN UNION COMPANY | 190 | 218 | 587 | 64,388 | ソフトウェア・サービス |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 14 | 14 | 101 | 11,110 | 素材 |
| WESTROCK CO | 113 | 130 | 525 | 57,654 | 素材 |
| WHIRLPOOL CORP | 26 | 32 | 459 | 50,413 | 耐久消費財・アパレル |
| WILLIAMS COS INC | 502 | 614 | 1,396 | 153,116 | エネルギー |
| WORKDAY INC-CLASS A | 60 | 88 | 1,593 | 174,730 | ソフトウェア・サービス |
| WORLDPAY INC-CL A | 123 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| WYNN RESORTS LTD | 42 | 49 | 593 | 65,120 | 消費者サービス |
| XPO LOGISTICS INC | 49 | 47 | 389 | 42,771 | 運輸 |
| XCEL ENERGY INC | 205 | 260 | 1,604 | 176,010 | 公益事業 |
| XILINX INC | 110 | 128 | 1,194 | 131,027 | 半導体・半導体製造装置 |
| XEROX CORP | 96 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| XYLEM INC | 79 | 91 | 707 | 77,565 | 資本財 |
| XEROX HOLDINGS CORP | — | 96 | 377 | 41,404 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| YUM! BRANDS INC | 134 | 155 | 1,561 | 171,308 | 消費者サービス |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC | 92 | 119 | 409 | 44,862 | 電気通信サービス |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | — | 27 | 686 | 75,330 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ZILLOW GROUP INC-C | 53 | 53 | 208 | 22,843 | メディア・娯楽 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 82 | 103 | 1,508 | 165,477 | ヘルスケア機器・サービス |
| ZIONS BANCORPORATION | 88 | 88 | 441 | 48,450 | 銀行 |
| ZOETIS INC | 201 | 253 | 3,057 | 335,396 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALKERMES PLC | 64 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALLEGION PLC | 39 | 47 | 571 | 62,717 | 資本財 |
| ALLERGAN PLC | 140 | 174 | 3,219 | 353,168 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMCOR PLC | — | 823 | 844 | 92,615 | 素材 |
| AON PLC | 101 | 121 | 2,483 | 272,360 | 保険 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD. | 178 | 204 | 859 | 94,256 | 保険 |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A | 60 | 81 | 369 | 40,484 | 保険 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 39 | — | — | — | 保険 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 107 | 125 | 358 | 39,313 | 素材 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 267 | 331 | 6,661 | 730,667 | ソフトウェア・サービス |
| BUNGE LIMITED | 59 | 71 | 382 | 42,001 | 食品・飲料・タバコ |
| CAPRI HOLDINGS LTD | — | 62 | 231 | 25,373 | 耐久消費財・アパレル |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC | 93 | 125 | 634 | 69,595 | 食品・飲料・タバコ |
| EATON CORP PLC | 181 | 214 | 1,984 | 217,659 | 資本財 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 16 | 20 | 560 | 61,437 | 保険 |
| IHS MARKIT LTD | 162 | 192 | 1,399 | 153,444 | 商業・専門サービス |
| INGERSOLL-RAND PLC | 103 | 122 | 1,603 | 175,840 | 資本財 |
| INVECO LIMITED | 183 | 183 | 321 | 35,299 | 各種金融 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 26 | 26 | 393 | 43,160 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 395 | 403 | 1,728 | 189,585 | 資本財 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 84 | 84 | 190 | 20,854 | メディア・娯楽 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 235 | 210 | 453 | 49,706 | メディア・娯楽 |
| LINDE PLC | 225 | 279 | 5,755 | 631,311 | 素材 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 268 | 317 | 837 | 91,829 | 半導体・半導体製造装置 |
| MEDTRONIC PLC | 562 | 703 | 7,841 | 860,021 | ヘルスケア機器・サービス |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED | 62 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| APTIV PLC | 105 | 130 | 1,227 | 134,619 | 自動車・自動車部品 |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 151 | 180 | 352 | 38,652 | 商業・専門サービス |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS | 91 | 109 | 585 | 64,256 | 消費者サービス |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD | 15 | 22 | 421 | 46,248 | 保険 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 113 | 126 | 753 | 82,698 | 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 | 金額 | 株数 | 金額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| PENTAIR PLC-REGISTERED | 70 | — | 99 | 441 | 資本財 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 71 | — | 95 | 489 | 資本財 | |
| STERIS PLC | — | — | 42 | 647 | ヘルスケア機器・サービス | |
| TECHNIPFMC PLC | 181 | — | 215 | 406 | エネルギー | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 54 | — | 65 | 1,287 | 保険 | |
| PERRIGO CO PLC | 55 | — | 77 | 396 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| CHUBB LTD | 191 | — | 239 | 3,624 | 保険 | |
| GARMIN LTD | 49 | — | 67 | 658 | 耐久消費財・アパレル | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 145 | — | 170 | 1,583 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 52 | — | 65 | 777 | ソフトウェア・サービス | |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | — | — | 23 | 283 | ソフトウェア・サービス | |
| WIX.COM LTD | — | — | 24 | 292 | ソフトウェア・サービス | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 48 | — | 70 | 438 | 資本財 | |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 135 | — | 142 | 1,317 | 素材 | |
| MYLAN NV | 225 | — | 261 | 490 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 142 | — | 149 | 1,732 | 半導体・半導体製造装置 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 67 | — | 90 | 1,084 | 消費者サービス | |
| FLEX LTD | 232 | — | 232 | 275 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 127,595 595 | 156,142 614 | 1,396,454 — | 153,163,129 <65.9%> |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| ARC RESOURCES LTD | 170 | — | — | — | エネルギー | |
| AGNICO EAGLE MINES LIMITED | 96 | — | 119 | 939 | 素材 | |
| AIR CANADA | — | — | 57 | 287 | 運輸 | |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES | — | — | 302 | 563 | 公益事業 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B | 183 | — | 462 | 2,009 | 食品・生活必需品小売り | |
| ALTAGAS LTD | 97 | — | 173 | 341 | 公益事業 | |
| ATCO LTD-CLASS I | 30 | — | 30 | 152 | 公益事業 | |
| AURORA CANNABIS INC | 285 | — | 285 | 94 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| BCE INC | 69 | — | 83 | 535 | 電気通信サービス | |
| BANK OF MONTREAL | 262 | — | 336 | 3,440 | 銀行 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 492 | — | 629 | 4,719 | 銀行 | |
| BARRICK GOLD CORP | 502 | — | 932 | 2,068 | 素材 | |
| BAUSCH HEALTH COS INC | 118 | — | 190 | 714 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| BLACKBERRY LIMITED | 180 | — | 259 | 190 | ソフトウェア・サービス | |
| BOMBARDIER INC 'B' | 758 | — | 758 | 149 | 資本財 | |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC | 343 | — | 464 | 3,567 | 各種金融 | |
| CAE INC | 139 | — | 128 | 460 | 資本財 | |
| CCL INDUSTRIES INC-CL B | 53 | — | 91 | 521 | 素材 | |
| CGI INC-CL A | — | — | 124 | 1,369 | ソフトウェア・サービス | |
| CI FINANCIAL CORP | 110 | — | 110 | 230 | 各種金融 | |
| CAMECO CORP | 163 | — | 163 | 198 | エネルギー | |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 191 | — | 225 | 2,603 | 銀行 | |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 302 | — | 372 | 4,489 | 運輸 | |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 499 | — | 628 | 2,332 | エネルギー | |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 59 | — | 70 | 2,230 | 運輸 | |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 24 | — | 35 | 547 | 小売 | |
| CANADIAN UTILITIES LIMITED | 39 | — | 73 | 286 | 公益事業 | |
| CANOPY GROWTH CORP | 83 | — | 112 | 275 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| CENOVUS ENERGY INC | 414 | — | 540 | 634 | エネルギー | |
| CONSTELLATION SOFTWARE | 8 | — | 11 | 1,570 | ソフトウェア・サービス | |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 225 | — | — | — | エネルギー | |
| CRONOS GROUP INC | — | — | 80 | 72 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| DOLLARAMA INC | 119 | — | 145 | 706 | 小売 | |
| EMERA INC | 24 | — | 134 | 732 | 公益事業 | |
| EMPIRE CO LTD A | 72 | — | 72 | 257 | 食品・生活必需品小売り | |
| ENCANA CORP | 418 | — | 663 | 345 | エネルギー | |
| ENBRIDGE INC | 701 | — | 1,042 | 5,243 | エネルギー | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 11 | — | 13 | 835 | 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 | 評価金額 | 価額 | |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 61 | — | — | — | 資本財 |
| FIRST CAPITAL REALTY INC | 65 | 65 | 141 | 11,671 | 不動産 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 316 | 316 | 384 | 31,793 | 素材 |
| FORTIS INC | 179 | 219 | 1,139 | 94,181 | 公益事業 |
| FRANCO-NEVADA CORPORATION | 80 | 94 | 1,240 | 102,486 | 素材 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 90 | 90 | 353 | 29,212 | 耐久消費財・アパレル |
| GOLDCORP INC | 333 | — | — | — | 素材 |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 142 | 142 | 474 | 39,243 | 保険 |
| CGI GROUP INC - CL A | 101 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| HUSKY ENERGY INC | 145 | 145 | 140 | 11,626 | エネルギー |
| HYDRO ONE LTD | 150 | 150 | 376 | 31,114 | 公益事業 |
| IGM FINANCIAL INC | 30 | 64 | 245 | 20,303 | 各種金融 |
| IA FINANCIAL CORP INC | — | 48 | 329 | 27,253 | 保険 |
| IMPERIAL OIL LTD | 129 | 129 | 432 | 35,720 | エネルギー |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC | 48 | — | — | — | 保険 |
| INTACT FINANCIAL CORPORATION | 62 | 70 | 966 | 79,871 | 保険 |
| INTER PIPELINE LTD | 180 | 252 | 555 | 45,891 | エネルギー |
| KEYERA CORP | 84 | 113 | 368 | 30,456 | エネルギー |
| KINROSS GOLD CORP | 570 | 635 | 364 | 30,114 | 素材 |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD | — | 113 | 632 | 52,219 | 素材 |
| LINAMAR CORP | 22 | — | — | — | 自動車・自動車部品 |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 85 | 85 | 611 | 50,513 | 食品・生活必需品小売り |
| LUNDIN MINING CORP | 282 | 282 | 202 | 16,757 | 素材 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 146 | 166 | 1,216 | 100,492 | 自動車・自動車部品 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 804 | 998 | 2,608 | 215,478 | 保険 |
| METHANEX CORPORATION | 24 | 24 | 121 | 10,013 | 素材 |
| METRO INC | 91 | 142 | 829 | 68,492 | 食品・生活必需品小売り |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 147 | 169 | 1,209 | 99,891 | 銀行 |
| NUTRIEN LTD | 262 | 300 | 1,883 | 155,625 | 素材 |
| ONEX CORPORATION | 42 | 42 | 333 | 27,559 | 各種金融 |
| OPEN TEXT CORPORATION | 116 | 136 | 790 | 65,290 | ソフトウェア・サービス |
| PARKLAND FUEL CORP | — | 76 | 361 | 29,907 | エネルギー |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 217 | 274 | 1,271 | 105,036 | エネルギー |
| POWER CORP OF CANADA | 145 | 145 | 470 | 38,876 | 保険 |
| POWER FINANCIAL CORP | 110 | 162 | 526 | 43,475 | 保険 |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 90 | 90 | 123 | 10,230 | エネルギー |
| QUEBECOR INC -CL B | — | 99 | 327 | 27,087 | メディア・娯楽 |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 91 | 130 | 1,137 | 93,985 | 消費者サービス |
| ROGERS COMMUNICATIONS -CL B | 145 | 183 | 1,180 | 97,521 | 電気通信サービス |
| ROYAL BANK OF CANADA | 595 | 753 | 8,197 | 677,248 | 銀行 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 82 | — | — | — | 資本財 |
| SAPUTO INC | 98 | 134 | 539 | 44,533 | 食品・飲料・タバコ |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY-A | 85 | — | — | — | エネルギー |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 193 | 265 | 728 | 60,172 | メディア・娯楽 |
| SHOPIFY INC-CLASS A | 38 | 51 | 2,306 | 190,529 | ソフトウェア・サービス |
| STARS GROUP INC/THE | — | 145 | 463 | 38,329 | 消費者サービス |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 258 | 300 | 1,823 | 150,673 | 保険 |
| SUNCOR ENERGY INC | 678 | 814 | 3,375 | 278,901 | エネルギー |
| TC ENERGY CORP | — | 481 | 3,233 | 267,143 | エネルギー |
| TECK RESOURCES LIMITED-CL B | 198 | 248 | 516 | 42,642 | 素材 |
| TELUS CORPORATION | 76 | 76 | 381 | 31,535 | 電気通信サービス |
| THOMSON REUTERS CORP | — | 110 | 1,021 | 84,426 | 商業・専門サービス |
| THOMSON REUTERS CORP-NEW | 78 | — | — | — | 各種金融 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 761 | 950 | 7,278 | 601,362 | 銀行 |
| TOURMALINE OIL CORP | 128 | — | — | — | エネルギー |
| TRANSCANADA CORP | 363 | — | — | — | エネルギー |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 451 | — | — | — | 素材 |
| VERMILION ENERGY INC | 55 | — | — | — | エネルギー |
| WSP GLOBAL INC | 45 | 63 | 548 | 45,281 | 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 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 28 | 28 | 165 | 13,712 | 素材 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 31 | 42 | 462 | 38,213 | 食品・生活必需品小売り |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 195 | 246 | 901 | 74,470 | 素材 |
| 小計 | 17,304 | 20,806 | 101,017 | 8,346,043 | |
| (ユーロ・・・ドイツ) | 89 | 86 | — | <3.6%> | |
| ADIDAS AG | 76 | 94 | 千ユーロ 2,675 | 323,380 | 耐久消費財・アパレル |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 168 | 211 | 1,050 | 126,961 | ヘルスケア機器・サービス |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 59 | 68 | 210 | 25,498 | 電気通信サービス |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF | 33 | 33 | 132 | 15,966 | 素材 |
| HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE | 23 | 30 | 515 | 62,275 | 保険 |
| GEA GROUP AG | 81 | 81 | 238 | 28,831 | 資本財 |
| CONTINENTAL AG | 46 | 55 | 661 | 79,955 | 自動車・自動車部品 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 413 | 519 | 1,756 | 212,343 | 運輸 |
| AXEL SPRINGER SE | 16 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| MERCK KGAA | 57 | 65 | 694 | 83,951 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RWE AG | 228 | 296 | 796 | 96,298 | 公益事業 |
| SAP SE | 405 | 509 | 6,295 | 760,934 | ソフトウェア・サービス |
| E.ON SE | 883 | 1,158 | 1,100 | 133,018 | 公益事業 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 46 | 57 | 504 | 60,931 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PUMA SE | 2 | 38 | 261 | 31,569 | 耐久消費財・アパレル |
| BAYER AG | 384 | 480 | 3,303 | 399,212 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HENKEL AG & CO KGAA | 71 | 90 | 867 | 104,790 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| BASF SE | 380 | 481 | 3,285 | 397,082 | 素材 |
| BEIERSDORF AG | 40 | 56 | 592 | 71,640 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HOCHTIEF AG | 8 | 8 | 91 | 11,117 | 資本財 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 65 | 83 | 560 | 67,716 | 素材 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA | 91 | 109 | 727 | 87,909 | ヘルスケア機器・サービス |
| ALLIANZ SE-REG | 181 | 220 | 4,795 | 579,544 | 保険 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 92 | 92 | 159 | 19,271 | 運輸 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 60 | 76 | 2,004 | 242,299 | 保険 |
| VOLKSWAGEN AG | 12 | 19 | 343 | 41,518 | 自動車・自動車部品 |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 75 | 94 | 1,651 | 199,572 | 自動車・自動車部品 |
| DAIMLER AG | 372 | 484 | 2,478 | 299,544 | 自動車・自動車部品 |
| THYSSENKRUPP AG | 193 | 193 | 220 | 26,637 | 素材 |
| SIEMENS AG-REG | 315 | 402 | 4,719 | 570,423 | 資本財 |
| 1&1 DRILLISCH AG | 21 | — | — | — | 電気通信サービス |
| DEUTSCHE BANK AG -REG | 789 | 995 | 651 | 78,742 | 各種金融 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 140 | 167 | 1,230 | 148,734 | 自動車・自動車部品 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE (BMW)AG-PFD | 25 | 25 | 140 | 16,974 | 自動車・自動車部品 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 1,366 | 1,734 | 2,643 | 319,470 | 電気通信サービス |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 13 | 18 | 345 | 41,709 | ヘルスケア機器・サービス |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 484 | 655 | 1,271 | 153,629 | 半導体・半導体製造装置 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | — | 22 | 251 | 30,439 | ヘルスケア機器・サービス |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 82 | 96 | 1,341 | 162,137 | 各種金融 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF | 66 | 77 | 521 | 63,046 | 自動車・自動車部品 |
| FRAPORT AG | 18 | 18 | 143 | 17,344 | 運輸 |
| WIRECARD AG | 48 | 59 | 713 | 86,179 | ソフトウェア・サービス |
| LANXESS | 31 | 44 | 266 | 32,238 | 素材 |
| MTU AERO ENGINES AG | 20 | 28 | 702 | 84,878 | 資本財 |
| DEUTSCHE WOHNEN SE | 142 | 181 | 643 | 77,737 | 不動産 |
| SYMRISE AG | 49 | 65 | 574 | 69,418 | 素材 |
| BRENTAG AG | 66 | 91 | 444 | 53,663 | 資本財 |
| K+S AG | 96 | — | — | — | 素材 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 64 | 118 | 311 | 37,679 | 素材 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 403 | 403 | 111 | 13,528 | 電気通信サービス |
| HUGO BOSS AG | 22 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| COMMERZBANK AG | 466 | 466 | 245 | 29,658 | 銀行 |
| OSRAM LICHT AG | 45 | — | — | — | 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 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| KION GROUP AG | 31 | 31 | 191 | 23,137 | 資本財 |
| VONOVIA SE | 200 | 275 | 1,303 | 157,546 | 不動産 |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG | 108 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| KNORR-BREMSE AG | — | 21 | 188 | 22,811 | 資本財 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 65 | 87 | 383 | 46,344 | ヘルスケア機器・サービス |
| METRO AG | 83 | 83 | 122 | 14,748 | 食品・生活必需品小売り |
| INNOGY SE | 58 | — | — | — | 公益事業 |
| AXEL SPRINGER SE-TEND | — | 23 | 146 | 17,698 | メディア・娯楽 |
| ZALANDO SE | 53 | 82 | 323 | 39,147 | 小売 |
| COVESTRO AG | 80 | 80 | 342 | 41,364 | 素材 |
| SCHAEFFLER AG | 95 | — | — | — | 自動車・自動車部品 |
| UNIPER SE | 89 | 123 | 362 | 43,762 | 公益事業 |
| DELIVERY HERO SE | 34 | 53 | 256 | 30,944 | 小売 |
| 小計 | 10,261 | 12,251 | 58,869 | 7,114,915 | |
| | 株数 | 株数 | 金額 | 金額 | |
| | 63 | 58 | — | <3.1%> | |
| (ユーロ・・・イタリア) | | | | | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 469 | 586 | 1,086 | 131,312 | 保険 |
| INTESA SANPAOLO | 6,179 | 7,792 | 1,792 | 216,664 | 銀行 |
| MEDIOBANCA SPA | 267 | 267 | 271 | 32,854 | 銀行 |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 72 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| ENEL SPA | 3,320 | 4,202 | 2,880 | 348,196 | 公益事業 |
| ENI SPA | 1,057 | 1,304 | 1,789 | 216,265 | エネルギー |
| SNAM SPA | 999 | 896 | 404 | 48,873 | 公益事業 |
| TELECOM ITALIA SPA | 4,940 | 4,919 | 279 | 33,785 | 電気通信サービス |
| TELECOM ITALIA-RNC | 2,513 | 2,513 | 140 | 16,983 | 電気通信サービス |
| ATLANTIA SPA | 198 | 265 | 533 | 64,442 | 運輸 |
| TERNA SPA | 663 | 804 | 469 | 56,708 | 公益事業 |
| RECORDATI SPA | 45 | 45 | 174 | 21,064 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LEONARDO SPA | 183 | 183 | 194 | 23,490 | 資本財 |
| PRYSMIAN SPA | 93 | 119 | 246 | 29,822 | 資本財 |
| MONCLER SPA | 77 | 77 | 306 | 37,063 | 耐久消費財・アパレル |
| FINECOBANK SPA | — | 320 | 360 | 43,594 | 銀行 |
| UNICREDIT SPA | 812 | 1,068 | 1,342 | 162,277 | 銀行 |
| POSTE ITALIANE SPA | 265 | 265 | 281 | 33,996 | 保険 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA | 229 | 361 | 299 | 36,195 | 食品・飲料・タバコ |
| PIRELLI & C SPA | 174 | 174 | 90 | 10,882 | 自動車・自動車部品 |
| 小計 | 22,565 | 26,169 | 12,944 | 1,564,475 | |
| | 株数 | 株数 | 金額 | 金額 | |
| | 19 | 19 | — | <0.7%> | |
| (ユーロ・・・フランス) | | | | | |
| BOUYGUES SA | 83 | 110 | 409 | 49,515 | 資本財 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 215 | 290 | 675 | 81,682 | 公益事業 |
| L'OREAL | 103 | 129 | 3,351 | 405,119 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 114 | 146 | 5,951 | 719,245 | 耐久消費財・アパレル |
| DASSAULT AVIATION SA | 0.89 | 1 | 212 | 25,673 | 資本財 |
| THALES SA | 45 | 54 | 480 | 58,065 | 資本財 |
| CAPGEMINI SA | 65 | 80 | 865 | 104,560 | ソフトウェア・サービス |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 18 | 18 | 73 | 8,848 | 食品・生活必需品小売り |
| INGENICO S. A. | 26 | 26 | 260 | 31,502 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| PUBLICIS GROUPE | 91 | 107 | 428 | 51,824 | メディア・娯楽 |
| FAURECIA | 31 | 31 | 150 | 18,193 | 自動車・自動車部品 |
| BOLLORE | 394 | 394 | 153 | 18,491 | 運輸 |
| MICHELIN (CGDE)-B | 68 | 87 | 952 | 115,111 | 自動車・自動車部品 |
| PERNOD-RICARD SA | 86 | 110 | 1,848 | 223,454 | 食品・飲料・タバコ |
| RENAULT SA | 76 | 88 | 383 | 46,374 | 自動車・自動車部品 |
| REMY COINTREAU | 12 | 12 | 148 | 17,985 | 食品・飲料・タバコ |
| SEB SA | 10 | 10 | 145 | 17,586 | 耐久消費財・アパレル |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 233 | 285 | 2,502 | 302,427 | 資本財 |
| VIVENDI SA | 454 | 475 | 1,184 | 143,161 | メディア・娯楽 |
| ORANGE S. A. | 829 | 1,048 | 1,572 | 190,107 | 電気通信サービス |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 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 | |
| HERMES INTERNATIONAL | 13 | 16 | 1,149 | 138,892 | 耐久消費財・アパレル |
| BIC | 13 | — | — | — | 商業・専門サービス |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 55 | 66 | 953 | 115,208 | ソフトウェア・サービス |
| KERING | 30 | 39 | 2,179 | 263,437 | 耐久消費財・アパレル |
| CNP ASSURANCES | 89 | 89 | 160 | 19,444 | 保険 |
| CARREFOUR SA | 263 | 351 | 526 | 63,598 | 食品・生活必需品小売り |
| ATOS SE | 36 | 45 | 350 | 42,359 | ソフトウェア・サービス |
| SANOFI | 464 | 593 | 5,013 | 605,887 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ACCOR SA | 75 | 106 | 414 | 50,121 | 消費者サービス |
| SOCIETE GENERALE | 311 | 410 | 1,171 | 141,608 | 銀行 |
| TELEPERFORMANCE | 24 | 29 | 638 | 77,175 | 商業・専門サービス |
| EURAZEO | 21 | 17 | 110 | 13,395 | 各種金融 |
| SODEXO | 39 | 39 | 412 | 49,869 | 消費者サービス |
| AXA SA | 794 | 1,028 | 2,538 | 306,829 | 保険 |
| PSA PEUGEOT CITROEN | 261 | 321 | 704 | 85,165 | 自動車・自動車部品 |
| JC DECAUX SA | 28 | 28 | 73 | 8,886 | メディア・娯楽 |
| ESSILORLUXOTTICA | 88 | 147 | 2,083 | 251,869 | 耐久消費財・アパレル |
| CREDIT AGRICOLE SA | 495 | 581 | 721 | 87,237 | 銀行 |
| BNP PARIBAS | 461 | 577 | 2,942 | 355,673 | 銀行 |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 212 | 255 | 940 | 113,629 | 資本財 |
| WENDEL | 10 | 10 | 132 | 15,993 | 各種金融 |
| ILIAD SA | 10 | 10 | 117 | 14,188 | 電気通信サービス |
| IMERYS SA | 13 | — | — | — | 素材 |
| SAFRAN SA | 136 | 171 | 2,552 | 308,524 | 資本財 |
| ENGIE | 736 | 962 | 1,381 | 167,017 | 公益事業 |
| ALSTOM RGPT | 64 | 96 | 382 | 46,248 | 資本財 |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 87 | 87 | 129 | 15,703 | メディア・娯楽 |
| ELECTRICITE DE FRANCE (EDF) | 238 | 286 | 267 | 32,272 | 公益事業 |
| IPSEN | 14 | 14 | 153 | 18,557 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ARKEMA | 32 | 32 | 305 | 36,946 | 素材 |
| LEGRAND SA | 106 | 143 | 1,028 | 124,317 | 資本財 |
| EIFFAGE SA | 35 | 46 | 459 | 55,586 | 資本財 |
| TOTAL SA | 989 | 1,260 | 6,005 | 725,847 | エネルギー |
| AEROPORTS DE PARIS (ADP) | 13 | 13 | 238 | 28,875 | 運輸 |
| NATIXIS | 453 | 453 | 172 | 20,794 | 各種金融 |
| UBISOFT ENTERTAINMENT SA | 35 | 52 | 287 | 34,728 | メディア・娯楽 |
| SCOR SE | 71 | 95 | 373 | 45,148 | 保険 |
| REXEL SA | 128 | — | — | — | 資本財 |
| VINCI S. A. | 209 | 264 | 2,614 | 315,995 | 資本財 |
| DANONE | 251 | 319 | 2,389 | 288,764 | 食品・飲料・タバコ |
| AIR LIQUIDE SA | 175 | 244 | 3,003 | 362,976 | 素材 |
| BUREAU VERITAS SA | 126 | 172 | 409 | 49,492 | 商業・専門サービス |
| GETLINK | 169 | 223 | 341 | 41,283 | 運輸 |
| SUEZ | 177 | 145 | 195 | 23,602 | 公益事業 |
| EDENRED | 94 | 121 | 546 | 66,093 | 商業・専門サービス |
| VALEO SA | 99 | 140 | 502 | 60,714 | 自動車・自動車部品 |
| BIOMERIEUX | 17 | 17 | 145 | 17,641 | ヘルスケア機器・サービス |
| WORLDLINE SA | — | 62 | 365 | 44,222 | ソフトウェア・サービス |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | — | 15 | 224 | 27,081 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMUNDI SA | 23 | 39 | 271 | 32,838 | 各種金融 |
| 小計 | 11,269 | 13,762 | 69,838 | 8,440,680 | |
| 銘柄数 | 68 | 67 | — | <3.6%> | |
| (ユーロ・・・オランダ) | | | | | |
| AIRBUS SE | 239 | 300 | 4,005 | 484,084 | 資本財 |
| RANDSTAD NV | 46 | 46 | 248 | 29,988 | 商業・専門サービス |
| AKZO NOBEL | 108 | — | — | — | 素材 |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 128 | 149 | 972 | 117,530 | 商業・専門サービス |
| VOPAK | 31 | 31 | 151 | 18,305 | エネルギー |
| AEGON NV | 745 | 916 | 374 | 45,306 | 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 | 評価金額 | 価額 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 1,415 | 1,996 | 558 | 67,450 | 電気通信サービス |
| STMICROELECTRONICS NV | 280 | 376 | 839 | 101,411 | 半導体・半導体製造装置 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 390 | 469 | 1,979 | 239,223 | ヘルスケア機器・サービス |
| HEINEKEN NV | 104 | 131 | 1,235 | 149,379 | 食品・飲料・タバコ |
| HEINEKEN HOLDING NV | 52 | 65 | 567 | 68,556 | 食品・飲料・タバコ |
| KONINKLIJKE DSM NV | 73 | 92 | 1,069 | 129,315 | 素材 |
| UNILEVER NV-CVA | 635 | — | — | — | 家庭用品・パーソナル用品 |
| UNILEVER NV | — | 763 | 4,109 | 496,682 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| ASML HOLDING NV | 168 | 218 | 5,407 | 653,499 | 半導体・半導体製造装置 |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 504 | 600 | 1,403 | 169,643 | 食品・生活必需品小売り |
| FERRARI NV | 48 | 65 | 1,009 | 121,974 | 自動車・自動車部品 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 431 | 570 | 554 | 67,055 | 資本財 |
| AKZO NOBEL | — | 122 | 1,060 | 128,162 | 素材 |
| PROSUS NV | — | 254 | 1,576 | 190,574 | 小売 |
| NN GROUP NV | 129 | 159 | 554 | 67,043 | 保険 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 431 | 594 | 798 | 96,490 | 自動車・自動車部品 |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 189 | 189 | 293 | 35,413 | 銀行 |
| EXOR NV | 46 | 63 | 442 | 53,460 | 各種金融 |
| ALTICE NV -A W/I | — | 376 | 203 | 24,564 | メディア・娯楽 |
| QIAGEN N.V. | 100 | 138 | 536 | 64,827 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADYEN NV | — | 6 | 433 | 52,336 | ソフトウェア・サービス |
| ING GROEP NV-CVA | 1,592 | 2,031 | 2,121 | 256,401 | 銀行 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 7,897 23 | 10,729 26 | 32,506 — | 3,928,681 <1.7%> |
| (ユーロ・・・スペイン) | | | | | |
| ENDESA S.A. | 129 | 183 | 452 | 54,693 | 公益事業 |
| BANKINTER, S.A. | 269 | 364 | 231 | 27,930 | 銀行 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 2,770 | 3,430 | 1,640 | 198,218 | 銀行 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 161 | 154 | 364 | 44,036 | 公益事業 |
| REPSOL SA | 565 | 736 | 1,052 | 127,255 | エネルギー |
| BANCO SANTANDER SA | 6,728 | 8,522 | 3,014 | 364,321 | 銀行 |
| TELEFONICA S.A. | 1,912 | 2,406 | 1,672 | 202,189 | 電気通信サービス |
| ENAGAS | 104 | 104 | 236 | 28,613 | 公益事業 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | 114 | 114 | 166 | 20,101 | 資本財 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 115 | 145 | 514 | 62,235 | 資本財 |
| FERROVIAL SA | 187 | 231 | 622 | 75,286 | 資本財 |
| MAPFRE SA | 463 | 463 | 118 | 14,340 | 保険 |
| BANCO DE SABADELL SA | 2,350 | 3,280 | 330 | 39,922 | 銀行 |
| CAIXABANK | 1,491 | 1,819 | 487 | 58,922 | 銀行 |
| IBERDROLA SA | 2,448 | 3,198 | 2,855 | 345,141 | 公益事業 |
| AMADEUS IT GROUP SA | 182 | 222 | 1,608 | 194,433 | ソフトウェア・サービス |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROU | 232 | — | — | — | 運輸 |
| FERROVIAL SA-RIGHTS | 187 | — | — | — | 資本財 |
| RED ELECTRICA CORPORATION SA | 183 | 207 | 367 | 44,422 | 公益事業 |
| FERROVIAL SA-RIGHTS | — | 231 | 9 | 1,174 | 資本財 |
| INDITEX | 450 | 556 | 1,573 | 190,223 | 小売 |
| AENA SME SA | 28 | 37 | 623 | 75,371 | 運輸 |
| CELLNEX TELECOM SA | — | 137 | 535 | 64,679 | 電気通信サービス |
| GRIFOLS S.A. | 119 | 170 | 529 | 63,983 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BANKIA SA | 483 | 820 | 144 | 17,432 | 銀行 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 21,683 23 | 27,539 23 | 19,153 — | 2,314,925 <1.0%> |
| (ユーロ・・・ベルギー) | | | | | |
| KBC GROUPE SA | 108 | 129 | 856 | 103,486 | 銀行 |
| SOLVAY SA | 28 | 37 | 390 | 47,235 | 素材 |
| UCB SA | 52 | 72 | 530 | 64,091 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COLRUYT NV | 31 | 24 | 116 | 14,041 | 食品・生活必需品小売り |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 33 | 47 | 435 | 52,628 | 各種金融 |
| PROXIMUS SA | 63 | 63 | 172 | 20,890 | 電気通信サービス |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|----------------------------------|-------------|------------|-------------|------------|------------------------|
| | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 | |
| GALAPAGOS NV | — | — | 23 | 414 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TELENET GROUP HOLDINGS NV | 21 | — | 21 | 89 | メディア・娯楽 |
| AGEAS | 72 | — | 87 | 477 | 保険 |
| UMICORE | 87 | — | 113 | 442 | 素材 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 313 | — | 392 | 2,818 | 食品・飲料・タバコ |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | |
| | 812 10 | 1,012 — | 1,012 11 | 6,744 — | 815,151 < 0.4% > |
| (ユーロ・・・オーストリア) | | | | | |
| OMV AG | 63 | — | 77 | 402 | エネルギー |
| VERBUND AG | — | — | 36 | 174 | 公益事業 |
| VOESTALPINE AG | 50 | — | 50 | 122 | 素材 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 120 | — | 169 | 551 | 銀行 |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 66 | — | 55 | 117 | 銀行 |
| ANDRITZ AG | 25 | — | 37 | 131 | 資本財 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | |
| | 326 5 | 427 — | 427 6 | 1,499 — | 181,269 < 0.1% > |
| (ユーロ・・・ルクセンブルク) | | | | | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 4 | — | 7 | 334 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TENARIS S. A. | 184 | — | 259 | 250 | エネルギー |
| SES | 138 | — | 176 | 213 | メディア・娯楽 |
| RTL GROUP | 16 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| AROUNDTOWN SA | — | — | 458 | 361 | 不動産 |
| ARCELORMITTAL | 265 | — | 359 | 558 | 素材 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | |
| | 609 5 | 1,262 — | 1,262 5 | 1,718 — | 207,663 < 0.1% > |
| (ユーロ・・・フィンランド) | | | | | |
| WARTSILA OYJ-B SHARES | 189 | — | 189 | 172 | 資本財 |
| UPM-KYMMENE OYJ | 213 | — | 290 | 882 | 素材 |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 247 | — | 247 | 301 | 素材 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 177 | — | 236 | 867 | 保険 |
| FORTUM OYJ | 170 | — | 244 | 522 | 公益事業 |
| ELISA OYJ | 59 | — | 83 | 404 | 電気通信サービス |
| METSO OYJ | 39 | — | 58 | 204 | 資本財 |
| NOKIA OYJ | 2,340 | — | 2,857 | 917 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| NESTE OYJ | 56 | — | 227 | 698 | エネルギー |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 55 | — | 55 | 135 | 自動車・自動車部品 |
| KONE OYJ-B | 146 | — | 182 | 1,037 | 資本財 |
| ORION OYJ | 42 | — | 42 | 168 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | |
| | 3,737 12 | 4,715 — | 4,715 12 | 6,312 — | 762,978 < 0.3% > |
| (ユーロ・・・アイルランド) | | | | | |
| CRH PLC | 349 | — | 406 | 1,412 | 素材 |
| KERRY GROUP PLC-A | 68 | — | 83 | 972 | 食品・飲料・タバコ |
| KINGSPAN GROUP PLC | — | — | 76 | 373 | 資本財 |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 101 | — | 114 | 368 | 素材 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 376 | — | 521 | 237 | 銀行 |
| AIB GROUP PLC | 369 | — | 369 | 109 | 銀行 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 34 | — | 45 | 477 | 消費者サービス |
| RYANAIR HOLDINGS PLC | 16 | — | — | — | 運輸 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | |
| | 1,316 7 | 1,617 — | 1,617 7 | 3,952 — | 477,686 < 0.2% > |
| (ユーロ・・・ポルトガル) | | | | | |
| BANCO ESPIRITO SANTO, S. A (BES) | 1,879 | — | 1,879 | 1 | 銀行 |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 979 | — | 1,363 | 500 | 公益事業 |
| GALP ENERGIA SGPS S. A | 209 | — | 241 | 356 | 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 | 株数 | 評価額 | 評価額 | |
| | | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| JERONIMO MARTINS SGPS S. A. | | 122 | 123 | 179 | 21,682 | 食品・生活必需品小売り |
| 小計 | 株数 | 3,190 | 3,607 | 1,038 | 125,519 | |
| | 金額 | 4 | 4 | — | <0.1%> | |
| ユーロ計 | 株数 | 83,670 | 103,095 | 214,578 | 25,933,947 | |
| | 金額 | 239 | 238 | — | <11.2%> | |
| (イギリス) | | | | 千英ポンド | | |
| ANTOFAGASTA PLC | | 194 | 194 | 168 | 23,890 | 素材 |
| ASHTAD GROUP PLC | | 192 | 236 | 556 | 78,811 | 資本財 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | | 397 | 587 | 391 | 55,453 | 耐久消費財・アパレル |
| AVIVA PLC | | 1,608 | 1,986 | 801 | 113,548 | 保険 |
| DIAGEO PLC | | 1,022 | 1,219 | 3,858 | 546,282 | 食品・飲料・タバコ |
| SCHRODERS PLC | | 62 | 62 | 204 | 29,021 | 各種金融 |
| DCC PLC | | 37 | 47 | 312 | 44,292 | 資本財 |
| BAE SYSTEMS PLC | | 1,285 | 1,706 | 978 | 138,512 | 資本財 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | | 946 | 1,178 | 3,607 | 510,802 | 食品・飲料・タバコ |
| HALMA PLC | | — | 211 | 445 | 63,114 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| STANDARD CHARTERED PLC | | 1,224 | 1,415 | 987 | 139,800 | 銀行 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | | 389 | 496 | 845 | 119,755 | 食品・飲料・タバコ |
| HSBC HOLDINGS PLC | | 8,294 | 10,485 | 6,042 | 855,569 | 銀行 |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | | 2,492 | 3,022 | 849 | 120,217 | 保険 |
| MEGGITT PLC | | 369 | 369 | 237 | 33,649 | 資本財 |
| WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC | | 1,008 | 1,462 | 289 | 41,058 | 食品・生活必需品小売り |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | | 167 | 167 | 430 | 61,003 | 食品・飲料・タバコ |
| PEARSON PLC | | 296 | 396 | 256 | 36,275 | メディア・娯楽 |
| PERSIMMON PLC | | 139 | 169 | 432 | 61,267 | 耐久消費財・アパレル |
| PRUDENTIAL PLC | | 1,062 | 1,330 | 1,831 | 259,339 | 保険 |
| RIO TINTO PLC | | 487 | 586 | 2,465 | 349,087 | 素材 |
| ST JAMES'S PLACE PLC | | 218 | 319 | 347 | 49,266 | 各種金融 |
| TRAVIS PERKINS PLC | | 92 | — | — | — | 資本財 |
| SSE PLC | | 445 | 548 | 713 | 100,964 | 公益事業 |
| BP PLC | | 8,272 | 10,558 | 5,070 | 717,887 | エネルギー |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | | 29,961 | 36,841 | 2,252 | 318,982 | 銀行 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | | 1,296 | 1,476 | 257 | 36,440 | 耐久消費財・アパレル |
| TESCO PLC | | 4,269 | 5,160 | 1,183 | 167,629 | 食品・生活必需品小売り |
| SMITH & NEPHEW PLC | | 354 | 443 | 767 | 108,710 | ヘルスケア機器・サービス |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | | 2,045 | 2,589 | 4,542 | 643,106 | 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 | 167 | 233 | 33,017 | 資本財 |
| BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC | | 114 | — | — | — | 商業・専門サービス |
| ASTRAZENECA PLC | | 522 | 681 | 5,080 | 719,406 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BT GROUP PLC | | 3,652 | 4,542 | 870 | 123,205 | 電気通信サービス |
| CARNIVAL PLC | | 80 | 80 | 263 | 37,266 | 消費者サービス |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | | 713 | 1,247 | 242 | 34,328 | 小売 |
| BARCLAYS PLC | | 6,968 | 9,260 | 1,588 | 224,932 | 銀行 |
| INTERTEK GROUP PLC | | 67 | 81 | 451 | 63,917 | 商業・専門サービス |
| BURBERRY GROUP PLC | | 174 | 230 | 485 | 68,714 | 耐久消費財・アパレル |
| NEXT PLC | | 54 | 76 | 518 | 73,381 | 小売 |
| KINGFISHER PLC | | 799 | 1,096 | 230 | 32,596 | 小売 |
| ITV PLC | | 1,510 | 2,150 | 312 | 44,183 | メディア・娯楽 |
| SAINSBURY (J) PLC | | 641 | 1,128 | 241 | 34,230 | 食品・生活必需品小売り |
| RANDGOLD RESOURCES LTD | | 38 | — | — | — | 素材 |
| G4S PLC | | 742 | 742 | 155 | 21,994 | 商業・専門サービス |
| ADMIRAL GROUP PLC | | 78 | 121 | 259 | 36,690 | 保険 |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | | 53 | 53 | 244 | 34,648 | 耐久消費財・アパレル |
| CENTRICA PLC | | 2,549 | 2,549 | 204 | 28,954 | 公益事業 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | | 1,901 | 2,237 | 4,946 | 700,395 | エネルギー |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | | 1,547 | 1,944 | 4,257 | 602,835 | エネルギー |
| BUNZL PLC | | 134 | 170 | 362 | 51,293 | 資本財 |
| RENTOKIL INITIAL PLC | | — | 905 | 402 | 57,041 | 商業・専門サービス |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | | 129 | 159 | 1,096 | 155,223 | 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 | |
| UNILEVER PLC | 501 | 588 | 2,693 | 381,316 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| TUI AG-DI | 176 | 176 | 187 | 26,556 | 消費者サービス |
| INVESTEC PLC | 330 | — | — | — | 各種金融 |
| EXPERIAN PLC | 381 | 479 | 1,229 | 174,146 | 商業・専門サービス |
| MONDI PLC | 140 | 251 | 421 | 59,612 | 素材 |
| SEVERN TRENT PLC | 98 | 144 | 324 | 45,942 | 公益事業 |
| WHITBREAD PLC | 77 | 68 | 312 | 44,305 | 消費者サービス |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 110 | 144 | 267 | 37,902 | 各種金融 |
| SMITHS GROUP PLC | 187 | 235 | 390 | 55,338 | 資本財 |
| ANGLO AMERICAN PLC | 447 | 559 | 1,133 | 160,547 | 素材 |
| 3I GROUP PLC | 377 | 493 | 528 | 74,817 | 各種金融 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 274 | 366 | 2,221 | 314,523 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| RELX PLC | 806 | 1,029 | 1,928 | 273,111 | 商業・専門サービス |
| SHIRE PLC | 386 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FRESNILLO PLC | 85 | — | — | — | 素材 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 250 | 332 | 283 | 40,124 | 公益事業 |
| OCADO GROUP PLC | — | 221 | 293 | 41,605 | 小売 |
| GLENCORE PLC | 4,722 | 5,567 | 1,357 | 192,250 | 素材 |
| WOOD GROUP (JOHN) PLC | 326 | — | — | — | エネルギー |
| GVC HOLDINGS PLC | 238 | 238 | 203 | 28,748 | 消費者サービス |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 716 | 869 | 618 | 87,573 | 資本財 |
| EVRAZ PLC | — | 282 | 104 | 14,828 | 素材 |
| NMC HEALTH PLC | 37 | 68 | 171 | 24,274 | ヘルスケア機器・サービス |
| EASYJET PLC | 76 | 76 | 102 | 14,454 | 運輸 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 2,091 | 2,452 | 554 | 78,545 | 銀行 |
| SAGE GROUP PLC/THE | 409 | 620 | 467 | 66,213 | ソフトウェア・サービス |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | 198 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| WPP PLC | 545 | 639 | 640 | 90,644 | メディア・娯楽 |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 87 | 87 | 224 | 31,783 | 食品・飲料・タバコ |
| AVEVA GROUP PLC | — | 35 | 160 | 22,762 | ソフトウェア・サービス |
| CONVATEC GROUP PLC | 612 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| COMPASS GROUP PLC | 652 | 826 | 1,566 | 221,817 | 消費者サービス |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 76 | — | — | — | 消費者サービス |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL | 182 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| NATIONAL GRID PLC | 1,366 | 1,783 | 1,586 | 224,702 | 公益事業 |
| ROYAL MAIL PLC | 360 | — | — | — | 運輸 |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC | 325 | — | — | — | 消費者サービス |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 1,024 | 1,232 | 390 | 55,307 | 各種金融 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT | 32,972 | — | — | — | 資本財 |
| FERGUSON PLC | 99 | — | — | — | 資本財 |
| BHP GROUP PLC | 899 | 1,070 | 1,831 | 259,302 | 素材 |
| VODAFONE GROUP PLC | 10,933 | 13,673 | 2,097 | 296,920 | 電気通信サービス |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | — | 97 | 485 | 68,795 | 消費者サービス |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL | — | 151 | 171 | 24,237 | ソフトウェア・サービス |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | — | 74 | 372 | 52,756 | 素材 |
| FERGUSON PLC | — | 122 | 822 | 116,467 | 資本財 |
| M&G PLC | — | 1,330 | 314 | 44,463 | 各種金融 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 405 | 522 | 288 | 40,828 | 保険 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENTITLEMENT | — | 39,981 | 3 | 566 | 資本財 |
| INFORMA PLC | 546 | 690 | 546 | 77,428 | メディア・娯楽 |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 420 | 420 | 236 | 33,463 | メディア・娯楽 |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | — | 36 | 328 | 46,567 | 資本財 |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 632 | 632 | 193 | 27,367 | 保険 |
| JD SPORTS FASHION PLC | — | 288 | 219 | 31,080 | 小売 |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 62 | — | — | — | 素材 |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 2,125 | 2,463 | 565 | 80,085 | 資本財 |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 72 | 100 | 289 | 40,994 | 素材 |
| 小計 | 株数 | 株数 | 92,711 | 13,127,085 | |
| | 銘柄数 | 銘柄数 | — | <5.6%> | |
| | 金額 | 金額 | — | | |
| | <比率> | <比率> | — | | |

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 | |
| (スイス) | | | | | 千スイスフラン | | |
| SGS SA | | 2 | | 2 | 666 | 72,999 | 商業・専門サービス |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | | 1 | | 1 | 377 | 41,411 | 食品・飲料・タバコ |
| SWISSCOM AG-REG | | 10 | | 14 | 740 | 81,171 | 電気通信サービス |
| LINDT & SPRUENGLI AG | | 0.45 | | 0.49 | 373 | 40,945 | 食品・飲料・タバコ |
| LINDT & SPRUENGLI AG-REG | | 0.04 | | 0.05 | 426 | 46,740 | 食品・飲料・タバコ |
| GIVAUDAN-REG | | 3 | | 4 | 1,387 | 152,024 | 素材 |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | | 64 | | 77 | 3,047 | 333,963 | 保険 |
| NOVARTIS AG-REG SHS | | 900 | | 1,124 | 10,347 | 1,133,997 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ABB LTD | | 751 | | 964 | 2,108 | 231,119 | 資本財 |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | | 290 | | 363 | 11,197 | 1,227,102 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADECCO GROUP AG-REG | | 70 | | 70 | 433 | 47,552 | 商業・専門サービス |
| LAFARGEHOLCIM LTD | | 206 | | 257 | 1,329 | 145,742 | 素材 |
| CLARIANT AG-REG | | 101 | | 101 | 208 | 22,869 | 素材 |
| NESTLE SA-REGISTERED | | 1,290 | | 1,551 | 16,125 | 1,767,145 | 食品・飲料・タバコ |
| BALOISE HOLDING AG | | 19 | | 24 | 430 | 47,140 | 保険 |
| TEMENOS GROUP AG-REG | | 24 | | 36 | 553 | 60,680 | ソフトウェア・サービス |
| SONOVA HOLDING AG | | 26 | | 26 | 603 | 66,126 | ヘルスケア機器・サービス |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG | | 4 | | 5 | 576 | 63,149 | ヘルスケア機器・サービス |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | | 1,039 | | 1,296 | 1,698 | 186,140 | 各種金融 |
| THE SWATCH GROUP AG-B | | 13 | | 13 | 372 | 40,811 | 耐久消費財・アパレル |
| THE SWATCH GROUP AG-REG | | 25 | | 25 | 134 | 14,696 | 耐久消費財・アパレル |
| LONZA GROUP AG-REG | | 31 | | 37 | 1,282 | 140,530 | 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 | | 17 | 860 | 94,270 | 保険 |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | | 3 | | 5 | 325 | 35,700 | 素材 |
| SWISS PRIME SITE-REG | | 32 | | 39 | 412 | 45,202 | 不動産 |
| PARGESA HOLDING SA-BR | | 18 | | 18 | 147 | 16,143 | 各種金融 |
| DUFREY AG-REG | | 11 | | 22 | 220 | 24,189 | 小売 |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | | 6 | | 9 | 820 | 89,911 | 各種金融 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | | 17 | | 23 | 578 | 63,438 | 資本財 |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | | 7 | | 12 | 310 | 34,051 | 資本財 |
| KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG | | 23 | | 23 | 384 | 42,089 | 運輸 |
| GEBERIT AG-REG | | 15 | | 19 | 1,073 | 117,596 | 資本財 |
| JULIUS BAER GROUP LTD | | 95 | | 126 | 596 | 65,350 | 各種金融 |
| SWISS RE AG | | 132 | | 154 | 1,673 | 183,405 | 保険 |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A | | 212 | | 272 | 2,076 | 227,522 | 耐久消費財・アパレル |
| SIKA AG | | 52 | | 64 | 1,126 | 123,409 | 素材 |
| ALCON INC | | — | | 210 | 1,162 | 127,440 | ヘルスケア機器・サービス |
| UBS GROUP AG | | 1,584 | | 2,037 | 2,469 | 270,616 | 各種金融 |
| VIFOR PHARMA AG | | 17 | | 26 | 470 | 51,546 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 小計 | 株数 | 7,124 | 株数 | 9,085 | 69,129 | 7,575,947 | |
| 銘柄数 | 比率 | 38 | 39 | — | — | <3.3%> | |
| (スウェーデン) | | | | | 千スウェーデンクローナ | | |
| LUNDBERGS AB-B SHS | | 31 | | 31 | 1,189 | 13,633 | 各種金融 |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A | | 647 | | 887 | 7,292 | 83,567 | 銀行 |
| SWEDBANK AB - A SHARES | | 390 | | 459 | 5,726 | 65,623 | 銀行 |
| SWEDISH MATCH AB | | 75 | | 101 | 4,655 | 53,350 | 食品・飲料・タバコ |
| SECURITAS AB-B SHS | | 122 | | 199 | 3,163 | 36,249 | 商業・専門サービス |
| INVESTOR AB-B SHS | | 198 | | 242 | 12,297 | 140,930 | 各種金融 |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS | | 362 | | 437 | 8,081 | 92,614 | 小売 |
| ERICSSON LM-B SHS | | 1,265 | | 1,594 | 13,756 | 157,647 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELIA CO AB | | 1,269 | | 1,269 | 5,262 | 60,309 | 電気通信サービス |
| SKANSKA AB-B SHS | | 157 | | 157 | 3,324 | 38,098 | 資本財 |
| LUNDIN PETROLEUM AB | | 68 | | 113 | 3,359 | 38,498 | エネルギー |
| ALFA LAVAL AB | | 120 | | 139 | 3,284 | 37,634 | 資本財 |
| MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | | 26 | | 26 | 1,154 | 13,226 | 電気通信サービス |
| ICA GRUPPEN AB | | 35 | | 35 | 1,483 | 17,005 | 食品・生活必需品小売り |
| HUSQVARNA AB-B SHS | | 185 | | 185 | 1,390 | 15,933 | 耐久消費財・アパレル |
| ELECTROLUX AB-SER B | | 110 | | 91 | 2,255 | 25,848 | 耐久消費財・アパレル |

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 | 価額 | | |
| | | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| SKF AB-B SHARES | 166 | 206 | 3,769 | 43,192 | 資本財 | |
| VOLVO AB-B SHS | 645 | 795 | 11,772 | 134,909 | 資本財 | |
| SANDVIK AB | 450 | 609 | 10,622 | 121,739 | 資本財 | |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 62 | 62 | 1,391 | 15,948 | 各種金融 | |
| HEXAGON AB-B SHS | 110 | 132 | 7,148 | 81,917 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| TELE2 AB-B SHS | 131 | 291 | 4,120 | 47,217 | 電気通信サービス | |
| KINNEVIK AB-B SHS | 112 | — | — | — | 各種金融 | |
| ATLAS COPCO AB-A SHS | 267 | 359 | 12,600 | 144,401 | 資本財 | |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 161 | 197 | 6,126 | 70,204 | 資本財 | |
| BOLIDEN AB | 102 | — | — | — | 素材 | |
| EPIROC AB-A | 302 | 302 | 3,381 | 38,755 | 資本財 | |
| EPIROC AB-B | 161 | 161 | 1,733 | 19,870 | 資本財 | |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B | 239 | 327 | 9,850 | 112,883 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| BOLIDEN AB | — | 162 | 4,012 | 45,986 | 素材 | |
| KINNEVIK AB-B SHS | — | 112 | 2,468 | 28,290 | 各種金融 | |
| KINNEVIK AB-REDEMPTION SHARE | — | 112 | 655 | 7,508 | 各種金融 | |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 608 | 776 | 7,300 | 83,667 | 銀行 | |
| ASSA ABLOY AB-B | 434 | 534 | 12,153 | 139,283 | 資本財 | |
| NORDEA BANK ABP | 1,231 | 1,704 | 11,563 | 132,514 | 銀行 | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 10,255 32 | 12,822 33 | 188,347 — | 2,158,463 <0.9%> | |
| (ノルウェー) | | | | 千ノルウェークローネ | | |
| DNB ASA | 406 | 510 | 7,906 | 94,091 | 銀行 | |
| TELENOR ASA | 311 | 396 | 6,661 | 79,266 | 電気通信サービス | |
| EQUINOR ASA | 498 | 507 | 8,623 | 102,623 | エネルギー | |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 74 | 90 | 3,129 | 37,237 | 素材 | |
| MOWI ASA | 169 | 222 | 5,084 | 60,505 | 食品・飲料・タバコ | |
| NORSK HYDRO ASA | 604 | 790 | 2,576 | 30,665 | 素材 | |
| AKER BP ASA | 36 | 53 | 1,425 | 16,958 | エネルギー | |
| ORKLA ASA | 339 | 339 | 3,027 | 36,024 | 食品・飲料・タバコ | |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 69 | 110 | 1,919 | 22,840 | 保険 | |
| SCHIBSTED ASA-B SHS | 37 | 39 | 933 | 11,111 | メディア・娯楽 | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 2,548 10 | 3,060 10 | 41,287 — | 491,326 <0.2%> | |
| (デンマーク) | | | | 千デンマーククローネ | | |
| CARLSBERG AS-B | 46 | 58 | 5,675 | 91,765 | 食品・飲料・タバコ | |
| A P MOLLER-MAERSK A/S-B | 2 | 3 | 3,506 | 56,705 | 運輸 | |
| A P MOLLER-MAERSK A/S-A | 1 | 1 | 1,479 | 23,919 | 運輸 | |
| DANSKE BANK A/S | 297 | 327 | 3,002 | 48,544 | 銀行 | |
| GENMAB A/S | 27 | 32 | 5,204 | 84,157 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 76 | 95 | 6,183 | 99,988 | 資本財 | |
| H LUNDBECK A/S | 28 | 28 | 752 | 12,165 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| DSV PANALPINA A S | 75 | 116 | 8,620 | 139,398 | 運輸 | |
| PANDORA A/S | 47 | 47 | 1,300 | 21,025 | 耐久消費財・アパレル | |
| CHR HANSEN HOLDING A/S | 40 | 60 | 3,104 | 50,206 | 素材 | |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES | 85 | 102 | 3,307 | 53,475 | 素材 | |
| COLOPLAST-B | 49 | 60 | 4,848 | 78,406 | ヘルスケア機器・サービス | |
| NOVO NORDISK A/S-B | 751 | 928 | 35,388 | 572,235 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ISS A/S | 64 | 85 | 1,326 | 21,451 | 商業・専門サービス | |
| TRYG A/S | 50 | 82 | 1,601 | 25,903 | 保険 | |
| ORSTED A/S | 77 | 95 | 5,995 | 96,939 | 公益事業 | |
| DEMANT A/S | 44 | 44 | 924 | 14,947 | ヘルスケア機器・サービス | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 1,769 17 | 2,172 17 | 92,222 — | 1,491,236 <0.6%> | |
| (オーストラリア) | | | | 千オーストラリアドル | | |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 61 | 95 | 694 | 51,548 | ヘルスケア機器・サービス | |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LT | 1,202 | 1,466 | 3,643 | 270,493 | 銀行 | |
| AMCOR PLC-CDI | 503 | — | — | — | 素材 | |
| WESTPAC BANKING CORPORATION | 1,406 | 1,853 | 4,545 | 337,493 | 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 | 価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| BANK OF QUEENSLAND LIMITED | 178 | — | — | — | 銀行 |
| FORTESCUE METALS GROUP LIMITED | 728 | 701 | 682 | 50,644 | 素材 |
| TELSTRA CORPORATION LIMITED | 1,697 | 2,169 | 837 | 62,176 | 電気通信サービス |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 198 | 198 | 199 | 14,776 | 銀行 |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED | 168 | 234 | 266 | 19,807 | 食品・飲料・タバコ |
| ASX LTD | 92 | 92 | 758 | 56,343 | 各種金融 |
| BHP GROUP LTD | 1,334 | 1,516 | 5,799 | 430,580 | 素材 |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 99 | 133 | 462 | 34,349 | エネルギー |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 205 | 205 | 88 | 6,558 | 小売 |
| COMPUTERSHARE LIMITED | 194 | 300 | 532 | 39,544 | ソフトウェア・サービス |
| CSL LIMITED | 185 | 234 | 6,650 | 493,795 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REA GROUP LTD | 17 | 28 | 299 | 22,246 | メディア・娯楽 |
| COCHLEAR LIMITED | 21 | 29 | 684 | 50,852 | ヘルスケア機器・サービス |
| ORIGIN ENERGY LIMITED | 745 | 893 | 776 | 57,689 | エネルギー |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 724 | 920 | 7,438 | 552,345 | 銀行 |
| BORAL LIMITED | 422 | 753 | 387 | 28,774 | 素材 |
| RIO TINTO LIMITED | 165 | 197 | 1,914 | 142,126 | 素材 |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 260 | 291 | 988 | 73,393 | 消費者サービス |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 1,010 | 1,171 | 924 | 68,651 | 保険 |
| TPG TELECOM LTD | 177 | 177 | 124 | 9,216 | 電気通信サービス |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 26 | 26 | 116 | 8,663 | 消費者サービス |
| ORICA LIMITED | 179 | 179 | 427 | 31,748 | 素材 |
| BLUESCOPE STEEL LTD | 230 | 230 | 335 | 24,943 | 素材 |
| WORLEY LIMITED | — | 133 | 200 | 14,906 | エネルギー |
| SUNCORP GROUP LTD | 523 | 639 | 855 | 63,515 | 保険 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 1,114 | 1,532 | 3,966 | 294,524 | 銀行 |
| NEWCREST MINING LIMITED | 313 | 412 | 1,270 | 94,310 | 素材 |
| OIL SEARCH LTD | 608 | 705 | 525 | 38,985 | エネルギー |
| INCITEC PIVOT LTD | 613 | 613 | 198 | 14,714 | 素材 |
| AMP LIMITED | 1,297 | 2,235 | 436 | 32,443 | 各種金融 |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | — | 458 | 334 | 24,841 | 運輸 |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 582 | 670 | 849 | 63,083 | 保険 |
| CHALLENGER FINANCIAL SERVICE | 230 | 230 | 187 | 13,914 | 各種金融 |
| SANTOS LTD | 715 | 916 | 747 | 55,465 | エネルギー |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 178 | 210 | 634 | 47,145 | ヘルスケア機器・サービス |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | — | 76 | 170 | 12,692 | エネルギー |
| TABCORP HOLDINGS LIMITED | 743 | 1,040 | 498 | 37,002 | 消費者サービス |
| WESFARMERS LIMITED | 464 | 585 | 2,481 | 184,262 | 小売 |
| ALUMINA LTD | 1,069 | 1,069 | 247 | 18,348 | 素材 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 381 | 501 | 1,729 | 128,428 | エネルギー |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 556 | 677 | 2,694 | 200,039 | 食品・生活必需品小売り |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | — | 80 | 424 | 31,545 | 各種金融 |
| SEEK LIMITED | 125 | 181 | 421 | 31,313 | 商業・専門サービス |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED | 21 | — | — | — | 消費者サービス |
| BRAMBLES LIMITED | 724 | 883 | 1,109 | 82,364 | 商業・専門サービス |
| MACQUARIE GROUP LTD | 130 | 169 | 2,333 | 173,269 | 各種金融 |
| CROWN RESORTS LTD | 165 | 218 | 282 | 20,957 | 消費者サービス |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 186 | 258 | 749 | 55,616 | 素材 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 319 | 364 | 681 | 50,629 | 食品・飲料・タバコ |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 868 | 868 | 502 | 37,287 | 運輸 |
| HEALTHSCOPE LTD | 760 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| AUSNET SERVICES | 852 | 852 | 148 | 11,009 | 公益事業 |
| MEDIBANK PRIVATE LTD | 1,287 | 1,287 | 419 | 31,158 | 保険 |
| AGL ENERGY LIMITED | 250 | 341 | 696 | 51,732 | 公益事業 |
| SOUTH32 LTD | 2,234 | 2,946 | 795 | 59,073 | 素材 |
| CIMIC GROUP LTD | 40 | 40 | 136 | 10,145 | 資本財 |
| COLES GROUP LIMITED | 464 | 574 | 934 | 69,412 | 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 | 株数 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 |
|--|-----------|--------------|------------|--------------|--------------|---------------------|
| | | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 | |
| WISETECH GLOBAL LTD | — | — | 79 | 215 | 16,019 | ソフトウェア・サービス |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 30,067 57 | 金額 <比率> | 35,962 58 | 67,460 — | 5,008,931 <2.2%> |
| (ニュージーランド) | | | | 千ニュージーランドドル | | |
| RYMAN HEALTHCARE LIMITED | 198 | 211 | 318 | 22,509 | ヘルスケア機器・サービス | |
| A2 MILK CO LTD | 319 | 349 | 541 | 38,267 | 食品・飲料・タバコ | |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 219 | 306 | 677 | 47,872 | ヘルスケア機器・サービス | |
| FLETCHER BUILDING LTD | 310 | 406 | 212 | 15,022 | 素材 | |
| SPARK NEW ZEALAND LIMITED | 798 | 878 | 399 | 28,185 | 電気通信サービス | |
| MERCURY NZ LTD | — | 302 | 145 | 10,246 | 公益事業 | |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 342 | 552 | 499 | 35,255 | 運輸 | |
| MERIDIAN ENERGY LTD | 633 | 818 | 385 | 27,221 | 公益事業 | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 2,822 7 | 金額 <比率> | 3,825 8 | 3,179 — | 224,581 <0.1%> |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 123 | 123 | 1,257 | 17,611 | 半導体・半導体製造装置 | |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 980 | 980 | 1,571 | 22,022 | 不動産 | |
| BANK OF EAST ASIA | 528 | 872 | 1,540 | 21,579 | 銀行 | |
| CLP HOLDINGS LTD | 661 | 851 | 6,867 | 96,214 | 公益事業 | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED | 478 | 606 | 14,980 | 209,874 | 各種金融 | |
| L1 & FUNG LTD | 2,372 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル | |
| MTR CORPORATION | 670 | 670 | 2,941 | 41,207 | 運輸 | |
| HANG LUNG GROUP LTD | 420 | — | — | — | 不動産 | |
| HANG SENG BANK LTD | 331 | 388 | 6,192 | 86,756 | 銀行 | |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 486 | 633 | 2,386 | 33,433 | 不動産 | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED | 600 | 715 | 3,893 | 54,543 | 公益事業 | |
| WHARF HOLDINGS LTD | 590 | — | — | — | 不動産 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 3,872 | 5,450 | 8,131 | 113,923 | 公益事業 | |
| HYSAN DEVELOPMENT CO | 290 | — | — | — | 不動産 | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED | 930 | 1,180 | 6,041 | 84,642 | 消費者サービス | |
| KERRY PROPERTIES LTD | 275 | 275 | 694 | 9,728 | 不動産 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 1,570 | 1,875 | 4,987 | 69,874 | 銀行 | |
| NWS HOLDINGS LTD | 695 | 695 | 729 | 10,223 | 資本財 | |
| PCCW LIMITED | 1,940 | 2,690 | 1,269 | 17,788 | 電気通信サービス | |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 270 | 270 | 625 | 8,756 | 耐久消費財・アパレル | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 2,613 | 3,563 | 3,641 | 51,020 | 不動産 | |
| SHANGRI-LA ASIA LTD. | 640 | — | — | — | 消費者サービス | |
| SINO LAND CO | 1,242 | 1,242 | 1,458 | 20,428 | 不動産 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 640 | 850 | 9,681 | 135,637 | 不動産 | |
| SWIRE PACIFIC LTD 'A' | 180 | 270 | 1,902 | 26,649 | 不動産 | |
| VITASOY INTL HOLDINGS LTD | — | 420 | 1,264 | 17,711 | 食品・飲料・タバコ | |
| WHEELLOCK&COMPANY LTD | 330 | 520 | 2,529 | 35,442 | 不動産 | |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 560 | 780 | 4,590 | 64,310 | 資本財 | |
| MINTH GROUP LTD | 320 | — | — | — | 自動車・自動車部品 | |
| SJM HOLDINGS LIMITED | 800 | 800 | 638 | 8,943 | 消費者サービス | |
| WYNN MACAU LTD | 708 | 708 | 1,219 | 17,080 | 消費者サービス | |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD | 440 | — | — | — | 消費者サービス | |
| AIA GROUP LTD | 4,980 | 6,326 | 49,595 | 694,837 | 保険 | |
| SANDS CHINA LTD | 936 | 1,356 | 5,017 | 70,290 | 消費者サービス | |
| SWIRE PROPERTIES LIMITED | 530 | 530 | 1,290 | 18,080 | 不動産 | |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 480 | 720 | 3,128 | 43,828 | 不動産 | |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS | 1,110 | 1,110 | 851 | 11,927 | 公益事業 | |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT | — | 650 | 1,813 | 25,407 | 食品・飲料・タバコ | |
| WH GROUP LIMITED | 3,975 | 5,170 | 4,156 | 58,235 | 食品・飲料・タバコ | |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 1,094 | 1,434 | 10,197 | 142,866 | 資本財 | |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 300 | 300 | 1,590 | 22,275 | 公益事業 | |
| CK ASSET HOLDINGS LTD | 1,074 | 1,394 | 7,257 | 101,670 | 不動産 | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 41,035 40 | 金額 <比率> | 46,417 35 | 175,933 — | 2,464,827 <1.1%> |

外国株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 期末 | | 業種等 | |
|--|---------|---------|---------|--------|-------------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | | |
| | | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | | | | | | |
| SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG | | 683 | 991 | 409 | 32,828 | 資本財 |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | | 3,536 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | | 769 | 942 | 2,378 | 190,783 | 銀行 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | | 161 | 258 | 266 | 21,397 | 不動産 |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | | 47 | 47 | 144 | 11,550 | 小売 |
| SATS LTD | | 268 | 268 | 133 | 10,705 | 運輸 |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | | 356 | 356 | 315 | 25,270 | 各種金融 |
| CAPITALAND LTD | | 1,045 | 1,366 | 502 | 40,320 | 不動産 |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | | 711 | 1,167 | 274 | 21,997 | 運輸 |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | | 250 | 250 | 230 | 18,476 | 運輸 |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | | 546 | 639 | 1,649 | 132,338 | 銀行 |
| UOL GROUP LIMITED | | 217 | 217 | 168 | 13,506 | 不動産 |
| VENTURE CORP LTD | | 119 | 119 | 188 | 15,147 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | | 563 | 690 | 151 | 12,184 | メディア・娯楽 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | | 3,349 | 4,391 | 1,484 | 119,048 | 電気通信サービス |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD | | 437 | 437 | 95 | 7,679 | 資本財 |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | | 1,268 | 1,762 | 1,899 | 152,353 | 銀行 |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | | 699 | 1,170 | 478 | 38,382 | 食品・飲料・タバコ |
| KEPPEL CORP LTD | | 586 | 699 | 469 | 37,676 | 資本財 |
| YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | | 900 | 900 | 92 | 7,435 | 資本財 |
| GENTING SINGAPORE LTD | | 2,807 | 3,702 | 342 | 27,466 | 消費者サービス |
| 小計 | 株数 | 19,318 | 20,372 | 11,676 | 936,553 | |
| | 銘柄数 | 21 | 20 | — | <0.4%> | |
| (イスラエル) | | | | | | |
| BANK HAPUALIM BM | | 440 | 650 | 1,797 | 56,738 | 銀行 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | | 655 | 839 | 2,091 | 66,005 | 銀行 |
| BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | | 1,001 | — | — | — | 電気通信サービス |
| ELBIT SYSTEMS LTD | | 8 | 13 | 784 | 24,772 | 資本財 |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A | | — | 546 | 869 | 27,435 | 銀行 |
| ISRAEL CHEMICALS LIMITED | | 287 | 287 | 458 | 14,461 | 素材 |
| NICE LTD | | 27 | 27 | 1,439 | 45,426 | ソフトウェア・サービス |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | | 54 | 54 | 495 | 15,629 | 銀行 |
| AZRIELI GROUP | | 21 | 21 | 583 | 18,417 | 不動産 |
| 小計 | 株数 | 2,496 | 2,441 | 8,519 | 268,887 | |
| | 銘柄数 | 8 | 8 | — | <0.1%> | |
| 合計 | 株数 | 505,064 | 612,636 | — | 221,190,960 | |
| | 銘柄数 | 1,250 | 1,260 | — | <95.2%> | |

※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。

※<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

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

※一部の銘柄において、資産区分を変更しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国投資信託証券

| 銘 | 柄 | 期首 (前期末) | | 期 | | 末 | | |
|---------------------------------------|---|----------|--------|-------|---------|-------|--------|---------|
| | | 口 | 数 | 口 | 数 | 評 価 額 | | 組 入 比 率 |
| | | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | | % | |
| AGNC INVESTMENT CORPORATION | | 17,476 | 25,432 | 440 | 48,312 | | 0.0 | |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC. | | 4,326 | 5,727 | 930 | 102,084 | | 0.0 | |
| AMERICAN TOWER CORP | | 18,353 | 23,336 | 4,994 | 547,808 | | 0.2 | |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | | 51,312 | 80,296 | 749 | 82,168 | | 0.0 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 5,571 | 7,069 | 1,515 | 166,238 | | 0.1 | |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 6,157 | 7,835 | 1,085 | 119,053 | | 0.1 | |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | | 11,010 | — | — | — | | — | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 4,242 | 4,902 | 546 | 59,975 | | 0.0 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | | 8,532 | 10,561 | 1,277 | 140,100 | | 0.1 | |
| DUKE REALTY CORP | | 13,732 | 20,240 | 712 | 78,096 | | 0.0 | |
| EQUINIX INC | | — | 4,426 | 2,508 | 275,173 | | 0.1 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | | — | 8,664 | 641 | 70,395 | | 0.0 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | | 14,828 | 18,789 | 1,598 | 175,372 | | 0.1 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | | 2,713 | 3,332 | 1,040 | 114,087 | | 0.0 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | | 5,405 | 6,463 | 685 | 75,174 | | 0.0 | |
| FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | | 3,224 | 4,227 | 558 | 61,229 | | 0.0 | |
| HCP, INC. | | 20,162 | — | — | — | | — | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | | — | 24,237 | 845 | 92,721 | | 0.0 | |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | | 32,068 | 37,569 | 657 | 72,068 | | 0.0 | |
| INVITATION HOMES INC | | 14,734 | 30,069 | 918 | 100,686 | | 0.0 | |
| IRON MOUNTAIN INC | | 12,165 | 16,395 | 526 | 57,758 | | 0.0 | |
| KIMCO REALTY CORPORATION | | 15,666 | 21,090 | 455 | 50,010 | | 0.0 | |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | | 6,876 | 9,193 | 566 | 62,130 | | 0.0 | |
| MACERICH COMPANY/THE | | 3,806 | — | — | — | | — | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | | — | 29,675 | 616 | 67,568 | | 0.0 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | | 4,759 | 5,780 | 786 | 86,286 | | 0.0 | |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | | 6,416 | 8,249 | 459 | 50,430 | | 0.0 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | | — | 12,872 | 541 | 59,337 | | 0.0 | |
| PROLOGIS INC | | 25,652 | 33,100 | 3,030 | 332,363 | | 0.1 | |
| PUBLIC STORAGE | | 6,516 | 7,965 | 1,678 | 184,050 | | 0.1 | |
| REALTY INCOME CORPORATION | | 11,714 | 16,047 | 1,229 | 134,871 | | 0.1 | |
| REGENCY CENTERS CORP | | 6,080 | 9,451 | 614 | 67,419 | | 0.0 | |
| SL GREEN REALTY CORP | | 3,945 | 3,945 | 336 | 36,921 | | 0.0 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | | 12,869 | 16,451 | 2,487 | 272,835 | | 0.1 | |
| SUN COMMUNITIES INC | | — | 4,598 | 757 | 83,064 | | 0.0 | |
| UDR INC | | 10,651 | 14,289 | 686 | 75,304 | | 0.0 | |
| VENTAS INC | | 14,830 | 20,469 | 1,193 | 130,908 | | 0.1 | |

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 | | |
| VEREIT INC | 44,740 | 54,273 | 529 | 58,097 | 0.0 | |
| VICI PROPERTIES INC | — | 26,533 | 656 | 71,967 | 0.0 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 7,603 | 8,706 | 562 | 61,656 | 0.0 | |
| WP CAREY INC | 6,694 | 8,640 | 720 | 79,051 | 0.0 | |
| WELLTOWER INC | 14,980 | 20,533 | 1,736 | 190,456 | 0.1 | |
| WEYERHAEUSER CO | 30,388 | 37,766 | 1,114 | 122,235 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 480,195 | 709,194 | 42,993 | 4,715,477 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 36 | 40 | — | <2.0%> | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| CAN APARTMENT PROP | — | 4,697 | 260 | 21,514 | 0.0 | |
| H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,825 | 10,391 | 224 | 18,526 | 0.0 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7,441 | 7,441 | 201 | 16,685 | 0.0 | |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 3,585 | 3,585 | 114 | 9,487 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 14,851 | 26,114 | 801 | 66,212 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 3 | 4 | — | <0.0%> | |
| (ユーロ・・・フランス) | | | 千ユーロ | | | |
| ICADE | 1,265 | 1,265 | 114 | 13,889 | 0.0 | |
| KLEPIERRE | 9,305 | 9,305 | 303 | 36,628 | 0.0 | |
| GECINA SA | 1,738 | 2,689 | 421 | 50,958 | 0.0 | |
| COVIVIO | 1,550 | 2,388 | 239 | 28,976 | 0.0 | |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED | 5,937 | 7,311 | 1,037 | 125,383 | 0.1 | |
| ユーロ口計 | 口 数 ・ 金 額 | 19,795 | 22,958 | 2,116 | 255,837 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 5 | 5 | — | <0.1%> | |
| (イギリス) | | | 千英ポンド | | | |
| BRITISH LAND CO PLC | 34,772 | 44,962 | 258 | 36,643 | 0.0 | |
| HAMMERSON PLC | 34,414 | — | — | — | — | |
| SEGRO PLC | 40,873 | 61,311 | 548 | 77,608 | 0.0 | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 32,703 | 32,703 | 313 | 44,377 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 142,762 | 138,976 | 1,120 | 158,629 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 4 | 3 | — | <0.1%> | |
| (オーストラリア) | | | 千オーストラリアドル | | | |
| MIRVAC GROUP | 140,993 | 226,368 | 762 | 56,642 | 0.0 | |
| TRANSURBAN GROUP | 104,775 | 141,455 | 2,171 | 161,221 | 0.1 | |
| APA GROUP | 48,387 | 67,160 | 738 | 54,852 | 0.0 | |
| GPT GROUP | 69,713 | 97,296 | 598 | 44,429 | 0.0 | |
| LENLEASE GROUP | 25,262 | 25,262 | 487 | 36,219 | 0.0 | |
| STOCKLAND | 103,417 | 103,417 | 522 | 38,777 | 0.0 | |
| DEXUS | 38,051 | 62,385 | 762 | 56,650 | 0.0 | |
| GOODMAN GROUP | 64,265 | 86,301 | 1,278 | 94,964 | 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 | |
| | | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| | SYDNEY AIRPORT | | 49,760 | 49,760 | 456 | 33,917 | 0.0 |
| | SCENTRE GROUP | | 234,290 | 290,995 | 1,146 | 85,129 | 0.0 |
| | VICINITY CENTRES | | 146,656 | 146,656 | 393 | 29,183 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数 <比率> | | 1,025,569 | 1,297,055 | 9,319 | 691,987 | |
| | | | 11 | 11 | — | <0.3%> | |
| (香港) | | | | | 千香港ドル | | |
| | LINK REIT | | 92,500 | 112,500 | 9,000 | 126,090 | 0.1 |
| | HKT TRUST AND HKT LTD | | 136,000 | 170,000 | 1,951 | 27,341 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数 <比率> | | 228,500 | 282,500 | 10,951 | 153,431 | |
| | | | 2 | 2 | — | <0.1%> | |
| (シンガポール) | | | | | 千シンガポールドル | | |
| | CAPITALAND MALL TRUST | | 102,800 | 160,800 | 405 | 32,502 | 0.0 |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | 118,300 | 150,400 | 448 | 35,949 | 0.0 |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | | 130,000 | 130,400 | 262 | 21,023 | 0.0 |
| | SUNTEC REIT | | 65,600 | 64,600 | 118 | 9,534 | 0.0 |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | | — | 104,900 | 247 | 19,857 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数 <比率> | | 416,700 | 611,100 | 1,481 | 118,866 | |
| | | | 4 | 5 | — | <0.1%> | |
| 合計 | 口数・金額 銘柄数 <比率> | | 2,328,372 | 3,087,897 | — | 6,160,443 | |
| | | | 65 | 70 | — | <2.7%> | |

※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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 | 柄 | 別 | 期 | | 末 |
|----|--------|--|-------|-----|-----|
| | | | 買 | 建 | 額 |
| 外国 | 株式先物取引 | S P I 2 0 0 D J E U R 0 F T S E S P M I N I | 百万円 | | 百万円 |
| | | | | 216 | — |
| | | | | 827 | — |
| | | | | 281 | — |
| | | | 3,534 | — | |

※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。

※一印は組入れなし。

■ 投資信託財産の構成

(2019年12月2日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株 式 | 221,190,960 | 95.1 |
| 投 資 証 券 | 6,160,443 | 2.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 5,346,121 | 2.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 232,697,524 | 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 (232,363,571千円) の投資信託財産総額 (232,697,524千円) に対する比率は99.9%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.68円、1カナダドル=82.62円、1ユーロ=120.86円、1英ポンド=141.59円、1スイスフラン=109.59円、1スウェーデンクローナ=11.46円、1ノルウェークローネ=11.90円、1デンマーククローネ=16.17円、1オーストラリアドル=74.25円、1ニュージーランドドル=70.63円、1香港ドル=14.01円、1シンガポールドル=80.21円、1イスラエルシェケル=31.56円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月2日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|--------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 232,939,548,805円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 3,229,184,929 |
| 株 式(評価額) | 221,190,960,865 |
| 投 資 証 券(評価額) | 6,160,443,382 |
| 未 収 入 金 | 318,051,486 |
| 未 収 配 当 金 | 388,775,579 |
| 差 入 委 託 証 抛 金 | 1,652,132,564 |
| (B) 負 債 | 520,629,054 |
| 未 払 金 | 331,083,940 |
| 未 払 解 約 金 | 189,530,582 |
| 未 払 利 息 | 469 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 14,063 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 232,418,919,751 |
| 元 本 | 59,882,488,969 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 172,536,430,782 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 59,882,488,969口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 38,813円 |

※当期における期首元本額50,246,578,230円、期中追加設定元本額25,475,610,485円、期中一部解約元本額15,839,699,746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12月1日 至2019年12月2日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 4,142,999,222円 |
| 受 取 配 当 金 | 4,118,511,245 |
| 受 取 利 息 | 7,980,013 |
| そ の 他 収 益 金 | 16,811,889 |
| 支 払 利 息 | △ 303,925 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 18,409,509,351 |
| 売 買 益 | 29,830,623,457 |
| 売 買 損 | △ 11,421,114,106 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | 689,302,248 |
| 取 引 益 | 1,248,893,389 |
| 取 引 損 | △ 559,591,141 |
| (D) 信 託 報 酬 等 | △ 86,588,797 |
| (E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D) | 23,155,222,024 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | 123,998,809,377 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 65,355,675,104 |
| (H) 解 約 差 損 益 金 | △ 39,973,275,723 |
| (I) 計 (E+F+G+H) | 172,536,430,782 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I) | 172,536,430,782 |

※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 | 24,341,482,029円 | SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 1,425,257,649円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 309,208,928円 | SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 1,437,712,637円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,259,261,163円 | SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 6,008,822,640円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 846,574,484円 | SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 20,208,409円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 95,225,173円 | SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 101,561,964円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2020(4資産タイプ) | 2,203,478円 | 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 419,448円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2025(4資産タイプ) | 8,569,298円 | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 719,013,252円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2030(4資産タイプ) | 23,404,360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> | 59,112,177円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2035(4資産タイプ) | 49,150,528円 | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 171,173,908円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2040(4資産タイプ) | 35,973,195円 | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 746,604,437円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2045(4資産タイプ) | 84,418,147円 | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 610,403,231円 |
| 外国株式指数ファンド | 519,424,273円 | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 1,481,526,688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 | 4,651,861,582円 | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 807,485円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 467,864,523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) | 298,971,151円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 467,950,368円 | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 124,994,236円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 363,716,897円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 17,270,683円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 12,835,702円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 12,728,159円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2050 | 6,924,395円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 6,672,335円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 38,804,550円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 41,560,678円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 35,331,600円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 104,386,931円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 98,630,259円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用> | 7,900,647円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 53,111,115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> | 824,759,297円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 67,295,491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> | 136,799,749円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 18,283,485円 | SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 5,661,668,736円 |
| 三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド | 280,003円 | SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 253,114,771円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 27,790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> | 3,894,611,777円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 41,770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> | 8,907,868円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 56,291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> | 45,206,401円 |
| SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 1,410,498,405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> | 27,976,493円 |
| バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定> | 7,831,278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> | 282,124,598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> | 73,969,974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)

エマージング株式インデックス・マザーファンド

第9期（2018年12月1日から2019年12月2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の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 | 株式先物 率 (買建-売建) | 債券組入 率 | 投資信託 証券組入 比率 | 純資産 額 |
|-----------------|-----------|-----------|--|-----------|-----------|----------------------|-----------|--------------------|----------|
| | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | | | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 9期（2019年12月2日） | 13,315 | 2.2 | 148.27 | 3.8 | 48.2 | 45.1 | — | 6.8 | 8,381 |

※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2019年12月2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

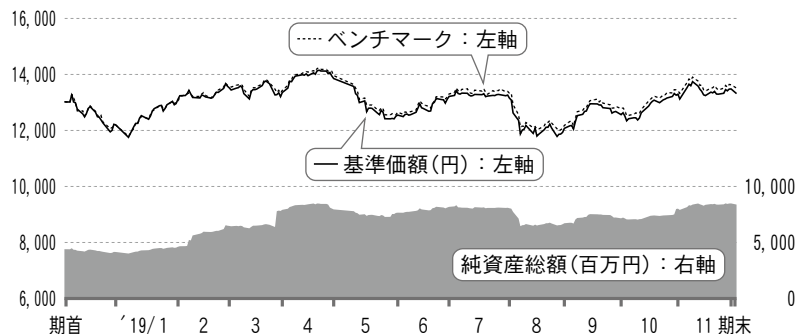
| 年月日 | 基準価額 | | (ベンチマーク) MSCIエマージング・ マーケット・インデックス (配当込み、 円ベース) | | 株式組入 率 | 株式先物 率 (買建-売建) | 債券組入 率 | 投資信託 証券組入 比率 |
|---------------------|--------|------|--|------|-----------|----------------------|-----------|--------------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | | |
| (期首) 2018年11月30日 | 円 | % | | % | % | % | % | % |
| 12月末 | 13,023 | — | 142.90 | — | 43.2 | 53.6 | — | 3.1 |
| 2019年1月末 | 12,202 | △6.3 | 133.82 | △6.4 | 43.3 | 54.0 | — | 3.2 |
| 2月末 | 13,118 | 0.7 | 143.06 | 0.1 | 41.5 | 55.5 | — | 3.1 |
| 3月末 | 13,523 | 3.8 | 149.22 | 4.4 | 30.8 | 67.1 | 43.2 | 2.3 |
| 4月末 | 13,358 | 2.6 | 147.39 | 3.1 | 36.4 | 60.9 | — | 2.7 |
| 5月末 | 13,853 | 6.4 | 153.19 | 7.2 | 37.5 | 59.7 | 37.7 | 2.8 |
| 6月末 | 12,550 | △3.6 | 138.83 | △2.8 | 35.2 | 61.6 | 36.5 | 3.6 |
| 7月末 | 13,214 | 1.5 | 145.97 | 2.1 | 34.5 | 62.3 | 40.3 | 3.5 |
| 8月末 | 13,152 | 1.0 | 146.30 | 2.4 | 34.9 | 61.5 | 41.0 | 3.6 |
| 9月末 | 12,076 | △7.3 | 133.66 | △6.5 | 48.1 | 45.5 | — | 6.2 |
| 10月末 | 12,565 | △3.5 | 140.22 | △1.9 | 46.8 | 47.5 | — | 6.0 |
| 11月末 | 13,296 | 2.1 | 147.31 | 3.1 | 44.2 | 50.3 | 24.9 | 5.6 |
| (期末) 2019年12月2日 | 13,483 | 3.5 | 149.58 | 4.7 | 48.1 | 45.2 | — | 6.8 |
| | 13,315 | 2.2 | 148.27 | 3.8 | 48.2 | 45.1 | — | 6.8 |

※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12月1日から2019年12月2日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 13,023円 |
| 期末 | 13,315円 |
| 騰落率 | +2.2% |

※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、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（2018年12月1日から2019年12月2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、対円で為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- ・米中協議の進展期待や中国政府の景気対策、FRB（米連邦準備制度理事会）の利上げ観測後退などを追い風に、新興国株式市場が上昇したこと

下落要因

- ・米ドルや香港ドル、新興国通貨が対円で下落したこと

▶ 投資環境について (2018年12月 1日から2019年12月 2日まで)

当期の新興国株式市場は上昇しました。新興国通貨は対円で下落しました。

株式市場

新興国株式市場は、期初から2018年12月末にかけては、米中貿易摩擦やF R Bによる利上げへの懸念を背景に下落しました。1月から4月にかけては、米中協議の進展期待や中国政府の景気対策、F R Bの利上げ観測の後退などを追い風に、堅調に推移しました。5月に入ると、米中貿易協議の先行き不透明感や、米国による中国の華為技術（ファーウェイ）に対する制裁強化を懸念して、株式市場は反落しました。6月から9月にかけては米中貿易摩擦や米金融当局の緩和姿勢、香港デモの動向をにらみながら一喜一憂する展開となりました。10月に入ると米中通商協議の一部合意に対する期待感が高まり、期末にかけて上昇しました。F R Bは7月以降3回の利下げを実施しました。またE C B（欧州中央銀行）は9月に再び金融緩和に舵を切りました。米中貿易交渉については、10月に第一段階の合意の大枠が発表され、その後の株価の下支えになりました。

当期の市場の動きをM S C I 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4.2%上昇しました。

為替市場

為替相場は、期初から世界的な株価の下落を受け、米ドルや香港ドル、新興国通貨は円に対して下落しましたが、1月に入ると米国の利上げ観測の後退などを背景に米国株式が上昇し、米ドルや香港ドル、新興国通貨が円に対して4月まで上昇しました。5月以降は、米中の貿易協議進展に対する懸念が高まったため米ドルや香港ドルなどが円に対して軟調となり、また8月上旬にはトランプ米大統領の対中追加関税の表明を受けて新興国通貨が対円で大幅安となりました。9月から期末にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待などを背景に米ドルや香港ドル、アジアの新興国通貨が対円で上昇しました。国内の政治リスクが不安視されたブラジルレアルはもみあいとなりました。

当期の米ドル・円は期首113円47銭から期末109円68銭へと3円79銭の米ドル安・円高、香港ドル・円は期首14円51銭から期末14円01銭へと0円50銭の香港ドル安・円高、ブラジルレアル・円は期首29円37銭から期末25円88銭へと3円49銭のブラジルレアル安・円高となりました。

▶ ポートフォリオについて (2018年12月 1日から2019年12月 2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の乖離）を低く抑えました。

長期売買停止銘柄について

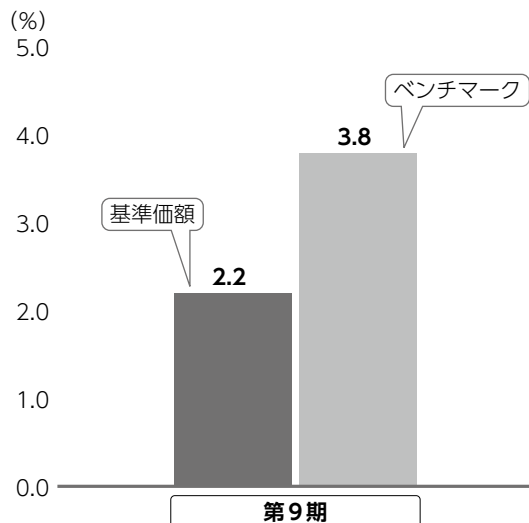
当ファンドで保有している長期売買停止銘柄（評価基準を変更した銘柄および売買停止期間が1年以上の銘柄）については以下の通りです。

| 銘柄名 | 売買停止日 | 評価基準 | 組入比率 |
|----------|-----------|-----------|------|
| FF GROUP | 2018/9/25 | 売買最終相場の価格 | 0.0% |

(2019年11月28日時点)

▶ベンチマークとの差異について（2018年12月1日から2019年12月2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+2.2%となり、ベンチマークの騰落率+3.8%から1.6%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・ベンチマークと先物にリターンの差異が生じたこと
- ・売買コスト、保管費用等の支払いが生じたこと
- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと

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。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 (2018年12月1日から2019年12月2日まで)

| 項 目 | 金 額 | 比 率 | 項 目 の 概 要 |
|---|--|--|--|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 21円 (11) (0) (1) (9) | 0.162% (0.085) (0.000) (0.011) (0.066) | 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) | 3 (3) (0) | 0.022 (0.022) (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) | 40 (38) (2) | 0.305 (0.293) (0.013) | 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 | 64 | 0.489 | |

期中の平均基準価額は13,031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12月1日から2019年12月2日まで)

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|-----------|--------------------|----------------------------|--------------|--------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | ア メ リ カ | 百株 463 (11) | 千米ドル 2,486 (-) | 百株 14 | 千米ドル 32 |
| | メ キ シ コ | 2,987 (-) | 千メキシコペソ 9,509 (△ 18) | 182 | 千メキシコペソ 512 |
| | ブ ラ ジ ル | 2,096 (195) | 千ブラジルレアル 6,141 (-) | 26 (-) | 千ブラジルレアル 78 (45) |
| | チ リ | 14,814 (534) | 千チリペソ 153,187 (260) | 25 (520) | 千チリペソ 1,927 (260) |
| | コ ロ ン ビ ア | 406 | 千コロンビアペソ 269,629 | 47 | 千コロンビアペソ 43,340 |
| | ユ ー ロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | オ ラ ン ダ | - (28) | - (172) | 28 | 198 |
| | ベ ル ギ ー | 3 | 6 | - | - |
| | ギ リ シ ャ | 300 | 61 | 1 | 3 |

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 | トルコ | 430 (116) | 千トルコリラ 583 (14) | 78 (80) | 千トルコリラ 38 (8) |
| | チエコ | 31 | 千チェココルナ 754 | 1 | 千チェココルナ 52 |
| | ハンガリー | 28 | 千ハンガリーフォリント 17,055 | — | 千ハンガリーフォリント — |
| | ポーランド | 263 | 千ポーランドズロチ 824 | 6 | 千ポーランドズロチ 45 |
| | 香港 | 34,823 (42) | 千香港ドル 37,052 (△ 17) | 3,295 (4) | 千香港ドル 1,260 (3) |
| | マレーシア | 2,473 | 千マレーシアリングgit 1,793 | 348 | 千マレーシアリングgit 91 |
| | タイ | 6,412 (277) | 千タイバーツ 23,477 (—) | 380 (—) | 千タイバーツ 1,010 (3) |
| | フィリピン | 2,495 (12) | 千フィリピンペソ 11,247 (—) | 321 | 千フィリピンペソ 375 |
| | インドネシア | 11,402 (924) | 千インドネシアルピア 6,184,317 (—) | 694 | 千インドネシアルピア 287,682 |
| | 韓国 | 543 (0.48) | 千韓国ウォン 2,876,692 (3,119) | 22 (—) | 千韓国ウォン 82,489 (3,293) |
| | 台湾 | 12,382 (129) | 千新台幣ドル 69,828 (△ 70) | 300 | 千新台幣ドル 1,822 |
| | インド | 2,811 (287) | 千インドルピー 149,948 (—) | 686 | 千インドルピー 5,724 |
| エジプト | 120 (9) | 千エジプトポンド 511 (—) | — | 千エジプトポンド — | |
| 南アフリカ | 1,369 (18) | 千南アフリカランド 16,700 (—) | 145 (—) | 千南アフリカランド 862 (2,791) | |

※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) 新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|---|----------------------|-------------------------|-------------|-------------|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外国 | イ | 証券 2,378 (660) | 千タイバーツ 0.8435 (2) | 証券 3,038 | 千タイバーツ 3 |

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()内は権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|----|------|-------------|-------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 311,899,456 | 311,898,215 |

※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。

(4) 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 | GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF | 442 | 千米ドル 2 | 52 | 千米ドル 0.38167 |
| | | ISHARES MSCI RUSSIA ETF | 20,809 | 756 | 1,211 | 43 |
| | | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | 36,091 | 1,134 | 1,335 | 43 |
| | | ISHARES MSCI UAE ETF | 11,968 | 170 | — | — |
| | | ISHARES MSCI QATAR ETF | 13,244 | 235 | 81 | 1 |
| | 小 | 計 | 82,554 | 2,300 | 2,679 | 88 |
| | メキシコ | DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR) | 13,600 | 千米キシコペソ 370 | 2,100 | 千米キシコペソ 50 |
| | | | (—) | (△ 15) | — | — |
| | 小 | 計 | 13,600 | 370 | 2,100 | 50 |
| | ブラジル | SUL AMERICA SA-UNITS BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT KLABIN SA-UNIT | 1,600 | 千ブラジルリアル 73 | — | 千ブラジルリアル — |
| | | | 1,200 | 51 | — | — |
| | | | 2,400 | 40 | — | — |
| | | | 小 | 計 | 5,200 | 165 |
| | 南アフリカ | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD FORTRESS REIT LTD-A FORTRESS REIT LTD-B REDEFINE PROPERTIES LTD HYPROP INVESTMENTS LTD RESILIENT REIT LTD | 9,572 | 千南アフリカランド 228 | — | 千南アフリカランド — |
| | | | 5,117 | 107 | — | — |
| — | | | — | 2,984 | 31 | |
| 25,134 | | | 224 | — | — | |
| — | | | — | 910 | 61 | |
| — | | | — | 1,090 | 61 | |
| 小 | 計 | 39,823 | 560 | 4,984 | 154 | |
| 中国(オフショア) | CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF | 273,400 | 千中国元(オフショア) 10,685 | — | 千中国元(オフショア) — | |
| | | 小 | 計 | 273,400 | 10,685 | — |

※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。

(5) 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 20,065 | 百万円 18,514 | 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）の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|-------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 2,256,691千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 2,842,870千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b) | 0.79 |

※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12月1日から2019年12月2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 2,801 | 百万円 311,899 | 0.9 | 百万円 2,801 | 百万円 311,898 | 0.9 |

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

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

(2018年12月1日から2019年12月2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12月2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 | 122 | 2,454 | 269,154 | 小売 |
| AUTOHOME INC-ADR | 2 | 4 | 29 | 3,201 | メディア・娯楽 |
| BAIDU INC - SPON ADR | 10 | 20 | 239 | 26,299 | メディア・娯楽 |
| BANCO MACRO SA-ADR | — | 3 | 8 | 907 | 銀行 |
| BAOZUN INC-SPN-ADR | 1 | 2 | 9 | 1,095 | 小売 |
| BEST INC-ADR | — | 18 | 10 | 1,197 | 運輸 |
| CIA DE MINAS BUENAVENTURA S. A-ADR | 7 | 15 | 24 | 2,636 | 素材 |
| CTRP.COM INTERNATIONAL-ADR | 14 | — | — | — | 小売 |
| 58.COM INC-ADR | 3 | 6 | 42 | 4,622 | メディア・娯楽 |
| 51JOB INC-ADR | 0.92 | 1 | 14 | 1,629 | 商業・専門サービス |
| GDS HOLDINGS LTD-ADR | 2 | 4 | 19 | 2,192 | ソフトウェア・サービス |
| GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR | — | 7 | 9 | 1,038 | 銀行 |
| HUAZHU GROUP LTD-ADR | 4 | 9 | 32 | 3,602 | 消費者サービス |
| HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR | — | 4 | 11 | 1,256 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HUYA INC-ADR | — | 4 | 10 | 1,138 | メディア・娯楽 |
| IQIYI INC-ADR | — | 7 | 15 | 1,671 | メディア・娯楽 |
| JD.COM INC-ADR | 26 | 53 | 174 | 19,155 | 小売 |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL-B | 39 | 68 | 4 | 537 | エネルギー |
| MOMO INC-SPON ADR | 4 | 10 | 40 | 4,478 | メディア・娯楽 |
| NIO INC-ADR | — | 43 | 9 | 1,071 | 自動車・自動車部品 |
| NETEASE.COM INC -ADR | 3 | 5 | 164 | 18,053 | メディア・娯楽 |
| NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR | 5 | 10 | 124 | 13,705 | 消費者サービス |
| NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS | 1 | 2 | 6 | 738 | 各種金融 |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 34 | 70 | 6 | 710 | 不動産 |
| PINDUODUO INC-ADR | — | 14 | 50 | 5,520 | 小売 |
| QUDIAN INC-SPON ADR | — | 6 | 3 | 341 | 各種金融 |
| SOUTHERN COPPER CORPORATION | 3 | 6 | 25 | 2,807 | 素材 |
| TAL EDUCATION GROUP-ADR | 12 | 27 | 123 | 13,563 | 消費者サービス |
| TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR | — | 5 | 5 | 619 | 電気通信サービス |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | — | 8 | 10 | 1,145 | メディア・娯楽 |
| TRIP.COM GROUP-ADR | — | 34 | 113 | 12,442 | 小売 |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR | 15 | 31 | 40 | 4,460 | 小売 |
| WEIBO CORP-SPON ADR | 2 | 3 | 14 | 1,638 | メディア・娯楽 |
| YPF S. A. -SPONSORED ADR | — | 11 | 11 | 1,239 | エネルギー |
| YY INC-ADR | 2 | 4 | 26 | 2,945 | メディア・娯楽 |
| YUM CHINA HOLDINGS INC | 14 | 25 | 115 | 12,676 | 消費者サービス |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | — | 23 | 51 | 5,599 | 運輸 |
| CREDICORP LTD | 2 | 4 | 101 | 11,141 | 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 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| SINA CORP | 2 | 4 | 13 | 1,534 | メディア・娯楽 | |
| GLOBALANT SA | — | 2 | 27 | 3,027 | ソフトウェア・サービス | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数〈比率〉 | 253 | 713 | 4,201 | 460,796 | |
| | | 25 | 39 | — | < 5.5% > | |
| (メキシコ) | | | 千メキシコペソ | | | |
| ALFA S. A. B. -A | 111 | 220 | 337 | 1,895 | 資本財 | |
| COCA-COLA FEMSA S. A. DE C. V | 18 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ | |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 71 | 143 | 2,537 | 14,237 | 食品・飲料・タバコ | |
| EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1 | 7 | 16 | 154 | 865 | 小売 | |
| GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO | 90 | 174 | 740 | 4,153 | メディア・娯楽 | |
| GRUPO BIMBO SAB-SERIES A | 60 | 107 | 361 | 2,028 | 食品・飲料・タバコ | |
| GRUMA S. A. B. -B | 7 | 15 | 296 | 1,663 | 食品・飲料・タバコ | |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA | 8 | 17 | 327 | 1,835 | 運輸 | |
| GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 17 | 36 | 235 | 1,320 | 資本財 | |
| CEMEX SAB-CPO | 534 | 1,156 | 826 | 4,636 | 素材 | |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE S. A. B. DE C. V. | 91 | 184 | 1,894 | 10,625 | 銀行 | |
| MEXICHEM SAB DE CV | 38 | — | — | — | 素材 | |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 5 | 11 | 247 | 1,389 | 素材 | |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 56 | 100 | 374 | 2,100 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| ALSEA SAB DE CV | 19 | 38 | 201 | 1,129 | 消費者サービス | |
| GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B | 7 | 14 | 495 | 2,779 | 運輸 | |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV | 140 | 262 | 1,338 | 7,507 | 素材 | |
| AMERICA MOVIL SAB DE C. V. | 1,233 | 2,447 | 3,670 | 20,591 | 電気通信サービス | |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA-O | 85 | 150 | 348 | 1,953 | 銀行 | |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 16 | 29 | 300 | 1,684 | 食品・飲料・タバコ | |
| GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 13 | 25 | 496 | 2,788 | 運輸 | |
| MEGACABLE HOLDINGS-CPO | — | 15 | 109 | 615 | メディア・娯楽 | |
| INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA | 20 | 43 | 344 | 1,934 | 公益事業 | |
| BANCO SANTANDER MEXICO-B | 66 | — | — | — | 銀行 | |
| ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV | — | 86 | 367 | 2,059 | 素材 | |
| COCA-COLA FEMSA S. A. DE C. V | — | 34 | 381 | 2,139 | 食品・飲料・タバコ | |
| WAL-MART DE MIXICO SAB DE CV | 192 | 387 | 2,108 | 11,827 | 食品・生活必需品小売り | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数〈比率〉 | 2,906 | 5,712 | 18,496 | 103,763 | |
| | | 24 | 24 | — | < 1.2% > | |
| (ブラジル) | | | 千ブラジルレアル | | | |
| BRF-BRASIL FOODS SA | 16 | 37 | 135 | 3,504 | 食品・飲料・タバコ | |
| VALE SA | 116 | 232 | 1,159 | 30,008 | 素材 | |
| TIM PARTICIPACOES SA | 31 | 56 | 75 | 1,962 | 電気通信サービス | |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B | 8 | 16 | 57 | 1,487 | 公益事業 | |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR | 8 | 22 | 76 | 1,983 | 公益事業 | |
| BANCO DO BRASIL S. A. | 31 | 64 | 305 | 7,918 | 銀行 | |
| ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR | 162 | 326 | 433 | 11,223 | 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 | |
| LOJAS AMERICANAS SA | 27 | 53 | 118 | 3,056 | 小売 |
| GERDAU S. A. -PREF | 38 | 71 | 120 | 3,123 | 素材 |
| PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS | 109 | 219 | 683 | 17,683 | エネルギー |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA | 13 | 48 | 136 | 3,532 | 小売 |
| PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR | 144 | 308 | 897 | 23,235 | エネルギー |
| KROTON EDUCACIONAL SA | 51 | — | — | — | 消費者サービス |
| COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS | 44 | 84 | 144 | 3,736 | 運輸 |
| WEG SA | 27 | 58 | 177 | 4,589 | 資本財 |
| BANCO BRADESCO S. A. -PREF | 123 | 294 | 983 | 25,462 | 銀行 |
| BANCO BRADESCO SA | 37 | 90 | 281 | 7,285 | 銀行 |
| NATURA COSMETICOS SA | 6 | 26 | 86 | 2,228 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S. A. -CSN | 23 | 53 | 66 | 1,722 | 素材 |
| SUZANO SA | 16 | 36 | 139 | 3,607 | 素材 |
| ITAU UNIVANCO HOLDING SA | 177 | 354 | 1,231 | 31,882 | 銀行 |
| PORTO SEGURO SA | 4 | 6 | 36 | 931 | 保険 |
| FIBRIA CELULOSE SA | 9 | — | — | — | 素材 |
| BRASKEM SA-PREF A | 6 | 9 | 25 | 651 | 素材 |
| LOCALIZA RENT A CAR SA | 18 | 40 | 180 | 4,662 | 運輸 |
| LOJAS RENNER S. A. | 26 | 59 | 309 | 8,016 | 小売 |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 13 | 47 | 102 | 2,652 | エネルギー |
| COSAN SA | 6 | 13 | 80 | 2,089 | エネルギー |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 7 | 13 | 26 | 694 | 公益事業 |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD(NEW) | — | 52 | 107 | 2,777 | 公益事業 |
| EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S. A. | 24 | 50 | 90 | 2,329 | 資本財 |
| M DIAS BRANCO SA | 4 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ |
| B2W CIA DIGITAL | — | 15 | 87 | 2,276 | 小売 |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA | 30 | 63 | 98 | 2,538 | 不動産 |
| JBS SA | 30 | 83 | 236 | 6,117 | 食品・飲料・タバコ |
| CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 32 | 60 | 78 | 2,026 | 公益事業 |
| COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO | 13 | 26 | 149 | 3,862 | 公益事業 |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS | 9 | 24 | 69 | 1,796 | 不動産 |
| HYPERMARCAS SA | 13 | 27 | 89 | 2,326 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TELEFONICA BRASIL SA | 16 | 34 | 191 | 4,949 | 電気通信サービス |
| MAGAZINE LUIZA SA | 3 | 54 | 243 | 6,293 | 小売 |
| ENERGISA SA-UNITS | — | 11 | 50 | 1,308 | 公益事業 |
| COMPANHIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRU | 6 | 10 | 80 | 2,074 | 食品・生活必需品小売り |
| CIELO SA | 45 | 93 | 72 | 1,877 | ソフトウェア・サービス |
| RAIA DROGASIL SA | 8 | 18 | 203 | 5,263 | 食品・生活必需品小売り |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 26 | 51 | 175 | 4,546 | 保険 |
| ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 6 | 13 | 63 | 1,634 | 公益事業 |
| NOTRE DAME INTERMED PAR SA | — | 24 | 136 | 3,521 | ヘルスケア機器・サービス |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | — | 18 | 100 | 2,594 | ヘルスケア機器・サービス |
| ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO | 15 | 21 | 39 | 1,022 | 食品・生活必需品小売り |

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 | |
| BM&F BOVESPA SA | 75 | 151 | 720 | 18,648 | 各種金融 | |
| AMBEV SA | 173 | 347 | 626 | 16,209 | 食品・飲料・タバコ | |
| COGNA EDUCACAO | — | 104 | 106 | 2,758 | 消費者サービス | |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASLIER-RTS | — | 2 | 0.03185 | 0.824 | 公益事業 | |
| CENTRAIS ELETRICAS BRAS-RTS | — | 3 | 0.02289 | 0.592 | 公益事業 | |
| RUMO SA | 40 | 75 | 183 | 4,741 | 運輸 | |
| IRB BRASIL RESSEGUROS SA | 4 | 51 | 189 | 4,900 | 保険 | |
| BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | — | 17 | 119 | 3,090 | 各種金融 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数 <比率> | 1,869 | 4,135 | 12,381 | 320,424 | |
| | | 49 | 55 | — | < 3.8% > | |
| (チリ) | | | | 千チリペソ | | |
| BANCO SANTANDER CHILE | 2,416 | 4,322 | 18,575 | 2,516 | 銀行 | |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES | 1 | 3 | 12,700 | 1,720 | 銀行 | |
| BANCO DE CHILE | 931 | 3,191 | 26,072 | 3,532 | 銀行 | |
| EMPRESAS CMPC SA | 45 | 89 | 15,670 | 2,123 | 素材 | |
| EMPRESAS COPEC SA | 14 | 26 | 16,832 | 2,280 | エネルギー | |
| CIA CERVECERIAS UNIDAS SA | 5 | 8 | 6,543 | 886 | 食品・飲料・タバコ | |
| EMPRESA NACIONAL DE TELECOM | 5 | 12 | 5,857 | 793 | 電気通信サービス | |
| ENEL AMERICAS SA | 1,052 | 2,866 | 44,264 | 5,997 | 公益事業 | |
| COLBUN SA | 289 | 617 | 7,071 | 958 | 公益事業 | |
| AGUAS ANDINAS SA-A | 95 | 203 | 6,690 | 906 | 公益事業 | |
| EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B | 9 | 18 | 3,866 | 523 | 食品・飲料・タバコ | |
| LATAM AIRLINES GROUP | 11 | 23 | 20,218 | 2,739 | 運輸 | |
| SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA | 3 | 9 | 17,591 | 2,383 | 素材 | |
| S. A. C. I. FALABELLA | 26 | 52 | 16,905 | 2,290 | 小売 | |
| CENCOSUD SA | 52 | 83 | 8,548 | 1,158 | 食品・生活必需品小売り | |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-RIGHTS | 0.12 | — | — | — | 銀行 | |
| ENEL CHILE SA | 719 | 2,275 | 13,741 | 1,861 | 公益事業 | |
| ITAU CORPBANCA | 5,630 | 12,309 | 4,923 | 667 | 銀行 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数 <比率> | 11,310 | 26,114 | 246,071 | 33,342 | |
| | | 18 | 17 | — | < 0.4% > | |
| (コロンビア) | | | | 千コロンビアペソ | | |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA | 14 | 32 | 61,590 | 1,921 | 公益事業 | |
| ECOPETRO SA | 180 | 341 | 112,491 | 3,509 | エネルギー | |
| GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF | 4 | — | — | — | 各種金融 | |
| GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF | 129 | 283 | 40,153 | 1,252 | 銀行 | |
| CEMENTOS ARGOS SA | 16 | — | — | — | 素材 | |
| GRUPO ARGOS SA | 10 | 22 | 39,510 | 1,232 | 素材 | |
| BANCOLOMBIA SA | 8 | 17 | 71,606 | 2,234 | 銀行 | |
| BANCOLOMBIA SA-PREF | 16 | 31 | 134,397 | 4,193 | 銀行 | |
| GRUPO DE INV SURAMERICANA | 8 | 19 | 62,078 | 1,936 | 各種金融 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数 <比率> | 389 | 747 | 521,827 | 16,281 | |
| | | 9 | 7 | — | < 0.2% > | |

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 |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | 千ユーロ | | |
| TITAN CEMENT INTERNATIONAL T | — | 3 | 6 | 744 | 素材 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | — — | 3 1 | 6 — | 744 < 0.0%> | |
| (ユーロ…ギリシャ) | | | | | | |
| HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 8 | 18 | 25 | 3,095 | 電気通信サービス | |
| MOTOR OIL (HELLAS) CORINTH REFINERIES SA | — | 3 | 7 | 883 | エネルギー | |
| OPAP SA | 8 | 13 | 14 | 1,787 | 消費者サービス | |
| JUMBO S. A. | 3 | 8 | 14 | 1,764 | 小売 | |
| TITAN CEMENT CO. S. A. | 1 | — | — | — | 素材 | |
| FOLLI FOLLIE GROUP | 1 | 1 | 0.5904 | 71 | 耐久消費財・アパレル | |
| NATIONAL BANK OF GREECE | — | 42 | 13 | 1,580 | 銀行 | |
| EUROBANK ERGASIAS SA | — | 191 | 18 | 2,215 | 銀行 | |
| ALPHA BANK AE | 50 | 94 | 18 | 2,187 | 銀行 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 74 6 | 373 8 | 112 — | 13,584 < 0.2%> | |
| ユーロ計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 74 6 | 377 9 | 118 — | 14,328 < 0.2%> | |
| (トルコ) | | | | 千トルコリラ | | |
| AKBANK T. A. S. | 80 | 201 | 156 | 2,992 | 銀行 | |
| ANADOLU EFES BIRACILIK VE | 7 | 7 | 16 | 314 | 食品・飲料・タバコ | |
| ARCELIK AS | 8 | 8 | 17 | 332 | 耐久消費財・アパレル | |
| ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 7 | 21 | 39 | 752 | 資本財 | |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 51 | 82 | 66 | 1,261 | 素材 | |
| FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 2 | 2 | 16 | 313 | 自動車・自動車部品 | |
| KOC HOLDING AS | 27 | 61 | 122 | 2,333 | 資本財 | |
| PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS | 27 | — | — | — | 素材 | |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS | 28 | — | — | — | 資本財 | |
| TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI | 20 | 44 | 61 | 1,166 | 運輸 | |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 40 | 89 | 120 | 2,304 | 電気通信サービス | |
| TURKIYE GARANTI BANKASI | 84 | 162 | 164 | 3,131 | 銀行 | |
| TURKIYE IS BANKASI-C | 57 | 96 | 59 | 1,136 | 銀行 | |
| TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE | 4 | 10 | 124 | 2,374 | エネルギー | |
| HACI OMER SABANCI HOLDING | 33 | 71 | 65 | 1,243 | 各種金融 | |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 7 | 29 | 137 | 2,624 | 食品・生活必需品小売り | |
| TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS | 5 | 17 | 47 | 901 | 運輸 | |
| TURKIYE HALK BANKASI A. S. | 22 | — | — | — | 銀行 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 519 18 | 907 15 | 1,214 — | 23,182 < 0.3%> | |
| (チェコ) | | | | 千チェココ罗纳 | | |
| KOMERCNI BANKA AS | 2 | 5 | 434 | 2,054 | 銀行 | |
| CEZ AS | 5 | 11 | 582 | 2,756 | 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 | 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 | |
| MONETA MONEY BANK AS | | 17 | 39 | 306 | 1,447 | 銀行 |
| 小計 | | 26 | 56 | 1,323 | 6,258 | |
| | | 3 | 3 | — | < 0.1% > | |
| (ハンガリー) | | | | 千ハンガリーフォリント | | |
| OTP BANK PLC | | 8 | 16 | 23,121 | 8,344 | 銀行 |
| RICHTER GEDEON NYRT | | 5 | 10 | 6,303 | 2,274 | 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 | 28 | 8,388 | 3,027 | エネルギー |
| 小計 | | 27 | 55 | 37,812 | 13,646 | |
| | | 3 | 3 | — | < 0.2% > | |
| (ポーランド) | | | | 千ポーランドズロチ | | |
| BANK MILLENNIUM SA | | 22 | 48 | 26 | 755 | 銀行 |
| MBANK SA | | 0.54 | 0.79 | 29 | 823 | 銀行 |
| BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA | | 1 | — | — | — | 銀行 |
| KGHM POLSKA MIEDZ SA | | 5 | 11 | 99 | 2,786 | 素材 |
| BANK PEKAO SA | | 5 | 11 | 124 | 3,485 | 銀行 |
| ORANGE POLSKA SA | | 24 | 43 | 27 | 770 | 電気通信サービス |
| POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | | 10 | 22 | 209 | 5,877 | エネルギー |
| LPP SA | | 0.05 | 0.09 | 78 | 2,193 | 耐久消費財・アパレル |
| SANTANDER BANK POLSKA SA | | 1 | 2 | 69 | 1,949 | 銀行 |
| CD PROJEKT SA | | 2 | 4 | 123 | 3,449 | メディア・娯楽 |
| PKO BANK POLSKI SA | | 34 | 64 | 233 | 6,530 | 銀行 |
| CCC SA | | 1 | 2 | 31 | 888 | 耐久消費財・アパレル |
| GRUPA LOTOS SA | | 3 | 5 | 50 | 1,402 | エネルギー |
| POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I | | 63 | 143 | 66 | 1,856 | エネルギー |
| CYFROWY POLSAT SA | | 8 | 15 | 43 | 1,230 | メディア・娯楽 |
| PGE SA | | 30 | 70 | 61 | 1,727 | 公益事業 |
| POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | | 22 | 41 | 160 | 4,487 | 保険 |
| JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S | | 1 | — | — | — | 素材 |
| ALIOR BANK SA | | 3 | — | — | — | 銀行 |
| DINO POLSKA SA | | 1 | 3 | 49 | 1,386 | 食品・生活必需品小売り |
| AMREST HOLDINGS SE | | — | 7 | 34 | 973 | 消費者サービス |
| 小計 | | 244 | 500 | 1,519 | 42,575 | |
| | | 20 | 18 | — | < 0.5% > | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H | | 50 | 70 | 63 | 885 | 素材 |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | | 40 | 100 | 104 | 1,462 | 運輸 |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | | 60 | 80 | 39 | 548 | 運輸 |
| ANGANG STEEL CO LTD-H | | 40 | — | — | — | 素材 |
| CHINA MOBILE LTD | | 230 | 450 | 2,655 | 37,196 | 電気通信サービス |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | | 45 | 95 | 475 | 6,661 | 素材 |
| DATANG INTL POWER GENERATION COMPANY LTD | | 120 | 120 | 17 | 243 | 公益事業 |
| BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED | | 20 | 35 | 121 | 1,696 | 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 | |
| HUANENG POWER INTL INC-H | 160 | 220 | 85 | 1,195 | 公益事業 |
| YANZHOU COAL MINING CO-H | 60 | 100 | 69 | 969 | エネルギー |
| HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD | 25 | 55 | 284 | 3,983 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HUADIAN POWER INTL CORP-H | 20 | 120 | 34 | 479 | 公益事業 |
| CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR | 60 | 180 | 71 | 1,001 | 運輸 |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 120 | 220 | 177 | 2,490 | 自動車・自動車部品 |
| CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 180 | 340 | 605 | 8,488 | 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 | 280 | 735 | 10,297 | 不動産 |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 100 | 200 | 677 | 9,484 | 不動産 |
| CITIC LIMITED | 210 | 440 | 431 | 6,041 | 資本財 |
| CHINA TRAVEL INTL INV HK | 40 | - | - | - | 消費者サービス |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H | 60 | 100 | 74 | 1,036 | 運輸 |
| LENOVO GROUP LTD | 260 | 500 | 258 | 3,621 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| PETROCHINA CO LTD | 780 | 1,580 | 570 | 7,991 | エネルギー |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD | 220 | 460 | 308 | 4,317 | 電気通信サービス |
| CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD | 60 | 106 | 191 | 2,687 | 保険 |
| CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H | 940 | 1,880 | 825 | 11,562 | エネルギー |
| TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H | 10 | - | - | - | 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 | 80 | 152 | 2,136 | ソフトウェア・サービス |
| KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP | 40 | 170 | 131 | 1,848 | ソフトウェア・サービス |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 30 | 59 | 501 | 7,026 | 公益事業 |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD | 120 | 240 | 159 | 2,229 | 公益事業 |
| TOWNGAS CHINA CO LTD | 40 | 40 | 22 | 309 | 公益事業 |
| COSCO SHIPPING PORTS LIMITED | 60 | 100 | 63 | 892 | 運輸 |
| YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD | 260 | 440 | 73 | 1,029 | 不動産 |
| CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD | 41 | 101 | 123 | 1,730 | 運輸 |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD | 140 | 200 | 48 | 672 | 素材 |
| WHARF HOLDINGS LTD | - | 90 | 170 | 2,388 | 不動産 |
| CHINA EVERBRIGHT LIMITED | 40 | 80 | 100 | 1,412 | 各種金融 |
| CHINA GAS HOLDINGS LIMITED | 64 | 138 | 401 | 5,626 | 公益事業 |
| KINGBOARD HOLDINGS LIMITED | 25 | 45 | 96 | 1,358 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED | 180 | 370 | 541 | 7,588 | 自動車・自動車部品 |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD | 120 | 160 | 49 | 690 | 不動産 |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD | 40 | 60 | 261 | 3,665 | 公益事業 |
| BYD CO LTD-H | 25 | 45 | 167 | 2,342 | 自動車・自動車部品 |
| CHINA TELECOM CORP LTD | 500 | 1,060 | 313 | 4,395 | 電気通信サービス |
| CHINA OILFIELD SERVICES-H | 60 | 100 | 105 | 1,476 | エネルギー |
| SINOTRANS LIMITED | 80 | 80 | 19 | 273 | 運輸 |
| MAANSHAN IRON&STEEL-H | - | 60 | 17 | 249 | 素材 |
| CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED | 90 | 260 | 153 | 2,156 | 商業・専門サービス |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED | 60 | 60 | 31 | 445 | 素材 |
| PICC PROPERTY & CASUALTY - H | 240 | 520 | 471 | 6,600 | 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 | |
| AVICHINA INDUSTRY & TECH CO | 80 | 130 | 46 | 650 | 資本財 |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD | 80 | 120 | 122 | 1,711 | 公益事業 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED | 115 | 250 | 151 | 2,119 | 自動車・自動車部品 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO. | 270 | 550 | 1,087 | 15,241 | 保険 |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 220 | 420 | 123 | 1,724 | 素材 |
| MMG LIMITED | 80 | — | — | — | 素材 |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 80 | 160 | 151 | 2,118 | ヘルスケア機器・サービス |
| WEICHAJ POWER CO | 70 | 140 | 187 | 2,624 | 資本財 |
| CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H | 20 | 80 | 25 | 362 | エネルギー |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L | 120 | 180 | 39 | 547 | 素材 |
| SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD | 20 | 50 | 70 | 987 | 資本財 |
| SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H | — | 60 | 62 | 877 | 運輸 |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 80 | 140 | 178 | 2,498 | 食品・飲料・タバコ |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 20 | 40 | 193 | 2,712 | 食品・飲料・タバコ |
| GUANGDONG INVESTMENT | 100 | 220 | 355 | 4,986 | 公益事業 |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS | 80 | 120 | 41 | 586 | 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 | 100 | 410 | 5,744 | 食品・飲料・タバコ |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 60 | 120 | 82 | 1,151 | 運輸 |
| CNOOC LTD | 650 | 1,310 | 1,488 | 20,849 | エネルギー |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 170 | 520 | 525 | 7,358 | 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 | 210 | 628 | 8,811 | 食品・飲料・タバコ |
| PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT | 195 | 405 | 3,592 | 50,328 | 保険 |
| LI NING COMPANY LIMITED | — | 135 | 338 | 4,747 | 耐久消費財・アパレル |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED | 200 | 360 | 138 | 1,936 | 公益事業 |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD | 390 | 390 | 26 | 377 | 小売 |
| CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT | 160 | 370 | 59 | 839 | 公益事業 |
| AIR CHINA/HONG KONG | 60 | 160 | 113 | 1,596 | 運輸 |
| ZTE CORPORATION | 26 | 62 | 129 | 1,811 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED | 100 | 260 | 62 | 877 | 資本財 |
| CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H | 125 | 255 | 386 | 5,415 | エネルギー |
| CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H | 95 | 220 | 63 | 890 | 運輸 |
| BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H | 320 | 670 | 344 | 4,824 | 銀行 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD | 80 | 120 | 74 | 1,037 | 資本財 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 3,570 | 7,000 | 4,361 | 61,097 | 銀行 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 30 | 56 | 577 | 8,096 | 耐久消費財・アパレル |
| DONGFENG MOTOR CORPORATION | 100 | 200 | 150 | 2,107 | 自動車・自動車部品 |
| AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED | 60 | 80 | 87 | 1,228 | 不動産 |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 60 | 140 | 111 | 1,563 | 素材 |
| CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD | 140 | 280 | 211 | 2,965 | 素材 |
| BANK OF CHINA LTD | 2,910 | 5,810 | 1,824 | 25,559 | 銀行 |
| SHUI ON LAND LIMITED | 135 | 135 | 22 | 310 | 不動産 |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED | 45 | 80 | 226 | 3,177 | 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 | |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD | 30 | — | — | — | 不動産 |
| GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H | 36 | 60 | 78 | 1,106 | 不動産 |
| CHINA MERCHANTS BANK- H | 145 | 285 | 1,054 | 14,773 | 銀行 |
| INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA | 2,580 | 4,750 | 2,650 | 37,133 | 銀行 |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H | 20 | 55 | 44 | 624 | 素材 |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD | 20 | 70 | 61 | 865 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 80 | 200 | 105 | 1,476 | 資本財 |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H | 160 | 310 | 188 | 2,644 | 資本財 |
| CHINA COAL ENERGY COMPANY - H | 40 | 110 | 34 | 477 | エネルギー |
| HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 20 | 40 | 70 | 980 | 資本財 |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD | 20 | 40 | 107 | 1,499 | 資本財 |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO | 50 | 90 | 195 | 2,742 | 耐久消費財・アパレル |
| CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS | 40 | 110 | 45 | 633 | 食品・飲料・タバコ |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY | 280 | 560 | 610 | 8,551 | 不動産 |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD | 150 | 210 | 56 | 788 | 素材 |
| CHINA CITIC BANK | 330 | 680 | 291 | 4,077 | 銀行 |
| KWG GROUP HOLDINGS LIMITED | 45 | 80 | 68 | 963 | 不動産 |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 26 | 53 | 679 | 9,526 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED | 40 | 80 | 588 | 8,249 | 耐久消費財・アパレル |
| FOSUN INTERNATIONAL | 95 | 180 | 189 | 2,657 | 資本財 |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED | 200 | 360 | 187 | 2,622 | 不動産 |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD. | 110 | 190 | 55 | 771 | 不動産 |
| BOSIDENG INTL HOLDGS LTD | — | 260 | 97 | 1,362 | 耐久消費財・アパレル |
| SOHO CHINA LTD | 75 | 75 | 20 | 283 | 不動産 |
| KINGSOFT CORPORATION LTD. | 30 | 60 | 103 | 1,455 | ソフトウェア・サービス |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 10 | 35 | 46 | 648 | 資本財 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 150 | 280 | 128 | 1,796 | 資本財 |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD | 50 | 80 | 63 | 891 | 食品・飲料・タバコ |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 25 | 55 | 77 | 1,078 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H | 70 | 145 | 117 | 1,641 | 資本財 |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED | 180 | 330 | 222 | 3,116 | 食品・飲料・タバコ |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 96 | 196 | 542 | 7,606 | 保険 |
| CRRC CORP LTD-H | 150 | 310 | 159 | 2,236 | 資本財 |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD | 85 | 175 | 155 | 2,172 | 食品・生活必需品小売り |
| BBMG CORPORATION - H | 90 | 90 | 19 | 272 | 素材 |
| CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD | 28 | 88 | 27 | 385 | 素材 |
| SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H | 44 | 84 | 217 | 3,042 | ヘルスケア機器・サービス |
| CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED | 80 | 180 | 168 | 2,362 | 素材 |
| METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA LTD-H | 110 | 110 | 17 | 251 | 資本財 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H | 112 | 212 | 177 | 2,483 | 自動車・自動車部品 |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | — | 115 | 47 | 662 | 素材 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H | 90 | 130 | 50 | 708 | 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 LONGYUAN POWER GROUP | 120 | 270 | 114 | 1,603 | 公益事業 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 32 | 46 | 64 | 904 | ヘルスケア機器・サービス |
| HUANENG RENEWABLES CORP-H | 180 | 300 | 89 | 1,256 | 公益事業 |
| SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS | 140 | — | — | — | 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 | 180 | 686 | 9,620 | 不動産 |
| YUZHOU PROPERTIES COMPANY | 60 | 170 | 61 | 857 | 不動産 |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H | — | 130 | 72 | 1,009 | 資本財 |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 55 | 135 | 432 | 6,061 | 不動産 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED | 30 | 54 | 162 | 2,280 | 保険 |
| CHINA MINSHENG BANKING-H | 246 | 511 | 278 | 3,901 | 銀行 |
| KAISA GROUP HOLDINGS LTD | 80 | 210 | 64 | 906 | 不動産 |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H | 22 | 66 | 57 | 807 | 資本財 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 90 | 210 | 70 | 994 | 銀行 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA | 1,080 | 2,170 | 687 | 9,637 | 銀行 |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 20 | 45 | 124 | 1,749 | 小売 |
| FAR EAST HORIZON LTD | 70 | 180 | 127 | 1,792 | 各種金融 |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 85 | 135 | 196 | 2,750 | 各種金融 |
| SEAZEN GROUP LTD | 60 | 100 | 83 | 1,168 | 不動産 |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED | 50 | 100 | 111 | 1,560 | 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 | 188 | 147 | 2,059 | 各種金融 |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 25 | 50 | 274 | 3,845 | 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 | 540 | 169 | 2,375 | 保険 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H | 20 | 30 | 66 | 924 | 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 | 220 | 125 | 1,756 | 不動産 |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP-H | 50 | 75 | 34 | 482 | 資本財 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO | 120 | 255 | 101 | 1,421 | 各種金融 |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED | 30 | 50 | 32 | 459 | 自動車・自動車部品 |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD | — | 100 | 82 | 1,148 | 資本財 |
| CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD | — | 80 | 184 | 2,586 | 各種金融 |
| GREENTOWN SERVICE GROUP | 40 | 100 | 85 | 1,200 | 商業・専門サービス |
| JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD | 40 | — | — | — | 不動産 |
| CHINA EVERGRANDE GROUP | 100 | 130 | 242 | 3,402 | 不動産 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H | 22 | 50 | 59 | 833 | 各種金融 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H | 100 | 590 | 299 | 4,199 | 銀行 |
| YIHA! INTERNATIONAL HOLDING LTD | — | 30 | 149 | 2,093 | 食品・飲料・タバコ |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 20 | 60 | 113 | 1,588 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL | 110 | 200 | 199 | 2,796 | 半導体・半導体製造装置 |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS | 40 | 80 | 202 | 2,835 | 商業・専門サービス |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD | — | 140 | 70 | 990 | 不動産 |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | — | 26 | 135 | 1,897 | ヘルスケア機器・サービス |
| CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD | 120 | 180 | 7 | 103 | 自動車・自動車部品 |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED | — | 30 | 31 | 445 | 消費者サービス |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 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 | |
| A-LIVING SERVICES CO LTD-H | — | 35 | 88 | 1,238 | 商業・専門サービス |
| CHINA TOWER CORP LTD-H | 1,260 | 3,140 | 502 | 7,038 | 電気通信サービス |
| XIAOMI CORP-CLASS B | — | 564 | 504 | 7,071 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WUXI APTEC CO LTD | — | 13 | 121 | 1,705 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MEITUAN DIANPING-CLASS B | — | 75 | 774 | 10,843 | 小売 |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD | — | 30 | 98 | 1,382 | 消費者サービス |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 120 | 240 | 115 | 1,617 | 半導体・半導体製造装置 |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | — | 60 | 164 | 2,303 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H | 320 | 640 | 104 | 1,461 | 各種金融 |
| LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD | 60 | 100 | 114 | 1,605 | 不動産 |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED | 60 | 125 | 380 | 5,332 | 資本財 |
| CHINA AOYUAN GROUP LTD | — | 90 | 100 | 1,412 | 不動産 |
| CHINA EAST EDUCATION HOLDING | — | 40 | 57 | 811 | 消費者サービス |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD | 35 | 80 | 132 | 1,853 | 運輸 |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | — | 40 | 92 | 1,294 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TENCENT HOLDINGS LIMITED | 209 | 416 | 13,802 | 193,378 | メディア・娯楽 |
| CHINA YANKE CO LTD -H | 43 | 103 | 301 | 4,228 | 不動産 |
| LUYE PHARMA GROUP | 45 | 95 | 54 | 765 | 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 | 1,100 | 143 | 2,003 | メディア・娯楽 |
| CAR INC | 30 | — | — | — | 運輸 |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED | 20 | 20 | 27 | 388 | 半導体・半導体製造装置 |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI | 120 | 240 | 212 | 2,979 | ヘルスケア機器・サービス |
| CGN POWER CO LTD-H | 390 | 700 | 137 | 1,922 | 公益事業 |
| FULLSHARE HOLDING LTD | 250 | — | — | — | 資本財 |
| BAIC MOTOR CORP LTD-H | 65 | 155 | 68 | 953 | 自動車・自動車部品 |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 50 | 76 | 63 | 892 | 各種金融 |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 20 | 28 | 64 | 906 | 自動車・自動車部品 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 60 | 108 | 126 | 1,776 | 各種金融 |
| 3SBIO INC | 35 | 105 | 118 | 1,662 | 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 | 20 | 32 | 451 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL | 70 | 120 | 82 | 1,149 | 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 | 530 | 60 | 846 | 各種金融 |
| CHINA LITERATURE LTD | 6 | 14 | 42 | 589 | メディア・娯楽 |
| SSY GROUP LIMITED | 20 | 100 | 61 | 863 | 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 | 110 | 58 | 819 | 食品・飲料・タバコ |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H | 30 | 100 | 42 | 588 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CHINA REINSURANCE GROUP CO-H | 210 | 300 | 37 | 521 | 保険 |
| MEITU INC | 45 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| BOC AVIATION LTD | 8 | 13 | 96 | 1,346 | 資本財 |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 6 | 28 | 75 | 1,061 | 保険 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H | 40 | 80 | 107 | 1,510 | 各種金融 |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 15 | 40 | 353 | 4,956 | 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 | 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 |
| HENGTEN NETWORKS GROUP LTD | 400 | — | — | — | 小売 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 32,443 | 64,009 | 67,581 | 946,811 | |
| | | 197 | 208 | — | <11.3%> | |
| (マレーシア) | | | | 千マレーシアリンギット | | |
| AMMB HOLDINGS BERHAD | 61 | 101 | 40 | 1,057 | 銀行 | |
| GENTING PLANTATIONS BERHAD | 9 | 9 | 9 | 243 | 食品・飲料・タバコ | |
| CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD | 169 | 333 | 172 | 4,526 | 銀行 | |
| DIGI.COM BHD | 114 | 218 | 97 | 2,562 | 電気通信サービス | |
| MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 30 | 83 | 68 | 1,807 | 運輸 | |
| RHB BANK BHD | 29 | 118 | 66 | 1,752 | 銀行 | |
| HAP SENG CONSOLIDATED | 23 | 39 | 38 | 1,013 | 資本財 | |
| GAMUDA BHD | 63 | 133 | 50 | 1,312 | 資本財 | |
| YTL CORP BHD | 160 | 160 | 13 | 350 | 公益事業 | |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP | 8 | 19 | 30 | 812 | 銀行 | |
| HONG LEONG BANK BERHAD | 24 | 47 | 79 | 2,084 | 銀行 | |
| IJM CORP BHD | 106 | 185 | 38 | 1,014 | 資本財 | |
| KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD | 18 | 35 | 81 | 2,143 | 食品・飲料・タバコ | |
| FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD | 5 | 12 | 41 | 1,093 | 食品・飲料・タバコ | |
| MALAYAN BANKING BERHAD | 141 | 296 | 252 | 6,625 | 銀行 | |
| ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD | 37 | — | — | — | 銀行 | |
| MISC BHD | 49 | 83 | 67 | 1,775 | 運輸 | |
| NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 2 | 6 | 85 | 2,256 | 食品・飲料・タバコ | |
| PPB GROUP BERHAD | 20 | 41 | 75 | 1,977 | 食品・飲料・タバコ | |
| PETRONAS DAGANGAN BHD | 9 | 19 | 43 | 1,141 | エネルギー | |
| PETRONAS GAS BHD | 25 | 43 | 66 | 1,748 | 公益事業 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO MALAYSIA BERHAD | 5 | 5 | 8 | 213 | 食品・飲料・タバコ | |
| TELEKOM MALAYSIA BHD | 41 | 82 | 30 | 809 | 電気通信サービス | |
| SP SETIA BHD | 55 | — | — | — | 不動産 | |
| TENAGA NASIONAL BHD | 125 | 233 | 306 | 8,045 | 公益事業 | |
| QL RESOURCES BHD | — | 53 | 38 | 1,008 | 食品・飲料・タバコ | |
| DIALOG GROUP BHD | 114 | 292 | 97 | 2,566 | エネルギー | |
| PUBLIC BANK BERHAD | 107 | 226 | 443 | 11,635 | 銀行 | |
| AIRASIA GROUP BERHAD | 55 | 55 | 9 | 243 | 運輸 | |
| TOP GLOVE CORPORATION BHD | 52 | 87 | 39 | 1,027 | ヘルスケア機器・サービス | |
| GENTING BHD | 85 | 152 | 88 | 2,325 | 消費者サービス | |
| GENTING MALAYSIA BHD | 109 | 175 | 54 | 1,441 | 消費者サービス | |
| IOI CORPORATION BERHAD | 81 | 140 | 60 | 1,598 | 食品・飲料・タバコ | |
| SIME DARBY BERHAD | 87 | 235 | 52 | 1,387 | 資本財 | |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD | 48 | 126 | 66 | 1,735 | ヘルスケア機器・サービス | |
| AXIATA GROUP BERHAD | 99 | 219 | 90 | 2,373 | 電気通信サービス | |
| MAXIS BERHAD | 72 | 187 | 96 | 2,541 | 電気通信サービス | |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 88 | 168 | 118 | 3,112 | 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 | | |
| IHH HEALTHCARE BHD | 75 | 156 | 83 | 2,198 | ヘルスケア機器・サービス | |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD | 37 | 37 | 15 | 404 | 運輸 | |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS | 48 | 87 | 40 | 1,072 | 素材 | |
| SIME DARBY PROPERTY BHD | 87 | — | — | — | 不動産 | |
| SIME DARBY PLANTATION BHD | 87 | 150 | 74 | 1,960 | 食品・飲料・タバコ | |
| IOI PROPERTIES GROUP BHD | 61 | — | — | — | 不動産 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率> | 2,720 | 4,845 | 3,239 | 85,001 | |
| | | 43 | 40 | — | <1.0%> | |
| (タイ) | | | 千タイパーツ | | | |
| BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG | 9 | 31 | 547 | 1,986 | 銀行 | |
| BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR | 44 | 73 | 332 | 1,205 | 食品・生活必需品小売り | |
| KRUNG THAI BANK PCL-NVDR | 128 | 292 | 478 | 1,738 | 銀行 | |
| RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR | — | 48 | 339 | 1,232 | 公益事業 | |
| ROBINSON DEPARTMENT STORE PLC-NVDR | 18 | 41 | 269 | 978 | 小売 | |
| SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR | 67 | 56 | 677 | 2,459 | 銀行 | |
| TRUE CORPORATION PCL-NVDR | 367 | 765 | 339 | 1,232 | 電気通信サービス | |
| KASIKORN BANK PUBLIC COMPANY LTD- NVDR | 25 | 55 | 852 | 3,094 | 銀行 | |
| TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR | 401 | 1,357 | 217 | 788 | 銀行 | |
| IRPC PCL-NVDR | 367 | 532 | 186 | 675 | エネルギー | |
| BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR | 76 | 374 | 433 | 1,574 | エネルギー | |
| ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR | 5 | 19 | 655 | 2,379 | 公益事業 | |
| INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR | — | 147 | 863 | 3,134 | 電気通信サービス | |
| CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR | 110 | 254 | 698 | 2,535 | 食品・飲料・タバコ | |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 38 | 89 | 1,886 | 6,849 | 電気通信サービス | |
| HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR | 145 | 418 | 689 | 2,503 | 小売 | |
| DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR | 18 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR | 390 | 843 | 3,645 | 13,234 | エネルギー | |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 70 | 219 | 302 | 1,097 | 食品・飲料・タバコ | |
| LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR | 111 | 548 | 537 | 1,949 | 不動産 | |
| SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR | 14 | 58 | 2,209 | 8,021 | 素材 | |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR | 157 | 319 | 2,408 | 8,742 | 運輸 | |
| KASIKORN BANK PUBLIC COMPANY LTD- FOREIGN | 43 | 89 | 1,379 | 5,007 | 銀行 | |
| CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR | 49 | 173 | 1,076 | 3,909 | 不動産 | |
| BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR | 142 | 709 | 1,744 | 6,331 | ヘルスケア機器・サービス | |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR | 13 | 32 | 433 | 1,573 | ヘルスケア機器・サービス | |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 83 | 194 | 746 | 2,711 | 消費者サービス | |
| THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR | 41 | 91 | 627 | 2,279 | エネルギー | |
| GLOW ENERGY PLC- NVDR | 19 | — | — | — | 公益事業 | |
| CP ALL PCL-NVDR | 181 | 432 | 3,283 | 11,918 | 食品・生活必需品小売り | |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR | 214 | 468 | 641 | 2,327 | 運輸 | |
| PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR | 51 | 106 | 1,272 | 4,617 | エネルギー | |
| TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL -NVDR | — | 46 | 246 | 893 | 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 |
| INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 58 | 142 | 493 | 1,791 | 素材 | |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR | 83 | 148 | 795 | 2,887 | 素材 | |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 41 | 110 | 470 | 1,707 | 公益事業 | |
| BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR | 274 | 547 | 590 | 2,144 | 運輸 | |
| B GRIMM POWER PCL-NVDR | — | 68 | 360 | 1,308 | 公益事業 | |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | — | 35 | 584 | 2,121 | 公益事業 | |
| OSOTSPA PCL-NVDR | — | 70 | 287 | 1,041 | 食品・飲料・タバコ | |
| SRISAWAD CORP PCL-NVDR | — | 63 | 395 | 1,435 | 各種金融 | |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR | — | 42 | 253 | 918 | 各種金融 | |
| GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR | — | 58 | 472 | 1,715 | 公益事業 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,852 34 | 10,161 41 | 34,726 — | 126,056 <1.5%> | |
| (フィリピン) | | | 千フィリピンペソ | | | |
| AYALA LAND INC | 270 | 559 | 2,543 | 5,493 | 不動産 | |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 72 | 164 | 805 | 1,739 | 資本財 | |
| BANK OF PHILIPPINE ISLANDS | 32 | 77 | 664 | 1,436 | 銀行 | |
| ALLIANCE GLOBAL GROUP, INC. | 150 | — | — | — | 資本財 | |
| DMCI HOLDINGS INC | 146 | — | — | — | 資本財 | |
| GLOBE TELECOM INC | 1 | 2 | 426 | 921 | 電気通信サービス | |
| INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 18 | 72 | 898 | 1,940 | 運輸 | |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC | 105 | 200 | 1,543 | 3,333 | 資本財 | |
| JOLLIBEE FOODS CORPORATION | 15 | 25 | 489 | 1,057 | 消費者サービス | |
| METROPOLITAN BANK & TRUST | 23 | 130 | 863 | 1,866 | 銀行 | |
| MEGAWORLD CORP | 410 | 920 | 407 | 880 | 不動産 | |
| ROBINSONS LAND CO | 76 | 172 | 450 | 973 | 不動産 | |
| SECURITY BANK CORP | 8 | 20 | 414 | 894 | 銀行 | |
| SM PRIME HOLDINGS INC | 376 | 761 | 2,967 | 6,410 | 不動産 | |
| UNIVERSAL ROBINA CORP | 32 | 71 | 1,067 | 2,305 | 食品・飲料・タバコ | |
| SM INVESTMENTS CORP | 8 | 16 | 1,764 | 3,812 | 資本財 | |
| AYALA CORPORATION | 9 | 19 | 1,563 | 3,377 | 資本財 | |
| METRO PACIFIC INVESTMENTS CO | 519 | 1,109 | 476 | 1,030 | 各種金融 | |
| ABOITIZ POWER CORP | 54 | 120 | 413 | 892 | 公益事業 | |
| MANILA ELECTRIC COMPANY | 8 | 13 | 430 | 930 | 公益事業 | |
| BDO UNIBANK INC | 72 | 135 | 2,049 | 4,426 | 銀行 | |
| GT CAPITAL HOLDINGS INC | 3 | 6 | 536 | 1,159 | 資本財 | |
| PLDT INC | 3 | 5 | 569 | 1,230 | 電気通信サービス | |
| ALTUS SAN NICOLAS CORP-NEW | — | 1 | 0.75774 | 1 | 不動産 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,415 23 | 4,602 22 | 21,349 — | 46,114 <0.6%> | |
| (インドネシア) | | | 千インドネシアルピア | | | |
| BARITO PACIFIC TBK PT | — | 2,082 | 283,152 | 2,208 | 素材 | |
| PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES | 61 | 122 | 255,285 | 1,991 | エネルギー | |

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 | | |
| PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK | 161 | 356 | 283,020 | 2,207 | 食品・飲料・タバコ | |
| CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 270 | 536 | 360,460 | 2,811 | 食品・飲料・タバコ | |
| PT GUDANG GARAM TBK | 18 | 40 | 201,500 | 1,571 | 食品・飲料・タバコ | |
| PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK | 341 | 547 | 105,844 | 825 | 食品・飲料・タバコ | |
| INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA | 67 | 132 | 256,080 | 1,997 | 素材 | |
| INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | 102 | 161 | 109,480 | 853 | 素材 | |
| BUKIT ASAM TBK PT | — | 104 | 25,168 | 196 | エネルギー | |
| PT BANK DANAMON INDONESIA TBK | 123 | — | — | — | 銀行 | |
| PT BANK MANDIRI | 684 | 1,396 | 973,710 | 7,594 | 銀行 | |
| PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT | — | 129 | 118,680 | 925 | 素材 | |
| PT UNILEVER INDONESIA TBK | 56 | 105 | 438,900 | 3,423 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| PT BANK RAKYAT | 2,033 | 4,096 | 1,675,264 | 13,067 | 銀行 | |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT | 400 | 656 | 125,952 | 982 | 公益事業 | |
| BANK NEGARA INDONESIA PT | 273 | 521 | 390,750 | 3,047 | 銀行 | |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT | 109 | 213 | 243,885 | 1,902 | 素材 | |
| PT BANK CENTRAL ASIA TBK | 361 | 721 | 2,263,940 | 17,658 | 銀行 | |
| XL AXIATA TBK PT | — | 354 | 118,236 | 922 | 電気通信サービス | |
| JASA MARGA(PERSERO)TBK PT | 80 | 80 | 39,520 | 308 | 運輸 | |
| BUMI SERPONG DAMAI PT | 282 | 282 | 35,250 | 274 | 不動産 | |
| ADARO ENERGY TBK PT | 527 | 1,159 | 142,557 | 1,111 | エネルギー | |
| PAKUWON JATI TBK PT | 794 | 794 | 44,861 | 349 | 不動産 | |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT | 85 | 143 | 161,947 | 1,263 | 食品・飲料・タバコ | |
| TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE | 75 | — | — | — | 電気通信サービス | |
| BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO | 155 | 155 | 33,015 | 257 | 銀行 | |
| KALBE FARMA PT | 773 | 1,531 | 233,477 | 1,821 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ACE HARDWARE INDONESIA | — | 669 | 105,702 | 824 | 小売 | |
| PT ASTRA INTERNATIONAL TBK | 741 | 1,513 | 983,450 | 7,670 | 自動車・自動車部品 | |
| PT SURYA CITRA MEDIA TBK | 214 | — | — | — | メディア・娯楽 | |
| TELEKOMUNIKASI TBK PT | 1,846 | 3,666 | 1,440,738 | 11,237 | 電気通信サービス | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 10,631 | 22,263 | 11,449,824 | 89,308 | |
| | 銘柄数 <比率> | 26 | 28 | — | <1.1%> | |
| (韓国) | | | | 千韓国ウォン | | |
| CHEIL COMMUNICATIONS INC | 2 | 5 | 12,605 | 1,174 | メディア・娯楽 | |
| HANMI SCIENCE CO LTD | 0.47 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| HYUNDAI MOTOR COMPANY | 1 | 2 | 21,544 | 2,007 | 自動車・自動車部品 | |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS | 1 | 2 | 51,847 | 4,832 | 保険 | |
| DB INSURANCE CO LTD | 1 | 3 | 19,996 | 1,863 | 保険 | |
| WOONGJIN COWAY CO LTD | 1 | 3 | 32,614 | 3,039 | 耐久消費財・アパレル | |
| KT&G CORPORATION | 4 | 8 | 85,281 | 7,948 | 食品・飲料・タバコ | |
| S1 CORPORATION | 0.63 | 1 | 9,921 | 924 | 商業・専門サービス | |
| KOREA GAS CORPORATION | 1 | 2 | 9,911 | 923 | 公益事業 | |
| CJ CORP | 0.53 | 0.9 | 8,289 | 772 | 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 | 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 | |
| KAKAO CORP | 1 | 3 | 53,336 | 4,970 | メディア・娯楽 |
| CJ ENM CO LTD | 0.28 | 0.57 | 8,698 | 810 | 小売 |
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING | — | 1 | 3,609 | 336 | 資本財 |
| KMW CO LTD | — | 2 | 11,182 | 1,042 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SK TELECOM CO LTD | 0.74 | 1 | 34,686 | 3,232 | 電気通信サービス |
| DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD | 1 | 1 | 14,833 | 1,382 | 資本財 |
| MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD | 13 | 28 | 20,771 | 1,935 | 各種金融 |
| NCSOFT CORP | 0.64 | 1 | 61,132 | 5,697 | メディア・娯楽 |
| LG UPLUS CORP | 7 | 6 | 8,696 | 810 | 電気通信サービス |
| DAEWOO ENGINEERING & CONSTR | 6 | 6 | 2,716 | 253 | 資本財 |
| POSCO INTERNATIONAL CORP | 1 | 4 | 8,048 | 750 | 資本財 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | 0.34 | 0.7 | 88,550 | 8,252 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| LG CHEM LTD | 1 | 3 | 104,516 | 9,740 | 素材 |
| LG CHEM LTD | 0.28 | 0.63 | 10,521 | 980 | 素材 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF | 0.08 | 0.17 | 12,648 | 1,178 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | 15 | 33 | 144,673 | 13,483 | 銀行 |
| S-OIL CORPORATION | 1 | 3 | 27,652 | 2,577 | エネルギー |
| HANWHA CHEMICAL CORP | 3 | 6 | 11,056 | 1,030 | 素材 |
| MERITZ SECURITIES CO LTD | — | 15 | 6,715 | 625 | 各種金融 |
| SAMSUNG SECURITIES CO,LTD. | 2 | 4 | 16,353 | 1,524 | 各種金融 |
| POSCO CHEMUCAL CO LTD | — | 2 | 9,668 | 901 | 素材 |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 0.56 | 1 | 26,840 | 2,501 | 素材 |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 1 | 2 | 21,852 | 2,036 | 小売 |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN | 1 | 2 | 32,880 | 3,064 | 資本財 |
| HYUNDAI MOBIS | 2 | 4 | 120,785 | 11,257 | 自動車・自動車部品 |
| HYNIX SEMICONDUCTOR INC | 21 | 39 | 322,710 | 30,076 | 半導体・半導体製造装置 |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO | 2 | 5 | 23,013 | 2,144 | 資本財 |
| HYUNDAI MOTOR COMPANY | 0.87 | 1 | 12,978 | 1,209 | 自動車・自動車部品 |
| HYUNDAI MOTOR CO | 5 | 11 | 133,463 | 12,438 | 自動車・自動車部品 |
| HYUNDAI STEEL COMPANY | 2 | 6 | 20,891 | 1,947 | 素材 |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 9 | 18 | 21,937 | 2,044 | 銀行 |
| KCC CORP | 0.21 | 0.36 | 7,812 | 728 | 資本財 |
| KIA MOTORS CORPORATION | 9 | 19 | 85,029 | 7,924 | 自動車・自動車部品 |
| KOREA ZINC CO., LTD. | 0.31 | 0.68 | 27,608 | 2,573 | 素材 |
| KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION | 9 | 17 | 49,243 | 4,589 | 公益事業 |
| HANWHA CORPORATION | 1 | 1 | 4,050 | 377 | 資本財 |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 1 | 2 | 7,301 | 680 | 運輸 |
| OCI COMPANY LTD | 0.61 | 1 | 6,809 | 634 | 素材 |
| CJ LOGISTICS CORPORATION | 0.29 | 0.74 | 11,655 | 1,086 | 運輸 |
| KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD | 0.67 | 1 | 8,260 | 769 | 素材 |
| HLB INC | 1 | 2 | 30,041 | 2,799 | 耐久消費財・アパレル |
| LG ELECTRONICS INC | 3 | 7 | 51,166 | 4,768 | 耐久消費財・アパレル |

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 | |
| LOTTE CORPORATION | 1 | 1 | 3,850 | 358 | 資本財 |
| LG CORP | 3 | 6 | 46,292 | 4,314 | 資本財 |
| WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD | 5 | 7 | 9,275 | 864 | 各種金融 |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCT | 1 | 5 | 15,360 | 1,431 | 資本財 |
| NAVER CORPORATION | 5 | 10 | 177,160 | 16,511 | メディア・娯楽 |
| HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD | 0.51 | 1 | 10,982 | 1,023 | 小売 |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 1 | 3 | 21,725 | 2,024 | 各種金融 |
| OTTOGI CORPORATION | 0.04 | 0.04 | 2,228 | 207 | 食品・飲料・タバコ |
| AMOREPACIFIC GROUP | 1 | 2 | 19,488 | 1,816 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| KANGWON LAND INC | 4 | 8 | 24,800 | 2,311 | 消費者サービス |
| POSCO | 2 | 5 | 133,690 | 12,459 | 素材 |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 5 | 12 | 23,819 | 2,219 | 資本財 |
| SAMSUNG SDI CO LTD | 2 | 4 | 94,479 | 8,805 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD | 2 | 3 | 43,401 | 4,044 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 178 | 346 | 1,744,102 | 162,550 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD. | 14 | 31 | 22,063 | 2,056 | 資本財 |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 32 | 60 | 246,121 | 22,938 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SHINSEGAE CO LTD | 0.27 | 0.63 | 17,734 | 1,652 | 小売 |
| YUHAN CORPORATION | 0.31 | 0.76 | 16,416 | 1,529 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HANON SYSTEMS | 6 | 15 | 17,139 | 1,597 | 自動車・自動車部品 |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO | 2 | 3 | 9,324 | 868 | 保険 |
| GS HOLDINGS | 1 | 4 | 20,144 | 1,877 | エネルギー |
| LG DISPLAY CO LTD | 8 | 16 | 24,784 | 2,309 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CELLTRION INC | 2 | 6 | 115,710 | 10,784 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HELIXMITH CO LTD | 0.5 | 1 | 12,453 | 1,160 | 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 | 22 | 80,294 | 7,483 | 銀行 |
| GLOVIS CO LTD | 0.69 | 1 | 23,026 | 2,146 | 運輸 |
| CELLTRION PHARM INC | 0.57 | — | — | — | 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 | 0.6 | 7,950 | 740 | 小売 |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD. | 2 | 4 | 35,084 | 3,269 | 保険 |
| AMOREPACIFIC CORP | 1 | 2 | 43,092 | 4,016 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| AMOREPACIFIC CORP-PREF | 0.33 | 0.33 | 2,897 | 270 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| SAMSUNG CARD CO LTD | 1 | 1 | 3,932 | 366 | 各種金融 |
| SK INNOVATION CO LTD | 2 | 3 | 55,230 | 5,147 | エネルギー |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 0.3 | 0.7 | 17,360 | 1,617 | 食品・飲料・タバコ |
| PAN OCEAN CO LTD | 7 | 22 | 9,290 | 865 | 運輸 |
| LG INNOTEK CO LTD | 0.52 | 1 | 14,030 | 1,307 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SK HOLDINGS CO LTD | 1 | 2 | 62,057 | 5,783 | 資本財 |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 14 | 29 | 135,110 | 12,592 | 銀行 |
| MEDY-TOC INC | 0.16 | 0.23 | 6,952 | 648 | 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 | 5 | 22,230 | 2,071 | 資本財 |
| BS FINANCIAL GROUP INC | 9 | 20 | 13,982 | 1,303 | 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 | | |
| HANMI PHARM CO LTD | 0.23 | 0.54 | 17,253 | 1,607 | 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 | 9 | 2,184 | 203 | 保険 | |
| FILA KOREA LTD | — | 3 | 18,472 | 1,721 | 耐久消費財・アパレル | |
| E-MART INC | 0.77 | 1 | 22,401 | 2,087 | 食品・生活必需品小売り | |
| DGB FINANCIAL GROUP INC | 6 | — | — | — | 銀行 | |
| GS RETAIL CO LTD | 0.99 | 0.99 | 3,771 | 351 | 食品・生活必需品小売り | |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD | 2 | 6 | 20,315 | 1,893 | 自動車・自動車部品 | |
| HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN | 1 | 1 | 3,539 | 329 | 資本財 | |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS | 0.36 | 0.7 | 24,220 | 2,257 | 資本財 | |
| BGF RETAIL CO LTD | 0.32 | 0.61 | 10,248 | 955 | 食品・生活必需品小売り | |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 0.8 | 1 | 18,437 | 1,718 | 食品・飲料・タバコ | |
| ORANGE LIFE INSURANCE LTD | 9 | 1 | 3,426 | 319 | 保険 | |
| NETMARBLE CORPORATION | 0.93 | 1 | 13,112 | 1,222 | メディア・娯楽 | |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | — | 33 | 38,610 | 3,598 | 銀行 | |
| AMOREPACIFIC GROUP-RIGHTS | — | 0.1 | 29 | 2 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| SAMSUNG SDS CO LTD | 1 | 2 | 46,724 | 4,354 | ソフトウェア・サービス | |
| WOORI BANK | 17 | — | — | — | 銀行 | |
| SAMSUNG C&T CORPORATION | 2 | 6 | 63,592 | 5,926 | 資本財 | |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 0.61 | 1 | 45,646 | 4,254 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| PEARLABYSS CORP | 0.21 | 0.54 | 10,006 | 932 | メディア・娯楽 | |
| DOOSAN BOBCAT INC | 1 | 2 | 9,045 | 843 | 資本財 | |
| SILLAJEN INC | 1 | — | — | — | 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 | 4 | 20,438 | 1,904 | ヘルスケア機器・サービス | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数 <比率> | 547 110 | 1,069 112 | 5,734,945 — | 534,496 < 6.4%> | |
| (台湾) | | | 千新台湾ドル | | | |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | — | 50 | 795 | 2,854 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| ACER INC | 110 | 180 | 323 | 1,159 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 30 | 50 | 1,152 | 4,137 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 20 | 30 | 691 | 2,482 | 半導体・半導体製造装置 | |
| ASIA CEMENT CORPORATION | 90 | 160 | 727 | 2,610 | 素材 | |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP | 10 | 20 | 340 | 1,220 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 145 | 442 | 553 | 1,987 | 銀行 | |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR | 30 | 50 | 358 | 1,285 | 半導体・半導体製造装置 | |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD | 20 | 40 | 335 | 1,204 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 20 | 40 | 354 | 1,274 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| QUANTA COMPUTER INC | 100 | 180 | 1,085 | 3,896 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | 30 | 60 | 279 | 1,002 | 不動産 | |
| EVA AIRWAYS CORP | 73 | 188 | 264 | 949 | 運輸 | |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 20 | 50 | 1,247 | 4,478 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 176 | 362 | 832 | 2,986 | 銀行 | |
| CHINA AIRLINES LTD | 100 | 100 | 90 | 323 | 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 | 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 | |
| CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD | 70 | 140 | 582 | 2,090 | 自動車・自動車部品 |
| CHINA STEEL CORP | 460 | 880 | 2,059 | 7,392 | 素材 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 95 | 215 | 546 | 1,960 | 保険 |
| ADVANTECH CO LTD | 10 | 30 | 898 | 3,225 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| COMPAL ELECTRONICS | 150 | 370 | 695 | 2,497 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DELTA ELECTRONICS INC | 70 | 150 | 2,100 | 7,539 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| NANYA TECHNOLOGY CORP | 40 | 80 | 569 | 2,044 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 140 | 280 | 3,164 | 11,358 | 電気通信サービス |
| AU OPTRONICS CORP | 320 | 780 | 684 | 2,458 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 60 | 110 | 1,259 | 4,521 | 電気通信サービス |
| EVERGREEN MARINE CORPORATION | 73 | 223 | 277 | 994 | 運輸 |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION | 120 | 250 | 743 | 2,670 | 資本財 |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 10 | 22 | 420 | 1,508 | 耐久消費財・アパレル |
| ECLAT TEXTILE CO LTD | 10 | 20 | 792 | 2,843 | 耐久消費財・アパレル |
| NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD | 20 | 40 | 894 | 3,209 | 半導体・半導体製造装置 |
| FORMOSA PLASTICS CORPORATION | 170 | 330 | 3,207 | 11,515 | 素材 |
| FORMOSA TAFFETA CO LTD | 30 | 100 | 340 | 1,220 | 耐久消費財・アパレル |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION | 130 | 260 | 2,269 | 8,148 | 素材 |
| GIANT MANUFACTURING CO LTD | 10 | 20 | 442 | 1,586 | 耐久消費財・アパレル |
| MEDIATEK INCORPORATION | 60 | 110 | 4,636 | 16,645 | 半導体・半導体製造装置 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD | 240 | 500 | 2,240 | 8,041 | 保険 |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 271 | 603 | 1,309 | 4,702 | 銀行 |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 10 | 20 | 1,194 | 4,286 | 小売 |
| FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD | 60 | 110 | 804 | 2,886 | 電気通信サービス |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 370 | 720 | 1,422 | 5,104 | 各種金融 |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 300 | 570 | 2,376 | 8,533 | 保険 |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING | 490 | 830 | 805 | 2,893 | 保険 |
| E. SUN FINANCIAL HOLDING CO | 360 | 777 | 2,104 | 7,553 | 銀行 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 488 | 918 | 8,124 | 29,166 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 400 | 810 | 2,454 | 8,810 | 銀行 |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 3 | 3 | 1,685 | 6,050 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS | 365 | 626 | 892 | 3,204 | 銀行 |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD | 304 | 684 | 687 | 2,468 | 保険 |
| INVENTEC CORPORATION | 90 | 240 | 548 | 1,968 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 80 | 150 | 726 | 2,606 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD. | 387 | 697 | 896 | 3,218 | 銀行 |
| CHINATRUST FINANCIAL HOLDING | 640 | 1,370 | 2,993 | 10,746 | 銀行 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 343 | 748 | 1,718 | 6,168 | 銀行 |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC | 30 | 60 | 564 | 2,026 | 半導体・半導体製造装置 |
| NAN YA PLASTICS CORP | 190 | 380 | 2,717 | 9,754 | 素材 |
| WISTRON CORPORATION | 102 | 252 | 700 | 2,515 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| POU CHEN | 80 | 190 | 755 | 2,711 | 耐久消費財・アパレル |

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 | | |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 180 | 360 | 2,610 | 9,369 | 食品・飲料・タバコ | |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 20 | 40 | 1,222 | 4,386 | 食品・生活必需品小売り | |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 50 | 80 | 768 | 2,757 | エネルギー | |
| PHISON ELECTRONICS CORP | 10 | 10 | 284 | 1,021 | 半導体・半導体製造装置 | |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 18 | 18 | 82 | 294 | 不動産 | |
| RUENTEX INDUSTRIES LIMITED | 12 | 12 | 90 | 326 | 耐久消費財・アパレル | |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 30 | 50 | 333 | 1,195 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| STANDARD FOODS CORPORATION | 20 | 20 | 132 | 476 | 食品・飲料・タバコ | |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 50 | 100 | 368 | 1,322 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| TAIWAN CEMENT CORPORATION | 143 | 340 | 1,410 | 5,064 | 素材 | |
| TATUNG CO LTD | — | 100 | 220 | 791 | 耐久消費財・アパレル | |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 900 | 1,790 | 54,595 | 195,996 | 半導体・半導体製造装置 | |
| UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION | 440 | 800 | 1,196 | 4,293 | 半導体・半導体製造装置 | |
| WINBOND ELECTRONICS CORP | 110 | 200 | 349 | 1,252 | 半導体・半導体製造装置 | |
| YAGEO CORPORATION | 11 | 21 | 725 | 2,603 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 60 | 120 | 431 | 1,548 | 運輸 | |
| INNOLUX DISPLAY CORPORATION | 330 | 480 | 379 | 1,361 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| WPG HOLDINGS CO LTD | 55 | 95 | 361 | 1,297 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP | 10 | 20 | 536 | 1,926 | 資本財 | |
| TAIMED BIOLOGICS INC | 10 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| PEGATRON CORP | 70 | 140 | 952 | 3,417 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | — | 10 | 441 | 1,583 | 資本財 | |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP | 10 | 30 | 907 | 3,257 | 半導体・半導体製造装置 | |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 40 | 82 | 1,127 | 4,048 | 各種金融 | |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD | 20 | 40 | 538 | 1,931 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO | 298 | 692 | 1,437 | 5,160 | 銀行 | |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | — | 252 | 1,262 | 4,532 | 銀行 | |
| WIWYNN CORP | — | 10 | 553 | 1,985 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD | 130 | 270 | 2,041 | 7,327 | 半導体・半導体製造装置 | |
| GLOBALWAFERS CO LTD | 10 | 20 | 662 | 2,376 | 半導体・半導体製造装置 | |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 10 | 10 | 280 | 1,005 | 耐久消費財・アパレル | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 11,682 84 | 23,895 88 | 150,032 — | 538,617 <6.4%> | |
| (インド) | | | | 千インドルピー | | |
| RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | 105 | 207 | 32,231 | 49,636 | エネルギー | |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 28 | 50 | 2,564 | 3,949 | エネルギー | |
| EICHER MOTORS LTD | 0.5 | 1 | 2,356 | 3,629 | 自動車・自動車部品 | |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 27 | 51 | 2,711 | 4,175 | 自動車・自動車部品 | |
| SHREE CEMENT LTD | 0.31 | 0.61 | 1,280 | 1,972 | 素材 | |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 22 | 44 | 1,264 | 1,946 | エネルギー | |
| LIC HOUSING FINANCE LTD | 11 | 13 | 648 | 998 | 銀行 | |
| TATA STEEL LTD | 12 | 20 | 877 | 1,351 | 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 | |
| NESTLE INDIA LTD | 0.86 | 1 | 2,572 | 3,962 | 食品・飲料・タバコ |
| GAIL INDIA LIMITED | 29 | 89 | 1,132 | 1,744 | 公益事業 |
| VEDANTA LTD | 48 | 130 | 1,890 | 2,911 | 素材 |
| TITAN CO LTD | 11 | 21 | 2,488 | 3,832 | 耐久消費財・アパレル |
| OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED | 52 | 174 | 2,301 | 3,543 | エネルギー |
| COLGATE PALMOLIVE INDIA | — | 5 | 844 | 1,300 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| LUPIN LTD | 8 | 13 | 1,046 | 1,611 | 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 | 118 | 27,305 | 42,049 | 銀行 |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE | 17 | 56 | 1,656 | 2,550 | メディア・娯楽 |
| INFOSYS LIMITED | 129 | 249 | 17,350 | 26,719 | ソフトウェア・サービス |
| WIPRO LTD | 42 | 83 | 1,995 | 3,073 | ソフトウェア・サービス |
| INDIAN OIL CORP LTD | 54 | 133 | 1,747 | 2,691 | エネルギー |
| HINDUSTAN UNILEVER LIMITED | 24 | 47 | 9,734 | 14,991 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 20 | 36 | 4,133 | 6,366 | ソフトウェア・サービス |
| DABUR INDIA LIMITED | 19 | 41 | 1,913 | 2,946 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HERO MOTOCORP LTD | 1 | 6 | 1,674 | 2,578 | 自動車・自動車部品 |
| DR. REDDY'S LABORATORIES | 4 | 7 | 2,325 | 3,580 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BHARTI AIRTEL LIMITED | 51 | 152 | 6,737 | 10,375 | 電気通信サービス |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD | 31 | 57 | 2,605 | 4,011 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | — | 5 | 1,064 | 1,639 | 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 | 7 | 5,709 | 8,792 | 自動車・自動車部品 |
| GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD | 5 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AUROBINDO PHARMA LIMITED | 9 | 15 | 692 | 1,066 | 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 | 74 | 964 | 1,484 | 自動車・自動車部品 |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE | 5 | 13 | 1,520 | 2,341 | 各種金融 |
| PETRONET LNG LTD | 22 | 44 | 1,200 | 1,849 | エネルギー |
| CIPLA LTD | 12 | 20 | 943 | 1,453 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 17 | 35 | 4,748 | 7,313 | 資本財 |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 3 | 6 | 2,811 | 4,328 | 素材 |
| ASHOK LEYLAND LIMITED | 43 | 103 | 819 | 1,262 | 資本財 |
| BOSCH LIMITED | 0.27 | 0.55 | 887 | 1,367 | 自動車・自動車部品 |
| TATA CONSULTANCY SVS LTD | 34 | 66 | 13,555 | 20,875 | ソフトウェア・サービス |
| NTPC LTD | 73 | 184 | 2,152 | 3,314 | 公益事業 |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 3 | 4 | 870 | 1,341 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 22 | 44 | 920 | 1,417 | 素材 |
| BHARAT FORGE LTD | 7 | 7 | 361 | 556 | 自動車・自動車部品 |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD | 43 | 92 | 1,845 | 2,842 | 素材 |
| ITC LIMITED | 126 | 255 | 6,296 | 9,695 | 食品・飲料・タバコ |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD | 4 | 8 | 1,154 | 1,777 | 素材 |
| UPL LTD | 13 | 37 | 2,135 | 3,288 | 素材 |
| SIEMENS LTD | — | 6 | 907 | 1,396 | 資本財 |
| INFO EDGE INDIA LTD | — | 5 | 1,316 | 2,027 | メディア・娯楽 |

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 | | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 13 | 28 | 2,035 | 3,135 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| VODAFONE IDEA LTD | 72 | — | — | — | 電気通信サービス | |
| MARICO LTD | 16 | 32 | 1,180 | 1,818 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| PAGE INDUSTRIES LTD | — | 0.46 | 1,014 | 1,561 | 耐久消費財・アパレル | |
| DLF LIMITED | — | 49 | 1,095 | 1,686 | 不動産 | |
| POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED | 58 | 125 | 2,434 | 3,749 | 公益事業 | |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 19 | 44 | 1,681 | 2,588 | 運輸 | |
| REC LTD | 25 | 53 | 741 | 1,141 | 各種金融 | |
| BAJAJ FINSERV LTD | 1 | 2 | 2,678 | 4,124 | 保険 | |
| BAJAJ AUTO LTD | 3 | 6 | 2,086 | 3,213 | 自動車・自動車部品 | |
| COAL INDIA LTD | 25 | 87 | 1,789 | 2,755 | エネルギー | |
| TATA MOTORS LTD | 59 | 124 | 2,009 | 3,093 | 自動車・自動車部品 | |
| TATA POWER CO LTD | 41 | 41 | 236 | 363 | 公益事業 | |
| MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS | 11 | 23 | 826 | 1,272 | 各種金融 | |
| BHARTI INFRA TEL LTD | 12 | 12 | 341 | 526 | 電気通信サービス | |
| INDIABULLS HOUSING FINANCE L | 10 | — | — | — | 銀行 | |
| ASIAN PAINTS LTD | 10 | 19 | 3,347 | 5,155 | 素材 | |
| BAJAJ FINANCE LIMITED | 6 | 12 | 5,288 | 8,143 | 各種金融 | |
| YES BANK LTD | 63 | — | — | — | 銀行 | |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | — | 35 | 2,020 | 3,111 | 保険 | |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | — | 3 | 1,237 | 1,906 | 各種金融 | |
| CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED | 6 | 16 | 928 | 1,430 | 運輸 | |
| BANDHAN BANK LTD | — | 25 | 1,470 | 2,264 | 銀行 | |
| BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED | 1 | 4 | 1,302 | 2,005 | 食品・飲料・タバコ | |
| BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED-NEW | 1 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ | |
| AXIS BANK LIMITED | 66 | 153 | 11,329 | 17,447 | 銀行 | |
| HAVELLS INDIA LTD | 9 | 14 | 981 | 1,512 | 資本財 | |
| STATE BANK OF INDIA | 64 | 121 | 4,146 | 6,385 | 銀行 | |
| ICICI BANK LIMITED | 88 | 349 | 17,913 | 27,586 | 銀行 | |
| BERGER PAINTS INDIA LTD | — | 20 | 995 | 1,532 | 素材 | |
| TECH MAHINDRA LTD | 17 | 32 | 2,438 | 3,755 | ソフトウェア・サービス | |
| CADILA HEALTHCARE LTD | 7 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| GRASIM INDUSTRIES LTD | 12 | 21 | 1,655 | 2,548 | 素材 | |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 4 | 7 | 1,332 | 2,051 | 食品・生活必需品小売り | |
| UNITED SPIRITS LTD | 10 | 21 | 1,278 | 1,969 | 食品・飲料・タバコ | |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD | — | 14 | 1,946 | 2,997 | 保険 | |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | — | 25 | 1,288 | 1,983 | 保険 | |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 3 | 6 | 976 | 1,503 | 運輸 | |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | — | 26 | 2,589 | 3,987 | 保険 | |
| JSW STEEL LTD | 31 | 67 | 1,757 | 2,705 | 素材 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 2,079 | 4,492 | 274,645 | 422,953 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 77 | 84 | — | < 5.0%> | |

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 | | |
| (エジプト) | | | 千エジプトポンド | | | |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE | 38 | 101 | 802 | 5,454 | 銀行 | |
| EASTERN TOBACCO | 33 | 59 | 88 | 603 | 食品・飲料・タバコ | |
| ELSEWEDY ELECTRIC CO | 14 | 54 | 64 | 439 | 資本財 | |
| 小 計 | 株 数 銘 柄 数 | ・ 金 額 < 比 率 > | 85 3 | 215 3 | 955 — | 6,497 < 0.1% > |
| (南アフリカ) | | | 千南アフリカランド | | | |
| BIDVEST GROUP LTD | 12 | 18 | 383 | 2,872 | 資本財 | |
| CLICKS GROUP LTD | 9 | 20 | 506 | 3,798 | 食品・生活必需品小売り | |
| TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD | 16 | — | — | — | 小売 | |
| DISCOVERY LTD | 13 | 31 | 366 | 2,749 | 保険 | |
| GOLD FIELDS LIMITED | 30 | 57 | 439 | 3,296 | 素材 | |
| REMGRO LTD | 19 | 36 | 696 | 5,223 | 各種金融 | |
| THE FOSCHINI GROUP | 8 | 13 | 202 | 1,522 | 小売 | |
| NORTHAM PLATINUM LTD | — | 28 | 308 | 2,312 | 素材 | |
| EXXARO RESOURCES LIMITED | 9 | 18 | 246 | 1,847 | エネルギー | |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 1 | 3 | 463 | 3,475 | 銀行 | |
| LIBERTY HOLDINGS LTD | 4 | 4 | 52 | 394 | 保険 | |
| MTN GROUP LIMITED | 62 | 126 | 1,166 | 8,746 | 電気通信サービス | |
| ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED | 15 | 31 | 855 | 6,413 | 素材 | |
| TELKOM SA SOC LTD | 9 | 21 | 101 | 763 | 電気通信サービス | |
| FIRSTRAND LIMITED | 123 | 248 | 1,557 | 11,683 | 各種金融 | |
| PSG GROUP LTD | 5 | 8 | 204 | 1,534 | 各種金融 | |
| NASPERS LIMITED-N SHS | 16 | 31 | 6,691 | 50,182 | 小売 | |
| NEDBANK GROUP LTD | 13 | 28 | 620 | 4,654 | 銀行 | |
| NETCARE LTD | 37 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス | |
| PICK N PAY STORES LTD | 13 | 31 | 212 | 1,597 | 食品・生活必需品小売り | |
| RMB HOLDINGS LTD | 25 | 54 | 440 | 3,307 | 各種金融 | |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 1 | 4 | 504 | 3,782 | 素材 | |
| SAPPI LIMITED | 20 | — | — | — | 素材 | |
| SASOL LTD. | 20 | 41 | 1,105 | 8,290 | 素材 | |
| SHOPRITE HOLDINGS LIMITED | 16 | 33 | 426 | 3,199 | 食品・生活必需品小売り | |
| STANDARD BANK GROUP LIMITED | 47 | 95 | 1,586 | 11,895 | 銀行 | |
| SPAR GROUP LIMITED | 7 | 11 | 230 | 1,731 | 食品・生活必需品小売り | |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED | 36 | 77 | 404 | 3,035 | 小売 | |
| IMPERIAL LOGISTICS LTD | 5 | — | — | — | 運輸 | |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD | 14 | 30 | 361 | 2,708 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| TIGER BRANDS LTD | 5 | 9 | 189 | 1,423 | 食品・飲料・タバコ | |
| SANLAM LTD | 64 | 139 | 1,067 | 8,008 | 保険 | |
| INVESTEC LTD | 10 | 22 | 187 | 1,403 | 各種金融 | |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LIMITED | — | 60 | 683 | 5,126 | 素材 | |
| KUMBA IRON ORE LTD | 2 | 4 | 184 | 1,381 | 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 | |
| MONDI LTD | | 4 | — | — | — | 素材 |
| LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD | | 48 | 103 | 256 | 1,920 | ヘルスケア機器・サービス |
| MMI HOLDINGS LTD | | 34 | — | — | — | 保険 |
| VODACOM GROUP LIMITED | | 22 | 44 | 538 | 4,038 | 電気通信サービス |
| SIBANYE GOLD LTD | | — | 175 | 507 | 3,807 | 素材 |
| NEPI ROCKCASTLE PLC | | 13 | 30 | 372 | 2,796 | 不動産 |
| MOTUS HOLDINGS LTD-NEW | | 5 | — | — | — | 小売 |
| OLD MUTUAL LTD | | 180 | 331 | 613 | 4,603 | 保険 |
| REINET INVESTMENTS SCA | | 5 | 10 | 304 | 2,280 | 各種金融 |
| ABSA GROUP LTD | | 26 | 48 | 720 | 5,407 | 銀行 |
| PEPKOR HOLDINGS LTD | | — | 70 | 124 | 935 | 小売 |
| MULTICHOICE GROUP LTD | | — | 30 | 371 | 2,789 | メディア・娯楽 |
| MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS | | — | 34 | 70 | 528 | 保険 |
| RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE | | 25 | 59 | 179 | 1,348 | 保険 |
| MR PRICE GROUP LTD | | 8 | 20 | 356 | 2,673 | 小売 |
| BID CORP LTD | | 12 | 22 | 737 | 5,529 | 食品・生活必需品小売り |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 1,086 | 2,329 | 27,603 | 207,024 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 45 | 44 | — | <2.5%> | |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 | 85,166 | 177,205 | — | 4,037,482 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 817 | 860 | — | <48.2%> | |

※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。

※< >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。

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 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | | | | | 千米ドル | 千円 | % |
| | GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF | 1,178 | 1,568 | | | 11 | 1,315 | 0.0 |
| | ISHARES MSCI RUSSIA ETF | 20,110 | 39,708 | | | 1,651 | 181,088 | 2.2 |
| | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | — | 34,756 | | | 1,020 | 111,883 | 1.3 |
| | ISHARES MSCI UAE ETF | 7,671 | 19,639 | | | 269 | 29,552 | 0.4 |
| | ISHARES MSCI QATAR ETF | 9,231 | 22,394 | | | 393 | 43,127 | 0.5 |
| 小 計 | 証 券 数 ・ 金 額 | 38,190 | 118,065 | | | 3,345 | 366,967 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 4 | 5 | | | — | <4.4%> | |
| (メキシコ) | | | | | | 千メキシコペソ | | |
| | DEUTSCHE BANK MEX (FIBRA UNO ADMINISTR) | 11,700 | 23,200 | | | 692 | 3,887 | 0.0 |
| 小 計 | 証 券 数 ・ 金 額 | 11,700 | 23,200 | | | 692 | 3,887 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 1 | 1 | | | — | <0.0%> | |
| (ブラジル) | | | | | | 千ブラジルレアル | | |
| | SUL AMERICA SA-UNITS | 700 | 2,300 | | | 122 | 3,166 | 0.0 |
| | BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT | 1,500 | 2,700 | | | 119 | 3,081 | 0.0 |
| | KLABIN SA-UNIT | 2,200 | 4,600 | | | 81 | 2,109 | 0.0 |
| 小 計 | 証 券 数 ・ 金 額 | 4,400 | 9,600 | | | 322 | 8,357 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 3 | 3 | | | — | <0.1%> | |
| (南アフリカ) | | | | | | 千南アフリカランド | | |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 11,038 | 20,610 | | | 470 | 3,525 | 0.0 |
| | FORTRESS REIT LTD-A | 3,905 | 9,022 | | | 178 | 1,336 | 0.0 |
| | FORTRESS REIT LTD-B | 2,984 | — | | | — | — | — |
| | REDEFINE PROPERTIES LTD | 18,627 | 43,761 | | | 360 | 2,701 | 0.0 |
| | HYPROP INVESTMENTS LTD | 910 | — | | | — | — | — |
| | RESILIENT REIT LTD | 1,090 | — | | | — | — | — |
| 小 計 | 証 券 数 ・ 金 額 | 38,554 | 73,393 | | | 1,008 | 7,563 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 6 | 3 | | | — | <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 | 301,800 | | | 11,800 | 184,085 | 2.2 |
| 小 計 | 証 券 数 ・ 金 額 | 28,400 | 301,800 | | | 11,800 | 184,085 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 1 | 1 | | | — | <2.2%> | |
| 合 計 | 証 券 数 ・ 金 額 | 121,244 | 526,058 | | | — | 570,861 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 15 | 13 | | | — | <6.8%> | |

※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。

※—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

(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 3,779 | 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。

※-印は組入れなし。

■ 投資信託財産の構成

(2019年12月2日現在)

| 項目 | 期 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| 株式 | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 4,037,483 | 47.8 |
| 投資証券 | 439,169 | 5.2 |
| コール・ローン等、その他 | 131,691 | 1.6 |
| 投資信託財産総額 | 3,837,106 | 45.4 |
| | 8,445,449 | 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（5,334,701千円）の投資信託財産総額（8,445,449千円）に対する比率は63.2%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=109.68円、1メキシコペソ=5.61円、1ブラジルリアル=25.88円、100チリペソ=13.55円、100コロンビアペソ=3.12円、1ユーロ=120.86円、1トルコリラ=19.09円、1チェココルナ=4.73円、100ハンガリーフォリント=36.09円、1ポーランドズロチ=28.02円、1香港ドル=14.01円、1マレーシアリングギット=26.24円、1タイバーツ=3.63円、1フィリピンペソ=2.16円、100インドネシアルピア=0.78円、100韓国ウォン=9.32円、1新台幣ドル=3.59円、1インドルピー=1.54円、1エジプトポンド=6.80円、1南アフリカランド=7.50円、1中国元（オフショア）=15.60円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月2日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 13,560,932,552円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 3,202,701,654 |
| 株 式(評価額) | 4,037,483,203 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 439,169,849 |
| 投 資 証 券(評価額) | 131,691,487 |
| 未 収 入 金 | 5,191,835,790 |
| 未 収 配 当 金 | 1,485,796 |
| 差 入 委 託 証 拠 | 556,564,773 |
| (B) 負 債 | 5,179,257,234 |
| 未 払 金 | 5,149,177,759 |
| 未 払 解 約 金 | 30,000,000 |
| 未 払 利 息 | 5,811 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 73,664 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 8,381,675,318 |
| 元 本 | 6,294,909,292 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 2,086,766,026 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 6,294,909,292口 |
| 1 万 口 当 ち 基 準 価 額(C/D) | 13,315円 |

※当期における期首元本額3,379,960,257円、期中追加設定元本額5,059,642,476円、期中一部解約元本額2,144,693,441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・全海外株インデックスファンド | 1,847,179,535円 |
| 三井住友・DC新興国株式インデックスファンド | 1,655,715,631円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 824,428,406円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 828,691,099円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 648,447,633円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 151,186,383円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050 | 9,957,591円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 24,723,670円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 19,042,255円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 76,580,510円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 56,263,926円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 102,301,455円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 26,205,801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> | 24,185,397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12月1日 至2019年12月2日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 80,244,991円 |
| 受 取 配 当 金 | 73,624,901 |
| 受 取 利 息 | △ 732,806 |
| そ の 他 収 益 金 | 8,380,307 |
| 支 払 利 息 | △ 1,027,411 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 56,839,480 |
| 売 買 益 | 565,472,335 |
| 売 買 損 | △ 508,632,855 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | 4,473,587 |
| 取 引 益 | 356,757,960 |
| 取 引 損 | △ 352,284,373 |
| (D) 信 託 報 酬 等 | △ 21,066,536 |
| (E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D) | 120,491,522 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | 1,021,637,749 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,577,442,258 |
| (H) 解 約 差 損 益 金 | △ 632,805,503 |
| (I) 計 (E+F+G+H) | 2,086,766,026 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I) | 2,086,766,026 |

※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31期（2020年2月26日から2020年8月25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) | | REIT指数 先物比率 (買建-売建) | 投資信託 証券組 比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|-----------------------------|-------|---------------------------|-------------------|--------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 30期（2020年2月25日） | 27,133 | 8.4 | 4,616.86 | 8.5 | 1.1 | 98.8 | 7,948 |
| 31期（2020年8月25日） | 21,827 | △19.6 | 3,707.66 | △19.7 | 0.8 | 98.4 | 6,848 |

※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

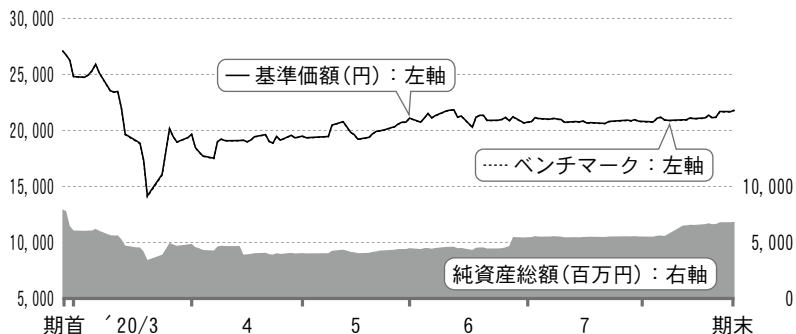
| 年 月 日 | 基準価額 | | (ベンチマーク) 東証REIT指数 (配当込み) | | REIT指数 先物比率 (買建-売建) | 投資信託 証券組 比率 |
|--------------------|--------|-------|-----------------------------|-------|---------------------------|-------------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | |
| (期首) 2020年2月25日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 27,133 | — | 4,616.86 | — | 1.1 | 98.8 |
| 2月末 | 24,809 | △8.6 | 4,218.40 | △8.6 | 1.7 | 98.0 |
| 3月末 | 19,658 | △27.5 | 3,343.59 | △27.6 | 2.0 | 96.9 |
| 4月末 | 19,496 | △28.1 | 3,313.25 | △28.2 | 2.3 | 96.9 |
| 5月末 | 21,102 | △22.2 | 3,586.37 | △22.3 | 1.5 | 97.9 |
| 6月末 | 20,753 | △23.5 | 3,525.99 | △23.6 | 0.9 | 98.7 |
| 7月末 | 20,813 | △23.3 | 3,535.10 | △23.4 | 0.9 | 98.4 |
| (期末) 2020年8月25日 | 21,827 | △19.6 | 3,707.66 | △19.7 | 0.8 | 98.4 |

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 27,133円 |
| 期末 | 21,827円 |
| 騰落率 | -19.6% |

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、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（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

当ファンドは、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 | ・ 3月下旬から4月上旬にかけて、日銀による金融緩和の強化、米国の大規模経済対策が期待されたこと |
| 下落要因 | ・ 期初から3月中旬にかけて、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大により、国内外景気の先行き不透明感が増大したこと |

▶ 投資環境について（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

当期のJリート市場は下落しました。

新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて、WHO（世界保健機関）がパンデミック（世界的大流行）宣言し、国内外景気の先行き不透明感が増大しました。投資家心理の悪化とともにJリート市場にも大きな売り圧力がかかり、期初から下げ足を早めました。下落幅が一定以上に達すると、国内金融機関からのロスカット（損切り）とみられる売りが集中し、Jリート市場の流動性の低下もあり、急落しました。

3月下旬になると、それまでの割安感や日銀による金融緩和の強化、米国の大規模経済対策への期待などを背景に、上昇に転じました。4月上旬から5月中旬まで膠着状態となった後、5月下旬に緊急事態宣言が全面解除となったことで投資家心理が改善し、感染拡大に伴う影響が懸念されたホテル・商業施設銘柄や利回りの高い中小型銘柄を中心に買戻しが入り、6月上旬まで堅調に推移しました。

その後、感染第二波への警戒感から賃料の減収リスクが意識されたことや、国内観光需要の喚起や個人消費の活性化を促すための「Go To トラベル事業」を巡る混乱を背景に、ホテルリート・商業施設リートが下落しました。一方、需要の安定した物流施設リート・住宅リートは上昇し、全体としては狭いレンジでの値動きとなりました。

当期の市場の動きを東証REIT指数（配当込み）でみると、期首に比べて19.7%下落しました。

▶ ポートフォリオについて（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

リート組入比率

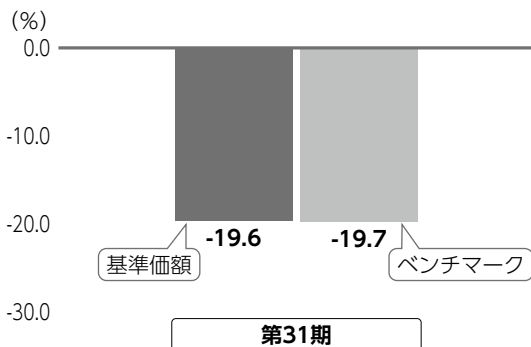
東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、期を通じて、リーートの組入比率は高位を保ちました。

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。また、東証REIT指数先物を利用することで、実質組入比率を高位に維持しました。

▶ ベンチマークとの差異について（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



当ファンドは、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】

当期における基準価額の騰落率は-19.6%となり、ベンチマークの騰落率-19.7%を0.1%上方乖離しました。

上方乖離要因

・現金などのキャッシュポジションが相場下落時にプラス寄与したこと

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す。また、東証REIT指数先物を含めたリートの組入比率は、原則として高位を保ちます。

■ 1万口当たりの費用明細 (2020年2月26日から2020年8月25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) (先物・オプション) | 6円 (6) (0) | 0.027% (0.026) (0.001) | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (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 | 6 | 0.027 | |

期中の平均基準価額は21,105円です。

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

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年2月26日から2020年8月25日まで)

(1) 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 | 66 | 6,882 | 32 | 3,548 |
| | サンケイリアルエステート投資法人 | 122 | 11,458 | 38 | 4,102 |
| | S O S i L A 物流リート投資法人 | 68 | 9,140 | 58 | 7,076 |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 105 | 67,835 | 86 | 56,582 |
| | M C U B S M i d C i t y 投資法人 | 393 | 29,778 | 367 | 34,633 |
| | 森ヒルズリート投資法人 | 358 | 49,942 | 293 | 47,385 |
| | 産業ファンド投資法人 | 490 | 86,045 | 328 | 53,438 |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 293 | 94,509 | 242 | 78,639 |
| | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 203 | 38,205 | 155 | 28,596 |
| | アクティブ・プロパティーズ投資法人 | 157 | 58,173 | 131 | 57,739 |
| | GLP投資法人 | 1,055 | 166,867 | 638 | 86,848 |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 136 | 44,412 | 113 | 36,579 |
| | 日本プロロジスリート投資法人 | 468 | 149,940 | 382 | 111,817 |
| | 星野リゾート・リート投資法人 | 47 | 20,844 | 39 | 17,517 |
| | Oneリート投資法人 | 47 | 11,698 | 39 | 11,461 |
| | イオンリート投資法人 | 330 | 36,811 | 318 | 38,978 |
| | ヒューリックリート投資法人 | 259 | 34,347 | 248 | 38,806 |
| | 日本リート投資法人 | 99 | 33,678 | 82 | 32,918 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 2,000 | 27,909 | 1,656 | 30,716 | |
| 日本ヘルスケア投資法人 | 2 (△ 29) | 375 (△ 6,394) | 5 | 1,083 | |

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 | 積水ハウス・リート投資法人 | 918 | 63,959 | 745 | 59,462 |
| | トーセイ・リート投資法人 | 71 | 7,395 | 56 | 6,466 |
| | ケネディクス商業リート投資法人 | 118 | 23,072 | 112 | 23,299 |
| | ヘルスケア&メディカル投資法人 | 66 | 7,802 | 56 | 6,868 |
| | サムティ・レジデンシャル投資法人 | 50 | 5,173 | 46 | 4,392 |
| | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 1,004 | 132,162 | 827 | 133,423 |
| | いちごホテルリート投資法人 | 52 | 3,321 | 40 | 3,450 |
| | ラサールロジポート投資法人 | 291 | 49,449 | 234 | 37,342 |
| | スターアジア不動産投資法人 | (181 448) | (10,540 11,927) | 96 | 8,150 |
| | マリモ地方創生リート投資法人 | 32 | 3,272 | 26 | 2,711 |
| | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 86 | 43,607 | 70 | 33,324 |
| | 大江戸温泉リート投資法人 | 54 | 3,330 | 53 | 3,668 |
| | さくら総合リート投資法人 | 39 (△ 135) | 3,124 (△ 11,927) | 54 | 4,276 |
| | 投資法人みらい | 346 | 12,760 | 331 | 15,082 |
| | 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 72 | 6,821 | 75 | 8,114 |
| | 三菱地所物流リート投資法人 | 59 | 24,326 | 47 | 17,662 |
| | 三菱地所物流リート投資法人 | 5 | 2,158 | — | — |
| | CREロジスティクスファンド投資法人 | 117 | 18,406 | 47 | 6,206 |
| | ザイマックス・リート投資法人 | 50 | 4,500 | 40 | 4,463 |
| | タカラレーベン不動産投資法人 | 102 | 8,903 | 72 | 7,327 |
| | 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 143 | 21,846 | 52 | 6,028 |
| | 日本ビルファンド投資法人 | 302 | 190,432 | 251 | 190,708 |
| | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 311 | 174,702 | 259 | 180,029 |
| | 日本リテールファンド投資法人 | 589 | 78,906 | 488 | 84,224 |
| | オリックス不動産投資法人 | 619 | 90,259 | 515 | 93,539 |
| | 日本プライムリアルティ投資法人 | 205 | 64,144 | 181 | 69,097 |
| | プレミアム投資法人 | 281 | 32,829 | 234 | 31,479 |
| | 東急リアル・エステート投資法人 | 208 | 29,112 | 176 | 29,656 |
| | グローバル・ワン不動産投資法人 | 216 | 21,124 | 181 | 20,653 |
| | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 687 | 77,875 | 646 | 92,082 |
| | 森トラスト総合リート投資法人 | 222 | 28,673 | 186 | 29,730 |
| | インヴィンシブル投資法人 | 1,342 | 36,528 | 1,258 | 45,249 |
| フロンティア不動産投資法人 | 109 | 35,948 | 108 | 39,160 | |
| 平和不動産リート投資法人 | 192 | 20,708 | 162 | 19,475 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 203 | 58,962 | 170 | 45,062 | |

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 | 福岡リート投資法人 | 162 | 20,365 | 135 | 19,595 |
| | ケネディクス・オフィス投資法人 | 97 | 56,667 | 81 | 57,157 |
| | いちごオフィスリート投資法人 | 279 | 20,220 | 198 | 18,191 |
| | 大和証券オフィス投資法人 | 70 | 40,861 | 70 | 49,246 |
| | 阪急阪神リート投資法人 | 139 | 17,173 | 117 | 16,683 |
| | スターツプロシード投資法人 | 46 | 9,243 | 38 | 7,339 |
| | 大和ハウスリート投資法人 | (442 16) | (117,823 4,666) | 332 | 89,917 |
| | 大和ハウスリート投資法人 | (△ — 16) | (△ — 4,666) | — | — |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 1,003 | 43,585 | 834 | 42,805 |
| | 大和証券リビング投資法人 | (376 59) | (38,598 6,394) | 283 | 27,705 |
| | ジャパンエクセレント投資法人 | 288 | 35,542 | 239 | 37,358 |
| 合 計 | (18,942 343) | (2,775,086 —) | 15,471 | 2,506,348 | |

※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。

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|------------|------------|------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国内 | REIT指数先物取引 | 百万円 198 | 百万円 210 | 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。

■ 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)

(1) 利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|---------------------|--------------|------|---------------------|-----------|-----|
| | うち利害関係人 との取引状況 B | B A | % | うち利害関係人 との取引状況 D | D C | % |
| 投資信託証券 | 百万円 2,775 | 百万円 1,648 | 59.4 | 百万円 2,506 | 百万円 80 | 3.2 |

(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 72 |

(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 | 1,385千円 |
| (b) うち利害関係人への支払額 | 264千円 |
| (c) (b) / (a) | 19.1% |

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

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

(2020年2月26日から2020年8月25日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2020年8月25日現在)

(1) 国内投資信託証券

| 銘 柄 | 期首 (前期末) | | 期 | | 末 | |
|-------------------------|----------|-------|-------|-------|--------------|---------|
| | 口 | 数 | 口 | 数 | 評 価 額 | 組 入 比 率 |
| エスコンジャパンリート投資法人 | 86 | 120 | 120 | 120 | 千円 12,264 | 0.2 |
| サンケイリアルエステート投資法人 | 98 | 182 | 182 | 182 | 16,871 | 0.2 |
| S O S i L A 物流リート投資法人 | 154 | 164 | 164 | 164 | 23,320 | 0.3 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 228 | 247 | 247 | 247 | 165,984 | 2.4 |
| MCUBS MidCity投資法人 | 879 | 905 | 905 | 905 | 68,508 | 1.0 |
| 森ヒルズリート投資法人 | 790 | 855 | 855 | 855 | 115,852 | 1.7 |
| 産業ファンド投資法人 | 883 | 1,045 | 1,045 | 1,045 | 196,042 | 2.9 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | 651 | 702 | 702 | 702 | 222,534 | 3.2 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 433 | 481 | 481 | 481 | 92,496 | 1.4 |
| アクティブピア・プロパティーズ投資法人 | 344 | 370 | 370 | 370 | 150,035 | 2.2 |

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 |
| GLP投資法人※ | | | 1,710 | | 2,127 | 368,396 | 5.4 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | | | 300 | | 323 | 106,105 | 1.5 |
| 日本プロロジスリート投資法人※ | | | 1,033 | | 1,119 | 392,769 | 5.7 |
| 星野リゾート・リート投資法人※ | | | 104 | | 112 | 53,256 | 0.8 |
| Oneリート投資法人 | | | 107 | | 115 | 29,267 | 0.4 |
| イオンリート投資法人 | | | 739 | | 751 | 84,787 | 1.2 |
| ヒューリックリート投資法人 | | | 584 | | 595 | 82,348 | 1.2 |
| 日本リート投資法人 | | | 223 | | 240 | 86,760 | 1.3 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人※ | | | 4,409 | | 4,753 | 66,494 | 1.0 |
| 日本ヘルスケア投資法人 | | | 32 | | — | — | — |
| 積水ハウス・リート投資法人 | | | 2,004 | | 2,177 | 159,791 | 2.3 |
| トーセイ・リート投資法人 | | | 149 | | 164 | 17,334 | 0.3 |
| ケネディクス商業リート投資法人 | | | 266 | | 272 | 57,800 | 0.8 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | | | 146 | | 156 | 18,610 | 0.3 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | | | 137 | | 141 | 13,846 | 0.2 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人※ | | | 2,215 | | 2,392 | 342,534 | 5.0 |
| いちごホテルリート投資法人 | | | 116 | | 128 | 8,179 | 0.1 |
| ラサールロジポート投資法人※ | | | 637 | | 694 | 127,696 | 1.9 |
| スターアジア不動産投資法人 | | | 228 | | 761 | 32,304 | 0.5 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | | | 65 | | 71 | 7,426 | 0.1 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | | | 195 | | 211 | 115,839 | 1.7 |
| 大江戸温泉リート投資法人 | | | 119 | | 120 | 7,584 | 0.1 |
| さくら総合リート投資法人 | | | 150 | | — | — | — |
| 投資法人みらい | | | 783 | | 798 | 28,887 | 0.4 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | | | 162 | | 159 | 15,677 | 0.2 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | | | 135 | | 147 | 67,620 | 1.0 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | | | — | | 5 | 2,270 | 0.0 |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | | | 130 | | 200 | 30,700 | 0.4 |
| ザイマックス・リート投資法人 | | | 102 | | 112 | 9,833 | 0.1 |
| タカラレーベン不動産投資法人 | | | 195 | | 225 | 19,777 | 0.3 |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 | | | 144 | | 235 | 34,780 | 0.5 |
| 日本ビルファンド投資法人※ | | | 665 | | 716 | 466,832 | 6.8 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | | | 687 | | 739 | 433,054 | 6.3 |
| 日本リートリアルファンド投資法人 | | | 1,298 | | 1,399 | 210,129 | 3.1 |
| オリックス不動産投資法人 | | | 1,368 | | 1,472 | 230,809 | 3.4 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | | | 436 | | 460 | 143,980 | 2.1 |
| プレミア投資法人 | | | 621 | | 668 | 83,767 | 1.2 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | | | 462 | | 494 | 67,727 | 1.0 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | | | 478 | | 513 | 52,274 | 0.8 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | | | 1,540 | | 1,581 | 183,396 | 2.7 |
| 森トラスト総合リート投資法人 | | | 492 | | 528 | 70,382 | 1.0 |

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 | 金 額 | 口 数 | 評 価 額 |
| インヴィンシブル投資法人※ | 3,009 | | 3,093 | 82,583 |
| フロンティア不動産投資法人※ | 244 | | 245 | 86,485 |
| 平和不動産リート投資法人 | 430 | | 460 | 55,200 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 450 | | 483 | 137,896 |
| 福岡リート投資法人※ | 355 | | 382 | 51,226 |
| ケネディクス・オフィス投資法人※ | 212 | | 228 | 137,940 |
| いちごオフィスリート投資法人※ | 533 | | 614 | 45,988 |
| 大和証券オフィス投資法人※ | 158 | | 158 | 94,484 |
| 阪急阪神リート投資法人 | 311 | | 333 | 39,627 |
| スターツプロシード投資法人 | 107 | | 115 | 23,494 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 929 | | 1,055 | 300,147 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 16 | | — | — |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 2,214 | | 2,383 | 109,141 |
| 大和証券リビング投資法人 | 772 | | 924 | 96,096 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 636 | | 685 | 83,638 |
| 合 計 | 40,288 | | 44,102 | 6,738,888 |
| 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 65 | | 63 | <98.4%> |

※<>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。

※-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。)

(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 東 証 R E I T 指 数 | 百万円 52 | 百万円 — |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※-印は組入れなし。

■ 投資信託財産の構成

(2020年8月25日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 証 券 | 千円 6,738,888 | % 98.2 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 124,233 | 1.8 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 6,863,121 | 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

(2020年8月25日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-----------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 6,863,121,997円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 37,732,212 |
| 投 資 証 券 (評価額) | 6,738,888,285 |
| 未 収 入 金 | 34,654,877 |
| 未 収 配 当 金 | 39,852,623 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 11,994,000 |
| (B) 負 債 | 15,001,701 |
| 未 払 金 | 2,158,505 |
| 未 払 解 約 金 | 12,843,012 |
| 未 払 利 息 | 85 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 99 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 6,848,120,296 |
| 元 本 | 3,137,483,431 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 3,710,636,865 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 3,137,483,431口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 21,827円 |

※当期における期首元本額2,929,494,221円、期中追加設定元本額1,587,651,463円、期中一部解約元本額1,379,662,253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) | 527,149,647円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 561,333,527円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 409,493,489円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 24,179,057円 |
| 三井住友・DC日本リートインデックスファンド | 1,318,525,849円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 7,249,023円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 28,114,893円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 19,044,936円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 59,826,990円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 31,414,131円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 25,064,827円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 12,230,878円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,159,286円 |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 328,136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> | 18,964,001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> | 11,225,579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> | 35,845,754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> | 46,333,428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2020年2月26日 至2020年8月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 109,616,383円 |
| 受 取 配 当 金 | 109,184,219 |
| そ の 他 収 益 金 | 471,235 |
| 支 払 利 息 | △ 39,071 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △1,384,888,546 |
| 売 買 益 損 | 108,215,867 |
| 売 買 損 益 | △1,493,104,413 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | △ 24,072,100 |
| 取 引 益 損 | 479,400 |
| 取 引 損 益 | △ 24,551,500 |
| (D) 信 託 報 酬 等 | △ 24,538 |
| (E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D) | △1,299,368,801 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | 5,019,106,665 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,689,956,376 |
| (H) 解 約 差 損 益 金 | △1,699,057,375 |
| (I) 計 (E + F + G + H) | 3,710,636,865 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (I) | 3,710,636,865 |

※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。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

外国リート・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）

| | |
|------|--|
| 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 証比 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|--|-------|--------------------------|-------|
| | 騰落 | 率 | 騰落 | 率 | | |
| 27期（2018年8月27日） | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 28期（2019年2月25日） | 20,790 | 15.2 | 229.10 | 15.8 | 99.1 | 5,795 |
| 29期（2019年8月26日） | 21,366 | 2.8 | 236.48 | 3.2 | 98.0 | 4,927 |
| 30期（2020年2月25日） | 21,144 | △1.0 | 235.00 | △0.6 | 99.4 | 5,204 |
| 31期（2020年8月25日） | 24,224 | 14.6 | 270.04 | 14.9 | 98.7 | 7,673 |
| | 18,760 | △22.6 | 209.38 | △22.5 | 99.1 | 7,606 |

※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2020年8月25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 証比 |
|--------------------|--------|-------|--|-------|--------------------------|
| | 騰落 | 率 | 騰落 | 率 | |
| (期首) 2020年2月25日 | 円 | % | | % | % |
| 2月末 | 24,224 | — | 270.04 | — | 98.7 |
| 3月末 | 22,029 | △9.1 | 245.35 | △9.1 | 99.1 |
| 4月末 | 16,524 | △31.8 | 183.83 | △31.9 | 97.0 |
| 5月末 | 17,635 | △27.2 | 196.30 | △27.3 | 98.8 |
| 6月末 | 17,807 | △26.5 | 198.33 | △26.6 | 100.6 |
| 7月末 | 17,999 | △25.7 | 200.68 | △25.7 | 98.5 |
| (期末) 2020年8月25日 | 18,332 | △24.3 | 204.25 | △24.4 | 98.8 |
| | 18,760 | △22.6 | 209.38 | △22.5 | 99.1 |

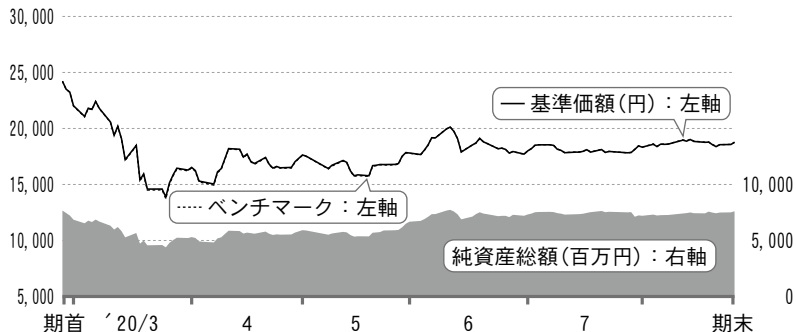
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 24,224円 |
| 期末 | 18,760円 |
| 騰落率 | -22.6% |

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、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（2020年2月26日から2020年8月25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。

下落要因

- ・新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な景気減速を受け、グローバルリート市場が下落したこと
- ・米ドルが円に対して下落したこと

▶ 投資環境について（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

当期のグローバルリート市場は下落しました。米ドルは対円で下落しました。

グローバルリート市場

期初から3月中旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けてリスク回避姿勢が高まり、グローバルリート市場が下落しました。特に、各国政府が感染拡大防止策として打ち出したロックダウン（都市封鎖）や店舗の臨時休業などによる経済活動の縮小により、小売りやホテル・セクターを中心に大幅な下落となりました。

3月下旬から期末にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大ペースにピークアウト感がみられたことや、企業などが徐々に経済活動を再開したことを好感し上昇傾向となりました。しかし、感染の再拡大に対する懸念もあり、期初からの大幅な下落を取り戻すまでには至りませんでした。

当期のグローバルリート市場の動きをS & P先進国REIT指数（米ドルベース）でみると、20.5%の下落となりました。

為替市場

米ドル・円は、新型コロナウイルスの感染が世界的に拡大したことから、市場や経済に対する不透明感が高まる中、リスク回避の動きが強まり、期初から3月上旬にかけて、米ドルが下落しました。ただし、WHO（世界保健機関）がパンデミック（世界的大流行）宣言を行う中、米ドル資金を確保する動きが強まったことなどから、3月中旬から下旬にかけて、米ドルが急上昇する局面もありました。4月以降は、市場の落ち着きなどを背景に、期末まで緩やかな米ドル安基調で推移しました。

当期の米ドル・円は期首110円91銭から期末106円01銭と4円90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（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

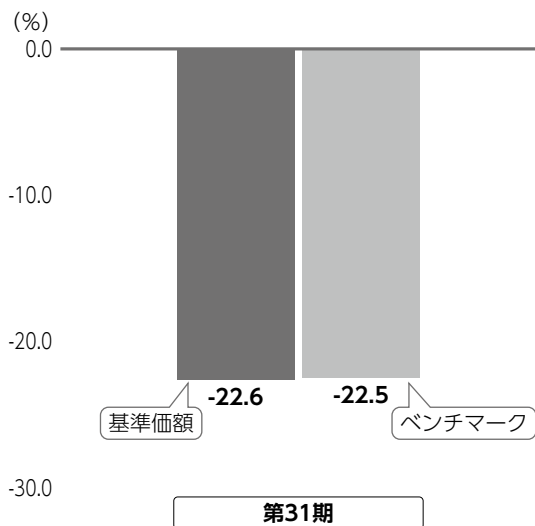
S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

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（2020年2月26日から2020年8月25日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



当ファンドは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-22.6%となり、ベンチマークの騰落率-22.5%を0.1%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、リート組入比率を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

■ 1万口当たりの費用明細 (2020年2月26日から2020年8月25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) | 0.068% (0.068) | 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) | 3 (3) | 0.015 (0.015) | 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) | 8 (7) (0) | 0.041 (0.039) (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 | 23 | 0.124 | |

期中の平均基準価額は18,387円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年2月26日から2020年8月25日まで)

投資信託証券

| | | 買付 | | 売却 | | |
|--------------------------|-------|--|-----------|--------|-------|-----|
| | | 口数 | 買付額 | 口数 | 売却額 | |
| | | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル | |
| 外国 | アメリカ | AGREE REALTY CORP | 2,681 | 170 | 1,030 | 65 |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC. | 2,744 | 437 | 717 | 122 |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 1,804 | 54 | — | — |
| | | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC | 2,895 | 101 | 1,014 | 35 |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 8,681 | 226 | 5,465 | 150 |
| | | AMERICOLD REALTY TRUST | 3,426 | 121 | — | — |
| | | APARTMENT INVESTMENT & MANAGEMENT CO-A | 2,708 | 106 | — | — |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 4,746 | 49 | — | — |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | — | — | — | — |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | (△ 6,012) | (△ 14) | — | — |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | — | — | — | — |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | (601) | (14) | — | — |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 2,611 | 413 | 444 | 64 |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 2,693 | 233 | 1,231 | 136 |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 4,458 | 48 | — | — |
| | | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | — | — | 7,201 | 1 |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 1,828 | 163 | 573 | 51 |
| | | CARETRUST REIT INC | 2,472 | 45 | — | — |
| | | CORESITE REALTY CORPORATION | 836 | 103 | — | — |
| | | CORECIVIC INC | 4,160 | 51 | — | — |
| COREPOINT LODGING INC | 1,000 | 4 | — | — | | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 1,810 | 56 | — | — | | |
| CUBESMART | 5,699 | 160 | 3,595 | 112 | | |
| CYRUSONE INC | 2,765 | 209 | 852 | 68 | | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 8,138 | 1,132 | 1,491 | 225 | | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 2,933 | 83 | 1,648 | 70 | | |

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 | DUKE REALTY CORP | 6,289 | 205 | 2,951 | 108 |
| | EPR PROPERTIES | 1,564 | 50 | — | — |
| | EASTGROUP PROPERTIES INC | 456 | 52 | — | — |
| | EQUINIX INC | 2,086 | 1,400 | 744 | 518 |
| | EQUITY COMMONWEALTH REIT | 1,516 | 50 | — | — |
| | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 2,774 | 168 | — | — |
| | EQUITY RESIDENTIAL | 6,946 | 410 | 2,149 | 145 |
| | ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST | 3,177 | 54 | — | — |
| | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 1,896 | 449 | 904 | 211 |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 2,443 | 234 | 652 | 62 |
| | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | 773 | 64 | — | — |
| | FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC | 1,378 | 52 | — | — |
| | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 2,221 | 53 | — | — |
| | GEO GROUP INC | 4,010 | 51 | — | — |
| | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 3,276 (134) | 94 (5) | 1,432 | 68 |
| | GLOBAL NET LEASE INC | 3,424 | 48 | — | — |
| | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 5,026 | 165 | 3,556 | 123 |
| | HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 4,575 | 127 | 1,950 | 61 |
| | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 10,648 | 281 | 2,394 | 63 |
| | HIGHWOODS PROPERTIES INC | 2,746 | 98 | 1,478 | 69 |
| | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 14,543 | 169 | 5,791 | 59 |
| | HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 2,317 | 49 | — | — |
| | INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 2,554 | 47 | — | — |
| | INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 569 | 52 | — | — |
| | INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 703 | 45 | — | — |
| | INVITATION HOMES INC | 10,388 | 258 | 2,012 | 56 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 8,139 | 215 | 5,330 | 156 |
| | JBG SMITH PROPERTIES | 1,681 | 52 | — | — |
| | KILROY REALTY CORP | 3,063 | 181 | 1,090 | 61 |
| | KIMCO REALTY CORPORATION | 9,572 | 108 | — | — |
| | LTC PROPERTIES INC | 1,271 | 42 | — | — |
| | LEXINGTON REALTY TRUST | 7,142 | 77 | 5,725 | 63 |
| | LIFE STORAGE INC | 879 | 83 | — | — |
| | MACERICH COMPANY/THE | 5,912 (227) | 50 (1) | — | — |
| | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 12,418 | 230 | 5,632 | 115 |
| | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 2,079 | 229 | 580 | 63 |
| | MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP | 3,600 | 45 | — | — |
| | NATIONAL HEALTH INVESTORS INC | 986 | 42 | 763 | 54 |
| | NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 3,260 | 107 | 1,569 | 54 |
| | NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 579 | 19 | — | — |
| | NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST | 1,329 | 42 | 1,323 | 54 |
| | OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 1,953 | 50 | — | — |
| | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | 5,521 | 165 | 2,462 | 77 |
| | ONE LIBERTY PROPERTIES INC | — (10) | — (0.18118) | — | — |
| | PS BUSINESS PARKS INC/CA | 383 | 48 | — | — |
| | PARAMOUNT GROUP INC | 5,280 | 44 | — | — |
| | PARK HOTELS AND RESORTS INC | 4,842 | 49 | — | — |
| 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 | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 3,462 | 48 | — | — |
| | PHYSICIANS REALTY TRUST | 9,674 | 158 | 4,000 | 70 |
| | PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 2,482 | 46 | — | — |
| | PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 500 | 6 | — | — |
| | PROLOGIS INC | 16,452 | 1,467 | 6,890 | 643 |
| | PUBLIC STORAGE | 2,681 | 522 | 534 | 99 |
| | QTS REALTY TRUST INC-CL A | 1,437 | 92 | 934 | 64 |
| | RLJ LODGING TRUST | 4,666 | 46 | — | — |
| | REALTY INCOME CORPORATION | 8,801 | 489 | 2,783 | 175 |
| | REGENCY CENTERS CORP | 6,206 | 293 | 3,767 | 188 |
| | REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 2,675 | 105 | 1,294 | 54 |
| | SL GREEN REALTY CORP | 4,330 | 208 | 3,337 | 191 |
| | SABRA HEALTH CARE REIT | 3,352 | 46 | — | — |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 5,546 | 54 | — | — |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 6,634 | 417 | 2,456 | 202 |
| | SITE CENTERS CORP | 6,880 | 55 | — | — |
| | SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 1,551 | 47 | — | — |
| | STAG INDUSTRIAL INC | 5,863 | 176 | 2,422 | 76 |
| | STORE CAPITAL CORP | 3,623 | 77 | — | — |
| | SUN COMMUNITIES INC | 2,406 | 343 | 816 | 122 |
| | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 5,805 | 50 | — | — |
| | TAUBMAN CENTERS INC | 1,163 | 47 | — | — |
| | TERRENO REALTY CORP | 833 | 45 | — | — |
| | UDR INC | 4,733 | 183 | 1,112 | 39 |
| | VENTAS INC | 7,994 | 291 | 2,408 | 85 |
| | VEREIT INC | 17,318 | 95 | — | — |
| | VICI PROPERTIES INC | 10,924 | 217 | 3,625 | 75 |
| | VORNADO REALTY TRUST | 2,836 | 107 | 1,477 | 51 |
| | WP CAREY INC | 4,024 | 270 | 1,098 | 74 |
| | WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,647 | 34 | — | — |
| | WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 2,544 | 48 | — | — |
| | WELLTOWER INC | 8,657 | 433 | 2,159 | 130 |
| WHITESTONE REIT | 1,000 | 6 | 4,533 | 56 | |
| PRIME US REIT | (—) | (△ 0.0675) | — | — | |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | (—) | (△ 0.3058) | — | — | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 58,300 | 43 | — | — | |
| 小 計 | 476,274 (△ 5,040) | 17,179 (6) | 121,393 | 5,754 | |
| 国 カ ナ ダ | 口 千カナダドル | 口 千カナダドル | | | |
| | BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,705 | 51 | 1,498 | 45 |
| | CAN APARTMENT PROP | 1,293 | 61 | — | — |
| | CHOICE PROPERTIES REIT | 3,883 | 46 | — | — |
| | COMINAR REAL ESTATE INV-TR | 5,753 | 51 | — | — |
| | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 4,251 | 55 | 4,957 | 63 |
| | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR | 1,222 | 13 | — | — |
| | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 3,537 | 49 | 2,325 | 47 |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 731 | 41 | — | — |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 1,971 | 28 | — | — | |

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 | NORTHVIEW APARTMENT REIT | 792 | 23 | — | — | |
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 4,323 | 65 | — | — | |
| | | SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 411 | 8 | — | — | |
| | | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST | 7,239 | 42 | — | — | |
| | | WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I | 2,449 | 45 | — | — | |
| | 小 計 | 39,560 | 586 | 8,780 | 156 | | |
| | ユ | ド イ ツ | HAMBORNER REIT AG | □ | 千ユーロ | □ | 千ユーロ |
| | | | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 3,245 | 25 | — | — |
| | | 小 計 | 3,832 | 55 | 4,745 | 73 | |
| | | フ ラ ン ス | ICADE | 7,077 | 81 | 4,745 | 73 |
| | | | ALTAREA | 695 | 43 | — | — |
| | | | KLEPIERRE | (—) | (△ 0.6568) | — | — |
| | | | GECINA SA | (2,688) | (△ 45) | — | — |
| | | | COVIVIO | 1,423 | 163 | 670 | 71 |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED | 870 | 43 | — | — | |
| | | 小 計 | 2,111 | 115 | — | — | |
| | オ ラ ン ダ | NSI NV | (7,787) | (△ 412) | 670 | 71 | |
| | 小 計 | 852 | 28 | — | — | | |
| | ス ペ イ ン | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | (5,617) | (△0.52473) | — | — | |
| | | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 3,000 | 23 | — | — | |
| 小 計 | | (8,617) | (△0.52473) | — | — | | |
| ベルギー | BEFIMMO SCA | 821 | 31 | — | — | | |
| | COFINIMMO | 605 | 74 | 399 | 47 | | |
| | RETAIL ESTATES | 930 | 52 | 764 | 42 | | |
| | MONTEA | 405 | 33 | 398 | 36 | | |
| | AEDIFICA | 1,135 | 107 | 788 | 88 | | |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 3,304 | 74 | 1,832 | 51 | | |
| 小 計 | 7,200 | 373 | 4,181 | 266 | | | |
| アイルランド | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 28,332 | 40 | — | — | | |
| 小 計 | 28,332 | 40 | — | — | | | |
| ユ ー ロ 計 | (59,865) | (△ 1,001) | 9,596 | 410 | | | |
| 国 | イギリス | BRITISH LAND CO PLC | □ | 千英ポンド | □ | 千英ポンド | |
| | | DERWENT LONDON PLC | 20,647 | 80 | 10,649 | 52 | |
| | | BIG YELLOW GROUP PLC | 1,361 | 38 | — | — | |
| | | UNITE GROUP PLC | 3,345 | 33 | — | — | |
| | | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 9,802 | 81 | 5,516 | 50 | |
| | | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 42,141 | 29 | — | — | |
| | | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 5,147 | 34 | 5,281 | 41 | |
| | | BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS | 37,804 | 88 | 21,632 | 47 | |
| | | SEGRO PLC | 63,210 | 41 | — | — | |
| | | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE | 31,724 | 276 | 9,732 | 89 | |
| | | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 64,631 | 103 | — | — | |
| | | | 32,964 | 34 | — | — | |

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 | | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 6,274 | 40 | — | — | |
| | | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 27,741 | 39 | — | — | |
| | | ELITE COMMERCIAL REIT | 20,000 | 13 | — | — | |
| | | ASSURA PLC | 48,611 | 38 | — | — | |
| | | AEW UK REIT PLC | 9,000 | 6 | — | — | |
| | | PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 24,693 | 37 | — | — | |
| | | REGIONAL REIT LTD | 40,664 | 36 | — | — | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 7,835 | 46 | — | — | | |
| | 小 | 計 | 497,594 | 1,102 | 52,810 | 280 | |
| | オーストラリア | | MIRVAC GROUP | 63,932 | 147 | 27,641 | 86 |
| | | | CROMWELL PROPERTY GROUP | 83,925 | 77 | 93,228 | 82 |
| | | | GPT GROUP | 51,538 | 247 | 39,396 | 186 |
| | | | STOCKLAND | 65,541 | 214 | 28,099 | 92 |
| | | | DEXUS | 33,265 | 310 | 19,845 | 201 |
| | | | GOODMAN GROUP | 31,373 | 491 | 6,797 | 113 |
| CHARTER HALL GROUP | | | 7,529 | 71 | — | — | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | | | 18,253 | 82 | — | — | |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR | | | 31,883 | 69 | — | — | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | | | 8,987 | 41 | — | — | |
| NATIONAL STORAGE REIT | | | 36,571 | 68 | — | — | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | | | 23,821 | 65 | — | — | |
| SCENTRE GROUP | | | 73,932 | 163 | — | — | |
| VICINITY CENTRES | 117,984 | 188 | — | — | | | |
| VIVA ENERGY REIT | 32,503 | 69 | — | — | | | |
| 小 | 計 | 681,037 | 2,309 | 215,006 | 763 | | |
| ニュージーランド | | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 32,088 | 54 | — | — | |
| | | GOODMAN PROPERTY TRUST | — | — | 21,687 | 47 | |
| | | ARGOSY PROPERTY LTD | 54,995 | 63 | — | — | |
| 小 | 計 | 87,083 | 117 | 21,687 | 47 | | |
| 香 港 | | LINK REIT | 45,700 | 2,963 | 16,500 | 997 | |
| | | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 92,000 | 334 | — | — | |
| | | CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT | 35,000 | 124 | — | — | |
| 小 | 計 | 172,700 | 3,423 | 16,500 | 997 | | |
| 国 | シンガポール | CAPITALAND MALL TRUST | 73,700 | 147 | 41,200 | 95 | |
| | | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 69,600 | 222 | 28,000 | 98 | |
| | | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | (—) | (△ 2) | — | — | |
| | | SUNTEC REIT | 43,800 | 71 | — | — | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 46,600 | 62 | 39,800 | 70 | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 39,100 | 71 | — | — | |
| | | FRASERS COMMERCIAL TRUST | (—) | (△ 1) | — | — | |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | (△ 44,800) | (△ 75) | — | — | | | |
| KEPPEL REIT | (—) | (△ 0.2967) | — | — | | | |

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 | ESR REIT | 160,400 | 64 | — | — |
| | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | (—) | (△ 0.3332) | — | — |
| | PARKWAY LIFE REAL ESTATE | (16,800) | (△0.35164) | — | — |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T | (—) | (△ 0.1188) | — | — |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | (43,000) | (△0.09126) | 26,600 | 85 |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 60,500 | 117 | 44,400 | 85 |
| | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | (—) | (△0.05405) | — | — |
| | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | (84,200) | (△ 0.7387) | — | — |
| | SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | (—) | (△ 0.0286) | — | — |
| | ASCOTT TRUST | (—) | (△0.23879) | — | — |
| | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL | (25,000) | (△ 0.1335) | — | — |
| | KEPPEL DC REIT | 24,200 | 59 | — | — |
| | FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | (57,800) | (59) | (—) | (6) |
| | 小 計 | (744,700) | (△ 1,136) | (180,000) | (435) |
| 韓 国 | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | □ 1,800 | 千韓国ウォン 11,521 | □ — | 千韓国ウォン — |
| | LOTTE REIT CO LTD | 5,000 | 29,151 | — | — |
| | 小 計 | 6,800 | 40,672 | — | — |

※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 (2020年2月26日から2020年8月25日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2020年2月26日から2020年8月25日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2020年8月25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 | | |
| | | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | 口 | 数 | 口 | 数 | 千円ドル | 千円 | % |
| ACADIA REALTY TRUST | | 5,392 | | 5,392 | | 64 | 6,876 | 0.1 |
| AGREE REALTY CORP | | 1,879 | | 3,530 | | 236 | 25,117 | 0.3 |
| ALEXANDER'S INC | | 136 | | 136 | | 35 | 3,809 | 0.1 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC. | | 6,003 | | 8,030 | | 1,374 | 145,744 | 1.9 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | | 2,052 | | 3,856 | | 99 | 10,534 | 0.1 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC | | 6,450 | | 8,331 | | 277 | 29,418 | 0.4 |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | | 6,262 | | 6,262 | | 44 | 4,706 | 0.1 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT-A | | 13,698 | | 16,914 | | 482 | 51,119 | 0.7 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | | 9,289 | | 12,715 | | 485 | 51,517 | 0.7 |
| APARTMENT INVESTMENT & MANAGEMENT CO-A | | 7,061 | | 9,769 | | 349 | 37,085 | 0.5 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | | 10,088 | | 14,834 | | 144 | 15,363 | 0.2 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | | 6,012 | | — | | — | — | — |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | | — | | 601 | | 1 | 198 | 0.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 6,764 | | 8,931 | | 1,391 | 147,488 | 1.9 |
| BRT APARTMENTS CORP | | 500 | | 500 | | 6 | 676 | 0.0 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | | 600 | | 600 | | 4 | 481 | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 7,286 | | 8,748 | | 762 | 80,802 | 1.1 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | | 602 | | 602 | | 1 | 153 | 0.0 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | | 9,810 | | 9,810 | | 110 | 11,709 | 0.2 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | | 14,299 | | 18,757 | | 227 | 24,099 | 0.3 |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | | 2,361 | | 2,361 | | 28 | 2,990 | 0.0 |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | | 7,201 | | — | | — | — | — |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 4,641 | | 5,896 | | 519 | 55,103 | 0.7 |
| CARETRUST REIT INC | | 4,198 | | 6,670 | | 127 | 13,568 | 0.2 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | | 2,130 | | 2,130 | | 1 | 202 | 0.0 |
| CHATHAM LODGING TRUST | | 4,019 | | 4,019 | | 28 | 2,995 | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC | | 4,603 | | 4,603 | | 38 | 4,035 | 0.1 |
| CLIPPER REALTY INC | | 800 | | 800 | | 5 | 563 | 0.0 |
| COLONY CAPITAL INC-CLASS A | | 22,060 | | 22,060 | | 63 | 6,758 | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | | 7,180 | | 7,180 | | 88 | 9,385 | 0.1 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | | 1,483 | | 1,483 | | 70 | 7,434 | 0.1 |

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 | 組入比率 |
| | | | | | |
| CORESITE REALTY CORPORATION | 1,755 | 2,591 | 311 | 33,070 | 0.4 |
| CORECIVIC INC | 5,301 | 9,461 | 91 | 9,688 | 0.1 |
| COREPOINT LODGING INC | — | 1,000 | 5 | 600 | 0.0 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 6,389 | 6,389 | 161 | 17,122 | 0.2 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 7,553 | 9,363 | 290 | 30,749 | 0.4 |
| CUBESMART | 10,274 | 12,378 | 387 | 41,071 | 0.5 |
| CYRUSONE INC | 5,633 | 7,546 | 604 | 64,076 | 0.8 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY | 10,330 | 10,330 | 54 | 5,760 | 0.1 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 10,094 | 16,741 | 2,558 | 271,264 | 3.6 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 10,696 | 10,696 | 42 | 4,535 | 0.1 |
| DOUGLAS EMMETT INC | 8,871 | 10,156 | 287 | 30,511 | 0.4 |
| DUKE REALTY CORP | 18,965 | 22,303 | 854 | 90,601 | 1.2 |
| EPR PROPERTIES | 3,634 | 5,198 | 165 | 17,556 | 0.2 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES | 4,292 | 4,292 | 104 | 11,101 | 0.1 |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 1,928 | 2,384 | 319 | 33,845 | 0.4 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 6,910 | 6,910 | 44 | 4,746 | 0.1 |
| EQUINIX INC | 4,190 | 5,532 | 4,273 | 453,012 | 6.0 |
| EQUITY COMMONWEALTH REIT | 6,082 | 7,598 | 232 | 24,614 | 0.3 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 8,777 | 11,551 | 764 | 81,063 | 1.1 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 17,554 | 22,351 | 1,249 | 132,474 | 1.7 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST | 4,017 | 7,194 | 124 | 13,147 | 0.2 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 3,235 | 4,227 | 909 | 96,405 | 1.3 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 6,169 | 7,960 | 845 | 89,649 | 1.2 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 300 | 300 | 2 | 216 | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | 3,495 | 4,268 | 349 | 37,069 | 0.5 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC | 6,809 | 8,187 | 351 | 37,302 | 0.5 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 3,339 | 5,560 | 139 | 14,800 | 0.2 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION | 3,700 | 3,700 | 17 | 1,855 | 0.0 |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 2,000 | 2,000 | 19 | 2,043 | 0.0 |
| GEO GROUP INC | 5,536 | 9,546 | 106 | 11,303 | 0.1 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 10,722 | 12,700 | 472 | 50,137 | 0.7 |
| GETTY REALTY CORPORATION | 1,428 | 1,428 | 41 | 4,437 | 0.1 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION | 1,440 | 1,440 | 26 | 2,845 | 0.0 |
| GLADSTONE LAND CORP | 600 | 600 | 9 | 969 | 0.0 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 3,433 | 6,857 | 121 | 12,902 | 0.2 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 1,000 | 1,000 | 12 | 1,376 | 0.0 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 7,343 | 8,813 | 251 | 26,682 | 0.4 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 10,857 | 13,482 | 348 | 36,974 | 0.5 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 24,335 | 32,589 | 910 | 96,525 | 1.3 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 1,018 | 1,018 | 6 | 734 | 0.0 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 5,754 | 7,022 | 265 | 28,130 | 0.4 |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 34,983 | 43,735 | 485 | 51,417 | 0.7 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 7,433 | 9,750 | 232 | 24,651 | 0.3 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST | 4,641 | 4,641 | 54 | 5,775 | 0.1 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 2,254 | 4,808 | 103 | 10,981 | 0.1 |

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 | 組入比率 | | |
| | | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | | 878 | | 1,447 | 175 | 18,574 | 0.2 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | | 323 | | 1,026 | 72 | 7,703 | 0.1 |
| INVITATION HOMES INC | | 25,551 | | 33,927 | 987 | 104,697 | 1.4 |
| IRON MOUNTAIN INC | | 15,137 | | 17,946 | 544 | 57,720 | 0.8 |
| JBG SMITH PROPERTIES | | 5,796 | | 7,477 | 208 | 22,059 | 0.3 |
| KILROY REALTY CORP | | 4,568 | | 6,541 | 380 | 40,321 | 0.5 |
| KIMCO REALTY CORPORATION | | 19,534 | | 29,106 | 344 | 36,563 | 0.5 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | | 3,261 | | 3,261 | 38 | 4,037 | 0.1 |
| LTC PROPERTIES INC | | 1,576 | | 2,847 | 104 | 11,055 | 0.1 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | | 12,897 | | 14,314 | 166 | 17,693 | 0.2 |
| LIFE STORAGE INC | | 2,099 | | 2,978 | 308 | 32,731 | 0.4 |
| MACERICH COMPANY/THE | | 4,415 | | 10,554 | 84 | 8,961 | 0.1 |
| MACK-CALI REALTY CORPORATION | | 4,669 | | 4,669 | 60 | 6,464 | 0.1 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | | 26,878 | | 33,664 | 632 | 67,091 | 0.9 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | | 5,424 | | 6,923 | 800 | 84,905 | 1.1 |
| MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP | | 3,536 | | 7,136 | 103 | 10,931 | 0.1 |
| NATIONAL HEALTH INVESTORS INC | | 2,469 | | 2,692 | 170 | 18,078 | 0.2 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | | 8,720 | | 10,411 | 376 | 39,908 | 0.5 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | | 3,311 | | 3,890 | 131 | 13,954 | 0.2 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | | 2,800 | | 2,800 | 12 | 1,303 | 0.0 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST | | 1,754 | | 1,760 | 73 | 7,815 | 0.1 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | | 1,919 | | 3,872 | 96 | 10,245 | 0.1 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | | 11,098 | | 14,157 | 435 | 46,209 | 0.6 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | | 1,000 | | 1,010 | 18 | 1,928 | 0.0 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | | 938 | | 1,321 | 169 | 18,016 | 0.2 |
| PARAMOUNT GROUP INC | | 8,400 | | 13,680 | 103 | 11,021 | 0.1 |
| PARK HOTELS AND RESORTS INC | | 11,136 | | 15,978 | 148 | 15,769 | 0.2 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | | 5,931 | | 9,393 | 117 | 12,436 | 0.2 |
| PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | | 2,331 | | 2,331 | 2 | 276 | 0.0 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | | 8,507 | | 14,181 | 256 | 27,195 | 0.4 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | | 5,400 | | 7,882 | 125 | 13,268 | 0.2 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | | — | | 500 | 6 | 688 | 0.0 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | | 2,900 | | 2,900 | 19 | 2,102 | 0.0 |
| PROLOGIS INC | | 36,575 | | 46,137 | 4,705 | 498,880 | 6.6 |
| PUBLIC STORAGE | | 7,232 | | 9,379 | 1,937 | 205,375 | 2.7 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A | | 2,764 | | 3,267 | 216 | 22,965 | 0.3 |
| RLJ LODGING TRUST | | 7,377 | | 12,043 | 111 | 11,860 | 0.2 |
| RPT REALTY | | 2,740 | | 2,740 | 16 | 1,786 | 0.0 |
| REALTY INCOME CORPORATION | | 15,860 | | 21,878 | 1,366 | 144,816 | 1.9 |
| REGENCY CENTERS CORP | | 8,593 | | 11,032 | 452 | 48,008 | 0.6 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | | 7,539 | | 7,539 | 87 | 9,230 | 0.1 |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA | | 10,355 | | 10,355 | 68 | 7,234 | 0.1 |
| RETAIL VALUE INC | | 617 | | 617 | 8 | 869 | 0.0 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | | 5,655 | | 7,036 | 333 | 35,355 | 0.5 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | | 2,795 | | 2,795 | 104 | 11,060 | 0.1 |

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 | | |
| SL GREEN REALTY CORP | 4,368 | 5,361 | 267 | 28,325 | 0.4 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT | 10,004 | 13,356 | 201 | 21,358 | 0.3 | |
| SAFEHOLD INC | 600 | 600 | 31 | 3,291 | 0.0 | |
| SAUL CENTERS INC | 703 | 703 | 20 | 2,144 | 0.0 | |
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 1,500 | 1,500 | 19 | 2,111 | 0.0 | |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 7,445 | 12,991 | 110 | 11,761 | 0.2 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 15,325 | 19,503 | 1,335 | 141,624 | 1.9 | |
| SITE CENTERS CORP | 5,797 | 12,677 | 98 | 10,482 | 0.1 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 4,896 | 6,447 | 237 | 25,130 | 0.3 | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 6,764 | 10,205 | 329 | 34,964 | 0.5 | |
| STORE CAPITAL CORP | 10,261 | 13,884 | 374 | 39,695 | 0.5 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 4,300 | 4,300 | 25 | 2,721 | 0.0 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 4,599 | 6,189 | 914 | 96,957 | 1.3 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 9,659 | 15,464 | 125 | 13,262 | 0.2 | |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC | 3,736 | 3,736 | 22 | 2,368 | 0.0 | |
| TAUBMAN CENTERS INC | 2,883 | 4,046 | 148 | 15,736 | 0.2 | |
| TERRENO REALTY CORP | 3,124 | 3,957 | 231 | 24,543 | 0.3 | |
| UDR INC | 14,232 | 17,853 | 616 | 65,351 | 0.9 | |
| UMH PROPERTIES INC | 800 | 800 | 11 | 1,177 | 0.0 | |
| UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST | 775 | 775 | 52 | 5,594 | 0.1 | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 6,559 | 6,559 | 72 | 7,704 | 0.1 | |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A | 2,927 | 2,927 | 28 | 3,062 | 0.0 | |
| VENTAS INC | 17,895 | 23,481 | 993 | 105,269 | 1.4 | |
| VEREIT INC | 51,987 | 69,305 | 479 | 50,841 | 0.7 | |
| VICI PROPERTIES INC | 21,940 | 29,239 | 672 | 71,260 | 0.9 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 7,768 | 9,127 | 337 | 35,770 | 0.5 | |
| WP CAREY INC | 8,165 | 11,091 | 794 | 84,172 | 1.1 | |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 6,130 | 6,130 | 4 | 456 | 0.0 | |
| WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,270 | 4,917 | 110 | 11,759 | 0.2 | |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 5,598 | 8,142 | 146 | 15,501 | 0.2 | |
| WELLTOWER INC | 19,745 | 26,243 | 1,506 | 159,743 | 2.1 | |
| WHITESTONE REIT | 4,533 | 1,000 | 6 | 715 | 0.0 | |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 6,674 | 6,674 | 60 | 6,417 | 0.1 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 20,000 | 20,000 | 2 | 290 | 0.0 | |
| PRIME US REIT | 15,000 | 15,000 | 11 | 1,256 | 0.0 | |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | 20,000 | 20,000 | 6 | 710 | 0.0 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 63,400 | 121,700 | 89 | 9,482 | 0.1 | |
| 小計 | 口数 | 口数 | 金額 | 金額 | | |
| | 1,196,548 | 1,546,389 | 53,277 | 5,647,941 | | |
| | 銘柄数 | 銘柄数 | <比率> | <比率> | | |
| | 155 | 156 | — | <74.2%> | | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE | 3,629 | 3,629 | 141 | 11,341 | 0.1 | |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 2,233 | 2,233 | 19 | 1,577 | 0.0 | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 735 | 942 | 29 | 2,379 | 0.0 | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,200 | 3,200 | 45 | 3,636 | 0.0 | |
| CAN APARTMENT PROP | 4,246 | 5,539 | 263 | 21,076 | 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 | | 評 価 額 | | 組 入 比 率 |
| | | 口 | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 5,671 | 9,554 | 122 | 9,847 | 0.1 | |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR | 3,192 | 8,945 | 63 | 5,086 | 0.1 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,500 | 794 | 10 | 842 | 0.0 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 1,476 | 1,476 | 29 | 2,350 | 0.0 | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR | 3,700 | 4,922 | 55 | 4,450 | 0.1 | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 6,982 | 8,194 | 117 | 9,430 | 0.1 | |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 1,000 | 1,731 | 135 | 10,891 | 0.1 | |
| H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7,692 | 7,692 | 79 | 6,339 | 0.1 | |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 2,479 | 4,450 | 58 | 4,700 | 0.1 | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 3,017 | 3,017 | 54 | 4,349 | 0.1 | |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 303 | 303 | 5 | 447 | 0.0 | |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RE | 1,557 | 1,557 | 24 | 1,966 | 0.0 | |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 1,052 | 1,844 | 64 | 5,129 | 0.1 | |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | 4,111 | 4,111 | 46 | 3,763 | 0.0 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 6,629 | 10,952 | 169 | 13,578 | 0.2 | |
| SLATE OFFICE REIT | 1,000 | 1,000 | 3 | 308 | 0.0 | |
| SLATE RETAIL REIT | 500 | — | — | — | — | |
| SLATE GROCERY REIT | — | 500 | 4 | 387 | 0.0 | |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 3,256 | 3,667 | 75 | 6,058 | 0.1 | |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 6,456 | 6,456 | 77 | 6,235 | 0.1 | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST | 1,000 | 8,239 | 49 | 3,945 | 0.1 | |
| WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I | — | 2,449 | 43 | 3,461 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 | 76,616 | 107,396 | 1,792 | 143,582 | |
| | 銘柄 数 <比率> | 25 | 26 | — | <1.9%> | |
| (ユーロ・・・ドイツ) | | | | 千ユーロ | | |
| HAMBORNER REIT AG | 2,840 | 6,085 | 51 | 6,498 | 0.1 | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 9,227 | 8,314 | 104 | 13,007 | 0.2 | |
| 小 計 | 口 数 | 12,067 | 14,399 | 155 | 19,506 | |
| | 銘柄 数 <比率> | 2 | 2 | — | <0.3%> | |
| (ユーロ・・・イタリア) | | | | 千ユーロ | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 3,408 | 3,408 | 10 | 1,321 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 | 3,408 | 3,408 | 10 | 1,321 | |
| | 銘柄 数 <比率> | 1 | 1 | — | <0.0%> | |
| (ユーロ・・・フランス) | | | | 千ユーロ | | |
| ICADE | 1,437 | 2,132 | 118 | 14,784 | 0.2 | |
| ALTAREA | 80 | 80 | 9 | 1,248 | 0.0 | |
| KLEPIERRE | 10,551 | 13,239 | 184 | 23,055 | 0.3 | |
| GECINA SA | 2,599 | 3,352 | 384 | 48,082 | 0.6 | |
| COVIVIO | 2,060 | 2,930 | 185 | 23,249 | 0.3 | |
| MERCIALYS | 2,280 | 2,280 | 12 | 1,591 | 0.0 | |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED | 6,474 | 8,585 | 348 | 43,611 | 0.6 | |
| 小 計 | 口 数 | 25,481 | 32,598 | 1,244 | 155,622 | |
| | 銘柄 数 <比率> | 7 | 7 | — | <2.0%> | |
| (ユーロ・・・オランダ) | | | | 千ユーロ | | |
| EUROCOMMERCIAL | 2,113 | 2,113 | 19 | 2,444 | 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 | | 組入比率 |
|---------------------------------------|----------|---------|-------|---------|--------|------|
| | | 口数 | 口数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| VASTNED RETAIL | 925 | 925 | 22 | 2,851 | 0.0 | |
| WERELDHAVE NV | 3,304 | 3,304 | 23 | 2,937 | 0.0 | |
| NSI NV | 727 | 1,579 | 47 | 5,953 | 0.1 | |
| 小計 | 7,069 | 7,921 | 113 | 14,187 | | |
| | 銘柄数 <比率> | 4 | 4 | — | <0.2%> | |
| (ユーロ・・・スペイン) | | | 千ユーロ | | | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 11,858 | 17,475 | 130 | 16,346 | 0.2 | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 2,620 | 2,620 | 11 | 1,404 | 0.0 | |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 18,605 | 21,605 | 164 | 20,521 | 0.3 | |
| 小計 | 33,083 | 41,700 | 306 | 38,272 | | |
| | 銘柄数 <比率> | 3 | 3 | — | <0.5%> | |
| (ユーロ・・・ベルギー) | | | 千ユーロ | | | |
| BEFIMMO SCA | 1,112 | 1,933 | 73 | 9,246 | 0.1 | |
| COFINIMMO | 1,185 | 1,391 | 169 | 21,222 | 0.3 | |
| RETAIL ESTATES | 512 | 678 | 38 | 4,799 | 0.1 | |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | 1,302 | 1,302 | 28 | 3,614 | 0.0 | |
| MONTEA | 430 | 437 | 43 | 5,405 | 0.1 | |
| AEDIFICA | 1,410 | 1,757 | 176 | 22,104 | 0.3 | |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 7,283 | 8,755 | 259 | 32,507 | 0.4 | |
| 小計 | 13,234 | 16,253 | 790 | 98,900 | | |
| | 銘柄数 <比率> | 7 | 7 | — | <1.3%> | |
| (ユーロ・・・アイルランド) | | | 千ユーロ | | | |
| HIBERNIA REIT PLC | 25,270 | 25,270 | 30 | 3,754 | 0.0 | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 10,100 | 38,432 | 57 | 7,171 | 0.1 | |
| 小計 | 35,370 | 63,702 | 87 | 10,925 | | |
| | 銘柄数 <比率> | 2 | 2 | — | <0.1%> | |
| ユーロ計 | 129,712 | 179,981 | 2,708 | 338,735 | | |
| | 銘柄数 <比率> | 26 | 26 | — | <4.5%> | |
| (イギリス) | | | 千英ポンド | | | |
| BRITISH LAND CO PLC | 50,867 | 60,865 | 220 | 30,576 | 0.4 | |
| DERWENT LONDON PLC | 5,161 | 6,522 | 187 | 25,929 | 0.3 | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 6,736 | 10,081 | 106 | 14,770 | 0.2 | |
| HAMMERSON PLC | 36,480 | 36,480 | 17 | 2,489 | 0.0 | |
| INTU PROPERTIES PLC | 28,500 | 28,500 | 0.285 | 39 | 0.0 | |
| UNITE GROUP PLC | 17,621 | 21,907 | 211 | 29,319 | 0.4 | |
| SHAFTESBURY PLC | 11,737 | 11,737 | 60 | 8,354 | 0.1 | |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 15,000 | 15,000 | 4 | 635 | 0.0 | |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 15,000 | 57,141 | 40 | 5,623 | 0.1 | |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 35,000 | 35,000 | 23 | 3,221 | 0.0 | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 13,067 | 12,933 | 99 | 13,804 | 0.2 | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 49,553 | 65,725 | 159 | 22,121 | 0.3 | |
| BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS | — | 63,210 | 42 | 5,923 | 0.1 | |
| SEGRO PLC | 50,582 | 72,574 | 699 | 96,980 | 1.3 | |
| CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE | — | 64,631 | 81 | 11,288 | 0.1 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 6,465 | 6,465 | 36 | 5,112 | 0.1 | |

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 | | |
| NEWRIVER REIT PLC | 17,642 | 17,642 | 10 | 1,437 | 0.0 | |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 19,661 | 52,625 | 58 | 8,053 | 0.1 | |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 10,000 | 10,000 | 10 | 1,469 | 0.0 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 13,270 | 19,544 | 117 | 16,347 | 0.2 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 93,936 | 121,677 | 190 | 26,447 | 0.3 | |
| RDI REIT PLC | 8,020 | 8,020 | 7 | 982 | 0.0 | |
| ELITE COMMERCIAL REIT | — | 20,000 | 13 | 1,815 | 0.0 | |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 2,000 | 2,000 | 1 | 191 | 0.0 | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 20,000 | 20,000 | 13 | 1,890 | 0.0 | |
| ASSURA PLC | 116,800 | 165,411 | 133 | 18,503 | 0.2 | |
| AEW UK REIT PLC | — | 9,000 | 7 | 1,023 | 0.0 | |
| LXI REIT PLC | 36,635 | 36,635 | 40 | 5,636 | 0.1 | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 63,444 | 88,137 | 133 | 18,546 | 0.2 | |
| REGIONAL REIT LTD | 5,000 | 45,664 | 35 | 4,855 | 0.1 | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 38,148 | 45,983 | 263 | 36,562 | 0.5 | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 786,325 27 | 1,231,109 31 | 3,029 — | 419,954 <5.5%> | |
| (オーストラリア) | | | 千オーストラリアドル | | | |
| BWP TRUST | 26,090 | 26,090 | 104 | 7,920 | 0.1 | |
| MIRVAC GROUP | 209,503 | 245,794 | 511 | 38,901 | 0.5 | |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 82,000 | 72,697 | 63 | 4,812 | 0.1 | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 24,091 | 24,091 | 79 | 6,012 | 0.1 | |
| GPT GROUP | 99,994 | 112,136 | 422 | 32,167 | 0.4 | |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 23,209 | 23,209 | 62 | 4,732 | 0.1 | |
| STOCKLAND | 113,616 | 151,058 | 548 | 41,723 | 0.5 | |
| DEXUS | 55,989 | 69,409 | 601 | 45,789 | 0.6 | |
| GOODMAN GROUP | 79,095 | 103,671 | 1,897 | 144,356 | 1.9 | |
| CHARTER HALL GROUP | 23,313 | 30,842 | 378 | 28,771 | 0.4 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUS | 15,930 | 15,930 | 51 | 3,939 | 0.1 | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 8,166 | 26,419 | 126 | 9,588 | 0.1 | |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR | 42,042 | 73,925 | 153 | 11,699 | 0.2 | |
| ARENA REIT | 12,763 | 12,763 | 31 | 2,398 | 0.0 | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 16,958 | 25,945 | 127 | 9,673 | 0.1 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 43,936 | 80,507 | 151 | 11,516 | 0.2 | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 100 | 23,921 | 70 | 5,387 | 0.1 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 18,000 | 18,000 | 19 | 1,458 | 0.0 | |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 7,100 | 7,100 | 18 | 1,420 | 0.0 | |
| APN INDUSTRIA REIT | 1,000 | 1,000 | 2 | 187 | 0.0 | |
| RURAL FUNDS GROUP | 10,000 | 10,000 | 22 | 1,673 | 0.0 | |
| CENTURIA OFFICE REIT | 24,034 | 24,034 | 46 | 3,538 | 0.0 | |
| WAYPOINT REIT LTD | — | 50,503 | 134 | 10,260 | 0.1 | |
| SCENTRE GROUP | 257,669 | 331,601 | 669 | 50,967 | 0.7 | |
| VICINITY CENTRES | 150,809 | 268,793 | 361 | 27,508 | 0.4 | |
| VIVA ENERGY REIT | 18,000 | — | — | — | — | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 1,363,407 25 | 1,829,438 25 | 6,655 — | 506,407 <6.7%> | |

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 | |
| | | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (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 | 76,088 | | 129 | 8,950 | 0.1 |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 19,000 | 19,000 | | 56 | 3,878 | 0.1 |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 74,117 | 52,430 | | 123 | 8,580 | 0.1 |
| | ARGOSY PROPERTY LTD | 30,000 | 84,995 | | 114 | 7,940 | 0.1 |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 86,057 | 86,057 | | 88 | 6,104 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 253,174 5 | 318,570 5 | | 512 - | 35,454 < 0.5%> | |
| (香港) | | | | | | 千香港ドル | |
| | LINK REIT | 100,400 | 129,600 | | 8,145 | 111,428 | 1.5 |
| | PROSPERITY REIT | 60,000 | 60,000 | | 148 | 2,035 | 0.0 |
| | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 61,000 | 153,000 | | 569 | 7,786 | 0.1 |
| | CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT | 92,000 | 127,000 | | 519 | 7,105 | 0.1 |
| | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 37,000 | 37,000 | | 139 | 1,908 | 0.0 |
| | FORTUNE REIT | 80,000 | 80,000 | | 536 | 7,332 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 430,400 6 | 586,600 6 | | 10,058 - | 137,596 < 1.8%> | |
| (シンガポール) | | | | | | 千シンガポールドル | |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 158,500 | 191,000 | | 359 | 27,792 | 0.4 |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 149,500 | 191,100 | | 647 | 50,141 | 0.7 |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 137,600 | 181,400 | | 293 | 22,745 | 0.3 |
| | SUNTEC REIT | 140,700 | 147,500 | | 197 | 15,298 | 0.2 |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 139,850 | 178,950 | | 375 | 29,086 | 0.4 |
| | STARHILL GLOBAL REIT | 54,000 | 54,000 | | 23 | 1,818 | 0.0 |
| | FRASERS COMMERCIAL TRUST | 44,800 | - | | - | - | - |
| | KEPPEL REIT | 98,900 | 98,900 | | 103 | 8,037 | 0.1 |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 36,800 | 36,800 | | 87 | 6,779 | 0.1 |
| | ESR REIT | 57,552 | 217,952 | | 83 | 6,494 | 0.1 |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 34,350 | 34,350 | | 34 | 2,658 | 0.0 |
| | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 61,000 | 61,000 | | 68 | 5,335 | 0.1 |
| | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 28,000 | 28,000 | | 16 | 1,246 | 0.0 |
| | PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 13,000 | 29,800 | | 111 | 8,603 | 0.1 |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T | 33,000 | 33,000 | | 3 | 298 | 0.0 |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 70,200 | 86,600 | | 268 | 20,778 | 0.3 |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 121,000 | 137,100 | | 265 | 20,586 | 0.3 |
| | ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 27,000 | 27,000 | | 17 | 1,337 | 0.0 |
| | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 23,500 | 23,500 | | 27 | 2,146 | 0.0 |
| | SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT | 31,000 | 31,000 | | 11 | 887 | 0.0 |
| | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 83,000 | 167,200 | | 152 | 11,776 | 0.2 |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 46,000 | 46,000 | | 23 | 1,798 | 0.0 |
| | SPH REIT | 74,600 | 74,600 | | 63 | 4,936 | 0.1 |
| | SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 26,000 | 26,000 | | 10 | 825 | 0.0 |
| | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 20,000 | 20,000 | | 15 | 1,199 | 0.0 |
| | ASCOTT TRUST | 117,055 | 117,055 | | 102 | 7,927 | 0.1 |
| | QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 100,000 | 100,000 | | 37 | 2,863 | 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) 口数 | 期末 | | 組入比率 |
|--------------------------------------|------------------|------------------|------------------|---------------|----------------------|
| | | | 評価額 外貨建金額 | 評価額 邦貨換算金額 | |
| LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL | — | 25,000 | 15 | 1,209 | 0.0 |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 10,000 | 10,000 | 4 | 328 | 0.0 |
| KEPPEL DC REIT | 58,300 | 82,500 | 245 | 19,028 | 0.3 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 59,000 | 172,038 | 232 | 17,976 | 0.2 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 2,054,207 30 | 2,629,345 30 | 3,901 — | 301,944 <4.0%> |
| (韓国) | | | 千韓国ウォン | | |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | — | 1,800 | 11,826 | 1,057 | 0.0 |
| LOTTE REIT CO LTD | — | 5,000 | 25,250 | 2,257 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | — | 6,800 2 | 37,076 — | 3,314 <0.0%> |
| (イスラエル) | | | 千イスラエルシケル | | |
| REIT 1 LTD | 8,000 | 8,000 | 108 | 3,375 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 8,000 1 | 8,000 1 | 108 — | 3,375 <0.0%> |
| 合計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 6,298,389 300 | 8,443,628 308 | — — | 7,538,308 <99.1%> |

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

※<>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

(2020年8月25日現在)

| 項目 | 期末 | |
|--------------|-----------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| 投資証券 | 千円 7,538,308 | % |
| コール・ローン等、その他 | 108,982 | 1.4 |
| 投資信託財産総額 | 7,647,290 | 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(7,600,757千円)の投資信託財産総額(7,647,290千円)に対する比率は99.4%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=106.01円、1カナダドル=80.09円、1ユーロ=125.06円、1英ポンド=138.62円、1オーストラリアドル=76.09円、1ニュージーランドドル=69.20円、1香港ドル=13.68円、1シンガポールドル=77.40円、100韓国ウォン=8.94円、1イスラエルシケル=31.14円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年8月25日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-----------------|----------------|
| (A) 資 産 | 7,650,790,246円 |
| コール・ローン等 | 90,431,996 |
| 投資証券(評価額) | 7,538,308,208 |
| 未 収 入 金 | 3,799,482 |
| 未 収 配 当 金 | 18,250,560 |
| (B) 負 債 | 43,888,169 |
| 未 払 金 | 43,888,128 |
| 未 払 利 息 | 13 |
| その他未払費用 | 28 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 7,606,902,077 |
| 元 本 | 4,054,756,885 |
| 次期繰越損益金 | 3,552,145,192 |
| (D) 受益権総口数 | 4,054,756,885口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 18,760円 |

※当期における期首元本額3,167,787,697円、期中追加設定元本額1,459,554,433円、期中一部解約元本額572,585,245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) | 54,039,875円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 60,808,013円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 44,348,260円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 37,927,263円 |
| 三井住友・DC外国リートインデックスファンド | 3,565,581,553円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 3,015,945円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 32,569,769円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 21,649,209円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 68,235,560円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 36,214,632円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 28,252,726円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 42,794,477円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 450,246円 |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 359,935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> | 46,968,471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> | 11,540,951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2020年2月26日 至2020年8月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 124,081,832円 |
| 受 取 配 当 金 | 124,078,437 |
| 受 取 利 息 | 6,300 |
| そ の 他 収 益 金 | 488 |
| 支 払 利 息 | △ 3,393 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △1,686,409,602 |
| 売 買 益 | 290,662,713 |
| 売 買 損 | △1,977,072,315 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 2,685,100 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △1,565,012,870 |
| (E) 前期繰越損益金 | 4,505,922,117 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,122,665,577 |
| (G) 解約差損益金 | △ 511,429,632 |
| (H) 計 (D+E+F+G) | 3,552,145,192 |
| 次期繰越損益金(H) | 3,552,145,192 |

※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>

該当事項はございません。